

L P S 4 資産分散ファンド  
( 慎 重 型 )  
( 安 定 重 視 型 )  
( バ ラ ン ス 型 )  
( 成 長 重 視 型 )  
( 積 極 型 )  
＜愛称 未来海図＞

第 8 期 運用報告書（全体版）

（決算日 2017年 5 月 29 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、「L P S 4 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 8 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/>

■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<br>(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 | L P S 4資産分散ファンド<br>(慎重型)<br>(安定重視型)<br>(バランス型)<br>(成長重視型)<br>(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TOIX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<br>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<br>マザーファンド                                                                                                                                           | 外国の株式                                                                                                 |       |                       |       |
|        | TMA外国債券インデックス<br>マザーファンド                                                                                                                                           | 外国の公社債                                                                                                |       |                       |       |
| 投資制限   | (慎重型)                                                                                                                                                              | 株式への<br>実質投資割合                                                                                        | 30%以下 | 外貨建<br>資産への<br>実質投資割合 | 40%以下 |
|        | (安定重視型)                                                                                                                                                            |                                                                                                       | 40%以下 |                       | 60%以下 |
|        | (バランス型)                                                                                                                                                            |                                                                                                       | 60%以下 |                       | 60%以下 |
|        | (成長重視型)                                                                                                                                                            |                                                                                                       | 70%以下 |                       | 70%以下 |
|        | (積極型)                                                                                                                                                              |                                                                                                       | 制限なし  |                       | 75%以下 |
| 分配方針   | 毎決算時に、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。<br>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。 |                                                                                                       |       |                       |       |

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<br>(分配落) | 標準 価 額     |            |          | ベンチ マー ク     |              | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 債 券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|----------------|------------|------------|------------|----------|--------------|--------------|-------------|-------------|-------------|--------------------|--------------|
|                |            | 税 込<br>分 配 | み 金<br>騰 落 | 中 率<br>率 | 期 中<br>騰 落 率 | 期 中<br>騰 落 率 |             |             |             |                    |              |
|                | 円          | 円          |            | %        |              | %            | %           | %           | %           | %                  | 百万円          |
| 4期(2013年5月28日) | 11,296     | 0          |            | 12.7     | 11,522       | 13.2         | 14.8        | 0.4         | 83.7        | 0.1                | 3            |
| 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           |

(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<br>(分配落) | 標準 価 額     |            |          | ベンチ マー ク     |              | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 債 券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|----------------|------------|------------|------------|----------|--------------|--------------|-------------|-------------|-------------|--------------------|--------------|
|                |            | 税 込<br>分 配 | み 金<br>騰 落 | 中 率<br>率 | 期 中<br>騰 落 率 | 期 中<br>騰 落 率 |             |             |             |                    |              |
|                | 円          | 円          |            | %        |              | %            | %           | %           | %           | %                  | 百万円          |
| 4期(2013年5月28日) | 11,868     | 0          |            | 22.7     | 12,051       | 23.2         | 26.6        | 0.8         | 71.7        | 0.3                | 14           |
| 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           |

(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、NOMURA-BPI（総合）、MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）、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）を基本資産配分で組み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、シティ世界国債インデックスは、シティ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。

## ＜L P S 4 資産分散ファンド (バランス型)＞

| 決 算 期          | 基<br>(分配落) | 標準 価 額     |            |          | ベンチマーク<br>期 中<br>騰 落 率 | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 債 券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|----------------|------------|------------|------------|----------|------------------------|-------------|-------------|-------------|--------------------|--------------|
|                |            | 税 込<br>分 配 | み 金<br>騰 落 | 中 率<br>率 |                        |             |             |             |                    |              |
|                | 円          | 円          | %          |          | %                      | %           | %           | %           | %                  | 百万円          |
| 4期(2013年5月28日) | 12,415     | 0          | 31.3       | 12,500   | 31.5                   | 39.1        | 1.1         | 58.7        | 0.4                | 16           |
| 5期(2014年5月28日) | 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          |

(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。

## ＜L P S 4 資産分散ファンド (成長重視型)＞

| 決 算 期          | 基<br>(分配落) | 標準 価 額     |            |          | ベンチマーク<br>期 中<br>騰 落 率 | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 債 券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|----------------|------------|------------|------------|----------|------------------------|-------------|-------------|-------------|--------------------|--------------|
|                |            | 税 込<br>分 配 | み 金<br>騰 落 | 中 率<br>率 |                        |             |             |             |                    |              |
|                | 円          | 円          | %          |          | %                      | %           | %           | %           | %                  | 百万円          |
| 4期(2013年5月28日) | 12,864     | 0          | 38.9       | 12,893   | 39.0                   | 53.6        | 1.5         | 43.8        | 0.5                | 23           |
| 5期(2014年5月28日) | 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          |

(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。

## ＜L P S 4 資産分散ファンド (積極型)＞

| 決 算 期          | 基<br>(分配落) | 標準 価 額     |            |          | ベンチマーク<br>期 中<br>騰 落 率 | 株 式<br>組入比率 | 株 式<br>先物比率 | 債 券<br>組入比率 | 投資信託<br>証券<br>組入比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|----------------|------------|------------|------------|----------|------------------------|-------------|-------------|-------------|--------------------|--------------|
|                |            | 税 込<br>分 配 | み 金<br>騰 落 | 中 率<br>率 |                        |             |             |             |                    |              |
|                | 円          | 円          | %          |          | %                      | %           | %           | %           | %                  | 百万円          |
| 4期(2013年5月28日) | 13,320     | 0          | 46.9       | 13,305   | 46.8                   | 67.9        | 1.9         | 29.1        | 0.6                | 14           |
| 5期(2014年5月28日) | 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          |

(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

## &lt; L P S 4 資産分散ファンド (慎重型) &gt;

| 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 | 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 |
| (期 首)<br>2016年5月30日 | 円       | %     | 円      | %     | %           | %           | %           | %               |
| 5月末                 | 12,729  | —     | 13,198 | —     | 12.7        | 0.4         | 85.9        | 0.1             |
| 6月末                 | 12,757  | 0.2   | 13,228 | 0.2   | 12.7        | 0.3         | 85.5        | 0.1             |
| 7月末                 | 12,570  | △1.2  | 13,041 | △1.2  | 11.4        | 0.3         | 87.2        | 0.1             |
| 8月末                 | 12,632  | △0.8  | 13,114 | △0.6  | 13.2        | 0.3         | 85.8        | 0.1             |
| 9月末                 | 12,525  | △1.6  | 13,009 | △1.4  | 12.7        | 0.2         | 85.9        | 0.1             |
| 10月末                | 12,468  | △2.1  | 12,949 | △1.9  | 12.8        | 0.4         | 86.3        | 0.1             |
| 11月末                | 12,509  | △1.7  | 12,996 | △1.5  | 13.1        | 0.3         | 86.2        | 0.1             |
| 12月末                | 12,650  | △0.6  | 13,150 | △0.4  | 13.3        | 0.3         | 85.5        | 0.1             |
| 2017年1月末            | 12,743  | 0.1   | 13,250 | 0.4   | 12.8        | 0.6         | 85.6        | 0.1             |
| 2月末                 | 12,634  | △0.7  | 13,143 | △0.4  | 12.6        | 0.3         | 85.9        | 0.1             |
| 3月末                 | 12,665  | △0.5  | 13,182 | △0.1  | 12.5        | 0.5         | 86.0        | 0.1             |
| 4月末                 | 12,647  | △0.6  | 13,164 | △0.3  | 12.4        | 0.5         | 86.5        | 0.1             |
| (期 末)<br>2017年5月29日 | 12,715  | △0.1  | 13,240 | 0.3   | 12.4        | 0.5         | 86.6        | 0.1             |
|                     | 12,771  | 0.3   | 13,304 | 0.8   | 12.6        | 0.5         | 86.4        | 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。

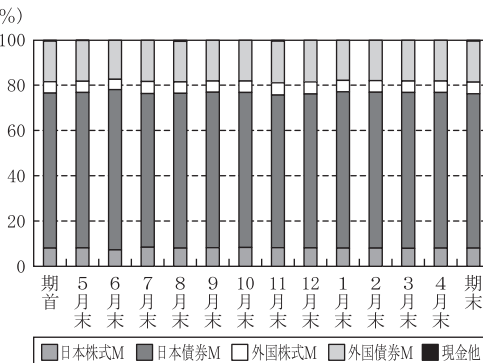
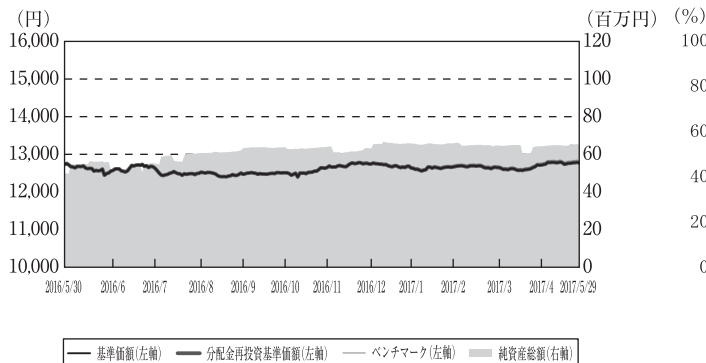
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(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。

## 基準価額とベンチマークの推移

## マザーファンドの組入推移



(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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2016年5月30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（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 先 物 比 率 | 債 券 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |     |
|------------|---------|--------|--------|-------------|-----------|-------------|---------------------|-----|
|            |         | 騰 落 率  | 騰 落 率  |             |           |             |                     |     |
| (期 首)      | 円       | %      | %      | %           | %         | %           | %                   |     |
| 2016年5月30日 | 13,587  | —      | 13,977 | —           | 23.3      | 0.7         | 75.0                | 0.3 |
| 5月末        | 13,631  | 0.3    | 14,022 | 0.3         | 23.3      | 0.6         | 74.6                | 0.3 |
| 6月末        | 13,167  | △3.1   | 13,551 | △3.0        | 21.5      | 0.6         | 76.7                | 0.3 |
| 7月末        | 13,372  | △1.6   | 13,768 | △1.5        | 24.2      | 0.6         | 74.4                | 0.3 |
| 8月末        | 13,278  | △2.3   | 13,680 | △2.1        | 22.6      | 0.4         | 74.8                | 0.3 |
| 9月末        | 13,174  | △3.0   | 13,567 | △2.9        | 22.5      | 0.7         | 76.2                | 0.2 |
| 10月末       | 13,282  | △2.2   | 13,681 | △2.1        | 23.1      | 0.4         | 75.9                | 0.2 |
| 11月末       | 13,607  | 0.1    | 14,024 | 0.3         | 23.1      | 0.6         | 75.2                | 0.2 |
| 12月末       | 13,840  | 1.9    | 14,265 | 2.1         | 22.4      | 1.0         | 75.4                | 0.2 |
| 2017年1月末   | 13,698  | 0.8    | 14,126 | 1.1         | 22.4      | 0.6         | 75.8                | 0.2 |
| 2月末        | 13,732  | 1.1    | 14,170 | 1.4         | 22.1      | 0.9         | 75.9                | 0.2 |
| 3月末        | 13,717  | 1.0    | 14,147 | 1.2         | 21.9      | 1.0         | 76.4                | 0.2 |
| 4月末        | 13,800  | 1.6    | 14,238 | 1.9         | 21.9      | 0.9         | 76.5                | 0.2 |
| (期 末)      |         |        |        |             |           |             |                     |     |
| 2017年5月29日 | 13,928  | 2.5    | 14,377 | 2.9         | 22.1      | 0.8         | 76.0                | 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。

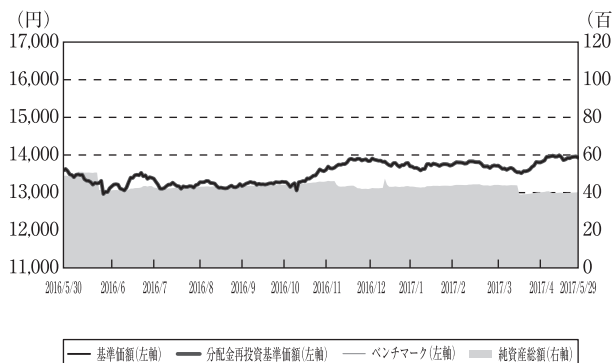
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(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。

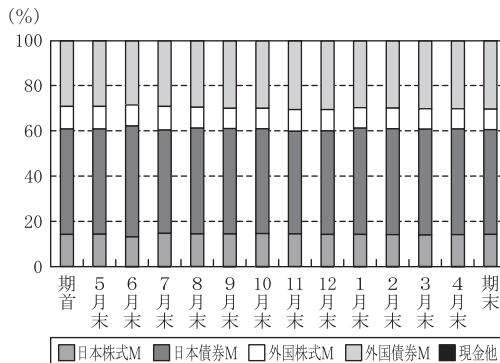
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## 基準価額とベンチマークの推移



- (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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首（2016年5月30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（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 先 物 比 率 | 債 券 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |     |
|------------|---------|--------|--------|-------------|-----------|-------------|---------------------|-----|
|            |         | 騰 落 率  | 騰 落 率  |             |           |             |                     |     |
| (期 首)      | 円       | %      |        | %           | %         | %           | %                   |     |
| 2016年5月30日 | 14,536  | —      | 14,744 | —           | 38.8      | 1.1         | 59.1                | 0.4 |
| 5月末        | 14,596  | 0.4    | 14,804 | 0.4         | 38.8      | 1.1         | 58.7                | 0.4 |
| 6月末        | 13,896  | △4.4   | 14,101 | △4.4        | 36.4      | 1.1         | 61.4                | 0.4 |
| 7月末        | 14,253  | △1.9   | 14,468 | △1.9        | 39.9      | 1.0         | 58.2                | 0.5 |
| 8月末        | 14,181  | △2.4   | 14,404 | △2.3        | 39.0      | 0.7         | 58.8                | 0.4 |
| 9月末        | 14,065  | △3.2   | 14,269 | △3.2        | 39.0      | 1.2         | 59.1                | 0.4 |
| 10月末       | 14,279  | △1.8   | 14,487 | △1.7        | 39.8      | 0.8         | 58.8                | 0.4 |
| 11月末       | 14,776  | 1.7    | 14,999 | 1.7         | 39.9      | 1.0         | 58.1                | 0.4 |
| 12月末       | 15,127  | 4.1    | 15,354 | 4.1         | 38.7      | 1.7         | 58.4                | 0.4 |
| 2017年1月末   | 15,003  | 3.2    | 15,237 | 3.3         | 38.8      | 1.0         | 58.9                | 0.4 |
| 2月末        | 15,074  | 3.7    | 15,319 | 3.9         | 38.3      | 1.6         | 59.0                | 0.4 |
| 3月末        | 15,061  | 3.6    | 15,284 | 3.7         | 38.0      | 1.7         | 59.5                | 0.4 |
| 4月末        | 15,166  | 4.3    | 15,395 | 4.4         | 38.1      | 1.5         | 59.6                | 0.4 |
| (期 末)      |         |        |        |             |           |             |                     |     |
| 2017年5月29日 | 15,354  | 5.6    | 15,593 | 5.8         | 38.4      | 1.5         | 59.1                | 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。

## 基準価額とベンチマークの推移

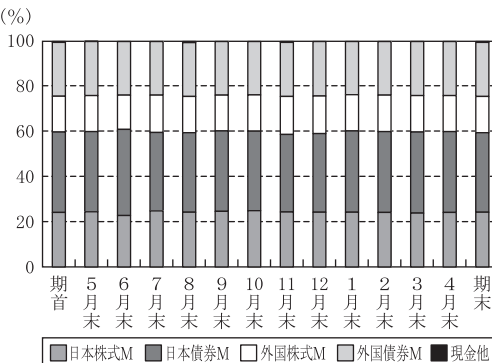


(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2016年5月30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（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 先 物 比 率 | 債 券 組 入 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |     |
|------------|---------|--------|--------|-------------|-----------|-------------|---------------------|-----|
|            |         | 騰 落 率  | 騰 落 率  |             |           |             |                     |     |
| (期 首)      | 円       | %      | %      | %           | %         | %           | %                   |     |
| 2016年5月30日 | 15,351  | —      | 15,421 | —           | 53.3      | 1.5         | 44.2                | 0.6 |
| 5月末        | 15,428  | 0.5    | 15,496 | 0.5         | 53.2      | 1.5         | 43.9                | 0.6 |
| 6月末        | 14,501  | △5.5   | 14,570 | △5.5        | 50.8      | 1.5         | 46.6                | 0.6 |
| 7月末        | 15,005  | △2.3   | 15,081 | △2.2        | 54.4      | 1.4         | 43.2                | 0.6 |
| 8月末        | 14,954  | △2.6   | 15,040 | △2.5        | 53.6      | 1.0         | 44.0                | 0.6 |
| 9月末        | 14,831  | △3.4   | 14,889 | △3.5        | 53.5      | 1.6         | 44.2                | 0.6 |
| 10月末       | 15,149  | △1.3   | 15,206 | △1.4        | 54.5      | 1.0         | 43.8                | 0.6 |
| 11月末       | 15,809  | 3.0    | 15,876 | 3.0         | 54.4      | 1.3         | 43.2                | 0.6 |
| 12月末       | 16,272  | 6.0    | 16,337 | 5.9         | 52.9      | 2.3         | 43.6                | 0.5 |
| 2017年1月末   | 16,170  | 5.3    | 16,245 | 5.3         | 53.3      | 1.4         | 44.1                | 0.5 |
| 2月末        | 16,280  | 6.1    | 16,368 | 6.1         | 52.6      | 2.2         | 44.1                | 0.5 |
| 3月末        | 16,268  | 6.0    | 16,320 | 5.8         | 52.2      | 2.3         | 44.6                | 0.5 |
| 4月末        | 16,393  | 6.8    | 16,449 | 6.7         | 52.4      | 2.1         | 44.6                | 0.5 |
| (期 末)      |         |        |        |             |           |             |                     |     |
| 2017年5月29日 | 16,639  | 8.4    | 16,705 | 8.3         | 52.6      | 2.0         | 44.2                | 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。

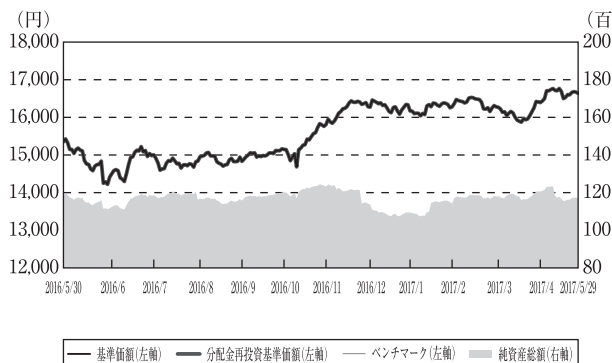
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式先物比率」は実質比率を記載しています。

(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。

## 基準価額とベンチマークの推移

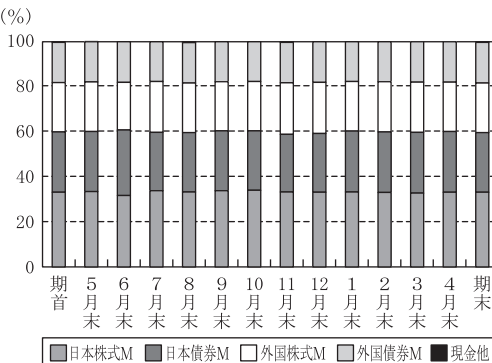


(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、期首(2016年5月30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 証 券 組 入 比 率 |
|------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------------|-------------|---------------------|
|            | 騰 落 率   | 騰 落 率 | 騰 落 率  | 騰 落 率 | 騰 落 率       | 騰 落 率       | 騰 落 率       | 騰 落 率               |
| (期 首)      | 円       | %     |        | %     | %           | %           | %           | %                   |
| 2016年5月30日 | 16,135  | —     | 16,080 | —     | 66.7        | 1.9         | 30.4        | 0.7                 |
| 5月末        | 16,227  | 0.6   | 16,168 | 0.5   | 66.6        | 1.8         | 30.2        | 0.7                 |
| 6月末        | 15,073  | △ 6.6 | 15,023 | △ 6.6 | 64.4        | 1.9         | 32.5        | 0.7                 |
| 7月末        | 15,724  | △ 2.5 | 15,675 | △ 2.5 | 67.6        | 1.8         | 29.5        | 0.8                 |
| 8月末        | 15,693  | △ 2.7 | 15,656 | △ 2.6 | 66.3        | 1.2         | 30.2        | 0.7                 |
| 9月末        | 15,564  | △ 3.5 | 15,488 | △ 3.7 | 65.9        | 2.0         | 31.3        | 0.7                 |
| 10月末       | 15,981  | △ 1.0 | 15,901 | △ 1.1 | 67.0        | 1.3         | 31.0        | 0.7                 |
| 11月末       | 16,799  | 4.1   | 16,722 | 4.0   | 66.7        | 1.6         | 30.5        | 0.7                 |
| 12月末       | 17,373  | 7.7   | 17,285 | 7.5   | 65.1        | 2.9         | 30.8        | 0.7                 |
| 2017年1月末   | 17,292  | 7.2   | 17,218 | 7.1   | 65.8        | 1.7         | 31.3        | 0.7                 |
| 2月末        | 17,439  | 8.1   | 17,378 | 8.1   | 65.0        | 2.7         | 31.3        | 0.7                 |
| 3月末        | 17,428  | 8.0   | 17,316 | 7.7   | 64.6        | 2.8         | 31.7        | 0.7                 |
| 4月末        | 17,574  | 8.9   | 17,464 | 8.6   | 64.7        | 2.6         | 31.7        | 0.7                 |
| (期 末)      |         |       |        |       |             |             |             |                     |
| 2017年5月29日 | 17,878  | 10.8  | 17,777 | 10.6  | 64.9        | 2.5         | 31.3        | 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。

## 基準価額とベンチマークの推移

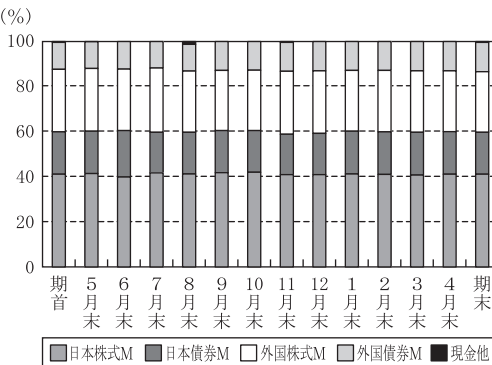


(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2016年5月30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。

## ○運用経過

(2016年5月31日～2017年5月29日)

## ■期中の基準価額等の推移

|                 | LPS4資産<br>分散ファンド<br>(慎重型) | LPS4資産<br>分散ファンド<br>(安定重視型) | LPS4資産<br>分散ファンド<br>(バランス型) | LPS4資産<br>分散ファンド<br>(成長重視型) | LPS4資産<br>分散ファンド<br>(積極型) |
|-----------------|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|---------------------------|
| 前期末(2016年5月30日) | 12,729円                   | 13,587円                     | 14,536円                     | 15,351円                     | 16,135円                   |
| 当期末(2017年5月29日) | 12,771円                   | 13,928円                     | 15,354円                     | 16,639円                     | 17,878円                   |
| 基準価額の騰落率        | +0.3%                     | +2.5%                       | +5.6%                       | +8.4%                       | +10.8%                    |
| ベンチマークの騰落率      | +0.8%                     | +2.9%                       | +5.8%                       | +8.3%                       | +10.6%                    |

## ◇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<br>TOPIX | 日本債券<br>NOMURA-BPI (総合) | 外国株式<br>MSCIコクサイ指数<br>(円ヘッジなし・円ベース) | 外国債券<br>シティ世界国債インデックス<br>(除く日本/円ヘッジなし・円ベース) |
|-----|---------------|-------------------------|-------------------------------------|---------------------------------------------|
| 騰落率 | 14.9%         | △2.0%                   | 17.7%                               | 0.3%                                        |

## プラス要因

- ・世界的な景気拡大への期待の高まりを背景とした内外株式市場の上昇

## マイナス要因

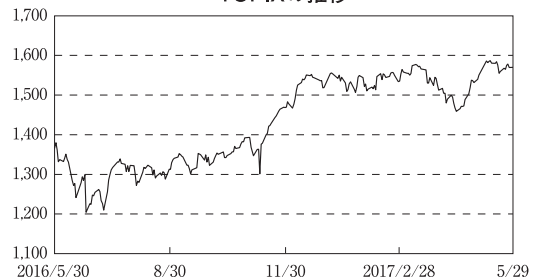
- ・主要中央銀行の金融緩和姿勢の後退に伴う世界的な金利の上昇（債券価格の下落）

## ■投資環境

【日本株式市況】

- ・期初、2016年6月の英国でのEU（欧州連合）離脱を問う国民投票においてEU離脱派が勝利したことを受け、投資家のリスク回避の動きから大きく円高・株安が進行しましたが、7月の参議院選挙での与党勝利や、その後表明された大型の経済対策および財政支出拡大への期待などから、国内株式市場は反発しました。
- ・その後、株価は一進一退ながらも底堅く推移しましたが、11月の米大統領選でトランプ候補が勝利する可能性が高まるにつれて株価は大きく下落しました。しかし、トランプ候補の勝利後は、同氏の経済政策への期待から株価は大きく反発し、さらに、円安米ドル高の進行もあり、国内株式市場は年初来高値を更新しました。
- ・12月の米国での利上げ実施後、国内株式市場は落ち着いた動きとなり、期末にかけては、北朝鮮の核やミサイル開発への懸念などから一時下落する場面もありましたが、大きな調整には至らず、2017年初来の高値圏で推移し、期初から上昇した水準で期を終えました。

TOPIXの推移



出所：ブルームバーグ

## 【日本債券市況】

- ・期初、英国のEU離脱決定などを背景に10年国債利回りは低下（債券価格は上昇）しましたが、2016年7月に日銀がマイナス金利幅の拡大を見送り、これまで実施してきた金融緩和政策の効果について「総括的な検証」を行うと発表したことを受けて、10年国債利回りは急上昇しました。その後は、日銀による長短金利操作付き量的・質的金融緩和政策の導入決定などもあり、債券市場は底堅く推移しましたが、11月に米大統領選でトランプ候補が勝利すると、円安米ドル高、株高、米金利の上昇が進むなか、10年国債利回りも上昇基調となりました。
- ・2017年1月以降、日本の物価上昇の見通しが高まらないなか、10年国債利回りは0.05%を挟んで横ばいで推移しましたが、期初からは上昇した水準で期を終えました。

## 【外国株式市況】

- ・期初、英国のEU離脱決定などを受けて、海外株式市場は下落しました。その後は一進一退となりましたが、米大統領選でトランプ候補が勝利すると、米国での税制改革やインフラ投資、規制緩和などによる経済成長への期待が高まり、海外株式市場は大きく上昇しました。
- ・2016年12月の米国での利上げ実施後、海外株式市場は一時レンジ内で推移しましたが、好調な経済指標を受けて、徐々に上昇して過去最高値圏で推移し、期初から上昇して期を終えました。

## 【外国債券市況】

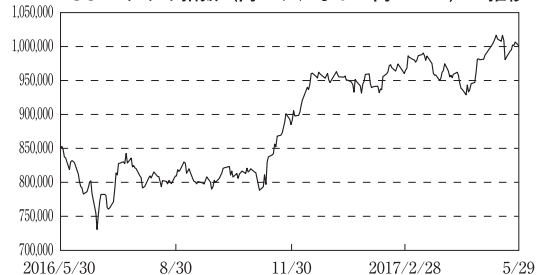
- ・期初、英国のEU離脱決定を受けて世界経済の下振れ懸念が広がり、海外債券市場で国債利回りは低下しました。その後、トランプ米大統領の政策への期待や好調な経済指標を受けて株式などのリスク資産が買われた一方、債券は売られ、世界的に国債利回りは上昇基調で推移し、期初からは小幅に高い水準で期を終えました。

NOMURA-BPI（総合）の推移



出所：ブルームバーグ

MSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）の推移



(注) グラフの値は、基準日前日の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です。

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）の推移

(注) グラフの値は、シティ世界国債インデックス（国内投信用）です。

出所：ブルームバーグ

(為替市況について)

- ・米ドル円為替レートは、期初1米ドル＝110円を超える水準でスタートした後、英国のEU離脱決定や日銀の金融緩和姿勢の後退などを受け、一時1米ドル＝100円割れの水準まで円高が進みました。
- ・2016年11月に米大統領選でトランプ候補が勝利すると、同氏の経済政策への期待が高まり、一時1米ドル＝120円に迫る水準まで円安米ドル高が進みました。
- ・その後はトランプ米大統領の経済政策への期待が徐々に後退するにつれて米ドルもやや値を下げ、期末は1米ドル＝111円台となり、前期末対比小幅に円安の水準で期を終えました。

## ■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<br>TOPIX<br>マザーファンド | TMA日本債券<br>インデックス<br>マザーファンド | TMA外国株式<br>インデックス<br>マザーファンド | TMA外国債券<br>インデックス<br>マザーファンド |
|---------|----------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| (慎重型)   | 8%                         | 69%                          | 5%                           | 18%                          |
| (安定重視型) | 14%                        | 47%                          | 9%                           | 30%                          |
| (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17.5%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上昇傾向となったことから1.9%下落し、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などを背景に17.5%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しました。当期の基準価額は、世界的に金利はやや上昇したものの、外国為替市場で小幅に円安が進んだことから、0.3%とおおむね横ばいとなり、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

## ■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<br>分散ファンド<br>(慎重型) | LPS4資産<br>分散ファンド<br>(安定重視型) | LPS4資産<br>分散ファンド<br>(バランス型) | LPS4資産<br>分散ファンド<br>(成長重視型) | LPS4資産<br>分散ファンド<br>(積極型) |
|--------------------------------------|---------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|---------------------------|
| フ      ァ      ン      ド               | 0.3%                      | 2.5%                        | 5.6%                        | 8.4%                        | 10.8%                     |
| ベ      ン      チ      マ      ー      ク | 0.8%                      | 2.9%                        | 5.8%                        | 8.3%                        | 10.6%                     |

(主な差異要因)

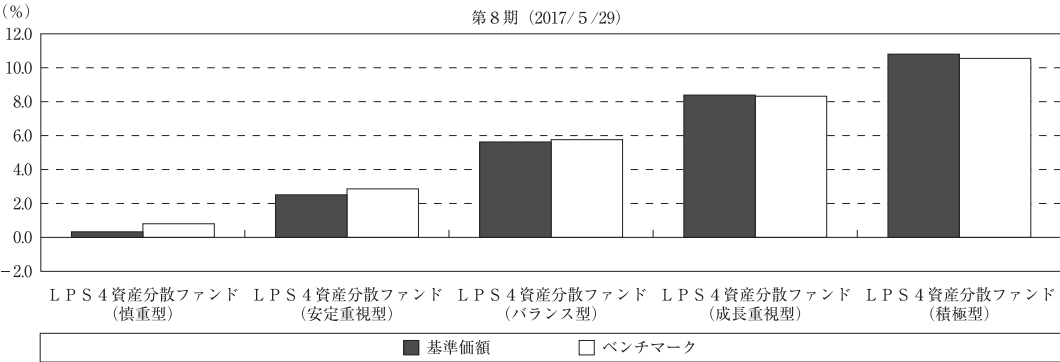
### プラス要因

- ・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

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(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 8 期                             |                                       |                                       |                                       |                                   |
|-----------|-----------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------------|
|           | 2016年 5 月 31 日～2017年 5 月 29 日     |                                       |                                       |                                       |                                   |
|           | L P S 4 資産<br>分散ファンド<br>( 慎 重 型 ) | L P S 4 資産<br>分散ファンド<br>( 安 定 重 視 型 ) | L P S 4 資産<br>分散ファンド<br>( バ ラ ン ス 型 ) | L P S 4 資産<br>分散ファンド<br>( 成 長 重 視 型 ) | L P S 4 資産<br>分散ファンド<br>( 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 | 2, 771                            | 3, 928                                | 5, 353                                | 6, 639                                | 7, 878                            |

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

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

## ○今後の運用方針

### ＜L P S 4 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、引き続き高い運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】

- ・米国の利上げ期待が継続することで円安米ドル高傾向が維持され、輸出産業を中心に日本株式市場のEPS(一株当たり利益)は徐々に上方修正されると想定します。
- ・TOPIXの予想PER(株価収益率)は、中期的には平均程度の水準であり割高感はないことから、EPSの上昇に合わせて株価も上昇する展開を予想します。
- ・日銀によるETF(指数連動型上場投資信託)購入、企業の株主還元強化も株価の下支えになると考えます。

#### 【日本債券市場見通し】

- ・米欧の金融政策は引き締め方向にあると思われますが、日本では物価上昇圧力が限定的なこともあり、日銀は10年国債利回りの誘導水準を当面維持する見込みです。
- また、トランプ米政権の政策実行力への不透明感が高まるなか、主要国の債券市場が底堅く推移していることなどから、10年国債利回りは当面現在の水準を中心に狭い範囲で推移すると考えます。

#### 【外国株式市場見通し】

- ・外国株式市場は高値警戒感から、当面は横ばいでの推移を想定しますが、中長期的にはインフラ投資や減税などのトランプ米政権の政策による景気および企業業績の押上げにより、緩やかな上昇を予想します。
- ・ただし、トランプ米政権の政策実現性の低下がリスク要因と考えます。

## 【外国債券市場見通し】

## ＜金利動向＞

- ・足元ではトランプ米大統領の政策実行力への懐疑的な見方も強まるなか、世界的に金利は低下基調となっています。しかし、米国の財政政策などの景気刺激策への期待感は継続すると考えることから、緩やかではあるものの、海外金利は上昇傾向に戻ることを想定します。

## ＜為替＞

- ・海外の金利先高観を背景に、米ドル、ユーロともに対円で底堅く推移する展開を想定します。

2017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 日本株式・日本債券・外国株式のウェイトを引き上げ、外国債券のウェイトを引き下げ。
- ・安定重視型 日本株式・日本債券・外国株式のウェイトを引き上げ、外国債券のウェイトを引き下げ。
- ・バランス型 変更なし。
- ・成長重視型 変更なし。
- ・積極型 変更なし。

## 【基本資産配分】

|         | TMA日本株<br>TOPIX<br>マザーファンド | TMA日本債券<br>インデックス<br>マザーファンド | TMA外国株式<br>インデックス<br>マザーファンド | TMA外国債券<br>インデックス<br>マザーファンド |
|---------|----------------------------|------------------------------|------------------------------|------------------------------|
| (慎重型)   | 8%                         | 69%                          | 5%                           | 18%                          |
| (安定重視型) | 14%                        | 47%                          | 9%                           | 30%                          |
| (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%                          |



## 2017年8月29日以降の基本資産配分（予定）

|         | TMA日本株<br>TOPIX<br>マザーファンド | TMA日本債券<br>インデックス<br>マザーファンド | TMA外国株式<br>インデックス<br>マザーファンド | TMA外国債券<br>インデックス<br>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＞

引き続き、ベンチマークであるTOPIX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す。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年5月31日～2017年5月29日)

| 項 目          | 第 8 期                                                                                                                                                                                      |           |                                   |           |                                   |           |                                   |           |                                   |           | 項目の概要                                                                                                                                        |
|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------|-----------------------------------|-----------|-----------------------------------|-----------|-----------------------------------|-----------|-----------------------------------|-----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|              | L P S 4 資産<br>分散ファンド<br>( 慎 重 型 )                                                                                                                                                          |           | L P S 4 資産<br>分散ファンド<br>( 安定重視型 ) |           | L P S 4 資産<br>分散ファンド<br>( バランス型 ) |           | L P S 4 資産<br>分散ファンド<br>( 成長重視型 ) |           | L P S 4 資産<br>分散ファンド<br>( 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     | 円 88                                                                                                                                                                                       | % 0.695   | 円 94                              | % 0.695   | 円 102                             | % 0.695   | 円 108                             | % 0.695   | 円 115                             | % 0.695   | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>*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<br>*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<br>*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 )     | ( 41 )                                                                                                                                                                                     | ( 0.323 ) | ( 44 )                            | ( 0.323 ) | ( 47 )                            | ( 0.323 ) | ( 50 )                            | ( 0.323 ) | ( 53 )                            | ( 0.323 ) |                                                                                                                                              |
| ( 販売会社 )     | ( 41 )                                                                                                                                                                                     | ( 0.323 ) | ( 44 )                            | ( 0.323 ) | ( 47 )                            | ( 0.323 ) | ( 50 )                            | ( 0.323 ) | ( 53 )                            | ( 0.323 ) |                                                                                                                                              |
| ( 受託会社 )     | ( 6 )                                                                                                                                                                                      | ( 0.048 ) | ( 7 )                             | ( 0.048 ) | ( 7 )                             | ( 0.048 ) | ( 8 )                             | ( 0.048 ) | ( 8 )                             | ( 0.048 ) |                                                                                                                                              |
| (b) 売買委託手数料  | 0                                                                                                                                                                                          | 0.003     | 1                                 | 0.005     | 1                                 | 0.009     | 2                                 | 0.012     | 3                                 | 0.015     | (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<br>*売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料                                                                       |
| ( 株式 )       | ( 0 )                                                                                                                                                                                      | ( 0.002 ) | ( 0 )                             | ( 0.003 ) | ( 1 )                             | ( 0.005 ) | ( 1 )                             | ( 0.006 ) | ( 1 )                             | ( 0.008 ) |                                                                                                                                              |
| ( 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 )                                                                                                                                                                                      | ( 0.001 ) | ( 0 )                             | ( 0.002 ) | ( 1 )                             | ( 0.004 ) | ( 1 )                             | ( 0.006 ) | ( 1 )                             | ( 0.007 ) |                                                                                                                                              |
| (c) 有価証券取引税  | 0                                                                                                                                                                                          | 0.000     | 0                                 | 0.001     | 0                                 | 0.001     | 0                                 | 0.001     | 0                                 | 0.002     | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引÷期中の平均受益権口数<br>*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 )                             | ( 0.002 ) |                                                                                                                                              |
| ( 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                                                                                                                                                                                          | 0.015     | 2                                 | 0.017     | 3                                 | 0.020     | 3                                 | 0.022     | 4                                 | 0.024     | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>*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<br>*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<br>*その他は、信託事務等に要する諸費用     |
| ( 保管費用 )     | ( 1 )                                                                                                                                                                                      | ( 0.004 ) | ( 1 )                             | ( 0.007 ) | ( 1 )                             | ( 0.010 ) | ( 2 )                             | ( 0.012 ) | ( 2 )                             | ( 0.014 ) |                                                                                                                                              |
| ( 監査費用 )     | ( 1 )                                                                                                                                                                                      | ( 0.011 ) | ( 1 )                             | ( 0.010 ) | ( 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 )                             | ( 0.000 ) |                                                                                                                                              |
| 合 計          | 90                                                                                                                                                                                         | 0.713     | 97                                | 0.718     | 106                               | 0.725     | 113                               | 0.730     | 122                               | 0.736     |                                                                                                                                              |
| 期中の平均基準価額    | L P S 4 資産分散ファンド ( 慎 重 型 ) 12,626円<br>L P S 4 資産分散ファンド ( 安定重視型 ) 13,524円<br>L P S 4 資産分散ファンド ( バランス型 ) 14,623円<br>L P S 4 資産分散ファンド ( 成長重視型 ) 15,588円<br>L P S 4 資産分散ファンド ( 積 極 型 ) 16,513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

(2016年5月31日～2017年5月29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    |
|                      | 千口     | 千円     | 千口     | 千円     |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 3,839  | 4,077  | 3,353  | 3,635  |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 26,214 | 33,672 | 17,338 | 22,296 |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 1,388  | 2,538  | 1,207  | 2,261  |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 6,207  | 8,988  | 4,242  | 6,123  |

## ＜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    |
|                      | 千口    | 千円     | 千口     | 千円     |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 2,798 | 3,052  | 4,763  | 5,220  |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 8,394 | 10,737 | 11,354 | 14,562 |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 1,065 | 1,988  | 2,041  | 3,823  |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 4,586 | 6,678  | 5,952  | 8,655  |

## ＜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    |
|                      | 千口     | 千円     | 千口     | 千円     |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 9,843  | 10,786 | 11,630 | 12,969 |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 15,464 | 19,754 | 11,906 | 15,252 |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 3,869  | 7,244  | 4,490  | 8,724  |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 7,688  | 11,158 | 5,755  | 8,445  |

## ＜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    |
|                      | 千口     | 千円     | 千口     | 千円     |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 13,134 | 14,432 | 19,174 | 21,566 |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 12,551 | 16,028 | 12,661 | 16,208 |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 5,261  | 9,873  | 7,481  | 14,614 |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 6,067  | 8,772  | 6,218  | 9,130  |

## ＜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    |
|                      | 千口     | 千円     | 千口     | 千円     |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 20,653 | 23,730 | 24,303 | 28,300 |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 11,881 | 15,148 | 10,207 | 13,017 |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 8,335  | 16,313 | 10,268 | 20,561 |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 6,903  | 10,088 | 5,170  | 7,613  |

## ○株式売買比率

(2016年5月31日～2017年5月29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<br>マザーファンド | TMA外国株式インデックス<br>マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額       | 106,569,277千円          | 64,505,008千円             |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 94,605,288千円           | 68,633,241千円             |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.12                   | 0.93                     |

(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5月31日～2017年5月29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

&lt;TMA日本株TOPIXマザーファンド&gt;

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|-------|-------|-------------|
|     | 百万円   | 百万円   | 百万円         |
| 株式  | 167   | 695   | 557         |

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

(2016年5月31日～2017年5月29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

(2017年5月29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)<br>口数 | 当期<br>口数 | 期末<br>評価額 |
|----------------------|---------------|----------|-----------|
|                      | 千口            | 千口       | 千円        |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 3,840         | 4,327    | 5,336     |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 26,433        | 35,308   | 44,799    |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 1,364         | 1,546    | 3,318     |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 5,997         | 7,961    | 11,916    |

## ＜LPS4資産分散ファンド(安定重視型)＞

| 銘柄                   | 期首(前期末)<br>口数 | 当期<br>口数 | 期末<br>評価額 |
|----------------------|---------------|----------|-----------|
|                      | 千口            | 千口       | 千円        |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 6,600         | 4,636    | 5,717     |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 17,685        | 14,726   | 18,684    |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 2,680         | 1,704    | 3,657     |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 9,490         | 8,124    | 12,160    |

## ＜LPS4資産分散ファンド(バランス型)＞

| 銘柄                   | 期首(前期末)<br>口数 | 当期<br>口数 | 期末<br>評価額 |
|----------------------|---------------|----------|-----------|
|                      | 千口            | 千口       | 千円        |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 27,446        | 25,659   | 31,643    |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 32,856        | 36,414   | 46,203    |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 10,403        | 9,783    | 20,989    |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 19,049        | 20,982   | 31,406    |

## ＜LPS4資産分散ファンド(成長重視型)＞

| 銘柄                   | 期首(前期末)<br>口数 | 当期<br>口数 | 期末<br>評価額 |
|----------------------|---------------|----------|-----------|
|                      | 千口            | 千口       | 千円        |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 37,701        | 31,660   | 39,044    |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 24,618        | 24,507   | 31,095    |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 14,291        | 12,070   | 25,897    |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 14,272        | 14,121   | 21,137    |

## ＜LPS4資産分散ファンド(積極型)＞

| 銘柄                   | 期首(前期末)<br>口数 | 当期<br>口数 | 期末<br>評価額 |
|----------------------|---------------|----------|-----------|
|                      | 千口            | 千口       | 千円        |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド   | 47,727        | 44,077   | 54,356    |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 17,651        | 19,325   | 24,520    |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 18,533        | 16,600   | 35,616    |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 9,695         | 11,428   | 17,106    |

## ＜LPS4資産分散ファンド（慎重型）＞

## ○投資信託財産の構成

(2017年5月29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   | 5,336  | 8.1   |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 44,799 | 68.3  |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 3,318  | 5.1   |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 11,916 | 18.2  |
| コール・ローン等、その他         | 237    | 0.3   |
| 投資信託財産総額             | 65,606 | 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（47,382,476千円）の投資信託財産総額（47,453,198千円）に対する比率は99.9%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（65,290,631千円）の投資信託財産総額（65,313,264千円）に対する比率は100.0%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＝111.34円、1カナダドル＝82.69円、1メキシコペソ＝6.02円、1ユーロ＝124.30円、1英ポンド＝142.70円、1スイスフラン＝114.18円、1スウェーデンクローネ＝12.80円、1ノルウェークローネ＝13.26円、1デンマーククローネ＝16.70円、1ポーランドズロチ＝29.72円、1豪ドル＝82.86円、1ニュージーランドドル＝78.38円、1香港ドル＝14.28円、1シンガポールドル＝80.49円、1マレーシアリンギット＝26.08円、1イスラエルシェケル＝31.11円、1南アフリカランド＝8.68円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月29日現在)

| 項 目                       | 当 期 末       |
|---------------------------|-------------|
|                           | 円           |
| (A) 資産                    | 65,606,611  |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)   | 5,336,146   |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額) | 44,799,634  |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 3,318,425   |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 11,916,716  |
| 未収入金                      | 235,690     |
| (B) 負債                    | 224,577     |
| 未払信託報酬                    | 221,211     |
| その他未払費用                   | 3,366       |
| (C) 純資産総額(A－B)            | 65,382,034  |
| 元本                        | 51,195,438  |
| 次期繰越損益金                   | 14,186,596  |
| (D) 受益権総口数                | 51,195,438口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)           | 12,771円     |

(注) 当ファンドの期首元本額は39,034,010円、期中追加設定元本額は35,772,205円、期中一部解約元本額は23,610,777円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.2771円です。

## ○損益の状況 (2016年5月31日～2017年5月29日)

| 項 目            | 当 期          |
|----------------|--------------|
|                | 円            |
| (A) 有価証券売買損益   | 925,984      |
| 売買益            | 2,009,024    |
| 売買損            | △ 1,083,040  |
| (B) 信託報酬等      | △ 435,043    |
| (C) 当期損益金(A＋B) | 490,941      |
| (D) 前期繰越損益金    | 623,622      |
| (E) 追加信託差損益金   | 13,072,033   |
| (配当等相当額)       | ( 9,184,284) |
| (売買損益相当額)      | ( 3,887,749) |
| (F) 計(C＋D＋E)   | 14,186,596   |
| (G) 収益分配金      | 0            |
| 次期繰越損益金(F＋G)   | 14,186,596   |
| 追加信託差損益金       | 13,072,033   |
| (配当等相当額)       | ( 9,237,525) |
| (売買損益相当額)      | ( 3,834,508) |
| 分配準備積立金        | 1,323,231    |
| 繰越損益金          | △ 208,668    |

(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(638,893円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(12,863,365円)および分配準備積立金(684,338円)より分配対象収益は14,186,596円(1万口当たり2,771円)でしたが、当期に分配した金額はありません。

## ＜LPS4資産分散ファンド（安定重視型）＞

## ○投資信託財産の構成

(2017年5月29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   | 5,717  | 14.2  |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 18,684 | 46.3  |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 3,657  | 9.1   |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 12,160 | 30.1  |
| コール・ローン等、その他         | 158    | 0.3   |
| 投資信託財産総額             | 40,376 | 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（47,382,476千円）の投資信託財産総額（47,453,198千円）に対する比率は99.9%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（65,290,631千円）の投資信託財産総額（65,313,264千円）に対する比率は100.0%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＝111.34円、1カナダドル＝82.69円、1メキシコペソ＝6.02円、1ユーロ＝124.30円、1英ポンド＝142.70円、1スイスフラン＝114.18円、1スウェーデンクローネ＝12.80円、1ノルウェークローネ＝13.26円、1デンマーククローネ＝16.70円、1ポーランドズロチ＝29.72円、1豪ドル＝82.86円、1ニュージーランドドル＝78.38円、1香港ドル＝14.28円、1シンガポールドル＝80.49円、1マレーシアリンギット＝26.08円、1イスラエルシェケル＝31.11円、1南アフリカランド＝8.68円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月29日現在)

| 項 目                       | 当 期 末       |
|---------------------------|-------------|
|                           | 円           |
| (A) 資産                    | 40,376,104  |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)   | 5,717,638   |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額) | 18,684,361  |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 3,657,236   |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 12,160,702  |
| 未収入金                      | 156,167     |
| (B) 負債                    | 148,767     |
| 未払信託報酬                    | 146,606     |
| その他未払費用                   | 2,161       |
| (C) 純資産総額(A－B)            | 40,227,337  |
| 元本                        | 28,881,333  |
| 次期繰越損益金                   | 11,346,004  |
| (D) 受益権総口数                | 28,881,333口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)           | 13,928円     |

(注) 当ファンドの期首元本額は35,973,567円、期中追加設定元本額は13,457,422円、期中一部解約元本額は20,549,656円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.3928円です。

## ○損益の状況 (2016年5月31日～2017年5月29日)

| 項 目            | 当 期          |
|----------------|--------------|
|                | 円            |
| (A) 有価証券売買損益   | 1,250,984    |
| 売買益            | 2,176,900    |
| 売買損            | △ 925,916    |
| (B) 信託報酬等      | △ 305,390    |
| (C) 当期損益金(A＋B) | 945,594      |
| (D) 前期繰越損益金    | 265,408      |
| (E) 追加信託差損益金   | 10,135,002   |
| (配当等相当額)       | ( 8,654,714) |
| (売買損益相当額)      | ( 1,480,288) |
| (F) 計(C＋D＋E)   | 11,346,004   |
| (G) 収益分配金      | 0            |
| 次期繰越損益金(F＋G)   | 11,346,004   |
| 追加信託差損益金       | 10,135,002   |
| (配当等相当額)       | ( 8,678,528) |
| (売買損益相当額)      | ( 1,456,474) |
| 分準備積立金         | 1,656,328    |
| 繰越損益金          | △ 445,326    |

(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(577,436円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(9,689,676円)および分準備積立金(1,078,892円)より分配対象収益は11,346,004円(1万口当たり3,928円)でしたが、当期に分配した金額はありません。

## ＜LPS4資産分散ファンド（バランス型）＞

## ○投資信託財産の構成

(2017年5月29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   | 31,643  | 24.2  |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 46,203  | 35.3  |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 20,989  | 16.1  |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 31,406  | 24.0  |
| コール・ローン等、その他         | 463     | 0.4   |
| 投資信託財産総額             | 130,704 | 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（47,382,476千円）の投資信託財産総額（47,453,198千円）に対する比率は99.9%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（65,290,631千円）の投資信託財産総額（65,313,264千円）に対する比率は100.0%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＝111.34円、1カナダドル＝82.69円、1メキシコペソ＝6.02円、1ユーロ＝124.30円、1英ポンド＝142.70円、1スイスフラン＝114.18円、1スウェーデンクローネ＝12.80円、1ノルウェークローネ＝13.26円、1デンマーククローネ＝16.70円、1ポーランドズロチ＝29.72円、1豪ドル＝82.86円、1ニュージーランドドル＝78.38円、1香港ドル＝14.28円、1シンガポールドル＝80.49円、1マレーシアリンギット＝26.08円、1イスラエルシェケル＝31.11円、1南アフリカランド＝8.68円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月29日現在)

## ○損益の状況 (2016年5月31日～2017年5月29日)

| 項 目                       | 当 期 末       |
|---------------------------|-------------|
|                           | 円           |
| (A) 資産                    | 130,704,228 |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)   | 31,643,320  |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額) | 46,203,143  |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 20,989,999  |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 31,406,893  |
| 未収入金                      | 460,873     |
| (B) 負債                    | 439,039     |
| 未払信託報酬                    | 432,441     |
| その他未払費用                   | 6,598       |
| (C) 純資産総額(A－B)            | 130,265,189 |
| 元本                        | 84,842,647  |
| 次期繰越損益金                   | 45,422,542  |
| (D) 受益権総口数                | 84,842,647口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)           | 15,354円     |

(注) 当ファンドの期首元本額は81,704,063円、期中追加設定元本額は25,304,256円、期中一部解約元本額は22,165,672円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.5354円です。

| 項 目            | 当 期           |
|----------------|---------------|
|                | 円             |
| (A) 有価証券売買損益   | 7,276,929     |
| 売買益            | 9,501,146     |
| 売買損            | △ 2,224,217   |
| (B) 信託報酬等      | △ 861,693     |
| (C) 当期損益金(A＋B) | 6,415,236     |
| (D) 前期繰越損益金    | 766,496       |
| (E) 追加信託差損益金   | 38,240,810    |
| (配当等相当額)       | ( 32,868,512) |
| (売買損益相当額)      | ( 5,372,298)  |
| (F) 計(C＋D＋E)   | 45,422,542    |
| (G) 収益分配金      | 0             |
| 次期繰越損益金(F＋G)   | 45,422,542    |
| 追加信託差損益金       | 38,240,810    |
| (配当等相当額)       | ( 32,921,459) |
| (売買損益相当額)      | ( 5,319,351)  |
| 分準備積立金         | 7,982,425     |
| 繰越損益金          | △ 800,693     |

(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,218,187円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（37,440,117円）および分準備積立金（5,764,238円）より分配対象収益は45,422,542円（1万口当たり5,353円）でしたが、当期に分配した金額はありません。

## ＜LPS4資産分散ファンド（成長重視型）＞

## ○投資信託財産の構成

(2017年5月29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   | 39,044  | 33.2  |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 31,095  | 26.4  |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 25,897  | 22.0  |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 21,137  | 17.9  |
| コール・ローン等、その他         | 603     | 0.5   |
| 投資信託財産総額             | 117,776 | 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（47,382,476千円）の投資信託財産総額（47,453,198千円）に対する比率は99.9%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（65,290,631千円）の投資信託財産総額（65,313,264千円）に対する比率は100.0%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＝111.34円、1カナダドル＝82.69円、1メキシコペソ＝6.02円、1ユーロ＝124.30円、1英ポンド＝142.70円、1スイスフラン＝114.18円、1スウェーデンクローネ＝12.80円、1ノルウェークローネ＝13.26円、1デンマーククローネ＝16.70円、1ポーランドズロチ＝29.72円、1豪ドル＝82.86円、1ニュージーランドドル＝78.38円、1香港ドル＝14.28円、1シンガポールドル＝80.49円、1マレーシアリンギット＝26.08円、1イスラエルシェケル＝31.11円、1南アフリカランド＝8.68円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月29日現在)

| 項 目                       | 当 期 末       |
|---------------------------|-------------|
|                           | 円           |
| (A) 資産                    | 117,776,252 |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)   | 39,044,149  |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額) | 31,095,590  |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 25,897,253  |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 21,137,724  |
| 未収入金                      | 601,536     |
| (B) 負債                    | 581,482     |
| 未払解約金                     | 175,840     |
| 未払信託報酬                    | 399,540     |
| その他未払費用                   | 6,102       |
| (C) 純資産総額(A－B)            | 117,194,770 |
| 元本                        | 70,433,609  |
| 次期繰越損益金                   | 46,761,161  |
| (D) 受益権総口数                | 70,433,609口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D)           | 16,639円     |

(注) 当ファンドの期首元本額は77,408,669円、期中追加設定元本額は24,056,011円、期中一部解約元本額は31,031,071円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.6639円です。

## ○損益の状況 (2016年5月31日～2017年5月29日)

| 項 目            | 当 期           |
|----------------|---------------|
|                | 円             |
| (A) 有価証券売買損益   | 9,007,793     |
| 売買益            | 12,291,169    |
| 売買損            | △ 3,283,376   |
| (B) 信託報酬等      | △ 824,827     |
| (C) 当期損益金(A＋B) | 8,182,966     |
| (D) 前期繰越損益金    | △ 125,238     |
| (E) 追加信託差損益金   | 38,703,433    |
| (配当等相当額)       | ( 32,051,335) |
| (売買損益相当額)      | ( 6,652,098)  |
| (F) 計(C＋D＋E)   | 46,761,161    |
| (G) 収益分配金      | 0             |
| 次期繰越損益金(F＋G)   | 46,761,161    |
| 追加信託差損益金       | 38,703,433    |
| (配当等相当額)       | ( 32,100,814) |
| (売買損益相当額)      | ( 6,602,619)  |
| 分配準備積立金        | 8,057,728     |

(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,098,594円）、費用控除後の有価証券等損益額（382,782円）、信託約款に規定する収益調整金（38,703,433円）および分配準備積立金（5,576,352円）より分配対象収益は46,761,161円（1万口当たり6,639円）でしたが、当期に分配した金額はありません。

## ＜LPS4資産分散ファンド（積極型）＞

## ○投資信託財産の構成

(2017年5月29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   | 54,356  | 41.1  |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 24,520  | 18.6  |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 35,616  | 27.0  |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 17,106  | 12.9  |
| コール・ローン等、その他         | 499     | 0.4   |
| 投資信託財産総額             | 132,097 | 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（47,382,476千円）の投資信託財産総額（47,453,198千円）に対する比率は99.9%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（65,290,631千円）の投資信託財産総額（65,313,264千円）に対する比率は100.0%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＝111.34円、1カナダドル＝82.69円、1メキシコペソ＝6.02円、1ユーロ＝124.30円、1英ポンド＝142.70円、1スイスフラン＝114.18円、1スウェーデンクローネ＝12.80円、1ノルウェークローネ＝13.26円、1デンマーククローネ＝16.70円、1ポーランドズロチ＝29.72円、1豪ドル＝82.86円、1ニュージーランドドル＝78.38円、1香港ドル＝14.28円、1シンガポールドル＝80.49円、1マレーシアリンギット＝26.08円、1イスラエルシェケル＝31.11円、1南アフリカランド＝8.68円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月29日現在)

## ○損益の状況 (2016年5月31日～2017年5月29日)

| 項 目                       | 当 期 末       |
|---------------------------|-------------|
|                           | 円           |
| (A) 資産                    | 132,097,440 |
| TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)   | 54,356,699  |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額) | 24,520,205  |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額) | 35,616,095  |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額) | 17,106,069  |
| 未収入金                      | 498,372     |
| (B) 負債                    | 474,118     |
| 未払信託報酬                    | 466,965     |
| その他未払費用                   | 7,153       |
| (C) 純資産総額(A－B)            | 131,623,322 |
| 元本                        | 73,622,498  |
| 次期繰越損益金                   | 58,000,824  |
| (D) 受益権総口数                | 73,622,498口 |
| 1万口当たり基準価額(C／D)           | 17,878円     |

(注) 当ファンドの期首元本額は75,150,157円、期中追加設定元本額は30,974,696円、期中一部解約元本額は32,502,355円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.7878円です。

| 項 目            | 当 期           |
|----------------|---------------|
|                | 円             |
| (A) 有価証券売買損益   | 11,069,837    |
| 売買益            | 15,184,209    |
| 売買損            | △ 4,114,372   |
| (B) 信託報酬等      | △ 907,635     |
| (C) 当期損益金(A＋B) | 10,162,202    |
| (D) 前期繰越損益金    | △ 3,801,794   |
| (E) 追加信託差損益金   | 51,640,416    |
| (配当等相当額)       | ( 37,305,207) |
| (売買損益相当額)      | ( 14,335,209) |
| (F) 計(C＋D＋E)   | 58,000,824    |
| (G) 収益分配金      | 0             |
| 次期繰越損益金(F＋G)   | 58,000,824    |
| 追加信託差損益金       | 51,640,416    |
| (配当等相当額)       | ( 37,384,055) |
| (売買損益相当額)      | ( 14,256,361) |
| 分準備積立金         | 6,696,236     |
| 繰越損益金          | △ 335,828     |

(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益（2,405,352円）、費用控除後の有価証券等損益額（0円）、信託約款に規定する収益調整金（51,304,588円）および分準備積立金（4,290,884円）より分配対象収益は58,000,824円（1万口当たり7,878円）でしたが、当期に分配した金額はありません。

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2017年5月29日現在)

## ＜TMA日本株TOP I Xマザーファンド＞

下記は、TMA日本株TOP I Xマザーファンド全体(56,917,619千口)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           | 77.9    | 43.2  | 25,142  |
| マルハニチロ         | 13.5    | 6.3   | 20,286  |
| サカタのタネ         | 10.1    | 5     | 17,800  |
| ホクト            | 10.5    | 7.1   | 14,363  |
| 鉱業 (0.3%)      |         |       |         |
| 日鉄鉱業           | 26      | —     | —       |
| 国際石油開発帝石       | 348.2   | 177.3 | 180,136 |
| 石油資源開発         | 9.5     | 5     | 11,245  |
| K&Oエナジーグループ    | 14.3    | 11    | 20,064  |
| 建設業 (3.1%)     |         |       |         |
| ショーボンドホールディングス | 6.9     | 3.3   | 17,457  |
| ミライト・ホールディングス  | 28.2    | 13.3  | 14,989  |
| 安藤・間           | 51.9    | 23.5  | 18,847  |
| 東急建設           | 21.6    | 11.3  | 10,848  |
| コムシスホールディングス   | 28.9    | 14.1  | 33,290  |
| ミサワホーム         | 23      | 12.8  | 12,582  |
| 東建コーポレーション     | 2       | 0.7   | 7,035   |
| ヤマウラ           | 41      | 24.5  | 20,580  |
| 大成建設           | 347     | 169   | 159,029 |
| 大林組            | 200.9   | 101.8 | 124,705 |
| 清水建設           | 201     | 102   | 114,444 |
| 長谷工コーポレーション    | 79.1    | 38.9  | 55,043  |
| 鹿島建設           | 312     | 147   | 123,921 |
| 西松建設           | 76      | 36    | 21,852  |
| 三井住友建設         | 259.7   | 144.9 | 17,967  |
| 前田建設工業         | 33      | 21    | 24,969  |
| 奥村組            | 57      | 25    | 18,550  |
| 東鉄工業           | 7.8     | 3.3   | 11,665  |
| 戸田建設           | 76      | 37    | 26,122  |
| 熊谷組            | 89      | 47    | 16,121  |
| 大東建託           | 24.2    | 12.1  | 208,664 |

| 銘柄         | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|------------|---------|-------|---------|
|            | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|            | 千株      | 千株    | 千円      |
| N I P P O  | 10      | 7     | 15,596  |
| 前田道路       | 16      | 10    | 22,470  |
| 東亜建設工業     | 60      | 7.9   | 15,886  |
| 五洋建設       | 81.2    | 39.7  | 24,772  |
| 大林道路       | 17.2    | 15.3  | 14,366  |
| 住友林業       | 47.4    | 22.4  | 39,872  |
| 日本基礎技術     | 48.3    | 33.1  | 11,684  |
| パナホーム      | 29      | 10    | 12,290  |
| 大和ハウス工業    | 195.6   | 99    | 359,073 |
| 積水ハウス      | 220.5   | 105.2 | 200,932 |
| 北陸電気工事     | —       | 1.9   | 1,765   |
| ユアテック      | 13      | —     | —       |
| 西部電気工業     | 32      | 2.8   | 6,406   |
| 中電工        | 12.7    | 5.9   | 16,667  |
| 関電工        | 26      | 11    | 12,408  |
| きんでん       | 41.8    | 22.5  | 37,980  |
| 東京エネシス     | 12      | —     | —       |
| トーエネック     | 17      | —     | —       |
| 日本電設工業     | 12.7    | 5.1   | 11,546  |
| 協和エクシオ     | 28.4    | 14.1  | 26,254  |
| 新日本空調      | 21.4    | 13.4  | 20,126  |
| 九電工        | 8.5     | 6.3   | 24,759  |
| 三機工業       | 28.7    | 17.9  | 20,764  |
| 日揮         | 66      | 31.1  | 51,937  |
| 中外炉工業      | 67      | 45    | 9,630   |
| ヤマト        | 43      | 24.9  | 14,018  |
| 太平電業       | 14      | —     | —       |
| 高砂熱学工業     | 22.4    | 10    | 18,020  |
| 三晃金属工業     | 39      | 1.7   | 5,440   |
| 大気社        | 9.2     | 4.8   | 14,400  |
| 日比谷総合設備    | 14.7    | 11.6  | 20,566  |
| 東芝プラントシステム | 18.2    | 5.4   | 8,812   |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当期 末  |         |
|-------------------|---------|-------|---------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                   | 千株      | 千株    | 千円      |
| 東洋エンジニアリング        | 63      | 30    | 7,800   |
| 千代田化工建設           | 45      | 22    | 13,926  |
| 新興ブランテック          | 28.7    | 19.6  | 15,621  |
| <b>食料品 (4.8%)</b> |         |       |         |
| 日本製粉              | 41      | 9.7   | 17,042  |
| 日清製粉グループ本社        | 73.1    | 37.5  | 69,787  |
| 鳥越製粉              | 23.4    | 20.4  | 16,503  |
| 日本甜菜製糖            | 117     | 7.9   | 17,609  |
| 三井製糖              | 43      | 4.8   | 16,104  |
| 森永製菓              | 53      | 6.7   | 43,751  |
| 中村屋               | 30      | —     | —       |
| 江崎グリコ             | 15.4    | 8.4   | 52,500  |
| 山崎製パン             | 46      | 24.7  | 57,229  |
| 亀田製菓              | —       | 1.1   | 6,479   |
| カルビー              | 23.7    | 13.6  | 60,248  |
| 森永乳業              | 53      | 29    | 27,144  |
| 六甲バター             | 1.5     | —     | —       |
| ヤクルト本社            | 35.4    | 18.1  | 142,809 |
| 明治ホールディングス        | 39.2    | 19.8  | 179,784 |
| 雪印メグミルク           | 15.6    | 6.9   | 23,322  |
| ブリマハム             | 44      | 14    | 8,302   |
| 日本ハム              | 47      | 23    | 79,580  |
| 丸大食品              | 43      | 10    | 5,230   |
| S F o o d s       | 7.3     | 4.5   | 16,875  |
| 伊藤ハム米久ホールディングス    | 33.1    | 21.3  | 21,981  |
| サッポロホールディングス      | 96      | 11    | 36,575  |
| アサヒグループホールディングス   | 123.8   | 62.9  | 282,043 |
| キリンホールディングス       | 267.1   | 144.1 | 337,410 |
| 宝ホールディングス         | 48.5    | 24.9  | 28,386  |
| オエノンホールディングス      | 54      | 40    | 10,680  |
| コカ・コーラボトラーズジャパン   | 22.6    | 20.9  | 72,314  |
| コカ・コーライーストジャパン    | 22.9    | —     | —       |
| サントリー食品インターナショナル  | 45.5    | 23.2  | 124,352 |
| ダイドーグループホールディングス  | 3.9     | 0.6   | 3,348   |
| 伊藤園               | 19.6    | 9.8   | 44,884  |
| キーコーヒー            | 11.4    | 8.6   | 19,014  |
| ユニカフェ             | —       | 0.4   | 392     |
| ジャパンフーズ           | 16.3    | 11.8  | 15,906  |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当期 末  |         |
|---------------------|---------|-------|---------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                     | 千株      | 千株    | 千円      |
| 日清オイリオグループ          | 43      | 14    | 9,212   |
| 不二製油グループ本社          | 17.6    | 8.9   | 23,629  |
| Jーオイルミルズ            | 38      | 1     | 4,050   |
| キッコーマン              | 50      | 23.5  | 82,955  |
| 味の素                 | 139.4   | 69.7  | 166,792 |
| キュービー               | 33.8    | 17.2  | 50,482  |
| ハウス食品グループ本社         | 23.1    | 12.2  | 33,818  |
| カゴメ                 | 24.4    | 12    | 42,660  |
| アリアケジャパン            | 4.8     | 2.8   | 22,316  |
| ニチレイ                | 66      | 16.9  | 53,573  |
| 東洋水産                | 32.5    | 16.5  | 71,197  |
| 日清食品ホールディングス        | 27.6    | 13.3  | 92,701  |
| 永谷園ホールディングス         | 4       | —     | —       |
| フジッコ                | 11      | 7.2   | 19,008  |
| ロック・フィールド           | 11.6    | 9.4   | 18,471  |
| 日本たばこ産業             | 390.7   | 186.3 | 783,018 |
| ユーグレナ               | 23      | 11    | 13,068  |
| <b>繊維製品 (0.7%)</b>  |         |       |         |
| 片倉工業                | 13.3    | 8.8   | 11,616  |
| グンゼ                 | 74      | 40    | 15,760  |
| 東洋紡                 | 240     | 120   | 22,560  |
| 倉敷紡績                | 102     | 78    | 20,514  |
| 日本毛織                | 20.6    | 10.2  | 8,649   |
| 帝国繊維                | 11.2    | 4.6   | 8,422   |
| 帝人                  | 254     | 25.3  | 52,801  |
| 東レ                  | 448     | 227.3 | 209,320 |
| 日本フェルト              | 39.8    | 24    | 12,360  |
| セーレン                | 15.4    | 7.7   | 12,350  |
| 小松精練                | 31      | 21.9  | 16,271  |
| ワコールホールディングス        | 35      | 18    | 25,560  |
| ホギメディカル             | 3.6     | 1.9   | 14,060  |
| T S I ホールディングス      | 34.1    | 26.1  | 18,687  |
| 三陽商会                | 65      | 56    | 8,960   |
| オンワードホールディングス       | 31      | 18    | 14,292  |
| デサント                | 17.4    | 10.6  | 14,341  |
| <b>パルプ・紙 (0.3%)</b> |         |       |         |
| 特種東海製紙              | 78      | 2.5   | 10,112  |
| 王子ホールディングス          | 255     | 121   | 67,155  |

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|----------------|---------|-------|---------|
|                | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                | 千株      | 千株    | 千円      |
| 日本製紙           | 32      | 13.4  | 29,252  |
| 三菱製紙           | 277     | 25.4  | 18,745  |
| 北越紀州製紙         | 41.8    | 19.5  | 17,004  |
| 大王製紙           | 26      | 13.6  | 18,781  |
| レンゴー           | 49      | 28.5  | 17,727  |
| ザ・バック          | 10.9    | 4.4   | 14,674  |
| 化学 (6.8%)      |         |       |         |
| クラレ            | 99.3    | 52.3  | 104,181 |
| 旭化成            | 385     | 196   | 208,152 |
| 共和レザー          | 25      | 16.7  | 15,881  |
| 昭和電工           | 424     | 20.9  | 42,845  |
| 住友化学           | 460     | 232   | 135,488 |
| 住友精化           | 20      | 0.2   | 982     |
| 日産化学工業         | 38.1    | 17.6  | 68,464  |
| クレハ            | 52      | 1.6   | 9,008   |
| 石原産業           | 253     | 9.2   | 9,724   |
| 片倉コープアグリ       | 56      | 33    | 9,207   |
| 日本曹達           | 32      | 13    | 7,358   |
| 東ソー            | 169     | 92    | 86,388  |
| トクヤマ           | 116     | 48    | 22,992  |
| セントラル硝子        | 58      | 29    | 13,050  |
| 東亜合成           | 40.5    | 20.2  | 25,229  |
| 大阪ソーダ          | 49      | 13    | 6,565   |
| デンカ            | 128     | 66    | 37,158  |
| 信越化学工業         | 110.9   | 56.3  | 558,045 |
| 堺化学工業          | 53      | 9     | 3,699   |
| エア・ウォーター       | 48      | 26.4  | 52,456  |
| 大陽日酸           | 48.2    | 24.6  | 27,650  |
| 日本バーカライジング     | 32.1    | 16.1  | 26,098  |
| 四国化成工業         | 9       | —     | —       |
| ステラ ケミファ       | 8.6     | 0.4   | 1,134   |
| 日本触媒           | 8.8     | 5     | 33,350  |
| カネカ            | 79      | 43    | 36,120  |
| 三菱瓦斯化学         | 104     | 29.8  | 65,202  |
| 三井化学           | 257     | 142   | 76,538  |
| J S R          | 59.1    | 32.1  | 59,770  |
| 東京応化工業         | 13      | 6.2   | 22,630  |
| 三菱ケミカルホールディングス | 418.9   | 210.4 | 172,969 |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-------------------|---------|-------|---------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                   | 千株      | 千株    | 千円      |
| ダイセル              | 88.4    | 42.9  | 55,383  |
| 住友ペークライト          | 50      | 26    | 19,552  |
| 積水化学工業            | 140.2   | 71.8  | 139,220 |
| 日本ゼオン             | 47      | 25    | 27,575  |
| アイカ工業             | 19.2    | 9.9   | 32,125  |
| 宇部興産              | 332     | 159   | 41,976  |
| 旭有機材              | 53      | 41    | 9,881   |
| 日立化成              | 31.6    | 18    | 52,524  |
| 群栄化学工業            | 40      | —     | —       |
| タイガースポリマー         | 27.2    | 17.4  | 12,997  |
| ミライアル             | 11.1    | 7.7   | 6,930   |
| 日本化薬              | 37      | 19    | 29,317  |
| A D E K A         | 30.2    | 13.4  | 21,386  |
| 日油                | 42      | 25    | 35,625  |
| ハリマ化成グループ         | 38.8    | 22.9  | 17,930  |
| 花王                | 166.5   | 78.1  | 539,514 |
| ニイタカ              | —       | 0.4   | 694     |
| 三洋化成工業            | 24      | 1.1   | 5,665   |
| 日本ペイントホールディングス    | 48.3    | 24.4  | 106,384 |
| 関西ペイント            | 70.1    | 33.4  | 78,289  |
| 中国塗料              | 21      | 7.2   | 5,810   |
| 太陽ホールディングス        | 6.2     | 2.5   | 12,050  |
| D I C             | 250     | 12.8  | 47,488  |
| サカタインクス           | 13      | 7.8   | 13,314  |
| 東洋インキ S Cホールディングス | 55      | 32    | 17,792  |
| 富士フイルムホールディングス    | 140.8   | 62    | 250,976 |
| 資生堂               | 117.5   | 59.7  | 220,949 |
| ライオン              | 70      | 38.9  | 88,186  |
| 高砂香料工業            | 7.5     | 4.1   | 16,236  |
| マンダム              | 6       | 2.9   | 16,559  |
| ファンケル             | 19.2    | 7.2   | 14,990  |
| コーセー              | 9.6     | 5     | 58,550  |
| コタ                | —       | 1     | 1,187   |
| シーズ・ホールディングス      | 12.2    | 3.5   | 12,180  |
| ポーラ・オルビスホールディングス  | 6.1     | 12.5  | 37,750  |
| エステー              | 16.2    | 11.2  | 25,894  |
| 長谷川香料             | 14.5    | 10.1  | 22,230  |
| 小林製薬              | 8.9     | 8.7   | 56,724  |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-------------------|---------|-------|---------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                   | 千株      | 千株    | 千円      |
| 荒川化学工業            | 14.4    | 6.9   | 13,248  |
| メック               | 19.3    | 8.3   | 10,408  |
| タカラバイオ            | —       | 9.3   | 13,838  |
| J C U             | 0.8     | —     | —       |
| アース製薬             | 4.6     | 1.8   | 10,566  |
| イハラケミカル工業         | 19      | —     | —       |
| 大成ラミック            | 4.7     | 1.5   | 4,300   |
| クミアイ化学工業          | 18.2    | 35.9  | 22,940  |
| 日本農薬              | 23.3    | 11.6  | 7,389   |
| 日東電工              | 47.8    | 22.7  | 200,940 |
| レック               | 15.3    | 6.5   | 19,214  |
| 前澤化成工業            | 13.3    | 9.5   | 11,485  |
| エフビコ              | 5       | 2.8   | 16,212  |
| 天馬                | 10.6    | 9.3   | 18,609  |
| 信越ポリマー            | 32.7    | 13.2  | 10,388  |
| ニフコ               | 12      | 5.5   | 31,295  |
| 日本バルカー工業          | 72      | 9     | 20,574  |
| ユニ・チャーム           | 124.2   | 63.8  | 188,273 |
| <b>医薬品 (4.7%)</b> |         |       |         |
| 協和発酵キリン           | 74.8    | 37.8  | 75,713  |
| 武田薬品工業            | 246.2   | 117.7 | 681,600 |
| アステラス製薬           | 693     | 319.6 | 448,558 |
| 大日本住友製薬           | 44.4    | 22.5  | 37,642  |
| 塩野義製薬             | 90.3    | 39.9  | 241,115 |
| 田辺三菱製薬            | 72.6    | 36.7  | 90,685  |
| あすか製薬             | 17.8    | 6.3   | 10,905  |
| 日本新薬              | 13.9    | 6.9   | 44,643  |
| 中外製薬              | 62.1    | 31.6  | 132,878 |
| 科研製薬              | 10.4    | 5.8   | 37,816  |
| エーザイ              | 75.8    | 38.6  | 227,392 |
| ロート製薬             | 30.9    | 15.8  | 36,450  |
| 小野薬品工業            | 140.3   | 71    | 166,495 |
| 久光製薬              | 18.7    | 8.9   | 50,285  |
| 持田製薬              | 4.1     | 2.2   | 17,534  |
| 参天製薬              | 114.2   | 57.5  | 86,710  |
| 日本ケミファ            | 11      | —     | —       |
| ツムラ               | 20      | 10.9  | 43,600  |
| 日医工               | 15      | 7.3   | 11,993  |

| 銘柄                     | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|------------------------|---------|-------|---------|
|                        | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                        | 千株      | 千株    | 千円      |
| キッセイ薬品工業               | 11.6    | 5.8   | 16,408  |
| 生化学工業                  | 17.2    | 7.5   | 13,140  |
| 鳥居薬品                   | 8.5     | 5.9   | 16,095  |
| J C R ファーマ             | 4.9     | 1.7   | 4,523   |
| 東和薬品                   | 2.5     | 0.6   | 3,180   |
| 沢井製薬                   | 10.4    | 5.6   | 34,496  |
| ゼリア新薬工業                | 13.4    | 7.7   | 13,321  |
| 第一三共                   | 208.4   | 92.6  | 224,323 |
| キョーリン製薬ホールディングス        | 16.9    | 7.9   | 18,209  |
| 大幸薬品                   | —       | 0.5   | 939     |
| 大塚ホールディングス             | 133.2   | 67.5  | 339,862 |
| 大正製薬ホールディングス           | 14.8    | 6.6   | 57,618  |
| ペプチドリーム                | 7.5     | 5.9   | 35,990  |
| <b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>  |         |       |         |
| 昭和シェル石油                | 62.9    | 27.5  | 28,407  |
| ニチレキ                   | 16.8    | 16.8  | 19,773  |
| 東燃ゼネラル石油               | 91      | —     | —       |
| 出光興産                   | 33      | 14.7  | 47,187  |
| J X T Gホールディングス        | 731.6   | 478.6 | 235,184 |
| コスモエネルギーホールディングス       | 19.5    | 10.7  | 18,350  |
| <b>ゴム製品 (1.0%)</b>     |         |       |         |
| 横浜ゴム                   | 38.5    | 19.2  | 42,182  |
| 東洋ゴム工業                 | 28.8    | 16.5  | 36,102  |
| ブリヂストン                 | 208.3   | 105.9 | 499,318 |
| 住友ゴム工業                 | 57.3    | 29.8  | 56,858  |
| オカモト                   | 22      | 5     | 6,245   |
| ニッタ                    | 7.6     | 4.5   | 14,602  |
| 住友理工                   | 21.5    | 8.1   | 9,217   |
| 三ツ星ベルト                 | 15      | —     | —       |
| バンダー化学                 | 38      | 11.2  | 11,536  |
| <b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b> |         |       |         |
| 日東紡績                   | 36      | 25    | 13,650  |
| 旭硝子                    | 325     | 154   | 138,292 |
| 日本板硝子                  | 316     | —     | —       |
| 日本山村硝子                 | 72      | 45    | 8,235   |
| 日本電気硝子                 | 127     | 63    | 48,762  |
| 住友大阪セメント               | 120     | 55    | 27,170  |
| 太平洋セメント                | 385     | 188   | 67,116  |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|--------------------|---------|-------|---------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                    | 千株      | 千株    | 千円      |
| 日本ヒューム             | 20.8    | 13.7  | 9,206   |
| 東海カーボン             | 63      | 28.7  | 15,698  |
| 日本カーボン             | 73      | —     | —       |
| 東洋炭素               | 11.4    | 3.4   | 6,415   |
| ノリタケカンパニーリミテド      | 69      | 0.4   | 1,332   |
| TOTO               | 45.3    | 22.9  | 95,378  |
| 日本碍子               | 77      | 39.3  | 87,599  |
| 日本特殊陶業             | 52.4    | 26.8  | 60,460  |
| MARUWA             | 1.5     | —     | —       |
| ニチアス               | 27      | 15    | 19,185  |
| ニチハ                | 15.1    | 4.3   | 17,243  |
| <b>鉄鋼 (1.2%)</b>   |         |       |         |
| 新日鐵住金              | 278.7   | 141.7 | 338,237 |
| 神戸製鋼所              | 1,145   | 55.8  | 56,971  |
| 合同製鐵               | 77      | 1.5   | 2,694   |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 169.8   | 86.4  | 158,284 |
| 日新製鋼               | 26.7    | 11.3  | 14,045  |
| 東京製鐵               | 39.1    | 16.2  | 14,401  |
| 共英製鋼               | 9.2     | 3.6   | 6,127   |
| 大和工業               | 12.2    | 5.8   | 15,619  |
| 大阪製鐵               | 10.5    | 6.8   | 14,069  |
| 淀川製鋼所              | 9.2     | 4     | 12,080  |
| 東洋鋼板               | 47      | 38.4  | 15,014  |
| 丸一鋼管               | 20.4    | 10.1  | 32,875  |
| モリ工業               | —       | 0.3   | 699     |
| 大同特殊鋼              | 99      | 50    | 29,350  |
| 山陽特殊製鋼             | 41      | 11    | 6,281   |
| 愛知製鋼               | 37      | 0.9   | 3,811   |
| 日立金属               | 71.5    | 31.5  | 46,021  |
| 大太平洋金属             | 55      | 23    | 6,647   |
| 新日本電工              | 70.6    | 33.5  | 12,562  |
| 三菱製鋼               | 74      | 41    | 9,963   |
| シンニッタン             | 32.3    | 24.5  | 17,003  |
| <b>非鉄金属 (0.9%)</b> |         |       |         |
| 日本軽金属ホールディングス      | 146.8   | 75.1  | 18,850  |
| 三井金属鉱業             | 169     | 83    | 34,445  |
| 東邦亜鉛               | 48      | 14    | 5,894   |
| 三菱マテリアル            | 388     | 19.9  | 61,789  |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|--------------------|---------|-------|---------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                    | 千株      | 千株    | 千円      |
| 住友金属鉱山             | 172     | 81    | 110,362 |
| DOWAホールディングス       | 73      | 32    | 25,536  |
| 古河機械金属             | 98      | 37    | 7,289   |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ     | 14.5    | —     | —       |
| UACJ               | 112     | 37    | 10,767  |
| 古河電気工業             | 201     | 10.1  | 48,429  |
| 住友電気工業             | 247.4   | 118.2 | 210,455 |
| フジクラ               | 80      | 41.1  | 38,839  |
| タツタ電線              | 33.6    | 26.5  | 14,548  |
| リョービ               | 56      | 22    | 10,054  |
| アサヒホールディングス        | 15.6    | 11.2  | 21,280  |
| <b>金属製品 (0.8%)</b> |         |       |         |
| トーカロ               | 9.1     | 3.7   | 13,005  |
| SUMCO              | 49.1    | 33    | 58,740  |
| 東洋製罐グループホールディングス   | 42.3    | 22.3  | 39,181  |
| ホッカンホールディングス       | 28      | —     | —       |
| コロナ                | 17.8    | 13.3  | 15,215  |
| 横河ブリッジホールディングス     | 21.1    | 11.3  | 17,164  |
| 駒井ハルテック            | 55      | 4.5   | 10,359  |
| 三和ホールディングス         | 64.1    | 30.1  | 36,150  |
| 文化シヤッター            | 23.2    | 9.8   | 8,437   |
| 三協立山               | 16.8    | 8.2   | 13,349  |
| LIXILグループ          | 85.9    | 44.1  | 117,085 |
| ノーリツ               | 13.1    | 5.5   | 11,693  |
| 長府製作所              | 8.9     | 5.2   | 13,982  |
| リンナイ               | 10.7    | 5.2   | 51,584  |
| 日東精工               | 50      | 31.5  | 14,175  |
| 東プレ                | 12.4    | 6     | 18,420  |
| 高周波熱練              | 28.7    | 18.2  | 18,473  |
| パイオラックス            | 3.2     | 3.4   | 9,390   |
| 日本発條               | 58.8    | 31.3  | 36,621  |
| 三益半導体工業            | 17.3    | 9.5   | 17,299  |
| <b>機械 (5.0%)</b>   |         |       |         |
| 日本製鋼所              | 102     | 10.1  | 16,422  |
| 三浦工業               | 27.6    | 13.6  | 29,539  |
| タクマ                | 19      | 6.7   | 6,840   |
| ツガミ                | 10      | —     | —       |
| オークマ               | 35      | 19    | 19,000  |

| 銘柄          | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-------------|---------|-------|---------|
|             | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|             | 千株      | 千株    | 千円      |
| 東芝機械        | 63      | 30    | 14,790  |
| アマダホールディングス | 92      | 42.4  | 55,416  |
| アイダエンジニアリング | 16.8    | 8.1   | 7,921   |
| 富士機械製造      | 21.9    | 11    | 17,963  |
| 牧野フライス製作所   | 25      | 14    | 12,768  |
| オーエスジー      | 29.1    | 14    | 30,800  |
| 旭ダイヤモンド工業   | 23.6    | 8.5   | 7,021   |
| DMG森精機      | 35.9    | 18.7  | 32,388  |
| ディスコ        | 7.6     | 3.7   | 69,375  |
| 日東工器        | 10.2    | 6.1   | 15,481  |
| 島精機製作所      | 9.7     | 3.9   | 20,046  |
| N Cホールディングス | —       | 0.8   | 723     |
| 日阪製作所       | 22.6    | 21.1  | 19,897  |
| ナブテスコ       | 31.3    | 16.2  | 52,731  |
| SMC         | 18.5    | 9.4   | 329,658 |
| 新川          | 26.2    | 18.1  | 11,746  |
| ユニオンツール     | 4.8     | 3.3   | 10,807  |
| オイレス工業      | 10.3    | 3.5   | 6,751   |
| サトーホールディングス | 12.1    | 5     | 12,560  |
| 小松製作所       | 302.9   | 144.8 | 383,720 |
| 住友重機械工業     | 173     | 92    | 65,872  |
| 日立建機        | 26.9    | 13.6  | 35,169  |
| 巴工業         | 7.7     | 5.4   | 9,601   |
| 井関農機        | 101     | 53    | 12,190  |
| タカキタ        | —       | 0.8   | 425     |
| クボタ         | 297.2   | 150   | 263,775 |
| 月島機械        | 22.2    | 11.8  | 14,089  |
| 帝国電機製作所     | 18.5    | 13.8  | 15,373  |
| 新東工業        | 24.9    | 13.7  | 15,193  |
| 小森コーポレーション  | 20.7    | 6.5   | 9,594   |
| 鶴見製作所       | —       | 0.5   | 878     |
| 住友精密工業      | 32      | 6     | 2,046   |
| 荏原製作所       | 136     | 13.9  | 43,229  |
| 西島製作所       | 20.4    | 15.4  | 16,447  |
| ダイキン工業      | 85.8    | 40.9  | 446,423 |
| オルガノ        | 17      | —     | —       |
| 栗田工業        | 36.1    | 18    | 52,434  |
| 椿本チエイン      | 39      | 17    | 16,201  |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|---------------------|---------|-------|---------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                     | 千株      | 千株    | 千円      |
| ダイフク                | 31.6    | 15.3  | 50,719  |
| タダノ                 | 23.6    | 15.4  | 20,220  |
| フジテック               | 19.6    | 8.9   | 11,454  |
| CKD                 | 19      | 9.5   | 16,093  |
| 平和                  | 18.1    | 8.9   | 21,858  |
| SANKYO              | 16.3    | 8.1   | 30,334  |
| 日本金銭機械              | 9.7     | 8.8   | 10,225  |
| 福島工業                | 8.7     | 4.9   | 20,972  |
| 竹内製作所               | 6       | 5.9   | 10,867  |
| アマノ                 | 17.9    | 9.1   | 22,922  |
| サンデンホールディングス        | 52      | 21    | 6,468   |
| グローリー               | 19.5    | 9.5   | 35,197  |
| 大和冷機工業              | 22.8    | 17.6  | 21,436  |
| セガサミーホールディングス       | 64.2    | 30.3  | 42,813  |
| リケン                 | 39      | 1.1   | 5,247   |
| ホシザキ                | 12.8    | 8.8   | 85,624  |
| 大豊工業                | 16.7    | 12    | 16,860  |
| 日本精工                | 123     | 62.3  | 83,419  |
| NTN                 | 146     | 68    | 34,476  |
| ジェイテクト              | 62.2    | 32.7  | 54,609  |
| 不二越                 | 47      | 29    | 16,327  |
| 日本トムソン              | 33      | 26.9  | 16,301  |
| THK                 | 39.5    | 21.3  | 64,113  |
| ユーシン精機              | 3.7     | 1.5   | 3,952   |
| キッツ                 | 44.7    | 16.5  | 14,965  |
| 日立工機                | 29.5    | —     | —       |
| マキタ                 | 38.5    | 39.1  | 162,851 |
| 日立造船                | 48.5    | 26    | 13,936  |
| 三菱重工業               | 1,050   | 501   | 219,838 |
| I H I               | 466     | 228   | 92,340  |
| スター精密               | —       | 5     | 8,200   |
| <b>電気機器 (13.0%)</b> |         |       |         |
| 日清紡ホールディングス         | 33.4    | 16.4  | 17,531  |
| イビデン                | 36.8    | 20.2  | 39,491  |
| コニカミノルタ             | 150.1   | 71.3  | 63,243  |
| ブラザー工業              | 80.5    | 38.6  | 94,956  |
| ミネベアミツミ             | 94      | 55.2  | 96,986  |
| 日立製作所               | 1,505   | 717   | 478,884 |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-------------------|---------|-------|---------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                   | 千株      | 千株    | 千円      |
| 東芝                | 1,247   | 668   | 175,216 |
| 三菱電機              | 627     | 319.8 | 495,530 |
| 富士電機              | 184     | 91    | 53,963  |
| 東洋電機製造            | 35      | —     | —       |
| 安川電機              | 70.1    | 34.2  | 75,240  |
| 明電舎               | 49      | 18    | 6,894   |
| 山洋電気              | 13      | —     | —       |
| 東芝テック             | 51      | 18    | 10,872  |
| マブチモーター           | 15.9    | 8.4   | 53,928  |
| 日本電産              | 71.1    | 38.8  | 421,174 |
| 東光高岳              | 13.3    | 4.9   | 8,114   |
| ダブル・スコープ          | 2.8     | 3.4   | 5,909   |
| ダイヘン              | 40      | 11    | 9,152   |
| ミマキエンジニアリング       | 4       | —     | —       |
| 日新電機              | —       | 8.5   | 10,633  |
| オムロン              | 67.4    | 32    | 146,720 |
| 日東工業              | 10.6    | 4.3   | 7,662   |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 111     | 58    | 29,232  |
| メルコホールディングス       | 10.1    | 3.2   | 10,128  |
| テクノメディカ           | —       | 0.5   | 965     |
| 日本電気              | 821     | 411   | 118,368 |
| 富士通               | 576     | 289   | 233,338 |
| 沖電気工業             | 290     | 12.6  | 20,953  |
| サンケン電気            | 31      | 7     | 3,192   |
| アイホン              | 10.4    | 6.9   | 13,130  |
| ルネサスエレクトロニクス      | 34.2    | 16.3  | 14,718  |
| セイコーエプソン          | 87.5    | 44.5  | 104,708 |
| ワコム               | 61      | 49.9  | 17,814  |
| アルバック             | 10.1    | 4.7   | 28,576  |
| E I Z O           | 9.2     | 5.7   | 24,424  |
| ジャパンディスプレイ        | 137.1   | 61.5  | 12,484  |
| 日本信号              | 23.7    | 18.3  | 19,507  |
| 能美防災              | 12.8    | 7     | 10,654  |
| ホーチキ              | 10.8    | 6.2   | 9,727   |
| パナソニック            | 674.8   | 343.9 | 473,206 |
| シャープ              | 486     | —     | —       |
| アンリツ              | 40.7    | 23.8  | 22,276  |
| 富士通ゼネラル           | 13      | 9.7   | 24,870  |

| 銘柄          | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-------------|---------|-------|---------|
|             | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|             | 千株      | 千株    | 千円      |
| 日立国際電気      | 19      | 7.2   | 18,662  |
| ソニー         | 416.5   | 211.9 | 855,652 |
| T D K       | 35.5    | 16.8  | 112,224 |
| ミツミ電機       | 28.3    | —     | —       |
| タムラ製作所      | 37      | —     | —       |
| アルプス電気      | 50.4    | 27.4  | 84,255  |
| パイオニア       | 114.6   | 51.7  | 10,340  |
| 日本電波工業      | 11.1    | 4.9   | 4,307   |
| 日本トリム       | 3.9     | 0.8   | 3,300   |
| フォスター電機     | 10.8    | 7.5   | 12,450  |
| SMK         | 20      | —     | —       |
| ヨコオ         | 26.6    | 12.9  | 17,943  |
| ホシデン        | 18.9    | 9.5   | 11,504  |
| ヒロセ電機       | 9.4     | 4.8   | 70,848  |
| 日本航空電子工業    | 11      | 5     | 7,520   |
| アルパイン       | 18.3    | 7.2   | 11,253  |
| アイコム        | 6.2     | 4.5   | 12,136  |
| 船井電機        | 14.5    | 12.4  | 11,036  |
| 横河電機        | 63.7    | 32    | 61,376  |
| アズビル        | 19.4    | 9.5   | 37,762  |
| 日本光電工業      | 24.7    | 12.5  | 30,675  |
| 堀場製作所       | 10.6    | 5.8   | 38,860  |
| アドバンテスト     | 44.2    | 19.8  | 38,154  |
| キーエンス       | 13.3    | 13.6  | 665,312 |
| 日置電機        | 9.5     | 7.1   | 15,627  |
| シスメックス      | 45.8    | 23.2  | 148,944 |
| メガチップス      | 16.8    | —     | —       |
| OBARA GROUP | 4.6     | 1.3   | 7,618   |
| コーセル        | 15      | 9.3   | 12,620  |
| オプテックスグループ  | 6       | 3.6   | 13,428  |
| 千代田インテグレ    | 7       | 4.7   | 10,772  |
| スタンレー電気     | 42.2    | 21    | 70,035  |
| ウシオ電機       | 38.3    | 17.5  | 24,972  |
| 日本セラミック     | 3.8     | 2.1   | 5,489   |
| 日本デジタル研究所   | 13.5    | —     | —       |
| 双信電機        | 33.3    | 35.9  | 10,805  |
| 図研          | 12.3    | 7.6   | 12,152  |
| 日本電子        | 30      | —     | —       |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|---------------------|---------|-------|-----------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                     | 千株      | 千株    | 千円        |
| カシオ計算機              | 60.4    | 24.5  | 43,046    |
| ファナック               | 60.4    | 30.4  | 661,960   |
| エンブラス               | 4.2     | —     | —         |
| ローム                 | 28.8    | 14.4  | 127,584   |
| 浜松ホトニクス             | 46.8    | 22.2  | 78,699    |
| 三井ハイテック             | 24.5    | 18.1  | 21,774    |
| 新光電気工業              | 25.3    | 11.4  | 9,940     |
| 京セラ                 | 97      | 49.1  | 313,896   |
| 太陽誘電                | 29.3    | 14.9  | 23,393    |
| 村田製作所               | 62.3    | 31.5  | 489,195   |
| 双葉電子工業              | 12.5    | 8     | 15,280    |
| ニチコン                | 17.2    | 9.6   | 10,483    |
| 日本ケミコン              | 105     | 44    | 16,896    |
| K O A               | 14.4    | 10.3  | 20,352    |
| 小糸製作所               | 35.3    | 18.1  | 107,333   |
| ミツバ                 | 16.8    | 6.9   | 12,978    |
| スター精密               | 10.8    | —     | —         |
| S C R E E Nホールディングス | 56      | 6.2   | 48,980    |
| キャノン電子              | 10.7    | 9.7   | 20,670    |
| キャノン                | 318     | 161.4 | 614,449   |
| リコー                 | 193.5   | 89.4  | 84,304    |
| 東京エレクトロン            | 48.4    | 20.1  | 317,881   |
| <b>輸送用機器 (8.6%)</b> |         |       |           |
| トヨタ紡織               | 20.9    | 10.5  | 22,711    |
| ユニプレス               | 13.1    | 6.5   | 16,809    |
| 豊田自動織機              | 54.1    | 27.4  | 154,810   |
| モリタホールディングス         | 21.1    | 7.3   | 12,132    |
| デンソー                | 145.5   | 73.9  | 350,803   |
| 東海理化電機製作所           | 16.6    | 7.9   | 16,424    |
| 三井造船                | 230     | 111   | 17,205    |
| 川崎重工業               | 463     | 230   | 74,060    |
| 日本車輛製造              | 57      | —     | —         |
| 近畿車輛                | 46      | 3.2   | 8,121     |
| 日産自動車               | 822     | 353.3 | 379,444   |
| いすゞ自動車              | 173.3   | 87.5  | 119,218   |
| トヨタ自動車              | 733.4   | 364.3 | 2,174,871 |
| 日野自動車               | 84.4    | 43.4  | 58,373    |
| 三菱自動車工業             | 236.2   | 111.4 | 79,539    |

| 銘柄                 | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|--------------------|---------|-------|---------|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                    | 千株      | 千株    | 千円      |
| 武蔵精密工業             | 11.4    | 4.1   | 11,529  |
| 日産車体               | 29.1    | 14.5  | 16,501  |
| 新明和工業              | 21      | 11    | 9,724   |
| 極東開発工業             | 21.1    | 11.6  | 20,613  |
| 日信工業               | 14      | 7     | 12,306  |
| トビー工業              | 98      | 3.7   | 10,308  |
| ティラド               | 89      | 53    | 18,709  |
| 曙ブレーキ工業            | 53.8    | 23.2  | 8,212   |
| N O K              | 28.9    | 14    | 33,670  |
| フタバ産業              | 40.4    | 14.5  | 12,397  |
| K Y B              | 69      | 32    | 16,800  |
| プレス工業              | 58.6    | 33.3  | 16,783  |
| カルソニックカンセイ         | 43      | —     | —       |
| ケーヒン               | 15.6    | 7.6   | 11,954  |
| アイシン精機             | 60.7    | 27.5  | 154,825 |
| マツダ                | 187.7   | 94.9  | 143,678 |
| ダイハツ工業             | 70.1    | —     | —       |
| 今仙電機製作所            | 14.7    | 11.9  | 13,994  |
| 本田技研工業             | 531.2   | 269.6 | 826,054 |
| スズキ                | 107.9   | 59.3  | 307,944 |
| S U B A R U        | 186     | 93.1  | 350,707 |
| ヤマハ発動機             | 84.7    | 42    | 117,348 |
| ショーワ               | 22.2    | 10.2  | 11,036  |
| エクセディ              | 8.5     | 4.1   | 12,525  |
| 豊田合成               | 21.7    | 9.6   | 25,785  |
| 愛三工業               | 21.3    | 15.3  | 13,662  |
| ヨロズ                | 10.7    | 5.2   | 8,798   |
| エフ・シー・シー           | 9.4     | 4.4   | 9,420   |
| シマノ                | 23.7    | 12.1  | 211,145 |
| テイ・エス テック          | 13.2    | 6.9   | 21,976  |
| <b>精密機器 (1.6%)</b> |         |       |         |
| テルモ                | 90      | 46.1  | 205,375 |
| クリエートメディック         | 20.2    | 16.6  | 16,467  |
| 日機装                | 27.9    | 11.1  | 11,888  |
| 島津製作所              | 75      | 38.9  | 83,557  |
| クボテック              | —       | 1.9   | 1,191   |
| 東京精密               | 12.8    | 5.4   | 20,331  |
| ニコン                | 109.9   | 51.9  | 88,800  |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|---------------------|---------|-------|---------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                     | 千株      | 千株    | 千円      |
| トプコン                | 19.8    | 14.6  | 29,754  |
| オリンパス               | 88.3    | 47.7  | 194,139 |
| 理研計器                | 17      | 11.6  | 21,819  |
| タムロン                | 7.8     | 3.5   | 7,126   |
| HOYA                | 133.1   | 61.7  | 336,265 |
| シチズン時計              | 78.5    | 35    | 25,935  |
| セイコーホールディングス        | 47      | 14    | 6,552   |
| ニプロ                 | 45.1    | 22.1  | 33,348  |
| <b>その他製品 (2.1%)</b> |         |       |         |
| パラマウントベッドホールディングス   | 5.7     | 2.9   | 13,746  |
| バンダイナムコホールディングス     | 62      | 32.8  | 129,560 |
| アイフィスジャパン           | 1       | 4.6   | 3,068   |
| パイロットコーポレーション       | 9.6     | 5     | 21,600  |
| トッパン・フォームズ          | 22.5    | 16.5  | 18,826  |
| フジシールインターナショナル      | 7.1     | 6.9   | 19,126  |
| タカラトミー              | 38.4    | 10.9  | 15,379  |
| タカノ                 | 28      | 18.5  | 20,794  |
| 大建工業                | 56      | 4.1   | 9,610   |
| 凸版印刷                | 168     | 84    | 102,984 |
| 大日本印刷               | 174     | 87    | 107,880 |
| 日本写真印刷              | 12      | 4.6   | 14,191  |
| アシックス               | 54.2    | 30.3  | 56,570  |
| 小松ウオール工業            | 4.7     | 4.5   | 9,243   |
| ヤマハ                 | 44.1    | 20.1  | 72,460  |
| クリナップ               | 19.9    | 14.7  | 11,848  |
| ビジョン                | 31.9    | 18    | 69,300  |
| キングジム               | 24.7    | 19    | 17,499  |
| リンテック               | 13.9    | 7.3   | 19,104  |
| TASAKI              | 5       | —     | —       |
| イトーキ                | 35      | 18.7  | 13,968  |
| 任天堂                 | 36.4    | 18.5  | 628,075 |
| 三菱鉛筆                | 5.5     | 2.1   | 13,650  |
| タカラスタンダード           | 18      | 4.2   | 7,761   |
| コクヨ                 | 32.9    | 15.8  | 23,447  |
| 岡村製作所               | 30.2    | 11.1  | 11,033  |
| 美津濃                 | 32      | 9     | 5,976   |
| アデランス               | 22.1    | —     | —       |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|----------------------|---------|-------|---------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                      | 千株      | 千株    | 千円      |
| <b>電気・ガス業 (1.9%)</b> |         |       |         |
| 東京電力ホールディングス         | 501.4   | 257   | 118,734 |
| 中部電力                 | 180.6   | 99    | 148,896 |
| 関西電力                 | 243.5   | 122.7 | 191,473 |
| 中国電力                 | 81.7    | 41.4  | 53,116  |
| 北陸電力                 | 56.5    | 28.3  | 31,356  |
| 東北電力                 | 147.9   | 75.3  | 123,642 |
| 四国電力                 | 53.5    | 26.3  | 37,503  |
| 九州電力                 | 130.6   | 65.9  | 91,139  |
| 北海道電力                | 57.2    | 27.1  | 23,278  |
| 沖縄電力                 | 13.8    | 6.05  | 16,643  |
| 電源開発                 | 50.2    | 23.5  | 70,147  |
| 東京瓦斯                 | 662     | 322   | 186,856 |
| 大阪瓦斯                 | 612     | 290   | 124,207 |
| 東邦瓦斯                 | 145     | 73    | 63,510  |
| 北海道瓦斯                | 64      | 33    | 8,943   |
| 西部瓦斯                 | 95      | 59    | 15,694  |
| 静岡ガス                 | 32.5    | 14.1  | 10,885  |
| <b>陸運業 (4.3%)</b>    |         |       |         |
| 東武鉄道                 | 315     | 162   | 96,228  |
| 相鉄ホールディングス           | 97      | 47    | 25,004  |
| 東京急行電鉄               | 343     | 163   | 132,682 |
| 京浜急行電鉄               | 163     | 83    | 112,548 |
| 小田急電鉄                | 190     | 48.5  | 107,961 |
| 京王電鉄                 | 166     | 84    | 77,700  |
| 京成電鉄                 | 87      | 22.9  | 65,929  |
| 富士急行                 | 12      | 2     | 2,334   |
| 東日本旅客鉄道              | 107.9   | 58    | 620,600 |
| 西日本旅客鉄道              | 56.9    | 28.8  | 224,812 |
| 東海旅客鉄道               | 52.8    | 24.9  | 454,300 |
| 西武ホールディングス           | 63.8    | 41.9  | 87,738  |
| 西日本鉄道                | 71      | 33    | 15,807  |
| 近鉄グループホールディングス       | 600     | 304   | 130,112 |
| 阪急阪神ホールディングス         | 397     | 38.1  | 154,686 |
| 南海電気鉄道               | 130     | 63    | 36,918  |
| 京阪ホールディングス           | 131     | 68    | 49,436  |
| 名古屋鉄道                | 213     | 109   | 56,244  |
| 日本通運                 | 224     | 113   | 76,727  |

| 銘柄                     | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|------------------------|---------|-------|---------|
|                        | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                        | 千株      | 千株    | 千円      |
| ヤマトホールディングス            | 104.7   | 54    | 129,573 |
| 山九                     | 74      | 39    | 27,105  |
| 丸運                     | 50.8    | 28.9  | 7,485   |
| センコーグループホールディングス       | 36.1    | 26.1  | 17,408  |
| トナミホールディングス            | 43      | 20    | 8,520   |
| ニッコンホールディングス           | 20.8    | 10.1  | 24,573  |
| 日本石油輸送                 | 74      | 1.7   | 4,479   |
| 福山通運                   | 30      | 13    | 9,165   |
| セイノーホールディングス           | 42.6    | 21.4  | 29,703  |
| 日立物流                   | 12.6    | 6.2   | 15,283  |
| C&F ロジホールディングス         | 14.5    | 11.9  | 17,457  |
| 九州旅客鉄道                 | —       | 29.9  | 109,583 |
| <b>海運業 (0.2%)</b>      |         |       |         |
| 日本郵船                   | 540     | 254   | 51,562  |
| 商船三井                   | 301     | 159   | 50,721  |
| 川崎汽船                   | 264     | 114   | 32,832  |
| 飯野海運                   | 36      | 23.3  | 10,648  |
| <b>空運業 (0.5%)</b>      |         |       |         |
| 日本航空                   | 113.3   | 52.7  | 174,015 |
| ANAホールディングス            | 1,093   | 554   | 195,839 |
| <b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b> |         |       |         |
| 三菱倉庫                   | 37      | 19    | 27,018  |
| 三井倉庫ホールディングス           | 58      | 28    | 8,596   |
| 住友倉庫                   | 47      | 21    | 15,120  |
| 東陽倉庫                   | 76      | 58.6  | 17,404  |
| 安田倉庫                   | 19.1    | 10.3  | 7,446   |
| 上組                     | 66      | 35    | 40,250  |
| キムラユニティー               | 11.4    | 7.7   | 8,754   |
| キューソー流通システム            | 3.8     | 2.2   | 5,810   |
| 郵船ロジスティクス              | 17.4    | 9     | 9,081   |
| 近鉄エクスプレス               | 17.3    | 7.3   | 12,285  |
| エーアイティー                | —       | 1.5   | 1,540   |
| <b>情報・通信業 (8.2%)</b>   |         |       |         |
| NECネットエスアイ             | 13.2    | 7.2   | 17,395  |
| 新日鉄住金ソリューションズ          | 13.6    | 6.9   | 18,133  |
| T I S                  | 19.8    | 9.6   | 30,864  |
| ネオス                    | 5       | 10.6  | 5,130   |
| 電算システム                 | —       | 1.1   | 1,879   |

| 銘柄                    | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-----------------------|---------|-------|---------|
|                       | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                       | 千株      | 千株    | 千円      |
| グリー                   | 43      | 19.9  | 18,168  |
| コーエーテクモホールディングス       | 17.4    | 6.4   | 14,470  |
| ヒト・コミュニケーションズ         | 2       | 2.4   | 4,356   |
| ブレインパッド               | 5       | 7.5   | 9,382   |
| K L a b               | 8       | 6.1   | 8,247   |
| ネクソフ                  | 55.4    | 32.1  | 66,671  |
| エムアップ                 | 4       | 5.3   | 11,718  |
| エイチーム                 | 5       | 4     | 12,420  |
| e n i s h             | 5       | 7.5   | 8,077   |
| コロブラ                  | 17      | 7.9   | 9,480   |
| サイバーリンクス              | 2       | 4.3   | 6,011   |
| VOYAGE GROUP          | 5       | 4.8   | 11,236  |
| ベリサーブ                 | 1.8     | 1.4   | 5,124   |
| ティーガイア                | 18.3    | 8.9   | 17,889  |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント  | 115     | 66.8  | 18,503  |
| GMOペイメントゲートウェイ        | 4.7     | 2.3   | 14,904  |
| ザップラス                 | 29.7    | 26.6  | 13,406  |
| インターネットイニシアティブ        | 12.2    | 8.4   | 17,656  |
| L I N E               | —       | 5.3   | 20,299  |
| フェイス                  | —       | 0.5   | 594     |
| 野村総合研究所               | 41.4    | 22    | 93,280  |
| C Eホールディングス           | —       | 0.5   | 548     |
| インテージホールディングス         | —       | 1.1   | 2,417   |
| フジ・メディア・ホールディングス      | 65.5    | 30.9  | 46,628  |
| オービック                 | 19.9    | 9.9   | 64,548  |
| ヤフー                   | 423.3   | 211.9 | 106,161 |
| トレンドマイクロ              | 28.8    | 15.8  | 87,058  |
| 日本オラクル                | 8.8     | 4.8   | 31,584  |
| アルファシステムズ             | —       | 0.8   | 1,603   |
| フューチャー                | 24.2    | 22.3  | 19,401  |
| C A C H o l d i n g s | 15.9    | 11.1  | 11,832  |
| ソフトバンク・テクノロジー         | 11.9    | 3.4   | 7,337   |
| 伊藤忠テクノソリューションズ        | 13.5    | 6.2   | 23,529  |
| 大塚商会                  | 15.8    | 7.7   | 53,130  |
| サイボウズ                 | 62      | 39.3  | 18,313  |
| 電通国際情報サービス            | 10.8    | 7.5   | 19,957  |
| デジタルガレージ              | —       | 5.9   | 11,658  |
| ウェザーニューズ              | 3.7     | 0.7   | 2,691   |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当 期 末 |           |
|----------------------|---------|-------|-----------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     |
|                      | 千株      | 千株    | 千円        |
| 日本エンタープライズ           | 20      | 21.2  | 5,448     |
| ネットワンシステムズ           | 35.1    | 15.5  | 15,918    |
| アルゴグラフィックス           | 7       | 6     | 15,372    |
| エイパックス・グループ・ホールディングス | 16.8    | 12    | 17,112    |
| 日本ユニシス               | 20      | 8.9   | 16,500    |
| 兼松エレクトロニクス           | 10.4    | 5.7   | 19,579    |
| 東京放送ホールディングス         | 36.8    | 19.2  | 35,270    |
| 日本テレビホールディングス        | 52.3    | 26.8  | 47,248    |
| テレビ朝日ホールディングス        | 17.8    | 7.6   | 15,032    |
| スカパー・J S A Tホールディングス | 52.9    | 29    | 14,181    |
| テレビ東京ホールディングス        | 10.9    | 6.9   | 15,483    |
| 日本通信                 | 30      | 47.5  | 8,027     |
| 日本電信電話               | 450     | 237.4 | 1,246,112 |
| K D D I              | 592     | 292.7 | 895,662   |
| 光通信                  | 7       | 3.5   | 37,870    |
| N T T ドコモ            | 435.4   | 217.8 | 592,416   |
| G M O インターネット        | 21.4    | 10.1  | 14,948    |
| カドカワ                 | 18.1    | 8.9   | 12,460    |
| ゼンリン                 | 11.7    | 8.2   | 22,049    |
| 松竹                   | 38      | 19    | 25,878    |
| 東宝                   | 42.3    | 19.2  | 64,128    |
| 東映                   | 25      | 5     | 5,305     |
| エヌ・ティ・ティ・データ         | 36      | 18.5  | 112,110   |
| ビジネスブレイン太田昭和         | 0.6     | 1.9   | 1,993     |
| D T S                | 10.7    | 7.2   | 23,328    |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 24.6    | 11.1  | 39,127    |
| カブコン                 | 16.2    | 6.4   | 16,902    |
| S C S K              | 13.4    | 7.7   | 37,884    |
| アイネス                 | 14.5    | 13.8  | 15,980    |
| T K C                | 8.9     | 4.7   | 14,875    |
| 富士ソフト                | 9.5     | 4.4   | 14,388    |
| N S D                | 14.7    | 6.5   | 12,746    |
| コナミホールディングス          | 26.4    | 13.4  | 73,298    |
| ソフトバンクグループ           | 329.9   | 133.2 | 1,163,102 |
| <b>卸売業 (4.4%)</b>    |         |       |           |
| 伊藤忠食品                | 3.5     | 0.6   | 2,799     |
| エレマテック               | 6.1     | 2.3   | 4,110     |
| J A L U X            | 4.9     | 1.5   | 3,915     |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|---------------------|---------|-------|---------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                     | 千株      | 千株    | 千円      |
| 双日                  | 397.8   | 179.7 | 48,159  |
| アルフレッサ ホールディングス     | 73.7    | 35.3  | 75,753  |
| 横浜冷凍                | 22.7    | 17.4  | 18,618  |
| あい ホールディングス         | 11.9    | 5.1   | 15,009  |
| マクニカ・富士エレホールディングス   | 22.4    | 14.5  | 23,881  |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 9.8     | 12.5  | 12,087  |
| U K C ホールディングス      | 10.1    | 6.4   | 13,171  |
| O C H I ホールディングス    | —       | 0.8   | 1,063   |
| T O K A I ホールディングス  | 19.5    | 14.7  | 11,804  |
| シッパヘルスケアホールディングス    | 11.8    | 5.9   | 18,260  |
| 明治電機工業              | —       | 0.3   | 378     |
| エコートレーディング          | 17.3    | 14.1  | 9,954   |
| ナガイレーベン             | 10.5    | 6.2   | 15,692  |
| 三菱食品                | 8.5     | 4.5   | 15,030  |
| 松田産業                | 15.1    | 12.2  | 17,982  |
| 第一興商                | 10.6    | 4.6   | 24,472  |
| メディopalホールディングス     | 57.9    | 30.2  | 60,913  |
| アドヴァン               | 22.3    | —     | —       |
| アズワン                | 1.7     | 1.4   | 7,462   |
| 尾家産業                | —       | 0.4   | 476     |
| ドウシシャ               | 11.6    | 6     | 12,414  |
| 黒田電気                | 13.4    | 9.3   | 19,595  |
| 丸文                  | 21.6    | 19    | 14,402  |
| 橋本総業ホールディングス        | —       | 1     | 1,529   |
| I D O M             | 30.2    | 21.6  | 12,636  |
| 進和                  | 7.5     | 6.8   | 13,382  |
| オーハシテクニカ            | 14      | 10.5  | 14,920  |
| 白銅                  | 11.6    | 8.3   | 13,653  |
| 伊藤忠商事               | 457.2   | 216.6 | 341,361 |
| 丸紅                  | 574.1   | 291.1 | 198,355 |
| 長瀬産業                | 38.3    | 18.3  | 28,657  |
| 豊田通商                | 64.8    | 33.2  | 112,880 |
| 兼松                  | 160     | 94    | 19,928  |
| 三井物産                | 527.6   | 266.9 | 399,282 |
| 日本紙パルプ商事            | 66      | 26    | 10,426  |
| 日立ハイテクノロジーズ         | 19.8    | 9.9   | 43,708  |
| 山善                  | 27.9    | 18.8  | 20,247  |
| 住友商事                | 366.7   | 185.7 | 262,486 |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-----------------|---------|-------|---------|
|                 | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                 | 千株      | 千株    | 千円      |
| 内田洋行            | 32      | 1.7   | 4,295   |
| 三菱商事            | 437.4   | 221.2 | 493,054 |
| キャノンマーケティングジャパン | 17.9    | 8     | 18,624  |
| 西華産業            | 60      | 33    | 12,045  |
| 菱洋エレクトロ         | 17.7    | 12.3  | 20,700  |
| 東京産業            | 48      | 38.3  | 17,120  |
| 阪和興業            | 51      | 28    | 21,812  |
| 菱電商事            | 14      | —     | —       |
| 岩谷産業            | 66      | 32    | 23,296  |
| イワキ             | 85      | 53    | 17,013  |
| 三愛石油            | 20.9    | 15.7  | 15,872  |
| 稲畑産業            | 20.1    | 14.1  | 19,204  |
| ワキタ             | 9.7     | 6.5   | 7,936   |
| 東邦ホールディングス      | 18.7    | 9.2   | 20,736  |
| サンゲツ            | 21.1    | 10.7  | 21,014  |
| シナネンホールディングス    | 23      | 1.8   | 3,967   |
| 伊藤忠エネクス         | 27.7    | 16.8  | 15,388  |
| サンリオ            | 19.1    | 8.9   | 18,520  |
| リョーサン           | 9.3     | 4.1   | 16,338  |
| 三信電気            | —       | 1.5   | 2,041   |
| モスフードサービス       | 12.4    | 3.5   | 11,917  |
| 加賀電子            | 13.7    | 8.2   | 16,957  |
| 立花エレテック         | 14.5    | 10.7  | 15,450  |
| フォーバル           | —       | 1.4   | 998     |
| PALTAC          | —       | 4.1   | 15,436  |
| 日鉄住金物産          | 29      | 1.8   | 9,108   |
| トラスコ中山          | 7.9     | 6.2   | 15,326  |
| オートバックスセブン      | 22.9    | 11.1  | 19,558  |
| 加藤産業            | 7.8     | 4.7   | 13,178  |
| イノテック           | 33.4    | 26.8  | 18,143  |
| 杉本商事            | 10.4    | 7.5   | 11,497  |
| 因幡電機産業          | 8.1     | 4     | 16,400  |
| ミスミグループ本社       | 64.6    | 33.8  | 83,114  |
| スズケン            | 26.7    | 13.5  | 48,465  |
| ジェコス            | 10.3    | 7.9   | 9,037   |
| 小売業 (4.8%)      |         |       |         |
| ローソン            | 22.2    | 9.2   | 69,552  |
| サンエー            | —       | 1.5   | 7,545   |

| 銘柄                        | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|---------------------------|---------|-------|---------|
|                           | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                           | 千株      | 千株    | 千円      |
| エービーシー・マート                | 7.6     | 5.6   | 36,064  |
| ハードオフコーポレーション             | 10.8    | 4.2   | 4,620   |
| アスクル                      | 7.2     | 3.4   | 11,475  |
| ゲオホールディングス                | 14.8    | 8.5   | 9,962   |
| アダストリア                    | 11.2    | 3.9   | 11,528  |
| ジーフット                     | —       | 1.4   | 1,089   |
| エディオン                     | 32.4    | 23    | 24,656  |
| ハローズ                      | —       | 0.5   | 1,168   |
| あみやき亭                     | 3.8     | 1.1   | 4,499   |
| ハニーズホールディングス              | 12.4    | 10.5  | 11,476  |
| ジンズ                       | —       | 1.7   | 10,897  |
| ビックカメラ                    | 29.8    | 17.1  | 20,280  |
| DCMホールディングス               | 37.8    | 18.1  | 17,864  |
| Monotaro                  | 21.4    | 10.9  | 40,384  |
| J. フロント リテイリング            | 72.7    | 36.8  | 58,328  |
| ドトール・日レスホールディングス          | 14.1    | 9.3   | 21,966  |
| マツモトキヨシホールディングス           | 12.7    | 5.5   | 35,365  |
| スタートゥデイ                   | 17      | 27.2  | 75,915  |
| ココカラファイン                  | 5.4     | 3.2   | 17,088  |
| 三越伊勢丹ホールディングス             | 115.7   | 58.5  | 66,865  |
| ウエルシアホールディングス             | 4.5     | 6.4   | 25,664  |
| クリエイトSDホールディングス           | 8.4     | 3.7   | 9,649   |
| シュッピン                     | —       | 1.4   | 2,416   |
| ジョイフル本田                   | 9.6     | 5     | 18,475  |
| すかいらーく                    | 21.1    | 12.8  | 22,348  |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 24      | 16.8  | 18,160  |
| ブックオフコーポレーション             | 24.6    | 9.8   | 7,604   |
| ゴルフダイジェスト・オンライン           | 1.9     | 4.9   | 4,385   |
| あさひ                       | 8.9     | 6.9   | 9,404   |
| コスモス薬品                    | 2.4     | 1.4   | 32,634  |
| トーエル                      | —       | 1.8   | 1,618   |
| セブン&アイ・ホールディングス           | 243.9   | 124.1 | 588,109 |
| ツルハホールディングス               | 13.4    | 5.9   | 71,803  |
| サンマルクホールディングス             | 9.1     | 4.1   | 13,878  |
| トリドールホールディングス             | —       | 3.2   | 9,056   |
| クスリのアオキ                   | 5.6     | —     | —       |
| クスリのアオキホールディングス           | —       | 2.5   | 13,425  |
| 総合メディカル                   | —       | 0.3   | 1,416   |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|---------------------|---------|-------|---------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                     | 千株      | 千株    | 千円      |
| カップ・クリエイト           | 3.8     | 6.9   | 8,659   |
| ライトオン               | 13.8    | 10.5  | 10,804  |
| 良品計画                | 6.6     | 3.9   | 111,384 |
| 三城ホールディングス          | 37.6    | 27.7  | 13,019  |
| アドヴァン               | —       | 14.9  | 16,688  |
| G-7ホールディングス         | —       | 0.7   | 1,607   |
| エコス                 | —       | 0.1   | 119     |
| マルシェ                | 0.7     | 2.2   | 1,815   |
| ドンキホーテホールディングス      | 38.3    | 19.4  | 83,420  |
| 西松屋チェーン             | 24      | 7.8   | 9,165   |
| ゼンショーホールディングス       | 34.1    | 15.1  | 30,517  |
| サイゼリヤ               | 12.5    | 4.6   | 14,490  |
| 魚力                  | —       | 0.3   | 375     |
| ユナイテッドアローズ          | 7.8     | 3.7   | 12,561  |
| ハイデイ日高              | 2.9     | 2.6   | 6,390   |
| 京都きもの友禅             | 22      | 12.4  | 11,457  |
| コロワイド               | 22.3    | 9.8   | 18,375  |
| 壱番屋                 | 8.2     | 3.3   | 12,490  |
| スギホールディングス          | 10      | 6.6   | 38,610  |
| スクロール               | 45.6    | 26.5  | 9,778   |
| ユニ・ファミリーマートホールディングス | 18.4    | 13.1  | 85,674  |
| 木曽路                 | 13.5    | 7     | 17,787  |
| 千趣会                 | 25.5    | 23.5  | 19,058  |
| ケーヨー                | 28.5    | 22.6  | 16,701  |
| 上新電機                | 19      | —     | —       |
| 日本瓦斯                | 6.6     | 5.2   | 19,006  |
| ロイヤルホールディングス        | 4.8     | 7     | 16,485  |
| いなげや                | —       | 0.5   | 923     |
| 島忠                  | 15      | 7.9   | 20,532  |
| チヨダ                 | 9.4     | 5.4   | 15,174  |
| ライフコーポレーション         | 6.4     | 2.5   | 7,495   |
| AOKIホールディングス        | 18.5    | 13.2  | 19,140  |
| オークワ                | 9       | —     | —       |
| コメリ                 | 11.5    | 4.6   | 13,096  |
| 青山商事                | 11.2    | 6.2   | 25,172  |
| しまむら                | 6.6     | 3.3   | 46,992  |
| 高島屋                 | 80      | 51    | 53,295  |
| 松屋                  | 26      | 13.4  | 12,984  |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末   |           |
|---------------------|---------|---------|-----------|
|                     | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     |
|                     | 千株      | 千株      | 千円        |
| エイチ・ツー・オー リテイリング    | 31      | 15.8    | 29,577    |
| ニッセンホールディングス        | 78.8    | —       | —         |
| パルコ                 | 12.4    | 11.5    | 14,260    |
| 丸井グループ              | 70.3    | 31.1    | 50,879    |
| アクシアル リテイリング        | —       | 1       | 4,360     |
| イオン                 | 239.9   | 122.1   | 203,540   |
| ユニーグループ・ホールディングス    | 62.9    | —       | —         |
| イズミ                 | 12.4    | 5.8     | 34,626    |
| 平和堂                 | 12.3    | 6.2     | 15,004    |
| フジ                  | 8.8     | 5.6     | 15,820    |
| ヤオコー                | 6       | 3.2     | 14,944    |
| ゼビオホールディングス         | 13.8    | 7.5     | 13,335    |
| ケーズホールディングス         | 25.6    | 13.5    | 31,185    |
| アインホールディングス         | 7.1     | 3.9     | 34,632    |
| ヤマダ電機               | 185.9   | 99.4    | 58,447    |
| ニトリホールディングス         | 25.3    | 12.8    | 204,800   |
| グルメ杵屋               | 11      | —       | —         |
| 吉野家ホールディングス         | 22.9    | 10.7    | 19,441    |
| 王将フードサービス           | 3.9     | 2.6     | 10,647    |
| プレナ                 | 14.3    | 4.7     | 11,134    |
| アークス                | 11.6    | 5.8     | 14,036    |
| パローホールディングス         | 12.6    | 6.9     | 17,677    |
| ファーストリテイリング         | 9.7     | 5       | 186,000   |
| サンドラッグ              | 12.1    | 11.4    | 49,305    |
| ヤマザワ                | 8.1     | 4.9     | 8,849     |
| ベルーナ                | 42.6    | 22.4    | 27,552    |
| <b>銀行業 (7.8%)</b>   |         |         |           |
| めぶきフィナンシャルグループ      | —       | 146.4   | 64,855    |
| 東京ＴＹフィナンシャルグループ     | 7.7     | 4.1     | 12,300    |
| 九州フィナンシャルグループ       | 88.4    | 49.3    | 34,559    |
| ゆうちょ銀行              | 149.2   | 83.7    | 115,589   |
| コンソルディア・フィナンシャルグループ | 407.3   | 194.5   | 103,940   |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | —       | 20.1    | 21,989    |
| 新生銀行                | 504     | 280     | 51,800    |
| あおぞら銀行              | 373     | 184     | 76,176    |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ   | 4,669.1 | 2,240.9 | 1,563,924 |
| りそなホールディングス         | 682.6   | 347.1   | 197,013   |
| 三井住友トラスト・ホールディングス   | 1,216   | 61.6    | 231,123   |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-----------------|---------|-------|---------|
|                 | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                 | 千株      | 千株    | 千円      |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 466     | 236.8 | 956,908 |
| 第四銀行            | 65      | 39    | 18,837  |
| 北越銀行            | 95      | 3     | 8,097   |
| 西日本シティ銀行        | 193     | —     | —       |
| 千葉銀行            | 224     | 115   | 85,905  |
| 常陽銀行            | 218     | —     | —       |
| 群馬銀行            | 128     | 65.8  | 39,348  |
| 武蔵野銀行           | 8.7     | 4.4   | 14,938  |
| 千葉興業銀行          | 31.1    | 24.6  | 14,415  |
| 七十七銀行           | 89      | 43    | 21,457  |
| 青森銀行            | 54      | 14    | 5,404   |
| 秋田銀行            | 54      | 18    | 5,850   |
| 山形銀行            | 40      | 7     | 3,381   |
| 岩手銀行            | 4.3     | 1     | 4,265   |
| 東邦銀行            | 52      | 18    | 7,038   |
| 東北銀行            | 57      | 52    | 7,800   |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 251     | 121   | 62,436  |
| 静岡銀行            | 169     | 79    | 74,813  |
| 十六銀行            | 65      | 37    | 12,099  |
| スルガ銀行           | 54.6    | 30.7  | 75,000  |
| 八十二銀行           | 102.6   | 57.8  | 37,281  |
| 山梨中央銀行          | 42      | 10    | 4,570   |
| 大垣共立銀行          | 76      | 44    | 13,816  |
| 福井銀行            | 82      | 28    | 7,840   |
| 北國銀行            | 61      | 26    | 10,010  |
| 滋賀銀行            | 49      | 26    | 14,222  |
| 南都銀行            | 60      | 2.6   | 8,645   |
| 百五銀行            | 44      | 25    | 11,125  |
| 京都銀行            | 109     | 52    | 49,660  |
| 紀陽銀行            | 24.3    | 11    | 19,932  |
| 三重銀行            | 70      | 4.9   | 11,343  |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 400     | 19.9  | 32,835  |
| 広島銀行            | 171     | 88    | 40,216  |
| 山陰合同銀行          | 35      | 18.4  | 15,511  |
| 中国銀行            | 37.1    | 20.9  | 32,415  |
| 鳥取銀行            | 64      | 5.7   | 9,747   |
| 伊予銀行            | 61      | 35.1  | 28,746  |
| 百十四銀行           | 63      | 29    | 10,382  |

| 銘柄                       | 期首(前期末) | 当 期 末   |         |
|--------------------------|---------|---------|---------|
|                          | 株 数     | 株 数     | 評 価 額   |
|                          | 千株      | 千株      | 千円      |
| 四国銀行                     | 92      | 48      | 14,976  |
| 阿波銀行                     | 37      | 25      | 19,125  |
| 大分銀行                     | 46      | 7       | 2,905   |
| 宮崎銀行                     | 56      | 21      | 7,476   |
| 佐賀銀行                     | 86      | 33      | 9,042   |
| 十八銀行                     | 63      | 33      | 10,065  |
| 沖縄銀行                     | 4.5     | 2.5     | 10,675  |
| 琉球銀行                     | 13      | 5.6     | 8,439   |
| セブン銀行                    | 218.3   | 113.2   | 47,317  |
| みずほフィナンシャルグループ           | 8,261.4 | 4,017.3 | 783,373 |
| 山口フィナンシャルグループ            | 49      | 28      | 35,588  |
| 長野銀行                     | 48      | 3.4     | 6,779   |
| 名古屋銀行                    | 49      | 1.4     | 5,551   |
| 北洋銀行                     | 95      | 48.2    | 18,653  |
| 愛知銀行                     | 2.9     | —       | —       |
| 第三銀行                     | 33      | 2.4     | 4,020   |
| 中京銀行                     | 55      | 4.6     | 10,662  |
| 愛媛銀行                     | 98      | 10.4    | 14,248  |
| トマト銀行                    | 72      | 5.7     | 8,686   |
| 京葉銀行                     | 46      | 22      | 9,988   |
| 関西アーバン銀行                 | 14.9    | 6.6     | 8,619   |
| 栃木銀行                     | 38      | 14      | 7,014   |
| 北日本銀行                    | 2.3     | —       | —       |
| トモニホールディングス              | 62.2    | 26.8    | 14,632  |
| フィデアホールディングス             | 71.9    | 42.3    | 8,163   |
| 池田泉州ホールディングス             | 62.2    | 34.3    | 15,812  |
| <b>証券、商品先物取引業 (1.1%)</b> |         |         |         |
| F P G                    | 17.7    | 10.6    | 10,557  |
| S B I ホールディングス           | 75.4    | 34.4    | 49,398  |
| ジャフコ                     | 9.6     | 4.7     | 19,975  |
| 大和証券グループ本社               | 544     | 268     | 180,873 |
| 野村ホールディングス               | 1,121.9 | 605.2   | 404,878 |
| 岡三証券グループ                 | 40      | 22      | 14,784  |
| 丸三証券                     | 13.8    | 6.5     | 5,726   |
| 東洋証券                     | 20      | 3       | 738     |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス     | 74.4    | 36      | 21,060  |
| 水戸証券                     | 8       | 13.4    | 4,100   |
| いちよし証券                   | 18.4    | 14.1    | 12,281  |

| 銘柄                        | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|---------------------------|---------|-------|---------|
|                           | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                           | 千株      | 千株    | 千円      |
| 松井証券                      | 34.2    | 15.3  | 14,152  |
| だいこう証券ビジネス                | 2       | 4.2   | 2,520   |
| マネックスグループ                 | 83.4    | 64.3  | 17,553  |
| カブドットコム証券                 | 65.9    | 43.7  | 15,906  |
| 極東証券                      | 10      | 6.9   | 11,385  |
| 藍澤証券                      | 6       | 2.2   | 1,469   |
| <b>保険業 (2.5%)</b>         |         |       |         |
| かんぽ生命保険                   | 18.3    | 11.1  | 26,595  |
| SOMPOホールディングス             | 129.5   | 61.6  | 266,235 |
| MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 174.3   | 88.5  | 340,282 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス        | 54.7    | 28.2  | 48,391  |
| 第一生命ホールディングス              | 373.3   | 177.8 | 326,618 |
| 東京海上ホールディングス              | 236.3   | 118.8 | 557,647 |
| T&Dホールディングス               | 211.2   | 108.2 | 168,846 |
| <b>その他金融業 (1.3%)</b>      |         |       |         |
| 全国保証                      | 14.8    | 8.3   | 37,723  |
| クレディセゾン                   | 42.1    | 22.8  | 47,902  |
| 芙蓉総合リース                   | 6.3     | 3.1   | 18,197  |
| 興銀リース                     | 12.6    | 5.9   | 14,272  |
| 東京センチュリー                  | 13.9    | 5.9   | 24,337  |
| 日本証券金融                    | 37.4    | 31.5  | 17,482  |
| アイフル                      | 106.8   | 49.4  | 15,857  |
| リコーリース                    | 6       | 2.5   | 8,725   |
| イオンフィナンシャルサービス            | 37.4    | 19.1  | 44,159  |
| アコム                       | 126     | 60.6  | 28,542  |
| オリエントコーポレーション             | 271.4   | 68.9  | 12,953  |
| 日立キャピタル                   | 13      | 6.6   | 17,404  |
| オリックス                     | 413.1   | 209.2 | 366,936 |
| 三菱UFJリース                  | 155.1   | 76.1  | 43,072  |
| 日本取引所グループ                 | 170.1   | 92.7  | 165,933 |
| アサックス                     | —       | 0.3   | 504     |
| NECキャピタルソリューション           | 7.1     | 6.7   | 11,369  |
| <b>不動産業 (2.5%)</b>        |         |       |         |
| いちご                       | 49.1    | 34.2  | 11,115  |
| ヒューリック                    | 122.8   | 61.8  | 64,395  |
| 野村不動産ホールディングス             | 40      | 19.5  | 47,209  |
| オープンハウス                   | —       | 3.9   | 13,708  |
| 東急不動産ホールディングス             | 145.2   | 71.2  | 47,632  |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|---------------------|---------|-------|---------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                     | 千株      | 千株    | 千円      |
| 飯田グループホールディングス      | 52.8    | 24.6  | 45,018  |
| パーク24               | 30.3    | 14.9  | 45,966  |
| 三井不動産               | 309     | 157   | 405,531 |
| 三菱地所                | 434     | 219.9 | 453,873 |
| 平和不動産               | 14.2    | 9.2   | 16,955  |
| 東京建物                | 62.3    | 34.5  | 53,199  |
| ダイビル                | 18.7    | 9.8   | 10,946  |
| 京阪神ビルディング           | 32.1    | 25.2  | 16,682  |
| 住友不動産               | 140     | 71    | 234,442 |
| 大京                  | 132     | 56    | 12,488  |
| テーオーシー              | 26.7    | 15.8  | 16,021  |
| 東京楽天地               | 18      | —     | —       |
| レオパレス21             | 68.8    | 35.2  | 23,302  |
| スターツコーポレーション        | 7.7     | 5.6   | 15,024  |
| 空港施設                | 25      | 21.7  | 12,824  |
| 住友不動産販売             | 7.8     | —     | —       |
| ゴールドクレスト            | 12      | 3.9   | 9,016   |
| 日本エスリード             | 16.2    | 10.1  | 17,927  |
| サンヨーハウジング名古屋        | 13.5    | 12.5  | 12,575  |
| イオンモール              | 39      | 18.3  | 37,643  |
| エヌ・ティ・ティ都市開発        | 35.6    | 17.7  | 18,797  |
| 日本空港ビルデング           | 19.9    | 9.3   | 40,873  |
| <b>サービス業 (3.9%)</b> |         |       |         |
| 日本M&Aセンター           | 9.1     | 9.1   | 39,767  |
| アコーディア・ゴルフ          | 32.8    | —     | —       |
| パソナグループ             | 28.2    | 15.8  | 15,215  |
| GCA                 | 10      | 12.2  | 11,028  |
| エス・エム・エス            | 7.9     | 3.5   | 10,657  |
| テンブホールディングス         | 45.7    | 24.2  | 52,078  |
| クックパッド              | 15.2    | 7.6   | 6,885   |
| 学情                  | 2       | 5.6   | 7,677   |
| スタジオアリス             | 7.7     | 4     | 9,548   |
| シミックホールディングス        | 10.7    | 8.2   | 11,635  |
| NJS                 | 1.9     | 5.4   | 7,560   |
| 総合警備保障              | 20.8    | 11.6  | 59,972  |
| カカコム                | 42.2    | 22    | 34,584  |
| アイロムグループ            | 3       | 4.2   | 6,510   |
| ディップ                | 6.8     | 2.7   | 6,579   |

| 銘柄             | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|----------------|---------|-------|---------|
|                | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                | 千株      | 千株    | 千円      |
| キャリアデザインセンター   | 1.9     | 6.1   | 7,625   |
| エムスリー          | 53.4    | 27.4  | 87,406  |
| ディー・エヌ・エー      | 29.2    | 13.5  | 33,439  |
| 博報堂DYホールディングス  | 86.1    | 43.3  | 64,257  |
| ぐるなび           | 6.9     | 3.9   | 7,784   |
| ファンコミュニケーションズ  | 26.8    | 21.2  | 20,712  |
| WDBホールディングス    | 2       | 6.5   | 12,122  |
| EPSホールディングス    | 19.8    | 11.8  | 19,281  |
| ドリームインキュベータ    | 8.6     | 4.7   | 9,479   |
| クイック           | 2       | 6.4   | 8,531   |
| ケネディクス         | 85.1    | 43    | 24,639  |
| 電通             | 68.6    | 35    | 200,200 |
| みらかホールディングス    | 15.8    | 8.3   | 37,806  |
| ダイオーズ          | 0.7     | 2.6   | 3,013   |
| 日本空調サービス       | 37.8    | 24.6  | 16,113  |
| オリエンタルランド      | 66.4    | 33.7  | 241,022 |
| ダスキン           | 19.2    | 7.6   | 20,831  |
| リゾートトラスト       | 26.2    | 12.6  | 26,056  |
| ビー・エム・エル       | 5.1     | 5.1   | 11,459  |
| りらいあコミュニケーションズ | 23.9    | 17    | 20,621  |
| 早稲田アカデミー       | 0.7     | 2.2   | 2,893   |
| ユー・エス・エス       | 76.2    | 37.9  | 84,100  |
| サイバーエージェント     | 15      | 18.2  | 71,071  |
| 楽天             | 289.2   | 160   | 220,080 |
| テー・オー・ダブリュー    | 1.9     | 11.1  | 9,046   |
| テクノプロ・ホールディングス | 10.4    | 5     | 22,375  |
| ファーストロジック      | 2       | 1.3   | 3,770   |
| キャリアリンク        | 4       | 5.2   | 3,052   |
| ライドオン・エクスプレス   | 2       | 6.1   | 5,575   |
| リクルートホールディングス  | 124.1   | 68.3  | 392,725 |
| エラン            | —       | 0.7   | 1,752   |

| 銘柄           | 期首(前期末)   | 当 期 末  |         |
|--------------|-----------|--------|---------|
|              | 株 数       | 株 数    | 評 価 額   |
|              | 千株        | 千株     | 千円      |
| 日本郵政         | 182.6     | 82.3   | 111,269 |
| リログループ       | 2         | 12.8   | 28,249  |
| エイチ・アイ・エス    | 10.6      | 4.8    | 15,360  |
| 共立メンテナンス     | 4.6       | 4.8    | 15,600  |
| 建設技術研究所      | 13.9      | 10.1   | 11,402  |
| 燦ホールディングス    | 1         | 2.2    | 4,037   |
| ナガワ          | 1.5       | —      | —       |
| よみうりランド      | 32        | 7      | 3,136   |
| 東京都競馬        | 103       | 64     | 15,680  |
| カナモト         | 9.3       | 3.9    | 11,700  |
| 東京ドーム        | 49        | 13.5   | 13,473  |
| トランス・コスモス    | 7.5       | 2      | 4,846   |
| 乃村工藝社        | 18.1      | 7      | 16,373  |
| 日本管財         | 16.2      | 8.5    | 15,963  |
| 白洋舎          | 80        | 3.4    | 10,251  |
| セコム          | 64.2      | 32.5   | 264,712 |
| セントラル警備保障    | 8.2       | 5.2    | 9,672   |
| メイテック        | 8.1       | 3.5    | 16,415  |
| アサツー ディ・ケイ   | 11.6      | 4.7    | 12,774  |
| 応用地質         | 14.5      | 12.8   | 18,995  |
| 船井総研ホールディングス | 7.8       | 4.1    | 10,475  |
| ベネッセホールディングス | 21.7      | 10.5   | 42,997  |
| イオンディライト     | 9.2       | 2.3    | 8,176   |
| ニチイ学館        | 18.7      | 19.5   | 20,670  |
| ダイセキ         | 16.5      | 5.5    | 13,024  |
| ステップ         | 1         | 4.3    | 6,217   |
| 合 計          | 株 数 ・ 金 額 | 97,261 | 44,799  |
|              | 銘柄数＜比率＞   | 1,100  | 1,094   |

(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     |
|      |        |       | 1,413 —     |

## ＜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(29,681,018千口)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<br>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                | 26,575,000   | 29,862,747   | 79.3    | —                   | 51.6      | 22.6   | 5.1   |
| 地方債証券               | 2,212,000    | 2,450,804    | 6.5     | —                   | 4.3       | 1.1    | 1.1   |
|                     | ( 2,212,000) | ( 2,450,804) | ( 6.5)  | (—)                 | ( 4.3)    | ( 1.1) | (1.1) |
| 特殊債券<br>(除く金融債)     | 1,124,000    | 1,207,849    | 3.2     | —                   | 1.2       | 1.1    | 0.9   |
|                     | ( 1,124,000) | ( 1,207,849) | ( 3.2)  | (—)                 | ( 1.2)    | ( 1.1) | (0.9) |
| 普通社債券<br>(含む投資法人債券) | 3,839,059    | 4,173,102    | 11.1    | —                   | 8.0       | 2.2    | 0.8   |
|                     | ( 3,839,059) | ( 4,173,102) | ( 11.1) | (—)                 | ( 8.0)    | ( 2.2) | (0.8) |
| 合 計                 | 33,750,059   | 37,694,504   | 100.1   | —                   | 65.1      | 27.1   | 7.9   |
|                     | ( 7,175,059) | ( 7,831,756) | ( 20.8) | (—)                 | (13.5)    | ( 4.5) | (2.8) |

(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366回利付国債 (2年)  | 0.1   | 100,000   | 100,298   | 2018/7/15  | 第311回利付国債 (10年) | 0.8   | 400,000 | 412,488 | 2020/9/20  |
| 第126回利付国債 (5年)  | 0.1   | 50,000    | 50,437    | 2020/12/20 | 第312回利付国債 (10年) | 1.2   | 580,000 | 607,666 | 2020/12/20 |
| 第128回利付国債 (5年)  | 0.1   | 200,000   | 201,916   | 2021/6/20  | 第313回利付国債 (10年) | 1.3   | 150,000 | 158,196 | 2021/3/20  |
| 第129回利付国債 (5年)  | 0.1   | 300,000   | 302,988   | 2021/9/20  | 第316回利付国債 (10年) | 1.1   | 100,000 | 104,992 | 2021/6/20  |
| 第4回利付国債 (40年)   | 2.2   | 135,000   | 187,786   | 2051/3/20  | 第317回利付国債 (10年) | 1.1   | 400,000 | 421,216 | 2021/9/20  |
| 第5回利付国債 (40年)   | 2.0   | 150,000   | 200,364   | 2052/3/20  | 第319回利付国債 (10年) | 1.1   | 450,000 | 475,038 | 2021/12/20 |
| 第6回利付国債 (40年)   | 1.9   | 65,000    | 85,017    | 2053/3/20  | 第320回利付国債 (10年) | 1.0   | 50,000  | 52,553  | 2021/12/20 |
| 第7回利付国債 (40年)   | 1.7   | 215,000   | 268,109   | 2054/3/20  | 第322回利付国債 (10年) | 0.9   | 150,000 | 157,314 | 2022/3/20  |
| 第8回利付国債 (40年)   | 1.4   | 80,000    | 92,192    | 2055/3/20  | 第324回利付国債 (10年) | 0.8   | 50,000  | 52,312  | 2022/6/20  |
| 第9回利付国債 (40年)   | 0.4   | 10,000    | 8,264     | 2056/3/20  | 第331回利付国債 (10年) | 0.6   | 50,000  | 52,188  | 2023/9/20  |
| 第300回利付国債 (10年) | 1.5   | 600,000   | 618,114   | 2019/3/20  | 第334回利付国債 (10年) | 0.6   | 80,000  | 83,800  | 2024/6/20  |
| 第301回利付国債 (10年) | 1.5   | 250,000   | 258,527   | 2019/6/20  | 第335回利付国債 (10年) | 0.5   | 50,000  | 52,035  | 2024/9/20  |
| 第303回利付国債 (10年) | 1.4   | 100,000   | 103,600   | 2019/9/20  | 第336回利付国債 (10年) | 0.5   | 90,000  | 93,718  | 2024/12/20 |
| 第304回利付国債 (10年) | 1.3   | 500,000   | 516,840   | 2019/9/20  | 第337回利付国債 (10年) | 0.3   | 250,000 | 256,537 | 2024/12/20 |
| 第305回利付国債 (10年) | 1.3   | 1,000,000 | 1,037,200 | 2019/12/20 | 第338回利付国債 (10年) | 0.4   | 360,000 | 372,250 | 2025/3/20  |
| 第307回利付国債 (10年) | 1.3   | 300,000   | 312,198   | 2020/3/20  | 第340回利付国債 (10年) | 0.4   | 200,000 | 206,902 | 2025/9/20  |
| 第308回利付国債 (10年) | 1.3   | 70,000    | 73,080    | 2020/6/20  | 第343回利付国債 (10年) | 0.1   | 250,000 | 252,035 | 2026/6/20  |
| 第309回利付国債 (10年) | 1.1   | 700,000   | 726,516   | 2020/6/20  | 第344回利付国債 (10年) | 0.1   | 180,000 | 181,337 | 2026/9/20  |
| 第310回利付国債 (10年) | 1.0   | 160,000   | 166,059   | 2020/9/20  | 第345回利付国債 (10年) | 0.1   | 500,000 | 503,335 | 2026/12/20 |

| 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      |            | 国債証券            | %     | 千円      | 千円      |            |
| 第346回利付国債 (10年) | 0.1   | 300,000 | 301,902 | 2027/3/20  | 第62回利付国債 (20年)  | 0.8   | 280,000 | 295,260 | 2023/6/20  |
| 第2回利付国債 (30年)   | 2.4   | 90,000  | 115,287 | 2030/2/20  | 第64回利付国債 (20年)  | 1.9   | 370,000 | 416,701 | 2023/9/20  |
| 第3回利付国債 (30年)   | 2.3   | 120,000 | 152,532 | 2030/5/20  | 第65回利付国債 (20年)  | 1.9   | 300,000 | 339,258 | 2023/12/20 |
| 第5回利付国債 (30年)   | 2.2   | 10,000  | 12,692  | 2031/5/20  | 第66回利付国債 (20年)  | 1.8   | 160,000 | 179,883 | 2023/12/20 |
| 第8回利付国債 (30年)   | 1.8   | 60,000  | 73,312  | 2032/11/22 | 第67回利付国債 (20年)  | 1.9   | 150,000 | 170,256 | 2024/3/20  |
| 第9回利付国債 (30年)   | 1.4   | 140,000 | 162,766 | 2032/12/20 | 第69回利付国債 (20年)  | 2.1   | 410,000 | 470,971 | 2024/3/20  |
| 第14回利付国債 (30年)  | 2.4   | 200,000 | 264,854 | 2034/3/20  | 第70回利付国債 (20年)  | 2.4   | 290,000 | 340,781 | 2024/6/20  |
| 第15回利付国債 (30年)  | 2.5   | 110,000 | 147,587 | 2034/6/20  | 第71回利付国債 (20年)  | 2.2   | 160,000 | 185,748 | 2024/6/20  |
| 第18回利付国債 (30年)  | 2.3   | 200,000 | 262,716 | 2035/3/20  | 第72回利付国債 (20年)  | 2.1   | 330,000 | 382,169 | 2024/9/20  |
| 第19回利付国債 (30年)  | 2.3   | 60,000  | 78,930  | 2035/6/20  | 第74回利付国債 (20年)  | 2.1   | 120,000 | 139,462 | 2024/12/20 |
| 第21回利付国債 (30年)  | 2.3   | 110,000 | 144,975 | 2035/12/20 | 第75回利付国債 (20年)  | 2.1   | 230,000 | 268,313 | 2025/3/20  |
| 第22回利付国債 (30年)  | 2.5   | 90,000  | 121,984 | 2036/3/20  | 第76回利付国債 (20年)  | 1.9   | 10,000  | 11,509  | 2025/3/20  |
| 第23回利付国債 (30年)  | 2.5   | 160,000 | 217,182 | 2036/6/20  | 第80回利付国債 (20年)  | 2.1   | 290,000 | 339,598 | 2025/6/20  |
| 第25回利付国債 (30年)  | 2.3   | 200,000 | 264,602 | 2036/12/20 | 第82回利付国債 (20年)  | 2.1   | 300,000 | 352,626 | 2025/9/20  |
| 第26回利付国債 (30年)  | 2.4   | 80,000  | 107,484 | 2037/3/20  | 第83回利付国債 (20年)  | 2.1   | 200,000 | 235,934 | 2025/12/20 |
| 第27回利付国債 (30年)  | 2.5   | 140,000 | 191,265 | 2037/9/20  | 第84回利付国債 (20年)  | 2.0   | 300,000 | 351,336 | 2025/12/20 |
| 第28回利付国債 (30年)  | 2.5   | 70,000  | 95,928  | 2038/3/20  | 第85回利付国債 (20年)  | 2.1   | 100,000 | 118,433 | 2026/3/20  |
| 第29回利付国債 (30年)  | 2.4   | 130,000 | 176,203 | 2038/9/20  | 第87回利付国債 (20年)  | 2.2   | 300,000 | 357,939 | 2026/3/20  |
| 第30回利付国債 (30年)  | 2.3   | 110,000 | 147,331 | 2039/3/20  | 第90回利付国債 (20年)  | 2.2   | 250,000 | 300,487 | 2026/9/20  |
| 第33回利付国債 (30年)  | 2.0   | 250,000 | 321,565 | 2040/9/20  | 第98回利付国債 (20年)  | 2.1   | 150,000 | 181,344 | 2027/9/20  |
| 第35回利付国債 (30年)  | 2.0   | 250,000 | 322,875 | 2041/9/20  | 第99回利付国債 (20年)  | 2.1   | 50,000  | 60,635  | 2027/12/20 |
| 第36回利付国債 (30年)  | 2.0   | 140,000 | 181,141 | 2042/3/20  | 第100回利付国債 (20年) | 2.2   | 110,000 | 134,975 | 2028/3/20  |
| 第37回利付国債 (30年)  | 1.9   | 150,000 | 190,954 | 2042/9/20  | 第104回利付国債 (20年) | 2.1   | 150,000 | 183,001 | 2028/6/20  |
| 第38回利付国債 (30年)  | 1.8   | 150,000 | 187,701 | 2043/3/20  | 第105回利付国債 (20年) | 2.1   | 160,000 | 195,776 | 2028/9/20  |
| 第39回利付国債 (30年)  | 1.9   | 20,000  | 25,513  | 2043/6/20  | 第107回利付国債 (20年) | 2.1   | 150,000 | 184,062 | 2028/12/20 |
| 第42回利付国債 (30年)  | 1.7   | 120,000 | 147,580 | 2044/3/20  | 第110回利付国債 (20年) | 2.1   | 100,000 | 123,114 | 2029/3/20  |
| 第43回利付国債 (30年)  | 1.7   | 50,000  | 61,513  | 2044/6/20  | 第112回利付国債 (20年) | 2.1   | 200,000 | 246,908 | 2029/6/20  |
| 第44回利付国債 (30年)  | 1.7   | 60,000  | 73,839  | 2044/9/20  | 第113回利付国債 (20年) | 2.1   | 20,000  | 24,742  | 2029/9/20  |
| 第47回利付国債 (30年)  | 1.6   | 100,000 | 120,821 | 2045/6/20  | 第115回利付国債 (20年) | 2.2   | 60,000  | 75,112  | 2029/12/20 |
| 第48回利付国債 (30年)  | 1.4   | 480,000 | 556,094 | 2045/9/20  | 第116回利付国債 (20年) | 2.2   | 50,000  | 62,757  | 2030/3/20  |
| 第49回利付国債 (30年)  | 1.4   | 140,000 | 162,164 | 2045/12/20 | 第118回利付国債 (20年) | 2.0   | 50,000  | 61,607  | 2030/6/20  |
| 第50回利付国債 (30年)  | 0.8   | 20,000  | 20,070  | 2046/3/20  | 第120回利付国債 (20年) | 1.6   | 50,000  | 59,018  | 2030/6/20  |
| 第51回利付国債 (30年)  | 0.3   | 270,000 | 235,672 | 2046/6/20  | 第121回利付国債 (20年) | 1.9   | 10,000  | 12,219  | 2030/9/20  |
| 第40回利付国債 (20年)  | 2.3   | 210,000 | 216,764 | 2018/9/20  | 第122回利付国債 (20年) | 1.8   | 100,000 | 120,895 | 2030/9/20  |
| 第41回利付国債 (20年)  | 1.5   | 190,000 | 195,719 | 2019/3/20  | 第123回利付国債 (20年) | 2.1   | 140,000 | 175,106 | 2030/12/20 |
| 第42回利付国債 (20年)  | 2.6   | 760,000 | 797,992 | 2019/3/20  | 第124回利付国債 (20年) | 2.0   | 80,000  | 99,004  | 2030/12/20 |
| 第43回利付国債 (20年)  | 2.9   | 450,000 | 481,770 | 2019/9/20  | 第125回利付国債 (20年) | 2.2   | 160,000 | 202,708 | 2031/3/20  |
| 第44回利付国債 (20年)  | 2.5   | 350,000 | 375,998 | 2020/3/20  | 第127回利付国債 (20年) | 1.9   | 70,000  | 85,868  | 2031/3/20  |
| 第45回利付国債 (20年)  | 2.4   | 80,000  | 85,717  | 2020/3/20  | 第128回利付国債 (20年) | 1.9   | 90,000  | 110,538 | 2031/6/20  |
| 第47回利付国債 (20年)  | 2.2   | 310,000 | 334,062 | 2020/9/21  | 第130回利付国債 (20年) | 1.8   | 100,000 | 121,661 | 2031/9/20  |
| 第49回利付国債 (20年)  | 2.1   | 330,000 | 358,231 | 2021/3/22  | 第131回利付国債 (20年) | 1.7   | 100,000 | 120,277 | 2031/9/20  |
| 第50回利付国債 (20年)  | 1.9   | 80,000  | 86,231  | 2021/3/22  | 第133回利付国債 (20年) | 1.8   | 50,000  | 60,884  | 2031/12/20 |
| 第51回利付国債 (20年)  | 2.0   | 230,000 | 249,881 | 2021/6/21  | 第135回利付国債 (20年) | 1.7   | 190,000 | 228,836 | 2032/3/20  |
| 第52回利付国債 (20年)  | 2.1   | 140,000 | 153,430 | 2021/9/21  | 第136回利付国債 (20年) | 1.6   | 30,000  | 35,704  | 2032/3/20  |
| 第53回利付国債 (20年)  | 2.1   | 230,000 | 253,333 | 2021/12/20 | 第140回利付国債 (20年) | 1.7   | 80,000  | 96,532  | 2032/9/20  |
| 第60回利付国債 (20年)  | 1.4   | 330,000 | 357,756 | 2022/12/20 | 第141回利付国債 (20年) | 1.7   | 100,000 | 120,807 | 2032/12/20 |

| 銘 柄                        | 当 期 末 |            |            |            |
|----------------------------|-------|------------|------------|------------|
|                            | 利率    | 額面金額       | 評 価 額      | 償還年月日      |
| <b>国債証券</b>                | %     | 千円         | 千円         |            |
| 第143回利付国債 (20年)            | 1.6   | 200,000    | 238,686    | 2033/3/20  |
| 第145回利付国債 (20年)            | 1.7   | 50,000     | 60,490     | 2033/6/20  |
| 第146回利付国債 (20年)            | 1.7   | 180,000    | 217,821    | 2033/9/20  |
| 第148回利付国債 (20年)            | 1.5   | 170,000    | 200,229    | 2034/3/20  |
| 第149回利付国債 (20年)            | 1.5   | 140,000    | 164,981    | 2034/6/20  |
| 第150回利付国債 (20年)            | 1.4   | 70,000     | 81,264     | 2034/9/20  |
| 第151回利付国債 (20年)            | 1.2   | 180,000    | 202,789    | 2034/12/20 |
| 第152回利付国債 (20年)            | 1.2   | 90,000     | 101,376    | 2035/3/20  |
| 第153回利付国債 (20年)            | 1.3   | 90,000     | 102,859    | 2035/6/20  |
| 第154回利付国債 (20年)            | 1.2   | 50,000     | 56,247     | 2035/9/20  |
| 第156回利付国債 (20年)            | 0.4   | 310,000    | 303,626    | 2036/3/20  |
| 第157回利付国債 (20年)            | 0.2   | 150,000    | 141,066    | 2036/6/20  |
| 第159回利付国債 (20年)            | 0.6   | 150,000    | 151,189    | 2036/12/20 |
| 小 計                        |       | 26,575,000 | 29,862,747 |            |
| <b>地方債証券</b>               |       |            |            |            |
| 第2回東京都公募公債 (20年)           | 1.97  | 100,000    | 112,187    | 2023/9/20  |
| 第10回東京都公募公債 (20年)          | 2.33  | 100,000    | 120,068    | 2026/9/18  |
| 第11回東京都公募公債 (20年)          | 2.22  | 100,000    | 119,540    | 2027/3/19  |
| 平成20年度第5回静岡県公募公債           | 1.59  | 200,000    | 204,494    | 2018/10/30 |
| 平成24年度第12回愛知県公募公債 (30年)    | 2.12  | 100,000    | 127,364    | 2042/9/19  |
| 平成25年度第4回愛知県公募公債 (10年)     | 0.856 | 100,000    | 104,886    | 2023/5/30  |
| 平成21年度第1回千葉県公募公債           | 1.53  | 112,000    | 115,245    | 2019/4/25  |
| 第13回千葉県公募公債 (20年)          | 1.701 | 100,000    | 117,743    | 2032/10/15 |
| 第5回群馬県公募公債 (10年)           | 1.71  | 100,000    | 102,524    | 2018/11/22 |
| 第3回群馬県公募公債 (20年)           | 1.687 | 100,000    | 117,460    | 2032/6/25  |
| 第75回共同発行市場公募地方債            | 1.64  | 100,000    | 103,381    | 2019/6/25  |
| 平成24年度第6回大阪市公募公債           | 0.797 | 100,000    | 104,133    | 2022/11/18 |
| 第9回名古屋市政公募公債 (30年)         | 2.095 | 100,000    | 126,706    | 2042/9/19  |
| 平成22年度第4回神戸市公募公債 (20年)     | 1.895 | 100,000    | 119,464    | 2030/9/13  |
| 平成22年度第3回横浜市公募公債           | 1.168 | 100,000    | 103,828    | 2020/9/18  |
| 平成24年度第1回札幌市公募公債           | 1.79  | 100,000    | 118,961    | 2032/4/23  |
| 第1回川崎市15年公募公債              | 1.78  | 100,000    | 104,093    | 2019/9/20  |
| 第2回川崎市15年公募公債              | 1.63  | 100,000    | 104,967    | 2020/6/22  |
| 第45回地方公共団体金融機構債券           | 0.791 | 200,000    | 208,426    | 2023/2/28  |
| 第10回公営企業債券 (20年)           | 2.21  | 100,000    | 115,334    | 2024/9/24  |
| 小 計                        |       | 2,212,000  | 2,450,804  |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>         |       |            |            |            |
| 第344回政府保証道路債債券             | 1.6   | 100,000    | 105,088    | 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    | 107,221    | 2021/2/26  |
| 第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 1.9   | 100,000    | 107,369    | 2021/3/26  |
| 第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 1.6   | 224,000    | 229,465    | 2018/11/28 |
| 第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 2.3   | 200,000    | 243,242    | 2027/10/29 |
| 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    | 102,737    | 2019/4/30  |
| 第87回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.5   | 100,000    | 103,440    | 2019/8/30  |
| 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    | 104,484    | 2022/9/30  |

| 銘 柄                        | 当 期 末 |           |           |            |
|----------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
|                            | 利率    | 額面金額      | 評 価 額     | 償還年月日      |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>         | %     | 千円        | 千円        |            |
| 第45回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.815 | 100,000   | 104,803   | 2023/2/17  |
| 小 計                        |       | 1,124,000 | 1,207,849 |            |
| <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>     |       |           |           |            |
| 第322回中国電力株式会社社債            | 2.95  | 100,000   | 129,708   | 2029/11/22 |
| 第21回道路債債券                  | 2.75  | 100,000   | 133,657   | 2033/6/20  |
| 第33回道路債債券                  | 2.91  | 100,000   | 137,443   | 2034/6/20  |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券      | 2.08  | 38,784    | 41,256    | 2037/11/10 |
| 第41回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.51  | 53,197    | 56,070    | 2045/10/10 |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.89  | 46,467    | 49,736    | 2046/5/10  |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.76  | 45,666    | 48,596    | 2046/6/10  |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.67  | 45,836    | 48,597    | 2046/7/10  |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.64  | 50,078    | 53,120    | 2046/8/10  |
| 第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.51  | 52,750    | 55,697    | 2046/9/10  |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.48  | 54,520    | 57,519    | 2046/10/10 |
| 第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.47  | 57,640    | 60,830    | 2046/11/10 |
| 第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.41  | 61,535    | 64,811    | 2046/12/10 |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.42  | 59,490    | 62,667    | 2047/1/10  |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.44  | 59,372    | 62,589    | 2047/2/10  |
| 第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.4   | 62,017    | 65,294    | 2047/3/10  |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.44  | 60,874    | 64,195    | 2047/4/10  |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.34  | 62,987    | 66,106    | 2047/5/10  |
| 第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.26  | 61,292    | 64,149    | 2047/6/10  |
| 第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.21  | 64,029    | 66,857    | 2047/7/10  |
| 第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.11  | 64,424    | 66,925    | 2047/8/10  |
| 第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.09  | 68,359    | 70,966    | 2047/12/10 |
| 第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.28  | 69,930    | 73,369    | 2048/2/10  |
| 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.25  | 62,661    | 65,661    | 2048/3/10  |
| 第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.07  | 61,668    | 64,039    | 2048/4/10  |
| 第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.08  | 64,421    | 66,936    | 2048/5/10  |
| 第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.3   | 69,270    | 72,892    | 2048/6/10  |
| 第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券        | 2.25  | 35,724    | 37,962    | 2037/5/10  |
| 第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券          | 1.82  | 11,786    | 11,990    | 2036/12/10 |
| 第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券         | 1.69  | 48,384    | 50,159    | 2039/2/10  |
| 第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券         | 1.79  | 58,914    | 61,559    | 2040/3/10  |
| 第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券         | 1.81  | 18,832    | 19,613    | 2040/4/10  |
| 第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券         | 1.88  | 145,936   | 153,240   | 2040/12/10 |
| 第52回貸付債権担保住宅金融公庫債券         | 2.18  | 22,216    | 23,746    | 2042/3/10  |
| 第3回ヒューリック株式会社無担保社債         | 0.8   | 100,000   | 101,673   | 2020/4/24  |
| 第22回株式会社豊田自動織機無担保社債        | 0.821 | 100,000   | 103,564   | 2022/9/20  |
| 第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債    | 0.87  | 100,000   | 100,813   | 2018/8/3   |
| 第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   | 101,096   | 2018/8/8   |
| 第36回住友商事株式会社無担保社債          | 2.21  | 200,000   | 209,034   | 2019/7/25  |
| 第127回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債    | 1.275 | 100,000   | 105,000   | 2021/7/14  |
| 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   | 104,921   | 2019/12/20 |
| 第6回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)  | 2.78  | 200,000   | 238,962   | 2026/4/27  |
| 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   | 106,309   | 2022/3/22  |

| 銘 柄                      | 当 期 末 |         |         |            |
|--------------------------|-------|---------|---------|------------|
|                          | 利率    | 額面金額    | 評 価 額   | 償還年月日      |
| 普通社債券(含む投資法人債券)          | %     | 千円      | 千円      |            |
| 第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 | 121,286 | 2026/11/6  |
| 第44回三井不動産株式会社無担保社債       | 1.173 | 100,000 | 104,163 | 2021/9/6   |
| 第6回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債     | 2.39  | 100,000 | 110,831 | 2022/2/15  |
| 第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債    | 2.166 | 100,000 | 121,180 | 2029/1/29  |
| 第253回四国電力株式会社社債          | 1.0   | 100,000 | 104,827 | 2023/6/23  |
| 第3回電源開発株式会社無担保社債         | 2.01  | 100,000 | 111,423 | 2023/12/20 |

| 銘 柄                   | 当 期 末 |            |            |           |
|-----------------------|-------|------------|------------|-----------|
|                       | 利率    | 額面金額       | 評 価 額      | 償還年月日     |
| 普通社債券(含む投資法人債券)       | %     | 千円         | 千円         |           |
| 第2回ノルデア・バンク円貨社債(2012) | 1.2   | 100,000    | 100,051    | 2017/6/15 |
| 小 計                   |       | 3,839,059  | 4,173,102  |           |
| 合 計                   |       | 33,750,059 | 37,694,504 |           |

(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(21,776,861千口)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 | 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                    |         | 107   | 39  | 297   | 33,089    | 保険                     |
| AGCO CORP                    |         | 39    | 13  | 84    | 9,428     | 資本財                    |
| AES CORPORATION              |         | 287   | —   | —     | —         | 公益事業                   |
| AT&T INC                     |         | 1,706 | 699 | 2,664 | 296,717   | 電気通信サービス               |
| ABBOTT LABORATORIES          |         | 409   | 197 | 881   | 98,201    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ABBVIE INC                   |         | 464   | 184 | 1,222 | 136,062   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      |         | 174   | 77  | 452   | 50,366    | ソフトウェア・サービス            |
| ACUITY BRANDS INC            |         | 16    | 8   | 141   | 15,805    | 資本財                    |
| ADOBE SYSTEMS INC            |         | 151   | 61  | 867   | 96,541    | ソフトウェア・サービス            |
| ADVANCE AUTO PARTS           |         | 24    | 11  | 154   | 17,222    | 小売                     |
| AETNA INC                    |         | 104   | 43  | 634   | 70,698    | ヘルスケア機器・サービス           |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    |         | 22    | 10  | 161   | 17,960    | 各種金融                   |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     |         | 119   | 46  | 275   | 30,684    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC |         | 55    | 22  | 321   | 35,811    | 素材                     |
| AKAMAI TECHNOLOGIES          |         | 67    | 31  | 147   | 16,372    | ソフトウェア・サービス            |
| ALCOA INC                    |         | 470   | —   | —     | —         | 素材                     |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  |         | 68    | 29  | 290   | 32,340    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALLEGHANY CORP               |         | 6     | 2   | 157   | 17,558    | 保険                     |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   |         | 22    | 7   | 190   | 21,248    | ソフトウェア・サービス            |
| ALLSTATE CORP                |         | 108   | 48  | 417   | 46,488    | 保険                     |
| ALPHABET INC-CL C            |         | 88    | 36  | 3,535 | 393,606   | ソフトウェア・サービス            |
| ALPHABET INC-CL A            |         | 80    | 34  | 3,446 | 383,749   | ソフトウェア・サービス            |
| ALTRIA GROUP INC             |         | 551   | 215 | 1,606 | 178,910   | 食品・飲料・タバコ              |
| AMAZON.COM INC               |         | 113   | 46  | 4,672 | 520,202   | 小売                     |
| AMEREN CORPORATION           |         | 78    | 37  | 208   | 23,268    | 公益事業                   |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      |         | 144   | 55  | 396   | 44,100    | 公益事業                   |
| AMERICAN EXPRESS COMPANY     |         | 235   | 95  | 740   | 82,440    | 各種金融                   |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP |         | 342   | 122 | 776   | 86,485    | 保険                     |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       |         | 58    | 24  | 226   | 25,218    | ヘルスケア機器・サービス           |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     |         | 56    | 23  | 282   | 31,482    | 各種金融                   |
| AMGEN INC                    |         | 210   | 85  | 1,321 | 147,096   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMPHENOL CORP-CL A           |         | 105   | 42  | 319   | 35,561    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ANADARKO PETROLEUM CORP      |         | 160   | 69  | 362   | 40,368    | エネルギー                  |
| ANALOG DEVICES               |         | 85    | 46  | 382   | 42,596    | 半導体・半導体製造装置            |
| ANSYS INC                    |         | 37    | 13  | 163   | 18,224    | ソフトウェア・サービス            |
| ANTHEM INC                   |         | 77    | 33  | 610   | 67,940    | ヘルスケア機器・サービス           |
| APACHE CORP                  |         | 122   | 49  | 237   | 26,414    | エネルギー                  |
| APPLE INC                    |         | 1,569 | 618 | 9,503 | 1,058,141 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| APPLIED MATERIALS INC        |         | 363   | 136 | 620   | 69,059    | 半導体・半導体製造装置            |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    |         | 163   | 72  | 308   | 34,318    | 食品・飲料・タバコ              |
| ARCONIC INC                  |         | —     | 73  | 201   | 22,393    | 資本財                    |
| ASHLAND INC                  |         | 27    | —   | —     | —         | 素材                     |
| AUTODESK INC                 |         | 81    | 27  | 312   | 34,809    | ソフトウェア・サービス            |
| AUTOLIV INC                  |         | 29    | 16  | 179   | 20,004    | 自動車・自動車部品              |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    |         | 114   | 56  | 568   | 63,271    | ソフトウェア・サービス            |
| AUTOZONE INC                 |         | 9     | 3   | 241   | 26,937    | 小売                     |

| 銘柄                           | 柄 | 期首(前期末) |       | 当 期   |         | 業 種 等                  |
|------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                              |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |
|                              |   |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                        |
| (アメリカ)                       |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                        |
| AVERY DENNISON CORP          |   | 40      | 16    | 139   | 15,541  | 素材                     |
| BB&T CORPORATION             |   | 229     | 105   | 450   | 50,106  | 銀行                     |
| BAKER HUGHES INC             |   | 123     | 50    | 281   | 31,288  | エネルギー                  |
| BALL CORP                    |   | 51      | 51    | 208   | 23,245  | 素材                     |
| BANK OF AMERICA CORP         |   | 2,992   | 1,188 | 2,761 | 307,477 | 銀行                     |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP |   | 311     | 130   | 616   | 68,653  | 各種金融                   |
| BARD (C.R.) INC              |   | 22      | 10    | 315   | 35,092  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BAXALTA INC                  |   | 189     | —     | —     | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BAXTER INTL INC              |   | 161     | 65    | 383   | 42,751  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BECTON DICKINSON & CO        |   | 59      | 28    | 533   | 59,360  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BED BATH & BEYOND INC        |   | 68      | 27    | 97    | 10,849  | 小売                     |
| WR BERKLEY CORP              |   | 48      | 16    | 112   | 12,479  | 保険                     |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  |   | 327     | 142   | 2,359 | 262,716 | 各種金融                   |
| BEST BUY COMPANY INC         |   | 98      | 43    | 253   | 28,265  | 小売                     |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  |   | 57      | 27    | 240   | 26,787  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOGEN INC                   |   | 63      | 26    | 654   | 72,909  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACKROCK INC                |   | 34      | 13    | 537   | 59,864  | 各種金融                   |
| H&R BLOCK INC                |   | 105     | 39    | 103   | 11,512  | 消費者サービス                |
| BOEING CO                    |   | 177     | 69    | 1,302 | 144,988 | 資本財                    |
| BORGWARNER INC               |   | 93      | 39    | 163   | 18,214  | 自動車・自動車部品              |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       |   | 409     | 176   | 482   | 53,736  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      |   | 471     | 196   | 1,061 | 118,227 | 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    |   | 35      | 28    | 146   | 16,265  | 食品・飲料・タバコ              |
| CBS CORP CL-B                |   | 141     | 53    | 330   | 36,812  | メディア                   |
| CDK GLOBAL INC               |   | 61      | 23    | 140   | 15,615  | ソフトウェア・サービス            |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   |   | 92      | 39    | 111   | 12,393  | 素材                     |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  |   | 47      | 18    | 126   | 14,122  | 運輸                     |
| CIGNA CORP                   |   | 76      | 32    | 516   | 57,512  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CIT GROUP INC                |   | 82      | 31    | 141   | 15,774  | 銀行                     |
| CME GROUP INC                |   | 91      | 39    | 462   | 51,492  | 各種金融                   |
| CMS ENERGY CORP              |   | 87      | 40    | 193   | 21,536  | 公益事業                   |
| CSX CORP                     |   | 285     | 118   | 637   | 70,977  | 運輸                     |
| CVS HEALTH CORPORATION       |   | 302     | 124   | 952   | 106,066 | 食品・生活必需品小売り            |
| CA INC                       |   | 105     | 46    | 148   | 16,559  | ソフトウェア・サービス            |
| CABOT OIL & GAS CORP         |   | 169     | 79    | 183   | 20,412  | エネルギー                  |
| CAMPBELL SOUP CO             |   | 61      | 31    | 183   | 20,475  | 食品・飲料・タバコ              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   |   | 156     | 62    | 495   | 55,204  | 各種金融                   |
| CARDINAL HEALTH INC          |   | 90      | 40    | 292   | 32,596  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CARMAX INC                   |   | 77      | 28    | 182   | 20,299  | 小売                     |
| CARNIVAL CORP                |   | 133     | 48    | 308   | 34,383  | 消費者サービス                |
| CATERPILLAR INC              |   | 173     | 72    | 766   | 85,337  | 資本財                    |
| CELANESE CORP-SERIES A       |   | 47      | 24    | 210   | 23,451  | 素材                     |
| CELGENE CORP                 |   | 227     | 93    | 1,096 | 122,078 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CENTERPOINT ENERGY INC       |   | 163     | 60    | 172   | 19,168  | 公益事業                   |
| CENTURYLINK INC.             |   | 172     | 83    | 205   | 22,926  | 電気通信サービス               |
| CERNER CORP                  |   | 94      | 43    | 280   | 31,247  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A |   | 51      | 26    | 898   | 100,012 | メディア                   |
| CHEVRONTXACO CORP            |   | 535     | 211   | 2,216 | 246,797 | エネルギー                  |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A  |   | 10      | 4     | 213   | 23,736  | 消費者サービス                |
| CIMAREX ENERGY CO            |   | 31      | 16    | 179   | 19,999  | エネルギー                  |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    |   | 60      | 23    | 164   | 18,330  | 保険                     |
| CISCO SYSTEMS INC            |   | 1,442   | 587   | 1,850 | 206,020 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |

| 銘柄                           | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       | 業 種 等   |                    |
|------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|--------------------|
|                              |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                    |
|                              |   |         |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額             |
| (アメリカ)                       |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                    |
| CINTAS CORP                  |   | 38      | 14    | 183   | 20,429  | 商業・専門サービス          |
| CITIGROUP INC                |   | 858     | 337   | 2,093 | 233,083 | 銀行                 |
| CITRIX SYSTEMS INC           |   | 57      | 25    | 212   | 23,613  | ソフトウェア・サービス        |
| CLOROX COMPANY               |   | 44      | 19    | 268   | 29,924  | 家庭用品・パーソナル用品       |
| COACH INC                    |   | 98      | 41    | 192   | 21,479  | 耐久消費財・アパレル         |
| COCA-COLA COMPANY            |   | 1,126   | 440   | 2,000 | 222,682 | 食品・飲料・タバコ          |
| COCA-COLA ENTERPRISES        |   | 68      | —     | —     | —       | 食品・飲料・タバコ          |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   |   | 178     | 76    | 514   | 57,237  | ソフトウェア・サービス        |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         |   | 235     | 104   | 788   | 87,777  | 家庭用品・パーソナル用品       |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP      |   | 143     | —     | —     | —       | エネルギー              |
| COMCAST CORP-CL A            |   | 706     | 563   | 2,303 | 256,505 | メディア               |
| COMERICA INC                 |   | 75      | 29    | 201   | 22,488  | 銀行                 |
| CONAGRA BRANDS INC           |   | 121     | 59    | 232   | 25,938  | 食品・飲料・タバコ          |
| CONCHO RESOURCES INC         |   | 46      | 21    | 285   | 31,805  | エネルギー              |
| CONOCOPHILLIPS               |   | 354     | 142   | 647   | 72,083  | エネルギー              |
| CONSOLIDATED EDISON INC      |   | 89      | 38    | 317   | 35,311  | 公益事業               |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   |   | 55      | 23    | 423   | 47,118  | 食品・飲料・タバコ          |
| COOPER COS INC/THE           |   | 20      | 7     | 169   | 18,885  | ヘルスケア機器・サービス       |
| CORE LABORATORIES N.V.       |   | 20      | 8     | 89    | 9,949   | エネルギー              |
| CORNING INC                  |   | 364     | 127   | 373   | 41,629  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| COSTCO WHOLESALE CORP        |   | 119     | 49    | 888   | 98,876  | 食品・生活必需品小売り        |
| COTY INC-CL A                |   | —       | 60    | 115   | 12,902  | 家庭用品・パーソナル用品       |
| CUMMINS INC                  |   | 47      | 19    | 311   | 34,723  | 資本財                |
| DR HORTON INC                |   | 122     | 55    | 184   | 20,544  | 耐久消費財・アパレル         |
| DTE ENERGY COMPANY           |   | 53      | 23    | 257   | 28,718  | 公益事業               |
| DXC TECHNOLOGY CO            |   | —       | 21    | 170   | 19,022  | ソフトウェア・サービス        |
| DANAHER CORP                 |   | 162     | 73    | 621   | 69,143  | ヘルスケア機器・サービス       |
| DARDEN RESTAURANTS INC       |   | 49      | 17    | 155   | 17,312  | 消費者サービス            |
| DAVITA INC                   |   | 61      | 28    | 184   | 20,503  | ヘルスケア機器・サービス       |
| DEERE & CO                   |   | 94      | 36    | 444   | 49,490  | 資本財                |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V   |   | —       | 33    | 230   | 25,631  | ソフトウェア・サービス        |
| DENTSPLY SIRONA INC          |   | 81      | 34    | 218   | 24,364  | ヘルスケア機器・サービス       |
| DEVON ENERGY CORPORATION     |   | 139     | 67    | 242   | 26,960  | エネルギー              |
| THE WALT DISNEY CO           |   | 443     | 177   | 1,923 | 214,164 | メディア               |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  |   | 128     | 54    | 324   | 36,107  | 各種金融               |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A   |   | 79      | 31    | 81    | 9,064   | メディア               |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C   |   | 104     | 45    | 114   | 12,740  | メディア               |
| DISH NETWORK CORPORATION     |   | 88      | 34    | 219   | 24,487  | メディア               |
| EVEREST RE GROUP LTD         |   | 17      | 6     | 169   | 18,909  | 保険                 |
| Dollar General Corp          |   | 87      | 35    | 257   | 28,673  | 小売                 |
| DOLLAR TREE INC              |   | 68      | 32    | 251   | 27,968  | 小売                 |
| DOMINION ENERGY INC          |   | 159     | 76    | 622   | 69,297  | 公益事業               |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD |   | 192     | 88    | 155   | 17,320  | 半導体・半導体製造装置        |
| DOVER CORP                   |   | 59      | 22    | 187   | 20,860  | 資本財                |
| DOW CHEMICAL                 |   | 313     | 131   | 805   | 89,698  | 素材                 |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I  |   | 55      | 23    | 223   | 24,867  | 食品・飲料・タバコ          |
| DU PONT (E. I.) DE NEMOURS   |   | 248     | 102   | 800   | 89,157  | 素材                 |
| DUKE ENERGY CORP             |   | 190     | 76    | 653   | 72,752  | 公益事業               |
| DUN & BRADSTREET CORP        |   | 20      | —     | —     | —       | 商業・専門サービス          |
| EMC CORP/MASS                |   | 552     | —     | —     | —       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| EOG RESOURCES INC            |   | 155     | 67    | 612   | 68,159  | エネルギー              |
| EQT CORPORATION              |   | 54      | 29    | 168   | 18,708  | エネルギー              |

| 銘柄                                     | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       | 業 種 等   |                        |
|----------------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                                        |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |
|                                        |   |         |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額                 |
| (アメリカ)                                 |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                        |
| E*TRADE FINANCIAL CORP                 |   | 125     | 46    | 163   | 18,197  | 各種金融                   |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD                 |   | 45      | 18    | 180   | 20,149  | 保険                     |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY               |   | 55      | 24    | 197   | 21,958  | 素材                     |
| EBAY INC                               |   | 316     | 137   | 480   | 53,468  | ソフトウェア・サービス            |
| ECOLAB INC                             |   | 74      | 29    | 385   | 42,950  | 素材                     |
| BUNGE LIMITED                          |   | 57      | 21    | 177   | 19,752  | 食品・飲料・タバコ              |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO              |   | 29      | 12    | 88    | 9,866   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EDISON INTERNATIONAL                   |   | 97      | 41    | 334   | 37,266  | 公益事業                   |
| Edwards Lifesciences Corp              |   | 69      | 29    | 339   | 37,792  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ELECTRONIC ARTS INC                    |   | 96      | 39    | 444   | 49,438  | ソフトウェア・サービス            |
| EMERSON ELECTRIC CO                    |   | 178     | 70    | 413   | 46,052  | 資本財                    |
| ENTERGY CORP                           |   | 64      | 27    | 213   | 23,749  | 公益事業                   |
| EQUIFAX INC                            |   | 42      | 16    | 223   | 24,835  | 商業・専門サービス              |
| EQUINIX INC                            |   | 11      | —     | —     | —       | 不動産                    |
| EVERSOURCE ENERGY                      |   | 97      | 40    | 249   | 27,796  | 公益事業                   |
| EXELON CORP                            |   | 271     | 117   | 420   | 46,817  | 公益事業                   |
| EXPEDIA INC                            |   | 44      | 15    | 224   | 25,031  | 小売                     |
| EXPEDITORS INTL WASH INC               |   | 50      | 24    | 131   | 14,632  | 運輸                     |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO             |   | 191     | 77    | 461   | 51,379  | ヘルスケア機器・サービス           |
| EXXON MOBIL CORPORATION                |   | 1,161   | 475   | 3,875 | 431,525 | エネルギー                  |
| FMC TECHNOLOGIES INC                   |   | 98      | —     | —     | —       | エネルギー                  |
| FACEBOOK INC-A                         |   | 646     | 273   | 4,162 | 463,478 | ソフトウェア・サービス            |
| FASTENAL CO                            |   | 101     | 48    | 210   | 23,478  | 資本財                    |
| FEDEX CORP                             |   | 77      | 31    | 602   | 67,136  | 運輸                     |
| F5 NETWORKS INC                        |   | 31      | 12    | 164   | 18,263  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES |   | 79      | 42    | 364   | 40,534  | ソフトウェア・サービス            |
| FNF GROUP                              |   | 106     | 40    | 173   | 19,340  | 保険                     |
| FIFTH THIRD BANCORP                    |   | 282     | 108   | 262   | 29,239  | 銀行                     |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA                 |   | 56      | 25    | 232   | 25,845  | 銀行                     |
| FISERV INC                             |   | 75      | 29    | 363   | 40,481  | ソフトウェア・サービス            |
| FIRSTENERGY CORP                       |   | 143     | 72    | 208   | 23,231  | 公益事業                   |
| FLUOR CORP                             |   | 60      | 24    | 108   | 12,134  | 資本財                    |
| FLOWSERVE CORP                         |   | 62      | 27    | 133   | 14,898  | 資本財                    |
| FOOT LOCKER INC                        |   | 45      | 21    | 130   | 14,519  | 小売                     |
| FORD MOTOR CO                          |   | 1,070   | 418   | 457   | 50,886  | 自動車・自動車部品              |
| FORTIVE CORP                           |   | —       | 41    | 261   | 29,154  | 資本財                    |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI           |   | 60      | 27    | 173   | 19,334  | 資本財                    |
| FRANKLIN RESOURCES INC                 |   | 115     | 58    | 243   | 27,128  | 各種金融                   |
| FREEMPORT-MCMORAN INC                  |   | 384     | 193   | 225   | 25,092  | 素材                     |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO                |   | 75      | 28    | 162   | 18,048  | 保険                     |
| GAMESTOP CORP-CLASS A                  |   | 45      | —     | —     | —       | 小売                     |
| GAP INC                                |   | 97      | 40    | 90    | 10,077  | 小売                     |
| GARTNER INC                            |   | 35      | 14    | 166   | 18,559  | ソフトウェア・サービス            |
| GENERAL DYNAMICS CORP                  |   | 64      | 31    | 629   | 70,119  | 資本財                    |
| GENERAL ELECTRIC CO                    |   | 2,650   | 996   | 2,735 | 304,607 | 資本財                    |
| GENERAL MILS INC                       |   | 146     | 59    | 340   | 37,858  | 食品・飲料・タバコ              |
| GENERAL MOTORS CO                      |   | 386     | 165   | 546   | 60,882  | 自動車・自動車部品              |
| GENUINE PARTS CO                       |   | 34      | 17    | 161   | 18,019  | 小売                     |
| GILEAD SCIENCES INC                    |   | 403     | 146   | 946   | 105,358 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC                |   | 114     | 43    | 976   | 108,685 | 各種金融                   |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO              |   | 108     | 50    | 165   | 18,475  | 自動車・自動車部品              |
| WR GRACE & CO                          |   | 34      | 12    | 92    | 10,261  | 素材                     |

| 銘柄                            | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       | 業 種 等   |                        |
|-------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                               |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |
|                               |   |         |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額                 |
| (アメリカ)                        |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                        |
| WW GRAINGER INC               |   | 20      | 8     | 143   | 16,002  | 資本財                    |
| HCA HEALTHCARE INC            |   | 105     | 40    | 338   | 37,706  | ヘルスケア機器・サービス           |
| HP INC                        |   | 565     | 224   | 415   | 46,247  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HALLIBURTON CO                |   | 236     | 110   | 506   | 56,395  | エネルギー                  |
| HARLEY-DAVIDSON INC           |   | 67      | 29    | 153   | 17,062  | 自動車・自動車部品              |
| HARMAN INTERNATIONAL          |   | 32      | —     | —     | —       | 耐久消費財・アパレル             |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP   |   | 125     | 49    | 242   | 27,022  | 保険                     |
| HASBRO INC                    |   | 39      | 15    | 161   | 17,961  | 耐久消費財・アパレル             |
| HELMERICH & PAYNE             |   | 47      | 19    | 107   | 11,927  | エネルギー                  |
| HERSHEY CO/THE                |   | 48      | 21    | 249   | 27,771  | 食品・飲料・タバコ              |
| HESS CORP                     |   | 93      | 44    | 214   | 23,921  | エネルギー                  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE    |   | 550     | 205   | 387   | 43,092  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HOLLYFRONTIER CORP            |   | 73      | 38    | 95    | 10,626  | エネルギー                  |
| HOME DEPOT INC                |   | 354     | 136   | 2,113 | 235,277 | 小売                     |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC   |   | 199     | 78    | 1,046 | 116,507 | 資本財                    |
| HORMEL FOODS CORP             |   | 108     | 39    | 132   | 14,717  | 食品・飲料・タバコ              |
| HUMANA INC                    |   | 44      | 19    | 454   | 50,657  | ヘルスケア機器・サービス           |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC   |   | 37      | 16    | 139   | 15,512  | 運輸                     |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC     |   | 329     | 177   | 227   | 25,373  | 銀行                     |
| IHS INC                       |   | 27      | —     | —     | —       | 商業・専門サービス              |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC       |   | 90      | 39    | 555   | 61,811  | 資本財                    |
| ILLUMINA INC                  |   | 47      | 19    | 350   | 39,054  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INCYTE CORP                   |   | 60      | 23    | 314   | 34,995  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INTEL CORP                    |   | 1,306   | 526   | 1,910 | 212,683 | 半導体・半導体製造装置            |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC |   | 33      | 74    | 451   | 50,220  | 各種金融                   |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP   |   | 258     | 103   | 1,576 | 175,537 | ソフトウェア・サービス            |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES     |   | 25      | 12    | 172   | 19,159  | 素材                     |
| INTERNATIONAL PAPER CO        |   | 118     | 52    | 277   | 30,868  | 素材                     |
| INTERPUBLIC GROUP COS INC     |   | 158     | 68    | 169   | 18,860  | メディア                   |
| INTUIT INC                    |   | 74      | 32    | 445   | 49,629  | ソフトウェア・サービス            |
| INTUITIVE SURGICAL INC        |   | 11      | 5     | 459   | 51,186  | ヘルスケア機器・サービス           |
| JPMORGAN CHASE & CO           |   | 1,044   | 418   | 3,576 | 398,188 | 銀行                     |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC  |   | 60      | 25    | 132   | 14,781  | 資本財                    |
| JOHNSON & JOHNSON             |   | 766     | 308   | 3,918 | 436,260 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JOHNSON CONTROLS INC          |   | 176     | —     | —     | —       | 自動車・自動車部品              |
| JUNIPER NETWORKS INC          |   | 135     | 60    | 178   | 19,828  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KLA-TENCOR CORPORATION        |   | 53      | 23    | 242   | 26,961  | 半導体・半導体製造装置            |
| KELLOGG CO                    |   | 69      | 30    | 222   | 24,814  | 食品・飲料・タバコ              |
| KEYCORP                       |   | 311     | 153   | 276   | 30,758  | 銀行                     |
| KIMBERLY-CLARK CORP           |   | 105     | 43    | 567   | 63,215  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| KINDER MORGAN INC             |   | 585     | 233   | 450   | 50,118  | エネルギー                  |
| KOHL'S CORP                   |   | 69      | 31    | 122   | 13,626  | 小売                     |
| KRAFT HEINZ CO/THE            |   | 170     | 68    | 637   | 70,983  | 食品・飲料・タバコ              |
| KROGER CO                     |   | 266     | 120   | 355   | 39,603  | 食品・生活必需品小売り            |
| L BRANDS INC                  |   | 71      | 37    | 190   | 21,257  | 小売                     |
| LKQ CORP                      |   | 120     | 52    | 166   | 18,554  | 小売                     |
| L3 TECHNOLOGIES INC           |   | —       | 11    | 195   | 21,791  | 資本財                    |
| L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS   |   | 22      | —     | —     | —       | 資本財                    |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS  |   | 36      | 16    | 233   | 25,971  | ヘルスケア機器・サービス           |
| LAM RESEARCH CORP             |   | 57      | 22    | 344   | 38,307  | 半導体・半導体製造装置            |
| LAS VEGAS SANDS CORP          |   | 126     | 58    | 339   | 37,829  | 消費者サービス                |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A   |   | 64      | 29    | 276   | 30,807  | 家庭用品・パーソナル用品           |

| 銘<br>柄                               | 株<br>数 | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         | 業<br>種<br>等            |
|--------------------------------------|--------|---------|-------------|---------|------------------------|
|                                      |        | 株<br>数  | 評<br>価<br>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      |                        |
| LEAR CORP                            | 29     | 11      | 165         | 18,436  | 自動車・自動車部品              |
| LEGGETT & PLATT INC                  | 63     | 26      | 138         | 15,372  | 耐久消費財・アパレル             |
| LEGG MASON INC                       | 61     | —       | —           | —       | 各種金融                   |
| LENNAR CORP-CL A                     | 74     | 35      | 183         | 20,482  | 耐久消費財・アパレル             |
| LEUCADIA NATIONAL CORP               | 156    | 62      | 154         | 17,159  | 各種金融                   |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A | 154    | 64      | 153         | 17,121  | 小売                     |
| ELI LILLY & CO                       | 282    | 119     | 929         | 103,481 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LINCOLN NATIONAL CORP                | 87     | 36      | 235         | 26,264  | 保険                     |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP               | 76     | —       | —           | —       | 半導体・半導体製造装置            |
| LinkedIn Corp                        | 40     | —       | —           | —       | ソフトウェア・サービス            |
| LOCKHEED MARTIN CORP                 | 76     | 31      | 880         | 98,029  | 資本財                    |
| LOEWS CORP                           | 92     | 44      | 207         | 23,065  | 保険                     |
| LOWE'S COMPANIES                     | 255    | 99      | 803         | 89,445  | 小売                     |
| LULULEMON ATHLETICA INC              | 44     | 22      | 106         | 11,824  | 耐久消費財・アパレル             |
| M & T BANK CORP                      | 43     | 19      | 309         | 34,478  | 銀行                     |
| MACY'S INC                           | 106    | 54      | 126         | 14,092  | 小売                     |
| MANPOWERGROUP                        | 34     | 12      | 124         | 13,863  | 商業・専門サービス              |
| MARATHON OIL CORP                    | 282    | 125     | 169         | 18,842  | エネルギー                  |
| MARATHON PETROLEUM CORP              | 158    | 70      | 370         | 41,208  | エネルギー                  |
| MARSH & MCLENNAN COS                 | 147    | 58      | 445         | 49,649  | 保険                     |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A          | 73     | 43      | 462         | 51,465  | 消費者サービス                |
| MASCO CORP                           | 129    | 55      | 206         | 22,983  | 資本財                    |
| MASTERCARD INC-CLASS A               | 278    | 115     | 1,403       | 156,305 | ソフトウェア・サービス            |
| MATTEL INC                           | 113    | 54      | 123         | 13,718  | 耐久消費財・アパレル             |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS            | 93     | 41      | 199         | 22,199  | 半導体・半導体製造装置            |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS          | 44     | 19      | 199         | 22,253  | 食品・飲料・タバコ              |
| MCDONALD'S CORP                      | 265    | 99      | 1,488       | 165,769 | 消費者サービス                |
| MCKESSON CORP                        | 66     | 27      | 450         | 50,110  | ヘルスケア機器・サービス           |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO            | 62     | 26      | 237         | 26,404  | 食品・飲料・タバコ              |
| MEDIVATION INC                       | 67     | —       | —           | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MERCK & CO. INC.                     | 766    | 311     | 2,022       | 225,172 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| METLIFE INC                          | 271    | 116     | 592         | 65,990  | 保険                     |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC     | 10     | 3       | 227         | 25,373  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MICROSOFT CORP                       | 2,128  | 857     | 5,997       | 667,765 | ソフトウェア・サービス            |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC             | 71     | 31      | 255         | 28,499  | 半導体・半導体製造装置            |
| MICRON TECHNOLOGY INC                | 388    | 138     | 412         | 45,924  | 半導体・半導体製造装置            |
| MOHAWK INDUSTRIES INC                | 23     | 9       | 232         | 25,870  | 耐久消費財・アパレル             |
| MOLSON COORS BREWING CO -B           | 51     | 22      | 214         | 23,909  | 食品・飲料・タバコ              |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC           | 445    | 178     | 827         | 92,135  | 食品・飲料・タバコ              |
| MONSANTO CO                          | 126    | 50      | 593         | 66,051  | 素材                     |
| MONSTER BEVERAGE CORP                | 42     | 51      | 264         | 29,435  | 食品・飲料・タバコ              |
| MOODY'S CORP                         | 60     | 24      | 285         | 31,802  | 各種金融                   |
| MORGAN STANLEY                       | 446    | 174     | 746         | 83,166  | 各種金融                   |
| MOSAIC CO/THE                        | 120    | 60      | 140         | 15,660  | 素材                     |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC               | 59     | 25      | 205         | 22,858  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MURPHY OIL CORP                      | 80     | 34      | 88          | 9,837   | エネルギー                  |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC           | 110    | 60      | 197         | 21,971  | エネルギー                  |
| NETAPP INC                           | 127    | 48      | 195         | 21,729  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NETFLIX INC                          | 121    | 51      | 842         | 93,788  | 小売                     |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP           | 210    | 100     | 131         | 14,605  | 銀行                     |
| NEWELL BRANDS INC                    | 96     | 51      | 272         | 30,321  | 耐久消費財・アパレル             |
| NEWMONT MINING CORP                  | 154    | 52      | 178         | 19,915  | 素材                     |

| 銘柄                            | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       | 業 種 等   |                        |
|-------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                               |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |
|                               |   |         |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額                 |
| (アメリカ)                        |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                        |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I        |   | 196     | 69    | 92    | 10,332  | メディア                   |
| NEXTERA ENERGY INC            |   | 131     | 57    | 810   | 90,224  | 公益事業                   |
| NIKE INC -CL B                |   | 388     | 148   | 781   | 86,999  | 耐久消費財・アパレル             |
| NOBLE ENERGY INC              |   | 151     | 75    | 223   | 24,900  | エネルギー                  |
| NORDSTROM INC                 |   | 60      | 26    | 113   | 12,686  | 小売                     |
| NORFOLK SOUTHERN CORP         |   | 89      | 38    | 464   | 51,770  | 運輸                     |
| NORTHERN TRUST CORP           |   | 68      | 31    | 278   | 30,957  | 各種金融                   |
| NORTHROP GRUMMAN CORP         |   | 49      | 19    | 507   | 56,539  | 資本財                    |
| NUCOR CORP                    |   | 104     | 47    | 277   | 30,850  | 素材                     |
| NVIDIA CORP                   |   | 169     | 66    | 936   | 104,230 | 半導体・半導体製造装置            |
| OGE ENERGY CORP               |   | 92      | 42    | 148   | 16,488  | 公益事業                   |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC       |   | 30      | 11    | 297   | 33,171  | 小売                     |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP     |   | 210     | 87    | 532   | 59,291  | エネルギー                  |
| OCEANEERING INTL INC          |   | 44      | —     | —     | —       | エネルギー                  |
| OMNICOM GROUP                 |   | 75      | 29    | 249   | 27,745  | メディア                   |
| ORACLE CORPORATION            |   | 892     | 355   | 1,607 | 178,989 | ソフトウェア・サービス            |
| P G & E CORP                  |   | 139     | 64    | 433   | 48,253  | 公益事業                   |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP  |   | 144     | 60    | 733   | 81,640  | 銀行                     |
| PPG INDUSTRIES INC            |   | 75      | 31    | 340   | 37,945  | 素材                     |
| PPL CORPORATION               |   | 196     | 78    | 314   | 34,975  | 公益事業                   |
| PVH CORP                      |   | 34      | 14    | 151   | 16,822  | 耐久消費財・アパレル             |
| PACCAR INC                    |   | 104     | 49    | 306   | 34,168  | 資本財                    |
| PACKAGING CORP OF AMERICA     |   | 37      | 14    | 147   | 16,450  | 素材                     |
| PARKER HANNIFIN CORP          |   | 41      | 18    | 297   | 33,141  | 資本財                    |
| PATTERSON COS INC             |   | 48      | 18    | 82    | 9,187   | ヘルスケア機器・サービス           |
| PAYCHEX INC                   |   | 74      | 39    | 231   | 25,787  | ソフトウェア・サービス            |
| PAYPAL HOLDINGS INC           |   | 322     | 134   | 690   | 76,857  | ソフトウェア・サービス            |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL     |   | 158     | 61    | 103   | 11,549  | 銀行                     |
| PEPSICO INC                   |   | 386     | 156   | 1,848 | 205,782 | 食品・飲料・タバコ              |
| PFIZER INC                    |   | 1,714   | 667   | 2,146 | 238,987 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL   |   | 432     | 181   | 2,176 | 242,381 | 食品・飲料・タバコ              |
| PHILLIPS 66                   |   | 147     | 48    | 374   | 41,722  | エネルギー                  |
| PINNACLE WEST CAPITAL         |   | 46      | 17    | 149   | 16,659  | 公益事業                   |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO  |   | 46      | 21    | 363   | 40,448  | エネルギー                  |
| POLARIS INDUSTRIES INC        |   | 29      | 12    | 105   | 11,746  | 耐久消費財・アパレル             |
| PRAXAIR INC                   |   | 76      | 31    | 419   | 46,696  | 素材                     |
| T ROWE PRICE GROUP INC        |   | 52      | 31    | 222   | 24,747  | 各種金融                   |
| PRICELINE GROUP INC           |   | 14      | 5     | 1,077 | 119,950 | 小売                     |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP     |   | 107     | 41    | 261   | 29,092  | 保険                     |
| PROCTER & GAMBLE CO           |   | 749     | 285   | 2,490 | 277,268 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| PROGRESSIVE CORP              |   | 188     | 79    | 338   | 37,653  | 保険                     |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      |   | 129     | 54    | 573   | 63,838  | 保険                     |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP  |   | 140     | 61    | 272   | 30,388  | 公益事業                   |
| PULTE HOMES INC               |   | 145     | 57    | 130   | 14,515  | 耐久消費財・アパレル             |
| QUALCOMM INC                  |   | 421     | 166   | 957   | 106,650 | 半導体・半導体製造装置            |
| QUEST DIAGNOSTICS             |   | 51      | 22    | 241   | 26,834  | ヘルスケア機器・サービス           |
| RALPH LAUREN CORP             |   | 26      | 11    | 77    | 8,597   | 耐久消費財・アパレル             |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   |   | 59      | 21    | 160   | 17,924  | 各種金融                   |
| RAYTHEON COMPANY              |   | 83      | 34    | 564   | 62,818  | 資本財                    |
| RED HAT INC                   |   | 65      | 28    | 252   | 28,058  | ソフトウェア・サービス            |
| Regeneron Pharmaceuticals Inc |   | 23      | 9     | 452   | 50,425  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| REGIONS FINANCIAL CORP        |   | 467     | 178   | 251   | 28,009  | 銀行                     |

| 銘柄                           | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       | 業 種 等   |                        |
|------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                              |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |
|                              |   |         |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額                 |
| (アメリカ)                       |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                        |
| REPUBLIC SERVICES INC        |   | 78      | 38    | 241   | 26,845  | 商業・専門サービス              |
| RESMED INC                   |   | 51      | 23    | 161   | 17,943  | ヘルスケア機器・サービス           |
| REYNOLDS AMERICAN INC        |   | 249     | 93    | 623   | 69,467  | 食品・飲料・タバコ              |
| RITE AID CORP                |   | 322     | 260   | 95    | 10,633  | 食品・生活必需品小売り            |
| ROBERT HALF INTL INC         |   | 60      | 23    | 107   | 11,953  | 商業・専門サービス              |
| ROCKWELL AUTOMATION INC      |   | 38      | 17    | 278   | 31,052  | 資本財                    |
| ROCKWELL COLLINS INC.        |   | 49      | 22    | 241   | 26,916  | 資本財                    |
| ROPER TECHNOLOGIES INC       |   | 29      | 14    | 318   | 35,446  | 資本財                    |
| ROSS STORES INC              |   | 114     | 47    | 303   | 33,777  | 小売                     |
| S&P GLOBAL INC               |   | 86      | 33    | 472   | 52,562  | 各種金融                   |
| SEI INVESTMENTS COMPANY      |   | 61      | 22    | 114   | 12,747  | 各種金融                   |
| ST JUDE MEDICAL INC          |   | 75      | —     | —     | —       | ヘルスケア機器・サービス           |
| SALESFORCE.COM INC           |   | 191     | 80    | 729   | 81,237  | ソフトウェア・サービス            |
| SCANA CORP                   |   | 55      | 25    | 172   | 19,243  | 公益事業                   |
| SCHLUMBERGER LTD             |   | 378     | 151   | 1,061 | 118,212 | エネルギー                  |
| SCHWAB (CHARLES) CORP        |   | 369     | 151   | 597   | 66,477  | 各種金融                   |
| SEALED AIR CORP              |   | 76      | 34    | 152   | 16,948  | 素材                     |
| SEMPRA ENERGY                |   | 65      | 30    | 350   | 39,079  | 公益事業                   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE      |   | 25      | 10    | 350   | 38,971  | 素材                     |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC       |   | 66      | 24    | 259   | 28,837  | 半導体・半導体製造装置            |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW COM    |   | 33      | 17    | 219   | 24,416  | 食品・飲料・タバコ              |
| SOUTHERN CO                  |   | 241     | 106   | 537   | 59,844  | 公益事業                   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO        |   | 70      | 28    | 174   | 19,440  | 運輸                     |
| SPECTRA ENERGY CORP          |   | 208     | —     | —     | —       | エネルギー                  |
| SPLUNK INC                   |   | 55      | 25    | 156   | 17,476  | ソフトウェア・サービス            |
| STANLEY BLACK & DECKER INC   |   | 36      | 19    | 264   | 29,470  | 資本財                    |
| STAPLES INC                  |   | 230     | 87    | 79    | 8,797   | 小売                     |
| STARBUCKS CORP               |   | 434     | 176   | 1,116 | 124,365 | 消費者サービス                |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS    |   | 61      | —     | —     | —       | 消費者サービス                |
| STATE STREET CORP            |   | 118     | 50    | 417   | 46,465  | 各種金融                   |
| STERICYCLE INC               |   | 29      | 17    | 147   | 16,477  | 商業・専門サービス              |
| STRYKER CORP                 |   | 93      | 40    | 573   | 63,859  | ヘルスケア機器・サービス           |
| SUNTRUST BANKS INC           |   | 156     | 66    | 359   | 40,001  | 銀行                     |
| SYMANTEC CORP                |   | 224     | 89    | 264   | 29,479  | ソフトウェア・サービス            |
| SYNOPSYS INC                 |   | 66      | 23    | 175   | 19,558  | ソフトウェア・サービス            |
| SYNCHRONY FINANCIAL          |   | 257     | 117   | 322   | 35,949  | 各種金融                   |
| SYSO CORP                    |   | 144     | 60    | 328   | 36,561  | 食品・生活必需品小売り            |
| TJX COMPANIES INC            |   | 182     | 66    | 505   | 56,242  | 小売                     |
| TARGET CORP                  |   | 160     | 57    | 312   | 34,815  | 小売                     |
| TERADATA CORP                |   | 80      | —     | —     | —       | ソフトウェア・サービス            |
| TESLA INC                    |   | 31      | 16    | 538   | 59,949  | 自動車・自動車部品              |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR   |   | 273     | 123   | 351   | 39,138  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXAS INSTRUMENTS            |   | 276     | 109   | 887   | 98,772  | 半導体・半導体製造装置            |
| TEXTRON INC                  |   | 90      | 41    | 198   | 22,049  | 資本財                    |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC |   | 116     | 46    | 808   | 90,055  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 3M CO                        |   | 168     | 64    | 1,293 | 144,065 | 資本財                    |
| TIFFANY & CO                 |   | 35      | 19    | 167   | 18,595  | 小売                     |
| TIME WARNER INC              |   | 233     | 91    | 905   | 100,807 | メディア                   |
| TOLL BROTHERS INC            |   | 87      | 29    | 109   | 12,160  | 耐久消費財・アパレル             |
| TORCHMARK CORP               |   | 54      | 21    | 161   | 17,949  | 保険                     |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC    |   | 67      | 25    | 150   | 16,796  | ソフトウェア・サービス            |
| TRAVELERS COS INC/THE        |   | 80      | 28    | 351   | 39,088  | 保険                     |

| 銘<br>柄                        | 株 数   | 期首(前期末) | 当 期 末 |         | 業 種 等                  |
|-------------------------------|-------|---------|-------|---------|------------------------|
|                               |       | 株 数     | 評 価 額 |         |                        |
|                               |       |         | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                        |
| (アメリカ)                        | 百株    | 百株      | 千米ドル  | 千円      |                        |
| TRIPADVISOR INC-W/I           | 42    | 21      | 82    | 9,226   | 小売                     |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX IN   | 323   | 139     | 378   | 42,094  | メディア                   |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B  | 159   | 66      | 178   | 19,882  | メディア                   |
| TWITTER INC                   | 204   | 93      | 171   | 19,040  | ソフトウェア・サービス            |
| TYSON FOODS INC-CL A          | 96    | 39      | 227   | 25,358  | 食品・飲料・タバコ              |
| US BANCORP                    | 482   | 203     | 1,046 | 116,482 | 銀行                     |
| UNION PACIFIC CORP            | 241   | 97      | 1,074 | 119,661 | 運輸                     |
| UNITED PARCEL SERVICE CL B    | 188   | 76      | 809   | 90,151  | 運輸                     |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP      | 232   | 84      | 1,033 | 115,059 | 資本財                    |
| UNITED THERAPEUTICS CORP      | 20    | 9       | 112   | 12,529  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| UNITEDHEALTH GROUP INC        | 271   | 113     | 2,008 | 223,616 | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 32    | 14      | 163   | 18,195  | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNUM GROUP                    | 100   | 40      | 184   | 20,499  | 保険                     |
| VF CORP                       | 94    | 36      | 197   | 21,952  | 耐久消費財・アパレル             |
| VALERO ENERGY CORP            | 138   | 60      | 377   | 42,011  | エネルギー                  |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC    | 39    | 16      | 158   | 17,663  | ヘルスケア機器・サービス           |
| VERISIGN INC                  | 41    | 18      | 162   | 18,105  | ソフトウェア・サービス            |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC    | 1,153 | 474     | 2,149 | 239,272 | 電気通信サービス               |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC    | 77    | 33      | 400   | 44,608  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VIACOM INC CL B               | 128   | 51      | 180   | 20,049  | メディア                   |
| VISA INC-CLASS A SHARES       | 551   | 221     | 2,092 | 232,999 | ソフトウェア・サービス            |
| VMWARE INC-CLASS A            | 35    | 12      | 116   | 12,945  | ソフトウェア・サービス            |
| VOYA FINANCIAL INC            | 93    | 33      | 116   | 12,954  | 各種金融                   |
| VULCAN MATERIALS CO           | 47    | 20      | 254   | 28,350  | 素材                     |
| WABCO HOLDINGS INC            | 25    | 9       | 115   | 12,883  | 資本財                    |
| WEC ENERGY GROUP INC          | 99    | 41      | 256   | 28,528  | 公益事業                   |
| WABTEC CORP/DE                | 40    | 16      | 132   | 14,745  | 資本財                    |
| WAL-MART STORES INC           | 438   | 172     | 1,351 | 150,423 | 食品・生活必需品小売り            |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC  | 242   | 101     | 825   | 91,856  | 食品・生活必需品小売り            |
| WASTE MANAGEMENT INC          | 111   | 50      | 360   | 40,121  | 商業・専門サービス              |
| WATERS CORP                   | 27    | 13      | 234   | 26,071  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WELLS FARGO & COMPANY         | 1,354 | 560     | 2,935 | 326,877 | 銀行                     |
| WESTERN DIGITAL CORP          | 90    | 40      | 362   | 40,367  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| WESTERN UNION CO              | 162   | 83      | 159   | 17,756  | ソフトウェア・サービス            |
| WESTROCK CO                   | 92    | 38      | 214   | 23,861  | 素材                     |
| WHIRLPOOL CORP                | 27    | 11      | 207   | 23,155  | 耐久消費財・アパレル             |
| WHITEWAVE FOODS CO            | 76    | —       | —     | —       | 食品・飲料・タバコ              |
| WHOLE FOODS MARKET INC        | 105   | 46      | 162   | 18,124  | 食品・生活必需品小売り            |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP        | 46    | 16      | 161   | 18,003  | 消費者サービス                |
| XCEL ENERGY INC               | 155   | 67      | 318   | 35,421  | 公益事業                   |
| XLINX INC                     | 78    | 37      | 245   | 27,332  | 半導体・半導体製造装置            |
| XEROX CORP                    | 287   | 173     | 121   | 13,491  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| XYLEM INC                     | 76    | 33      | 170   | 18,963  | 資本財                    |
| YAHOO! INC                    | 274   | 114     | 582   | 64,850  | ソフトウェア・サービス            |
| YUM! BRANDS INC               | 133   | 47      | 343   | 38,190  | 消費者サービス                |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC    | 50    | 26      | 316   | 35,245  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ZOETIS INC                    | 155   | 62      | 392   | 43,645  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INVESCO LTD                   | 152   | 60      | 194   | 21,605  | 各種金融                   |
| CHUBB LTD                     | 129   | 51      | 731   | 81,402  | 保険                     |
| SIGNET JEWELERS LTD           | 23    | 13      | 66    | 7,362   | 小売                     |
| LyondellBasell Industries NV  | 108   | 42      | 340   | 37,931  | 素材                     |
| GARMIN LTD                    | 45    | 16      | 86    | 9,678   | 耐久消費財・アパレル             |

| 銘柄                              |  | 期首(前期末)       | 当 期    |        | 業 種 等   |                        |
|---------------------------------|--|---------------|--------|--------|---------|------------------------|
|                                 |  | 株 数           | 株 数    | 評 価 額  |         |                        |
|                                 |  |               |        | 外貨建金額  |         | 邦貨換算金額                 |
| (アメリカ)                          |  | 百株            | 百株     | 千米ドル   | 千円      |                        |
| ACCENTURE PLC-CL A              |  | 173           | 72     | 885    | 98,569  | ソフトウェア・サービス            |
| NXP SEMICONDUCTORS NV           |  | —             | 35     | 379    | 42,278  | 半導体・半導体製造装置            |
| SEAGATE TECHNOLOGY              |  | 110           | 46     | 196    | 21,933  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| AON PLC                         |  | 80            | 34     | 442    | 49,245  | 保険                     |
| TE CONNECTIVITY LTD             |  | 119           | 48     | 378    | 42,194  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV |  | 76            | 35     | 145    | 16,201  | 資本財                    |
| INGERSOLL-RAND PLC              |  | 81            | 35     | 317    | 35,405  | 資本財                    |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD       |  | 63            | 26     | 98     | 10,964  | 耐久消費財・アパレル             |
| Delphi Automotive PLC           |  | 90            | 37     | 329    | 36,699  | 自動車・自動車部品              |
| EATON CORP PLC                  |  | 134           | 50     | 389    | 43,376  | 資本財                    |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C     |  | 196           | 87     | 262    | 29,277  | メディア                   |
| IHS MARKIT LTD                  |  | —             | 53     | 245    | 27,318  | 商業・専門サービス              |
| BROADCOM LTD                    |  | 114           | 48     | 1,168  | 130,118 | 半導体・半導体製造装置            |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC        |  | 45            | 17     | 259    | 28,882  | 保険                     |
| TECHNIPFMC PLC                  |  | —             | 60     | 176    | 19,633  | エネルギー                  |
| PERRIGO CO PLC                  |  | 44            | 23     | 164    | 18,325  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PENTAIR PLC                     |  | 64            | 29     | 195    | 21,760  | 資本財                    |
| TYCO INTERNATIONAL PLC          |  | 103           | —      | —      | —       | 商業・専門サービス              |
| MEDTRONIC PLC                   |  | 389           | 158    | 1,348  | 150,190 | ヘルスケア機器・サービス           |
| MYLAN NV                        |  | 131           | 63     | 252    | 28,122  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NIELSEN HOLDINGS PLC            |  | 99            | 55     | 213    | 23,789  | 商業・専門サービス              |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION    |  | —             | 109    | 460    | 51,218  | 資本財                    |
| ALLERGAN PLC                    |  | 114           | 44     | 995    | 110,820 | 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     | 87,243 | 35,800 | 246,237 | 27,416,115             |
|                                 |  | 銘 柄 数 < 比 率 > | 475    | 459    | —       | <58.7%>                |
| (カナダ)                           |  |               |        | 千カナダドル |         |                        |
| ARC RESOURCES LTD               |  | 159           | 67     | 120    | 9,971   | エネルギー                  |
| AGNICO EAGLE MINES LTD          |  | 66            | 28     | 188    | 15,617  | 素材                     |
| AGRIUM INC                      |  | 37            | 18     | 231    | 19,170  | 素材                     |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC    |  | 118           | 45     | 278    | 23,041  | 食品・生活必需品小売り            |
| BCE INC                         |  | 63            | 31     | 189    | 15,663  | 電気通信サービス               |
| BANK OF MONTREAL                |  | 142           | 54     | 494    | 40,920  | 銀行                     |
| BANK OF NOVA SCOTIA             |  | 313           | 120    | 911    | 75,336  | 銀行                     |
| BARRICK GOLD CORP               |  | 364           | 114    | 252    | 20,917  | 素材                     |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A    |  | 279           | 114    | 590    | 48,824  | 各種金融                   |
| CAE INC                         |  | 145           | 51     | 112    | 9,289   | 資本財                    |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B       |  | 14            | 5      | 166    | 13,782  | 素材                     |
| CAMECO CORP                     |  | 171           | 98     | 126    | 10,471  | エネルギー                  |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE     |  | 86            | 27     | 294    | 24,326  | 銀行                     |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO        |  | 213           | 85     | 888    | 73,470  | 運輸                     |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES      |  | 328           | 130    | 523    | 43,283  | エネルギー                  |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD    |  | 44            | 16     | 349    | 28,932  | 運輸                     |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A        |  | 27            | 9      | 149    | 12,379  | 小売                     |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A        |  | 76            | 27     | 112    | 9,320   | 公益事業                   |
| CENOVUS ENERGY INC              |  | 275           | 171    | 217    | 17,950  | エネルギー                  |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC      |  | 8             | 3      | 225    | 18,627  | ソフトウェア・サービス            |
| DOLLARAMA INC                   |  | 46            | 16     | 203    | 16,836  | 小売                     |
| ENCANA CORP                     |  | 350           | 152    | 220    | 18,243  | エネルギー                  |
| ENBRIDGE INC                    |  | 273           | 190    | 999    | 82,616  | エネルギー                  |
| FINNING INTERNATIONAL INC       |  | 110           | 48     | 124    | 10,278  | 資本財                    |
| FIRST CAPITAL REALTY INC        |  | 103           | 51     | 101    | 8,389   | 不動産                    |
| FORTIS INC                      |  | 116           | 64     | 286    | 23,710  | 公益事業                   |

| 銘<br>柄                       | 株<br>数 | 期首(前期末) | 当<br>期<br>末 |         | 業<br>種<br>等            |
|------------------------------|--------|---------|-------------|---------|------------------------|
|                              |        | 株<br>数  | 評<br>価<br>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      |                        |
| FRANCO-NEVADA CORP           | 34     | 18      | 185         | 15,305  | 素材                     |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        | 101    | 34      | 132         | 10,952  | 耐久消費財・アパレル             |
| GOLDCORP INC                 | 253    | 108     | 199         | 16,529  | 素材                     |
| GREAT-WEST LIFE CO INC       | 110    | 56      | 191         | 15,826  | 保険                     |
| CGI GROUP INC                | 77     | 33      | 220         | 18,225  | ソフトウェア・サービス            |
| HUSKY ENERGY INC             | 164    | 73      | 118         | 9,798   | エネルギー                  |
| IGM FINANCIAL INC            | 62     | 28      | 113         | 9,416   | 各種金融                   |
| IMPERIAL OIL LTD             | 114    | 52      | 201         | 16,701  | エネルギー                  |
| INTACT FINANCIAL CORP        | 36     | 19      | 185         | 15,378  | 保険                     |
| INTER PIPELINE LTD           | 145    | 67      | 178         | 14,733  | エネルギー                  |
| JEAN COUTU GROUP INC A       | 60     | 31      | 69          | 5,760   | 食品・生活必需品小売り            |
| KEYERA CORP                  | 70     | 32      | 132         | 10,983  | エネルギー                  |
| KINROSS GOLD CORP            | 447    | 199     | 113         | 9,403   | 素材                     |
| LOBLAW COMPANIES LTD         | 69     | 22      | 171         | 14,162  | 食品・生活必需品小売り            |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      | 116    | 43      | 265         | 21,986  | 自動車・自動車部品              |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      | 567    | 225     | 534         | 44,157  | 保険                     |
| METRO INC                    | 102    | 47      | 212         | 17,540  | 食品・生活必需品小売り            |
| NATIONAL BANK OF CANADA      | 95     | 45      | 240         | 19,861  | 銀行                     |
| ONEX CORPORATION             | 42     | 18      | 173         | 14,342  | 各種金融                   |
| OPEN TEXT CORP               | 50     | 49      | 217         | 17,962  | ソフトウェア・サービス            |
| PEMBINA PIPELINE CORP        | 126    | 58      | 253         | 20,935  | エネルギー                  |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN  | 246    | 118     | 265         | 21,962  | 素材                     |
| POWER CORP OF CANADA         | 113    | 71      | 206         | 17,050  | 保険                     |
| POWER FINANCIAL CORP         | 115    | 42      | 135         | 11,240  | 保険                     |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD       | —      | 47      | 140         | 11,634  | エネルギー                  |
| ROGERS COMMUNICATIONS -CL B  | 129    | 48      | 304         | 25,143  | 電気通信サービス               |
| ROYAL BANK OF CANADA         | 379    | 150     | 1,416       | 117,130 | 銀行                     |
| SNC-LAVALIN GROUP INC        | 64     | 25      | 129         | 10,729  | 資本財                    |
| SAPUTO INC                   | 108    | 45      | 199         | 16,514  | 食品・飲料・タバコ              |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B    | 168    | 78      | 224         | 18,562  | メディア                   |
| SILVER WHEATON CORP          | 108    | —       | —           | —       | 素材                     |
| SUN LIFE FINANCIAL INC       | 146    | 68      | 306         | 25,341  | 保険                     |
| SUNCOR ENERGY INC            | 456    | 197     | 839         | 69,439  | エネルギー                  |
| TELUS CORP                   | 99     | 25      | 117         | 9,688   | 電気通信サービス               |
| THOMSON REUTERS CORP         | 116    | 41      | 247         | 20,433  | 各種金融                   |
| TORONTO-DOMINION BANK        | 470    | 191     | 1,232       | 101,937 | 銀行                     |
| TRANSCANADA CORP             | 206    | 104     | 662         | 54,811  | エネルギー                  |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 552    | —       | —           | —       | 素材                     |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTE | 109    | —       | —           | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VERMILION ENERGY INC         | 46     | 25      | 110         | 9,170   | エネルギー                  |
| WESTON (GEORGE) LTD          | 26     | 7       | 85          | 7,110   | 食品・生活必需品小売り            |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | —      | 61      | 171         | 14,214  | 素材                     |
| YAMANA GOLD INC              | 376    | 183     | 68          | 5,639   | 素材                     |
| 小計                           | 株数・金額  | 10,834  | 4,550       | 19,338  | 1,599,095              |
| 銘柄数<比率>                      |        | 67      | 66          | —       | <3.4%>                 |
| (ユーロ…ドイツ)                    |        |         | 千ユーロ        |         |                        |
| ADIDAS AG                    | 65     | 22      | 393         | 48,852  | 耐久消費財・アパレル             |
| Fresenius SE & CO KG         | 121    | 51      | 394         | 49,039  | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 56     | 23      | 111         | 13,885  | ソフトウェア・サービス            |
| HANNOVER RUECK SE            | 26     | 11      | 119         | 14,873  | 保険                     |
| GEA GROUP AG                 | 76     | 36      | 136         | 16,952  | 資本財                    |
| CONTINENTAL AG               | 32     | 13      | 272         | 33,897  | 自動車・自動車部品              |

| 銘柄                             | 柄            | 期首(前期末) | 当 期 末 |        | 業 種 等     |                        |
|--------------------------------|--------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
|                                |              | 株 数     | 株 数   | 評 価 額  |           |                        |
|                                |              |         |       | 外貨建金額  |           | 邦貨換算金額                 |
| (ユーロ…ドイツ)                      |              | 百株      | 百株    | 千ユーロ   | 千円        |                        |
| DEUTSCHE POST AG               |              | 259     | 99    | 313    | 38,973    | 運輸                     |
| AXEL SPRINGER SE               |              | 31      | 13    | 75     | 9,329     | メディア                   |
| MERCK KGAA                     |              | 45      | 20    | 216    | 26,897    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RWE AG                         |              | 200     | 80    | 141    | 17,644    | 公益事業                   |
| SAP SE                         |              | 273     | 114   | 1,085  | 134,868   | ソフトウェア・サービス            |
| E.ON SE                        |              | 594     | 253   | 191    | 23,786    | 公益事業                   |
| HENKEL AG & CO KGAA            |              | 40      | 17    | 191    | 23,835    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| METRO AG                       |              | 76      | 25    | 78     | 9,711     | 食品・生活必需品小売り            |
| BAYER AG                       |              | 232     | 95    | 1,117  | 138,907   | 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   |              | 38      | 17    | 219    | 27,324    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| BASF SE                        |              | 240     | 102   | 859    | 106,885   | 素材                     |
| BEIERSDORF AG                  |              | 35      | 15    | 147    | 18,394    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HEIDELBERGCEMENT AG            |              | 46      | 22    | 187    | 23,351    | 素材                     |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co |              | 69      | 28    | 235    | 29,328    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ALLIANZ SE                     |              | 119     | 49    | 854    | 106,265   | 保険                     |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG         |              | 133     | 48    | 83     | 10,364    | 運輸                     |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG     |              | 36      | 12    | 220    | 27,439    | 保険                     |
| VOLKSWAGEN AG                  |              | 17      | 5     | 82     | 10,284    | 自動車・自動車部品              |
| VOLKSWAGEN AG PFD              |              | 48      | 22    | 307    | 38,221    | 自動車・自動車部品              |
| DAIMLER AG                     |              | 272     | 102   | 670    | 83,380    | 自動車・自動車部品              |
| THYSSENKRUPP AG                |              | 147     | 57    | 137    | 17,040    | 素材                     |
| SIEMENS AG                     |              | 218     | 89    | 1,129  | 140,385   | 資本財                    |
| LINDE AG                       |              | 50      | 22    | 390    | 48,539    | 素材                     |
| DEUTSCHE BANK AG -REG          |              | 419     | 220   | 364    | 45,257    | 各種金融                   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG    |              | 104     | 40    | 343    | 42,725    | 自動車・自動車部品              |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG        |              | 962     | 393   | 704    | 87,556    | 電気通信サービス               |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG       |              | 355     | 141   | 277    | 34,554    | 半導体・半導体製造装置            |
| DEUTSCHE BOERSE AG             |              | 55      | 25    | 228    | 28,367    | 各種金融                   |
| LANXESS                        |              | 46      | 16    | 105    | 13,068    | 素材                     |
| BRENTAG AG                     |              | 55      | 28    | 148    | 18,445    | 資本財                    |
| K+S AG                         |              | 75      | 39    | 90     | 11,274    | 素材                     |
| EVONIK INDUSTRIES AG           |              | 49      | 29    | 89     | 11,154    | 素材                     |
| HUGO BOSS AG -ORD              |              | 24      | 11    | 73     | 9,110     | 耐久消費財・アパレル             |
| COMMERZBANK AG                 |              | 415     | 167   | 156    | 19,508    | 銀行                     |
| VONOVIA SE                     |              | —       | 61    | 216    | 26,909    | 不動産                    |
| PROSIEBENSAT1 MEDIA SE         |              | 83      | 37    | 142    | 17,705    | メディア                   |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額    | 6,257   | 2,692 | 13,308 | 1,654,302 |                        |
|                                | 銘柄 数 < 比 率 > | 41      | 42    | —      | <3.5%>    |                        |
| (ユーロ…イタリア)                     |              |         |       |        |           |                        |
| ASSICURAZIONI GENERALI         |              | 334     | 166   | 239    | 29,720    | 保険                     |
| INTESA SANPAOLO                |              | 3,947   | 1,636 | 429    | 53,332    | 銀行                     |
| MEDIOBANCA SPA                 |              | 311     | 99    | 88     | 10,998    | 銀行                     |
| LUXOTTICA GROUP SPA            |              | 68      | 26    | 142    | 17,752    | 耐久消費財・アパレル             |
| ENEL SPA                       |              | 2,012   | 976   | 469    | 58,375    | 公益事業                   |
| ENI SPA                        |              | 700     | 324   | 464    | 57,718    | エネルギー                  |
| SNAM SPA                       |              | 765     | 424   | 173    | 21,558    | エネルギー                  |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA  |              | 518     | —     | —      | —         | 銀行                     |
| TELECOM ITALIA SPA             |              | 4,367   | 1,714 | 147    | 18,317    | 電気通信サービス               |
| TELECOM ITALIA-RNC             |              | 2,870   | 1,381 | 97     | 12,088    | 電気通信サービス               |
| ATLANTIA S.P.A                 |              | 154     | 61    | 151    | 18,852    | 運輸                     |
| TERNA SPA                      |              | 616     | 264   | 133    | 16,578    | 公益事業                   |
| UNICREDIT SPA                  |              | 1,617   | —     | —      | —         | 銀行                     |

| 銘柄                                  | 株数    | 金額     | 株数    | 金額      | 業種等                    |
|-------------------------------------|-------|--------|-------|---------|------------------------|
|                                     |       |        |       |         |                        |
| (ユーロ…イタリア)                          | 百株    | 百株     | 千ユーロ  | 千円      |                        |
| UNICREDIT SPA                       | —     | 105    | 174   | 21,749  | 銀行                     |
| 小計                                  | 株数・金額 | 18,285 | 7,182 | 2,711   | 337,042                |
| 銘柄数＜比率＞                             | 13    | 12     | —     | <0.7%>  |                        |
| (ユーロ…フランス)                          |       |        |       |         |                        |
| BOUYGUES                            | 47    | 39     | 148   | 18,488  | 資本財                    |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                | 151   | 75     | 149   | 18,630  | 公益事業                   |
| L'OREAL                             | 64    | 23     | 447   | 55,566  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| CHRISTIAN DIOR SE                   | 16    | 7      | 187   | 23,363  | 耐久消費財・アパレル             |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 76    | 32     | 733   | 91,129  | 耐久消費財・アパレル             |
| THALES SA                           | 38    | 15     | 150   | 18,746  | 資本財                    |
| CAP GEMINI SA                       | 41    | 21     | 197   | 24,604  | ソフトウェア・サービス            |
| CASINO GUICHARD PERRACHON           | 26    | 11     | 60    | 7,576   | 食品・生活必需品小売り            |
| PUBLICIS GROUPE                     | 64    | 30     | 206   | 25,630  | メディア                   |
| LAGARDERE S.C.A                     | 64    | 24     | 68    | 8,527   | メディア                   |
| MICHELIN (CGDE)-B                   | 44    | 20     | 233   | 29,047  | 自動車・自動車部品              |
| PERNOD-RICARD                       | 51    | 23     | 277   | 34,438  | 食品・飲料・タバコ              |
| RENAULT SA                          | 58    | 23     | 195   | 24,290  | 自動車・自動車部品              |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               | 152   | 61     | 427   | 53,084  | 資本財                    |
| VIVENDI SA                          | 292   | 134    | 263   | 32,744  | メディア                   |
| TECHNIP S.A.                        | 43    | —      | —     | —       | エネルギー                  |
| VALEO SA                            | 29    | —      | —     | —       | 自動車・自動車部品              |
| ORANGE                              | 574   | 228    | 359   | 44,728  | 電気通信サービス               |
| HERMES INTERNATIONAL                | 7     | 3      | 164   | 20,414  | 耐久消費財・アパレル             |
| BIC                                 | 11    | 4      | 50    | 6,258   | 商業・専門サービス              |
| DASSAULT SYSTEMES SA                | 42    | 21     | 174   | 21,707  | ソフトウェア・サービス            |
| KERING                              | 25    | 10     | 295   | 36,716  | 耐久消費財・アパレル             |
| CNP ASSURANCES                      | 103   | 34     | 66    | 8,296   | 保険                     |
| CARREFOUR SA                        | 142   | 71     | 165   | 20,516  | 食品・生活必需品小売り            |
| ATOS SE                             | 33    | 15     | 186   | 23,145  | ソフトウェア・サービス            |
| SANOFI                              | 318   | 131    | 1,149 | 142,891 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ACCOR SA                            | 82    | 30     | 130   | 16,210  | 消費者サービス                |
| SOCIETE GENERALE-A                  | 222   | 95     | 468   | 58,269  | 銀行                     |
| SODEXO                              | 31    | 13     | 163   | 20,354  | 消費者サービス                |
| AXA                                 | 515   | 213    | 505   | 62,784  | 保険                     |
| ESSILOR INTERNATIONAL               | 52    | 24     | 292   | 36,380  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CREDIT AGRICOLE SA                  | 392   | 161    | 234   | 29,088  | 銀行                     |
| ZODIAC AEROSPACE                    | 87    | 37     | 87    | 10,926  | 資本財                    |
| BNP PARIBAS                         | 308   | 136    | 905   | 112,610 | 銀行                     |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN           | 119   | 58     | 291   | 36,188  | 資本財                    |
| Wendel                              | 18    | 5      | 74    | 9,229   | 各種金融                   |
| Iliad SA                            | 11    | 4      | 101   | 12,635  | 電気通信サービス               |
| IMERYS SA                           | 23    | 9      | 75    | 9,442   | 素材                     |
| SAFRAN SA                           | 86    | 36     | 290   | 36,149  | 資本財                    |
| ENGIE                               | 291   | 160    | 212   | 26,361  | 公益事業                   |
| ALSTOM                              | 88    | 27     | 86    | 10,810  | 資本財                    |
| Eutelsat Communications             | 85    | 32     | 75    | 9,381   | メディア                   |
| ELECTRICITE DE FRANCE               | 100   | 58     | 56    | 6,977   | 公益事業                   |
| Arkema SA                           | 32    | 12     | 119   | 14,804  | 素材                     |
| Legrand SA                          | 65    | 24     | 150   | 18,763  | 資本財                    |
| TOTAL SA                            | 576   | 241    | 1,145 | 142,386 | エネルギー                  |
| Natixis                             | 457   | 198    | 121   | 15,074  | 銀行                     |
| SCOR SE                             | 72    | 31     | 110   | 13,743  | 保険                     |

| 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 |
| (ユーロ…フランス)                          | 百株      | 百株    | 千ユーロ    | 千円      |                        |        |
| REXEL SA                            | 136     | 55    | 86      | 10,730  | 資本財                    |        |
| VINCI S.A.                          | 125     | 60    | 467     | 58,115  | 資本財                    |        |
| DANONE                              | 139     | 65    | 436     | 54,224  | 食品・飲料・タバコ              |        |
| AIR LIQUIDE                         | 84      | 43    | 480     | 59,674  | 素材                     |        |
| Bureau Veritas SA                   | 120     | 56    | 121     | 15,066  | 商業・専門サービス              |        |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR         | 224     | 83    | 87      | 10,900  | 運輸                     |        |
| SUEZ                                | 147     | 58    | 94      | 11,764  | 公益事業                   |        |
| EDENRED                             | 103     | 36    | 84      | 10,548  | 商業・専門サービス              |        |
| VALEO SA                            | —       | 35    | 233     | 29,029  | 自動車・自動車部品              |        |
| 小計                                  | 株数・金額   | 7,331 | 3,172   | 14,152  | 1,759,171              |        |
|                                     | 銘柄数＜比率＞ | 56    | 55      | —       | <3.8%>                 |        |
| (ユーロ…オランダ)                          |         |       |         |         |                        |        |
| AIRBUS SE                           | 169     | 74    | 554     | 68,874  | 資本財                    |        |
| RELX NV                             | 319     | 109   | 200     | 24,887  | 商業・専門サービス              |        |
| RANDSTAD HOLDING NV                 | 54      | 22    | 115     | 14,399  | 商業・専門サービス              |        |
| AKZO NOBEL                          | 57      | 30    | 232     | 28,892  | 素材                     |        |
| WOLTERS KLUWER                      | 109     | 45    | 178     | 22,150  | 商業・専門サービス              |        |
| QIAGEN N.V.                         | 112     | —     | —       | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |        |
| Koninklijke Vopak NV                | 35      | 14    | 59      | 7,457   | エネルギー                  |        |
| AEGON NV                            | 644     | 338   | 149     | 18,522  | 保険                     |        |
| KONINKLIJKE KPN NV                  | 1,194   | 511   | 155     | 19,336  | 電気通信サービス               |        |
| STMICROELECTRONICS NV               | 259     | 96    | 141     | 17,626  | 半導体・半導体製造装置            |        |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV              | 266     | 115   | 363     | 45,161  | 資本財                    |        |
| ING GROEP N.V.                      | 1,171   | —     | —       | —       | 銀行                     |        |
| HEINEKEN NV                         | 62      | 23    | 208     | 25,945  | 食品・飲料・タバコ              |        |
| HEINEKEN HOLDING NV                 | 41      | 18    | 156     | 19,424  | 食品・飲料・タバコ              |        |
| KONINKLIJKE DSM NV                  | 58      | 29    | 192     | 23,947  | 素材                     |        |
| UNILEVER NV-CVA                     | 449     | 187   | 946     | 117,626 | 家庭用品・パーソナル用品           |        |
| Koninklijke Boskalis Westminster NV | 46      | 14    | 45      | 5,675   | 資本財                    |        |
| ASML HOLDING NV                     | 103     | 43    | 525     | 65,357  | 半導体・半導体製造装置            |        |
| GEMALTO                             | 36      | 18    | 96      | 11,941  | ソフトウェア・サービス            |        |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV       | —       | 126   | 250     | 31,175  | 食品・生活必需品小売り            |        |
| CNH INDUSTRIAL NV                   | 412     | 152   | 156     | 19,421  | 資本財                    |        |
| KONINKLIJKE AHOLD NV                | 210     | —     | —       | —       | 食品・生活必需品小売り            |        |
| QIAGEN N.V.                         | —       | 41    | 120     | 15,020  | 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   | 726     | 90,328  | 銀行                     |        |
| 小計                                  | 株数・金額   | 5,817 | 2,493   | 5,576   | 693,174                |        |
|                                     | 銘柄数＜比率＞ | 21    | 21      | —       | <1.5%>                 |        |
| (ユーロ…スペイン)                          |         |       |         |         |                        |        |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA         | 212     | 95    | 156     | 19,478  | 運輸                     |        |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA        | 1,975   | 833   | 621     | 77,211  | 銀行                     |        |
| GAS NATURAL SDG SA                  | 152     | 61    | 134     | 16,688  | 公益事業                   |        |
| REPSOL SA                           | 393     | 161   | 241     | 30,026  | エネルギー                  |        |
| BANCO SANTANDER S.A.                | 4,269   | 1,762 | 1,033   | 128,505 | 銀行                     |        |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA        | 39      | —     | —       | —       | 公益事業                   |        |
| TELEFONICA SA                       | 1,360   | 569   | 572     | 71,146  | 電気通信サービス               |        |
| ENAGAS SA                           | 95      | 38    | 99      | 12,365  | エネルギー                  |        |
| FERROVIAL SA                        | 170     | 76    | 155     | 19,269  | 資本財                    |        |
| MAPFRE S.A.                         | 718     | 232   | 72      | 9,034   | 保険                     |        |
| IBERDROLA SA                        | 1,435   | 703   | 493     | 61,284  | 公益事業                   |        |
| AMADEUS IT GROUP SA-A SHS           | 137     | 59    | 299     | 37,239  | ソフトウェア・サービス            |        |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL         | 363     | 136   | 75      | 9,325   | 食品・生活必需品小売り            |        |

| 銘                            | 柄             | 期首(前期末) | 当 期   |       | 業 種 等                  |
|------------------------------|---------------|---------|-------|-------|------------------------|
|                              |               | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |                        |
|                              |               |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額                 |
| (ユーロ…スペイン)                   |               | 百株      | 百株    | 千ユーロ  | 千円                     |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA |               | —       | 81    | 159   | 19,851                 |
| FERROVIAL SA - RTS           |               | 170     | —     | —     | —                      |
| INDITEX                      |               | 327     | 139   | 505   | 62,796                 |
| GRIFOLS SA                   |               | 127     | 53    | 132   | 16,409                 |
|                              |               |         |       |       | 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     | 11,952  | 5,004 | 4,751 | 590,635                |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 16      | 15    | —     | < 1.3% >               |
| (ユーロ…ベルギー)                   |               |         |       |       |                        |
| UMICORE                      |               | 41      | 16    | 101   | 12,609                 |
| DELHAIZE GROUP               |               | 30      | —     | —     | —                      |
| KBC GROEP NV                 |               | 90      | 34    | 229   | 28,577                 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV         |               | 221     | —     | —     | —                      |
| SOLVAY SA                    |               | 28      | 10    | 129   | 16,035                 |
| UCB SA                       |               | 46      | 19    | 120   | 14,923                 |
| COLRUYT SA                   |               | 23      | 3     | 18    | 2,296                  |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA  |               | 13      | 11    | 102   | 12,739                 |
| PROXIMUS                     |               | 66      | 28    | 93    | 11,653                 |
| AGEAS                        |               | 81      | 34    | 130   | 16,260                 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV   |               | —       | 87    | 919   | 114,313                |
|                              |               |         |       |       | 素材                     |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 644     | 248   | 1,845 | 229,411                |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 10      | 9     | —     | < 0.5% >               |
| (ユーロ…オーストリア)                 |               |         |       |       |                        |
| OMV AG                       |               | 68      | 26    | 127   | 15,805                 |
| VOESTALPINE AG               |               | 50      | 20    | 85    | 10,662                 |
| ERSTE GROUP BANK AG          |               | 116     | 45    | 153   | 19,063                 |
|                              |               |         |       |       | 銀行                     |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 236     | 92    | 366   | 45,530                 |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 3       | 3     | —     | < 0.1% >               |
| (ユーロ…ルクセンブルク)                |               |         |       |       |                        |
| TENARIS SA                   |               | 199     | 87    | 121   | 15,125                 |
| SES SA                       |               | 97      | 68    | 148   | 18,517                 |
|                              |               |         |       |       | エネルギー                  |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 296     | 155   | 270   | 33,642                 |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2       | 2     | —     | < 0.1% >               |
| (ユーロ…フィンランド)                 |               |         |       |       |                        |
| WARTSILA                     |               | 54      | 28    | 150   | 18,672                 |
| UPM-KYMMENE OYJ              |               | 158     | 60    | 151   | 18,832                 |
| STORA ENSO OYJ-R SHS         |               | 228     | 104   | 119   | 14,878                 |
| SAMPO OYJ-A SHS              |               | 68      | 27    | 125   | 15,584                 |
| FORTUM OYJ                   |               | 100     | 34    | 48    | 6,019                  |
| ELISA OYJ                    |               | 67      | 25    | 89    | 11,185                 |
| METSO OYJ                    |               | 49      | 22    | 69    | 8,612                  |
| NOKIA OYJ                    |               | 1,637   | 722   | 414   | 51,531                 |
| NESTE OYJ                    |               | 61      | 26    | 97    | 12,088                 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ           |               | 48      | 19    | 74    | 9,217                  |
| KONE OYJ-B                   |               | 87      | 31    | 141   | 17,537                 |
| ORION OYJ                    |               | 37      | 17    | 103   | 12,848                 |
|                              |               |         |       |       | 自動車・自動車部品              |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 2,599   | 1,121 | 1,584 | 197,006                |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 12      | 12    | —     | < 0.4% >               |
| (ユーロ…アイルランド)                 |               |         |       |       |                        |
| CRH PLC(DUBLIN)              |               | 268     | 109   | 349   | 43,382                 |
| KERRY GROUP PLC-A            |               | 55      | 25    | 203   | 25,336                 |
|                              |               |         |       |       | 素材                     |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 324     | 135   | 552   | 68,719                 |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2       | 2     | —     | < 0.1% >               |

| 銘柄                           | 株数     | 株数     | 期末     |           | 業種等                    |
|------------------------------|--------|--------|--------|-----------|------------------------|
|                              |        |        | 評価額    | 評価額       |                        |
| 銘柄                           | 株数     | 株数     | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    | 業種等                    |
| (ユーロ…ポルトガル)                  | 百株     | 百株     | 千ユーロ   | 千円        |                        |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA      | 820    | 464    | 148    | 18,437    | 公益事業                   |
| Galp Energia SGPS SA         | 193    | 90     | 125    | 15,601    | エネルギー                  |
| JERONIMO MARTINS             | 113    | 48     | 83     | 10,368    | 食品・生活必需品小売り            |
| 小計                           | 1,126  | 602    | 357    | 44,407    |                        |
| 銘柄数＜比率＞                      | 3      | 3      | —      | <0.1%＞    |                        |
| (ユーロ…その他)                    | —      | —      | —      | —         |                        |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  | —      | 40     | 151    | 18,878    | 食品・飲料・タバコ              |
| 小計                           | —      | 40     | 151    | 18,878    |                        |
| 銘柄数＜比率＞                      | —      | 1      | —      | <0.0%＞    |                        |
| ユーロ計                         | 54,871 | 22,942 | 45,630 | 5,671,923 |                        |
| 銘柄数＜比率＞                      | 179    | 177    | —      | <12.1%＞   |                        |
| (イギリス)                       | —      | —      | 千英ポンド  | —         |                        |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC      | 475    | 164    | 48     | 6,890     | 各種金融                   |
| Antofagasta PLC              | 242    | 83     | 69     | 9,850     | 素材                     |
| ASHTREAD GROUP PLC           | 215    | 75     | 119    | 17,004    | 資本財                    |
| BHP BILLITON PLC             | 629    | 269    | 324    | 46,296    | 素材                     |
| ARM HOLDINGS PLC             | 426    | —      | —      | —         | 半導体・半導体製造装置            |
| SKY PLC                      | 332    | 162    | 161    | 23,114    | メディア                   |
| AVIVA PLC                    | 1,082  | 420    | 221    | 31,573    | 保険                     |
| DIAGEO PLC                   | 643    | 270    | 631    | 90,175    | 食品・飲料・タバコ              |
| SCHRODERS PLC                | 60     | 26     | 85     | 12,171    | 各種金融                   |
| BAE SYSTEMS PLC              | 782    | 343    | 228    | 32,663    | 資本財                    |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 510    | 211    | 1,184  | 169,045   | 食品・飲料・タバコ              |
| STANDARD CHARTERED PLC       | 1,016  | 426    | 312    | 44,634    | 銀行                     |
| IMPERIAL BRANDS PLC          | 263    | 101    | 375    | 53,513    | 食品・飲料・タバコ              |
| SABMILLER PLC                | 253    | —      | —      | —         | 食品・飲料・タバコ              |
| HSBC HOLDINGS PLC            | 5,360  | 2,266  | 1,529  | 218,324   | 銀行                     |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC    | 1,637  | 585    | 146    | 20,928    | 保険                     |
| MEGGITT PLC                  | 382    | 151    | 76     | 10,902    | 資本財                    |
| MORRISON <WM.> SUPERMARKETS  | 879    | 428    | 105    | 15,121    | 食品・生活必需品小売り            |
| Associated British Foods PLC | 98     | 51     | 152    | 21,709    | 食品・飲料・タバコ              |
| PEARSON PLC                  | 281    | 140    | 98     | 14,010    | メディア                   |
| PERSIMMON PLC                | 104    | 41     | 100    | 14,352    | 耐久消費財・アパレル             |
| PRUDENTIAL PLC               | 765    | 302    | 528    | 75,391    | 保険                     |
| RIO TINTO PLC                | 334    | 145    | 464    | 66,228    | 素材                     |
| TRAVIS PERKINS PLC           | 83     | 51     | 84     | 12,050    | 資本財                    |
| SSE PLC                      | 214    | 79     | 121    | 17,327    | 公益事業                   |
| BP PLC                       | 5,099  | 2,173  | 1,031  | 147,188   | エネルギー                  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC     | 16,568 | 7,596  | 544    | 77,767    | 銀行                     |
| TATE & LYLE PLC              | 174    | 90     | 66     | 9,496     | 食品・飲料・タバコ              |
| TESCO PLC                    | 2,506  | 1,069  | 199    | 28,520    | 食品・生活必需品小売り            |
| SMITH & NEPHEW PLC           | 216    | 102    | 139    | 19,851    | ヘルスケア機器・サービス           |
| GLAXOSMITHKLINE PLC          | 1,329  | 520    | 856    | 122,177   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WEIR GROUP PLC/THE           | 108    | 41     | 77     | 11,050    | 資本財                    |
| ASTRAZENECA PLC              | 337    | 142    | 746    | 106,461   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GKN PLC                      | 701    | 313    | 110    | 15,834    | 自動車・自動車部品              |
| BT GROUP PLC                 | 2,436  | 947    | 297    | 42,434    | 電気通信サービス               |
| CARNIVAL PLC                 | 73     | 29     | 143    | 20,542    | 消費者サービス                |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC    | 282    | 246    | 95     | 13,583    | 小売                     |
| BARCLAYS PLC                 | 4,865  | 2,142  | 453    | 64,711    | 銀行                     |
| INTERTEK GROUP PLC           | 68     | 30     | 130    | 18,681    | 商業・専門サービス              |
| WILLIAM HILL PLC             | 450    | —      | —      | —         | 消費者サービス                |

| 銘柄                                | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       | 業 種 等   |                        |
|-----------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                                   |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |
|                                   |   |         |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額                 |
| (イギリス)                            |   | 百株      | 百株    | 千英ポンド | 千円      |                        |
| BURBERRY GROUP PLC                |   | 159     | 67    | 119   | 17,098  | 耐久消費財・アパレル             |
| NEXT PLC                          |   | 41      | 20    | 89    | 12,787  | 小売                     |
| KINGFISHER PLC                    |   | 686     | 227   | 74    | 10,673  | 小売                     |
| ICAP PLC                          |   | 248     | —     | —     | —       | 各種金融                   |
| ITV PLC                           |   | 1,416   | 545   | 109   | 15,581  | メディア                   |
| SAINSBURY (J) PLC                 |   | 449     | 274   | 77    | 11,024  | 食品・生活必需品小売り            |
| RANDGOLD RESOURCES LTD            |   | 18      | 14    | 101   | 14,445  | 素材                     |
| G4S PLC                           |   | 775     | 296   | 97    | 13,894  | 商業・専門サービス              |
| ADMIRAL GROUP PLC                 |   | 101     | 41    | 82    | 11,839  | 保険                     |
| CENTRICA PLC                      |   | 1,441   | 770   | 156   | 22,331  | 公益事業                   |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS       |   | 1,047   | 470   | 995   | 142,112 | エネルギー                  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS       |   | 1,152   | 450   | 976   | 139,372 | エネルギー                  |
| BUNZL PLC                         |   | 76      | 42    | 103   | 14,779  | 資本財                    |
| COBHAM PLC                        |   | 435     | —     | —     | —       | 資本財                    |
| NATIONAL GRID PLC                 |   | 969     | —     | —     | —       | 公益事業                   |
| London Stock Exchange Group PLC   |   | 117     | 48    | 164   | 23,464  | 各種金融                   |
| UNILEVER PLC                      |   | 349     | 145   | 627   | 89,547  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EXPERIAN PLC                      |   | 226     | 101   | 167   | 23,850  | 商業・専門サービス              |
| SEVERN TRENT PLC                  |   | 100     | 43    | 109   | 15,660  | 公益事業                   |
| Whitbread PLC                     |   | 65      | 31    | 135   | 19,291  | 消費者サービス                |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC           |   | 135     | 50    | 69    | 9,987   | 各種金融                   |
| SMITHS GROUP PLC                  |   | 179     | 75    | 119   | 17,026  | 資本財                    |
| 3I GROUP PLC                      |   | 401     | 144   | 125   | 17,883  | 各種金融                   |
| CAPITA PLC                        |   | 185     | 151   | 86    | 12,284  | 商業・専門サービス              |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       |   | 172     | 68    | 541   | 77,334  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| RELX PLC                          |   | 363     | 113   | 188   | 26,890  | 商業・専門サービス              |
| SHIRE PLC                         |   | 179     | 104   | 486   | 69,430  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| Fresnillo PLC                     |   | 104     | 40    | 64    | 9,243   | 素材                     |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC        |   | 205     | 127   | 132   | 18,860  | 公益事業                   |
| GLENCORE PLC                      |   | 3,834   | 1,549 | 453   | 64,667  | 素材                     |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC          |   | 538     | 248   | 217   | 30,984  | 資本財                    |
| OLD MUTUAL PLC                    |   | 1,770   | 694   | 136   | 19,490  | 保険                     |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROU       |   | 1,240   | 575   | 150   | 21,473  | 銀行                     |
| SAGE GROUP PLC/THE                |   | 365     | 173   | 123   | 17,661  | ソフトウェア・サービス            |
| WPP PLC                           |   | 385     | 139   | 241   | 34,518  | メディア                   |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC |   | —       | 27    | 119   | 17,004  | 消費者サービス                |
| NATIONAL GRID PLC                 |   | —       | 358   | 391   | 55,847  | 公益事業                   |
| ROYAL MAIL PLC                    |   | 230     | 104   | 45    | 6,533   | 運輸                     |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-        |   | 373     | 131   | 68    | 9,742   | 消費者サービス                |
| WOLSELEY PLC                      |   | 88      | 36    | 183   | 26,122  | 資本財                    |
| IMI PLC                           |   | 135     | 64    | 79    | 11,414  | 資本財                    |
| VODAFONE GROUP PLC                |   | 7,351   | 2,927 | 673   | 96,171  | 電気通信サービス               |
| AGGREKO PLC                       |   | 117     | —     | —     | —       | 商業・専門サービス              |
| RSA INSURANCE GROUP PLC           |   | 446     | 182   | 113   | 16,151  | 保険                     |
| COMPASS GROUP PLC                 |   | 497     | 214   | 352   | 50,293  | 消費者サービス                |
| REXAM PLC                         |   | 284     | —     | —     | —       | 素材                     |
| STANDARD LIFE PLC                 |   | 542     | 270   | 103   | 14,794  | 保険                     |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP       |   | 581     | 173   | 60    | 8,562   | 保険                     |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC |   | 77      | —     | —     | —       | 消費者サービス                |
| CRODA INTERNATIONAL PLC           |   | 54      | 23    | 93    | 13,303  | 素材                     |

| 銘柄                                 |               | 期首(前期末) | 当 期 末  |             | 業 種 等     |                        |
|------------------------------------|---------------|---------|--------|-------------|-----------|------------------------|
|                                    |               | 株 数     | 株 数    | 評 価 額       |           |                        |
|                                    |               |         |        | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |                        |
| (イギリス)                             |               | 百株      | 百株     | 千英ポンド       | 千円        |                        |
| JOHNSON MATTHEY PLC                |               | 71      | 36     | 114         | 16,346    | 素材                     |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額     | 83,090  | 34,652 | 21,789      | 3,109,363 |                        |
|                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 89      | 82     | —           | <6.7%>    |                        |
| (スイス)                              |               |         |        | 千スイスフラン     |           |                        |
| SIKA AG-BR                         |               | 0.84    | 0.35   | 218         | 24,916    | 素材                     |
| SGS SA                             |               | 1       | 0.75   | 173         | 19,833    | 商業・専門サービス              |
| SWISSCOM AG-REG                    |               | 9       | 4      | 199         | 22,791    | 電気通信サービス               |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG        |               | 0.04    | 0.02   | 142         | 16,298    | 食品・飲料・タバコ              |
| GIVAUDAN-REG                       |               | 2       | 1      | 227         | 26,007    | 素材                     |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG          |               | 39      | 17     | 494         | 56,481    | 保険                     |
| NOVARTIS AG-REG SHS                |               | 630     | 258    | 2,031       | 232,010   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ABB LTD                            |               | 608     | 228    | 556         | 63,501    | 資本財                    |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSS           |               | 195     | 82     | 2,211       | 252,533   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADECCO GROUP AG(REG)               |               | 54      | 27     | 199         | 22,763    | 商業・専門サービス              |
| LAFARGEHOLCIM LTD                  |               | 148     | 61     | 359         | 41,065    | 素材                     |
| NESTLE SA-REGISTERED               |               | 869     | 363    | 3,008       | 343,533   | 食品・飲料・タバコ              |
| SONOVA HOLDING AG                  |               | 23      | 9      | 147         | 16,833    | ヘルスケア機器・サービス           |
| CREDIT SUISSE GROUP AG             |               | 535     | 257    | 351         | 40,172    | 各種金融                   |
| THE SWATCH GROUP AG-B              |               | 11      | 5      | 196         | 22,471    | 耐久消費財・アパレル             |
| LONZA GROUP AG-REG                 |               | 21      | 10     | 217         | 24,836    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SWISS LIFE HOLDING AG              |               | 13      | 5      | 182         | 20,796    | 保険                     |
| Schindler Holding AG               |               | 18      | 7      | 162         | 18,503    | 資本財                    |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG         |               | 22      | 7      | 113         | 12,919    | 運輸                     |
| GEBERIT AG-REG                     |               | 13      | 4      | 221         | 25,273    | 資本財                    |
| Actelion Ltd                       |               | 32      | —      | —           | —         | 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              |               | 83      | 38     | 196         | 22,406    | 各種金融                   |
| SWISS RE AG                        |               | 82      | 29     | 260         | 29,743    | 保険                     |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-REG        |               | 147     | 64     | 527         | 60,227    | 耐久消費財・アパレル             |
| ACTELION LTD-NEW LINE              |               | —       | 15     | 425         | 48,630    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| UBS GROUP AG                       |               | 1,090   | 453    | 718         | 82,090    | 各種金融                   |
| Credit Suisse Group AG - RTS       |               | —       | 257    | 13          | 1,525     | 各種金融                   |
| SYNGENTA AG-2ND LINE               |               | 26      | —      | —           | —         | 素材                     |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額     | 4,719   | 2,212  | 13,558      | 1,548,163 |                        |
|                                    | 銘 柄 数 < 比 率 > | 27      | 26     | —           | <3.3%>    |                        |
| (スウェーデン)                           |               |         |        | 千スウェーデンクローネ |           |                        |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A       |               | 407     | 155    | 1,641       | 21,005    | 銀行                     |
| Swedbank AB                        |               | 239     | 88     | 1,803       | 23,083    | 銀行                     |
| SWEDISH MATCH AB                   |               | 88      | 38     | 1,145       | 14,665    | 食品・飲料・タバコ              |
| NORDEA BANK AB                     |               | 756     | 365    | 4,134       | 52,923    | 銀行                     |
| SECURITAS AB-B SHS                 |               | 153     | 60     | 833         | 10,667    | 商業・専門サービス              |
| INVESTOR AB-B SHS                  |               | 102     | 33     | 1,352       | 17,306    | 各種金融                   |
| HENNES & MAURITZ AB-B              |               | 238     | 87     | 1,946       | 24,911    | 小売                     |
| ERICSSON LM-B SHS                  |               | 871     | 399    | 2,448       | 31,337    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TELIA COMPANY AB                   |               | 620     | 138    | 549         | 7,032     | 電気通信サービス               |
| SKANSKA AB-B SHS                   |               | 93      | 58     | 1,193       | 15,283    | 資本財                    |
| LUNDIN PETROLEUM AB                |               | 93      | 40     | 695         | 8,907     | エネルギー                  |
| ALFA LAVAL AB                      |               | 146     | 50     | 882         | 11,297    | 資本財                    |
| GETINGE AB-B SHS                   |               | 98      | 39     | 711         | 9,102     | ヘルスケア機器・サービス           |
| Millicom International Cellular SA |               | 35      | 14     | 766         | 9,811     | 電気通信サービス               |
| SKF AB-B SHARES                    |               | 164     | 77     | 1,367       | 17,505    | 資本財                    |
| VOLVO AB-B SHS                     |               | 437     | 205    | 2,929       | 37,495    | 資本財                    |

| 銘柄                            | 株数    | 株数    | 期末          |         | 業種等                    |
|-------------------------------|-------|-------|-------------|---------|------------------------|
|                               |       |       | 当           | 期       |                        |
|                               |       |       | 期末          |         |                        |
|                               |       |       | 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      |                        |
| SANDVIK AB                    | 353   | 160   | 2,176       | 27,856  | 資本財                    |
| Industriervarden AB           | 96    | 34    | 695         | 8,907   | 各種金融                   |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS    | 168   | 74    | 2,245       | 28,746  | 家庭用品・パーソナル用品           |
| Boliden AB                    | 130   | 49    | 1,218       | 15,590  | 素材                     |
| TELE2 AB-B SHS                | 179   | 74    | 672         | 8,603   | 電気通信サービス               |
| KINNEVIK AB-B                 | 88    | 28    | 685         | 8,773   | 各種金融                   |
| ATLAS COPCO AB-A SHS          | 175   | 72    | 2,296       | 29,389  | 資本財                    |
| ATLAS COPCO AB-B SHS          | 142   | 64    | 1,831       | 23,446  | 資本財                    |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS   | 426   | 204   | 2,500       | 32,002  | 銀行                     |
| ASSA ABLOY AB-B               | 276   | 115   | 2,217       | 28,387  | 資本財                    |
| INVESTMENT AB KINNEVIK-RED    | 88    | —     | —           | —       | 各種金融                   |
| 小計                            | 株数・金額 | 6,672 | 2,732       | 40,940  | 524,043                |
| 銘柄数＜比率＞                       |       | 27    | 26          | —       | <1.1%＞                 |
| (ノルウェー)                       |       |       | 千ノルウェークローネ  |         |                        |
| DNB ASA                       | 358   | 140   | 2,046       | 27,141  | 銀行                     |
| TELENOR ASA                   | 234   | 96    | 1,336       | 17,722  | 電気通信サービス               |
| STATOIL ASA                   | 301   | 129   | 1,931       | 25,612  | エネルギー                  |
| YARA INTERNATIONAL ASA        | 57    | 35    | 1,139       | 15,114  | 素材                     |
| NORSK HYDRO ASA               | 419   | 246   | 1,169       | 15,509  | 素材                     |
| ORKLA ASA                     | 279   | 135   | 1,159       | 15,381  | 食品・飲料・タバコ              |
| 小計                            | 株数・金額 | 1,650 | 784         | 8,784   | 116,482                |
| 銘柄数＜比率＞                       |       | 6     | 6           | —       | <0.2%＞                 |
| (デンマーク)                       |       |       | 千デンマーククローネ  |         |                        |
| CARLSBERG AS-B                | 41    | 17    | 1,230       | 20,549  | 食品・飲料・タバコ              |
| A. P. MOLLER MAERSK           | 1     | 0.89  | 1,110       | 18,549  | 運輸                     |
| A P Moller - Maersk A/S       | 1     | 0.77  | 917         | 15,315  | 運輸                     |
| DANSKE BANK A/S               | 245   | 100   | 2,529       | 42,244  | 銀行                     |
| TDC A/S                       | 358   | 226   | 866         | 14,468  | 電気通信サービス               |
| DSV A/S                       | 80    | 33    | 1,317       | 22,009  | 運輸                     |
| PANDORA A/S                   | 40    | 19    | 1,252       | 20,910  | 耐久消費財・アパレル             |
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S  | 46    | 22    | 1,067       | 17,833  | 素材                     |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES        | 81    | 41    | 1,224       | 20,441  | 素材                     |
| COLOPLAST-B                   | 39    | 22    | 1,256       | 20,976  | ヘルスケア機器・サービス           |
| NOVO NORDISK A/S-B            | 585   | 240   | 6,675       | 111,474 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WILLIAM DEMANT HOLDING        | 93    | 39    | 666         | 11,128  | ヘルスケア機器・サービス           |
| 小計                            | 株数・金額 | 1,618 | 766         | 20,113  | 335,900                |
| 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 | 826   | 356   | 1,005       | 83,325  | 銀行                     |
| AMCOR LTD                     | 414   | 182   | 281         | 23,339  | 素材                     |
| WESTPAC BANKING CORPORATION   | 970   | 390   | 1,188       | 98,482  | 銀行                     |
| TELSTRA CORP LTD              | 1,011 | 607   | 272         | 22,549  | 電気通信サービス               |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED      | 314   | 130   | 122         | 10,142  | 食品・飲料・タバコ              |
| AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE     | 87    | 33    | 173         | 14,375  | 各種金融                   |
| BHP BILLITON LTD              | 826   | 399   | 959         | 79,519  | 素材                     |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED      | 108   | 41    | 135         | 11,186  | エネルギー                  |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD    | 474   | 132   | 48          | 4,059   | 小売                     |
| COMPUTERSHARE LIMITED         | 241   | 101   | 148         | 12,293  | ソフトウェア・サービス            |
| CSL LIMITED                   | 130   | 53    | 708         | 58,686  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TRANSURBAN GROUP              | 691   | 276   | 339         | 28,134  | 運輸                     |
| COCHLEAR LIMITED              | 29    | 11    | 170         | 14,134  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ORIGIN ENERGY LIMITED         | 765   | 301   | 239         | 19,810  | エネルギー                  |

| 銘柄                                 |              | 期首(前期末) | 当 期   |             | 業 種 等     |              |
|------------------------------------|--------------|---------|-------|-------------|-----------|--------------|
|                                    |              | 株 数     | 株 数   | 評 価 額       |           |              |
|                                    |              |         |       | 外貨建金額       |           | 邦貨換算金額       |
| (オーストラリア)                          |              | 百株      | 百株    | 千豪ドル        | 千円        |              |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA     |              | 494     | 200   | 1,608       | 133,286   | 銀行           |
| RIO TINTO LIMITED                  |              | 98      | 53    | 339         | 28,137    | 素材           |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD      |              | 859     | 327   | 205         | 17,003    | 保険           |
| ORICA LTD                          |              | 194     | 77    | 151         | 12,525    | 素材           |
| LENDLEASE GROUP                    |              | 263     | 96    | 160         | 13,283    | 不動産          |
| SUNCORP GROUP LTD                  |              | 431     | 198   | 278         | 23,080    | 保険           |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD        |              | 760     | 313   | 933         | 77,312    | 銀行           |
| NEWCREST MINING LIMITED            |              | 234     | 112   | 235         | 19,474    | 素材           |
| INCITEC PIVOT LTD                  |              | 878     | 413   | 145         | 12,058    | 素材           |
| AMP LIMITED                        |              | 1,070   | 419   | 215         | 17,882    | 各種金融         |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED        |              | 439     | 224   | 292         | 24,230    | 保険           |
| SANTOS LTD                         |              | 637     | 386   | 134         | 11,156    | エネルギー        |
| SONIC HEALTHCARE LTD               |              | 184     | 44    | 101         | 8,382     | ヘルスケア機器・サービス |
| TABCORP HOLDINGS LIMITED           |              | 575     | 263   | 121         | 10,081    | 消費者サービス      |
| WESFARMERS LIMITED                 |              | 271     | 99    | 424         | 35,177    | 食品・生活必需品小売り  |
| ALUMINA LTD                        |              | 1,556   | 599   | 114         | 9,483     | 素材           |
| ILUKA RESOURCES LIMITED            |              | 312     | —     | —           | —         | 素材           |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD             |              | 168     | 82    | 270         | 22,427    | エネルギー        |
| WOOLWORTHS LIMITED                 |              | 300     | 131   | 341         | 28,280    | 食品・生活必需品小売り  |
| BRAMBLES LTD                       |              | 504     | 254   | 266         | 22,108    | 商業・専門サービス    |
| ASCIANO LTD                        |              | 290     | —     | —           | —         | 運輸           |
| MACQUARIE GROUP LTD                |              | 101     | 40    | 359         | 29,747    | 各種金融         |
| CROWN RESORTS LIMITED              |              | 221     | 91    | 118         | 9,795     | 消費者サービス      |
| SYDNEY AIRPORT                     |              | 518     | 208   | 151         | 12,527    | 運輸           |
| AGL ENERGY LTD                     |              | 271     | 103   | 281         | 23,288    | 公益事業         |
| SOUTH32 LTD                        |              | 1,676   | 850   | 229         | 19,020    | 素材           |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額    | 20,207  | 8,612 | 13,272      | 1,099,792 |              |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 40      | 38    | —           | <2.4%>    |              |
| (ニュージーランド)                         |              |         |       | 千ニュージーランドドル |           |              |
| CONTACT ENERGY LTD                 |              | 347     | 86    | 44          | 3,503     | 公益事業         |
| FLETCHER BUILDING LTD              |              | 289     | 111   | 87          | 6,826     | 素材           |
| SPARK NEW ZEALAND LTD              |              | 849     | 384   | 144         | 11,340    | 電気通信サービス     |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD          |              | 505     | 177   | 124         | 9,763     | 運輸           |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額    | 1,991   | 760   | 401         | 31,434    |              |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 4       | 4     | —           | <0.1%>    |              |
| (香港)                               |              |         |       | 千香港ドル       |           |              |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY             |              | 181     | 54    | 604         | 8,628     | 半導体・半導体製造装置  |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD           |              | 1,090   | 390   | 762         | 10,893    | 不動産          |
| BANK OF EAST ASIA                  |              | 628     | 218   | 704         | 10,057    | 銀行           |
| CLP HOLDINGS LIMITED               |              | 335     | 130   | 1,088       | 15,547    | 公益事業         |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE         |              | 310     | 110   | 732         | 10,461    | 公益事業         |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR        |              | 321     | 133   | 2,606       | 37,225    | 各種金融         |
| LI & FUNG LTD                      |              | 2,280   | 1,520 | 481         | 6,880     | 耐久消費財・アパレル   |
| MTR CORPORATION                    |              | 615     | 255   | 1,100       | 15,712    | 運輸           |
| HANG SENG BANK                     |              | 260     | 94    | 1,541       | 22,014    | 銀行           |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT         |              | 500     | 210   | 1,040       | 14,860    | 不動産          |
| POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED      |              | 375     | 145   | 1,007       | 14,380    | 公益事業         |
| THE WHARF (HOLDINGS)               |              | 600     | 230   | 1,523       | 21,759    | 不動産          |
| HONG KONG & CHINA GAS              |              | 2,262   | 1,197 | 1,915       | 27,357    | 公益事業         |
| HYSAN DEVELOPMENT CO               |              | 430     | 210   | 758         | 10,825    | 不動産          |
| Galaxy Entertainment Group Limited |              | 880     | 350   | 1,503       | 21,466    | 消費者サービス      |
| KERRY PROPERTIES LTD               |              | 605     | 220   | 609         | 8,702     | 不動産          |

| 銘柄                                |               | 期首(前期末) | 当 期     |            | 業 種 等      |             |
|-----------------------------------|---------------|---------|---------|------------|------------|-------------|
|                                   |               | 株 数     | 株 数     | 評 価 額      |            |             |
|                                   |               |         |         | 外貨建金額      | 邦貨換算金額     |             |
| (香港)                              |               | 百株      | 百株      | 千香港ドル      | 千円         |             |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD        |               | 1,155   | 545     | 1,891      | 27,005     | 銀行          |
| NWS HOLDINGS LTD                  |               | 1,115   | 445     | 671        | 9,595      | 資本財         |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG          |               | 350     | 215     | 685        | 9,793      | 耐久消費財・アパレル  |
| NEW WORLD DEVLEOPMENT             |               | 2,690   | 1,070   | 1,034      | 14,775     | 不動産         |
| SINO LAND CO                      |               | 1,598   | 578     | 766        | 10,944     | 不動産         |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES           |               | 460     | 180     | 2,066      | 29,508     | 不動産         |
| SWIRE PACIFIC LTD A               |               | 270     | 75      | 584        | 8,343      | 不動産         |
| AIA GROUP LTD                     |               | 3,444   | 1,466   | 8,026      | 114,616    | 保険          |
| Sands China Ltd                   |               | 972     | 424     | 1,479      | 21,130     | 消費者サービス     |
| SWIRE PROPERTIES LTD              |               | 632     | 232     | 605        | 8,646      | 不動産         |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD         |               | 598     | 268     | 2,733      | 39,038     | 資本財         |
| Cheung Kong Property Holdings Ltd |               | 778     | 358     | 2,065      | 29,495     | 不動産         |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額     | 25,735  | 11,323  | 40,592     | 579,666    |             |
|                                   | 銘 柄 数 < 比 率 > | 28      | 28      | —          | <1.2%>     |             |
| (シンガポール)                          |               |         |         | 千シンガポールドル  |            |             |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING        |               | 410     | 280     | 104        | 8,383      | 資本財         |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD         |               | 4,700   | 2,480   | 95         | 7,685      | 食品・飲料・タバコ   |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD            |               | 340     | 200     | 416        | 33,483     | 銀行          |
| CITY DEVELOPMENTS                 |               | 280     | 120     | 127        | 10,238     | 不動産         |
| SEMBCORP MARINE LTD               |               | 568     | —       | —          | —          | 資本財         |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD      |               | 50      | 20      | 88         | 7,141      | 小売          |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD            |               | 300     | 50      | 37         | 2,982      | 各種金融        |
| CAPITALAND LIMITED                |               | 1,180   | 460     | 161        | 13,032     | 不動産         |
| GENTING SINGAPORE PLC             |               | 3,550   | 1,190   | 138        | 11,158     | 消費者サービス     |
| COMFORTDELGRO CORP LTD            |               | 690     | 340     | 81         | 6,567      | 運輸          |
| SINGAPORE AIRLINES LTD            |               | 280     | 110     | 108        | 8,747      | 運輸          |
| UNITED OVERSEAS BANK              |               | 230     | 120     | 280        | 22,572     | 銀行          |
| UNITED OVERSEAS LAND LTD          |               | 370     | 160     | 111        | 8,937      | 不動産         |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS          |               | 590     | 200     | 66         | 5,312      | メディア        |
| NOBLE GROUP LTD                   |               | 3,340   | —       | —          | —          | 資本財         |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS      |               | 1,867   | 547     | 204        | 16,422     | 電気通信サービス    |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD           |               | 630     | 340     | 107        | 8,620      | 資本財         |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP      |               | 540     | 240     | 250        | 20,148     | 銀行          |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD          |               | 720     | 340     | 124        | 9,988      | 食品・飲料・タバコ   |
| KEPPEL CORP LTD                   |               | 616     | 286     | 186        | 14,986     | 資本財         |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額     | 21,251  | 7,483   | 2,688      | 216,410    |             |
|                                   | 銘 柄 数 < 比 率 > | 20      | 18      | —          | <0.5%>     |             |
| (イスラエル)                           |               |         |         | 千イスラエルシェケル |            |             |
| BANK HAPOLIM BM                   |               | 125     | 125     | 291        | 9,054      | 銀行          |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL              |               | 737     | 341     | 593        | 18,463     | 銀行          |
| BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP        |               | 1,029   | 656     | 403        | 12,537     | 電気通信サービス    |
| ISRAEL CHEMICALS LTD              |               | 145     | 145     | 220        | 6,856      | 素材          |
| NICE LTD                          |               | 33      | 20      | 559        | 17,405     | ソフトウェア・サービス |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額     | 2,071   | 1,288   | 2,067      | 64,317     |             |
|                                   | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5       | 5       | —          | <0.1%>     |             |
| 合 計                               | 株 数 ・ 金 額     | 321,959 | 133,909 | —          | 42,312,709 |             |
|                                   | 銘 柄 数 < 比 率 > | 979     | 947     | —          | <90.6%>    |             |

(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                 | 12            | 5     | 697    | 77,616 | 0.2     |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC           | 4             | 1     | 341    | 38,044 | 0.1     |
| BOSTON PROPERTIES INC               | 5             | 2     | 260    | 29,048 | 0.1     |
| CROWN CASTLE INTL CORP              | 9             | 4     | 481    | 53,605 | 0.1     |
| DIGITAL REALTY TRUST INC            | 5             | 2     | 268    | 29,932 | 0.1     |
| DUKE REALTY CORP                    | 14            | 5     | 154    | 17,212 | 0.0     |
| EQUINIX INC                         | —             | 1     | 442    | 49,321 | 0.1     |
| EQUITY RESIDENTIAL                  | 11            | 4     | 292    | 32,579 | 0.1     |
| EXTRA SPACE STORAGE INC             | 4             | 1     | 153    | 17,082 | 0.0     |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST           | 2             | 1     | 166    | 18,593 | 0.0     |
| HCP INC                             | 14            | 7     | 235    | 26,203 | 0.1     |
| HOST HOTELS & RESORTS INC           | 26            | 11    | 206    | 22,947 | 0.0     |
| IRON MOUNTAIN INC                   | 9             | 4     | 166    | 18,521 | 0.0     |
| KIMCO REALTY CORP                   | 15            | 8     | 144    | 16,111 | 0.0     |
| LIBERTY PROPERTY TRUST              | 7             | 2     | 109    | 12,194 | 0.0     |
| PROLOGIS INC                        | 15            | 6     | 340    | 37,872 | 0.1     |
| PUBLIC STORAGE                      | 4             | 1     | 405    | 45,198 | 0.1     |
| REALTY INCOME CORP                  | 8             | 3     | 217    | 24,243 | 0.1     |
| REGENCY CENTERS CORP                | 4             | 2     | 135    | 15,083 | 0.0     |
| SL GREEN REALTY CORP                | 3             | 1     | 161    | 17,960 | 0.0     |
| SIMON PROPERTY GROUP INC            | 9             | 3     | 622    | 69,284 | 0.1     |
| UDR INC                             | 10            | 4     | 162    | 18,094 | 0.0     |
| VENTAS INC                          | 10            | 4     | 330    | 36,813 | 0.1     |
| VORNADO REALTY TRUST                | 5             | 2     | 236    | 26,371 | 0.1     |
| WELLTOWER INC                       | 11            | 4     | 332    | 37,050 | 0.1     |
| WEYERHAEUSER CO                     | 23            | 8     | 288    | 32,070 | 0.1     |
| 小 計                                 | 口 数 ・ 金 額     | 250   | 109    | 7,356  | 819,060 |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 25    | 26     | —      | <1.8%>  |
| (カナダ)                               |               |       | 千カナダドル |        |         |
| RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 9             | 3     | 85     | 7,070  | 0.0     |
| 小 計                                 | 口 数 ・ 金 額     | 9     | 3      | 85     | 7,070   |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1     | 1      | —      | <0.0%>  |
| (ユーロ…フランス)                          |               |       | 千ユーロ   |        |         |
| KLEPIERRE                           | 7             | 4     | 155    | 19,332 | 0.0     |
| GECCINA SA                          | 1             | 0.621 | 84     | 10,563 | 0.0     |
| FONCIERE DES REGIONS                | 1             | 1     | 85     | 10,575 | 0.0     |
| UNIBAIL-RODAMCO SE                  | 2             | 0.901 | 209    | 25,982 | 0.1     |
| ユ ー ロ 計                             | 口 数 ・ 金 額     | 14    | 6      | 534    | 66,454  |
|                                     | 銘 柄 数 < 比 率 > | 4     | 4      | —      | <0.1%>  |
| (イギリス)                              |               |       | 千英ポンド  |        |         |
| BRITISH LAND CO PLC                 | 28            | 15    | 100    | 14,294 | 0.0     |
| HAMMERSON PLC                       | 34            | 12    | 73     | 10,470 | 0.0     |

| 銘 柄                                   |               | 期首(前期末) |     | 当 期 末     |           |     |
|---------------------------------------|---------------|---------|-----|-----------|-----------|-----|
|                                       |               | 口 数     | 口 数 | 評 価 額     |           | 比 率 |
|                                       |               |         |     | 外貨建金額     | 邦貨換算金額    |     |
| (イギリス)                                |               | 千口      | 千口  | 千英ポンド     | 千円        | %   |
| INTU PROPERTIES PLC                   |               | 52      | 17  | 47        | 6,833     | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC             |               | 28      | 10  | 116       | 16,625    | 0.0 |
| SEGRO PLC                             |               | 38      | 20  | 100       | 14,304    | 0.0 |
| 小 計                                   | 口 数 ・ 金 額     | 183     | 77  | 438       | 62,529    |     |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5       | 5   | —         | <0.1%>    |     |
| (オーストラリア)                             |               |         |     | 千豪ドル      |           |     |
| MIRVAC GROUP                          |               | 174     | 65  | 150       | 12,455    | 0.0 |
| GPT GROUP                             |               | 78      | 38  | 199       | 16,568    | 0.0 |
| STOCKLAND                             |               | 98      | 48  | 229       | 19,002    | 0.0 |
| GOODMAN GROUP                         |               | 70      | 27  | 237       | 19,672    | 0.0 |
| SCENTRE GROUP                         |               | 160     | 58  | 251       | 20,804    | 0.0 |
| WESTFIELD CORP                        |               | 61      | 29  | 248       | 20,607    | 0.0 |
| VICINITY CENTRES                      |               | 136     | 70  | 196       | 16,243    | 0.0 |
| 小 計                                   | 口 数 ・ 金 額     | 781     | 338 | 1,512     | 125,353   |     |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 7       | 7   | —         | <0.3%>    |     |
| (香港)                                  |               |         |     | 千香港ドル     |           |     |
| LINK REIT                             |               | 75      | 32  | 1,954     | 27,915    | 0.1 |
| 小 計                                   | 口 数 ・ 金 額     | 75      | 32  | 1,954     | 27,915    |     |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 1       | 1   | —         | <0.1%>    |     |
| (シンガポール)                              |               |         |     | 千シンガポールドル |           |     |
| CAPITALAND MALL TRUST                 |               | 119     | 38  | 74        | 5,979     | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST |               | 118     | 25  | 65        | 5,272     | 0.0 |
| 小 計                                   | 口 数 ・ 金 額     | 237     | 63  | 139       | 11,251    |     |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 2       | 2   | —         | <0.0%>    |     |
| 合 計                                   | 口 数 ・ 金 額     | 1,550   | 631 | —         | 1,119,635 |     |
|                                       | 銘 柄 数 < 比 率 > | 45      | 46  | —         | <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、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 |              | 百万円   | 百万円   |
|       |        | S&P 500 EMIN | 1,733 | —     |
|       |        | DJ EU STX 50 | 570   | —     |
|       |        | FTSE 100 IDX | 569   | —     |

(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(43, 112, 066千口)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<br>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    | 242, 140               | 249, 285               | 27, 755, 452 | 43. 0 | —                  | 17. 9 | 16. 7 | 8. 4  |
| カナダ     | 千カナダドル<br>14, 060      | 千カナダドル<br>16, 145      | 1, 335, 087  | 2. 1  | —                  | 1. 0  | 0. 8  | 0. 3  |
| メキシコ    | 千メキシコペソ<br>90, 910     | 千メキシコペソ<br>95, 926     | 577, 480     | 0. 9  | —                  | 0. 4  | 0. 2  | 0. 2  |
| ユーロ     | 千ユーロ                   | 千ユーロ                   |              |       |                    |       |       |       |
| ドイツ     | 30, 260                | 35, 968                | 4, 470, 842  | 6. 9  | —                  | 4. 0  | 2. 0  | 0. 9  |
| イタリア    | 42, 220                | 49, 096                | 6, 102, 634  | 9. 5  | —                  | 5. 7  | 2. 5  | 1. 2  |
| フランス    | 40, 790                | 49, 478                | 6, 150, 129  | 9. 5  | —                  | 5. 7  | 2. 9  | 0. 9  |
| オランダ    | 9, 520                 | 11, 830                | 1, 470, 577  | 2. 3  | —                  | 1. 5  | 0. 8  | —     |
| スペイン    | 25, 185                | 30, 001                | 3, 729, 223  | 5. 8  | —                  | 3. 5  | 1. 8  | 0. 5  |
| ベルギー    | 10, 770                | 13, 567                | 1, 686, 447  | 2. 6  | —                  | 1. 9  | 0. 5  | 0. 2  |
| オーストリア  | 6, 210                 | 7, 849                 | 975, 717     | 1. 5  | —                  | 1. 0  | 0. 3  | 0. 2  |
| フィンランド  | 2, 400                 | 2, 723                 | 338, 538     | 0. 5  | —                  | 0. 3  | 0. 2  | —     |
| アイルランド  | 3, 920                 | 4, 734                 | 588, 482     | 0. 9  | —                  | 0. 5  | 0. 4  | —     |
| イギリス    | 千英ポンド<br>23, 190       | 千英ポンド<br>31, 074       | 4, 434, 280  | 6. 9  | —                  | 5. 4  | 1. 5  | —     |
| スイス     | 千スイスフラン<br>600         | 千スイスフラン<br>762         | 87, 101      | 0. 1  | —                  | 0. 1  | 0. 1  | —     |
| スウェーデン  | 千スウェーデンクローネ<br>18, 420 | 千スウェーデンクローネ<br>21, 519 | 275, 454     | 0. 4  | —                  | 0. 3  | 0. 1  | —     |
| ノルウェー   | 千ノルウェークローネ<br>10, 000  | 千ノルウェークローネ<br>10, 823  | 143, 521     | 0. 2  | —                  | 0. 1  | 0. 1  | 0. 0  |
| デンマーク   | 千デンマーククローネ<br>15, 760  | 千デンマーククローネ<br>21, 954  | 366, 644     | 0. 6  | —                  | 0. 4  | 0. 2  | —     |
| ポーランド   | 千ポーランドズロチ<br>12, 300   | 千ポーランドズロチ<br>13, 159   | 391, 102     | 0. 6  | —                  | 0. 2  | 0. 2  | 0. 2  |
| オーストラリア | 千豪ドル<br>14, 560        | 千豪ドル<br>16, 193        | 1, 341, 759  | 2. 1  | —                  | 1. 4  | 0. 5  | 0. 2  |
| シンガポール  | 千シンガポールドル<br>2, 700    | 千シンガポールドル<br>2, 877    | 231, 604     | 0. 4  | —                  | 0. 2  | 0. 1  | 0. 1  |
| マレーシア   | 千マレーシアリンギット<br>9, 400  | 千マレーシアリンギット<br>9, 617  | 250, 820     | 0. 4  | —                  | 0. 2  | 0. 2  | —     |
| 南アフリカ   | 千南アフリカランド<br>45, 000   | 千南アフリカランド<br>39, 067   | 339, 107     | 0. 5  | —                  | 0. 5  | 0. 0  | —     |
| 合 計     | —                      | —                      | 63, 042, 009 | 97. 7 | —                  | 52. 1 | 32. 2 | 13. 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) 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 |       |       |         |            |
|------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
|                  | 利率    | 額面金額  | 評 価 額 |         | 償還年月日      |
|                  |       |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
| (アメリカ)           | %     | 千米ドル  | 千米ドル  | 千円      |            |
| 国債証券             |       |       |       |         |            |
| T 1 06/30/19     | 1.0   | 2,000 | 1,987 | 221,253 | 2019/6/30  |
| T 1 08/31/19     | 1.0   | 2,000 | 1,984 | 220,992 | 2019/8/31  |
| T 1 1/2 01/31/19 | 1.5   | 4,000 | 4,015 | 447,030 | 2019/1/31  |
| T 1 1/2 02/28/19 | 1.5   | 4,500 | 4,516 | 502,869 | 2019/2/28  |
| T 1 1/2 12/31/18 | 1.5   | 5,000 | 5,017 | 558,613 | 2018/12/31 |
| T 1 1/4 11/30/18 | 1.25  | 6,000 | 5,999 | 667,987 | 2018/11/30 |
| T 1 1/8 05/31/19 | 1.125 | 5,000 | 4,983 | 554,829 | 2019/5/31  |
| T 1 1/8 08/31/21 | 1.125 | 5,000 | 4,878 | 543,217 | 2021/8/31  |
| T 1 1/8 12/31/19 | 1.125 | 2,000 | 1,986 | 221,201 | 2019/12/31 |
| T 1 11/30/19     | 1.0   | 2,000 | 1,981 | 220,661 | 2019/11/30 |
| T 1 3/4 02/28/22 | 1.75  | 1,500 | 1,497 | 166,722 | 2022/2/28  |
| T 1 3/4 05/15/22 | 1.75  | 1,000 | 997   | 111,087 | 2022/5/15  |
| T 1 3/4 05/15/23 | 1.75  | 5,000 | 4,941 | 550,132 | 2023/5/15  |
| T 1 3/4 09/30/22 | 1.75  | 1,500 | 1,491 | 166,031 | 2022/9/30  |
| T 1 3/8 02/28/19 | 1.375 | 5,000 | 5,008 | 557,656 | 2019/2/28  |
| T 1 3/8 02/29/20 | 1.375 | 3,500 | 3,495 | 389,141 | 2020/2/29  |
| T 1 3/8 03/31/20 | 1.375 | 4,000 | 3,993 | 444,594 | 2020/3/31  |
| T 1 3/8 04/30/21 | 1.375 | 1,000 | 989   | 110,139 | 2021/4/30  |
| T 1 3/8 05/31/20 | 1.375 | 2,300 | 2,292 | 255,241 | 2020/5/31  |
| T 1 3/8 09/30/20 | 1.375 | 2,000 | 1,988 | 221,375 | 2020/9/30  |
| T 1 5/8 02/15/26 | 1.625 | 4,000 | 3,813 | 424,622 | 2026/2/15  |
| T 1 5/8 03/31/19 | 1.625 | 7,000 | 7,042 | 784,129 | 2019/3/31  |
| T 1 5/8 05/15/26 | 1.625 | 4,000 | 3,806 | 423,787 | 2026/5/15  |
| T 1 5/8 08/15/22 | 1.625 | 1,500 | 1,483 | 165,222 | 2022/8/15  |
| T 1 5/8 11/15/22 | 1.625 | 3,000 | 2,960 | 329,583 | 2022/11/15 |
| T 1 7/8 11/30/21 | 1.875 | 3,500 | 3,519 | 391,851 | 2021/11/30 |
| T 2 02/15/22     | 2.0   | 3,000 | 3,032 | 337,595 | 2022/2/15  |
| T 2 02/15/23     | 2.0   | 3,700 | 3,715 | 413,631 | 2023/2/15  |
| T 2 02/15/25     | 2.0   | 2,200 | 2,178 | 242,498 | 2025/2/15  |
| T 2 02/28/21     | 2.0   | 3,500 | 3,547 | 394,987 | 2021/2/28  |
| T 2 07/31/22     | 2.0   | 2,700 | 2,720 | 302,919 | 2022/7/31  |
| T 2 08/15/25     | 2.0   | 3,900 | 3,846 | 428,323 | 2025/8/15  |
| T 2 1/2 02/15/45 | 2.5   | 4,000 | 3,679 | 409,626 | 2045/2/15  |
| T 2 1/2 02/15/46 | 2.5   | 3,600 | 3,299 | 367,411 | 2046/2/15  |
| T 2 1/2 05/15/24 | 2.5   | 3,000 | 3,084 | 343,466 | 2024/5/15  |
| T 2 1/2 08/15/23 | 2.5   | 4,000 | 4,119 | 458,616 | 2023/8/15  |
| T 2 1/4 02/15/27 | 2.25  | 400   | 399   | 44,508  | 2027/2/15  |
| T 2 1/4 03/31/21 | 2.25  | 1,800 | 1,839 | 204,858 | 2021/3/31  |
| T 2 1/4 04/30/21 | 2.25  | 2,500 | 2,555 | 284,547 | 2021/4/30  |
| T 2 1/4 07/31/21 | 2.25  | 3,500 | 3,575 | 398,123 | 2021/7/31  |
| T 2 1/4 08/15/46 | 2.25  | 1,800 | 1,559 | 173,606 | 2046/8/15  |
| T 2 1/4 11/15/24 | 2.25  | 2,500 | 2,523 | 281,003 | 2024/11/15 |
| T 2 1/8 05/15/25 | 2.125 | 2,800 | 2,793 | 310,972 | 2025/5/15  |

| 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  |            |
| (アメリカ)           | %     | 千米ドル  | 千米ドル  | 千円      |            |
| 国債証券             |       |       |       |         |            |
| T 2 1/8 01/31/21 | 2.125 | 2,500 | 2,544 | 283,329 | 2021/1/31  |
| T 2 1/8 06/30/21 | 2.125 | 3,500 | 3,558 | 396,174 | 2021/6/30  |
| T 2 1/8 08/15/21 | 2.125 | 5,000 | 5,085 | 566,224 | 2021/8/15  |
| T 2 1/8 08/31/20 | 2.125 | 1,000 | 1,018 | 113,418 | 2020/8/31  |
| T 2 11/15/21     | 2.0   | 4,000 | 4,045 | 450,474 | 2021/11/15 |
| T 2 3/4 02/15/19 | 2.75  | 5,600 | 5,740 | 639,091 | 2019/2/15  |
| T 2 3/4 02/15/24 | 2.75  | 3,500 | 3,658 | 407,378 | 2024/2/15  |
| T 2 3/4 11/15/23 | 2.75  | 4,500 | 4,703 | 523,654 | 2023/11/15 |
| T 2 3/8 08/15/24 | 2.375 | 2,300 | 2,344 | 261,083 | 2024/8/15  |
| T 2 3/8 12/31/20 | 2.375 | 4,000 | 4,107 | 457,329 | 2020/12/31 |
| T 2 5/8 08/15/20 | 2.625 | 1,000 | 1,033 | 115,106 | 2020/8/15  |
| T 2 5/8 11/15/20 | 2.625 | 4,000 | 4,139 | 460,912 | 2020/11/15 |
| T 2 7/8 08/15/45 | 2.875 | 3,100 | 3,073 | 342,160 | 2045/8/15  |
| T 3 02/15/47     | 3.0   | 500   | 508   | 56,587  | 2047/2/15  |
| T 3 05/15/42     | 3.0   | 900   | 920   | 102,460 | 2042/5/15  |
| T 3 1/2 02/15/39 | 3.5   | 600   | 673   | 74,982  | 2039/2/15  |
| T 3 1/2 05/15/20 | 3.5   | 3,000 | 3,176 | 353,617 | 2020/5/15  |
| T 3 1/8 02/15/42 | 3.125 | 500   | 523   | 58,262  | 2042/2/15  |
| T 3 1/8 02/15/43 | 3.125 | 1,700 | 1,771 | 197,292 | 2043/2/15  |
| T 3 1/8 05/15/19 | 3.125 | 5,000 | 5,177 | 576,445 | 2019/5/15  |
| T 3 1/8 05/15/21 | 3.125 | 2,500 | 2,639 | 293,833 | 2021/5/15  |
| T 3 1/8 08/15/44 | 3.125 | 3,300 | 3,441 | 383,152 | 2044/8/15  |
| T 3 1/8 11/15/41 | 3.125 | 1,000 | 1,047 | 116,585 | 2041/11/15 |
| T 3 11/15/45     | 3.0   | 2,900 | 2,945 | 327,931 | 2045/11/15 |
| T 3 3/4 08/15/41 | 3.75  | 600   | 695   | 77,409  | 2041/8/15  |
| T 3 3/8 11/15/19 | 3.375 | 3,500 | 3,669 | 408,535 | 2019/11/15 |
| T 3 5/8 02/15/20 | 3.625 | 3,900 | 4,128 | 459,635 | 2020/2/15  |
| T 3 5/8 02/15/21 | 3.625 | 4,000 | 4,288 | 477,509 | 2021/2/15  |
| T 3 5/8 02/15/44 | 3.625 | 2,900 | 3,299 | 367,408 | 2044/2/15  |
| T 3 5/8 08/15/43 | 3.625 | 3,000 | 3,410 | 379,686 | 2043/8/15  |
| T 3 7/8 08/15/40 | 3.875 | 800   | 943   | 105,091 | 2040/8/15  |
| T 3.75 11/15/18  | 3.75  | 6,000 | 6,218 | 692,360 | 2018/11/15 |
| T 4 1/2 02/15/36 | 4.5   | 600   | 772   | 85,957  | 2036/2/15  |
| T 4 1/2 08/15/39 | 4.5   | 400   | 514   | 57,301  | 2039/8/15  |
| T 4 1/4 05/15/39 | 4.25  | 400   | 497   | 55,436  | 2039/5/15  |
| T 4 1/4 11/15/40 | 4.25  | 200   | 249   | 27,756  | 2040/11/15 |
| T 4 3/4 02/15/41 | 4.75  | 1,000 | 1,336 | 148,778 | 2041/2/15  |
| T 4 3/8 02/15/38 | 4.375 | 200   | 253   | 28,271  | 2038/2/15  |
| T 4 3/8 05/15/41 | 4.375 | 900   | 1,143 | 127,324 | 2041/5/15  |
| T 4 3/8 11/15/39 | 4.375 | 400   | 506   | 56,348  | 2039/11/15 |
| T 4 5/8 02/15/40 | 4.625 | 800   | 1,047 | 116,614 | 2040/2/15  |
| T 5 05/15/37     | 5.0   | 50    | 68    | 7,615   | 2037/5/15  |
| T 5 1/4 02/15/29 | 5.25  | 690   | 894   | 99,583  | 2029/2/15  |

| 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     |            |
| (アメリカ)<br>国債証券       | %     | 千米ドル    | 千米ドル    | 千円         |            |
| T 5 3/8 02/15/31     | 5.375 | 500     | 675     | 75,184     | 2031/2/15  |
| T 6 02/15/26         | 6.0   | 1,500   | 1,955   | 217,700    | 2026/2/15  |
| T 6 1/2 11/15/26     | 6.5   | 1,950   | 2,660   | 296,274    | 2026/11/15 |
| T 6 1/4 08/15/23     | 6.25  | 3,200   | 4,007   | 446,167    | 2023/8/15  |
| T 6 1/8 11/15/27     | 6.125 | 490     | 665     | 74,052     | 2027/11/15 |
| T 8 1/8 08/15/19     | 8.125 | 2,060   | 2,364   | 263,280    | 2019/8/15  |
| 小 計                  |       |         |         | 27,755,452 |            |
| (カナダ)<br>国債証券        |       | 千カナダドル  | 千カナダドル  |            |            |
| CAN 0 3/4 03/01/21   | 0.75  | 1,000   | 996     | 82,379     | 2021/3/1   |
| CAN 1 1/2 06/01/23   | 1.5   | 600     | 614     | 50,842     | 2023/6/1   |
| CAN 1 1/2 06/01/26   | 1.5   | 400     | 405     | 33,555     | 2026/6/1   |
| CAN 1 1/4 09/01/18   | 1.25  | 2,000   | 2,014   | 166,579    | 2018/9/1   |
| CAN 2 1/2 06/01/24   | 2.5   | 1,000   | 1,090   | 90,137     | 2024/6/1   |
| CAN 2 3/4 12/01/48   | 2.75  | 600     | 693     | 57,353     | 2048/12/1  |
| CAN 3 1/2 06/01/20   | 3.5   | 1,200   | 1,296   | 107,180    | 2020/6/1   |
| CAN 3 1/2 12/01/45   | 3.5   | 400     | 518     | 42,910     | 2045/12/1  |
| CAN 3 1/4 06/01/21   | 3.25  | 1,200   | 1,311   | 108,462    | 2021/6/1   |
| CAN 3 3/4 06/01/19   | 3.75  | 2,800   | 2,969   | 245,516    | 2019/6/1   |
| CAN 4 06/01/41       | 4.0   | 600     | 815     | 67,435     | 2041/6/1   |
| CAN 5 06/01/37       | 5.0   | 310     | 461     | 38,200     | 2037/6/1   |
| CAN 5 3/4 06/01/33   | 5.75  | 600     | 921     | 76,210     | 2033/6/1   |
| CAN 5.75 06/01/29    | 5.75  | 810     | 1,173   | 97,058     | 2029/6/1   |
| CAN 8 06/01/27       | 8.0   | 100     | 161     | 13,333     | 2027/6/1   |
| CAN 9 06/01/25       | 9.0   | 440     | 700     | 57,931     | 2025/6/1   |
| 小 計                  |       |         |         | 1,335,087  |            |
| (メキシコ)<br>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   | 3,749   | 22,571     | 2036/11/20 |
| MBONO 10 12/05/24    | 10.0  | 15,000  | 17,374  | 104,591    | 2024/12/5  |
| MBONO 7 1/2 06/03/27 | 7.5   | 2,000   | 2,023   | 12,183     | 2027/6/3   |
| MBONO 7 3/4 05/29/31 | 7.75  | 6,000   | 6,166   | 37,120     | 2031/5/29  |
| MBONO 7 3/4 11/13/42 | 7.75  | 10,000  | 10,199  | 61,399     | 2042/11/13 |
| MBONO 8 06/11/20     | 8.0   | 23,000  | 23,499  | 141,464    | 2020/6/11  |
| MBONO 8 1/2 11/18/38 | 8.5   | 3,910   | 4,296   | 25,863     | 2038/11/18 |
| MBONO 8 1/2 12/13/18 | 8.5   | 24,000  | 24,465  | 147,282    | 2018/12/13 |
| MBONO 8 12/07/23     | 8.0   | 4,000   | 4,153   | 25,002     | 2023/12/7  |
| 小 計                  |       |         |         | 577,480    |            |
| (ユーロ…ドイツ)<br>国債証券    |       | 千ユーロ    | 千ユーロ    |            |            |
| DBR 0 1/2 02/15/25   | 0.5   | 1,700   | 1,764   | 219,293    | 2025/2/15  |
| DBR 0 1/2 02/15/26   | 0.5   | 800     | 823     | 102,358    | 2026/2/15  |
| DBR 0 1/4 02/15/27   | 0.25  | 500     | 496     | 61,673     | 2027/2/15  |
| DBR 1 08/15/25       | 1.0   | 1,200   | 1,290   | 160,399    | 2025/8/15  |
| DBR 1 1/2 02/15/23   | 1.5   | 600     | 661     | 82,164     | 2023/2/15  |

| 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  |            |
| (ユーロ…ドイツ)<br>国債証券   | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| DBR 1 1/2 05/15/23  | 1.5   | 500   | 552   | 68,635  | 2023/5/15  |
| DBR 1 1/2 09/04/22  | 1.5   | 1,800 | 1,975 | 245,565 | 2022/9/4   |
| DBR 1 3/4 02/15/24  | 1.75  | 800   | 902   | 112,120 | 2024/2/15  |
| DBR 2 01/04/22      | 2.0   | 1,300 | 1,448 | 180,048 | 2022/1/4   |
| DBR 2 08/15/23      | 2.0   | 1,000 | 1,137 | 141,426 | 2023/8/15  |
| DBR 2 1/2 07/04/44  | 2.5   | 800   | 1,055 | 131,253 | 2044/7/4   |
| DBR 2 1/2 08/15/46  | 2.5   | 700   | 932   | 115,900 | 2046/8/15  |
| DBR 2 1/4 09/04/21  | 2.25  | 2,000 | 2,237 | 278,128 | 2021/9/4   |
| DBR 3 07/04/20      | 3.0   | 1,200 | 1,336 | 166,159 | 2020/7/4   |
| DBR 3 1/2 07/04/19  | 3.5   | 2,500 | 2,721 | 338,251 | 2019/7/4   |
| DBR 3 1/4 01/04/20  | 3.25  | 500   | 551   | 68,578  | 2020/1/4   |
| DBR 3 1/4 07/04/42  | 3.25  | 500   | 741   | 92,156  | 2042/7/4   |
| DBR 3 3/4 01/04/19  | 3.75  | 2,000 | 2,144 | 266,596 | 2019/1/4   |
| DBR 4 01/04/37      | 4.0   | 730   | 1,140 | 141,810 | 2037/1/4   |
| DBR 4 3/4 07/04/28  | 4.75  | 580   | 851   | 105,875 | 2028/7/4   |
| DBR 4 3/4 07/04/34  | 4.75  | 700   | 1,148 | 142,772 | 2034/7/4   |
| DBR 4 3/4 07/04/40  | 4.75  | 700   | 1,247 | 155,064 | 2040/7/4   |
| DBR 4.25 07/04/39   | 4.25  | 500   | 829   | 103,118 | 2039/7/4   |
| DBR 5 5/8 01/04/28  | 5.625 | 700   | 1,081 | 134,451 | 2028/1/4   |
| DBR 5.5 01/04/31    | 5.5   | 450   | 739   | 91,882  | 2031/1/4   |
| DBR 6 1/4 01/04/30  | 6.25  | 250   | 424   | 52,809  | 2030/1/4   |
| DBR 6.25 01/04/24   | 6.25  | 200   | 284   | 35,395  | 2024/1/4   |
| DBR 6.5 07/04/27    | 6.5   | 450   | 726   | 90,293  | 2027/7/4   |
| OBL 0 04/09/21      | —     | 1,600 | 1,633 | 203,046 | 2021/4/9   |
| OBL 0 1/2 04/12/19  | 0.5   | 500   | 511   | 63,583  | 2019/4/12  |
| OBL 0 1/4 10/16/20  | 0.25  | 500   | 514   | 63,941  | 2020/10/16 |
| OBL 1 02/22/19      | 1.0   | 2,000 | 2,060 | 256,087 | 2019/2/22  |
| (ユーロ…イタリア)<br>国債証券  |       |       |       |         |            |
| BTPS 1 1/2 06/01/25 | 1.5   | 1,500 | 1,477 | 183,634 | 2025/6/1   |
| BTPS 1.35 04/15/22  | 1.35  | 700   | 717   | 89,228  | 2022/4/15  |
| BTPS 1.65 03/01/32  | 1.65  | 1,000 | 908   | 112,901 | 2032/3/1   |
| BTPS 2 12/01/25     | 2.0   | 2,000 | 2,029 | 252,304 | 2025/12/1  |
| BTPS 2.15 12/15/21  | 2.15  | 1,200 | 1,279 | 159,079 | 2021/12/15 |
| BTPS 2.7 03/01/47   | 2.7   | 600   | 546   | 67,905  | 2047/3/1   |
| BTPS 2.8 03/01/67   | 2.8   | 300   | 255   | 31,771  | 2067/3/1   |
| BTPS 3 1/2 03/01/30 | 3.5   | 1,000 | 1,125 | 139,899 | 2030/3/1   |
| BTPS 3 1/4 09/01/46 | 3.25  | 500   | 509   | 63,380  | 2046/9/1   |
| BTPS 3 3/4 03/01/21 | 3.75  | 1,200 | 1,350 | 167,879 | 2021/3/1   |
| BTPS 3 3/4 08/01/21 | 3.75  | 1,950 | 2,208 | 274,573 | 2021/8/1   |
| BTPS 3 3/4 09/01/24 | 3.75  | 1,200 | 1,379 | 171,429 | 2024/9/1   |
| BTPS 4 02/01/37     | 4.0   | 1,260 | 1,492 | 185,545 | 2037/2/1   |
| BTPS 4 09/01/20     | 4.0   | 1,000 | 1,120 | 139,278 | 2020/9/1   |
| BTPS 4 1/2 02/01/20 | 4.5   | 970   | 1,081 | 134,472 | 2020/2/1   |

| 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  |            |
| (ユーロ…イタリア)<br>国債証券  | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| BTPS 4 1/2 03/01/24 | 4.5   | 800   | 957   | 119,019 | 2024/3/1   |
| BTPS 4 1/2 03/19    | 4.5   | 2,000 | 2,161 | 268,629 | 2019/3/1   |
| BTPS 4 1/2 05/01/23 | 4.5   | 900   | 1,073 | 133,382 | 2023/5/1   |
| BTPS 4 1/4 02/01/19 | 4.25  | 4,020 | 4,311 | 535,963 | 2019/2/1   |
| BTPS 4 1/4 03/01/20 | 4.25  | 610   | 677   | 84,269  | 2020/3/1   |
| BTPS 4 1/4 09/19    | 4.25  | 1,500 | 1,641 | 204,088 | 2019/9/1   |
| BTPS 4 3/4 08/01/23 | 4.75  | 1,100 | 1,333 | 165,744 | 2023/8/1   |
| BTPS 4 3/4 09/01/21 | 4.75  | 1,500 | 1,763 | 219,171 | 2021/9/1   |
| BTPS 4 3/4 09/01/28 | 4.75  | 600   | 748   | 92,993  | 2028/9/1   |
| BTPS 4 3/4 09/01/44 | 4.75  | 600   | 770   | 95,805  | 2044/9/1   |
| BTPS 5 03/01/22     | 5.0   | 1,000 | 1,195 | 148,625 | 2022/3/1   |
| BTPS 5 03/01/25     | 5.0   | 1,300 | 1,616 | 200,888 | 2025/3/1   |
| BTPS 5 08/01/34     | 5.0   | 1,200 | 1,583 | 196,816 | 2034/8/1   |
| BTPS 5 08/01/39     | 5.0   | 800   | 1,064 | 132,255 | 2039/8/1   |
| BTPS 5 09/01/40     | 5.0   | 900   | 1,185 | 147,388 | 2040/9/1   |
| BTPS 5 1/2 09/01/22 | 5.5   | 700   | 863   | 107,335 | 2022/9/1   |
| BTPS 5 1/2 11/01/22 | 5.5   | 1,300 | 1,607 | 199,838 | 2022/11/1  |
| BTPS 5 3/4 02/01/33 | 5.75  | 800   | 1,127 | 140,120 | 2033/2/1   |
| BTPS 5.25 11/01/29  | 5.25  | 1,000 | 1,315 | 163,504 | 2029/11/1  |
| BTPS 6 05/01/31     | 6.0   | 1,110 | 1,575 | 195,811 | 2031/5/1   |
| BTPS 6 1/2 11/01/27 | 6.5   | 800   | 1,127 | 140,110 | 2027/11/1  |
| BTPS 7 1/4 11/01/26 | 7.25  | 300   | 437   | 54,417  | 2026/11/1  |
| BTPS 9 11/01/23     | 9.0   | 1,000 | 1,473 | 183,168 | 2023/11/1  |
| (ユーロ…フランス)<br>国債証券  |       |       |       |         |            |
| FRTR 0 1/2 05/25/25 | 0.5   | 1,100 | 1,108 | 137,837 | 2025/5/25  |
| FRTR 0 1/2 11/25/19 | 0.5   | 500   | 512   | 63,741  | 2019/11/25 |
| FRTR 0 1/4 11/25/26 | 0.25  | 1,000 | 959   | 119,278 | 2026/11/25 |
| FRTR 1 05/25/19     | 1.0   | 2,000 | 2,062 | 256,306 | 2019/5/25  |
| FRTR 1 1/2 05/25/31 | 1.5   | 800   | 838   | 104,203 | 2031/5/25  |
| FRTR 1 1/4 05/25/36 | 1.25  | 500   | 482   | 60,005  | 2036/5/25  |
| FRTR 1 11/25/25     | 1.0   | 1,100 | 1,146 | 142,500 | 2025/11/25 |
| FRTR 1 3/4 05/25/23 | 1.75  | 600   | 663   | 82,418  | 2023/5/25  |
| FRTR 1 3/4 11/25/24 | 1.75  | 1,500 | 1,663 | 206,754 | 2024/11/25 |
| FRTR 2 1/2 05/25/30 | 2.5   | 1,700 | 2,002 | 248,859 | 2030/5/25  |
| FRTR 2 1/2 10/25/20 | 2.5   | 1,500 | 1,651 | 205,318 | 2020/10/25 |
| FRTR 2 1/4 05/25/24 | 2.25  | 1,100 | 1,259 | 156,514 | 2024/5/25  |
| FRTR 2 1/4 10/25/22 | 2.25  | 600   | 676   | 84,118  | 2022/10/25 |
| FRTR 2 3/4 10/25/27 | 2.75  | 1,000 | 1,195 | 148,637 | 2027/10/25 |
| FRTR 3 04/25/22     | 3.0   | 1,700 | 1,969 | 244,781 | 2022/4/25  |
| FRTR 3 1/2 04/25/20 | 3.5   | 2,700 | 3,016 | 374,909 | 2020/4/25  |
| FRTR 3 1/2 04/25/26 | 3.5   | 1,100 | 1,382 | 171,855 | 2026/4/25  |
| FRTR 3 1/4 05/25/45 | 3.25  | 1,000 | 1,334 | 165,816 | 2045/5/25  |
| FRTR 3 1/4 10/25/21 | 3.25  | 2,000 | 2,314 | 287,655 | 2021/10/25 |

| 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  |            |
| (ユーロ…フランス)<br>国債証券    | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| FRTR 3 3/4 04/25/21   | 3.75  | 2,300 | 2,673 | 332,261 | 2021/4/25  |
| FRTR 3 3/4 10/19      | 3.75  | 1,400 | 1,546 | 192,170 | 2019/10/25 |
| FRTR 4 04/25/55       | 4.0   | 670   | 1,053 | 130,934 | 2055/4/25  |
| FRTR 4 04/25/60       | 4.0   | 500   | 801   | 99,614  | 2060/4/25  |
| FRTR 4 1/4 04/25/19   | 4.25  | 2,460 | 2,688 | 334,154 | 2019/4/25  |
| FRTR 4 10/25/38       | 4.0   | 960   | 1,405 | 174,672 | 2038/10/25 |
| FRTR 4 3/4 04/25/35   | 4.75  | 1,080 | 1,674 | 208,158 | 2035/4/25  |
| FRTR 4.25 10/23       | 4.25  | 1,990 | 2,526 | 314,019 | 2023/10/25 |
| FRTR 5 1/2 04/25/29   | 5.5   | 910   | 1,383 | 171,965 | 2029/4/25  |
| FRTR 5 3/4 10/25/32   | 5.75  | 1,120 | 1,846 | 229,483 | 2032/10/25 |
| FRTR 6 10/25/25       | 6.0   | 1,100 | 1,611 | 200,282 | 2025/10/25 |
| FRTR 8 1/2 04/25/23   | 8.5   | 500   | 753   | 93,622  | 2023/4/25  |
| FRTR 8 1/2 10/25/19   | 8.5   | 1,000 | 1,219 | 151,608 | 2019/10/25 |
| FRTR4.5 04/25/41      | 4.5   | 1,300 | 2,056 | 255,667 | 2041/4/25  |
| (ユーロ…オランダ)<br>国債証券    |       |       |       |         |            |
| NETHER 0 1/2 07/15/26 | 0.5   | 500   | 504   | 62,759  | 2026/7/15  |
| NETHER 0 1/4 07/15/25 | 0.25  | 500   | 500   | 62,237  | 2025/7/15  |
| NETHER 2 07/15/24     | 2.0   | 800   | 910   | 113,182 | 2024/7/15  |
| NETHER 2 1/2 01/15/33 | 2.5   | 500   | 624   | 77,575  | 2033/1/15  |
| NETHER 2 1/4 07/15/22 | 2.25  | 500   | 565   | 70,285  | 2022/7/15  |
| NETHER 2 3/4 01/15/47 | 2.75  | 400   | 553   | 68,797  | 2047/1/15  |
| NETHER 3 1/2 07/15/20 | 3.5   | 400   | 451   | 56,109  | 2020/7/15  |
| NETHER 3 1/4 07/15/21 | 3.25  | 1,100 | 1,269 | 157,827 | 2021/7/15  |
| NETHER 3 3/4 01/15/42 | 3.75  | 500   | 785   | 97,681  | 2042/1/15  |
| NETHER 4 01/15/37     | 4.0   | 660   | 1,023 | 127,257 | 2037/1/15  |
| NETHER 4 07/15/19     | 4.0   | 2,000 | 2,198 | 273,261 | 2019/7/15  |
| NETHER 5 1/2 01/15/28 | 5.5   | 690   | 1,049 | 130,391 | 2028/1/15  |
| NETHER 7 1/2 01/15/23 | 7.5   | 970   | 1,393 | 173,212 | 2023/1/15  |
| (ユーロ…スペイン)<br>国債証券    |       |       |       |         |            |
| SPGB 1.3 10/31/26     | 1.3   | 500   | 494   | 61,466  | 2026/10/31 |
| SPGB 1.6 04/30/25     | 1.6   | 1,900 | 1,967 | 244,601 | 2025/4/30  |
| SPGB 1.95 04/30/26    | 1.95  | 1,500 | 1,577 | 196,033 | 2026/4/30  |
| SPGB 1.95 07/30/30    | 1.95  | 200   | 199   | 24,847  | 2030/7/30  |
| SPGB 2 3/4 04/30/19   | 2.75  | 1,500 | 1,587 | 197,338 | 2019/4/30  |
| SPGB 2.9 10/31/46     | 2.9   | 400   | 403   | 50,172  | 2046/10/31 |
| SPGB 3 3/4 10/31/18   | 3.75  | 900   | 953   | 118,475 | 2018/10/31 |
| SPGB 3.45 07/30/66    | 3.45  | 100   | 105   | 13,109  | 2066/7/30  |
| SPGB 3.8 04/30/24     | 3.8   | 600   | 716   | 89,000  | 2024/4/30  |
| SPGB 4 04/30/20       | 4.0   | 1,200 | 1,343 | 166,999 | 2020/4/30  |
| SPGB 4.2 01/31/37     | 4.2   | 800   | 1,019 | 126,766 | 2037/1/31  |
| SPGB 4.3 10/31/19     | 4.3   | 1,500 | 1,662 | 206,633 | 2019/10/31 |
| SPGB 4.4 10/31/23     | 4.4   | 900   | 1,106 | 137,499 | 2023/10/31 |
| SPGB 4.6 07/30/19     | 4.6   | 1,500 | 1,656 | 205,840 | 2019/7/30  |

| 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  |            |
| (ユーロ…スペイン)<br>国債証券   | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| SPGB 4.65 07/30/25   | 4.65  | 2,000 | 2,538 | 315,498 | 2025/7/30  |
| SPGB 4.7 07/30/41    | 4.7   | 400   | 546   | 67,867  | 2041/7/30  |
| SPGB 4.8 01/31/24    | 4.8   | 500   | 629   | 78,246  | 2024/1/31  |
| SPGB 4.85 10/31/20   | 4.85  | 1,500 | 1,749 | 217,400 | 2020/10/31 |
| SPGB 4.9 07/30/40    | 4.9   | 600   | 838   | 104,165 | 2040/7/30  |
| SPGB 5 1/2 04/30/21  | 5.5   | 1,500 | 1,821 | 226,462 | 2021/4/30  |
| SPGB 5 3/4 07/30/32  | 5.75  | 760   | 1,124 | 139,812 | 2032/7/30  |
| SPGB 5.15 10/31/28   | 5.15  | 900   | 1,213 | 150,823 | 2028/10/31 |
| SPGB 5.15 10/31/44   | 5.15  | 400   | 580   | 72,094  | 2044/10/31 |
| SPGB 5.4 01/31/23    | 5.4   | 1,000 | 1,273 | 158,271 | 2023/1/31  |
| SPGB 5.85 01/31/22   | 5.85  | 1,000 | 1,259 | 156,611 | 2022/1/31  |
| SPGB 6 01/31/29      | 6.0   | 1,125 | 1,634 | 203,183 | 2029/1/31  |
| (ユーロ…ベルギー)<br>国債証券   |       |       |       |         |            |
| BGB 0.8 06/22/25     | 0.8   | 1,000 | 1,035 | 128,737 | 2025/6/22  |
| BGB 1 06/22/26       | 1.0   | 500   | 521   | 64,760  | 2026/6/22  |
| BGB 1.6 06/22/47     | 1.6   | 300   | 292   | 36,406  | 2047/6/22  |
| BGB 1.9 06/22/38     | 1.9   | 400   | 434   | 54,015  | 2038/6/22  |
| BGB 2 1/4 06/22/23   | 2.25  | 500   | 570   | 70,956  | 2023/6/22  |
| BGB 2.15 06/22/66    | 2.15  | 200   | 209   | 26,048  | 2066/6/22  |
| BGB 3 3/4 06/22/45   | 3.75  | 400   | 591   | 73,535  | 2045/6/22  |
| BGB 3 3/4 09/28/20   | 3.75  | 1,000 | 1,141 | 141,826 | 2020/9/28  |
| BGB 4 03/28/19       | 4.0   | 1,000 | 1,084 | 134,789 | 2019/3/28  |
| BGB 4 03/28/22       | 4.0   | 40    | 48    | 6,008   | 2022/3/28  |
| BGB 4 03/28/32       | 4.0   | 400   | 563   | 70,000  | 2032/3/28  |
| BGB 4 1/2 03/28/26   | 4.5   | 500   | 678   | 84,306  | 2026/3/28  |
| BGB 4 1/4 03/28/41   | 4.25  | 500   | 779   | 96,922  | 2041/3/28  |
| BGB 4 1/4 09/28/21   | 4.25  | 1,000 | 1,201 | 149,284 | 2021/9/28  |
| BGB 4 1/4 09/28/22   | 4.25  | 900   | 1,115 | 138,618 | 2022/9/28  |
| BGB 5 03/28/35       | 5.0   | 810   | 1,309 | 162,754 | 2035/3/28  |
| BGB 5 1/2 03/28/28   | 5.5   | 1,320 | 1,990 | 247,475 | 2028/3/28  |
| (ユーロ…オーストリア)<br>国債証券 |       |       |       |         |            |
| RAGB 1 3/4 10/20/23  | 1.75  | 500   | 556   | 69,213  | 2023/10/20 |
| RAGB 2.4 05/23/34    | 2.4   | 100   | 120   | 15,003  | 2034/5/23  |
| RAGB 3 1/2 09/15/21  | 3.5   | 500   | 583   | 72,529  | 2021/9/15  |
| RAGB 3.15 06/20/44   | 3.15  | 500   | 695   | 86,450  | 2044/6/20  |
| RAGB 3.4 11/22/22    | 3.4   | 500   | 598   | 74,346  | 2022/11/22 |
| RAGB 3.8 01/26/62    | 3.8   | 100   | 167   | 20,867  | 2062/1/26  |
| RAGB 3.9 07/15/20    | 3.9   | 1,000 | 1,138 | 141,503 | 2020/7/15  |
| RAGB 4.15 03/37      | 4.15  | 550   | 837   | 104,160 | 2037/3/15  |
| RAGB 4.35 03/19      | 4.35  | 1,000 | 1,089 | 135,387 | 2019/3/15  |
| RAGB 4.85 03/26      | 4.85  | 1,300 | 1,809 | 224,949 | 2026/3/15  |
| RAGB 6 1/4 07/15/27  | 6.25  | 160   | 251   | 31,305  | 2027/7/15  |

| 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     |            |
| (ユーロ…フィンランド)<br>国債証券 | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円         |            |
| RFBG 0 3/4 04/15/31  | 0.75  | 400   | 393   | 48,889     | 2031/4/15  |
| RFBG 1 1/2 04/15/23  | 1.5   | 500   | 546   | 67,979     | 2023/4/15  |
| RFBG 2 5/8 07/04/42  | 2.625 | 200   | 263   | 32,698     | 2042/7/4   |
| RFBG 3 1/2 04/15/21  | 3.5   | 500   | 576   | 71,627     | 2021/4/15  |
| RFBG 4 07/04/25      | 4.0   | 300   | 391   | 48,667     | 2025/7/4   |
| RFBG 4 3/8 07/04/19  | 4.375 | 500   | 552   | 68,675     | 2019/7/4   |
| (ユーロ…アイルランド)<br>国債証券 |       |       |       |            |            |
| IRISH 2 02/18/45     | 2.0   | 200   | 203   | 25,252     | 2045/2/18  |
| IRISH 2.4 05/15/30   | 2.4   | 300   | 340   | 42,271     | 2030/5/15  |
| IRISH 3.4 03/18/24   | 3.4   | 500   | 602   | 74,921     | 2024/3/18  |
| IRISH 4 1/2 04/18/20 | 4.5   | 520   | 593   | 73,794     | 2020/4/18  |
| IRISH 5 10/18/20     | 5.0   | 400   | 473   | 58,793     | 2020/10/18 |
| IRISH 5.4 03/13/25   | 5.4   | 1,000 | 1,369 | 170,266    | 2025/3/13  |
| IRISH 5.9 10/18/19   | 5.9   | 1,000 | 1,151 | 143,181    | 2019/10/18 |
| ユ ー ロ 計              |       |       |       | 25,512,592 |            |
| (イギリス)<br>国債証券       |       | 千英ポンド | 千英ポンド |            |            |
| UKT 1 1/2 01/22/21   | 1.5   | 1,000 | 1,046 | 149,278    | 2021/1/22  |
| UKT 1 1/2 07/22/26   | 1.5   | 500   | 524   | 74,831     | 2026/7/22  |
| UKT 1 3/4 07/22/19   | 1.75  | 500   | 518   | 74,025     | 2019/7/22  |
| UKT 1 3/4 09/07/22   | 1.75  | 1,300 | 1,390 | 198,458    | 2022/9/7   |
| UKT 2 07/22/20       | 2.0   | 800   | 846   | 120,765    | 2020/7/22  |
| UKT 2 09/07/25       | 2.0   | 1,000 | 1,095 | 156,319    | 2025/9/7   |
| UKT 2 1/4 09/07/23   | 2.25  | 700   | 772   | 110,288    | 2023/9/7   |
| UKT 2 3/4 09/07/24   | 2.75  | 400   | 458   | 65,457     | 2024/9/7   |
| UKT 3 1/2 01/22/45   | 3.5   | 400   | 556   | 79,398     | 2045/1/22  |
| UKT 3 1/2 07/22/68   | 3.5   | 1,100 | 1,890 | 269,778    | 2068/7/22  |
| UKT 3 1/4 01/22/44   | 3.25  | 1,400 | 1,865 | 266,186    | 2044/1/22  |
| UKT 3 3/4 07/22/52   | 3.75  | 600   | 950   | 135,680    | 2052/7/22  |
| UKT 3 3/4 09/07/19   | 3.75  | 600   | 650   | 92,786     | 2019/9/7   |
| UKT 3 3/4 09/07/20   | 3.75  | 700   | 783   | 111,852    | 2020/9/7   |
| UKT 3 3/4 09/07/21   | 3.75  | 500   | 574   | 81,965     | 2021/9/7   |
| UKT 4 01/22/60       | 4.0   | 700   | 1,249 | 178,303    | 2060/1/22  |
| UKT 4 03/07/22       | 4.0   | 500   | 587   | 83,886     | 2022/3/7   |
| UKT 4 1/2 12/07/42   | 4.5   | 640   | 1,017 | 145,128    | 2042/12/7  |
| UKT 4 1/4 03/07/36   | 4.25  | 800   | 1,148 | 163,870    | 2036/3/7   |
| UKT 4 1/4 09/07/39   | 4.25  | 400   | 592   | 84,606     | 2039/9/7   |
| UKT 4 1/4 12/07/27   | 4.25  | 530   | 700   | 100,000    | 2027/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/40   | 4.25  | 700   | 1,044 | 149,045    | 2040/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/46   | 4.25  | 750   | 1,200 | 171,322    | 2046/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/49   | 4.25  | 700   | 1,165 | 166,318    | 2049/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/55   | 4.25  | 600   | 1,072 | 153,089    | 2055/12/7  |
| UKT 4 3/4 03/07/20   | 4.75  | 900   | 1,016 | 145,102    | 2020/3/7   |
| UKT 4 3/4 12/07/30   | 4.75  | 700   | 994   | 141,963    | 2030/12/7  |

| 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)<br>国債証券           | %     | 千英ポンド   | 千英ポンド   | 千円        |            |
| UKT 4 3/4 12/07/38       | 4.75  | 700     | 1,097   | 156,674   | 2038/12/7  |
| UKT 4.25 06/07/32        | 4.25  | 410     | 568     | 81,178    | 2032/6/7   |
| UKT 4.5 09/07/34         | 4.5   | 900     | 1,308   | 186,696   | 2034/9/7   |
| UKT 5 03/07/25           | 5.0   | 800     | 1,058   | 151,026   | 2025/3/7   |
| UKT 6 12/07/28           | 6.0   | 310     | 474     | 67,742    | 2028/12/7  |
| UKT 8 06/07/21           | 8.0   | 650     | 849     | 121,249   | 2021/6/7   |
| 小 計                      |       |         |         | 4,434,280 |            |
| (スイス)<br>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     | 328     | 37,532    | 2020/7/6   |
| SWISS 4 04/08/28         | 4.0   | 300     | 434     | 49,568    | 2028/4/8   |
| 小 計                      |       |         |         | 87,101    |            |
| (スウェーデン)<br>国債証券         |       | 千クローナ   | 千クローナ   |           |            |
| SGB 1 1/2 11/13/23       | 1.5   | 6,000   | 6,535   | 83,660    | 2023/11/13 |
| SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 | 2.5   | 4,000   | 4,688   | 60,018    | 2025/5/12  |
| SGB 3 1/2 03/30/39       | 3.5   | 1,500   | 2,058   | 26,347    | 2039/3/30  |
| SGB 3 1/2 06/01/22       | 3.5   | 1,000   | 1,182   | 15,133    | 2022/6/1   |
| SGB 5 12/01/20           | 5.0   | 5,920   | 7,054   | 90,295    | 2020/12/1  |
| 小 計                      |       |         |         | 275,454   |            |
| (ノルウェー)<br>国債証券          |       | 千クローナ   | 千クローナ   |           |            |
| NGB 2 05/24/23           | 2.0   | 4,000   | 4,209   | 55,812    | 2023/5/24  |
| NGB 3 3/4 05/25/21       | 3.75  | 4,000   | 4,458   | 59,123    | 2021/5/25  |
| NGB 4 1/2 05/22/19       | 4.5   | 2,000   | 2,155   | 28,585    | 2019/5/22  |
| 小 計                      |       |         |         | 143,521   |            |
| (デンマーク)<br>国債証券          |       | 千デンナーク  | 千デンナーク  |           |            |
| DGB 3 11/15/21           | 3.0   | 4,000   | 4,579   | 76,479    | 2021/11/15 |
| DGB 4 1/2 11/15/39       | 4.5   | 5,500   | 9,137   | 152,590   | 2039/11/15 |
| DGB 4 11/15/19           | 4.0   | 3,000   | 3,332   | 55,656    | 2019/11/15 |
| DGB 7 11/10/24           | 7.0   | 3,260   | 4,905   | 81,918    | 2024/11/10 |
| 小 計                      |       |         |         | 366,644   |            |
| (ポーランド)<br>国債証券          |       | 千ズロツ    | 千ズロツ    |           |            |
| POLGB 1 3/4 07/25/21     | 1.75  | 2,000   | 1,928   | 57,300    | 2021/7/25  |
| POLGB 2 1/2 07/25/18     | 2.5   | 3,500   | 3,532   | 104,976   | 2018/7/25  |
| POLGB 5 1/2 10/25/19     | 5.5   | 1,000   | 1,080   | 32,118    | 2019/10/25 |
| POLGB 5 3/4 09/23/22     | 5.75  | 3,800   | 4,357   | 129,503   | 2022/9/23  |
| POLGB 5 3/4 10/25/21     | 5.75  | 2,000   | 2,261   | 67,202    | 2021/10/25 |
| 小 計                      |       |         |         | 391,102   |            |
| (オーストラリア)<br>国債証券        |       | 千豪ドル    | 千豪ドル    |           |            |
| ACGB 2 3/4 04/21/24      | 2.75  | 1,400   | 1,450   | 120,180   | 2024/4/21  |
| ACGB 2 3/4 11/21/27      | 2.75  | 800     | 821     | 68,051    | 2027/11/21 |

| 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)<br>国債証券    | %     | 千豪ドル      | 千豪ドル      | 千円         |            |
| ACGB 3 1/4 04/21/25  | 3.25  | 600       | 641       | 53,186     | 2025/4/21  |
| ACGB 3 1/4 04/21/29  | 3.25  | 1,600     | 1,710     | 141,723    | 2029/4/21  |
| ACGB 3 3/4 04/21/37  | 3.75  | 800       | 875       | 72,572     | 2037/4/21  |
| ACGB 4 1/2 04/20     | 4.5   | 1,000     | 1,079     | 89,434     | 2020/4/15  |
| ACGB 4 1/2 04/21/33  | 4.5   | 600       | 728       | 60,390     | 2033/4/21  |
| ACGB 4 1/4 04/21/26  | 4.25  | 1,400     | 1,612     | 133,601    | 2026/4/21  |
| ACGB 4 3/4 04/21/27  | 4.75  | 1,000     | 1,205     | 99,904     | 2027/4/21  |
| ACGB 5 1/2 04/21/23  | 5.5   | 500       | 594       | 49,278     | 2023/4/21  |
| ACGB 5 1/4 03/15/19  | 5.25  | 1,660     | 1,766     | 146,350    | 2019/3/15  |
| ACGB 5 3/4 05/15/21  | 5.75  | 2,400     | 2,758     | 228,584    | 2021/5/15  |
| ACGB 5 3/4 07/15/22  | 5.75  | 800       | 947       | 78,501     | 2022/7/15  |
| 小 計                  |       |           |           | 1,341,759  |            |
| (シンガポール)<br>国債証券     |       | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル |            |            |
| SIGB 2 3/4 04/01/42  | 2.75  | 500       | 530       | 42,716     | 2042/4/1   |
| SIGB 3 1/2 03/01/27  | 3.5   | 300       | 337       | 27,172     | 2027/3/1   |
| SIGB 3 1/4 09/01/20  | 3.25  | 900       | 953       | 76,722     | 2020/9/1   |
| SIGB 3 1/8 09/01/22  | 3.125 | 500       | 537       | 43,283     | 2022/9/1   |
| SIGB 4 09/01/18      | 4.0   | 500       | 518       | 41,709     | 2018/9/1   |
| 小 計                  |       |           |           | 231,604    |            |
| (マレーシア)<br>国債証券      |       | 千リンギット    | 千リンギット    |            |            |
| MGS 3.502 05/31/27   | 3.502 | 1,000     | 947       | 24,712     | 2027/5/31  |
| MGS 4.16 07/15/21    | 4.16  | 1,000     | 1,020     | 26,601     | 2021/7/15  |
| MGS 4.181 07/15/24   | 4.181 | 1,000     | 1,018     | 26,549     | 2024/7/15  |
| MGS 4.378 11/29/19   | 4.378 | 2,700     | 2,760     | 72,000     | 2019/11/29 |
| MGS 4.392 04/15/26   | 4.392 | 2,500     | 2,566     | 66,921     | 2026/4/15  |
| MGS 5.248 09/28      | 5.248 | 1,200     | 1,305     | 34,034     | 2028/9/15  |
| 小 計                  |       |           |           | 250,820    |            |
| (南アフリカ)<br>国債証券      |       | 千ラング      | 千ラング      |            |            |
| SAGB 10 1/2 12/21/26 | 10.5  | 10,000    | 11,289    | 97,988     | 2026/12/21 |
| SAGB 6 1/2 02/28/41  | 6.5   | 5,000     | 3,596     | 31,213     | 2041/2/28  |
| SAGB 6 1/4 03/31/36  | 6.25  | 15,000    | 10,948    | 95,032     | 2036/3/31  |
| SAGB 7 02/28/31      | 7.0   | 8,000     | 6,733     | 58,447     | 2031/2/28  |
| SAGB 7 1/4 01/15/20  | 7.25  | 1,000     | 996       | 8,646      | 2020/1/15  |
| SAGB 8 3/4 02/28/48  | 8.75  | 6,000     | 5,504     | 47,178     | 2048/2/28  |
| 小 計                  |       |           |           | 339,107    |            |
| 合 計                  |       |           |           | 63,042,009 |            |

(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17期（決算日 2017年3月21日）

（計算期間 2016年3月23日～2017年3月21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 | 純総資産額   |
|-----------------|---------|-------|----------|-------|-------|-------|---------|
|                 | 期騰落     | 中率    | 期騰落      | 中率    |       |       |         |
|                 | 円       | %     |          | %     | %     | %     | 百万円     |
| 13期(2013年3月21日) | 7,590   | 26.0  | 1,058.10 | 23.2  | 98.8  | 1.2   | 151,771 |
| 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  |

（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)      | 円       | %     |             | %     | %         | %         |
| 2016年3月22日 | 10,430  | —     | 1,369.93    | —     | 98.5      | 1.6       |
| 3月末        | 10,351  | △ 0.8 | 1,347.20    | △ 1.7 | 97.1      | 2.9       |
| 4月末        | 10,298  | △ 1.3 | 1,340.55    | △ 2.1 | 97.4      | 2.5       |
| 5月末        | 10,601  | 1.6   | 1,379.80    | 0.7   | 97.0      | 2.8       |
| 6月末        | 9,584   | △ 8.1 | 1,245.82    | △ 9.1 | 97.7      | 2.2       |
| 7月末        | 10,178  | △ 2.4 | 1,322.74    | △ 3.4 | 97.8      | 2.2       |
| 8月末        | 10,235  | △ 1.9 | 1,329.54    | △ 2.9 | 98.7      | 1.1       |
| 9月末        | 10,263  | △ 1.6 | 1,322.78    | △ 3.4 | 97.9      | 2.1       |
| 10月末       | 10,810  | 3.6   | 1,393.02    | 1.7   | 98.1      | 1.8       |
| 11月末       | 11,409  | 9.4   | 1,469.43    | 7.3   | 98.0      | 1.8       |
| 12月末       | 11,808  | 13.2  | 1,518.61    | 10.9  | 97.4      | 2.5       |
| 2017年1月末   | 11,834  | 13.5  | 1,521.67    | 11.1  | 98.1      | 1.4       |
| 2月末        | 11,949  | 14.6  | 1,535.32    | 12.1  | 98.2      | 1.5       |
| (期 末)      |         |       |             |       |           |           |
| 2017年3月21日 | 12,166  | 16.6  | 1,563.42    | 14.1  | 97.2      | 2.1       |

(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3月23日～2017年3月21日)

### ■期中の基準価額等の推移

期 首：10,430円

期 末：12,166円

騰落率： 16.6%

### ◇基準価額の主な変動要因

#### プラス要因

- ・日銀による金融緩和政策の継続
- ・米大統領選後のトランプ新大統領の政策への期待感
- ・2016年10月以降の円安米ドル高の進行
- ・原油をはじめとする資源価格の上昇

#### マイナス要因

- ・期前半の米国の利上げ観測の後退などを背景とした円高米ドル安の進行
- ・英国の国民投票におけるEU（欧州連合）離脱派の勝利
- ・米大統領選を巡る不透明感の高まり

### ■投資環境

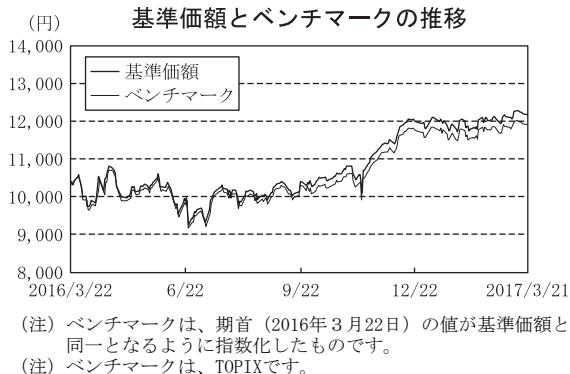
当期の国内株式市場は、日銀の金融政策や為替動向、欧米の選挙などの影響を受けて大きく変動しました。

期初、景気減速懸念から米国の利上げ観測が後退し、為替が円高米ドル安傾向で推移したことによる輸出関連企業の業績悪化懸念や、日銀によるマイナス金利の導入が金融機関の業績に与える影響、国内消費の回復感の乏しさなどから国内株式市場の上値は重く、弱含みで推移しました。2016年6月には英国のEU離脱を問う国民投票で離脱派が勝利したことにより先行き不透明感が強まり、国内株式市場は急落しました。

その後、10月までは国内消費の低迷や円高の進行、米大統領選の不透明感などから国内株式市場の戻りは鈍く、方向感なく推移しましたが、日銀のETF（指数連動型上場投資信託）買い入れにより下値も限定的となる展開が続きました。

11月の米大統領選においてトランプ候補が勝利すると、同氏の掲げる大型減税やインフラ投資などの政策への期待から米国金利が上昇したことにより、為替が円安米ドル高となったことから、国内株式市場は企業業績回復への期待から大きく反発して当期の高値を更新しました。

12月中旬以降は、同氏の大統領就任後の政策の実現性を見極める姿勢が強まり、高値圏で一進一退の動きとなりました。



## ■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1,035銘柄でした。期中では、ベンチマークとのトラッキングエラー\*を一定程度に抑えるため、設定・解約に応じたTOPIX先物と現物株式の売買を行い、実質的な株式組入比率はほぼ100%を維持しました。なお、期末における保有銘柄数は1,118銘柄となりました。

※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。

## ■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+16.6%となり、ベンチマークであるTOPIXにほぼ連動しました。また、TOPIXからの乖離度合いを表すトラッキングエラーは、過去1年で1.1%となりました。

（主な差異要因）

プラス要因

・配当金収入

## ○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

（2016年3月23日～2017年3月21日）

| 項 目                                                 | 当 期                  |                                  | 項 目 の 概 要                                                               |
|-----------------------------------------------------|----------------------|----------------------------------|-------------------------------------------------------------------------|
|                                                     | 金 額                  | 比 率                              |                                                                         |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料<br>( 株 式 )<br>( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ) | 円<br>1<br>(0)<br>(1) | %<br>0.009<br>(0.000)<br>(0.009) | (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<br>* 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<br>( そ の 他 )                          | 0<br>(0)             | 0.000<br>(0.000)                 | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br>* その他は、信託事務等に要する諸費用                    |
| 合 計                                                 | 1                    | 0.009                            |                                                                         |
| 期中の平均基準価額は、10,776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

(2016年3月23日～2017年3月21日)

## 株式

|   |    | 買 付      |           | 売 付    |            |
|---|----|----------|-----------|--------|------------|
|   |    | 株 数      | 金 額       | 株 数    | 金 額        |
| 国 |    | 千株       | 千円        | 千株     | 千円         |
| 内 | 上場 | 3,351    | 3,942,189 | 50,615 | 68,375,403 |
|   |    | (△6,782) | ( )       |        |            |

(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     |        | 百万円    | 百万円    | 百万円   | 百万円   |
| 内     | 株式先物取引 | 69,862 | 70,695 | 1,280 | 1,288 |

## ○株式売買比率

(2016年3月23日～2017年3月21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       | 72,317,592千円  |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 104,087,566千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.69          |

(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3月23日～2017年3月21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 |
|-----|-------|-------|-------------|
|     | 百万円   | 百万円   | 百万円         |
| 株式  | 8     | 543   | 690         |

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

(2017年3月21日現在)

## 国内株式

| 銘柄                   | 期首(前期末) |       |         | 当 期 末 |       |       |
|----------------------|---------|-------|---------|-------|-------|-------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 | 評 価 額 | 評 価 額 |
|                      | 千株      | 千株    | 千株      | 千円    | 千円    | 千円    |
| <b>水産・農林業 (0.1%)</b> |         |       |         |       |       |       |
| 日本水産                 | 82.9    | 49    | 27,832  |       |       |       |
| マルハニチロ               | 14.6    | 7.3   | 26,134  |       |       |       |
| サカタのタネ               | 10.8    | 5.4   | 18,333  |       |       |       |
| ホクト                  | 10.7    | 7.7   | 16,678  |       |       |       |
| <b>鉱業 (0.3%)</b>     |         |       |         |       |       |       |
| 日鉄鉱業                 | 33      | 0.1   | 584     |       |       |       |
| 国際石油開発帝石             | 382.9   | 201.2 | 222,627 |       |       |       |
| 石油資源開発               | 10.1    | 5.4   | 13,969  |       |       |       |
| K&Oエナジーグループ          | 14.3    | 12.2  | 22,399  |       |       |       |
| <b>建設業 (2.9%)</b>    |         |       |         |       |       |       |
| ショーボンドホールディングス       | 7.8     | 3.9   | 19,461  |       |       |       |
| ミライト・ホールディングス        | 34      | 14.7  | 17,301  |       |       |       |
| 安藤・間                 | 54      | 27    | 21,411  |       |       |       |
| 東急建設                 | —       | 12.8  | 10,892  |       |       |       |
| コムシスホールディングス         | 31.2    | 15.8  | 32,974  |       |       |       |
| ミサワホーム               | 23      | 12.3  | 13,357  |       |       |       |
| 東建コーポレーション           | 2.7     | 0.9   | 8,100   |       |       |       |
| ヤマウラ                 | 45.8    | 24.6  | 15,350  |       |       |       |
| 大成建設                 | 377     | 195   | 160,290 |       |       |       |
| 大林組                  | 215.7   | 115.4 | 120,477 |       |       |       |
| 清水建設                 | 217     | 118   | 120,832 |       |       |       |
| 長谷工コーポレーション          | 86.6    | 44.3  | 57,988  |       |       |       |
| 鹿島建設                 | 341     | 168   | 127,512 |       |       |       |
| 西松建設                 | 86      | 42    | 24,822  |       |       |       |
| 三井住友建設               | —       | 160.8 | 19,939  |       |       |       |
| 前田建設工業               | 40      | 24    | 25,224  |       |       |       |
| 奥村組                  | 65      | 31    | 22,444  |       |       |       |
| 東鉄工業                 | 8.8     | 4     | 13,020  |       |       |       |
| 戸田建設                 | 86      | 43    | 30,659  |       |       |       |
| 熊谷組                  | 98      | 57    | 17,214  |       |       |       |
| 大東建託                 | 27.1    | 14.1  | 222,568 |       |       |       |
| N I P P O            | 15      | 8     | 17,592  |       |       |       |
| 前田道路                 | 21      | 12    | 24,684  |       |       |       |
| 東亜建設工業               | —       | 7.8   | 15,943  |       |       |       |
| 五洋建設                 | 86      | 44.8  | 25,312  |       |       |       |
| 大林道路                 | 17.2    | 16.6  | 11,387  |       |       |       |
| 福田組                  | —       | 1     | 1,051   |       |       |       |
| 住友林業                 | 50.9    | 25.8  | 45,175  |       |       |       |
| 日本基礎技術               | 52.4    | 30.4  | 11,035  |       |       |       |
| パナホーム                | 36      | 10    | 10,290  |       |       |       |
| 大和ハウス工業              | 212.8   | 112.9 | 368,957 |       |       |       |
| 積水ハウス                | 238.1   | 120.2 | 229,461 |       |       |       |
| 北陸電気工事               | —       | 1.7   | 1,570   |       |       |       |
| ユアテック                | 20      | —     | —       |       |       |       |
| 西部電気工業               | 36      | 2.7   | 6,193   |       |       |       |
| 中電工                  | 12.9    | 6.5   | 16,191  |       |       |       |
| 関電工                  | 33      | 13    | 13,338  |       |       |       |

| 銘柄                | 期首(前期末) |       |         | 当 期 末 |       |       |
|-------------------|---------|-------|---------|-------|-------|-------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 | 評 価 額 | 評 価 額 |
|                   | 千株      | 千株    | 千株      | 千円    | 千円    | 千円    |
| きんでん              | 44.7    | 25.7  | 40,811  |       |       |       |
| 東京エネシス            | 15      | —     | —       |       |       |       |
| トーエネック            | 21      | —     | —       |       |       |       |
| 日本電設工業            | 13.3    | 6     | 12,270  |       |       |       |
| 協和エクシオ            | 30.1    | 16    | 26,624  |       |       |       |
| 新日本空調             | 21.4    | 15.5  | 21,467  |       |       |       |
| 九電工               | 11      | 7.3   | 23,250  |       |       |       |
| 三機工業              | 28.7    | 18.1  | 18,624  |       |       |       |
| 日揮                | 73      | 35.5  | 73,662  |       |       |       |
| 中外炉工業             | 67      | 54    | 12,528  |       |       |       |
| ヤマト               | 47.4    | 25.2  | 14,490  |       |       |       |
| 太平電業              | 21      | —     | —       |       |       |       |
| 高砂熱学工業            | 23.7    | 11.5  | 19,446  |       |       |       |
| 三晃金属工業            | 43      | 2     | 6,720   |       |       |       |
| 大気社               | 9.7     | 5.5   | 16,010  |       |       |       |
| 日比谷総合設備           | 14.7    | 11.6  | 19,557  |       |       |       |
| 東芝プラントシステム        | 18.2    | 6.2   | 9,696   |       |       |       |
| 東洋エンジニアリング        | 67      | 34    | 9,452   |       |       |       |
| 千代田化工建設           | 55      | 26    | 19,864  |       |       |       |
| 新興プランテック          | 28.7    | 19.8  | 17,602  |       |       |       |
| <b>食料品 (4.5%)</b> |         |       |         |       |       |       |
| 日本製粉              | 48      | 11    | 18,964  |       |       |       |
| 日清製粉グループ本社        | 80.3    | 42.6  | 75,018  |       |       |       |
| 鳥越製粉              | 23.4    | 21.6  | 17,560  |       |       |       |
| 日本甜菜製糖            | 117     | 7.7   | 19,250  |       |       |       |
| 三井製糖              | 50      | 5.2   | 14,669  |       |       |       |
| 森永製菓              | 61      | 7.4   | 39,738  |       |       |       |
| 中村屋               | 37      | 0.5   | 2,645   |       |       |       |
| 江崎グリコ             | 16.8    | 9.5   | 53,200  |       |       |       |
| 山崎製パン             | 50      | 28    | 64,988  |       |       |       |
| 亀田製菓              | —       | 1.2   | 6,180   |       |       |       |
| カルビー              | 25.6    | 15.4  | 61,523  |       |       |       |
| 森永乳業              | 61      | 34    | 33,524  |       |       |       |
| ヤクルト本社            | 38.1    | 20.4  | 122,808 |       |       |       |
| 明治ホールディングス        | 42.9    | 22.6  | 211,310 |       |       |       |
| 雪印メグミルク           | 18      | 8.2   | 25,502  |       |       |       |
| プリマハム             | —       | 15    | 7,605   |       |       |       |
| 日本ハム              | 53      | 26    | 80,470  |       |       |       |
| 伊藤ハム              | 36      | —     | —       |       |       |       |
| 丸大食品              | 50      | 15    | 7,635   |       |       |       |
| S F o o d s       | 7.5     | 4.8   | 15,264  |       |       |       |
| 伊藤ハム米久ホールディングス    | —       | 23.8  | 26,322  |       |       |       |
| サッポロホールディングス      | 116     | 12.5  | 37,300  |       |       |       |
| アサヒグループホールディングス   | 136.1   | 71.6  | 300,720 |       |       |       |
| 麒麟ホールディングス        | 294.2   | 164.4 | 344,500 |       |       |       |
| 宝ホールディングス         | 57.2    | 28.2  | 34,855  |       |       |       |
| オエノンホールディングス      | 54      | 39    | 9,672   |       |       |       |
| コカ・コーラウエスト        | 24.4    | 12.7  | 47,307  |       |       |       |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|---------------------|---------|-------|---------|
|                     | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                     | 千株      | 千株    | 千円      |
| コカ・コーライーストジャパン      | 27.9    | 14.9  | 41,273  |
| サントリー食品インターナショナル    | 49.9    | 26.4  | 124,476 |
| ダイドグループホールディングス     | 4.6     | 1.2   | 6,552   |
| 伊藤園                 | 21.1    | 11.4  | 46,455  |
| キーコーヒー              | 11.4    | 9.8   | 22,853  |
| ユニカフェ               | —       | 0.3   | 291     |
| ジャパンフーズ             | 18.7    | 12.1  | 17,508  |
| 日清オイログループ           | 50      | 16    | 10,480  |
| 不二製油グループ本社          | 21      | 10    | 26,790  |
| J-オイルミルズ            | 44      | 1.6   | 6,864   |
| キッコーマン              | 54      | 27    | 92,880  |
| 味の素                 | 155     | 78.7  | 178,727 |
| キュービー               | 37.3    | 19.5  | 63,375  |
| ハウス食品グループ本社         | 25      | 13.9  | 34,944  |
| カゴメ                 | 26.5    | 13.7  | 41,017  |
| アリアケジャパン            | 5.5     | 3     | 20,670  |
| ニチレイ                | 80      | 19.2  | 54,201  |
| 東洋水産                | 36      | 18.8  | 81,686  |
| 日清食品ホールディングス        | 30.9    | 14.9  | 97,893  |
| 永谷園ホールディングス         | 11      | —     | —       |
| フジッコ                | 11.2    | 7.5   | 18,937  |
| ロック・フィールド           | 6.2     | 9.5   | 18,259  |
| 日本たばこ産業             | 424.6   | 211.6 | 815,929 |
| ユウグレナ               | 25.8    | 11.9  | 15,065  |
| <b>繊維製品 (0.7%)</b>  |         |       |         |
| 片倉工業                | 13.3    | 9     | 13,293  |
| グンゼ                 | 80      | 44    | 19,580  |
| 東洋紡                 | 291     | 138   | 27,876  |
| 倉敷紡績                | 124     | 80    | 19,920  |
| 日本毛織                | 26      | 11.1  | 9,967   |
| 帝国繊維                | 11.2    | 7.6   | 12,608  |
| 帝人                  | 280     | 28.9  | 62,741  |
| 東レ                  | 492     | 259   | 259,259 |
| 日本フェルト              | 39.8    | 32.1  | 16,916  |
| セーレン                | 22      | 9.1   | 15,015  |
| 小松精練                | 31      | 23.5  | 17,390  |
| ワコールホールディングス        | 41      | 20    | 28,440  |
| ホギメディカル             | 4.3     | 2.2   | 15,136  |
| T S I ホールディングス      | 35      | 26.6  | 21,200  |
| 三陽商会                | 67      | 58    | 9,628   |
| オンワードホールディングス       | 38      | 22    | 17,512  |
| デサント                | 18.2    | 11.6  | 15,810  |
| <b>パルプ・紙 (0.3%)</b> |         |       |         |
| 特種東海製紙              | 84      | 2.9   | 13,412  |
| 王子ホールディングス          | 281     | 138   | 75,072  |
| 日本製紙                | 34.5    | 15.7  | 33,142  |
| 三菱製紙                | 277     | 23.3  | 18,034  |
| 北越紀州製紙              | 43.7    | 23.3  | 18,127  |
| 大王製紙                | 27.9    | 15.3  | 22,246  |
| レンゴー                | 56      | 33    | 21,384  |
| ザ・バック               | 11.1    | 5.9   | 18,821  |
| <b>化学 (6.7%)</b>    |         |       |         |
| クラレ                 | 108.1   | 59.7  | 102,982 |
| 旭化成                 | 424     | 223   | 246,749 |

| 銘柄              | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-----------------|---------|-------|---------|
|                 | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                 | 千株      | 千株    | 千円      |
| 共和レザー           | 25      | 18.3  | 16,616  |
| 昭和電工            | 456     | 24    | 46,488  |
| 住友化学            | 500     | 263   | 172,528 |
| 住友精化            | 27      | 0.5   | 2,375   |
| 日産化学工業          | 40.8    | 19.6  | 67,620  |
| クレハ             | 59      | 2.1   | 10,458  |
| 石原産業            | 253     | 9.5   | 11,039  |
| 片倉コープアグリ        | 56      | 41    | 10,537  |
| 日本曹達            | 39      | 14    | 9,100   |
| 東ソー             | 183     | 105   | 105,000 |
| トクヤマ            | 120     | 55    | 30,085  |
| セントラル硝子         | 66      | 34    | 17,340  |
| 東亜合成            | 43.1    | 22.2  | 28,726  |
| 大阪ソーダ           | 54      | 17    | 8,619   |
| デンカ             | 139     | 73    | 44,530  |
| 信越化学工業          | 120.2   | 64    | 620,672 |
| 堺化学工業           | 59      | 13    | 5,395   |
| エア・ウォーター        | 54      | 29.3  | 61,823  |
| 大陽日酸            | 51.8    | 28    | 37,884  |
| 日本パーカライジング      | 34.4    | 18.3  | 25,857  |
| 四国化成工業          | 16      | —     | —       |
| ステラ ケミファ        | 8.6     | 0.9   | 2,902   |
| 日本触媒            | 10.3    | 5.7   | 44,745  |
| カネカ             | 89      | 48    | 42,192  |
| 三菱瓦斯化学          | 114     | 33.4  | 81,496  |
| 三井化学            | 278     | 165   | 94,050  |
| J S R           | 63.2    | 35.8  | 70,096  |
| 東京応化工業          | 14      | 7     | 25,795  |
| 三菱ケミカルホールディングス  | 447.3   | 240.4 | 212,201 |
| ダイセル            | 96.5    | 48.6  | 66,096  |
| 住友バークライト        | 57      | 31    | 21,204  |
| 積水化学工業          | 148.3   | 81.6  | 160,262 |
| 日本ゼオン           | 54      | 30    | 37,050  |
| アイカ工業           | 20.7    | 11.3  | 34,521  |
| 宇部興産            | 357     | 182   | 49,686  |
| 旭有機材            | 53      | 46    | 11,500  |
| 日立化成            | 34.1    | 19.9  | 63,381  |
| 群栄化学工業          | 46      | 0.3   | 1,105   |
| タイガースポリマー       | 27.2    | 18.9  | 14,023  |
| ミライアル           | 11.1    | 9.3   | 9,830   |
| 日本化薬            | 42      | 23    | 35,926  |
| ADEKA           | 32.7    | 15.4  | 24,763  |
| 日油              | 49      | 28    | 33,180  |
| ハリマ化成グループ       | 38.8    | 28.6  | 23,251  |
| 花王              | 180.3   | 90.7  | 548,644 |
| ニイタカ            | —       | 0.3   | 515     |
| 三洋化成工業          | 31      | 1.3   | 6,090   |
| 日本ペイントホールディングス  | 52.9    | 27.6  | 109,848 |
| 関西ペイント          | 77.2    | 37.4  | 87,179  |
| 中国塗料            | 28      | 8.1   | 6,795   |
| 太陽ホールディングス      | 6.9     | 3     | 15,270  |
| D I C           | 271     | 14    | 58,730  |
| サカタインクス         | —       | 8.5   | 13,353  |
| 東洋インキSCホールディングス | 63      | 35    | 19,985  |

| 銘柄                | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|-------------------|---------|-------|---------|
|                   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                   | 千株      | 千株    | 千円      |
| 富士フイルムホールディングス    | 152.9   | 70.8  | 320,016 |
| 資生堂               | 129.2   | 67.7  | 202,321 |
| ライオン              | 78      | 44    | 91,124  |
| 高砂香料工業            | 7.6     | 4.4   | 15,796  |
| マンダム              | 6.7     | 3.5   | 19,040  |
| ファンケル             | 19.7    | 8.3   | 13,993  |
| コーセー              | 10.6    | 5.7   | 58,767  |
| コタ                | —       | 0.8   | 1,189   |
| シーズ・ホールディングス      | 12.5    | 4.1   | 14,370  |
| ポーラ・オルビスホールディングス  | 6.9     | 3.6   | 38,808  |
| エステー              | 16.2    | 13.2  | 24,261  |
| 長谷川香料             | 14.7    | 10.4  | 22,214  |
| 小林製薬              | 9.9     | 9.7   | 53,350  |
| 荒川化学工業            | 14.4    | 10.1  | 20,846  |
| メック               | 19.3    | 11.4  | 13,794  |
| J C U             | 1.5     | —     | —       |
| アース製薬             | 5.3     | 1.7   | 10,217  |
| イハラケミカル工業         | 19      | 15.5  | 16,011  |
| 大成ラミック            | 5       | 2     | 5,800   |
| クミアイ化学工業          | 18.2    | 11    | 7,183   |
| 日本農薬              | 23.3    | 12.1  | 8,566   |
| 日電東工              | 52.4    | 25.8  | 225,466 |
| レック               | 15.3    | 6.2   | 30,907  |
| 前澤化成工業            | 13.3    | 10.4  | 12,500  |
| エフビコ              | 6.7     | 3.1   | 15,562  |
| 天馬                | 10.6    | 8.8   | 18,708  |
| 信越ポリマー            | 32.7    | 14    | 11,424  |
| ニフコ               | 13.1    | 6.2   | 35,402  |
| 日本バルカー工業          | 74      | 10    | 19,530  |
| ユニ・チャーム           | 137.5   | 72.4  | 192,692 |
| <b>医薬品 (4.7%)</b> |         |       |         |
| 協和発酵キリン           | 82      | 42.4  | 72,800  |
| 武田薬品工業            | 267.3   | 133.8 | 711,147 |
| アステラス製薬           | 750.5   | 364.4 | 552,794 |
| 大日本住友製薬           | 51.4    | 25    | 48,850  |
| 塩野義製薬             | 98.7    | 45.3  | 255,265 |
| 田辺三菱製薬            | 79.8    | 41.7  | 98,078  |
| あすか製薬             | 17.8    | 6.8   | 11,634  |
| 日本新薬              | 16.1    | 8.2   | 48,052  |
| 中外製薬              | 67.8    | 35.3  | 136,258 |
| 科研製薬              | 12.1    | 6.6   | 42,438  |
| エーザイ              | 83.3    | 44    | 266,596 |
| ロート製薬             | 33.4    | 17.4  | 38,071  |
| 小野薬品工業            | 30.4    | 81    | 194,400 |
| 久光製薬              | 19.8    | 10    | 63,100  |
| 持田製薬              | 4.6     | 2.4   | 20,976  |
| 参天製薬              | 120.3   | 65.3  | 109,573 |
| 日本ケミファ            | 15      | —     | —       |
| ツムラ               | 21.5    | 11.8  | 41,123  |
| 日医工               | 16.2    | 8.3   | 14,010  |
| キッセイ薬品工業          | 12.3    | 6.1   | 18,635  |
| 生化学工業             | 17.9    | 8.1   | 15,495  |
| 鳥居薬品              | 8.7     | 6.7   | 19,805  |
| J C R ファーマ        | —       | 2.2   | 5,588   |

| 銘柄                     | 期首(前期末) | 当 期 末 |         |
|------------------------|---------|-------|---------|
|                        | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |
|                        | 千株      | 千株    | 千円      |
| 東和薬品                   | 3.1     | 1.1   | 6,006   |
| 沢井製薬                   | 11.1    | 6     | 36,600  |
| ゼリア新薬工業                | 13.9    | 8.4   | 15,128  |
| 第一三共                   | 226.3   | 105.1 | 273,522 |
| キョーリン製薬ホールディングス        | 19.3    | 9.1   | 22,194  |
| 大幸薬品                   | —       | 1.2   | 2,263   |
| 大塚ホールディングス             | 143.6   | 76.8  | 392,678 |
| 大正製薬ホールディングス           | 16.5    | 7.7   | 69,916  |
| ペプチドリーム                | 8.4     | 6.5   | 34,840  |
| <b>石油・石炭製品 (0.6%)</b>  |         |       |         |
| 昭和シェル石油                | 67.5    | 31.6  | 35,739  |
| ニチレキ                   | 14.9    | 15.9  | 14,818  |
| 東燃ゼネラル石油               | 101     | 58    | 78,068  |
| 出光興産                   | 35.5    | 16.9  | 65,149  |
| J X ホールディングス           | 791.3   | 395.6 | 213,149 |
| コスモエネルギーホールディングス       | 20.4    | 12.1  | 23,667  |
| <b>ゴム製品 (1.0%)</b>     |         |       |         |
| 横浜ゴム                   | 41.2    | 21.7  | 50,235  |
| 東洋ゴム工業                 | 31.1    | 19    | 37,012  |
| ブリヂストン                 | 226.6   | 120.4 | 555,405 |
| 住友ゴム工業                 | 61.4    | 33.6  | 64,680  |
| オカモト                   | 29      | 7     | 7,833   |
| ニッタ                    | 9       | 4.9   | 16,121  |
| 住友理工                   | 21.5    | 13.6  | 16,292  |
| 三ツ星ベルト                 | 22      | 4     | 4,368   |
| バンドー化学                 | 43      | 11.4  | 11,844  |
| <b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b> |         |       |         |
| 日東紡績                   | 63      | 30    | 16,380  |
| 旭硝子                    | 350     | 175   | 162,925 |
| 日本板硝子                  | 334     | —     | —       |
| 日本山村硝子                 | 72      | 48    | 9,792   |
| 日本電気硝子                 | 138     | 73    | 51,830  |
| 住友大阪セメント               | 131     | 64    | 30,464  |
| 太平洋セメント                | 433     | 215   | 84,925  |
| 日本ヒューム                 | 17.9    | 14.4  | 10,137  |
| 東海カーボン                 | 77      | 32.8  | 16,301  |
| 日本カーボン                 | 73      | —     | —       |
| 東洋炭素                   | 11.4    | 4.3   | 8,127   |
| ノリタケカンパニーリミテド          | 69      | 1.1   | 3,275   |
| T O T O                | 50.1    | 26.1  | 115,753 |
| 日本碍子                   | 84      | 44.6  | 111,901 |
| 日本特殊陶業                 | 56.2    | 30.7  | 81,109  |
| M A R U W A            | 1.8     | —     | —       |
| ニチアス                   | 34      | 19    | 21,299  |
| ニチハ                    | 18.3    | 6.9   | 23,149  |
| <b>鉄鋼 (1.3%)</b>       |         |       |         |
| 新日鐵住金                  | 303.3   | 161   | 427,213 |
| 神戸製鋼所                  | 1,264   | 63.2  | 66,992  |
| 合同製鐵                   | 77      | 3.1   | 5,620   |
| ジェイ エフ イー ホールディングス     | 186.9   | 97.6  | 194,224 |
| 日新製鋼                   | 30.8    | 15.5  | 22,955  |
| 東京製鐵                   | 39.7    | 18.5  | 17,630  |
| 共英製鋼                   | 14.5    | 5     | 10,510  |
| 大和工業                   | 15.3    | 6.8   | 20,978  |

| 銘柄                 | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |  |
|--------------------|---------|-------|---------|--|
|                    | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |  |
|                    | 千株      | 千株    | 千円      |  |
| 大阪製鐵               | 10.5    | 6.6   | 14,110  |  |
| 淀川製鋼所              | 9.5     | 4.8   | 15,360  |  |
| 東洋鋼板               | 47      | 40.3  | 17,691  |  |
| 丸一銅管               | 23.2    | 11.7  | 39,897  |  |
| モリ工業               | —       | 0.6   | 1,374   |  |
| 大同特殊鋼              | 109     | 59    | 31,329  |  |
| 山陽特殊製鋼             | 48      | 14    | 8,680   |  |
| 愛知製鋼               | 50      | 1.2   | 5,646   |  |
| 日立金属               | 79.7    | 35.8  | 56,850  |  |
| 大太平洋金属             | 61      | 28    | 11,424  |  |
| 新日本電工              | 70.6    | 33.8  | 11,255  |  |
| 三菱製鋼               | 74      | 51    | 12,852  |  |
| シンニッタン             | 32.3    | 25.6  | 18,227  |  |
| <b>非鉄金属 (1.0%)</b> |         |       |         |  |
| 日本軽金属ホールディングス      | 163.9   | 86.6  | 22,342  |  |
| 三井金属鉱業             | 181     | 94    | 36,472  |  |
| 東邦亜鉛               | 52      | 19    | 11,077  |  |
| 三菱マテリアル            | 426     | 22.5  | 80,325  |  |
| 住友金属鉱山             | 187     | 92    | 147,522 |  |
| DOWAホールディングス       | 83      | 38    | 32,452  |  |
| 古河機械金属             | 132     | 45    | 10,080  |  |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ     | 14.5    | —     | —       |  |
| U A C J            | 117     | 45    | 13,005  |  |
| 古河電気工業             | 216     | 11.7  | 49,900  |  |
| 住友電気工業             | 268     | 134.4 | 253,680 |  |
| フジクラ               | 90      | 46.7  | 37,920  |  |
| タツタ電線              | 33.6    | 28    | 14,084  |  |
| リョービ               | 63      | 27    | 13,473  |  |
| アサヒホールディングス        | 15.6    | 11.7  | 23,236  |  |
| <b>金属製品 (0.8%)</b> |         |       |         |  |
| トーカロ               | 9.1     | 4     | 10,744  |  |
| SUMCO              | 54.8    | 37.5  | 63,375  |  |
| 東洋製鐵グループホールディングス   | 45.6    | 25.2  | 48,409  |  |
| ホッカンホールディングス       | 33      | 2     | 1,070   |  |
| コロナ                | 17.8    | 14.2  | 16,883  |  |
| 横河ブリッジホールディングス     | 21.1    | 11.6  | 15,741  |  |
| 駒井ハルテック            | 55      | 4.3   | 9,984   |  |
| 三和ホールディングス         | 70.6    | 34.6  | 37,368  |  |
| 文化シャッター            | 26.3    | 11.9  | 10,043  |  |
| 三協立山               | 16.8    | 8.5   | 14,696  |  |
| L I X I L グループ     | 94.9    | 49.4  | 145,927 |  |
| ノーリツ               | 13.6    | 6.5   | 13,877  |  |
| 長府製作所              | 9.2     | 5.8   | 16,100  |  |
| リンナイ               | 11.7    | 6.1   | 58,133  |  |
| 日東精工               | 52      | 32.3  | 15,633  |  |
| 東プレ                | 13.1    | 6.9   | 20,631  |  |
| 高周波熱錬              | 28.7    | 19.7  | 18,419  |  |
| パイオラックス            | 3.9     | 1.2   | 9,540   |  |
| 日本発條               | 64.9    | 35.2  | 45,865  |  |
| 三益半導体工業            | 17.3    | 10.5  | 17,776  |  |
| <b>機械 (5.2%)</b>   |         |       |         |  |
| 日本製鋼所              | 112     | 11.7  | 22,311  |  |
| 三浦工業               | 31.9    | 15.3  | 27,907  |  |
| タクマ                | 26      | 7     | 7,350   |  |

| 銘柄            | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |  |
|---------------|---------|-------|---------|--|
|               | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |  |
|               | 千株      | 千株    | 千円      |  |
| ツガミ           | 17      | 2     | 1,506   |  |
| オークマ          | 52      | 23    | 30,866  |  |
| 東芝機械          | 68      | 34    | 16,660  |  |
| アマダホールディングス   | 98.3    | 48.2  | 62,419  |  |
| アイダエンジニアリング   | 22.3    | 9.3   | 10,230  |  |
| 富士機械製造        | 27.4    | 12.4  | 18,637  |  |
| 牧野フライス製作所     | 32      | 17    | 18,122  |  |
| オーエスジー        | 31.4    | 16.3  | 39,641  |  |
| 旭ダイヤモンド工業     | 24.1    | 9.6   | 8,524   |  |
| DMG森精機        | 38.4    | 21.3  | 39,468  |  |
| ディスコ          | 8.6     | 4.1   | 69,290  |  |
| 日東工器          | 10.2    | 6.9   | 18,064  |  |
| 島精機製作所        | 12.9    | 4.7   | 20,304  |  |
| NCホールディングス    | —       | 0.7   | 649     |  |
| 日阪製作所         | 22.6    | 20.4  | 19,624  |  |
| ナブテスコ         | 33.8    | 18.6  | 58,404  |  |
| SMC           | 20.3    | 10.7  | 355,989 |  |
| 新川            | 26.2    | 20.6  | 16,191  |  |
| ユニオンツール       | 5.2     | 3.5   | 12,617  |  |
| オイレス工業        | 10.5    | 4.1   | 8,851   |  |
| サトーホールディングス   | 14.7    | 5.7   | 14,027  |  |
| 小松製作所         | 330.9   | 164.7 | 495,582 |  |
| 住友重機械工業       | 188     | 104   | 88,296  |  |
| 日立建機          | 31.2    | 15.9  | 46,141  |  |
| 巴工業           | 7.7     | 6.5   | 11,940  |  |
| 井関農機          | 103     | 57    | 13,680  |  |
| タカキタ          | —       | 0.7   | 392     |  |
| クボタ           | 323.3   | 171   | 302,499 |  |
| 月島機械          | 22.2    | 11.8  | 14,301  |  |
| 帝国電機製作所       | 18.5    | 15.1  | 16,972  |  |
| 新東工業          | 24.9    | 14.2  | 14,484  |  |
| 小森コーポレーション    | 21.2    | 7.9   | 12,079  |  |
| 鶴見製作所         | —       | 0.9   | 1,451   |  |
| 住友精密工業        | 30      | 10    | 3,680   |  |
| 荏原製作所         | 149     | 16.2  | 57,996  |  |
| 西島製作所         | 20.4    | 18.3  | 20,569  |  |
| ダイキン工業        | 92.8    | 46.6  | 517,027 |  |
| オルガノ          | 24      | —     | —       |  |
| 栗田工業          | 38.8    | 20.6  | 57,453  |  |
| 椿本チエイン        | 46      | 20    | 20,360  |  |
| ダイフク          | 34.1    | 17.4  | 50,042  |  |
| タダノ           | 27      | 17.7  | 25,842  |  |
| フジテック         | 20.4    | 10.3  | 13,390  |  |
| CKD           | 24.3    | 12.3  | 17,330  |  |
| 平和            | 19.6    | 10.5  | 31,815  |  |
| SANKYO        | 18.7    | 9.5   | 37,382  |  |
| 日本金銭機械        | 9.7     | 8.6   | 13,089  |  |
| 福島工業          | 8.9     | 5.8   | 23,084  |  |
| 竹内製作所         | —       | 6.6   | 15,021  |  |
| アマノ           | 21.3    | 10.6  | 24,168  |  |
| サンデンホールディングス  | 56      | 25    | 9,200   |  |
| グローリー         | 21      | 10.8  | 42,660  |  |
| 大和冷機工業        | 29.9    | 18.6  | 21,278  |  |
| セガサミーホールディングス | 70.8    | 34.3  | 56,697  |  |

| 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               | 46      | 1.6   | 8,432   |  |
| ホシザキ              | 13.9    | 7.5   | 68,475  |  |
| 大豊工業              | 16.7    | 11.4  | 18,388  |  |
| 日本精工              | 134.6   | 71.5  | 121,836 |  |
| NTN               | 159     | 79    | 47,558  |  |
| ジェイテクト            | 66.8    | 36.9  | 69,224  |  |
| 不二越               | 54      | 34    | 20,774  |  |
| 日本トムソン            | 35      | 26.5  | 16,032  |  |
| THK               | 44.3    | 24.4  | 73,566  |  |
| ユーション精機           | 3.7     | 1.9   | 5,909   |  |
| キッツ               | 44.7    | 18.6  | 14,508  |  |
| 日立工機              | 29.5    | —     | —       |  |
| マキタ               | 42.3    | 22.2  | 171,828 |  |
| 日立造船              | 57      | 30.7  | 20,323  |  |
| 三菱重工業             | 1,152   | 571   | 273,566 |  |
| IHI               | 500     | 262   | 93,796  |  |
| スター精密             | —       | 5.8   | 10,196  |  |
| 電気機器 (12.7%)      |         |       |         |  |
| 日清紡ホールディングス       | 37.9    | 18.8  | 22,240  |  |
| イビデン              | 41.5    | 23.4  | 42,003  |  |
| コニカミノルタ           | 163.2   | 80.7  | 86,752  |  |
| ブラザー工業            | 85.9    | 43.9  | 105,360 |  |
| ミネベアミツミ           | 104     | 62.9  | 99,130  |  |
| 日立製作所             | 1,636   | 818   | 513,622 |  |
| 東芝                | 1,332   | 760   | 149,340 |  |
| 三菱電機              | 689     | 363.5 | 613,769 |  |
| 富士電機              | 199     | 101   | 65,347  |  |
| 東洋電機製造            | 41      | 4.4   | 7,779   |  |
| 安川電機              | 75.3    | 39.2  | 89,728  |  |
| 明電舎               | 56      | 20    | 8,120   |  |
| 山洋電気              | 20      | 2     | 1,732   |  |
| 東芝テック             | 58      | 23    | 14,743  |  |
| マブチモーター           | 17.3    | 9.4   | 60,536  |  |
| 日本電産              | 77.8    | 44.2  | 474,487 |  |
| 東光高岳              | 13.3    | 6.4   | 13,664  |  |
| ダブル・スコープ          | —       | 3.6   | 5,922   |  |
| ダイヘン              | 47      | 14    | 10,710  |  |
| 日新電機              | —       | 9     | 11,358  |  |
| オムロン              | 73.5    | 36.3  | 182,952 |  |
| 日東工業              | 16.1    | 4.9   | 8,006   |  |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 121     | 65    | 34,645  |  |
| メルコホールディングス       | 10.1    | 3.5   | 11,970  |  |
| テクノメディア           | —       | 0.5   | 1,154   |  |
| 日本電気              | 894     | 465   | 133,455 |  |
| 富士通               | 626     | 328   | 221,301 |  |
| 沖電気工業             | 311     | 14.1  | 24,111  |  |
| サンケン電気            | 36      | 11    | 5,401   |  |
| アイホン              | 10.4    | 7.9   | 14,559  |  |
| ルネサスエレクトロニクス      | 35.3    | 18.6  | 20,348  |  |
| セイコーエプソン          | 93.2    | 50.7  | 127,713 |  |
| ワコム               | 61.8    | 50.7  | 21,953  |  |
| アルバック             | 11.1    | 5.7   | 30,666  |  |
| EIZO              | 9.4     | 6.1   | 20,648  |  |
| ジャパンディスプレイ        | 140.7   | 68.6  | 18,247  |  |

| 銘柄          | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |  |
|-------------|---------|-------|---------|--|
|             | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |  |
|             | 千株      | 千株    | 千円      |  |
| 日本信号        | 23.7    | 18.6  | 19,455  |  |
| 能美防災        | 12.8    | 9.3   | 14,387  |  |
| ホーチキ        | 10.8    | 6.8   | 9,792   |  |
| パナソニック      | 732.3   | 389.6 | 485,052 |  |
| シャープ        | 523     | —     | —       |  |
| アンリツ        | 42      | 26.8  | 24,334  |  |
| 富士通ゼネラル     | 18      | 11    | 24,838  |  |
| 日立国際電気      | 19.5    | 8.3   | 21,131  |  |
| ソニー         | 452     | 240.8 | 873,381 |  |
| TDK         | 39.1    | 19.1  | 140,194 |  |
| ミツミ電機       | 38.6    | —     | —       |  |
| タムラ製作所      | 41      | 5     | 2,425   |  |
| アルプス電気      | 55.1    | 31.4  | 108,016 |  |
| パイオニア       | 120.3   | 56.5  | 13,390  |  |
| 日本電波工業      | 11.1    | 7.5   | 6,232   |  |
| 日本トリム       | 4.6     | 1.2   | 4,782   |  |
| フォスター電機     | 11.1    | 7.9   | 15,049  |  |
| SMK         | 27      | —     | —       |  |
| ヨコオ         | 26.6    | 18.7  | 28,723  |  |
| ホンデン        | 29.1    | 10.7  | 11,759  |  |
| ヒロセ電機       | 10.3    | 5.5   | 88,000  |  |
| 日本航空電子工業    | 17      | 8     | 12,088  |  |
| アルパイン       | 19      | 8.5   | 14,195  |  |
| アイコム        | 6.2     | 4.8   | 12,254  |  |
| 船井電機        | 14.5    | 13.4  | 13,266  |  |
| 横河電機        | 67.9    | 36.6  | 66,648  |  |
| アズビル        | 20.9    | 10.8  | 41,418  |  |
| 日本光電工業      | 27.8    | 14.4  | 37,195  |  |
| 堀場製作所       | 11.6    | 6.6   | 41,910  |  |
| アドバンテスト     | 47.1    | 22.9  | 44,563  |  |
| キーエンス       | 14.5    | 15.5  | 700,445 |  |
| 日置電機        | 9.5     | 7     | 16,520  |  |
| シスメックス      | 50.3    | 26.4  | 179,520 |  |
| メガチップス      | 16.8    | —     | —       |  |
| OBARA GROUP | 5.3     | 1.8   | 9,180   |  |
| コーセル        | 15      | 9.5   | 13,661  |  |
| オプテックスグループ  | 8.7     | 3.9   | 12,597  |  |
| 千代田インテグレ    | 7       | 4.7   | 11,543  |  |
| スタンレー電気     | 46.5    | 24.2  | 78,650  |  |
| ウシオ電機       | 41      | 20    | 29,520  |  |
| 日本セラミック     | 3.8     | 2.7   | 6,777   |  |
| 日本デジタル研究所   | 13.5    | —     | —       |  |
| 双信電機        | 33.3    | 33    | 10,164  |  |
| 図研          | 12.3    | 10.5  | 14,175  |  |
| 日本電子        | 35      | 3     | 1,755   |  |
| カシオ計算機      | 65.6    | 27.9  | 45,644  |  |
| ファナック       | 65.6    | 34.6  | 795,973 |  |
| エンプラス       | 7.1     | 0.6   | 1,923   |  |
| ローム         | 32.1    | 16.6  | 124,500 |  |
| 浜松ホトニクス     | 51      | 26.8  | 89,646  |  |
| 三井ハイテック     | 24.5    | 18.6  | 21,576  |  |
| 新光電気工業      | 30.7    | 12.8  | 10,035  |  |
| 京セラ         | 106.3   | 56    | 354,928 |  |
| 太陽誘電        | 34.6    | 17.1  | 24,983  |  |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当期末   |           |
|---------------------|---------|-------|-----------|
|                     |         | 株数    | 評価額       |
|                     | 千株      | 千株    | 千円        |
| 村田製作所               | 67.2    | 35.8  | 570,294   |
| 双葉電子工業              | 16.8    | 8.5   | 17,892    |
| ニチコン                | 27.8    | 10.9  | 12,382    |
| 日本ケミコン              | 105     | 48    | 18,432    |
| KOA                 | 14.4    | 10.4  | 15,880    |
| 小糸製作所               | 38      | 20.6  | 121,128   |
| ミツバ                 | 17      | 7.5   | 16,252    |
| スター精密               | 17.2    | —     | —         |
| SCREENホールディングス      | 64      | 6.9   | 53,475    |
| キャノン電子              | 10.7    | 9.6   | 17,433    |
| キャノン                | 345.2   | 183.7 | 649,379   |
| リコー                 | 208.7   | 101.6 | 99,771    |
| 東京エレクトロン            | 53.1    | 22.7  | 263,547   |
| <b>輸送用機器 (9.3%)</b> |         |       |           |
| トヨタ紡織               | 24.7    | 12.1  | 32,137    |
| ユニプレス               | 13.9    | 7.1   | 17,267    |
| 豊田自動織機              | 59.1    | 31.2  | 178,776   |
| モリタホールディングス         | 21.1    | 7.9   | 13,698    |
| デンソー                | 157.7   | 84.1  | 438,833   |
| 東海理化電機製作所           | 20      | 9.3   | 21,743    |
| 三井造船                | 250     | 129   | 23,865    |
| 川崎重工業               | 508     | 262   | 93,534    |
| 日本車輛製造              | 59      | 35    | 11,025    |
| 近畿車輛                | 49      | 3.5   | 8,862     |
| 日産自動車               | 900.4   | 402.2 | 457,703   |
| いすゞ自動車              | 188.3   | 97.7  | 153,730   |
| トヨタ自動車              | 797.4   | 414.7 | 2,642,883 |
| 日野自動車               | 90.5    | 47.8  | 67,589    |
| 三菱自動車工業             | 246.9   | 126.3 | 88,788    |
| 武蔵精密工業              | 11.6    | 4.9   | 14,636    |
| 日産車体                | 31.2    | 16.4  | 17,958    |
| 新明和工業               | 28      | 14    | 16,478    |
| 極東開発工業              | 21.1    | 11.9  | 23,050    |
| 日信工業                | 19.7    | 8.2   | 16,851    |
| トビー工業               | 98      | 6.7   | 20,636    |
| ティラド                | 89      | 54    | 18,738    |
| 曙ブレーキ工業             | 53.8    | 24.1  | 9,182     |
| NOK                 | 31.2    | 16.3  | 43,390    |
| フタバ産業               | 40.4    | 31.3  | 25,947    |
| KYB                 | 77      | 38    | 23,104    |
| プレス工業               | 58.6    | 33.8  | 19,468    |
| カルソニックカンセイ          | 52      | —     | —         |
| ケーヒン                | 16.1    | 8.4   | 15,817    |
| アイシン精機              | 65.3    | 31.2  | 174,096   |
| マツダ                 | 204.4   | 107.7 | 174,743   |
| ダイハツ工業              | 74.1    | —     | —         |
| 今仙電機製作所             | 14.7    | 12.9  | 13,261    |
| 本田技研工業              | 576.9   | 306.7 | 1,086,331 |
| スズキ                 | 135.8   | 67.5  | 322,717   |
| 富士重工業               | 202.5   | 105.9 | 456,640   |
| ヤマハ発動機              | 92.2    | 47.9  | 130,000   |
| ショウワ                | 22.2    | 12.6  | 12,398    |
| エクセディ               | 8.9     | 4.7   | 15,745    |
| 豊田合成                | 23.5    | 11.1  | 33,155    |

| 銘柄                  | 期首(前期末) | 当期末  |         |
|---------------------|---------|------|---------|
|                     |         | 株数   | 評価額     |
|                     | 千株      | 千株   | 千円      |
| 愛三工業                | 21.3    | 15.2 | 15,108  |
| オロズ                 | 10.7    | 5.4  | 9,714   |
| エフ・シー・シー            | 12.8    | 5.4  | 12,479  |
| シマノ                 | 26.1    | 13.7 | 235,914 |
| テイ・エス テック           | 14.4    | 7.9  | 24,292  |
| <b>精密機器 (1.6%)</b>  |         |      |         |
| テルモ                 | 99.4    | 52.3 | 207,892 |
| クリエートメディック          | 20.2    | 16.7 | 16,199  |
| 日機装                 | 27.9    | 12.7 | 15,697  |
| 島津製作所               | 83      | 44.2 | 80,576  |
| クボテック               | —       | 1.7  | 941     |
| 東京精密                | 13.4    | 6.3  | 22,680  |
| ニコン                 | 116.7   | 59   | 99,356  |
| トプコン                | 21      | 16.8 | 36,120  |
| オリンパス               | 96.5    | 54.7 | 236,851 |
| 理研計器                | 17      | 13.3 | 22,676  |
| タムロン                | 7.8     | 3.8  | 7,907   |
| HOYA                | 148.6   | 70.2 | 384,766 |
| シチズン時計              | 83.7    | 39.3 | 30,575  |
| 松風                  | —       | 0.4  | 546     |
| セイコーホールディングス        | 54      | 18   | 9,108   |
| ニプロ                 | 49.4    | 25.2 | 41,328  |
| <b>その他製品 (1.8%)</b> |         |      |         |
| スノーピーク              | —       | 0.3  | 922     |
| パラマウントベッドホールディングス   | 7.3     | 3.1  | 14,244  |
| バンダイナムコホールディングス     | 67.6    | 37.4 | 132,022 |
| アイフィスジャパン           | —       | 4.2  | 1,810   |
| パイロットコーポレーション       | 10.6    | 5.7  | 26,590  |
| トッパン・フォームズ          | 22.5    | 16.2 | 18,160  |
| フジシールインターナショナル      | 8       | 7.4  | 17,915  |
| タカラトミー              | 35.6    | 12.7 | 14,820  |
| タカノ                 | 28      | 20.7 | 20,844  |
| プロネクス               | —       | 0.5  | 655     |
| 大建工業                | 62      | 4.1  | 8,782   |
| 凸版印刷                | 184     | 96   | 114,432 |
| 大日本印刷               | 188     | 99   | 122,958 |
| 日本写真印刷              | 17.5    | 5.3  | 16,085  |
| アシックス               | 58.3    | 34.3 | 64,552  |
| 小松ウオール工業            | 4.7     | 4.5  | 8,712   |
| ヤマハ                 | 47.7    | 23.1 | 74,728  |
| クリナップ               | 19.9    | 16.1 | 14,071  |
| ビジョン                | 34.4    | 20.5 | 75,337  |
| キングジム               | 24.7    | 21   | 18,354  |
| リンテック               | 16.1    | 8    | 19,912  |
| TASAKI              | —       | 4.8  | 7,612   |
| イトーキ                | 35      | 22.7 | 16,525  |
| 任天堂                 | 39.3    | 21   | 551,565 |
| 三菱鉛筆                | 6.2     | 2.6  | 14,742  |
| タカラスタンダード           | 25      | 4.8  | 8,928   |
| コクヨ                 | 35.2    | 18.1 | 26,896  |
| 岡村製作所               | 30.6    | 12.5 | 12,912  |
| 美津濃                 | 39      | 11   | 6,721   |
| アデランス               | 22.1    | —    | —       |

| 銘柄                   | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |  |
|----------------------|---------|-------|---------|--|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |  |
|                      | 千株      | 千株    | 千円      |  |
| <b>電気・ガス業 (1.7%)</b> |         |       |         |  |
| 東京電力ホールディングス         | 551.3   | 290.8 | 121,263 |  |
| 中部電力                 | 198.4   | 111.4 | 165,261 |  |
| 関西電力                 | 264.9   | 139.5 | 171,654 |  |
| 中国電力                 | 90.5    | 47.3  | 59,456  |  |
| 北陸電力                 | 60.6    | 32.5  | 35,425  |  |
| 東北電力                 | 157.9   | 84.4  | 123,730 |  |
| 四国電力                 | 59.5    | 30.2  | 34,730  |  |
| 九州電力                 | 144.7   | 74.9  | 88,157  |  |
| 北海道電力                | 61.3    | 31.2  | 24,991  |  |
| 沖縄電力                 | 9.6     | 6.1   | 15,738  |  |
| 電源開発                 | 53.8    | 27    | 70,389  |  |
| 東京瓦斯                 | 723     | 366   | 187,904 |  |
| 大阪瓦斯                 | 672     | 330   | 143,253 |  |
| 東邦瓦斯                 | 153     | 86    | 68,198  |  |
| 北海道瓦斯                | 66      | 35    | 9,800   |  |
| 西部瓦斯                 | 98      | 65    | 16,770  |  |
| 静岡ガス                 | 32.5    | 14.7  | 10,907  |  |
| <b>陸運業 (4.1%)</b>    |         |       |         |  |
| 東武鉄道                 | 340     | 183   | 107,421 |  |
| 相鉄ホールディングス           | 107     | 54    | 28,944  |  |
| 東京急行電鉄               | 377     | 185   | 151,700 |  |
| 京浜急行電鉄               | 177     | 93    | 118,482 |  |
| 小田急電鉄                | 207     | 54.4  | 121,203 |  |
| 京王電鉄                 | 182     | 95    | 86,830  |  |
| 京成電鉄                 | 97      | 25.5  | 67,498  |  |
| 富士急行                 | —       | 5     | 5,180   |  |
| 東日本旅客鉄道              | 117.1   | 66    | 654,258 |  |
| 西日本旅客鉄道              | 62.3    | 32.9  | 244,348 |  |
| 東海旅客鉄道               | 57.5    | 28.3  | 524,823 |  |
| 西武ホールディングス           | 52.8    | 46.9  | 89,766  |  |
| 西日本鉄道                | 81      | 40    | 20,000  |  |
| 近鉄グループホールディングス       | 653     | 343   | 143,717 |  |
| 阪急阪神ホールディングス         | 433     | 43.1  | 162,487 |  |
| 南海電気鉄道               | 142     | 72    | 40,896  |  |
| 京阪ホールディングス           | 143     | 77    | 54,670  |  |
| 名古屋鉄道                | 221     | 124   | 64,356  |  |
| 日本通運                 | 244     | 132   | 80,388  |  |
| ヤマトホールディングス          | 117.2   | 60.7  | 147,956 |  |
| 山九                   | 84      | 45    | 32,850  |  |
| 丸運                   | 50.8    | 27.8  | 7,228   |  |
| センコー                 | 39      | 27.4  | 20,878  |  |
| トナミホールディングス          | 45      | 24    | 10,104  |  |
| ニッコンホールディングス         | 22.3    | 11.5  | 28,888  |  |
| 日本石油輸送               | 74      | 2     | 5,210   |  |
| 福山通運                 | 37      | 14    | 10,094  |  |
| セイノーホールディングス         | 45.9    | 24.5  | 32,095  |  |
| 日立物流                 | 13.3    | 7     | 17,136  |  |
| C&F ロジホールディングス       | 14.5    | 11.7  | 18,193  |  |
| 九州旅客鉄道               | —       | 25.5  | 94,350  |  |
| <b>海運業 (0.2%)</b>    |         |       |         |  |
| 日本郵船                 | 588     | 290   | 74,820  |  |
| 商船三井                 | 324     | 178   | 66,572  |  |
| 川崎汽船                 | 285     | 128   | 40,064  |  |

| 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                   | 36      | 24.1  | 12,411  |  |
| <b>空運業 (0.6%)</b>      |         |       |         |  |
| 日本航空                   | 123.9   | 61.5  | 227,611 |  |
| ANAホールディングス            | 1,203   | 632   | 222,148 |  |
| <b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b> |         |       |         |  |
| 三菱倉庫                   | 42      | 22    | 36,168  |  |
| 三井倉庫ホールディングス           | 61      | 32    | 10,912  |  |
| 住友倉庫                   | 54      | 23    | 15,272  |  |
| 東陽倉庫                   | 76      | 58.8  | 18,345  |  |
| 安田倉庫                   | 19.1    | 10.2  | 8,068   |  |
| 上組                     | 75      | 41    | 42,517  |  |
| キムラユニティ                | 11.4    | 7.7   | 9,209   |  |
| キューソー流通システム            | 4       | 2.7   | 7,427   |  |
| 郵船ロジスティクス              | 17.4    | 12.2  | 14,493  |  |
| 近鉄エクスプレス               | 17.3    | 7.9   | 13,935  |  |
| ユーアイテイ                 | —       | 1.3   | 1,320   |  |
| <b>情報・通信業 (7.9%)</b>   |         |       |         |  |
| N E C ネットエスアイ          | 13.4    | 7.4   | 16,450  |  |
| 新日鉄住金ソリューションズ          | 14.1    | 7.6   | 18,209  |  |
| T I S                  | 21.3    | 11.1  | 32,778  |  |
| ネオス                    | —       | 9.7   | 4,568   |  |
| 電算システム                 | —       | 1.2   | 1,981   |  |
| グリー                    | 43.7    | 22.3  | 16,524  |  |
| コーエーテクモホールディングス        | 18.4    | 7.4   | 17,175  |  |
| ヒト・コミュニケーションズ          | —       | 2.2   | 4,136   |  |
| ブレインパッド                | —       | 6.8   | 7,561   |  |
| K L a b                | —       | 6.7   | 6,927   |  |
| ネクソン                   | 59.5    | 36.7  | 65,179  |  |
| エムアップ                  | —       | 4.8   | 4,291   |  |
| エイチーム                  | —       | 4.3   | 11,339  |  |
| e n i s h              | —       | 6.8   | 4,229   |  |
| コプロ                    | 18.3    | 9.1   | 10,064  |  |
| サイバーリンクス               | —       | 3.9   | 3,989   |  |
| VOYAGE GROUP           | —       | 4.8   | 8,558   |  |
| ベリサーブ                  | —       | 1.8   | 5,113   |  |
| ティールガイア                | 18.3    | 8.8   | 17,740  |  |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント   | 120.4   | 75    | 18,825  |  |
| GMOペイメントゲートウェイ         | 5.4     | 2.8   | 15,848  |  |
| ザッパラス                  | 29.7    | 27.2  | 14,171  |  |
| インターネットイニシアティブ         | 12.5    | 8.7   | 17,634  |  |
| L I N E                | —       | 5.4   | 22,545  |  |
| フェイス                   | —       | 0.4   | 524     |  |
| 野村総合研究所                | 45.1    | 24.9  | 103,335 |  |
| C E ホールディングス           | —       | 0.4   | 447     |  |
| インテージホールディングス          | —       | 1.3   | 2,756   |  |
| フジ・メディア・ホールディングス       | 70      | 35.3  | 55,774  |  |
| オービック                  | 21.4    | 11.6  | 62,524  |  |
| ヤフー                    | 452.3   | 240.4 | 130,056 |  |
| トレンドマイクロ               | 31.3    | 17.6  | 85,624  |  |
| 日本オラクル                 | 9.8     | 5.3   | 35,086  |  |
| アルファシステムズ              | —       | 0.7   | 1,406   |  |
| フューチャ                  | 24.2    | 21.2  | 18,740  |  |
| C A C H o l d i n g s  | 15.9    | 12.6  | 14,036  |  |
| ソフトバンク・テクノロジー          | 14.6    | 3.6   | 14,058  |  |

| 銘柄                   | 期首(前期末) |       |           | 当 期 末 |     |       |
|----------------------|---------|-------|-----------|-------|-----|-------|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額     | 株 数   | 株 数 | 評 価 額 |
|                      | 千株      | 千株    | 千円        |       |     |       |
| 伊藤忠テクノソリューションズ       | 14.5    | 7.4   | 24,235    |       |     |       |
| 大塚商会                 | 17.2    | 8.8   | 51,920    |       |     |       |
| サイボウズ                | 63.2    | 43.3  | 19,138    |       |     |       |
| 電通国際情報サービス           | 10.8    | 9.2   | 22,834    |       |     |       |
| ウェザーニューズ             | 4.4     | 1.2   | 4,482     |       |     |       |
| 日本エンタープライズ           | —       | 19.5  | 5,323     |       |     |       |
| ネットワンシステムズ           | 35.1    | 16.8  | 16,128    |       |     |       |
| アルゴグラフィックス           | 7       | 5.8   | 14,482    |       |     |       |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 16.8    | 12.3  | 20,393    |       |     |       |
| 日本ユニシス               | 20.8    | 10.3  | 16,160    |       |     |       |
| 兼松エレクトロニクス           | 10.4    | 7.2   | 20,347    |       |     |       |
| 東京放送ホールディングス         | 39.4    | 21.9  | 44,588    |       |     |       |
| 日本テレビホールディングス        | 56.3    | 30.7  | 60,847    |       |     |       |
| テレビ朝日ホールディングス        | 18.9    | 9     | 20,277    |       |     |       |
| スカパーJ S A Tホールディングス  | 55      | 30.5  | 15,036    |       |     |       |
| テレビ東京ホールディングス        | 10.9    | 7.2   | 18,972    |       |     |       |
| 日本通信                 | —       | 45.8  | 9,160     |       |     |       |
| 日本電信電話               | 489.1   | 270.1 | 1,335,914 |       |     |       |
| KDD I                | 644     | 332.7 | 1,011,408 |       |     |       |
| 光通信                  | 7.9     | 4.1   | 45,920    |       |     |       |
| NTTドコモ               | 487.1   | 251.5 | 679,175   |       |     |       |
| GMOインターネット           | 22.9    | 11.9  | 15,922    |       |     |       |
| カドカワ                 | 19.5    | 10.3  | 17,046    |       |     |       |
| ゼンリン                 | 16.2    | 8.7   | 19,879    |       |     |       |
| 松竹                   | 45      | 21    | 27,510    |       |     |       |
| 東宝                   | 46.2    | 21.9  | 67,561    |       |     |       |
| 東映                   | 32      | 8     | 7,944     |       |     |       |
| エヌ・ティ・ティ・データ         | 38.5    | 20.5  | 109,265   |       |     |       |
| ビジネスブレイン太田昭和         | —       | 1.7   | 1,778     |       |     |       |
| D T S                | 10.9    | 7.4   | 21,112    |       |     |       |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 26.7    | 12.9  | 45,279    |       |     |       |
| カブコン                 | 17.4    | 7.8   | 18,751    |       |     |       |
| S C S K              | 14.7    | 9.1   | 40,313    |       |     |       |
| アイネス                 | 14.5    | 13.2  | 14,968    |       |     |       |
| T K C                | 9.3     | 5.1   | 16,677    |       |     |       |
| 富士ソフト                | 9.8     | 5.1   | 14,927    |       |     |       |
| N S D                | 15.2    | 7.3   | 12,322    |       |     |       |
| コナミホールディングス          | 28.5    | 15.4  | 77,770    |       |     |       |
| ソフトバンクグループ           | 359.1   | 151.6 | 1,254,338 |       |     |       |
| <b>卸売業 (4.6%)</b>    |         |       |           |       |     |       |
| 伊藤忠食品                | 4.1     | 1     | 4,825     |       |     |       |
| エレマテック               | 6.1     | 3.4   | 6,806     |       |     |       |
| J A L U X            | 4.9     | 2     | 5,442     |       |     |       |
| 双日                   | 422.7   | 202.7 | 59,188    |       |     |       |
| アルフレッサ ホールディングス      | 80.9    | 39.5  | 77,420    |       |     |       |
| 横浜冷凍                 | 25.8    | 17.9  | 20,406    |       |     |       |
| あい ホールディングス          | 12.9    | 5.8   | 15,538    |       |     |       |
| マクニカ・富士エレホールディングス    | 22.4    | 14.5  | 24,084    |       |     |       |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス  | —       | 12.6  | 13,318    |       |     |       |
| U K Cホールディングス        | 10.1    | 6.2   | 13,206    |       |     |       |
| O C H Iホールディングス      | —       | 0.7   | 1,024     |       |     |       |
| T O K A Iホールディングス    | —       | 16.1  | 14,216    |       |     |       |
| シップヘルスケアホールディングス     | 13.8    | 6.3   | 19,845    |       |     |       |
| 明治電機工業               | —       | 0.4   | 523       |       |     |       |

| 銘柄              | 期首(前期末) |       |         | 当 期 末 |     |       |
|-----------------|---------|-------|---------|-------|-----|-------|
|                 | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   | 株 数   | 株 数 | 評 価 額 |
|                 | 千株      | 千株    | 千円      |       |     |       |
| エコートレーディング      | 17.3    | 13.6  | 9,057   |       |     |       |
| ナガイレーベン         | 11      | 6.8   | 16,082  |       |     |       |
| 三菱食品            | 9       | 5.1   | 18,232  |       |     |       |
| 松田産業            | 13.2    | 13.4  | 21,158  |       |     |       |
| 第一興商            | 11.6    | 5.4   | 25,245  |       |     |       |
| メディアバルホールディングス  | 61.7    | 34.2  | 60,397  |       |     |       |
| アドヴァン           | 22.3    | —     | —       |       |     |       |
| アズワン            | —       | 1.6   | 8,048   |       |     |       |
| 尾家産業            | —       | 0.3   | 376     |       |     |       |
| ドウシシャ           | 11.8    | 6.7   | 14,023  |       |     |       |
| 黒田電気            | 13.8    | 9.7   | 24,812  |       |     |       |
| 丸文              | 21.6    | 18.5  | 13,579  |       |     |       |
| 橋本総業ホールディングス    | —       | 0.8   | 1,199   |       |     |       |
| I D O M         | 30.4    | 20.9  | 15,173  |       |     |       |
| 進和              | 7.5     | 6.5   | 12,805  |       |     |       |
| オーハシテクニカ        | 14      | 12    | 17,184  |       |     |       |
| 白銅              | 11.6    | 8.9   | 16,064  |       |     |       |
| 伊藤忠商事           | 497.7   | 246.3 | 408,858 |       |     |       |
| 丸紅              | 628     | 331   | 238,684 |       |     |       |
| 長瀬産業            | 40.9    | 20.8  | 33,196  |       |     |       |
| 豊田通商            | 69.3    | 37.8  | 128,898 |       |     |       |
| 兼松              | 165     | 104   | 20,904  |       |     |       |
| 三井物産            | 573.5   | 304.2 | 510,751 |       |     |       |
| 日本紙パルプ商事        | 72      | 30    | 11,820  |       |     |       |
| 日立ハイテク ロジーズ     | 21.5    | 11.6  | 54,984  |       |     |       |
| 山善              | 28.6    | 19.6  | 20,658  |       |     |       |
| 住友商事            | 398.3   | 211.7 | 319,772 |       |     |       |
| 内田洋行            | 38      | 2     | 5,274   |       |     |       |
| 三菱商事            | 474.8   | 252.3 | 628,479 |       |     |       |
| キヤノンマーケティングジャパン | 19.2    | 9.4   | 21,150  |       |     |       |
| 西華産業            | 60      | 36    | 13,536  |       |     |       |
| 菱洋エレクトロ         | 17.7    | 13.2  | 23,350  |       |     |       |
| 東京産業            | 48      | 37.5  | 18,000  |       |     |       |
| 阪和興業            | 58      | 33    | 27,621  |       |     |       |
| 菱電商事            | 17      | —     | —       |       |     |       |
| フルサト工業          | —       | 0.2   | 362     |       |     |       |
| 岩谷産業            | 75      | 38    | 25,384  |       |     |       |
| イワキ             | 85      | 65    | 19,565  |       |     |       |
| 三愛石油            | 19      | 16.2  | 15,892  |       |     |       |
| 稲畑産業            | 25.2    | 14.9  | 22,037  |       |     |       |
| ワキタ             | —       | 7.1   | 7,788   |       |     |       |
| 東邦ホールディングス      | 21.1    | 10.7  | 25,947  |       |     |       |
| サンゲツ            | 22.8    | 12.4  | 24,316  |       |     |       |
| シナネンホールディングス    | 29      | 2.5   | 5,775   |       |     |       |
| 伊藤忠エネクス         | 27.7    | 16.7  | 15,915  |       |     |       |
| サンリオ            | 20.6    | 10.2  | 22,338  |       |     |       |
| リョーサン           | 10      | 4.7   | 16,990  |       |     |       |
| 新光商事            | —       | 0.5   | 654     |       |     |       |
| 三信電気            | —       | 1.9   | 2,711   |       |     |       |
| モスフードサービス       | 13      | 3.9   | 13,221  |       |     |       |
| 加賀電子            | 13.7    | 9.4   | 19,147  |       |     |       |
| 立花エレクトック        | 14.5    | 12    | 16,596  |       |     |       |
| フォーバル           | —       | 1.2   | 828     |       |     |       |
| P A L T A C     | —       | 5.1   | 16,447  |       |     |       |

| 銘柄                       | 期首(前期末) | 当期 末  |         |       |
|--------------------------|---------|-------|---------|-------|
|                          |         | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 |
|                          |         | 千株    | 千株      | 千円    |
| 日鉄住金物産                   | —       | 2     | 9,440   |       |
| トラスコ中山                   | 8.7     | 7.5   | 19,200  |       |
| オートバックスセブン               | 24.7    | 12.9  | 22,226  |       |
| 加藤産業                     | 8.5     | 5.6   | 16,788  |       |
| イノテック                    | 33.4    | 26.9  | 18,426  |       |
| 杉本商事                     | 10.4    | 8.5   | 13,693  |       |
| 因幡電機産業                   | 9.1     | 4.8   | 20,160  |       |
| ミスミグループ本社                | 69.3    | 38.4  | 77,376  |       |
| スズケン                     | 29.7    | 15.3  | 56,380  |       |
| ジェコス                     | 10.3    | 9.9   | 11,137  |       |
| <b>小売業 (4.5%)</b>        |         |       |         |       |
| ローソン                     | 24.3    | 10.8  | 82,836  |       |
| サンエー                     | —       | 2     | 10,200  |       |
| エービーシー・マート               | 8.6     | 6     | 40,680  |       |
| ハードオフコーポレーション            | 10.8    | 5.5   | 6,484   |       |
| アスクル                     | 8.1     | 4     | 12,840  |       |
| ゲオホールディングス               | 20.3    | 9.1   | 11,930  |       |
| アダストリア                   | 12.2    | 4.7   | 13,935  |       |
| ジーフット                    | —       | 1.2   | 918     |       |
| エディオン                    | 32.9    | 23.7  | 25,548  |       |
| ハローズ                     | —       | 0.8   | 1,835   |       |
| あみやき亭                    | 4.4     | 1.6   | 7,088   |       |
| ハニーズホールディングス             | 12.4    | 10.4  | 11,897  |       |
| ジェイアイエヌ                  | —       | 2.2   | 13,222  |       |
| ビックカメラ                   | 32.1    | 19.1  | 20,838  |       |
| DCMホールディングス              | 38.8    | 20.1  | 20,783  |       |
| MonotaRO                 | 23.2    | 11.9  | 39,508  |       |
| J. フロント リテイリング           | 77.9    | 42.2  | 75,622  |       |
| ドトール・日レスホールディングス         | 20.6    | 9.9   | 22,344  |       |
| マツモトキヨシホールディングス          | 13.8    | 6.4   | 35,200  |       |
| スタートトゥデイ                 | 18.5    | 30.5  | 71,065  |       |
| ココカラファイン                 | 6.2     | 3.4   | 16,456  |       |
| 三越伊勢丹ホールディングス            | 123.1   | 66.5  | 87,780  |       |
| ウエルシアホールディングス            | 5.2     | 6.6   | 21,813  |       |
| クリエイトSDホールディングス          | —       | 4.5   | 12,298  |       |
| シュッピン                    | —       | 1.7   | 2,985   |       |
| ジョイフル本田                  | —       | 5.2   | 19,422  |       |
| すかいらく                    | 22.3    | 14.6  | 25,973  |       |
| ユニテッド・スーパーマーケット・ホールディングス | 24.9    | 17.8  | 18,529  |       |
| ブックオフコーポレーション            | 24.6    | 11.6  | 9,442   |       |
| ゴルフダイジェスト・オンライン          | —       | 4.5   | 3,667   |       |
| あさひ                      | 8.9     | 7.1   | 9,443   |       |
| コスモス薬品                   | 2.9     | 1.7   | 37,689  |       |
| トーエル                     | —       | 1.6   | 1,516   |       |
| セブン&アイ・ホールディングス          | 264.4   | 140.8 | 622,476 |       |
| ツルハホールディングス              | 14.6    | 7.8   | 84,474  |       |
| サンマルクホールディングス            | 9.5     | 4.4   | 15,202  |       |
| トリドールホールディングス            | —       | 4     | 9,616   |       |
| クスリのアオキ                  | 6.3     | —     | —       |       |
| クスリのアオキホールディングス          | —       | 3     | 15,570  |       |
| 総合メディカル                  | —       | 0.8   | 3,384   |       |
| カップ・クリエイト                | —       | 7.3   | 9,533   |       |
| ライトオン                    | 13.8    | 9.9   | 9,979   |       |
| 良品計画                     | 7.3     | 4.4   | 107,316 |       |

| 銘柄                   | 期首(前期末) | 当期 末  |         |       |
|----------------------|---------|-------|---------|-------|
|                      |         | 株 数   | 株 数     | 評 価 額 |
|                      |         | 千株    | 千株      | 千円    |
| 三城ホールディングス           | 37.6    | 29.7  | 14,582  |       |
| アドヴァン                | —       | 16.4  | 19,811  |       |
| G-1ホールディングス          | —       | 0.8   | 2,062   |       |
| エコス                  | —       | 0.1   | 120     |       |
| マルシェ                 | —       | 2     | 1,694   |       |
| ドンキホーテホールディングス       | 41.7    | 22.1  | 87,074  |       |
| 西松屋チェーン              | 24      | 8.2   | 10,627  |       |
| ゼンショーホールディングス        | 36.3    | 17.3  | 33,683  |       |
| サイゼリヤ                | 12.9    | 5.3   | 15,120  |       |
| 魚力                   | —       | 0.2   | 266     |       |
| ユナイテッドアローズ           | 8.8     | 4.1   | 13,899  |       |
| ハイデイ日高               | —       | 3.2   | 7,878   |       |
| 京都きもの友禅              | 22      | 14.3  | 14,443  |       |
| コロワイド                | 23.7    | 11.2  | 21,784  |       |
| 壱番屋                  | 5.2     | 3.7   | 14,282  |       |
| スギホールディングス           | 11      | 7.3   | 38,398  |       |
| スクロール                | 56.9    | 27.8  | 10,174  |       |
| ユニー・ファミリーマートホールディングス | 19.9    | 14.7  | 100,254 |       |
| 木曽路                  | 13.8    | 7.5   | 19,455  |       |
| 千趣会                  | 25.5    | 22.1  | 18,320  |       |
| ケーヨー                 | 28.5    | 24.2  | 14,132  |       |
| 上新電機                 | 24      | 4     | 4,644   |       |
| 日本瓦斯                 | 12      | 6.2   | 20,057  |       |
| ロイヤルホールディングス         | —       | 7.8   | 17,745  |       |
| いなげや                 | —       | 0.8   | 1,281   |       |
| 島忠                   | 16.3    | 8.5   | 24,029  |       |
| チヨダ                  | 10      | 6     | 16,530  |       |
| ライフコーポレーション          | 6.6     | 2.9   | 9,526   |       |
| AOKIホールディングス         | 19      | 13.4  | 18,492  |       |
| オークワ                 | 16      | —     | —       |       |
| コメリ                  | 11.9    | 5.3   | 15,269  |       |
| 青山商事                 | 12.2    | 7.1   | 30,210  |       |
| しまむら                 | 7.3     | 3.9   | 59,163  |       |
| 高島屋                  | 90      | 55    | 56,430  |       |
| 松屋                   | 26      | 13.5  | 14,215  |       |
| エイチ・ツー・オー リテイリング     | 33.4    | 18    | 34,326  |       |
| ニッセンホールディングス         | 78.8    | —     | —       |       |
| パルコ                  | 12.4    | 10.6  | 13,430  |       |
| 丸井グループ               | 75      | 35.4  | 56,640  |       |
| アクナル リテイリング          | —       | 1.2   | 5,310   |       |
| イオン                  | 259.9   | 138.3 | 226,327 |       |
| ユニーグループ・ホールディングス     | 66.1    | —     | —       |       |
| イズミ                  | 13.4    | 6.6   | 34,056  |       |
| 平和堂                  | 13      | 7     | 19,614  |       |
| フジ                   | 9       | 6     | 14,652  |       |
| ヤオコー                 | 6.8     | 3.6   | 16,038  |       |
| ゼビオホールディングス          | 14      | 7.9   | 14,330  |       |
| ケーズホールディングス          | 13.9    | 15.3  | 31,686  |       |
| アインホールディングス          | 7.9     | 4.2   | 32,844  |       |
| ヤマダ電機                | 198     | 112.2 | 65,524  |       |
| ニトリホールディングス          | 27.8    | 14.5  | 195,460 |       |
| グルメ軒屋                | 15      | —     | —       |       |
| 吉野家ホールディングス          | 24.2    | 12.4  | 20,410  |       |
| 王将フードサービス            | —       | 3.1   | 13,531  |       |

| 銘柄                  | 期首(前期末) |         |           | 当 期 末 |     |       |
|---------------------|---------|---------|-----------|-------|-----|-------|
|                     | 株 数     | 株 数     | 評 価 額     | 株 数   | 株 数 | 評 価 額 |
|                     | 千株      | 千株      | 千円        |       |     |       |
| ブレナス                | 14.5    | 5.2     | 13,478    |       |     |       |
| アークス                | 12.3    | 6.1     | 16,183    |       |     |       |
| パローホールディングス         | 13.6    | 7.1     | 19,425    |       |     |       |
| ファーストリテイリング         | 12.7    | 5.6     | 200,760   |       |     |       |
| サンドラッグ              | 13.2    | 6.4     | 48,512    |       |     |       |
| ヤマザワ                | 8.1     | 5.2     | 9,484     |       |     |       |
| ペルーナ                | 42.6    | 22      | 18,766    |       |     |       |
| <b>銀行業 (8.3%)</b>   |         |         |           |       |     |       |
| めぶきフィナンシャルグループ      | —       | 165.2   | 77,974    |       |     |       |
| 東京ＴＹフィナンシャルグループ     | 8.2     | 4.9     | 18,816    |       |     |       |
| 九州フィナンシャルグループ       | 99.7    | 55      | 40,975    |       |     |       |
| ゆうちょ銀行              | 124     | 94.9    | 136,086   |       |     |       |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | —       | 219.9   | 124,287   |       |     |       |
| 西日本フィナンシャルホールディングス  | —       | 22.5    | 26,977    |       |     |       |
| 新生銀行                | 571     | 315     | 63,630    |       |     |       |
| あおぞら銀行              | 407     | 212     | 89,464    |       |     |       |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ   | 5,074.2 | 2,549.9 | 1,901,460 |       |     |       |
| りそなホールディングス         | 742     | 393.2   | 252,041   |       |     |       |
| 三井住友トラスト・ホールディングス   | 1,334   | 70.3    | 281,129   |       |     |       |
| 三井住友フィナンシャルグループ     | 506.9   | 269.5   | 1,149,687 |       |     |       |
| 第四銀行                | 74      | 41      | 19,926    |       |     |       |
| 北越銀行                | 97      | 3.3     | 9,537     |       |     |       |
| 西日本シティ銀行            | 208     | —       | —         |       |     |       |
| 千葉銀行                | 247     | 132     | 100,188   |       |     |       |
| 横浜銀行                | 430     | —       | —         |       |     |       |
| 常陽銀行                | 232     | —       | —         |       |     |       |
| 群馬銀行                | 144     | 74.6    | 46,699    |       |     |       |
| 武蔵野銀行               | 9.5     | 5.3     | 18,815    |       |     |       |
| 千葉興業銀行              | 31.1    | 24.2    | 15,657    |       |     |       |
| 七十七銀行               | 99      | 52      | 26,884    |       |     |       |
| 青森銀行                | 61      | 18      | 7,218     |       |     |       |
| 秋田銀行                | 68      | 23      | 8,303     |       |     |       |
| 山形銀行                | 47      | 9       | 4,536     |       |     |       |
| 岩手銀行                | 5.4     | 1.5     | 7,222     |       |     |       |
| 東邦銀行                | 66      | 23      | 9,982     |       |     |       |
| 東北銀行                | 57      | 54      | 8,640     |       |     |       |
| ふくおかフィナンシャルグループ     | 275     | 136     | 66,776    |       |     |       |
| 静岡銀行                | 186     | 93      | 88,629    |       |     |       |
| 十六銀行                | 74      | 44      | 17,072    |       |     |       |
| スルガ銀行               | 60.7    | 35.1    | 87,223    |       |     |       |
| 八十二銀行               | 116     | 65.5    | 44,736    |       |     |       |
| 山梨中央銀行              | 49      | 14      | 7,406     |       |     |       |
| 大垣共立銀行              | 86      | 45      | 15,480    |       |     |       |
| 福井銀行                | 93      | 33      | 9,009     |       |     |       |
| 北國銀行                | 83      | 33      | 14,883    |       |     |       |
| 滋賀銀行                | 56      | 31      | 18,631    |       |     |       |
| 南都銀行                | 73      | 3.2     | 13,936    |       |     |       |
| 百五銀行                | 51      | 30      | 14,310    |       |     |       |
| 京都銀行                | 122     | 60      | 53,160    |       |     |       |
| 紀陽銀行                | 25.7    | 12.7    | 23,177    |       |     |       |
| 三重銀行                | 70      | 5.7     | 14,597    |       |     |       |
| はくほくフィナンシャルグループ     | 444     | 22.6    | 42,375    |       |     |       |
| 広島銀行                | 188     | 101     | 51,207    |       |     |       |
| 山陰合同銀行              | 36.7    | 20.9    | 20,293    |       |     |       |

| 銘柄                       | 期首(前期末) |         |         | 当 期 末 |     |       |
|--------------------------|---------|---------|---------|-------|-----|-------|
|                          | 株 数     | 株 数     | 評 価 額   | 株 数   | 株 数 | 評 価 額 |
|                          | 千株      | 千株      | 千円      |       |     |       |
| 中国銀行                     | 45.4    | 24      | 41,016  |       |     |       |
| 鳥取銀行                     | 59      | 5.2     | 9,692   |       |     |       |
| 伊予銀行                     | 70.3    | 36.4    | 29,265  |       |     |       |
| 百十四銀行                    | 71      | 35      | 13,860  |       |     |       |
| 四国銀行                     | 92      | 50      | 15,550  |       |     |       |
| 阿波銀行                     | 44      | 29      | 22,446  |       |     |       |
| 大分銀行                     | 51      | 13      | 5,967   |       |     |       |
| 宮崎銀行                     | 69      | 26      | 9,672   |       |     |       |
| 佐賀銀行                     | 86      | 37      | 11,988  |       |     |       |
| 十八銀行                     | 64      | 34      | 13,124  |       |     |       |
| 沖縄銀行                     | 5.2     | 3.1     | 13,888  |       |     |       |
| 琉球銀行                     | 18.5    | 6.4     | 10,656  |       |     |       |
| セブン銀行                    | 243.2   | 128     | 47,488  |       |     |       |
| みずほフィナンシャルグループ           | 8,911.2 | 4,566.4 | 963,510 |       |     |       |
| 山ロフィナンシャルグループ            | 56      | 32      | 40,928  |       |     |       |
| 長野銀行                     | 48      | 3.4     | 6,898   |       |     |       |
| 名古屋銀行                    | 58      | 1.9     | 8,103   |       |     |       |
| 北洋銀行                     | 99      | 55      | 25,355  |       |     |       |
| 愛知銀行                     | 3.6     | 0.4     | 2,640   |       |     |       |
| 第三銀行                     | 33      | 2.6     | 4,563   |       |     |       |
| 中京銀行                     | 55      | 4.9     | 11,534  |       |     |       |
| 東日本銀行                    | 57      | —       | —       |       |     |       |
| 愛媛銀行                     | 98      | 10.5    | 14,973  |       |     |       |
| トマト銀行                    | 69      | 5.7     | 9,291   |       |     |       |
| 京業銀行                     | 58      | 28      | 14,336  |       |     |       |
| 関西アーバン銀行                 | 14.9    | 7       | 10,605  |       |     |       |
| 栃木銀行                     | 45      | 16.2    | 9,007   |       |     |       |
| 北日本銀行                    | 2.5     | —       | —       |       |     |       |
| トモニホールディングス              | 62.2    | 30      | 18,840  |       |     |       |
| フィデアホールディングス             | 71.9    | 42.8    | 9,373   |       |     |       |
| 池田泉州ホールディングス             | 65.2    | 38.4    | 18,931  |       |     |       |
| <b>証券・商品先物取引業 (1.3%)</b> |         |         |         |       |     |       |
| F P G                    | —       | 12      | 12,612  |       |     |       |
| S B I ホールディングス           | 80.5    | 39      | 65,247  |       |     |       |
| ジャフコ                     | 10.6    | 5.5     | 22,550  |       |     |       |
| 大和証券グループ本社               | 598     | 314     | 232,925 |       |     |       |
| 野村ホールディングス               | 1,212.2 | 687.7   | 512,886 |       |     |       |
| 岡三証券グループ                 | 47      | 27      | 20,358  |       |     |       |
| 丸三証券                     | —       | 7.7     | 7,838   |       |     |       |
| 東洋証券                     | —       | 8       | 2,264   |       |     |       |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス     | 78.9    | 40.7    | 26,048  |       |     |       |
| 水戸証券                     | —       | 14.5    | 4,698   |       |     |       |
| いちよし証券                   | 18.4    | 14.2    | 12,780  |       |     |       |
| 松井証券                     | 35.9    | 18.1    | 17,158  |       |     |       |
| だいこう証券ビジネス               | —       | 3.8     | 2,424   |       |     |       |
| マネックスグループ                | 85.6    | 65.4    | 20,339  |       |     |       |
| カブドットコム証券                | 66.6    | 44.7    | 17,522  |       |     |       |
| 極東証券                     | —       | 7.3     | 13,037  |       |     |       |
| 藍澤証券                     | —       | 2.5     | 1,677   |       |     |       |
| <b>保険業 (2.8%)</b>        |         |         |         |       |     |       |
| かんぽ生命保険                  | 19.7    | 12.9    | 35,229  |       |     |       |
| S O M P O ホールディングス       | 141.9   | 70.5    | 307,239 |       |     |       |
| MS&Aインシュアランスグループホールディングス | 187.9   | 100.6   | 389,221 |       |     |       |
| ソニーフィナンシャルホールディングス       | 58.8    | 32.2    | 62,983  |       |     |       |

| 銘柄                   | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |  |
|----------------------|---------|-------|---------|--|
|                      | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |  |
|                      | 千株      | 千株    | 千円      |  |
| 第一生命ホールディングス         | 406.8   | 202.8 | 444,334 |  |
| 東京海上ホールディングス         | 257.2   | 136.4 | 690,456 |  |
| T & Dホールディングス        | 221.7   | 122.7 | 217,424 |  |
| <b>その他金融業 (1.2%)</b> |         |       |         |  |
| 全国保証                 | 16.2    | 9.4   | 33,934  |  |
| クレディセゾン              | 45.4    | 25.4  | 52,908  |  |
| 芙蓉総合リース              | 7.1     | 3.8   | 20,368  |  |
| 興銀リース                | 13      | 6.8   | 17,340  |  |
| 東京センチュリー             | 15.2    | 6.8   | 27,200  |  |
| 日本証券金融               | 37.4    | 31.2  | 19,812  |  |
| アイフル                 | 113.1   | 56.2  | 18,546  |  |
| リコーリース               | 6.6     | 3.1   | 11,687  |  |
| イオンフィナンシャルサービス       | 40.2    | 21.8  | 48,962  |  |
| アコム                  | 134.1   | 68.5  | 31,578  |  |
| オリエントコーポレーション        | 288.6   | 75.9  | 15,863  |  |
| 日立キャピタル              | 14.2    | 7.8   | 22,152  |  |
| オリックス                | 451.3   | 238.3 | 409,161 |  |
| 三菱UFJリース             | 165.4   | 86.1  | 50,885  |  |
| 日本取引所グループ            | 188.9   | 104   | 168,272 |  |
| アサックス                | —       | 0.2   | 333     |  |
| NECキャピタルソリューション      | 7.1     | 6.9   | 12,495  |  |
| <b>不動産業 (2.4%)</b>   |         |       |         |  |
| いちご                  | —       | 37.1  | 12,762  |  |
| ヒューリック               | 134.9   | 70.2  | 74,201  |  |
| 野村不動産ホールディングス        | 42.8    | 22.2  | 41,980  |  |
| オープンハウス              | —       | 4.6   | 12,815  |  |
| 東急不動産ホールディングス        | 154.8   | 80.9  | 50,562  |  |
| 飯田グループホールディングス       | 55.7    | 28.1  | 51,282  |  |
| パーク24                | 32.6    | 17.1  | 51,556  |  |
| 三井不動産                | 335     | 178   | 440,639 |  |
| 三菱地所                 | 472     | 250   | 543,125 |  |
| 平和不動産                | 17.4    | 9.7   | 15,384  |  |
| 東京建物                 | 66.9    | 39.3  | 59,736  |  |
| ダイビル                 | 22      | 10.6  | 10,886  |  |
| 京阪神ビルディング            | 32.1    | 27.8  | 17,847  |  |
| 住友不動産                | 152     | 81    | 244,215 |  |
| 大京                   | 138     | 65    | 15,275  |  |
| テアオーシー               | 27.5    | 16.9  | 16,393  |  |
| 東京楽天地                | 25      | —     | —       |  |
| レオパレス21              | 78.9    | 40.7  | 24,216  |  |
| スターツコーポレーション         | 9.9     | 6     | 14,754  |  |
| 空港施設                 | 25      | 23.1  | 13,605  |  |
| 住友不動産販売              | 7.8     | 2.7   | 9,193   |  |
| ゴールドクレスト             | 12      | 4.2   | 8,660   |  |
| 日本エスリード              | 16.2    | 11.3  | 18,159  |  |
| サンヨーハウジング名古屋         | 13.5    | 13    | 12,857  |  |
| イオンモール               | 41.7    | 21.1  | 36,946  |  |
| エヌ・ティ・ティ都市開発         | 42.3    | 20.4  | 20,624  |  |
| 日本空港ビルデング            | 21.4    | 10.9  | 47,306  |  |
| <b>サービス業 (3.7%)</b>  |         |       |         |  |
| 日本M&Aセンター            | 10.1    | 10.4  | 37,960  |  |
| アコーディア・ゴルフ           | 33.3    | —     | —       |  |
| パソナグループ              | 23.3    | 17.6  | 13,992  |  |
| GCA                  | —       | 12.4  | 12,300  |  |

| 銘柄             | 期首(前期末) |       | 当 期 末   |  |
|----------------|---------|-------|---------|--|
|                | 株 数     | 株 数   | 評 価 額   |  |
|                | 千株      | 千株    | 千円      |  |
| エス・エム・エス       | —       | 4.1   | 11,156  |  |
| テンブホールディングス    | 49      | 27.6  | 57,187  |  |
| クックパッド         | 16      | 8.8   | 8,500   |  |
| 学情             | —       | 5.3   | 6,513   |  |
| スタジオアリス        | 7.9     | 5.8   | 13,995  |  |
| シミックホールディングス   | 10.7    | 9.4   | 13,554  |  |
| N J S          | —       | 5     | 6,835   |  |
| 総合警備保障         | 22.8    | 13.2  | 57,222  |  |
| カカコム           | 45.5    | 25.1  | 40,787  |  |
| アイロムグループ       | —       | 3.8   | 5,213   |  |
| ディップ           | —       | 3.3   | 8,134   |  |
| キャリアデザインセンター   | —       | 5.6   | 6,479   |  |
| エムスリー          | 59.1    | 30.7  | 85,499  |  |
| ディー・エヌ・エー      | 31.5    | 15.8  | 40,053  |  |
| 博報堂DYホールディングス  | 92.2    | 49.3  | 68,181  |  |
| ぐるなび           | 11.4    | 4.5   | 10,476  |  |
| ファンコミュニケーションズ  | 26.8    | 20.9  | 17,660  |  |
| WDBホールディングス    | —       | 6.4   | 8,115   |  |
| E P Sホールディングス  | 19.8    | 13    | 20,241  |  |
| ドリームインキュベータ    | 7.7     | 5.8   | 12,562  |  |
| クイック           | —       | 5.8   | 6,803   |  |
| ケネディクス         | 100.8   | 48.2  | 22,702  |  |
| 電通             | 75.4    | 39.7  | 245,346 |  |
| みらかホールディングス    | 16.8    | 9     | 48,960  |  |
| アルプス技研         | —       | 0.5   | 1,757   |  |
| ダイオーズ          | —       | 2.3   | 2,490   |  |
| 日本空調サービス       | 18.9    | 26.9  | 17,807  |  |
| オリエンタルランド      | 72.7    | 38.5  | 243,358 |  |
| ダスキン           | 20.6    | 9     | 23,211  |  |
| リゾートトラスト       | 28.3    | 14.3  | 28,986  |  |
| ビー・エム・エル       | 6.8     | 5.8   | 14,482  |  |
| りらいあコミュニケーションズ | 23.9    | 18    | 19,998  |  |
| 早稲田アカデミー       | —       | 2     | 2,610   |  |
| ユー・エス・エス       | 82.7    | 43.2  | 83,937  |  |
| サイバーエージェント     | 16.4    | 18.9  | 65,488  |  |
| 楽天             | 316.9   | 181.7 | 204,775 |  |
| デー・オー・ダブリュー    | —       | 10.2  | 7,129   |  |
| テクノプロ・ホールディングス | 11.3    | 5.8   | 24,824  |  |
| ファーストロジック      | —       | 1.6   | 3,998   |  |
| キャリアリンク        | —       | 4.7   | 3,355   |  |
| ライドオン・エクスプレス   | —       | 5.6   | 5,124   |  |
| リクルートホールディングス  | 136.4   | 77.9  | 437,019 |  |
| エラン            | —       | 0.7   | 1,319   |  |
| 日本郵政           | 146.4   | 93.3  | 137,430 |  |
| リログループ         | 2.6     | 1.3   | 23,140  |  |
| エイチ・アイ・エス      | 11.5    | 5.8   | 16,118  |  |
| 共立メンテナンス       | 5.3     | 2.9   | 19,256  |  |
| 建設技術研究所        | 13.9    | 12    | 13,728  |  |
| 燎ホールディングス      | —       | 1.9   | 3,174   |  |
| よみうりランド        | 35      | 11    | 5,071   |  |
| 東京都競馬          | 99      | 65    | 17,030  |  |
| カナモト           | 10      | 4.7   | 14,640  |  |
| 東京ドーム          | 56      | 15.2  | 16,355  |  |
| トランス・コスモス      | 7.9     | 2.7   | 7,319   |  |

| 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        | 18.8    | 8.2   | 16,113  |  |
| 日本管財         | 16.2    | 8.4   | 15,892  |  |
| 白洋舎          | 86      | 5.1   | 14,529  |  |
| セコム          | 69.4    | 37.1  | 304,553 |  |
| セントラル警備保障    | 13.4    | 6.6   | 11,906  |  |
| メイテック        | 9.1     | 4.3   | 19,995  |  |
| アサツー ディ・ケイ   | 12.3    | 5.6   | 16,800  |  |
| 応用地質         | 14.5    | 12.2  | 17,519  |  |
| 船井総研ホールディングス | —       | 4.9   | 10,192  |  |
| ベネッセホールディングス | 23.5    | 12.1  | 44,286  |  |

| 銘柄       | 期首(前期末)   | 当 期 末   |        |            |
|----------|-----------|---------|--------|------------|
|          | 株 数       | 株 数     | 評 価 額  |            |
|          | 千株        | 千株      | 千円     |            |
| イオンディライト | 9.9       | 2.8     | 9,828  |            |
| ニチイ学館    | 18.7      | 19.1    | 16,617 |            |
| ダイセキ     | 16.9      | 6.9     | 16,194 |            |
| ステップ     | —         | 4.5     | 6,741  |            |
| 合 計      | 株 数 ・ 金 額 | 104,674 | 50,627 | 77,705,684 |
|          | 銘柄数<比率>   | 1,035   | 1,118  | <97.2%>    |

(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<br>1,672 — |

## ○投資信託財産の構成

(2017年3月21日現在)

| 項 目          | 当 期 末      |       |
|--------------|------------|-------|
|              | 評 価 額      | 比 率   |
|              | 千円         | %     |
| 株式           | 77,705,684 | 96.8  |
| コール・ローン等、その他 | 2,537,883  | 3.2   |
| 投資信託財産総額     | 80,243,567 | 100.0 |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年3月21日現在)

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 81,126,067,934  |
| コール・ローン等        | 2,375,639,958   |
| 株式(評価額)         | 77,705,684,830  |
| 未収入金            | 1,935,120       |
| 未収配当金           | 152,320,026     |
| 差入委託証拠金         | 890,488,000     |
| (B) 負債          | 1,205,823,149   |
| 未払金             | 8,681,320       |
| 未払解約金           | 314,636,843     |
| 未払利息            | 4,986           |
| 差入委託証拠金代用有価証券   | 882,500,000     |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 79,920,244,785  |
| 元本              | 65,689,541,274  |
| 次期繰越損益金         | 14,230,703,511  |
| (D) 受益権総口数      | 65,689,541,274口 |
| 1万円当たり基準価額(C／D) | 12,166円         |

(注) 当親ファンドの期首元本額は126,460,855,200円、期中追加設定元本額は17,938,262,969円、期中一部解約元本額は78,709,576,895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> | 24,366,062,721円 |
| 東京海上セレクション・日本株TOPIX             | 16,186,801,364円 |
| TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>      | 13,968,573,968円 |
| TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>    | 8,921,502,332円  |
| TMA世界バランスファンド55VA<適格機関投資家限定>    | 1,756,977,162円  |
| 東京海上日本株TOPIXファンド                | 375,973,673円    |
| LPS4資産分散ファンド(積極型)               | 45,488,971円     |
| LPS4資産分散ファンド(成長重視型)             | 32,422,697円     |
| LPS4資産分散ファンド(バランス型)             | 25,613,043円     |
| LPS4資産分散ファンド(安定重視型)             | 5,157,837円      |
| LPS4資産分散ファンド(慎重型)               | 4,352,539円      |
| TMA債券重視型バランスVA(適格機関投資家限定)       | 269,285円        |
| TMA資産分散型バランスVA(適格機関投資家限定)       | 234,473円        |
| TMA新興国重視型バランスVA(適格機関投資家限定)      | 111,209円        |

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1,2166円です。

## ○損益の状況 (2016年3月23日～2017年3月21日)

| 項 目                | 当 期             |
|--------------------|-----------------|
|                    | 円               |
| (A) 配当等収益          | 2,546,874,627   |
| 受取配当金              | 2,546,454,579   |
| 受取利息               | 37,419          |
| その他収益金             | 1,745,092       |
| 支払利息               | △ 1,362,463     |
| (B) 有価証券売買損益       | 12,272,713,023  |
| 売買益                | 16,462,921,694  |
| 売買損                | △ 4,190,208,671 |
| (C) 先物取引等取引損益      | 423,898,160     |
| 取引益                | 880,022,600     |
| 取引損                | △ 456,124,440   |
| (D) 保管費用等          | △ 58,219        |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | 15,243,427,591  |
| (F) 前期繰越損益金        | 5,441,292,191   |
| (G) 追加信託差損益金       | 726,968,325     |
| (H) 解約差損益金         | △ 7,180,984,596 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 14,230,703,511  |
| 次期繰越損益金(I)         | 14,230,703,511  |

(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日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第11期（決算日 2016年11月10日）

（計算期間 2015年11月11日～2016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、－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 | 期 騰 落 率 | ベ ン チ マ ー ク |     | 債 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|------------------|---------|---------|-------------|-----|-----------|---------|
|                  |         |         | 期 騰 落       | 中 率 |           |         |
|                  | 円       | %       |             | %   | %         | 百万円     |
| 7期(2012年11月12日)  | 11,497  | 2.2     | 344,119     | 2.3 | 99.6      | 200,723 |
| 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  |

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日       | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | ベ ン チ マ ー ク |     | 債 組 入 比 率 | 券 率  |
|-------------|---------|-------|-------------|-----|-----------|------|
|             |         |       | 騰 落         | 率   |           |      |
| (期 首)       | 円       | %     |             | %   |           | %    |
| 2015年11月10日 | 12,233  | —     | 366,242     | —   | 99.0      | 99.0 |
| 11月末        | 12,245  | 0.1   | 366,578     | 0.1 | 98.9      | 98.9 |
| 12月末        | 12,319  | 0.7   | 368,877     | 0.7 | 98.8      | 98.8 |
| 2016年1月末    | 12,473  | 2.0   | 373,520     | 2.0 | 98.9      | 98.9 |
| 2月末         | 12,687  | 3.7   | 379,830     | 3.7 | 99.1      | 99.1 |
| 3月末         | 12,792  | 4.6   | 382,913     | 4.6 | 98.8      | 98.8 |
| 4月末         | 12,904  | 5.5   | 386,253     | 5.5 | 99.0      | 99.0 |
| 5月末         | 12,950  | 5.9   | 387,599     | 5.8 | 98.5      | 98.5 |
| 6月末         | 13,109  | 7.2   | 392,355     | 7.1 | 99.0      | 99.0 |
| 7月末         | 12,997  | 6.2   | 389,242     | 6.3 | 99.5      | 99.5 |
| 8月末         | 12,869  | 5.2   | 385,240     | 5.2 | 99.4      | 99.4 |
| 9月末         | 12,879  | 5.3   | 385,504     | 5.3 | 99.4      | 99.4 |
| 10月末        | 12,845  | 5.0   | 384,444     | 5.0 | 99.5      | 99.5 |
| (期 末)       |         |       |             |     |           |      |
| 2016年11月10日 | 12,834  | 4.9   | 384,198     | 4.9 | 99.5      | 99.5 |

（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

(2015年11月11日～2016年11月10日)

### ■期中の基準価額等の推移

期 首：12,233円

期 末：12,834円

騰落率： 4.9%

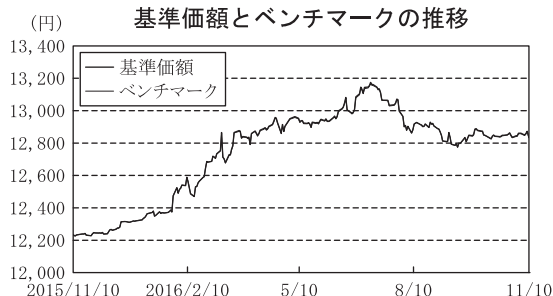
### ◇基準価額の主な変動要因

#### プラス要因

- ・日銀の追加金融緩和などを背景に国内金利が低下（債券価格は上昇）したこと

#### マイナス要因

- ・日銀の金融政策に対する不透明感から長期金利が上昇（債券価格は下落）する局面があったこと



(注) ベンチマークは期首（2015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NOMURA-BPI（総合）です。

### ■投資環境

期初から、国内金利の代表的な指標である10年国債利回りは0.3%台前半を中心とする狭い範囲内で推移し、好需給を背景に徐々に水準を切り下げました。2015年12月下旬には、日銀が量的・質的金融緩和政策の補完措置を決定したことなどを受けて、10年国債利回りは0.2%台後半まで低下しました。

2016年1月には、中国株式市場の下落をきっかけとする世界的な株安、原油安などにより投資家のリスク回避姿勢が強まったことを背景に、10年国債利回りは低下基調で推移しました。その後、1月末の日銀金融政策決定会合でマイナス金利政策が導入されると、10年国債利回りは低下幅を拡大し、2月半ば以降はおおむねマイナス圏で推移しました。

6月には英国のEU（欧州連合）離脱懸念、およびその後の国民投票でEU離脱派が勝利したことなどを背景に10年国債利回りは-0.3%に近い水準まで低下しましたが、7月の日銀金融政策決定会合でマイナス金利幅の拡大や国債買入額の増額が見送られると国債利回りは急上昇しました。

8月以降、日銀によるこれまでの金融政策の「総括的な検証」に対する不透明感を背景に、10年国債利回りは一時0%近辺まで上昇した後、-0.1%から0%の狭い範囲で推移しました。その後、9月の日銀金融政策決定会合で長短金利操作付き量的・質的金融緩和政策の導入が決定され、10年国債利回りは再び0%程度の水準まで上昇しましたが、期末にかけて方向感のない展開となり、-0.1%を小幅に上回る水準で終了しました。

### ■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値が近似するよう調整して運用を行いました。

当期、ベンチマークの騰落率4.9%に対して、基準価額の騰落率は4.9%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。

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0.030%となっています。

※2016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、ベンチマークとの連動性を高位に維持するよう運用する方針です。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年11月11日～2016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<br>0 | %<br>0.000 | (a) 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 )             | (0)    | (0.000)    | *その他は、信託事務等に要する諸費用            |
| 合 計                   | 0      | 0.000      |                               |
| 期中の平均基準価額は、12,755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

(2015年11月11日～2016年11月10日)

## 公社債

|                |                | 買 付 額      | 売 付 額        |
|----------------|----------------|------------|--------------|
|                |                | 千円         | 千円           |
| 国<br><br><br>内 | 国債証券           | 15,330,407 | 51,196,459   |
|                | 地方債証券          | —          | 1,988,487    |
|                | 特殊債券           | —          | 1,990,827    |
|                | 社債券（投資法人債券を含む） | —          | ( 1,317,000) |
|                |                |            | 3,154,151    |
|                |                |            | ( 614,948)   |

(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

(2015年11月11日～2016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

(2016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         |        |       |
|------------|--------------|--------------|---------|---------------------|-----------|--------|-------|
|            | 額 面 金 額      | 評 価 額        | 組 入 比 率 | うちB B格以下<br>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       | 46,535,000   | 52,956,013   | 73.8    | —                   | 49.1      | 21.2   | 3.5   |
| 地方債証券      | 6,362,000    | 6,960,083    | 9.7     | —                   | 5.7       | 1.3    | 2.6   |
|            | ( 6,362,000) | ( 6,960,083) | ( 9.7)  | (—)                 | ( 5.7)    | ( 1.3) | (2.6) |
| 特殊債券       | 1,949,000    | 2,089,654    | 2.9     | —                   | 1.5       | 1.1    | 0.3   |
| (除く金融債)    | ( 1,949,000) | ( 2,089,654) | ( 2.9)  | (—)                 | ( 1.5)    | ( 1.1) | (0.3) |
| 普通社債券      | 8,734,872    | 9,405,609    | 13.1    | —                   | 6.6       | 3.5    | 3.0   |
| (含む投資法人債券) | ( 8,734,872) | ( 9,405,609) | (13.1)  | (—)                 | ( 6.6)    | ( 3.5) | (3.0) |
| 合 計        | 63,580,872   | 71,411,360   | 99.5    | —                   | 63.0      | 27.1   | 9.4   |
|            | (17,045,872) | (18,455,346) | (25.7)  | (—)                 | (13.9)    | ( 5.9) | (5.9) |

(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365回利付国債 (2年)  | 0.1   | 1,550,000 | 1,559,362 | 2018/6/15  | 第303回利付国債 (10年) | 1.4   | 200,000   | 209,350   | 2019/9/20  |
| 第114回利付国債 (5年)  | 0.3   | 500,000   | 505,390   | 2018/9/20  | 第304回利付国債 (10年) | 1.3   | 500,000   | 521,940   | 2019/9/20  |
| 第115回利付国債 (5年)  | 0.2   | 200,000   | 201,784   | 2018/9/20  | 第305回利付国債 (10年) | 1.3   | 1,000,000 | 1,047,580 | 2019/12/20 |
| 第117回利付国債 (5年)  | 0.2   | 100,000   | 101,097   | 2019/3/20  | 第307回利付国債 (10年) | 1.3   | 300,000   | 315,312   | 2020/3/20  |
| 第120回利付国債 (5年)  | 0.2   | 150,000   | 151,893   | 2019/9/20  | 第308回利付国債 (10年) | 1.3   | 700,000   | 738,311   | 2020/6/20  |
| 第122回利付国債 (5年)  | 0.1   | 550,000   | 555,577   | 2019/12/20 | 第309回利付国債 (10年) | 1.1   | 700,000   | 733,236   | 2020/6/20  |
| 第123回利付国債 (5年)  | 0.1   | 650,000   | 657,007   | 2020/3/20  | 第310回利付国債 (10年) | 1.0   | 160,000   | 167,448   | 2020/9/20  |
| 第125回利付国債 (5年)  | 0.1   | 450,000   | 455,323   | 2020/9/20  | 第311回利付国債 (10年) | 0.8   | 400,000   | 415,516   | 2020/9/20  |
| 第126回利付国債 (5年)  | 0.1   | 600,000   | 607,434   | 2020/12/20 | 第312回利付国債 (10年) | 1.2   | 580,000   | 613,297   | 2020/12/20 |
| 第127回利付国債 (5年)  | 0.1   | 950,000   | 962,274   | 2021/3/20  | 第313回利付国債 (10年) | 1.3   | 150,000   | 159,756   | 2021/3/20  |
| 第128回利付国債 (5年)  | 0.1   | 350,000   | 354,704   | 2021/6/20  | 第316回利付国債 (10年) | 1.1   | 100,000   | 105,933   | 2021/6/20  |
| 第3回利付国債 (40年)   | 2.2   | 130,000   | 195,678   | 2050/3/20  | 第317回利付国債 (10年) | 1.1   | 400,000   | 424,940   | 2021/9/20  |
| 第4回利付国債 (40年)   | 2.2   | 135,000   | 204,669   | 2051/3/20  | 第319回利付国債 (10年) | 1.1   | 450,000   | 479,515   | 2021/12/20 |
| 第5回利付国債 (40年)   | 2.0   | 150,000   | 219,228   | 2052/3/20  | 第320回利付国債 (10年) | 1.0   | 50,000    | 53,022    | 2021/12/20 |
| 第6回利付国債 (40年)   | 1.9   | 145,000   | 208,395   | 2053/3/20  | 第322回利付国債 (10年) | 0.9   | 150,000   | 158,700   | 2022/3/20  |
| 第7回利付国債 (40年)   | 1.7   | 235,000   | 323,740   | 2054/3/20  | 第324回利付国債 (10年) | 0.8   | 50,000    | 52,755    | 2022/6/20  |
| 第8回利付国債 (40年)   | 1.4   | 230,000   | 294,705   | 2055/3/20  | 第328回利付国債 (10年) | 0.6   | 50,000    | 52,469    | 2023/3/20  |
| 第9回利付国債 (40年)   | 0.4   | 70,000    | 65,335    | 2056/3/20  | 第330回利付国債 (10年) | 0.8   | 350,000   | 373,397   | 2023/9/20  |
| 第297回利付国債 (10年) | 1.4   | 300,000   | 310,473   | 2018/12/20 | 第331回利付国債 (10年) | 0.6   | 50,000    | 52,649    | 2023/9/20  |
| 第299回利付国債 (10年) | 1.3   | 200,000   | 207,312   | 2019/3/20  | 第332回利付国債 (10年) | 0.6   | 450,000   | 474,385   | 2023/12/20 |
| 第300回利付国債 (10年) | 1.5   | 800,000   | 833,024   | 2019/3/20  | 第333回利付国債 (10年) | 0.6   | 150,000   | 158,296   | 2024/3/20  |
| 第301回利付国債 (10年) | 1.5   | 800,000   | 836,376   | 2019/6/20  | 第334回利付国債 (10年) | 0.6   | 550,000   | 581,025   | 2024/6/20  |
| 第302回利付国債 (10年) | 1.4   | 550,000   | 573,573   | 2019/6/20  | 第335回利付国債 (10年) | 0.5   | 500,000   | 524,770   | 2024/9/20  |

| 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      |            | 国債証券            | %     | 千円      | 千円      |            |
| 第336回利付国債 (10年) | 0.5   | 300,000 | 315,081 | 2024/12/20 | 第51回利付国債 (30年)  | 0.3   | 270,000 | 254,763 | 2046/6/20  |
| 第337回利付国債 (10年) | 0.3   | 450,000 | 465,264 | 2024/12/20 | 第40回利付国債 (20年)  | 2.3   | 210,000 | 220,071 | 2018/9/20  |
| 第338回利付国債 (10年) | 0.4   | 650,000 | 677,631 | 2025/3/20  | 第41回利付国債 (20年)  | 1.5   | 190,000 | 197,866 | 2019/3/20  |
| 第339回利付国債 (10年) | 0.4   | 700,000 | 730,030 | 2025/6/20  | 第42回利付国債 (20年)  | 2.6   | 760,000 | 811,186 | 2019/3/20  |
| 第340回利付国債 (10年) | 0.4   | 550,000 | 574,035 | 2025/9/20  | 第43回利付国債 (20年)  | 2.9   | 450,000 | 490,464 | 2019/9/20  |
| 第341回利付国債 (10年) | 0.3   | 400,000 | 413,928 | 2025/12/20 | 第44回利付国債 (20年)  | 2.5   | 350,000 | 381,951 | 2020/3/20  |
| 第342回利付国債 (10年) | 0.1   | 550,000 | 558,794 | 2026/3/20  | 第45回利付国債 (20年)  | 2.4   | 80,000  | 87,033  | 2020/3/20  |
| 第343回利付国債 (10年) | 0.1   | 650,000 | 660,036 | 2026/6/20  | 第47回利付国債 (20年)  | 2.2   | 310,000 | 338,814 | 2020/9/21  |
| 第1回利付国債 (30年)   | 2.8   | 90,000  | 121,599 | 2029/9/20  | 第49回利付国債 (20年)  | 2.1   | 330,000 | 363,069 | 2021/3/22  |
| 第2回利付国債 (30年)   | 2.4   | 90,000  | 117,800 | 2030/2/20  | 第50回利付国債 (20年)  | 1.9   | 80,000  | 87,315  | 2021/3/22  |
| 第3回利付国債 (30年)   | 2.3   | 120,000 | 156,028 | 2030/5/20  | 第51回利付国債 (20年)  | 2.0   | 230,000 | 253,197 | 2021/6/21  |
| 第5回利付国債 (30年)   | 2.2   | 10,000  | 13,003  | 2031/5/20  | 第52回利付国債 (20年)  | 2.1   | 140,000 | 155,547 | 2021/9/21  |
| 第8回利付国債 (30年)   | 1.8   | 110,000 | 138,180 | 2032/11/22 | 第53回利付国債 (20年)  | 2.1   | 230,000 | 256,916 | 2021/12/20 |
| 第9回利付国債 (30年)   | 1.4   | 140,000 | 167,113 | 2032/12/20 | 第60回利付国債 (20年)  | 1.4   | 330,000 | 362,036 | 2022/12/20 |
| 第14回利付国債 (30年)  | 2.4   | 200,000 | 273,072 | 2034/3/20  | 第62回利付国債 (20年)  | 0.8   | 380,000 | 404,456 | 2023/6/20  |
| 第15回利付国債 (30年)  | 2.5   | 170,000 | 235,264 | 2034/6/20  | 第64回利付国債 (20年)  | 1.9   | 370,000 | 422,636 | 2023/9/20  |
| 第18回利付国債 (30年)  | 2.3   | 200,000 | 270,966 | 2035/3/20  | 第65回利付国債 (20年)  | 1.9   | 300,000 | 344,124 | 2023/12/20 |
| 第19回利付国債 (30年)  | 2.3   | 60,000  | 81,352  | 2035/6/20  | 第66回利付国債 (20年)  | 1.8   | 160,000 | 182,385 | 2023/12/20 |
| 第21回利付国債 (30年)  | 2.3   | 110,000 | 149,604 | 2035/12/20 | 第67回利付国債 (20年)  | 1.9   | 150,000 | 172,708 | 2024/3/20  |
| 第22回利付国債 (30年)  | 2.5   | 140,000 | 195,777 | 2036/3/20  | 第68回利付国債 (20年)  | 2.2   | 300,000 | 352,098 | 2024/3/20  |
| 第23回利付国債 (30年)  | 2.5   | 160,000 | 224,320 | 2036/6/20  | 第69回利付国債 (20年)  | 2.1   | 410,000 | 478,158 | 2024/3/20  |
| 第24回利付国債 (30年)  | 2.5   | 70,000  | 98,297  | 2036/9/20  | 第70回利付国債 (20年)  | 2.4   | 290,000 | 346,294 | 2024/6/20  |
| 第25回利付国債 (30年)  | 2.3   | 200,000 | 273,488 | 2036/12/20 | 第71回利付国債 (20年)  | 2.2   | 160,000 | 188,604 | 2024/6/20  |
| 第27回利付国債 (30年)  | 2.5   | 180,000 | 254,950 | 2037/9/20  | 第72回利付国債 (20年)  | 2.1   | 330,000 | 388,050 | 2024/9/20  |
| 第28回利付国債 (30年)  | 2.5   | 120,000 | 170,902 | 2038/3/20  | 第74回利付国債 (20年)  | 2.1   | 120,000 | 141,669 | 2024/12/20 |
| 第29回利付国債 (30年)  | 2.4   | 130,000 | 183,532 | 2038/9/20  | 第75回利付国債 (20年)  | 2.1   | 230,000 | 272,579 | 2025/3/20  |
| 第30回利付国債 (30年)  | 2.3   | 220,000 | 307,313 | 2039/3/20  | 第76回利付国債 (20年)  | 1.9   | 10,000  | 11,683  | 2025/3/20  |
| 第31回利付国債 (30年)  | 2.2   | 140,000 | 193,568 | 2039/9/20  | 第80回利付国債 (20年)  | 2.1   | 290,000 | 345,175 | 2025/6/20  |
| 第32回利付国債 (30年)  | 2.3   | 250,000 | 352,925 | 2040/3/20  | 第82回利付国債 (20年)  | 2.1   | 300,000 | 358,446 | 2025/9/20  |
| 第33回利付国債 (30年)  | 2.0   | 300,000 | 404,946 | 2040/9/20  | 第83回利付国債 (20年)  | 2.1   | 200,000 | 239,960 | 2025/12/20 |
| 第34回利付国債 (30年)  | 2.2   | 220,000 | 308,193 | 2041/3/20  | 第84回利付国債 (20年)  | 2.0   | 300,000 | 357,189 | 2025/12/20 |
| 第35回利付国債 (30年)  | 2.0   | 200,000 | 272,328 | 2041/9/20  | 第85回利付国債 (20年)  | 2.1   | 100,000 | 120,356 | 2026/3/20  |
| 第36回利付国債 (30年)  | 2.0   | 140,000 | 191,326 | 2042/3/20  | 第87回利付国債 (20年)  | 2.2   | 300,000 | 363,888 | 2026/3/20  |
| 第37回利付国債 (30年)  | 1.9   | 170,000 | 228,933 | 2042/9/20  | 第90回利付国債 (20年)  | 2.2   | 250,000 | 305,372 | 2026/9/20  |
| 第38回利付国債 (30年)  | 1.8   | 200,000 | 265,468 | 2043/3/20  | 第95回利付国債 (20年)  | 2.3   | 150,000 | 186,955 | 2027/6/20  |
| 第39回利付国債 (30年)  | 1.9   | 140,000 | 189,571 | 2043/6/20  | 第98回利付国債 (20年)  | 2.1   | 150,000 | 184,374 | 2027/9/20  |
| 第40回利付国債 (30年)  | 1.8   | 150,000 | 199,704 | 2043/9/20  | 第99回利付国債 (20年)  | 2.1   | 150,000 | 185,062 | 2027/12/20 |
| 第41回利付国債 (30年)  | 1.7   | 50,000  | 65,411  | 2043/12/20 | 第100回利付国債 (20年) | 2.2   | 260,000 | 324,893 | 2028/3/20  |
| 第42回利付国債 (30年)  | 1.7   | 250,000 | 327,285 | 2044/3/20  | 第103回利付国債 (20年) | 2.3   | 100,000 | 126,526 | 2028/6/20  |
| 第43回利付国債 (30年)  | 1.7   | 200,000 | 262,336 | 2044/6/20  | 第104回利付国債 (20年) | 2.1   | 150,000 | 186,315 | 2028/6/20  |
| 第44回利付国債 (30年)  | 1.7   | 400,000 | 525,688 | 2044/9/20  | 第105回利付国債 (20年) | 2.1   | 160,000 | 199,457 | 2028/9/20  |
| 第45回利付国債 (30年)  | 1.5   | 270,000 | 341,142 | 2044/12/20 | 第107回利付国債 (20年) | 2.1   | 150,000 | 187,656 | 2028/12/20 |
| 第47回利付国債 (30年)  | 1.6   | 130,000 | 168,091 | 2045/6/20  | 第109回利付国債 (20年) | 1.9   | 100,000 | 123,000 | 2029/3/20  |
| 第48回利付国債 (30年)  | 1.4   | 340,000 | 421,936 | 2045/9/20  | 第110回利付国債 (20年) | 2.1   | 100,000 | 125,460 | 2029/3/20  |
| 第49回利付国債 (30年)  | 1.4   | 110,000 | 136,711 | 2045/12/20 | 第111回利付国債 (20年) | 2.2   | 50,000  | 63,576  | 2029/6/20  |
| 第50回利付国債 (30年)  | 0.8   | 120,000 | 129,710 | 2046/3/20  | 第112回利付国債 (20年) | 2.1   | 250,000 | 314,747 | 2029/6/20  |

| 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      |
| <b>国債証券</b>       | %     | 千円         | 千円         |            | <b>地方債証券</b>            | %     | 千円        | 千円        |            |
| 第113回利付国債 (20年)   | 2.1   | 340,000    | 429,260    | 2029/9/20  | 第11回東京都公募公債 (20年)       | 2.22  | 300,000   | 364,038   | 2027/3/19  |
| 第114回利付国債 (20年)   | 2.1   | 50,000     | 63,297     | 2029/12/20 | 第155回神奈川県公募公債           | 1.61  | 100,000   | 102,562   | 2018/6/20  |
| 第115回利付国債 (20年)   | 2.2   | 200,000    | 255,790    | 2029/12/20 | 平成19年度第11回兵庫県公募公債       | 1.76  | 100,000   | 101,775   | 2017/11/15 |
| 第116回利付国債 (20年)   | 2.2   | 200,000    | 256,662    | 2030/3/20  | 平成20年度第5回静岡県公募公債        | 1.59  | 200,000   | 206,170   | 2018/10/30 |
| 第117回利付国債 (20年)   | 2.1   | 150,000    | 190,510    | 2030/3/20  | 平成25年度第5回静岡県公募公債        | 0.926 | 200,000   | 211,560   | 2023/7/25  |
| 第118回利付国債 (20年)   | 2.0   | 50,000     | 62,997     | 2030/6/20  | 平成24年度第4回愛知県公募公債 (20年)  | 1.687 | 100,000   | 120,554   | 2032/6/11  |
| 第120回利付国債 (20年)   | 1.6   | 200,000    | 241,214    | 2030/6/20  | 平成24年度第12回愛知県公募公債 (30年) | 2.12  | 100,000   | 134,621   | 2042/9/19  |
| 第121回利付国債 (20年)   | 1.9   | 110,000    | 137,516    | 2030/9/20  | 平成25年度第4回愛知県公募公債 (10年)  | 0.856 | 100,000   | 105,192   | 2023/5/30  |
| 第122回利付国債 (20年)   | 1.8   | 100,000    | 123,644    | 2030/9/20  | 平成22年度第10回埼玉県公募公債 (20年) | 1.94  | 100,000   | 123,023   | 2030/11/12 |
| 第123回利付国債 (20年)   | 2.1   | 240,000    | 307,372    | 2030/12/20 | 第12回埼玉県公募公債 (20年)       | 1.73  | 100,000   | 121,130   | 2032/5/24  |
| 第124回利付国債 (20年)   | 2.0   | 140,000    | 177,350    | 2030/12/20 | 平成24年度第9回福岡県公募公債        | 0.71  | 100,000   | 103,993   | 2022/12/26 |
| 第125回利付国債 (20年)   | 2.2   | 300,000    | 389,370    | 2031/3/20  | 平成20年度第3回千葉県公募公債        | 1.78  | 100,000   | 103,001   | 2018/7/25  |
| 第126回利付国債 (20年)   | 2.0   | 100,000    | 126,960    | 2031/3/20  | 平成21年度第1回千葉県公募公債        | 1.53  | 112,000   | 116,139   | 2019/4/25  |
| 第127回利付国債 (20年)   | 1.9   | 220,000    | 276,196    | 2031/3/20  | 第13回千葉県公募公債 (20年)       | 1.701 | 100,000   | 120,914   | 2032/10/15 |
| 第128回利付国債 (20年)   | 1.9   | 90,000     | 113,225    | 2031/6/20  | 第4回群馬県公募公債 (10年)        | 1.76  | 100,000   | 101,818   | 2017/11/24 |
| 第130回利付国債 (20年)   | 1.8   | 100,000    | 124,600    | 2031/9/20  | 第5回群馬県公募公債 (10年)        | 1.71  | 100,000   | 103,425   | 2018/11/22 |
| 第131回利付国債 (20年)   | 1.7   | 100,000    | 123,140    | 2031/9/20  | 第3回群馬県公募公債 (20年)        | 1.687 | 100,000   | 120,512   | 2032/6/25  |
| 第134回利付国債 (20年)   | 1.8   | 120,000    | 150,037    | 2032/3/20  | 第56回共同発行市場公募地方債         | 1.72  | 100,000   | 101,776   | 2017/11/24 |
| 第135回利付国債 (20年)   | 1.7   | 50,000     | 61,763     | 2032/3/20  | 第57回共同発行市場公募地方債         | 1.65  | 100,000   | 101,842   | 2017/12/25 |
| 第136回利付国債 (20年)   | 1.6   | 130,000    | 158,631    | 2032/3/20  | 第60回共同発行市場公募地方債         | 1.49  | 200,000   | 204,024   | 2018/3/23  |
| 第139回利付国債 (20年)   | 1.6   | 70,000     | 85,534     | 2032/6/20  | 第67回共同発行市場公募地方債         | 1.5   | 150,000   | 154,333   | 2018/10/25 |
| 第140回利付国債 (20年)   | 1.7   | 180,000    | 222,847    | 2032/9/20  | 第73回共同発行市場公募地方債         | 1.59  | 300,000   | 311,529   | 2019/4/25  |
| 第141回利付国債 (20年)   | 1.7   | 200,000    | 247,948    | 2032/12/20 | 第75回共同発行市場公募地方債         | 1.64  | 100,000   | 104,231   | 2019/6/25  |
| 第143回利付国債 (20年)   | 1.6   | 150,000    | 183,819    | 2033/3/20  | 第112回共同発行市場公募地方債        | 0.84  | 200,000   | 208,922   | 2022/7/25  |
| 第144回利付国債 (20年)   | 1.5   | 100,000    | 120,959    | 2033/3/20  | 第118回共同発行市場公募地方債        | 0.84  | 100,000   | 104,841   | 2023/1/25  |
| 第145回利付国債 (20年)   | 1.7   | 300,000    | 372,585    | 2033/6/20  | 平成19年度第1回新潟市公募公債 (10年)  | 1.72  | 150,000   | 152,889   | 2017/12/26 |
| 第146回利付国債 (20年)   | 1.7   | 380,000    | 472,522    | 2033/9/20  | 平成19年度第10回大阪市公募公債       | 1.74  | 100,000   | 101,916   | 2017/12/19 |
| 第148回利付国債 (20年)   | 1.5   | 320,000    | 387,785    | 2034/3/20  | 平成24年度第6回大阪市公募公債        | 0.797 | 100,000   | 104,450   | 2022/11/18 |
| 第149回利付国債 (20年)   | 1.5   | 450,000    | 545,269    | 2034/6/20  | 第481回名古屋市公募公債 (10年)     | 0.744 | 100,000   | 104,192   | 2022/12/20 |
| 第150回利付国債 (20年)   | 1.4   | 370,000    | 441,946    | 2034/9/20  | 第9回名古屋市公募公債 (30年)       | 2.095 | 100,000   | 133,905   | 2042/9/19  |
| 第151回利付国債 (20年)   | 1.2   | 380,000    | 440,598    | 2034/12/20 | 平成22年度第4回神戸市公募公債 (20年)  | 1.895 | 100,000   | 122,244   | 2030/9/13  |
| 第152回利付国債 (20年)   | 1.2   | 170,000    | 196,945    | 2035/3/20  | 平成22年度第3回横浜市公募公債        | 1.168 | 100,000   | 104,381   | 2020/9/18  |
| 第153回利付国債 (20年)   | 1.3   | 350,000    | 411,649    | 2035/6/20  | 第25回横浜市公募公債 (20年)       | 1.72  | 100,000   | 121,076   | 2032/7/16  |
| 第154回利付国債 (20年)   | 1.2   | 300,000    | 347,238    | 2035/9/20  | 平成20年度第2回札幌市公募公債        | 1.93  | 100,000   | 103,076   | 2018/6/20  |
| 第155回利付国債 (20年)   | 1.0   | 250,000    | 280,092    | 2035/12/20 | 平成24年度第1回札幌市公募公債        | 1.79  | 100,000   | 121,995   | 2032/4/23  |
| 第156回利付国債 (20年)   | 0.4   | 310,000    | 312,241    | 2036/3/20  | 第14回川崎市公募公債 (20年)       | 1.79  | 100,000   | 121,952   | 2032/3/19  |
| 第157回利付国債 (20年)   | 0.2   | 250,000    | 241,790    | 2036/6/20  | 第1回川崎市15年公募公債           | 1.78  | 100,000   | 105,016   | 2019/9/20  |
| 小 計               |       | 46,535,000 | 52,956,013 |            | 第2回川崎市15年公募公債           | 1.63  | 100,000   | 105,776   | 2020/6/22  |
| <b>地方債証券</b>      |       |            |            |            | 平成24年度第2回北九州市公募公債       | 0.715 | 100,000   | 104,024   | 2022/12/26 |
| 第661回東京都公募公債      | 1.6   | 150,000    | 154,404    | 2018/9/20  | 第37回地方公共団体金融機構債券        | 0.852 | 200,000   | 208,764   | 2022/6/28  |
| 第662回東京都公募公債      | 1.67  | 200,000    | 206,134    | 2018/9/20  | 第45回地方公共団体金融機構債券        | 0.791 | 200,000   | 208,990   | 2023/2/28  |
| 第716回東京都公募公債      | 0.77  | 100,000    | 104,382    | 2022/12/20 | 第2回公営企業債券 (20年)         | 1.45  | 100,000   | 108,395   | 2022/12/20 |
| 第7回東京都公募公債 (30年)  | 2.51  | 100,000    | 138,619    | 2038/9/17  | 第10回公営企業債券 (20年)        | 2.21  | 100,000   | 116,536   | 2024/9/24  |
| 第1回東京都公募公債 (20年)  | 1.54  | 200,000    | 219,562    | 2023/6/20  | 小 計                     |       | 6,362,000 | 6,960,083 |            |
| 第2回東京都公募公債 (20年)  | 1.97  | 100,000    | 113,091    | 2023/9/20  | <b>特殊債券(除く金融債)</b>      |       |           |           |            |
| 第10回東京都公募公債 (20年) | 2.33  | 100,000    | 122,388    | 2026/9/18  | 第344回政府保証道路債債券          | 1.6   | 100,000   | 105,899   | 2020/7/15  |

| 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      |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>         | %     | 千円        | 千円        |            | <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>       | %     | 千円      | 千円      |            |
| 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   | 108,141   | 2021/2/26  | 第62回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 1.21  | 70,378  | 73,972  | 2047/7/10  |
| 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   | 108,286   | 2021/3/26  | 第63回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 1.11  | 71,235  | 74,486  | 2047/8/10  |
| 第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券   | 1.6   | 224,000   | 231,389   | 2018/11/28 | 第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 1.09  | 74,810  | 78,187  | 2047/12/10 |
| 第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 2.3   | 200,000   | 247,460   | 2027/10/29 | 第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 1.28  | 75,743  | 80,046  | 2048/2/10  |
| 第16回政府保証日本政策投資銀行債券         | 1.8   | 7,000     | 7,038     | 2017/2/28  | 第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 1.25  | 70,313  | 74,190  | 2048/3/10  |
| 第21回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.8   | 1,000     | 1,000     | 2016/11/30 | 第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 1.07  | 69,174  | 72,303  | 2048/4/10  |
| 第23回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.7   | 3,000     | 3,006     | 2016/12/28 | 第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 1.08  | 71,324  | 74,622  | 2048/5/10  |
| 第27回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.8   | 5,000     | 5,027     | 2017/2/28  | 第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券         | 1.3   | 75,439  | 79,990  | 2048/6/10  |
| 第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.4   | 200,000   | 204,090   | 2018/4/20  | 第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券          | 2.25  | 38,240  | 40,946  | 2037/5/10  |
| 第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.4   | 100,000   | 103,484   | 2019/4/30  | 第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券            | 1.82  | 12,802  | 13,152  | 2036/12/10 |
| 第87回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.5   | 100,000   | 104,232   | 2019/8/30  | 第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券           | 1.69  | 53,343  | 55,650  | 2039/2/10  |
| 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   | 104,789   | 2022/9/30  | 第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券           | 1.79  | 63,672  | 66,843  | 2040/3/10  |
| 第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.834 | 200,000   | 210,022   | 2023/1/31  | 第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券           | 1.81  | 20,276  | 21,233  | 2040/4/10  |
| 第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.605 | 200,000   | 207,516   | 2023/5/31  | 第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券           | 1.88  | 162,540 | 171,834 | 2040/12/10 |
| 第870回政府保証公営企業債券            | 1.7   | 9,000     | 9,017     | 2016/12/21 | 第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券           | 2.18  | 24,671  | 26,578  | 2042/3/10  |
| 第45回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.815 | 100,000   | 104,923   | 2023/2/17  | 第14回国際協力機構債券                 | 0.825 | 100,000 | 104,403 | 2022/9/20  |
| 第51回政府保証関西国際空港債券           | 2.1   | 200,000   | 224,332   | 2022/8/31  | 第3回ヒューリック株式会社無担保社債           | 0.8   | 100,000 | 102,269 | 2020/4/24  |
| <b>小 計</b>                 |       | 1,949,000 | 2,089,654 |            | 第13回武田薬品工業株式会社無担保社債          | 0.549 | 100,000 | 100,749 | 2018/3/22  |
| <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>     |       |           |           |            | 第46回株式会社神戸製鋼所無担保社債           | 1.97  | 200,000 | 203,644 | 2017/10/27 |
| 第472回関西電力株式会社社債            | 1.79  | 100,000   | 103,451   | 2018/11/22 | 第12回株式会社フジクラ無担保社債            | 0.826 | 100,000 | 101,422 | 2018/9/7   |
| 第322回中国電力株式会社社債            | 2.95  | 100,000   | 130,924   | 2029/11/22 | 第22回株式会社豊田自動織機無担保社債          | 0.821 | 100,000 | 103,563 | 2022/9/20  |
| 第445回東北電力株式会社社債            | 1.792 | 300,000   | 310,491   | 2018/11/22 | 第17回富士通株式会社無担保社債             | 3.0   | 100,000 | 104,400 | 2018/5/8   |
| 第404回九州電力株式会社社債            | 1.884 | 200,000   | 213,394   | 2020/10/23 | 第11回パナソニック株式会社無担保社債          | 1.081 | 200,000 | 202,786 | 2018/3/20  |
| 第2回日本高速道路保有・債務返済機構債券       | 2.7   | 100,000   | 139,272   | 2035/9/20  | 第26回ソニー株式会社無担保社債             | 2.068 | 200,000 | 209,692 | 2019/6/20  |
| 第67回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 1.3   | 200,000   | 210,856   | 2021/3/19  | 第22回三菱重工株式会社無担保社債            | 2.03  | 100,000 | 101,744 | 2017/9/12  |
| 第7回道路債券                    | 2.7   | 100,000   | 114,696   | 2022/6/20  | 第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債      | 0.87  | 100,000 | 101,014 | 2018/8/3   |
| 第21回道路債券                   | 2.75  | 100,000   | 137,577   | 2033/6/20  | 第5回住友生命流動化特定目的会社第1回特定社債      | 1.12  | 100,000 | 101,403 | 2018/8/8   |
| 第33回道路債券                   | 2.91  | 100,000   | 141,680   | 2034/6/20  | 第64回三井物産株式会社無担保社債            | 2.36  | 200,000 | 240,546 | 2027/5/21  |
| 第30回株式会社日本政策金融公庫社債         | 0.825 | 100,000   | 104,477   | 2022/10/26 | 第36回住友商事株式会社無担保社債            | 2.21  | 200,000 | 211,220 | 2019/7/25  |
| 第46回都市再生債券                 | 1.12  | 200,000   | 208,612   | 2020/11/20 | 第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債       | 2.22  | 100,000 | 112,433 | 2022/10/27 |
| 第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券      | 2.08  | 41,622    | 44,603    | 2037/11/10 | 第124回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債      | 1.51  | 200,000 | 212,810 | 2021/4/16  |
| 第41回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.51  | 59,321    | 62,901    | 2045/10/10 | 第127回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債      | 1.275 | 100,000 | 105,661 | 2021/7/14  |
| 第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.89  | 53,398    | 57,577    | 2046/5/10  | 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 | 106,018 | 2019/12/20 |
| 第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.76  | 52,387    | 56,572    | 2046/6/10  | 第9回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付) | 1.68  | 200,000 | 212,764 | 2021/4/28  |
| 第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.67  | 52,433    | 55,962    | 2046/7/10  | 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 | 242,358 | 2026/4/27  |
| 第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.64  | 57,134    | 61,014    | 2046/8/10  | 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 | 107,047 | 2022/3/22  |
| 第52回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.51  | 60,354    | 64,146    | 2046/9/10  | 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 | 122,408 | 2026/11/6  |
| 第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.48  | 61,774    | 65,592    | 2046/10/10 | 第44回三井不動産株式会社無担保社債           | 1.173 | 100,000 | 104,645 | 2021/9/6   |
| 第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.47  | 64,557    | 68,585    | 2046/11/10 | 第65回三菱地所株式会社無担保社債            | 2.04  | 100,000 | 120,871 | 2032/12/20 |
| 第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.41  | 68,448    | 72,786    | 2046/12/10 | 第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債         | 2.02  | 100,000 | 111,221 | 2029/9/20  |
| 第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.42  | 66,694    | 70,722    | 2047/1/10  | 第6回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債         | 2.39  | 100,000 | 112,027 | 2022/2/15  |
| 第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.44  | 67,357    | 71,482    | 2047/2/10  | 第9回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債         | 1.74  | 100,000 | 109,588 | 2022/9/20  |
| 第58回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.4   | 69,020    | 73,132    | 2047/3/10  | 第23回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債        | 2.14  | 100,000 | 103,133 | 2018/4/25  |
| 第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.44  | 68,140    | 72,338    | 2047/4/10  | 第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債        | 2.166 | 100,000 | 122,576 | 2029/1/29  |
| 第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.34  | 69,390    | 73,304    | 2047/5/10  | 第15回株式会社エス・ティ・ティ・ドコモ無担保社債    | 1.96  | 200,000 | 206,336 | 2018/6/20  |
| 第61回貸付債権担保住宅金融支援機構債券       | 1.26  | 68,283    | 71,934    | 2047/6/10  | 第416回東北電力株式会社社債              | 0.83  | 100,000 | 101,268 | 2018/6/25  |

| 銘柄                                | 当 期 末 |         |         |            |
|-----------------------------------|-------|---------|---------|------------|
|                                   | 利率    | 額面金額    | 評 価 額   | 償還年月日      |
| 普通社債券(含む投資法人債券)                   | %     | 千円      | 千円      |            |
| 第253回四国電力株式会社社債                   | 1.0   | 100,000 | 105,187 | 2023/6/23  |
| 第265回北海道電力株式会社社債                  | 2.0   | 200,000 | 208,158 | 2018/12/25 |
| 第3回電源開発株式会社無担保社債                  | 2.01  | 100,000 | 112,209 | 2023/12/20 |
| 第23回東京瓦斯株式会社無担保社債                 | 1.01  | 100,000 | 105,600 | 2023/6/9   |
| 第17回東邦瓦斯株式会社無担保社債                 | 3.175 | 200,000 | 208,124 | 2018/2/19  |
| 第1回ディー・エヌ・ビー・バンク円貨社債 (2012)       | 1.91  | 100,000 | 100,423 | 2017/2/2   |
| 第2回ノルデア・バンク円貨社債 (2012)            | 1.2   | 100,000 | 100,617 | 2017/6/15  |
| 第9回ジョー・ビー・モルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債 | 1.32  | 100,000 | 100,297 | 2017/2/9   |

| 銘柄                                 | 当 期 末 |            |            |           |
|------------------------------------|-------|------------|------------|-----------|
|                                    | 利率    | 額面金額       | 評 価 額      | 償還年月日     |
| 普通社債券(含む投資法人債券)                    | %     | 千円         | 千円         |           |
| 第9回カエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債      | 1.2   | 100,000    | 100,349    | 2017/3/9  |
| 第10回コーベレイブ・セントラル・ラホバンク・ネーデルランド円貨社債 | 1.142 | 100,000    | 100,498    | 2017/5/25 |
| 小 計                                |       | 8,734,872  | 9,405,609  |           |
| 合 計                                |       | 63,580,872 | 71,411,360 |           |

(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

(2016年11月10日現在)

| 項 目          | 当 期 末      |       |
|--------------|------------|-------|
|              | 評 価 額      | 比 率   |
|              | 千円         | %     |
| 公社債          | 71,411,360 | 98.9  |
| コール・ローン等、その他 | 793,741    | 1.1   |
| 投資信託財産総額     | 72,205,101 | 100.0 |

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年11月10日現在)

| 項 目             | 当 期 末<br>円      |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資産          | 72,205,101,441  |
| コール・ローン等        | 56,210,272      |
| 公社債(評価額)        | 71,411,360,836  |
| 未収入金            | 522,866,300     |
| 未収利息            | 213,193,519     |
| 前払費用            | 1,470,514       |
| (B) 負債          | 461,057,694     |
| 未払解約金           | 461,057,568     |
| 未払利息            | 126             |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 71,744,043,747  |
| 元本              | 55,902,471,242  |
| 次期繰越損益金         | 15,841,572,505  |
| (D) 受益権総口数      | 55,902,471,242口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,834円         |

(注) 当親ファンドの期首元本額は92,810,738,302円、期中追加設定元本額は5,359,074,105円、期中一部解約元本額は42,267,341,165円です。

<元本の内訳>

|                              |                 |
|------------------------------|-----------------|
| TMA日本債券インデックスVA<適格機関投資家限定>   | 32,034,103,876円 |
| TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定> | 17,354,607,456円 |
| TMA世界バランスファンド55VA<適格機関投資家限定> | 5,987,037,329円  |
| 東京海上セレクション・日本債券インデックス        | 243,228,981円    |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)     | 153,805,941円    |
| L P S 4資産分散ファンド(バランス型)       | 34,449,997円     |
| L P S 4資産分散ファンド(慎重型)         | 34,049,574円     |
| L P S 4資産分散ファンド(成長重視型)       | 25,425,874円     |
| L P S 4資産分散ファンド(積極型)         | 18,862,177円     |
| L P S 4資産分散ファンド(安定重視型)       | 16,214,766円     |
| TMA債券重視型バランスVA(適格機関投資家限定)    | 685,271円        |

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1,2834円です。

## ○損益の状況 (2015年11月11日～2016年11月10日)

| 項 目              | 当 期<br>円        |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益        | 1,179,314,236   |
| 受取利息             | 1,179,546,532   |
| 支払利息             | △ 232,296       |
| (B) 有価証券売買損益     | 3,947,741,875   |
| 売買益              | 4,334,221,626   |
| 売買損              | △ 386,479,751   |
| (C) 保管費用等        | △ 19,374        |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 5,127,036,737   |
| (E) 前期繰越損益金      | 20,723,826,821  |
| (F) 追加信託差損益金     | 1,503,136,415   |
| (G) 解約差損益金       | △11,512,427,468 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 15,841,572,505  |
| 次期繰越損益金(H)       | 15,841,572,505  |

(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。

# TMA外国株式インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第11期（決算日 2016年11月10日）

（計算期間 2015年11月11日～2016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<br>組 入 比 率 | 株<br>先 物 比 率 | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 | 純 資 産 額 |
|------------------|----------|-------|----------|-------|--------------|--------------|----------------------|---------|
|                  | 期<br>騰 落 | 中 率   | 期<br>騰 落 | 中 率   |              |              |                      |         |
|                  | 円        | %     |          | %     | %            | %            | %                    | 百万円     |
| 7期(2012年11月12日)  | 9,150    | 15.0  | 423,025  | 15.1  | 96.6         | 1.1          | 2.3                  | 196,103 |
| 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  |

（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（円ヘッジなし・円ベース）およびMSCIコクサイ指数（米ドルベース）とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用などすることは禁じられています。MSCI社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日       | 基 準 価 額 | 騰 落 率 | ペ ン チ   | マ ー ク | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 投 資 信 託 組 入 比 率 |
|-------------|---------|-------|---------|-------|-----------|-----------|-----------------|
|             |         |       |         |       |           |           |                 |
| (期 首)       | 円       | %     |         | %     | %         | %         | %               |
| 2015年11月10日 | 20,086  | —     | 934,426 | —     | 95.2      | 2.4       | 2.4             |
| 11月末        | 20,145  | 0.3   | 937,887 | 0.4   | 94.9      | 2.0       | 2.5             |
| 12月末        | 19,663  | △ 2.1 | 915,044 | △ 2.1 | 92.7      | 5.0       | 2.5             |
| 2016年1月末    | 17,940  | △10.7 | 834,508 | △10.7 | 92.9      | 4.5       | 2.6             |
| 2月末         | 17,207  | △14.3 | 800,304 | △14.4 | 92.4      | 4.9       | 2.5             |
| 3月末         | 18,204  | △ 9.4 | 847,721 | △ 9.3 | 93.1      | 3.9       | 2.7             |
| 4月末         | 18,112  | △ 9.8 | 843,015 | △ 9.8 | 93.5      | 3.6       | 2.6             |
| 5月末         | 18,318  | △ 8.8 | 852,826 | △ 8.7 | 94.6      | 2.4       | 2.7             |
| 6月末         | 16,563  | △17.5 | 771,820 | △17.4 | 93.4      | 3.7       | 2.7             |
| 7月末         | 17,610  | △12.3 | 820,416 | △12.2 | 93.8      | 3.0       | 2.8             |
| 8月末         | 17,564  | △12.6 | 818,847 | △12.4 | 93.9      | 2.8       | 2.8             |
| 9月末         | 17,145  | △14.6 | 799,793 | △14.4 | 93.0      | 4.1       | 2.7             |
| 10月末        | 17,508  | △12.8 | 815,255 | △12.8 | 95.2      | 1.9       | 2.6             |
| (期 末)       |         |       |         |       |           |           |                 |
| 2016年11月10日 | 17,807  | △11.3 | 829,736 | △11.2 | 93.4      | 3.8       | 2.5             |

(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

(2015年11月11日～2016年11月10日)

### ■期中の基準価額等の推移

期 首：20,086円  
 期 末：17,807円  
 騰落率：△11.3%

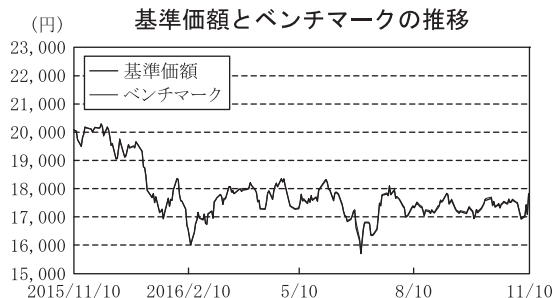
### ◇基準価額の主な変動要因

#### プラス要因

- ・原油価格が底打ち気配となったこと
- ・米国の雇用統計が堅調に推移したこと

#### マイナス要因

- ・米国製造業の活動停滞を示唆する経済指標が散見されたこと
- ・米国の利上げ先送りなどを要因として、円高が進行したこと
- ・英国のEU（欧州連合）離脱で世界経済の先行きに不安が広がったこと



(注) ベンチマークは、期首（2015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。

### ■投資環境

(2015年11月から2016年5月)

2015年12月の米国ISM（供給管理協会）製造業景況感指数が2009年6月以来の低水準となったことから、米国の景気回復に対して失望感が広がり、米国や欧州の株式市場は大きく下落しました。その後も原油価格の下落に連動して米国や欧州の株式市場は下落基調となりましたが、2016年2月中旬にサウジアラビアとロシアが原油生産量を2016年1月の水準で維持すると合意したことを受けて原油価格に底打ち気配が見られたことから、株式市場は世界的に上昇する展開となりました。

(2016年6月から2016年11月)

6月下旬に英国のEU離脱を問う国民投票において離脱派が勝利したことで、世界経済の先行きに懸念が広がり、世界的に株式市場は大きく下落しました。その後、米国の雇用統計が市場予想を上回ったことで米国経済の底堅さが確認されたことや、英国で新首相が決定したことにより英国のEU離脱を巡るショックが和らいだことから、世界的に株式市場は戻り基調となりました。

以上のような環境下、当期の外国株式市場は上昇しましたが、世界経済の先行き懸念などを背景とする投資家のリスク回避姿勢の強まりや米国の利上げ先送りにより為替市場で円高が進行した結果、円換算後の外国株式市場は前期末比で下落して期を終えました。

### ■ポートフォリオについて

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

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ています。その結果、保有銘柄数は前期末の1,034銘柄に対して、当期末には1,012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。

当期、ベンチマークの騰落率△11.2%に対して基準価額の騰落率は△11.3%となり、ベンチマーク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

(2015年11月11日～2016年11月10日)

| 項 目                   | 当 期 |         | 項 目 の 概 要                                                                                                    |
|-----------------------|-----|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                       | 金 額 | 比 率     |                                                                                                              |
|                       | 円   | %       |                                                                                                              |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料     | 3   | 0.019   | (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<br>*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)                 | (3) | (0.014) |                                                                                                              |
| (投 資 信 託 証 券)         | (0) | (0.000) |                                                                                                              |
| (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)     | (1) | (0.005) |                                                                                                              |
| (b) 有 価 証 券 取 引 税     | 1   | 0.008   | (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<br>*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) | (0.008) |                                                                                                              |
| (投 資 信 託 証 券)         | (0) | (0.000) |                                                                                                              |
| (c) そ の 他 費 用         | 5   | 0.025   | (c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数<br><br>*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<br>*その他は、信託事務等に要する諸費用 |
| (保 管 費 用)             | (4) | (0.024) |                                                                                                              |
| (そ の 他)               | (0) | (0.001) |                                                                                                              |
| 合 計                   | 9   | 0.052   |                                                                                                              |
| 期中の平均基準価額は、17,998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

(2015年11月11日～2016年11月10日)

## 株式

|     |         | 買 付                      |                                 | 売 付                    |                                 |
|-----|---------|--------------------------|---------------------------------|------------------------|---------------------------------|
|     |         | 株 数                      | 金 額                             | 株 数                    | 金 額                             |
| 外 国 | アメリカ    | 百株<br>11,199<br>( 1,116) | 千米ドル<br>63,263<br>( 4,479)      | 百株<br>35,030<br>( 905) | 千米ドル<br>206,338<br>( 8,228)     |
|     | カナダ     | 1,731<br>(△ 162)         | 千カナダドル<br>4,774<br>( 28)        | 4,489<br>( ー)          | 千カナダドル<br>13,771<br>( 28)       |
|     | ユーロ     |                          | 千ユーロ                            |                        | 千ユーロ                            |
|     | ドイツ     | 882<br>( 53)             | 3,306<br>( 64)                  | 2,196<br>( ー)          | 9,617<br>( 162)                 |
|     | イタリア    | 2,393<br>( 152)          | 825<br>( 61)                    | 5,782<br>( ー)          | 2,083<br>( 69)                  |
|     | フランス    | 1,119<br>( 133)          | 3,626<br>( 25)                  | 2,662<br>( ー)          | 10,226<br>( 65)                 |
|     | オランダ    | 382<br>( 133)            | 977<br>( 271)                   | 1,821<br>( ー)          | 3,805<br>( 59)                  |
|     | スペイン    | 1,308<br>( 13,543)       | 868<br>( 164)                   | 17,466<br>( ー)         | 3,331<br>( 14)                  |
|     | ベルギー    | 97<br>(△ 4)              | 685<br>(△ 256)                  | 256<br>( ー)            | 1,701<br>( 15)                  |
|     | オーストリア  | 19                       | 44                              | 67<br>( ー)             | 173<br>( 5)                     |
|     | ルクセンブルク | 44                       | 47                              | 514                    | 373                             |
|     | フィンランド  | 864                      | 861                             | 903                    | 1,373                           |
|     | アイルランド  | 44                       | 140                             | 118                    | 369                             |
|     | ポルトガル   | 253                      | 231                             | 561                    | 276                             |
|     | その他     | 19<br>( 68)              | 60<br>( 215)                    | 13                     | 46                              |
|     | イギリス    | 14,136<br>( 962)         | 千英ポンド<br>6,712<br>( 904)        | 32,033<br>( 1,018)     | 千英ポンド<br>18,642<br>( 1,077)     |
|     | スイス     | 590<br>( 486)            | 千スイスフラン<br>3,566<br>( 28)       | 2,094<br>( ー)          | 千スイスフラン<br>11,158<br>( 344)     |
|     | スウェーデン  | 806<br>( 214)            | 千スウェーデンクローネ<br>10,013<br>( 194) | 2,836<br>( ー)          | 千スウェーデンクローネ<br>31,944<br>( 194) |
|     | ノルウェー   | 207                      | 千ノルウェークローネ<br>2,099             | 590                    | 千ノルウェークローネ<br>5,506             |
|     | デンマーク   | 118<br>( 75)             | 千デンマーククローネ<br>4,432<br>( ー)     | 416                    | 千デンマーククローネ<br>12,873            |

|     |          | 買 付                   |                           | 売 付                 |                             |
|-----|----------|-----------------------|---------------------------|---------------------|-----------------------------|
|     |          | 株 数                   | 金 額                       | 株 数                 | 金 額                         |
| 外 国 | オーストラリア  | 百株<br>1,108<br>( 531) | 千豪ドル<br>1,536<br>( 101)   | 百株<br>5,838<br>( ー) | 千豪ドル<br>7,832<br>( 101)     |
|     | ニュージーランド | —                     | 千ニュージーランドドル<br>—          | 1,065               | 千ニュージーランドドル<br>469          |
|     | 香港       | 2,888<br>( 265)       | 千香港ドル<br>9,917<br>( ー)    | 7,014               | 千香港ドル<br>27,375             |
|     | シンガポール   | 1,170<br>( 3,340)     | 千シンガポールドル<br>658<br>( 58) | 13,720<br>( ー)      | 千シンガポールドル<br>2,290<br>( 58) |
|     | イスラエル    | —                     | 千イスラエルシェケル<br>—           | 443                 | 千イスラエルシェケル<br>686           |

(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             | 1          | 121          | 4         | 478          |
|     | AVALONBAY COMMUNITIES INC       | 0.455      | 79           | 2         | 371          |
|     | BOSTON PROPERTIES INC           | 0.685      | 81           | 2         | 304          |
|     | CROWN CASTLE INTL CORP          | 1          | 138          | 4         | 397          |
|     | DIGITAL REALTY TRUST INC        | 0.871      | 71           | 1         | 152          |
|     | DUKE REALTY CORP                | —          | —            | 3         | 102          |
|     | EQUINIX INC                     | —<br>( 2)  | —<br>( 770)  | 0.313     | 114          |
|     | EQUITY RESIDENTIAL              | 1          | 85           | 5         | 379          |
|     | EXTRA SPACE STORAGE INC         | 2          | 261          | 0.405     | 34           |
|     | FEDERAL REALTY INVS TRUST       | 0.251      | 40           | 0.744     | 112          |
|     | FOUR CORNERS PROPERTY TRUST     | —<br>( 1)  | —<br>( 35)   | —<br>( 1) | —<br>( 35)   |
|     | HCP INC                         | 1          | 52           | 3<br>( ー) | 131<br>( 36) |
|     | HOST HOTELS & RESORTS INC       | 4          | 81           | 13        | 209          |
|     | IRON MOUNTAIN INC               | 0.658      | 25           | 1         | 50           |
|     | KIMCO REALTY CORP               | —          | —            | 4         | 119          |
|     | LIBERTY PROPERTY TRUST          | —          | —            | 1         | 74           |
|     | PLUM CREEK TIMBER CO INC (REIT) | —<br>(△ 7) | —<br>(△ 340) | 0.338     | 16           |
|     | PROLOGIS INC                    | 3          | 151          | 7         | 323          |
|     | PUBLIC STORAGE                  | 0.445      | 111          | 1         | 429          |

| 銘 柄 | 買 付                                 |       | 売 付    |        |
|-----|-------------------------------------|-------|--------|--------|
|     | 口 数                                 | 金 額   | 口 数    | 金 額    |
| 外 国 | アメリカ                                | 千口    | 千口     | 千米ドル   |
|     | REALTY INCOME CORP                  | 0.365 | 21     | 120    |
|     | REGENCY CENTERS CORP                | —     | —      | 0.837  |
|     | SL GREEN REALTY CORP                | 0.405 | 38     | 129    |
|     | SIMON PROPERTY GROUP INC            | 0.803 | 160    | 621    |
|     | UDR INC                             | 3     | 142    | 69     |
|     | VENTAS INC                          | 2     | 154    | 279    |
|     | VORNADO REALTY TRUST                | 0.642 | 58     | 238    |
|     | WELLTOWER INC                       | 1     | 121    | 341    |
|     | WEYERHAEUSER CO                     | 2     | 60     | 463    |
|     |                                     | ( 11) | ( 340) |        |
|     | 小 計                                 | 33    | 2,062  | 6,131  |
|     |                                     | ( 8)  | ( 805) | ( 71)  |
|     | カナダ                                 |       | 千カナダドル | 千カナダドル |
|     | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | —     | —      | 1      |
|     | 小 計                                 | —     | —      | 1      |
|     | ユーロ                                 |       | 千ユーロ   | 千ユーロ   |
|     | フランス                                |       |        |        |
|     | KLEPIERRE                           | —     | —      | 2      |
|     | GECINA SA                           | 0.109 | 12     | 0.199  |
|     | FONCIERE DES REGIONS                | —     | —      | 0.267  |
|     |                                     |       | ( —)   | ( 2)   |
|     | UNIBAIL-RODAMCO SE                  | 0.233 | 53     | 1      |
|     | 小 計                                 | 0.342 | 65     | 4      |
|     |                                     |       | ( —)   | ( 2)   |
|     | ユ ー ロ 計                             | 0.342 | 65     | 4      |
|     |                                     |       | ( —)   | ( 2)   |
|     | イギリス                                |       | 千英ポンド  | 千英ポンド  |
|     | BRITISH LAND CO PLC                 | 16    | 99     | 26     |
|     | HAMMERSON PLC                       | 4     | 24     | 15     |
|     | INTU PROPERTIES PLC                 | 3     | 10     | 16     |
|     | LAND SECURITIES GROUP PLC           | 4     | 47     | 13     |
|     | SEGRO PLC                           | 4     | 18     | 15     |
|     | 小 計                                 | 33    | 200    | 88     |
|     | オーストラリア                             |       | 千豪ドル   | 千豪ドル   |
|     | MIRVAC GROUP                        | —     | —      | 58     |
|     | GPT GROUP                           | —     | —      | 25     |
|     | STOCKLAND                           | —     | —      | 35     |
|     | GOODMAN GROUP                       | —     | —      | 20     |
|     | SCENTRE GROUP                       | 32    | 141    | 52     |
|     | WESTFIELD CORP                      | —     | —      | 17     |
|     | VICINITY CENTRES                    | 20    | 58     | 19     |
|     | 小 計                                 | 52    | 199    | 228    |
|     |                                     |       |        | 1,005  |

| 銘 柄 |                                       | 買 付   |             | 売 付   |           |
|-----|---------------------------------------|-------|-------------|-------|-----------|
|     |                                       | 口 数   | 金 額         | 口 数   | 金 額       |
| 外 国 | 香港                                    | 千口    | 千香港ドル       | 千口    | 千香港ドル     |
|     | LINK REIT                             | 10    | 436         | 19    | 1,054     |
|     | 小 計                                   | 10    | 436         | 19    | 1,054     |
|     | 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                 | —     | —           | 10    | 19        |
|     | ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | —     | —           | 26    | 62        |
|     |                                       | ( — ) | ( 0.00118 ) | ( — ) | (0.2575)  |
|     | 小 計                                   | —     | —           | 36    | 82        |
|     |                                       | ( — ) | ( 0.00118 ) | ( — ) | (0.2575)  |

(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<br>39,174 | 百万円<br>38,378 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

(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 (2015年11月11日～2016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       | 44,567,525千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額   | 88,045,504千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.50         |

(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 (2015年11月11日～2016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

(2016年11月10日現在)

## 外国株式

| 銘柄                           | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |        | 業 種 等     |                        |
|------------------------------|---|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
|                              |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額  |           |                        |
|                              |   |         |       | 外貨建金額  |           | 邦貨換算金額                 |
| (アメリカ)                       |   | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| ADT CORPORATION              |   | 85      | —     | —      | —         | 商業・専門サービス              |
| AFLAC INC                    |   | 124     | 88    | 637    | 67,304    | 保険                     |
| AGCO CORP                    |   | 46      | 32    | 168    | 17,808    | 資本財                    |
| AES CORPORATION              |   | 312     | 238   | 286    | 30,253    | 公益事業                   |
| AT&T INC                     |   | 1,840   | 1,455 | 5,448  | 575,536   | 電気通信サービス               |
| ABBOTT LABORATORIES          |   | 438     | 340   | 1,365  | 144,280   | ヘルスケア機器・サービス           |
| ABBVIE INC                   |   | 527     | 379   | 2,374  | 250,798   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ACTIVISION BLIZZARD INC      |   | 179     | 160   | 644    | 68,039    | ソフトウェア・サービス            |
| ACUITY BRANDS INC            |   | 17      | 14    | 348    | 36,782    | 資本財                    |
| ADOBE SYSTEMS INC            |   | 164     | 125   | 1,357  | 143,441   | ソフトウェア・サービス            |
| ADVANCE AUTO PARTS           |   | 27      | 21    | 302    | 31,973    | 小売                     |
| AETNA INC                    |   | 116     | 83    | 982    | 103,833   | ヘルスケア機器・サービス           |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP    |   | 22      | 19    | 276    | 29,211    | 各種金融                   |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC     |   | 132     | 88    | 406    | 42,911    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC |   | 64      | 44    | 610    | 64,515    | 素材                     |
| AKAMAI TECHNOLOGIES          |   | 70      | 50    | 337    | 35,671    | ソフトウェア・サービス            |
| ALCOA INC                    |   | 517     | —     | —      | —         | 素材                     |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC  |   | 71      | 57    | 729    | 77,045    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ALLEGHANY CORP               |   | 2       | 5     | 294    | 31,134    | 保険                     |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP   |   | 21      | 18    | 381    | 40,294    | ソフトウェア・サービス            |
| ALLSTATE CORP                |   | 130     | 83    | 570    | 60,270    | 保険                     |
| ALPHABET INC-CL C            |   | 92      | 71    | 5,607  | 592,362   | ソフトウェア・サービス            |
| ALPHABET INC-CL A            |   | 88      | 70    | 5,640  | 595,831   | ソフトウェア・サービス            |
| ALTERA CORPORATION           |   | 85      | —     | —      | —         | 半導体・半導体製造装置            |
| ALTRIA GROUP INC             |   | 600     | 460   | 2,946  | 311,277   | 食品・飲料・タバコ              |
| AMAZON.COM INC               |   | 121     | 95    | 7,339  | 775,303   | 小売                     |
| AMEREN CORPORATION           |   | 98      | 75    | 370    | 39,086    | 公益事業                   |
| AMERICAN ELECTRIC POWER      |   | 151     | 119   | 733    | 77,431    | 公益事業                   |
| AMERICAN EXPRESS COMPANY     |   | 285     | 197   | 1,360  | 143,760   | 各種金融                   |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP |   | 412     | 265   | 1,619  | 171,018   | 保険                     |
| AMERISOURCEBERGEN CORP       |   | 64      | 47    | 357    | 37,753    | ヘルスケア機器・サービス           |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC     |   | 60      | 49    | 500    | 52,912    | 各種金融                   |
| AMGEN INC                    |   | 231     | 173   | 2,545  | 268,897   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| AMPHENOL CORP-CL A           |   | 115     | 86    | 581    | 61,395    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| ANADARKO PETROLEUM CORP      |   | 153     | 143   | 875    | 92,505    | エネルギー                  |
| ANALOG DEVICES               |   | 102     | 55    | 358    | 37,855    | 半導体・半導体製造装置            |
| ANSYS INC                    |   | 22      | 31    | 276    | 29,241    | ソフトウェア・サービス            |
| ANTHEM INC                   |   | 86      | 63    | 819    | 86,549    | ヘルスケア機器・サービス           |
| APACHE CORP                  |   | 132     | 94    | 545    | 57,633    | エネルギー                  |
| APPLE INC                    |   | 1,755   | 1,292 | 14,325 | 1,513,223 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| APPLIED MATERIALS INC        |   | 320     | 269   | 784    | 82,820    | 半導体・半導体製造装置            |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO    |   | 174     | 140   | 650    | 68,718    | 食品・飲料・タバコ              |
| ARCONIC INC                  |   | —       | 130   | 228    | 24,179    | 資本財                    |
| ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC  |   | —       | 23    | 251    | 26,523    | 素材                     |
| AUTODESK INC                 |   | 92      | 62    | 450    | 47,581    | ソフトウェア・サービス            |
| AUTOLIV INC                  |   | 35      | 28    | 267    | 28,226    | 自動車・自動車部品              |

| 銘柄                           | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       |         | 業 種 等                  |
|------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                              |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |
|                              |   |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                        |
| (アメリカ)                       |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                        |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING    |   | 132     | 105   | 956   | 101,000 | ソフトウェア・サービス            |
| AUTOZONE INC                 |   | 11      | 7     | 573   | 60,570  | 小売                     |
| AVERY DENNISON CORP          |   | 47      | 33    | 238   | 25,198  | 素材                     |
| BB&T CORPORATION             |   | 269     | 202   | 823   | 86,933  | 銀行                     |
| BAKER HUGHES INC             |   | 132     | 103   | 610   | 64,465  | エネルギー                  |
| BALL CORP                    |   | 57      | 51    | 403   | 42,644  | 素材                     |
| BANK OF AMERICA CORP         |   | 3,249   | 2,463 | 4,427 | 467,625 | 銀行                     |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP |   | 366     | 270   | 1,232 | 130,154 | 各種金融                   |
| BARD (C.R.) INC              |   | 27      | 20    | 440   | 46,556  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BAXALTA INC                  |   | 169     | —     | —     | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BAXTER INTL INC              |   | 160     | 124   | 579   | 61,194  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BECTON DICKINSON & CO        |   | 59      | 54    | 947   | 100,099 | ヘルスケア機器・サービス           |
| BED BATH & BEYOND INC        |   | 70      | 62    | 257   | 27,221  | 小売                     |
| WR BERKLEY CORP              |   | 50      | 39    | 225   | 23,771  | 保険                     |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B  |   | 352     | 281   | 4,264 | 450,467 | 各種金融                   |
| BEST BUY COMPANY INC         |   | 123     | 80    | 310   | 32,827  | 小売                     |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC  |   | 57      | 49    | 452   | 47,753  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BIOGEN INC                   |   | 73      | 52    | 1,677 | 177,211 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BLACKROCK INC                |   | 37      | 28    | 1,036 | 109,437 | 各種金融                   |
| H&R BLOCK INC                |   | 101     | 94    | 200   | 21,149  | 消費者サービス                |
| BOEING CO                    |   | 200     | 141   | 2,051 | 216,676 | 資本財                    |
| BORGWARNER INC               |   | 93      | 77    | 265   | 27,998  | 自動車・自動車部品              |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP       |   | 454     | 356   | 778   | 82,243  | ヘルスケア機器・サービス           |
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO      |   | 519     | 397   | 2,237 | 236,344 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| BROADCOM CORP CL A           |   | 156     | —     | —     | —       | 半導体・半導体製造装置            |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B    |   | 43      | 63    | 291   | 30,741  | 食品・飲料・タバコ              |
| CBS CORP CL-B                |   | 164     | 113   | 651   | 68,804  | メディア                   |
| CDK GLOBAL INC               |   | 52      | 48    | 274   | 28,956  | ソフトウェア・サービス            |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC   |   | 91      | 85    | 225   | 23,808  | 素材                     |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC  |   | 59      | 42    | 304   | 32,181  | 運輸                     |
| CIGNA CORP                   |   | 86      | 64    | 870   | 91,991  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CIT GROUP INC                |   | 42      | 73    | 278   | 29,373  | 銀行                     |
| CME GROUP INC                |   | 104     | 85    | 959   | 101,340 | 各種金融                   |
| CMS ENERGY CORP              |   | 62      | 88    | 355   | 37,540  | 公益事業                   |
| CSX CORP                     |   | 321     | 233   | 789   | 83,420  | 運輸                     |
| CVS HEALTH CORPORATION       |   | 341     | 252   | 1,933 | 204,213 | 食品・生活必需品小売り            |
| CA INC                       |   | 115     | 97    | 310   | 32,749  | ソフトウェア・サービス            |
| CABOT OIL & GAS CORP         |   | 155     | 153   | 336   | 35,520  | エネルギー                  |
| CAMERON INTERNATIONAL CORP   |   | 62      | —     | —     | —       | エネルギー                  |
| CAMPBELL SOUP CO             |   | 76      | 64    | 354   | 37,456  | 食品・飲料・タバコ              |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP   |   | 173     | 128   | 979   | 103,468 | 各種金融                   |
| CARDINAL HEALTH INC          |   | 92      | 72    | 499   | 52,718  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CARMAX INC                   |   | 80      | 65    | 332   | 35,113  | 小売                     |
| CARNIVAL CORP                |   | 149     | 104   | 516   | 54,605  | 消費者サービス                |
| CATERPILLAR INC              |   | 181     | 142   | 1,302 | 137,546 | 資本財                    |
| CELANESE CORP-SERIES A       |   | 62      | 43    | 329   | 34,761  | 素材                     |
| CELGENE CORP                 |   | 249     | 187   | 2,252 | 237,983 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| CENTERPOINT ENERGY INC       |   | 189     | 135   | 315   | 33,308  | 公益事業                   |
| CENTURYLINK INC.             |   | 206     | 138   | 336   | 35,574  | 電気通信サービス               |
| CERNER CORP                  |   | 99      | 77    | 396   | 41,833  | ヘルスケア機器・サービス           |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A |   | —       | 53    | 1,447 | 152,885 | メディア                   |
| CHEVRONTXACO CORP            |   | 571     | 444   | 4,786 | 505,567 | エネルギー                  |

| 銘柄                           | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       | 業 種 等   |                    |
|------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|--------------------|
|                              |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                    |
|                              |   |         |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額             |
| (アメリカ)                       |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                    |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A  |   | 10      | 9     | 353   | 37,314  | 消費者サービス            |
| CHUBB CORP                   |   | 64      | —     | —     | —       | 保険                 |
| CIMAREX ENERGY CO            |   | 38      | 29    | 372   | 39,381  | エネルギー              |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP    |   | 66      | 51    | 359   | 37,924  | 保険                 |
| CISCO SYSTEMS INC            |   | 1,580   | 1,209 | 3,793 | 400,666 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| CINTAS CORP                  |   | 41      | 29    | 313   | 33,131  | 商業・専門サービス          |
| CITIGROUP INC                |   | 940     | 707   | 3,647 | 385,330 | 銀行                 |
| CITRIX SYSTEMS INC           |   | 62      | 48    | 415   | 43,851  | ソフトウェア・サービス        |
| CLOROX COMPANY               |   | 50      | 35    | 403   | 42,593  | 家庭用品・パーソナル用品       |
| COACH INC                    |   | 108     | 78    | 287   | 30,326  | 耐久消費財・アパレル         |
| COCA-COLA COMPANY            |   | 1,200   | 906   | 3,832 | 404,786 | 食品・飲料・タバコ          |
| COCA-COLA ENTERPRISES        |   | 91      | —     | —     | —       | 食品・飲料・タバコ          |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A   |   | 196     | 152   | 806   | 85,161  | ソフトウェア・サービス        |
| COLGATE-PALMOLIVE CO         |   | 252     | 199   | 1,405 | 148,418 | 家庭用品・パーソナル用品       |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP      |   | 127     | —     | —     | —       | エネルギー              |
| COMCAST CORP-CL A            |   | 646     | 577   | 3,662 | 386,912 | メディア               |
| COMCAST CORP-SPECIAL CL A    |   | 140     | —     | —     | —       | メディア               |
| COMERICA INC                 |   | 81      | 60    | 332   | 35,122  | 銀行                 |
| COMPUTER SCIENCES CORP       |   | 59      | —     | —     | —       | ソフトウェア・サービス        |
| CONAGRA FOODS INC            |   | 140     | 94    | 453   | 47,910  | 食品・飲料・タバコ          |
| CONCHO RESOURCES INC         |   | 46      | 38    | 511   | 54,069  | エネルギー              |
| CONOCOPHILLIPS               |   | 353     | 292   | 1,338 | 141,358 | エネルギー              |
| CONSOLIDATED EDISON INC      |   | 87      | 79    | 571   | 60,345  | 公益事業               |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A   |   | 61      | 44    | 690   | 72,947  | 食品・飲料・タバコ          |
| COOPER COS INC/THE           |   | 11      | 16    | 300   | 31,774  | ヘルスケア機器・サービス       |
| CORE LABORATORIES N.V.       |   | —       | 17    | 173   | 18,331  | エネルギー              |
| CORNING INC                  |   | 415     | 293   | 680   | 71,836  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| COSTCO WHOLESALE CORP        |   | 132     | 99    | 1,467 | 154,992 | 食品・生活必需品小売り        |
| COTY INC-CL A                |   | —       | 60    | 119   | 12,619  | 家庭用品・パーソナル用品       |
| CUMMINS INC                  |   | 49      | 40    | 552   | 58,327  | 資本財                |
| DR HORTON INC                |   | 136     | 111   | 308   | 32,552  | 耐久消費財・アパレル         |
| DTE ENERGY COMPANY           |   | 66      | 48    | 444   | 46,989  | 公益事業               |
| DANAHER CORP                 |   | 197     | 142   | 1,142 | 120,671 | ヘルスケア機器・サービス       |
| DARDEN RESTAURANTS INC       |   | 52      | 43    | 299   | 31,649  | 消費者サービス            |
| DAVITA INC                   |   | 55      | 55    | 330   | 34,869  | ヘルスケア機器・サービス       |
| DEERE & CO                   |   | 103     | 63    | 574   | 60,717  | 資本財                |
| DELL TECHNOLOGIES INC-CL V   |   | —       | 57    | 282   | 29,866  | ソフトウェア・サービス        |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC   |   | 61      | —     | —     | —       | ヘルスケア機器・サービス       |
| DENTSPLY SIRONA INC          |   | —       | 70    | 428   | 45,263  | ヘルスケア機器・サービス       |
| DEVON ENERGY CORPORATION     |   | 130     | 131   | 575   | 60,755  | エネルギー              |
| THE WALT DISNEY CO           |   | 498     | 362   | 3,427 | 362,034 | メディア               |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES  |   | 143     | 109   | 658   | 69,594  | 各種金融               |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-A   |   | 87      | 72    | 186   | 19,730  | メディア               |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C   |   | 120     | 78    | 196   | 20,785  | メディア               |
| DISH NETWORK CORPORATION     |   | 86      | 70    | 411   | 43,439  | メディア               |
| EVEREST RE GROUP LTD         |   | 19      | 14    | 310   | 32,783  | 保険                 |
| Dollar General Corp          |   | 97      | 71    | 514   | 54,317  | 小売                 |
| DOLLAR TREE INC              |   | 82      | 61    | 468   | 49,501  | 小売                 |
| DOMINION RESOURCES INC/VA    |   | 173     | 147   | 1,079 | 114,033 | 公益事業               |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD |   | 229     | 150   | 191   | 20,240  | 半導体・半導体製造装置        |
| DOVER CORP                   |   | 66      | 51    | 360   | 38,119  | 資本財                |
| DOW CHEMICAL                 |   | 354     | 257   | 1,386 | 146,473 | 素材                 |

| 銘柄                                     | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       | 業 種 等   |                    |
|----------------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|--------------------|
|                                        |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                    |
|                                        |   |         |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額             |
| (アメリカ)                                 |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                    |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I            |   | 65      | 41    | 358   | 37,913  | 食品・飲料・タバコ          |
| DU PONT (E.I.) DE NEMOURS              |   | 277     | 205   | 1,443 | 152,460 | 素材                 |
| DUKE ENERGY CORP                       |   | 206     | 163   | 1,262 | 133,325 | 公益事業               |
| DUN & BRADSTREET CORP                  |   | 21      | 16    | 194   | 20,573  | 商業・専門サービス          |
| EMC CORP/MASS                          |   | 628     | —     | —     | —       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| EOG RESOURCES INC                      |   | 163     | 132   | 1,238 | 130,853 | エネルギー              |
| EQT CORPORATION                        |   | 57      | 50    | 328   | 34,725  | エネルギー              |
| E*TRADE FINANCIAL CORP                 |   | 81      | 102   | 307   | 32,511  | 各種金融               |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD                 |   | 30      | 41    | 325   | 34,409  | 保険                 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY               |   | 61      | 47    | 352   | 37,222  | 素材                 |
| EBAY INC                               |   | 357     | 273   | 774   | 81,827  | ソフトウェア・サービス        |
| ECOLAB INC                             |   | 88      | 56    | 644   | 68,077  | 素材                 |
| BUNGE LIMITED                          |   | 57      | 39    | 269   | 28,463  | 食品・飲料・タバコ          |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO              |   | 29      | 27    | 203   | 21,493  | 家庭用品・パーソナル用品       |
| EDISON INTERNATIONAL                   |   | 102     | 85    | 601   | 63,491  | 公益事業               |
| Edwards Lifesciences Corp              |   | 39      | 56    | 523   | 55,282  | ヘルスケア機器・サービス       |
| ELECTRONIC ARTS INC                    |   | 110     | 78    | 621   | 65,678  | ソフトウェア・サービス        |
| EMERSON ELECTRIC CO                    |   | 191     | 142   | 761   | 80,420  | 資本財                |
| ENERGEN CORP                           |   | 41      | —     | —     | —       | エネルギー              |
| ENTERGY CORP                           |   | 66      | 55    | 382   | 40,377  | 公益事業               |
| EQUIFAX INC                            |   | 48      | 31    | 385   | 40,679  | 商業・専門サービス          |
| NABORS INDUSTRIES LTD                  |   | 177     | —     | —     | —       | エネルギー              |
| EVERSOURCE ENERGY                      |   | 111     | 78    | 417   | 44,093  | 公益事業               |
| EXELON CORP                            |   | 274     | 225   | 721   | 76,236  | 公益事業               |
| EXPEDIA INC                            |   | 38      | 32    | 403   | 42,655  | 小売                 |
| EXPEDITORS INTL WASH INC               |   | 79      | 55    | 276   | 29,190  | 運輸                 |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO             |   | 221     | 153   | 1,144 | 120,886 | ヘルスケア機器・サービス       |
| EXXON MOBIL CORPORATION                |   | 1,258   | 970   | 8,374 | 884,610 | エネルギー              |
| FMC TECHNOLOGIES INC                   |   | 104     | 77    | 260   | 27,532  | エネルギー              |
| FACEBOOK INC-A                         |   | 640     | 548   | 6,760 | 714,071 | ソフトウェア・サービス        |
| FASTENAL CO                            |   | 116     | 82    | 359   | 37,921  | 資本財                |
| FEDEX CORP                             |   | 84      | 60    | 1,093 | 115,549 | 運輸                 |
| F5 NETWORKS INC                        |   | 31      | 22    | 314   | 33,254  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES |   | 92      | 84    | 652   | 68,923  | ソフトウェア・サービス        |
| FNF GROUP                              |   | 110     | 84    | 282   | 29,797  | 保険                 |
| FIFTH THIRD BANCORP                    |   | 305     | 223   | 512   | 54,103  | 銀行                 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA                 |   | 60      | 46    | 366   | 38,686  | 銀行                 |
| FISERV INC                             |   | 83      | 61    | 618   | 65,325  | ソフトウェア・サービス        |
| FIRSTENERGY CORP                       |   | 157     | 126   | 424   | 44,877  | 公益事業               |
| FLUOR CORP                             |   | 70      | 51    | 254   | 26,891  | 資本財                |
| FLOWSERVE CORP                         |   | 67      | 52    | 231   | 24,449  | 資本財                |
| FOOT LOCKER INC                        |   | 57      | 39    | 276   | 29,202  | 小売                 |
| FORD MOTOR CO                          |   | 1,147   | 844   | 978   | 103,355 | 自動車・自動車部品          |
| FORTIVE CORP                           |   | —       | 65    | 351   | 37,095  | 資本財                |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI           |   | 26      | 53    | 294   | 31,120  | 資本財                |
| FRANKLIN RESOURCES INC                 |   | 118     | 118   | 457   | 48,320  | 各種金融               |
| FREEMPORT-MCMORAN INC                  |   | 384     | 354   | 463   | 48,948  | 素材                 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO                |   | 41      | 62    | 313   | 33,122  | 保険                 |
| GAMESTOP CORP-CLASS A                  |   | 53      | —     | —     | —       | 小売                 |
| GAP INC                                |   | 86      | 76    | 210   | 22,241  | 小売                 |
| GARTNER INC                            |   | 13      | 30    | 304   | 32,201  | ソフトウェア・サービス        |
| GENERAL DYNAMICS CORP                  |   | 87      | 55    | 900   | 95,144  | 資本財                |

| 銘柄                            | 柄 | 期首(前期末) |       | 当 期 末 |         | 業 種 等                  |
|-------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                               |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |
|                               |   |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                        |
| (アメリカ)                        |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                        |
| GENERAL ELECTRIC CO           |   | 3,088   | 2,128 | 6,307 | 666,219 | 資本財                    |
| GENERAL MILS INC              |   | 169     | 132   | 831   | 87,817  | 食品・飲料・タバコ              |
| GENERAL MOTORS CO             |   | 446     | 317   | 983   | 103,913 | 自動車・自動車部品              |
| GENUINE PARTS CO              |   | 42      | 37    | 337   | 35,616  | 小売                     |
| GILEAD SCIENCES INC           |   | 446     | 308   | 2,419 | 255,559 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC       |   | 123     | 92    | 1,788 | 188,946 | 各種金融                   |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO     |   | 68      | 95    | 268   | 28,328  | 自動車・自動車部品              |
| WR GRACE & CO                 |   | —       | 31    | 218   | 23,055  | 素材                     |
| WW GRAINGER INC               |   | 19      | 18    | 399   | 42,158  | 資本財                    |
| HCA HOLDINGS INC              |   | 112     | 83    | 603   | 63,714  | ヘルスケア機器・サービス           |
| HP INC                        |   | 573     | 469   | 730   | 77,215  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HALLIBURTON CO                |   | 261     | 214   | 1,027 | 108,555 | エネルギー                  |
| HARLEY-DAVIDSON INC           |   | 85      | 55    | 323   | 34,186  | 自動車・自動車部品              |
| HARMAN INTERNATIONAL          |   | 28      | 28    | 243   | 25,678  | 耐久消費財・アパレル             |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP   |   | 151     | 97    | 444   | 47,004  | 保険                     |
| HASBRO INC                    |   | 48      | 31    | 266   | 28,147  | 耐久消費財・アパレル             |
| HELMERICH & PAYNE             |   | 51      | 35    | 227   | 24,015  | エネルギー                  |
| HERSHEY CO/THE                |   | 48      | 35    | 355   | 37,522  | 食品・飲料・タバコ              |
| HESS CORP                     |   | 87      | 81    | 399   | 42,147  | エネルギー                  |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE    |   | 573     | 440   | 1,023 | 108,111 | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| HOLLYFRONTIER CORP            |   | 81      | 75    | 197   | 20,827  | エネルギー                  |
| HOME DEPOT INC                |   | 395     | 287   | 3,625 | 383,011 | 小売                     |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC   |   | 224     | 163   | 1,842 | 194,609 | 資本財                    |
| HORMEL FOODS CORP             |   | 60      | 94    | 348   | 36,825  | 食品・飲料・タバコ              |
| HUMANA INC                    |   | 48      | 36    | 672   | 71,004  | ヘルスケア機器・サービス           |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC   |   | 36      | 33    | 291   | 30,838  | 運輸                     |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC     |   | 296     | 326   | 355   | 37,578  | 銀行                     |
| IHS INC                       |   | 16      | —     | —     | —       | 商業・専門サービス              |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC       |   | 100     | 79    | 965   | 101,979 | 資本財                    |
| ILLUMINA INC                  |   | 49      | 39    | 527   | 55,757  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INCYTE CORP                   |   | 57      | 47    | 499   | 52,719  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INTEL CORP                    |   | 1,419   | 1,085 | 3,772 | 398,448 | 半導体・半導体製造装置            |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC |   | 37      | 152   | 875   | 92,457  | 各種金融                   |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP   |   | 277     | 212   | 3,291 | 347,655 | ソフトウェア・サービス            |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES     |   | 35      | 25    | 320   | 33,814  | 素材                     |
| INTERNATIONAL PAPER CO        |   | 128     | 98    | 449   | 47,472  | 素材                     |
| INTERPUBLIC GROUP COS INC     |   | 174     | 135   | 297   | 31,464  | メディア                   |
| INTUIT INC                    |   | 82      | 58    | 642   | 67,877  | ソフトウェア・サービス            |
| INTUITIVE SURGICAL INC        |   | 11      | 9     | 640   | 67,643  | ヘルスケア機器・サービス           |
| JPMORGAN CHASE & CO           |   | 1,142   | 858   | 6,290 | 664,441 | 銀行                     |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC  |   | 68      | 47    | 261   | 27,626  | 資本財                    |
| JOHNSON & JOHNSON             |   | 824     | 638   | 7,685 | 811,770 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| JOHNSON CONTROLS INC          |   | 203     | —     | —     | —       | 自動車・自動車部品              |
| JUNIPER NETWORKS INC          |   | 144     | 117   | 297   | 31,456  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| KLA-TENCOR CORPORATION        |   | 65      | 42    | 319   | 33,785  | 半導体・半導体製造装置            |
| KELLOGG CO                    |   | 63      | 61    | 458   | 48,422  | 食品・飲料・タバコ              |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC     |   | 44      | —     | —     | —       | 食品・飲料・タバコ              |
| KEYCORP                       |   | 343     | 314   | 478   | 50,533  | 銀行                     |
| KIMBERLY-CLARK CORP           |   | 109     | 85    | 985   | 104,133 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| KINDER MORGAN INC             |   | 561     | 473   | 1,009 | 106,649 | エネルギー                  |
| KOHL'S CORP                   |   | 82      | 53    | 245   | 25,932  | 小売                     |
| KRAFT HEINZ CO/THE            |   | 186     | 148   | 1,262 | 133,398 | 食品・飲料・タバコ              |

| 銘柄                                   | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |        | 業 種 等     |                        |
|--------------------------------------|---|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
|                                      |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額  |           |                        |
|                                      |   |         |       | 外貨建金額  |           | 邦貨換算金額                 |
| (アメリカ)                               |   | 百株      | 百株    | 千米ドル   | 千円        |                        |
| KROGER CO                            |   | 310     | 233   | 754    | 79,727    | 食品・生活必需品小売り            |
| L BRANDS INC                         |   | 84      | 59    | 392    | 41,438    | 小売                     |
| LKQ CORP                             |   | 81      | 103   | 333    | 35,225    | 小売                     |
| L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS          |   | 34      | 24    | 367    | 38,830    | 資本財                    |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS         |   | 40      | 31    | 382    | 40,410    | ヘルスケア機器・サービス           |
| LAM RESEARCH CORP                    |   | 62      | 42    | 411    | 43,481    | 半導体・半導体製造装置            |
| LAS VEGAS SANDS CORP                 |   | 139     | 117   | 704    | 74,411    | 消費者サービス                |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A          |   | 73      | 52    | 422    | 44,674    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| LEAR CORP                            |   | 17      | 24    | 291    | 30,754    | 自動車・自動車部品              |
| LEGGETT & PLATT INC                  |   | 68      | 54    | 254    | 26,862    | 耐久消費財・アパレル             |
| LEGG MASON INC                       |   | 55      | —     | —      | —         | 各種金融                   |
| LENNAR CORP-CL A                     |   | 61      | 66    | 272    | 28,744    | 耐久消費財・アパレル             |
| LEUCADIA NATIONAL CORP               |   | 156     | 130   | 256    | 27,047    | 各種金融                   |
| LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A |   | 168     | 147   | 298    | 31,516    | 小売                     |
| ELI LILLY & CO                       |   | 317     | 232   | 1,824  | 192,691   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| LINCOLN NATIONAL CORP                |   | 98      | 74    | 427    | 45,105    | 保険                     |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP               |   | 97      | 58    | 350    | 37,014    | 半導体・半導体製造装置            |
| LinkedIn Corp                        |   | 36      | 29    | 560    | 59,197    | ソフトウェア・サービス            |
| LOCKHEED MARTIN CORP                 |   | 82      | 63    | 1,603  | 169,339   | 資本財                    |
| LOEWS CORP                           |   | 123     | 91    | 396    | 41,914    | 保険                     |
| LOWE'S COMPANIES                     |   | 293     | 206   | 1,401  | 147,990   | 小売                     |
| LULULEMON ATHLETICA INC              |   | 42      | 41    | 241    | 25,473    | 耐久消費財・アパレル             |
| M & T BANK CORP                      |   | 45      | 35    | 460    | 48,672    | 銀行                     |
| MDU RESOURCES GROUP INC              |   | 115     | —     | —      | —         | 公益事業                   |
| MACY'S INC                           |   | 102     | 81    | 314    | 33,223    | 小売                     |
| MANPOWERGROUP                        |   | 37      | 26    | 210    | 22,263    | 商業・専門サービス              |
| MARATHON OIL CORP                    |   | 273     | 247   | 367    | 38,866    | エネルギー                  |
| MARATHON PETROLEUM CORP              |   | 176     | 133   | 582    | 61,518    | エネルギー                  |
| MARSH & MCLENNAN COS                 |   | 171     | 131   | 876    | 92,629    | 保険                     |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A          |   | 82      | 90    | 671    | 70,965    | 消費者サービス                |
| MASCO CORP                           |   | 146     | 107   | 333    | 35,271    | 資本財                    |
| MASTERCARD INC-CLASS A               |   | 307     | 235   | 2,503  | 264,392   | ソフトウェア・サービス            |
| MATTEL INC                           |   | 141     | 90    | 284    | 30,063    | 耐久消費財・アパレル             |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS            |   | 115     | 72    | 285    | 30,115    | 半導体・半導体製造装置            |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS          |   | 50      | 37    | 358    | 37,911    | 食品・飲料・タバコ              |
| MCDONALD'S CORP                      |   | 298     | 214   | 2,461  | 259,983   | 消費者サービス                |
| MCGRW HILL FINANCIAL INC             |   | 94      | —     | —      | —         | 各種金融                   |
| MCKESSON CORP                        |   | 70      | 54    | 770    | 81,413    | ヘルスケア機器・サービス           |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO            |   | 63      | 46    | 346    | 36,646    | 食品・飲料・タバコ              |
| MEDIVATION INC                       |   | 66      | —     | —      | —         | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MERCK & CO. INC.                     |   | 852     | 648   | 4,160  | 439,524   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| METLIFE INC                          |   | 291     | 228   | 1,171  | 123,728   | 保険                     |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC     |   | 8       | 8     | 371    | 39,197    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| MICROSOFT CORP                       |   | 2,327   | 1,750 | 10,532 | 1,112,524 | ソフトウェア・サービス            |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC             |   | 87      | 65    | 421    | 44,542    | 半導体・半導体製造装置            |
| MICRON TECHNOLOGY INC                |   | 349     | 274   | 471    | 49,853    | 半導体・半導体製造装置            |
| MOHAWK INDUSTRIES INC                |   | 24      | 19    | 387    | 40,882    | 耐久消費財・アパレル             |
| MOLSON COORS BREWING CO -B           |   | 53      | 46    | 479    | 50,613    | 食品・飲料・タバコ              |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC           |   | 506     | 367   | 1,618  | 170,944   | 食品・飲料・タバコ              |
| MONSANTO CO                          |   | 145     | 103   | 1,022  | 107,990   | 素材                     |
| MONSTER BEVERAGE CORP                |   | 49      | 34    | 452    | 47,814    | 食品・飲料・タバコ              |
| MOODY'S CORP                         |   | 65      | 50    | 512    | 54,083    | 各種金融                   |

| 銘柄                           | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       | 業 種 等   |                        |
|------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                              |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |
|                              |   |         |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額                 |
| (アメリカ)                       |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                        |
| MORGAN STANLEY               |   | 487     | 368   | 1,345 | 142,168 | 各種金融                   |
| MOSAIC CO/THE                |   | 115     | 103   | 275   | 29,148  | 素材                     |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC       |   | 64      | 48    | 386   | 40,793  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| MURPHY OIL CORP              |   | 83      | 72    | 201   | 21,289  | エネルギー                  |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC   |   | 105     | 104   | 344   | 36,388  | エネルギー                  |
| NETAPP INC                   |   | 128     | 98    | 327   | 34,641  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NETFLIX INC                  |   | 130     | 104   | 1,281 | 135,316 | 小売                     |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP   |   | 194     | 186   | 275   | 29,132  | 銀行                     |
| NEWELL BRANDS INC            |   | 110     | 111   | 553   | 58,422  | 耐久消費財・アパレル             |
| NEWMONT MINING CORP          |   | 158     | 125   | 464   | 49,035  | 素材                     |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I       |   | 192     | 162   | 195   | 20,622  | メディア                   |
| NEXTERA ENERGY INC           |   | 131     | 115   | 1,358 | 143,489 | 公益事業                   |
| NIKE INC -CL B               |   | 215     | 312   | 1,598 | 168,900 | 耐久消費財・アパレル             |
| NOBLE ENERGY INC             |   | 133     | 110   | 413   | 43,705  | エネルギー                  |
| NORDSTROM INC                |   | 60      | 44    | 233   | 24,612  | 小売                     |
| NORFOLK SOUTHERN CORP        |   | 97      | 70    | 700   | 73,982  | 運輸                     |
| NORTHERN TRUST CORP          |   | 82      | 55    | 430   | 45,514  | 各種金融                   |
| NORTHROP GRUMMAN CORP        |   | 61      | 42    | 1,033 | 109,184 | 資本財                    |
| NUCOR CORP                   |   | 96      | 92    | 535   | 56,530  | 素材                     |
| NVIDIA CORP                  |   | 183     | 137   | 962   | 101,618 | 半導体・半導体製造装置            |
| OGE ENERGY CORP              |   | —       | 79    | 247   | 26,179  | 公益事業                   |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC      |   | 34      | 24    | 637   | 67,300  | 小売                     |
| OCCIDENTAL PETROLEUM CORP    |   | 238     | 175   | 1,177 | 124,358 | エネルギー                  |
| OCEANEERING INTL INC         |   | 51      | —     | —     | —       | エネルギー                  |
| OMNICOM GROUP                |   | 79      | 58    | 474   | 50,131  | メディア                   |
| ORACLE CORPORATION           |   | 1,041   | 718   | 2,840 | 300,006 | ソフトウェア・サービス            |
| P G & E CORP                 |   | 152     | 122   | 725   | 76,592  | 公益事業                   |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP |   | 169     | 120   | 1,222 | 129,142 | 銀行                     |
| PPG INDUSTRIES INC           |   | 86      | 59    | 566   | 59,819  | 素材                     |
| PPL CORPORATION              |   | 194     | 149   | 500   | 52,914  | 公益事業                   |
| PVH CORP                     |   | 35      | 26    | 284   | 30,021  | 耐久消費財・アパレル             |
| PACCAR INC                   |   | 113     | 86    | 502   | 53,043  | 資本財                    |
| PACKAGING CORP OF AMERICA    |   | —       | 35    | 288   | 30,485  | 素材                     |
| PARKER HANNIFIN CORP         |   | 51      | 33    | 446   | 47,155  | 資本財                    |
| PATTERSON COS INC            |   | 52      | 41    | 193   | 20,428  | ヘルスケア機器・サービス           |
| PAYCHEX INC                  |   | 74      | 71    | 394   | 41,628  | ソフトウェア・サービス            |
| PAYPAL HOLDINGS INC          |   | 346     | 267   | 1,102 | 116,497 | ソフトウェア・サービス            |
| PEOPLE'S UNITED FINANCIAL    |   | —       | 129   | 226   | 23,884  | 銀行                     |
| PEPCO HOLDINGS INC           |   | 118     | —     | —     | —       | 公益事業                   |
| PEPSICO INC                  |   | 422     | 319   | 3,426 | 361,978 | 食品・飲料・タバコ              |
| PFIZER INC                   |   | 1,860   | 1,400 | 4,497 | 475,112 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL  |   | 456     | 358   | 3,377 | 356,809 | 食品・飲料・タバコ              |
| PHILLIPS 66                  |   | 171     | 105   | 866   | 91,542  | エネルギー                  |
| PINNACLE WEST CAPITAL        |   | 50      | 39    | 295   | 31,179  | 公益事業                   |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO |   | 48      | 40    | 714   | 75,480  | エネルギー                  |
| POLARIS INDUSTRIES INC       |   | 28      | 21    | 177   | 18,792  | 耐久消費財・アパレル             |
| PRAXAIR INC                  |   | 81      | 61    | 730   | 77,185  | 素材                     |
| PRECISION CASTPARTS CORP     |   | 42      | —     | —     | —       | 資本財                    |
| T ROWE PRICE GROUP INC       |   | 66      | 35    | 240   | 25,370  | 各種金融                   |
| PRICELINE GROUP INC          |   | 16      | 11    | 1,851 | 195,556 | 小売                     |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP    |   | 111     | 82    | 460   | 48,597  | 保険                     |
| PROCTER & GAMBLE CO          |   | 808     | 596   | 5,128 | 541,757 | 家庭用品・パーソナル用品           |

| 銘柄                            | 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 |       | 業 種 等   |                        |
|-------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                               |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |
|                               |   |         |       | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額                 |
| (アメリカ)                        |   | 百株      | 百株    | 千米ドル  | 千円      |                        |
| PROGRESSIVE CORP              |   | 211     | 135   | 434   | 45,861  | 保険                     |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC      |   | 143     | 113   | 1,060 | 112,020 | 保険                     |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP  |   | 154     | 114   | 464   | 49,101  | 公益事業                   |
| PULTE HOMES INC               |   | 134     | 121   | 219   | 23,181  | 耐久消費財・アパレル             |
| QUALCOMM INC                  |   | 506     | 347   | 2,356 | 248,933 | 半導体・半導体製造装置            |
| QUEST DIAGNOSTICS             |   | 62      | 44    | 357   | 37,750  | ヘルスケア機器・サービス           |
| RALPH LAUREN CORP             |   | 29      | 19    | 197   | 20,878  | 耐久消費財・アパレル             |
| RANGE RESOURCES CORP          |   | 77      | —     | —     | —       | エネルギー                  |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC   |   | —       | 46    | 303   | 32,073  | 各種金融                   |
| RAYTHEON COMPANY              |   | 94      | 69    | 1,026 | 108,401 | 資本財                    |
| RED HAT INC                   |   | 70      | 55    | 428   | 45,236  | ソフトウェア・サービス            |
| Regeneron Pharmaceuticals Inc |   | 25      | 20    | 871   | 92,019  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| REGIONS FINANCIAL CORP        |   | 523     | 384   | 443   | 46,814  | 銀行                     |
| REPUBLIC SERVICES INC         |   | 99      | 74    | 394   | 41,636  | 商業・専門サービス              |
| RESMED INC                    |   | 62      | 49    | 289   | 30,563  | ヘルスケア機器・サービス           |
| REYNOLDS AMERICAN INC         |   | 279     | 200   | 1,092 | 115,447 | 食品・飲料・タバコ              |
| RITE AID CORP                 |   | 305     | 377   | 251   | 26,582  | 食品・生活必需品小売り            |
| ROBERT HALF INTL INC          |   | 63      | 56    | 228   | 24,083  | 商業・専門サービス              |
| ROCKWELL AUTOMATION INC       |   | 48      | 31    | 402   | 42,515  | 資本財                    |
| ROCKWELL COLLINS INC.         |   | 52      | 32    | 275   | 29,049  | 資本財                    |
| ROPER TECHNOLOGIES INC        |   | 36      | 24    | 438   | 46,335  | 資本財                    |
| ROSS STORES INC               |   | 134     | 97    | 614   | 64,858  | 小売                     |
| S&P GLOBAL INC                |   | —       | 69    | 873   | 92,241  | 各種金融                   |
| SEI INVESTMENTS COMPANY       |   | —       | 54    | 246   | 26,047  | 各種金融                   |
| ST JUDE MEDICAL INC           |   | 87      | 65    | 520   | 54,929  | ヘルスケア機器・サービス           |
| SALESFORCE.COM INC            |   | 197     | 163   | 1,238 | 130,850 | ソフトウェア・サービス            |
| SANDISK CORP                  |   | 73      | —     | —     | —       | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SCANA CORP                    |   | 63      | 44    | 312   | 33,059  | 公益事業                   |
| SCHLUMBERGER LTD              |   | 368     | 312   | 2,497 | 263,784 | エネルギー                  |
| SCHWAB (CHARLES) CORP         |   | 399     | 308   | 1,040 | 109,857 | 各種金融                   |
| SEALED AIR CORP               |   | 86      | 66    | 311   | 32,895  | 素材                     |
| SEMPRA ENERGY                 |   | 69      | 57    | 574   | 60,684  | 公益事業                   |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE       |   | 28      | 20    | 522   | 55,212  | 素材                     |
| SIGMA-ALDRICH                 |   | 17      | —     | —     | —       | 素材                     |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC        |   | 70      | 56    | 436   | 46,069  | 半導体・半導体製造装置            |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW COM     |   | 42      | 28    | 377   | 39,902  | 食品・飲料・タバコ              |
| SOUTHERN CO                   |   | 253     | 217   | 1,071 | 113,168 | 公益事業                   |
| SOUTHWEST AIRLINES CO         |   | 75      | 60    | 256   | 27,139  | 運輸                     |
| SOUTHWESTERN ENERGY COMPANY   |   | 178     | —     | —     | —       | エネルギー                  |
| SPECTRA ENERGY CORP           |   | 236     | 179   | 738   | 77,967  | エネルギー                  |
| SPLUNK INC                    |   | 35      | 46    | 281   | 29,757  | ソフトウェア・サービス            |
| STANLEY BLACK & DECKER INC    |   | 57      | 37    | 449   | 47,506  | 資本財                    |
| STAPLES INC                   |   | 246     | 184   | 149   | 15,745  | 小売                     |
| STARBUCKS CORP                |   | 472     | 360   | 1,969 | 208,017 | 消費者サービス                |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS     |   | 68      | —     | —     | —       | 消費者サービス                |
| STATE STREET CORP             |   | 134     | 99    | 751   | 79,417  | 各種金融                   |
| STERICYCLE INC                |   | 34      | 33    | 244   | 25,846  | 商業・専門サービス              |
| STRYKER CORP                  |   | 105     | 83    | 971   | 102,598 | ヘルスケア機器・サービス           |
| SUNTRUST BANKS INC            |   | 185     | 133   | 643   | 67,986  | 銀行                     |
| SYMANTEC CORP                 |   | 214     | 185   | 460   | 48,614  | ソフトウェア・サービス            |
| SYNOPSYS INC                  |   | 71      | 52    | 307   | 32,499  | ソフトウェア・サービス            |
| SYNCHRONY FINANCIAL           |   | —       | 211   | 639   | 67,532  | 各種金融                   |

| 銘柄                            | 柄 | 期首(前期末) |       | 当 期 末 |         | 業 種 等                  |
|-------------------------------|---|---------|-------|-------|---------|------------------------|
|                               |   | 株 数     | 株 数   | 評 価 額 |         |                        |
|                               |   |         |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |                        |
| (アメリカ)                        |   | 百株      | 百株    | 千円    | 千円      |                        |
| SYSCO CORP                    |   | 159     | 121   | 659   | 69,646  | 食品・生活必需品小売り            |
| TJX COMPANIES INC             |   | 204     | 143   | 1,061 | 112,116 | 小売                     |
| TARGET CORP                   |   | 185     | 121   | 838   | 88,601  | 小売                     |
| TERADATA CORP                 |   | 80      | —     | —     | —       | ソフトウェア・サービス            |
| TESLA MOTORS INC              |   | 33      | 30    | 576   | 60,890  | 自動車・自動車部品              |
| TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR    |   | 253     | 236   | 946   | 99,977  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TEXAS INSTRUMENTS             |   | 311     | 226   | 1,580 | 166,981 | 半導体・半導体製造装置            |
| TEXTRON INC                   |   | 113     | 86    | 370   | 39,165  | 資本財                    |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC  |   | 126     | 95    | 1,457 | 153,912 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| 3M CO                         |   | 189     | 138   | 2,361 | 249,474 | 資本財                    |
| TIFFANY & CO                  |   | 53      | 36    | 284   | 30,076  | 小売                     |
| TIME WARNER INC               |   | 259     | 192   | 1,663 | 175,669 | メディア                   |
| TIME WARNER CABLE             |   | 91      | —     | —     | —       | メディア                   |
| TOLL BROTHERS INC             |   | 84      | 71    | 197   | 20,885  | 耐久消費財・アパレル             |
| TORCHMARK CORP                |   | 60      | 42    | 283   | 29,963  | 保険                     |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC     |   | 72      | 58    | 298   | 31,511  | ソフトウェア・サービス            |
| TRAVELERS COS INC/THE         |   | 98      | 65    | 699   | 73,865  | 保険                     |
| TRIPADVISOR INC-W/I           |   | 47      | 39    | 209   | 22,131  | 小売                     |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX IN   |   | 376     | 247   | 680   | 71,856  | メディア                   |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B  |   | 174     | 137   | 375   | 39,633  | メディア                   |
| TWITTER INC                   |   | 166     | 175   | 334   | 35,364  | ソフトウェア・サービス            |
| TYSON FOODS INC-CL A          |   | 111     | 82    | 575   | 60,840  | 食品・飲料・タバコ              |
| US BANCORP                    |   | 560     | 389   | 1,816 | 191,925 | 銀行                     |
| UNION PACIFIC CORP            |   | 276     | 198   | 1,866 | 197,148 | 運輸                     |
| UNITED PARCEL SERVICE CL B    |   | 216     | 149   | 1,683 | 177,865 | 運輸                     |
| UNITED TECHNOLOGIES CORP      |   | 245     | 180   | 1,891 | 199,810 | 資本財                    |
| UNITED THERAPEUTICS CORP      |   | 10      | 18    | 239   | 25,290  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| UNITEDHEALTH GROUP INC        |   | 297     | 224   | 3,181 | 336,021 | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC |   | 33      | 29    | 346   | 36,557  | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNUM GROUP                    |   | 111     | 82    | 325   | 34,349  | 保険                     |
| VF CORP                       |   | 107     | 70    | 390   | 41,208  | 耐久消費財・アパレル             |
| VALERO ENERGY CORP            |   | 165     | 112   | 695   | 73,476  | エネルギー                  |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC    |   | 44      | 32    | 288   | 30,441  | ヘルスケア機器・サービス           |
| VERISIGN INC                  |   | 45      | 34    | 282   | 29,788  | ソフトウェア・サービス            |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC    |   | 1,240   | 971   | 4,648 | 491,036 | 電気通信サービス               |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC    |   | 78      | 67    | 624   | 65,998  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VIACOM INC CL B               |   | 120     | 100   | 382   | 40,435  | メディア                   |
| VISA INC-CLASS A SHARES       |   | 602     | 450   | 3,747 | 395,897 | ソフトウェア・サービス            |
| VMWARE INC-CLASS A            |   | 40      | 28    | 218   | 23,065  | ソフトウェア・サービス            |
| VOYA FINANCIAL INC            |   | 66      | 79    | 270   | 28,534  | 各種金融                   |
| VULCAN MATERIALS CO           |   | 53      | 39    | 513   | 54,290  | 素材                     |
| WABCO HOLDINGS INC            |   | 25      | 22    | 221   | 23,435  | 資本財                    |
| WEC ENERGY GROUP INC          |   | 111     | 89    | 505   | 53,378  | 公益事業                   |
| WABTEC CORP/DE                |   | 27      | 33    | 271   | 28,687  | 資本財                    |
| WAL-MART STORES INC           |   | 477     | 359   | 2,557 | 270,137 | 食品・生活必需品小売り            |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC  |   | 270     | 213   | 1,741 | 183,949 | 食品・生活必需品小売り            |
| WASTE MANAGEMENT INC          |   | 118     | 103   | 685   | 72,432  | 商業・専門サービス              |
| WATERS CORP                   |   | 34      | 25    | 362   | 38,275  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WELLS FARGO & COMPANY         |   | 1,503   | 1,128 | 5,415 | 572,062 | 銀行                     |
| WESTERN DIGITAL CORP          |   | 75      | 75    | 436   | 46,077  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| WESTERN UNION CO              |   | 219     | 154   | 307   | 32,442  | ソフトウェア・サービス            |
| WESTROCK CO                   |   | 96      | 80    | 384   | 40,627  | 素材                     |

| 銘柄                              |  | 期首(前期末) |        | 当期     |         | 業種等                    |
|---------------------------------|--|---------|--------|--------|---------|------------------------|
|                                 |  | 株数      | 株数     | 評価額    |         |                        |
|                                 |  |         |        | 外貨建金額  | 邦貨換算金額  |                        |
| (アメリカ)                          |  | 百株      | 百株     | 千米ドル   | 千円      |                        |
| WHIRLPOOL CORP                  |  | 30      | 21     | 342    | 36,216  | 耐久消費財・アパレル             |
| WHITEWAVE FOODS CO              |  | 41      | 57     | 311    | 32,933  | 食品・飲料・タバコ              |
| WHOLE FOODS MARKET INC          |  | 123     | 86     | 255    | 27,040  | 食品・生活必需品小売り            |
| WILLIAMS COS INC                |  | 234     | —      | —      | —       | エネルギー                  |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP          |  | 51      | 41     | 283    | 29,967  | 消費者サービス                |
| WYNN RESORTS LTD                |  | 36      | —      | —      | —       | 消費者サービス                |
| XCEL ENERGY INC                 |  | 161     | 140    | 556    | 58,757  | 公益事業                   |
| XLINX INC                       |  | 83      | 76     | 397    | 41,964  | 半導体・半導体製造装置            |
| XEROX CORP                      |  | 443     | 296    | 282    | 29,815  | ソフトウェア・サービス            |
| XYLEM INC                       |  | 86      | 61     | 310    | 32,786  | 資本財                    |
| YAHOO! INC                      |  | 276     | 229    | 944    | 99,797  | ソフトウェア・サービス            |
| YUM! BRANDS INC                 |  | 147     | 109    | 676    | 71,457  | 消費者サービス                |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC      |  | 45      | 53     | 546    | 57,706  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ZOETIS INC                      |  | 169     | 128    | 657    | 69,418  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| INVESCO LTD                     |  | 156     | 132    | 397    | 41,961  | 各種金融                   |
| CHUBB LTD                       |  | 96      | 107    | 1,347  | 142,294 | 保険                     |
| SIGNET JEWELERS LTD             |  | 14      | 24     | 216    | 22,871  | 小売                     |
| LyondellBasell Industries NV    |  | 127     | 81     | 655    | 69,252  | 素材                     |
| AVAGO TECHNOLOGIES LTD          |  | 86      | —      | —      | —       | 半導体・半導体製造装置            |
| GARMIN LTD                      |  | 60      | 37     | 185    | 19,561  | 耐久消費財・アパレル             |
| ACCENTURE PLC-CL A              |  | 185     | 150    | 1,760  | 185,973 | ソフトウェア・サービス            |
| Ensco PLC                       |  | 90      | —      | —      | —       | エネルギー                  |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC       |  | 76      | —      | —      | —       | 保険                     |
| NXP SEMICONDUCTORS NV           |  | —       | 73     | 711    | 75,176  | 半導体・半導体製造装置            |
| SEAGATE TECHNOLOGY              |  | 114     | 89     | 311    | 32,894  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| AON PLC                         |  | 93      | 68     | 761    | 80,487  | 保険                     |
| TE CONNECTIVITY LTD             |  | 142     | 98     | 647    | 68,381  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV |  | 23      | 66     | 237    | 25,064  | 資本財                    |
| INGERSOLL-RAND PLC              |  | 93      | 68     | 508    | 53,716  | 資本財                    |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD       |  | 60      | 48     | 244    | 25,776  | 耐久消費財・アパレル             |
| Delphi Automotive PLC           |  | 100     | 74     | 490    | 51,850  | 自動車・自動車部品              |
| EATON CORP PLC                  |  | 138     | 110    | 730    | 77,129  | 資本財                    |
| LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C     |  | 215     | 175    | 563    | 59,547  | メディア                   |
| IHS MARKIT LTD                  |  | —       | 111    | 394    | 41,697  | 商業・専門サービス              |
| BROADCOM LTD                    |  | —       | 93     | 1,624  | 171,588 | 半導体・半導体製造装置            |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC        |  | —       | 39     | 460    | 48,623  | 保険                     |
| PERRIGO CO PLC                  |  | 46      | 45     | 381    | 40,303  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC   |  | 340     | —      | —      | —       | エネルギー                  |
| PENTAIR PLC                     |  | 75      | 57     | 332    | 35,099  | 資本財                    |
| TYCO INTERNATIONAL PLC          |  | 118     | —      | —      | —       | 商業・専門サービス              |
| MEDTRONIC PLC                   |  | 420     | 319    | 2,649  | 279,869 | ヘルスケア機器・サービス           |
| MYLAN NV                        |  | 139     | 120    | 469    | 49,625  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| NIELSEN HOLDINGS PLC            |  | 126     | 81     | 366    | 38,718  | 商業・専門サービス              |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION    |  | —       | 226    | 994    | 105,073 | 資本財                    |
| ALLERGAN PLC                    |  | 120     | 96     | 2,063  | 217,982 | 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   | 95,598 | 71,978 | 448,668 | 47,392,902             |
| 銘柄数<比率>                         |  |         | 486    | 467    | —       | <61.3%>                |
| (カナダ)                           |  |         |        | 千カナダドル |         |                        |
| ARC RESOURCES LTD               |  | 171     | 126    | 290    | 22,853  | エネルギー                  |
| AGNICO EAGLE MINES LTD          |  | 86      | 55     | 375    | 29,569  | 素材                     |
| AGRIUM INC                      |  | 45      | 35     | 451    | 35,583  | 素材                     |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC    |  | 139     | 99     | 661    | 52,127  | 食品・生活必需品小売り            |

| 銘                            | 柄 | 期首(前期末) | 当 |     | 期 |        | 業 | 種       | 等           |        |   |
|------------------------------|---|---------|---|-----|---|--------|---|---------|-------------|--------|---|
|                              |   | 株       | 数 | 株   | 数 | 評      |   |         |             | 価      | 額 |
|                              |   |         |   |     |   | 外貨建金額  |   |         |             | 邦貨換算金額 |   |
| (カナダ)                        |   | 百株      |   | 百株  |   | 千カナダドル |   | 千円      |             |        |   |
| BCE INC                      |   | 68      |   | 55  |   | 329    |   | 25,930  | 電気通信サービス    |        |   |
| BANK OF MONTREAL             |   | 165     |   | 115 |   | 985    |   | 77,570  | 銀行          |        |   |
| BANK OF NOVA SCOTIA          |   | 322     |   | 261 |   | 1,872  |   | 147,485 | 銀行          |        |   |
| BARRICK GOLD CORP            |   | 357     |   | 284 |   | 656    |   | 51,691  | 素材          |        |   |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A |   | 291     |   | 228 |   | 1,068  |   | 84,109  | 各種金融        |        |   |
| CAE INC                      |   | 194     |   | 134 |   | 260    |   | 20,504  | 資本財         |        |   |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B    |   | —       |   | 11  |   | 277    |   | 21,880  | 素材          |        |   |
| CAMECO CORP                  |   | 199     |   | 145 |   | 166    |   | 13,092  | エネルギー       |        |   |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE  |   | 90      |   | 68  |   | 691    |   | 54,427  | 銀行          |        |   |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO     |   | 240     |   | 176 |   | 1,496  |   | 117,811 | 運輸          |        |   |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES   |   | 309     |   | 272 |   | 1,132  |   | 89,187  | エネルギー       |        |   |
| CANADIAN OIL SANDS LTD       |   | 284     |   | —   |   | —      |   | —       | エネルギー       |        |   |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD |   | 49      |   | 35  |   | 685    |   | 54,013  | 運輸          |        |   |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A     |   | 29      |   | 23  |   | 311    |   | 24,563  | 小売          |        |   |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A     |   | 84      |   | 64  |   | 240    |   | 18,948  | 公益事業        |        |   |
| CENOVUS ENERGY INC           |   | 326     |   | 261 |   | 503    |   | 39,626  | エネルギー       |        |   |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC   |   | 4       |   | 6   |   | 413    |   | 32,594  | ソフトウェア・サービス |        |   |
| DOLLARAMA INC                |   | 53      |   | 37  |   | 376    |   | 29,657  | 小売          |        |   |
| ELDORADO GOLD CORP           |   | 343     |   | —   |   | —      |   | —       | 素材          |        |   |
| ENCANA CORP                  |   | 404     |   | 314 |   | 446    |   | 35,150  | エネルギー       |        |   |
| ENBRIDGE INC                 |   | 269     |   | 231 |   | 1,318  |   | 103,827 | エネルギー       |        |   |
| FINNING INTERNATIONAL INC    |   | 123     |   | 93  |   | 236    |   | 18,661  | 資本財         |        |   |
| FIRST CAPITAL REALTY INC     |   | —       |   | 86  |   | 182    |   | 14,410  | 不動産         |        |   |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD   |   | 301     |   | —   |   | —      |   | —       | 素材          |        |   |
| FORTIS INC                   |   | 69      |   | 103 |   | 442    |   | 34,833  | 公益事業        |        |   |
| FRANCO-NEVADA CORP           |   | 37      |   | 36  |   | 328    |   | 25,879  | 素材          |        |   |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC        |   | 107     |   | 76  |   | 260    |   | 20,514  | 耐久消費財・アパレル  |        |   |
| GOLDCORP INC                 |   | 143     |   | 188 |   | 378    |   | 29,809  | 素材          |        |   |
| GREAT-WEST LIFE CO INC       |   | 138     |   | 99  |   | 332    |   | 26,201  | 保険          |        |   |
| CGI GROUP INC                |   | 102     |   | 69  |   | 464    |   | 36,559  | ソフトウェア・サービス |        |   |
| HUSKY ENERGY INC             |   | 177     |   | 164 |   | 233    |   | 18,396  | エネルギー       |        |   |
| IGM FINANCIAL INC            |   | 74      |   | 57  |   | 210    |   | 16,591  | 各種金融        |        |   |
| IMPERIAL OIL LTD             |   | 123     |   | 99  |   | 437    |   | 34,482  | エネルギー       |        |   |
| INTACT FINANCIAL CORP        |   | 50      |   | 41  |   | 383    |   | 30,168  | 保険          |        |   |
| INTER PIPELINE LTD           |   | 100     |   | 128 |   | 347    |   | 27,367  | エネルギー       |        |   |
| JEAN COUTU GROUP INC A       |   | —       |   | 60  |   | 123    |   | 9,732   | 食品・生活必需品小売り |        |   |
| KEYERA CORP                  |   | —       |   | 70  |   | 276    |   | 21,750  | エネルギー       |        |   |
| KINROSS GOLD CORP            |   | 667     |   | 376 |   | 200    |   | 15,765  | 素材          |        |   |
| LOBLAW COMPANIES LTD         |   | 72      |   | 50  |   | 329    |   | 25,956  | 食品・生活必需品小売り |        |   |
| MAGNA INTERNATIONAL INC      |   | 126     |   | 100 |   | 512    |   | 40,328  | 自動車・自動車部品   |        |   |
| MANULIFE FINANCIAL CORP      |   | 569     |   | 454 |   | 913    |   | 71,931  | 保険          |        |   |
| METRO INC                    |   | 115     |   | 86  |   | 353    |   | 27,867  | 食品・生活必需品小売り |        |   |
| NATIONAL BANK OF CANADA      |   | 136     |   | 85  |   | 408    |   | 32,144  | 銀行          |        |   |
| ONEX CORPORATION             |   | 45      |   | 33  |   | 289    |   | 22,804  | 各種金融        |        |   |
| OPEN TEXT CORP               |   | 57      |   | 44  |   | 370    |   | 29,211  | ソフトウェア・サービス |        |   |
| PEMBINA PIPELINE CORP        |   | 146     |   | 120 |   | 475    |   | 37,427  | エネルギー       |        |   |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN  |   | 216     |   | 223 |   | 509    |   | 40,088  | 素材          |        |   |
| POWER CORP OF CANADA         |   | 167     |   | 124 |   | 360    |   | 28,428  | 保険          |        |   |
| POWER FINANCIAL CORP         |   | 123     |   | 76  |   | 244    |   | 19,221  | 保険          |        |   |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD       |   | —       |   | 76  |   | 221    |   | 17,430  | エネルギー       |        |   |
| ROGERS COMMUNICATIONS -CL B  |   | 127     |   | 109 |   | 567    |   | 44,704  | 電気通信サービス    |        |   |
| ROYAL BANK OF CANADA         |   | 394     |   | 315 |   | 2,657  |   | 209,269 | 銀行          |        |   |

| 銘柄                             |       | 株数     | 期首(前期末) | 当期     |           | 業種等                    |
|--------------------------------|-------|--------|---------|--------|-----------|------------------------|
|                                |       |        | 株数      | 評価額    |           |                        |
|                                |       |        |         | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| (カナダ)                          |       | 百株     | 百株      | 千カナダドル | 千円        |                        |
| SNC-LAVALIN GROUP INC          |       | 84     | 58      | 321    | 25,291    | 資本財                    |
| SAPUTO INC                     |       | 123    | 87      | 419    | 33,046    | 食品・飲料・タバコ              |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B      |       | 185    | 138     | 368    | 29,006    | メディア                   |
| SILVER WHEATON CORP            |       | 108    | 102     | 331    | 26,115    | 素材                     |
| SUN LIFE FINANCIAL INC         |       | 187    | 118     | 550    | 43,318    | 保険                     |
| SUNCOR ENERGY INC              |       | 444    | 406     | 1,658  | 130,621   | エネルギー                  |
| TELUS CORP                     |       | 111    | 75      | 321    | 25,310    | 電気通信サービス               |
| THOMSON REUTERS CORP           |       | 134    | 101     | 568    | 44,753    | 各種金融                   |
| TORONTO-DOMINION BANK          |       | 527    | 382     | 2,316  | 182,437   | 銀行                     |
| TRANSALTA CORP                 |       | 246    | —       | —      | —         | 公益事業                   |
| TRANSCANADA CORP               |       | 201    | 198     | 1,190  | 93,775    | エネルギー                  |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD   |       | —      | 511     | 224    | 17,666    | 素材                     |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTE   |       | 103    | 33      | 72     | 5,699     | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| VERMILION ENERGY INC           |       | 57     | 48      | 259    | 20,424    | エネルギー                  |
| WESTON (GEORGE) LTD            |       | 30     | 24      | 252    | 19,892    | 食品・生活必需品小売り            |
| YAMANA GOLD INC                |       | 605    | 296     | 143    | 11,269    | 素材                     |
| 小計                             | 株数・金額 | 12,205 | 9,285   | 37,063 | 2,918,776 |                        |
| 銘柄数<比率>                        |       | 66     | 68      | —      | <3.8%>    |                        |
| (ユーロ…ドイツ)                      |       |        |         | 千ユーロ   |           |                        |
| ADIDAS AG                      |       | 64     | 48      | 682    | 78,731    | 耐久消費財・アパレル             |
| Fresenius SE & CO KG           |       | 132    | 104     | 738    | 85,222    | ヘルスケア機器・サービス           |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE   |       | 58     | 54      | 215    | 24,884    | ソフトウェア・サービス            |
| HANNOVER RUECK SE              |       | 28     | 23      | 233    | 26,914    | 保険                     |
| GEA GROUP AG                   |       | 86     | 63      | 214    | 24,758    | 資本財                    |
| CONTINENTAL AG                 |       | 38     | 24      | 415    | 48,003    | 自動車・自動車部品              |
| DEUTSCHE POST AG               |       | 283    | 212     | 612    | 70,651    | 運輸                     |
| AXEL SPRINGER SE               |       | 34     | 25      | 109    | 12,645    | メディア                   |
| MERCK KGAA                     |       | 51     | 39      | 387    | 44,724    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| RWE AG                         |       | 158    | 164     | 221    | 25,565    | 公益事業                   |
| SAP SE                         |       | 287    | 229     | 1,801  | 207,926   | ソフトウェア・サービス            |
| E.ON SE                        |       | 619    | 461     | 295    | 34,076    | 公益事業                   |
| HENKEL AG & CO KGAA            |       | 42     | 33      | 322    | 37,261    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| METRO AG                       |       | 89     | 55      | 150    | 17,370    | 食品・生活必需品小売り            |
| BAYER AG                       |       | 255    | 191     | 1,792  | 206,966   | 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   |       | 45     | 36      | 418    | 48,356    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| BASF SE                        |       | 266    | 206     | 1,650  | 190,563   | 素材                     |
| BEIERSDORF AG                  |       | 42     | 33      | 269    | 31,128    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| HEIDELBERGCEMENT AG            |       | 57     | 43      | 403    | 46,625    | 素材                     |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co |       | 69     | 48      | 376    | 43,416    | ヘルスケア機器・サービス           |
| ALLIANZ SE                     |       | 132    | 99      | 1,441  | 166,419   | 保険                     |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG         |       | 142    | 125     | 154    | 17,787    | 運輸                     |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG     |       | 36     | 31      | 551    | 63,694    | 保険                     |
| VOLKSWAGEN AG                  |       | 15     | 14      | 184    | 21,323    | 自動車・自動車部品              |
| VOLKSWAGEN AG PFD              |       | 45     | 40      | 473    | 54,662    | 自動車・自動車部品              |
| DAIMLER AG                     |       | 297    | 224     | 1,433  | 165,453   | 自動車・自動車部品              |
| THYSSENKRUPP AG                |       | 159    | 126     | 269    | 31,144    | 素材                     |
| SIEMENS AG                     |       | 221    | 174     | 1,824  | 210,604   | 資本財                    |
| LINDE AG                       |       | 53     | 44      | 679    | 78,421    | 素材                     |
| DEUTSCHE BANK AG -REG          |       | 435    | 395     | 528    | 61,012    | 各種金融                   |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG    |       | 111    | 87      | 669    | 77,252    | 自動車・自動車部品              |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG        |       | 1,022  | 749     | 1,091  | 125,952   | 電気通信サービス               |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG       |       | 418    | 280     | 446    | 51,521    | 半導体・半導体製造装置            |

| 銘柄                                  |  | 期首(前期末)      | 当 期 末  |        | 業 種 等     |               |
|-------------------------------------|--|--------------|--------|--------|-----------|---------------|
|                                     |  |              | 株 数    | 評 価 額  |           |               |
|                                     |  | 株 数          | 株 数    | 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 BOERSE AG                  |  | 70           | —      | —      | —         | 各種金融          |
| LANXESS                             |  | 49           | 36     | 207    | 23,938    | 素材            |
| BRENNTAG AG                         |  | 67           | 53     | 245    | 28,327    | 資本財           |
| K+S AG                              |  | 91           | 59     | 113    | 13,052    | 素材            |
| EVONIK INDUSTRIES AG                |  | —            | 51     | 137    | 15,824    | 素材            |
| HUGO BOSS AG -ORD                   |  | 24           | 17     | 106    | 12,254    | 耐久消費財・アパレル    |
| COMMERZBANK AG                      |  | 425          | 400    | 256    | 29,589    | 銀行            |
| VONOVIA SE                          |  | —            | 125    | 405    | 46,792    | 不動産           |
| PROSIEBENSAT1 MEDIA SE              |  | 87           | 74     | 258    | 29,784    | メディア          |
| DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER           |  | —            | 44     | 319    | 36,865    | 各種金融          |
| 株 数 ・ 金 額                           |  | 6,621        | 5,360  | 23,107 | 2,667,475 |               |
| 小 計                                 |  | 銘柄 数 < 比 率 > | 40     | 42     | —         | <3.5%>        |
| (ユーロ…イタリア)                          |  |              |        |        |           |               |
| ASSICURAZIONI GENERALI              |  | 388          | 332    | 390    | 45,102    | 保険            |
| INTESA SANPAOLO                     |  | 4,206        | 3,385  | 724    | 83,626    | 銀行            |
| MEDIOBANCA SPA                      |  | 297          | 267    | 183    | 21,165    | 銀行            |
| LUXOTTICA GROUP SPA                 |  | 68           | 57     | 276    | 31,943    | 耐久消費財・アパレル    |
| ENEL SPA                            |  | 2,329        | 1,724  | 651    | 75,190    | 公益事業          |
| ENI SPA                             |  | 802          | 573    | 734    | 84,756    | エネルギー         |
| SNAM SPA                            |  | 853          | 764    | 286    | 33,101    | エネルギー         |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SPA       |  | 418          | 598    | 141    | 16,298    | 銀行            |
| TELECOM ITALIA SPA                  |  | 3,995        | 3,247  | 242    | 27,951    | 電気通信サービス      |
| TELECOM ITALIA-RNC                  |  | 2,967        | 2,131  | 132    | 15,242    | 電気通信サービス      |
| ATLANTIA S. P. A                    |  | 165          | 117    | 244    | 28,244    | 運輸            |
| TERNA SPA                           |  | 679          | 550    | 230    | 26,552    | 公益事業          |
| UNICREDIT SPA                       |  | 1,617        | 1,649  | 367    | 42,456    | 銀行            |
| ITALGAS SPA                         |  | —            | 152    | 54     | 6,302     | 公益事業          |
| 株 数 ・ 金 額                           |  | 18,788       | 15,552 | 4,659  | 537,936   |               |
| 小 計                                 |  | 銘柄 数 < 比 率 > | 13     | 14     | —         | <0.7%>        |
| (ユーロ…フランス)                          |  |              |        |        |           |               |
| BOUYGUES                            |  | 77           | 59     | 177    | 20,502    | 資本財           |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                |  | 183          | 140    | 241    | 27,831    | 公益事業          |
| L' OREAL                            |  | 73           | 55     | 908    | 104,876   | 家庭用品・ パーソナル用品 |
| CHRISTIAN DIOR SE                   |  | 21           | 14     | 253    | 29,209    | 耐久消費財・アパレル    |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE |  | 86           | 62     | 1,042  | 120,378   | 耐久消費財・アパレル    |
| THALES SA                           |  | 47           | 32     | 292    | 33,771    | 資本財           |
| CAP GEMINI SA                       |  | 53           | 43     | 320    | 37,028    | ソフトウェア・ サービス  |
| CASINO GUICHARD PERRACHON           |  | 19           | 22     | 104    | 12,085    | 食品・生活必需品小売り   |
| PUBLICIS GROUPE                     |  | 66           | 58     | 346    | 40,013    | メディア          |
| LAGARDERE S. C. A                   |  | 73           | 55     | 127    | 14,726    | メディア          |
| MICHELIN (CGDE)-B                   |  | 50           | 35     | 344    | 39,741    | 自動車・自動車部品     |
| PERNOD-RICARD                       |  | 52           | 40     | 424    | 49,017    | 食品・飲料・タバコ     |
| RENAULT SA                          |  | 60           | 45     | 342    | 39,586    | 自動車・自動車部品     |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE               |  | 140          | 121    | 747    | 86,340    | 資本財           |
| VIVENDI SA                          |  | 343          | 231    | 417    | 48,245    | メディア          |
| TECHNIP S. A.                       |  | 31           | 30     | 190    | 21,936    | エネルギー         |
| VALEO SA                            |  | 31           | —      | —      | —         | 自動車・自動車部品     |
| ORANGE                              |  | 648          | 454    | 639    | 73,848    | 電気通信サービス      |
| HERMES INTERNATIONAL                |  | 10           | 7      | 264    | 30,577    | 耐久消費財・アパレル    |
| BIC                                 |  | 16           | 9      | 119    | 13,752    | 商業・専門サービス     |
| DASSAULT SYSTEMES SA                |  | 45           | 40     | 288    | 33,247    | ソフトウェア・ サービス  |
| KERING                              |  | 21           | 18     | 364    | 42,107    | 耐久消費財・アパレル    |

| 銘<br>柄                      |               | 期首(前期末) |       | 当 期    |           | 業 種 等                  |
|-----------------------------|---------------|---------|-------|--------|-----------|------------------------|
|                             |               | 株 数     | 株 数   | 評 価 額  |           |                        |
|                             |               |         |       | 外貨建金額  | 邦貨換算金額    |                        |
| (ユーロ…フランス)                  |               | 百株      | 百株    | 千ユーロ   | 千円        |                        |
| CNP ASSURANCES              |               | 103     | 93    | 152    | 17,625    | 保険                     |
| CARREFOUR SA                |               | 149     | 104   | 246    | 28,417    | 食品・生活必需品小売り            |
| ATOS SE                     |               | 35      | 29    | 286    | 33,123    | ソフトウェア・サービス            |
| SANOFI                      |               | 349     | 265   | 2,049  | 236,566   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ACCOR SA                    |               | 85      | 66    | 224    | 25,950    | 消費者サービス                |
| SOCIETE GENERALE-A          |               | 226     | 193   | 751    | 86,702    | 銀行                     |
| SODEXO                      |               | 31      | 30    | 315    | 36,408    | 消費者サービス                |
| AXA                         |               | 573     | 445   | 947    | 109,334   | 保険                     |
| ESSILOR INTERNATIONAL       |               | 59      | 43    | 447    | 51,691    | ヘルスケア機器・サービス           |
| CREDIT AGRICOLE SA          |               | 356     | 330   | 352    | 40,701    | 銀行                     |
| ZODIAC AEROSPACE            |               | 55      | 75    | 165    | 19,145    | 資本財                    |
| BNP PARIBAS                 |               | 327     | 264   | 1,450  | 167,414   | 銀行                     |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN   |               | 143     | 87    | 357    | 41,215    | 資本財                    |
| Wendel                      |               | 18      | 15    | 159    | 18,385    | 各種金融                   |
| Iliad SA                    |               | 12      | 10    | 196    | 22,693    | 電気通信サービス               |
| IMERYS SA                   |               | 28      | 21    | 137    | 15,889    | 素材                     |
| SAFRAN SA                   |               | 88      | 70    | 440    | 50,845    | 資本財                    |
| ENGIE                       |               | 331     | 224   | 286    | 33,085    | 公益事業                   |
| ALSTOM                      |               | 80      | 73    | 190    | 22,030    | 資本財                    |
| Eutelsat Communications     |               | 85      | 77    | 140    | 16,203    | メディア                   |
| ELECTRICITE DE FRANCE       |               | 99      | 107   | 109    | 12,623    | 公益事業                   |
| Arkema SA                   |               | 35      | 26    | 232    | 26,838    | 素材                     |
| Legrand SA                  |               | 84      | 50    | 261    | 30,171    | 資本財                    |
| TOTAL SA                    |               | 619     | 487   | 2,118  | 244,560   | エネルギー                  |
| Natixis                     |               | 457     | 408   | 182    | 21,111    | 銀行                     |
| SCOR SE                     |               | 72      | 55    | 162    | 18,755    | 保険                     |
| REXEL SA                    |               | 108     | 143   | 194    | 22,422    | 資本財                    |
| VINCI S.A.                  |               | 139     | 103   | 661    | 76,418    | 資本財                    |
| DANONE                      |               | 136     | 117   | 712    | 82,206    | 食品・飲料・タバコ              |
| AIR LIQUIDE                 |               | 92      | 74    | 691    | 79,787    | 素材                     |
| Bureau Veritas SA           |               | 113     | 105   | 179    | 20,734    | 商業・専門サービス              |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR |               | 194     | 204   | 176    | 20,352    | 運輸                     |
| SUEZ                        |               | 147     | 139   | 185    | 21,399    | 公益事業                   |
| EDENRED                     |               | 88      | 80    | 160    | 18,560    | 商業・専門サービス              |
| VALEO SA                    |               | —       | 73    | 374    | 43,230    | 自動車・自動車部品              |
| 小 計                         | 株 数 ・ 金 額     | 7,690   | 6,281 | 23,661 | 2,731,435 |                        |
|                             | 銘 柄 数 < 比 率 > | 56      | 56    | —      | <3.5%>    |                        |
| (ユーロ…オランダ)                  |               |         |       |        |           |                        |
| AIRBUS GROUP SE             |               | 184     | 141   | 769    | 88,864    | 資本財                    |
| RELX NV                     |               | 323     | 187   | 276    | 31,893    | 商業・専門サービス              |
| RANDSTAD HOLDING NV         |               | 57      | 42    | 202    | 23,368    | 商業・専門サービス              |
| AKZO NOBEL                  |               | 78      | 49    | 294    | 33,939    | 素材                     |
| WOLTERS KLUWER              |               | 124     | 97    | 320    | 36,987    | 商業・専門サービス              |
| QIAGEN N.V.                 |               | 115     | 88    | 229    | 26,464    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| Koninklijke Vopak NV        |               | 35      | 34    | 151    | 17,516    | エネルギー                  |
| AEGON NV                    |               | 709     | 644   | 264    | 30,521    | 保険                     |
| KONIKLIJKE KPN NV           |               | 1,234   | 1,128 | 323    | 37,374    | 電気通信サービス               |
| STMICROELECTRONICS NV       |               | 330     | 236   | 203    | 23,479    | 半導体・半導体製造装置            |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV      |               | 248     | 219   | 602    | 69,501    | 資本財                    |
| ING GROEP N.V.              |               | 1,247   | —     | —      | —         | 銀行                     |
| HEINEKEN NV                 |               | 62      | 43    | 314    | 36,362    | 食品・飲料・タバコ              |
| HEINEKEN HOLDING NV         |               | 44      | 36    | 247    | 28,552    | 食品・飲料・タバコ              |

| 銘柄                                  | 株数    | 株数     | 期末    |         | 業種等                    |
|-------------------------------------|-------|--------|-------|---------|------------------------|
|                                     |       |        | 当期    | 前期      |                        |
|                                     | 株数    | 株数     | 評価額   | 評価額     |                        |
|                                     |       |        | 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      |                        |
| KONINKLIJKE DSM NV                  | 73    | 57     | 331   | 38,252  | 素材                     |
| UNILEVER NV-CVA                     | 484   | 364    | 1,381 | 159,517 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| Koninklijke Boskalis Westminster NV | 46    | 42     | 121   | 14,024  | 資本財                    |
| TNT EXPRESS NV-W/I                  | 222   | —      | —     | —       | 運輸                     |
| ASML HOLDING NV                     | 102   | 83     | 790   | 91,220  | 半導体・半導体製造装置            |
| GEMALTO                             | 33    | 32     | 156   | 18,043  | ソフトウェア・サービス            |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV       | —     | 275    | 559   | 64,598  | 食品・生活必需品小売り            |
| CNH INDUSTRIAL NV                   | 433   | 367    | 260   | 30,082  | 資本財                    |
| KONINKLIJKE AHOLD NV                | 259   | —      | —     | —       | 食品・生活必需品小売り            |
| ING GROEP NV-CVA                    | —     | 970    | 1,253 | 144,675 | 銀行                     |
| 小計                                  | 株数・金額 | 6,453  | 5,147 | 9,054   | 1,045,240              |
| 銘柄数<比率>                             | 22    | 21     | —     | <1.4%>  |                        |
| (ユーロ…スペイン)                          |       |        |       |         |                        |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA         | 217   | 214    | 279   | 32,265  | 運輸                     |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA        | 2,069 | 1,675  | 1,025 | 118,353 | 銀行                     |
| GAS NATURAL SDG SA                  | 162   | 131    | 224   | 25,903  | 公益事業                   |
| REPSOL SA                           | 392   | 287    | 362   | 41,903  | エネルギー                  |
| BANCO SANTANDER S.A                 | 4,576 | 3,614  | 1,598 | 184,519 | 銀行                     |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA        | 45    | —      | —     | —       | 公益事業                   |
| TELEFONICA SA                       | 1,431 | 1,142  | 1,011 | 116,743 | 電気通信サービス               |
| ENAGAS SA                           | 101   | 85     | 215   | 24,832  | 公益事業                   |
| Grifols SA                          | 63    | —      | —     | —       | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| FERROVIAL SA                        | 177   | 166    | 283   | 32,772  | 資本財                    |
| MAPFRE S.A.                         | 685   | 583    | 159   | 18,387  | 保険                     |
| IBERDROLA SA                        | 1,795 | 1,163  | 689   | 79,547  | 公益事業                   |
| AMADEUS IT GROUP SA-A SHS           | 159   | 122    | 516   | 59,606  | ソフトウェア・サービス            |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL         | 363   | 282    | 133   | 15,379  | 食品・生活必需品小売り            |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA        | —     | 148    | 263   | 30,360  | 公益事業                   |
| INDITEX                             | 360   | 256    | 799   | 92,303  | 小売                     |
| GRIFOLS SA                          | —     | 115    | 214   | 24,742  | 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 | 12,604 | 9,990 | 7,775   | 897,621                |
| 銘柄数<比率>                             | 15    | 15     | —     | <1.2%>  |                        |
| (ユーロ…ベルギー)                          |       |        |       |         |                        |
| UMICORE                             | 54    | 37     | 208   | 24,122  | 素材                     |
| DELHAIZE GROUP                      | 44    | —      | —     | —       | 食品・生活必需品小売り            |
| KBC GROEP NV                        | 93    | 70     | 412   | 47,599  | 銀行                     |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV                | 235   | —      | —     | —       | 食品・飲料・タバコ              |
| SOLVAY SA                           | 27    | 25     | 260   | 30,048  | 素材                     |
| UCB SA                              | 50    | 41     | 263   | 30,458  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| COLRUYT SA                          | 25    | 16     | 77    | 8,929   | 食品・生活必需品小売り            |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA         | 13    | 23     | 180   | 20,838  | 各種金融                   |
| PROXIMUS                            | 81    | 48     | 126   | 14,545  | 電気通信サービス               |
| AGEAS                               | 52    | 67     | 219   | 25,330  | 保険                     |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV          | —     | 183    | 1,886 | 217,777 | 食品・飲料・タバコ              |
| 小計                                  | 株数・金額 | 679    | 515   | 3,635   | 419,648                |
| 銘柄数<比率>                             | 10    | 9      | —     | <0.5%>  |                        |
| (ユーロ…オーストリア)                        |       |        |       |         |                        |
| OMV AG                              | 85    | 53     | 152   | 17,555  | エネルギー                  |
| VOESTALPINE AG                      | 50    | 55     | 188   | 21,812  | 素材                     |
| ERSTE GROUP BANK AG                 | 125   | 104    | 286   | 33,122  | 銀行                     |
| 小計                                  | 株数・金額 | 261    | 212   | 627     | 72,490                 |
| 銘柄数<比率>                             | 3     | 3      | —     | <0.1%>  |                        |

| 銘柄                           | 株数      | 株数     | 期末      |         | 業種等                    |
|------------------------------|---------|--------|---------|---------|------------------------|
|                              |         |        | 期首(前期末) | 当期      |                        |
|                              | 金額      | 金額     | 評価      | 金額      |                        |
|                              |         |        |         |         |                        |
| (ユーロ…ルクセンブルク)                |         |        | 千ユーロ    | 千円      |                        |
| TENARIS SA                   | 222     | 160    | 220     | 25,457  | エネルギー                  |
| SES SA                       | 125     | 103    | 213     | 24,606  | メディア                   |
| ARCELORMITTAL                | 387     | —      | —       | —       | 素材                     |
| 小計                           | 株数・金額   | 734    | 264     | 433     | 50,064                 |
|                              | 銘柄数<比率> | 3      | 2       | —       | <0.1%>                 |
| (ユーロ…フィンランド)                 |         |        |         |         |                        |
| WARTSILA                     | 57      | 43     | 173     | 20,082  | 資本財                    |
| UPM-KYMMENE OYJ              | 209     | 130    | 282     | 32,573  | 素材                     |
| STORA ENSO OYJ-R SHS         | 281     | 173    | 152     | 17,568  | 素材                     |
| SAMPO OYJ-A SHS              | 82      | 66     | 282     | 32,659  | 保険                     |
| FORTUM OYJ                   | 114     | 105    | 159     | 18,386  | 公益事業                   |
| ELISA OYJ                    | 72      | 61     | 187     | 21,692  | 電気通信サービス               |
| METSO OYJ                    | 49      | 60     | 155     | 17,900  | 資本財                    |
| NOKIA OYJ                    | 1,173   | 1,460  | 586     | 67,657  | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| NESTE OYJ                    | 81      | 48     | 175     | 20,216  | エネルギー                  |
| NOKIAN RENKAAT OYJ           | 52      | 34     | 114     | 13,192  | 自動車・自動車部品              |
| KONE OYJ-B                   | 90      | 56     | 236     | 27,292  | 資本財                    |
| ORION OYJ                    | 43      | 28     | 114     | 13,198  | 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   | 2,309  | 2,270   | 2,619   | 302,419                |
|                              | 銘柄数<比率> | 12     | 12      | —       | <0.4%>                 |
| (ユーロ…アイルランド)                 |         |        |         |         |                        |
| KERRY GROUP PLC-A            | 53      | —      | —       | —       | 食品・飲料・タバコ              |
| CRH PLC(DUBLIN)              | 286     | 217    | 699     | 80,736  | 素材                     |
| KERRY GROUP PLC-A            | —       | 49     | 326     | 37,634  | 食品・飲料・タバコ              |
| 小計                           | 株数・金額   | 339    | 266     | 1,025   | 118,371                |
|                              | 銘柄数<比率> | 2      | 2       | —       | <0.2%>                 |
| (ユーロ…ポルトガル)                  |         |        |         |         |                        |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA      | 1,041   | 635    | 180     | 20,825  | 公益事業                   |
| Galp Energia SGPS SA         | —       | 168    | 201     | 23,268  | エネルギー                  |
| JERONIMO MARTINS             | 163     | 93     | 145     | 16,805  | 食品・生活必需品小売り            |
| 小計                           | 株数・金額   | 1,205  | 897     | 527     | 60,898                 |
|                              | 銘柄数<比率> | 2      | 3       | —       | <0.1%>                 |
| (ユーロ…その他)                    |         |        |         |         |                        |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS  | —       | 74     | 262     | 30,328  | 食品・飲料・タバコ              |
| 小計                           | 株数・金額   | —      | 74      | 262     | 30,328                 |
|                              | 銘柄数<比率> | —      | 1       | —       | <0.0%>                 |
| ユーロ計                         | 株数・金額   | 57,688 | 46,835  | 77,390  | 8,933,932              |
|                              | 銘柄数<比率> | 178    | 180     | —       | <11.6%>                |
| (イギリス)                       |         |        | 千英ポンド   |         |                        |
| ABERDEEN ASSET MGMT PLC      | 475     | 363    | 112     | 14,809  | 各種金融                   |
| AMEC FOSTER WHEELER PLC      | 113     | —      | —       | —       | エネルギー                  |
| Antofagasta PLC              | 147     | 213    | 136     | 18,001  | 素材                     |
| ASHTREAD GROUP PLC           | 113     | 183    | 253     | 33,367  | 資本財                    |
| BHP BILLITON PLC             | 618     | 539    | 721     | 94,837  | 素材                     |
| ARM HOLDINGS PLC             | 448     | —      | —       | —       | 半導体・半導体製造装置            |
| SKY PLC                      | 376     | 288    | 232     | 30,527  | メディア                   |
| AVIVA PLC                    | 1,205   | 831    | 369     | 48,505  | 保険                     |
| CRODA INTERNATIONAL PLC      | 59      | —      | —       | —       | 素材                     |
| DIAGEO PLC                   | 712     | 568    | 1,174   | 154,303 | 食品・飲料・タバコ              |
| SCHRODERS PLC                | 64      | 59     | 169     | 22,217  | 各種金融                   |
| BAE SYSTEMS PLC              | 761     | 641    | 375     | 49,336  | 資本財                    |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 539     | 439    | 1,967   | 258,574 | 食品・飲料・タバコ              |

| 銘柄                              | 柄 | 期首(前期末) | 当 期    |       | 業 種 等   |                        |
|---------------------------------|---|---------|--------|-------|---------|------------------------|
|                                 |   | 株 数     | 株 数    | 評 価 額 |         |                        |
|                                 |   |         |        | 外貨建金額 |         | 邦貨換算金額                 |
| (イギリス)                          |   | 百株      | 百株     | 千英ポンド | 千円      |                        |
| STANDARD CHARTERED PLC          |   | 800     | 824    | 538   | 70,820  | 銀行                     |
| IMPERIAL BRANDS PLC             |   | 287     | 214    | 774   | 101,824 | 食品・飲料・タバコ              |
| SABMILLER PLC                   |   | 289     | —      | —     | —       | 食品・飲料・タバコ              |
| HSBC HOLDINGS PLC               |   | 5,870   | 4,608  | 2,868 | 376,860 | 銀行                     |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC       |   | 1,799   | 1,245  | 276   | 36,288  | 保険                     |
| MEGGITT PLC                     |   | 382     | 253    | 113   | 14,973  | 資本財                    |
| MORRISON <WM.> SUPERMARKETS     |   | 990     | 713    | 155   | 20,440  | 食品・生活必需品小売り            |
| Associated British Foods PLC    |   | 112     | 93     | 241   | 31,716  | 食品・飲料・タバコ              |
| PEARSON PLC                     |   | 281     | 239    | 178   | 23,458  | メディア                   |
| PERSIMMON PLC                   |   | 131     | 94     | 161   | 21,284  | 耐久消費財・アパレル             |
| PRUDENTIAL PLC                  |   | 805     | 598    | 853   | 112,195 | 保険                     |
| RIO TINTO PLC                   |   | 341     | 301    | 924   | 121,488 | 素材                     |
| TRAVIS PERKINS PLC              |   | 34      | 80     | 108   | 14,284  | 資本財                    |
| SSE PLC                         |   | 263     | 139    | 213   | 28,064  | 公益事業                   |
| BP PLC                          |   | 5,418   | 4,380  | 2,006 | 263,660 | エネルギー                  |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC        |   | 17,691  | 15,389 | 885   | 116,294 | 銀行                     |
| TATE & LYLE PLC                 |   | 212     | 195    | 128   | 16,931  | 食品・飲料・タバコ              |
| BG GROUP PLC                    |   | 1,039   | —      | —     | —       | エネルギー                  |
| TESCO PLC                       |   | 2,552   | 2,071  | 413   | 54,355  | 食品・生活必需品小売り            |
| SMITH & NEPHEW PLC              |   | 258     | 246    | 278   | 36,559  | ヘルスケア機器・サービス           |
| GLAXOSMITHKLINE PLC             |   | 1,432   | 1,135  | 1,816 | 238,655 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WEIR GROUP PLC/THE              |   | 108     | 89     | 154   | 20,309  | 資本財                    |
| ASTRAZENECA PLC                 |   | 370     | 291    | 1,332 | 175,057 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| GKN PLC                         |   | 701     | 644    | 197   | 25,959  | 自動車・自動車部品              |
| BT GROUP PLC                    |   | 2,680   | 1,926  | 698   | 91,822  | 電気通信サービス               |
| CARNIVAL PLC                    |   | 78      | 65     | 259   | 34,143  | 消費者サービス                |
| MARKS & SPENCER GROUP PLC       |   | 514     | 448    | 146   | 19,241  | 小売                     |
| BARCLAYS PLC                    |   | 5,382   | 4,201  | 810   | 106,494 | 銀行                     |
| INTERTEK GROUP PLC              |   | 74      | 59     | 196   | 25,774  | 商業・専門サービス              |
| WILLIAM HILL PLC                |   | —       | 407    | 118   | 15,634  | 消費者サービス                |
| BURBERRY GROUP PLC              |   | 184     | 127    | 184   | 24,307  | 耐久消費財・アパレル             |
| NEXT PLC                        |   | 38      | 39     | 200   | 26,302  | 小売                     |
| KINGFISHER PLC                  |   | 718     | 461    | 167   | 21,966  | 小売                     |
| ICAP PLC                        |   | 333     | 215    | 107   | 14,081  | 各種金融                   |
| ITV PLC                         |   | 1,444   | 1,114  | 185   | 24,316  | メディア                   |
| SAINSBURY (J) PLC               |   | 649     | 172    | 41    | 5,402   | 食品・生活必需品小売り            |
| RANDGOLD RESOURCES LTD          |   | 23      | 23     | 164   | 21,596  | 素材                     |
| G4S PLC                         |   | 775     | 528    | 130   | 17,134  | 商業・専門サービス              |
| ADMIRAL GROUP PLC               |   | 109     | 74     | 140   | 18,484  | 保険                     |
| CENTRICA PLC                    |   | 1,385   | 1,252  | 260   | 34,178  | 公益事業                   |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS     |   | 1,144   | 968    | 2,007 | 263,836 | エネルギー                  |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS     |   | 723     | 913    | 1,975 | 259,562 | エネルギー                  |
| BUNZL PLC                       |   | 123     | 99     | 213   | 28,114  | 資本財                    |
| COBHAM PLC                      |   | 597     | 544    | 85    | 11,270  | 資本財                    |
| NATIONAL GRID PLC               |   | 1,000   | 839    | 844   | 110,928 | 公益事業                   |
| London Stock Exchange Group PLC |   | 122     | 95     | 266   | 35,082  | 各種金融                   |
| UNILEVER PLC                    |   | 369     | 299    | 991   | 130,315 | 家庭用品・パーソナル用品           |
| EXPERIAN PLC                    |   | 278     | 198    | 290   | 38,200  | 商業・専門サービス              |
| SEVERN TRENT PLC                |   | 104     | 90     | 202   | 26,606  | 公益事業                   |
| Whitbread PLC                   |   | 70      | 65     | 230   | 30,325  | 消費者サービス                |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC         |   | 129     | 125    | 151   | 19,856  | 各種金融                   |
| SMITHS GROUP PLC                |   | 169     | 151    | 219   | 28,898  | 資本財                    |

| 銘柄                                |               | 期首(前期末) | 当 期 末  |         | 業 種 等     |                        |
|-----------------------------------|---------------|---------|--------|---------|-----------|------------------------|
|                                   |               | 株 数     | 株 数    | 評 価 額   |           |                        |
|                                   |               |         |        | 外貨建金額   |           | 邦貨換算金額                 |
| (イギリス)                            |               | 百株      | 百株     | 千英ポンド   | 千円        |                        |
| ANGLO AMERICAN PLC                |               | 406     | —      | —       | —         | 素材                     |
| 3I GROUP PLC                      |               | 449     | 321    | 211     | 27,733    | 各種金融                   |
| CAPITA PLC                        |               | 224     | 188    | 108     | 14,296    | 商業・専門サービス              |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC       |               | 189     | 142    | 1,006   | 132,214   | 家庭用品・パーソナル用品           |
| RELX PLC                          |               | 368     | 239    | 329     | 43,252    | 商業・専門サービス              |
| SHIRE PLC                         |               | 184     | 212    | 1,040   | 136,736   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| Fresnillo PLC                     |               | 131     | 64     | 114     | 15,046    | 素材                     |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC        |               | 279     | 247    | 224     | 29,541    | 公益事業                   |
| GLENCORE PLC                      |               | 3,559   | 3,039  | 821     | 107,920   | 素材                     |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC          |               | 562     | 447    | 339     | 44,588    | 資本財                    |
| JOHNSON MATTHEY PLC               |               | 79      | —      | —       | —         | 素材                     |
| OLD MUTUAL PLC                    |               | 1,736   | 1,249  | 251     | 33,055    | 保険                     |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROU       |               | 1,185   | 1,240  | 238     | 31,332    | 銀行                     |
| SAGE GROUP PLC/THE                |               | 457     | 368    | 250     | 32,978    | ソフトウェア・サービス            |
| WPP PLC                           |               | 437     | 304    | 512     | 67,401    | メディア                   |
| ROYAL MAIL PLC                    |               | —       | 174    | 86      | 11,322    | 運輸                     |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-        |               | —       | 346    | 153     | 20,191    | 消費者サービス                |
| WOLSELEY PLC                      |               | 86      | 71     | 322     | 42,421    | 資本財                    |
| IMI PLC                           |               | 135     | 133    | 129     | 16,975    | 資本財                    |
| VODAFONE GROUP PLC                |               | 8,184   | 6,089  | 1,319   | 173,319   | 電気通信サービス               |
| AGGREKO PLC                       |               | 135     | 89     | 72      | 9,554     | 商業・専門サービス              |
| RSA INSURANCE GROUP PLC           |               | 468     | 387    | 208     | 27,379    | 保険                     |
| COMPASS GROUP PLC                 |               | 528     | 437    | 611     | 80,396    | 消費者サービス                |
| REXAM PLC                         |               | 284     | —      | —       | —         | 素材                     |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC |               | 102     | —      | —       | —         | 消費者サービス                |
| STANDARD LIFE PLC                 |               | 728     | 599    | 212     | 27,864    | 保険                     |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP       |               | 345     | 278    | 101     | 13,319    | 保険                     |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC |               | —       | 68     | 213     | 27,992    | 消費者サービス                |
| CRODA INTERNATIONAL PLC           |               | —       | 39     | 128     | 16,908    | 素材                     |
| JOHNSON MATTHEY PLC               |               | —       | 64     | 214     | 28,193    | 素材                     |
| 小 計                               | 株 数 ・ 金 額     | 88,289  | 70,336 | 40,652  | 5,341,782 |                        |
|                                   | 銘 柄 数 < 比 率 > | 89      | 86     | —       | <6.9%>    |                        |
| (スイス)                             |               |         |        | 千スイスフラン |           |                        |
| SYNGENTA AG-REG                   |               | 29      | —      | —       | —         | 素材                     |
| SIKA AG-BR                        |               | 1       | 0.7    | 345     | 37,069    | 素材                     |
| SGS SA                            |               | 2       | 1      | 354     | 38,006    | 商業・専門サービス              |
| SWISSCOM AG-REG                   |               | 9       | 8      | 362     | 38,893    | 電気通信サービス               |
| CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG       |               | 0.05    | 0.04   | 249     | 26,807    | 食品・飲料・タバコ              |
| GIVAUDAN-REG                      |               | 3       | 2      | 375     | 40,271    | 素材                     |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG         |               | 39      | 34     | 900     | 96,627    | 保険                     |
| NOVARTIS AG-REG SHS               |               | 689     | 511    | 3,707   | 397,990   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ABB LTD                           |               | 626     | 466    | 969     | 104,074   | 資本財                    |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSS          |               | 211     | 159    | 3,777   | 405,544   | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| ADECCO GROUP AG(REG)              |               | 66      | 48     | 280     | 30,064    | 商業・専門サービス              |
| LAFARGEHOLCIM LTD                 |               | 141     | 123    | 692     | 74,381    | 素材                     |
| NESTLE SA-REGISTERED              |               | 950     | 725    | 5,107   | 548,311   | 食品・飲料・タバコ              |
| SONOVA HOLDING AG                 |               | 24      | 20     | 261     | 28,118    | ヘルスケア機器・サービス           |
| CREDIT SUISSE GROUP AG            |               | 499     | 508    | 661     | 71,029    | 各種金融                   |
| THE SWATCH GROUP AG-B             |               | 12      | 10     | 313     | 33,705    | 耐久消費財・アパレル             |
| LONZA GROUP AG-REG                |               | 23      | 17     | 324     | 34,831    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| SWISS LIFE HOLDING AG             |               | 14      | 11     | 301     | 32,335    | 保険                     |
| Schindler Holding AG              |               | 21      | 15     | 289     | 31,048    | 資本財                    |

| 銘柄                                 |              | 期首(前期末) | 当 期 末 |             | 業 種 等     |                        |
|------------------------------------|--------------|---------|-------|-------------|-----------|------------------------|
|                                    |              | 株 数     | 株 数   | 評 価 額       |           |                        |
|                                    |              |         |       | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |                        |
| (スイス)                              |              | 百株      | 百株    | 千スイスフラン     | 千円        |                        |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG         |              | 24      | 17    | 227         | 24,383    | 運輸                     |
| GEBERIT AG-REG                     |              | 14      | 10    | 430         | 46,259    | 資本財                    |
| Actelion Ltd                       |              | 35      | 26    | 381         | 40,914    | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| Aryzta AG                          |              | 43      | 36    | 154         | 16,599    | 食品・飲料・タバコ              |
| JULIUS BAER GROUP LTD              |              | 92      | 77    | 323         | 34,698    | 各種金融                   |
| SWISS RE AG                        |              | 85      | 65    | 599         | 64,366    | 保険                     |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-REG        |              | 162     | 128   | 860         | 92,352    | 耐久消費財・アパレル             |
| UBS GROUP AG                       |              | 1,161   | 918   | 1,288       | 138,364   | 各種金融                   |
| SYNGENTA AG-2ND LINE               |              | —       | 22    | 864         | 92,851    | 素材                     |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額    | 4,987   | 3,969 | 24,405      | 2,619,904 |                        |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 27      | 27    | —           | <3.4%>    |                        |
| (スウェーデン)                           |              |         |       | 千スウェーデンクローネ |           |                        |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A       |              | 459     | 320   | 2,947       | 34,425    | 銀行                     |
| Swedbank AB                        |              | 229     | 220   | 4,716       | 55,090    | 銀行                     |
| SWEDISH MATCH AB                   |              | 97      | 72    | 2,152       | 25,138    | 食品・飲料・タバコ              |
| NORDEA BANK AB                     |              | 867     | 617   | 5,862       | 68,476    | 銀行                     |
| SECURITAS AB-B SHS                 |              | 187     | 118   | 1,580       | 18,462    | 商業・専門サービス              |
| INVESTOR AB-B SHS                  |              | 127     | 76    | 2,411       | 28,162    | 各種金融                   |
| HENNES & MAURITZ AB-B              |              | 224     | 194   | 4,958       | 57,916    | 小売                     |
| ERICSSON LM-B SHS                  |              | 933     | 698   | 3,119       | 36,440    | テクノロジー・ハードウェアおよび機器     |
| TELIA COMPANY AB                   |              | 549     | 408   | 1,432       | 16,732    | 電気通信サービス               |
| SKANSKA AB-B SHS                   |              | 170     | 114   | 2,326       | 27,174    | 資本財                    |
| LUNDIN PETROLEUM AB                |              | 151     | 93    | 1,479       | 17,280    | エネルギー                  |
| ALFA LAVAL AB                      |              | 158     | 106   | 1,394       | 16,283    | 資本財                    |
| GETINGE AB-B SHS                   |              | 85      | 90    | 1,325       | 15,482    | ヘルスケア機器・サービス           |
| INVESTMENT AB KINNEVIK-B SHS       |              | 88      | —     | —           | —         | 各種金融                   |
| Millicom International Cellular SA |              | 38      | 29    | 1,077       | 12,590    | 電気通信サービス               |
| SKF AB-B SHARES                    |              | 184     | 133   | 2,038       | 23,808    | 資本財                    |
| VOLVO AB-B SHS                     |              | 455     | 353   | 3,417       | 39,920    | 資本財                    |
| SANDVIK AB                         |              | 444     | 333   | 3,580       | 41,823    | 資本財                    |
| Industrivarden AB                  |              | 120     | 96    | 1,524       | 17,800    | 各種金融                   |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS         |              | 177     | 129   | 3,194       | 37,310    | 家庭用品・パーソナル用品           |
| Boliden AB                         |              | 141     | 104   | 2,294       | 26,802    | 素材                     |
| TELE2 AB-B SHS                     |              | 209     | 125   | 897         | 10,479    | 電気通信サービス               |
| KINNEVIK AB-B                      |              | —       | 94    | 2,089       | 24,409    | 各種金融                   |
| ATLAS COPCO AB-A SHS               |              | 143     | 136   | 3,796       | 44,344    | 資本財                    |
| ATLAS COPCO AB-B SHS               |              | 163     | 127   | 3,150       | 36,793    | 資本財                    |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS        |              | 477     | 362   | 4,521       | 52,808    | 銀行                     |
| ASSA ABLOY AB-B                    |              | 316     | 226   | 3,897       | 45,521    | 資本財                    |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額    | 7,203   | 5,387 | 71,188      | 831,480   |                        |
|                                    | 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                            |              | 342     | 293   | 3,510       | 44,578    | 銀行                     |
| TELENOR ASA                        |              | 234     | 237   | 3,054       | 38,790    | 電気通信サービス               |
| SUBSEA 7 SA                        |              | 200     | —     | —           | —         | エネルギー                  |
| STATOIL ASA                        |              | 287     | 276   | 3,775       | 47,947    | エネルギー                  |
| YARA INTERNATIONAL ASA             |              | 61      | 44    | 1,336       | 16,976    | 素材                     |
| NORSK HYDRO ASA                    |              | 419     | 381   | 1,502       | 19,083    | 素材                     |
| ORKLA ASA                          |              | 340     | 268   | 2,094       | 26,598    | 食品・飲料・タバコ              |
| 小 計                                | 株 数 ・ 金 額    | 1,885   | 1,501 | 15,273      | 193,974   |                        |
|                                    | 銘柄 数 < 比 率 > | 7       | 6     | —           | <0.3%>    |                        |

| 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                 |
| (デンマーク)                        |              | 百株      | 百株    | 千デンマーククローネ | 千円      |                        |
| CARLSBERG AS-B                 |              | 47      | 33    | 2,038      | 31,615  | 食品・飲料・タバコ              |
| A. P. MOLLER MAERSK            |              | 1       | 1     | 1,285      | 19,933  | 運輸                     |
| A P Moller - Maersk A/S        |              | 1       | 1     | 1,440      | 22,335  | 運輸                     |
| DANSKE BANK A/S                |              | 252     | 185   | 3,809      | 59,091  | 銀行                     |
| TDC A/S                        |              | 394     | 358   | 1,261      | 19,568  | 電気通信サービス               |
| WILLIAM DEMANT HOLDING         |              | 20      | —     | —          | —       | ヘルスケア機器・サービス           |
| DSV A/S                        |              | 80      | 65    | 1,966      | 30,507  | 運輸                     |
| PANDORA A/S                    |              | 40      | 33    | 2,681      | 41,582  | 耐久消費財・アパレル             |
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S   |              | —       | 39    | 1,488      | 23,081  | 素材                     |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES         |              | 95      | 69    | 1,691      | 26,230  | 素材                     |
| COLOPLAST-B                    |              | 47      | 40    | 1,855      | 28,782  | ヘルスケア機器・サービス           |
| NOVO NORDISK A/S-B             |              | 601     | 456   | 10,715     | 166,200 | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| WILLIAM DEMANT HOLDING         |              | —       | 74    | 925        | 14,347  | ヘルスケア機器・サービス           |
| 小 計                            | 株 数 ・ 金 額    | 1,583   | 1,360 | 31,159     | 483,277 |                        |
|                                | 銘柄 数 < 比 率 > | 11      | 12    | —          | <0.6%>  |                        |
| (オーストラリア)                      |              |         |       | 千豪ドル       |         |                        |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LTD  |              | 833     | 687   | 1,820      | 147,303 | 銀行                     |
| AMCOR LTD                      |              | 502     | 345   | 494        | 40,025  | 素材                     |
| WESTPAC BANKING CORPORATION    |              | 973     | 775   | 2,299      | 186,096 | 銀行                     |
| TELSTRA CORP LTD               |              | 800     | 847   | 410        | 33,189  | 電気通信サービス               |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED       |              | 378     | 268   | 251        | 20,342  | 食品・飲料・タバコ              |
| AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE      |              | 87      | 67    | 306        | 24,811  | 各種金融                   |
| BHP BILLITON LTD               |              | 836     | 826   | 1,865      | 150,951 | 素材                     |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED       |              | 102     | 103   | 300        | 24,281  | エネルギー                  |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD     |              | 531     | 377   | 178        | 14,444  | 小売                     |
| COMPUTERSHARE LIMITED          |              | 288     | 224   | 229        | 18,585  | ソフトウェア・サービス            |
| CSL LIMITED                    |              | 162     | 111   | 1,078      | 87,319  | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス |
| TRANSURBAN GROUP               |              | 772     | 589   | 601        | 48,690  | 運輸                     |
| COCHLEAR LIMITED               |              | 42      | 23    | 286        | 23,205  | ヘルスケア機器・サービス           |
| ORIGIN ENERGY LIMITED          |              | 482     | 580   | 301        | 24,408  | エネルギー                  |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA |              | 512     | 398   | 2,823      | 228,498 | 銀行                     |
| RIO TINTO LIMITED              |              | 74      | 98    | 526        | 42,627  | 素材                     |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD  |              | 934     | 748   | 389        | 31,497  | 保険                     |
| ORICA LTD                      |              | 194     | 145   | 236        | 19,099  | 素材                     |
| LENLEASE GROUP                 |              | 281     | 191   | 246        | 19,916  | 不動産                    |
| WORLEYPARSONS LTD              |              | 118     | —     | —          | —       | エネルギー                  |
| SUNCORP GROUP LTD              |              | 431     | 406   | 466        | 37,764  | 保険                     |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD    |              | 825     | 613   | 1,582      | 128,057 | 銀行                     |
| NEWCREST MINING LIMITED        |              | 305     | 198   | 504        | 40,818  | 素材                     |
| INCITEC PIVOT LTD              |              | 949     | 729   | 221        | 17,946  | 素材                     |
| AMP LIMITED                    |              | 1,205   | 865   | 382        | 30,971  | 各種金融                   |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED    |              | 558     | 439   | 412        | 33,410  | 保険                     |
| SANTOS LTD                     |              | 500     | 506   | 174        | 14,109  | エネルギー                  |
| SONIC HEALTHCARE LTD           |              | 213     | 139   | 287        | 23,239  | ヘルスケア機器・サービス           |
| TABCORP HOLDINGS LIMITED       |              | 631     | 413   | 191        | 15,470  | 消費者サービス                |
| WESFARMERS LIMITED             |              | 229     | 237   | 960        | 77,711  | 食品・生活必需品小売り            |
| ALUMINA LTD                    |              | 1,556   | 1,422 | 222        | 18,018  | 素材                     |
| ILUKA RESOURCES LIMITED        |              | 342     | —     | —          | —       | 素材                     |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD         |              | 157     | 168   | 470        | 38,064  | エネルギー                  |
| WOOLWORTHS LIMITED             |              | 283     | 284   | 647        | 52,364  | 食品・生活必需品小売り            |
| BRAMBLES LTD                   |              | 534     | 461   | 508        | 41,121  | 商業・専門サービス              |
| ASCIANO LTD                    |              | 570     | —     | —          | —       | 運輸                     |

| 銘柄                                 |         | 株数     | 期首(前期末) | 当期          |           | 業種等         |
|------------------------------------|---------|--------|---------|-------------|-----------|-------------|
|                                    |         |        | 株数      | 評価額         |           |             |
|                                    |         |        |         | 外貨建金額       | 邦貨換算金額    |             |
| (オーストラリア)                          |         | 百株     | 百株      | 千豪ドル        | 千円        |             |
| MACQUARIE GROUP LTD                |         | 103    | 85      | 636         | 51,477    | 各種金融        |
| CROWN RESORTS LIMITED              |         | 221    | 182     | 191         | 15,504    | 消費者サービス     |
| SYDNEY AIRPORT                     |         | 670    | 459     | 282         | 22,871    | 運輸          |
| AGL ENERGY LTD                     |         | 230    | 209     | 404         | 32,712    | 公益事業        |
| SOUTH32 LTD                        |         | 1,676  | 1,676   | 415         | 33,653    | 素材          |
| 小計                                 | 株数・金額   | 21,110 | 16,912  | 23,607      | 1,910,582 |             |
|                                    | 銘柄数<比率> | 41     | 38      | —           | <2.5%>    |             |
| (ニュージーランド)                         |         |        |         | 千ニュージーランドドル |           |             |
| CONTACT ENERGY LTD                 |         | 441    | 182     | 82          | 6,356     | 公益事業        |
| FLETCHER BUILDING LTD              |         | 289    | 289     | 274         | 21,208    | 素材          |
| SPARK NEW ZEALAND LTD              |         | 1,344  | 805     | 276         | 21,304    | 電気通信サービス    |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD          |         | 702    | 434     | 282         | 21,771    | 運輸          |
| 小計                                 | 株数・金額   | 2,777  | 1,711   | 915         | 70,641    |             |
|                                    | 銘柄数<比率> | 4      | 4       | —           | <0.1%>    |             |
| (香港)                               |         |        |         | 千香港ドル       |           |             |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY             |         | 198    | 134     | 1,002       | 13,651    | 半導体・半導体製造装置 |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD           |         | 1,090  | 990     | 1,607       | 21,897    | 不動産         |
| BANK OF EAST ASIA                  |         | 672    | 512     | 1,557       | 21,215    | 銀行          |
| CLP HOLDINGS LIMITED               |         | 225    | 345     | 2,694       | 36,698    | 公益事業        |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE         |         | 310    | 200     | 1,294       | 17,624    | 公益事業        |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR        |         | 353    | 265     | 5,363       | 73,052    | 各種金融        |
| LI & FUNG LTD                      |         | 2,280  | 2,280   | 829         | 11,303    | 耐久消費財・アパレル  |
| MTR CORPORATION                    |         | 680    | 520     | 2,189       | 29,816    | 運輸          |
| HANG SENG BANK                     |         | 232    | 206     | 2,855       | 38,887    | 銀行          |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT         |         | 520    | 420     | 1,787       | 24,341    | 不動産         |
| POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED      |         | 330    | 340     | 2,488       | 33,897    | 公益事業        |
| THE WHARF (HOLDINGS)               |         | 490    | 440     | 2,494       | 33,979    | 不動産         |
| HONG KONG & CHINA GAS              |         | 1,302  | 1,587   | 2,400       | 32,688    | 公益事業        |
| HYSAN DEVELOPMENT CO               |         | 430    | 360     | 1,251       | 17,038    | 不動産         |
| Galaxy Entertainment Group Limited |         | 970    | 770     | 2,483       | 33,821    | 消費者サービス     |
| KERRY PROPERTIES LTD               |         | 475    | 465     | 1,041       | 14,186    | 不動産         |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD         |         | 1,430  | 1,130   | 2,994       | 40,785    | 銀行          |
| NWS HOLDINGS LTD                   |         | 1,215  | 905     | 1,212       | 16,516    | 資本財         |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG           |         | 465    | 405     | 1,174       | 15,996    | 耐久消費財・アパレル  |
| NEW WORLD DEVLEOPMENT              |         | 2,690  | 2,050   | 1,808       | 24,626    | 不動産         |
| SINO LAND CO                       |         | 1,598  | 1,278   | 1,469       | 20,017    | 不動産         |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES            |         | 470    | 330     | 3,441       | 46,878    | 不動産         |
| SWIRE PACIFIC LTD A                |         | 280    | 165     | 1,314       | 17,899    | 不動産         |
| AIA GROUP LTD                      |         | 3,696  | 2,970   | 14,092      | 191,941   | 保険          |
| Sands China Ltd                    |         | 808    | 776     | 2,688       | 36,622    | 消費者サービス     |
| SWIRE PROPERTIES LTD               |         | 722    | 542     | 1,192       | 16,240    | 不動産         |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD          |         | 728    | 588     | 5,532       | 75,356    | 資本財         |
| Cheung Kong Property Holdings Ltd  |         | 823    | 648     | 3,358       | 45,737    | 不動産         |
| 小計                                 | 株数・金額   | 25,483 | 21,622  | 73,621      | 1,002,720 |             |
|                                    | 銘柄数<比率> | 28     | 28      | —           | <1.3%>    |             |
| (シンガポール)                           |         |        |         | 千シンガポールドル   |           |             |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING         |         | 410    | 630     | 193         | 14,598    | 資本財         |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD          |         | 6,310  | 4,160   | 153         | 11,617    | 食品・飲料・タバコ   |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD             |         | 410    | 310     | 468         | 35,378    | 銀行          |
| CITY DEVELOPMENTS                  |         | 310    | 220     | 187         | 14,114    | 不動産         |
| SEMBCORP MARINE LTD                |         | 798    | 568     | 76          | 5,787     | 資本財         |
| JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD       |         | 80     | 40      | 167         | 12,668    | 小売          |

| 銘                            | 柄             | 期首(前期末) |         | 当 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     |             |
| (シンガポール)                     |               | 百株      | 百株      | 千シンガポールドル  | 千円         |             |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD       |               | 460     | 190     | 133        | 10,096     | 各種金融        |
| CAPITALAND LIMITED           |               | 1,310   | 1,000   | 303        | 22,870     | 不動産         |
| GENTING SINGAPORE PLC        |               | 3,880   | 2,910   | 251        | 18,999     | 消費者サービス     |
| COMFORTDELGRO CORP LTD       |               | 1,230   | 690     | 169        | 12,759     | 運輸          |
| SINGAPORE AIRLINES LTD       |               | 320     | 260     | 255        | 19,271     | 運輸          |
| UNITED OVERSEAS BANK         |               | 280     | 200     | 368        | 27,791     | 銀行          |
| UNITED OVERSEAS LAND LTD     |               | 370     | 150     | 85         | 6,453      | 不動産         |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS     |               | 590     | 510     | 189        | 14,281     | メディア        |
| NOBLE GROUP LTD              |               | 4,120   | —       | —          | —          | 資本財         |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS |               | 1,977   | 1,767   | 682        | 51,482     | 電気通信サービス    |
| SEMBCORP INDUSTRIES LTD      |               | 690     | 630     | 162        | 12,268     | 資本財         |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP |               | 580     | 400     | 338        | 25,512     | 銀行          |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD     |               | 720     | 720     | 239        | 18,042     | 食品・飲料・タバコ   |
| KEPPEL CORP LTD              |               | 166     | 446     | 238        | 17,976     | 資本財         |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 25,011  | 15,801  | 4,663      | 351,973    |             |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 20      | 19      | —          | <0.5%>     |             |
| (イスラエル)                      |               |         |         | 千イスラエルシェケル |            |             |
| BANK HAPOLIM BM              |               | 125     | 125     | 279        | 7,738      | 銀行          |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL         |               | 737     | 579     | 892        | 24,698     | 銀行          |
| BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP   |               | 1,307   | 1,029   | 720        | 19,936     | 電気通信サービス    |
| ISRAEL CHEMICALS LTD         |               | 145     | 145     | 210        | 5,826      | 素材          |
| NICE LTD                     |               | 36      | 28      | 734        | 20,314     | ソフトウェア・サービス |
| 小 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 2,352   | 1,908   | 2,838      | 78,514     |             |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 5       | 5       | —          | <0.1%>     |             |
| 合 計                          | 株 数 ・ 金 額     | 346,177 | 268,612 | —          | 72,130,463 |             |
|                              | 銘 柄 数 < 比 率 > | 988     | 966     | —          | <93.4%>    |             |

(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) 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 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                 | 13        | 10  | 1,175  | 124,206 | 0.2       |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC           | 4         | 3   | 521    | 55,098  | 0.1       |
| BOSTON PROPERTIES INC               | 5         | 3   | 458    | 48,379  | 0.1       |
| CROWN CASTLE INTL CORP              | 11        | 8   | 698    | 73,830  | 0.1       |
| DIGITAL REALTY TRUST INC            | 5         | 4   | 434    | 45,889  | 0.1       |
| DUKE REALTY CORP                    | 15        | 11  | 294    | 31,082  | 0.0       |
| EQUINIX INC                         | —         | 1   | 660    | 69,718  | 0.1       |
| EQUITY RESIDENTIAL                  | 12        | 8   | 511    | 53,997  | 0.1       |
| EXTRA SPACE STORAGE INC             | 1         | 4   | 330    | 34,940  | 0.0       |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST           | 2         | 2   | 330    | 34,866  | 0.0       |
| HCP INC                             | 14        | 12  | 351    | 37,088  | 0.0       |
| HOST HOTELS & RESORTS INC           | 27        | 18  | 304    | 32,187  | 0.0       |
| IRON MOUNTAIN INC                   | 9         | 8   | 290    | 30,695  | 0.0       |
| KIMCO REALTY CORP                   | 16        | 12  | 316    | 33,430  | 0.0       |
| LIBERTY PROPERTY TRUST              | 7         | 5   | 222    | 23,467  | 0.0       |
| PLUM CREEK TIMBER CO INC (REIT)     | 7         | —   | —      | —       | —         |
| PROLOGIS INC                        | 17        | 13  | 664    | 70,234  | 0.1       |
| PUBLIC STORAGE                      | 4         | 3   | 776    | 82,003  | 0.1       |
| REALTY INCOME CORP                  | 9         | 7   | 428    | 45,250  | 0.1       |
| REGENCY CENTERS CORP                | 4         | 3   | 253    | 26,805  | 0.0       |
| SL GREEN REALTY CORP                | 4         | 3   | 327    | 34,627  | 0.0       |
| SIMON PROPERTY GROUP INC            | 9         | 7   | 1,399  | 147,782 | 0.2       |
| UDR INC                             | 6         | 8   | 307    | 32,452  | 0.0       |
| VENTAS INC                          | 10        | 8   | 544    | 57,477  | 0.1       |
| VORNADO REALTY TRUST                | 6         | 4   | 414    | 43,834  | 0.1       |
| WELLTOWER INC                       | 11        | 8   | 553    | 58,454  | 0.1       |
| WEYERHAEUSER CO                     | 18        | 17  | 510    | 53,901  | 0.1       |
| 小 計                                 | 口 数 ・ 金 額 | 262 | 205    | 13,080  | 1,381,703 |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                       | 26        | 26  | —      | <1.8%>  |           |
| (カナダ)                               |           |     | 千カナダドル |         |           |
| RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 10        | 8   | 227    | 17,952  | 0.0       |
| 小 計                                 | 口 数 ・ 金 額 | 10  | 8      | 227     | 17,952    |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                       | 1         | 1   | —      | <0.0%>  |           |
| (ユーロ…フランス)                          |           |     | 千ユーロ   |         |           |
| KLEPIERRE                           | 8         | 5   | 196    | 22,657  | 0.0       |
| GEICINA SA                          | 1         | 1   | 213    | 24,590  | 0.0       |
| FONCIERE DES REGIONS                | 2         | 1   | 142    | 16,497  | 0.0       |
| UNIBAIL-RODAMCO SE                  | 3         | 1   | 379    | 43,771  | 0.1       |
| ユ ー ロ 計                             | 口 数 ・ 金 額 | 14  | 10     | 931     | 107,515   |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                       | 4         | 4   | —      | <0.1%>  |           |
| (イギリス)                              |           |     | 千英ポンド  |         |           |
| BRITISH LAND CO PLC                 | 37        | 27  | 164    | 21,651  | 0.0       |
| HAMMERSON PLC                       | 35        | 24  | 136    | 17,921  | 0.0       |
| INTU PROPERTIES PLC                 | 49        | 35  | 96     | 12,726  | 0.0       |
| LAND SECURITIES GROUP PLC           | 29        | 19  | 198    | 26,066  | 0.0       |

| 銘 柄                                   |  | 期首(前期末) | 当 期 末 |       |           |           |
|---------------------------------------|--|---------|-------|-------|-----------|-----------|
|                                       |  |         | 口 数   | 口 数   | 評 価 額     |           |
|                                       |  |         |       |       | 外貨建金額     | 邦貨換算金額    |
| (イギリス)                                |  |         | 千口    | 千口    | 千英ポンド     | 千円        |
| SEGREO PLC                            |  |         | 40    | 29    | 122       | 16,073    |
| 小 計                                   |  |         | 192   | 137   | 718       | 94,440    |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                         |  |         | 5     | 5     | —         | <0.1%>    |
| (オーストラリア)                             |  |         |       |       | 千豪ドル      |           |
| MIRVAC GROUP                          |  |         | 207   | 149   | 303       | 24,523    |
| GPT GROUP                             |  |         | 95    | 70    | 324       | 26,258    |
| STOCKLAND                             |  |         | 115   | 79    | 343       | 27,814    |
| GOODMAN GROUP                         |  |         | 82    | 61    | 413       | 33,502    |
| SCENTRE GROUP                         |  |         | 148   | 128   | 548       | 44,393    |
| WESTFIELD CORP                        |  |         | 75    | 57    | 500       | 40,510    |
| VICINITY CENTRES                      |  |         | 125   | 126   | 358       | 29,048    |
| 小 計                                   |  |         | 850   | 674   | 2,793     | 226,051   |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                         |  |         | 7     | 7     | —         | <0.3%>    |
| (香港)                                  |  |         |       |       | 千香港ドル     |           |
| LINK REIT                             |  |         | 65    | 55    | 3,044     | 41,461    |
| 小 計                                   |  |         | 65    | 55    | 3,044     | 41,461    |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                         |  |         | 1     | 1     | —         | <0.1%>    |
| (シンガポール)                              |  |         |       |       | 千シンガポールドル |           |
| CAPITALAND MALL TRUST                 |  |         | 119   | 109   | 220       | 16,619    |
| ASCENDAS REAL ESTATE INVESTMENT TRUST |  |         | 126   | 100   | 234       | 17,662    |
| 小 計                                   |  |         | 245   | 209   | 454       | 34,281    |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                         |  |         | 2     | 2     | —         | <0.0%>    |
| 合 計                                   |  |         | 1,640 | 1,301 | —         | 1,903,407 |
| 銘 柄 数 < 比 率 >                         |  |         | 46    | 46    | —         | <2.5%>    |

(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 |              | 百万円   | 百万円   |
|       |        | S&P 500 EMIN | 1,779 | —     |
|       |        | DJ EU STX 50 | 583   | —     |
|       |        | FTSE 100 IDX | 578   | —     |

(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

(2016年11月10日現在)

| 項 目          | 当 期 末      |       |
|--------------|------------|-------|
|              | 評 価 額      | 比 率   |
|              | 千円         | %     |
| 株式           | 72,130,463 | 93.0  |
| 投資証券         | 1,903,407  | 2.5   |
| コール・ローン等、その他 | 3,549,242  | 4.5   |
| 投資信託財産総額     | 77,583,112 | 100.0 |

(注) 当期末における外貨建純資産 (77,229,191千円) の投資信託財産総額 (77,583,112千円) に対する比率は99.5%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=105.63円、1カナダドル=78.75円、1ユーロ=115.44円、1英ポンド=131.40円、1スイスフラン=107.35円、1スウェーデンクローネ=11.68円、1ノルウェークローネ=12.70円、1デンマーククローネ=15.51円、1豪ドル=80.93円、1ニュージーランドドル=77.14円、1香港ドル=13.62円、1シンガポールドル=75.48円、1イスラエルシェケル=27.66円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年11月10日現在)

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 77,889,110,769  |
| コール・ローン等        | 794,250,559     |
| 株式(評価額)         | 72,130,463,157  |
| 投資証券(評価額)       | 1,903,407,107   |
| 未収入金            | 2,063,017,702   |
| 未収配当金           | 98,365,171      |
| 差入委託証拠金         | 899,607,073     |
| (B) 負債          | 631,178,390     |
| 未払金             | 320,674,805     |
| 未払解約金           | 310,502,823     |
| 未払利息            | 762             |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 77,257,932,379  |
| 元本              | 43,385,534,877  |
| 次期繰越損益金         | 33,872,397,502  |
| (D) 受益権総口数      | 43,385,534,877口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 17,807円         |

(注) 当親ファンドの期首元本額は57,054,697,450円、期中追加設定元本額は10,603,699,292円、期中一部解約元本額は24,272,861,865円です。

&lt;元本の内訳&gt;

|                               |                 |
|-------------------------------|-----------------|
| TMA外国株式インデックスVA<適格機関投資家限定>    | 20,076,511,301円 |
| TMA世界バランスファンド3.5VA<適格機関投資家限定> | 15,943,080,167円 |
| TMA世界バランスファンド5.5VA<適格機関投資家限定> | 6,599,927,496円  |
| 東京海上セレクション・外国株式インデックス         | 631,080,836円    |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)      | 80,595,012円     |
| L P S 4 資産分散ファンド(積極型)         | 19,669,195円     |
| L P S 4 資産分散ファンド(成長重視型)       | 15,200,264円     |
| L P S 4 資産分散ファンド(バランス型)       | 11,232,585円     |
| TMA資産分散型バランスVA(適格機関投資家限定)     | 3,574,864円      |
| L P S 4 資産分散ファンド(安定重視型)       | 2,277,647円      |
| L P S 4 資産分散ファンド(慎重型)         | 1,809,819円      |
| TMA債券重視型バランスVA(適格機関投資家限定)     | 504,623円        |
| TMA新興国重視型バランスVA(適格機関投資家限定)    | 71,068円         |

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.7807円です。

## ○損益の状況 (2015年11月11日～2016年11月10日)

| 項 目                | 当 期             |
|--------------------|-----------------|
|                    | 円               |
| (A) 配当等収益          | 2,078,718,276   |
| 受取配当金              | 2,069,359,943   |
| 受取利息               | 261,168         |
| その他収益金             | 9,256,543       |
| 支払利息               | △ 159,378       |
| (B) 有価証券売買損益       | △14,565,927,213 |
| 売買益                | 7,257,708,370   |
| 売買損                | △21,823,635,583 |
| (C) 先物取引等取引損益      | 50,238,943      |
| 取引益                | 547,691,640     |
| 取引損                | △ 497,452,697   |
| (D) 保管費用等          | △ 22,737,230    |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △12,459,707,224 |
| (F) 前期繰越損益金        | 57,546,861,262  |
| (G) 追加信託差損益金       | 7,781,065,256   |
| (H) 解約差損益金         | △18,995,821,792 |
| (I) 計(E+F+G+H)     | 33,872,397,502  |
| 次期繰越損益金(I)         | 33,872,397,502  |

(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11期（決算日 2016年11月10日）

（計算期間 2015年11月11日～2016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、－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  | 純 資 産   |
|------------------|--------|-----------|---------|-----------|-----|------|---------|
|                  |        | 期 騰 落 中 率 |         | 期 騰 落 中 率 |     |      |         |
|                  | 円      | %         |         | %         |     | %    | 百万円     |
| 7期(2012年11月12日)  | 10,238 | 6.6       | 176.129 | 6.6       |     | 98.5 | 298,564 |
| 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 | △10.6     |     | 98.6 | 103,516 |

## ○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 | 券 率  |
|-------------|--------|-------|---------|-------|-----|-----|------|
|             |        | 騰 落 率 |         | 騰 落 率 |     |     |      |
| (期 首)       | 円      | %     |         | %     |     |     | %    |
| 2015年11月10日 | 15,790 | －     | 271.842 | －     |     |     | 98.3 |
| 11月末        | 15,841 | 0.3   | 272.686 | 0.3   |     |     | 98.4 |
| 12月末        | 15,620 | △ 1.1 | 268.806 | △ 1.1 |     |     | 98.5 |
| 2016年1月末    | 15,865 | 0.5   | 273.123 | 0.5   |     |     | 98.1 |
| 2月末         | 15,054 | △ 4.7 | 259.085 | △ 4.7 |     |     | 98.4 |
| 3月末         | 15,319 | △ 3.0 | 263.732 | △ 3.0 |     |     | 97.2 |
| 4月末         | 14,838 | △ 6.0 | 255.371 | △ 6.1 |     |     | 96.5 |
| 5月末         | 14,981 | △ 5.1 | 257.816 | △ 5.2 |     |     | 98.5 |
| 6月末         | 14,147 | △10.4 | 243.376 | △10.5 |     |     | 98.6 |
| 7月末         | 14,380 | △ 8.9 | 247.403 | △ 9.0 |     |     | 98.8 |
| 8月末         | 14,276 | △ 9.6 | 245.574 | △ 9.7 |     |     | 98.6 |
| 9月末         | 14,002 | △11.3 | 240.907 | △11.4 |     |     | 98.9 |
| 10月末        | 14,031 | △11.1 | 241.337 | △11.2 |     |     | 98.9 |
| (期 末)       |        |       |         |       |     |     |      |
| 2016年11月10日 | 14,050 | △11.0 | 243.067 | △10.6 |     |     | 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

(2015年11月11日～2016年11月10日)

## ■期中の基準価額等の推移

期 首：15,790円

期 末：14,050円

騰落率：△11.0%

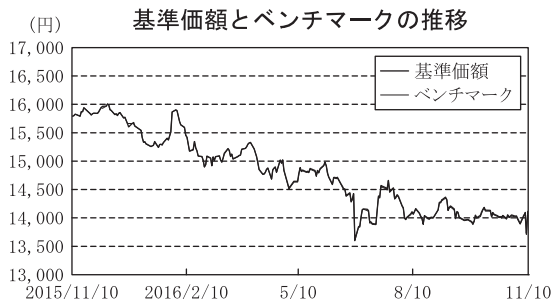
## ◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・ECB（欧州中央銀行）による金融緩和政策を背景にドイツ国債利回りが低下（債券価格は上昇）したこと

マイナス要因

- ・投資家のリスク回避姿勢の強まりなどを背景に、米ドル、ユーロに対して円高が進行したこと



## ■投資環境

## 【外国債券市場動向】

米国債利回りは、低下しました。

期初、FOMC（米連邦公開市場委員会）の声明を受けて、米国の利上げ観測が高まり、その後、2015年12月に米国の政策金利が引き上げられたことから、米国債利回りは上昇しました。

2016年1月から7月上旬にかけては、世界経済の先行きや、英国のEU（欧州連合）離脱による世界経済への影響に対する懸念から、米国の追加利上げ観測が後退し、米国債利回りは低下基調で推移しました。

その後、事前予想を大幅に上回る米国雇用統計などから米国債利回りは上昇に転じ、11月上旬の米大統領選でトランプ候補が勝利したことを受け、米国債利回りは更に上昇しましたが、前期末からは低下した水準で期を終えました。

ドイツ国債利回りは低下しました。

期初、ECBが追加金融緩和の可能性を示唆したことなどをきっかけにドイツ国債利回りは低下しました。その後、2015年12月にECBによる追加金融緩和策が発表されると、内容が市場の期待を下回っていたことなどから、ドイツ国債利回りは一時上昇に転じる局面がありましたが、2016年1月以降は、中国株式市場の下落や欧州金融機関の信用不安などから、ドイツ国債利回りは再び低下基調となりました。

7月中旬以降は、米国債利回りの上昇のほか、英国中央銀行やECBの政策金利据え置き、またドラギECB総裁の発言により追加金融緩和期待が後退したことから、ドイツ国債利回りは上昇に転じましたが、前期末からは低下した水準で期を終えました。

## 【外国為替市場動向】

米ドル円相場は円高米ドル安、ユーロ円相場は円高ユーロ安で期を終えました。

期初、米国の利上げ観測が円安米ドル高圧力となった一方、世界経済の先行き懸念や原油価格の下落などを背景とした投資家のリスク回避姿勢が円高米ドル安圧力となったことにより、米ドル円相場はレンジ内で推移しました。2016年1月以降は、米国の追加利上げ観測の後退や景況感の悪化、EUの離脱をめぐる英国の国民投票などから投資家のリスク回避姿勢が強まり、大幅に円高が進行しましたが、その後は徐々に円安が進む展開となりました。期末にかけては、米大統領選で予想に反してトランプ候補が勝利すると、一旦は円高米ドル安となりましたが、翌日には米国の長期金利の上昇などをを受けて、急激に円安米ドル高が進みました。以上のような経過を経て、前期末対比では円高米ドル安で期を終えました。

ユーロ円相場も投資家のリスク回避姿勢が強まったことを受けて円高が進行し、前期末対比円高ユーロ安となりました。

## ■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しています。

ベンチマークの騰落率△10.6%に対して、基準価額の騰落率は△11.0%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。

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0.052%となっています。

※2016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、ベンチマークとの連動性を高位に維持するよう運用する方針です。

## ○1万口当たりの費用明細

（2015年11月11日～2016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<br>1 | %<br>0.009 | (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 ）           | (1)    | (0.009)    | *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                   | 1      | 0.009      |                                                    |
| 期中の平均基準価額は、14,862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。

(2015年11月11日～2016年11月10日)

|         |        |       | 買 付 額                 | 売 付 額                 |
|---------|--------|-------|-----------------------|-----------------------|
| 外       | アメリカ   | 国債証券  | 千米ドル<br>121,329       | 千米ドル<br>239,183       |
|         | カナダ    | 国債証券  | 千カナダドル<br>2,938       | 千カナダドル<br>9,269       |
|         | メキシコ   | 国債証券  | 千メキシコペソ<br>13,245     | 千メキシコペソ<br>46,123     |
|         | ユーロ    |       | 千ユーロ                  | 千ユーロ                  |
|         | ドイツ    | 国債証券  | 8,629                 | 28,020                |
|         | イタリア   | 国債証券  | 10,604                | 38,098                |
|         | フランス   | 国債証券  | 10,864                | 37,303                |
|         | オランダ   | 国債証券  | 5,543                 | 12,466                |
|         | スペイン   | 国債証券  | 3,947                 | 17,775                |
|         | ベルギー   | 国債証券  | 4,112                 | 10,703                |
|         | オーストリア | 国債証券  | 2,117                 | 6,994                 |
|         | フィンランド | 国債証券  | —                     | 1,607                 |
|         | アイルランド | 国債証券  | 1,885                 | 4,374                 |
|         | イギリス   | 国債証券  | 千英ポンド<br>8,387        | 千英ポンド<br>25,925       |
|         | スイス    | 国債証券  | 千スイスフラン<br>307        | 千スイスフラン<br>524        |
|         | スウェーデン | 国債証券  | 千スウェーデンクローネ<br>12,092 | 千スウェーデンクローネ<br>20,308 |
|         | ノルウェー  | 国債証券  | 千ノルウェークローネ<br>3,491   | 千ノルウェークローネ<br>8,546   |
|         | デンマーク  | 国債証券  | 千デンマーククローネ<br>3,308   | 千デンマーククローネ<br>15,605  |
|         | 国      | ポーランド | 国債証券                  | 千ポーランドズロチ<br>5,874    |
| オーストラリア |        | 国債証券  | 千豪ドル<br>4,177         | 千豪ドル<br>8,562         |
| シンガポール  |        | 国債証券  | 千シンガポールドル<br>1,068    | 千シンガポールドル<br>1,608    |
| マレーシア   |        | 国債証券  | 千マレーシアリングgit<br>1,501 | 千マレーシアリングgit<br>4,848 |
| 南アフリカ   |        | 国債証券  | 千南アフリカランド<br>—        | 千南アフリカランド<br>10,807   |

### ○利害関係人との取引状況等

(2015年11月11日～2016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

(2016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 末                 |                       |                  |           |                    |           |           |          |
|---------|-----------------------|-----------------------|------------------|-----------|--------------------|-----------|-----------|----------|
|         | 額面金額                  | 評 価 額                 |                  | 組入比率      | うちBB格以下<br>組 入 比 率 | 残存期間別組入比率 |           |          |
|         |                       | 外貨建金額                 | 邦貨換算金額           |           |                    | 5年以上      | 2年以上      | 2年未満     |
| アメリカ    | 千米ドル<br>406,240       | 千米ドル<br>421,294       | 千円<br>44,501,370 | %<br>43.0 | %<br>—             | %<br>18.0 | %<br>18.9 | %<br>6.1 |
| カナダ     | 千カナダドル<br>23,310      | 千カナダドル<br>27,049      | 2,130,176        | 2.1       | —                  | 1.0       | 0.5       | 0.6      |
| メキシコ    | 千メキシコペソ<br>148,910    | 千メキシコペソ<br>166,490    | 887,395          | 0.9       | —                  | 0.5       | 0.3       | 0.1      |
| ユーロ     | 千ユーロ                  | 千ユーロ                  |                  |           |                    |           |           |          |
| ドイツ     | 53,460                | 65,162                | 7,522,388        | 7.3       | —                  | 4.3       | 2.7       | 0.3      |
| イタリア    | 71,820                | 86,428                | 9,977,307        | 9.6       | —                  | 5.9       | 3.0       | 0.7      |
| フランス    | 69,390                | 86,748                | 10,014,252       | 9.7       | —                  | 6.2       | 3.2       | 0.3      |
| オランダ    | 16,720                | 20,964                | 2,420,195        | 2.3       | —                  | 1.5       | 0.7       | 0.1      |
| スペイン    | 41,085                | 50,120                | 5,785,943        | 5.6       | —                  | 3.5       | 1.6       | 0.5      |
| ベルギー    | 17,470                | 22,830                | 2,635,577        | 2.5       | —                  | 1.9       | 0.6       | —        |
| オーストリア  | 10,510                | 13,527                | 1,561,612        | 1.5       | —                  | 0.9       | 0.6       | —        |
| フィンランド  | 4,600                 | 5,454                 | 629,634          | 0.6       | —                  | 0.4       | 0.3       | —        |
| アイルランド  | 5,720                 | 7,036                 | 812,240          | 0.8       | —                  | 0.4       | 0.3       | —        |
| イギリス    | 千英ポンド<br>43,290       | 千英ポンド<br>55,565       | 7,301,329        | 7.1       | —                  | 5.0       | 1.7       | 0.3      |
| スイス     | 千スイスフラン<br>1,820      | 千スイスフラン<br>2,270      | 243,738          | 0.2       | —                  | 0.1       | 0.1       | —        |
| スウェーデン  | 千スウェーデンクローネ<br>31,420 | 千スウェーデンクローネ<br>38,474 | 449,387          | 0.4       | —                  | 0.3       | 0.2       | —        |
| ノルウェー   | 千ノルウェークローネ<br>19,000  | 千ノルウェークローネ<br>20,876  | 265,136          | 0.3       | —                  | 0.1       | 0.1       | —        |
| デンマーク   | 千デンマーククローネ<br>33,760  | 千デンマーククローネ<br>45,193  | 700,953          | 0.7       | —                  | 0.5       | 0.2       | —        |
| ポーランド   | 千ポーランドズロチ<br>22,300   | 千ポーランドズロチ<br>23,731   | 631,485          | 0.6       | —                  | 0.2       | 0.2       | 0.2      |
| オーストラリア | 千豪ドル<br>23,260        | 千豪ドル<br>26,278        | 2,126,706        | 2.1       | —                  | 1.2       | 0.7       | 0.1      |
| シンガポール  | 千シンガポールドル<br>4,600    | 千シンガポールドル<br>4,994    | 377,010          | 0.4       | —                  | 0.2       | 0.1       | 0.1      |
| マレーシア   | 千マレーシアリンギット<br>19,800 | 千マレーシアリンギット<br>20,463 | 508,527          | 0.5       | —                  | 0.2       | 0.2       | 0.1      |
| 南アフリカ   | 千南アフリカランド<br>77,500   | 千南アフリカランド<br>69,243   | 542,871          | 0.5       | —                  | 0.4       | 0.1       | —        |
| 合 計     | —                     | —                     | 102,025,241      | 98.6      | —                  | 52.9      | 36.2      | 9.4      |

(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) 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 |       |       |         |            |
|------------------|-------|-------|-------|---------|------------|
|                  | 利率    | 額面金額  | 評 価 額 |         | 償還年月日      |
|                  |       |       | 外貨建金額 | 邦貨換算金額  |            |
| (アメリカ)<br>国債証券   | %     | 千米ドル  | 千米ドル  | 千円      |            |
| T 0 3/4 03/31/18 | 0.75  | 9,000 | 8,990 | 949,704 | 2018/3/31  |
| T 0 3/4 12/31/17 | 0.75  | 4,500 | 4,498 | 475,186 | 2017/12/31 |
| T 1 05/31/18     | 1.0   | 2,000 | 2,004 | 211,738 | 2018/5/31  |
| T 1 06/30/19     | 1.0   | 2,000 | 1,997 | 210,979 | 2019/6/30  |
| T 1 08/15/18     | 1.0   | 6,000 | 6,011 | 634,968 | 2018/8/15  |
| T 1 08/31/19     | 1.0   | 4,000 | 3,990 | 421,463 | 2019/8/31  |
| T 1 1/2 01/31/19 | 1.5   | 4,000 | 4,044 | 427,240 | 2019/1/31  |
| T 1 1/2 02/28/19 | 1.5   | 7,500 | 7,587 | 801,508 | 2019/2/28  |
| T 1 1/2 12/31/18 | 1.5   | 5,000 | 5,056 | 534,091 | 2018/12/31 |
| T 1 1/4 02/29/20 | 1.25  | 3,000 | 3,006 | 317,533 | 2020/2/29  |
| T 1 1/4 11/30/18 | 1.25  | 6,000 | 6,037 | 637,741 | 2018/11/30 |
| T 1 1/8 05/31/19 | 1.125 | 5,000 | 5,011 | 529,387 | 2019/5/31  |
| T 1 1/8 08/31/21 | 1.125 | 5,000 | 4,917 | 519,402 | 2021/8/31  |
| T 1 1/8 12/31/19 | 1.125 | 2,000 | 1,998 | 211,061 | 2019/12/31 |
| T 1 11/30/19     | 1.0   | 3,000 | 2,988 | 315,652 | 2019/11/30 |
| T 1 3/4 05/15/22 | 1.75  | 4,500 | 4,529 | 478,417 | 2022/5/15  |
| T 1 3/4 05/15/23 | 1.75  | 8,500 | 8,480 | 895,820 | 2023/5/15  |
| T 1 3/4 09/30/22 | 1.75  | 4,500 | 4,514 | 476,894 | 2022/9/30  |
| T 1 3/4 10/31/18 | 1.75  | 3,000 | 3,048 | 322,039 | 2018/10/31 |
| T 1 3/8 02/28/19 | 1.375 | 5,000 | 5,045 | 532,936 | 2019/2/28  |
| T 1 3/8 03/31/20 | 1.375 | 3,000 | 3,014 | 318,400 | 2020/3/31  |
| T 1 3/8 04/30/21 | 1.375 | 3,000 | 2,989 | 315,800 | 2021/4/30  |
| T 1 3/8 05/31/20 | 1.375 | 5,500 | 5,520 | 583,143 | 2020/5/31  |
| T 1 3/8 06/30/18 | 1.375 | 1,500 | 1,512 | 159,769 | 2018/6/30  |
| T 1 3/8 09/30/18 | 1.375 | 7,000 | 7,059 | 745,706 | 2018/9/30  |
| T 1 3/8 09/30/20 | 1.375 | 4,500 | 4,504 | 475,854 | 2020/9/30  |
| T 1 5/8 02/15/26 | 1.625 | 4,500 | 4,336 | 458,066 | 2026/2/15  |
| T 1 5/8 03/31/19 | 1.625 | 7,000 | 7,098 | 749,865 | 2019/3/31  |
| T 1 5/8 05/15/26 | 1.625 | 5,000 | 4,810 | 508,096 | 2026/5/15  |
| T 1 5/8 08/15/22 | 1.625 | 4,500 | 4,491 | 474,443 | 2022/8/15  |
| T 1 5/8 11/15/22 | 1.625 | 5,500 | 5,470 | 577,878 | 2022/11/15 |
| T 1 5/8 12/31/19 | 1.625 | 3,000 | 3,042 | 321,420 | 2019/12/31 |
| T 1 7/8 09/30/17 | 1.875 | 3,000 | 3,030 | 320,058 | 2017/9/30  |
| T 1 7/8 11/30/21 | 1.875 | 3,500 | 3,556 | 375,654 | 2021/11/30 |
| T 2 02/15/22     | 2.0   | 5,500 | 5,619 | 593,628 | 2022/2/15  |
| T 2 02/15/23     | 2.0   | 8,500 | 8,624 | 910,972 | 2023/2/15  |
| T 2 02/15/25     | 2.0   | 4,000 | 4,005 | 423,081 | 2025/2/15  |
| T 2 02/28/21     | 2.0   | 6,000 | 6,144 | 649,030 | 2021/2/28  |
| T 2 07/31/22     | 2.0   | 4,500 | 4,582 | 484,024 | 2022/7/31  |
| T 2 08/15/25     | 2.0   | 5,200 | 5,189 | 548,203 | 2025/8/15  |
| T 2 1/2 02/15/45 | 2.5   | 5,600 | 5,189 | 548,133 | 2045/2/15  |
| T 2 1/2 02/15/46 | 2.5   | 4,100 | 3,789 | 400,263 | 2046/2/15  |
| T 2 1/2 05/15/24 | 2.5   | 5,000 | 5,217 | 551,132 | 2024/5/15  |
| T 2 1/2 08/15/23 | 2.5   | 4,000 | 4,177 | 441,236 | 2023/8/15  |

| 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    |            |
| (アメリカ)<br>国債証券   | %     | 千米ドル  | 千米ドル   | 千円        |            |
| T 2 1/4 03/31/21 | 2.25  | 3,000 | 3,102  | 327,684   | 2021/3/31  |
| T 2 1/4 04/30/21 | 2.25  | 2,500 | 2,586  | 273,173   | 2021/4/30  |
| T 2 1/4 07/31/21 | 2.25  | 3,500 | 3,619  | 382,298   | 2021/7/31  |
| T 2 1/4 08/15/46 | 2.25  | 1,800 | 1,575  | 166,456   | 2046/8/15  |
| T 2 1/4 11/15/24 | 2.25  | 6,500 | 6,646  | 702,097   | 2024/11/15 |
| T 2 1/8 05/15/25 | 2.125 | 2,800 | 2,826  | 298,606   | 2025/5/15  |
| T 2 1/8 01/31/21 | 2.125 | 5,000 | 5,146  | 543,581   | 2021/1/31  |
| T 2 1/8 06/30/21 | 2.125 | 3,500 | 3,601  | 380,420   | 2021/6/30  |
| T 2 1/8 08/15/21 | 2.125 | 5,000 | 5,142  | 543,210   | 2021/8/15  |
| T 2 1/8 08/31/20 | 2.125 | 5,500 | 5,663  | 598,257   | 2020/8/31  |
| T 2 11/15/21     | 2.0   | 4,000 | 4,089  | 431,960   | 2021/11/15 |
| T 2 3/4 02/15/19 | 2.75  | 5,600 | 5,822  | 615,050   | 2019/2/15  |
| T 2 3/4 02/15/24 | 2.75  | 3,700 | 3,925  | 414,647   | 2024/2/15  |
| T 2 3/4 02/28/18 | 2.75  | 7,500 | 7,688  | 812,154   | 2018/2/28  |
| T 2 3/4 11/15/23 | 2.75  | 3,500 | 3,712  | 392,176   | 2023/11/15 |
| T 2 3/8 06/30/18 | 2.375 | 1,500 | 1,536  | 162,331   | 2018/6/30  |
| T 2 3/8 08/15/24 | 2.375 | 6,000 | 6,201  | 655,071   | 2024/8/15  |
| T 2 3/8 12/31/20 | 2.375 | 4,000 | 4,158  | 439,288   | 2020/12/31 |
| T 2 5/8 08/15/20 | 2.625 | 5,500 | 5,763  | 608,833   | 2020/8/15  |
| T 2 5/8 11/15/20 | 2.625 | 5,500 | 5,770  | 609,559   | 2020/11/15 |
| T 2 7/8 03/31/18 | 2.875 | 7,000 | 7,197  | 760,263   | 2018/3/31  |
| T 2 7/8 08/15/45 | 2.875 | 5,500 | 5,502  | 581,237   | 2045/8/15  |
| T 3 05/15/42     | 3.0   | 4,300 | 4,446  | 469,715   | 2042/5/15  |
| T 3 1/2 02/15/39 | 3.5   | 1,500 | 1,708  | 180,454   | 2039/2/15  |
| T 3 1/2 05/15/20 | 3.5   | 7,500 | 8,075  | 853,065   | 2020/5/15  |
| T 3 1/8 02/15/42 | 3.125 | 2,000 | 2,115  | 223,423   | 2042/2/15  |
| T 3 1/8 02/15/43 | 3.125 | 1,700 | 1,794  | 189,559   | 2043/2/15  |
| T 3 1/8 05/15/19 | 3.125 | 9,000 | 9,463  | 999,614   | 2019/5/15  |
| T 3 1/8 05/15/21 | 3.125 | 4,000 | 4,290  | 453,152   | 2021/5/15  |
| T 3 1/8 08/15/44 | 3.125 | 4,900 | 5,161  | 545,164   | 2044/8/15  |
| T 3 1/8 11/15/41 | 3.125 | 1,000 | 1,057  | 111,687   | 2041/11/15 |
| T 3 11/15/45     | 3.0   | 3,800 | 3,895  | 411,460   | 2045/11/15 |
| T 3 3/4 08/15/41 | 3.75  | 1,900 | 2,226  | 235,191   | 2041/8/15  |
| T 3 3/8 11/15/19 | 3.375 | 9,500 | 10,131 | 1,070,201 | 2019/11/15 |
| T 3 5/8 02/15/20 | 3.625 | 3,900 | 4,202  | 443,948   | 2020/2/15  |
| T 3 5/8 02/15/21 | 3.625 | 5,000 | 5,457  | 576,508   | 2021/2/15  |
| T 3 5/8 02/15/44 | 3.625 | 5,800 | 6,690  | 706,705   | 2044/2/15  |
| T 3 5/8 08/15/43 | 3.625 | 3,000 | 3,464  | 365,933   | 2043/8/15  |
| T 3 7/8 08/15/40 | 3.875 | 1,300 | 1,552  | 163,967   | 2040/8/15  |
| T 3.75 11/15/18  | 3.75  | 6,000 | 6,336  | 669,331   | 2018/11/15 |
| T 4 1/2 02/15/36 | 4.5   | 600   | 786    | 83,099    | 2036/2/15  |
| T 4 1/2 08/15/39 | 4.5   | 1,200 | 1,566  | 165,426   | 2039/8/15  |
| T 4 1/4 05/15/39 | 4.25  | 400   | 505    | 53,369    | 2039/5/15  |
| T 4 1/4 11/15/17 | 4.25  | 7,000 | 7,247  | 765,578   | 2017/11/15 |

| 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     |            |
| (アメリカ)<br>国債証券       | %     | 千米ドル    | 千米ドル    | 千円         |            |
| T 4 3/4 02/15/41     | 4.75  | 1,800   | 2,435   | 257,230    | 2041/2/15  |
| T 4 3/8 02/15/38     | 4.375 | 200     | 258     | 27,283     | 2038/2/15  |
| T 4 3/8 05/15/41     | 4.375 | 1,900   | 2,442   | 257,989    | 2041/5/15  |
| T 4 3/8 11/15/39     | 4.375 | 800     | 1,025   | 108,369    | 2039/11/15 |
| T 4 5/8 02/15/40     | 4.625 | 800     | 1,061   | 112,152    | 2040/2/15  |
| T 5 05/15/37         | 5.0   | 350     | 488     | 51,547     | 2037/5/15  |
| T 5 1/2 08/15/28     | 5.5   | 1,000   | 1,342   | 141,816    | 2028/8/15  |
| T 5 1/4 02/15/29     | 5.25  | 690     | 914     | 96,600     | 2029/2/15  |
| T 5 3/8 02/15/31     | 5.375 | 1,000   | 1,382   | 146,000    | 2031/2/15  |
| T 6 02/15/26         | 6.0   | 1,500   | 2,005   | 211,883    | 2026/2/15  |
| T 6 1/2 11/15/26     | 6.5   | 350     | 490     | 51,822     | 2026/11/15 |
| T 6 1/4 08/15/23     | 6.25  | 3,200   | 4,115   | 434,746    | 2023/8/15  |
| T 6 1/8 11/15/27     | 6.125 | 490     | 681     | 71,968     | 2027/11/15 |
| T 8 1/8 08/15/19     | 8.125 | 2,060   | 2,455   | 259,400    | 2019/8/15  |
| 小 計                  |       |         |         | 44,501,370 |            |
| (カナダ)<br>国債証券        |       | 千カナダドル  | 千カナダドル  |            |            |
| CAN 0 3/4 03/01/21   | 0.75  | 1,000   | 1,000   | 78,821     | 2021/3/1   |
| CAN 1 1/2 06/01/23   | 1.5   | 1,200   | 1,234   | 97,246     | 2023/6/1   |
| CAN 1 1/2 06/01/26   | 1.5   | 1,200   | 1,221   | 96,201     | 2026/6/1   |
| CAN 1 1/4 03/01/18   | 1.25  | 1,000   | 1,008   | 79,421     | 2018/3/1   |
| CAN 1 1/4 09/01/18   | 1.25  | 3,000   | 3,035   | 239,009    | 2018/9/1   |
| CAN 2 1/2 06/01/24   | 2.5   | 1,000   | 1,095   | 86,301     | 2024/6/1   |
| CAN 2 3/4 12/01/48   | 2.75  | 600     | 705     | 55,530     | 2048/12/1  |
| CAN 3 1/2 06/01/20   | 3.5   | 1,200   | 1,318   | 103,794    | 2020/6/1   |
| CAN 3 1/2 12/01/45   | 3.5   | 1,400   | 1,854   | 146,026    | 2045/12/1  |
| CAN 3 1/4 06/01/21   | 3.25  | 1,200   | 1,331   | 104,894    | 2021/6/1   |
| CAN 3 3/4 06/01/19   | 3.75  | 2,800   | 3,023   | 238,117    | 2019/6/1   |
| CAN 4 06/01/41       | 4.0   | 1,000   | 1,391   | 109,612    | 2041/6/1   |
| CAN 4 1/4 06/01/18   | 4.25  | 3,150   | 3,327   | 262,053    | 2018/6/1   |
| CAN 5 06/01/37       | 5.0   | 810     | 1,222   | 96,255     | 2037/6/1   |
| CAN 5 3/4 06/01/33   | 5.75  | 900     | 1,398   | 110,112    | 2033/6/1   |
| CAN 5.75 06/01/29    | 5.75  | 810     | 1,185   | 93,361     | 2029/6/1   |
| CAN 8 06/01/27       | 8.0   | 600     | 980     | 77,182     | 2027/6/1   |
| CAN 9 06/01/25       | 9.0   | 440     | 714     | 56,235     | 2025/6/1   |
| 小 計                  |       |         |         | 2,130,176  |            |
| (メキシコ)<br>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  | 9,000   | 12,320  | 65,666     | 2036/11/20 |
| MBONO 10 12/05/24    | 10.0  | 20,000  | 25,003  | 133,266    | 2024/12/5  |
| MBONO 6 1/2 06/09/22 | 6.5   | 7,000   | 7,192   | 38,336     | 2022/6/9   |
| MBONO 7 1/2 06/03/27 | 7.5   | 10,000  | 10,936  | 58,288     | 2027/6/3   |
| MBONO 7 3/4 05/29/31 | 7.75  | 16,000  | 17,820  | 94,984     | 2031/5/29  |
| MBONO 7 3/4 11/13/42 | 7.75  | 10,000  | 11,160  | 59,482     | 2042/11/13 |
| MBONO 7 3/4 12/14/17 | 7.75  | 12,000  | 12,325  | 65,693     | 2017/12/14 |
| MBONO 8 06/11/20     | 8.0   | 23,000  | 24,660  | 131,440    | 2020/6/11  |

| 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  |            |
| (メキシコ)<br>国債証券       | %     | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 千円      |            |
| MBONO 8 1/2 11/18/38 | 8.5   | 3,910   | 4,725   | 25,185  | 2038/11/18 |
| MBONO 8 1/2 12/13/18 | 8.5   | 34,000  | 35,897  | 191,332 | 2018/12/13 |
| MBONO 8 12/07/23     | 8.0   | 4,000   | 4,450   | 23,718  | 2023/12/7  |
| 小 計                  |       |         |         | 887,395 |            |
| (ユーロ…ドイツ)<br>国債証券    |       | 千ユーロ    | 千ユーロ    |         |            |
| DBR 0 1/2 02/15/25   | 0.5   | 1,700   | 1,780   | 205,561 | 2025/2/15  |
| DBR 0 1/2 02/15/26   | 0.5   | 1,800   | 1,869   | 215,781 | 2026/2/15  |
| DBR 1 08/15/25       | 1.0   | 2,500   | 2,718   | 313,852 | 2025/8/15  |
| DBR 1 1/2 02/15/23   | 1.5   | 1,400   | 1,560   | 180,174 | 2023/2/15  |
| DBR 1 1/2 05/15/23   | 1.5   | 500     | 558     | 64,522  | 2023/5/15  |
| DBR 1 1/2 09/04/22   | 1.5   | 1,800   | 1,998   | 230,715 | 2022/9/4   |
| DBR 1 3/4 02/15/24   | 1.75  | 1,800   | 2,059   | 237,765 | 2024/2/15  |
| DBR 2 01/04/22       | 2.0   | 2,300   | 2,590   | 299,008 | 2022/1/4   |
| DBR 2 08/15/23       | 2.0   | 1,000   | 1,155   | 133,417 | 2023/8/15  |
| DBR 2 1/2 07/04/44   | 2.5   | 1,000   | 1,436   | 165,839 | 2044/7/4   |
| DBR 2 1/2 08/15/46   | 2.5   | 1,100   | 1,600   | 184,811 | 2046/8/15  |
| DBR 2 1/4 09/04/21   | 2.25  | 2,000   | 2,263   | 261,275 | 2021/9/4   |
| DBR 3 07/04/20       | 3.0   | 2,000   | 2,263   | 261,314 | 2020/7/4   |
| DBR 3 1/2 07/04/19   | 3.5   | 2,500   | 2,776   | 320,539 | 2019/7/4   |
| DBR 3 1/4 01/04/20   | 3.25  | 2,500   | 2,807   | 324,149 | 2020/1/4   |
| DBR 3 1/4 07/04/42   | 3.25  | 1,000   | 1,593   | 183,936 | 2042/7/4   |
| DBR 3 3/4 01/04/19   | 3.75  | 3,000   | 3,287   | 379,514 | 2019/1/4   |
| DBR 4 01/04/37       | 4.0   | 1,230   | 2,034   | 234,808 | 2037/1/4   |
| DBR 4 1/4 07/04/18   | 4.25  | 500     | 540     | 62,430  | 2018/7/4   |
| DBR 4 3/4 07/04/28   | 4.75  | 580     | 881     | 101,715 | 2028/7/4   |
| DBR 4 3/4 07/04/34   | 4.75  | 1,300   | 2,242   | 258,886 | 2034/7/4   |
| DBR 4 3/4 07/04/40   | 4.75  | 1,000   | 1,896   | 218,944 | 2040/7/4   |
| DBR 4.25 07/04/39    | 4.25  | 900     | 1,585   | 183,086 | 2039/7/4   |
| DBR 5 5/8 01/04/28   | 5.625 | 1,100   | 1,760   | 203,213 | 2028/1/4   |
| DBR 5.5 01/04/31     | 5.5   | 1,050   | 1,796   | 207,407 | 2031/1/4   |
| DBR 6 1/4 01/04/30   | 6.25  | 550     | 975     | 112,654 | 2030/1/4   |
| DBR 6.25 01/04/24    | 6.25  | 2,000   | 2,936   | 339,010 | 2024/1/4   |
| DBR 6.5 07/04/27     | 6.5   | 750     | 1,252   | 144,587 | 2027/7/4   |
| OBL 0 04/09/21       | —     | 3,600   | 3,676   | 424,411 | 2021/4/9   |
| OBL 0 1/2 04/12/19   | 0.5   | 1,500   | 1,542   | 178,025 | 2019/4/12  |
| OBL 0 1/4 04/13/18   | 0.25  | 2,000   | 2,026   | 233,918 | 2018/4/13  |
| OBL 0 1/4 10/16/20   | 0.25  | 2,500   | 2,578   | 297,604 | 2020/10/16 |
| OBL 1 02/22/19       | 1.0   | 3,000   | 3,114   | 359,500 | 2019/2/22  |
| (ユーロ…イタリア)<br>国債証券   |       |         |         |         |            |
| BTPS 1 1/2 06/01/25  | 1.5   | 1,500   | 1,501   | 173,298 | 2025/6/1   |
| BTPS 2 12/01/25      | 2.0   | 2,000   | 2,066   | 238,522 | 2025/12/1  |
| BTPS 2.15 12/15/21   | 2.15  | 1,200   | 1,288   | 148,709 | 2021/12/15 |
| BTPS 2.7 03/01/47    | 2.7   | 800     | 782     | 90,274  | 2047/3/1   |
| BTPS 2.8 03/01/67    | 2.8   | 300     | 274     | 31,646  | 2067/3/1   |

| 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  |            |
| (ユーロ…イタリア)          | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| 国債証券                |       |       |       |         |            |
| BTPS 3 1/2 03/01/30 | 3.5   | 1,500 | 1,761 | 203,289 | 2030/3/1   |
| BTPS 3 1/2 06/01/18 | 3.5   | 2,000 | 2,108 | 243,412 | 2018/6/1   |
| BTPS 3 1/2 12/01/18 | 3.5   | 2,500 | 2,677 | 309,119 | 2018/12/1  |
| BTPS 3 1/4 09/01/46 | 3.25  | 800   | 874   | 100,903 | 2046/9/1   |
| BTPS 3 3/4 03/01/21 | 3.75  | 3,200 | 3,648 | 421,235 | 2021/3/1   |
| BTPS 3 3/4 08/01/21 | 3.75  | 2,950 | 3,388 | 391,153 | 2021/8/1   |
| BTPS 3 3/4 09/01/24 | 3.75  | 2,500 | 2,935 | 338,902 | 2024/9/1   |
| BTPS 4 02/01/37     | 4.0   | 1,760 | 2,188 | 252,627 | 2037/2/1   |
| BTPS 4 09/01/20     | 4.0   | 2,000 | 2,274 | 262,602 | 2020/9/1   |
| BTPS 4 1/2 02/01/18 | 4.5   | 1,000 | 1,056 | 121,918 | 2018/2/1   |
| BTPS 4 1/2 02/01/20 | 4.5   | 2,470 | 2,805 | 323,858 | 2020/2/1   |
| BTPS 4 1/2 03/01/24 | 4.5   | 2,500 | 3,061 | 353,361 | 2024/3/1   |
| BTPS 4 1/2 03/19    | 4.5   | 2,000 | 2,201 | 254,175 | 2019/3/1   |
| BTPS 4 1/2 05/01/23 | 4.5   | 1,500 | 1,826 | 210,804 | 2023/5/1   |
| BTPS 4 1/2 08/18    | 4.5   | 3,000 | 3,231 | 373,048 | 2018/8/1   |
| BTPS 4 1/4 02/01/19 | 4.25  | 4,020 | 4,388 | 506,623 | 2019/2/1   |
| BTPS 4 1/4 03/01/20 | 4.25  | 1,810 | 2,046 | 236,234 | 2020/3/1   |
| BTPS 4 1/4 09/19    | 4.25  | 1,500 | 1,670 | 192,865 | 2019/9/1   |
| BTPS 4 3/4 08/01/23 | 4.75  | 1,600 | 1,984 | 229,032 | 2023/8/1   |
| BTPS 4 3/4 09/01/21 | 4.75  | 1,500 | 1,794 | 207,203 | 2021/9/1   |
| BTPS 4 3/4 09/01/28 | 4.75  | 600   | 781   | 90,216  | 2028/9/1   |
| BTPS 4 3/4 09/01/44 | 4.75  | 1,100 | 1,521 | 175,606 | 2044/9/1   |
| BTPS 5 03/01/22     | 5.0   | 2,500 | 3,051 | 352,294 | 2022/3/1   |
| BTPS 5 03/01/25     | 5.0   | 2,500 | 3,194 | 368,801 | 2025/3/1   |
| BTPS 5 08/01/34     | 5.0   | 2,500 | 3,471 | 400,721 | 2034/8/1   |
| BTPS 5 08/01/39     | 5.0   | 1,300 | 1,826 | 210,851 | 2039/8/1   |
| BTPS 5 09/01/40     | 5.0   | 1,200 | 1,686 | 194,687 | 2040/9/1   |
| BTPS 5 1/2 09/01/22 | 5.5   | 2,000 | 2,525 | 291,509 | 2022/9/1   |
| BTPS 5 1/2 11/01/22 | 5.5   | 1,800 | 2,277 | 262,939 | 2022/11/1  |
| BTPS 5 3/4 02/01/33 | 5.75  | 1,300 | 1,919 | 221,581 | 2033/2/1   |
| BTPS 5.25 11/01/29  | 5.25  | 2,000 | 2,751 | 317,667 | 2029/11/1  |
| BTPS 6 05/01/31     | 6.0   | 2,010 | 2,989 | 345,151 | 2031/5/1   |
| BTPS 6 1/2 11/01/27 | 6.5   | 2,300 | 3,378 | 389,984 | 2027/11/1  |
| BTPS 7 1/4 11/01/26 | 7.25  | 300   | 453   | 52,370  | 2026/11/1  |
| BTPS 9 11/01/23     | 9.0   | 500   | 763   | 88,098  | 2023/11/1  |
| (ユーロ…フランス)          |       |       |       |         |            |
| 国債証券                |       |       |       |         |            |
| FRTR 0 1/2 05/25/25 | 0.5   | 1,600 | 1,632 | 188,471 | 2025/5/25  |
| FRTR 0 1/2 11/25/19 | 0.5   | 2,000 | 2,062 | 238,060 | 2019/11/25 |
| FRTR 0 1/4 11/25/26 | 0.25  | 500   | 487   | 56,300  | 2026/11/25 |
| FRTR 1 05/25/19     | 1.0   | 2,000 | 2,080 | 240,161 | 2019/5/25  |
| FRTR 1 1/2 05/25/31 | 1.5   | 800   | 876   | 101,171 | 2031/5/25  |
| FRTR 1 1/4 05/25/36 | 1.25  | 500   | 514   | 59,365  | 2036/5/25  |
| FRTR 1 11/25/25     | 1.0   | 2,100 | 2,220 | 256,363 | 2025/11/25 |
| FRTR 1 3/4 05/25/23 | 1.75  | 2,500 | 2,797 | 322,914 | 2023/5/25  |
| FRTR 1 3/4 11/25/24 | 1.75  | 2,000 | 2,254 | 260,224 | 2024/11/25 |

| 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  |            |
| (ユーロ…フランス)            | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| 国債証券                  |       |       |       |         |            |
| FRTR 2 1/2 05/25/30   | 2.5   | 2,200 | 2,705 | 312,304 | 2030/5/25  |
| FRTR 2 1/2 10/25/20   | 2.5   | 3,500 | 3,905 | 450,868 | 2020/10/25 |
| FRTR 2 1/4 05/25/24   | 2.25  | 2,200 | 2,561 | 295,694 | 2024/5/25  |
| FRTR 2 1/4 10/25/22   | 2.25  | 2,100 | 2,401 | 277,260 | 2022/10/25 |
| FRTR 2 3/4 10/25/27   | 2.75  | 2,000 | 2,467 | 284,790 | 2027/10/25 |
| FRTR 3 04/25/22       | 3.0   | 2,500 | 2,940 | 339,480 | 2022/4/25  |
| FRTR 3 1/2 04/25/20   | 3.5   | 5,000 | 5,690 | 656,911 | 2020/4/25  |
| FRTR 3 1/2 04/25/26   | 3.5   | 3,100 | 3,990 | 460,714 | 2026/4/25  |
| FRTR 3 1/4 05/25/45   | 3.25  | 1,300 | 1,903 | 219,690 | 2045/5/25  |
| FRTR 3 1/4 10/25/21   | 3.25  | 2,000 | 2,352 | 271,526 | 2021/10/25 |
| FRTR 3 3/4 04/25/21   | 3.75  | 2,300 | 2,722 | 314,260 | 2021/4/25  |
| FRTR 3 3/4 10/19      | 3.75  | 3,600 | 4,060 | 468,695 | 2019/10/25 |
| FRTR 4 04/25/18       | 4.0   | 2,500 | 2,669 | 308,195 | 2018/4/25  |
| FRTR 4 04/25/55       | 4.0   | 1,070 | 1,894 | 218,705 | 2055/4/25  |
| FRTR 4 04/25/60       | 4.0   | 900   | 1,646 | 190,067 | 2060/4/25  |
| FRTR 4 1/4 04/25/19   | 4.25  | 3,960 | 4,433 | 511,770 | 2019/4/25  |
| FRTR 4 10/25/38       | 4.0   | 1,660 | 2,599 | 300,112 | 2038/10/25 |
| FRTR 4 3/4 04/25/35   | 4.75  | 1,580 | 2,595 | 299,602 | 2035/4/25  |
| FRTR 4.25 10/23       | 4.25  | 2,490 | 3,235 | 373,478 | 2023/10/25 |
| FRTR 5 1/2 04/25/29   | 5.5   | 2,410 | 3,829 | 442,076 | 2029/4/25  |
| FRTR 5 3/4 10/25/32   | 5.75  | 2,020 | 3,510 | 405,258 | 2032/10/25 |
| FRTR 6 10/25/25       | 6.0   | 1,600 | 2,413 | 278,625 | 2025/10/25 |
| FRTR 8 1/2 04/25/23   | 8.5   | 500   | 778   | 89,852  | 2023/4/25  |
| FRTR 8 1/2 10/25/19   | 8.5   | 1,000 | 1,269 | 146,562 | 2019/10/25 |
| FRTR4.5 04/25/41      | 4.5   | 1,900 | 3,245 | 374,713 | 2041/4/25  |
| (ユーロ…オランダ)            |       |       |       |         |            |
| 国債証券                  |       |       |       |         |            |
| NETHER 0 1/4 07/15/25 | 0.25  | 2,000 | 2,013 | 232,426 | 2025/7/15  |
| NETHER 2 07/15/24     | 2.0   | 1,300 | 1,499 | 173,153 | 2024/7/15  |
| NETHER 2 1/2 01/15/33 | 2.5   | 900   | 1,170 | 135,147 | 2033/1/15  |
| NETHER 2 1/4 07/15/22 | 2.25  | 1,000 | 1,146 | 132,351 | 2022/7/15  |
| NETHER 2 3/4 01/15/47 | 2.75  | 700   | 1,052 | 121,462 | 2047/1/15  |
| NETHER 3 1/2 07/15/20 | 3.5   | 1,000 | 1,149 | 132,732 | 2020/7/15  |
| NETHER 3 1/4 07/15/21 | 3.25  | 1,100 | 1,290 | 148,964 | 2021/7/15  |
| NETHER 3 3/4 01/15/42 | 3.75  | 900   | 1,513 | 174,721 | 2042/1/15  |
| NETHER 4 01/15/37     | 4.0   | 860   | 1,406 | 162,359 | 2037/1/15  |
| NETHER 4 07/15/18     | 4.0   | 1,000 | 1,078 | 124,513 | 2018/7/15  |
| NETHER 4 07/15/19     | 4.0   | 3,500 | 3,935 | 454,302 | 2019/7/15  |
| NETHER 5 1/2 01/15/28 | 5.5   | 690   | 1,081 | 124,833 | 2028/1/15  |
| NETHER 7 1/2 01/15/23 | 7.5   | 1,770 | 2,626 | 303,223 | 2023/1/15  |
| (ユーロ…スペイン)            |       |       |       |         |            |
| 国債証券                  |       |       |       |         |            |
| SPGB 1.3 10/31/26     | 1.3   | 500   | 501   | 57,939  | 2026/10/31 |
| SPGB 1.6 04/30/25     | 1.6   | 2,700 | 2,825 | 326,181 | 2025/4/30  |
| SPGB 1.95 04/30/26    | 1.95  | 1,500 | 1,601 | 184,882 | 2026/4/30  |
| SPGB 1.95 07/30/30    | 1.95  | 200   | 208   | 24,034  | 2030/7/30  |

| 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  |            |
| (ユーロ…スペイン)<br>国債証券   | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円      |            |
| SPGB 2 3/4 04/30/19  | 2.75  | 1,500 | 1,603 | 185,151 | 2019/4/30  |
| SPGB 2.9 10/31/46    | 2.9   | 400   | 439   | 50,728  | 2046/10/31 |
| SPGB 3 3/4 10/31/18  | 3.75  | 3,000 | 3,233 | 373,270 | 2018/10/31 |
| SPGB 3.45 07/30/66   | 3.45  | 300   | 346   | 39,989  | 2066/7/30  |
| SPGB 3.8 04/30/24    | 3.8   | 2,300 | 2,789 | 321,986 | 2024/4/30  |
| SPGB 4 04/30/20      | 4.0   | 2,000 | 2,273 | 262,395 | 2020/4/30  |
| SPGB 4 1/2 01/31/18  | 4.5   | 1,000 | 1,057 | 122,089 | 2018/1/31  |
| SPGB 4.1 07/30/18    | 4.1   | 500   | 536   | 61,956  | 2018/7/30  |
| SPGB 4.2 01/31/37    | 4.2   | 1,000 | 1,363 | 157,344 | 2037/1/31  |
| SPGB 4.3 10/31/19    | 4.3   | 2,500 | 2,819 | 325,511 | 2019/10/31 |
| SPGB 4.4 10/31/23    | 4.4   | 1,500 | 1,876 | 216,571 | 2023/10/31 |
| SPGB 4.6 07/30/19    | 4.6   | 2,500 | 2,807 | 324,097 | 2019/7/30  |
| SPGB 4.65 07/30/25   | 4.65  | 2,000 | 2,596 | 299,728 | 2025/7/30  |
| SPGB 4.7 07/30/41    | 4.7   | 1,000 | 1,467 | 169,442 | 2041/7/30  |
| SPGB 4.8 01/31/24    | 4.8   | 2,000 | 2,566 | 296,219 | 2024/1/31  |
| SPGB 4.85 10/31/20   | 4.85  | 2,500 | 2,965 | 342,279 | 2020/10/31 |
| SPGB 4.9 07/30/40    | 4.9   | 900   | 1,351 | 156,020 | 2040/7/30  |
| SPGB 5 1/2 04/30/21  | 5.5   | 1,500 | 1,856 | 214,276 | 2021/4/30  |
| SPGB 5 3/4 07/30/32  | 5.75  | 1,060 | 1,650 | 190,512 | 2032/7/30  |
| SPGB 5.15 10/31/28   | 5.15  | 1,400 | 1,960 | 226,327 | 2028/10/31 |
| SPGB 5.15 10/31/44   | 5.15  | 800   | 1,256 | 145,001 | 2044/10/31 |
| SPGB 5.4 01/31/23    | 5.4   | 1,000 | 1,300 | 150,095 | 2023/1/31  |
| SPGB 5.85 01/31/22   | 5.85  | 2,000 | 2,571 | 296,888 | 2022/1/31  |
| SPGB 6 01/31/29      | 6.0   | 1,525 | 2,295 | 265,019 | 2029/1/31  |
| (ユーロ…ベルギー)<br>国債証券   |       |       |       |         |            |
| BGB 0.8 06/22/25     | 0.8   | 1,000 | 1,043 | 120,484 | 2025/6/22  |
| BGB 1 06/22/26       | 1.0   | 1,000 | 1,052 | 121,442 | 2026/6/22  |
| BGB 1.6 06/22/47     | 1.6   | 300   | 315   | 36,384  | 2047/6/22  |
| BGB 1.9 06/22/38     | 1.9   | 400   | 458   | 52,968  | 2038/6/22  |
| BGB 2 1/4 06/22/23   | 2.25  | 500   | 578   | 66,741  | 2023/6/22  |
| BGB 2.15 06/22/66    | 2.15  | 200   | 236   | 27,273  | 2066/6/22  |
| BGB 3 3/4 06/22/45   | 3.75  | 600   | 961   | 110,947 | 2045/6/22  |
| BGB 3 3/4 09/28/20   | 3.75  | 2,000 | 2,326 | 268,513 | 2020/9/28  |
| BGB 4 03/28/19       | 4.0   | 2,000 | 2,220 | 256,299 | 2019/3/28  |
| BGB 4 03/28/22       | 4.0   | 1,040 | 1,281 | 147,989 | 2022/3/28  |
| BGB 4 03/28/32       | 4.0   | 1,000 | 1,463 | 168,957 | 2032/3/28  |
| BGB 4 1/2 03/28/26   | 4.5   | 1,000 | 1,388 | 160,288 | 2026/3/28  |
| BGB 4 1/4 03/28/41   | 4.25  | 900   | 1,501 | 173,340 | 2041/3/28  |
| BGB 4 1/4 09/28/21   | 4.25  | 1,000 | 1,225 | 141,431 | 2021/9/28  |
| BGB 4 1/4 09/28/22   | 4.25  | 1,500 | 1,896 | 218,891 | 2022/9/28  |
| BGB 5 03/28/35       | 5.0   | 1,210 | 2,051 | 236,831 | 2035/3/28  |
| BGB 5 1/2 03/28/28   | 5.5   | 1,820 | 2,830 | 326,790 | 2028/3/28  |
| (ユーロ…オーストリア)<br>国債証券 |       |       |       |         |            |
| RAGB 1 3/4 10/20/23  | 1.75  | 1,000 | 1,128 | 130,216 | 2023/10/20 |

| 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     |            |
| (ユーロ…オーストリア)<br>国債証券 | %     | 千ユーロ  | 千ユーロ  | 千円         |            |
| RAGB 2.4 05/23/34    | 2.4   | 400   | 506   | 58,486     | 2034/5/23  |
| RAGB 3 1/2 09/15/21  | 3.5   | 500   | 593   | 68,513     | 2021/9/15  |
| RAGB 3.15 06/20/44   | 3.15  | 500   | 751   | 86,706     | 2044/6/20  |
| RAGB 3.4 11/22/22    | 3.4   | 1,000 | 1,217 | 140,490    | 2022/11/22 |
| RAGB 3.8 01/26/62    | 3.8   | 300   | 565   | 65,288     | 2062/1/26  |
| RAGB 3.9 07/15/20    | 3.9   | 2,000 | 2,323 | 268,259    | 2020/7/15  |
| RAGB 4.15 03/37      | 4.15  | 850   | 1,376 | 158,862    | 2037/3/15  |
| RAGB 4.35 03/19      | 4.35  | 2,000 | 2,233 | 257,777    | 2019/3/15  |
| RAGB 4.85 03/26      | 4.85  | 1,800 | 2,572 | 297,017    | 2026/3/15  |
| RAGB 6 1/4 07/15/27  | 6.25  | 160   | 259   | 29,992     | 2027/7/15  |
| (ユーロ…フィンランド)<br>国債証券 |       |       |       |            |            |
| RFGB 0 3/4 04/15/31  | 0.75  | 600   | 605   | 69,928     | 2031/4/15  |
| RFGB 1 1/2 04/15/23  | 1.5   | 500   | 551   | 63,665     | 2023/4/15  |
| RFGB 2 5/8 07/04/42  | 2.625 | 200   | 281   | 32,480     | 2042/7/4   |
| RFGB 3 1/2 04/15/21  | 3.5   | 500   | 586   | 67,722     | 2021/4/15  |
| RFGB 4 07/04/25      | 4.0   | 1,300 | 1,730 | 199,715    | 2025/7/4   |
| RFGB 4 3/8 07/04/19  | 4.375 | 1,500 | 1,698 | 196,121    | 2019/7/4   |
| (ユーロ…アイルランド)<br>国債証券 |       |       |       |            |            |
| IRISH 2 02/18/45     | 2.0   | 400   | 442   | 51,079     | 2045/2/18  |
| IRISH 2.4 05/15/30   | 2.4   | 300   | 352   | 40,651     | 2030/5/15  |
| IRISH 3.4 03/18/24   | 3.4   | 1,000 | 1,222 | 141,125    | 2024/3/18  |
| IRISH 3.9 03/20/23   | 3.9   | 500   | 622   | 71,812     | 2023/3/20  |
| IRISH 4 1/2 04/18/20 | 4.5   | 520   | 606   | 70,071     | 2020/4/18  |
| IRISH 5 10/18/20     | 5.0   | 1,000 | 1,210 | 139,768    | 2020/10/18 |
| IRISH 5.4 03/13/25   | 5.4   | 1,000 | 1,395 | 161,096    | 2025/3/13  |
| IRISH 5.9 10/18/19   | 5.9   | 1,000 | 1,183 | 136,634    | 2019/10/18 |
| 小 計                  |       |       |       | 41,359,151 |            |
| (イギリス)<br>国債証券       |       | 千英ポンド | 千英ポンド |            |            |
| UKT 1 1/2 01/22/21   | 1.5   | 1,000 | 1,037 | 136,380    | 2021/1/22  |
| UKT 1 1/2 07/22/26   | 1.5   | 500   | 510   | 67,124     | 2026/7/22  |
| UKT 1 1/4 07/22/18   | 1.25  | 2,300 | 2,341 | 307,638    | 2018/7/22  |
| UKT 1 3/4 07/22/19   | 1.75  | 1,500 | 1,559 | 204,916    | 2019/7/22  |
| UKT 1 3/4 09/07/22   | 1.75  | 1,800 | 1,904 | 250,209    | 2022/9/7   |
| UKT 2 07/22/20       | 2.0   | 1,600 | 1,689 | 222,042    | 2020/7/22  |
| UKT 2 09/07/25       | 2.0   | 1,500 | 1,609 | 211,549    | 2025/9/7   |
| UKT 2 1/4 09/07/23   | 2.25  | 1,100 | 1,199 | 157,626    | 2023/9/7   |
| UKT 2 3/4 09/07/24   | 2.75  | 1,200 | 1,354 | 177,970    | 2024/9/7   |
| UKT 3 1/2 01/22/45   | 3.5   | 400   | 537   | 70,653     | 2045/1/22  |
| UKT 3 1/2 07/22/68   | 3.5   | 1,400 | 2,241 | 294,510    | 2068/7/22  |
| UKT 3 1/4 01/22/44   | 3.25  | 2,500 | 3,193 | 419,658    | 2044/1/22  |
| UKT 3 3/4 07/22/52   | 3.75  | 900   | 1,343 | 176,577    | 2052/7/22  |
| UKT 3 3/4 09/07/19   | 3.75  | 600   | 658   | 86,511     | 2019/9/7   |
| UKT 3 3/4 09/07/20   | 3.75  | 2,200 | 2,478 | 325,631    | 2020/9/7   |

| 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)<br>国債証券           | %     | 千英ポンド   | 千英ポンド   | 千円        |            |
| UKT 3 3/4 09/07/21       | 3.75  | 1,100   | 1,265   | 166,329   | 2021/9/7   |
| UKT 4 01/22/60           | 4.0   | 1,400   | 2,370   | 311,420   | 2060/1/22  |
| UKT 4 03/07/22           | 4.0   | 1,000   | 1,176   | 154,652   | 2022/3/7   |
| UKT 4 1/2 03/07/19       | 4.5   | 1,100   | 1,208   | 158,859   | 2019/3/7   |
| UKT 4 1/2 12/07/42       | 4.5   | 1,340   | 2,063   | 271,104   | 2042/12/7  |
| UKT 4 1/4 03/07/36       | 4.25  | 1,300   | 1,814   | 238,377   | 2036/3/7   |
| UKT 4 1/4 09/07/39       | 4.25  | 900     | 1,285   | 168,850   | 2039/9/7   |
| UKT 4 1/4 12/07/27       | 4.25  | 530     | 687     | 90,361    | 2027/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/40       | 4.25  | 900     | 1,301   | 170,953   | 2040/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/46       | 4.25  | 1,150   | 1,759   | 231,213   | 2046/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/49       | 4.25  | 900     | 1,438   | 189,065   | 2049/12/7  |
| UKT 4 1/4 12/07/55       | 4.25  | 1,100   | 1,879   | 246,976   | 2055/12/7  |
| UKT 4 3/4 03/07/20       | 4.75  | 1,900   | 2,174   | 285,745   | 2020/3/7   |
| UKT 4 3/4 12/07/30       | 4.75  | 1,000   | 1,408   | 185,024   | 2030/12/7  |
| UKT 4 3/4 12/07/38       | 4.75  | 1,100   | 1,669   | 219,387   | 2038/12/7  |
| UKT 4.25 06/07/32        | 4.25  | 1,310   | 1,779   | 233,835   | 2032/6/7   |
| UKT 4.5 09/07/34         | 4.5   | 1,400   | 1,994   | 262,120   | 2034/9/7   |
| UKT 5 03/07/25           | 5.0   | 1,300   | 1,708   | 224,435   | 2025/3/7   |
| UKT 6 12/07/28           | 6.0   | 910     | 1,379   | 181,262   | 2028/12/7  |
| UKT 8 06/07/21           | 8.0   | 1,150   | 1,539   | 202,351   | 2021/6/7   |
| 小 計                      |       |         |         | 7,301,329 |            |
| (スイス)<br>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  | 1,000   | 1,113   | 119,577   | 2020/7/6   |
| SWISS 4 02/11/23         | 4.0   | 320     | 413     | 44,351    | 2023/2/11  |
| SWISS 4 04/08/28         | 4.0   | 500     | 743     | 79,809    | 2028/4/8   |
| 小 計                      |       |         |         | 243,738   |            |
| (スウェーデン)<br>国債証券         |       | 千クローナ   | 千クローナ   |           |            |
| SGB 1 1/2 11/13/23       | 1.5   | 6,000   | 6,681   | 78,045    | 2023/11/13 |
| SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 | 2.5   | 4,000   | 4,821   | 56,319    | 2025/5/12  |
| SGB 3 1/2 03/30/39       | 3.5   | 3,500   | 5,071   | 59,240    | 2039/3/30  |
| SGB 3 1/2 06/01/22       | 3.5   | 7,000   | 8,493   | 99,202    | 2022/6/1   |
| SGB 5 12/01/20           | 5.0   | 10,920  | 13,405  | 156,580   | 2020/12/1  |
| 小 計                      |       |         |         | 449,387   |            |
| (ノルウェー)<br>国債証券          |       | 千クローナ   | 千クローナ   |           |            |
| NGB 2 05/24/23           | 2.0   | 4,000   | 4,198   | 53,319    | 2023/5/24  |
| NGB 3 03/14/24           | 3.0   | 6,000   | 6,722   | 85,374    | 2024/3/14  |
| NGB 3 3/4 05/25/21       | 3.75  | 4,000   | 4,485   | 56,967    | 2021/5/25  |
| NGB 4 1/2 05/22/19       | 4.5   | 5,000   | 5,470   | 69,475    | 2019/5/22  |
| 小 計                      |       |         |         | 265,136   |            |
| (デンマーク)<br>国債証券          |       | 千デンマーク  | 千デンマーク  |           |            |
| DGB 1 1/2 11/15/23       | 1.5   | 6,000   | 6,652   | 103,175   | 2023/11/15 |
| DGB 1 3/4 11/15/25       | 1.75  | 3,000   | 3,399   | 52,718    | 2025/11/15 |
| DGB 3 11/15/21           | 3.0   | 4,000   | 4,662   | 72,313    | 2021/11/15 |

| 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    |            |
| (デンマーク)<br>国債証券      | %     | 千デンマーク    | 千デンマーク    | 千円        |            |
| DGB 4 1/2 11/15/39   | 4.5   | 8,500     | 15,159    | 235,127   | 2039/11/15 |
| DGB 4 11/15/19       | 4.0   | 9,000     | 10,228    | 158,644   | 2019/11/15 |
| DGB 7 11/10/24       | 7.0   | 3,260     | 5,091     | 78,973    | 2024/11/10 |
| 小 計                  |       |           |           | 700,953   |            |
| (ポーランド)<br>国債証券      |       | 千ゾロツ      | 千ゾロツ      |           |            |
| POLGB 1 3/4 07/25/21 | 1.75  | 6,000     | 5,799     | 154,311   | 2021/7/25  |
| POLGB 2 1/2 07/25/18 | 2.5   | 3,500     | 3,541     | 94,233    | 2018/7/25  |
| POLGB 5 1/2 10/25/19 | 5.5   | 1,000     | 1,097     | 29,204    | 2019/10/25 |
| POLGB 5 1/4 10/25/17 | 5.25  | 3,000     | 3,102     | 82,568    | 2017/10/25 |
| POLGB 5 3/4 09/23/22 | 5.75  | 6,800     | 7,896     | 210,134   | 2022/9/23  |
| POLGB 5 3/4 10/25/21 | 5.75  | 2,000     | 2,293     | 61,032    | 2021/10/25 |
| 小 計                  |       |           |           | 631,485   |            |
| (オーストラリア)<br>国債証券    |       | 千豪ドル      | 千豪ドル      |           |            |
| ACGB 2 3/4 04/21/24  | 2.75  | 2,400     | 2,504     | 202,661   | 2024/4/21  |
| ACGB 3 1/4 04/21/25  | 3.25  | 600       | 645       | 52,267    | 2025/4/21  |
| ACGB 3 1/4 04/21/29  | 3.25  | 1,600     | 1,747     | 141,387   | 2029/4/21  |
| ACGB 3 1/4 10/21/18  | 3.25  | 500       | 514       | 41,657    | 2018/10/21 |
| ACGB 3 3/4 04/21/37  | 3.75  | 800       | 910       | 73,723    | 2037/4/21  |
| ACGB 4 1/2 04/20     | 4.5   | 2,800     | 3,055     | 247,315   | 2020/4/15  |
| ACGB 4 1/2 04/21/33  | 4.5   | 1,200     | 1,461     | 118,277   | 2033/4/21  |
| ACGB 4 1/4 04/21/26  | 4.25  | 2,000     | 2,304     | 186,495   | 2026/4/21  |
| ACGB 4 3/4 04/21/27  | 4.75  | 2,100     | 2,592     | 209,772   | 2027/4/21  |
| ACGB 5 1/2 01/21/18  | 5.5   | 1,200     | 1,253     | 101,418   | 2018/1/21  |
| ACGB 5 1/2 04/21/23  | 5.5   | 1,700     | 2,047     | 165,716   | 2023/4/21  |
| ACGB 5 1/4 03/15/19  | 5.25  | 2,660     | 2,874     | 232,603   | 2019/3/15  |
| ACGB 5 3/4 05/15/21  | 5.75  | 2,400     | 2,804     | 226,989   | 2021/5/15  |
| ACGB 5 3/4 07/15/22  | 5.75  | 1,300     | 1,562     | 126,419   | 2022/7/15  |
| 小 計                  |       |           |           | 2,126,706 |            |
| (シンガポール)<br>国債証券     |       | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル |           |            |
| SIGB 2 3/4 04/01/42  | 2.75  | 500       | 532       | 40,155    | 2042/4/1   |
| SIGB 3 09/01/24      | 3.0   | 900       | 980       | 74,005    | 2024/9/1   |
| SIGB 3 1/2 03/01/27  | 3.5   | 800       | 908       | 68,584    | 2027/3/1   |
| SIGB 3 1/4 09/01/20  | 3.25  | 900       | 971       | 73,339    | 2020/9/1   |
| SIGB 3 1/8 09/01/22  | 3.125 | 500       | 545       | 41,189    | 2022/9/1   |
| SIGB 4 09/01/18      | 4.0   | 1,000     | 1,056     | 79,737    | 2018/9/1   |
| 小 計                  |       |           |           | 377,010   |            |
| (マレーシア)<br>国債証券      |       | 千リンギット    | 千リンギット    |           |            |
| MGS 3.502 05/31/27   | 3.502 | 1,000     | 965       | 23,982    | 2027/5/31  |
| MGS 4.16 07/15/21    | 4.16  | 3,000     | 3,098     | 77,002    | 2021/7/15  |
| MGS 4.181 07/15/24   | 4.181 | 3,000     | 3,096     | 76,950    | 2024/7/15  |
| MGS 4.24 02/07/18    | 4.24  | 3,300     | 3,370     | 83,759    | 2018/2/7   |
| MGS 4.254 05/31/35   | 4.254 | 1,500     | 1,489     | 37,002    | 2035/5/31  |
| MGS 4.378 11/29/19   | 4.378 | 2,700     | 2,791     | 69,376    | 2019/11/29 |

| 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  |            |
| (マレーシア)<br>国債証券      | %     | 千円     | 千円     | 千円      |            |
| MGS 4.392 04/15/26   | 4.392 | 2,500  | 2,612  | 64,908  | 2026/4/15  |
| MGS 5.248 09/28      | 5.248 | 1,200  | 1,334  | 33,159  | 2028/9/15  |
| MGS 5.734 07/30/19   | 5.734 | 1,600  | 1,705  | 42,384  | 2019/7/30  |
| 小 計                  |       |        |        | 508,527 |            |
| (南アフリカ)<br>国債証券      |       | 千円     | 千円     | 千円      |            |
| SAGB 10 1/2 12/21/26 | 10.5  | 16,000 | 17,755 | 139,200 | 2026/12/21 |
| SAGB 6 1/2 02/28/41  | 6.5   | 10,000 | 7,182  | 56,306  | 2041/2/28  |
| SAGB 6 1/4 03/31/36  | 6.25  | 15,000 | 10,755 | 84,319  | 2036/3/31  |
| SAGB 6 3/4 03/31/21  | 6.75  | 6,500  | 6,143  | 48,167  | 2021/3/31  |
| SAGB 7 02/28/31      | 7.0   | 8,000  | 6,571  | 51,518  | 2031/2/28  |
| SAGB 7 1/4 01/15/20  | 7.25  | 1,000  | 977    | 7,661   | 2020/1/15  |

| 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      |            |
| (南アフリカ)<br>国債証券     | %     | 千円     | 千円     | 千円          |            |
| SAGB 7 3/4 02/28/23 | 7.75  | 6,000  | 5,785  | 45,360      | 2023/2/28  |
| SAGB 8 12/21/18     | 8.0   | 3,000  | 3,007  | 23,576      | 2018/12/21 |
| SAGB 8 3/4 02/28/48 | 8.75  | 12,000 | 11,066 | 86,760      | 2048/2/28  |
| 小 計                 |       |        |        | 542,871     |            |
| 合 計                 |       |        |        | 102,025,241 |            |

(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

(2016年11月10日現在)

| 項 目          | 当 期 末       |       |
|--------------|-------------|-------|
|              | 評 価 額       | 比 率   |
|              | 千円          | %     |
| 公社債          | 102,025,241 | 98.1  |
| コール・ローン等、その他 | 1,938,166   | 1.9   |
| 投資信託財産総額     | 103,963,407 | 100.0 |

(注) 当期末における外貨建純資産（103,875,178千円）の投資信託財産総額（103,963,407千円）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＝105.63円、1カナダドル＝78.75円、1メキシコペソ＝5.33円、1ユーロ＝115.44円、1英ポンド＝131.40円、1スイスフラン＝107.35円、1スウェーデンクローネ＝11.68円、1ノルウェークローネ＝12.70円、1デンマーククローネ＝15.51円、1ポーランドズロチ＝26.61円、1豪ドル＝80.93円、1シンガポールドル＝75.48円、1マレーシアリンギット＝24.85円、1南アフリカランド＝7.84円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年11月10日現在)

| 項 目             | 当 期 末<br>円      |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資産          | 104,652,691,269 |
| コール・ローン等        | 294,361,926     |
| 公社債(評価額)        | 102,025,241,196 |
| 未収入金            | 1,373,588,866   |
| 未収利息            | 917,427,415     |
| 前払費用            | 42,071,866      |
| (B) 負債          | 1,135,830,908   |
| 未払金             | 689,492,677     |
| 未払解約金           | 446,338,033     |
| 未払利息            | 198             |
| (C) 純資産総額(A－B)  | 103,516,860,361 |
| 元本              | 73,680,002,614  |
| 次期繰越損益金         | 29,836,857,747  |
| (D) 受益権総口数      | 73,680,002,614口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 14,050円         |

(注) 当親ファンドの期首元本額は97,456,475,306円、期中追加設定元本額は7,320,861,102円、期中一部解約元本額は31,097,333,794円です。

<元本の内訳>

|                               |                 |
|-------------------------------|-----------------|
| TMA世界バランスファンド3.5VA<適格機関投資家限定> | 35,838,391,045円 |
| TMA外国債券インデックスVA<適格機関投資家限定>    | 34,618,878,006円 |
| TMA世界バランスファンド5.5VA<適格機関投資家限定> | 2,747,367,852円  |
| 東京海上セレクション・外国債券インデックス         | 341,549,590円    |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)      | 60,344,364円     |
| LPS4資産分散ファンド(バランス型)           | 21,025,119円     |
| LPS4資産分散ファンド(成長重視型)           | 15,517,545円     |
| LPS4資産分散ファンド(積極型)             | 11,814,578円     |
| LPS4資産分散ファンド(安定重視型)           | 9,474,952円      |
| LPS4資産分散ファンド(慎重型)             | 8,131,647円      |
| TMA資産分散型バランスVA(適格機関投資家限定)     | 4,459,903円      |
| TMA債券重視型バランスVA(適格機関投資家限定)     | 2,517,144円      |
| TMA新興国重視型バランスVA(適格機関投資家限定)    | 530,869円        |

(注) 当期末の1口当たり純資産額は14,050円です。

## ○損益の状況 (2015年11月11日～2016年11月10日)

| 項 目              | 当 期<br>円        |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益        | 3,371,527,168   |
| 受取利息             | 3,371,697,456   |
| 支払利息             | △ 170,288       |
| (B) 有価証券売買損益     | △18,602,458,089 |
| 売買益              | 3,484,240,200   |
| 売買損              | △22,086,698,289 |
| (C) 保管費用等        | △ 11,189,876    |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △15,242,120,797 |
| (E) 前期繰越損益金      | 56,428,636,471  |
| (F) 追加信託差損益金     | 3,526,512,900   |
| (G) 解約差損益金       | △14,876,170,827 |
| (H) 計(D+E+F+G)   | 29,836,857,747  |
| 次期繰越損益金(H)       | 29,836,857,747  |

(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。