

# LPS4資産分散ファンド

(慎重型)  
(安定重視型)  
(バランス型)  
(成長重視型)  
(積極型)

＜愛称 未来海図＞

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合／インデックス型 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)				
信託期間	2009年9月2日から2021年5月28日				
運用方針	信託財産の中長期的な成長を目標として運用を行います。				
主要投資対象	LPS4資産分散ファンド (慎重型) (安定重視型) (バランス型) (成長重視型) (積極型)	「TMA日本株TOPIXマザーファンド」、「TMA日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」を主要投資対象とします。			
	TMA日本株TOPIXマザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式			
	TMA日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債			
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式			
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債			
投資制限	(慎重型)	株式へ 実質割 投資割合	30%以下	外貨建 へ 実質割 投資割合	40%以下
	(安定重視型)		40%以下		60%以下
	(バランス型)		60%以下		60%以下
	(成長重視型)		70%以下		70%以下
	(積極型)		制限なし		75%以下
分配方針	毎決算時に、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。				

第10期 運用報告書 (全体版)

(決算日 2019年5月28日)

## 受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「LPS4資産分散ファンド(慎重型)(安定重視型)(バランス型)(成長重視型)(積極型)＜愛称 未来海図＞」は、このたび、第10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

受付時間：営業日の9時～17時

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

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

## ○最近5期の運用実績

### ＜LPS4資産分散ファンド(慎重型)＞

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
6期(2015年5月28日)	12,648	0	7.7	13,044	8.3	12.7	0.4	86.0	0.1	39
7期(2016年5月30日)	12,729	0	0.6	13,198	1.2	12.7	0.4	85.9	0.1	49
8期(2017年5月29日)	12,771	0	0.3	13,304	0.8	12.6	0.5	86.4	0.1	65
9期(2018年5月28日)	13,026	0	2.0	13,626	2.4	13.8	1.1	83.9	0.1	72
10期(2019年5月28日)	13,079	0	0.4	13,742	0.9	13.7	0.5	84.5	0.2	82

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

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

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

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

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

### ＜LPS4資産分散ファンド(安定重視型)＞

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
6期(2015年5月28日)	14,041	0	12.6	14,384	13.1	22.2	0.8	75.6	0.2	20
7期(2016年5月30日)	13,587	0	△ 3.2	13,977	△ 2.8	23.3	0.7	75.0	0.3	48
8期(2017年5月29日)	13,928	0	2.5	14,377	2.9	22.1	0.8	76.0	0.2	40
9期(2018年5月28日)	14,423	0	3.6	14,924	3.8	24.8	2.0	71.5	0.2	83
10期(2019年5月28日)	14,372	0	△ 0.4	14,926	0.0	24.8	0.9	72.9	0.3	87

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

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

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

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

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分で組み合わせた合成指数です。基準価額は対顧客電信売買相場の仲値(TTM)を用いて計算しているため、MSCIコクサイ指数は、基準日前日のMSCIコクサイ指数(米ドルベース)を基準日のTTMで委託会社が円換算したもの、FTSE世界国債インデックスは、FTSE世界国債インデックス(国内投信用)を使用しています。  
各ファンドの決算日時点の基本資産配分は10ページをご参照ください。

## ＜LPS4資産分散ファンド(バランス型)＞

決算期	基準価額 (分配落)	税込み		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		分配	金額	騰落率	騰落率					
6期(2015年5月28日)	円 15,499	円 0	% 17.6	% 15,676	% 17.9	% 38.3	% 1.3	% 58.5	% 0.4	百万円 78
7期(2016年5月30日)	円 14,536	円 0	% △6.2	% 14,744	% △5.9	% 38.8	% 1.1	% 59.1	% 0.4	百万円 118
8期(2017年5月29日)	円 15,354	円 0	% 5.6	% 15,593	% 5.8	% 38.4	% 1.5	% 59.1	% 0.4	百万円 130
9期(2018年5月28日)	円 16,134	円 0	% 5.1	% 16,404	% 5.2	% 36.7	% 2.9	% 58.4	% 0.4	百万円 161
10期(2019年5月28日)	円 15,927	円 0	% △1.3	% 16,229	% △1.1	% 37.0	% 1.4	% 60.2	% 0.4	百万円 184

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

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

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

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

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ＜LPS4資産分散ファンド(成長重視型)＞

決算期	基準価額 (分配落)	税込み		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		分配	金額	騰落率	騰落率					
6期(2015年5月28日)	円 16,814	円 0	% 22.0	% 16,868	% 22.1	% 52.4	% 1.8	% 43.6	% 0.5	百万円 66
7期(2016年5月30日)	円 15,351	円 0	% △8.7	% 15,421	% △8.6	% 53.3	% 1.5	% 44.2	% 0.6	百万円 118
8期(2017年5月29日)	円 16,639	円 0	% 8.4	% 16,705	% 8.3	% 52.6	% 2.0	% 44.2	% 0.5	百万円 117
9期(2018年5月28日)	円 17,799	円 0	% 7.0	% 17,858	% 6.9	% 50.5	% 4.0	% 43.8	% 0.5	百万円 161
10期(2019年5月28日)	円 17,375	円 0	% △2.4	% 17,439	% △2.3	% 51.3	% 2.0	% 45.4	% 0.6	百万円 177

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

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

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

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

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ＜LPS4資産分散ファンド(積極型)＞

決算期	基準価額 (分配落)	税込み		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		分配	金額	騰落率	騰落率					
6期(2015年5月28日)	円 18,101	円 0	% 26.0	% 18,044	% 26.0	% 64.4	% 2.2	% 30.8	% 0.6	百万円 85
7期(2016年5月30日)	円 16,135	円 0	% △10.9	% 16,080	% △10.9	% 66.7	% 1.9	% 30.4	% 0.7	百万円 121
8期(2017年5月29日)	円 17,878	円 0	% 10.8	% 17,777	% 10.6	% 64.9	% 2.5	% 31.3	% 0.6	百万円 131
9期(2018年5月28日)	円 19,419	円 0	% 8.6	% 19,268	% 8.4	% 62.3	% 5.0	% 31.1	% 0.6	百万円 184
10期(2019年5月28日)	円 18,734	円 0	% △3.5	% 18,555	% △3.7	% 65.7	% 2.5	% 30.5	% 0.7	百万円 162

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

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

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

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

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

## ＜LPS4資産分散ファンド(慎重型)＞

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマ ー ク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2018年5月28日	円 13,026	% —	13,626	% —	% 13.8	% 1.1	% 83.9	% 0.1
5月末	12,991	△0.3	13,589	△0.3	13.8	1.0	84.3	0.1
6月末	13,017	△0.1	13,620	△0.0	14.0	0.7	84.1	0.1
7月末	13,056	0.2	13,666	0.3	14.4	0.7	84.0	0.1
8月末	13,001	△0.2	13,618	△0.1	14.2	0.5	81.8	0.1
9月末	13,090	0.5	13,709	0.6	14.6	0.8	83.2	0.1
10月末	12,882	△1.1	13,500	△0.9	13.0	0.9	85.2	0.1
11月末	12,960	△0.5	13,591	△0.3	14.1	1.0	84.1	0.1
12月末	12,811	△1.7	13,438	△1.4	12.8	0.8	85.8	0.1
2019年1月末	12,931	△0.7	13,573	△0.4	14.7	0.9	83.5	0.2
2月末	13,049	0.2	13,704	0.6	14.7	0.7	84.0	0.2
3月末	13,141	0.9	13,793	1.2	14.2	0.7	84.6	0.2
4月末	13,153	1.0	13,815	1.4	14.5	0.9	84.1	0.2
(期 末) 2019年5月28日	13,079	0.4	13,742	0.9	13.7	0.5	84.5	0.2

(注) 騰落率は期首比です。

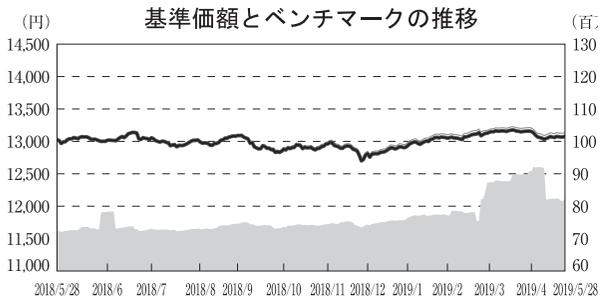
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

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

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

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

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

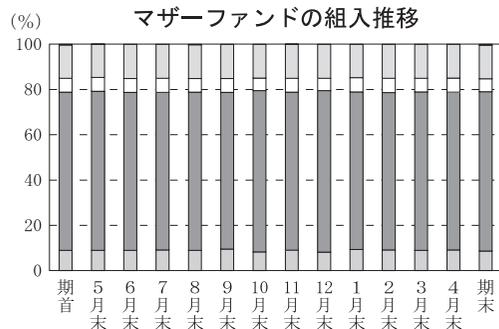


— 基準価額(左軸) — 分配金再投資基準価額(左軸) — ベンチマーク(左軸) — 純資産総額(右軸)

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

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

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2018年5月28日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。



■ 日本株式M ■ 日本債券M □ 外国株式M □ 外国債券M ■ 現金他

※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

## &lt;LPS4資産分散ファンド(安定重視型)&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				
(期 首) 2018年5月28日	円	%		%	%	%	%	%
2018年5月28日	14,423	—	14,924	—	24.8	2.0	71.5	0.2
5月末	14,349	△0.5	14,849	△0.5	24.9	1.8	72.3	0.2
6月末	14,390	△0.2	14,896	△0.2	25.1	1.3	71.8	0.3
7月末	14,488	0.5	15,004	0.5	25.9	1.3	71.7	0.3
8月末	14,446	0.2	14,972	0.3	25.6	1.0	69.9	0.3
9月末	14,646	1.5	15,169	1.6	26.2	1.5	70.9	0.2
10月末	14,227	△1.4	14,743	△1.2	23.7	1.6	73.9	0.2
11月末	14,340	△0.6	14,871	△0.4	25.4	1.7	72.0	0.3
12月末	13,970	△3.1	14,488	△2.9	23.4	1.5	74.5	0.2
2019年1月末	14,171	△1.7	14,711	△1.4	26.4	1.6	71.1	0.3
2月末	14,379	△0.3	14,936	0.1	26.3	1.3	71.6	0.3
3月末	14,482	0.4	15,023	0.7	25.6	1.3	72.6	0.3
4月末	14,551	0.9	15,104	1.2	26.0	1.6	71.8	0.3
(期 末) 2019年5月28日								
2019年5月28日	14,372	△0.4	14,926	0.0	24.8	0.9	72.9	0.3

(注) 騰落率は期首比です。

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

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

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

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

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。



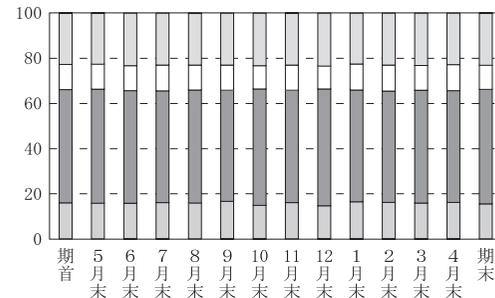
— 基準価額(左軸) — 分配金再投資基準価額(左軸) — ベンチマーク(左軸) ■ 純資産総額(右軸)

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

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

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2018年5月28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 (%)



■ 日本株式M ■ 日本債券M □ 外国株式M □ 外国債券M ■ 現金他

※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

## ＜LPS4資産分散ファンド(バランス型)＞

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2018年5月28日	円 16,134	% —		% —	% 36.7	% 2.9	% 58.4	% 0.4
5月末	16,022	△0.7	16,292	△0.7	37.0	2.6	59.3	0.3
6月末	16,065	△0.4	16,340	△0.4	37.2	1.9	58.9	0.4
7月末	16,228	0.6	16,513	0.7	38.2	2.0	58.6	0.4
8月末	16,196	0.4	16,495	0.6	37.9	1.4	57.2	0.4
9月末	16,523	2.4	16,804	2.4	38.5	2.1	57.8	0.4
10月末	15,846	△1.8	16,124	△1.7	35.5	2.4	61.4	0.4
11月末	15,999	△0.8	16,292	△0.7	37.5	2.5	59.0	0.4
12月末	15,355	△4.8	15,632	△4.7	35.1	2.3	61.9	0.3
2019年1月末	15,673	△2.9	15,976	△2.6	38.8	2.4	58.0	0.4
2月末	15,980	△1.0	16,300	△0.6	38.8	2.0	58.5	0.4
3月末	16,088	△0.3	16,374	△0.2	37.9	1.9	59.6	0.4
4月末	16,229	0.6	16,528	0.8	38.4	2.4	58.6	0.4
(期 末) 2019年5月28日	15,927	△1.3	16,229	△1.1	37.0	1.4	60.2	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。



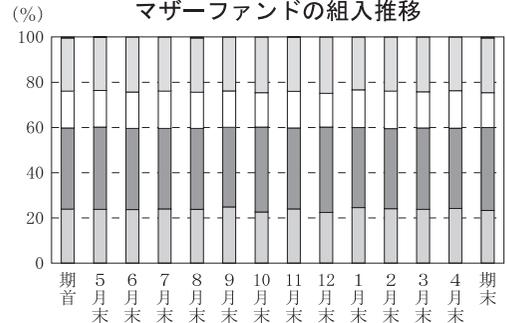
— 基準価額(左軸) — 分配金再投資基準価額(左軸) — ベンチマーク(左軸) ■ 純資産総額(右軸)

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

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

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2018年5月28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



■ 日本株式M ■ 日本債券M □ 外国株式M □ 外国債券M ■ 現金他

※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

## ＜LPS4資産分散ファンド（成長重視型）＞

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2018年5月28日	円	%		%	%	%	%	%
	17,799	—	17,858	—	50.5	4.0	43.8	0.5
5月末	17,652	△0.8	17,712	△0.8	50.9	3.6	44.5	0.5
6月末	17,677	△0.7	17,742	△0.6	51.3	2.6	44.2	0.5
7月末	17,914	0.6	17,989	0.7	52.4	2.7	43.8	0.5
8月末	17,895	0.5	17,985	0.7	52.0	2.0	42.9	0.5
9月末	18,360	3.2	18,413	3.1	52.6	2.9	43.1	0.5
10月末	17,374	△2.4	17,431	△2.4	49.4	3.3	46.7	0.5
11月末	17,570	△1.3	17,641	△1.2	51.5	3.5	44.2	0.5
12月末	16,587	△6.8	16,645	△6.8	49.1	3.2	47.2	0.5
2019年1月末	17,066	△4.1	17,150	△4.0	53.0	3.3	43.1	0.6
2月末	17,484	△1.8	17,583	△1.5	53.0	2.7	43.7	0.6
3月末	17,587	△1.2	17,629	△1.3	52.2	2.6	44.7	0.6
4月末	17,823	0.1	17,877	0.1	52.6	3.3	43.8	0.6
(期 末) 2019年5月28日	円	%		%	%	%	%	%
	17,375	△2.4	17,439	△2.3	51.3	2.0	45.4	0.6

(注) 騰落率は期首比です。

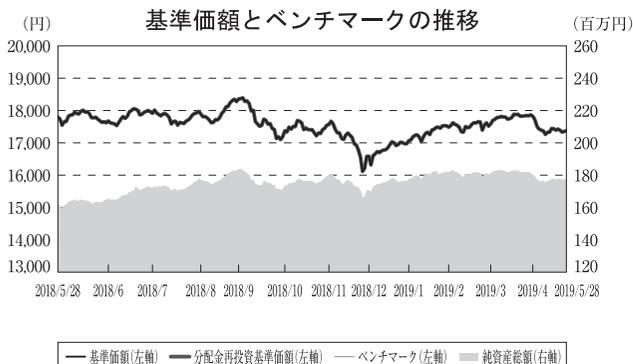
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

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

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

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

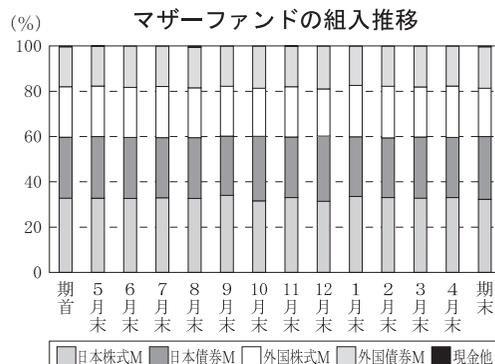
(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。



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

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

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2018年5月28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(積極型)＞

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマ ー ク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(期 首) 2018年5月28日	円	%		%	%	%	%	%
	19,419	—	19,268	—	62.3	5.0	31.1	0.6
5月末	19,235	△0.9	19,089	△0.9	62.9	4.5	31.6	0.6
6月末	19,243	△0.9	19,101	△0.9	63.5	3.2	31.5	0.6
7月末	19,555	0.7	19,419	0.8	64.6	3.3	31.1	0.6
8月末	19,548	0.7	19,431	0.8	64.8	2.4	28.7	0.7
9月末	20,171	3.9	19,990	3.7	66.6	3.7	28.6	0.6
10月末	18,830	△3.0	18,668	△3.1	63.8	4.3	31.5	0.6
11月末	19,075	△1.8	18,923	△1.8	65.5	4.4	29.4	0.7
12月末	17,708	△8.8	17,553	△8.9	63.5	4.2	32.0	0.6
2019年1月末	18,368	△5.4	18,232	△5.4	66.9	4.1	28.5	0.7
2月末	18,907	△2.6	18,783	△2.5	67.2	3.4	29.0	0.7
3月末	19,001	△2.2	18,797	△2.4	66.5	3.3	29.9	0.7
4月末	19,345	△0.4	19,149	△0.6	66.6	4.1	29.1	0.7
(期 末) 2019年5月28日	18,734	△3.5	18,555	△3.7	65.7	2.5	30.5	0.7

(注) 騰落率は期首比です。

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

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

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

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

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。



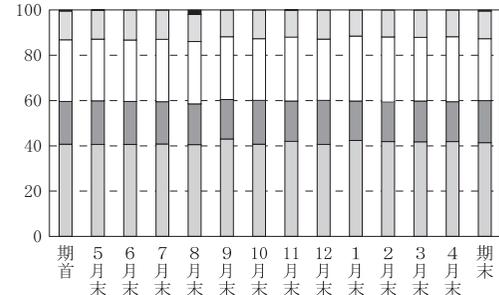
— 基準価額(左軸) — 分配金再投資基準価額(左軸) — ベンチマーク(左軸) ■ 純資産総額(右軸)

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

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

(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首(2018年5月28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 (%)



■ 日本株式M ■ 日本債券M □ 外国株式M □ 外国債券M ■ 現金他

※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

## ○運用経過

(2018年5月29日～2019年5月28日)

## ■期中の基準価額等の推移

	LPS4資産 分散ファンド (慎重型)	LPS4資産 分散ファンド (安定重視型)	LPS4資産 分散ファンド (バランス型)	LPS4資産 分散ファンド (成長重視型)	LPS4資産 分散ファンド (積極型)
前期末(2018年5月28日)	13,026円	14,423円	16,134円	17,799円	19,419円
当期末(2019年5月28日)	13,079円	14,372円	15,927円	17,375円	18,734円
基準価額の騰落率	0.4%	△0.4%	△1.3%	△2.4%	△3.5%
ベンチマークの騰落率	0.9%	0.0%	△1.1%	△2.3%	△3.7%

## ◇基準価額の主な変動要因

【各マザーファンドのベンチマークの騰落率】

	日本株式 TOPIX (東証株価指数)	日本債券 NOMURA - BPI (総合)	外国株式 MSCIコクサイ指数 (円ヘッジなし・円ベース)	外国債券 FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
騰落率	△12.4%	1.9%	3.0%	2.4%

## プラス要因

- ・世界経済の減速懸念などを背景に主要国中央銀行の金融引き締め姿勢が後退し、世界的に金利が低下（債券価格が上昇）したこと

## マイナス要因

- ・米中貿易摩擦への警戒や世界的な景気減速に対する懸念などの外需要因および消費税増税による国内経済への影響に対する懸念などの内需要因を背景に、国内株式市場が下落したこと

## ■投資環境

【日本株式市況】

期初、トランプ米政権の保護主義的な通商政策や欧州の政治状況への懸念から国内株式市場は下落しました。

2018年秋には、米国の対中関税引き上げで米中貿易摩擦への懸念は一旦の悪材料出尽くしとなった一方、自民党総裁選で安倍首相が選出されたことが追い風となったことから、国内株式市場は反発上昇しました。その後、米中貿易摩擦への楽観と警戒に影響されて株価が上下する展開が続きましたが、12月に入り、米国の金融引き締め姿勢への警戒から急落しました。

2019年に入り、米金融政策の引き締め姿勢の後退や米中貿易摩擦の緊張緩和期待から国内株式市場は反発した後、世界的な景気減速への懸念から上値の重い展開となりました。期末にかけては中国政府の景気刺激策に対する期待が高まったものの、米中対立激化を受けて国内株式市場は、期初から下落した水準で終了しました。

TOPIX (東証株価指数) の推移



### 【日本債券市況】

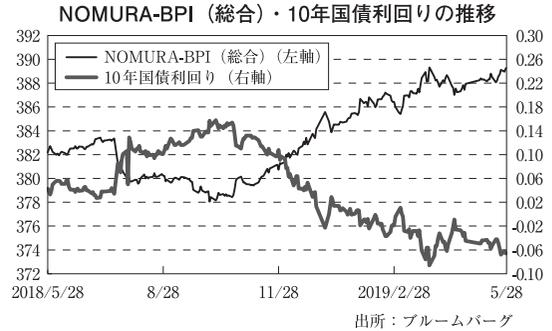
期初、国内長期金利(10年国債利回り)は小幅な値動きで推移した後、2018年7月に日銀が政策金利に関するフォワードガイダンス<sup>※</sup>の導入や、国債買入れの弾力化などを発表し、さらに黒田日銀総裁が長期金利の変動幅について従来の2倍(±0.2%)程度を意識していると発言したことを受けて、国内長期金利は上昇しました。

その後、日銀が金利上昇を牽制したため、国内長期金利は一旦安定化しましたが、8月下旬以降、欧米の長期金利上昇や日銀による国債買入額の減額から再び上昇しました。

10月上旬には国内長期金利が0.15%を上回る水準まで上昇しましたが、10月下旬以降、投資家のリスク回避姿勢が強まり、国内長期金利は低下しました。

2019年3月には、主要国中央銀行の金融引き締め姿勢の後退から国内金利の低下が加速しましたが、期末にかけて中国の事前予想を上回る経済指標を受け国内金利は若干上昇しました。期を通じてみると、期初から低下した水準で終了しました。

※フォワードガイダンス：中央銀行が将来の金融政策の方針を前もって表明すること



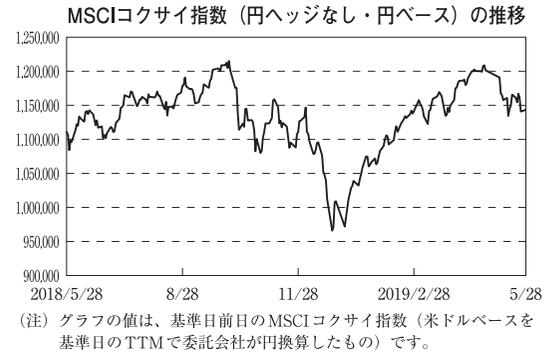
### 【外国株式市況】

期初、堅調な企業業績などを背景に外国株式市場は上昇しました。

その後、米中貿易摩擦への懸念の高まりなどが株価の重しとなったものの、堅調な企業業績や良好な経済指標の発表などを背景に外国株式市場は上昇基調を維持しました。

2018年後半に入り、世界経済の減速懸念が台頭するなか、米国の金融当局が利上げ継続の姿勢を示したことへの警戒感が高まったことなどを背景に外国株式市場は下落しました。

2019年に入ると、米国の利上げ見送りなどにより外国株式市場は上昇に転じました。期末にかけては米中通商交渉への懸念が高まり下落する場面もありましたが、期を通じてみると、期初から上昇した水準で終了しました。

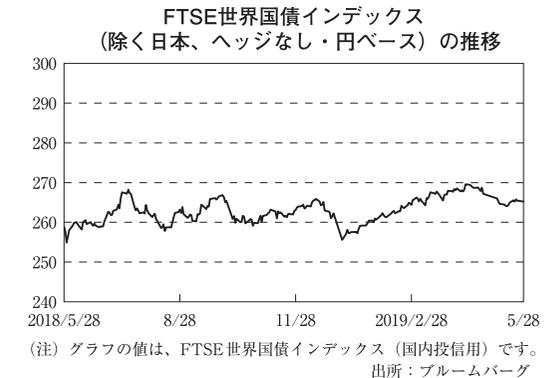


### 【外国債券市況】

期初から期半ばにかけては、米国を中心に各種経済指標が堅調に推移し、さらに原油価格が上昇したことなどにより外国債券市場で国債利回りは上昇しました。

米国では株高などを背景にFRB(米連邦準備制度理事会)は利上げ姿勢を緩めず、2018年11月上旬に米国10年国債利回りは、直近の高値である3.23%程度まで上昇しました。しかし、長期金利の上昇を懸念して外国株式市場が下落に転じると、物価の低迷や世界経済の減速懸念などを背景にFRBが利上げに慎重な姿勢を示したことなどから、主要国の国債利回りは低下に転じました。

2019年4月に入り、米国の経済指標に加えて、中国でも景況感に下げ止まりの兆しがみられたことから、主要国の国債利回りは一時上昇しましたが、期末にかけて米中貿易摩擦懸念から再度低下しました。期を通じてみると、前期末比で主要国の国債利回りは低下しました。



## 【為替市況】

米ドル円為替レートは、期初、1米ドル＝109円台でスタートした後、米国経済の堅調な推移を受けて円安米ドル高となりました。

その後、世界的な金利上昇により株式市場が下落に転じると米ドル円為替レートは方向感を失い、2018年末にかけて株式市場が急落すると円が買われました。2019年年明け以降はFRBの利上げ停止観測が台頭したことなどを背景に円安米ドル高が進みましたが、期末にかけては米中貿易摩擦懸念が再燃し、円高米ドル安基調となりました。期を通じてみると、米ドル円為替レートは、前期末比でほぼ同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 TOPIX マザーファンド	TMA日本債券 インデックス マザーファンド	TMA外国株式 インデックス マザーファンド	TMA外国債券 インデックス マザーファンド
(慎重型)	9%	70%	6%	15%
(安定重視型)	16%	50%	11%	23%
(バランス型)	24%	36%	16%	24%
(成長重視型)	33%	27%	22%	18%
(積極型)	42%	18%	28%	12%

## ＜TMA日本株TOPIXマザーファンド＞

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は、米中貿易摩擦への警戒とグローバル景気の減速懸念などを背景に10.2%下落し、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、国債利回りが低下したことなどから2.0%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

## ＜TMA外国株式インデックスマザーファンド＞

ベンチマークであるMSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は、堅調な企業業績や米国金融政策の不透明感の後退などを背景に2.6%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

## ＜TMA外国債券インデックスマザーファンド＞

ベンチマークであるFTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果を目指して運用しました。当期の基準価額は、世界的に金利が低下したことから2.4%上昇し、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは期中の基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。

各ファンドの騰落率は、次表の通りベンチマークにおおむね連動しました。

### 【各ファンドとベンチマークの騰落率】

	LPS4資産 分散ファンド (慎重型)	LPS4資産 分散ファンド (安定重視型)	LPS4資産 分散ファンド (バランス型)	LPS4資産 分散ファンド (成長重視型)	LPS4資産 分散ファンド (積極型)
ファンド	0.4%	△0.4%	△1.3%	△2.4%	△3.5%
ベンチマーク	0.9%	0.0%	△1.1%	△2.3%	△3.7%

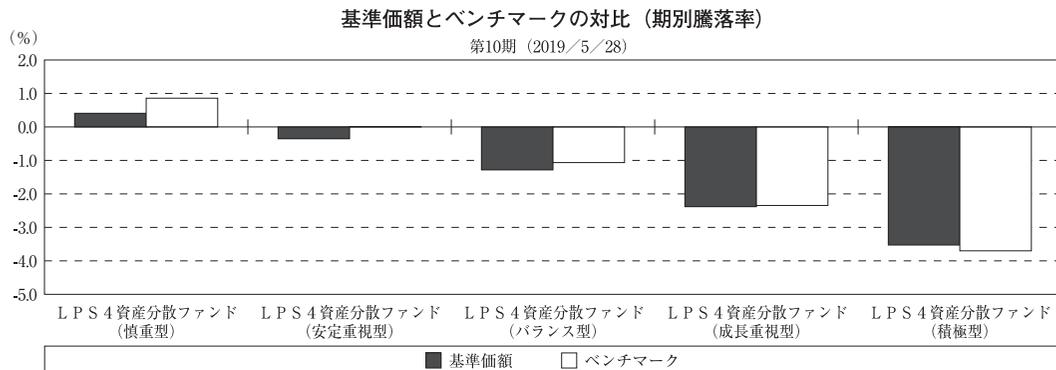
### (主な差異要因)

#### プラス要因

- ・マザーファンドにおける配当金収入

#### マイナス要因

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



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## ■分配金

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

## ◇分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第10期				
	2018年5月29日～2019年5月28日				
	LPS4資産 分散ファンド (慎重型)	LPS4資産 分散ファンド (安定重視型)	LPS4資産 分散ファンド (バランス型)	LPS4資産 分散ファンド (成長重視型)	LPS4資産 分散ファンド (積極型)
当期分配金	—	—	—	—	—
(対基準価額比率)	—%	—%	—%	—%	—%
当期の収益	—	—	—	—	—
当期の収益以外	—	—	—	—	—
翌期繰越分配対象額	3,078	4,371	5,926	7,375	8,733

(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

### <LPS4資産分散ファンド(慎重型)(安定重視型)(バランス型)(成長重視型)(積極型)>

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

なお、各市場の今後の見通しは以下の通りです。

#### 【日本株式市場見通し】

2019年1-3月期のGDP(国内総生産)成長率が市場の想定を上回り、国内経済は今後も内需主導で緩やかな回復基調が続くと想定しています。

海外に目を向けると、中国では景気刺激策が講じられていることから、経済指標の改善が期待できます。また、米国経済も良好な労働市場を背景とした消費者心理の改善を受けて、今後も緩やかな成長ペースが継続すると想定しています。このような世界的な景気の安定は国内株式市場の支援材料になると考えます。

以上のような環境下、国内株式市場は、基調としては堅調な推移を想定しています。

#### 【日本債券市場見通し】

世界経済は力強さに欠け、米中貿易摩擦や英国のEU(欧州連合)離脱問題に対する不透明感が払拭されないなか、主要国の長期金利は低下傾向にあることや、国内債券市場の需給環境が良好であることを背景に、長期金利は狭いレンジ内ながら底堅く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、世界経済の減速懸念や米中貿易摩擦を巡る不透明感が今後も継続すると想定しており、当面はボラティリティ(変動性)が大きい展開を予想します。しかし、米国経済は個人消費を中心に堅調に推移しており、中国政府も経済政策では景気下支えを重視する方針を発表していることなどから、2019年は緩やかな経済成長が継続し、企業収益の増益基調は維持され、企業業績に沿って外国株式市場は上昇する展開を想定します。

## 【外国債券市場見通し】

米国債利回りは、米中貿易摩擦に対する懸念などを背景に低下基調で推移する展開を予想します。  
ドイツ国債利回りは、一部経済指標が軟調であることから低金利局面が続くと想定します。

## 【為替市場見通し】

米ドル円相場は、日米金利差が米ドルの支援材料となるものの、リスク回避の局面では円が選好されることが考えられ、おおむね横ばいで推移すると予想します。

ユーロ米ドル相場は、ユーロ圏の経済指標が力強さに欠けるものの、対米ドルでは既に安値圏にあることから、おおむね横ばいで推移すると予想します。

2019年8月29日以降、前述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 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。
- ・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 T O P I X マザーファンド	TMA日本債券 インデックス マザーファンド	TMA外国株式 インデックス マザーファンド	TMA外国債券 インデックス マザーファンド
(慎重型)	9%	70%	6%	15%
(安定重視型)	16%	50%	11%	23%
(バランス型)	24%	36%	16%	24%
(成長重視型)	33%	27%	22%	18%
(積極型)	42%	18%	28%	12%



## 2019年8月29日以降の基本資産配分（予定）

	TMA日本株 T O P I X マザーファンド	TMA日本債券 インデックス マザーファンド	TMA外国株式 インデックス マザーファンド	TMA外国債券 インデックス マザーファンド
(慎重型)	11%	71%	7%	11%
(安定重視型)	18%	55%	12%	15%
(バランス型)	26%	39%	17%	18%
(成長重視型)	33%	27%	22%	18%
(積極型)	42%	18%	28%	12%

〈TMA日本株TOPIXマザーファンド〉

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

〈TMA日本債券インデックスマザーファンド〉

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

〈TMA外国株式インデックスマザーファンド〉

引き続き、ベンチマークであるMSCIコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）に連動する投資成果を目指して運用を行います。

〈TMA外国債券インデックスマザーファンド〉

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

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2018年5月29日～2019年5月28日)

項目	第10期										項目の概要
	LPS4資産分散ファンド(慎重型)		LPS4資産分散ファンド(安定重視型)		LPS4資産分散ファンド(バランス型)		LPS4資産分散ファンド(成長重視型)		LPS4資産分散ファンド(積極型)		
	金額	比率	金額	比率	金額	比率	金額	比率	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 91	0.697%	円 100	0.697%	円 112	0.697%	円 122	0.697%	円 133	0.697%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 *委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価 *購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価 *運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(42)	(0.324)	(47)	(0.324)	(52)	(0.324)	(57)	(0.324)	(62)	(0.324)	
(販売会社)	(42)	(0.324)	(47)	(0.324)	(52)	(0.324)	(57)	(0.324)	(62)	(0.324)	
(受託会社)	(6)	(0.049)	(7)	(0.049)	(8)	(0.049)	(9)	(0.049)	(9)	(0.049)	
(b) 売買委託手数料	0	0.003	1	0.005	1	0.008	2	0.011	3	0.014	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 *売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(0)	(0.002)	(0)	(0.003)	(1)	(0.004)	(1)	(0.006)	(1)	(0.007)	
(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)	(0.005)	(1)	(0.006)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	0	0.002	0	0.003	1	0.004	1	0.005	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 *有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(0)	(0.001)	(0)	(0.002)	(0)	(0.003)	(1)	(0.004)	(1)	(0.005)	
(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	3	0.026	5	0.038	7	0.046	9	0.051	11	0.057	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 *保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 *監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 *その他は、信託事務等に要する諸費用
(保管費用)	(2)	(0.016)	(4)	(0.027)	(5)	(0.034)	(7)	(0.040)	(9)	(0.045)	
(監査費用)	(1)	(0.011)	(2)	(0.011)	(2)	(0.011)	(2)	(0.011)	(2)	(0.011)	
(その他)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.000)	(0)	(0.001)	(0)	(0.001)	
合計	94	0.727	106	0.742	120	0.754	134	0.763	148	0.773	
期中の平均基準価額	LPS4資産分散ファンド(慎重型)		LPS4資産分散ファンド(安定重視型)		LPS4資産分散ファンド(バランス型)		LPS4資産分散ファンド(成長重視型)		LPS4資産分散ファンド(積極型)		
					13,006円						
					14,369円						
					16,017円						
					17,582円						
					19,082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

(2018年5月29日～2019年5月28日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

## &lt;LPS4資産分散ファンド(慎重型)&gt;

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 3,656	千円 4,847	千口 2,629	千円 3,483
TMA日本債券インデックスマザーファンド	22,392	28,886	17,500	22,579
TMA外国株式インデックスマザーファンド	1,274	3,059	1,194	2,903
TMA外国債券インデックスマザーファンド	4,085	6,271	3,185	4,889

## &lt;LPS4資産分散ファンド(安定重視型)&gt;

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 5,093	千円 6,757	千口 3,800	千円 5,194
TMA日本債券インデックスマザーファンド	13,040	16,772	11,607	14,851
TMA外国株式インデックスマザーファンド	1,796	4,286	1,913	4,681
TMA外国債券インデックスマザーファンド	4,826	7,377	4,234	6,483

## &lt;LPS4資産分散ファンド(バランス型)&gt;

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 13,961	千円 18,516	千口 7,355	千円 9,987
TMA日本債券インデックスマザーファンド	18,983	24,347	12,629	16,193
TMA外国株式インデックスマザーファンド	4,780	11,331	4,133	10,093
TMA外国債券インデックスマザーファンド	10,034	15,326	6,410	9,789

## &lt;LPS4資産分散ファンド(成長重視型)&gt;

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 17,275	千円 23,051	千口 9,512	千円 12,843
TMA日本債券インデックスマザーファンド	14,755	18,917	11,098	14,247
TMA外国株式インデックスマザーファンド	5,904	14,040	5,468	13,364
TMA外国債券インデックスマザーファンド	7,823	11,951	5,723	8,737

## &lt;LPS4資産分散ファンド(積極型)&gt;

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 25,395	千円 33,945	千口 25,532	千円 34,285
TMA日本債券インデックスマザーファンド	11,993	15,367	16,224	20,843
TMA外国株式インデックスマザーファンド	8,481	20,255	11,443	28,027
TMA外国債券インデックスマザーファンド	6,534	9,977	9,248	14,175

## ○株式売買比率

(2018年5月29日～2019年5月28日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期	
	TMA日本株TOPIX マザーファンド	TMA外国株式インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33,510,215千円	7,083,685千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	42,415,864千円	8,553,185千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.79	0.82

(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

(2018年5月29日～2019年5月28日)

## 利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

## ＜TMA日本株TOPIXマザーファンド＞

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 79	百万円 173	百万円 317

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

(2018年5月29日～2019年5月28日)

	期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取 引 の 理 由
	百万円	百万円	百万円	百万円	
(慎重型)	1	—	—	1	当初設定における取得
(安定重視型)	1	—	—	1	
(バランス型)	1	—	—	1	
(成長重視型)	1	—	—	1	
(積極型)	—	—	—	—	

## ○組入資産の明細

(2019年5月28日現在)

## 親投資信託残高

## ＜LPS4資産分散ファンド(慎重型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期末	
		口数	評価額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 4,573	千口 5,600	千円 7,138
TMA日本債券インデックスマザーファンド	39,675	44,566	58,128
TMA外国株式インデックスマザーファンド	1,852	1,932	4,716
TMA外国債券インデックスマザーファンド	7,091	7,990	12,322

## ＜LPS4資産分散ファンド(安定重視型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期末	
		口数	評価額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 9,352	千口 10,644	千円 13,567
TMA日本債券インデックスマザーファンド	32,594	34,028	44,383
TMA外国株式インデックスマザーファンド	3,906	3,789	9,247
TMA外国債券インデックスマザーファンド	12,506	13,097	20,198

## ＜LPS4資産分散ファンド(バランス型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期末	
		口数	評価額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 27,285	千口 33,891	千円 43,197
TMA日本債券インデックスマザーファンド	45,644	51,998	67,821
TMA外国株式インデックスマザーファンド	11,051	11,698	28,550
TMA外国債券インデックスマザーファンド	25,383	29,007	44,732

## ＜LPS4資産分散ファンド(成長重視型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期末	
		口数	評価額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 37,502	千口 45,265	千円 57,695
TMA日本債券インデックスマザーファンド	34,219	37,876	49,401
TMA外国株式インデックスマザーファンド	15,189	15,625	38,131
TMA外国債券インデックスマザーファンド	19,030	21,130	32,585

## ＜LPS4資産分散ファンド(積極型)＞

銘柄	期首(前期末) 口数	当期末	
		口数	評価額
TMA日本株TOPIXマザーファンド	千口 53,091	千口 52,955	千円 67,496
TMA日本債券インデックスマザーファンド	27,437	23,206	30,268
TMA外国株式インデックスマザーファンド	21,240	18,278	44,607
TMA外国債券インデックスマザーファンド	15,661	12,947	19,965

## ＜LPS4資産分散ファンド（慎重型）＞

## ○投資信託財産の構成

(2019年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	7,138	8.6
TMA日本債券インデックスマザーファンド	58,128	70.4
TMA外国株式インデックスマザーファンド	4,716	5.7
TMA外国債券インデックスマザーファンド	12,322	14.9
コール・ローン等、その他	297	0.4
投資信託財産総額	82,601	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（10,263,043千円）の投資信託財産総額（10,317,438千円）に対する比率は99.5%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（4,163,290千円）の投資信託財産総額（4,281,681千円）に対する比率は97.2%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=109.57円、1カナダドル=81.53円、1メキシコペソ=5.76円、1ユーロ=122.62円、1英ポンド=138.96円、1スイスフラン=109.12円、1スウェーデンクローネ=11.44円、1ノルウェークローネ=12.59円、1デンマーククローネ=16.41円、1ポーランドズロチ=28.59円、1豪ドル=75.88円、1ニュージーランドドル=71.76円、1香港ドル=13.96円、1シンガポールドル=79.70円、1マレーシアリングギット=26.17円、1イスラエルシェケル=30.40円、1南アフリカランド=7.59円です。

## &lt;LPS4資産分散ファンド(慎重型)&gt;

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	82,601,163
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	7,138,606
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	58,128,121
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	4,716,968
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	12,322,524
未収入金	294,944
(B) 負債	280,857
未払信託報酬	276,663
その他未払費用	4,194
(C) 純資産総額(A-B)	82,320,306
元本	62,941,901
次期繰越損益金	19,378,405
(D) 受益権総口数	62,941,901口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,079円

(注) 当ファンドの期首元本額は55,520,142円、期中追加設定元本額は29,294,620円、期中一部解約元本額は21,872,861円です。

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

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

## ○損益の状況

(2018年5月29日～2019年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	783,953
売買益	1,683,717
売買損	△ 899,764
(B) 信託報酬等	△ 543,409
(C) 当期損益金(A+B)	240,544
(D) 前期繰越損益金	1,366,586
(E) 追加信託差損益金	17,771,275
(配当等相当額)	( 12,676,465)
(売買損益相当額)	( 5,094,810)
(F) 計(C+D+E)	19,378,405
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	19,378,405
追加信託差損益金	17,771,275
(配当等相当額)	( 12,727,131)
(売買損益相当額)	( 5,044,144)
分配準備積立金	2,065,734
繰越損益金	△ 458,604

(注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	699,148円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	17,312,671円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	1,366,586円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	19,378,405円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,078円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

## 〈LPS4資産分散ファンド(安定重視型)〉

## ○投資信託財産の構成

(2019年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	13,567	15.5
TMA日本債券インデックスマザーファンド	44,383	50.6
TMA外国株式インデックスマザーファンド	9,247	10.5
TMA外国債券インデックスマザーファンド	20,198	23.0
コール・ローン等、その他	299	0.4
投資信託財産総額	87,694	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(10,263,043千円)の投資信託財産総額(10,317,438千円)に対する比率は99.5%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(4,163,290千円)の投資信託財産総額(4,281,681千円)に対する比率は97.2%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=109.57円、1カナダドル=81.53円、1メキシコペソ=5.76円、1ユーロ=122.62円、1英ポンド=138.96円、1スイスフラン=109.12円、1スウェーデンクローネ=11.44円、1ノルウェークローネ=12.59円、1デンマーククローネ=16.41円、1ポーランドズロチ=28.59円、1豪ドル=75.88円、1ニュージーランドドル=71.76円、1香港ドル=13.96円、1シンガポールドル=79.70円、1マレーシアリングギット=26.17円、1イスラエルシェケル=30.40円、1南アフリカランド=7.59円です。

## ＜LPS4資産分散ファンド(安定重視型)＞

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	87,694,340
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	13,567,910
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	44,383,036
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	9,247,766
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	20,198,242
未収入金	297,386
(B) 負債	283,211
未払信託報酬	278,960
その他未払費用	4,251
(C) 純資産総額(A-B)	87,411,129
元本	60,820,380
次期繰越損益金	26,590,749
(D) 受益権総口数	60,820,380口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,372円

(注) 当ファンドの期首元本額は57,614,799円、期中追加設定元本額は19,468,653円、期中一部解約元本額は16,263,072円です。

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

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

## ○損益の状況

(2018年5月29日～2019年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	337,174
売買益	1,937,535
売買損	△ 1,600,361
(B) 信託報酬等	△ 572,985
(C) 当期損益金(A+B)	△ 235,811
(D) 前期繰越損益金	1,963,042
(E) 追加信託差損益金	24,863,518
(配当等相当額)	( 21,079,051)
(売買損益相当額)	( 3,784,467)
(F) 計(C+D+E)	26,590,749
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	26,590,749
追加信託差損益金	24,863,518
(配当等相当額)	( 21,119,302)
(売買損益相当額)	( 3,744,216)
分配準備積立金	2,903,172
繰越損益金	△ 1,175,941

(注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	940,130円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	23,687,577円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	1,963,042円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	26,590,749円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	4,371円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

## ＜LPS4資産分散ファンド(バランス型)＞

## ○投資信託財産の構成

(2019年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	43,197	23.4
TMA日本債券インデックスマザーファンド	67,821	36.7
TMA外国株式インデックスマザーファンド	28,550	15.4
TMA外国債券インデックスマザーファンド	44,732	24.2
コール・ローン等、その他	661	0.3
投資信託財産総額	184,961	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(10,263,043千円)の投資信託財産総額(10,317,438千円)に対する比率は99.5%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(4,163,290千円)の投資信託財産総額(4,281,681千円)に対する比率は97.2%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=109.57円、1カナダドル=81.53円、1メキシコペソ=5.76円、1ユーロ=122.62円、1英ポンド=138.96円、1スイスフラン=109.12円、1スウェーデンクローネ=11.44円、1ノルウェークローネ=12.59円、1デンマーククローネ=16.41円、1ポーランドズロチ=28.59円、1豪ドル=75.88円、1ニュージーランドドル=71.76円、1香港ドル=13.96円、1シンガポールドル=79.70円、1マレーシアリングギット=26.17円、1イスラエルシェケル=30.40円、1南アフリカランド=7.59円です。

## ＜LPS4資産分散ファンド(バランス型)＞

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	184,961,243
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	43,197,871
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	67,821,159
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	28,550,024
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	44,732,942
未収入金	659,247
(B) 負債	627,834
未払信託報酬	618,340
その他未払費用	9,494
(C) 純資産総額(A-B)	184,333,409
元本	115,739,043
次期繰越損益金	68,594,366
(D) 受益権総口数	115,739,043口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,927円

- (注) 当ファンドの期首元本額は100,185,917円、期中追加設定元本額は31,827,578円、期中一部解約元本額は16,274,452円です。
- (注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。
- (注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

## ○損益の状況 (2018年5月29日～2019年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△ 700,386
売買益	3,892,591
売買損	△ 4,592,977
(B) 信託報酬等	△ 1,229,257
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,929,643
(D) 前期繰越損益金	8,442,010
(E) 追加信託差損益金	62,081,999
(配当等相当額)	( 52,725,423)
(売買損益相当額)	( 9,356,576)
(F) 計(C+D+E)	68,594,366
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	68,594,366
追加信託差損益金	62,081,999
(配当等相当額)	( 52,791,822)
(売買損益相当額)	( 9,290,177)
分配準備積立金	10,752,302
繰越損益金	△ 4,239,935

- (注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。
- (注) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。
- (注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。
- (注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	2,310,292円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	57,842,064円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	8,442,010円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	68,594,366円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	5,926円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

## ＜LPS4資産分散ファンド（成長重視型）＞

## ○投資信託財産の構成

(2019年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOP I Xマザーファンド	57,695	32.3
TMA日本債券インデックスマザーファンド	49,401	27.7
TMA外国株式インデックスマザーファンド	38,131	21.4
TMA外国債券インデックスマザーファンド	32,585	18.3
コール・ローン等、その他	659	0.3
投資信託財産総額	178,471	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（10,263,043千円）の投資信託財産総額（10,317,438千円）に対する比率は99.5%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（4,163,290千円）の投資信託財産総額（4,281,681千円）に対する比率は97.2%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=109.57円、1カナダドル=81.53円、1メキシコペソ=5.76円、1ユーロ=122.62円、1英ポンド=138.96円、1スイスフラン=109.12円、1スウェーデンクローネ=11.44円、1ノルウェークローネ=12.59円、1デンマーククローネ=16.41円、1ポーランドズロチ=28.59円、1豪ドル=75.88円、1ニュージーランドドル=71.76円、1香港ドル=13.96円、1シンガポールドル=79.70円、1マレーシアリングギット=26.17円、1イスラエルシェケル=30.40円、1南アフリカランド=7.59円です。

## ＜LPS4資産分散ファンド(成長重視型)＞

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	178,471,628
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	57,695,412
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	49,401,953
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	38,131,681
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	32,585,607
未収入金	656,975
(B) 負債	625,622
未払解約金	6
未払信託報酬	616,146
その他未払費用	9,470
(C) 純資産総額(A-B)	177,846,006
元本	102,356,316
次期繰越損益金	75,489,690
(D) 受益権総口数	102,356,316口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,375円

(注) 当ファンドの期首元本額は90,908,414円、期中追加設定元本額は27,429,451円、期中一部解約元本額は15,981,549円です。

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

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

## ○損益の状況 (2018年5月29日～2019年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△ 2,497,941
売買益	3,833,837
売買損	△ 6,331,778
(B) 信託報酬等	△ 1,240,928
(C) 当期損益金(A+B)	△ 3,738,869
(D) 前期繰越損益金	11,807,260
(E) 追加信託差損益金	67,421,299
(配当等相当額)	( 54,812,302)
(売買損益相当額)	( 12,608,997)
(F) 計(C+D+E)	75,489,690
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	75,489,690
追加信託差損益金	67,421,299
(配当等相当額)	( 54,878,060)
(売買損益相当額)	( 12,543,239)
分配準備積立金	14,288,001
繰越損益金	△ 6,219,610

(注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	2,480,741円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	61,201,689円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	11,807,260円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	75,489,690円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	7,375円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

## ＜LPS4資産分散ファンド（積極型）＞

## ○投資信託財産の構成

(2019年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
TMA日本株TOP I Xマザーファンド	67,496	41.3
TMA日本債券インデックスマザーファンド	30,268	18.5
TMA外国株式インデックスマザーファンド	44,607	27.3
TMA外国債券インデックスマザーファンド	19,965	12.2
コール・ローン等、その他	1,056	0.7
投資信託財産総額	163,392	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（10,263,043千円）の投資信託財産総額（10,317,438千円）に対する比率は99.5%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（4,163,290千円）の投資信託財産総額（4,281,681千円）に対する比率は97.2%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=109.57円、1カナダドル=81.53円、1メキシコペソ=5.76円、1ユーロ=122.62円、1英ポンド=138.96円、1スイスフラン=109.12円、1スウェーデンクローネ=11.44円、1ノルウェークローネ=12.59円、1デンマーククローネ=16.41円、1ポーランドズロチ=28.59円、1豪ドル=75.88円、1ニュージーランドドル=71.76円、1香港ドル=13.96円、1シンガポールドル=79.70円、1マレーシアリングギット=26.17円、1イスラエルシェケル=30.40円、1南アフリカランド=7.59円です。

## &lt;LPS4資産分散ファンド(積極型)&gt;

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	163,392,216
TMA日本株TOPIXマザーファンド(評価額)	67,496,511
TMA日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	30,268,047
TMA外国株式インデックスマザーファンド(評価額)	44,607,632
TMA外国債券インデックスマザーファンド(評価額)	19,965,759
未収入金	1,054,267
(B) 負債	1,022,822
未払解約金	395,978
未払信託報酬	617,374
その他未払費用	9,470
(C) 純資産総額(A-B)	162,369,394
元本	86,671,920
次期繰越損益金	75,697,474
(D) 受益権総口数	86,671,920口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,734円

(注) 当ファンドの期首元本額は95,055,628円、期中追加設定元本額は30,262,954円、期中一部解約元本額は38,646,662円です。

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

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

## ○損益の状況 (2018年5月29日～2019年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	△ 3,613,400
売買益	4,391,633
売買損	△ 8,005,033
(B) 信託報酬等	△ 1,302,832
(C) 当期損益金(A+B)	△ 4,916,232
(D) 前期繰越損益金	8,887,472
(E) 追加信託差損益金	71,726,234
(配当等相当額)	( 50,863,086)
(売買損益相当額)	( 20,863,148)
(F) 計(C+D+E)	75,697,474
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	75,697,474
追加信託差損益金	71,726,234
(配当等相当額)	( 50,930,991)
(売買損益相当額)	( 20,795,243)
分配準備積立金	11,147,804
繰越損益金	△ 7,176,564

(注) (A)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B)信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	2,260,332円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	64,549,670円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	8,887,472円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	75,697,474円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	8,733円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

## ○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2019年5月28日現在)

## ＜TMA日本株TOPIXマザーファンド＞

下記は、TMA日本株TOPIXマザーファンド全体(29,363,112千口)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
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			
日本水産	26.3	21.3	13,951
マルハニチロ	4.1	3.3	11,335
サカタのタネ	3.1	2.5	8,562
ホクト	4.6	2.4	4,351
<b>鉱業 (0.3%)</b>			
国際石油開発帝石	108.4	87.7	79,228
石油資源開発	3.7	3.2	7,446
K&Oエナジーグループ	4.9	3.2	5,273
<b>建設業 (2.8%)</b>			
ショーボンドホールディングス	2.1	1.6	12,080
ミライト・ホールディングス	7.3	6.1	10,351
ベステラ	3	3.2	4,064
安藤・間	16.8	13.7	9,672
東急建設	9.1	8.7	6,707
コムシスホールディングス	8	7.9	20,619
ミサワホーム	8.8	6.6	6,685
東建コーポレーション	1.1	1	6,470
ヤマウラ	6.1	5.6	4,709
大成建設	22.2	18	73,620
大林組	67.4	54.7	54,207
清水建設	66.9	55.9	49,080
長谷工コーポレーション	26	22.5	25,087
鹿島建設	98	42.4	63,854
西松建設	4.8	3.8	7,904
三井住友建設	17.1	13.3	8,219
前田建設工業	15.9	13.1	11,698
奥村組	3.7	2.9	10,034
東鉄工業	2.9	2.1	6,751
戸田建設	25	21.9	13,161
熊谷組	3.5	2.5	7,205
大東建託	7.9	6.4	91,168

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>NIPPO</b>	4.8	4.9	10,441
前田道路	7.2	5.6	12,420
東亜建設工業	3.1	4.3	6,768
五洋建設	27.6	21.5	10,384
住友林業	14.4	12.5	15,387
日本基礎技術	16.3	13.8	4,995
大和ハウス工業	65.6	50	168,450
積水ハウス	72.4	55.3	98,351
北陸電気工事	5.3	5.2	4,295
西部電気工業	1.8	—	—
中電工	3.3	3.2	7,110
関電工	9.4	7.6	6,665
きんでん	14.8	12.2	20,227
日本電設工業	4.2	3.4	8,224
協和エクシオ	8.1	6.9	17,063
新日本空調	5.6	4.2	7,400
九電工	4.3	3.5	11,182
三機工業	7.8	6.4	8,032
日揮	19.3	15.8	22,499
中外炉工業	2.9	2.3	3,829
ヤマト	8.4	7.8	4,180
高砂熱学工業	6.3	4.6	7,755
三晃金属工業	1.3	1.2	3,033
大氣社	2.8	2.3	7,670
日比谷総合設備	4.3	4.5	8,419
東芝プラントシステム	5	3.9	7,593
OSJBホールディングス	18	25.4	7,239
東洋エンジニアリング	9	11	5,115
千代田化工建設	15.1	—	—
新興ブランテック	10	5.7	6,765
<b>食料品 (4.3%)</b>			
日本製粉	6.7	4.9	9,040

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日清製粉グループ本社	24.4	18.4	48,465
鳥越製粉	9.9	7	5,243
日本甜菜製糖	4	3.3	6,497
三井製糖	2.8	2.2	5,236
森永製菓	4.5	4.1	20,623
江崎グリコ	5.4	4.8	25,536
山崎製パン	16.2	13.3	22,822
亀田製菓	1.8	1.5	7,102
寿スピリッツ	1.8	1.8	10,296
カルビー	9.2	7.2	23,508
森永乳業	4.1	3.1	12,601
ヤクルト本社	11.7	12	78,240
明治ホールディングス	13.1	11.5	90,850
雪印メグミルク	4.6	3.8	8,257
ブリマハム	16	3	6,612
日本ハム	8.6	6.6	29,799
丸大食品	18	2.8	5,569
S F o o d s	2.4	1.6	6,160
伊藤ハム米久ホールディングス	13.4	11.2	7,537
サッポロホールディングス	7.4	5.8	13,711
アサヒグループホールディングス	41.8	33.9	165,194
キリンホールディングス	95.7	73.1	175,293
宝ホールディングス	15.3	12.4	16,256
オエノンホールディングス	16.4	16.3	6,308
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	14.1	12.4	32,525
サントリー食品インターナショナル	15.3	10.9	51,284
ダイドーグループホールディングス	1.7	1.3	6,149
伊藤園	6.6	5	27,350
キーコーヒー	4.5	2.9	6,174
ユニカフェ	5	4	3,928
ジャパンフーズ	6.3	3.9	4,410
日清オイリオグループ	3.2	2.2	7,227
不二製油グループ本社	5.5	4	14,060
J-オイルミルズ	2.5	1.3	5,239
キッコーマン	15.7	10.7	53,500
味の素	46.2	35.7	68,829
キュービー	11.2	9.1	23,432
ハウス食品グループ本社	7.6	6.1	28,487

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カゴメ	7.8	6.5	17,277
アリアケジャパン	1.8	1.4	10,290
ニチレイ	9.6	8.4	23,032
東洋水産	10.8	8.4	37,128
日清食品ホールディングス	8.6	6.9	45,954
フジッコ	4.1	2.9	6,365
ロック・フィールド	5.1	4.9	8,016
日本たばこ産業	123.5	93.4	237,936
ユーグレナ	9.5	9.9	8,632
<b>繊維製品 (0.7%)</b>			
片倉工業	6.4	5.3	6,667
グンゼ	1.5	1.5	7,132
東洋紡	7.9	6.4	7,865
倉敷紡績	39	2.7	5,416
日本毛織	10.1	7.9	6,825
帝国繊維	3.9	2.6	5,941
帝人	17.3	12.7	22,733
東レ	150.9	122.1	90,732
日本フェルト	19.3	10.5	4,882
セーレン	4.4	4.1	5,809
小松マテーレ	8	8	6,296
ワコールホールディングス	5.7	4.4	12,007
ホギメディカル	2.3	2.1	7,434
T S I ホールディングス	13.5	9.3	6,119
三陽商会	2.8	3	5,178
オンワードホールディングス	12	10.2	5,977
ゴールドウイン	1.1	1.4	20,818
デサント	5.2	3.6	6,778
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>			
特種東海製紙	2.3	1.6	6,040
王子ホールディングス	87	71.4	42,340
日本製紙	9.1	7.5	14,565
三菱製紙	12.1	9.9	5,583
北越コーポレーション	14.7	11.9	6,830
大王製紙	8.3	7.2	9,417
レンゴー	19.5	16.2	16,248
ザ・バック	2.5	1.8	5,616

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
化学 (7.3%)			
クラレ	35.4	26.6	32,319
旭化成	129.9	112.4	130,777
共和レザー	8.1	5.2	4,087
昭和電工	13.8	10.5	32,287
住友化学	153	125.4	59,565
日産化学	12.2	9.8	45,570
クレハ	1.7	1.5	10,710
石原産業	6.3	5.8	6,101
片倉コープアグリ	3.7	3.6	4,024
日本曹達	17	2.8	7,613
東ソー	30.4	24.8	34,596
トクヤマ	6	4.5	11,146
セントラル硝子	4.2	3.4	8,364
東亜合成	12.5	10.2	12,178
大阪ソーダ	3.5	2.4	6,264
デンカ	7.6	6.1	19,489
信越化学工業	34.6	27.8	258,095
堺化学工業	3.5	2.5	6,215
エア・ウォーター	17.3	13.2	21,436
大陽日酸	16.2	13.3	28,196
日本パーカライジング	10.8	8.4	10,122
ステラ ケミファ	2.7	2.1	5,609
日本触媒	3.2	2.6	16,406
カネカ	27	4.1	15,600
三菱瓦斯化学	17.4	16	21,840
三井化学	19.1	14.6	34,748
J S R	20.9	16.3	25,020
東京応化工業	3.5	2.7	8,383
三菱ケミカルホールディングス	139.5	106.3	75,823
KHネオケム	3.1	2.9	8,282
ダイセル	28	24.1	23,063
住友パークライト	16	2.6	9,828
積水化学工業	43.3	34.9	55,700
日本ゼオン	17.7	14.6	15,271
アイカ工業	5.7	4.7	17,789
宇部興産	10.7	8	16,728
旭有機材	3.8	4.7	6,669

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立化成	10.5	7.4	21,578
タイガースポリマー	10.5	5.8	3,433
ミライアル	3.5	3.9	4,278
日本化薬	13.3	9.6	12,076
ADEKA	9.2	7.5	11,752
日油	8.1	6.1	24,095
ハリマ化成グループ	6.8	5.6	5,594
花王	48.9	39.1	347,325
ニイタカ	2.9	2.8	4,323
三洋化成工業	1.9	1.1	5,676
日本ペイントホールディングス	16.2	13	57,070
関西ペイント	22.1	18	36,756
中国塗料	9.9	7.2	6,768
太陽ホールディングス	2.3	2.4	7,944
D I C	8.3	7.1	19,766
サカタインクス	6	4.7	4,544
東洋インキS Cホールディングス	20	3.2	7,395
富士フイルムホールディングス	41.1	33.5	179,627
資生堂	37	32	267,328
ライオン	27.8	22.3	48,279
高砂香料工業	3	1.7	5,142
マンダム	3.8	3.6	9,867
ミルボン	2.6	2	10,760
ファンケル	4.6	6.9	19,872
コーセー	3.4	2.7	48,195
コタ	4.7	4.4	5,227
シーズ・ホールディングス	2.4	—	—
ポーラ・オルビスホールディングス	8.5	6.9	21,769
ノエビアホールディングス	1.3	1.5	8,775
エステー	3.6	3.3	5,874
長谷川香料	3.9	3.6	6,606
小林製薬	5.6	4.5	37,800
荒川化学工業	4.3	4.4	5,482
メック	4	6	6,084
タカラバイオ	5.5	4	9,944
アース製薬	2.7	1.4	7,140
大成ラミック	2.5	1.9	5,333
クミアイ化学工業	16.3	10.7	8,025

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本農薬	12.8	12.7	5,207
日東電工	15	11.1	55,544
レック	2.1	2.4	3,105
前澤化成工業	6.1	4.2	4,271
エフビコ	1.7	1.7	10,829
天馬	4	3.1	5,527
信越ポリマー	7.9	9.1	7,079
ニフコ	7.2	6.3	17,810
バルカー	2.8	2	4,144
ユニ・チャーム	42.1	34.1	115,087
<b>医薬品 (5.7%)</b>			
協和発酵キリン	24.9	19.1	40,759
武田薬品工業	73	140.6	555,229
アステラス製薬	204.4	148.4	223,713
大日本住友製薬	14.7	12.1	28,519
塩野義製薬	28	20.6	128,276
田辺三菱製薬	24.6	17.1	22,007
あすか製薬	4.4	5.9	7,003
日本新薬	5.1	4.2	33,726
中外製薬	20.7	16.8	120,288
科研製薬	3.7	3	15,630
エーザイ	23.8	19.2	126,547
ロート製薬	10.8	8.2	26,158
小野薬品工業	47	38.2	75,292
久光製薬	5.9	4.7	22,066
持田製薬	1.3	2.4	12,792
参天製薬	38	30.3	50,116
ツムラ	7.2	5	16,175
日医工	5.4	5	6,515
キッセイ薬品工業	3.5	2.7	7,171
生化学工業	7	5	6,335
栄研化学	—	2.7	5,229
鳥居薬品	3.3	1.9	4,459
JCRファーマ	1.8	1.1	7,942
東和薬品	1.2	2.7	7,379
沢井製薬	4	3.3	19,272
ゼリア新薬工業	4.7	3.9	8,080
第一三共	56.8	46	252,034

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キョーリン製薬ホールディングス	5.2	3.8	7,379
大幸薬品	3.9	3.8	7,303
大塚ホールディングス	41.2	30.6	117,534
大正製薬ホールディングス	4.5	3.6	33,192
ペプチドリーム	9	8	44,000
<b>石油・石炭製品 (0.6%)</b>			
昭和シェル石油	18.7	—	—
ニチレキ	7.3	6.7	6,914
出光興産	16.8	18.7	56,100
JXTGホールディングス	317.3	270.8	137,918
コスモエネルギーホールディングス	5.7	4.5	9,765
<b>ゴム製品 (0.8%)</b>			
横浜ゴム	11.5	9.3	17,670
TOYO TIRE	11.6	8.1	10,878
ブリヂストン	65.8	49.4	201,650
住友ゴム工業	20.2	14.5	17,922
オカモト	8	1.2	6,024
ニッタ	2.6	1.9	5,918
住友理工	8.1	7.4	6,090
パンドー化学	8.8	4.4	4,175
<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>			
日東紡績	3.9	3	6,054
AGC	20.2	16	58,720
日本山村硝子	31	3.4	5,134
日本電気硝子	8.5	6.9	18,340
住友大阪セメント	38	3.3	14,553
太平洋セメント	12.6	10.2	33,864
日本ヒューム	10.2	6.8	4,841
東海カーボン	17.6	14.7	15,861
東洋炭素	2.5	2.7	5,643
TOTO	15.4	12.5	51,937
日本碍子	24.5	19.5	29,503
日本特殊陶業	17.2	13.7	26,578
ニチアス	10	4.1	7,720
ニチハ	2.9	2.5	7,155
<b>鉄鋼 (0.9%)</b>			
日本製鉄	87.8	73.7	136,013
神戸製鋼所	36.4	29.4	20,727

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
合同製鐵	3.1	2.3	4,795
ジェイ エフ イー ホールディングス	53.1	42.9	66,688
日新製鋼	6.5	—	—
東京製鐵	11	8.6	7,525
共英製鋼	2.7	2.1	3,924
大和工業	4	3.3	10,444
大阪製鐵	4.1	3	5,370
淀川製鋼所	3.5	2.9	5,802
東洋鋼板	13.3	—	—
丸一鋼管	7	5.6	15,909
大同特殊鋼	3.5	2.5	9,837
山陽特殊製鋼	3.8	2.4	3,631
愛知製鋼	1.8	1	3,265
日立金属	21.4	17.1	18,946
大平洋金属	1	1.3	2,918
新日本電工	26.1	26.8	5,467
三菱製鋼	3.7	4.2	4,926
シンニッタン	22	11.5	3,967
<b>非鉄金属 (0.7%)</b>			
日本軽金属ホールディングス	56.3	44.6	10,347
三井金属鉱業	5.2	4.3	9,425
東邦亜鉛	1.7	1.3	3,034
三菱マテリアル	12.9	10.4	29,421
住友金属鉱山	25.2	21.9	64,002
DOWAホールディングス	4.9	3.8	12,787
古河機械金属	5.8	4.3	5,886
UACJ	4.3	3.4	5,950
古河電気工業	6.5	4.5	12,676
住友電気工業	73.4	59.4	79,952
フジクラ	23	18.4	6,789
タツタ電線	12.7	12.7	5,689
リョービ	3.2	3.2	6,620
アサヒホールディングス	4.6	3.6	7,390
<b>金属製品 (0.6%)</b>			
トーカロ	7.8	6.4	4,480
SUMCO	18.3	17.6	21,648
東洋製織グループホールディングス	13.9	10.1	21,078
コロナ	5.1	4.1	4,198

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
横河ブリッジホールディングス	4.2	4.2	6,493
駒井ハルテック	2.1	1.8	2,914
三和ホールディングス	19	16.1	17,581
文化シヤッター	10.2	7.5	6,315
三協立山	5.8	5.5	6,715
LIXILグループ	29.3	24	33,264
ノーリツ	5.3	4.7	6,664
長府製作所	4.2	2.7	5,915
リンナイ	3.5	2.9	21,025
日東精工	12.7	9.1	5,041
東プレ	3.4	2.7	4,868
高周波熱練	8.7	7.8	6,754
パイオラックス	3.7	2.7	4,962
日本発條	20	16.3	13,268
三益半導体工業	4.4	4.6	6,923
<b>機械 (4.9%)</b>			
日本製鋼所	6.6	4.9	8,109
三浦工業	8.7	6.9	23,494
タクマ	8	5.7	8,413
オークマ	2.2	2	10,660
東芝機械	14	2.9	6,591
アマダホールディングス	30.2	24.7	27,762
アイダエンジニアリング	6.6	7.6	5,654
F U J I	5.7	5.7	6,897
牧野フライス製作所	8	1.7	6,375
オーエスジー	9	7.8	16,091
旭ダイヤモンド工業	5.5	9.2	6,173
DMG森精機	10.6	10	13,270
ディスコ	2.7	2.2	33,616
日東工器	3.2	2.9	6,322
島精機製作所	2.3	2.3	7,061
NCホールディングス	5.7	—	—
日阪製作所	9.5	7	6,475
ナブテスコ	10.7	8.8	24,147
SMC	6.2	4.7	173,571
新川	6.4	—	—
ユニオンツール	2.4	2	5,512
オイレス工業	4.2	3	4,563

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サトーホールディングス	3.1	2.4	6,619
小松製作所	96.1	72.9	177,365
住友重機械工業	11.3	9.1	31,804
日立建機	9.2	6.4	16,492
巴工業	3.2	2.6	6,073
井関農機	4.8	3.3	4,936
タカキタ	6.1	6	3,216
クボタ	106.7	86.4	142,732
月島機械	6	5.2	7,020
帝国電機製作所	3.7	5.8	6,942
新東工業	8.8	6	5,622
小森コーポレーション	6.6	5.9	6,549
鶴見製作所	4.5	3.6	7,009
荏原製作所	8.2	7.1	19,517
西島製作所	10	6.4	6,131
ダイキン工業	27.1	22	303,820
栗田工業	10.7	8.6	22,119
椿本チエイン	11	1.9	6,327
ダイフク	10.1	8.9	48,238
タダノ	10	7.8	8,127
フジテック	6.8	6.1	8,790
CKD	5.3	6	6,174
平和	6.1	4.5	9,927
SANKYO	4.8	4	16,900
日本金銭機械	6.7	5.8	6,484
福島工業	2.1	1.9	6,897
竹内製作所	4	3.7	6,778
アマノ	6.2	4.6	13,142
グローリー	5.9	4.5	12,424
大和冷機工業	7.7	6.4	7,820
セガサミーホールディングス	19.6	16.3	21,988
リケン	1.4	1.1	5,054
ホシザキ	6.2	4.7	37,976
大豊工業	5.1	5.8	4,843
日本精工	41.4	33.7	30,431
NTN	47.4	37.3	10,854
ジェイテクト	21.2	16	18,976
不二越	17	1.5	6,525

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本トムソン	13.1	9.5	4,370
THK	12.4	10.2	23,215
ユーチン精機	5.1	5.2	5,595
キッツ	10.2	8.7	6,203
マキタ	25.9	19.7	76,337
日立造船	16.2	16.5	6,022
三菱重工業	33.3	27	128,493
I H I	15.4	12.5	31,150
スター精密	5.6	3.9	5,222
<b>電気機器 (13.0%)</b>			
日清紡ホールディングス	11.9	8.9	6,835
イビデン	12.1	9.8	16,738
コニカミノルタ	46.1	35.9	36,259
ブラザー工業	24.5	20.8	39,582
ミネベアミツミ	37.2	29.7	47,371
日立製作所	477	72.3	274,306
三菱電機	198.8	161	224,192
富士電機	59	10.4	38,324
安川電機	23.1	18.8	61,194
明電舎	23	4.4	6,705
東芝テック	16	2.9	8,099
マプチモーター	5.4	4.3	16,189
日本電産	23.9	19.4	270,145
東光高岳	3.1	3.4	3,899
ダブル・スコープ	4.8	—	—
ダイヘン	12	2.5	7,395
日新電機	7.8	6.2	6,472
オムロン	21.1	17.1	90,117
日東工業	5.2	3.7	7,196
ジーエス・ユアサ コーポレーション	35	5.6	10,830
メルコホールディングス	2.4	1.8	5,499
テクノメディカ	2.8	2.1	4,407
日本電気	25.3	20.9	85,272
富士通	204	15.5	118,420
沖電気工業	8.4	6.6	9,180
サンケン電気	14	2.9	6,243
アイホン	3.7	3.6	5,623
ルネサスエレクトロニクス	10.4	16.7	7,899

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セイコーエプソン	29.4	20.4	33,048
ワコム	18.6	16.6	5,693
アルバック	4.5	3.4	10,659
E I Z O	2	1.7	6,783
日本信号	10.1	6.4	7,078
能美防災	4.3	2.7	5,551
ホーチキ	4.3	3.9	4,672
パナソニック	227.2	183.9	165,087
シャープ	18.5	16	16,272
アンリツ	14.6	10.7	18,093
富士通ゼネラル	6.1	5	7,730
ソニー	132.6	107.9	588,918
TDK	10.4	8.4	63,000
アルプスアルパイン	17.3	16.7	29,709
パイオニア	44.4	—	—
日本トリム	1.4	0.9	4,689
フォスター電機	5.3	4.4	6,877
ヨコオ	4	2.9	5,878
ホシデン	8.9	5.9	6,047
ヒロセ電機	3.4	2.3	27,807
日本航空電子工業	5	4.9	7,345
アルパイン	4.2	—	—
アイコム	3.1	2.6	5,808
船井電機	7.6	8.3	6,125
横河電機	19.9	16.4	34,948
アズビル	6	10.6	27,538
日本光電工業	8.2	7.1	21,655
堀場製作所	4	3.1	15,779
アドバンテス	11.3	10.8	28,965
キーエンス	9.7	7.9	494,619
日置電機	1.8	1.6	5,720
シスメックス	15.4	12.5	96,250
OBARA GROUP	1.4	1.3	4,589
コーセル	6.5	4.1	4,350
イリソ電子工業	1.6	1.5	7,740
オブテックスグループ	3.5	4.2	5,699
千代田インテグレ	3.9	2.8	5,602
レーザーテック	4	3.4	13,192

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スタンレー電気	15.3	11.3	29,538
ウシオ電機	12.3	9.6	13,363
日本セラミック	3.2	2	5,726
図研	5.9	5.2	7,566
カシオ計算機	15.9	14.1	17,892
ファナック	18.9	15.3	280,525
ローム	8.9	7.7	49,896
浜松ホトニクス	14.4	11.6	46,400
三井ハイテック	5.9	5	5,255
新光電気工業	10.2	7.8	6,879
京セラ	32.6	24.5	168,241
太陽誘電	8.8	6.9	14,055
村田製作所	20.8	50.6	237,263
双葉電子工業	4.1	3.7	5,220
ニチコン	7.5	6.4	5,049
日本ケミコン	3	2.1	3,347
KO A	4.2	4.1	5,067
小糸製作所	11.9	9.7	52,089
ミツバ	6	8.5	4,930
S C R E E Nホールディングス	3.8	2.9	11,556
キャノン電子	3.8	3.8	6,615
キャノン	107	86.8	269,080
リコー	60.5	49	51,744
東京エレクトロン	13.2	10.7	160,607
<b>輸送用機器 (7.8%)</b>			
トヨタ紡織	5.6	5.3	7,441
ユニプレス	4.3	3	5,310
豊田自動織機	16.1	13	73,060
モリタホールディングス	4.8	3.5	6,821
デンソー	44.1	35.4	155,406
東海理化電機製作所	5.2	4.2	7,274
三井E&Sホールディングス	7.2	7.3	6,380
川崎重工業	15.4	12.7	31,610
日産自動車	234.5	189.9	145,292
いすゞ自動車	58	51.1	63,261
トヨタ自動車	241.4	179.3	1,184,097
日野自動車	28.2	19.9	17,651
三菱自動車工業	74.4	59.9	30,908

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	2.4	3.9	5,296
日産車体	9.2	7.4	7,400
新明和工業	9.1	6.7	8,716
極東開発工業	6.1	4	5,432
日信工業	5.1	4.7	6,655
トビー工業	3.2	1.7	3,855
ティラド	2.2	3.1	5,837
NOK	10.9	8.5	12,325
フタバ産業	11.4	11.2	6,081
KYB	1.9	2.1	5,875
プレス工業	21.5	13.9	6,797
ケーヒン	4.8	3.7	5,513
アイシン精機	16.4	13.3	49,343
マツダ	62.9	50.8	59,461
今仙電機製作所	7.4	6	5,268
本田技研工業	178.4	135.8	376,166
スズキ	39.4	29.4	161,670
SUBARU	61.5	50	133,525
ヤマハ発動機	28.2	22.4	42,627
ショーワ	5.2	5.1	7,318
エクセディ	2.5	2.5	5,625
豊田合成	7.1	5.2	10,337
愛三工業	8.3	7.9	5,514
ヨロズ	4.7	3.5	4,840
エフ・シー・シー	3.5	2.9	6,783
シマノ	8	6.5	109,395
テイ・エス テック	4.5	3.7	10,141
<b>精密機器 (2.1%)</b>			
テルモ	30.3	45.5	144,690
クリエートメディック	7.5	4.4	4,017
島津製作所	24	20.9	57,997
クボテック	7	—	—
ブイ・テクノロジー	0.5	0.6	6,042
東京精密	3.6	2.8	7,100
マニー	2.4	2	13,320
ニコン	34.8	28.5	44,346
トプコン	10.4	8.3	11,686
オリンパス	29.5	96.1	128,966

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
理研計器	3.1	2.7	5,292
タムロン	4.2	2.7	6,226
HOYA	40	32.4	257,256
朝日インテック	—	6.7	41,272
シチズン時計	23.9	18.9	9,487
メニコン	—	2	7,490
セイコーホールディングス	3.8	2.9	5,962
ニプロ	14	11.1	13,819
<b>その他製品 (2.2%)</b>			
パラマウントベッドホールディングス	2	1.8	8,181
パンダイナムコホールディングス	20.7	16.8	90,720
アイフィスジャパン	7	6.1	3,635
パイロットコーポレーション	3.5	2.7	10,894
トッパン・フォームズ	8	6.9	6,216
フジシールインターナショナル	4.4	3.6	13,698
タカラトミー	9.7	7.3	9,402
タカノ	5.7	4.9	3,626
大建工業	3.7	3	6,681
凸版印刷	56	22.5	37,530
大日本印刷	25.6	22.7	55,592
N I S S H A	4.1	4.3	4,476
アシックス	19.7	15.4	19,866
小松ウオール工業	2.9	2.3	4,287
ヤマハ	13.5	9.6	48,768
クリナップ	10.3	6.8	3,542
ビジョン	11.9	9.8	44,296
キングジム	8.4	5.8	5,156
リントック	4.7	3.6	7,887
イトーキ	11.6	11.2	4,558
任天堂	12.2	9.2	359,812
三菱鉛筆	4.2	2.8	5,546
タカラスタンダード	5.3	4.1	6,842
コクヨ	9.4	7.5	10,860
オカムラ	7.4	6	6,546
美津濃	3	2.9	7,223
<b>電気・ガス業 (1.7%)</b>			
東京電力ホールディングス	159.2	129.1	77,589
中部電力	61.1	49.4	76,397

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
関西電力	81.2	65.6	88,133
中国電力	27.8	22.4	30,643
北陸電力	20.1	16	12,784
東北電力	47.1	37.6	42,826
四国電力	18.5	14.9	15,212
九州電力	44.5	33.5	36,548
北海道電力	19.7	15.7	9,467
沖縄電力	3.4	3.1	5,245
電源開発	15.8	12.9	30,921
東京瓦斯	42.3	31.5	85,869
大阪瓦斯	37.8	31.2	60,808
東邦瓦斯	9.7	7.9	33,575
北海道瓦斯	17	3.7	5,483
西部瓦斯	4.4	2.8	6,504
静岡ガス	11.8	7.1	6,113
<b>陸運業 (4.8%)</b>			
東武鉄道	21.2	17.2	54,782
相鉄ホールディングス	6.3	5.5	16,940
東京急行電鉄	54.2	43.8	86,461
京浜急行電鉄	27.7	22.4	41,440
小田急電鉄	29.9	26	69,758
京王電鉄	11.2	9	67,770
京成電鉄	13.8	12	49,260
富士急行	—	2.1	8,631
東日本旅客鉄道	35.7	28.6	299,156
西日本旅客鉄道	17.9	14.5	124,192
東海旅客鉄道	17.8	14.4	330,192
西武ホールディングス	25.5	20.4	37,230
西日本鉄道	5.5	4.3	10,401
近鉄グループホールディングス	18.9	15.2	79,952
阪急阪神ホールディングス	25.2	20.4	80,580
南海電気鉄道	8.7	6.8	19,611
京阪ホールディングス	8.5	6.9	32,982
名古屋鉄道	14.8	12.4	37,187
日本通運	7.3	6	34,020
ヤマトホールディングス	33.2	26.9	61,089
山九	4.8	4.2	23,982
丸運	23	16.9	4,715

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
センコーグループホールディングス	14.3	9.3	7,746
トナミホールディングス	1.3	1	5,810
ニッコンホールディングス	7.1	5.7	14,324
日本石油輸送	1.6	1.5	4,231
福山通運	2.6	2	7,880
セイノーホールディングス	14.1	11.6	16,588
日立物流	4	3.4	10,897
C&Fロジホールディングス	6	4.5	6,259
九州旅客鉄道	15.8	12.9	44,763
S Gホールディングス	17.8	14.6	42,807
<b>海運業 (0.2%)</b>			
日本郵船	15.9	13	21,333
商船三井	11.9	9.1	21,494
川崎汽船	8.4	5.8	7,354
飯野海運	17.3	13.5	4,873
<b>空運業 (0.6%)</b>			
日本航空	35	27.8	97,466
A N Aホールディングス	36.6	27.9	102,895
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
三菱倉庫	6.5	5.2	15,433
三井倉庫ホールディングス	27	2.8	4,645
住友倉庫	14	5.6	7,817
東陽倉庫	25.2	15.9	4,944
安田倉庫	7.3	6	5,322
上組	11.9	9.5	24,377
キムラユニティ	4.1	3.9	4,024
キューソー流通システム	1.9	1.8	3,562
近鉄エクスプレス	4.4	4.5	6,439
エアアイテイ	6.2	5.3	5,421
<b>情報・通信業 (9.1%)</b>			
NEC ネットズエスアイ	4.2	3.1	8,850
システナ	—	6.1	9,760
デジタルアーツ	—	1	8,530
日鉄ソリューションズ	3.3	2.3	7,613
T I S	6.5	5.4	29,646
ネオス	11.7	5.9	4,590
電算システム	3.8	2.1	8,967
グリー	13.6	11.9	5,985

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コーエーテックホールディングス	5.2	3.9	7,885
ヒト・コミュニケーションズ	3	—	—
ブレインパッド	2	1	8,420
KL a b	6.4	6.9	6,396
ネクソン	43.8	40.7	68,172
エイチーム	3.6	3.3	5,243
コロブラ	8.7	7.7	5,336
サイバーリンクス	2.4	2.8	3,119
CARTA HOLDINGS	4.3	3.5	5,859
ティーガイア	3.4	2.7	4,927
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	53.7	40.4	12,928
GMOペイメントゲートウェイ	1.5	2.6	20,358
ザッパラス	14.1	11	4,103
インターネットイニシアティブ	4.2	3.1	6,634
LINE	5.8	4.7	15,792
フェイス	4.1	3	2,391
野村総合研究所	12.4	10.2	53,958
CEホールディングス	8.3	6.1	6,215
インテージホールディングス	7.7	7	7,147
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	—	3	5,070
フジ・メディア・ホールディングス	20.1	16.7	25,651
オービック	6.2	5.5	74,360
ジャストシステム	—	2	6,970
ヤフー	140.6	105.7	32,344
トレンドマイクロ	9.5	8.6	42,398
日本オラクル	3	3.3	25,443
フューチャー	9.4	4.9	9,354
CAC Holdings	9.2	5	8,820
ソフトバンク・テクノロジー	5.2	3.3	7,811
オービックビジネスコンサルタント	—	1.7	8,398
伊藤忠テクノソリューションズ	8.7	7.3	19,753
大塚商会	11.8	8.7	37,758
サイボウズ	9.3	6.6	7,873
電通国際情報サービス	2.9	2.9	10,338
デジタルガレージ	3.6	3.1	11,749
ウェザーニューズ	2	1.6	5,328
日本エンタープライズ	23.1	18.9	3,175
ネットワンシステムズ	7.9	5.7	17,442

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルゴグラフィックス	1.9	4	10,168
エイベックス	6.8	4.7	6,542
日本ユニシス	5.5	5	17,875
兼松エレクトロニクス	2.7	1.8	5,472
東京放送ホールディングス	11	10.4	19,063
日本テレビホールディングス	18.1	14.8	23,813
テレビ朝日ホールディングス	5.1	4.3	7,752
スカパーJ SATホールディングス	22.1	14.5	6,119
テレビ東京ホールディングス	3.3	1.4	3,249
日本電信電話	139.5	108.1	535,203
KDDI	175.5	139.3	389,343
ソフトバンク	—	167.6	241,344
光通信	2.3	1.9	42,579
NTTドコモ	140.2	100.2	254,908
GMOインターネット	7.1	5.7	10,231
カドカワ	9.8	5	7,335
ゼンリン	4	3.2	6,736
松竹	1.3	1	13,040
東宝	12.9	10.4	48,776
東映	0.7	0.7	10,248
エヌ・ティ・ティ・データ	61.2	42.7	56,278
ビジネスブレイン太田昭和	2.3	1.9	3,938
DTS	2.5	1.9	8,645
スクウェア・エニックス・ホールディングス	9.1	7.4	27,084
カプコン	8.1	7	16,044
SCSK	4.5	4.3	22,403
アイネス	7.7	6.6	8,071
TKC	2.8	2.5	11,000
富士ソフト	2.8	2.4	11,364
NSD	5	2.6	7,943
コナミホールディングス	7.9	6.6	33,792
ソフトバンクグループ	88.1	66	694,650
卸売業 (5.0%)			
伊藤忠食品	1.5	1.2	5,418
エレマテック	3.4	3.1	6,466
JALUX	1.7	2.2	6,146
双日	115.3	90	31,950
アルフレッサ ホールディングス	21.5	17.8	50,587

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
横浜冷凍	9.5	7	6,853
神戸物産	—	2.3	11,753
あい ホールディングス	3.3	3.8	6,756
ダイワボウホールディングス	—	1.4	6,559
マクニカ・富士エレホールディングス	5.1	5	6,365
バイタルケーエスケー・ホールディングス	8.6	4.9	5,213
レスターホールディングス	3.2	3.1	4,839
OCHIホールディングス	2.9	3.1	3,506
TOKAIホールディングス	10.8	9	8,127
シップヘルスケアホールディングス	4.2	3.4	16,354
明治電機工業	3.2	2.8	3,698
コマダホールディングス	—	3.4	7,051
エコートレーディング	11.7	8.1	4,406
ナガイレーベン	3.5	2.5	6,107
三菱食品	2.9	2.7	7,797
松田産業	3.9	4	5,872
第一興商	2.8	2.2	11,154
メディバルホールディングス	19.4	17.1	41,826
アズワン	1.4	1.1	10,516
尾家産業	2.7	3.3	4,227
ドウシシャ	3.5	3.6	6,483
丸文	8.1	7.5	4,125
橋本総業ホールディングス	2.8	2.9	4,062
日本ライフライン	5.6	4.9	8,981
IDOM	12	—	—
進和	3.5	3.3	6,982
オーハシテクニカ	4.8	3.9	5,393
白銅	2.6	2.4	3,177
伊藤忠商事	143.5	111	221,944
丸紅	161.1	156.9	108,998
長瀬産業	11.8	9.3	14,945
豊田通商	21.9	17.8	57,049
兼松	8.7	6.6	8,170
三井物産	165.9	130.7	217,158
日本紙バルブ商事	2.1	1.5	5,940
日立ハイテクノロジーズ	6.7	4.9	22,589
山善	11.3	6.9	6,948
住友商事	123.3	93.9	148,174

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	2.8	1.3	4,693
三菱商事	137.5	111.4	318,047
キヤノンマーケティングジャパン	5.6	4.3	10,074
西華産業	3.1	4.1	5,174
菱洋エレクトロ	5.3	4.2	6,892
東京産業	12.5	7.6	3,572
阪和興業	3.6	2.7	7,500
岩谷産業	4.2	3.6	13,176
イワキ	13.8	8.6	4,007
三菱石油	6.5	6.9	6,479
稲畑産業	5.9	4.8	6,657
ワキタ	7.6	6.4	6,918
東邦ホールディングス	5.6	4.6	11,615
サンゲツ	6.8	5	10,400
シナネンホールディングス	3.1	2.8	5,322
伊藤忠エネクス	8.2	6.7	5,755
サンリオ	5.8	4.8	12,288
リョーサン	2.5	2.5	6,617
三信電気	4.4	3.7	6,800
モスフードサービス	3.1	2.9	6,983
加賀電子	3.5	3.4	5,776
立花エレテック	3.8	3.7	5,809
フォーバル	6.6	5.7	5,266
PALTAC	2.7	2.8	16,604
日鉄物産	1.7	1.7	7,114
トラスコ中山	4	3.4	8,340
オートバックスセブン	7.7	6.1	10,607
加藤産業	2.9	2.5	8,887
イノテック	5.1	5	4,135
杉本商事	5.4	3.1	6,432
因幡電機産業	2.4	2.3	10,039
ミスミグループ本社	22.4	19.8	51,499
スズケン	9	7.2	50,328
ジェコス	8.1	5.3	5,029
<b>小売業 (4.6%)</b>			
ローソン	4.9	4	21,080
サンエー	1.9	1.3	5,707
エービーシー・マート	3.6	2.4	16,464

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ハードオフコーポレーション	4.3	4.5	3,190
アスクル	3	1.9	5,466
ゲオホールディングス	6.1	3.6	5,068
アダストリア	4.4	2.6	7,670
ジーフット	9.9	5.2	3,333
エディオン	8.7	7	6,839
あみやき亭	1.5	1.8	6,084
ハニーズホールディングス	6.6	5.6	5,689
ジンス	1.6	1.2	7,884
ビックカメラ	10.8	8.8	10,375
DCMホールディングス	11	8.7	9,561
Monotaro	7	10	22,970
J. フロント リテイリング	23.4	20.5	24,477
ドトール・日レスホールディングス	4	3.6	7,567
マツモトキヨシホールディングス	7.9	6.4	20,576
ZOZO	19.1	17.1	31,481
トレジャー・ファクトリー	3.9	3.8	2,739
ココカラファイン	2	1.7	7,522
三越伊勢丹ホールディングス	36.9	29.8	27,594
ウエルシアホールディングス	5.2	4.1	16,297
クリエイトSDホールディングス	3.4	2.6	6,320
シュッピン	5.2	4.1	3,464
ジョイフル本田	2.7	4.8	6,091
すかいらーくホールディングス	12.1	14.9	29,546
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	10.2	5.1	4,901
ブックオフコーポレーション	6.5	—	—
ゴルフダイジェスト・オンライン	5.7	6.7	4,803
あさひ	4.5	4	5,356
コスモス薬品	1	0.7	12,810
トーエル	5.8	3.6	2,548
セブン&アイ・ホールディングス	82.1	66.3	252,934
葉王堂	1.7	1.5	3,402
ツルハホールディングス	4.2	3.4	30,090
サンマルクホールディングス	3.4	3.2	7,622
トリドールホールディングス	2.9	4.5	8,496
クスリのアオキホールディングス	1.5	1.5	10,770
スシローグローバルホールディングス	2.2	1.7	12,920
カッパ・クリエイト	6.3	6	8,340

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ライトオン	8.3	5.4	4,276
良品計画	2.6	2.2	44,638
三城ホールディングス	15.7	10.3	3,502
アドヴァン	7.2	4.6	4,903
G-7ホールディングス	2.6	2.8	8,540
エコス	3.8	2.1	3,032
マルシェ	6.3	5.3	4,123
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	12.7	9.5	65,930
西松屋チェーン	7.2	5.1	4,620
ゼンショーホールディングス	10.3	7.6	17,578
サイゼリヤ	4.2	4.1	10,106
魚力	3.9	2.9	4,268
ユナイテッドアローズ	2.3	1.8	6,696
ハイデイ日高	3.1	3.2	6,588
京都市きの友禅	6.5	4.9	1,788
コロワイド	6.4	5.1	10,771
荳番屋	2.4	1.7	7,922
スギホールディングス	4.3	3.5	18,025
スクロール	15	9	3,168
ユニー・ファミリーマートホールディングス	6.2	17.7	51,648
木曾路	3.4	3	7,713
千趣会	13.3	12.8	3,660
ケーヨー	13	11.5	5,819
上新電機	1.4	2.5	5,697
日本瓦斯	3.5	2.7	7,300
ロイヤルホールディングス	3.6	3	8,328
いなげや	5.5	4.1	5,694
島忠	4.3	3.1	7,787
チヨダ	3.9	2.4	4,015
ライフコーポレーション	3.5	2	4,304
AOKIホールディングス	6.6	3.4	3,631
コメリ	3.2	2.5	5,402
青山商事	3.8	2.8	5,975
しまむら	2.2	1.8	14,976
高島屋	31	12.5	14,950
松屋	7.2	4.4	4,312
エイチ・ツー・オー リテイリング	9.5	7.8	9,399
パルコ	6.1	5	5,390

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丸井グループ	18.8	13.5	30,402
アクシアル リテイリング	2.7	1.7	6,902
イオン	75.3	61	122,152
イズミ	3.5	3.2	15,328
平和堂	4.2	3	5,805
フジ	3.8	2.9	5,249
ヤオコー	2	1.8	9,810
ゼビオホールディングス	4	4.7	5,992
ケーズホールディングス	16.7	16.1	17,516
Genky Drug Stores	1.5	1.7	4,675
ブックオフグループホールディングス	—	4.5	3,825
アインホールディングス	2.6	2.1	17,934
ヤマダ電機	66.3	48.8	24,595
ニトリホールディングス	7.8	6.9	92,460
吉野家ホールディングス	6.8	5.5	10,037
王特フードサービス	1.9	1.1	7,689
ブレナス	5.2	4.7	8,793
ミニストップ	3	3	5,121
アークス	3.7	2.8	6,118
パローホールディングス	4.5	3.3	7,616
ファーストリテイリング	2.6	2.1	139,356
サンドラッグ	8.2	5.8	16,280
ヤマザワ	4.2	2.4	3,907
ベルーナ	6.8	5.8	4,570
<b>銀行業 (6.0%)</b>			
めぶきフィナンシャルグループ	102.8	83.8	22,877
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2.2	3.3	5,652
九州フィナンシャルグループ	32.5	25.8	11,223
ゆうちょ銀行	56.1	45.1	50,602
コンコルディア・フィナンシャルグループ	116.7	100.1	42,742
西日本フィナンシャルホールディングス	12.6	9.8	7,957
関西みらいフィナンシャルグループ	7.7	7.3	5,256
三十三フィナンシャルグループ	4.6	2.5	3,585
第四北越フィナンシャルグループ	—	2.5	7,052
新生銀行	17.2	11.8	18,561
あおぞら銀行	11.6	8.8	23,311
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,371.7	1,092.3	560,349
りそなホールディングス	215.7	173.6	81,036

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	38.5	31.2	124,488
三井住友フィナンシャルグループ	147.9	111.8	432,218
第四銀行	2.1	—	—
北越銀行	3.2	—	—
千葉銀行	69.1	54.2	29,051
群馬銀行	39.1	32.8	12,726
武蔵野銀行	2.8	2.5	5,155
千葉興業銀行	7.8	11.6	2,714
七十七銀行	5.9	4.6	7,631
青森銀行	2	1	2,792
秋田銀行	2.8	1.7	3,763
山形銀行	3.4	2.3	3,746
岩手銀行	1.8	1.5	4,368
東邦銀行	15.3	17.6	4,505
東北銀行	3.7	1.3	1,345
ふくおかフィナンシャルグループ	79	13.8	27,144
静岡銀行	51.6	40.1	35,689
十六銀行	2.4	2.4	5,652
スルガ銀行	20.2	—	—
八十二銀行	35.5	36.2	16,615
山梨中央銀行	18	2.4	2,995
大垣共立銀行	3.5	3.1	7,585
福井銀行	3.7	2.5	3,892
北國銀行	2.1	1.8	5,643
滋賀銀行	17	3	7,875
南都銀行	2	2.3	4,850
百五銀行	17.5	15.5	5,099
京都銀行	7.4	5.7	24,396
紀陽銀行	6.9	5.5	8,178
ほくほくフィナンシャルグループ	13	10.4	12,292
広島銀行	28.6	23.5	13,230
山陰合同銀行	11	8.7	6,264
中国銀行	13.4	13.1	13,676
鳥取銀行	3.4	0.9	1,230
伊予銀行	27.8	21.3	12,055
百十四銀行	21	2.7	6,004
四国銀行	6	3.4	3,213
阿波銀行	14	2.5	6,875

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大分銀行	2.3	0.9	2,956
宮崎銀行	1.6	1.5	3,883
佐賀銀行	1.1	2.8	4,650
十八銀行	31	—	—
沖縄銀行	1.9	1.9	6,612
琉球銀行	3.9	4.1	4,829
セブン銀行	73.2	55.1	16,034
みずほフィナンシャルグループ	2,663.5	2,160.2	339,799
山口フィナンシャルグループ	24	19.9	16,477
長野銀行	3	0.9	1,497
名古屋銀行	2.7	1.6	5,736
北洋銀行	30	24.9	6,399
中京銀行	2.9	2	4,452
愛媛銀行	5.9	3.6	3,945
トマト銀行	4.4	1.7	1,730
京葉銀行	17	8	4,976
栃木銀行	19	18.8	3,365
トモニホールディングス	18.3	13.3	4,681
フィデアホールディングス	42.4	27.9	3,320
池田泉州ホールディングス	19.9	19.9	4,238
<b>証券、商品先物取引業 (0.8%)</b>			
F P G	7.3	7	6,251
S B Iホールディングス	22.4	18.8	49,312
ジャフコ	2.8	2.5	9,850
大和証券グループ本社	168	126.6	61,312
野村ホールディングス	337.5	280.6	99,697
岡三証券グループ	15	14.3	5,534
丸三証券	10.1	6.3	3,748
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	22.3	18.2	6,297
水戸証券	15.2	9.6	1,948
いちよし証券	8.8	4.8	3,753
松井証券	10.4	7.7	8,031
だいに証券ビジネス	7.1	7.7	3,295
マネックスグループ	22	16.2	5,799
カブドットコム証券	31.1	13.9	7,742
極東証券	6.3	4.2	3,973
藍澤証券	11.1	5.6	3,892

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>保険業 (2.3%)</b>			
かんぽ生命保険	7.1	5.9	11,811
S O M P Oホールディングス	38.5	28	113,288
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	51	41.5	143,382
ソニーフィナンシャルホールディングス	16	13.1	31,479
第一生命ホールディングス	110.7	89.9	145,997
東京海上ホールディングス	73.9	56.9	317,729
T & Dホールディングス	61	49.5	57,766
<b>その他金融業 (1.1%)</b>			
全国保証	5.6	4.4	18,150
クレディセゾン	15.1	10.9	12,774
芙蓉総合リース	2.1	1.9	10,184
興銀リース	3.5	2.9	7,293
東京センチュリー	4	3.1	14,461
日本証券金融	13.8	9.4	5,423
アイフル	34.2	26.9	5,675
リコーリース	2.7	1.9	6,412
イオンフィナンシャルサービス	13.8	10.4	17,867
アコム	40.1	33.1	12,280
オリエントコーポレーション	53.7	49.8	5,627
日立キャピタル	5.4	3.7	8,743
オリックス	130.6	106	164,459
三菱UFJリース	50.2	36.7	20,588
日本取引所グループ	56.6	42.7	74,810
アサックス	2.3	7.4	4,062
NECキャピタルソリューション	4.5	3.2	5,689
<b>不動産業 (2.4%)</b>			
いちご	26.5	23	7,866
ヒューリック	40.9	33.9	30,238
野村不動産ホールディングス	12.8	10.6	24,221
オープンハウス	3.1	2.3	10,856
東急不動産ホールディングス	47.3	42.4	27,008
飯田グループホールディングス	16.6	13.2	23,509
パーク24	10.8	9.2	20,046
三井不動産	97.7	84.4	230,327
三菱地所	145.9	111.5	233,369
平和不動産	4.4	3.6	7,592
東京建物	21.6	17.8	21,680

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ダイビル	9.1	6.6	6,395
京阪神ビルディング	8.3	6.9	7,210
住友不動産	47	35.7	147,441
大京	4.5	—	—
テーオーシー	10.7	9.3	6,017
レオパレス21	24.1	—	—
スタートコーポレーション	3.5	2.6	6,637
空港施設	10.1	10	5,190
ゴールドクレスト	3.6	3.8	6,585
日本エスリード	3.5	3.6	5,518
サンヨーハウジング名古屋	4.9	5.2	4,602
イオンモール	12.9	8.3	13,512
カチタス	2.6	2.2	8,899
エス・ティ・ティ都市開発	12.5	—	—
日本空港ビルデング	5.6	5.1	21,496
<b>サービス業 (5.3%)</b>			
日本M&Aセンター	13.2	11.4	34,314
パソナグループ	4.9	4.3	7,460
GCA	8.7	7.7	5,667
エス・エム・エス	3.7	5.6	14,196
パーソルホールディングス	17.5	15.3	36,674
クックパッド	14.9	17.5	5,757
学情	4.1	3	3,354
スタジオアリス	3.3	3	6,225
シミックホールディングス	3.3	2.9	5,800
NJS	5.7	2.7	4,314
総合警備保障	7.6	6.2	33,232
カカココム	14.4	11.7	27,132
アイロムグループ	2.3	3.1	5,065
ディップ	3.7	5.5	9,053
キャリアデザインセンター	2.7	2.5	3,822
ベネフィット・ワン	—	4.2	9,273
エムスリー	20.1	32.6	71,720
アウトソーシング	5.6	7.7	8,808
ディー・エヌ・エー	10.4	8.1	17,601
博報堂DYホールディングス	26.4	21.7	37,823
ぐるなび	7	11.4	6,349
ファンコミュニケーションズ	12.7	11.8	6,277

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
WDBホールディングス	2.6	2.6	7,113
インフォマート	9.7	8.2	14,161
E P Sホールディングス	5.1	3.7	6,697
クイック	5	4	6,928
ケネディクス	26.3	14.9	7,971
電通	23.2	18.8	69,184
みらかホールディングス	5.6	4.4	11,440
ダイオーズ	4.9	3.9	5,206
日本空調サービス	11.9	8.9	6,034
オリエンタルランド	22.4	18.2	243,425
ダスキン	4.9	4	11,432
ラウンドワン	5.5	5.2	8,616
リゾートトラスト	8.4	6.5	11,264
ビー・エム・エル	3.3	2.5	7,875
りらいあコミュニケーションズ	6.1	6.4	7,776
リソー教育	7	16.5	7,260
早稲田アカデミー	4.4	6.1	4,843
ユー・エス・エス	23.6	19	38,798
サイバーエージェント	11.8	8.9	41,118
楽天	97.9	72.1	82,915
テー・オー・ダブリュー	9.8	6.7	5,246
エン・ジャパン	—	2	7,980
テクノプロ・ホールディングス	3.7	3	18,360
インターワークス	3.8	4	2,452
キャリアリンク	9.1	9.1	4,040
ライドオンエクスプレスホールディングス	4.9	3.9	4,539
リクルートホールディングス	146.4	110.3	398,955
エラン	2.6	2.6	4,693
日本郵政	107.7	126.2	153,206
MS-Japan	0.8	3	4,713
リログループ	10.4	8.3	25,024
エイチ・アイ・エス	2.9	2.7	8,748
共立メンテナンス	3.4	2.5	14,300
建設技術研究所	5.8	3.9	5,772
よみうりランド	1.9	1.2	6,060
東京都競馬	2.2	2.3	7,797
カナモト	3.1	2.5	6,235
東京ドーム	9.2	7.9	8,800

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トランス・コスモス	3.8	3.8	9,260
乃村工藝社	4.8	3.7	10,892
日本管財	4.2	2.2	4,109
白洋舎	1.7	1.6	4,800
セコム	20.1	16.4	157,046
セントラル警備保障	2.1	1.6	8,848
メイテック	2.1	2	10,840
応用地質	5.5	5.6	6,070
船井総研ホールディングス	4	3.2	8,480
ベネッセホールディングス	7	5.5	14,074

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
イオンデイライト	2.7	2	6,450	
ニチイ学館	5.6	7	10,003	
ダイセキ	3.1	2.7	7,325	
ステップ	4.2	3.2	4,662	
合 計	株 数 ・ 金 額	24,088	18,768	35,838,993
	銘柄数<比率>	1,090	1,085	<95.8%>

(注) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の<>内は、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 1,563	百万円 —

## 〈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(4,295,399千口)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BB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	4,400,000	4,860,647	86.8	—	62.2	18.6	5.9	
地方債証券	100,000	101,517	1.8	—	—	—	1.8	
	( 100,000)	( 101,517)	( 1.8)	(—)	( —)	( —)	( 1.8)	
特殊債券 (除く金融債)	100,000	103,387	1.8	—	—	—	1.8	
	( 100,000)	( 103,387)	( 1.8)	(—)	( —)	( —)	( 1.8)	
普通社債券 (含む投資法人債券)	422,864	474,675	8.5	—	6.7	—	1.8	
	( 422,864)	( 474,675)	( 8.5)	(—)	( 6.7)	( —)	( 1.8)	
合 計	5,022,864	5,540,226	98.9	—	68.9	18.6	11.4	
	( 622,864)	( 679,579)	(12.1)	(—)	( 6.7)	( —)	( 5.5)	

(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
<b>国債証券</b>	%	千円	千円		<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第391回利付国債(2年)	0.1	100,000	100,306	2020/8/1	第71回利付国債(20年)	2.2	60,000	67,275	2024/6/20
第126回利付国債(5年)	0.1	170,000	170,691	2020/12/20	第74回利付国債(20年)	2.1	40,000	45,110	2024/12/20
第129回利付国債(5年)	0.1	170,000	171,064	2021/9/20	第75回利付国債(20年)	2.1	30,000	33,994	2025/3/20
第132回利付国債(5年)	0.1	50,000	50,423	2022/6/20	第76回利付国債(20年)	1.9	10,000	11,214	2025/3/20
第133回利付国債(5年)	0.1	190,000	191,772	2022/9/20	第80回利付国債(20年)	2.1	40,000	45,560	2025/6/20
第135回利付国債(5年)	0.1	80,000	80,858	2023/3/20	第82回利付国債(20年)	2.1	30,000	34,345	2025/9/20
第136回利付国債(5年)	0.1	60,000	60,687	2023/6/20	第84回利付国債(20年)	2.0	80,000	91,519	2025/12/20
第137回利付国債(5年)	0.1	50,000	50,608	2023/9/20	第85回利付国債(20年)	2.1	20,000	23,119	2026/3/20
第139回利付国債(5年)	0.1	40,000	40,543	2024/3/20	第90回利付国債(20年)	2.2	65,000	76,349	2026/9/20
第5回利付国債(40年)	2.0	30,000	43,542	2052/3/20	第99回利付国債(20年)	2.1	20,000	23,840	2027/12/20
第7回利付国債(40年)	1.7	45,000	62,021	2054/3/20	第100回利付国債(20年)	2.2	70,000	84,382	2028/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	30,000	33,815	2057/3/20	第105回利付国債(20年)	2.1	20,000	24,124	2028/9/20
第11回利付国債(40年)	0.8	10,000	10,921	2058/3/20	第113回利付国債(20年)	2.1	20,000	24,457	2029/9/20
第320回利付国債(10年)	1.0	50,000	51,505	2021/12/20	第116回利付国債(20年)	2.2	50,000	62,090	2030/3/20
第324回利付国債(10年)	0.8	50,000	51,499	2022/6/20	第117回利付国債(20年)	2.1	50,000	61,548	2030/3/20
第327回利付国債(10年)	0.8	55,000	56,931	2022/12/20	第123回利付国債(20年)	2.1	70,000	87,405	2030/12/20
第335回利付国債(10年)	0.5	100,000	103,647	2024/9/20	第127回利付国債(20年)	1.9	30,000	36,708	2031/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	30,000	31,056	2025/6/20	第133回利付国債(20年)	1.8	90,000	109,866	2031/12/20
第340回利付国債(10年)	0.4	80,000	82,936	2025/9/20	第141回利付国債(20年)	1.7	70,000	85,270	2032/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	60,000	61,136	2026/3/20	第145回利付国債(20年)	1.7	50,000	61,177	2033/6/20
第343回利付国債(10年)	0.1	85,000	86,670	2026/6/20	第146回利付国債(20年)	1.7	50,000	61,288	2033/9/20
第344回利付国債(10年)	0.1	30,000	30,599	2026/9/20	第147回利付国債(20年)	1.6	30,000	36,406	2033/12/20
第345回利付国債(10年)	0.1	30,000	30,608	2026/12/20	第151回利付国債(20年)	1.2	20,000	23,193	2034/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	60,000	61,209	2027/3/20	第153回利付国債(20年)	1.3	60,000	70,599	2035/6/20
第347回利付国債(10年)	0.1	80,000	81,631	2027/6/20	第154回利付国債(20年)	1.2	50,000	58,081	2035/9/20
第348回利付国債(10年)	0.1	130,000	132,623	2027/9/20	第156回利付国債(20年)	0.4	50,000	51,542	2036/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	120,000	122,305	2028/6/20	第158回利付国債(20年)	0.5	50,000	52,247	2036/9/20
第352回利付国債(10年)	0.1	50,000	50,939	2028/9/20	第160回利付国債(20年)	0.7	80,000	86,284	2037/3/20
第353回利付国債(10年)	0.1	70,000	71,282	2028/12/20	第161回利付国債(20年)	0.6	40,000	42,419	2037/6/20
第3回利付国債(30年)	2.3	20,000	25,117	2030/5/20	第164回利付国債(20年)	0.5	10,000	10,393	2038/3/20
第5回利付国債(30年)	2.2	10,000	12,619	2031/5/20	第167回利付国債(20年)	0.5	10,000	10,350	2038/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	10,000	13,773	2036/3/20	小計		4,400,000	4,860,647	
第28回利付国債(30年)	2.5	20,000	28,108	2038/3/20	<b>地方債証券</b>				
第29回利付国債(30年)	2.4	60,000	83,611	2038/9/20	平成22年度第3回横浜市公募公債	1.168	100,000	101,517	2020/9/18
第32回利付国債(30年)	2.3	10,000	13,930	2040/3/20	小計		100,000	101,517	
第33回利付国債(30年)	2.0	20,000	26,757	2040/9/20	<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
第34回利付国債(30年)	2.2	100,000	138,466	2041/3/20	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	103,387	2021/2/26
第38回利付国債(30年)	1.8	20,000	26,373	2043/3/20	小計		100,000	103,387	
第39回利付国債(30年)	1.9	20,000	26,879	2043/6/20	<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>				
第40回利付国債(30年)	1.8	10,000	13,234	2043/9/20	第33回道路債債券	2.91	100,000	138,106	2034/6/20
第47回利付国債(30年)	1.6	20,000	25,755	2045/6/20	第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	43,934	46,684	2046/11/10
第49回利付国債(30年)	1.4	70,000	86,911	2045/12/20	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	48,027	51,009	2046/12/10
第50回利付国債(30年)	0.8	20,000	21,804	2046/3/20	第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	45,768	48,595	2047/1/10
第51回利付国債(30年)	0.3	50,000	48,132	2046/6/20	第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	46,867	49,833	2047/4/10
第56回利付国債(30年)	0.8	20,000	21,757	2047/9/20	第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	38,268	39,307	2039/2/10
第58回利付国債(30年)	0.8	80,000	87,029	2048/3/20	第7回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特別付)	2.11	100,000	101,139	2019/12/20
第59回利付国債(30年)	0.7	40,000	42,406	2048/6/20	小計		422,864	474,675	
第62回利付国債(30年)	0.5	10,000	10,026	2049/3/20	合計		5,022,864	5,540,226	
第50回利付国債(20年)	1.9	60,000	62,253	2021/3/22					
第51回利付国債(20年)	2.0	90,000	94,032	2021/6/21					
第53回利付国債(20年)	2.1	20,000	21,168	2021/12/20					
第60回利付国債(20年)	1.4	20,000	21,132	2022/12/20					
第66回利付国債(20年)	1.8	60,000	65,448	2023/12/20					
第67回利付国債(20年)	1.9	30,000	33,018	2024/3/20					
第70回利付国債(20年)	2.4	40,000	45,258	2024/6/20					

(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(4,217,840千口)の内容です。

## 外国株式

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等	
		株数	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	20	15	83	9,095	保険
AGCO CORP	5	—	—	—	資本財
AT&T INC	143	182	588	64,528	電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	44	44	340	37,323	ヘルスケア機器・サービス
ABBVIE INC	38	38	304	33,360	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABIOMED INC	—	1	34	3,732	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	24	19	80	8,850	メディア・娯楽
ACUITY BRANDS INC	2	1	24	2,657	資本財
ADOBE INC	12	12	346	37,934	ソフトウェア・サービス
ADVANCE AUTO PARTS	3	2	36	3,949	小売
ADVANCED MICRO DEVICES	—	24	65	7,190	半導体・半導体製造装置
AETNA INC	8	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	2	2	20	2,237	各種金融
AGILENT TECHNOLOGIES INC	14	8	57	6,336	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	7	5	106	11,673	素材
AKAMAI TECHNOLOGIES	6	5	40	4,412	ソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	—	3	22	2,517	素材
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	7	5	75	8,303	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	2	65	7,166	ヘルスケア機器・サービス
ALLEGHANY CORP	0.99	0.53	36	3,982	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	1	1	25	2,842	ソフトウェア・サービス
ALLSTATE CORP	10	8	78	8,626	保険
ALPHABET INC-CL C	7	7	895	98,113	メディア・娯楽
ALPHABET INC-CL A	7	7	866	94,940	メディア・娯楽
ALTRIA GROUP INC	44	47	248	27,271	食品・飲料・タバコ
AMAZON.COM INC	10	10	1,910	209,366	小売
AMEREN CORPORATION	11	6	50	5,542	公益事業
AMERICAN ELECTRIC POWER	12	11	104	11,395	公益事業
AMERICAN EXPRESS COMPANY	18	18	219	24,002	各種金融
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	27	23	125	13,735	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	—	5	58	6,390	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	7	5	43	4,817	ヘルスケア機器・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	3	4	61	6,768	各種金融
AMETEK INC	—	6	55	6,109	資本財
AMGEN INC	20	16	275	30,215	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMPHENOL CORP-CL A	9	7	65	7,139	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ANADARKO PETROLEUM CORP	14	13	93	10,285	エネルギー
ANALOG DEVICES	8	9	95	10,503	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	2	2	44	4,909	ソフトウェア・サービス
ANTHEM INC	6	6	185	20,323	ヘルスケア機器・サービス
APACHE CORP	13	13	36	3,961	エネルギー
APPLE INC	129	119	2,138	234,277	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	28	25	102	11,231	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	—	9	30	3,309	消費者サービス
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	12	13	52	5,762	食品・飲料・タバコ
ARISTA NETWORKS INC	—	1	44	4,823	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	期末			業種等
		株数	評価額		
			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	
ASSURANT INC	—	2	26	2,884	保険
ATMOS ENERGY CORP	—	3	39	4,336	公益事業
AUTODESK INC	7	6	98	10,740	ソフトウェア・サービス
AUTOLIV INC	3	3	24	2,646	自動車・自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESSING	14	10	171	18,744	ソフトウェア・サービス
AUTOZONE INC	0.9	0.67	70	7,724	小売
AVERY DENNISON CORP	3	3	30	3,339	素材
BB&T CORPORATION	21	18	89	9,823	銀行
BAKER HUGHES A GE CO	14	14	31	3,497	エネルギー
BALL CORP	12	9	57	6,258	素材
BANK OF AMERICA CORP	262	235	664	72,847	銀行
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	32	25	114	12,533	各種金融
BAXTER INTL INC	13	12	93	10,285	ヘルスケア機器・サービス
BECTON DICKINSON & CO	7	6	159	17,497	ヘルスケア機器・サービス
WR BERKLEY CORP	4	5	31	3,488	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	35	32	655	71,844	各種金融
BEST BUY COMPANY INC	—	7	46	5,064	小売
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	6	5	52	5,699	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOGEN INC	6	5	119	13,111	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BLACKROCK INC	3	2	128	14,132	各種金融
H&R BLOCK INC	10	8	24	2,670	消費者サービス
BOEING CO	15	13	486	53,352	資本財
BOOKING HOLDINGS INC	1	1	199	21,902	小売
BORGWARNER INC	8	7	28	3,092	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	35	36	139	15,301	ヘルスケア機器・サービス
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	5	5	20	2,242	保険
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	51	41	194	21,351	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	—	3	48	5,267	ソフトウェア・サービス
BROADCOM INC	11	10	267	29,305	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	11	8	45	4,975	食品・飲料・タバコ
CBS CORP CL-B	11	10	49	5,405	メディア・娯楽
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	3	36	4,019	各種金融
CBRE GROUP INC - A	—	10	48	5,276	不動産
CDK GLOBAL INC	5	4	23	2,547	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	—	4	48	5,359	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	6	4	36	3,974	運輸
CIGNA CORP	6	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CIGNA CORP	—	10	150	16,460	ヘルスケア機器・サービス
CME GROUP INC	8	8	166	18,201	各種金融
CMS ENERGY CORP	10	9	51	5,663	公益事業
CSX CORP	22	19	148	16,323	運輸
CVS HEALTH CORPORATION	24	33	176	19,317	ヘルスケア機器・サービス
CA INC	12	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CABOT OIL & GAS CORP	15	11	30	3,370	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	12	6	23	2,565	食品・飲料・タバコ
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	11	13	118	12,960	各種金融
CARDINAL HEALTH INC	12	9	44	4,843	ヘルスケア機器・サービス
CARMAX INC	8	5	42	4,675	小売
CARNIVAL CORP	13	10	54	6,022	消費者サービス
CATERPILLAR INC	19	15	187	20,522	資本財
CELANESE CORP-SERIES A	5	4	43	4,714	素材
CELGENE CORP	19	18	173	19,013	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
CENTENE CORP	—	11	66	7,265	ヘルスケア機器・サービス	
CENTERPOINT ENERGY INC	—	14	42	4,617	公益事業	
CERNER CORP	14	8	58	6,365	ヘルスケア機器・サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	5	4	162	17,791	メディア・娯楽	
CHEVRONTEXACO CORP	50	47	566	62,108	エネルギー	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	0.99	0.68	45	4,936	消費者サービス	
CHURCH & DWIGHT CO INC	—	7	53	5,869	家庭用品・パーソナル用品	
CIMAREX ENERGY CO	3	3	21	2,391	エネルギー	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	7	4	49	5,450	保険	
CISCO SYSTEMS INC	137	113	617	67,609	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CINTAS CORP	3	2	52	5,729	商業・専門サービス	
CITIGROUP INC	73	63	405	44,454	銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	14	50	5,513	銀行	
CITRIX SYSTEMS INC	5	4	42	4,666	ソフトウェア・サービス	
CLOROX COMPANY	4	3	48	5,311	家庭用品・パーソナル用品	
COCA-COLA COMPANY	88	99	492	53,971	食品・飲料・タバコ	
COGNEX CORP	—	6	26	2,917	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	16	14	90	9,883	ソフトウェア・サービス	
COLGATE-PALMOLIVE CO	19	20	145	15,969	家庭用品・パーソナル用品	
COMCAST CORP-CL A	130	116	498	54,594	メディア・娯楽	
COMERICA INC	5	5	39	4,380	銀行	
CONAGRA BRANDS INC	14	14	42	4,630	食品・飲料・タバコ	
CONCHO RESOURCES INC	4	5	54	6,011	エネルギー	
CONOCOPHILLIPS	29	27	162	17,839	エネルギー	
CONSOLIDATED EDISON INC	6	7	62	6,818	公益事業	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	4	4	86	9,491	食品・飲料・タバコ	
COOPER COS INC/THE	1	1	45	4,945	ヘルスケア機器・サービス	
COPART INC	—	6	46	5,141	商業・専門サービス	
CORNING INC	25	20	59	6,567	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COSTCO WHOLESALE CORP	10	10	269	29,535	食品・生活必需品小売り	
COSTAR GROUP INC	—	1	51	5,632	商業・専門サービス	
COTY INC-CL A	21	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品	
CUMMINS INC	4	3	55	6,132	資本財	
DR HORTON INC	15	10	47	5,237	耐久消費財・アパレル	
DTE ENERGY COMPANY	6	3	48	5,362	公益事業	
DXC TECHNOLOGY CO	10	7	42	4,612	ソフトウェア・サービス	
DANAHER CORP	19	15	208	22,873	ヘルスケア機器・サービス	
DARDEN RESTAURANTS INC	4	3	44	4,896	消費者サービス	
DAVITA INC	7	5	24	2,715	ヘルスケア機器・サービス	
DEERE & CO	9	8	111	12,210	資本財	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	9	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
DENTSPLY SIRONA INC	8	7	39	4,311	ヘルスケア機器・サービス	
DEVON ENERGY CORPORATION	14	15	40	4,474	エネルギー	
THE WALT DISNEY CO	41	46	610	66,943	メディア・娯楽	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	10	9	73	8,004	各種金融	
DISCOVERY INC-A	13	7	19	2,188	メディア・娯楽	
DISCOVERY INC-C	16	10	26	2,943	メディア・娯楽	
EVEREST RE GROUP LTD	2	1	37	4,107	保険	
Dollar General Corp	7	6	79	8,672	小売	
DOLLAR TREE INC	9	6	61	6,718	小売	
DOMINION ENERGY INC	14	18	141	15,507	公益事業	
DOMINO'S PIZZA INC	—	1	39	4,304	消費者サービス	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
DOVER CORP	6	4	43	4,820	資本財	
DOW INC	—	19	97	10,630	素材	
DOWDUPONT INC	65	58	182	19,989	素材	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	4	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
DUKE ENERGY CORP	12	17	152	16,669	公益事業	
EOG RESOURCES INC	16	14	130	14,258	エネルギー	
E*TRADE FINANCIAL CORP	11	8	39	4,353	各種金融	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	—	4	54	5,976	消費者サービス	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	4	4	33	3,617	素材	
EBAY INC	27	23	84	9,271	小売	
ECOLAB INC	7	5	106	11,716	素材	
BUNGE LIMITED	5	5	28	3,085	食品・飲料・タバコ	
EDISON INTERNATIONAL	9	8	51	5,670	公益事業	
Edwards Lifesciences Corp	6	5	90	9,966	ヘルスケア機器・サービス	
ELECTRONIC ARTS INC	8	8	75	8,293	メディア・娯楽	
EMERSON ELECTRIC CO	16	14	89	9,845	資本財	
ENTERGY CORP	6	5	51	5,650	公益事業	
EQUIFAX INC	6	3	41	4,587	商業・専門サービス	
EVERGY INC	—	6	37	4,133	公益事業	
EVERSOURCE ENERGY	9	6	51	5,685	公益事業	
EXELON CORP	30	22	113	12,408	公益事業	
EXPEDIA GROUP INC	6	3	38	4,216	小売	
EXPEDITORS INTL WASH INC	6	5	40	4,407	運輸	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	18	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
EXXON MOBIL CORPORATION	98	105	783	85,819	エネルギー	
FLIR SYSTEMS INC	—	5	27	3,033	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FACEBOOK INC-A	61	60	1,101	120,738	メディア・娯楽	
FASTENAL CO	12	15	47	5,153	資本財	
FEDEX CORP	6	6	103	11,320	運輸	
F5 NETWORKS INC	2	2	29	3,240	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	9	7	93	10,265	ソフトウェア・サービス	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	13	9	38	4,171	保険	
FIFTH THIRD BANCORP	21	20	54	5,997	銀行	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	7	4	48	5,275	銀行	
FISERV INC	12	10	91	9,988	ソフトウェア・サービス	
FIRSTENERGY CORP	19	12	54	5,982	公益事業	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	—	2	58	6,372	ソフトウェア・サービス	
FLUOR CORP	—	6	18	2,020	資本財	
FLOWSERVE CORP	—	5	25	2,750	資本財	
FORD MOTOR CO	89	98	97	10,641	自動車・自動車部品	
FORTINET INC	—	4	36	4,046	ソフトウェア・サービス	
FORTIVE CORP	9	7	57	6,301	資本財	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	9	5	29	3,250	資本財	
FOX CORP-CLASS A	—	11	41	4,510	メディア・娯楽	
FOX CORP-CLASS B	—	6	23	2,568	メディア・娯楽	
FRANKLIN RESOURCES INC	15	10	34	3,777	各種金融	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	6	5	48	5,300	保険	
GARTNER INC	3	2	44	4,927	ソフトウェア・サービス	
GENERAL DYNAMICS CORP	6	6	103	11,358	資本財	
GENERAL ELECTRIC CO	211	225	213	23,394	資本財	
GENERAL MILS INC	14	15	80	8,824	食品・飲料・タバコ	
GENERAL MOTORS CO	33	33	116	12,756	自動車・自動車部品	

銘柄	株数	期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
GENUINE PARTS CO	5	4	44	4,893	小売
GILEAD SCIENCES INC	31	32	218	23,929	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GLOBAL PAYMENTS INC	—	4	63	6,909	ソフトウェア・サービス
GODADDY INC - CLASS A	—	5	41	4,589	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	9	8	173	18,968	各種金融
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	12	11	16	1,851	自動車・自動車部品
WR GRACE & CO	5	—	—	—	素材
WW GRAINGER INC	1	1	39	4,334	資本財
HCA HEALTHCARE INC	8	7	92	10,149	ヘルスケア機器・サービス
HP INC	46	40	81	8,877	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HALLIBURTON CO	19	21	49	5,476	エネルギー
HARLEY-DAVIDSON INC	10	7	24	2,717	自動車・自動車部品
HARRIS CORP	—	2	54	6,006	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	11	10	54	5,961	保険
HASBRO INC	4	3	36	4,007	耐久消費財・アパレル
HELMERICH & PAYNE	6	3	19	2,140	エネルギー
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	2	34	3,832	ソフトウェア・サービス
HESS CORP	9	7	46	5,134	エネルギー
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	47	37	54	5,980	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	—	7	68	7,556	消費者サービス
HOLLYFRONTIER CORP	6	6	27	2,990	エネルギー
HOME DEPOT INC	27	28	549	60,156	小売
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	16	18	300	32,946	資本財
HORMEL FOODS CORP	11	10	41	4,527	食品・飲料・タバコ
HUMANA INC	4	3	96	10,560	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	3	3	28	3,119	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	46	34	46	5,041	銀行
IAC/INTERACTIVECORP	—	2	53	5,812	メディア・娯楽
IDEXX LABORATORIES INC	—	2	62	6,875	ヘルスケア機器・サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	7	7	108	11,879	資本財
ILLUMINA INC	4	3	124	13,659	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INCYTE CORP	6	5	44	4,908	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INGREDION INC	—	2	21	2,377	食品・飲料・タバコ
INTEL CORP	132	114	512	56,116	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	16	13	109	11,987	各種金融
INTL BUSINESS MACHINES CORP	26	22	297	32,596	ソフトウェア・サービス
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	3	2	35	3,852	素材
INTERNATIONAL PAPER CO	11	10	46	5,112	素材
INTERPUBLIC GROUP COS INC	16	14	31	3,486	メディア・娯楽
INTUIT INC	6	6	160	17,632	ソフトウェア・サービス
INTUITIVE SURGICAL INC	3	2	141	15,507	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	—	4	62	6,873	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	89	83	913	100,134	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	5	4	34	3,773	資本財
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC.	18	12	23	2,565	各種金融
JOHNSON & JOHNSON	68	67	931	102,099	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA-TENCOR CORPORATION	5	4	46	5,073	半導体・半導体製造装置
KELLOGG CO	8	7	40	4,443	食品・飲料・タバコ
KEYCORP	42	31	53	5,816	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	—	5	44	4,828	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	7	8	116	12,738	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	63	51	102	11,229	エネルギー

銘柄	株数	期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	—	6	19	2,126	運輸
KOHL'S CORP	—	5	26	2,929	小売
KONTOOR BRANDS INC	—	1	4	466	耐久消費財・アパレル
KRAFT HEINZ CO/THE	13	15	49	5,416	食品・飲料・タバコ
KROGER CO	25	19	47	5,195	食品・生活必需品小売り
LKQ CORP	14	11	31	3,486	小売
L3 TECHNOLOGIES INC	—	2	49	5,465	資本財
LAM RESEARCH CORP	5	4	74	8,131	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	11	10	60	6,638	消費者サービス
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	6	5	92	10,115	家庭用品・パーソナル用品
LEGGETT & PLATT INC	7	5	21	2,322	耐久消費財・アパレル
LEIDOS HOLDINGS INC	—	4	36	3,994	ソフトウェア・サービス
LENNAR CORP-CL A	9	8	46	5,084	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	—	1	35	3,847	資本財
LIBERTY BROADBAND-C	—	3	38	4,174	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	—	6	25	2,831	メディア・娯楽
ELI LILLY & CO	28	23	272	29,867	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	7	7	44	4,918	保険
LOCKHEED MARTIN CORP	6	6	221	24,239	資本財
LOEWS CORP	12	8	46	5,120	保険
LOWE'S COMPANIES	20	20	194	21,327	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	5	2	51	5,641	耐久消費財・アパレル
M & T BANK CORP	4	3	52	5,746	銀行
MSCI INC	—	2	59	6,498	各種金融
MANPOWERGROUP	3	2	24	2,737	商業・専門サービス
MARATHON OIL CORP	37	28	40	4,442	エネルギー
MARATHON PETROLEUM CORP	17	18	92	10,149	エネルギー
MARSH & MCLENNAN COS	13	11	110	12,133	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	8	7	95	10,491	消費者サービス
MASCO CORP	14	10	39	4,293	資本財
MASTERCARD INC-CLASS A	26	23	585	64,119	ソフトウェア・サービス
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	9	7	41	4,495	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	5	3	55	6,053	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	19	19	381	41,800	消費者サービス
MCKESSON CORP	5	5	66	7,260	ヘルスケア機器・サービス
MERCADOLIBRE INC	—	1	68	7,466	小売
MERCK & CO. INC.	64	66	537	58,876	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METLIFE INC	20	21	100	11,047	保険
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	1	0.73	53	5,829	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	191	183	2,316	253,791	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	9	6	51	5,674	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY INC	38	30	102	11,243	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	—	2	28	3,079	資本財
MOHAWK INDUSTRIES INC	2	2	34	3,788	耐久消費財・アパレル
MOLSON COORS BREWING CO -B	8	6	37	4,098	食品・飲料・タバコ
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	32	34	182	19,968	食品・飲料・タバコ
MONSANTO CO	10	—	—	—	素材
MONSTER BEVERAGE CORP	12	10	69	7,560	食品・飲料・タバコ
MOODY'S CORP	5	4	87	9,593	各種金融
MORGAN STANLEY	44	34	149	16,390	各種金融
MOSAIC CO/THE	18	12	27	3,045	素材
MOTOROLA SOLUTIONS INC	5	4	69	7,641	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
NATIONAL OILWELL VARCO INC	13	12	29	3,184	エネルギー	
NETAPP INC	8	7	45	4,971	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NETFLIX INC	12	11	399	43,723	メディア・娯楽	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	31	—	—	—	銀行	
NEWELL BRANDS INC	17	14	22	2,450	耐久消費財・アパレル	
NEWMONT GOLDCORP CORPORATION	8	19	60	6,648	素材	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	19	19	22	2,469	メディア・娯楽	
NEXTERA ENERGY INC	15	11	230	25,224	公益事業	
NIKE INC -CL B	30	31	261	28,699	耐久消費財・アパレル	
NISOURCE INC	—	13	38	4,195	公益事業	
NOBLE ENERGY INC	15	16	36	3,958	エネルギー	
NORDSTROM INC	—	4	14	1,640	小売	
NORFOLK SOUTHERN CORP	9	6	136	14,934	運輸	
NORTHERN TRUST CORP	8	5	51	5,594	各種金融	
NORTHROP GRUMMAN CORP	4	4	132	14,566	資本財	
NUCOR CORP	12	9	48	5,302	素材	
NVIDIA CORP	17	14	215	23,665	半導体・半導体製造装置	
OGE ENERGY CORP	9	7	33	3,640	公益事業	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	2	2	78	8,642	小売	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	20	19	103	11,295	エネルギー	
ONEOK INC	—	10	66	7,323	エネルギー	
ORACLE CORPORATION	77	65	346	37,912	ソフトウェア・サービス	
P G & E CORP	15	—	—	—	公益事業	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	12	11	151	16,614	銀行	
PPG INDUSTRIES INC	7	5	61	6,776	素材	
PPL CORPORATION	15	16	51	5,629	公益事業	
PVH CORP	2	2	30	3,304	耐久消費財・アパレル	
PACCAR INC	10	8	55	6,092	資本財	
PACKAGING CORP OF AMERICA	3	3	30	3,360	素材	
PALO ALTO NETWORKS INC	—	2	54	5,994	ソフトウェア・サービス	
PARKER HANNIFIN CORP	4	3	50	5,567	資本財	
PAYCHEX INC	14	6	57	6,259	ソフトウェア・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	29	28	314	34,435	ソフトウェア・サービス	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	21	16	26	2,889	銀行	
PEPSICO INC	31	35	455	49,861	食品・飲料・タバコ	
PFIZER INC	139	146	614	67,296	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	36	39	332	36,409	食品・飲料・タバコ	
PHILLIPS 66	11	11	93	10,214	エネルギー	
PINNACLE WEST CAPITAL	4	3	36	4,035	公益事業	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	4	4	66	7,248	エネルギー	
POLARIS INDUSTRIES INC	2	2	20	2,289	耐久消費財・アパレル	
PRAXAIR INC	7	—	—	—	素材	
T ROWE PRICE GROUP INC	7	5	61	6,775	各種金融	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	9	8	45	5,008	保険	
PROCTER & GAMBLE CO	55	62	664	72,793	家庭用品・パーソナル用品	
PROGRESSIVE CORP	16	14	119	13,079	保険	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	10	10	102	11,278	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	12	11	68	7,478	公益事業	
PULTE HOMES INC	15	9	31	3,431	耐久消費財・アパレル	
QUALCOMM INC	42	30	203	22,278	半導体・半導体製造装置	
QUEST DIAGNOSTICS	4	4	44	4,823	ヘルスケア機器・サービス	
QURATE RETAIL INC-A	22	15	21	2,301	小売	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
RALPH LAUREN CORP	3	1	20	2,202	耐久消費財・アパレル
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	4	4	38	4,262	各種金融
RAYTHEON COMPANY	7	7	130	14,318	資本財
RED HAT INC	5	4	78	8,565	ソフトウェア・サービス
Regeneron Pharmaceuticals Inc	2	2	65	7,123	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
REGIONS FINANCIAL CORP	36	33	47	5,188	銀行
REPUBLIC SERVICES INC	10	5	45	4,966	商業・専門サービス
RESMED INC	6	4	48	5,328	ヘルスケア機器・サービス
ROBERT HALF INTL INC	5	4	23	2,603	商業・専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	3	3	46	5,104	資本財
ROCKWELL COLLINS INC.	4	—	—	—	資本財
ROLLINS INC	—	5	21	2,393	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	3	2	86	9,496	資本財
ROSS STORES INC	12	9	85	9,362	小売
S&P GLOBAL INC	6	6	137	15,029	各種金融
SEI INVESTMENTS COMPANY	5	5	28	3,096	各種金融
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	—	7	40	4,457	ソフトウェア・サービス
SVB FINANCIAL GROUP	—	1	39	4,355	銀行
SALESFORCE.COM INC	17	19	305	33,419	ソフトウェア・サービス
SCANA CORP	7	—	—	—	公益事業
SCHLUMBERGER LTD	28	33	122	13,419	エネルギー
SCHWAB (CHARLES) CORP	40	31	135	14,851	各種金融
SEALED AIR CORP	8	6	27	2,969	素材
SEATTLE GENETICS INC	—	3	27	2,962	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SEMPRA ENERGY	5	6	87	9,642	公益事業
SERVICENOW INC	—	4	125	13,791	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	2	2	92	10,146	素材
SKYWORKS SOLUTIONS INC	7	5	37	4,083	半導体・半導体製造装置
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	4	3	47	5,233	食品・飲料・タバコ
SOUTHERN CO	23	24	132	14,476	公益事業
SOUTHWEST AIRLINES CO	8	5	28	3,127	運輸
SPLUNK INC	4	4	49	5,398	ソフトウェア・サービス
SQUARE INC - A	—	8	54	6,014	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	4	4	55	6,111	資本財
STARBUCKS CORP	46	31	241	26,449	消費者サービス
STATE STREET CORP	13	10	60	6,681	各種金融
STERICYCLE INC	4	—	—	—	商業・専門サービス
STRYKER CORP	10	8	154	16,965	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC	13	11	73	8,013	銀行
SYMANTEC CORP	26	19	38	4,239	ソフトウェア・サービス
SYNOPSIS INC	5	4	54	5,920	ソフトウェア・サービス
SYNCHRONY FINANCIAL	21	17	59	6,514	各種金融
SYSCO CORP	16	11	87	9,612	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	—	8	45	5,023	各種金融
TJX COMPANIES INC	17	30	155	17,075	小売
T-MOBILE US INC	—	8	68	7,458	電気通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	—	3	35	3,900	メディア・娯楽
TAPESTRY INC	12	10	32	3,545	耐久消費財・アパレル
TARGET CORP	13	12	102	11,225	小売
TELEFLEX INC	—	1	45	4,988	ヘルスケア機器・サービス
TESLA INC	3	3	66	7,247	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS	23	24	252	27,650	半導体・半導体製造装置

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		千円	
			株数	外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
TEXTRON INC	11	8	38	4,168	資本財	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	13	10	285	31,240	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
3M CO	14	14	239	26,242	資本財	
TIFFANY & CO	4	3	32	3,570	小売	
TIME WARNER INC	18	—	—	—	メディア・娯楽	
TOLL BROTHERS INC	9	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
TORCHMARK CORP	4	3	33	3,687	保険	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	7	5	57	6,265	ソフトウェア・サービス	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	—	4	40	4,488	小売	
TRANSDIGM GROUP INC	—	1	57	6,351	資本財	
TRANSUNION	—	6	41	4,548	商業・専門サービス	
TRAVELERS COS INC/THE	7	6	91	9,985	保険	
TRIMBLE INC	—	8	36	3,991	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRIPADVISOR INC-W/I	8	3	17	1,903	メディア・娯楽	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX IN	29	—	—	—	メディア・娯楽	
TWITTER INC	20	17	66	7,316	メディア・娯楽	
TYSON FOODS INC-CL A	11	7	62	6,810	食品・飲料・タバコ	
US BANCORP	40	35	184	20,213	銀行	
ULTA BEAUTY INC	—	1	49	5,433	小売	
UNION PACIFIC CORP	25	18	316	34,710	運輸	
UNITED PARCEL SERVICE CL B	16	17	168	18,421	運輸	
UNITED RENTALS INC	—	2	34	3,779	資本財	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	18	20	272	29,860	資本財	
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	1	16	1,812	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNITEDHEALTH GROUP INC	23	24	603	66,149	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	4	2	35	3,843	ヘルスケア機器・サービス	
UNUM GROUP	11	8	29	3,202	保険	
VF CORP	7	8	69	7,569	耐久消費財・アパレル	
VAIL RESORTS INC	—	1	32	3,523	消費者サービス	
VALERO ENERGY CORP	11	11	86	9,503	エネルギー	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	3	3	39	4,378	ヘルスケア機器・サービス	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	—	3	50	5,482	ヘルスケア機器・サービス	
VERISIGN INC	4	3	62	6,849	ソフトウェア・サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	110	103	615	67,388	電気通信サービス	
VERISK ANALYTICS INC	—	3	42	4,705	商業・専門サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	8	6	118	13,024	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VIACOM INC CL B	13	12	34	3,778	メディア・娯楽	
VISA INC-CLASS A SHARES	48	44	716	78,552	ソフトウェア・サービス	
VMWARE INC-CLASS A	3	2	51	5,596	ソフトウェア・サービス	
VOYA FINANCIAL INC	7	5	30	3,308	各種金融	
VULCAN MATERIALS CO	5	3	48	5,339	素材	
WABCO HOLDINGS INC	3	1	22	2,497	資本財	
WEC ENERGY GROUP INC	6	7	58	6,420	公益事業	
WABTEC CORP/DE	5	5	36	3,944	資本財	
WALMART INC	44	35	368	40,363	食品・生活必需品小売り	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	19	20	105	11,532	食品・生活必需品小売り	
WASTE CONNECTIONS INC	—	5	48	5,286	商業・専門サービス	
WASTE MANAGEMENT INC	10	9	101	11,144	商業・専門サービス	
WATERS CORP	2	2	48	5,355	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WELLS FARGO & COMPANY	123	112	518	56,805	銀行	
WESTERN DIGITAL CORP	11	9	38	4,220	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WESTERN UNION CO	24	16	32	3,595	ソフトウェア・サービス	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
WESTROCK CO	10	9	32	3,561	素材	
WHIRLPOOL CORP	2	2	30	3,311	耐久消費財・アパレル	
WILLIAMS COS INC	—	31	84	9,238	エネルギー	
WORKDAY INC-CLASS A	—	3	84	9,212	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY INC-CLASS A	—	8	96	10,532	ソフトウェア・サービス	
WYNDHAM DESTINATIONS	3	—	—	—	消費者サービス	
XCEL ENERGY INC	11	12	73	8,066	公益事業	
XILINX INC	8	6	68	7,452	半導体・半導体製造装置	
XEROX CORP	13	9	28	3,146	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
XYLEM INC	6	5	42	4,625	資本財	
YUM! BRANDS INC	9	7	79	8,664	消費者サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	5	5	60	6,600	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	17	12	131	14,395	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INVESCO LTD	15	15	31	3,488	各種金融	
CHUBB LTD	9	10	162	17,842	保険	
LyondellBasell Industries NV	9	8	63	6,907	素材	
GARMIN LTD	5	3	30	3,352	耐久消費財・アパレル	
ACCENTURE PLC-CL A	15	15	276	30,309	ソフトウェア・サービス	
NXP SEMICONDUCTORS NV	8	8	81	8,983	半導体・半導体製造装置	
SEAGATE TECHNOLOGY	12	8	38	4,188	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AON PLC	6	5	106	11,629	保険	
TE CONNECTIVITY LTD	12	8	73	8,081	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INGERSOLL-RAND PLC	7	6	73	8,059	資本財	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	7	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
APTIV PLC	10	7	49	5,408	自動車・自動車部品	
EATON CORP PLC	10	10	78	8,555	資本財	
IHS MARKIT LTD	12	8	47	5,232	商業・専門サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	3	3	58	6,367	保険	
TECHNIPFMC PLC	15	14	32	3,600	エネルギー	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	9	5	25	2,830	資本財	
PERRIGO CO PLC	5	5	26	2,853	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAPRI HOLDINGS LTD	—	5	20	2,277	耐久消費財・アパレル	
PENTAIR PLC	8	6	23	2,557	資本財	
MEDTRONIC PLC	31	33	307	33,648	ヘルスケア機器・サービス	
MYLAN NV	15	16	30	3,377	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NIELSEN HOLDINGS PLC	13	13	29	3,276	商業・専門サービス	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	21	23	89	9,810	資本財	
ALLERGAN PLC	10	8	121	13,259	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	11	7	41	4,503	食品・飲料・タバコ	
LINDE PLC	—	13	260	28,508	素材	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	—	6	27	3,016	保険	
小 計	株 数	金 額	7,732	7,330	60,217	6,597,995
銘 柄 数 < 比 率 >	418	482	—	< 64.1% >		
(カナダ)			千カナダドル			
ARC RESOURCES LTD	19	—	—	—	エネルギー	
AGNICO EAGLE MINES LTD	—	8	46	3,809	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	12	11	99	8,142	食品・生活必需品小売り	
BCE INC	5	6	37	3,016	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	11	14	148	12,111	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	29	28	199	16,253	銀行	
BARRICK GOLD CORP	38	39	63	5,176	素材	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	13	22	144	11,778	各種金融	

銘柄	株数	期 末			業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
CAE INC	18	10	35	2,901	資本財
CCL INDUSTRIES INC - CL B	8	6	39	3,196	素材
CGI INC	—	7	75	6,132	ソフトウェア・サービス
CAMECO CORP	38	16	21	1,781	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	8	9	96	7,886	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	17	17	222	18,149	運輸
CANADIAN NATURAL RESOURCES	25	30	109	8,892	エネルギー
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	3	3	114	9,355	運輸
CANADIAN TIRE CORP -CL A	3	2	30	2,525	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	14	6	25	2,070	公益事業
CENOVUS ENERGY INC	59	37	42	3,452	エネルギー
CONSTELLATION SOFTWARE INC	—	0.58	69	5,693	ソフトウェア・サービス
DOLLARAMA INC	3	11	48	3,993	小売
ENCANA CORP	45	50	40	3,300	エネルギー
ENBRIDGE INC	38	50	257	20,990	エネルギー
FINNING INTERNATIONAL INC	10	—	—	—	資本財
FIRST CAPITAL REALTY INC	16	11	24	2,004	不動産
FORTIS INC	14	13	66	5,456	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	8	4	44	3,601	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	11	7	38	3,124	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	40	—	—	—	素材
GREAT-WEST LIFE CO INC	10	11	35	2,863	保険
CGI GROUP INC	11	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HUSKY ENERGY INC	24	19	23	1,953	エネルギー
HYDRO ONE LTD	—	14	33	2,751	公益事業
IGM FINANCIAL INC	2	6	22	1,863	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	12	10	39	3,206	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	5	4	54	4,483	保険
INTER PIPELINE LTD	22	14	30	2,453	エネルギー
KEYERA CORP	13	8	29	2,428	エネルギー
LOBLAW COMPANIES LTD	9	6	47	3,850	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	10	9	55	4,536	自動車・自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	40	51	121	9,886	保険
METRO INC	16	8	43	3,552	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	11	10	65	5,330	銀行
NUTRIEN LTD	20	15	101	8,289	素材
ONEX CORPORATION	6	—	—	—	各種金融
OPEN TEXT CORP	13	9	51	4,177	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	16	13	63	5,201	エネルギー
POWER CORP OF CANADA	15	12	34	2,841	保険
POWER FINANCIAL CORP	8	11	35	2,902	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	7	10	19	1,583	エネルギー
RESTAURANT BRANDS INTERN	—	7	68	5,603	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	12	10	73	5,981	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	30	34	360	29,375	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	10	9	23	1,894	資本財
SAPUTO INC	9	8	36	2,995	食品・飲料・タバコ
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	22	17	47	3,868	メディア・娯楽
SUN LIFE FINANCIAL INC	14	14	78	6,362	保険
SUNCOR ENERGY INC	42	42	179	14,666	エネルギー
TC ENERGY CORP	—	23	154	12,573	エネルギー
TELUS CORP	3	3	15	1,236	電気通信サービス

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	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		
THOMSON REUTERS CORP	9	—	—	—	—	各種金融
THOMSON REUTERS CORP	—	6	56	4,594	—	商業・専門サービス
TORONTO-DOMINION BANK	39	43	333	27,150	—	銀行
TRANSCANADA CORP	18	—	—	—	—	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	8	7	23	1,878	—	エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	3	3	35	2,892	—	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	27	15	41	3,405	—	素材
小 計	株 数	1,050	925	4,580	373,431	
	銘柄 数 < 比 率 >	60	60	—	< 3.6% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ADIDAS AG	5	4	117	14,384	—	耐久消費財・アパレル
Fresenius SE & CO KG	11	10	51	6,350	—	ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	5	6	19	2,393	—	電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PREF	—	3	12	1,543	—	素材
HANNOVER RUECK SE	—	2	30	3,785	—	保険
GEA GROUP AG	8	6	15	1,927	—	資本財
CONTINENTAL AG	3	3	38	4,702	—	自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG	27	23	62	7,724	—	運輸
AXEL SPRINGER SE	4	3	15	1,846	—	メディア・娯楽
MERCK KGAA	5	4	36	4,499	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	23	14	33	4,111	—	公益事業
SAP SE	24	24	274	33,675	—	ソフトウェア・サービス
E.ON SE	67	50	47	5,831	—	公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	3	3	28	3,500	—	家庭用品・パーソナル用品
PUMA AG	0.19	0.33	18	2,239	—	耐久消費財・アパレル
BAYER AG	19	24	132	16,236	—	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	2	3	31	3,894	—	家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	21	22	134	16,497	—	素材
BEIERSDORF AG	4	3	31	3,858	—	家庭用品・パーソナル用品
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	7	6	40	4,942	—	ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE	10	10	204	25,041	—	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	11	10	18	2,261	—	運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	3	3	68	8,405	—	保険
VOLKSWAGEN AG	1	1	20	2,567	—	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD	6	4	64	7,860	—	自動車・自動車部品
DAIMLER AG	28	24	117	14,406	—	自動車・自動車部品
SIEMENS AG	18	18	191	23,538	—	資本財
DEUTSCHE BANK AG -REG	52	60	38	4,774	—	各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	9	9	59	7,310	—	自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	78	74	113	13,859	—	電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	34	29	48	5,950	—	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG	7	4	50	6,146	—	各種金融
WIRECARD AG	—	3	51	6,266	—	ソフトウェア・サービス
LANXESS	4	3	17	2,148	—	素材
MTU AERO ENGINES AG	—	1	31	3,866	—	資本財
SYMRISE AG	—	3	32	4,010	—	素材
BRENTAG AG	8	5	25	3,110	—	資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	10	8	20	2,491	—	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	—	46	12	1,474	—	電気通信サービス
HUGO BOSS AG -ORD	3	2	15	1,923	—	耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	38	38	25	3,113	—	銀行
NONOVIA SE	15	12	58	7,208	—	不動産

銘柄	株数	期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
PROSIEBENSATI MEDIA SE	12	—	—	—	メディア・娯楽	
METRO AG	18	8	12	1,477	食品・生活必需品小売り	
INNOGY SE	—	4	19	2,353	公益事業	
LINDE AG - TENDER	5	—	—	—	素材	
COVESTRO AG	—	6	25	3,096	素材	
UNIPER SE	—	6	17	2,087	公益事業	
DELIVERY HERO SE	—	4	15	1,956	小売	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	626 39	625 47	2,549 —	312,649 <3.0%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	47	30	49	6,114	保険	
INTESA SANPAOLO	460	418	79	9,792	銀行	
MEDIOBANCA SPA	35	26	22	2,805	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	6	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
ENEL SPA	220	222	128	15,761	公益事業	
ENI SPA	68	70	99	12,211	エネルギー	
TELECOM ITALIA-RNC	407	—	—	—	電気通信サービス	
ATLANTIA S. P. A	15	16	38	4,730	運輸	
TERNA SPA	77	50	29	3,571	公益事業	
RECORDATI SPA	—	4	17	2,197	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MONCLER SPA	—	6	24	2,991	耐久消費財・アパレル	
UNICREDIT SPA	55	56	57	7,069	銀行	
POSTE ITALIANE SPA	—	22	20	2,486	保険	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	—	24	22	2,746	食品・飲料・タバコ	
PIRELLI & C SPA	—	25	13	1,650	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,395 10	979 13	604 —	74,127 <0.7%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES	10	8	26	3,302	資本財	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	18	17	36	4,498	公益事業	
L'OREAL	5	5	142	17,418	家庭用品・パーソナル用品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	6	6	232	28,486	耐久消費財・アパレル	
THALES SA	3	3	32	3,961	資本財	
CAPGEMINI	6	4	46	5,650	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	5	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
LAGARDERE S. C. A	10	—	—	—	メディア・娯楽	
MICHELIN (CGDE)-B	4	3	41	5,077	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	5	4	75	9,256	食品・飲料・タバコ	
RENAULT SA	7	6	36	4,506	自動車・自動車部品	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	14	12	94	11,643	資本財	
VIVENDI SA	30	26	62	7,666	メディア・娯楽	
ORANGE	41	41	58	7,161	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	0.56	0.79	47	5,870	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	4	3	46	5,736	ソフトウェア・サービス	
KERING	1	1	93	11,440	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	10	8	17	2,161	保険	
ATOS SE	—	3	23	2,892	ソフトウェア・サービス	
SANOFI	32	28	212	26,010	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCOR SA	7	7	24	2,975	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE-A	18	20	48	5,894	銀行	
TELEPERFORMANCE	—	1	31	3,894	商業・専門サービス	
SODEXO	—	3	32	4,043	消費者サービス	

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額		業 種 等	
			株 数	外貨建金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
AXA	54	43	96	11,855	保険	
PEUGEOT SA	—	19	38	4,682	自動車・自動車部品	
ESSILORLUXOTTICA	4	6	73	8,985	耐久消費財・アパレル	
CREDIT AGRICOLE SA	37	36	37	4,658	銀行	
BNP PARIBAS	27	29	128	15,777	銀行	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	14	13	45	5,565	資本財	
Wendel	1	1	17	2,138	各種金融	
Iliad SA	1	1	15	1,841	電気通信サービス	
IMERYS SA	2	3	11	1,444	素材	
SAFRAN SA	9	7	95	11,753	資本財	
ENGIE	62	43	55	6,843	公益事業	
ALSTOM	9	6	25	3,081	資本財	
Eutelsat Communications	11	8	13	1,642	メディア・娯楽	
ELECTRICITE DE FRANCE	24	21	26	3,241	公益事業	
Legrand SA	9	7	43	5,285	資本財	
Eiffage SA	—	3	27	3,369	資本財	
TOTAL SA	72	58	277	34,071	エネルギー	
Aeroports de Paris	—	1	18	2,251	運輸	
Natixis	42	38	18	2,269	各種金融	
UBISOFT ENTERTAINMENT	—	2	20	2,473	メディア・娯楽	
SCOR SE	10	5	21	2,639	保険	
VINCI S.A.	13	11	102	12,553	資本財	
DANONE	11	13	98	12,132	食品・飲料・タバコ	
AIR LIQUIDE	10	9	110	13,598	素材	
Bureau Veritas SA	15	10	21	2,679	商業・専門サービス	
GETLINK SE	28	18	25	3,096	運輸	
SUEZ	25	15	19	2,360	公益事業	
EDENRED	—	7	31	3,881	商業・専門サービス	
VALEO SA	8	9	24	3,056	自動車・自動車部品	
WORLDDLINE SA	—	1	5	719	ソフトウェア・サービス	
小 計	株 数	金 額				
	銘柄 数 < 比 率 >					
	45	52	—	< 3.6% >		
(ユーロ…オランダ)						
AIRBUS SE	19	14	171	21,046	資本財	
RELX NV	29	—	—	—	商業・専門サービス	
RANDSTAD NV	5	4	21	2,668	商業・専門サービス	
AKZO NOBEL	6	—	—	—	素材	
WOLTERS KLUWER	12	6	41	5,093	商業・専門サービス	
Koninklijke Vopak NV	8	4	15	1,878	エネルギー	
AEGON NV	82	65	27	3,339	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	134	122	33	4,099	電気通信サービス	
STMICROELECTRONICS NV	21	23	31	3,895	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	21	22	81	9,971	ヘルスケア機器・サービス	
HEINEKEN NV	6	6	59	7,283	食品・飲料・タバコ	
HEINEKEN HOLDING NV	4	4	36	4,498	食品・飲料・タバコ	
KONINKLIJKE DSM NV	7	5	52	6,400	素材	
UNILEVER NV-CVA	36	37	204	25,121	家庭用品・パーソナル用品	
ASML HOLDING NV	9	10	179	22,022	半導体・半導体製造装置	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	31	28	58	7,175	食品・生活必需品小売り	
AKZO NOBEL	—	5	40	4,907	素材	
QIAGEN N V	9	8	29	3,671	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ADYEN NV /WI	—	0.24	17	2,122	ソフトウェア・サービス	

銘柄	株数	金額	期首(前期末)		当期		業種等
			株数	金額	期末		
					株数	金額	
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円			
ING GROEP NV-CVA	99	103	100	12,364			銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	546	472	1,203	147,559		
		18	18	—	<1.4%>		
(ユーロ…スペイン)							
ENDESA SA	—	10	23	2,883			公益事業
Bankinter SA	—	30	19	2,433			銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	226	167	84	10,348			銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA	14	12	34	4,187			公益事業
REPSOL SA	48	26	38	4,676			エネルギー
BANCO SANTANDER S.A	408	416	167	20,593			銀行
TELEFONICA SA	126	105	76	9,350			電気通信サービス
ENAGAS SA	—	9	23	2,858			エネルギー
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	—	7	29	3,606			資本財
FERROVIAL SA	24	16	35	4,380			資本財
MAPPRE S.A.	93	55	14	1,834			保険
CaixaBank SA	—	124	34	4,247			銀行
IBERDROLA SA	136	145	123	15,141			公益事業
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	16	10	73	9,042			ソフトウェア・サービス
RED ELECTRICA CORPORACION SA	18	16	32	4,006			公益事業
FERROVIAL SA-RTS	24	—	—	—			資本財
INDITEX	24	24	62	7,608			小売
AENA SME SA	—	1	32	3,997			運輸
GRIFOLS SA	12	10	24	2,997			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,174	1,191	931	114,195		
		13	18	—	<1.1%>		
(ユーロ…ベルギー)							
KBC GROEP NV	9	6	40	4,940			銀行
SOLVAY SA	—	2	23	2,916			素材
UCB SA	5	4	29	3,643			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COLRUYT SA	3	2	17	2,150			食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	4	2	23	2,854			各種金融
AGEAS	7	6	29	3,604			保険
UMICORE	—	6	17	2,168			素材
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	22	19	144	17,690			食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	53	51	325	39,969		
		6	8	—	<0.4%>		
(ユーロ…オーストリア)							
OMV AG	7	5	25	3,129			エネルギー
ERSTE GROUP BANK AG	13	10	33	4,130			銀行
ANDRITZ AG	—	3	11	1,453			資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	21	20	71	8,713		
		2	3	—	<0.1%>		
(ユーロ…ルクセンブルク)							
TENARIS SA	19	20	22	2,790			エネルギー
SES SA	19	11	16	2,056			メディア・娯楽
ARCELORMITTAL	—	21	30	3,723			素材
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	38	53	69	8,570		
		2	3	—	<0.1%>		
(ユーロ…フィンランド)							
WARTSILA	22	17	23	2,863			資本財
UPM-KYMMENE OYJ	21	14	32	4,013			素材
STORA ENSO OYJ-R SHS	26	22	22	2,700			素材

銘柄	株数	期末			業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド)	百株	百株	千ユーロ	千円	
SAMPO OYJ-A SHS	4	7	31	3,806	保険
FORTUM OYJ	—	13	25	3,106	公益事業
ELISA OYJ	9	5	22	2,731	電気通信サービス
NOKIA OYJ	158	142	64	7,944	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NESTE OYJ	6	11	35	4,323	エネルギー
NOKIAN RENKAAT OYJ	6	4	11	1,439	自動車・自動車部品
KONE OYJ-B	11	7	37	4,591	資本財
ORION OYJ	—	4	11	1,466	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	267 9	249 11	317 —	38,988 <0.4%>
(ユーロ…アイルランド)					
CRH PLC(DUBLIN)	20	22	62	7,701	素材
KERRY GROUP PLC-A	6	4	48	5,976	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC	—	2	16	2,080	消費者サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	27 2	29 3	128 —	15,759 <0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)					
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	100	94	32	3,923	公益事業
Galp Energia SGPS SA	25	17	24	3,004	エネルギー
JERONIMO MARTINS	13	11	15	1,957	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	140 3	123 3	72 —	8,885 <0.1%>
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,048 149	4,476 179	9,288 —	1,138,921 <11.1%>
(イギリス)			千英ポンド		
ASHTAD GROUP PLC	17	16	31	4,379	資本財
BHP GROUP PLC	73	—	—	—	素材
SKY PLC	30	—	—	—	メディア・娯楽
AVIVA PLC	73	84	34	4,737	保険
DIAGEO PLC	50	58	195	27,192	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	6	5	17	2,438	各種金融
BAE SYSTEMS PLC	71	76	34	4,793	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	53	58	174	24,228	食品・飲料・タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	90	78	53	7,502	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	22	22	46	6,503	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	525	492	325	45,170	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	55	106	28	3,895	保険
MEGGITT PLC	43	31	15	2,199	資本財
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	101	90	17	2,496	食品・生活必需品小売り
Associated British Foods PLC	12	11	27	3,840	食品・飲料・タバコ
PERSIMMON PLC	—	10	19	2,735	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	55	64	102	14,297	保険
RIO TINTO PLC	31	30	143	19,906	素材
TRAVIS PERKINS PLC	15	—	—	—	資本財
SSE PLC	16	28	29	4,144	公益事業
BP PLC	561	499	272	37,823	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	2,048	1,851	108	15,060	銀行
TESCO PLC	252	243	56	7,863	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	42	22	37	5,157	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	116	124	197	27,428	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	13	10	16	2,284	資本財
ASTRAZENECA PLC	29	32	197	27,397	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
BT GROUP PLC	202	203	39	5,546	電気通信サービス	
CARNIVAL PLC	6	6	25	3,496	消費者サービス	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	60	60	14	2,063	小売	
BARCLAYS PLC	565	463	69	9,604	銀行	
INTERTEK GROUP PLC	7	4	26	3,620	商業・専門サービス	
BURBERRY GROUP PLC	13	13	24	3,380	耐久消費財・アパレル	
NEXT PLC	5	4	27	3,760	小売	
KINGFISHER PLC	79	84	18	2,512	小売	
ITV PLC	156	150	16	2,266	メディア・娯楽	
SAINSBURY (J) PLC	78	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
RANDGOLD RESOURCES LTD	3	—	—	—	素材	
G4S PLC	105	70	14	2,073	商業・専門サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	11	8	17	2,468	保険	
CENTRICA PLC	215	174	16	2,256	公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	129	108	270	37,624	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	90	95	238	33,138	エネルギー	
BUNZL PLC	13	12	25	3,578	資本財	
London Stock Exchange Group PLC	8	7	38	5,407	各種金融	
UNILEVER PLC	24	26	131	18,308	家庭用品・パーソナル用品	
EXPERIAN PLC	17	18	44	6,140	商業・専門サービス	
MONDI PLC	—	13	23	3,197	素材	
SEVERN TRENT PLC	15	10	19	2,728	公益事業	
Whitbread PLC	7	5	25	3,593	消費者サービス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	12	11	25	3,494	各種金融	
SMITHS GROUP PLC	21	14	21	3,004	資本財	
ANGLO AMERICAN PLC	—	30	60	8,339	素材	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	14	16	108	15,024	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	20	46	85	11,888	商業・専門サービス	
SHIRE PLC	22	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Fresnillo PLC	18	13	9	1,366	素材	
GLENCORE PLC	322	311	81	11,315	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	53	44	39	5,462	資本財	
OLD MUTUAL PLC	210	—	—	—	保険	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROU	162	149	32	4,488	銀行	
SAGE GROUP PLC/THE	43	37	28	3,919	ソフトウェア・サービス	
WPP PLC	33	37	35	4,928	メディア・娯楽	
COMPASS GROUP PLC	40	37	67	9,357	消費者サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	6	—	—	—	消費者サービス	
NATIONAL GRID PLC	67	78	63	8,889	公益事業	
ROYAL MAIL PLC	40	—	—	—	運輸	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-	81	34	13	1,830	消費者サービス	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	—	94	24	3,445	各種金融	
FERGUSON PLC	7	—	—	—	資本財	
BHP GROUP PLC	—	57	104	14,457	素材	
VODAFONE GROUP PLC	555	679	85	11,909	電気通信サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	—	6	31	4,331	消費者サービス	
CRODA INTERNATIONAL PLC	—	4	21	3,011	素材	
FERGUSON PLC	—	6	32	4,452	資本財	
RSA INSURANCE GROUP PLC	42	37	20	2,892	保険	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	96	—	—	—	各種金融	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	65	42	13	1,849	保険	
MELROSE INDUSTRIES PLC	165	165	27	3,888	資本財	

銘柄	株数	金額	期首(前期末)		当期		期末		業種等
			株数	株数	評価額				
					外貨建金額	邦貨換算金額			
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円					
JOHNSON MATTHEY PLC	11	7	23	3,244	素材				
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,346	7,564	4,368	607,039				
		72	69	—	<5.9%>				
(スイス)			千スイスフラン						
SIKA AG-BR	0.09	—	—	—	素材				
SGS SA	0.19	0.16	40	4,446	商業・専門サービス				
BARRY CALLEBAUT AG-REG	—	0.1	19	2,173	食品・飲料・タバコ				
SWISSCOM AG-REG	0.97	0.75	36	3,995	電気通信サービス				
Lindt & Spruengli AG	—	0.03	20	2,204	食品・飲料・タバコ				
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	—	—	—	食品・飲料・タバコ				
GIVAUDAN-REG	0.29	0.18	47	5,232	素材				
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4	3	107	11,764	保険				
NOVARTIS AG-REG SHS	58	54	482	52,701	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス				
ABB LTD	51	40	76	8,335	資本財				
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	18	17	476	51,961	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス				
ADECCO GROUP AG(REG)	—	5	33	3,651	商業・専門サービス				
LAFARGEHOLCIM LTD	11	11	59	6,508	素材				
CLARIANT AG-REG	—	9	18	2,026	素材				
NESTLE SA-REGISTERED	79	75	751	81,981	食品・飲料・タバコ				
Baloise Holding AG	—	1	18	2,003	保険				
TEMENOS GROUP AG-REG	—	2	37	4,124	ソフトウェア・サービス				
SONOVA HOLDING AG	2	1	40	4,455	ヘルスケア機器・サービス				
STRAUMANN HOLDING AG-REG	—	0.4	33	3,635	ヘルスケア機器・サービス				
CREDIT SUISSE GROUP AG	81	71	83	9,095	各種金融				
THE SWATCH GROUP AG-B	1	1	31	3,393	耐久消費財・アパレル				
LONZA GROUP AG-REG	2	2	66	7,293	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス				
SWISS LIFE HOLDING AG	1	1	48	5,289	保険				
PARTNERS GROUP HOLDING AG	—	0.56	40	4,375	各種金融				
Schindler Holding AG	2	1	34	3,755	資本財				
Schindler Holding AG	—	1	21	2,345	資本財				
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	2	1	25	2,769	運輸				
GEBERIT AG-REG	1	0.92	41	4,502	資本財				
JULIUS BAER GROUP LTD	10	8	32	3,570	各種金融				
SWISS RE AG	7	6	58	6,402	保険				
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	11	12	93	10,249	耐久消費財・アパレル				
SIKA AG-REG	—	3	56	6,117	素材				
ALCON INC	—	11	64	6,998	ヘルスケア機器・サービス				
UBS GROUP AG	85	104	123	13,523	各種金融				
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	434	453	3,123	340,883				
		23	32	—	<3.3%>				
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ						
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	59	40	354	4,055	銀行				
Swedbank AB	15	26	367	4,209	銀行				
SWEDISH MATCH AB	7	5	268	3,068	食品・飲料・タバコ				
NORDEA BANK AB	52	—	—	—	銀行				
SECURITAS AB-B SHS	21	13	215	2,468	商業・専門サービス				
INVESTOR AB-B SHS	3	8	349	4,000	各種金融				
HENNES & MAURITZ AB-B	28	19	297	3,399	小売				
ERICSSON LM-B SHS	86	72	688	7,874	テクノロジー・ハードウェアおよび機器				
TELIA COMPANY AB	99	76	312	3,574	電気通信サービス				
SKANSKA AB-B SHS	23	12	194	2,221	資本財				
LUNDIN PETROLEUM AB	15	7	196	2,249	エネルギー				

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローネ	千円		
ALFA LAVAL AB	13	10	206	2,367	資本財	
Millicom International Cellular SA	5	3	172	1,970	電気通信サービス	
Husqvarna AB	—	18	154	1,765	耐久消費財・アパレル	
SKF AB-B SHARES	16	15	235	2,690	資本財	
VOLVO AB-B SHS	35	33	462	5,289	資本財	
SANDVIK AB	27	26	405	4,633	資本財	
Industrivarden AB	2	7	143	1,642	各種金融	
HEXAGON AB-B SHS	—	7	346	3,964	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TELE2 AB-B SHS	20	17	227	2,599	電気通信サービス	
KINNEVIK AB-B	9	9	237	2,720	各種金融	
ATLAS COPCO AB-A REDEMPTION	15	—	—	—	資本財	
ATLAS COPCO AB-B REDEMPTION	17	—	—	—	資本財	
ATLAS COPCO AB-A SHS	8	15	408	4,676	資本財	
ATLAS COPCO AB-B SHS	13	13	330	3,782	資本財	
BOLIDEN AB-REDEMPTION	14	—	—	—	素材	
BOLIDEN AB	10	—	—	—	素材	
EPIROC AB-A	—	24	226	2,586	資本財	
EPIROC AB-B	—	18	161	1,847	資本財	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	20	14	411	4,706	家庭用品・パーソナル用品	
BOLIDEN AB	—	11	249	2,859	素材	
BOLIDEN AB-REDEMPTION SHARES	—	11	4	54	素材	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	40	34	335	3,836	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	15	19	379	4,338	資本財	
NORDEA BANK ABP	—	61	437	5,002	銀行	
小 計	株数・金額	700	657	8,781	100,455	
	銘柄数<比率>	28	30	—	<1.0%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	37	26	408	5,138	銀行	
TELENOR ASA	25	21	387	4,881	電気通信サービス	
EQUINOR ASA	33	22	388	4,892	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	8	6	245	3,085	素材	
NORSK HYDRO ASA	71	59	191	2,405	素材	
ORKLA ASA	36	25	195	2,462	食品・飲料・タバコ	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	—	10	172	2,173	保険	
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	6	147	1,854	メディア・娯楽	
小 計	株数・金額	213	178	2,136	26,894	
	銘柄数<比率>	6	8	—	<0.3%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG AS-B	3	3	274	4,502	食品・飲料・タバコ	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	0.33	0.23	161	2,653	運輸	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	0.1	0.14	93	1,538	運輸	
DANSKE BANK A/S	19	22	252	4,144	銀行	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	—	5	280	4,601	資本財	
H LUNDBECK A/S	—	3	97	1,603	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DSV A/S	8	4	273	4,495	運輸	
PANDORA A/S	4	4	114	1,882	耐久消費財・アパレル	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	5	3	225	3,693	素材	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	8	6	211	3,463	素材	
COLOPLAST-B	7	3	264	4,340	ヘルスケア機器・サービス	
NOVO NORDISK A/S-B	56	44	1,435	23,563	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ORSTED A/S	—	5	280	4,602	公益事業	

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	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円			
DEMANT A/S	11	4	100	1,656			ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	124	111	4,067	66,742		
	銘柄数<比率>	11	14	—	<0.6%>		
(オーストラリア)			千豪ドル				
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	77	70	196	14,933			銀行
AMCOR LTD	64	39	63	4,784			素材
WESTPAC BANKING CORPORATION	88	84	237	18,003			銀行
TELSTRA CORP LTD	213	145	51	3,899			電気通信サービス
COCA-COLA AMATIL LIMITED	48	26	25	1,951			食品・飲料・タバコ
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	7	6	52	3,972			各種金融
BHP GROUP LIMITED	105	78	297	22,590			素材
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	16	12	31	2,427			エネルギー
COMPUTERSHARE LIMITED	30	20	33	2,557			ソフトウェア・サービス
CSL LIMITED	14	11	236	17,969			医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRANSURBAN GROUP	77	61	85	6,480			運輸
COCHLEAR LIMITED	3	1	38	2,952			ヘルスケア機器・サービス
ORIGIN ENERGY LIMITED	—	51	38	2,937			エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	48	43	337	25,644			銀行
RIO TINTO LIMITED	15	11	113	8,645			素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	107	77	60	4,610			保険
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	—	3	14	1,137			消費者サービス
ORICA LTD	26	17	35	2,702			素材
LENLEASE GROUP	36	23	34	2,607			不動産
SUNCORP GROUP LTD	59	42	57	4,384			保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	67	63	162	12,361			銀行
NEWCREST MINING LIMITED	39	20	56	4,276			素材
INCITEC PIVOT LTD	162	86	28	2,176			素材
AMP LIMITED	162	114	25	1,900			各種金融
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	68	42	52	4,006			保険
SANTOS LTD	102	57	40	3,070			エネルギー
SONIC HEALTHCARE LTD	27	17	45	3,421			ヘルスケア機器・サービス
TABCORP HOLDINGS LIMITED	102	78	36	2,737			消費者サービス
WESFARMERS LIMITED	21	27	102	7,809			小売
ALUMINA LTD	170	117	28	2,169			素材
WOODSIDE PETROLEUM LTD	14	19	69	5,309			エネルギー
WOOLWORTHS GROUP LTD	19	27	88	6,720			食品・生活必需品小売り
SEEK LTD	—	15	32	2,432			商業・専門サービス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	—	4	16	1,235			消費者サービス
BRAMBLES LTD	86	52	64	4,870			商業・専門サービス
MACQUARIE GROUP LTD	8	8	108	8,240			各種金融
CROWN RESORTS LIMITED	39	18	24	1,859			消費者サービス
TREASURY WINE ESTATES LTD	—	17	25	1,950			食品・飲料・タバコ
SYDNEY AIRPORT	74	45	34	2,628			運輸
AGL ENERGY LTD	33	21	46	3,529			公益事業
SOUTH32 LTD	225	174	60	4,584			素材
COLES GROUP LTD	—	40	50	3,803			食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	2,467	1,900	3,245	246,287		
	銘柄数<比率>	36	42	—	<2.4%>		
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル				
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	22	25	1,809			ヘルスケア機器・サービス
A2 MILK CO LTD	—	17	26	1,906			食品・飲料・タバコ
SPARK NEW ZEALAND LTD	138	85	32	2,341			電気通信サービス

銘柄	株数	期首(前期末)			業種等	
		当		期末		
		株数	株数	評価額		評価額
(ニュージーランド)	百株	百株	千ニュージーランドドル	千円		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	59	40	35	2,513	運輸	
MERIDIAN ENERGY LTD	—	67	28	2,073	公益事業	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	198	232	148	10,644	
(香港)	2	5	—	<0.1%>		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	23	18	千香港ドル	139	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA	66	64	153	2,148	銀行	
CLP HOLDINGS LIMITED	45	45	417	5,823	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	40	32	797	11,132	各種金融	
LI & FUNG LTD	360	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
MTR CORPORATION	45	55	262	3,666	運輸	
HANG SENG BANK	20	21	421	5,880	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	81	49	240	3,353	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	40	50	271	3,786	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	277	244	480	6,711	公益事業	
HYSAN DEVELOPMENT CO	60	40	165	2,308	不動産	
Galaxy Entertainment Group Limited	100	70	327	4,578	消費者サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	65	—	—	—	不動産	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	115	110	332	4,645	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	165	95	148	2,076	資本財	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	30	45	96	1,347	耐久消費財・アパレル	
SINO LAND CO	178	138	178	2,492	不動産	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	30	45	608	8,499	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD A	30	20	184	2,568	不動産	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	—	50	251	3,514	耐久消費財・アパレル	
AIA GROUP LTD	304	314	2,378	33,204	保険	
HKT Trust / HKT Ltd	—	160	198	2,769	電気通信サービス	
Sands China Ltd	84	80	292	4,081	消費者サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	70	58	192	2,684	不動産	
WH Group Limited	—	310	225	3,146	食品・飲料・タバコ	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	48	73	542	7,575	資本財	
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	35	30	181	2,540	公益事業	
CK ASSET HOLDINGS LIMITED	58	73	426	5,958	不動産	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,370	2,290	9,916	138,436	
(シンガポール)	25	26	—	<1.3%>		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	50	75	千シンガポールドル	29	資本財	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	860	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	50	44	110	8,788	銀行	
CITY DEVELOPMENTS	30	30	24	1,986	不動産	
CAPITALAND LIMITED	120	—	—	—	不動産	
GENTING SINGAPORE LTD	320	—	—	—	消費者サービス	
COMFORTDELGRO CORP LTD	160	110	26	2,147	運輸	
SINGAPORE AIRLINES LTD	30	30	27	2,209	運輸	
UNITED OVERSEAS BANK	40	31	76	6,102	銀行	
UNITED OVERSEAS LAND LTD	40	30	20	1,645	不動産	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	120	90	21	1,700	メディア・娯楽	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	97	217	68	5,482	電気通信サービス	
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	120	—	—	—	資本財	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	100	79	86	6,919	銀行	
KEPPEL CORP LTD	76	56	34	2,722	資本財	

銘柄	株数	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	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
GENTING SINGAPORE LTD		—	290	25	2,033	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	2,213	1,082	553	44,081	
	銘柄 数 < 比 率 >	15	12	—	<0.4%>	
(イスラエル)				千イスラエルシケル		
BANK HAPOALIM BM		56	37	100	3,043	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		77	51	127	3,864	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		208	—	—	—	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD		35	35	68	2,084	素材
NICE LTD		4	2	125	3,801	ソフトウェア・サービス
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		—	7	54	1,666	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	382	133	475	14,461	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	31,281	27,336	—	9,706,276	
	銘柄 数 < 比 率 >	850	964	—	<94.3%>	

(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		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	1	1	229	25,156	0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.361	0.301	61	6,770	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	0.395	0.359	47	5,193	0.1	
CAMDEN PROPERTY TRUST	—	0.347	36	3,965	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	1	1	130	14,258	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	0.658	0.507	60	6,665	0.1	
DUKE REALTY CORP	1	1	38	4,258	0.0	
EQUINIX INC	0.271	0.208	103	11,315	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	0.828	0.844	65	7,138	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	—	0.189	54	6,025	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.472	0.41	43	4,805	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.311	0.271	35	3,932	0.0	
HCP INC	1	1	46	5,126	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	2	2	46	5,142	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	1	1	32	3,598	0.0	
KIMCO REALTY CORP	2	1	29	3,234	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	0.729	0.574	27	3,045	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	—	0.39	44	4,906	0.0	
PROLOGIS INC	1	1	119	13,055	0.1	
PUBLIC STORAGE	0.418	0.365	86	9,447	0.1	
REALTY INCOME CORP	1	0.747	52	5,772	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	0.645	0.555	37	4,059	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	0.324	67	7,410	0.1	
SL GREEN REALTY CORP	0.398	0.346	30	3,359	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	0.743	0.793	135	14,886	0.1	
UDR INC	1	0.883	40	4,383	0.0	
VENTAS INC	0.813	0.916	60	6,618	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	0.642	0.572	38	4,241	0.0	
WELLTOWER INC	0.841	0.971	79	8,678	0.1	
WEYERHAEUSER CO	1	2	47	5,221	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	25	24	1,931	211,676	
	銘 柄 数 < 比 率 >	26	30	—	< 2.1% >	
(カナダ)			千カナダドル			
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.252	0.967	25	2,111	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	0.252	0.967	25	2,111	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
KLEPIERRE	0.928	0.837	25	3,160	0.0	
GECINA SA	0.211	0.19	25	3,093	0.0	
COVIVIO	0.224	0.219	20	2,537	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.212	—	—	—	—	

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		
(ユーロ…フランス)	千口	千口	千ユーロ	千円	%	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	0.356	49	6,063	0.1	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	1	1	121	14,855	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	
(イギリス)			千英ポンド			
BRITISH LAND CO PLC	4	3	19	2,648	0.0	
HAMMERSON PLC	5	—	—	—	—	
SEGRO PLC	4	3	26	3,749	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	3	2	23	3,242	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	16	10	69	9,640	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	3	—	< 0.1% >	
(オーストラリア)			千豪ドル			
MIRVAC GROUP	23	13	43	3,280	0.0	
GPT GROUP	14	7	44	3,360	0.0	
STOCKLAND	11	10	45	3,463	0.0	
DEXUS	—	3	40	3,095	0.0	
GOODMAN GROUP	8	4	67	5,099	0.0	
SCENTRE GROUP	24	17	69	5,285	0.1	
WESTFIELD CORP	10	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	92	57	310	23,584	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 0.2% >	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	6	6	581	8,112	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	6	6	581	8,112	
	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	13	12	29	2,343	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	13	12	29	2,343	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	156	112	—	272,323	
	銘柄 数 < 比 率 >	43	46	—	< 2.6% >	

(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) 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	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
株式先物取引		
S&P 500 EMIN	186	—
DJ EU STX 50	53	—
FTSE 100 IDX	50	—

(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(2,723,557千口)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	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	17,750	17,920	1,963,520	46.7	—	19.4	19.0	8.3
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	800	870	70,964	1.7	—	0.9	0.8	—
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	5,800	5,721	32,956	0.8	—	0.5	0.3	—
	千ユーロ	千ユーロ						
ユーロ								
ドイツ	1,900	2,254	276,487	6.6	—	3.9	1.5	1.2
イタリア	2,600	2,921	358,239	8.5	—	5.1	2.9	0.6
フランス	2,700	3,328	408,160	9.7	—	7.2	1.9	0.6
オランダ	500	662	81,270	1.9	—	1.3	0.7	—
スペイン	1,500	1,855	227,499	5.4	—	3.8	0.7	0.9
ベルギー	700	851	104,424	2.5	—	1.8	0.6	—
オーストリア	400	517	63,446	1.5	—	1.2	0.3	—
フィンランド	200	229	28,189	0.7	—	0.7	—	—
アイルランド	200	236	29,010	0.7	—	0.7	—	—
	千英ポンド	千英ポンド						
イギリス	1,490	1,847	256,793	6.1	—	4.2	1.6	0.3
	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ						
スウェーデン	1,000	1,141	13,055	0.3	—	0.1	0.1	0.1
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	900	928	11,693	0.3	—	0.1	0.1	0.1
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	1,100	1,418	23,277	0.6	—	0.4	0.1	0.0
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	800	814	23,285	0.6	—	0.2	0.3	0.1
	千豪ドル	千豪ドル						
オーストラリア	1,000	1,124	85,361	2.0	—	1.2	0.6	0.2
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	200	220	17,569	0.4	—	0.4	—	—
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	700	702	18,389	0.4	—	0.2	0.2	—
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	3,500	3,233	24,539	0.6	—	0.5	0.0	0.0
合 計	—	—	4,118,136	98.0	—	53.8	31.8	12.4

(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				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	債 年 月 日	
	%	千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ) 国債証券					
T 1 1/2 02/28/23	1.5	100	97	10,714	2023/2/28
T 1 1/2 03/31/23	1.5	100	97	10,708	2023/3/31
T 1 1/2 07/15/20	1.5	200	198	21,715	2020/7/15
T 1 1/4 07/31/23	1.25	100	96	10,576	2023/7/31
T 1 1/8 08/31/21	1.125	300	293	32,126	2021/8/31
T 1 3/4 01/31/23	1.75	300	296	32,447	2023/1/31
T 1 3/4 02/28/22	1.75	500	495	54,237	2022/2/28
T 1 3/4 05/15/22	1.75	400	395	43,365	2022/5/15
T 1 3/4 05/15/23	1.75	500	493	54,023	2023/5/15
T 1 3/4 09/30/22	1.75	200	197	21,658	2022/9/30
T 1 3/4 12/31/20	1.75	500	496	54,348	2020/12/31
T 1 3/8 09/30/20	1.375	500	494	54,147	2020/9/30
T 1 5/8 02/15/26	1.625	500	481	52,747	2026/2/15
T 1 5/8 05/15/26	1.625	300	288	31,592	2026/5/15
T 1 5/8 08/15/22	1.625	500	492	53,954	2022/8/15
T 1 5/8 11/30/20	1.625	400	396	43,417	2020/11/30
T 1 7/8 11/30/21	1.875	600	596	65,331	2021/11/30
T 2 01/15/21	2.0	100	99	10,915	2021/1/15
T 2 02/15/22	2.0	500	498	54,618	2022/2/15
T 2 02/15/23	2.0	300	298	32,732	2023/2/15
T 2 02/15/25	2.0	200	198	21,718	2025/2/15
T 2 08/15/25	2.0	800	790	86,608	2025/8/15
T 2 1/2 02/15/46	2.5	100	95	10,437	2046/2/15
T 2 1/2 05/15/24	2.5	500	508	55,718	2024/5/15
T 2 1/2 08/15/23	2.5	300	304	33,358	2023/8/15
T 2 1/4 03/31/21	2.25	300	300	32,901	2021/3/31
T 2 1/4 04/30/21	2.25	200	200	21,944	2021/4/30
T 2 1/4 07/31/21	2.25	300	300	32,932	2021/7/31
T 2 1/4 08/15/27	2.25	100	99	10,933	2027/8/15
T 2 1/4 08/15/46	2.25	300	271	29,704	2046/8/15
T 2 1/4 11/15/24	2.25	800	803	88,073	2024/11/15
T 2 1/4 11/15/27	2.25	400	398	43,687	2027/11/15
T 2 1/8 05/15/25	2.125	300	298	32,747	2025/5/15
T 2 1/8 08/15/21	2.125	400	399	43,800	2021/8/15
T 2 11/15/21	2.0	300	299	32,773	2021/11/15
T 2 11/30/20	2.0	100	99	10,916	2020/11/30
T 2 11/30/22	2.0	200	199	21,830	2022/11/30
T 2 3/4 02/15/28	2.75	500	517	56,723	2028/2/15
T 2 3/4 11/15/23	2.75	600	615	67,452	2023/11/15
T 2 3/4 11/15/42	2.75	200	201	22,037	2042/11/15
T 2 3/8 08/15/24	2.375	200	202	22,151	2024/8/15
T 2 5/8 02/15/29	2.625	100	102	11,239	2029/2/15
T 2 5/8 07/15/21	2.625	100	100	11,062	2021/7/15

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	債 年 月 日	
	%	千米ドル	千米ドル	千円	
(アメリカ) 国債証券					
T 2 5/8 11/15/20	2.625	500	502	55,110	2020/11/15
T 2 7/8 08/15/28	2.875	100	104	11,464	2028/8/15
T 2 7/8 10/15/21	2.875	100	101	11,141	2021/10/15
T 2 7/8 11/15/21	2.875	100	101	11,156	2021/11/15
T 3 02/15/47	3.0	400	420	46,036	2047/2/15
T 3 02/15/48	3.0	200	209	22,963	2048/2/15
T 3 08/15/48	3.0	100	104	11,490	2048/8/15
T 3 1/8 02/15/43	3.125	100	107	11,733	2043/2/15
T 3 1/8 05/15/21	3.125	100	101	11,153	2021/5/15
T 3 1/8 05/15/48	3.125	100	107	11,762	2048/5/15
T 3 1/8 08/15/44	3.125	300	321	35,202	2044/8/15
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	107	11,788	2041/11/15
T 3 11/15/45	3.0	400	419	46,002	2045/11/15
T 3 5/8 02/15/21	3.625	300	307	33,667	2021/2/15
T 3 5/8 02/15/44	3.625	100	116	12,722	2044/2/15
T 3 5/8 08/15/43	3.625	200	232	25,430	2043/8/15
T 3 7/8 08/15/40	3.875	100	120	13,179	2040/8/15
T 4 1/4 11/15/40	4.25	100	126	13,857	2040/11/15
T 4 3/8 11/15/39	4.375	100	128	14,060	2039/11/15
T 5 05/15/37	5.0	50	68	7,463	2037/5/15
小 計					1,963,520
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0 3/4 09/01/21	0.75	100	98	8,005	2021/9/1
CAN 1 1/2 06/01/23	1.5	100	99	8,151	2023/6/1
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	100	104	8,550	2024/6/1
CAN 2 1/4 06/01/29	2.25	100	106	8,645	2029/6/1
CAN 2 3/4 06/01/22	2.75	100	103	8,439	2022/6/1
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	100	120	9,812	2048/12/1
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	100	134	10,933	2045/12/1
CAN 3 1/4 06/01/21	3.25	100	103	8,427	2021/6/1
小 計					70,964
(メキシコ) 国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10 11/20/36	10.0	200	230	1,326	2036/11/20
MBONO 10 12/05/24	10.0	600	656	3,779	2024/12/5
MBONO 5 3/4 03/05/26	5.75	400	353	2,038	2026/3/5
MBONO 6 1/2 06/09/22	6.5	600	577	3,323	2022/6/9
MBONO 6 1/2 06/10/21	6.5	1,000	971	5,596	2021/6/10
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	700	677	3,904	2027/6/3
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	300	289	1,667	2031/5/29
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	400	372	2,143	2042/11/13
MBONO 7 3/4 11/23/34	7.75	200	190	1,099	2034/11/23

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	千円	千円
<b>(メキシコ)</b>					
<b>国債証券</b>					
MBONO 8 09/05/24	8.0	100	100	578	2024/9/5
MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	300	308	1,775	2029/5/31
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	300	301	1,735	2038/11/18
MBONO 8 11/07/47	8.0	200	190	1,095	2047/11/7
MBONO 8 12/07/23	8.0	500	502	2,891	2023/12/7
小 計				32,956	
<b>(ユーロ…ドイツ)</b>					
<b>国債証券</b>					
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	100	106	13,035	2026/2/15
DBR 0 1/4 08/15/28	0.25	200	208	25,544	2028/8/15
DBR 1 08/15/24	1.0	100	108	13,258	2024/8/15
DBR 1 08/15/25	1.0	100	109	13,397	2025/8/15
DBR 1 1/2 09/04/22	1.5	100	107	13,137	2022/9/4
DBR 1 3/4 07/04/22	1.75	100	107	13,190	2022/7/4
DBR 2 1/2 07/04/44	2.5	100	149	18,295	2044/7/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	100	151	18,623	2046/8/15
DBR 3 07/04/20	3.0	100	103	12,752	2020/7/4
DBR 4 01/04/37	4.0	100	165	20,288	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	100	169	20,817	2034/7/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	100	156	19,149	2027/7/4
OBL 0 04/05/24	—	100	102	12,589	2024/4/5
OBL 0 04/09/21	—	200	202	24,822	2021/4/9
OBL 0 1/4 10/16/20	0.25	100	101	12,412	2020/10/16
OBL 0 10/13/23	—	200	205	25,171	2023/10/13
<b>(ユーロ…イタリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
BTPS 0.65 11/01/20	0.65	200	200	24,630	2020/11/1
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	100	97	11,940	2025/6/1
BTPS 1.35 04/15/22	1.35	100	100	12,323	2022/4/15
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	100	88	10,844	2032/3/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	100	99	12,241	2025/12/1
BTPS 2.15 12/15/21	2.15	100	102	12,616	2021/12/15
BTPS 3 08/01/29	3.0	100	103	12,667	2029/8/1
BTPS 3 1/2 03/01/30	3.5	100	107	13,180	2030/3/1
BTPS 3 3/4 08/01/21	3.75	100	106	13,038	2021/8/1
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	100	109	13,391	2024/9/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	111	13,713	2037/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	100	112	13,797	2024/3/1
BTPS 4 1/2 05/01/23	4.5	100	111	13,651	2023/5/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	100	112	13,838	2023/8/1
BTPS 4 3/4 09/01/21	4.75	100	108	13,323	2021/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	100	119	14,653	2028/9/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	100	123	15,174	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	100	124	15,282	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	100	123	15,188	2040/9/1

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額	償還年月日
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	千円
<b>(ユーロ…イタリア)</b>					
<b>国債証券</b>					
BTPS 5 1/2 11/01/22	5.5	200	227	27,900	2022/11/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	100	131	16,071	2033/2/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	132	16,228	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	100	131	16,095	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	100	134	16,445	2026/11/1
<b>(ユーロ…フランス)</b>					
<b>国債証券</b>					
FRTR 0 02/25/21	—	100	100	12,341	2021/2/25
FRTR 0 3/4 11/25/28	0.75	100	105	12,876	2028/11/25
FRTR 1 05/25/27	1.0	200	215	26,446	2027/5/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	100	112	13,771	2031/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	100	106	13,078	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	100	107	13,184	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/23	1.75	100	108	13,342	2023/5/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	200	222	27,297	2024/11/25
FRTR 2 05/25/48	2.0	100	117	14,372	2048/5/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	100	122	15,077	2030/5/25
FRTR 2 1/4 10/25/22	2.25	300	328	40,271	2022/10/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	200	250	30,744	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	100	146	17,954	2045/5/25
FRTR 3 1/4 10/25/21	3.25	100	109	13,399	2021/10/25
FRTR 3 3/4 04/25/21	3.75	100	108	13,283	2021/4/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	100	155	19,068	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	100	161	19,751	2035/4/25
FRTR 4.25 10/23	4.25	100	120	14,813	2023/10/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	100	151	18,614	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	100	168	20,614	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	100	139	17,134	2025/10/25
FRTR4.5 04/25/41	4.5	100	168	20,720	2041/4/25
<b>(ユーロ…オランダ)</b>					
<b>国債証券</b>					
NETHER 0 01/15/22	—	100	101	12,458	2022/1/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	100	112	13,807	2024/7/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	170	20,863	2042/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	148	18,238	2028/1/15
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	100	129	15,902	2023/1/15
<b>(ユーロ…スペイン)</b>					
<b>国債証券</b>					
SPGB 0.05 01/31/21	0.05	100	100	12,337	2021/1/31
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	100	107	13,144	2027/10/31
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	100	110	13,602	2026/4/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	100	114	14,034	2024/10/31
SPGB 2.15 10/31/25	2.15	200	222	27,312	2025/10/31
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	100	142	17,492	2037/1/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	100	119	14,685	2023/10/31

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) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	100	155	19,011	2041/7/30
SPGB 4.85 10/31/20	4.85	100	107	13,169	2020/10/31
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	100	157	19,296	2040/7/30
SPGB 5 1/2 04/30/21	5.5	100	111	13,632	2021/4/30
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	100	140	17,187	2028/10/31
SPGB 5.85 01/31/22	5.85	100	116	14,272	2022/1/31
SPGB 6 01/31/29	6.0	100	149	18,319	2029/1/31
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BGB 0.2 10/22/23	0.2	100	102	12,556	2023/10/22
BGB 1 06/22/26	1.0	100	107	13,120	2026/6/22
BGB 1.6 06/22/47	1.6	100	105	12,942	2047/6/22
BGB 2.6 06/22/24	2.6	100	114	14,053	2024/6/22
BGB 4 1/4 03/28/41	4.25	100	159	19,604	2041/3/28
BGB 4 1/4 09/28/22	4.25	100	115	14,193	2022/9/28
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	100	146	17,954	2028/3/28
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
RAGB 0 09/20/22	-	100	101	12,477	2022/9/20
RAGB 0 3/4 02/20/28	0.75	100	105	12,990	2028/2/20
RAGB 4.15 03/37	4.15	100	158	19,441	2037/3/15
RAGB 6 1/4 07/15/27	6.25	100	151	18,536	2027/7/15
(ユーロ…フィンランド) 国債証券					
RFGB 0 1/2 09/15/28	0.5	100	103	12,702	2028/9/15
RFGB 4 07/04/25	4.0	100	126	15,486	2025/7/4
(ユーロ…アイルランド) 国債証券					
IRISH 1.3 05/15/33	1.3	100	105	12,891	2033/5/15
IRISH 5.4 03/13/25	5.4	100	131	16,119	2025/3/13
ユーロ計				1,576,727	
(イギリス) 国債証券		千英ポンド	千英ポンド		
UKT 1 04/22/24	1.0	100	101	14,096	2024/4/22
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	99	13,843	2047/7/22
UKT 1 1/4 07/22/27	1.25	100	103	14,326	2027/7/22
UKT 1 3/4 09/07/22	1.75	100	103	14,399	2022/9/7
UKT 1 5/8 10/22/28	1.625	100	106	14,735	2028/10/22
UKT 2 09/07/25	2.0	100	107	14,984	2025/9/7
UKT 2 1/4 09/07/23	2.25	100	106	14,824	2023/9/7
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	100	141	19,712	2045/1/22
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	100	173	24,129	2068/7/22
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	100	135	18,815	2044/1/22
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	100	159	22,218	2052/7/22
UKT 3 3/4 09/07/20	3.75	100	103	14,439	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) 国債証券	%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
UKT 4 01/22/60	4.0	100	179	24,937	2060/1/22
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	38	5,338	2027/12/7
UKT 6 12/07/28	6.0	10	14	2,032	2028/12/7
UKT 8 06/07/21	8.0	150	172	23,960	2021/6/7
小 計				256,793	
(スウェーデン) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	0.75	100	106	1,217	2028/5/12
SGB 1 1/2 11/13/23	1.5	200	217	2,483	2023/11/13
SGB 1 11/12/26 #1059	1.0	100	108	1,236	2026/11/12
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	2.5	100	116	1,331	2025/5/12
SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	100	152	1,743	2039/3/30
SGB 3 1/2 06/01/22	3.5	200	224	2,563	2022/6/1
SGB 5 12/01/20	5.0	200	216	2,480	2020/12/1
小 計				13,055	
(ノルウェー) 国債証券		千ノルウェー	千ノルウェー		
NGB 1 1/2 02/19/26	1.5	100	100	1,260	2026/2/19
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	100	101	1,277	2027/2/17
NGB 1 3/4 03/13/25	1.75	100	101	1,282	2025/3/13
NGB 2 04/26/28	2.0	100	103	1,301	2028/4/26
NGB 2 05/24/23	2.0	200	204	2,580	2023/5/24
NGB 3 03/14/24	3.0	100	107	1,352	2024/3/14
NGB 3 3/4 05/25/21	3.75	200	209	2,639	2021/5/25
小 計				11,693	
(デンマーク) 国債証券		千デンマーク	千デンマーク		
DGB 0 1/2 11/15/27	0.5	200	212	3,489	2027/11/15
DGB 0 1/4 11/15/20	0.25	100	101	1,662	2020/11/15
DGB 1 1/2 11/15/23	1.5	100	109	1,792	2023/11/15
DGB 1 3/4 11/15/25	1.75	200	228	3,743	2025/11/15
DGB 3 11/15/21	3.0	200	218	3,580	2021/11/15
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	300	549	9,009	2039/11/15
小 計				23,277	
(ポーランド) 国債証券		千ポーランド	千ポーランド		
POLGB 0 07/25/20	-	100	98	2,805	2020/7/25
POLGB 1 3/4 07/25/21	1.75	200	200	5,722	2021/7/25
POLGB 2 1/2 01/25/23	2.5	100	101	2,908	2023/1/25
POLGB 2 1/2 07/25/26	2.5	100	99	2,842	2026/7/25
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	100	98	2,809	2027/7/25
POLGB 3 1/4 07/25/25	3.25	100	104	2,990	2025/7/25
POLGB 5 3/4 09/23/22	5.75	100	112	3,206	2022/9/23
小 計				23,285	

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
	%	千豪ドル	外貨建金額 千豪ドル	邦貨換算金額 千円	
<b>(オーストラリア)</b> <b>国債証券</b>					
ACGB 2 1/4 05/21/28	2.25	100	106	8,056	2028/5/21
ACGB 2 3/4 04/21/24	2.75	100	107	8,154	2024/4/21
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	100	110	8,355	2027/11/21
ACGB 3 03/21/47	3.0	100	115	8,795	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25	3.25	100	111	8,427	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	100	115	8,790	2029/4/21
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	100	118	9,010	2026/4/21
ACGB 5 1/2 04/21/23	5.5	100	116	8,843	2023/4/21
ACGB 5 3/4 05/15/21	5.75	100	108	8,264	2021/5/15
ACGB 5 3/4 07/15/22	5.75	100	114	8,663	2022/7/15
小 計				85,361	
<b>(シンガポール)</b> <b>国債証券</b>					
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	200	220	17,569	2027/3/1
小 計				17,569	
<b>(マレーシア)</b> <b>国債証券</b>					
MGS 3.48 03/15/23	3.48	100	99	2,605	2023/3/15
MGS 3.502 05/31/27	3.502	100	97	2,555	2027/5/31
MGS 3.844 04/15/33	3.844	100	96	2,533	2033/4/15
MGS 3.882 03/10/22	3.882	100	101	2,649	2022/3/10
MGS 4.16 07/15/21	4.16	100	101	2,657	2021/7/15
MGS 4.181 07/15/24	4.181	100	102	2,676	2024/7/15

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	評 価 額		償還年月日
	%	千円	外貨建金額	邦貨換算金額	
<b>(マレーシア)</b> <b>国債証券</b>					
MGS 4.392 04/15/26	4.392	100	103	2,711	2026/4/15
小 計				18,389	
<b>(南アフリカ)</b> <b>国債証券</b>					
SAGB 10 1/2 12/21/26	10.5	500	556	4,220	2026/12/21
SAGB 6 1/2 02/28/41	6.5	200	141	1,073	2041/2/28
SAGB 6 1/4 03/31/36	6.25	200	145	1,104	2036/3/31
SAGB 6 3/4 03/31/21	6.75	100	100	760	2021/3/31
SAGB 7 02/28/31	7.0	300	253	1,922	2031/2/28
SAGB 7 3/4 02/28/23	7.75	200	201	1,530	2023/2/28
SAGB 8 01/31/30 #2030	8.0	300	278	2,116	2030/1/31
SAGB 8 1/2 01/31/37 #203	8.5	300	271	2,061	2037/1/31
SAGB 8 1/4 03/31/32 #203	8.25	200	184	1,403	2032/3/31
SAGB 8 3/4 01/31/44	8.75	300	272	2,069	2044/1/31
SAGB 8 3/4 02/28/48	8.75	500	451	3,424	2048/2/28
SAGB 8 7/8 02/28/35 #203	8.875	200	188	1,431	2035/2/28
SAGB 9 01/31/40 #2040	9.0	200	187	1,421	2040/1/31
小 計				24,539	
合 計				4,118,136	

(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19期 (決算日 2019年3月20日)

(計算期間 2018年3月21日~2019年3月20日)

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

## 東京海上アセットマネジメント

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

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
15期(2015年3月20日)	11,801	40.7	1,580.51	37.9	97.2	2.3	161,556
16期(2016年3月22日)	10,430	△11.6	1,369.93	△13.3	98.5	1.6	131,902
17期(2017年3月21日)	12,166	16.6	1,563.42	14.1	97.2	2.1	79,920
18期(2018年3月20日)	13,619	11.9	1,716.29	9.8	93.8	6.2	68,511
19期(2019年3月20日)	13,116	△3.7	1,614.39	△5.9	94.9	4.8	40,598

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

ベンチマークはTOPIX（東証株価指数）です。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。(株)東京証券取引所は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。(株)東京証券取引所は、委託会社又は当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2018年3月20日	円 13,619	% -	1,716.29	% -	% 93.8	% 6.2
3月末	13,739	0.9	1,716.30	0.0	93.6	6.2
4月末	14,239	4.6	1,777.23	3.6	93.0	6.8
5月末	14,005	2.8	1,747.45	1.8	95.5	4.6
6月末	13,896	2.0	1,730.89	0.9	95.2	4.7
7月末	14,078	3.4	1,753.29	2.2	96.0	4.3
8月末	13,936	2.3	1,735.35	1.1	95.4	4.5
9月末	14,713	8.0	1,817.25	5.9	94.4	5.6
10月末	13,336	△ 2.1	1,646.12	△ 4.1	92.1	7.8
11月末	13,513	△ 0.8	1,667.45	△ 2.8	92.3	7.7
12月末	12,137	△10.9	1,494.09	△12.9	94.0	5.9
2019年1月末	12,729	△ 6.5	1,567.49	△ 8.7	94.3	5.7
2月末	13,058	△ 4.1	1,607.66	△ 6.3	94.4	5.6
(期 末) 2019年3月20日	13,116	△ 3.7	1,614.39	△ 5.9	94.9	4.8

(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

(2018年3月21日～2019年3月20日)

### ■期中の基準価額等の推移

期首：13,619円

期末：13,116円

騰落率：△3.7%

### ◇基準価額の主な変動要因

#### プラス要因

- ・米国など主要国の経済成長
- ・日銀による金融緩和政策の継続
- ・期前半の企業業績への期待感

#### マイナス要因

- ・米中貿易摩擦への警戒感
- ・米国の金融引き締め政策
- ・期後半の企業業績への警戒感

### ■投資環境

当期、国内株式市場は米国を中心とした主要国の景気拡大や企業業績の改善期待が株価を下支えしましたが、米中貿易摩擦への懸念などが株価の上値を抑える展開となりました。

期初、米中貿易摩擦が懸念されて国内株式市場は下落しました。その後、朝鮮半島の緊張緩和への期待や円安の進行、好調な企業決算が好感されて2018年5月中旬まで国内株式市場は上昇しましたが、トランプ米政権による自動車の輸入関税引き上げの検討表明や欧州政治の不安定化などにより反落しました。その後、米中貿易摩擦の行方や新興国の金融市場動向への警戒、国内では相次ぐ自然災害の発生が嫌気されて夏にかけて国内株式市場は方向性が見出せない展開となりました。

期の後半は、円安の進行や自民党総裁選で安倍首相の再選が確実視されたことから、アベノミクス継続への期待が高まり10月上旬にかけて国内株式市場は上昇しました。その後は、米中通商協議の進捗状況により国内株式市場は上下しましたが、12月は国内の大型IPO（新規株式公開）による株式市場の需給悪化への懸念や、引き締め姿勢が続く米国の金融政策への警戒、中国の景気下振れなどが嫌気されて急落しました。2019年1月以降は、米国の金融政策が緩和的になるとの観測や米中の対話姿勢への期待から、米国株式市場が上昇したことに連れて国内株式市場も戻り歩調となりました。

以上のような経過を経て、国内株式市場は前期末対比下落した水準で当期を終えました。

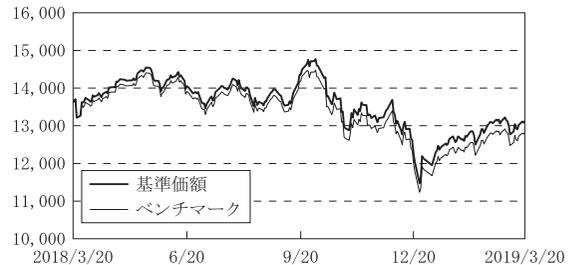
### ■ポートフォリオについて

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

期首の保有銘柄数は1,076銘柄でしたが、期中は設定・解約に応じたTOPIX先物と現物株式の売買を行い、期末における保有銘柄数は1,084銘柄となりました。なお、実質的な株式の組入比率はほぼ100%に維持しました。

以上の運用の結果、基準価額は3.7%下落しました。

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークは、期首(2018年3月20日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は△3.7%となり、ベンチマークの騰落率△5.9%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<sup>※</sup>は、過去1年で1.2%となりました。

(主な差異要因)

### プラス要因

- ・配当金収入

### マイナス要因

- ・特にありません

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

## ○今後の運用方針

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

## ○1万口当たりの費用明細

(2018年3月21日～2019年3月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.010)	
合 計	1	0.010	
期中の平均基準価額は、13,614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

(2018年3月21日～2019年3月20日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		6,575 (△ 833)	13,787,543 ( )	18,155	37,563,855

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ( ) 内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		42,870	44,959	5,272	5,326

## ○株式売買比率

(2018年3月21日～2019年3月20日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	51,351,399千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	44,482,985千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.15

(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

(2018年3月21日～2019年3月20日)

## 利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

## 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
株式	百万円 94	百万円 285	百万円 326

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

(2019年3月20日現在)

## 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			
日本水産	34.6	21.9	17,520
マルハニチロ	5.1	3.4	13,770
サカタのタネ	3.9	2.7	10,773
ホクト	6.9	2.4	4,797
<b>鉱業 (0.3%)</b>			
国際石油開発帝石	143	90.6	95,673
石油資源開発	5.2	3.3	7,596
K&Oエナジーグループ	6.3	3	4,695
<b>建設業 (3.0%)</b>			
ショーボンドホールディングス	2.7	1.7	12,937
ミライト・ホールディングス	9.7	5.9	9,398
ベステラ	—	3.8	5,293
安藤・間	20.8	14.1	10,814
東急建設	12	7.9	6,801
コムシスホールディングス	10.6	8.2	24,263
ミサワホーム	11.6	6.6	5,194
東建コーポレーション	1.3	1	7,020
ヤマウラ	8	6.7	6,700
大成建設	29.3	18.6	96,534
大林組	88.9	56.5	62,941
清水建設	90.9	57.7	55,738
長谷工コーポレーション	34	22.9	33,136
鹿島建設	129	43.4	71,566
西松建設	6.4	4	10,208
三井住友建設	22.5	13.7	10,576
前田建設工業	21.1	13.5	15,457
奥村組	4.6	3	10,905
東鉄工業	3.9	2.8	8,456
戸田建設	34	22.5	16,042
熊谷組	4.3	2.7	9,369
大東建託	10.6	6.6	103,521
N I P P O	6.3	5.1	10,868
前田道路	9	5.8	12,475

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>東亜建設工業</b>	4.1	4.8	7,680
<b>五洋建設</b>	36.2	22.1	11,514
<b>住友林業</b>	19	12.9	19,246
<b>日本基礎技術</b>	20.5	14.5	5,437
<b>大和ハウス工業</b>	86.1	51.6	181,580
<b>積水ハウス</b>	95.5	57.1	103,979
<b>北陸電気工事</b>	6.2	5.8	5,069
<b>西部電気工業</b>	2.4	—	—
<b>中電工</b>	4.5	3.4	7,813
<b>関電工</b>	12.9	8.1	7,970
<b>きんでん</b>	19.5	12.6	22,226
<b>日本電設工業</b>	5.9	3.6	8,409
<b>協和エクシオ</b>	10.7	7.2	21,441
<b>新日本空調</b>	8.8	4.2	8,269
<b>九電工</b>	5.8	3.7	13,042
<b>三機工業</b>	10.8	6.8	8,377
<b>日揮</b>	25.5	16.3	24,922
<b>中外炉工業</b>	4	2.9	5,249
<b>ヤマト</b>	11	7.8	3,790
<b>高砂熱学工業</b>	8.4	4.9	8,736
<b>三晃金属工業</b>	1.7	1.8	5,202
<b>大氣社</b>	3.8	2.5	8,200
<b>日比谷総合設備</b>	5.9	4.5	8,464
<b>東芝プラントシステム</b>	6.7	3.9	7,967
<b>OSJBホールディングス</b>	—	25.7	6,913
<b>東洋エンジニアリング</b>	7.1	8	5,112
<b>千代田化工建設</b>	20	—	—
<b>新興プランテック</b>	14.2	5.9	7,262
<b>食料品 (4.3%)</b>			
<b>日本製粉</b>	8.8	5.3	10,350
<b>日清製粉グループ本社</b>	32.1	19.1	48,189
<b>鳥越製粉</b>	9.9	6	4,614
<b>日本甜菜製糖</b>	5.6	3.3	6,702
<b>三井製糖</b>	3.1	2.2	6,457

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
森永製菓	6	4.3	21,328
江崎グリコ	7.3	5	28,800
山崎製パン	21.3	13.7	25,180
亀田製菓	2.5	1.6	8,688
寿スピリッツ	2.4	1.8	7,884
カルビー	12.3	7.5	22,650
森永乳業	5.2	3.2	11,888
ヤクルト本社	15.8	12.4	95,728
明治ホールディングス	17.4	11.8	106,436
雪印メグミルク	6.2	4	10,948
プリマハム	22	2.8	5,871
日本ハム	22	7.3	29,127
丸大食品	20	2.8	5,415
S F o o d s	3.3	1.7	6,970
伊藤ハム米久ホールディングス	18.1	11.6	8,073
サッポロホールディングス	9.3	6	15,240
アサヒグループホールディングス	55.1	35	169,120
キリンホールディングス	126.2	75.5	194,978
宝ホールディングス	20.7	12.8	16,921
オエノンホールディングス	29.7	16.3	6,683
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	18	12.8	35,673
サントリー食品インターナショナル	20.3	11.3	57,404
ダイドールグループホールディングス	2	1.3	6,604
伊藤園	8.7	5.5	30,360
キーコーヒー	6.6	2.9	6,235
ユニカフェ	5.6	4	3,980
ジャパンフーズ	7.5	4.3	5,504
日清オイリオグループ	4.4	2.4	8,184
不二製油グループ本社	7.4	4.2	15,792
Jーオイルミルズ	3.6	1.3	5,382
キッコーマン	20.8	11.1	60,939
味の素	61	36.9	64,944
キュービー	14.8	9.4	24,947
ハウス食品グループ本社	10.2	6.3	27,688
カゴメ	10.3	6.7	20,870
アリアケジャパン	2.4	1.5	9,120
ニチレイ	12.8	8.6	23,538
東洋水産	14.7	8.6	35,518

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日清食品ホールディングス	11.6	7.2	54,504
フジッコ	4.6	3	6,666
ロック・フィールド	7	5.1	8,338
日本たばこ産業	162.9	96.5	269,621
ユーグレナ	11.5	10.5	7,329
<b>繊維製品 (0.7%)</b>			
片倉工業	8.4	5.5	7,117
グンゼ	2.2	1.5	7,140
東洋紡	10.5	6.6	10,362
倉敷紡績	54	2.7	5,778
日本毛織	12	8.3	7,818
帝国繊維	6	3.1	8,701
帝人	22.8	13.6	25,935
東レ	199.2	126.4	92,840
日本フェルト	20.5	12.7	5,956
セーレン	6.3	4.4	7,532
小松マテール	15	8	6,360
ワコールホールディングス	7.7	4.6	12,539
ホギメディカル	1.5	2.4	9,348
T S I ホールディングス	19.7	10.2	6,721
三陽商会	5.1	2.8	4,656
オンワードホールディングス	15	10.7	6,131
ゴールドウイン	—	1.5	21,720
デサント	8.4	3.9	9,964
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>			
特種東海製紙	3.1	1.7	7,216
王子ホールディングス	117	73.9	52,247
日本製紙	12.1	7.8	18,041
三菱製紙	15.9	8.8	4,778
北越コーポレーション	18.3	12.6	8,202
大玉製紙	11	7.5	9,772
レンゴー	25.6	17.2	17,492
ザ・バック	3.6	1.9	6,460
<b>化学 (7.3%)</b>			
クラレ	46.6	27.8	39,948
旭化成	171.5	116.1	138,042
共和レザー	9.2	5.2	3,796
昭和電工	18.1	10.9	42,673

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友化学	202	129.4	69,487
日産化学	16.2	10.1	52,520
クレハ	2.2	1.6	10,448
石原産業	7.6	5.8	6,565
片倉コープアグリ	4.7	4.2	4,930
日本曹達	22	3	8,922
東ソー	40.1	25.5	44,727
トクヤマ	8	4.7	12,412
セントラル硝子	5.7	3.3	8,431
東亜合成	16.6	10.5	12,379
大阪ソーダ	4.3	2.5	7,002
デンカ	10.2	6.3	20,254
信越化学工業	45.7	28.7	264,987
堺化学工業	4.6	3.6	8,838
エア・ウォーター	22.7	13.6	22,344
大陽日酸	21.3	13.7	22,358
日本パーカライジング	14.3	8.7	12,615
ステラ ケミファ	3.7	2.2	6,787
日本触媒	4.2	2.8	20,972
カネカ	37	4.3	18,533
三菱瓦斯化学	22.2	16.5	27,538
三井化学	25.3	15	41,775
J S R	27.5	16.8	29,517
東京応化工業	4.8	2.7	8,437
三菱ケミカルホールディングス	184.3	109.1	89,265
KHネオケム	—	2.9	7,925
ダイセル	37.9	25.5	30,396
住友ベークライト	21	2.7	11,043
積水化学工業	56.7	35.9	64,189
日本ゼオン	23.4	15	16,935
アイカ工業	7.7	4.9	17,689
宇部興産	14.1	8.3	19,571
旭有機材	7.6	3.5	5,901
日立化成	13.8	8	20,200
タイガースポリマー	12.6	5.8	3,445
ミライアル	3.6	4.5	5,008
日本化薬	17.5	10.9	14,606
ADEKA	12.3	7.8	12,682

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日油	11	6.3	24,097
ハリマ化成グループ	8.9	5.6	6,104
花王	64.5	40.4	357,257
ニイタカ	3	2.8	4,090
三洋化成工業	2.6	1.1	5,852
日本ペイントホールディングス	21.4	13.4	58,960
関西ペイント	29.2	18.5	39,738
中国塗料	14.3	7.6	7,410
太陽ホールディングス	2.5	2	7,310
D I C	11	7.4	24,679
サカタインクス	8.2	4.7	4,888
東洋インキS Cホールディングス	26	3.3	8,345
富士フィルムホールディングス	54.5	34.6	176,114
資生堂	48.7	33	261,921
ライオン	37.1	23.4	56,370
高砂香料工業	4	1.8	5,958
マンダム	5.2	3.6	10,537
ミルボン	3.3	2	10,300
ファンケル	6.2	7.2	20,671
コーセー	4.4	2.8	53,816
コタ	5.7	3.1	4,606
シーズ・ホールディングス	3.3	—	—
ポーラ・オルビスホールディングス	11.2	7.2	25,416
ノエビアホールディングス	1.9	1.5	8,445
エステー	4.8	3.3	6,342
長谷川香料	5.7	3.6	6,642
小林製薬	7.3	4.6	41,906
荒川化学工業	5.9	4.4	5,566
メック	6.5	5	5,055
タカラバイオ	7.5	4.2	11,306
アース製薬	2.3	1.4	7,280
大成ラミック	2.1	1.4	3,936
クミアイ化学工業	23.2	11.2	8,579
日本農薬	17.3	10.6	4,950
日東電工	19.8	12.5	74,712
レック	3.5	2.4	3,636
前澤化成工業	6.1	3.2	3,257
エフビコ	2.3	1.3	8,541

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
天馬	5.1	3.1	6,333
信越ポリマー	10.8	9.6	7,939
ニフコ	4.8	6.5	18,382
バルカー	4.6	2.1	4,653
ユニ・チャーム	55.6	35.3	130,433
<b>医薬品 (6.1%)</b>			
協和発酵キリン	32.8	21	49,392
武田薬品工業	96.5	143.5	682,055
アステラス製薬	269.3	153.5	269,699
大日本住友製薬	19.4	12.4	34,360
塩野義製薬	37.2	21.8	149,046
田辺三菱製薬	32.5	17.5	27,825
あすか製薬	5.8	6.1	7,496
日本新薬	6.8	4.3	32,207
中外製薬	27.4	17.4	132,936
科研製薬	4.6	2.9	15,486
エーザイ	31.3	19.9	180,393
ロート製薬	14.3	8.5	24,913
小野薬品工業	62	39.3	88,287
久光製薬	7.5	4.9	25,382
持田製薬	1.8	1.3	14,664
参天製薬	50.2	31.9	52,316
ツムラ	9.3	5.2	17,628
日医工	7.6	5	7,810
キッセイ薬品工業	4.4	2.8	8,173
生化学工業	6.8	4.6	6,136
栄研化学	—	2.9	7,917
鳥居薬品	4.1	3.4	7,826
JCRファーマ	2.5	1.3	8,450
東和薬品	2.5	1	9,060
沢井製薬	5	3.4	22,100
ゼリア新薬工業	6.6	3.8	7,261
第一三共	74.8	47.6	213,962
キョーリン製薬ホールディングス	6.5	4.3	9,528
大幸薬品	5.2	2.8	5,336
大塚ホールディングス	54.2	31.7	146,549
大正製薬ホールディングス	5.8	3.7	41,255
ペプチドリーム	11.9	7.7	41,580

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>石油・石炭製品 (0.7%)</b>			
昭和シェル石油	24.6	15.6	27,222
ニチレキ	9.9	6.9	7,748
出光興産	22.2	13	53,235
JXTGホールディングス	418.2	282.6	153,423
コスモエネルギーホールディングス	7.2	4.7	12,628
<b>ゴム製品 (0.8%)</b>			
横浜ゴム	15.2	9.6	19,747
TOYO TIRE	15.3	8.4	10,953
ブリヂストン	87.2	51.1	220,496
住友ゴム工業	26.6	14.9	20,219
オカモト	11	1.3	7,553
ニッタ	3	2.1	7,686
住友理工	11.2	8.6	8,109
バンドー化学	10	4.4	5,095
<b>ガラス・土石製品 (0.8%)</b>			
日東紡績	5.4	3.1	6,231
AGC	27	16.8	66,108
日本山村硝子	41	2.4	3,463
日本電気硝子	11.3	7.2	21,405
住友大阪セメント	52	3.4	15,028
太平洋セメント	16.8	10.5	39,165
日本ヒューム	10.2	5.8	4,361
東海カーボン	23.2	15.1	21,230
東洋炭素	3.9	2.7	5,691
TOTO	20.3	12.9	57,534
日本碍子	32.1	20.5	34,993
日本特殊陶業	22	14.1	30,709
ニチアス	13	4.4	9,688
ニチハ	3.7	2.7	8,113
<b>鉄鋼 (1.0%)</b>			
新日鐵住金	115.8	76.5	152,579
神戸製鋼所	47.6	30.2	25,972
合同製鐵	5.5	2.3	4,008
ジェイ エフ イー ホールディングス	70.2	44.5	87,487
日新製鋼	8.4	—	—
東京製鐵	15.1	9.3	8,583
共英製鋼	6.6	2.2	3,597

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大和工業	5	3.4	10,387
大阪製鐵	4	3	5,775
淀川製鋼所	4.9	3.2	6,966
東洋鋼鈑	20.3	—	—
丸一鋼管	9	5.8	19,082
大同特殊鋼	4.4	2.7	12,015
山陽特殊製鋼	4.6	3	6,900
愛知製鋼	3.1	1	3,525
日立金属	28.2	18.1	23,801
大太平洋金属	3.7	1.3	3,775
新日本電工	31.9	26.8	6,110
三菱製鋼	4.9	3.2	5,200
シンニッタン	12.5	12	4,080
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>			
日本軽金属ホールディングス	73.9	46.3	11,389
三井金属鉱業	7	4.2	12,096
東邦亜鉛	2.3	1.4	4,704
三菱マテリアル	17	10.8	32,022
住友金属鉱山	33.2	22.5	73,507
DOWAホールディングス	6.2	4	14,740
古河機械金属	6.4	4.5	6,588
UACJ	4.3	2.9	6,188
古河電気工業	8.6	4.7	13,785
住友電気工業	97	61.5	93,049
フジクラ	30.2	19	8,246
タツタ電線	16.2	11.6	5,324
リョービ	4.4	2.9	7,235
アサヒホールディングス	6.3	3.7	7,955
<b>金属製品 (0.6%)</b>			
トーカロ	10.8	6.4	5,542
SUMCO	24.2	18.1	23,294
東洋製織グループホールディングス	18.3	10.4	24,866
コロナ	5.2	4.1	4,526
横河ブリッジホールディングス	5.8	4.4	8,549
駒井ハルテック	2.9	1.8	3,396
三和ホールディングス	25.7	16.5	21,202
文化シャッター	13.5	7.7	6,337
三協立山	8.5	6	9,306

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
LIXILグループ	38.6	24.6	36,727
ノーリツ	7	4.2	7,131
長府製作所	4.5	2.8	6,406
リンナイ	4.7	3	22,950
日東精工	16.6	8	4,400
東プレ	4.6	3.3	6,903
高周波熱錬	11.2	7.8	7,105
パイオラックス	4.3	2.8	6,126
日本発條	26.3	16.8	16,396
三益半導体工業	5.5	4.6	6,987
<b>機械 (4.8%)</b>			
日本製鋼所	8.7	5.2	10,488
三浦工業	11.5	7	17,878
タクマ	9.3	5.9	7,947
オークマ	3.1	2.1	12,390
東芝機械	17	3	6,669
アマダホールディングス	39.7	26	28,704
アイダエンジニアリング	9	7.6	6,201
FUJ I	7.7	5	7,435
牧野フライス製作所	11	1.9	7,961
オーエスジー	12	8.1	16,734
旭ダイヤモンド工業	7.7	9.2	6,798
DMG森精機	14	10.3	14,708
ディスコ	3.5	2.2	32,670
日東工器	3.1	2.9	6,423
島精機製作所	3	2.6	9,217
NCホールディングス	4.8	—	—
日阪製作所	14.7	7	6,265
ナブテスコ	14.1	8.9	27,857
SMC	8.2	4.9	193,501
新川	7.6	—	—
ユニオンツール	3.3	1.8	5,149
オイレス工業	5.8	3.2	6,124
サトーホールディングス	3.8	2.9	7,325
小松製作所	126.2	75.3	202,782
住友重機械工業	14.8	9.4	34,545
日立建機	12.3	6.6	19,899
巴工業	4.3	2.6	6,588

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
井関農機	5.6	3.3	5,590
タカキタ	7.7	6	3,618
クボタ	140.7	89.2	142,541
月島機械	8.3	4.8	6,926
帝国電機製作所	11.5	4.6	5,138
新東工業	12.1	6	5,844
小森コーポレーション	9	6.5	7,553
鶴見製作所	5.5	4.1	8,687
住友精密工業	16	—	—
荏原製作所	10.9	7.2	21,888
西島製作所	10	6.4	6,009
ダイキン工業	35.8	22.7	286,247
栗田工業	14.2	8.9	24,519
椿本チエイン	14	2.1	8,389
ダイフク	13.3	9.1	51,870
タダノ	13.3	8.1	8,415
フジテック	9.6	6.3	7,881
CKD	7.1	5.1	5,176
平和	7.7	4.7	10,518
SANKYO	6.5	4.2	17,703
日本金銭機械	7	5.8	6,316
福島工業	3.1	1.4	5,215
竹内製作所	5.5	4	7,868
アマノ	8.3	4.8	11,952
グローリー	7.9	4.7	12,567
大和冷機工業	10.1	7.1	8,030
セガサミーホールディングス	25.8	16.8	22,243
リケン	2	1.2	6,192
ホシザキ	8.2	4.9	33,614
大豊工業	6.2	4.8	4,425
日本精工	54.4	34.6	34,842
NTN	62.2	38.4	13,094
ジェイテクト	27.9	16.6	22,825
不二越	22	1.5	6,885
日本トムソン	17.9	9.5	4,873
THK	16.2	10.5	28,654
ユースン精機	2.9	5.2	5,460
キッツ	14.2	7.8	6,091

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マキタ	34.2	20.2	74,740
日立造船	21.6	16	5,408
三菱重工業	43.9	27.9	129,567
I H I	20.4	12.9	34,920
スター精密	6.3	4.1	6,863
<b>電気機器 (12.9%)</b>			
日清紡ホールディングス	15.7	9.2	8,896
イビデン	16.1	10.1	17,058
コニカミノルタ	62.2	37	41,144
ブラザー工業	32.5	21.4	43,270
ミネベアミツミ	49	30.5	49,654
日立製作所	629	74.9	270,389
三菱電機	262.4	166	238,210
富士電機	79	10.8	35,910
安川電機	30.5	19.4	66,348
明電舎	31	4.7	7,341
東芝テック	19	3.1	10,168
マブチモーター	7.3	4.5	17,527
日本電産	31.5	20	268,400
東光高岳	4.1	3.4	4,566
ダブル・スコープ	6.3	—	—
ダイヘン	17	2.5	6,977
日新電機	9.6	6.5	6,415
オムロン	27.9	17.8	91,670
日東工業	6.8	4	8,940
ジーエス・ユアサ コーポレーション	48	5.8	12,516
メルコホールディングス	3.2	2.2	8,360
テクノメディカ	2.4	2.5	5,305
日本電気	34.2	21.7	81,700
富士通	269	16	125,376
沖電気工業	11.1	6.9	9,273
サンケン電気	16	2.5	5,007
アイホン	4.3	3.1	5,635
ルネサスエレクトロニクス	13.6	17.1	9,678
セイコーエプソン	38.6	21	35,322
ワコム	24.5	16.7	7,498
アルバック	6.1	3.7	11,655
E I Z O	2.9	1.8	8,001

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	14.1	6.7	6,599
能美防災	6.5	2.8	5,121
ホーチキ	5.6	2.9	3,335
パナソニック	299.6	190.2	180,842
シャープ	18.3	16.5	20,344
アンリツ	19.3	11.1	23,376
富士通ゼネラル	8.3	5.8	8,520
ソニー	175	111.5	552,036
TDK	13.7	8.7	76,212
アルプスアルパイン	22.1	17.9	40,525
パイオニア	61.3	—	—
日本トリム	2	0.9	5,292
フォスター電機	5.4	5.6	8,752
ヨコオ	9.3	3.9	6,275
ホシデン	8	6.7	5,936
ヒロセ電機	4.2	2.4	27,840
日本航空電子工業	8	5.2	7,945
アルパイン	5.8	—	—
アイコム	3.7	2.6	5,891
船井電機	9	8.3	5,942
横河電機	26.2	16.9	37,433
アズビル	7.6	10.5	26,953
日本光電工業	10.8	7.2	25,920
堀場製作所	5.2	3.2	19,040
アドバンテスト	14	11.1	26,950
キーエンス	12.8	8.2	558,338
日置電機	4.8	2.2	10,131
シスメックス	20.4	13	91,091
OBARA GROUP	2	1.8	6,570
コーセル	8.2	6.3	7,326
イリゾ電子工業	2.2	1.6	7,840
オブテックスグループ	2.5	3.4	6,120
千代田インテグレ	4	2.3	4,795
レーザーテック	5.4	3.5	15,820
スタンレー電気	20.3	11.6	34,916
ウシオ電機	16.2	10.4	14,060
日本セラミック	4.5	2.6	7,508
図研	5.9	4.9	7,261

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	21.1	14.5	21,315
ファナック	24.9	15.8	304,624
ローム	11.8	8	55,120
浜松ホトニクス	18.9	12	50,460
三井ハイテック	5.5	5	5,725
新光電気工業	14.2	8.6	7,396
京セラ	42.7	25.2	161,481
太陽誘電	11.7	7.7	16,470
村田製作所	27.5	17.4	288,840
双葉電子工業	5.7	3.8	6,885
ニチコン	8.9	6.3	6,350
日本ケミコン	4	2.1	4,132
KOA	5.8	4.1	6,268
小糸製作所	15.7	10	62,600
ミツバ	7.8	8.5	5,839
SCREENホールディングス	4.9	3	13,755
キャノン電子	5.7	4.3	7,593
キャノン	141.1	89.6	287,884
リコー	79.7	50.6	59,050
東京エレクトロン	17.4	11.1	174,270
<b>輸送用機器 (7.9%)</b>			
トヨタ紡織	7.5	5.5	9,531
ユニプレス	5.8	3.7	6,434
豊田自動織機	21.3	13.4	77,050
モリタホールディングス	6.4	3.8	6,779
デンソー	58.2	36.9	165,238
東海理化電機製作所	6.5	4.5	8,671
三井E&Sホールディングス	9	6.9	8,197
川崎重工業	20.2	13.1	35,632
日産自動車	309.4	196.4	186,854
いすゞ自動車	75	52.3	77,639
トヨタ自動車	318.2	185.4	1,246,073
日野自動車	37.1	20.4	19,482
三菱自動車工業	98.3	62.3	37,566
武蔵精密工業	3.4	4	5,920
日産車体	11.3	8.4	8,173
新明和工業	13.3	7.6	10,343
極東開発工業	7.9	4.8	7,440

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日信工業	5.8	4.9	7,134
トピー工業	3.5	2.2	5,038
ティラド	2.8	2.1	4,794
NOK	13.5	8.8	15,584
フタバ産業	12.5	11.7	6,107
KYB	2.7	2.7	7,484
プレス工業	29.1	15.5	9,129
ケーヒン	6.5	4	7,392
アイシン精機	21.7	13.7	56,786
マツダ	83	52.6	66,065
今仙電機製作所	5.8	5	4,915
本田技研工業	235.6	140.3	433,527
スズキ	51.7	30.4	149,233
SUBARU	81.2	51.6	139,939
ヤマハ発動機	37.3	23.7	51,666
ショーワ	9	5.9	8,614
エクセディ	3.5	2.1	5,268
豊田合成	8.9	5.6	13,451
愛三工業	10.6	8.4	5,829
ヨロズ	4.9	4.1	6,560
エフ・シー・シー	5.5	2.8	6,722
シマノ	10.5	6.7	113,900
テイ・エス テック	6.1	3.9	12,597
<b>精密機器 (2.0%)</b>			
テルモ	40.2	23.5	163,090
クリエートメディック	8.5	4.4	4,188
島津製作所	31.7	21.2	65,190
クボテック	5.9	—	—
ブイ・テクノロジー	0.6	0.5	6,915
東京精密	4.9	2.9	8,140
マニー	—	2	10,820
ニコン	45	29.3	46,440
トプコン	13.8	8.6	12,401
オリンパス	38.9	24.9	120,889
理研計器	4.3	2.7	5,915
タムロン	5.3	4.8	10,128
HOYA	53.4	33.5	245,119
朝日インテック	—	6.1	31,110

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シチズン時計	31.3	19.4	12,086
セイコーホールディングス	5.2	3.1	8,494
ニプロ	18.4	11.9	17,159
<b>その他製品 (2.0%)</b>			
パラマウントベッドホールディングス	2.9	2	10,120
バンダイナムコホールディングス	27.3	17.3	86,067
アイフィスジャパン	8.1	6.1	3,519
パイロットコーポレーション	4.4	2.8	12,642
トッパン・フォームズ	10.9	6.7	6,472
フジシールインターナショナル	5.5	3.8	15,105
タカラトミー	11.9	7.6	9,097
タカノ	6.8	4.9	4,194
大建工業	4.7	4.1	8,958
凸版印刷	75	23.6	40,072
大日本印刷	34.8	23.3	58,226
N I S S H A	5.5	4.5	5,341
アシックス	26.6	16.4	23,484
小松ウオール工業	4.8	2.3	4,416
ヤマハ	17.8	9.8	54,292
クリナップ	11.1	6.8	3,991
ビジョン	15.6	10.1	46,712
キングジム	8.4	5.8	4,959
リンテック	5.9	3.8	9,401
イトーキ	12.7	9.9	5,256
任天堂	16.1	10.2	310,896
三菱鉛筆	4.6	2.9	6,397
タカラスタンダード	7.3	4.1	6,970
コクヨ	12.6	7.6	12,464
オカムラ	10	5.8	6,606
美津濃	4.2	2.5	6,582
<b>電気・ガス業 (2.0%)</b>			
東京電力ホールディングス	208.3	132.4	92,150
中部電力	80.7	50.7	89,206
関西電力	107	67.8	115,497
中国電力	36.5	22.9	33,113
北陸電力	26.5	16.5	14,635
東北電力	62.2	38.6	55,970
四国電力	24.5	15.3	20,976

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
九州電力	58.8	34.3	45,756
北海道電力	25.9	16.1	10,577
沖縄電力	4.8	3.2	6,470
電源開発	20.9	13.3	36,362
東京瓦斯	56	32.6	100,212
大阪瓦斯	51.2	32.5	74,262
東邦瓦斯	12.8	8.2	41,328
北海道瓦斯	22	2.7	3,942
西部瓦斯	4.6	2.8	7,072
静岡ガス	15.7	7.9	7,410
<b>陸運業 (4.8%)</b>			
東武鉄道	28.3	17.7	57,082
相鉄ホールディングス	7.9	5.7	19,323
東京急行電鉄	71.8	45.5	88,133
京浜急行電鉄	36.4	22.9	42,571
小田急電鉄	39.5	26.9	71,150
京王電鉄	14.8	9.3	65,007
京成電鉄	18.1	12.4	49,228
富士急行	—	2.3	9,625
東日本旅客鉄道	47	29.6	317,016
西日本旅客鉄道	23.7	14.9	124,698
東海旅客鉄道	23.4	14.9	377,491
西武ホールディングス	33.6	21.5	40,248
西日本鉄道	6.9	4.5	12,244
近鉄グループホールディングス	25	15.8	81,528
阪急阪神ホールディングス	33.3	21.1	86,826
南海電気鉄道	11.6	7	21,840
京阪ホールディングス	11.2	7.1	31,630
名古屋鉄道	19.5	12.6	38,178
日本通運	9.7	6.2	38,936
ヤマトホールディングス	43.9	27.8	81,287
山九	6.4	4.4	24,200
丸運	24.1	17.5	4,970
センコーグループホールディングス	23.1	9.6	9,004
トナミホールディングス	1.8	1	5,990
ニッコンホールディングス	8.9	5.8	15,712
日本石油輸送	2.1	1.6	4,617
福山通運	3.3	2.2	9,526

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セイノーホールディングス	18.6	11.9	18,706
日立物流	5	3.5	11,830
C&Fロジホールディングス	7.2	5	6,540
九州旅客鉄道	20.9	13.3	48,478
S Gホールディングス	17.6	15.1	48,848
<b>海運業 (0.2%)</b>			
日本郵船	21	13.4	21,949
商船三井	15.7	9.4	22,691
川崎汽船	11.2	6.1	7,527
飯野海運	23.6	13.5	5,305
<b>空運業 (0.6%)</b>			
日本航空	46.1	28.9	111,987
A N Aホールディングス	48.5	28.8	116,582
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
三菱倉庫	8.1	5.3	15,825
三井倉庫ホールディングス	36	2.8	5,051
住友倉庫	20	5.8	8,265
東陽倉庫	30.4	16.7	5,394
安田倉庫	8.3	6	5,532
上組	15.7	9.8	24,843
キムラユニティー	5.6	3.9	4,317
キューソー流通システム	2.6	1.9	3,838
近鉄エクスプレス	6.2	4.3	7,310
エアアティー	4.5	5.3	6,105
<b>情報・通信業 (8.3%)</b>			
N E C ネットエスアイ	4.5	3.7	10,086
システナ	—	5.8	6,635
デジタルアーツ	—	0.9	7,947
新日鉄住金ソリューションズ	4.6	3.5	10,307
T I S	8.3	5.5	27,995
ネオス	11.8	4.9	4,968
電算システム	3.9	3.2	10,688
グリー	18.8	11.9	5,604
コーエーテックモホールディングス	6	4.1	8,437
ヒト・コミュニケーションズ	3.6	—	—
ブレインパッド	5.4	1.2	7,296
K L a b	7.4	6.9	5,961
ネクソン	28.9	41.9	70,685

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エイチーム	4.3	3.1	5,567
コロブラ	12	7.7	5,328
サイバーリンクス	4.2	2.8	2,900
CARTA HOLDINGS	5.5	3.5	3,402
ティーガイア	5.4	2.5	4,797
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	70.4	42.3	17,131
GMOペイメントゲートウェイ	1.6	2.6	19,812
ザッパラス	14.1	11.6	4,686
インターネットイニシアティブ	5.8	3.1	7,052
LINE	7.3	4.9	18,865
フェイス	5	3	2,499
野村総合研究所	17.3	10.5	52,500
CEホールディングス	7.4	7.2	5,328
インターージホールディングス	10.3	7.2	6,120
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	—	3.9	6,552
フジ・メディア・ホールディングス	26.5	17.2	26,763
オービック	8	5.6	61,880
ヤフー	184.1	108.2	29,971
トレンドマイクロ	12.7	8.7	45,849
日本オラクル	4.1	2.7	22,680
フューチャー	10.3	4.7	7,994
CAC Holdings	9.5	7.3	9,957
ソフトバンク・テクノロジー	4.8	3	7,074
オービックビジネスコンサルタント	—	1.6	6,856
伊藤忠テクノソリューションズ	5.5	7.5	19,402
大塚商会	7.8	8.8	35,156
サイボウズ	16.8	12.8	9,830
電通国際情報サービス	3.5	2.9	10,657
デジタルガレージ	4.9	3.2	9,952
ウェザーニューズ	2.7	1.5	4,777
日本エンタープライズ	25.3	18.9	3,213
ネットワンシステムズ	10.5	5.6	15,164
アルゴグラフィックス	4	2.1	9,702
エイベックス	9.3	4.4	6,472
日本ユニシス	7.4	5.1	14,626
兼松エレクトロニクス	4.2	2.4	8,136
東京放送ホールディングス	15.8	10.8	22,420
日本テレビホールディングス	23.9	15.2	26,402

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
テレビ朝日ホールディングス	6.4	4.2	8,484
スカパーJ SATホールディングス	29.6	13.4	6,485
テレビ東京ホールディングス	5.2	1.4	3,455
日本電信電話	184.3	111.7	533,702
KDDI	231.7	143.8	357,055
ソフトバンク	—	128.5	169,877
光通信	3.1	1.9	40,337
NTTドコモ	190.5	117.2	290,538
GMOインターネット	8.9	5.5	10,582
カドカワ	10.5	5	5,830
ゼンリン	3.5	3.3	9,758
松竹	1.7	1.1	12,892
東宝	16.9	10.8	45,684
東映	1	0.7	10,500
エス・ティ・ティ・データ	80.9	44	54,076
ビジネスブレイン太田昭和	4.2	2.4	4,514
DTS	3.5	2.4	10,056
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11.8	7.6	28,158
カプコン	5.4	7.1	17,402
SCSK	6	4.2	20,643
アイネス	12.9	7.3	9,497
TKC	2.7	2.2	9,196
富士ソフト	3.8	2.4	9,996
NSD	6.8	3.8	9,686
コナミホールディングス	10.5	6.7	32,227
ソフトバンクグループ	116.1	68.3	749,251
<b>卸売業 (5.1%)</b>			
伊藤忠食品	1.6	1.2	5,916
エレマテック	5	2.1	3,490
JALUX	2.4	1.7	4,459
双日	155.5	92.5	36,907
アルフレッサ ホールディングス	28.1	18.4	60,812
横浜冷凍	13.5	7	6,356
神戸物産	—	2.4	9,576
あい ホールディングス	5	4	7,468
ダイワボウホールディングス	—	1.5	9,810
マクニカ・富士エレホールディングス	5.9	5.3	8,156
バイタルケーエスケー・ホールディングス	13.4	4.9	5,355

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
UKCホールディングス	5.6	3.1	6,010
OCHIホールディングス	2.2	3.7	4,806
TOKAIホールディングス	14.5	8.7	7,482
シップヘルスケアホールディングス	5.7	3.5	15,890
明治電機工業	3.3	2.8	4,824
コメダホールディングス	—	3.6	7,754
エコートレーディング	12.8	8.7	4,811
ナガイレーベン	4.9	2.5	6,120
三菱食品	4.1	2.9	8,294
松田産業	7.8	3.9	5,616
第一興商	3.8	2.4	13,488
メディパルホールディングス	26.3	17.5	46,795
アズワン	1.9	1.2	10,680
尾家産業	2.3	3.3	4,263
ドウシシャ	4.9	4.7	8,530
丸文	7.6	8.2	5,420
橋本総業ホールディングス	2.3	3.1	4,966
日本ライフライン	7	4.9	9,020
IDOM	16.2	—	—
進和	3.6	3.3	7,203
オーハシテクニカ	5	3.4	4,936
白銅	3.5	3	5,019
伊藤忠商事	189.1	114.7	235,823
丸紅	212.7	161.9	128,338
長瀬産業	15.6	9.6	15,542
豊田通商	29	18.4	68,172
兼松	11.8	6.8	9,173
三井物産	219.1	135.2	244,374
日本紙ハルブ商事	3.5	1.6	7,056
日立ハイテクノロジーズ	8.8	5.1	23,383
山善	15	7.6	9,165
住友商事	162.9	97	155,782
内田洋行	3.4	2.4	8,028
三菱商事	181.1	115	370,530
キヤノンマーケティングジャパン	7.5	4.5	9,823
西華産業	3.4	3.6	5,281
菱洋エレクトロ	4.8	5.3	8,808
東京産業	14.7	7.6	3,936

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
阪和興業	4.9	2.9	9,642
岩谷産業	5.7	3.5	12,932
イワキ	15	8.6	3,388
三菱石油	9.1	6.6	6,567
稲畑産業	6.8	4.8	7,320
ワキタ	10.4	6.6	7,451
東邦ホールディングス	7.5	4.8	13,656
サンゲツ	9	5.3	11,124
シナネンホールディングス	4	2.3	5,046
伊藤忠エネクス	9.1	6.7	6,291
サンリオ	7.8	5	12,605
リョーサン	3.6	2.7	8,329
三信電気	6.5	4.8	8,928
モスフードサービス	3.7	2.8	7,834
加賀電子	3.9	3.4	7,310
立花エレテック	6.9	3.7	6,312
フォーバル	6.5	6.8	5,705
PALTA C	3.4	2.9	17,516
日鉄住金物産	2.6	1.4	6,657
トラスコ中山	5	3.5	10,472
オートバックスセブン	9.6	6.3	11,881
加藤産業	3.7	2.5	9,412
イノテック	7.9	5.6	5,432
杉本商事	5.4	3.1	5,356
因幡電機産業	3.3	2.5	11,112
ミスミグループ本社	29.5	20.3	54,952
スズケン	12	7.5	48,075
ジェコス	10.2	4.8	4,939
<b>小売業 (4.7%)</b>			
ローソン	6.5	4.2	26,166
サンエー	2.5	1.3	5,642
エービーシー・マート	4.5	2.5	16,450
ハードオフコーポレーション	5.6	4.5	3,726
アスクル	4.2	2	5,574
ゲオホールディングス	6.3	3.6	5,634
アダストリア	6	3.8	9,283
ジーフット	8	5.2	3,416
エディオン	15.6	7	7,063

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
あみやき亭	2.1	1.7	6,341
ハニーズホールディングス	8.6	5.6	6,188
ジンズ	3.2	1.2	6,996
ビックカメラ	14.8	8.7	10,614
DCMホールディングス	14.9	8.9	9,256
Monotaro	9.4	10.3	24,328
J. フロント リテイリング	30.7	21	26,502
ドトール・日レスホールディングス	5.3	3.8	8,090
マツモトキヨシホールディングス	10.5	6.6	24,486
ZOZO	24.7	17.6	35,640
トレジャー・ファクトリー	—	3.8	2,823
ココカラファイン	2.6	1.9	8,797
三越伊勢丹ホールディングス	48.4	30.6	34,088
ウエルシアホールディングス	6.9	4.3	15,845
クリエイトSDホールディングス	4.6	2.6	7,137
シュッピン	5.8	4.1	3,308
ジョイフル本田	4.1	5	7,025
すかいらーくホールディングス	16.1	15.3	27,096
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	13.9	5.5	6,193
ブックオフコーポレーション	8.5	—	—
ゴルフダイジェスト・オンライン	5.9	7.2	4,514
あさひ	5.9	4	6,028
コスモス薬品	1.2	0.8	14,952
トーエル	5.9	3.6	2,826
セブン&アイ・ホールディングス	108.3	68.6	304,515
薬王堂	—	1.5	3,990
ツルハホールディングス	5.5	3.5	31,255
サンマルクホールディングス	4.6	3.1	8,010
トリドールホールディングス	3.7	3.1	7,021
クスリのアオキホールディングス	2.3	1.3	9,646
スシローグローバルホールディングス	—	1.8	13,410
カップ・クリエイト	9.1	5.9	8,926
ライトオン	8.3	5.4	4,017
良品計画	3.4	2.3	60,628
三城ホールディングス	18.9	10.3	4,130
アドヴァン	10.9	6.8	7,323
G-7ホールディングス	2.7	1.8	4,053
エコス	5.6	2.1	3,255

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マルシェ	7.4	5.2	4,175
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	16.9	10.7	74,900
西松屋チェーン	9.1	5.1	4,865
ゼンショーホールディングス	13.6	7.9	20,650
サイゼリヤ	4.7	4.4	9,323
魚力	5.1	2.9	4,268
ユナイテッドアローズ	3.3	1.8	6,750
ハイデイ日高	4.3	3.6	7,711
京都きもの友禅	8.6	4.9	1,994
コロナイド	8.5	5.4	13,057
壱番屋	2.9	1.8	8,631
スギホールディングス	5.8	3.5	17,185
スクロール	14.7	9	3,456
ユニー・ファミリーマートホールディングス	8.2	18.4	54,648
木曾路	4.7	3.2	8,508
千趣会	17.4	12.8	2,956
ケーヨー	17.1	10.4	5,345
上新電機	—	2.9	7,841
日本瓦斯	4.3	2.9	10,092
ロイヤルホールディングス	4.9	3.2	8,720
いなげや	6.9	4.3	5,697
島忠	6.2	3.5	10,262
チヨダ	4.7	2.6	4,747
ライフコーポレーション	4.7	2.1	4,914
AOKIホールディングス	9	4.6	5,625
コメリ	4.5	2.7	7,392
青山商事	4.8	3	7,710
しまむら	2.9	1.9	17,556
高島屋	40	12.9	19,092
松屋	11.2	4.4	4,422
エイチ・ツー・オー リテイリング	12.7	8.1	12,417
バルコ	9.6	5	5,130
丸井グループ	24.7	13.9	30,635
アクシアル リテイリング	3.7	1.8	6,192
イオン	99.5	63	147,451
イズミ	4.8	3.3	16,731
平和堂	5.8	3.2	7,744
フジ	4.5	2.9	5,565

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤオコー	2.6	1.8	10,404
ゼビオホールディングス	5.5	4.9	6,232
ケーズホールディングス	10.3	16.6	16,815
Genky DrugStores	—	1.7	4,141
ブックオフグループホールディングス	—	4.5	3,771
アインホールディングス	3.6	2.2	17,886
ヤマダ電機	84.5	50	27,850
ニトリホールディングス	10.2	7.1	94,110
吉野家ホールディングス	9	5.7	10,009
王将フードサービス	2.6	1.2	8,880
プレナス	5.1	4.6	8,050
ミニストップ	—	3	5,157
アークス	5.9	2.9	7,067
パローホールディングス	5.7	3.4	9,322
ファーストリテイリング	4.3	2.2	119,504
サンドラッグ	10.9	6	19,320
ヤマザワ	4.7	2.9	4,898
ペルーナ	9.4	5.8	5,237
<b>銀行業 (6.3%)</b>			
めぶきフィナンシャルグループ	135.6	86.3	25,717
東京きらばしフィナンシャルグループ	4	2.8	4,779
九州フィナンシャルグループ	43.3	26.5	13,144
ゆうちょ銀行	74	46.7	58,375
コンコルディア・フィナンシャルグループ	154.8	103.1	44,951
西日本フィナンシャルホールディングス	17.4	10.1	9,928
関西みらいフィナンシャルグループ	—	7.5	6,667
三十三フィナンシャルグループ	—	2.5	3,935
第四北越フィナンシャルグループ	—	2.7	8,761
新生銀行	22.6	12.1	19,456
あおぞら銀行	15.2	9.1	28,483
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,811	1,124.2	644,503
りそなホールディングス	284.8	180.1	90,013
三井住友トラスト・ホールディングス	50.7	32.3	135,530
三井住友フィナンシャルグループ	194.9	115.7	467,659
第四銀行	2.8	—	—
北越銀行	4.8	—	—
千葉銀行	93	58.6	36,390
群馬銀行	51.2	33.6	15,960

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
武蔵野銀行	3.8	2.5	5,720
千葉興業銀行	17.2	7.4	2,249
七十七銀行	7.4	4.9	7,722
青森銀行	2.9	1	3,065
秋田銀行	3.9	1.8	4,086
山形銀行	5.1	2.3	4,717
岩手銀行	2.8	1.5	5,077
東邦銀行	21	17.4	5,341
東北銀行	4.6	1.3	1,431
ふくおかフィナンシャルグループ	103	13.2	33,752
静岡銀行	68	41.6	36,316
十六銀行	4.5	2.7	6,453
スルガ銀行	25.7	—	—
八十二銀行	47.6	29.1	13,677
山梨中央銀行	22	2.5	3,625
大垣共立銀行	5.2	2.7	6,369
福井銀行	4.1	2.5	4,310
北國銀行	3.3	1.8	6,390
滋賀銀行	22	3.1	8,357
南都銀行	3.3	2.4	5,215
百五銀行	24.1	16	5,936
京都銀行	9.9	5.9	29,913
紀陽銀行	9.3	5.7	9,199
三重銀行	3.4	—	—
ほくほくフィナンシャルグループ	17.1	10.8	13,489
広島銀行	37.4	24.1	14,291
山陰合同銀行	14.6	9	7,722
中国銀行	18.1	10.8	12,549
鳥取銀行	4.2	0.9	1,301
伊予銀行	37.3	22.4	13,843
百十四銀行	31	2.2	5,277
四国銀行	6.7	3.6	3,942
阿波銀行	18	2.5	7,352
大分銀行	2.7	0.9	3,190
富崎銀行	2.6	1.6	4,409
佐賀銀行	3.5	1.5	2,920
十八銀行	37	1.3	3,703
沖縄銀行	2.7	1.9	7,115

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
琉球銀行	8.1	4.1	5,026
セブン銀行	96	56.9	18,947
みずほフィナンシャルグループ	3,515.4	2,231.1	391,558
山口フィナンシャルグループ	23	20.4	20,624
長野銀行	3.9	0.9	1,481
名古屋銀行	3	1.8	6,498
北洋銀行	40.5	24.1	7,230
第三銀行	3.8	—	—
中京銀行	3.2	1	2,282
愛媛銀行	8.2	3.8	4,465
トマト銀行	4.9	1.7	1,796
京葉銀行	24	8.8	6,116
関西アーバン銀行	8.6	—	—
栃木銀行	22.3	17	4,063
トモニホールディングス	25.6	14.2	6,248
フィデアホールディングス	56.8	27.9	3,654
池田泉州ホールディングス	29.9	20.1	6,150
<b>証券、商品先物取引業 (0.8%)</b>			
F P G	10.3	6.1	5,788
S B I ホールディングス	29.6	19.4	47,452
ジャフコ	3.8	2.7	11,016
大和証券グループ本社	220	132.5	76,161
野村ホールディングス	445.2	300.7	123,256
岡三証券グループ	20	15	6,855
丸三証券	13.6	6.3	4,391
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	30.1	18.8	8,253
水戸証券	33.6	9.6	2,092
いちよし証券	11.9	5.1	4,141
松井証券	14.7	8	9,752
だいにこう証券ビジネス	9.2	7.7	3,149
マネックスグループ	52	17.1	7,028
カブドットコム証券	42.9	14.8	8,302
極東証券	8.2	4.4	4,875
藍澤證券	10.7	5.6	3,824
<b>保険業 (2.2%)</b>			
かんぽ生命保険	9.5	6.1	15,231
S O M P Oホールディングス	50.5	29	117,334
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	67.6	42.9	144,444

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソニーフィナンシャルホールディングス	21.1	13.5	27,823
第一生命ホールディングス	146.3	92.8	150,660
東京海上ホールディングス	97.5	59.5	326,476
T & Dホールディングス	80.5	51.1	60,451
<b>その他金融業 (1.1%)</b>			
全国保証	7	4.5	18,405
クレディセゾン	19.9	11.2	17,494
芙蓉総合リース	3	1.8	10,440
興銀リース	4.3	3	8,115
東京センチュリー	5.2	3.2	15,440
日本証券金融	18.9	9	5,715
アイフル	44.8	28.4	8,292
リコーリース	3.2	1.7	6,103
イオンフィナンシャルサービス	18.3	10.7	25,102
アコム	53.6	33.9	13,560
オリエントコーポレーション	73.8	51	6,120
日立キャピタル	7.3	3.9	10,522
オリックス	172.2	109.5	173,721
三菱UFJリース	65.7	37.6	21,319
日本取引所グループ	75.9	44.3	87,669
アサックス	1.5	7.4	4,107
NECキャピタルソリューション	6	3.2	5,769
<b>不動産業 (2.4%)</b>			
いちご	34.9	23.7	9,029
ヒューリック	53.7	34.8	37,688
野村不動産ホールディングス	16.8	11	23,837
オープンハウス	4	2.7	10,881
東急不動産ホールディングス	63.9	43.4	28,557
飯田グループホールディングス	21.8	13.6	28,002
パーク24	14.3	9.5	23,930
三井不動産	129.1	87	240,990
三菱地所	192.8	115.1	231,523
平和不動産	6.2	3.7	7,973
東京建物	28.4	18.3	24,082
ダイビル	9.7	6.2	6,702
京阪神ビルディング	16.7	8.1	7,946
住友不動産	62	36.9	172,692
大京	6.1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
テーオーシー	13.1	9.6	7,401
レオバレス21	31.6	—	—
スタートコーポレーション	4.9	2.6	6,180
空港施設	10.3	8	4,560
ゴールドクレスト	4.7	3.8	5,897
日本エスリード	3.8	3.6	6,033
サンヨーハウジング名古屋	6	5.2	4,685
イオンモール	17.2	8.6	15,531
カチタス	—	2.8	10,402
エヌ・ティ・ティ都市開発	16.7	—	—
日本空港ビルデング	7.6	5.3	26,076
<b>サービス業 (4.9%)</b>			
日本M&Aセンター	8.7	11.7	35,919
パソナグループ	6.4	4.4	6,824
GCA	11.1	6.2	5,146
エス・エム・エス	5	5.8	11,025
パーソルホールディングス	23.1	15.7	29,578
クックパッド	19.3	15.3	4,192
学情	5.4	2.8	3,514
スタジオアリス	4.4	2.9	6,609
シミックホールディングス	6.9	2.9	4,631
NJS	7.7	3.3	4,692
総合警備保障	10.1	6.4	30,144
カカコム	19.5	12.2	24,400
アイロムグループ	5.1	3.1	4,628
ディップ	4.2	4.1	7,650
キャリアデザインセンター	3.3	2.4	3,096
ベネフィット・ワン	—	4.4	8,927
エムスリー	26.5	33.8	60,975
アウトソーシング	7.5	8	11,232
ディー・エヌ・エー	12.9	8.3	14,176
博報堂DYホールディングス	34.7	22.4	40,185
ぐるなび	9.6	9.2	6,679
ファンコミュニケーションズ	16.7	11.8	6,962
WDBホールディングス	3.3	2.5	7,675
インフォマート	—	8.2	11,135
EPSホールディングス	6.1	3.4	6,555
クイック	6.5	4.5	8,127

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ケネディクス	34.6	16.9	9,328
電通	30.6	19.3	91,289
みらかホールディングス	7.5	4.6	13,312
ダイオーズ	4.9	4.4	6,186
日本空調サービス	11.9	7.7	5,313
オリエンタルランド	29.6	18.8	231,804
ダスキン	6.2	4.2	11,167
ラウンドワン	7	6.7	9,755
リゾートトラスト	11.1	6.7	10,103
ビー・エム・エル	4.6	2.5	8,262
りらいあコミュニケーションズ	10	6.3	6,230
リソー教育	—	20.8	10,691
早稲田アカデミー	3.3	3	4,254
ユー・エス・エス	31	19.7	40,148
サイバーエージェント	16.7	9.8	40,082
楽天	128.1	74.4	75,218
テー・オー・ダブリュー	6.8	6.7	4,837
テクノプロ・ホールディングス	4.4	2.9	19,024
インターワークス	—	4	2,900
キャリアリンク	11.2	9.1	3,676
ライドオンエクスプレスホールディングス	6	4.4	5,368
リクルートホールディングス	193.3	113.9	360,949
エラン	6.4	4.6	6,256
日本郵政	142.2	130.5	171,216
MS-Japan	—	2.9	4,860
リロググループ	13.6	8.5	26,222
エイチ・アイ・エス	4	2.7	10,746
共立メンテナンス	4.5	2.4	13,920
建設技術研究所	7.6	3.9	6,052
よみうりランド	1.6	1.7	7,650
東京都競馬	3.7	2.2	7,645
カナモト	4.3	2.7	7,306
東京ドーム	12.4	8.1	8,772
トランス・コスモス	4.6	3.8	8,553
乃村工藝社	6.8	3.9	12,031
日本管財	6.8	2.2	4,283
白洋舎	1.7	1.6	4,656
セコム	26.5	16.9	162,240

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セントラル警備保障	6.1	1.5	6,870
メイテック	3	2.2	11,022
応用地質	8.8	5.6	6,350
船井総研ホールディングス	6.3	3.3	8,718
ベネッセホールディングス	9.4	5.7	16,564
イオンディライト	3.4	2	8,270
ニチイ学館	7.7	7.2	9,374

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ダイセキ	4.5	3.4	9,166	
ステップ	5.3	3.7	5,309	
合 計	株 数 ・ 金 額	31,602	19,188	38,530,201
	銘柄数<比率>	1,076	1,084	<94.9%>

(注) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の<>内は、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 1,963	百万円 -

### ○投資信託財産の構成

(2019年3月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	38,530,201	94.5
コール・ローン等、その他	2,263,871	5.5
投資信託財産総額	40,794,072	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年3月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	41,416,197,450
コール・ローン等	2,186,229,251
株式(評価額)	38,530,201,180
未収配当金	65,774,019
差入委託証拠金	633,993,000
(B) 負債	817,532,409
未払金	4,779,480
未払解約金	190,623,190
未払利息	4,739
差入委託証拠金代用有価証券	622,125,000
(C) 純資産総額(A-B)	40,598,665,041
元本	30,954,355,870
次期繰越損益金	9,644,309,171
(D) 受益権総口数	30,954,355,870口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,116円

(注) 当親ファンドの期首元本額は50,305,675,669円、期中追加設定元本額は17,392,230,268円、期中一部解約元本額は36,743,550,067円です。

(元本の内訳)

東京海上セレクション・日本株TOPIX	16,428,490,297円
東京海上・TOPIXインデックスファンド<適格機関投資家限定>	13,171,315,992円
円資産バランスファンド2018-09<適格機関投資家限定>	293,283,030円
東京海上日本株TOPIXファンド	287,898,582円
TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	248,889,352円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	178,826,718円
TMA世界バランスファンド35VA (適格機関投資家限定)	168,041,224円
LPS4資産分散ファンド (積極型)	58,027,660円
LPS4資産分散ファンド (成長重視型)	45,571,189円
LPS4資産分散ファンド (バランス型)	33,233,386円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	24,502,095円
LPS4資産分散ファンド (安定重視型)	10,043,169円
LPS4資産分散ファンド (慎重型)	5,178,423円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	1,054,753円

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

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

(注) 2019年3月20日現在、先物取引などに係る差入委託証拠金代用有価証券として担保に供している資産は以下の通りです。

・株式	809,690,000円
-----	--------------

## ○損益の状況 (2018年3月21日～2019年3月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,154,895,406
受取配当金	1,156,423,409
受取利息	34,061
その他収益金	855,106
支払利息	△ 2,417,170
(B) 有価証券売買損益	△ 1,924,511,632
売買益	3,352,834,607
売買損	△ 5,277,346,239
(C) 先物取引等取引損益	△ 223,869,900
取引益	407,426,120
取引損	△ 631,296,020
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 993,486,126
(E) 前期繰越損益金	18,206,074,648
(F) 追加信託差損益金	6,800,295,277
(G) 解約差損益金	△14,368,574,628
(H) 計(D+E+F+G)	9,644,309,171
次期繰越損益金(H)	9,644,309,171

(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) (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日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第13期 (決算日 2018年11月12日)

(計算期間 2017年11月11日~2018年11月12日)

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

## 東京海上アセットマネジメント

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

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	純資産額
	騰落	率	騰落	率		
	円	%		%	%	百万円
9期(2014年11月10日)	12,015	2.2	359.767	2.2	99.0	198,569
10期(2015年11月10日)	12,233	1.8	366.242	1.8	99.0	113,534
11期(2016年11月10日)	12,834	4.9	384.198	4.9	99.5	71,744
12期(2017年11月10日)	12,715	△0.9	380.302	△1.0	99.2	21,910
13期(2018年11月12日)	12,710	△0.0	379.669	△0.2	99.5	5,155

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率
	騰落	率	騰落	率	
(期首)	円	%		%	%
2017年11月10日	12,715	—	380.302	—	99.2
11月末	12,714	△0.0	380.257	△0.0	98.7
12月末	12,724	0.1	380.513	0.1	98.3
2018年1月末	12,706	△0.1	379.850	△0.1	98.9
2月末	12,754	0.3	381.295	0.3	98.0
3月末	12,775	0.5	381.911	0.4	97.7
4月末	12,769	0.4	381.638	0.4	93.3
5月末	12,798	0.7	382.498	0.6	99.3
6月末	12,810	0.7	382.669	0.6	99.7
7月末	12,789	0.6	381.979	0.4	99.6
8月末	12,720	0.0	379.893	△0.1	96.8
9月末	12,689	△0.2	378.986	△0.3	98.9
10月末	12,710	△0.0	379.645	△0.2	98.7
(期末)					
2018年11月12日	12,710	△0.0	379.669	△0.2	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、野村証券が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。

## ○運用経過

(2017年11月11日～2018年11月12日)

### ■期中の基準価額等の推移

期首：12,715円  
 期末：12,710円  
 騰落率：△0.0%

### ◇基準価額の主な変動要因

#### プラス要因

・保有する債券の利息収入

#### マイナス要因

・米国の利上げ観測の高まりや日銀の金融政策修正への思惑などを背景に、10年国債利回りが上昇（債券価格は下落）したこと

### ■投資環境

10年国債利回りは、上昇しました。

期の半ばまでは、海外金利の動向や欧州の不透明な政治情勢などに左右される局面もありましたが、日銀による金融緩和政策が継続したことから、10年国債利回りは0.05%を中心とする狭いレンジで推移しました。

2018年7月下旬以降、日銀の金融政策修正に関する報道が相次いだことや、7月末の日銀金融政策決定会合後に黒田総裁が10年国債利回りの変動幅を現行の2倍（±0.2%）程度まで許容すると表明したことから、10年国債利回りは一時0.13%程度まで上昇しました。しかし、8月上旬に日銀が異例のタイミングで国債買い入れオペを実施して長期金利の急上昇を牽制する姿勢を示したことから、10年国債利回りは0.1%程度まで低下しました。

8月中旬以降は、海外金利の上昇や日銀が超長期国債利回りの上昇を容認する姿勢を示したことを背景に10年国債利回りは一時0.15%台まで上昇しましたが、10月上旬には世界的に投資家のリスク回避姿勢が鮮明化したことを背景に低下しました。期末直前には、米国の中間選挙などの波乱要因はあったものの、10年国債利回りは小幅な変化にとどまり、0.12%程度の水準で期を終えました。

### ■ポートフォリオについて

当ファンドは、ベンチマークであるNOMURA-BPI（総合）に連動することを目標に、ファンドとベンチマークのリスク特性値が近似するよう調整して運用を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は前期末対比おおむね横ばいとなりました。

### ■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、ベンチマークの騰落率△0.2%に対して、基準価額の騰落率は△0.0%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。

#### (主な変動要因)

##### プラス要因

・リバランスに伴い売却した債券の評価時価と売却時価の差異に起因する含み益

##### マイナス要因

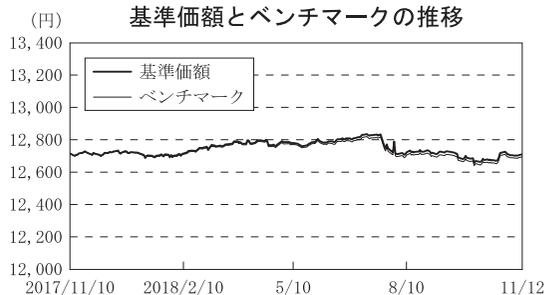
・特にありません

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<sup>(※)</sup>は、10月末現在、推定値で0.07%となっています。

※2018年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。

## ○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。



(注) ベンチマークは、期首(2017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。

## ○1万口当たりの費用明細

(2017年11月11日～2018年11月12日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2017年11月11日～2018年11月12日)

## 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	2,579,793	15,591,346
	地方債証券	—	1,038,288
内	特殊債券	—	757,571
	社債券(投資法人債券を含む)	—	1,448,830 (242,723)

(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

(2017年11月11日～2018年11月12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

(2018年11月12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BB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	3,890,000	4,219,747	81.9	—	60.0	17.7	4.1
地方債証券	312,000 (312,000)	316,705 (316,705)	6.1 (6.1)	— (—)	— (—)	— (—)	6.1 (6.1)
特殊債券 (除く金融債)	104,000 (104,000)	108,437 (108,437)	2.1 (2.1)	— (—)	— (—)	2.0 (2.0)	0.1 (0.1)
普通社債券 (含む投資法人債券)	435,369 (435,369)	483,892 (483,892)	9.4 (9.4)	— (—)	7.4 (7.4)	— (—)	2.0 (2.0)
合 計	4,741,369 (851,369)	5,128,783 (909,035)	99.5 (17.6)	— (—)	67.4 (7.4)	19.8 (2.0)	12.3 (8.2)

(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391回利付国債(2年)	0.1	200,000	200,842	2020/8/1	第82回利付国債(20年)	2.1	30,000	34,387	2025/9/20
第126回利付国債(5年)	0.1	170,000	170,877	2020/12/20	第84回利付国債(20年)	2.0	80,000	91,492	2025/12/20
第132回利付国債(5年)	0.1	50,000	50,379	2022/6/20	第90回利付国債(20年)	2.2	65,000	76,168	2026/9/20
第133回利付国債(5年)	0.1	190,000	191,542	2022/9/20	第99回利付国債(20年)	2.1	20,000	23,682	2027/12/20
第135回利付国債(5年)	0.1	80,000	80,698	2023/3/20	第100回利付国債(20年)	2.2	70,000	83,769	2028/3/20
第136回利付国債(5年)	0.1	60,000	60,540	2023/6/20	第105回利付国債(20年)	2.1	20,000	23,890	2028/9/20
第5回利付国債(40年)	2.0	30,000	39,218	2052/3/20	第113回利付国債(20年)	2.1	20,000	24,151	2029/9/20
第7回利付国債(40年)	1.7	45,000	55,022	2054/3/20	第116回利付国債(20年)	2.2	50,000	61,266	2030/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	30,000	29,087	2057/3/20	第117回利付国債(20年)	2.1	50,000	60,709	2030/3/20
第308回利付国債(10年)	1.3	10,000	10,231	2020/6/20	第123回利付国債(20年)	2.1	80,000	97,015	2030/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	50,000	51,735	2021/12/20	第127回利付国債(20年)	1.9	30,000	36,785	2031/3/20
第324回利付国債(10年)	0.8	50,000	51,635	2022/6/20	第133回利付国債(20年)	1.8	90,000	107,491	2031/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	55,000	57,038	2022/12/20	第141回利付国債(20年)	1.7	40,000	47,447	2032/12/20
第335回利付国債(10年)	0.5	100,000	103,288	2024/9/20	第145回利付国債(20年)	1.7	50,000	59,417	2033/6/20
第339回利付国債(10年)	0.4	30,000	30,873	2025/6/20	第146回利付国債(20年)	1.7	50,000	59,445	2033/9/20
第340回利付国債(10年)	0.4	80,000	82,389	2025/9/20	第151回利付国債(20年)	1.2	20,000	22,302	2034/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	60,000	60,507	2026/3/20	第153回利付国債(20年)	1.3	60,000	67,772	2035/6/20
第343回利付国債(10年)	0.1	75,000	75,598	2026/6/20	第154回利付国債(20年)	1.2	50,000	55,656	2035/9/20
第346回利付国債(10年)	0.1	60,000	60,324	2027/3/20	第156回利付国債(20年)	0.4	30,000	29,356	2036/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	60,000	60,282	2027/6/20	第158回利付国債(20年)	0.5	50,000	49,513	2036/9/20
第348回利付国債(10年)	0.1	130,000	130,457	2027/9/20	第160回利付国債(20年)	0.7	90,000	91,866	2037/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	120,000	120,000	2028/6/20	第161回利付国債(20年)	0.6	40,000	40,033	2037/6/20
第3回利付国債(30年)	2.3	20,000	24,769	2030/5/20	小 計		3,890,000	4,219,747	
第5回利付国債(30年)	2.2	10,000	12,388	2031/5/20	地方債証券				
第22回利付国債(30年)	2.5	10,000	13,266	2036/3/20	平成21年度第1回千葉県公募公債	1.53	12,000	12,081	2019/4/25
第28回利付国債(30年)	2.5	20,000	26,796	2038/3/20	第75回共同発行市場公募地方債	1.64	100,000	100,998	2019/6/25
第29回利付国債(30年)	2.4	60,000	79,440	2038/9/20	平成22年度第3回横浜市公募公債	1.168	100,000	102,122	2020/9/18
第33回利付国債(30年)	2.0	20,000	25,166	2040/9/20	第1回川崎市15年公募公債	1.78	100,000	101,504	2019/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	100,000	130,245	2041/3/20	小 計		312,000	316,705	
第38回利付国債(30年)	1.8	20,000	24,525	2043/3/20	特殊債券(除く金融債)				
第39回利付国債(30年)	1.9	20,000	24,984	2043/6/20	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	104,435	2021/2/26
第47回利付国債(30年)	1.6	20,000	23,691	2045/6/20	第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	4,000	4,002	2018/11/28
第49回利付国債(30年)	1.4	70,000	79,531	2045/12/20	小 計		104,000	108,437	
第50回利付国債(30年)	0.8	20,000	19,800	2046/3/20	普通社債券(含む投資法人債券)				
第51回利付国債(30年)	0.3	50,000	43,319	2046/6/20	第33回道路債券	2.91	100,000	134,386	2034/6/20
第56回利付国債(30年)	0.8	20,000	19,677	2047/9/20	第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	46,675	49,283	2046/11/10
第58回利付国債(30年)	0.8	80,000	78,507	2048/3/20	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	50,607	53,369	2046/12/10
第59回利付国債(30年)	0.7	30,000	28,630	2048/6/20	第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	48,320	50,958	2047/1/10
第59回利付国債(20年)	1.9	60,000	62,867	2021/3/22	第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	49,504	52,270	2047/4/10
第51回利付国債(20年)	2.0	90,000	94,981	2021/6/21	第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	40,263	41,384	2039/2/10
第53回利付国債(20年)	2.1	20,000	21,375	2021/12/20	第7回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.11	100,000	102,240	2019/12/20
第60回利付国債(20年)	1.4	20,000	21,235	2022/12/20	小 計		435,369	483,892	
第66回利付国債(20年)	1.8	60,000	65,760	2023/12/20	合 計		4,741,369	5,128,783	
第67回利付国債(20年)	1.9	30,000	33,172	2024/3/20					
第70回利付国債(20年)	2.4	40,000	45,541	2024/6/20					
第71回利付国債(20年)	2.2	60,000	67,638	2024/6/20					
第74回利付国債(20年)	2.1	40,000	45,263	2024/12/20					
第75回利付国債(20年)	2.1	30,000	34,096	2025/3/20					
第76回利付国債(20年)	1.9	10,000	11,238	2025/3/20					
第80回利付国債(20年)	2.1	40,000	45,649	2025/6/20					

(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

(2018年11月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	5,128,783	99.0
コール・ローン等、その他	52,376	1.0
投資信託財産総額	5,181,159	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年11月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,181,159,545
コール・ローン等	37,629,659
公社債(評価額)	5,128,783,247
未収利息	13,803,304
前払費用	943,335
(B) 負債	25,718,924
未払解約金	25,718,825
未払利息	99
(C) 純資産総額(A-B)	5,155,440,621
元本	4,056,267,227
次期繰越損益金	1,099,173,394
(D) 受益権総口数	4,056,267,227口
1万円当たり基準価額(C/D)	12,710円

(注) 当親ファンドの期首元本額は17,231,428,891円、期中追加設定元本額は3,834,903,364円、期中一部解約元本額は17,010,065,028円です。

<元本の内訳>

東京海上セレクション・日本債券インデックス	1,537,368,604円
円資産バランスファンド2018-09<適格機関投資家限定>	1,396,242,038円
TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>	472,711,894円
TMA日本債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	210,987,548円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	113,001,095円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	109,049,066円
L P S 4資産分散ファンド(バランス型)	48,776,515円
L P S 4資産分散ファンド(慎重型)	40,902,804円
L P S 4資産分散ファンド(成長重視型)	37,214,663円
L P S 4資産分散ファンド(安定重視型)	30,744,171円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	29,527,418円
L P S 4資産分散ファンド(積極型)	28,088,503円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	1,652,908円

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

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

## ○損益の状況 (2017年11月11日~2018年11月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	141,432,757
受取利息	141,515,646
支払利息	△ 82,889
(B) 有価証券売買損益	△ 103,078,737
売買益	27,150,400
売買損	△ 130,229,137
(C) 当期損益金(A+B)	38,354,020
(D) 前期繰越損益金	4,678,901,625
(E) 追加信託差損益金	1,049,388,226
(F) 解約差損益金	△4,667,470,477
(G) 計(C+D+E+F)	1,099,173,394
次期繰越損益金(G)	1,099,173,394

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

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

## TMA外国株式インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第13期（決算日 2018年11月12日）

（計算期間 2017年11月11日～2018年11月12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 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率	期 騰 落	中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
9期(2014年11月10日)	18,533	27.3	860,159	27.5	95.6	1.7	2.3	197,889
10期(2015年11月10日)	20,086	8.4	934,426	8.6	95.2	2.4	2.4	114,601
11期(2016年11月10日)	17,807	△11.3	829,736	△11.2	93.4	3.8	2.5	77,257
12期(2017年11月10日)	23,462	31.8	1,093,435	31.8	89.0	8.2	2.4	29,547
13期(2018年11月12日)	24,465	4.3	1,147,119	4.9	92.4	5.1	2.3	8,378

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

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

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率			
(期 首)	円	%		%	%	%	%
2017年11月10日	23,462	—	1,093,435	—	89.0	8.2	2.4
11月末	23,496	0.1	1,096,331	0.3	92.7	4.7	2.4
12月末	24,231	3.3	1,130,329	3.4	89.4	7.0	2.3
2018年1月末	24,504	4.4	1,143,342	4.6	94.8	2.0	2.2
2月末	23,407	△0.2	1,092,376	△0.1	90.5	6.2	2.1
3月末	22,415	△4.5	1,046,335	△4.3	87.4	8.1	2.2
4月末	23,439	△0.1	1,093,785	0.0	85.6	9.3	2.1
5月末	23,538	0.3	1,098,797	0.5	88.2	9.5	2.1
6月末	23,720	1.1	1,108,958	1.4	91.0	4.7	2.3
7月末	24,652	5.1	1,153,118	5.5	91.6	5.6	2.3
8月末	25,145	7.2	1,177,938	7.7	94.4	2.2	2.4
9月末	25,790	9.9	1,208,801	10.6	92.9	4.6	2.2
10月末	23,527	0.3	1,102,226	0.8	95.3	4.1	2.4
(期 末)							
2018年11月12日	24,465	4.3	1,147,119	4.9	92.4	5.1	2.3

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

## ○運用経過

(2017年11月11日～2018年11月12日)

## ■期中の基準価額等の推移

期首：23,462円

期末：24,465円

騰落率：4.3%

## ◇基準価額の主な変動要因

## プラス要因

- ・米国の税制改革により景気拡大が期待されたこと
- ・米国経済指標から米国内の景況感改善が確認されたこと

## マイナス要因

- ・VIX指数（恐怖指数：投資家の心理を表す指数）の急騰で株式市場が動揺し、一時的にリスク回避的となったこと
- ・米中貿易摩擦の悪影響で世界経済の減速懸念が広がったこと

## ■投資環境

(2017年11月から2018年4月)

期初は、米国の税制改革法案への期待感が外国株式市場を下支えする動きとなり、株価は徐々に落ち着きを取り戻しながら堅調に推移しました。しかし、2018年2月上旬に発表された米国の賃金上昇率が事前予想を上回ったことで、米国の利上げペースが加速することへの懸念が一段と強くなり、市場に警戒感が広がりました。このような状況下、それまで記録的低水準で推移していたVIX指数が急騰したことにより外国株式市場は急落し、しばらくは値動きの荒い展開が続きました。その後、外国株式市場は一旦落ち着きを取り戻しましたが、トランプ米大統領が鉄鋼やアルミニウムの輸入製品に対して追加関税を課すと決定したことで、保護貿易主義の台頭が嫌気され、外国株式市場には様子見姿勢が広がり、一進一退の展開となりました。

(2018年5月から2018年9月)

米中貿易摩擦による世界経済の減速懸念が強まり、欧州・アジア圏の株式市場は軟調となった一方で、米国株式市場は米国内の良好な経済指標を支えに堅調に推移しました。

(2018年10月から2018年11月)

10月上旬のFRB（米連邦準備制度理事会）議長による中立金利（金融緩和と引き締めとの分岐点となる金利の水準）に関する発言で金利の上昇が一段と進んだことや、米国とサウジアラビアの関係悪化、一部の米国企業の決算が失望されたことなどが重なり、投資家心理は急激に悪化しました。その結果、5月以降堅調に推移していた米国株式市場も他市場と同様に下落する動きとなり、外国株式市場は大幅に下落しました。



(注) ベンチマークは、期首(2017年11月10日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) ベンチマークは、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)です。

## ■ポートフォリオについて

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

個別銘柄の選択は、最適化手法を用いてファンドとベンチマークのリスク特性がほぼ一致するように調整しました。その結果、保有銘柄数は前期末の912銘柄に対して、当期末には974銘柄となりました。また、期中の設定・解約に応じて外国株式指数先物と現物株式の売買を行いました。

以上の運用の結果、基準価額は4.3%上昇しました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、ベンチマークの騰落率+4.9%対して基準価額の騰落率は+4.3%となり、ベンチマークにはほぼ連動しました。

(主な差異要因)

### プラス要因

- ・特にありません

### マイナス要因

- ・配当課税の影響
- ・売買コストの影響

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー<sup>(※)</sup>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、外国株式指数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

(2017年11月11日～2018年11月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 14	% 0.057	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(11)	(0.044)	
(投資信託証券)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(3)	(0.012)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	2	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 * 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)	(2)	(0.008)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	30	0.124	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 * 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 * その他は、信託事務等に要する諸費用
(保 管 費 用)	(30)	(0.123)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	46	0.189	
期中の平均基準価額は、23,988円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

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

## ○売買及び取引の状況

(2017年11月11日～2018年11月12日)

## 株式

	買付		売付	
	株数	金額	株数	金額
アメリカ	百株 746 ( 134)	千米ドル 6,214 ( 408)	百株 15,180 ( 22)	千米ドル 119,558 ( 410)
カナダ	94 (△ 6)	千カナダドル 490 ( 6)	1,951 ( ー)	千カナダドル 8,752 ( 6)
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
ドイツ	96 ( 29)	340 ( 196)	1,223 ( 13)	5,683 ( 275)
イタリア	151	108	2,668	1,255
フランス	57	265	1,459 ( ー)	6,059 ( 10)
オランダ	63	83	1,145	2,594
スペイン	193 ( 931)	150 ( 11)	3,425	2,105
ベルギー	8	37	93	690
オーストリア	ー	ー	36 ( ー)	158 ( 1)
ルクセンブルク	15	39	79	114
フィンランド	6 ( 21)	26 ( ー)	551	711
アイルランド	7 ( 5)	39 ( 70)	55 ( 5)	237 ( 70)
ポルトガル	7	10	310	206
その他	ー	ー	ー ( 25)	ー ( 85)
イギリス	808 ( 156)	千英ポンド 433 ( 23)	15,659 ( 97)	千英ポンド 9,552 ( 41)
スイス	41 ( 5)	千スイスフラン 222 ( ー)	812 ( ー)	千スイスフラン 5,462 ( 18)
スウェーデン	77 ( 109)	千スウェーデンクローネ 1,280 ( 341)	1,292 ( ー)	千スウェーデンクローネ 17,675 ( 341)
ノルウェー	4	千ノルウェークローネ 31	345	千ノルウェークローネ 4,475
デンマーク	14	千デンマーククローネ 513	371	千デンマーククローネ 9,352
オーストラリア	96 ( 20)	千豪ドル 175 ( 2)	3,661 ( ー)	千豪ドル 5,797 ( 3)
ニュージーランド	34	千ニュージーランドドル 13	460	千ニュージーランドドル 237

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	香港	百株 160 ( 35)	千香港ドル 1,041 ( -)	百株 4,994	千香港ドル 19,599
	シンガポール	127	千シンガポールドル 79	4,450	千シンガポールドル 1,308
	イスラエル	-	千イスラエルシケル -	647	千イスラエルシケル 950

(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	0.076	12	2	328
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.039	6	0.589	101
	BOSTON PROPERTIES INC	0.035	4	0.926	115
	CROWN CASTLE INTL CORP	0.033	3	1	212
	DIGITAL REALTY TRUST INC	0.039	4	1	148
	DUKE REALTY CORP	-	-	3	83
	EQUINIX INC	0.016	6	0.464	203
	EQUITY RESIDENTIAL	0.081	5	1	87
	EXTRA SPACE STORAGE INC	-	-	0.995	87
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	-	-	0.604	72
	HCP INC	-	-	3	86
	HOST HOTELS & RESORTS INC	-	-	5	118
	IRON MOUNTAIN INC	-	-	2	75
	KIMCO REALTY CORP	-	-	4	67
	LIBERTY PROPERTY TRUST	-	-	1	59
	PROLOGIS INC	0.299	19	3	192
	PUBLIC STORAGE	-	-	0.676	137
	REALTY INCOME CORP	0.207	12	2	123
	REGENCY CENTERS CORP	-	-	1	78
	SBA COMMUNICATIONS CORP	0.227	36	-	-
	SL GREEN REALTY CORP	-	-	0.915	89
	SIMON PROPERTY GROUP INC	0.059	11	1	277
UDR INC	-	-	2	90	
VENTAS INC	0.056	3	1	88	
VORNADO REALTY TRUST	-	-	1	99	

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千米ドル	千口	千米ドル
WELLTOWER INC	0.055	3	1	88
WEYERHAEUSER CO	0.351	9	3	121
小計	1	138	50	3,237
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.524	12	—	—
小計	0.524	12	—	—
ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
フランス				
KLEPIERRE	—	—	1	66
GECINA SA	—	—	0.481	71
COVIVIO	—	—	0.527	47
UNIBAIL-RODAMCO SE	—	—	0.308	60
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	0.039	6	—	—
	(△0.212)	(△46)		
	( 0.212)	( 46)		
小計	0.039	6	3	245
ユーロ計	0.039	6	3	245
イギリス		千英ポンド		千英ポンド
BRITISH LAND CO PLC	—	—	10	66
HAMMERSON PLC	—	—	9	52
INTU PROPERTIES PLC	—	—	17	35
SEGRO PLC	0.488	3	10	61
LAND SECURITIES GROUP PLC	0.408	3	5	50
小計	0.896	6	53	265
オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
MIRVAC GROUP	2	6	33	76
GPT GROUP	—	—	15	76
STOCKLAND	3	13	21	88
GOODMAN GROUP	—	—	14	129
SCENTRE GROUP	—	—	36	151
WESTFIELD CORP	—	—	19	171
小計	6	20	140	694
香港		千香港ドル		千香港ドル
LINK REIT	0.5	36	10	709
小計	0.5	36	10	709
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	3	6	6	12
小計	3	6	6	12

(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 15,792	百万円 17,906	百万円 -	百万円 -

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

## ○株式売買比率

(2017年11月11日～2018年11月12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	20,997,477千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	13,265,260千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.58

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年11月11日～2018年11月12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

(2018年11月12日現在)

## 外国株式

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
AFLAC INC	24	14	65	7,441	保険	
AGCO CORP	10	3	20	2,389	資本財	
AT&T INC	407	141	434	49,514	電気通信サービス	
ABBOTT LABORATORIES	120	34	249	28,480	ヘルスケア機器・サービス	
ABBVIE INC	109	29	264	30,117	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ABIOMED INC	—	0.92	37	4,247	ヘルスケア機器・サービス	
ACTIVISION BLIZZARD INC	54	14	78	8,963	メディア・娯楽	
ACUITY BRANDS INC	5	1	22	2,588	資本財	
ADOBE INC	35	9	238	27,199	ソフトウェア・サービス	
ADVANCE AUTO PARTS	9	1	21	2,496	小売	
ADVANCED MICRO DEVICES	—	18	38	4,370	半導体・半導体製造装置	
AETNA INC	24	6	130	14,861	ヘルスケア機器・サービス	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	6	1	19	2,219	各種金融	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	26	6	45	5,158	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	14	3	63	7,232	素材	
AKAMAI TECHNOLOGIES	21	5	36	4,178	ソフトウェア・サービス	
ALBEMARLE CORP	—	3	30	3,499	素材	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	17	4	53	6,146	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	1	37	4,247	ヘルスケア機器・サービス	
ALLEGHANY CORP	1	0.41	25	2,938	保険	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5	1	33	3,772	ソフトウェア・サービス	
ALLSTATE CORP	28	6	63	7,282	保険	
ALPHABET INC-CL C	21	6	648	73,858	メディア・娯楽	
ALPHABET INC-CL A	20	5	630	71,788	メディア・娯楽	
ALTRIA GROUP INC	124	36	232	26,469	食品・飲料・タバコ	
AMAZON.COM INC	27	8	1,378	157,066	小売	
AMEREN CORPORATION	22	5	38	4,387	公益事業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	27	9	70	8,015	公益事業	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	53	14	157	17,938	各種金融	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	63	18	79	9,067	保険	
AMERISOURCEBERGEN CORP	16	4	38	4,383	ヘルスケア機器・サービス	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	12	2	37	4,218	各種金融	
AMETEK INC	—	5	43	4,903	資本財	
AMGEN INC	49	12	249	28,457	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMPHENOL CORP-CL A	24	5	49	5,586	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ANADARKO PETROLEUM CORP	43	10	58	6,672	エネルギー	
ANALOG DEVICES	26	7	61	7,045	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	8	1	24	2,778	ソフトウェア・サービス	
ANTHEM INC	19	5	143	16,386	ヘルスケア機器・サービス	
APACHE CORP	37	8	32	3,688	エネルギー	
APPLE INC	348	95	1,958	223,095	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APPLIED MATERIALS INC	78	20	68	7,850	半導体・半導体製造装置	
ARAMARK	—	6	24	2,742	消費者サービス	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	36	10	49	5,647	食品・飲料・タバコ	
ARISTA NETWORKS INC	—	1	31	3,592	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ASSURANT INC	—	1	18	2,137	保険	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	期末		額	
			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		
ATMOS ENERGY CORP	—	1	17	1,983	公益事業	
AUTODESK INC	16	4	62	7,119	ソフトウェア・サービス	
AUTOLIV INC	9	3	26	2,999	自動車・自動車部品	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	32	8	124	14,137	ソフトウェア・サービス	
AUTOZONE INC	2	0.52	41	4,703	小売	
AVERY DENNISON CORP	9	3	27	3,155	素材	
BB&T CORPORATION	62	15	78	8,953	銀行	
BAKER HUGHES A GE CO	40	10	28	3,191	エネルギー	
BALL CORP	35	8	40	4,609	素材	
BANK OF AMERICA CORP	675	189	539	61,494	銀行	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	69	20	97	11,096	各種金融	
BARD (C. R.) INC	4	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
BAXTER INTL INC	35	9	62	7,088	ヘルスケア機器・サービス	
BECTON DICKINSON & CO	16	5	128	14,634	ヘルスケア機器・サービス	
WR BERKLEY CORP	13	3	23	2,715	保険	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	80	24	548	62,511	各種金融	
BEST BUY COMPANY INC	—	4	30	3,498	小売	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	16	3	38	4,338	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BIOGEN INC	15	4	135	15,414	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BLACKROCK INC	8	2	98	11,272	各種金融	
H&R BLOCK INC	33	7	21	2,494	消費者サービス	
BOEING CO	39	10	399	45,575	資本財	
BOOKING HOLDINGS INC	—	0.93	180	20,532	小売	
BORGWARNER INC	22	6	23	2,691	自動車・自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	100	27	105	11,989	ヘルスケア機器・サービス	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	8	5	22	2,567	保険	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	112	32	172	19,636	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	—	2	25	2,870	ソフトウェア・サービス	
BROADCOM INC	—	7	190	21,757	半導体・半導体製造装置	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	21	6	31	3,623	食品・飲料・タバコ	
CBS CORP CL-B	32	7	44	5,035	メディア・娯楽	
CBRE GROUP INC - A	—	6	25	2,938	不動産	
CDK GLOBAL INC	15	3	19	2,273	ソフトウェア・サービス	
CDW CORP/DE	—	3	35	4,026	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	16	3	29	3,379	運輸	
CIGNA CORP	18	4	104	11,853	ヘルスケア機器・サービス	
CME GROUP INC	21	6	122	13,965	各種金融	
CMS ENERGY CORP	27	6	34	3,890	公益事業	
CSX CORP	68	16	116	13,284	運輸	
CVS HEALTH CORPORATION	67	19	159	18,164	ヘルスケア機器・サービス	
CA INC	36	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
CABOT OIL & GAS CORP	45	11	30	3,492	エネルギー	
CAMPBELL SOUP CO	21	5	20	2,366	食品・飲料・タバコ	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	35	10	91	10,403	各種金融	
CARDINAL HEALTH INC	24	8	46	5,274	ヘルスケア機器・サービス	
CARMAX INC	19	3	23	2,658	小売	
CARNIVAL CORP	29	8	47	5,362	消費者サービス	
CATERPILLAR INC	42	11	150	17,178	資本財	
CELANESE CORP-SERIES A	13	3	32	3,723	素材	
CELGENE CORP	55	14	107	12,245	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CENTENE CORP	—	4	59	6,745	ヘルスケア機器・サービス	
CENTERPOINT ENERGY INC	41	13	36	4,166	公益事業	

銘柄	株数	当 期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額		千円	
			株 数	外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
CERNER CORP	26	6	39	4,539	ヘルスケア機器・サービス	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	15	3	108	12,403	メディア・娯楽	
CHEVRONTXACO CORP	127	37	443	50,546	エネルギー	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	3	0.68	33	3,802	消費者サービス	
CIMAREX ENERGY CO	9	2	26	2,974	エネルギー	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	17	3	31	3,622	保険	
CISCO SYSTEMS INC	344	92	433	49,409	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CINTAS CORP	8	2	39	4,451	商業・専門サービス	
CITIGROUP INC	188	50	332	37,860	銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	10	38	4,384	銀行	
CITRIX SYSTEMS INC	15	3	34	3,913	ソフトウェア・サービス	
CLOROX COMPANY	12	2	40	4,613	家庭用品・パーソナル用品	
COCA-COLA COMPANY	249	77	385	43,886	食品・飲料・タバコ	
COGNEX CORP	—	5	24	2,777	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	44	11	78	8,976	ソフトウェア・サービス	
COLGATE-PALMOLIVE CO	55	16	106	12,081	家庭用品・パーソナル用品	
COMCAST CORP-CL A	325	91	351	40,019	メディア・娯楽	
COMERICA INC	17	3	33	3,850	銀行	
CONAGRA BRANDS INC	40	10	37	4,239	食品・飲料・タバコ	
CONCHO RESOURCES INC	10	3	52	6,035	エネルギー	
CONOCOPHILLIPS	78	22	151	17,282	エネルギー	
CONSOLIDATED EDISON INC	15	5	46	5,247	公益事業	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	12	3	67	7,660	食品・飲料・タバコ	
COOPER COS INC/THE	5	1	33	3,814	ヘルスケア機器・サービス	
COPART INC	—	3	17	2,004	商業・専門サービス	
CORE LABORATORIES N. V.	7	—	—	—	エネルギー	
CORNING INC	74	15	53	6,087	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
COSTCO WHOLESALE CORP	29	8	203	23,133	食品・生活必需品小売り	
COSTAR GROUP INC	—	0.73	26	3,036	商業・専門サービス	
COTY INC-CL A	60	15	12	1,475	家庭用品・パーソナル用品	
CUMMINS INC	12	2	39	4,548	資本財	
DR HORTON INC	33	6	21	2,477	耐久消費財・アパレル	
DTE ENERGY COMPANY	13	3	38	4,361	公益事業	
DXC TECHNOLOGY CO	21	5	36	4,111	ソフトウェア・サービス	
DANAHER CORP	38	12	128	14,665	ヘルスケア機器・サービス	
DARDEN RESTAURANTS INC	13	2	22	2,600	消費者サービス	
DAVITA INC	18	3	27	3,097	ヘルスケア機器・サービス	
DEERE & CO	20	6	88	10,064	資本財	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	18	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
DENTSPLY SIRONA INC	21	7	26	3,007	ヘルスケア機器・サービス	
DEVON ENERGY CORPORATION	43	12	40	4,581	エネルギー	
THE WALT DISNEY CO	108	29	349	39,877	メディア・娯楽	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	32	7	50	5,708	各種金融	
DISCOVERY INC-A	31	5	19	2,194	メディア・娯楽	
DISCOVERY INC-C	37	4	14	1,611	メディア・娯楽	
EVEREST RE GROUP LTD	4	1	25	2,949	保険	
Dollar General Corp	20	5	60	6,852	小売	
DOLLAR TREE INC	19	4	36	4,173	小売	
DOMINION ENERGY INC	37	12	90	10,265	公益事業	
DOMINO'S PIZZA INC	—	1	29	3,344	消費者サービス	
DOVER CORP	14	3	34	3,879	資本財	
DOWDUPONT INC	160	45	267	30,508	素材	

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
DR PEPPER SNAPPLE GROUP-W/I	17	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
DUKE ENERGY CORP	36	13	115	13,183	公益事業	
EOG RESOURCES INC	35	10	113	12,983	エネルギー	
EQT CORPORATION	—	6	23	2,675	エネルギー	
E*TRADE FINANCIAL CORP	30	7	39	4,493	各種金融	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	—	3	36	4,151	消費者サービス	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	15	4	34	3,935	素材	
EBAY INC	79	18	55	6,292	小売	
ECOLAB INC	16	4	77	8,841	素材	
BUNGE LIMITED	16	4	25	2,941	食品・飲料・タバコ	
EDISON INTERNATIONAL	18	6	41	4,691	公益事業	
Edwards Lifesciences Corp	16	4	63	7,190	ヘルスケア機器・サービス	
ELECTRONIC ARTS INC	24	5	51	5,843	メディア・娯楽	
EMERSON ELECTRIC CO	45	12	82	9,419	資本財	
ENTERGY CORP	16	4	36	4,152	公益事業	
EQUIFAX INC	12	2	20	2,385	商業・専門サービス	
EVERSOURCE ENERGY	23	5	36	4,200	公益事業	
EXELON CORP	64	18	84	9,637	公益事業	
EXPEDIA GROUP INC	11	3	41	4,692	小売	
EXPEDITORS INTL WASH INC	20	4	30	3,514	運輸	
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	44	10	108	12,309	ヘルスケア機器・サービス	
EXXON MOBIL CORPORATION	275	82	663	75,575	エネルギー	
FLIR SYSTEMS INC	—	4	19	2,244	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FACEBOOK INC-A	159	46	677	77,182	メディア・娯楽	
FASTENAL CO	28	6	34	3,949	資本財	
FEDEX CORP	17	5	114	13,065	運輸	
F5 NETWORKS INC	8	1	30	3,528	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	24	5	63	7,236	ソフトウェア・サービス	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	29	7	26	3,052	保険	
FIFTH THIRD BANCORP	64	14	40	4,593	銀行	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	15	4	41	4,773	銀行	
FISERV INC	17	7	63	7,222	ソフトウェア・サービス	
FIRSTENERGY CORP	42	9	37	4,312	公益事業	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	—	2	43	4,963	ソフトウェア・サービス	
FLOWSERVE CORP	—	4	20	2,368	資本財	
FORD MOTOR CO	268	76	71	8,141	自動車・自動車部品	
FORTINET INC	—	3	27	3,133	ソフトウェア・サービス	
FORTIVE CORP	24	5	42	4,799	資本財	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	16	5	24	2,774	資本財	
FRANKLIN RESOURCES INC	34	9	28	3,204	各種金融	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	20	4	34	3,957	保険	
GARTNER INC	9	2	33	3,852	ソフトウェア・サービス	
GENERAL DYNAMICS CORP	17	4	90	10,321	資本財	
GENERAL ELECTRIC CO	584	171	147	16,752	資本財	
GENERAL MILS INC	37	11	53	6,045	食品・飲料・タバコ	
GENERAL MOTORS CO	100	25	90	10,352	自動車・自動車部品	
GENUINE PARTS CO	15	3	34	3,966	小売	
GILEAD SCIENCES INC	86	25	182	20,737	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GLOBAL PAYMENTS INC	—	3	37	4,243	ソフトウェア・サービス	
GODADDY INC - CLASS A	—	4	26	3,025	ソフトウェア・サービス	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	25	7	164	18,747	各種金融	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	31	9	20	2,337	自動車・自動車部品	

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
WR GRACE & CO	11	—	—	—	素材	
WW GRAINGER INC	5	0.81	23	2,711	資本財	
HCA HEALTHCARE INC	25	5	81	9,283	ヘルスケア機器・サービス	
HP INC	128	31	79	9,004	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HALLIBURTON CO	56	15	55	6,289	エネルギー	
HARLEY-DAVIDSON INC	22	5	21	2,506	自動車・自動車部品	
HARRIS CORP	—	2	32	3,734	資本財	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	30	9	44	5,074	保険	
HASBRO INC	12	3	31	3,603	耐久消費財・アパレル	
HELMERICH & PAYNE	16	3	20	2,374	エネルギー	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	2	28	3,256	ソフトウェア・サービス	
HESS CORP	30	6	38	4,380	エネルギー	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	124	30	47	5,382	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	—	6	43	4,953	消費者サービス	
HOLLYFRONTIER CORP	21	4	27	3,110	エネルギー	
HOME DEPOT INC	79	22	416	47,427	小売	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	44	14	214	24,389	資本財	
HORMEL FOODS CORP	34	7	33	3,821	食品・飲料・タバコ	
HUMANA INC	10	2	91	10,388	ヘルスケア機器・サービス	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	10	2	30	3,501	運輸	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	110	30	44	5,017	銀行	
IAC/INTERACTIVECORP	—	1	31	3,613	メディア・娯楽	
IDEXX LABORATORIES INC	—	1	39	4,555	ヘルスケア機器・サービス	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	22	5	79	9,032	資本財	
ILLUMINA INC	10	3	99	11,329	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INCYTE CORP	15	4	28	3,302	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INTEL CORP	307	90	437	49,795	半導体・半導体製造装置	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	42	10	86	9,857	各種金融	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	59	17	219	25,041	ソフトウェア・サービス	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	8	2	32	3,655	素材	
INTERNATIONAL PAPER CO	32	8	38	4,423	素材	
INTERPUBLIC GROUP COS INC	49	11	26	3,058	メディア・娯楽	
INTUIT INC	18	4	107	12,226	ソフトウェア・サービス	
INTUITIVE SURGICAL INC	8	2	117	13,410	ヘルスケア機器・サービス	
IQVIA HOLDINGS INC	—	3	41	4,697	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
JPMORGAN CHASE & CO	239	66	741	84,489	銀行	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	16	3	26	3,019	資本財	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC.	—	10	22	2,613	各種金融	
JOHNSON & JOHNSON	176	52	761	86,708	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
KLA-TENCOR CORPORATION	14	3	29	3,354	半導体・半導体製造装置	
KELLOGG CO	20	5	33	3,844	食品・飲料・タバコ	
KEYCORP	95	22	42	4,786	銀行	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	—	4	28	3,297	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
KIMBERLY-CLARK CORP	22	6	73	8,317	家庭用品・パーソナル用品	
KINDER MORGAN INC	151	39	69	7,935	エネルギー	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	—	5	17	1,979	運輸	
KOHL'S CORP	—	3	27	3,082	小売	
KRAFT HEINZ CO/THE	36	12	66	7,572	食品・飲料・タバコ	
KROGER CO	74	16	51	5,822	食品・生活必需品小売り	
LKQ CORP	34	8	24	2,755	小売	
L3 TECHNOLOGIES INC	—	1	36	4,140	資本財	
LAM RESEARCH CORP	12	3	47	5,458	半導体・半導体製造装置	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
LAS VEGAS SANDS CORP	29	7	39	4,457	消費者サービス	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	17	4	62	7,126	家庭用品・パーソナル用品	
LEGGETT & PLATT INC	18	4	18	2,131	耐久消費財・アパレル	
LEIDOS HOLDINGS INC	—	3	25	2,935	ソフトウェア・サービス	
LENNAR CORP-CL A	23	8	34	3,929	耐久消費財・アパレル	
LENNAR CORP-B SHS	0.46	—	—	—	耐久消費財・アパレル	
LENNOX INTERNATIONAL INC	—	0.8	16	1,930	資本財	
LEUCADIA NATIONAL CORP	41	—	—	—	各種金融	
LIBERTY BROADBAND-C	—	3	25	2,902	メディア・娯楽	
LIBERTY INTERACTIVE CORP QVC GROUP-A	49	—	—	—	小売	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	—	3	15	1,763	メディア・娯楽	
ELI LILLY & CO	66	19	217	24,739	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
LINCOLN NATIONAL CORP	20	4	30	3,418	保険	
LOCKHEED MARTIN CORP	17	5	156	17,874	資本財	
LOEWS CORP	27	6	32	3,746	保険	
LOWE'S COMPANIES	58	15	154	17,562	小売	
LULULEMON ATHLETICA INC	14	2	28	3,291	耐久消費財・アパレル	
M & T BANK CORP	11	2	45	5,128	銀行	
MSCI INC	—	2	30	3,430	各種金融	
MANPOWERGROUP	7	2	18	2,095	商業・専門サービス	
MARATHON OIL CORP	83	19	34	3,963	エネルギー	
MARATHON PETROLEUM CORP	41	13	92	10,570	エネルギー	
MARSH & MCLENNAN COS	36	9	83	9,549	保険	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	24	5	68	7,827	消費者サービス	
MASCO CORP	32	9	30	3,447	資本財	
MASTERCARD INC-CLASS A	65	18	374	42,686	ソフトウェア・サービス	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	26	7	40	4,564	半導体・半導体製造装置	
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	12	2	42	4,798	食品・飲料・タバコ	
MCDONALD'S CORP	56	15	284	32,435	消費者サービス	
MCKESSON CORP	15	4	52	6,021	ヘルスケア機器・サービス	
MERCADOLIBRE INC	—	0.93	30	3,451	小売	
MERCK & CO. INC.	178	52	393	44,891	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
METLIFE INC	66	17	77	8,778	保険	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	2	0.51	31	3,533	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MICROSOFT CORP	490	142	1,560	177,765	ソフトウェア・サービス	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	19	5	39	4,462	半導体・半導体製造装置	
MICRON TECHNOLOGY INC	79	22	89	10,186	半導体・半導体製造装置	
MIDDLEBY CORP	—	1	20	2,293	資本財	
MOHAWK INDUSTRIES INC	5	1	21	2,462	耐久消費財・アパレル	
MOLSON COORS BREWING CO -B	17	5	32	3,703	食品・飲料・タバコ	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	101	28	125	14,279	食品・飲料・タバコ	
MONSANTO CO	25	—	—	—	素材	
MONSTER BEVERAGE CORP	27	8	47	5,394	食品・飲料・タバコ	
MOODY'S CORP	13	3	54	6,173	各種金融	
MORGAN STANLEY	100	27	126	14,448	各種金融	
MOSAIC CO/THE	41	9	33	3,839	素材	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	15	3	46	5,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MURPHY OIL CORP	28	—	—	—	エネルギー	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	40	10	36	4,162	エネルギー	
NETAPP INC	29	5	43	4,921	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NETFLIX INC	30	8	261	29,840	メディア・娯楽	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	66	22	21	2,503	銀行	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	期末		額	
			株数	外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
NEWELL BRANDS INC	32	14	29	3,369	耐久消費財・アパレル	
NEWMONT MINING CORP	31	8	25	2,922	素材	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	56	13	19	2,266	メディア・娯楽	
NEXTERA ENERGY INC	31	8	158	18,085	公益事業	
NIKE INC -CL B	84	24	187	21,359	耐久消費財・アパレル	
NISOURCE INC	—	10	27	3,129	公益事業	
NOBLE ENERGY INC	49	13	35	4,052	エネルギー	
NORDSTROM INC	—	3	24	2,796	小売	
NORFOLK SOUTHERN CORP	21	5	96	10,964	運輸	
NORTHERN TRUST CORP	17	3	37	4,251	各種金融	
NORTHROP GRUMMAN CORP	11	3	93	10,645	資本財	
NUCOR CORP	28	7	46	5,300	素材	
NVIDIA CORP	41	11	233	26,550	半導体・半導体製造装置	
OGE ENERGY CORP	25	6	25	2,918	公益事業	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	8	1	56	6,467	小売	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	52	14	109	12,461	エネルギー	
ONEOK INC	—	7	46	5,276	エネルギー	
ORACLE CORPORATION	209	59	301	34,339	ソフトウェア・サービス	
P G & E CORP	31	10	42	4,807	公益事業	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	35	9	127	14,514	銀行	
PPG INDUSTRIES INC	18	4	53	6,087	素材	
PPL CORPORATION	38	13	43	4,990	公益事業	
PVH CORP	9	2	29	3,347	耐久消費財・アパレル	
PACCAR INC	30	6	37	4,282	資本財	
PACKAGING CORP OF AMERICA	9	2	25	2,854	素材	
PALO ALTO NETWORKS INC	—	2	39	4,506	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
PARKER HANNIFIN CORP	11	2	44	5,052	資本財	
PATTERSON COS INC	18	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス	
PAYCHEX INC	24	5	39	4,537	ソフトウェア・サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	81	22	192	21,955	ソフトウェア・サービス	
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	49	12	19	2,225	銀行	
PEPSICO INC	86	27	324	36,957	食品・飲料・タバコ	
PFIZER INC	380	114	507	57,854	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	102	30	270	30,859	食品・飲料・タバコ	
PHILLIPS 66	30	8	87	9,943	エネルギー	
PINNACLE WEST CAPITAL	12	3	26	3,044	公益事業	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	12	3	52	5,936	エネルギー	
POLARIS INDUSTRIES INC	7	2	19	2,197	耐久消費財・アパレル	
PRAXAIR INC	21	—	—	—	素材	
T ROWE PRICE GROUP INC	19	4	46	5,251	各種金融	
PRICELINE GROUP INC	3	—	—	—	小売	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	25	5	27	3,140	保険	
PROCTER & GAMBLE CO	161	48	451	51,403	家庭用品・パーソナル用品	
PROGRESSIVE CORP	47	11	82	9,381	保険	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	32	8	81	9,261	保険	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	31	9	51	5,822	公益事業	
PULTE HOMES INC	32	9	23	2,715	耐久消費財・アパレル	
QUALCOMM INC	97	27	154	17,656	半導体・半導体製造装置	
QUEST DIAGNOSTICS	13	3	31	3,581	ヘルスケア機器・サービス	
QURATE RETAIL INC-A	—	11	28	3,221	小売	
RALPH LAUREN CORP	7	1	22	2,598	耐久消費財・アパレル	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	14	4	32	3,731	各種金融	

銘柄	株数	期末				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
RAYTHEON COMPANY	19	5	104	11,889	資本財	
RED HAT INC	15	3	61	7,047	ソフトウェア・サービス	
Regeneron Pharmaceuticals Inc	5	1	57	6,502	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
REGIONS FINANCIAL CORP	106	22	38	4,370	銀行	
REPUBLIC SERVICES INC	23	5	40	4,564	商業・専門サービス	
RESMED INC	14	3	37	4,215	ヘルスケア機器・サービス	
ROBERT HALF INTL INC	16	4	26	3,021	商業・専門サービス	
ROCKWELL AUTOMATION INC	10	2	38	4,397	資本財	
ROCKWELL COLLINS INC.	13	2	39	4,538	資本財	
ROLLINS INC	—	3	20	2,349	商業・専門サービス	
ROPER TECHNOLOGIES INC	8	2	59	6,831	資本財	
ROSS STORES INC	28	6	69	7,914	小売	
S&P GLOBAL INC	19	4	91	10,463	各種金融	
SEI INVESTMENTS COMPANY	17	4	22	2,514	各種金融	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	—	3	17	1,991	ソフトウェア・サービス	
SVB FINANCIAL GROUP	—	1	25	2,959	銀行	
SALESFORCE.COM INC	49	14	192	21,918	ソフトウェア・サービス	
SCANA CORP	20	5	22	2,600	公益事業	
SCHLUMBERGER LTD	83	24	124	14,212	エネルギー	
SCHWAB (CHARLES) CORP	89	23	111	12,723	各種金融	
SEALED AIR CORP	24	5	19	2,239	素材	
SEATTLE GENETICS INC	—	3	18	2,163	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
SEMPRA ENERGY	15	4	56	6,422	公益事業	
SERVICENOW INC	—	3	66	7,567	ソフトウェア・サービス	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	6	1	70	8,082	素材	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	14	4	32	3,755	半導体・半導体製造装置	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	12	2	31	3,601	食品・飲料・タバコ	
SOUTHERN CO	62	19	92	10,512	公益事業	
SOUTHWEST AIRLINES CO	19	4	20	2,392	運輸	
SPLUNK INC	15	2	29	3,312	ソフトウェア・サービス	
SQUARE INC - A	—	5	43	4,950	ソフトウェア・サービス	
STANLEY BLACK & DECKER INC	12	3	46	5,343	資本財	
STARBUCKS CORP	102	26	181	20,736	消費者サービス	
STATE STREET CORP	27	7	54	6,190	各種金融	
STERICYCLE INC	12	3	15	1,748	商業・専門サービス	
STRYKER CORP	23	6	112	12,800	ヘルスケア機器・サービス	
SUNTRUST BANKS INC	39	9	58	6,688	銀行	
SYMANTEC CORP	54	15	33	3,866	ソフトウェア・サービス	
SYNOPSIS INC	14	3	33	3,807	ソフトウェア・サービス	
SYNCHRONY FINANCIAL	63	14	39	4,534	各種金融	
SYSCO CORP	29	9	64	7,345	食品・生活必需品小売り	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	—	7	37	4,223	各種金融	
TJX COMPANIES INC	37	23	130	14,898	小売	
T-MOBILE US INC	—	6	47	5,391	電気通信サービス	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	—	2	25	2,949	メディア・娯楽	
TAPESTRY INC	31	7	32	3,665	耐久消費財・アパレル	
TARGET CORP	35	9	84	9,588	小売	
TELEFLEX INC	—	0.7	18	2,120	ヘルスケア機器・サービス	
TESLA INC	10	2	89	10,144	自動車・自動車部品	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	77	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TEXAS INSTRUMENTS	63	18	181	20,629	半導体・半導体製造装置	
TEXTRON INC	27	4	28	3,208	資本財	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	期末		額	
			株数	評価		
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	26	8	196	22,357	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
3M CO	40	11	232	26,441	資本財	
TIFFANY & CO	12	3	34	3,910	小売	
TIME WARNER INC	53	—	—	—	メディア・娯楽	
TOLL BROTHERS INC	19	5	17	2,029	耐久消費財・アパレル	
TORCHMARK CORP	12	2	25	2,862	保険	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	16	3	35	4,034	ソフトウェア・サービス	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	—	3	32	3,663	小売	
TRANSDIGM GROUP INC	—	1	42	4,846	資本財	
TRANSUNION	—	4	29	3,406	商業・専門サービス	
TRAVELERS COS INC/THE	19	5	66	7,554	保険	
TRIMBLE INC	—	6	24	2,847	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
TRIPADVISOR INC-W/I	17	3	24	2,769	メディア・娯楽	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX IN	86	19	94	10,738	メディア・娯楽	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	—	10	48	5,561	メディア・娯楽	
TWITTER INC	62	13	45	5,226	メディア・娯楽	
TYSON FOODS INC-CL A	21	5	36	4,187	食品・飲料・タバコ	
US BANCORP	116	29	159	18,125	銀行	
ULTA BEAUTY INC	—	1	36	4,142	小売	
UNION PACIFIC CORP	54	15	228	26,021	運輸	
UNITED PARCEL SERVICE CL B	43	13	149	17,019	運輸	
UNITED RENTALS INC	—	2	26	3,074	資本財	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	49	14	192	21,952	資本財	
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	1	15	1,811	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
UNITEDHEALTH GROUP INC	64	18	518	59,112	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	10	2	30	3,520	ヘルスケア機器・サービス	
UNUM GROUP	25	6	25	2,900	保険	
VF CORP	20	6	56	6,386	耐久消費財・アパレル	
VAIL RESORTS INC	—	1	28	3,295	消費者サービス	
VALERO ENERGY CORP	34	8	73	8,342	エネルギー	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10	2	30	3,441	ヘルスケア機器・サービス	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	—	3	31	3,583	ヘルスケア機器・サービス	
VERISIGN INC	10	2	41	4,761	ソフトウェア・サービス	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	272	80	470	53,573	電気通信サービス	
VERISK ANALYTICS INC	—	2	34	3,936	商業・専門サービス	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	18	5	91	10,450	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
VIACOM INC CL B	44	10	34	3,876	メディア・娯楽	
VISA INC-CLASS A SHARES	126	34	502	57,250	ソフトウェア・サービス	
VMWARE INC-CLASS A	9	2	35	4,021	ソフトウェア・サービス	
VOYA FINANCIAL INC	24	5	22	2,609	各種金融	
VULCAN MATERIALS CO	12	3	40	4,651	素材	
WABCO HOLDINGS INC	6	2	25	2,850	資本財	
WEC ENERGY GROUP INC	17	6	42	4,801	公益事業	
WABTEC CORP/DE	11	2	25	2,955	資本財	
WALMART INC	99	28	302	34,458	食品・生活必需品小売り	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	63	16	135	15,461	食品・生活必需品小売り	
WASTE CONNECTIONS INC	—	4	36	4,121	商業・専門サービス	
WASTE MANAGEMENT INC	26	7	71	8,142	商業・専門サービス	
WATERS CORP	7	1	37	4,226	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WELLS FARGO & COMPANY	322	90	480	54,746	銀行	
WESTERN DIGITAL CORP	24	7	33	3,834	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
WESTERN UNION CO	53	13	25	2,950	ソフトウェア・サービス	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	評価額		業種等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
WESTROCK CO	23	7	34	3,899	素材	
WHIRLPOOL CORP	7	1	21	2,452	耐久消費財・アパレル	
WILLIAMS COS INC	—	23	59	6,779	エネルギー	
WORKDAY INC-CLASS A	—	3	42	4,862	ソフトウェア・サービス	
WORLDPAY INC-CLASS A	—	5	53	6,108	ソフトウェア・サービス	
WYNDHAM DESTINATIONS	11	—	—	—	消費者サービス	
XCEL ENERGY INC	31	9	48	5,517	公益事業	
XLINX INC	18	4	42	4,849	半導体・半導体製造装置	
XEROX CORP	29	7	21	2,442	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
XYLEM INC	18	4	32	3,650	資本財	
YUM! BRANDS INC	27	6	58	6,615	消費者サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	17	4	48	5,481	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	37	10	95	10,865	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
INVESCO LTD	38	11	24	2,790	各種金融	
CHUBB LTD	30	8	117	13,376	保険	
SIGNET JEWELERS LTD	10	—	—	—	小売	
LyondellBasell Industries NV	26	6	63	7,212	素材	
GARMIN LTD	12	3	26	2,967	耐久消費財・アパレル	
ACCENTURE PLC-CL A	41	12	202	23,069	ソフトウェア・サービス	
NXP SEMICONDUCTORS NV	19	6	57	6,560	半導体・半導体製造装置	
SEAGATE TECHNOLOGY	31	8	34	3,922	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AON PLC	19	4	76	8,661	保険	
TE CONNECTIVITY LTD	28	6	49	5,635	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING NV	21	—	—	—	資本財	
INGERSOLL-RAND PLC	20	4	45	5,191	資本財	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	20	4	21	2,498	耐久消費財・アパレル	
APTIV PLC	20	5	42	4,833	自動車・自動車部品	
EATON CORP PLC	33	8	58	6,701	資本財	
IHS MARKIT LTD	36	6	35	4,027	商業・専門サービス	
BROADCOM LTD	27	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	9	2	37	4,282	保険	
TECHNIPFMC PLC	44	10	27	3,130	エネルギー	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	—	5	23	2,706	資本財	
PERRIGO CO PLC	14	3	22	2,591	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
PENTAIR PLC	17	5	24	2,771	資本財	
MEDTRONIC PLC	89	26	248	28,265	ヘルスケア機器・サービス	
MYLAN NV	42	12	45	5,195	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
NIELSEN HOLDINGS PLC	35	11	29	3,349	商業・専門サービス	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	64	18	62	7,154	資本財	
ALLERGAN PLC	24	6	112	12,843	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	6	29	3,343	食品・飲料・タバコ	
LINDE PLC	—	10	175	20,004	素材	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	—	4	23	2,651	保険	
小計	株数・金額	20,105	5,784	46,605	5,310,254	
	銘柄数<比率>	424	485	—	<63.4%>	
(カナダ)			千カナダドル			
ARC RESOURCES LTD	58	15	16	1,427	エネルギー	
AGRIUM INC	13	—	—	—	素材	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	27	8	56	4,869	食品・生活必需品小売り	
BCE INC	15	5	27	2,400	電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	31	11	113	9,765	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA	65	21	151	13,085	銀行	

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
BARRICK GOLD CORP	57	22	39	3,384	素材	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	49	16	93	8,037	各種金融	
CAE INC	41	10	25	2,187	資本財	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	19	4	22	1,981	素材	
CAMECO CORP	79	13	21	1,880	エネルギー	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	18	7	91	7,899	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	40	13	154	13,308	運輸	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	62	21	81	7,042	エネルギー	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	8	2	73	6,330	運輸	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	7	2	36	3,117	小売	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	23	6	21	1,848	公益事業	
CENOVUS ENERGY INC	109	22	26	2,289	エネルギー	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	—	0.49	43	3,780	ソフトウェア・サービス	
DOLLARAMA INC	10	7	27	2,407	小売	
ENCANA CORP	99	29	34	2,948	エネルギー	
ENBRIDGE INC	108	32	141	12,252	エネルギー	
FINNING INTERNATIONAL INC	31	7	20	1,729	資本財	
FIRST CAPITAL REALTY INC	39	11	22	1,973	不動産	
FORTIS INC	39	9	42	3,661	公益事業	
FRANCO-NEVADA CORP	15	4	38	3,299	素材	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	30	7	32	2,795	耐久消費財・アパレル	
GOLDCORP INC	85	23	28	2,450	素材	
GREAT-WEST LIFECO INC	26	9	28	2,470	保険	
CGI GROUP INC	24	5	42	3,653	ソフトウェア・サービス	
HUSKY ENERGY INC	61	15	28	2,467	エネルギー	
IGM FINANCIAL INC	17	4	16	1,462	各種金融	
IMPERIAL OIL LTD	33	7	29	2,551	エネルギー	
INTACT FINANCIAL CORP	15	3	40	3,455	保険	
INTER PIPELINE LTD	48	12	29	2,529	エネルギー	
JEAN COUTU GROUP INC A	24	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
KEYERA CORP	28	7	21	1,853	エネルギー	
LOBLAW COMPANIES LTD	22	5	29	2,563	食品・生活必需品小売り	
MAGNA INTERNATIONAL INC	28	7	46	3,984	自動車・自動車部品	
MANULIFE FINANCIAL CORP	128	35	79	6,832	保険	
METRO INC	28	7	32	2,836	食品・生活必需品小売り	
NATIONAL BANK OF CANADA	31	7	46	3,982	銀行	
NUTRIEN LTD	—	11	83	7,246	素材	
ONEX CORPORATION	11	3	31	2,733	各種金融	
OPEN TEXT CORP	29	7	30	2,633	ソフトウェア・サービス	
PEMBINA PIPELINE CORP	41	9	44	3,811	エネルギー	
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	77	—	—	—	素材	
POWER CORP OF CANADA	43	12	32	2,786	保険	
POWER FINANCIAL CORP	32	8	24	2,141	保険	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	26	7	14	1,256	エネルギー	
RESTAURANT BRANDS INTERN	—	4	30	2,591	消費者サービス	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	24	6	43	3,772	電気通信サービス	
ROYAL BANK OF CANADA	85	26	253	21,887	銀行	
SNC-LAVALIN GROUP INC	20	5	27	2,368	資本財	
SAPUTO INC	28	6	27	2,344	食品・飲料・タバコ	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	46	13	33	2,867	メディア・娯楽	
SUN LIFE FINANCIAL INC	29	10	52	4,538	保険	
SUNCOR ENERGY INC	107	30	134	11,637	エネルギー	

銘柄	株数	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
TELUS CORP	3	3	13	1,188		電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	30	5	36	3,157		各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	106	33	247	21,354		銀行
TRANSCANADA CORP	50	16	83	7,200		エネルギー
VERMILION ENERGY INC	19	6	19	1,654		エネルギー
WESTON (GEORGE) LTD	7	2	24	2,145		食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	45	13	29	2,523		素材
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,579	715	3,273	282,639	
		62	62	—	<3.4%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ADIDAS AG	12	3	71	9,255		耐久消費財・アパレル
Fresenius SE & CO KG	28	8	45	5,837		ヘルスケア機器・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16	3	13	1,769		電気通信サービス
HANNOVER RUECK SE	—	1	22	2,940		保険
GEA GROUP AG	20	6	16	2,179		資本財
CONTINENTAL AG	7	2	37	4,788		自動車・自動車部品
DEUTSCHE POST AG	62	18	52	6,834		運輸
AXEL SPRINGER SE	10	1	10	1,371		メディア・娯楽
MERCK KGAA	13	3	29	3,841		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	50	14	27	3,509		公益事業
SAP SE	65	19	180	23,331		ソフトウェア・サービス
E.ON SE	181	43	38	4,923		公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	10	2	24	3,163		家庭用品・パーソナル用品
PUMA AG	—	0.33	14	1,902		耐久消費財・アパレル
BAYER AG	56	18	131	16,948		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	8	3	30	3,976		家庭用品・パーソナル用品
BASF SE	60	17	120	15,591		素材
BEIERSDORF AG	10	2	24	3,207		家庭用品・パーソナル用品
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	14	5	36	4,666		ヘルスケア機器・サービス
ALLIANZ SE	30	8	155	20,105		保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	28	7	15	2,028		運輸
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	8	2	51	6,636		保険
VOLKSWAGEN AG	4	1	15	1,994		自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG PFD	12	3	49	6,441		自動車・自動車部品
DAIMLER AG	62	18	92	11,913		自動車・自動車部品
SIEMENS AG	51	14	149	19,308		資本財
LINDE AG	13	—	—	—		素材
DEUTSCHE BANK AG -REG	158	42	37	4,868		各種金融
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	25	7	52	6,830		自動車・自動車部品
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	227	62	92	11,918		電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	83	23	43	5,568		半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG	15	3	38	4,930		各種金融
WIRECARD AG	—	2	41	5,297		ソフトウェア・サービス
LANXESS	11	2	16	2,116		素材
MTU AERO ENGINES AG	—	1	25	3,320		資本財
SYMRISE AG	—	3	23	3,083		素材
BRENTAG AG	17	4	18	2,445		資本財
EVONIK INDUSTRIES AG	24	5	15	1,964		素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	—	35	12	1,585		電気通信サービス
HUGO BOSS AG -ORD	9	2	17	2,270		耐久消費財・アパレル
COMMERZBANK AG	101	27	24	3,103		銀行
VONOVIA SE	31	9	40	5,194		不動産

銘柄	株数	当期			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
PROSIEBENSATI MEDIA SE	28	8	14	1,849	メディア・娯楽	
METRO AG	25	8	11	1,538	食品・生活必需品小売り	
COVESTRO AG	—	3	22	2,877	素材	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,601	490	2,010	259,233	
		38	44	—	<3.1%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	106	28	40	5,253	保険	
INTESA SANPAOLO	1,044	328	65	8,490	銀行	
MEDIOBANCA SPA	83	26	21	2,713	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA	20	4	25	3,317	耐久消費財・アパレル	
ENEL SPA	607	175	78	10,143	公益事業	
ENI SPA	194	54	84	10,858	エネルギー	
TELECOM ITALIA-RNC	1,139	244	10	1,398	電気通信サービス	
ATLANTIA S.P.A	43	13	25	3,303	運輸	
TERNA SPA	163	43	20	2,705	公益事業	
MONCLER SPA	—	5	18	2,322	耐久消費財・アパレル	
UNICREDIT SPA	105	45	51	6,644	銀行	
PIRELLI & C SPA	—	19	12	1,569	自動車・自動車部品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,508	991	455	58,721	
		10	12	—	<0.7%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES	24	7	24	3,218	資本財	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	54	13	26	3,403	公益事業	
L'OREAL	13	4	96	12,488	家庭用品・パーソナル用品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	17	5	139	18,009	耐久消費財・アパレル	
THALES SA	11	2	29	3,867	資本財	
CAPGEMINI	14	3	34	4,438	ソフトウェア・サービス	
CASINO GUICHARD PERRACHON	11	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
LAGARDERE S. C. A	24	—	—	—	メディア・娯楽	
MICHELIN (CGDE)-B	11	3	35	4,520	自動車・自動車部品	
PERNOD-RICARD	11	3	56	7,308	食品・飲料・タバコ	
RENAULT SA	14	4	28	3,726	自動車・自動車部品	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	37	10	67	8,674	資本財	
VIVENDI SA	85	22	47	6,107	メディア・娯楽	
ORANGE	134	35	52	6,726	電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	3	0.56	27	3,576	耐久消費財・アパレル	
DASSAULT SYSTEMES SA	12	3	34	4,440	ソフトウェア・サービス	
KERING	5	1	57	7,352	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES	34	7	15	1,960	保険	
SANOFI	72	21	175	22,608	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ACCOR SA	22	5	21	2,730	消費者サービス	
SOCIETE GENERALE-A	57	14	49	6,408	銀行	
TELEPERFORMANCE	—	1	24	3,152	商業・専門サービス	
SODEXO	—	2	24	3,105	消費者サービス	
AXA	127	34	77	9,975	保険	
PEUGEOT SA	—	13	28	3,648	自動車・自動車部品	
ESSILORLUXOTTICA	13	3	45	5,874	ヘルスケア機器・サービス	
CREDIT AGRICOLE SA	100	26	30	3,891	銀行	
ZODIAC AEROSPACE	26	—	—	—	資本財	
BNP PARIBAS	79	21	100	12,968	銀行	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	32	10	32	4,186	資本財	
Wendel	4	1	13	1,749	各種金融	

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
Iliad SA		3	1	14	1,872	電気通信サービス
IMERYS SA		7	1	8	1,102	素材
SAFRAN SA		22	6	74	9,600	資本財
ENGIE		123	32	41	5,293	公益事業
ALSTOM		21	5	20	2,588	資本財
Eutelsat Communications		28	8	15	1,964	メディア・娯楽
ELECTRICITE DE FRANCE		58	18	29	3,767	公益事業
Legrand SA		19	6	35	4,632	資本財
TOTAL SA		148	45	230	29,749	エネルギー
Natixis		125	29	15	2,014	各種金融
UBISOFT ENTERTAINMENT		—	2	17	2,256	メディア・娯楽
SCOR SE		23	5	22	2,888	保険
VINCI S. A.		35	9	73	9,425	資本財
DANONE		39	11	76	9,924	食品・飲料・タバコ
AIR LIQUIDE		29	8	85	11,044	素材
Bureau Veritas SA		36	8	17	2,253	商業・専門サービス
GETLINK SE		71	15	18	2,354	運輸
SUEZ		51	13	17	2,312	公益事業
VALEO SA		23	8	21	2,722	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,929	527	2,232	287,888	
(ユーロ…オランダ)						
AIRBUS SE		42	11	107	13,870	資本財
RELX NV		61	—	—	—	商業・専門サービス
RANDSTAD NV		15	3	16	2,131	商業・専門サービス
AKZO NOBEL		14	4	33	4,330	素材
WOLTERS KLUWER		28	6	34	4,464	商業・専門サービス
Koninklijke Vopak NV		14	2	11	1,485	エネルギー
AEGON NV		206	48	27	3,506	保険
KONINKLIJKE KPN NV		350	97	23	3,012	電気通信サービス
STMICROELECTRONICS NV		59	17	23	2,993	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE PHILIPS NV		65	17	60	7,761	ヘルスケア機器・サービス
HEINEKEN NV		10	4	36	4,746	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV		13	3	27	3,595	食品・飲料・タバコ
KONINKLIJKE DSM NV		16	4	38	4,947	素材
UNILEVER NV-CVA		104	29	141	18,305	家庭用品・パーソナル用品
Koninklijke Boskalis Westminster NV		14	—	—	—	資本財
ASML HOLDING NV		25	7	118	15,331	半導体・半導体製造装置
GEMALTO		15	—	—	—	ソフトウェア・サービス
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		86	23	53	6,930	食品・生活必需品小売り
QIAGEN N V		29	6	21	2,822	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ING GROEP NV-CVA		278	79	90	11,630	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,454	372	867	111,864	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA		65	—	—	—	運輸
ENDESA SA		—	10	20	2,616	公益事業
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		492	139	68	8,816	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		46	10	23	3,049	公益事業
REPSOL SA		104	24	38	4,973	エネルギー
BANCO SANTANDER S. A		1,135	332	140	18,167	銀行
TELEFONICA SA		342	91	68	8,853	電気通信サービス

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…スペイン)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ENAGAS SA	—	7	18	2,414	エネルギー	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	—	7	24	3,136	資本財	
FERROVIAL SA	55	13	24	3,102	資本財	
MAPFRE S. A.	232	42	10	1,388	保険	
CaixaBank SA	—	88	32	4,205	銀行	
IBERDROLA SA	434	110	72	9,401	公益事業	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	35	8	58	7,549	ソフトウェア・サービス	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	136	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
FERROVIAL SA - RTS	—	13	0.55756	71	資本財	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	53	12	24	3,110	公益事業	
INDITEX	72	19	50	6,528	小売	
GRIFOLS SA	33	8	23	2,982	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 銘柄 数 < 比 率 >	3,240 14	940 17	700 —	90,366 < 1.1% >	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV	21	6	38	4,992	銀行	
UCB SA	15	3	26	3,424	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COLRUYT SA	3	2	12	1,633	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	10	2	19	2,480	各種金融	
AGEAS	23	5	23	2,995	保険	
UMICORE	—	5	23	2,972	素材	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	51	15	98	12,713	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	125 6	39 7	242 —	31,212 < 0.4% >	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG	18	4	21	2,770	エネルギー	
ERSTE GROUP BANK AG	30	7	27	3,514	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	48 2	11 2	48 —	6,285 < 0.1% >	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
TENARIS SA	59	14	18	2,397	エネルギー	
SES SA	45	10	19	2,483	メディア・娯楽	
ARCELORMITTAL	—	15	34	4,420	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	104 2	40 3	72 —	9,301 < 0.1% >	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA	17	13	20	2,611	資本財	
UPM-KYMMENE OYJ	49	11	30	3,935	素材	
STORA ENSO OYJ-R SHS	63	15	19	2,514	素材	
SAMPO OYJ-A SHS	14	7	32	4,224	保険	
ELISA OYJ	20	4	17	2,255	電気通信サービス	
NOKIA OYJ	470	100	52	6,711	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NESTE OYJ	16	3	22	2,914	エネルギー	
NOKIAN RENKAAT OYJ	19	4	12	1,608	自動車・自動車部品	
KONE OYJ-B	18	5	25	3,280	資本財	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	689 9	166 9	233 —	30,055 < 0.4% >	
(ユーロ…アイルランド)						
CRH PLC(DUBLIN)	58	18	47	6,098	素材	
KERRY GROUP PLC-A	14	3	34	4,502	食品・飲料・タバコ	

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…アイルランド)	百株	百株		千ユーロ	千円	
PADDY POWER BETFAIR PLC	—	2		20	2,579	消費者サービス
小計	株数・金額	73	24	102	13,180	
	銘柄数<比率>	2	3	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	303	80		25	3,237	公益事業
Galp Energia SGPS SA	62	13		19	2,488	エネルギー
JERONIMO MARTINS	41	11		12	1,579	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	407	105	56	7,305	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…その他)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	25	—		—	—	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	25	—	—	—	
	銘柄数<比率>	1	—	—	<—%>	
ユーロ計	株数・金額	13,208	3,710	7,020	905,414	
	銘柄数<比率>	153	164	—	<10.8%>	
(イギリス)				千英ポンド		
ASHTED GROUP PLC	49	13		25	3,690	資本財
BHP BILLITON PLC	162	43		69	10,222	素材
SKY PLC	95	—		—	—	メディア・娯楽
AVIVA PLC	171	71		31	4,571	保険
DIAGEO PLC	154	45		126	18,572	食品・飲料・タバコ
SCHRODERS PLC	19	4		12	1,898	各種金融
BAE SYSTEMS PLC	183	56		29	4,397	資本財
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	149	44		148	21,880	食品・飲料・タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	248	59		33	5,007	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	57	18		49	7,364	食品・飲料・タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	1,308	381		241	35,640	銀行
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	227	106		27	4,105	保険
MEGGITT PLC	121	31		16	2,366	資本財
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	305	73		18	2,706	食品・生活必需品小売り
Associated British Foods PLC	33	9		25	3,794	食品・飲料・タバコ
PRUDENTIAL PLC	173	46		74	10,948	保険
RIO TINTO PLC	90	24		93	13,844	素材
TRAVIS PERKINS PLC	35	15		16	2,409	資本財
SSE PLC	42	22		25	3,774	公益事業
BP PLC	1,276	375		196	28,969	エネルギー
LLOYDS BANKING GROUP PLC	4,850	1,383		82	12,228	銀行
TATE & LYLE PLC	70	—		—	—	食品・飲料・タバコ
TESCO PLC	630	178		39	5,765	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	81	18		25	3,735	ヘルスケア機器・サービス
GLAXOSMITHKLINE PLC	296	96		151	22,296	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WEIR GROUP PLC/THE	33	10		16	2,452	資本財
ASTRAZENECA PLC	82	24		150	22,241	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GKN PLC	222	—		—	—	自動車・自動車部品
BT GROUP PLC	495	159		40	5,977	電気通信サービス
CARNIVAL PLC	20	5		22	3,272	消費者サービス
MARKS & SPENCER GROUP PLC	161	60		18	2,779	小売
BARCLAYS PLC	1,245	339		60	8,844	銀行
INTERTEK GROUP PLC	16	4		20	3,002	商業・専門サービス
BURBERRY GROUP PLC	40	9		17	2,517	耐久消費財・アパレル
NEXT PLC	14	4		21	3,213	小売
KINGFISHER PLC	227	68		17	2,588	小売

銘柄	株数	期 末				業 種 等
		株 数	評 価 額		業 種 等	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
ITV PLC	431	109	16	2,435	メディア・娯楽	
SAINSBURY (J) PLC	213	55	17	2,614	食品・生活必需品小売り	
RANDGOLD RESOURCES LTD	10	2	16	2,447	素材	
G4S PLC	216	58	10	1,577	商業・専門サービス	
ADMIRAL GROUP PLC	33	6	12	1,849	保険	
CENTRICA PLC	559	174	26	3,979	公益事業	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	275	85	207	30,538	エネルギー	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	261	73	182	26,832	エネルギー	
BUNZL PLC	37	10	24	3,605	資本財	
London Stock Exchange Group PLC	29	6	27	4,098	各種金融	
UNILEVER PLC	80	22	93	13,830	家庭用品・パーソナル用品	
EXPERIAN PLC	52	17	31	4,710	商業・専門サービス	
SEVERN TRENT PLC	30	7	15	2,288	公益事業	
Whitbread PLC	20	5	23	3,438	消費者サービス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	42	9	17	2,615	各種金融	
SMITHS GROUP PLC	52	14	19	2,915	資本財	
ANGLO AMERICAN PLC	—	23	40	5,925	素材	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	39	12	80	11,791	家庭用品・パーソナル用品	
RELX PLC	52	34	53	7,830	商業・専門サービス	
SHIRE PLC	61	17	81	12,039	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
Fresnillo PLC	40	9	8	1,256	素材	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	92	—	—	—	公益事業	
GLENCORE PLC	897	234	71	10,518	素材	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	116	31	25	3,734	資本財	
OLD MUTUAL PLC	533	—	—	—	保険	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROU	353	123	30	4,566	銀行	
SAGE GROUP PLC/THE	114	33	18	2,712	ソフトウェア・サービス	
WPP PLC	86	29	24	3,673	メディア・娯楽	
COMPASS GROUP PLC	100	28	43	6,413	消費者サービス	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	19	5	20	3,092	消費者サービス	
NATIONAL GRID PLC	156	61	52	7,712	公益事業	
ROYAL MAIL PLC	54	40	14	2,071	運輸	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-	131	34	11	1,700	消費者サービス	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	—	71	19	2,838	各種金融	
FERGUSON PLC	22	—	—	—	資本財	
FERGUSON PLC	—	5	26	3,840	資本財	
IMI PLC	43	—	—	—	資本財	
VODAFONE GROUP PLC	1,537	503	72	10,687	電気通信サービス	
RSA INSURANCE GROUP PLC	134	32	17	2,586	保険	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	271	—	—	—	各種金融	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	124	42	13	2,015	保険	
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	114	19	2,869	資本財	
JOHNSON MATTHEY PLC	23	6	17	2,645	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額	20,756	5,963	3,456	509,383	
	銘柄 数 < 比 率 >	75	71	—	<6.1%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SIKA AG-BR	0.2	—	—	—	—	素材
SGS SA	0.54	0.13	30	3,404	商業・専門サービス	
SWISSCOM AG-REG	2	0.65	30	3,407	電気通信サービス	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.01	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
GIVAUDAN-REG	0.69	0.18	43	4,905	素材	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	8	2	88	10,006	保険	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
NOVARTIS AG-REG SHS	143	43	386	43,760	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABB LTD	135	36	74	8,492	資本財
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	44	13	349	39,573	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LAFARGEHOLCIM LTD	33	10	49	5,628	素材
NESTLE SA-REGISTERED	198	60	519	58,842	食品・飲料・タバコ
SONOVA HOLDING AG	6	1	24	2,776	ヘルスケア機器・サービス
CREDIT SUISSE GROUP AG	174	56	73	8,318	各種金融
THE SWATCH GROUP AG-B	3	0.92	29	3,359	耐久消費財・アパレル
LONZA GROUP AG-REG	6	1	54	6,154	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SWISS LIFE HOLDING AG	3	0.88	34	3,897	保険
Schindler Holding AG	4	1	23	2,693	資本財
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	6	1	23	2,607	運輸
GEBERIT AG-REG	3	0.92	35	4,017	資本財
JULIUS BAER GROUP LTD	23	6	31	3,580	各種金融
SWISS RE AG	16	6	56	6,384	保険
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	32	9	68	7,772	耐久消費財・アパレル
SIKA AG-REG	—	3	45	5,112	素材
UBS GROUP AG	258	81	115	13,038	各種金融
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,107 23	342 22	2,187 —	247,733 < 3.0% >
(スウェーデン)			千スウェーデンクローネ		
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	80	25	242	3,045	銀行
Swedbank AB	39	16	336	4,222	銀行
SWEDISH MATCH AB	23	3	174	2,189	食品・飲料・タバコ
NORDEA BANK AB	193	—	—	—	銀行
SECURITAS AB-B SHS	50	13	207	2,595	商業・専門サービス
INVESTOR AB-B SHS	13	8	319	4,006	各種金融
HENNES & MAURITZ AB-B	54	19	313	3,926	小売
ERICSSON LM-B SHS	260	54	449	5,634	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELIA COMPANY AB	138	76	323	4,060	電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	41	12	180	2,257	資本財
LUNDIN PETROLEUM AB	29	5	152	1,910	エネルギー
ALFA LAVAL AB	36	7	173	2,175	資本財
GETINGE AB-B SHS	39	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
Millicom International Cellular SA	11	3	171	2,154	電気通信サービス
Husqvarna AB	—	18	129	1,618	耐久消費財・アパレル
SKF AB-B SHARES	48	11	166	2,082	資本財
VOLVO AB-B SHS	113	27	378	4,743	資本財
SANDVIK AB	85	21	299	3,752	資本財
Industrivarden AB	25	7	138	1,734	各種金融
Boliden AB	30	—	—	—	素材
HEXAGON AB-B SHS	—	5	250	3,142	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TELE2 AB-B SHS	57	14	150	1,885	電気通信サービス
KINNEVIK AB-B	22	7	179	2,245	各種金融
ATLAS COPCO AB-A SHS	—	8	195	2,453	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	—	10	222	2,790	資本財
BOLIDEN AB	—	7	160	2,011	素材
EPIROC AB-A	—	16	122	1,538	資本財
EPIROC AB-B	—	18	131	1,644	資本財
ESSITY AKTIEBOLAG-B	51	13	282	3,548	家庭用品・パーソナル用品
ATLAS COPCO AB-A SHS	30	—	—	—	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	36	—	—	—	資本財

銘柄	株数	当 期			業 種 等	
		株 数	価 値			
			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		
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	77	24	247	3,101	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	47	15	272	3,411	資本財	
NORDEA BANK ABP	—	54	438	5,493	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,637	532	6,808	85,378	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	29	—	< 1.0% >	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ			
DNB ASA	76	17	273	3,693	銀行	
TELENOR ASA	69	19	306	4,139	電気通信サービス	
EQUINOR ASA	79	22	475	6,425	エネルギー	
YARA INTERNATIONAL ASA	20	5	208	2,811	素材	
NORSK HYDRO ASA	143	40	171	2,321	素材	
ORKLA ASA	82	25	187	2,534	食品・飲料・タバコ	
小 計	株 数 ・ 金 額	472	131	1,624	21,925	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 0.3% >	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG AS-B	10	3	223	3,857	食品・飲料・タバコ	
A. P. MOLLER MAERSK	0.66	0.23	199	3,444	運輸	
A P Moller - Maersk A/S	0.38	0.04	32	560	運輸	
DANSKE BANK A/S	56	15	230	3,980	銀行	
TDC A/S	147	—	—	—	電気通信サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	—	3	169	2,931	資本財	
H LUNDBECK A/S	—	2	78	1,351	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DSV A/S	18	3	164	2,852	運輸	
PANDORA A/S	12	2	103	1,782	耐久消費財・アパレル	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	11	2	177	3,068	素材	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	22	5	191	3,310	素材	
COLOPLAST-B	14	2	189	3,274	ヘルスケア機器・サービス	
NOVO NORDISK A/S-B	122	33	982	16,982	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ORSTED A/S	—	3	173	2,991	公益事業	
WILLIAM DEMANT HOLDING	25	4	92	1,601	ヘルスケア機器・サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	441	84	3,006	51,989	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	14	—	< 0.6% >	
(オーストラリア)			千豪ドル			
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	195	51	139	11,504	銀行	
AMCOR LTD	120	31	43	3,551	素材	
WESTPAC BANKING CORPORATION	219	61	169	13,943	銀行	
TELSTRA CORP LTD	413	110	33	2,774	電気通信サービス	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	75	26	27	2,240	食品・飲料・タバコ	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	22	5	34	2,834	各種金融	
BHP BILLITON LTD	233	63	212	17,526	素材	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	28	8	23	1,969	エネルギー	
COMPUTERSHARE LIMITED	59	13	26	2,214	ソフトウェア・サービス	
CSL LIMITED	29	8	166	13,706	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TRANSURBAN GROUP	152	42	48	4,011	運輸	
COCHLEAR LIMITED	6	1	30	2,478	ヘルスケア機器・サービス	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	113	31	222	18,297	銀行	
RIO TINTO LIMITED	35	8	70	5,822	素材	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	247	67	48	4,006	保険	
ORICA LTD	46	14	26	2,217	素材	
LENDLEASE GROUP	63	20	29	2,426	不動産	
SUNCORP GROUP LTD	124	31	44	3,663	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	176	48	121	9,970	銀行	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円		
NEWCREST MINING LIMITED	79	20	43	3,599	素材	
INCITEC PIVOT LTD	230	56	23	1,963	素材	
AMP LIMITED	293	94	25	2,080	各種金融	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	141	31	36	3,017	保険	
SANTOS LTD	234	40	25	2,129	エネルギー	
SONIC HEALTHCARE LTD	44	12	28	2,346	ヘルスケア機器・サービス	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	102	62	28	2,363	消費者サービス	
WESFARMERS LIMITED	47	20	96	7,905	食品・生活必需品小売り	
ALUMINA LTD	333	117	29	2,411	素材	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	29	14	50	4,123	エネルギー	
WOOLWORTHS GROUP LTD	53	23	69	5,682	食品・生活必需品小売り	
BRAMBLES LTD	158	38	40	3,350	商業・専門サービス	
MACQUARIE GROUP LTD	19	6	80	6,613	各種金融	
CROWN RESORTS LIMITED	52	13	16	1,348	消費者サービス	
SYDNEY AIRPORT	131	37	24	2,040	運輸	
AGL ENERGY LTD	66	13	24	2,045	公益事業	
SOUTH32 LTD	532	117	41	3,429	素材	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	4,917 36	1,372 36	2,206 —	181,612 < 2.2% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
CONTACT ENERGY LTD	86	—	—	—	公益事業	
FLETCHER BUILDING LTD	111	—	—	—	素材	
SPARK NEW ZEALAND LTD	250	68	27	2,146	電気通信サービス	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	81	35	25	1,938	運輸	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	530 4	103 2	53 —	4,085 < 0.0% >	
(香港)			千香港ドル			
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	46	15	112	1,635	半導体・半導体製造装置	
BANK OF EAST ASIA	178	46	119	1,731	銀行	
CLP HOLDINGS LIMITED	45	35	299	4,364	公益事業	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	75	24	531	7,731	各種金融	
LI & FUNG LTD	600	360	59	864	耐久消費財・アパレル	
MTR CORPORATION	185	45	172	2,507	運輸	
HANG SENG BANK	39	16	284	4,141	銀行	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	141	49	183	2,669	不動産	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	130	40	209	3,043	公益事業	
HONG KONG & CHINA GAS	777	184	273	3,984	公益事業	
HYSAN DEVELOPMENT CO	130	30	112	1,634	不動産	
Galaxy Entertainment Group Limited	220	60	257	3,745	消費者サービス	
KERRY PROPERTIES LTD	135	—	—	—	不動産	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	315	100	290	4,226	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	345	95	147	2,148	資本財	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	165	45	103	1,499	耐久消費財・アパレル	
NEW WORLD DEVELOPMENT	740	—	—	—	不動産	
SINO LAND CO	478	118	146	2,128	不動産	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	90	40	424	6,169	不動産	
SWIRE PACIFIC LTD A	75	20	166	2,422	不動産	
AIA GROUP LTD	808	242	1,516	22,059	保険	
Sands China Ltd	248	64	202	2,951	消費者サービス	
SWIRE PROPERTIES LTD	232	50	140	2,040	不動産	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	148	58	460	6,698	資本財	
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	80	25	143	2,089	公益事業	

銘柄	株数	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	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
CK ASSET HOLDINGS LIMITED		193	58	310	4,515	不動産
小 計	株 数 ・ 金 額	6,619	1,820	6,667	97,005	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	24	—	< 1.2% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		230	65	22	1,863	資本財
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		1,960	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DBS GROUP HOLDINGS LTD		100	33	78	6,472	銀行
CITY DEVELOPMENTS		70	20	16	1,396	不動産
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		10	—	—	—	小売
CAPITALAND LIMITED		330	—	—	—	不動産
GENTING SINGAPORE LTD		960	—	—	—	消費者サービス
COMFORTDELGRO CORP LTD		240	110	23	1,981	運輸
SINGAPORE AIRLINES LTD		90	30	28	2,359	運輸
UNITED OVERSEAS BANK		70	24	59	4,889	銀行
UNITED OVERSEAS LAND LTD		100	30	18	1,556	不動産
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		200	70	18	1,532	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		227	137	42	3,508	電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		280	—	—	—	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		140	65	74	6,154	銀行
KEPPEL CORP LTD		176	56	34	2,868	資本財
GENTING SINGAPORE LTD		—	220	20	1,726	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	5,183	860	439	36,310	
	銘柄 数 < 比 率 >	16	12	—	< 0.4% >	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
BANK HAPOALIM BM		125	30	81	2,515	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		174	51	126	3,910	銀行
BEZEQ ISRAELI TELECOM CORP		364	—	—	—	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD		94	35	83	2,597	素材
NICE LTD		8	2	106	3,302	ソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	767	119	397	12,325	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	4	—	< 0.1% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	78,327	21,542	—	7,746,059	
	銘柄 数 < 比 率 >	868	931	—	< 92.4% >	

(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		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	3	0.865	138	15,783	0.2	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.807	0.257	46	5,344	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	1	0.31	38	4,389	0.1	
CROWN CASTLE INTL CORP	2	0.796	88	10,055	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	0.407	45	5,129	0.1	
DUKE REALTY CORP	4	1	28	3,256	0.0	
EQUINIX INC	0.605	0.157	60	6,886	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	2	0.704	47	5,412	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1	0.342	31	3,536	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.816	0.212	27	3,107	0.0	
HCP INC	4	1	33	3,819	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	7	1	23	2,728	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	2	0.806	26	3,009	0.0	
KIMCO REALTY CORP	5	1	26	3,012	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	1	0.511	22	2,564	0.0	
PROLOGIS INC	3	1	82	9,392	0.1	
PUBLIC STORAGE	0.956	0.28	57	6,583	0.1	
REALTY INCOME CORP	2	0.692	43	4,948	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	1	0.429	27	3,189	0.0	
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	0.227	38	4,435	0.1	
SL GREEN REALTY CORP	1	0.265	25	2,868	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	2	0.612	115	13,157	0.2	
UDR INC	3	0.693	28	3,224	0.0	
VENTAS INC	2	0.692	41	4,736	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	1	0.422	29	3,368	0.0	
WELLTOWER INC	2	0.719	49	5,692	0.1	
WEYERHAEUSER CO	4	1	41	4,707	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	67	18	1,266	144,340	
	銘 柄 数 < 比 率 >	26	27	—	< 1.7% >	
(カナダ)			千カナダドル			
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	0.252	0.776	19	1,652	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	0.252	0.776	19	1,652	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
KLEPIERRE	2	0.619	19	2,474	0.0	
GECINA SA	0.621	0.14	18	2,375	0.0	
COVIVIO	0.684	0.157	14	1,814	0.0	
UNIBAIL-RODAMCO SE	0.52	—	—	—	—	
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	—	0.251	40	5,237	0.1	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	4	1	92	11,901	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	

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	%	
BRITISH LAND CO PLC	12	2	16	2,407	0.0	
HAMMERSON PLC	12	2	11	1,730	0.0	
INTU PROPERTIES PLC	17	—	—	—	—	
SEGRO PLC	12	3	19	2,825	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	7	2	19	2,828	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	62	10	66	9,791	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	4	—	<0.1%>	
(オーストラリア)			千豪ドル			
MIRVAC GROUP	43	12	26	2,217	0.0	
GPT GROUP	19	4	25	2,092	0.0	
STOCKLAND	25	7	27	2,300	0.0	
GOODMAN GROUP	19	4	50	4,193	0.1	
SCENTRE GROUP	51	14	58	4,799	0.1	
WESTFIELD CORP	19	—	—	—	—	
小 計	口 数 ・ 金 額	178	44	189	15,604	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	5	—	<0.2%>	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	14	4	324	4,714	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	14	4	324	4,714	
	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	13	10	21	1,759	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	13	10	21	1,759	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	340	89	—	189,765	
	銘 柄 数 < 比 率 >	44	43	—	<2.3%>	

(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	百万円	百万円
株式先物取引	269	—
S&P 500 EMIN	74	—
DJ EU STX 50	83	—
FTSE 100 IDX	—	—

(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

(2018年11月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	7,746,059	92.2
投資証券	189,765	2.3
コール・ローン等、その他	465,303	5.5
投資信託財産総額	8,401,127	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産 (8,356,576千円) の投資信託財産総額 (8,401,127千円) 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=113.94円、1カナダドル=86.34円、1ユーロ=128.96円、1英ポンド=147.39円、1スイスフラン=113.27円、1スウェーデンクローネ=12.54円、1ノルウェークローネ=13.50円、1デンマーククローネ=17.29円、1豪ドル=82.29円、1ニュージーランドドル=76.74円、1香港ドル=14.55円、1シンガポールドル=82.62円、1イスラエルシェケル=30.97円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年11月12日現在)

項 目	当期末 円
(A) 資産	8,414,825,316
コール・ローン等	344,090,581
株式(評価額)	7,746,059,951
投資証券(評価額)	189,765,855
未収入金	20,501,876
未収配当金	9,310,404
差入委託証拠金	105,096,649
(B) 負債	35,921,664
未払金	19,879,720
未払解約金	16,041,843
未払利息	101
(C) 純資産総額(A-B)	8,378,903,652
元本	3,424,850,935
次期繰越損益金	4,954,052,717
(D) 受益権総口数	3,424,850,935口
1万円当たり基準価額(C/D)	24,465円

(注) 当親ファンドの期首元本額は12,593,720,222円、期中追加設定元本額は2,438,508,796円、期中一部解約元本額は11,607,378,083円です。

<元本の内訳>

東京海上セレクション・外国株式インデックス	2,761,205,920円
TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>	318,294,706円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	120,803,664円
TMA外国株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	112,155,962円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	42,033,842円
L P S 4資産分散ファンド(積極型)	23,593,198円
L P S 4資産分散ファンド(成長重視型)	16,368,416円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	13,156,643円
L P S 4資産分散ファンド(バランス型)	11,698,689円
L P S 4資産分散ファンド(安定重視型)	3,648,965円
L P S 4資産分散ファンド(慎重型)	1,890,930円

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

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

## ○損益の状況 (2017年11月11日～2018年11月12日)

項 目	当 期 円
(A) 配当等収益	331,634,865
受取配当金	320,489,313
受取利息	3,138,737
その他収益金	8,128,087
支払利息	△ 121,272
(B) 有価証券売買損益	432,485,127
売買益	1,977,068,743
売買損	△ 1,544,583,616
(C) 先物取引等取引損益	144,627,393
取引益	249,938,774
取引損	△ 105,311,381
(D) 保管費用等	△ 18,870,056
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	889,877,329
(F) 前期繰越損益金	16,954,151,994
(G) 追加信託差損益金	3,377,339,168
(H) 解約差損益金	△16,267,315,774
(I) 計(E+F+G+H)	4,954,052,717
次期繰越損益金(I)	4,954,052,717

(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13期 (決算日 2018年11月12日)

(計算期間 2017年11月11日~2018年11月12日)

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

## 東京海上アセットマネジメント

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

## ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比	券 率	純 資 産 額
	騰 落	中 率	騰 落	中 率			
9期(2014年11月10日)	円 15,505	% 19.1	266.839	% 19.2	% 98.2		百万円 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
12期(2017年11月10日)	15,662	11.5	269.321	10.8	98.6		46,126
13期(2018年11月12日)	15,274	△2.5	262.755	△2.4	98.9		4,169

## ○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) 2017年11月10日	円 15,662	% -	269.321	% -		% 98.6
11月末	15,611	△0.3	268.466	△0.3		98.8
12月末	15,807	0.9	271.833	0.9		97.9
2018年1月末	15,417	△1.6	265.105	△1.6		97.6
2月末	15,022	△4.1	258.350	△4.1		97.0
3月末	15,119	△3.5	260.098	△3.4		96.3
4月末	15,308	△2.3	263.226	△2.3		94.2
5月末	14,914	△4.8	256.485	△4.8		98.0
6月末	15,137	△3.4	260.301	△3.3		94.9
7月末	15,251	△2.6	262.225	△2.6		96.7
8月末	15,233	△2.7	262.080	△2.7		93.6
9月末	15,489	△1.1	266.515	△1.0		96.1
10月末	15,205	△2.9	261.651	△2.8		98.3
(期 末) 2018年11月12日	15,274	△2.5	262.755	△2.4		98.9

(注) 騰落率は期首比です。

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

## ○運用経過

(2017年11月11日～2018年11月12日)

## ■期中の基準価額等の推移

期首：15,662円

期末：15,274円

騰落率：△2.5%

## ◇基準価額の主な変動要因

## プラス要因

- ・保有する債券の利息収入

## マイナス要因

- ・経済成長への期待を背景とした米国債利回りの上昇（債券価格の下落）
- ・イタリアの財政問題などによる円高ユーロ安の進行

## ■投資環境

## 【外国債券市場動向】

米国債利回りは上昇しました。期初、堅調な米国経済指標を背景に米国債利回りは上昇しました。2018年2月には利上げペースの加速懸念などを背景として米国株式市場が急落すると、投資家のリスク回避姿勢が強まり、米国債利回りは一時的に低下しましたが、米国株式市場の回復と共に上昇しました。2018年5月末にイタリアの財政問題に対する危機感から米国債利回りが低下する局面もありましたが、2018年9月には引き続き堅調な米国経済指標を背景に利上げ観測が一段と高まり、利回りは上昇基調で推移し、期を終えました。

ドイツ国債利回りはおおむね横ばいとなりました。期前半は、IFO景況感指数などの経済指標が堅調となるなど、米国債利回りの動きと同様に上昇基調で推移しました。しかし、2018年5月にイタリアの財政問題に対する懸念が高まったことから、退避先資産としてドイツ国債が買われ、ドイツ国債利回りは低下しました。2018年夏以降もイタリアの財政問題が引き続き懸念材料となったことから、ドイツ国債利回りは期初と同水準で期を終えました。

## 【外国為替市場動向】

米ドル円相場はおおむね横ばい、ユーロ円相場は円高ユーロ安で期を終えました。

期初、米ドル円相場は堅調な米国経済指標を背景に円安米ドル高となりましたが、2018年1月にムニューシン米財務長官が米ドル安を容認する姿勢を示したことや2018年2月に米国株式市場が急落したことなどから、3月まで円高米ドル安基調で推移しました。その後4月頃から堅調な米国経済が改めて評価されて円安米ドル高が進行し、期初と同水準で期を終えました。

ユーロ円相場は、期初、ユーロ圏の経済指標が堅調となったことなどを背景に円安ユーロ高となりましたが、その後は、イタリアの財政問題など不透明な欧州の政治情勢に対する懸念が高まったことからユーロ安が進行し、前期末対比円高ユーロ安で期を終えました。

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークは、期首(2017年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、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)です。

## ■ポートフォリオについて

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

以上の運用の結果、基準価額は2.5%下落しました。

## ■当ファンドのベンチマークとの差異

当期、ベンチマークの騰落率△2.4%に対して、基準価額の騰落率は△2.5%となり、ベンチマークにほぼ連動する値動きとなりました。

(主な変動要因)

### プラス要因

・保有債券の時価評価の違いなどのテクニカル要因

### マイナス要因

・取引などのコスト

また、ベンチマークからの乖離度合いを表すトラッキングエラー<sup>(※)</sup>は、10月末現在、推定値で0.08%となっています。

※2018年10月末のポートフォリオのデータを基にベンチマークとの乖離を推計しています。ベンチマークとの連動が高いほどこの値は低くなります。

## ○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに対する高い連動率を維持するよう運用を行う方針です。

## ○1万口当たりの費用明細

(2017年11月11日～2018年11月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 4	% 0.024	(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 ）	(4)	(0.024)	*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	4	0.024	
期中の平均基準価額は、15,292円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

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



## ○組入資産の明細

(2018年11月12日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期		期 末		残存期間別組入比率			
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	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
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	17,250	16,626	1,894,417	45.4	—	18.6	19.6	7.3
カナダ	千カナダドル	千カナダドル						
	900	928	80,135	1.9	—	0.7	0.6	0.6
メキシコ	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
	6,300	6,001	34,027	0.8	—	0.5	0.2	0.1
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	1,900	2,241	289,064	6.9	—	3.7	2.3	1.0
イタリア	2,600	2,810	362,450	8.7	—	5.1	2.6	0.9
フランス	2,700	3,235	417,268	10.0	—	6.7	2.7	0.7
オランダ	500	647	83,529	2.0	—	1.3	0.7	—
スペイン	1,600	1,896	244,614	5.9	—	3.8	1.4	0.7
ベルギー	600	727	93,848	2.3	—	1.9	0.4	—
オーストリア	400	500	64,525	1.5	—	1.2	0.3	—
フィンランド	200	222	28,720	0.7	—	0.2	—	—
アイルランド	200	208	26,867	0.6	—	0.3	—	0.3
イギリス	千英ポンド	千英ポンド						
	1,590	1,860	274,279	6.6	—	4.8	1.4	0.4
スウェーデン	千スウェーデンクローネ	千スウェーデンクローネ						
	1,000	1,119	14,033	0.3	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
	900	918	12,400	0.3	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
	1,300	1,589	27,479	0.7	—	0.4	0.2	—
ポーランド	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
	800	804	24,197	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千豪ドル	千豪ドル						
	1,000	1,055	86,857	2.1	—	1.2	0.7	0.2
シンガポール	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
	200	215	17,791	0.4	—	0.4	—	—
マレーシア	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
	800	805	21,939	0.5	—	0.3	0.2	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
	3,600	3,222	25,587	0.6	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	4,124,035	98.9	—	52.7	33.9	12.3

(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
	%	千米ドル	千米ドル	千円
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) 国債証券		千米ドル	千米ドル	千円
T 1 1/2 07/15/20	1.5	200	195	22,261
T 1 1/8 08/31/21	1.125	300	285	32,472
T 1 1/8 12/31/19	1.125	800	785	89,442
T 1 3/4 01/31/23	1.75	100	94	10,811
T 1 3/4 02/28/22	1.75	400	384	43,781
T 1 3/4 05/15/22	1.75	400	383	43,660
T 1 3/4 05/15/23	1.75	500	472	53,876
T 1 3/4 09/30/22	1.75	200	190	21,718
T 1 3/4 12/31/20	1.75	500	487	55,568
T 1 3/8 02/29/20	1.375	400	392	44,714
T 1 3/8 03/31/20	1.375	400	391	44,650
T 1 3/8 09/30/20	1.375	500	485	55,354
T 1 5/8 02/15/26	1.625	200	180	20,553
T 1 5/8 05/15/26	1.625	300	269	30,721
T 1 5/8 08/15/22	1.625	500	475	54,148
T 1 5/8 11/30/20	1.625	400	389	44,379
T 1 7/8 11/30/21	1.875	400	387	44,105
T 2 02/15/22	2.0	500	484	55,203
T 2 02/15/23	2.0	300	287	32,763
T 2 02/15/25	2.0	200	187	21,356
T 2 08/15/25	2.0	800	745	84,913
T 2 1/2 02/15/46	2.5	100	84	9,578
T 2 1/2 05/15/24	2.5	500	485	55,309
T 2 1/2 08/15/23	2.5	300	292	33,343
T 2 1/4 03/31/21	2.25	300	295	33,618
T 2 1/4 04/30/21	2.25	200	196	22,399
T 2 1/4 07/31/21	2.25	300	294	33,522
T 2 1/4 08/15/46	2.25	300	238	27,137
T 2 1/4 11/15/24	2.25	500	476	54,312
T 2 1/4 11/15/27	2.25	300	278	31,690
T 2 1/8 05/15/25	2.125	300	282	32,189
T 2 1/8 08/15/21	2.125	400	390	44,539
T 2 11/15/21	2.0	300	291	33,209
T 2 11/30/20	2.0	100	98	11,177
T 2 3/4 02/15/28	2.75	400	385	43,973
T 2 3/4 11/15/23	2.75	600	591	67,413
T 2 3/4 11/15/42	2.75	200	178	20,393
T 2 3/8 08/15/24	2.375	100	96	10,964
T 2 5/8 07/15/21	2.625	100	99	11,287
T 2 5/8 11/15/20	2.625	500	496	56,609
T 2 7/8 08/15/28	2.875	100	97	11,089
T 3 02/15/47	3.0	400	371	42,332
T 3 02/15/48	3.0	100	92	10,552

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千米ドル	千米ドル	千円
		外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) 国債証券		千米ドル	千米ドル	千円
T 3 08/15/48	3.0	100	92	10,553
T 3 1 2/5 05/15/20	3.5	400	403	45,974
T 3 1/8 02/15/43	3.125	100	95	10,889
T 3 1/8 05/15/21	3.125	100	100	11,434
T 3 1/8 05/15/48	3.125	100	94	10,818
T 3 1/8 08/15/44	3.125	300	286	32,619
T 3 1/8 11/15/41	3.125	100	95	10,935
T 3 11/15/45	3.0	400	372	42,414
T 3 5/8 02/15/21	3.625	300	304	34,676
T 3 5/8 02/15/44	3.625	100	103	11,844
T 3 5/8 08/15/43	3.625	200	207	23,671
T 3 7/8 08/15/40	3.875	100	107	12,301
T 4 1/4 11/15/40	4.25	100	113	12,962
T 4 3/8 11/15/39	4.375	100	115	13,165
T 5 05/15/37	5.0	50	61	7,050
小 計				1,894,417
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル	
CAN 1 1/2 06/01/23	1.5	100	96	8,290
CAN 2 1/2 06/01/24	2.5	100	100	8,650
CAN 2 3/4 06/01/22	2.75	100	101	8,729
CAN 2 3/4 12/01/48	2.75	100	104	9,026
CAN 3 1/2 06/01/20	3.5	300	305	26,377
CAN 3 1/2 12/01/45	3.5	100	118	10,239
CAN 3 1/4 06/01/21	3.25	100	102	8,821
小 計				80,135
(メキシコ) 国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ	
MBONO 10 11/20/36	10.0	200	217	1,234
MBONO 10 12/05/24	10.0	600	636	3,610
MBONO 5 3/4 03/05/26	5.75	400	336	1,906
MBONO 6 1/2 06/09/22	6.5	600	560	3,179
MBONO 6 1/2 06/10/21	6.5	800	759	4,308
MBONO 7 1/2 06/03/27	7.5	600	551	3,128
MBONO 7 3/4 05/29/31	7.75	300	272	1,545
MBONO 7 3/4 11/13/42	7.75	400	349	1,980
MBONO 7 3/4 11/23/34	7.75	200	178	1,014
MBONO 8 06/11/20	8.0	1,100	1,090	6,184
MBONO 8 1/2 05/31/29	8.5	200	194	1,103
MBONO 8 1/2 11/18/38	8.5	300	284	1,615
MBONO 8 11/07/47	8.0	200	178	1,010
MBONO 8 12/07/23	8.0	400	388	2,204
小 計				34,027

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…ドイツ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
DBR 0 1/2 02/15/26	0.5	100	102	13,261	2026/2/15
DBR 0 1/4 08/15/28	0.25	100	98	12,698	2028/8/15
DBR 1 08/15/24	1.0	100	106	13,693	2024/8/15
DBR 1 08/15/25	1.0	100	106	13,726	2025/8/15
DBR 1 1/2 02/15/23	1.5	100	107	13,890	2023/2/15
DBR 1 1/2 09/04/22	1.5	100	107	13,819	2022/9/4
DBR 1 3/4 07/04/22	1.75	100	107	13,909	2022/7/4
DBR 2 01/04/22	2.0	100	107	13,902	2022/1/4
DBR 2 1/2 08/15/46	2.5	100	136	17,542	2046/8/15
DBR 3 07/04/20	3.0	100	106	13,674	2020/7/4
DBR 3 1/4 01/04/20	3.25	100	104	13,488	2020/1/4
DBR 4 01/04/37	4.0	100	154	19,903	2037/1/4
DBR 4 3/4 07/04/34	4.75	100	160	20,657	2034/7/4
DBR 4 3/4 07/04/40	4.75	100	176	22,816	2040/7/4
DBR 6.5 07/04/27	6.5	100	153	19,820	2027/7/4
OBL 0 04/09/21	—	200	202	26,137	2021/4/9
OBL 0 1/4 10/16/20	0.25	100	101	13,111	2020/10/16
OBL 0 10/13/23	—	100	100	13,009	2023/10/13
(ユーロ…イタリア) 国債証券					
BTPS 0.65 11/01/20	0.65	300	296	38,294	2020/11/1
BTPS 1 1/2 06/01/25	1.5	100	91	11,830	2025/6/1
BTPS 1.35 04/15/22	1.35	100	97	12,592	2022/4/15
BTPS 1.65 03/01/32	1.65	100	81	10,490	2032/3/1
BTPS 2 12/01/25	2.0	100	93	12,104	2025/12/1
BTPS 2.15 12/15/21	2.15	100	100	13,013	2021/12/15
BTPS 3 3/4 08/01/21	3.75	100	105	13,545	2021/8/1
BTPS 3 3/4 09/01/24	3.75	100	104	13,534	2024/9/1
BTPS 4 02/01/37	4.0	100	104	13,432	2037/2/1
BTPS 4 1/2 03/01/24	4.5	100	108	14,005	2024/3/1
BTPS 4 1/2 05/01/23	4.5	100	108	14,001	2023/5/1
BTPS 4 3/4 08/01/23	4.75	100	109	14,183	2023/8/1
BTPS 4 3/4 09/01/21	4.75	100	107	13,905	2021/9/1
BTPS 4 3/4 09/01/28	4.75	100	111	14,439	2028/9/1
BTPS 5 08/01/34	5.0	100	115	14,930	2034/8/1
BTPS 5 08/01/39	5.0	100	115	14,866	2039/8/1
BTPS 5 09/01/40	5.0	100	115	14,831	2040/9/1
BTPS 5 1/2 11/01/22	5.5	200	223	28,827	2022/11/1
BTPS 5 3/4 02/01/33	5.75	100	123	15,867	2033/2/1
BTPS 5.25 11/01/29	5.25	100	116	15,014	2029/11/1
BTPS 6 05/01/31	6.0	100	124	16,072	2031/5/1
BTPS 6 1/2 11/01/27	6.5	100	124	16,059	2027/11/1
BTPS 7 1/4 11/01/26	7.25	100	128	16,606	2026/11/1

銘柄	当 期 末				
	利率	額面金額	外貨建金額	評価額 邦貨換算金額	償還年月日
(ユーロ…フランス) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
FRTR 0 02/25/21	—	100	100	13,005	2021/2/25
FRTR 0 03/25/23	—	100	100	12,919	2023/3/25
FRTR 0 3/4 11/25/28	0.75	100	99	12,834	2028/11/25
FRTR 1 1/2 05/25/31	1.5	100	105	13,651	2031/5/25
FRTR 1 1/4 05/25/36	1.25	100	99	12,787	2036/5/25
FRTR 1 11/25/25	1.0	100	104	13,464	2025/11/25
FRTR 1 3/4 05/25/23	1.75	100	108	13,954	2023/5/25
FRTR 1 3/4 11/25/24	1.75	200	218	28,208	2024/11/25
FRTR 2 1/2 05/25/30	2.5	100	117	15,132	2030/5/25
FRTR 2 1/4 10/25/22	2.25	200	219	28,257	2022/10/25
FRTR 2 3/4 10/25/27	2.75	100	118	15,302	2027/10/25
FRTR 3 1/2 04/25/20	3.5	200	211	27,311	2020/4/25
FRTR 3 1/2 04/25/26	3.5	200	246	31,734	2026/4/25
FRTR 3 1/4 05/25/45	3.25	100	136	17,584	2045/5/25
FRTR 3 1/4 10/25/21	3.25	100	110	14,269	2021/10/25
FRTR 3 3/4 04/25/21	3.75	100	110	14,216	2021/4/25
FRTR 4 10/25/38	4.0	100	146	18,935	2038/10/25
FRTR 4 3/4 04/25/35	4.75	100	153	19,812	2035/4/25
FRTR 4.25 10/23	4.25	100	121	15,618	2023/10/25
FRTR 5 1/2 04/25/29	5.5	100	147	19,025	2029/4/25
FRTR 5 3/4 10/25/32	5.75	100	161	20,815	2032/10/25
FRTR 6 10/25/25	6.0	100	139	17,933	2025/10/25
FRTR4.5 04/25/41	4.5	100	158	20,494	2041/4/25
(ユーロ…オランダ) 国債証券					
NETHER 0 01/15/22	—	100	101	13,052	2022/1/15
NETHER 2 07/15/24	2.0	100	111	14,341	2024/7/15
NETHER 3 3/4 01/15/42	3.75	100	157	20,262	2042/1/15
NETHER 5 1/2 01/15/28	5.5	100	145	18,784	2028/1/15
NETHER 7 1/2 01/15/23	7.5	100	132	17,088	2023/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
SPGB 0.05 01/31/21	0.05	100	100	12,927	2021/1/31
SPGB 1.45 10/31/27	1.45	100	99	12,872	2027/10/31
SPGB 1.95 04/30/26	1.95	100	105	13,571	2026/4/30
SPGB 2 3/4 10/31/24	2.75	100	110	14,306	2024/10/31
SPGB 2.15 10/31/25	2.15	100	106	13,789	2025/10/31
SPGB 4 04/30/20	4.0	100	106	13,708	2020/4/30
SPGB 4.2 01/31/37	4.2	100	129	16,675	2037/1/31
SPGB 4.4 10/31/23	4.4	100	118	15,252	2023/10/31
SPGB 4.65 07/30/25	4.65	100	123	15,912	2025/7/30
SPGB 4.7 07/30/41	4.7	100	139	17,939	2041/7/30
SPGB 4.85 10/31/20	4.85	100	109	14,158	2020/10/31
SPGB 4.9 07/30/40	4.9	100	141	18,309	2040/7/30

銘柄	当 期 末					
	利率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
	%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
<b>(ユーロ…スペイン)</b> 国債証券						
SPGB 5 1/2 04/30/21	5.5	100	113	14,658	2021/4/30	
SPGB 5.15 10/31/28	5.15	100	132	17,084	2028/10/31	
SPGB 5.85 01/31/22	5.85	100	118	15,239	2022/1/31	
SPGB 6 01/31/29	6.0	100	141	18,207	2029/1/31	
<b>(ユーロ…ベルギー)</b> 国債証券						
BGB 1 06/22/26	1.0	100	103	13,339	2026/6/22	
BGB 1.6 06/22/47	1.6	100	96	12,413	2047/6/22	
BGB 2.6 06/22/24	2.6	100	113	14,633	2024/6/22	
BGB 4 1/4 09/28/22	4.25	100	117	15,112	2022/9/28	
BGB 5 03/28/35	5.0	100	154	19,881	2035/3/28	
BGB 5 1/2 03/28/28	5.5	100	143	18,467	2028/3/28	
<b>(ユーロ…オーストリア)</b> 国債証券						
RAGB 0 09/20/22	-	100	100	13,009	2022/9/20	
RAGB 0 3/4 02/20/28	0.75	100	101	13,054	2028/2/20	
RAGB 4.15 03/37	4.15	100	149	19,271	2037/3/15	
RAGB 6 1/4 07/15/27	6.25	100	148	19,189	2027/7/15	
<b>(ユーロ…フィンランド)</b> 国債証券						
RFBG 0 1/2 09/15/28	0.5	100	97	12,627	2028/9/15	
RFBG 4 07/04/25	4.0	100	124	16,092	2025/7/4	
<b>(ユーロ…アイルランド)</b> 国債証券						
IRISH 1.3 05/15/33	1.3	100	97	12,596	2033/5/15	
IRISH 5 10/18/20	5.0	100	110	14,270	2020/10/18	
ユ ー ロ 計				1,610,889		
<b>(イギリス)</b> 国債証券						
UKT 1 04/22/24	1.0	100	99	14,611	2024/4/22	
UKT 1 1/2 07/22/26	1.5	100	101	14,957	2026/7/22	
UKT 1 1/2 07/22/47	1.5	100	90	13,320	2047/7/22	
UKT 1 1/4 07/22/27	1.25	100	98	14,554	2027/7/22	
UKT 1 3/4 09/07/22	1.75	100	102	15,166	2022/9/7	
UKT 1 5/8 10/22/28	1.625	100	101	14,906	2028/10/22	
UKT 2 09/07/25	2.0	100	105	15,498	2025/9/7	
UKT 2 1/4 09/07/23	2.25	100	105	15,551	2023/9/7	
UKT 3 1/2 01/22/45	3.5	100	131	19,349	2045/1/22	
UKT 3 1/2 07/22/68	3.5	100	153	22,633	2068/7/22	
UKT 3 1/4 01/22/44	3.25	100	129	19,089	2044/1/22	
UKT 3 3/4 07/22/52	3.75	100	146	21,524	2052/7/22	
UKT 3 3/4 09/07/20	3.75	100	105	15,524	2020/9/7	
UKT 4 01/22/60	4.0	100	161	23,841	2060/1/22	
UKT 4 1/4 12/07/27	4.25	30	37	5,506	2027/12/7	
UKT 6 12/07/28	6.0	10	14	2,103	2028/12/7	

銘柄	当 期 末					
	利率	額面金額	評 価 額	外貨建金額	邦貨換算金額	償還年月日
	%	千英ポンド	千英ポンド	千円		
<b>(イギリス)</b> 国債証券						
UKT 8 06/07/21	8.0	150	177	26,138	2021/6/7	
小 計				274,279		
<b>(スウェーデン)</b> 国債証券						
SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	0.75	100	100	1,265	2028/5/12	
SGB 1 1/2 11/13/23	1.5	200	213	2,680	2023/11/13	
SGB 1 11/12/26 #1059	1.0	100	104	1,304	2026/11/12	
SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	2.5	100	114	1,430	2025/5/12	
SGB 3 1/2 03/30/39	3.5	100	138	1,735	2039/3/30	
SGB 3 1/2 06/01/22	3.5	200	225	2,830	2022/6/1	
SGB 5 12/01/20	5.0	200	222	2,787	2020/12/1	
小 計				14,033		
<b>(ノルウェー)</b> 国債証券						
NGB 1 1/2 02/19/26	1.5	100	97	1,317	2026/2/19	
NGB 1 3/4 02/17/27	1.75	100	98	1,331	2027/2/17	
NGB 1 3/4 03/13/25	1.75	100	99	1,347	2025/3/13	
NGB 2 04/26/28	2.0	100	100	1,350	2028/4/26	
NGB 2 05/24/23	2.0	200	203	2,749	2023/5/24	
NGB 3 03/14/24	3.0	100	106	1,439	2024/3/14	
NGB 3 3/4 05/25/21	3.75	200	212	2,863	2021/5/25	
小 計				12,400		
<b>(デンマーク)</b> 国債証券						
DGB 0 1/2 11/15/27	0.5	200	202	3,498	2027/11/15	
DGB 0 1/4 11/15/20	0.25	100	101	1,758	2020/11/15	
DGB 1 1/2 11/15/23	1.5	100	108	1,871	2023/11/15	
DGB 1 3/4 11/15/25	1.75	200	222	3,851	2025/11/15	
DGB 3 11/15/21	3.0	400	441	7,638	2021/11/15	
DGB 4 1/2 11/15/39	4.5	300	512	8,861	2039/11/15	
小 計				27,479		
<b>(ポーランド)</b> 国債証券						
POLGB 0 07/25/20	-	100	97	2,939	2020/7/25	
POLGB 1 3/4 07/25/21	1.75	200	199	6,003	2021/7/25	
POLGB 2 1/2 01/25/23	2.5	100	100	3,016	2023/1/25	
POLGB 2 1/2 07/25/26	2.5	100	96	2,896	2026/7/25	
POLGB 2 1/2 07/25/27	2.5	100	95	2,865	2027/7/25	
POLGB 3 1/4 07/25/25	3.25	100	102	3,078	2025/7/25	
POLGB 5 3/4 09/23/22	5.75	100	112	3,397	2022/9/23	
小 計				24,197		
<b>(オーストラリア)</b> 国債証券						
ACGB 2 3/4 04/21/24	2.75	100	101	8,359	2024/4/21	
ACGB 2 3/4 11/21/27	2.75	100	100	8,253	2027/11/21	

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額	千円	
(オーストラリア) 国債証券	%	千豪ドル	千豪ドル	千円	
ACGB 3 03/21/47	3.0	100	95	7,847	2047/3/21
ACGB 3 1/4 04/21/25	3.25	100	104	8,587	2025/4/21
ACGB 3 1/4 04/21/29	3.25	100	104	8,593	2029/4/21
ACGB 4 1/2 04/20	4.5	100	103	8,514	2020/4/15
ACGB 4 1/4 04/21/26	4.25	100	111	9,142	2026/4/21
ACGB 5 1/2 04/21/23	5.5	100	113	9,339	2023/4/21
ACGB 5 3/4 05/15/21	5.75	100	108	8,959	2021/5/15
ACGB 5 3/4 07/15/22	5.75	100	112	9,259	2022/7/15
小 計				86,857	
(シンガポール) 国債証券		シンガポールドル	シンガポールドル		
SIGB 3 1/2 03/01/27	3.5	200	215	17,791	2027/3/1
小 計				17,791	
(マレーシア) 国債証券		マレーシアリンギット	マレーシアリンギット		
MGS 3.48 03/15/23	3.48	100	98	2,683	2023/3/15
MGS 3.492 03/31/20	3.492	100	99	2,722	2020/3/31
MGS 3.502 05/31/27	3.502	100	95	2,597	2027/5/31
MGS 3.882 03/10/22	3.882	100	100	2,736	2022/3/10
MGS 4.16 07/15/21	4.16	100	101	2,755	2021/7/15
MGS 4.181 07/15/24	4.181	100	100	2,741	2024/7/15
MGS 4.392 04/15/26	4.392	100	101	2,759	2026/4/15
MGS 5.248 09/28	5.248	100	108	2,943	2028/9/15
小 計				21,939	

銘柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額 外貨建金額 邦貨換算金額	千円	
(南アフリカ) 国債証券	%	種アフリカランド	種アフリカランド	千円	
SAGB 10 1/2 12/21/26	10.5	500	535	4,250	2026/12/21
SAGB 6 1/2 02/28/41	6.5	200	137	1,092	2041/2/28
SAGB 6 1/4 03/31/36	6.25	200	140	1,114	2036/3/31
SAGB 6 3/4 03/31/21	6.75	100	97	778	2021/3/31
SAGB 7 02/28/31	7.0	300	242	1,923	2031/2/28
SAGB 7 1/4 01/15/20	7.25	100	100	798	2020/1/15
SAGB 7 3/4 02/28/23	7.75	200	194	1,546	2023/2/28
SAGB 8 01/31/30 #2030	8.0	300	266	2,117	2030/1/31
SAGB 8 1/2 01/31/37 #203	8.5	300	262	2,086	2037/1/31
SAGB 8 1/4 03/31/32 #203	8.25	200	177	1,405	2032/3/31
SAGB 8 3/4 01/31/44	8.75	300	264	2,097	2044/1/31
SAGB 8 3/4 02/28/48	8.75	500	439	3,490	2048/2/28
SAGB 8 7/8 02/28/35 #203	8.875	200	183	1,453	2035/2/28
SAGB 9 01/31/40 #2040	9.0	200	180	1,431	2040/1/31
小 計				25,587	
合 計				4,124,035	

(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

(2018年11月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 4,124,035	% 98.4
コール・ローン等、その他	68,962	1.6
投資信託財産総額	4,192,997	100.0

(注) 当期末における外貨建純資産 (4,165,027千円) の投資信託財産総額 (4,192,997千円) に対する比率は99.3%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値で邦貨換算したものです。なお、当期末における邦貨換算レートは1米ドル=113.94円、1カナダドル=86.34円、1メキシコペソ=5.67円、1ユーロ=128.96円、1英ポンド=147.39円、1スウェーデンクローネ=12.54円、1ノルウェークローネ=13.50円、1デンマーククローネ=17.29円、1ポーランドズロチ=30.07円、1豪ドル=82.29円、1シンガポールドル=82.62円、1マレーシアリンギット=27.24円、1南アフリカランド=7.94円です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年11月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,192,997,686
コール・ローン等	31,583,442
公社債(評価額)	4,124,035,854
未収利息	32,543,825
前払費用	4,834,565
(B) 負債	23,642,388
未払解約金	23,642,315
未払利息	73
(C) 純資産総額(A-B)	4,169,355,298
元本	2,729,690,547
次期繰越損益金	1,439,664,751
(D) 受益権総口数	2,729,690,547口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,274円

(注) 当親ファンドの期首元本額は29,451,990,787円、期中追加設定元本額は2,011,134,999円、期中一部解約元本額は28,733,435,239円です。

<元本の内訳>

東京海上セレクション・外国債券インデックス	1,401,759,720円
TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>	890,655,979円
TMA外国債券インデックスVA<適格機関投資家限定>	196,165,188円
東京海上・世界インデックス・バランス60<適格機関投資家限定>	94,599,759円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	39,065,917円
L P S 4資産分散ファンド(バランス型)	27,182,189円
東京海上・世界インデックス・バランス40<適格機関投資家限定>	24,720,692円
L P S 4資産分散ファンド(成長重視型)	20,739,173円
L P S 4資産分散ファンド(積極型)	15,653,459円
L P S 4資産分散ファンド(安定重視型)	11,821,870円
L P S 4資産分散ファンド(慎重型)	7,326,601円

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

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

## ○損益の状況 (2017年11月11日～2018年11月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	524,857,389
受取利息	525,001,857
支払利息	△ 144,468
(B) 有価証券売買損益	△ 1,294,821,550
売買益	325,609,797
売買損	△ 1,620,431,347
(C) 保管費用等	△ 4,581,606
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 774,545,767
(E) 前期繰越損益金	16,674,358,919
(F) 追加信託差損益金	1,079,935,756
(G) 解約差損益金	△ 15,540,084,157
(H) 計(D+E+F+G)	1,439,664,751
次期繰越損益金(H)	1,439,664,751

(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。

## ○お知らせ

2018年2月21日付で、シティ債券インデックスのブランド変更に伴いベンチマークの名称を変更するため、所要の約款変更を行いました。

当ファンドの運用の基本方針、運用体制等については、一切変更ありません。