

日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）

償還 運用報告書（全体版）

第20期（償還）（償還日 2017年8月15日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）」は、信託約款の規定に基づき、2017年8月15日に信託期間が終了し、償還いたしました。
ここに、設定以来の運用状況と償還内容をご報告いたしますとともに、受益者のみなさまのご愛顧に對しまして、重ねてお礼申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／株式	
信託期間	2007年10月31日から2017年8月15日までです。	
運用方針	主として株式を投資対象とする投資信託証券（投資信託または外国投資信託の受益証券（振替投資信託受益権を含みます。）および投資法人または外国投資法人の投資証券をいいます。）の一部またはすべてに投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行います。	
主要運用対象	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	投資信託証券を主要投資対象とします。
	日本株式インデックスTOP1Xマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	新興国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）	投資信託証券、短期社債等、コマーシャル・ペーパーおよび指定金銭信託以外の有価証券への直接投資は行ないません。 外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	日本株式インデックスTOP1Xマザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。 ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行なわないこともあります。	

<952613>

日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号
<http://www.nikkoam.com/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

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

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 込 分	配 金	期 騰 落 中 率				
	円 銭	円		%	%	%	%	百万円
16期(2015年8月17日)	10,371	110		6.8	97.0	1.2	1.0	77
17期(2016年2月15日)	8,033	40		△22.2	95.3	2.2	1.1	27
18期(2016年8月15日)	8,468	60		6.2	96.7	1.5	1.1	10
19期(2017年2月15日)	9,950	70		18.3	96.8	1.4	1.0	11
(償還時)	(償還価額)							
20期(2017年8月15日)	10,620.68	—		6.7	—	—	—	12

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(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おります。

(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おります。

(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おります。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) ファンドの商品性格に適合する適切なベンチマークおよび参考指数はございません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
		騰 落	率			
(期 首)	円 銭		%	%	%	%
2017年2月15日	9,950	—		96.8	1.4	1.0
2月末	9,842	△1.1		96.7	1.7	1.0
3月末	9,894	△0.6		96.3	2.0	1.0
4月末	9,984	0.3		96.3	1.8	1.0
5月末	10,201	2.5		96.3	2.1	1.0
6月末	10,412	4.6		96.1	2.3	1.0
7月末	10,536	5.9		96.7	1.9	1.0
(償還時)	(償還価額)					
2017年8月15日	10,620.68		6.7	—	—	—

(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おります。

(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おります。

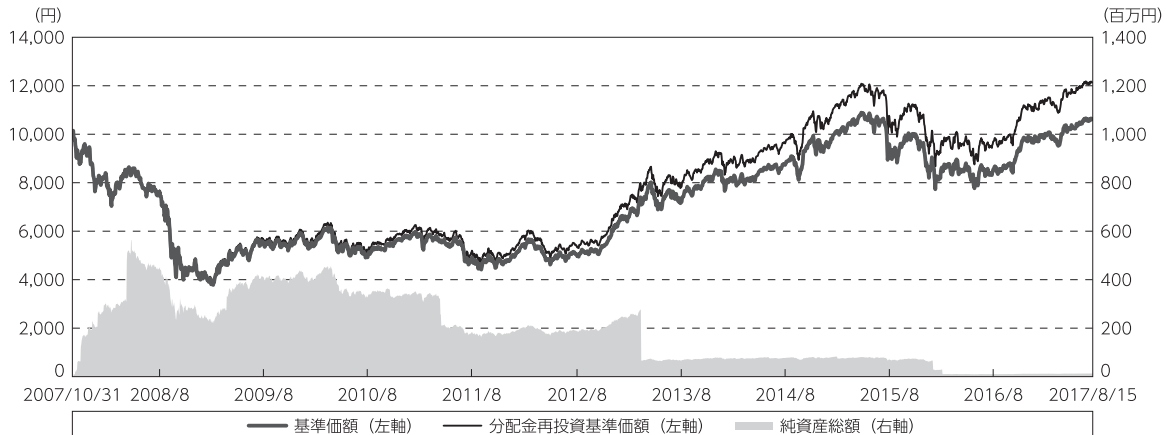
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2007年10月31日～2017年8月15日)

設定以来の基準価額等の推移



設 定 日：10,000円

期末(償還日)：10,620円68銭(既払分配金(税込み)：935円)

騰 落 率： 21.4% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、投資信託証券(マザーファンド)を通じて新興国を含む世界の株式に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっていました。信託期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・世界的に量的緩和を含む金融緩和策の強化と継続がなされたこと。
- ・景気対策への期待や、円安の進行を受けた輸出関連企業の業績回復への期待、好調な内容の経済指標の発表、2020年夏季オリンピックの東京開催の決定などを受けて日本国内景気の回復への期待が高まったこと(2012年11月～期間末)。
- ・米国において市場予想を上回る経済指標の発表などを受けて景気回復への期待が高まったこと(2011年10月中旬～2015年4月中旬)や、米国大統領選挙後に新政権の減税や財政支出拡大による景気刺激策が経済成長を加速させるとの期待が強まったこと(2015年8月中旬～期間末)。

- ・日銀による金融緩和策の拡大や、米国連邦準備制度理事会（ＦＲＢ）による利上げ観測などを背景に、円安／アメリカドル高、円安／ユーロ高が進行したこと（2012年後半～期間末）。

<値下がり要因>

- ・米国「サブプライムローン」（低所得者層を対象とした住宅融資）問題による信用不安が拡大したこと（期間の初め～2009年3月上旬）や、欧州債務問題の深刻化（2009年9月～2012年10月）を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。
- ・原油価格の下落を受けた産油国経済の先行き不透明感が強まったこと（2011年10月中旬～2015年4月中旬）。
- ・英国が欧州連合（ＥＵ）離脱を選択したこと（2015年8月中旬～期間末）。
- ・投資家によるリスク回避の円買い需要などを背景に、円高／アメリカドル安、円高／ユーロ安が進行したこと（期間の初め～2012年前半）や、投資対象である新興国の通貨が対円で総じて下落したこと。

投資環境

（国内株式市況）

国内株式市場では、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、期間の初めとほぼ同水準で、期間末を迎えました。

期間の初めは、米国「サブプライムローン」問題の拡大懸念が高まり、世界的に株価が下落し、ＴＯＰＩＸも水準を切り下げました。その後も、円高／アメリカドル安の進行、原油価格の高値更新などから、景気減速や企業業績の悪化懸念が高まり、ＴＯＰＩＸは下げ幅を広げました。また、2008年9月には米国の投資銀行が破たんし、金融不安が世界的に拡大したことから、世界的な株安連鎖が起こりました。2009年3月から8月にかけては、金融不安の後退や政府の追加経済対策への期待、円安への修正などからＴＯＰＩＸは反発し、日本および米国で景気や企業業績の底入れ観測が広がると、ＴＯＰＩＸは上昇幅を拡大しました。ただし、その後は、主要企業の相つぐ増資発表や円高の進行、中東や北アフリカ情勢の緊迫化、欧州債務問題の深刻化など不透明要因が重なり、ＴＯＰＩＸは狭いレンジ内での動きに終止しました。9月から2012年10月にかけては、東日本大震災によるサプライチェーン（供給網）の寸断、タイの洪水による海外生産拠点の長期に亘る生産停止などを受け、日本経済の先行き不透明感が強まりました。また、欧州債務問題が深刻化し、逃避需要から円がアメリカドルに対して戦後最高値を更新するなど円高が進行したこともあり、企業業績の悪化懸念が強まり、ＴＯＰＩＸは軟調な推移が続きました。11月から2013年5月中旬にかけては、衆議院議員総選挙における自由民主党の圧倒的な勝利を受けて誕生した新政府による景気対策への期待や、日銀による大規模な追加金融緩和の決定、円安の進行を受けた輸出関連企業の業績回復への期待などから、ＴＯＰＩＸは大幅に上昇しました。5月下旬から6月中旬にかけては、ＦＲＢによる量的金融緩和の早期縮小懸念などを受けた世界的な株価の急落などを背景に、ＴＯＰＩＸは下落しました。その後、12月にかけては、好調な内容の経済指標の発表や、2020年夏季オリンピックの東京開催の決定などを受けて国内景気の回復への期待が高まったことなどから、ＴＯＰＩＸは上昇しました。2014年1月から10月中旬にかけては、中国や欧州などの景気減速懸念や、ウクライナや中東における地政学的リスクの高まりなどが株価の下落要因となった一方で、政府による新たな成長戦略への期待や、米国の景況感の改善などが株価の上昇要因となり、ＴＯＰＩＸはもみ合いで推移しました。10月下旬から2015年7月にかけては、日銀による追加金融緩和策の決定や、円安の大幅な進行などを背景とした輸出関連企業の収益向上への期待などから、ＴＯＰＩＸは上昇しました。8月から2016年6月にかけては、中国の成長鈍化や原油などの資源価格の下落を背景とする世界的な景気減速への懸念や、英国のＥＵ離脱の決定による世界経済や金融市場への影響が懸念されたこと、円高／アメリカドル安への動きなどから、ＴＯＰＩＸは下落しました。7月から期間末にかけては、参議院選挙における与党の勝利を受けて追加経済対

策の実施に期待が高まったことや、米国新政権による政策への期待などを受けて円安／アメリカドル高となったことなどが支援材料となり、ＴＯＰＩＸは上昇しました。

（先進国株式市況）

海外先進国の株式市場では、期間の初めと比べて、米国と欧州各国市場の株価はまちまちの動きとなりました。

期間の初めから2009年3月上旬にかけては、欧米の中央銀行による大幅な利下げや資金供給拡大が実施されたものの、米国「サブプライムローン」問題による信用不安が拡大したことや、米国金融機関の経営破たんをきっかけとする金融不安などを背景に、世界的に株価が急落しました。3月中旬から2011年10月上旬にかけては、欧米で積極的な金融緩和および景気支援策が実施されたことや、米国などの主要経済指標の改善傾向を背景とした景気回復への期待の高まり、欧米主要企業に業績回復傾向が見られたことなどから、株価は総じて上昇に転じました。10月中旬から2015年8月上旬にかけては、ギリシャの財政問題に端を発した欧州債務問題の深刻化を背景に株価が下落する局面があったものの、米国や中国における堅調な内容の経済指標の発表を受けて景気回復への期待が強まったことや、欧州中央銀行（ＥＣＢ）による債務比率の高い国の国債購入計画などの政策対応を好感した欧州債務問題の収束期待の高まり、米国や欧州、日本における量的緩和を含む金融緩和策の強化と継続などを受けて、株価は総じて上昇しました。8月中旬から期間末にかけては、中国の市場予想を下回る内容の経済指標の発表を契機とした世界経済の成長鈍化懸念および中国市場の株価の急落、米国の利上げ、英国のＥＵ離脱選択などを受けて株価が下落する局面があったものの、ＥＣＢによる量的金融緩和策の強化観測や、中国における金融緩和姿勢の強化、米国大統領選挙後に新政権の減税や財政支出拡大による景気刺激策が経済成長を加速させるとの期待が強まったこと、フランス大統領選挙の結果を受けてＥＵの混乱が回避されるとの期待が高まったことなどから、株価は総じて上昇に転じました。

（新興国株式市況）

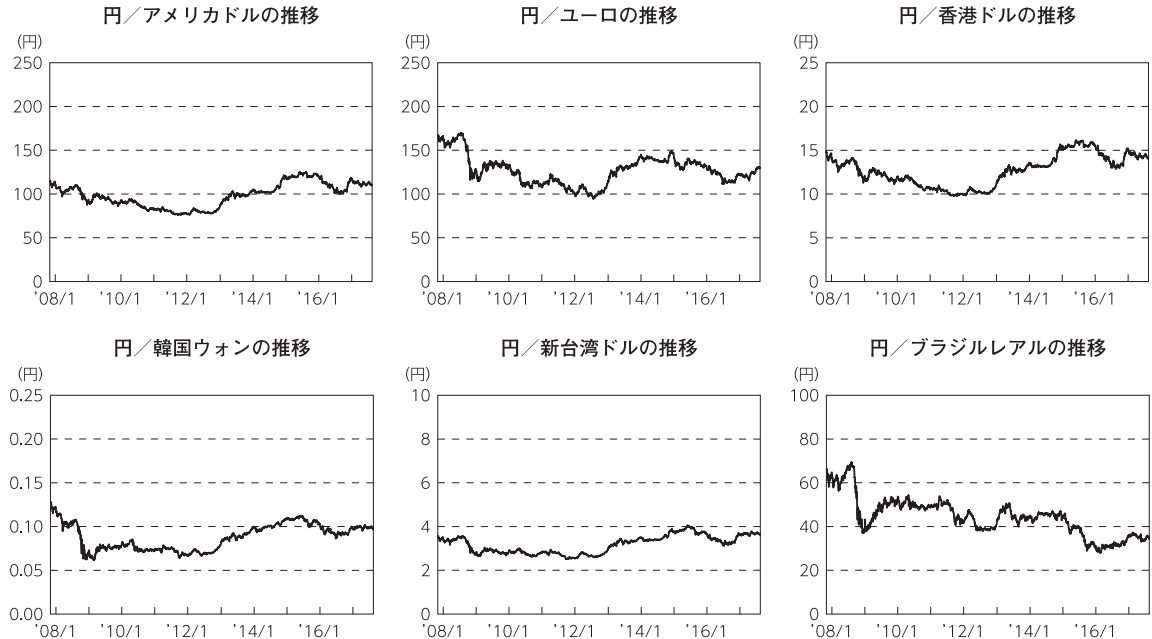
新興国株式市場では、期間の初めと比べて、新興国各国の株価は概して上昇しました。

期間の初めから2009年3月上旬にかけては、世界経済の減速傾向が強まるなか、米国金融機関の経営破たんから端を発した金融不安の拡大および世界同時株安の流れから、新興国各国の株価は総じて下落する展開となりました。その後は、米国および中国の景気対策への期待や利下げ観測などが支援材料となる一方、米国の景気低迷や東欧圏を火種とする欧州での金融不安の拡大などが嫌気され、新興国各国の株価は一進一退で推移しました。3月中旬から2010年11月上旬にかけては、欧州の財政不安の落ち着きや、米国および中国の景況感改善を受けた景気底入れへの期待、商品需要の回復見通しなどを受け、新興国各国の株価は総じて上昇しました。11月中旬から2011年10月上旬にかけては、米国の景況感の悪化などを背景とする世界的な景気後退懸念や、欧州の債務問題の深刻化による投資家のリスク回避姿勢の強まりなどから、新興国各国の株価は総じて下落しました。10月中旬から2015年4月中旬にかけては、中国の景気減速懸念や、米国の量的金融緩和の縮小、原油価格の下落を受けた産油国経済の先行き不透明感などの要因から、株価が軟調となる局面があったものの、新興国各国における金融緩和策の進展や、米国における市場予想を上回る経済指標の発表などをを受けた景気回復への期待の高まり、中国政府による景気刺激策への期待などから、新興国各国の株価は総じて上昇しました。4月下旬から2016年1月中旬にかけては、米国における政策金利の引き上げ懸念や、原油などの資源価格の下落、中国における中国人民元安の進行などを背景とする景気減速懸念の強まり、中東諸国間の関係悪化などによる投資家のリスク回避姿勢などから、新興国各国の株価は総じて下落しました。1月下旬から期間末にかけては、主要な産油国による原油の増産凍結への動きなどを契機とした原油価格の下げ止まりやそれを受けた産油国経済の回復への期待、一部の先進国や新興国の中央銀行による金融緩和継続への期待の高まり、フランス大統領選挙の結果を受けてＥＵの結束が強まると期待されたことなどが支援材料となり、新興国各

国の株価は総じて上昇しました。

（為替市況）

信託期間中における主要通貨（対円）は、下記の推移となりました。



当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

当ファンドは、主として、国内および海外の株式を投資対象とする投資信託証券に分散投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行ないました。信託期間中の資産配分比率は、日興グローバルラップ株式会社の投資助言をもとに決定し、投資信託証券の合計組入比率を高位に保ちました。

当ファンドは2007年10月31日の設定以来、約9年9ヵ月にわたり運用してまいりました。このたび、約款の規定に基づき、信託終了日を2017年8月15日として償還いたしました。

これまでのみなさまのご愛顧に対しまして、心より厚くお礼申し上げますとともに、今後とも弊社投資信託をご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

（日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド）

ベンチマークである「東証株価指数」との連動をめざし、「バーラ日本株式モデル」に基づいて構築したポートフォリオによる運用を行ないました。また、一定期間ごとにポートフォリオの見直しなどを行ない、現物株

式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持しました。

（海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド）

ベンチマークである「MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）」に連動する投資成果をめざし、リスクコントロールモデルにより構築した現物株式ポートフォリオへの投資を継続するとともに、現物株式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持して運用を行ないました。また、外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、高位の外貨エクスポージャーを維持しました。

（海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド）

ベンチマークである「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース）」に連動する投資成果をめざし、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した現物株式ポートフォリオへの投資を継続するとともに、現物株式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持して運用を行ないました。また、外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、高位の外貨エクスポージャーを維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方針に対し、適切に比較できる指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を設定しておりません。

分配金

信託期間中における分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案して決定し、1万口当たりの累計は935円（税込み）となりました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたしました。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年 2 月16日～2017年 8 月15日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 43	% 0.428	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(22)	(0.214)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(19)	(0.187)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.027)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	1	0.006	(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
（ 株 式 ）	(1)	(0.005)	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
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数
（ 株 式 ）	(0)	(0.001)	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
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	7	0.068	(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 ）	(2)	(0.019)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ 印 刷 費 用 ）	(5)	(0.047)	印刷費用は、法定開示資料の印刷に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.001)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	51	0.503	
期中の平均基準価額は、10,144円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2017年2月16日～2017年8月15日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	15	20	3,974	5,683
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	48	100	1,885	4,216
海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド	—	—	1,666	2,936

○株式売買比率

(2017年2月16日～2017年8月15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		
	日本株式 インデックスＴＯＰＩＸ マザーファンド	海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI（ヘッジなし） マザーファンド	海外新興国株式インデックス MSCIエマージング（ヘッジなし） マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,930,676千円	2,450,517千円	998,713千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	26,528,831千円	74,895,380千円	11,219,941千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	0.03	0.08

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2017年2月16日～2017年8月15日)

利害関係人の発行する有価証券等

<日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産）>

該当事項はございません。

<日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	1	1	95

<海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド>

該当事項はございません。

<海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド>

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2017年2月16日～2017年8月15日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況（2017年2月16日～2017年8月15日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細（2017年8月15日現在）

2017年8月15日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
日本株式インデックスT O P I Xマザーファンド			千口 3,958
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド			1,837
海外新興国株式インデックスMSCIエマージング（ヘッジなし）マザーファンド			1,666

○投資信託財産の構成

(2017年8月15日現在)

項 目	債 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	12,808	100.0
投資信託財産総額	12,808	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2017年8月15日現在)

項 目	債 還 時
	円
(A) 資産	12,808,155
コール・ローン等	12,808,155
(B) 負債	63,334
未払信託報酬	52,269
未払利息	10
その他未払費用	11,055
(C) 純資産総額(A－B)	12,744,821
元本	12,000,000
償還差益金	744,821
(D) 受益権総口数	12,000,000口
1万口当たり償還価額(C／D)	10,620円68銭

(注) 当ファンドの期首元本額は12,000,000円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は0円です。

(注) 1口当たり純資産額は1.062068円です。

○損益の状況 (2017年2月16日～2017年8月15日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 20
支払利息	△ 20
(B) 有価証券売買損益	863,435
売買益	864,213
売買損	△ 778
(C) 信託報酬等	△ 58,180
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	805,235
(E) 前期繰越損益金	3,483,655
(F) 追加信託差損益金	△3,544,069
(配当等相当額)	(26,718)
(売買損益相当額)	(△3,570,787)
償還差益金(D＋E＋F)	744,821

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

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

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○投資信託財産運用総括表

信 託 期 間	投資信託契約締結日	2007年10月31日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2017年 8 月15日		資 産 総 額	12,808,155円
区 分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負 債 総 額	63,334円
				純 資 産 総 額	12,744,821円
受益権口数	1,000,000口	12,000,000口	11,000,000口	受 益 権 口 数	12,000,000口
元 本 額	1,000,000円	12,000,000円	11,000,000円	1 万口当たり償還金	10,620円68銭
毎計算期末の状況					
計 算 期	元 本 額	純資産総額	基準価額	1 万口当たり分配金	
				金 額	分 配 率
第 1 期	324,043,725円	265,563,072円	8,195円	5円	0.05%
第 2 期	589,771,820	452,050,887	7,665	50	0.50
第 3 期	587,521,005	243,996,382	4,153	30	0.30
第 4 期	743,976,574	406,539,243	5,464	50	0.50
第 5 期	739,315,065	393,544,066	5,323	40	0.40
第 6 期	663,514,158	336,956,737	5,078	40	0.40
第 7 期	586,017,436	346,399,633	5,911	40	0.40
第 8 期	373,447,880	180,643,673	4,837	40	0.40
第 9 期	373,148,203	193,745,554	5,192	40	0.40
第10期	374,404,813	189,353,205	5,057	40	0.40
第11期	374,173,417	242,657,508	6,485	50	0.50
第12期	92,600,525	68,774,667	7,427	50	0.50
第13期	92,360,476	73,950,176	8,007	50	0.50
第14期	87,773,467	75,249,175	8,573	60	0.60
第15期	81,657,521	80,139,248	9,814	70	0.70
第16期	74,248,765	77,006,105	10,371	110	1.10
第17期	33,764,879	27,122,293	8,033	40	0.40
第18期	12,000,000	10,162,137	8,468	60	0.60
第19期	12,000,000	11,939,586	9,950	70	0.70

○償還金のお知らせ

1 万口当たり償還金（税込み）	10,620円68銭
-----------------	------------

○お知らせ

約款変更について

2017年2月16日から2017年8月15日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

運用報告書

第17期（決算日 2016年10月26日）
（2015年10月27日～2016年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	1999年10月29日から原則無期限です。
運 用 方 針	わが国の株式市場の動きをとらえることを目標に、「東証株価指数」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主 要 運 用 対 象	わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式への投資割合には、制限を設けません。

フ ァ ン ド 概 要

主としてわが国の株式に投資し、「東証株価指数」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。運用の効率化をはかるため、株価指数等先物取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。株式以外の資産への投資割合は、原則として、信託財産の総額の50%以下とします。ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<935743>

【運用報告書の表記について】

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

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		東 証 株 価 指 数 (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					
	円	%		%	%	百万円	
13期(2012年10月26日)	5,904	1.7	741.23	△ 0.7	98.6	1.4	24,198
14期(2013年10月28日)	9,744	65.0	1,198.36	61.7	99.0	1.1	27,805
15期(2014年10月27日)	10,409	6.8	1,254.28	4.7	98.8	1.2	26,866
16期(2015年10月26日)	13,197	26.8	1,558.99	24.3	98.9	1.0	28,318
17期(2016年10月26日)	11,966	△ 9.3	1,382.70	△11.3	98.9	1.1	26,081

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しています。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額	東 証 株 (ベンチマーク)	価 指 数	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		式 率
(期 首)	円	%		%	%	%
2015年10月26日	13,197	－	1,558.99	－	98.9	1.0
10月末	13,191	△ 0.0	1,558.20	△ 0.1	99.0	0.9
11月末	13,381	1.4	1,580.25	1.4	99.2	0.7
12月末	13,118	△ 0.6	1,547.30	△ 0.7	99.6	0.4
2016年1月末	12,142	△ 8.0	1,432.07	△ 8.1	99.6	0.4
2月末	11,008	△16.6	1,297.85	△16.8	99.7	0.4
3月末	11,535	△12.6	1,347.20	△13.6	98.5	1.4
4月末	11,477	△13.0	1,340.55	△14.0	98.8	1.1
5月末	11,819	△10.4	1,379.80	△11.5	98.3	1.7
6月末	10,687	△19.0	1,245.82	△20.1	98.9	1.1
7月末	11,348	△14.0	1,322.74	△15.2	99.6	0.6
8月末	11,410	△13.5	1,329.54	△14.7	99.3	0.6
9月末	11,447	△13.3	1,322.78	△15.2	98.9	1.1
(期 末)						
2016年10月26日	11,966	△ 9.3	1,382.70	△11.3	98.9	1.1

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2015年10月27日～2016年10月26日)

基準価額等の推移

期間の初め13,197円の基準価額は、期間末に11,966円となり、騰落率は△9.3%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

<値上がり要因>

- ・原油価格の回復傾向により原油関連銘柄の株価が上昇したこと（2016年2月中旬～期間末）。
- ・参議院選挙における与党の勝利を受けて追加経済対策への期待が高まったこと。
- ・日銀が導入を決定した新しい金融緩和の枠組みが好感されたこと。

<値下がり要因>

- ・中国における人民元安・株安の進行や英国の欧州連合（ＥＵ）離脱決定などを受けて、世界経済の先行き不透明感が強まったこと。
- ・円高／アメリカドル安が進行したこと。
- ・国内景気の先行き不透明感が強まったこと。

基準価額の推移



東証株価指数の推移



（株式市況）

国内株式市場では、東証株価指数（ＴＯＰＩＸ）は、期間の初めと比べて下落しました。期間の初めから2016年2月上旬にかけては、原油安や中国の株安進行を受けた世界経済の先行き懸念や、北朝鮮などにおける地政学的リスクの高まり、円高／アメリカドル安の進行などから、ＴＯＰＩＸは下落しました。2月中旬から6月上旬にかけては、中国における追加金融緩和策や、原油価格の上昇による関連銘柄の堅調な株価推移などが支援材料となる一方で、国内景気の先行き不透明感が強まったことや、一部の銘柄における市場予想を下回る決算内容などが重しとなり、ＴＯＰＩＸは一進一退の推移となりました。6月中旬から7月上旬にかけては、英国のＥＵ離脱の決定による世界経済や金融市場への影響が懸念されたことや、円高／アメリカドル安が進行したことなどから、ＴＯＰＩＸは下落しました。7月中旬から期間末にかけては、参議院選挙における与党の勝利を受けて追加経済対策の実施に期待が高まったことや、日銀が導入を決定した新しい金融緩和の枠組みが好感されたことなどから、ＴＯＰＩＸは上昇しました。

ポートフォリオ

ＴＯＰＩＸに連動する投資成果を目標とし、「バーラ日本株式モデル」に基づいてポートフォリオを構築しました。また、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、9.3%の値下がりとなり、ベンチマークである「東証株価指数」の下落率11.3%を概ね2.0%上回ることとなりました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・株式配当金を受け取ったこと。

<マイナス要因>

- ・売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○今後の運用方針

引き続き、ＴＯＰＩＸとの連動をめざし、原則として「バーラ日本株式モデル」に基づいて構築したポートフォリオによる運用を継続します。また、一定期間ごとにポートフォリオの見直しなどを行ない、株式先物取引を含めた実質の株式組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

○１万口当たりの費用明細

(2015年10月27日～2016年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 0 (0) (0)	% 0.001 (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、11,880円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年10月27日～2016年10月26日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 3,580 (△1,495)	千円 4,155,501 ()	千株 2,729	千円 3,462,881

(注) 金額は受け渡し代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 2,155	百万円 2,173	百万円 —	百万円 —

(注) 金額は受け渡し代金。

○株式売買比率

(2015年10月27日～2016年10月26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	7,618,382千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	25,959,227千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.29

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年10月27日～2016年10月26日)

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 10	百万円 17	百万円 87

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三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

○組入資産の明細

(2016年10月26日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	6	0.6	1,661
日本水産	16.9	18.1	8,941
マルハニチロ	2.8	2.9	8,415
カネコ種苗	—	0.5	749
サカタのタネ	2.2	2.1	6,363
ホクト	1.5	1.4	2,707
ホクリョウ	—	0.1	75
鉱業 (0.3%)			
住石ホールディングス	4	4.4	387
日鉄鉱業	4	0.4	1,652
三井松島産業	9	1	1,242
国際石油開発帝石	72.3	74.4	73,388
日本海洋掘削	0.4	0.4	953
石油資源開発	2	2.2	5,141
K&Oエナジーグループ	0.9	1	1,493
建設業 (3.1%)			
ショーボンドホールディングス	1.3	1.5	7,545
ミライト・ホールディングス	4.2	4.4	4,061
サンヨーホームズ	0.2	0.3	167
ダイセキ環境ソリューション	0.3	0.4	593
安藤・間	9.2	9.5	6,355
東急建設	4.9	4.6	4,917
コムシスホールディングス	6.1	6.1	11,291
ミサワホーム	1.6	1.7	1,341
高松コンストラクショングループ	1	1.1	2,784
東建コーポレーション	0.5	0.6	4,548
ソネック	—	0.2	124
ヤマウラ	0.7	0.7	367
大成建設	71	73	57,305
大林組	41	42.4	42,993
清水建設	42	43	39,689
飛島建設	10.6	11.6	2,134
長谷工コーポレーション	17.2	16.5	16,846
松井建設	1.5	1.6	1,830
銭高組	2	2	706
鹿島建設	60	66	46,134

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
不動産テトラ	10.5	10.2	1,866
大末建設	0.5	0.6	542
鉄建建設	9	9	3,087
西松建設	15	16	7,648
三井住友建設	55.8	54.6	5,405
大豊建設	4	6	3,498
前田建設工業	9	9	8,523
ナカノフドー建設	1.1	1.1	464
奥村組	13	14	8,344
東鉄工業	1.7	1.7	4,962
イチケン	2	2	620
浅沼組	4	5	1,215
戸田建設	17	17	9,826
熊谷組	17	21	5,901
青木あすなろ建設	0.9	1	724
北野建設	3	3	816
植木組	2	2	438
三井ホーム	2	2	920
矢作建設工業	1.7	1.9	1,852
ビーエス三菱	1.5	1.8	651
日本ハウスホールディングス	2.8	3	1,299
大東建託	5.1	5.2	89,960
新日本建設	1.7	1.7	1,691
N I P P O	3	3	5,994
東亜道路工業	3	3	819
前田道路	4	4	7,620
日本道路	4	4	1,740
東亜建設工業	10	1.3	2,750
若築建設	8	9	1,386
東洋建設	4.1	4.5	1,939
五洋建設	15.3	15.7	9,624
大林道路	2	1.7	1,086
福田組	2	2	2,356
住友林業	10.1	9.7	14,035
日本基礎技術	1.7	1.6	553
日成ビルド工業	4	4	2,028
ヤマダ・エスバイエルホーム	7	8	616

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
巴コーポレーション	1.8	1.9	646
パナホーム	5	5	3,965
大和ハウス工業	40.5	41.7	119,032
ライト工業	2.2	2.7	3,296
積水ハウス	43.2	47.2	80,712
日特建設	1.9	1.6	748
北陸電気工事	0.7	0.7	552
ユアテック	2	2	1,254
西部電気工業	1	0.3	609
四電工	1	1	395
中電工	2	2	4,262
関電工	6	6	6,054
きんでん	9.1	8.6	10,879
東京エネシス	1	2	2,026
トーエネック	2	2	996
住友電設	1.1	1.2	1,393
日本電設工業	2.3	2.3	4,436
協和エクシオ	5.9	5.5	8,426
新日本空調	1.2	1.2	1,390
N D S	3	0.2	504
九電工	3	2.6	9,568
三機工業	2.8	3.2	3,020
日揮	14	14.2	26,582
中外炉工業	4	4	800
ヤマト	1.3	1.4	778
太平電業	2	2	2,028
高砂熱学工業	3.8	4.2	6,413
三晃金属工業	2	0.2	569
朝日工業社	2	0.3	919
明星工業	2.3	2.6	1,378
大気社	2	1.8	4,714
ダイダン	2	2	1,630
日比谷総合設備	1.8	1.7	2,818
東芝プラントシステム	2.2	2.3	3,698
東洋エンジニアリング	7	8	2,816
千代田化工建設	10	10	9,140
新興プランテック	2.8	2.9	2,262
食料品 (4.8%)			
日本製粉	9	4.5	7,074
日清製粉グループ本社	15	15.5	24,924
日東富士製粉	1	0.1	368

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
昭和産業	6	6	3,456
鳥越製粉	1.1	1.1	845
中部飼料	1.3	1.3	1,137
フィード・ワン	8.4	8.5	1,156
東洋精糖	2	3	333
日本甜菜製糖	7	0.7	1,402
三井製糖	5	1.1	2,712
塩水港精糖	1.6	1.6	398
日新製糖	—	0.6	861
森永製菓	12	2.6	12,610
中村屋	3	0.3	1,425
江崎グリコ	3.2	3.3	19,734
名糖産業	0.6	0.6	829
不二家	8	8	1,648
山崎製パン	10	10.4	25,916
第一屋製パン	2	3	408
モロゾフ	2	2	884
亀田製菓	0.8	0.8	4,592
寿スピリッツ	0.3	1	2,517
カルビー	5.1	5.2	20,072
森永乳業	12	13	10,842
六甲バター	0.6	0.6	1,701
ヤクルト本社	7.4	7.6	36,860
明治ホールディングス	8.1	8.4	88,032
雪印メグミルク	3.2	3.3	11,929
ブリマハム	8	9	3,465
日本ハム	10	10	25,310
伊藤ハム	8	—	—
林兼産業	4	0.5	452
丸大食品	7	7	3,535
米久	0.4	—	—
S F o o d s	0.8	0.9	2,522
伊藤ハム米久ホールディングス	—	8.4	8,584
サッポロホールディングス	21	4.6	13,680
アサヒグループホールディングス	25.7	26.5	95,850
キリンホールディングス	55.6	60.9	107,853
宝ホールディングス	10.8	10.2	10,108
オエノンホールディングス	4	4	1,008
養命酒製造	0.4	0.4	741
コカ・コーラウエスト	4.6	4.8	14,880
コカ・コーライーストジャパン	4.8	5.5	12,760

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サントリー食品インターナショナル	9.4	9.7	44,620
ダイドードリンコ	0.7	0.7	4,060
伊藤園	4.1	4.2	16,149
キーコーヒー	1.2	1.3	2,657
ユニカフェ	0.4	0.4	384
ジャパンフーズ	0.2	0.2	234
日清オイリオグループ	7	7	3,325
不二製油グループ本社	3.7	3.8	8,071
かどや製油	0.1	0.2	638
J-オイルミルズ	6	0.6	2,250
キッコーマン	11	11	36,520
味の素	32	29.1	67,584
キュービー	7	7.2	21,520
ハウス食品グループ本社	5.1	4.8	11,107
カゴメ	4.9	5.1	13,759
焼津水産化学工業	0.7	0.7	714
アリアケジャパン	1.3	1.2	7,056
ビエトロ	—	0.2	309
エバラ食品工業	0.2	0.3	591
ニチレイ	15	7.5	17,752
東洋水産	7.2	6.9	30,291
イートアンド	0.2	0.2	413
日清食品ホールディングス	5.8	6	36,480
永谷園ホールディングス	1	1	1,338
一正蒲鉾	0.5	0.5	567
フジッコ	1.3	1.4	3,491
ロック・フィールド	0.7	1.5	2,238
日本たばこ産業	81.1	78.4	310,856
ケンコーマヨネーズ	0.5	0.5	1,935
わらべや日洋ホールディングス	0.8	0.8	2,026
なとり	0.6	0.7	1,267
北の達人コーポレーション	—	0.3	138
ユーグレナ	4.6	4.5	6,439
ミヨシ油脂	5	5	675
理研ビタミン	0.4	0.3	1,524
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	1.6	1.7	2,170
グンゼ	10	11	3,828
東洋紡	51	52	8,944
ユニチカ	38	39	2,808
富士紡ホールディングス	6	0.6	1,929

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
倉敷紡績	13	13	2,730
シキボウ	8	8	944
日本毛織	4	3.7	2,800
ダイトウボウ	3	3	210
トーア紡コーポレーション	0.6	0.6	305
ダイドーリミテッド	1.5	1.5	613
帝国繊維	1.3	1.4	2,163
帝人	53	10.8	21,330
東レ	99	96	93,571
サカイオーベックス	3	0.4	754
住江織物	3	3	705
日本フエルト	0.7	0.7	359
イチカワ	1	1	266
日本バイリーン	2	—	—
日東製網	1	1	165
芦森工業	3	—	—
アツギ	11	10	1,150
ダイニック	3	3	516
セーレン	3.2	3.3	4,118
ソトー	—	0.5	612
東海染工	2	2	254
小松精練	2.1	2	1,302
ワコールホールディングス	8	8	9,520
ホギメディカル	0.8	0.8	5,488
レナウン	3.2	3.7	381
クラウドシア	0.4	0.3	147
T S I ホールディングス	5.7	5.9	3,528
三陽商会	7	7	1,162
ナイガイ	6	5	295
オンワードホールディングス	9	9	6,246
ルック	2	2	310
キムラタン	61	58	406
ゴールドウイン	0.6	0.6	2,904
デサント	2.9	3	4,302
キング	0.6	0.6	240
ヤマトインターナショナル	0.8	0.8	310
パルプ・紙 (0.2%)			
特種東海製紙	7	0.8	2,880
王子ホールディングス	53	51	22,338
日本製紙	6.2	6.8	13,266
三菱製紙	20	2	1,346

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北越紀州製紙	8	8.2	5,354
中越パルプ工業	5	5	1,130
巴川製紙所	2	2	506
大王製紙	5.7	5.9	7,339
レンゴー	11	11.7	7,745
トーモク	4	4	1,196
ザ・バック	0.9	0.9	2,555
化学 (6.6%)			
クラレ	20.2	22.2	34,343
旭化成	80	82	77,080
共和レザー	0.8	0.9	679
昭和電工	86	8.8	12,082
住友化学	95	97	49,664
日本化成	3	3	432
住友精化	3	0.5	1,965
日産化学工業	8.3	7.9	27,966
ラサ工業	5	5	630
クレハ	9	1	3,930
多木化学	1	1	747
テイカ	2	2	1,098
石原産業	22	2.4	1,888
片倉コープアグリ	1.55	2	438
日東エフシー	0.8	0.8	676
日本曹達	8	9	4,068
東ソー	34	36	25,020
トクヤマ	20	22	10,472
セントラル硝子	13	14	6,104
東亜合成	8	8.3	9,843
大阪ソーダ	5	6	2,646
関東電化工業	3	3	2,625
デンカ	26	27	12,636
信越化学工業	23	23.7	182,300
日本カーバイド工業	5	5	695
堺化学工業	5	5	1,780
エア・ウォーター	11	10.9	21,320
大陽日酸	16.5	10.2	11,169
日本化学工業	5	5	1,355
日本バーカライジング	6.1	6.7	9,668
高压ガス工業	2	2	1,412
四国化成工業	2	2	1,942
戸田工業	3	3	903

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ステラ ケミファ	0.7	0.7	2,663
保土谷化学工業	4	0.4	1,151
日本触媒	2	1.9	13,547
大日精化工業	5	5	2,855
カネカ	17	18	15,534
三菱瓦斯化学	22	11.4	18,319
三井化学	58	56	29,736
J S R	12.7	12.4	19,852
東京応化工業	2.7	2.6	8,723
大阪有機化学工業	0.9	0.9	718
三菱ケミカルホールディングス	80.2	88.5	60,958
日本合成化学工業	3	—	—
ダイセル	18	17.8	24,350
住友ペークライト	12	12	6,792
積水化学工業	29.7	30	47,070
日本ゼオン	11	11	11,033
アイカ工業	3.9	4	11,280
宇部興産	65	71	15,123
積水樹脂	2	2	3,392
タキロン	3	3	1,446
旭有機材	5	4	788
日立化成	6.3	6.5	16,165
ニチパン	1	1	929
リケンテクノス	2.1	2.9	1,580
大倉工業	3	3	1,209
積水化成成品工業	4	1.7	1,295
群栄化学工業	3	0.4	1,199
タイガースポリマー	0.6	0.7	491
ミライアル	0.5	0.5	358
ダイキアクシス	0.2	0.2	199
ダイキョーニシカワ	0.4	1.7	2,306
日本化薬	8	9	10,782
カーリットホールディングス	1.2	1.3	695
日本精化	1.1	1.1	889
扶桑化学工業	—	0.8	1,836
ADEKA	5.9	6.5	10,146
日油	11	10	11,340
新日本理化	2.1	2.2	354
ハリマ化成グループ	1.1	1.2	699
花王	34.5	33.6	193,233
第一工業製薬	3	3	1,053

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニイタカ	0.2	0.2	294
三洋化成工業	4	0.8	3,860
有機合成薬品工業	—	1	224
大日本塗料	7	8	1,824
日本ペイントホールディングス	11.1	10.2	36,414
関西ペイント	15.6	14.9	33,152
神東塗料	1	1	202
中国塗料	4	3.8	2,808
日本特殊塗料	1	0.9	1,282
藤倉化成	1.8	1.8	1,126
太陽ホールディングス	1.1	1	3,895
D I C	52	5.2	16,796
サカタインクス	2.6	2.7	3,655
東洋インキＳＣホールディングス	13	13	6,266
T&K T O K A	0.4	1	993
富士フイルムホールディングス	29.3	30.2	124,695
資生堂	22.8	25.1	67,644
ライオン	15	16	27,488
高砂香料工業	0.9	0.9	2,544
マンダム	1.3	1.2	5,706
ミルボン	0.7	0.7	3,262
ファンケル	3	3.1	5,105
コーセー	2.1	2.1	20,370
コタ	0.4	0.4	496
シーズ・ホールディングス	1.7	1.7	5,108
シーボン	0.2	0.1	215
ポーラ・オルビスホールディングス	1.3	1.4	12,320
ノエビアホールディングス	0.8	0.8	2,528
アジュバンコスメジャパン	0.3	0.3	261
エステー	0.9	0.9	1,196
アグロ カネショウ	0.5	0.5	576
コニシ	1	2.1	2,751
長谷川香料	1.6	1.7	3,202
星光PMC	0.7	0.7	790
小林製薬	2.1	4	21,800
荒川化学工業	1.1	1.1	1,666
メック	1	1	1,081
日本高純度化学	0.4	0.4	983
タカラバイオ	—	2.8	4,261
J C U	0.3	0.4	1,704
新田ゼラチン	0.8	0.9	656

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ＯＡＴアグリオ	—	0.2	263
デクセリアルズ	2.9	4	3,656
アース製薬	0.9	0.9	4,369
イハラケミカル工業	2	1.8	1,701
北興化学工業	1	1	347
大成ラミック	0.4	0.4	1,214
クミアイ化学工業	2.7	2.7	1,649
日本農薬	3	3	1,716
アキレス	11	1.1	1,643
有沢製作所	2.2	1.9	1,033
日東電工	9.9	10.2	75,816
レック	0.4	0.4	1,106
きもと	2.3	2.3	568
藤森工業	1.1	1.1	2,741
前澤化成工業	0.9	0.9	972
J S P	1	0.9	2,178
エフビコ	1.1	1.2	6,852
天馬	1	1	1,778
信越ポリマー	2.5	2.6	1,809
東リ	3	3	987
ニフコ	2.9	2.5	13,925
日本バルカー工業	5	1	1,399
ユニ・チャーム	26	26.7	66,029
医薬品 (5.3%)			
協和発酵キリン	15	15.8	25,532
武田薬品工業	48	52.6	252,690
アステラス製薬	143.6	143.4	223,273
大日本住友製薬	9.1	9.3	17,437
塩野義製薬	20	19.2	101,184
田辺三菱製薬	14.9	15.4	32,678
わかもと製薬	1	1	239
あすか製薬	1.5	1.7	3,216
日本新薬	3	3	16,170
バイオフェルミン製薬	0.2	0.2	532
中外製薬	12.8	13.1	45,719
科研製薬	2.2	2.3	15,157
エーザイ	16.9	16.3	111,655
ロート製薬	5.8	6.5	11,713
小野薬品工業	5.8	30	81,000
久光製薬	3.6	4.1	22,673
有機合成薬品工業	1	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
持田製薬	0.9	0.9	7,443
参天製薬	23.6	24.4	36,917
扶桑薬品工業	4	0.5	1,335
日本ケミファ	2	0.2	884
ツムラ	4	4.2	12,705
日医工	3	3.1	6,017
キッセイ薬品工業	2.3	2.3	6,373
生化学工業	2.5	2.4	4,036
栄研化学	1.1	1.1	3,327
日水製薬	0.5	0.5	574
鳥居薬品	0.9	0.9	2,079
J C Rファーマ	1	1	2,557
東和薬品	0.6	0.6	2,487
富士製薬工業	0.3	0.4	1,042
沢井製薬	2	2.2	15,202
ゼリア新薬工業	2.6	2.7	4,754
第一三共	43.1	44.4	107,670
キョーリン製薬ホールディングス	3.4	3.5	8,092
大幸薬品	0.6	0.7	1,130
ダイト	0.6	0.8	1,856
大塚ホールディングス	27.6	28.4	130,895
大正製薬ホールディングス	3.1	3.2	32,960
ベプチドリーム	—	2.2	11,880
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	11.6	11	990
昭和シェル石油	12.9	11.8	11,398
ニチレキ	1	1.7	1,373
東燃ゼネラル石油	19	22	22,418
ユシロ化学工業	0.7	0.7	1,008
ビービー・カストロール	0.5	0.5	682
富士石油	3	3.1	1,041
MORESCO	0.3	0.4	557
出光興産	6.1	6.9	16,311
J Xホールディングス	142.3	156.3	64,473
コスモエネルギーホールディングス	3.6	4	5,444
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	7.7	8	14,488
東洋ゴム工業	5.8	7	11,473
ブリヂストン	43.3	44.6	176,616
住友ゴム工業	12	12.4	21,191
藤倉ゴム工業	1.1	1.2	678

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オカモト	4	4	4,712
フコク	0.5	0.5	432
ニッタ	1.3	1.4	3,735
住友理工	2.4	2.8	2,996
三ツ星ベルト	3	3	2,658
パンドー化学	5	2.4	2,440
ガラス・土石製品 (0.9%)			
日東紡績	9	9	3,204
旭硝子	68	65	47,125
日本板硝子	62	6.4	5,382
石塚硝子	2	2	348
日本山村硝子	5	5	940
日本電気硝子	27	27	15,201
オハラ	0.5	0.5	320
住友大阪セメント	24	26	11,596
太平洋セメント	80	84	25,956
デイ・シイ	1.4	—	—
日本ヒューム	1.4	1.3	885
日本コンクリート工業	2.3	2.8	1,038
三谷セキサン	0.6	0.7	1,846
アジアパイルホールディングス	1.7	1.7	763
東海カーボン	11	12	3,780
日本カーボン	6	7	1,463
東洋炭素	0.7	0.7	1,046
ノリタケカンパニーリミテド	7	0.7	1,670
TOTO	9.4	9.7	40,352
日本碍子	16	16.7	35,854
日本特殊陶業	11.1	11.4	22,708
ダントーホールディングス	1	1	189
MARUWA	0.4	0.5	1,980
品川リフラクトリーズ	3	3	645
黒崎播磨	3	3	900
ヨータイ	1	1	306
イソライト工業	0.7	0.7	199
東京窯業	2	1.6	270
ニッカトー	0.4	0.5	193
フジミインコーポレーテッド	1.2	1.1	1,809
エーアンドエーマテリアル	3	3	294
ニチアス	6	7	6,587
ニチハ	1.7	1.8	4,725

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
鉄鋼 (1.2%)			
新日鐵住金	54.7	59.6	121,911
神戸製鋼所	222	24.3	20,727
合同製鐵	7	0.8	1,514
ジェイ エフ イー ホールディングス	32.7	36.1	52,579
日新製鋼	5.5	6	8,370
東京製鐵	6.5	7.3	5,365
共英製鋼	1.4	1.4	2,818
大和工業	2.9	2.9	8,859
東京鐵鋼	2	3	1,341
大阪製鐵	0.8	0.8	1,487
淀川製鋼所	1.8	2	5,676
東洋鋼鋳	3.1	3.2	956
丸一鋼管	3.9	4.4	14,784
モリ工業	2	0.4	778
大同特殊鋼	22	22	10,582
日本高周波鋼業	6	6	456
日本冶金工業	10.2	10	1,500
山陽特殊製鋼	8	8	4,560
愛知製鋼	8	0.8	4,088
日立金属	13.1	15.1	20,400
日本金属	4	0.4	436
大太平洋金属	8	9	2,826
新日本電工	7.3	7.7	1,486
栗本鐵工所	7	0.7	1,335
缸技	2	2	482
日本鑄鉄管	1	2	396
三菱製鋼	8	9	1,674
日亜鋼業	1.9	2	498
日本精線	1	1	490
シンニッタン	1.3	1.2	584
新家工業	3	3	435
非鉄金属 (0.9%)			
大紀アルミニウム工業所	2	2	800
日本軽金属ホールディングス	31.3	30	7,110
三井金属鉱業	35	34	8,092
東邦亜鉛	7	7	2,555
三菱マテリアル	80	8.3	24,294
住友金属鉱山	35	36	48,600
DOWAホールディングス	15	17	13,005
古河機械金属	20	21	3,528

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エス・サイエンス	6.6	6.6	231
大阪チタニウムテクノロジーズ	1.3	1.3	1,922
東邦チタニウム	2.2	2.3	1,715
U A C J	15	18	6,192
古河電気工業	38	4.2	12,394
住友電気工業	48.3	52.9	81,545
フジクラ	18	18.4	11,555
昭和電線ホールディングス	15	17	1,258
タツタ電線	2.4	2.8	1,092
沖電線	1	1	232
カナレ電気	0.2	0.2	399
平河ヒューテック	0.3	0.6	565
リョービ	7	8	3,592
アーレスティ	1.5	1.5	1,726
アサヒホールディングス	1.9	2	3,656
金属製品 (0.7%)			
稲葉製作所	0.7	0.7	926
宮地エンジニアリンググループ	4	4	668
トーカロ	0.8	0.9	2,080
アルファＣｏ	0.4	0.4	407
SUMCO	10	13.8	12,654
川田テクノロジーズ	0.3	0.3	1,446
東洋製罐グループホールディングス	9.1	9.4	17,850
ホッカンホールディングス	3	4	1,408
コロナ	0.7	0.7	781
横河ブリッジホールディングス	2.5	2.5	2,877
駒井ハルテック	3	0.2	399
高田機工	1	1	212
三和ホールディングス	12.1	13.1	13,532
文化シャッター	3.6	3.7	3,163
三協立山	1.7	1.7	2,822
アルインコ	0.6	1	968
東洋シャッター	0.3	0.4	218
L I X I L グループ	19.1	18.4	44,656
日本フィルコン	1	1	540
ノーリツ	2.5	2.6	5,717
長府製作所	1.4	1.4	3,773
リンナイ	2.4	2.5	24,900
ダイニチ工業	0.7	0.8	520
日東精工	2	2	800
三洋工業	2	2	356

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
岡部	2.7	2.8	2,545
ジーテクト	1.2	1.4	2,772
中国工業	0.2	0.2	136
東ブレ	2.5	2.5	5,667
高周波熱錬	2.2	2.5	2,172
東京製綱	9	0.9	1,560
サンコール	0.8	0.7	322
モリテック スチール	0.7	0.7	185
パイオラックス	0.6	0.7	4,669
日本発條	11.1	12.4	12,040
中央発條	2	1	289
アドバネクス	0.2	0.3	346
立川プラインド工業	0.5	0.6	453
三益半導体工業	0.9	1	1,195
機械 (5.1%)			
日本ドライケミカル	0.2	0.2	459
日本製鋼所	19	4.4	10,010
三浦工業	5.7	5.9	10,525
タクマ	4	5	4,805
ツガミ	4	4	2,272
オークマ	8	9	7,722
東芝機械	7	7	2,611
アマダホールディングス	19.1	19.2	22,636
アイダエンジニアリング	2.8	3.5	3,146
滝澤鉄工所	4	4	548
富士機械製造	4.2	4.3	5,680
牧野フライス製作所	6	6	4,056
オーエスジー	5.8	6	13,284
ダイジェット工業	2	2	310
旭ダイヤモンド工業	3.5	3.6	2,736
DMG森精機	8.1	7.8	8,533
ソディック	2.4	3.4	2,611
ディスコ	1.5	1.7	20,842
日東工器	0.7	0.8	1,963
パンチ工業	0.5	0.5	450
豊和工業	0.8	0.8	438
ＯＫＫ	5	5	535
東洋機械金属	0.9	1	389
津田駒工業	3	3	429
島精機製作所	1.8	1.9	5,321
ＮＣホールディングス	—	0.4	345

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フリュー	—	0.2	658
ヤマシンフィルタ	—	0.3	192
日阪製作所	1.6	1.7	1,407
やまびこ	2	2.4	2,433
ペガサスミシン製造	1.1	1.4	837
ナブテスコ	7.8	6.9	21,493
三井海洋開発	1.5	1.3	2,341
レオン自動機	1	1.1	908
ＳＭＣ	3.9	4	122,640
新川	1.1	1.2	824
ホソカワミクロン	2	2	1,296
ユニオンツール	0.5	0.6	1,638
オイレス工業	1.5	1.7	3,145
日精エー・エス・ビー機械	0.5	0.4	744
サトーホールディングス	1.6	1.8	4,102
日本エアーテック	0.5	0.4	254
日精樹脂工業	0.9	1	788
オカダアイオン	—	0.3	243
ワイエイシイ	0.5	0.5	657
小松製作所	62.8	64.7	150,136
住友重機械工業	35	38	20,672
日立建機	5.7	5.9	12,620
日工	2	0.4	679
巴工業	0.5	0.5	781
井関農機	13	13	3,289
ＴＯＷＡ	1.1	1.3	1,474
丸山製作所	3	3	522
北川鉄工所	6	0.6	1,056
ローツェ	—	0.5	917
タカキタ	—	0.5	269
クボタ	61	63.4	103,912
荏原実業	0.4	0.4	509
三菱化工機	4	4	828
月島機械	2.3	2.5	3,155
帝国電機製作所	0.9	1	794
新東工業	2.9	3	2,646
澁谷工業	1.1	1.1	2,399
アイチ コーポレーション	1.8	1.9	1,501
小森コーポレーション	3.1	2.9	3,946
鶴見製作所	0.9	1	1,528
住友精密工業	2	2	686

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
酒井重工業	2	2	416
住原製作所	27	5.8	18,183
石井鐵工所	2	0.2	309
西島製作所	1.3	1.4	1,549
北越工業	1.3	1.4	953
ダイキン工業	17.8	18.4	181,773
オルガノ	3	2	918
トーヨーカネツ	7	6	1,392
栗田工業	7.3	7.9	19,647
椿本チエイン	6	7	5,775
大同工業	2	3	690
日本コンパヤ	4	—	—
木村化工機	1.2	1.2	429
アネスト岩田	1.9	2.1	2,205
ダイフク	6	6.8	12,743
サムコ	0.2	0.3	271
加藤製作所	3	0.6	1,521
油研工業	3	2	352
タダノ	6	6.1	7,210
フジテック	3.6	3.7	4,414
CKD	3.4	3.5	4,144
キトー	1.4	1.6	1,588
平和	3.6	3.9	9,461
理想科学工業	1.5	1.4	2,424
SANKYO	3.4	3.5	12,827
日本金銭機械	1.1	1.2	1,812
マースエンジニアリング	0.7	0.7	1,461
福島工業	0.7	0.8	2,824
オーイズミ	0.5	0.6	449
ダイコク電機	0.5	0.5	825
竹内製作所	1.5	2.5	5,052
アマノ	4.1	3.9	7,176
JUKI	1.8	2	1,540
サンデンホールディングス	7	8	2,592
蛇の目ミシン工業	1.2	1.3	1,024
マックス	2	2	2,482
グローリー	3.9	4.3	15,007
新晃工業	0.9	0.9	1,152
大和冷機工業	2	2	1,844
セガサミーホールディングス	13.2	13.6	20,862
日本ビストンリング	0.5	0.5	788

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リケン	5	0.6	2,253
T P R	1.4	1.5	4,522
ツバキ・ナカシマ	—	1.4	2,234
ホシザキ	2.7	2.8	26,264
大豊工業	1	1	1,204
日本精工	25.2	25.9	30,069
NTN	28	31	12,307
ジェイテクト	13.1	13.4	20,917
不二越	11	13	5,174
日本トムソン	4	4.3	1,741
THK	8.2	8.4	18,253
ユーシン精機	0.5	0.5	1,214
前澤給装工業	0.5	0.5	703
イーグル工業	1.7	1.6	2,345
前澤工業	0.9	1	347
日本ビラー工業	1.3	1.3	1,345
キッツ	5.5	5.6	3,438
日立工機	3.3	3.4	2,862
マキタ	8	8.2	61,500
日立造船	9.6	10	5,220
三菱重工業	205	225	101,475
I H I	88	97	25,899
スター精密	—	2.4	3,489
電気機器 (12.5%)			
日清紡ホールディングス	8.2	7	7,434
イビデン	8	7.7	11,696
コニカミノルタ	28.7	31.5	29,484
ブラザー工業	15.8	16.3	30,236
ミネベア	18	20.4	21,114
日立製作所	294	322	169,082
東芝	258	266	100,149
三菱電機	122	134.6	188,305
富士電機	34	38	20,026
東洋電機製造	3	2	590
安川電機	15	15.7	25,842
シンフォニアテクノロジー	8	8	1,520
明電舎	11	12	4,260
オリジン電気	2	2	550
山洋電気	3	3	1,974
デンヨー	1	1.2	1,515
東芝テック	9	9	4,131

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
芝浦メカトロニクス	2	2	520
マブチモーター	3.5	3.6	21,636
日本電産	13.6	15.2	152,760
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	—	0.2	460
東光高岳	0.6	0.7	1,503
ダブル・スコープ	—	1.2	2,124
ダイヘン	7	7	4,151
田淵電機	1.4	1.5	507
ヤーマン	0.2	0.1	330
JVCケンウッド	9.1	9.3	2,706
ミマキエンジニアリング	0.8	1.2	699
第一精工	0.5	0.6	697
日新電機	2.9	3	4,620
大崎電気工業	2	2	1,938
オムロン	13.2	14.2	54,031
日東工業	2	2	2,944
I D E C	1.4	1.6	1,494
不二電機工業	0.1	0.1	137
ジーエス・ユアサ コーポレーション	24	24	10,776
サクサホールディングス	3	3	651
メルコホールディングス	0.7	0.7	1,927
テクノメディカ	0.3	0.3	531
日本電気	158	173	47,229
富士通	118	122	67,807
沖電気工業	43	5.5	8,486
岩崎通信機	6	6	456
電気興業	3	3	1,662
サンケン電気	6	7	2,555
ナカヨ	1	1	370
アイホン	0.6	0.7	1,288
ルネサスエレクトロニクス	6.3	6.5	4,088
セイコーエプソン	16.7	18.8	38,295
ワコム	9.7	9.8	3,077
アルバック	2.1	2.3	7,348
アクセル	0.6	0.6	515
E I Z O	1.1	1.2	3,514
ジャパンディスプレイ	25.2	23.6	4,861
日本信号	3.4	3.5	3,255
京三製作所	3	3	1,143
能美防災	1.6	1.4	2,182
ホーチキ	0.9	0.9	1,080

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エレコム	0.9	1.1	2,321
日本無線	3	0.8	1,203
パナソニック	149.9	144.1	154,763
シャープ	104	—	—
アンリツ	7.3	7.6	4,620
富士通ゼネラル	4	4	9,412
日立国際電気	3	2.9	5,626
ソニー	86.1	89.1	296,257
T D K	7.4	7.6	55,100
帝国通信工業	3	3	480
ミツミ電機	4.4	4.8	2,961
タムラ製作所	5	5	2,140
アルプス電気	10.1	10.9	28,002
池上通信機	4	4	548
パイオニア	18.5	20.5	5,268
日本電波工業	1.1	1.2	1,023
鈴木	0.3	0.5	264
日本トリム	0.3	0.3	1,644
ローランド ディー・ジー	0.5	0.6	1,456
フォスター電機	1.4	1.6	3,044
クラリオン	6	7	2,296
SMK	4	3	1,164
ヨコオ	1	0.9	632
東光	3	—	—
ティアック	7	—	—
ホシデン	3.7	3.8	2,758
ヒロセ電機	2.1	2	27,180
日本航空電子工業	3	4	6,928
T O A	1.3	1.5	1,423
日立マクセル	2.4	2.1	3,427
古野電気	1.5	1.5	1,167
ユニデンホールディングス	3	4	596
アルパイン	2.9	3	4,248
スミダコーポレーション	1	1	1,187
アイコム	0.7	0.7	1,336
リオン	0.5	0.5	755
本多通信工業	—	0.3	389
船井電機	1.2	1.3	1,075
横河電機	12.3	12.6	18,585
新電元工業	5	4	1,816
アズビル	4	4.1	12,587

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東亜ディーケーケー	0.5	0.7	330
日本光電工業	5.1	5.3	13,562
チノー	0.4	0.4	420
共和電業	1.5	1.5	564
日本電子材料	0.5	0.5	265
堀場製作所	2.3	2.5	12,375
アドバンテスト	8.4	8.6	11,816
小野測器	0.6	0.6	552
エスベック	1.4	1.3	1,753
パナソニック デバイスSUNX	1.1	1.1	677
キーエンス	2.8	2.9	223,967
日置電機	0.6	0.7	1,405
シスメックス	9.5	9.8	71,736
日本マイクロニクス	—	2.3	2,688
メガチップス	1.3	1.3	2,498
OBARA GROUP	0.8	0.7	3,150
澤藤電機	1	1	210
コーセル	1.7	1.7	2,126
イリソ電子工業	—	0.4	2,288
新日本無線	1	1	339
オブテックス	0.9	0.9	2,371
千代田インテグレ	0.6	0.7	1,501
アイ・オー・データ機器	—	0.4	396
レーザーテック	1.2	1.5	3,093
スタンレー電気	8.8	9	25,983
岩崎電気	4	5	785
ウシオ電機	7.4	7.6	9,256
岡谷電機産業	0.6	0.7	275
ヘリオス テクノ ホールディング	1.2	1.1	458
日本セラミック	0.7	1	1,912
遠藤照明	0.6	0.6	496
日本デジタル研究所	1	1.1	1,820
古河電池	1	1	716
双信電機	0.6	0.6	168
山一電機	1.4	1.1	903
図研	0.9	0.9	961
日本電子	5	5	2,020
カシオ計算機	12.3	12.6	18,950
ファナック	12.8	12.8	252,416
日本シイエムケイ	3.2	2.7	1,474
エンプラス	0.6	0.6	1,908

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
大真空	2	0.5	554
ローム	6	6.1	33,184
浜松ホトニクス	9.5	9.8	30,723
三井ハイテック	1.6	1.8	1,261
新光電気工業	4.6	4.7	2,984
京セラ	20.1	20.7	106,749
太陽誘電	6.4	6.1	6,679
村田製作所	12.8	13.3	192,118
ユーシン	1.6	1.7	1,266
双葉電子工業	2.1	2.1	3,593
北陸電気工業	5	5	650
ニチコン	3.9	3.9	3,467
日本ケミコン	10	10	1,770
KOA	1.7	1.8	1,764
市光工業	3	3	924
小糸製作所	7.3	7.5	40,050
ミツバ	2.2	2.1	3,145
スター精密	2.3	—	—
SCREENホールディングス	12	2.6	17,186
キャノン電子	1.1	1.1	1,801
キャノン	65.9	67.9	207,298
リコー	36.8	40.8	37,372
MUTOHホールディングス	1	1	239
東京エレクトロン	10.3	10.3	93,019
輸送用機器 (9.6%)			
トヨタ紡織	4.3	4.4	10,881
芦森工業	—	3	498
鬼怒川ゴム工業	3	—	—
ユニプレス	2.4	2.6	5,054
豊田自動織機	11.2	11.5	56,695
モリタホールディングス	2.1	2.2	3,267
三櫻工業	1.6	1.6	1,094
デンソー	30.2	28	123,200
東海理化電機製作所	3.2	3.7	7,792
三井造船	47	49	7,203
川崎重工業	89	98	29,596
名村造船所	3.4	3.8	2,671
サノヤスホールディングス	1.6	1.6	451
日本車輛製造	4	5	1,380
ニチユ三菱フォークリフト	1.4	1.5	946
近畿車輛	2	0.2	471

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日産自動車	171.8	172	178,192
いすゞ自動車	38.7	36.6	46,719
トヨタ自動車	168.9	160.8	968,820
日野自動車	17.5	18	20,988
三菱自動車工業	44.9	50.1	28,807
エフテック	0.7	0.7	931
レシップホールディングス	0.4	0.4	358
GMB	0.2	0.2	202
ファルテック	0.2	0.2	249
武蔵精密工業	1.3	1.3	3,272
日産車体	5.4	6.1	6,362
新明和工業	5	6	4,416
極東開発工業	2.3	2.5	3,047
日信工業	2.3	2.8	4,606
トビー工業	10	1	2,301
ティラド	5	5	1,175
曙ブレーキ工業	5.3	6.5	1,287
タチエス	1.9	2	3,372
NOK	5.9	6.1	14,176
フタバ産業	3.8	3.9	2,078
KYB	14	14	6,566
シロキ工業	3	—	—
大同メタル工業	1.7	1.8	1,989
プレス工業	6.1	6.7	3,316
ミクニ	1.2	1.6	553
カルソニックカンセイ	9	10	10,340
太平洋工業	2.5	2.8	3,472
ケーヒン	2.8	2.9	4,779
河西工業	1.5	1.6	1,856
アイシン精機	11.2	12.9	60,372
富士機工	1.4	1.5	595
マツダ	36.5	39.9	68,229
ダイハツ工業	14.6	—	—
今仙電機製作所	1.1	1.2	1,112
本田技研工業	110.2	113.5	356,844
スズキ	25.6	23.1	85,308
富士重工業	41.7	39.2	157,740
安永	0.4	0.5	264
ヤマハ発動機	17.3	17.8	40,370
ショーワ	2.9	3.3	1,864
T B K	1.6	1.5	660

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エクセディ	1.7	1.7	4,707
豊田合成	3.9	4.6	11,500
愛三工業	1.9	2.2	1,887
盟和産業	0.1	0.2	214
ヨロズ	1.2	1.2	1,946
エフ・シー・シー	1.8	2.1	4,729
シマノ	4.9	5.1	91,035
タカタ	2.2	2.3	839
テイ・エス テック	2.6	2.9	8,285
ジャムコ	0.5	0.7	1,526
精密機器 (1.5%)			
テルモ	18.8	19.3	78,647
クリエートメディック	0.4	0.4	379
日機装	4	4.5	4,126
島津製作所	15	16	24,496
J M S	2	2	544
モリテックス	0.3	—	—
長野計器	0.8	0.8	512
ブイ・テクノロジー	0.2	0.3	3,801
東京計器	4	4	712
愛知時計電機	2	0.2	633
オーバル	1.3	1.3	327
東京精密	2.2	2.4	6,660
マニー	1.1	1.7	4,115
ニコン	22.9	23.6	36,957
トプコン	3.7	4.2	6,304
オリンパス	18.3	18.8	71,064
理研計器	1.1	1	1,328
タムロン	1	1.1	1,967
HOYA	28.5	28	122,192
ノーリツ鋼機	1.1	1.2	960
エー・アンド・デイ	1.1	1.2	529
シチズン時計	15.1	15.5	9,067
リズム時計工業	5	6	1,092
大研医器	0.9	1	769
メニコン	0.6	0.9	2,663
松風	0.6	0.6	852
セイコーホールディングス	9	8	2,664
ニプロ	7.8	9.4	12,257
その他製品 (1.9%)			
スノーピーク	—	0.2	705

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パラマウントベッドホールディングス	1.3	1.3	5,200
トランザクション	0.2	0.3	572
SHO-BI	0.5	0.5	209
ニホンフラッシュ	0.4	0.5	620
前田工繊	1.4	1.3	1,472
永大産業	2	2	896
アートネイチャー	0.9	1.4	900
ダンロップスポーツ	0.8	0.8	822
バンダイナムコホールディングス	13.5	13	41,600
アイフィスジャパン	0.2	0.3	131
共立印刷	2.3	2.2	675
SHOEI	—	0.6	1,116
フランスベッドホールディングス	1.7	1.8	1,584
パイロットコーポレーション	2.1	2.2	10,219
萩原工業	0.3	0.4	984
トッパン・フォームズ	2.2	2.2	2,382
フジシールインターナショナル	1.5	1.5	6,525
タカラトミー	4.5	4.2	4,872
廣済堂	1.2	1.2	370
A s - m e エステール	0.4	0.4	261
アーク	4	5.6	436
タカノ	0.6	0.6	456
プロネックス	1.2	1.2	1,332
ホクシン	1.2	1.1	225
ウッドワン	2	2	490
大建工業	5	1	2,221
凸版印刷	35	35	34,755
大日本印刷	36	36	38,124
図書印刷	2	2	932
共同印刷	4	4	1,384
日本写真印刷	2.1	2.1	5,203
光村印刷	1	1	212
宝印刷	0.7	0.6	881
アシックス	11.4	12.6	27,707
ツツミ	0.6	0.7	1,129
小松ウオール工業	0.4	0.5	860
ヤマハ	9	9.3	34,224
河合楽器製作所	0.4	0.5	1,021
クリナップ	1.1	1.5	1,342
ビジョン	6.9	7.1	21,548
兼松サステック	2	2	330

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キングジム	1	1.1	933
リンテック	2.9	3	6,837
TASAKI	0.3	0.4	600
イトーキ	2.6	2.7	1,803
任天堂	7.5	7.8	191,256
三菱鉛筆	0.9	1	5,520
タカラスタンダード	5	2.5	4,900
コクヨ	6.4	6.5	9,743
ナカバヤシ	3	3	705
岡村製作所	4.7	4.4	4,668
美津濃	7	7	3,885
アデランス	1.4	2.2	1,361
電気・ガス業 (1.9%)			
東京電力ホールディングス	103.9	107	43,870
中部電力	37.5	38.6	59,038
関西電力	50	51.5	49,903
中国電力	16.9	17.4	21,715
北陸電力	12	12.4	15,425
東北電力	30.6	31.5	41,328
四国電力	11	11.4	11,217
九州電力	27.1	27.9	26,588
北海道電力	11.5	11.8	10,242
沖縄電力	1.2	2	4,514
電源開発	8.9	10.8	26,978
エフオン	—	0.5	359
イーレックス	—	0.4	1,360
東京瓦斯	146	135	66,042
大阪瓦斯	127	130	58,201
東邦瓦斯	31	32	31,616
北海道瓦斯	3	3	822
広島ガス	2	2.2	805
西部瓦斯	14	14	3,514
静岡ガス	3.5	3.9	3,237
メタウォーター	0.8	0.8	2,322
陸運業 (4.2%)			
SBSホールディングス	1.2	1.3	1,177
東武鉄道	66	67	35,108
相鉄ホールディングス	21	22	11,220
東京急行電鉄	66	73	57,597
京浜急行電鉄	34	35	36,785
小田急電鉄	39	20.2	45,631

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
京王電鉄	34	35	31,045
京成電鉄	18	9.5	24,728
富士急行	3	3	3,552
東日本旅客鉄道	22.4	22.9	215,420
西日本旅客鉄道	11.8	12.1	79,000
東海旅客鉄道	11	11.3	197,976
西武ホールディングス	9.8	13.4	24,615
鴻池運輸	1.5	1.8	2,507
西日本鉄道	16	16	7,968
ハマキョウレックス	0.8	1	1,989
サカイ引越センター	0.2	0.5	1,115
近鉄グループホールディングス	123	127	54,229
阪急阪神ホールディングス	82	16.9	58,981
南海電気鉄道	28	28	13,748
京阪ホールディングス	27	28	19,628
神戸電鉄	3	3	1,113
名古屋鉄道	45	46	25,392
山陽電気鉄道	4	5	2,595
日本通運	47	49	24,500
ヤマトホールディングス	21	22.5	53,257
山九	15	16	9,600
丸運	0.7	0.6	147
丸全昭和運輸	4	4	1,688
センコー	5	5.7	4,143
トナミホールディングス	3	3	834
ニッコンホールディングス	4	4	9,108
日本石油輸送	2	0.1	225
福山通運	7	8	4,720
セイノーホールディングス	9.5	8.9	10,128
神奈川中央交通	2	1	745
日立物流	2.6	2.6	5,384
丸和運輸機関	0.2	0.4	1,000
C&Fロジホールディングス	0.5	1.2	1,263
海運業 (0.2%)			
日本郵船	104	113	22,939
商船三井	64	61	15,250
川崎汽船	54	55	14,520
ＮＳユナイテッド海運	5	6	882
明治海運	1.1	1.2	429
飯野海運	6.4	6.5	2,587
共栄タンカー	1	1	197

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
乾汽船	0.8	1	985
空運業 (0.5%)			
日本航空	23.4	24.2	74,995
ANAホールディングス	241	234	66,339
パスコ	1	1	372
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	0.3	0.4	2,436
日新	5	5	1,735
三菱倉庫	8	9	13,077
三井倉庫ホールディングス	7	7	2,254
住友倉庫	9	9	5,013
澁澤倉庫	3	3	900
東陽倉庫	2	2.2	594
日本トランスシティ	3	3	1,128
ケイヒン	3	3	420
中央倉庫	0.7	0.7	700
安田倉庫	1	1	680
東洋埠頭	4	4	692
宇徳	1	1.1	372
上組	15	15	13,200
サンリツ	0.4	0.3	146
キムラユニティ	0.3	0.3	318
キューソー流通システム	0.3	0.4	924
郵船ロジスティクス	1.1	1.2	1,322
近鉄エクスプレス	2.2	2.3	3,206
東海運	0.7	0.8	295
エーアイティ	0.6	0.8	733
内外トランスライン	0.3	0.4	397
情報・通信業 (8.3%)			
NECネットエスアイ	1.5	1.6	2,945
システナ	1.2	1.2	2,266
デジタルアーツ	0.6	0.6	1,600
新日鉄住金ソリューションズ	1	2.1	4,130
キューブシステム	0.5	0.6	389
コア	0.5	0.6	740
ソフトクリエイトホールディングス	0.4	0.6	703
T I S	4	4.1	11,287
ネオス	0.4	0.4	191
電算システム	0.4	0.5	852
グリー	7.4	7.6	4,392
コーエーテクモホールディングス	3.24	2.9	5,727

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱総合研究所	0.5	0.5	1,630
ボルテージ	0.2	0.2	208
電算	0.1	0.1	204
A G S	0.2	0.3	354
ファインデックス	0.8	0.9	1,244
ヒト・コミュニケーションズ	0.2	0.3	470
ブレインパッド	0.2	0.2	204
K L a b	1.9	2.4	1,507
ポールトゥウィン・ビットクルーHD	0.8	0.8	712
イーブクイニシアティブジャパン	0.3	0.2	183
ネクソン	11.5	13.7	23,550
アイスタイル	1	1.9	1,537
エムアップ	0.3	0.4	241
エイチーム	0.4	0.7	1,596
テクノスジャパン	—	0.4	934
e n i s h	—	0.4	196
コロブラ	3.3	3.5	5,421
モバイルクリエイト	0.7	0.9	339
オルトプラス	0.5	—	—
ブロードリーフ	1.2	1.5	1,674
ハーツユニテッドグループ	0.4	0.8	1,628
メディアドゥ	—	0.3	435
ブイキューブ	0.3	0.7	576
サイバーリンクス	—	0.2	183
ディー・エル・イー	—	0.4	272
VOYAGE GROUP	—	0.4	438
オブティム	—	0.1	592
ベリサーブ	0.1	0.1	338
ティーガイア	1.2	1.2	1,924
日本アジアグループ	1	1.5	571
豆蔵ホールディングス	1	1	1,131
テクマトリックス	0.5	0.5	1,092
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	29.1	7,566
GMOペイメントゲートウェイ	1.1	1	5,020
ザッパラス	0.7	0.8	296
インターネットイニシアティブ	2	2	3,736
さくらインターネット	—	0.8	795
GMOクラウド	0.3	0.3	316
ビットアイル	1.4	—	—
SRAホールディングス	0.6	0.7	1,761
M i n o r i ソリューションズ	—	0.3	283

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
システムインテグレータ	0.2	0.2	117
朝日ネット	1.2	1.2	520
フリービット	—	0.7	613
コムチュア	0.2	0.2	765
サイバーコム	—	0.2	181
g u m i	1.2	1.3	986
パイプドHD	0.2	0.2	240
L I N E	—	2.1	10,069
ソルクシーズ	—	0.4	217
フェイス	0.4	0.3	355
ハイマックス	0.2	0.1	120
野村総合研究所	7.59	8.4	31,542
サイバネットシステム	1	1	712
C E ホールディングス	0.2	0.2	206
インテージホールディングス	0.7	0.7	1,327
東邦システムサイエンス	0.4	0.4	247
ソースネクスト	0.6	0.7	375
ティール・ワイ・オー	1.8	2.6	387
フォーカスシステムズ	—	0.5	258
クレスコ	0.3	0.3	675
フジ・メディア・ホールディングス	12.6	13	18,993
オービック	4.2	4.3	23,865
ジャストシステム	2.2	2.3	2,334
TDC ソフトウェアエンジニアリング	0.3	0.6	748
ヤフー	86.6	89.2	37,196
トレンドマイクロ	5.9	6.6	24,321
インフォメーション・ディベロプメント	0.2	0.2	207
日本オラクル	1.9	2	11,300
アルファシステムズ	0.4	0.4	700
フューチャー	1.5	1.7	1,312
C A C H o l d i n g s	0.9	0.9	801
ソフトバンク・テクノロジー	0.3	0.3	1,147
トーセ	0.3	0.4	329
オービックビジネスコンサルタント	0.8	0.6	2,997
伊藤忠テクノソリューションズ	2.7	2.8	7,462
アイティフォー	1.5	1.6	1,073
東計電算	0.2	0.2	409
エクスネット	0.1	0.1	157
大塚商会	3.3	3.3	16,929
サイボウズ	1.7	1.7	763
ソフトブレーン	1.9	1.7	630

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
電通国際情報サービス	0.7	0.8	1,606
デジタルガレージ	—	2	3,852
EMシステムズ	0.2	0.4	659
ウェザーニューズ	0.4	0.4	1,298
C I J	1.1	1.2	602
東洋ビジネスエンジニアリング	0.1	0.1	145
日本エンタープライズ	1.1	1.3	373
WOWOW	0.6	0.6	1,732
フュージョンパートナー	0.7	0.8	799
日本コロムビア	0.5	0.5	305
イマジカ・ロボット ホールディングス	0.9	1.1	723
ネットワンシステムズ	4.9	5.4	3,931
アルゴグラフィックス	0.5	0.6	1,228
マーベラス	2	2.1	1,677
エイベックス・グループ・ホールディングス	2.4	2.3	3,243
日本ユニシス	3.3	3.4	4,379
兼松エレクトロニクス	0.7	0.8	1,628
東京放送ホールディングス	7.2	7.5	12,705
日本テレビホールディングス	11	11.4	21,614
朝日放送	1.2	1.2	826
テレビ朝日ホールディングス	3.3	3.4	6,721
スカパー J S A Tホールディングス	9.2	9.4	4,850
テレビ東京ホールディングス	1	1.1	2,687
日本BS放送	0.2	0.3	294
U-NEXT	—	0.3	194
ワイヤレスゲート	—	0.4	719
コネクシオ	0.9	1.1	1,529
日本通信	5.7	9.3	1,655
クロップス	0.2	0.3	159
日本電信電話	94.6	96.2	454,545
KDDI	122.8	123.2	383,275
光通信	1.1	1.5	14,205
NTTドコモ	93.2	93	241,846
エムティーアイ	1.6	1.9	1,278
GMOインターネット	4.5	4.6	6,490
カドカワ	3	3.9	6,006
学研ホールディングス	4	4	1,384
ゼンリン	1.6	1.7	3,182
昭文社	0.7	0.7	435
インプレスホールディングス	0.9	1.1	152
アイネット	0.6	0.7	725

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
松竹	8	8	9,440
東宝	8.6	8.9	28,257
東映	4	5	4,230
AOI Pro.	0.6	0.6	495
エヌ・ティ・ティ・データ	7.5	7.7	41,734
ビー・シー・エー	0.1	0.2	246
ビジネスブレイン太田昭和	0.2	0.2	195
D T S	1.2	1.4	3,238
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4.7	5.3	18,762
シーイーシー	0.8	0.8	1,632
カプコン	3.1	3.2	7,699
アイ・エス・ビー	0.1	0.2	176
ジャステック	0.8	0.8	882
S C S K	2.9	3	12,405
日本システムウエア	0.5	0.5	836
アイネス	1.6	1.6	1,920
T K C	1.1	1.1	3,366
富士ソフト	1.8	1.9	5,340
NSD	2.8	2.6	4,188
コナミホールディングス	4.9	5.6	23,380
福井コンピュータホールディングス	0.3	0.4	1,118
J B C Cホールディングス	1	1.1	749
ミロク情報サービス	0.8	0.9	1,927
ソフトバンクグループ	63.9	70.6	464,901
卸売業 (4.4%)			
ハウスイ	1	1	109
高千穂交易	0.4	0.5	465
伊藤忠食品	0.3	0.3	1,245
エレマテック	0.5	0.6	1,197
J A L U X	0.4	0.4	737
あらた	0.5	0.6	1,440
トーマンデバイス	0.2	0.2	410
東京エレクトロン デバイス	0.3	0.4	606
フィールズ	0.8	1.1	1,402
双日	81	78.4	21,481
アルフレッサ ホールディングス	14.3	15.6	34,195
横浜冷凍	3	3.1	3,310
神栄	2	2	288
山下医科器械	0.1	0.1	169
ラサ商事	0.6	0.6	353
ラクーン	—	0.6	319

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルコニックス	0.7	0.7	973
神戸物産	0.4	0.7	2,509
あい ホールディングス	1.9	2.2	5,621
ディーブイエックス	0.4	0.4	558
ダイワボウホールディングス	11	11	2,750
マクニカ・富士エレホールディングス	2.1	2.2	2,723
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2.3	2.2	2,514
八洲電機	0.9	1	580
U K Cホールディングス	0.8	0.8	1,414
O C H I ホールディングス	0.3	0.4	439
T O K A I ホールディングス	5.9	5.5	3,745
大阪工機	—	0.1	70
三洋貿易	0.7	0.7	923
ビューティガレージ	—	0.1	115
ウイン・パートナーズ	0.4	0.5	876
ミタチ産業	0.3	0.3	183
シップヘルスケアホールディングス	2.2	2.5	7,600
明治電機工業	0.4	0.4	424
デリカフーズ	0.2	0.3	289
スターティア	0.3	0.3	158
コメダホールディングス	—	1.7	2,886
富士興産	0.5	0.5	213
協栄産業	2	2	276
小野建	1.1	1.1	1,428
佐島電機	1	1	743
エコートレーディング	0.3	0.3	193
伯東	0.8	0.9	856
コンドテック	0.9	1	797
中山福	0.7	0.8	649
ナガイレーベン	1.7	1.8	4,059
三菱食品	1.3	1.4	4,816
松田産業	0.9	0.9	1,332
第一興商	—	2.2	9,834
メディバルホールディングス	12.1	12.5	22,262
アドヴァン	1.2	—	—
S P K	0.3	0.3	646
萩原電気	0.3	0.4	792
アズワン	0.9	1	4,610
スズデン	0.4	0.4	393
シモジマ	0.7	0.9	946
ドウシシャ	1.6	1.5	3,253

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
小津産業	0.2	0.3	609
高速	0.7	0.7	732
たけびし	0.4	0.5	537
黒田電気	2.1	2.3	4,551
リックス	—	0.3	384
丸文	1.1	1.1	657
ハビネット	0.7	1.2	1,322
橋本総業ホールディングス	0.2	0.3	479
日本ライフライン	—	0.6	3,366
エクセル	0.6	0.6	813
マルカキカイ	0.4	0.4	527
I D O M	3.7	3.4	1,734
日本エム・ディ・エム	1	1.1	861
進和	0.7	0.8	1,276
エスケイジャパン	0.4	0.4	124
ダイトエレクトロン	0.5	0.6	483
シークス	0.8	0.9	3,672
田中商事	0.4	0.4	275
オーハシテクニカ	0.7	0.7	960
白銅	0.4	0.4	487
伊藤忠商事	101.1	97.7	125,544
丸紅	105.7	122.5	67,350
高島	2	2	336
長瀬産業	6.8	7.4	9,938
蝶理	0.8	0.8	1,316
豊田通商	13.5	13.9	34,041
三共生興	2	1.8	630
兼松	24	26	4,498
ツカモトコーポレーション	2	3	348
三井物産	102.4	112.6	163,382
日本紙パルプ商事	6	7	2,464
日立ハイテクノロジーズ	4.2	4.3	18,060
カメイ	1.6	1.6	1,558
東都水産	2	0.2	331
O U G ホールディングス	2	2	532
スターゼン	0.5	0.4	2,228
山善	4.7	4.8	3,974
椿本興業	1	1	306
住友商事	71.3	78.3	94,038
内田洋行	3	3	1,308
三菱商事	90.7	93.5	220,847

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第一実業	3	3	1,707
キヤノンマーケティングジャパン	3.5	3.6	6,490
西華産業	4	4	1,160
佐藤商事	1.1	1.1	863
菱洋エレクトロ	1.4	1.4	1,818
東京産業	1.2	1.3	516
ユアサ商事	1.1	1.2	3,004
神鋼商事	3	0.3	548
小林産業	0.8	0.9	234
阪和興業	12	12	7,764
カナデン	1.1	1.2	1,228
菱電商事	2	2	1,328
フルサト工業	0.7	0.7	1,046
岩谷産業	13	15	9,360
すてきなニスグループ	5	6	846
昭光通商	5	5	425
ニチモウ	2	2	324
極東貿易	1	2	406
イワキ	2	2	418
三菱石油	3	3	2,241
稲畑産業	2.9	3	3,381
G S I クレオス	3	4	472
明和産業	1	1.2	390
ワキタ	2.6	2.6	2,295
東邦ホールディングス	4.2	4	8,788
サンゲツ	4.1	4.3	8,741
ミツウロコグループホールディングス	2	2	1,386
シナネンホールディングス	2	0.5	1,024
伊藤忠エネクス	2.7	3.2	2,624
サンリオ	3.4	3.9	7,796
サンワテクノス	0.8	0.8	637
リョーサン	2	2	6,290
新光商事	1.4	1.5	1,597
トーホー	0.5	0.6	1,483
三信電気	1.7	1.7	1,460
東陽テクニカ	1.8	1.7	1,819
モスフードサービス	1.6	1.6	5,584
加賀電子	1.1	1.1	1,579
ソーダニッカ	1.2	1.3	642
立花エレクトック	0.9	0.9	1,002
フォーバル	0.5	0.7	504

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
PAL TAC	1.9	2	4,818
三谷産業	1.3	1.4	478
太平洋興発	5	5	450
ヤマタネ	6	0.6	829
丸紅建材リース	1	1	192
日鉄住金物産	8	1.1	4,213
トラスコ中山	1.4	1.4	7,616
オートバックスセブン	4.3	4.6	6,978
加藤産業	1.9	1.9	4,824
イノテック	1.1	1.2	579
イエローハット	1.1	1.2	2,673
J Kホールディングス	1.2	1.3	708
日伝	0.5	0.5	1,500
北沢産業	1.1	1.1	192
杉南商事	0.7	0.7	892
因幡電機産業	1.8	1.7	6,587
パイテックホールディングス	0.4	0.5	533
ミスミグループ本社	13.6	14	27,356
アルテック	1.2	1.2	169
タキヒヨー	2	2	866
蔵王産業	0.2	0.2	266
スズケン	5.5	5.7	19,123
ジェコス	0.8	0.9	888
ルネサスイーストン	0.6	1.1	493
小売業 (4.9%)			
ローソン	4.6	4.7	37,318
サンエー	0.9	0.8	4,664
ダイユーエイト	0.3	—	—
カワチ薬品	0.9	1	2,504
エービーシー・マート	1.8	1.6	10,432
ハードオフコーポレーション	0.6	0.6	688
アスクル	1.3	1.5	6,637
ゲオホールディングス	2.3	2.1	2,763
アダストリア	1	2.3	6,150
ジーフット	—	0.8	609
シー・ヴィ・エス・ペリエリア	2	0.2	156
くらコーポレーション	0.7	0.8	4,152
キャンドウ	0.7	0.7	1,278
バルグループホールディングス	0.7	0.7	1,815
エディオン	5.6	5.3	4,897
サウラコーポレーション	1.1	1.3	811

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ワッツ	0.5	0.6	664
ハローズ	—	0.4	956
あみやき亭	0.2	0.3	1,129
ひらまつ	1.7	1.8	1,081
ゲンキー	0.2	0.3	1,782
サッポロドラッグストア	0.1	—	—
大黒天物産	0.3	0.3	1,476
ハニーズ	1.1	1.1	1,366
ファーマライズホールディングス	0.3	0.3	164
アルペン	1.1	1.1	2,120
クオール	1.2	1.3	2,104
ジェイアイエヌ	0.8	0.8	4,464
ビックカメラ	6.3	7.2	6,444
D C Mホールディングス	6	6.1	5,654
M o n o t a R O	4.3	4.4	12,095
東京一番フーズ	0.2	0.4	222
ダイヤモンドダイニング	0.2	0.3	328
きちり	0.4	0.4	276
アークランドサービスホールディングス	0.2	0.4	1,238
J. フロント リテイリング	15.3	15.7	22,466
ドトール・日レスホールディングス	2.1	2.2	4,635
マツモトキヨシホールディングス	2.7	2.6	14,248
ブロンコビリー	0.5	0.6	1,881
スタートトゥデイ	3.8	11.4	21,067
トレジャー・ファクトリー	0.3	0.4	332
物語コーポレーション	0.3	0.3	1,449
ココカラファイン	1.3	1.3	5,278
三越伊勢丹ホールディングス	24	24.8	27,552
H a m e e	—	0.1	202
ウエルシアホールディングス	1.2	1.1	8,030
クリエイトSDホールディングス	0.6	1.8	3,902
丸善CH I ホールディングス	1.5	1.5	552
ミサワ	0.1	0.3	137
エー・ピーカンパニー	0.2	0.2	140
チムニー	0.3	0.4	1,185
シュッピン	—	0.5	561
ネクステージ	0.2	0.3	506
ジョイフル本田	1.8	2	5,640
鳥貴族	—	0.3	857
キリン堂ホールディングス	0.4	0.4	313
ホットランド	—	0.6	613

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
すかいらく	3.7	5.4	8,029
綿半ホールディングス	—	0.5	872
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4	4.1	3,919
ブックオフコーポレーション	0.7	0.8	651
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	0.5	419
あさひ	0.8	0.9	1,149
日本調剤	0.3	0.3	1,387
コスモス薬品	0.6	0.6	13,800
トーエル	0.7	0.6	558
一六堂	0.3	0.4	140
オンリー	—	0.1	79
セブン&アイ・ホールディングス	50.6	52.1	234,085
薬王堂	0.2	0.2	1,434
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	0.8	3.4	3,406
ツルハホールディングス	2.6	2.9	34,771
サンマルクホールディングス	0.9	1	2,895
フェリシモ	0.3	0.4	404
トリドールホールディングス	1.3	1.5	4,041
クスリのアオキ	1	1.1	5,610
サツドラホールディングス	—	0.2	399
ダイユー・リックホールディングス	—	0.4	260
メディカルシステムネットワーク	1.3	1.4	639
総合メディカル	0.6	0.6	1,938
はるやま商事	0.5	0.5	407
ノジマ	—	1.5	1,956
カッパ・クリエイト	1.7	1.7	2,125
ライトオン	0.9	0.9	905
ジーンズメイト	0.5	0.5	87
良品計画	1.5	1.4	31,976
三城ホールディングス	1.5	1.5	660
アドヴァン	—	1.3	1,251
アルビス	0.3	0.3	665
コナカ	1.4	1.6	790
ハウス オブ ローゼ	0.2	0.2	293
G-7ホールディングス	0.3	0.4	549
イオン北海道	0.9	0.9	494
コジマ	1.9	1.9	444
ヒマラヤ	0.4	0.4	321
コーナン商事	1.8	1.8	3,760
エコス	0.5	0.5	618
マルシェ	0.4	0.4	329

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ドンキホーテホールディングス	7.8	8	32,520
西松屋チェーン	2.4	2.5	3,717
ゼンショーホールディングス	6.2	6.4	12,428
幸楽苑ホールディングス	0.8	0.8	1,249
ハークスレイ	0.4	0.4	381
サイゼリヤ	2	2.1	5,888
V Tホールディングス	3.8	4.2	2,377
魚力	0.4	0.4	520
ボブラ	0.4	0.4	202
ユナイテッドアローズ	1.6	1.8	4,899
ハイデイ日高	0.9	1.1	2,879
京都きもの友禅	0.7	0.9	836
コロワイド	4	4.1	8,487
ピーシーデポコーポレーション	—	1.6	836
売番屋	0.5	1.1	4,383
トップカルチャー	0.6	0.5	237
P L A N T	0.3	0.3	356
スギホールディングス	2.2	2.2	12,672
スクロール	1.6	1.9	733
ヨンドシーホールディングス	0.9	1	2,632
ユニ・ファミリーマートホールディングス	4.1	5.5	36,025
木曽路	1.5	1.5	3,522
サトレストランシシステムズ	1.4	1.5	1,234
千趣会	2.4	2.3	1,685
タカキュー	0.9	1.1	203
ケーヨー	2.3	2.1	1,113
上新電機	3	3	2,637
日本瓦斯	1.9	1.9	6,175
ベスト電器	4.2	4.1	561
ロイヤルホールディングス	2	2.1	3,868
東天紅	1	1	141
いなげや	1.3	1.4	1,989
島忠	3.1	3.2	8,899
チヨダ	1.4	1.5	3,745
ライフコーポレーション	0.8	0.8	2,832
リンガーハット	1.2	1.1	2,930
さが美	1	1	116
M r M a x	1.3	1.1	413
テンアライド	1.1	1.2	450
A O K I ホールディングス	2.8	2.8	3,542
オークワ	2	2	2,174

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コメリ	2.1	1.9	4,799
青山商事	2.7	2.4	8,868
しまむら	1.4	1.5	20,385
はせがわ	0.5	0.6	266
高島屋	17	18	15,588
松屋	2.4	2.5	2,055
エイチ・ツー・オー リテイリング	5.7	6.4	9,945
近鉄百貨店	5	5	1,740
丸栄	2	3	243
ニッセンホールディングス	1.9	—	—
パルコ	1.2	1.2	1,159
丸井グループ	12.7	15.3	22,276
アクシアル リテイリング	0.9	1	3,775
イオン	49.8	51.2	75,904
ユニーグループ・ホールディングス	11.6	—	—
イズミ	2.7	2.5	12,237
東武ストア	2	0.2	568
平和堂	2.5	2.5	5,395
フジ	1.3	1.4	3,122
ヤオコー	1.4	1.4	6,181
ゼビオホールディングス	1.6	1.7	2,740
ケーズホールディングス	2.8	5.3	9,672
O l y m p i c グループ	0.8	0.8	456
日産東京販売ホールディングス	2	2.2	530
アインホールディングス	1.5	1.5	10,545
元気寿司	0.4	0.4	825
ヤマダ電機	47.8	37.9	20,731
アークランドサカモト	0.9	2.1	2,635
ニトリホールディングス	5.2	5.4	68,850
愛眼	1.2	1	201
ケーユーホールディングス	0.6	0.6	475
吉野家ホールディングス	3.4	4.6	7,235
松屋フーズ	0.6	0.6	1,899
サガミチェーン	1.5	1.7	2,136
関西スーパーマーケット	0.9	1	1,616
王将フードサービス	0.9	0.9	3,636
プレナス	1.4	1.4	3,007
ミニストップ	0.9	0.9	1,632
アークス	2.1	2.3	6,228
パローホールディングス	2.6	2.7	8,100
藤久	0.1	0.1	171

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ベルク	0.5	0.6	2,481
大庄	0.6	0.7	1,068
ファーストリテイリング	2.4	2.1	76,545
サンドラッグ	2.5	2.6	21,424
サックスパー ホールディングス	0.9	1.2	1,350
ヤマザワ	0.3	0.3	518
やまや	0.2	0.3	447
ペルーナ	3	3.1	2,126
銀行業 (7.6%)			
島根銀行	0.3	0.3	381
じもとホールディングス	8.6	9.1	1,510
めぶきフィナンシャルグループ	7.6	61.8	23,298
東京ＴＹフィナンシャルグループ	1.5	1.7	5,533
九州フィナンシャルグループ	19.29	19.1	13,274
ゆうちょ銀行	—	31.9	38,854
富山第一銀行	—	3.2	1,577
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	86.8	41,195
西日本フィナンシャルホールディングス	—	8	8,416
新生銀行	115	108	17,712
あおぞら銀行	82	79	27,176
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	969.6	999.1	532,420
りそなホールディングス	141.4	145.7	64,865
三井住友トラスト・ホールディングス	267	25.5	87,286
三井住友フィナンシャルグループ	91.4	99.7	353,635
第四銀行	15	15	6,555
北越銀行	13	1.3	3,186
西日本シティ銀行	42	—	—
千葉銀行	47	48	30,288
横浜銀行	81	—	—
常陽銀行	44	—	—
群馬銀行	29	27.7	13,683
武蔵野銀行	1.9	2	5,692
千葉興業銀行	3	3.5	1,585
筑波銀行	5	5.3	1,627
七十七銀行	20	19	8,759
青森銀行	10	9	3,141
秋田銀行	8	8	2,760
山形銀行	7	7	3,115
岩手銀行	0.9	0.9	3,874
東邦銀行	11	11	4,312
東北銀行	7	6	888

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
みちのく銀行	6	6	1,248
ふくおかフィナンシャルグループ	49	54	24,192
静岡銀行	35	37	32,042
十六銀行	15	16	5,024
スルガ銀行	12.8	11.8	29,783
八十二銀行	22	22.5	12,667
山梨中央銀行	7	8	3,984
大垣共立銀行	15	17	6,239
福井銀行	11	11	3,058
北國銀行	14	13	4,576
清水銀行	0.4	0.4	1,236
富山銀行	—	0.2	816
滋賀銀行	12	12	6,324
南都銀行	12	1.2	4,710
百五銀行	12	11	4,290
京都銀行	23	24	18,168
紀陽銀行	4.7	4.9	8,428
三重銀行	5	0.6	1,271
ほくほくフィナンシャルグループ	82	8.5	12,707
広島銀行	36	37	16,428
山陰合同銀行	7.3	7.5	5,572
中国銀行	8.6	8.8	12,003
鳥取銀行	4	0.4	686
伊予銀行	12.9	13.3	8,339
百十四銀行	13	14	5,012
四国銀行	9	10	2,440
阿波銀行	10	10	6,970
大分銀行	7	7	2,751
宮崎銀行	8	8	2,320
佐賀銀行	7	8	2,128
十八銀行	7	8	2,576
沖縄銀行	1	1.1	3,910
琉球銀行	2.5	2.6	3,504
セブン銀行	40.8	46.7	15,457
みずほフィナンシャルグループ	1,698.5	1,790.1	307,002
高知銀行	5	5	575
山口フィナンシャルグループ	12	12	13,524
長野銀行	4	0.4	802
名古屋銀行	11	1	3,700
北洋銀行	18.2	18.7	7,255
愛知銀行	0.4	0.4	2,264

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第三銀行	7	0.7	1,239
中京銀行	5	0.5	1,179
東日本銀行	5	—	—
大光銀行	4	5	1,260
愛媛銀行	7	1.4	1,944
トマト銀行	5	0.5	794
みなと銀行	11	1.1	2,106
京葉銀行	10	10	4,470
関西アーバン銀行	1.7	1.7	1,953
栃木銀行	6	6.4	3,168
北日本銀行	0.4	0.4	1,208
東和銀行	17	23	2,369
福島銀行	15	16	1,552
大東銀行	8	8	1,344
トモニホールディングス	9.3	9.6	5,107
フィデアホールディングス	8.4	10.2	1,846
池田泉州ホールディングス	11.4	13.2	6,177
証券、商品先物取引業 (1.0%)			
F P G	3.6	4.5	4,203
S B I ホールディングス	14.5	15	18,075
ジャフコ	1.6	2.1	7,129
大和証券グループ本社	113	116	68,184
野村ホールディングス	247.1	239.7	118,531
岡三証券グループ	10	11	5,742
丸三証券	3.9	3.7	3,167
東洋証券	5	5	915
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	13.9	14.3	7,378
光世証券	3	3	366
水戸証券	3.8	4	988
いちよし証券	2.6	2.8	2,189
松井証券	6.1	6.1	5,099
だいこう証券ビジネス	0.6	0.6	301
マネックスグループ	14.3	14.5	3,480
カブドットコム証券	10.7	10.5	3,433
極東証券	1.6	1.7	2,476
岩井コスモホールディングス	1.2	1.2	1,077
藍澤證券	1.7	2.3	1,290
マネースクウェアHD	0.5	0.5	623
マネーパートナーズグループ	1.3	1.2	573
保険業 (2.4%)			
かんば生命保険	—	5.1	10,929

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SOMPOホールディングス	26.9	27.6	92,128
アニコム ホールディングス	0.7	0.9	2,122
MS & ADインシュアランスグループ ホールディングス	38.5	37.2	111,897
ソニーフィナンシャルホールディングス	11.6	11.9	16,707
第一生命ホールディングス	77.4	79.8	118,104
東京海上ホールディングス	48.9	50.4	204,422
T & Dホールディングス	44.1	45.4	55,138
アドバンスクリエイト	—	0.3	500
その他金融業 (1.2%)			
全国保証	3.1	3.3	14,619
クレディセゾン	9.9	9.4	16,694
芙蓉総合リース	1.3	1.4	7,406
興銀リース	2.3	2.4	5,203
東京センチュリー	2.8	2.9	10,469
日本証券金融	5.4	5.5	2,519
アイフル	20.3	21	6,636
ポケットカード	0.9	1.3	648
リコーリース	1	1	3,015
イオンフィナンシャルサービス	7.9	8.3	15,139
アコム	24.3	25.1	12,148
ジャックス	7	7	2,856
オリエントコーポレーション	37.6	54.1	10,495
日立キャピタル	2.4	3	6,885
アプラスフィナンシャル	6	6.3	667
オリックス	85.6	88.2	131,903
三菱UFJリース	30.7	31.6	15,705
日本取引所グループ	35.5	36.6	58,486
イー・ギャランティ	0.4	0.4	1,047
アサックス	0.2	0.2	300
NECキャピタルソリューション	0.5	0.5	871
不動産業 (2.6%)			
いちご	—	13.8	6,279
日本駐車場開発	13.3	15.1	2,144
ヒューリック	25.2	26	26,936
三栄建築設計	0.5	0.5	889
野村不動産ホールディングス	7.3	8.3	15,247
三重交通グループホールディングス	2.2	2.2	855
サムティ	—	1	1,063
ディア・ライフ	0.6	0.9	304
エー・ディー・ワークス	—	12.1	471
日本商業開発	—	0.6	1,083

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ブレサンスコーポレーション	0.4	1.6	1,934
ユニゾホールディングス	0.7	0.8	2,237
THEグローバル社	—	0.4	182
日本管理センター	0.8	0.9	1,266
サンセイランディック	0.3	0.3	216
エストラスト	0.2	0.2	112
フージャースホールディングス	1.8	1.8	936
オープンハウス	1.7	1.8	3,976
東急不動産ホールディングス	31.7	30.1	17,608
飯田グループホールディングス	7.8	11.5	23,103
ムゲンエステート	—	0.4	305
シーアールイー	—	0.1	360
エコナックホールディングス	5	4	192
パーク 2 4	6.1	6.3	21,357
バラカ	0.4	0.4	771
三井不動産	64	66	158,994
三菱地所	90	93	189,766
平和不動産	2.3	2.3	3,486
東京建物	13.2	14.5	19,096
ダイビル	3.1	3.2	2,976
京阪神ビルディング	2.1	2.1	1,152
住友不動産	29	30	83,895
大京	19	23	4,554
テーオーシー	4.2	4.8	4,670
東京楽天地	2	2	1,016
レオパレス 2 1	13.2	14.7	10,040
スターツコーポレーション	1.4	1.4	2,727
フジ住宅	1.6	1.6	1,094
空港施設	1.5	1.5	838
明和地所	0.7	0.7	403
住友不動産販売	0.9	0.9	2,094
ゴールドクレスト	1.1	1	1,695
日本エスリード	0.5	0.5	544
日神不動産	1.6	1.7	649
日本エスコン	—	1.7	540
タカラレーベン	5.4	5.4	3,996
サンヨーハウジング名古屋	0.7	0.7	629
イオンモール	7.8	8	12,600
ファースト住建	0.5	0.5	669
トーセイ	1.9	1.7	1,317
穴吹興産	1	1	247

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エヌ・ティ・ティ都市開発	7.5	7.7	7,499
サンフロンティア不動産	1.3	1.5	1,509
エフ・ジェー・ネクスト	0.9	1.1	660
インテリックス	—	0.3	216
ランドビジネス	0.9	0.8	210
グランディハウス	1.1	1.1	403
日本空港ビルデング	4.2	4	15,800
サービス業 (3.8%)			
日本工営	4	4	1,956
ネクスト	3	3.7	3,415
ジェイエイシーリクルートメント	0.6	0.8	1,049
日本M&Aセンター	2	4.1	13,550
ノバレーゼ	0.3	0.3	581
アコーディア・ゴルフ	4.8	3.7	3,903
中広	—	0.1	68
タケエイ	1.3	1.2	1,060
トラスト・テック	0.2	0.5	831
パソナグループ	1	1.2	1,058
C D S	0.3	0.3	290
リンクアンドモチベーション	2.6	3.1	988
G C A	1.1	1.2	936
エス・エム・エス	1.4	1.6	4,129
テンブホールディングス	7.8	9.2	16,652
リニカル	0.3	0.8	1,123
クックパッド	2.9	3	3,015
エスクリ	0.5	0.6	329
アイ・ケイ・ケイ	0.7	0.6	376
学情	0.5	0.6	692
スタジオアリス	0.6	0.5	1,080
シミックホールディングス	0.6	0.7	1,077
N J S	0.3	0.3	380
総合警備保障	4.3	4.4	23,276
カカコム	8.4	9.4	17,108
ルネサンス	0.7	0.7	940
ディップ	1.4	1.5	4,132
オプトホールディング	0.8	1	720
新日本科学	1.2	1.3	796
ツクイ	1.5	3.1	2,154
総合臨床ホールディングス	0.7	—	—
キャリアデザインセンター	0.4	0.3	278
エムスリー	11.1	11.4	36,537

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ツカダ・グローバルホールディング	0.9	1	722
アウトソーシング	0.6	0.7	2,824
ウェルネット	0.5	1	1,301
ワールドホールディングス	—	0.3	493
ディー・エヌ・エー	6.3	5.9	20,178
博報堂DYホールディングス	17.7	18.3	23,277
ぐるなび	1.5	1.5	4,426
エスアールジータカミヤ	1	1.4	751
一休	1	—	—
ジャパンベストレスキューシステム	1.5	1.7	416
ファンコミュニケーションズ	3	3.4	2,686
ジェイコムホールディングス	0.3	0.3	586
WDBホールディングス	0.5	0.5	543
ティア	0.6	0.7	434
バリューコマース	1.2	1.3	460
インフォマート	—	2.8	3,514
J Pホールディングス	3.2	3.3	867
E P Sホールディングス	1.2	1.7	2,346
レッグス	0.2	0.3	245
プレスステージ・インターナショナル	1	2.2	1,744
アミューズ	0.4	0.7	1,245
ドリームインキュベータ	0.4	0.4	956
クイック	0.6	0.7	752
T A C	0.8	0.8	170
ケネディクス	17.3	17.7	7,734
電通	14.3	14.7	76,440
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.5	0.6	304
びあ	0.4	0.4	980
イオンファンタジー	0.4	0.5	1,537
シーティーエス	0.3	0.4	393
みらかホールディングス	3.3	3.4	17,306
アルプス技研	0.5	0.5	1,144
サニックス	1.5	—	—
ダイオーズ	0.3	0.3	290
日本空調サービス	0.6	1.2	684
オリエンタルランド	13.8	14.2	88,324
ダスキン	3.6	3.4	6,830
明光ネットワークジャパン	1.5	1.6	1,569
ファルコホールディングス	0.6	0.6	827
秀英予備校	0.3	0.3	105
田谷	0.3	0.3	195

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ラウンドワン	3.7	4.1	2,964
リゾートトラスト	5	5.5	11,874
ビー・エム・エル	0.8	1.5	4,236
ワタベウエディング	0.5	0.4	184
りらいあコミュニケーションズ	2.4	2.2	2,202
リソー教育	2	2.5	1,462
早稲田アカデミー	0.2	0.2	180
ユー・エス・エス	15.5	16	28,256
東京個別指導学院	0.6	0.7	385
サイバーエージェント	3.1	6.9	21,459
楽天	59.8	67.3	85,942
クリーク・アンド・リバー社	—	0.5	387
テー・オー・ダブリュー	0.8	1.1	731
セントラルスポーツ	0.4	0.4	990
フルキャストホールディングス	1.2	1.4	1,365
リソルホールディングス	1	2	650
テクノプロ・ホールディングス	1.8	2.1	7,591
アトラ	—	0.2	257
インターワークス	—	0.2	225
K e e P e r 技研	—	0.2	326
ファーストロジック	—	0.1	170
デザインワン・ジャパン	—	0.1	219
リブセンス	0.9	0.9	406
ジャパンマテリアル	0.5	0.5	1,840
ベクトル	0.3	1.2	1,362
ウチヤマホールディングス	0.8	0.7	291
サクセスホールディングス	0.1	0.1	119
キャリアリンク	0.2	0.4	313
I B J	0.2	1	731
アサンテ	0.4	0.5	786
N・フィールド	0.4	0.6	936
M&Aキャピタルパートナーズ	0.1	0.2	446
ライドオン・エクスプレス	—	0.3	309
E R I ホールディングス	0.4	0.4	322
アビスト	0.2	0.2	539
ウィルグループ	0.3	0.3	291
エスクロー・エージェント・ジャパン	—	0.1	252
日本ビューホテル	0.2	0.2	262
リクルートホールディングス	19.3	26.6	113,449
エラン	—	0.2	269
日本郵政	—	38.7	50,271

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ベルシステム24ホールディングス	—	2.6	2,553
ソラスト	—	0.6	669
リログループ	0.4	0.5	8,705
東洋	0.3	0.4	1,780
エイチ・アイ・エス	2.1	2.1	6,018
ラックランド	—	0.2	360
共立メンテナンス	0.8	1	6,170
イチネンホールディングス	1.3	1.4	1,412
建設技術研究所	0.8	0.8	828
スペース	0.7	0.7	877
燦ホールディングス	0.3	0.3	455
スバル興業	1	1	414
東京テアトル	5	5	610
ナガワ	—	0.2	795
よみうりランド	3	3	1,356
東京都競馬	9	9	1,845
常磐興産	5	0.5	767
カナモト	1.8	1.8	4,566
東京ドーム	9	5.3	5,289
西尾レントオール	1	1.1	3,437
トランス・コスモス	1.7	1.5	4,102
乃村工芸社	2.5	2.8	4,832
藤田観光	5	4	1,388
KNT-CTホールディングス	6	8	920

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
日本管財		1.2	1.1	1,683
トーカイ		0.6	0.6	2,178
白洋舎		1	0.1	250
セコム		12.4	13.7	105,572
セントラル警備保障		0.6	0.6	1,235
丹青社		2.2	2.5	2,002
メイテック		1.7	1.6	5,720
アサツー ディ・ケイ		2.2	2.1	6,111
応用地質		1.3	1.2	1,474
船井総研ホールディングス		1.5	1.7	2,726
進学会		0.6	0.6	297
オオバ		0.7	1	438
学究社		—	0.2	254
ベネッセホールディングス		4.7	4.4	12,205
イオンディライト		1.2	1.3	4,153
ナック		0.9	0.8	712
ニチイ学館		2.5	2.3	1,943
ダイセキ		2.1	2.5	5,315
ステップ		0.4	0.4	501
合 計	株 数 ・ 金 額	20,047	19,403	25,801,778
	銘柄数<比率>	1,864	1,939	<98.9%>

(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。
(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

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先物	百万円	百万円
			276	—

○投資信託財産の構成

(2016年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	25,801,778	98.7
コール・ローン等、その他	338,126	1.3
投資信託財産総額	26,139,904	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年10月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	26,688,029,018
コール・ローン等	74,004,493
株式(評価額)	25,801,778,970
未収入金	55,266,160
未収配当金	216,734,395
差入委託証拠金	540,245,000
(B) 負債	606,564,605
未払解約金	58,439,520
未払利息	85
差入委託証拠金代用有価証券	548,125,000
(C) 純資産総額(A－B)	26,081,464,413
元本	21,796,501,197
次期繰越損益金	4,284,963,216
(D) 受益権総口数	21,796,501,197口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,966円

(注) 当ファンドの期首元本額は21,458,722,226円、期中追加設定元本額は3,751,599,477円、期中一部解約元本額は3,413,820,506円です。

(注) 2016年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・国際分散型ファンド40 (適格機関投資家向け)	6,780,173,464円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式) 毎月分配型	5,417,402,166円
・D Cインデックスバランス (株式80)	1,676,193,204円
・D Cインデックスバランス (株式60)	1,477,110,439円
・インデックスファンド日本株式(D C専用)	1,337,447,149円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	1,223,362,763円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	1,214,272,609円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	907,512,348円
・D Cインデックスバランス (株式40)	812,936,819円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	304,993,776円
・D Cインデックスバランス (株式20)	239,816,527円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	100,340,782円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	80,019,965円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	64,875,756円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	52,860,753円
・世界アセットバランスファンド25 (適格機関投資家向け)	41,662,571円
・グローバルバランスファンド35 (適格機関投資家向け)	37,909,904円
・世界アセットバランスファンド40 (適格機関投資家向け)	18,417,277円
・全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国) 毎月分配型	5,113,692円
・日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	4,079,233円

(注) 1口当たり純資産額は1.1966円です。

(注) 2016年10月26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 378,205千円

○損益の状況 (2015年10月27日～2016年10月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	561,438,290
受取配当金	560,854,022
受取利息	26,036
その他収益金	587,536
支払利息	△ 29,304
(B) 有価証券売買損益	△2,901,131,148
売買益	1,044,472,501
売買損	△3,945,603,649
(C) 先物取引等取引損益	△ 2,492,180
取引益	38,045,820
取引損	△ 40,538,000
(D) 保管費用等	△ 313
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△2,342,185,351
(F) 前期繰越損益金	6,860,170,332
(G) 追加信託差損益金	413,878,688
(H) 解約差損益金	△ 646,900,453
(I) 計(E+F+G+H)	4,284,963,216
次期繰越損益金(I)	4,284,963,216

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2015年10月27日から2016年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日 2016年10月26日）
（2015年10月27日～2016年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信 託 期 間	2000年5月17日から原則無期限です。
運 用 方 針	世界の主要国の株式市場の動きをとらえることを目標に、「MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主 要 運 用 対 象	日本を除く世界各国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

フ ァ ン ド 概 要

主として日本を除く世界各国の株式に投資し、「MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用の効率化をはかるため、株価指数等先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<935026>

【運用報告書の表記について】

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	期 騰	中 落 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
13期(2012年10月26日)	9,566	19.6	74.31	16.4	94.9	2.9	2.2	63,558
14期(2013年10月28日)	14,674	53.4	111.00	49.4	96.7	1.1	2.1	77,949
15期(2014年10月27日)	17,388	18.5	128.45	15.7	95.5	2.2	2.3	78,486
16期(2015年10月26日)	20,298	16.7	146.54	14.1	95.0	2.5	2.5	79,510
17期(2016年10月26日)	17,803	△12.3	125.37	△14.4	95.5	1.9	2.7	69,214

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 「MSCI-KOKUSAIインデックス」は、「MSCI Inc.」が発表している、日本を除く世界の主要国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。同指数の（円ヘッジなし・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。なお、設定時を100として2016年10月26日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCI-KOKUSAIインデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	騰 落	率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首)	円	%		%	%	%	%
2015年10月26日	20,298	—	146.54	—	95.0	2.5	2.5
10月末	20,292	△ 0.0	146.24	△ 0.2	94.9	2.5	2.5
11月末	20,519	1.1	147.75	0.8	95.5	1.9	2.5
12月末	20,034	△ 1.3	143.94	△ 1.8	94.2	3.1	2.5
2016年1月末	18,258	△10.1	131.12	△10.5	93.8	3.6	2.6
2月末	17,503	△13.8	125.38	△14.4	93.1	4.3	2.6
3月末	18,514	△ 8.8	132.46	△ 9.6	93.8	3.4	2.7
4月末	18,430	△ 9.2	131.41	△10.3	94.2	3.1	2.6
5月末	18,640	△ 8.2	132.26	△ 9.7	93.8	3.5	2.6
6月末	16,856	△17.0	119.44	△18.5	94.7	2.3	2.9
7月末	17,922	△11.7	126.82	△13.5	94.9	2.2	2.8
8月末	17,868	△12.0	126.23	△13.9	94.8	2.4	2.7
9月末	17,439	△14.1	123.09	△16.0	94.9	2.3	2.7
(期 末)							
2016年10月26日	17,803	△12.3	125.37	△14.4	95.5	1.9	2.7

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2015年10月27日～2016年10月26日)

基準価額の推移

期間の初め20,298円の基準価額は、期間末に17,803円となり、騰落率は△12.3%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

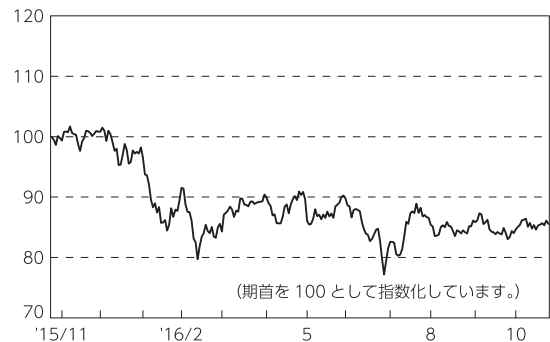
<値上がり要因>

- ・原油価格の上昇や、米国における追加利上げ観測の後退などから投資家のリスク許容度が改善したこと。(2016年2月中旬～4月中旬)
- ・英国の欧州連合（EU）離脱選択を受けて各国政策当局などによる追加経済対策への期待が高まったことや、米国雇用統計の改善を背景に米国経済に対する楽観的な見方が強まったこと。

<値下がり要因>

- ・石油輸出機構（OPEC）による減産の見送りを受けた原油安の進行や、米国や中国における市場予想を下回る内容の経済指標の発表などを背景とした世界経済の成長鈍化が懸念されたこと。(2015年12月～2016年2月中旬)
- ・投資家によるリスク回避の円買い需要などを背景に、円高／アメリカドル安、円高／ユーロ安となったこと。

基準価額の推移

MSCI-KOKUSAIインデックス
(円ヘッジなし・円ベース) (指数化) の推移

（海外株式市況）

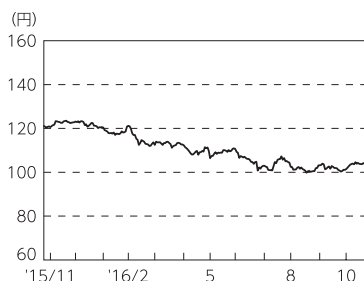
海外株式市場では、期間の初めと比べて、米国の株価は上昇、欧州各国市場の株価は概して下落しました。

期間の初めから2015年11月にかけては、米国の市場予想を上回る経済指標の発表を背景とした米国連邦準備制度理事会（FRB）による利上げ観測や原油などの資源価格の下落を背景に株価が下落する局面があったものの、米国経済に対する楽観的な見方が強まったことや、欧州や中国の中央銀行による追加金融緩和への期待が高まったことなどから、米国と欧州各国の株価は概して上昇しました。12月から2016年2月中旬にかけては、OPECによる減産の見送りを受けた原油安の進行や、米国や中国における市場予想を下回る内容の経済指標の発表などを背景とした世界経済の成長鈍化懸念などから、米国や欧州各国の株価は総じて下落しました。2月中旬から4月中旬にかけては、原油価格の上昇や、米国における追加利上げ観測の後退などから投資家のリスク許容度が改善し、米国や欧州各国の株価は総じて上昇しました。4月下旬から6月下旬にかけては、ギリシャ金融支援協議の進展などが株価の上昇要因となったものの、米国や中国の市場予想を下回る内容の経済指標の発表や、一部の欧米企業による市場予想を下回る業績発表、英国によるEU離脱の影響懸念などを背景に、米国や欧州各国の株価は総じて下落しました。7月上旬から期間末にかけては、8月下旬のFRB議長による年内の追加利上げを示唆する発言が株価の重しとなったものの、英国のEU離脱選択を受けて各国政策当局などによる追加経済対策への期待が高まったことや、米国雇用統計の改善を背景に米国経済に対する楽観的な見方が強まったことなどから、米国や欧州各国の株価は総じて上昇しました。

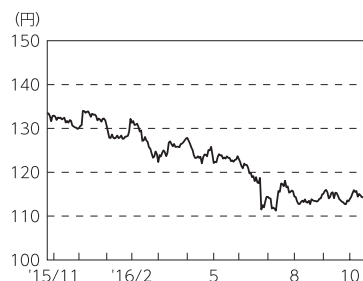
（為替市況）

期間中における主要通貨（対円）は、右記の推移となりました。

円／アメリカドルの推移



円／ユーロの推移



ポートフォリオ

ベンチマークが採用している国の株式の中からリスクコントロールモデルを使用して構築したポートフォリオで、運用を行ないました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ない、現物株式と株式先物取引を合計した実質の株式組入比率を高位に保ちました。

なお、外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、12.3%の値下がりとなり、ベンチマークである「MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジなし・円ベース）」の下落率14.4%を概ね2.2%上回ることであります。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・ 現物株式の組入れに基づく要因が寄与したこと。
- ・ 株式先物の組入れに基づく要因が寄与したこと。
- ・ 株式配当金を受け取ったこと。

<マイナス要因>

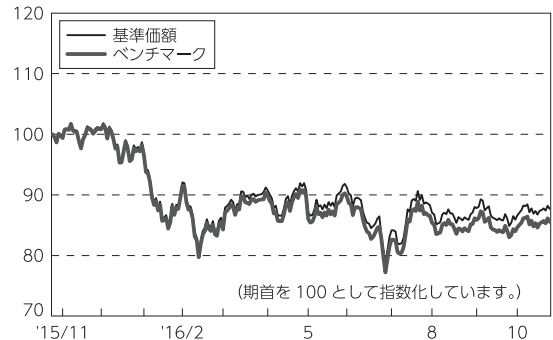
- ・ 海外カストディ・フィーや売買手数料などの諸費用を支払ったこと。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークに連動する投資成果をめざして、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した現物株式ポートフォリオへの投資を継続するとともに、現物株式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持する方針です。また、外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行わず、高水準の外貨エクスポージャーを維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年10月27日～2016年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 1	% 0.007	(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)	(1)	(0.005)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(リミテッドパートナー(出資金))	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.004	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.004)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	5	0.026	(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、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
(保 管 費 用)	(5)	(0.025)	
(そ の 他)	(0)	(0.001)	
合 計	7	0.037	
期中の平均基準価額は、18,522円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年10月27日～2016年10月26日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 4,776 (1,323)	千アメリカドル 24,561 (4,259)	百株 3,375 (1,865)	千アメリカドル 15,854 (9,526)
	カナダ	750 (△ 4)	千カナダドル 2,353 (30)	266 (14)	千カナダドル 334 (115)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	394 (44)	1,574 (△ 21)	184 (ー)	876 (63)
	イタリア	993 (1,460)	405 (112)	674 (490)	150 (72)
	フランス	382 (133)	1,305 (155)	612 (90)	520 (126)
	オランダ	339 (302)	585 (545)	158 (177)	214 (391)
	スペイン	555 (13,585)	376 (304)	74 (16,129)	58 (422)
	ベルギー	16 (△ 11)	151 (△ 189)	15 (ー)	43 (7)
	オーストリア	15 (ー)	40 (△ 2)	ー	ー
	ルクセンブルク	19 (389)	34 (89)	ー (229)	ー (54)
	フィンランド	479	358	ー	ー
	アイルランド	48	337	3	28
	ポルトガル	57	17	7,500	22
	イギリス	4 (44)	15 (149)	ー	ー
	スイス	ー	ー	40	25
	イギリス	6,338 (47,326)	千イギリスポンド 3,033 (149)	1,416 (64,060)	千イギリスポンド 1,515 (827)
	スイス	264 (318)	千スイスフラン 1,675 (△ 210)	542 (ー)	959 (18)
	スウェーデン	197 (ー)	千スウェーデンクローナ 3,174 (△ 99)	16	千スウェーデンクローナ 155

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ノルウェー	百株 138 (ー)	千ノルウェークローネ 2,377 (△ 24)	百株 140	千ノルウェークローネ 798
	デンマーク	69 (30)	千デンマーククローネ 3,419 (70)	44 (6)	千デンマーククローネ 1,914 (70)
	オーストラリア	2,100 (1,252)	千オーストラリアドル 1,909 (436)	592 (516)	千オーストラリアドル 554 (185)
	ニュージーランド	464	千ニュージーランドドル 207	ー	千ニュージーランドドル ー
	香港	2,813 (187)	千香港ドル 3,185 (ー)	448	千香港ドル 1,103
	シンガポール	902 (828)	千シンガポールドル 183 (12)	1,408 (828)	千シンガポールドル 71 (19)
	イスラエル	88	千イスラエルシェケル 491	0.78	千イスラエルシェケル 65

(注) 金額は受け渡し代金。

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

投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口	口	千アメリカドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	1,490	—	—
	PROLOGIS INC	670	—	—
	AMERICAN TOWER CORP	510	—	—
	VEREIT INC	5,590	—	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	340	—	—
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	4,460	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	—	260	22
	COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	—	3,071	59
	CROWN CASTLE INTL CORP	460	330	28
	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	220	210	16
	EQUINIX INC	270	—	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	(31)	(9)	—
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	580	—	—
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST(N)	—	777	15
	WELLTOWER INC	(777)	(16)	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	690	45	—
	IRON MOUNTAIN INC	2,020	29	—
	IRON MOUNTAIN INC	2,230	72	—
	MACERICH CO/THE	—	—	30
	MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	—	380	—
	PLUM CREEK TIMBER CO	1,500	134	—
	PUBLIC STORAGE	—	—	(139)
	SIMON PROPERTY GROUP INC	120	30	—
	VENTAS INC	270	55	25
	VORNADO REALTY TRUST	610	42	—
	WEYERHAEUSER CO	490	42	—
	WEYERHAEUSER CO	760	23	—
	小 計	(5,452)	(139)	—
	小 計	23,280	1,145	197
	小 計	(6,260)	(165)	(139)
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	フランス			
	FONCIERE DES REGIONS	—	—	—
	GECINA SA	(—)	(△0.714)	—
	KLEPIERRE	390	49	—
	小 計	1,590	62	—
	小 計	1,980	111	—
	小 計	(—)	(△0.714)	—
	ユ ー ロ 計	1,980	111	—
	ユ ー ロ 計	(—)	(△0.714)	—
	オーストラリア		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル
	GOODMAN GROUP	—	—	28
	GPT GROUP	11,720	63	—
	小 計	11,720	63	28
	香港		千香港ドル	千香港ドル
	LINK REIT	—	—	183
	小 計	—	—	183

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	12,900 (-)	30 (△0.069)	- (-)	- (0.099)
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT-RTS	-	-	- (1,462)	- (0.099)
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT-RTS(N)	- (1,462)	- (0.099)	-	-
	CAPITALAND MALL TRUST	24,500	49	-	-
	SUNTEC REIT	- (-)	- (△0.444)	-	-
	小 計	37,400 (1,462)	80 (△0.414)	- (1,462)	- (0.198)

(注) 金額は受け渡し代金。
(注) ()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

リミテッドパートナー(出資金)

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
		5,400	52	-	-

(注) 金額は受け渡し代金。

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 10,404	百万円 10,850	百万円 -	百万円 -

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

○株式売買比率

(2015年10月27日～2016年10月26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	7,082,077千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	68,258,745千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.10

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2015年10月27日～2016年10月26日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2016年10月26日現在)

外国株式

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
3M CO	133	132	2,200	229,218	資本財
ABBVIE INC	363	354	2,179	227,097	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABBOTT LABORATORIES	319	318	1,280	133,426	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	132	138	1,593	166,058	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	69	102	1,253	130,566	保険
ACUITY BRANDS INC	8	9	224	23,391	資本財
ADVANCE AUTO PARTS INC	16	16	231	24,091	小売
ADT CORP/THE	35	—	—	—	商業・専門サービス
AES CORP	137	137	165	17,190	公益事業
AETNA INC	76	76	853	88,962	ヘルスケア機器・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	—	34	140	14,664	資本財
AFLAC INC	94	90	633	65,963	保険
AFFILIATED MANAGERS GROUP	12	12	172	18,018	各種金融
AGCO CORP	16	16	86	8,996	資本財
AGILENT TECHNOLOGIES INC	70	70	305	31,775	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	42	45	602	62,799	素材
AIRGAS INC	14	—	—	—	素材
ALLEGHANY CORP	4	3	169	17,620	保険
ALLSTATE CORP	93	81	550	57,356	保険
ALTRIA GROUP INC	417	429	2,778	289,466	食品・飲料・タバコ
ALCOA INC	261	106	290	30,315	素材
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	12	12	259	27,083	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	21	52	195	20,372	公益事業
ALBEMARLE CORP	16	25	208	21,725	素材
ALLY FINANCIAL INC	91	91	178	18,574	各種金融
AMPHENOL CORP-CL A	59	64	420	43,805	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERIPRISE FINANCIAL INC	40	36	355	37,073	各種金融
AMEREN CORPORATION	57	51	254	26,469	公益事業
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	290	248	1,507	157,040	保険
AMERICAN EXPRESS CO	193	179	1,195	124,555	各種金融
AMETEK INC	50	50	227	23,677	資本財
AMERICAN ELECTRIC POWER	106	106	678	70,727	公益事業
AMERICAN WATER WORKS CO INC	40	40	297	30,989	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	47	40	323	33,701	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	109	121	744	77,549	エネルギー
ANTERO RESOURCES CORP	10	36	93	9,692	エネルギー
AON PLC	56	57	624	65,097	保険
APACHE CORP	82	82	502	52,336	エネルギー
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	139	130	553	57,657	食品・飲料・タバコ
ARROW ELECTRONICS INC	23	23	144	15,060	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	33	33	159	16,629	保険
ARAMARK	31	49	183	19,077	消費者サービス
ASHLAND INC	16	—	—	—	素材
ASSURANT INC	15	15	125	13,110	保険
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	—	16	179	18,673	素材
AT&T INC	1,294	1,349	4,951	515,880	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	—	23	170	17,736	公益事業
AUTOLIV INC	20	20	201	20,970	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	7	6	511	53,315	小売
AUTONATION INC	16	16	75	7,874	小売
AVERY DENNISON CORP	22	22	171	17,839	素材

銘	柄	期首(前期末)	当		期		業	種	等	
		株	数	株	数	評				価
						外貨建金額				邦貨換算金額
(アメリカ)		百株		百株		千アメリカドル		千円		
AVNET INC		34		34		146		15,287	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD		21		21		120		12,600	保険	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		21		41		107		11,247	素材	
BALL CORP		31		36		292		30,491	素材	
BANK OF AMERICA CORP		2,226		2,243		3,750		390,738	銀行	
BAXTER INTERNATIONAL INC		115		109		538		56,075	ヘルスケア機器・サービス	
BAKER HUGHES INC		96		96		525		54,765	エネルギー	
CR BARD INC		15		15		338		35,245	ヘルスケア機器・サービス	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP		236		235		1,021		106,397	各種金融	
BAXALTA INC		115		—		—		—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BB&T CORP		154		175		681		70,997	銀行	
BECTON DICKINSON AND CO		46		46		787		82,063	ヘルスケア機器・サービス	
BEST BUY CO INC		65		65		255		26,602	小売	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B		244		262		3,757		391,467	各種金融	
BLACKROCK INC		27		26		917		95,536	各種金融	
H&R BLOCK INC		56		56		129		13,442	消費者サービス	
BORGWARNER INC		43		43		151		15,765	自動車・自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP		287		287		644		67,183	ヘルスケア機器・サービス	
BOEING CO/THE		141		131		1,831		190,771	資本財	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO		351		364		1,806		188,216	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO		—		24		157		16,407	ソフトウェア・サービス	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B		22		50		227		23,751	食品・飲料・タバコ	
BUNGE LTD		31		31		190		19,890	食品・飲料・タバコ	
CARMAX INC		48		42		217		22,650	小売	
CARDINAL HEALTH INC		72		71		532		55,526	ヘルスケア機器・サービス	
CATERPILLAR INC		121		126		1,071		111,651	資本財	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		118		116		876		91,304	各種金融	
CARNIVAL CORP		84		79		373		38,894	消費者サービス	
CAMERON INTERNATIONAL CORP		42		—		—		—	エネルギー	
CALPINE CORP		80		80		98		10,210	公益事業	
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A		42		—		—		—	メディア	
CABOT OIL & GAS CORP		90		114		237		24,694	エネルギー	
CAMPBELL SOUP CO		42		42		225		23,466	食品・飲料・タバコ	
CBRE GROUP INC		66		66		184		19,219	不動産	
CBS CORP-CLASS B NON VOTING		97		94		527		54,935	メディア	
CENTENE CORP		22		37		246		25,670	ヘルスケア機器・サービス	
CELANESE CORP-SERIES A		32		32		234		24,449	素材	
CENTERPOINT ENERGY INC		81		81		184		19,229	公益事業	
CENTURYLINK INC		126		126		358		37,392	電気通信サービス	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		48		48		123		12,904	素材	
CHUBB CORP		50		—		—		—	保険	
CHURCH & DWIGHT CO INC		29		59		285		29,721	家庭用品・パーソナル用品	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		6		6		277		28,949	消費者サービス	
CHEVRON CORP		397		412		4,156		433,062	エネルギー	
CHESAPEAKE ENERGY CORP		112		—		—		—	エネルギー	
CHICAGO BRIDGE & IRON CO NV		24		—		—		—	資本財	
CIT GROUP INC		34		45		164		17,101	銀行	
CIGNA CORP		54		55		693		72,258	ヘルスケア機器・サービス	
CITIGROUP INC		643		641		3,179		331,195	銀行	
CIMAREX ENERGY CO		20		20		268		27,969	エネルギー	
CITIZENS FINANCIAL GROUP		91		112		296		30,901	銀行	
CLOROX COMPANY		27		27		327		34,084	家庭用品・パーソナル用品	
CMS ENERGY CORP		52		61		255		26,616	公益事業	
CONCHO RESOURCES INC		23		30		406		42,352	エネルギー	
COLGATE-PALMOLIVE CO		181		186		1,332		138,849	家庭用品・パーソナル用品	
CONOCOPHILLIPS		259		269		1,128		117,562	エネルギー	
COACH INC		58		62		224		23,346	耐久消費財・アパレル	
COMERICA INC		33		33		174		18,132	銀行	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	株数	評価額	価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
COMPUTER SCIENCES CORP	34	—	—	—	—	ソフトウェア・サービス
CONAGRA FOODS INC	97	89	428	44,656	—	食品・飲料・タバコ
CONSOL ENERGY INC	52	—	—	—	—	エネルギー
COCA-COLA CO/THE	876	902	3,839	399,980	—	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA ENTERPRISES	44	—	—	—	—	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	63	63	464	48,385	—	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	37	37	625	65,162	—	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	258	243	558	58,217	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	19	19	100	10,456	—	エネルギー
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	58	—	—	—	—	エネルギー
CORE LABORATORIES N.V.	7	10	112	11,760	—	エネルギー
COLUMBIA PIPELINE GROUP	63	—	—	—	—	エネルギー
COTY INC-CL A	—	100	231	24,075	—	家庭用品・パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	28	28	153	16,018	—	素材
CSX CORP	209	209	645	67,245	—	運輸
CUMMINS INC	36	36	463	48,337	—	資本財
CVS HEALTH CORP	239	239	2,090	217,797	—	食品・生活必需品小売り
DAVITA INC	39	39	229	23,914	—	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	23	29	179	18,666	—	消費者サービス
DANAHER CORP	133	134	1,060	110,530	—	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	85	110	449	46,865	—	エネルギー
DEERE & CO	66	57	494	51,467	—	資本財
DELTA AIR LINES INC	42	42	176	18,396	—	運輸
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	62	60	385	40,116	—	自動車・自動車部品
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	—	47	221	23,106	—	ソフトウェア・サービス
DICK'S SPORTING GOODS INC	21	21	116	12,105	—	小売
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	93	93	526	54,801	—	各種金融
DOMINO'S PIZZA INC	—	10	168	17,521	—	消費者サービス
DOMINION RESOURCES INC/VA	121	134	987	102,903	—	公益事業
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	62	62	428	44,600	—	小売
DOVER CORP	36	36	247	25,775	—	資本財
DOW CHEMICAL CO/THE	243	246	1,333	138,917	—	素材
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	41	41	362	37,807	—	食品・飲料・タバコ
DR HORTON INC	69	79	228	23,819	—	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	36	36	347	36,210	—	公益事業
DU PONT (E. I.) DE NEMOURS	190	191	1,330	138,590	—	素材
DUKE ENERGY CORP	149	150	1,180	123,025	—	公益事業
DUN & BRADSTREET CORP	8	8	109	11,427	—	商業・専門サービス
EATON VANCE CORP	28	28	107	11,218	—	各種金融
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	29	33	225	23,485	—	素材
EATON CORP PLC	97	97	616	64,214	—	資本財
ECOLAB INC	58	56	659	68,733	—	素材
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	21	46	533	55,544	—	ヘルスケア機器・サービス
EDISON INTERNATIONAL	70	70	505	52,669	—	公益事業
EMERSON ELECTRIC CO	141	138	693	72,198	—	資本財
EMC CORP/MASS	418	—	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ENTERGY CORP	34	38	278	29,048	—	公益事業
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	13	13	100	10,481	—	家庭用品・パーソナル用品
ENSCO PLC-CL A	45	—	—	—	—	エネルギー
ENERGEN CORP	15	—	—	—	—	エネルギー
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	36	36	78	8,164	—	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	113	120	1,114	116,064	—	エネルギー
EQUIFAX INC	26	26	343	35,791	—	商業・専門サービス
EQT CORP	34	38	252	26,275	—	エネルギー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	47	47	408	42,556	—	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	10	10	204	21,310	—	保険
EXXON MOBIL CORP	887	908	7,875	820,521	—	エネルギー
EXELON CORP	185	196	647	67,474	—	公益事業

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千円		
FEDEX CORP		57	57	989	103,135	運輸
FIRST REPUBLIC BANK/CA		23	30	231	24,140	銀行
FIRSTENERGY CORP		82	89	302	31,505	公益事業
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO		61	69	523	54,512	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		17	21	364	38,006	ソフトウェア・サービス
FLOWSERVE CORP		24	29	128	13,341	資本財
FLUOR CORP		32	32	159	16,607	資本財
FMC TECHNOLOGIES INC		44	44	143	14,911	エネルギー
FMC CORP		32	32	154	16,127	素材
FNF GROUP		58	58	214	22,393	保険
FORD MOTOR COMPANY		784	809	958	99,892	自動車・自動車部品
FOOT LOCKER INC		31	31	210	21,961	小売
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI		31	31	165	17,220	資本財
FORTIVE CORP		—	67	322	33,618	資本財
NEXTERA ENERGY INC		92	100	1,262	131,485	公益事業
FRANKLIN RESOURCES INC		79	79	278	29,002	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC		229	257	271	28,299	素材
FREESCALE SEMICONDUCTOR LTD		20	—	—	—	半導体・半導体製造装置
GAMESTOP CORP-CLASS A		24	—	—	—	小売
GAP INC/THE		51	51	135	14,155	小売
TEGNA INC		43	43	85	8,949	メディア
GENERAL MOTORS CORP		306	302	956	99,667	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO		35	32	289	30,176	小売
GENERAL ELECTRIC CO		2,126	2,015	5,773	601,467	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP		59	57	873	90,961	資本財
GENERAL MILLS INC		131	125	767	80,006	食品・飲料・タバコ
GLOBAL PAYMENTS INC		—	32	234	24,426	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC		83	82	1,456	151,760	各種金融
WW GRAINGER INC		13	13	267	27,863	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP		94	83	355	36,984	保険
HALLIBURTON CO		185	186	888	92,601	エネルギー
HANESBRANDS INC		88	88	209	21,874	耐久消費財・アパレル
HARMAN INTERNATIONAL		13	16	125	13,030	耐久消費財・アパレル
HARRIS CORP		21	28	256	26,743	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HARLEY-DAVIDSON INC		48	40	230	24,052	自動車・自動車部品
HCA HOLDINGS INC		73	69	559	58,239	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE		34	33	325	33,887	食品・飲料・タバコ
HESS CORP		55	60	305	31,816	エネルギー
HELMERICH & PAYNE		21	21	138	14,468	エネルギー
HERC HOLDINGS INC		97	—	—	—	運輸
HP INC		386	386	536	55,918	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS		—	386	834	86,894	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN		111	111	252	26,355	消費者サービス
HONEYWELL INTERNATIONAL INC		157	159	1,737	180,965	資本財
HOME DEPOT INC		279	274	3,389	353,105	小売
HORMEL FOODS CORP		28	66	250	26,148	食品・飲料・タバコ
HOLLYFRONTIER CORP		45	37	92	9,670	エネルギー
HUMANA INC		31	32	572	59,660	ヘルスケア機器・サービス
INTL BUSINESS MACHINES CORP		199	200	3,022	314,876	ソフトウェア・サービス
IHS INC-CLASS A		13	—	—	—	商業・専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS		72	69	771	80,395	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		16	16	217	22,622	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC		87	87	198	20,650	メディア
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC		24	26	703	73,306	各種金融
INVESCO LTD		83	93	277	28,896	各種金融
INTERNATIONAL PAPER CO		79	86	404	42,091	素材
INGERSOLL-RAND PLC		58	58	378	39,478	資本財
INGREDION INC		—	14	193	20,161	食品・飲料・タバコ

銘柄	株数	当期首(前期末)	当期		業種等
			株数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
JARDEN CORP	35	—	—	—	耐久消費財・アパレル
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	22	28	141	14,763	資本財
JM SMUCKER CO/THE	21	25	329	34,314	食品・飲料・タバコ
JOHNSON CONTROLS INC	142	—	—	—	資本財
JOHNSON & JOHNSON	588	602	6,867	715,439	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JONES LANG LASALLE INC	8	8	91	9,521	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	789	801	5,512	574,338	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	76	76	181	18,862	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	23	23	216	22,528	運輸
KEYCORP	176	226	314	32,769	銀行
KELLOGG CO	59	57	423	44,129	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	79	78	896	93,400	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	383	415	886	92,354	エネルギー
KOHL'S CORP	44	44	191	19,953	小売
KROGER CO	196	196	607	63,341	食品・生活必需品小売り
L-3 COMMUNICATIONS HOLDINGS	15	17	259	26,985	資本財
LAS VEGAS SANDS CORP	90	94	549	57,282	消費者サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	21	21	298	31,074	ヘルスケア機器・サービス
LEGGETT & PLATT INC	26	33	150	15,730	耐久消費財・アパレル
LEGG MASON INC	21	—	—	—	各種金融
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	57	65	304	31,759	電気通信サービス
LEUCADIA NATIONAL CORP	73	73	136	14,200	各種金融
LENNAR CORP-CL A	36	43	178	18,546	耐久消費財・アパレル
LEAR CORP	15	15	177	18,543	自動車・自動車部品
ELI LILLY & CO	211	217	1,689	176,037	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	58	53	258	26,952	保険
L BRANDS INC	55	53	385	40,213	小売
LINKEDIN CORP - A	24	25	480	50,092	ソフトウェア・サービス
LOCKHEED MARTIN CORP	56	57	1,431	149,081	資本財
LOWE'S COS INC	206	197	1,351	140,823	小売
LOEWS CORP	68	64	265	27,618	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	86	81	650	67,808	素材
M & T BANK CORP	24	30	365	38,113	銀行
MARATHON OIL CORP	140	178	253	26,394	エネルギー
MASTERCARD INC	211	213	2,197	228,937	ソフトウェア・サービス
MACY'S INC	70	70	251	26,236	小売
MANPOWERGROUP INC	19	19	151	15,790	商業・専門サービス
MARSH & MCLENNAN COS	109	113	712	74,224	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	10	13	235	24,574	素材
MASCO CORP	85	75	228	23,829	資本財
MARKEL CORP	—	3	275	28,680	保険
MARATHON PETROLEUM CORP	114	114	498	51,943	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	24	24	151	15,772	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	22	22	218	22,731	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	204	191	2,163	225,363	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	60	58	724	75,491	各種金融
MCKESSON CORP	49	49	778	81,142	ヘルスケア機器・サービス
MDU RESOURCES GROUP INC	41	—	—	—	公益事業
MEDNAX INC	—	22	146	15,268	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	199	200	929	96,859	保険
SUNEDISON INC	54	—	—	—	半導体・半導体製造装置
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	39	39	322	33,628	食品・飲料・タバコ
T-MOBILE US INC	63	—	—	—	電気通信サービス
MERCK & CO. INC.	601	606	3,756	391,386	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDTRONIC PLC	300	306	2,524	262,975	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	6	6	241	25,123	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM RESORTS INTERNATIONAL	75	97	254	26,518	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	45	40	194	20,231	耐久消費財・アパレル

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
MICRON TECHNOLOGY INC	232	232	408	42,571	半導体・半導体製造装置
MOLSON COORS BREWING CO -B	31	40	441	45,948	食品・飲料・タバコ
MOHAWK INDUSTRIES INC	13	14	276	28,818	耐久消費財・アパレル
MOSAIC CO/THE	66	74	184	19,195	素材
MORGAN STANLEY	311	317	1,057	110,190	各種金融
MONSANTO CO	101	95	971	101,212	素材
MOODY'S CORP	39	39	402	41,937	各種金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	41	33	251	26,229	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MOBILEYE NV	—	35	134	14,034	ソフトウェア・サービス
MSCI INC	—	20	166	17,333	各種金融
MURPHY OIL CORP	42	37	106	11,119	エネルギー
NABORS INDUSTRIES LTD	58	—	—	—	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	82	82	297	31,007	エネルギー
NETSUITE INC	7	8	85	8,921	ソフトウェア・サービス
NEWFIELD EXPLORATION CO	—	40	169	17,677	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	112	112	413	43,036	素材
NEWELL BRANDS INC	58	99	516	53,766	耐久消費財・アパレル
NIKE INC -CL B	145	294	1,502	156,509	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	—	65	149	15,548	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	69	78	357	37,261	商業・専門サービス
NORDSTROM INC	28	28	154	16,074	小売
NORTHROP GRUMMAN CORP	39	38	843	87,914	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	67	65	609	63,451	運輸
NOBLE ENERGY INC	86	94	325	33,898	エネルギー
EVERSOURCE ENERGY	69	69	374	39,033	公益事業
NRG ENERGY INC	76	76	83	8,749	公益事業
NUCOR CORP	63	71	336	35,102	素材
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	96	96	138	14,452	銀行
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	162	167	1,247	129,966	エネルギー
OCEANEERING INTL INC	20	—	—	—	エネルギー
OGE ENERGY CORP	35	46	143	14,963	公益事業
OMNICOM GROUP	54	54	433	45,192	メディア
ONEOK INC	41	45	225	23,512	エネルギー
ORACLE CORP	744	686	2,633	274,401	ソフトウェア・サービス
P G & E CORP	103	105	643	67,010	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	27	30	365	38,053	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	19	19	157	16,430	素材
PARTNERRE LTD	10	—	—	—	保険
PALO ALTO NETWORKS INC	14	19	284	29,655	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEPSICO INC	314	317	3,399	354,138	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	40	40	224	23,407	資本財
PERRIGO CO PLC	30	30	274	28,548	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PEPCO HOLDINGS INC	45	—	—	—	公益事業
PFIZER INC	1,296	1,327	4,286	446,529	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PVH CORP	20	20	214	22,318	耐久消費財・アパレル
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	327	340	3,291	342,882	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	114	101	816	85,103	エネルギー
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	32	35	657	68,454	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	21	21	165	17,227	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	111	108	1,009	105,184	銀行
RALPH LAUREN CORP	13	13	133	13,910	耐久消費財・アパレル
POLARIS INDUSTRIES INC	12	14	111	11,629	耐久消費財・アパレル
PPL CORP	136	145	491	51,181	公益事業
PPG INDUSTRIES INC	58	58	535	55,822	素材
PRECISION CASTPARTS CORP	30	—	—	—	資本財
PROCTER & GAMBLE CO	571	561	4,885	509,011	家庭用品・パーソナル用品
PRAXAIR INC	61	61	733	76,436	素材

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外貨建金額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		58	64	340	35,476	保険
PROGRESSIVE CORP		123	123	393	41,004	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		94	94	786	81,967	保険
PUMA BIOTECHNOLOGY INC		5	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PULTE GROUP INC		68	68	127	13,329	耐久消費財・アパレル
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP		101	109	451	47,085	公益事業
QUANTA SERVICES INC		46	—	—	—	資本財
QUEST DIAGNOSTICS		31	31	259	26,999	ヘルスケア機器・サービス
QUINTILES TMS HOLDINGS INC		19	36	271	28,248	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RACKSPACE HOSTING INC		25	—	—	—	ソフトウェア・サービス
RANGE RESOURCES CORP		40	40	145	15,143	エネルギー
RAYTHEON COMPANY		67	64	898	93,644	資本財
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		25	25	146	15,249	各種金融
REGIONS FINANCIAL CORP		297	297	316	32,952	銀行
REYNOLDS AMERICAN INC		183	186	1,023	106,590	食品・飲料・タバコ
RENAISSANCE HOLDINGS LTD		8	8	110	11,514	保険
REPUBLIC SERVICES INC		51	51	259	27,070	商業・専門サービス
RESMED INC		33	33	216	22,515	ヘルスケア機器・サービス
REALOGY HOLDINGS CORP		31	31	76	7,956	不動産
RITE AID CORP		198	229	160	16,745	食品・生活必需品小売り
ROCKWELL AUTOMATION INC		29	29	349	36,369	資本財
ROBERT HALF INTL INC		23	23	91	9,565	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC		19	21	368	38,377	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		35	35	249	26,033	消費者サービス
ROCKWELL COLLINS INC.		26	29	239	24,961	資本財
WESTROCK CO		59	59	279	29,153	素材
SALESFORCE.COM INC		125	141	1,061	110,571	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD		270	306	2,454	255,742	エネルギー
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A		19	19	127	13,243	メディア
SCANA CORP		24	31	224	23,414	公益事業
SCHWAB (CHARLES) CORP		246	258	820	85,509	各種金融
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		31	39	148	15,480	資本財
SEALED AIR CORP		43	43	184	19,264	素材
SEMPRA ENERGY		46	50	539	56,171	公益事業
SERVICENOW INC		30	36	289	30,174	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE		17	16	417	43,517	素材
SIGNET JEWELERS LTD		16	16	134	14,035	小売
SMITH (A.O.) CORP		—	30	141	14,705	資本財
SNAP-ON INC		12	12	195	20,414	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO		41	34	142	14,859	運輸
SOUTHWESTERN ENERGY CO		88	104	112	11,697	エネルギー
SOUTHERN CO		195	204	1,040	108,351	公益事業
SPECTRA ENERGY CORP		148	152	639	66,657	エネルギー
SPRINT CORP		151	173	112	11,748	電気通信サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC		31	31	364	37,987	資本財
STRYKER CORP		75	74	843	87,886	ヘルスケア機器・サービス
STATE STREET CORP		87	87	617	64,303	各種金融
STARWOOD HOTELS & RESORTS		35	—	—	—	消費者サービス
ST JUDE MEDICAL INC		61	61	483	50,375	ヘルスケア機器・サービス
SUNTRUST BANKS INC		110	110	499	52,079	銀行
SYSCO CORP		130	120	572	59,683	食品・生活必需品小売り
SYNCHRONY FINANCIAL		34	182	522	54,457	各種金融
TARGET CORP		128	123	837	87,284	小売
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A		10	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TD AMERITRADE HOLDING CORP		50	59	205	21,381	各種金融
TESORO CORP		28	28	233	24,325	エネルギー
TEXTRON INC		54	54	211	22,078	資本財
TERADATA CORP		30	—	—	—	ソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期				業 種 等
		株 数	株 数	評 価	額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
THE WALT DISNEY CO.	342	337	3,127	325,855	メディア	
COOPER COS INC/THE	10	10	188	19,676	ヘルスケア機器・サービス	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	83	86	1,274	132,789	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
TIFFANY & CO	29	29	218	22,784	小売	
TIME WARNER INC	176	171	1,494	155,709	メディア	
TIME WARNER CABLE	59	—	—	—	メディア	
TJX COMPANIES INC	144	145	1,068	111,310	小売	
TOLL BROTHERS INC	31	37	106	11,115	耐久消費財・アパレル	
TORCHMARK CORP	31	22	140	14,588	保険	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	36	36	175	18,269	ソフトウェア・サービス	
TRAVELERS COS INC/THE	67	63	692	72,173	保険	
TRANSDIGM GROUP INC	11	11	319	33,239	資本財	
TWITTER INC	103	122	211	22,045	ソフトウェア・サービス	
TYSON FOODS INC-CL A	64	64	445	46,435	食品・飲料・タバコ	
TE CONNECTIVITY LTD	83	83	517	53,943	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL	87	202	889	92,652	自動車・自動車部品	
UGI CORP	—	35	158	16,492	公益事業	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	35	35	117	12,198	耐久消費財・アパレル	
UNUM GROUP	47	47	168	17,598	保険	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	149	151	1,638	170,734	運輸	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	172	173	1,755	182,840	資本財	
UNION PACIFIC CORP	185	184	1,656	172,559	運輸	
UNITEDHEALTH GROUP INC	202	207	2,987	311,263	ヘルスケア機器・サービス	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	18	20	249	25,969	ヘルスケア機器・サービス	
UNITED RENTALS INC	22	22	172	17,929	資本財	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	46	131	13,749	耐久消費財・アパレル	
US BANCORP	379	377	1,652	172,189	銀行	
VF CORP	72	76	407	42,461	耐久消費財・アパレル	
VANTIV INC - CL-A	24	37	214	22,375	ソフトウェア・サービス	
VALERO ENERGY CORP	107	103	608	63,431	エネルギー	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	24	23	223	23,308	ヘルスケア機器・サービス	
VALSPAR CORP/THE	—	15	161	16,773	素材	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	861	894	4,281	446,000	電気通信サービス	
VISA INC-CLASS A SHARES	414	418	3,433	357,747	ソフトウェア・サービス	
VMWARE INC	18	18	134	13,993	ソフトウェア・サービス	
VOYA FINANCIAL INC	46	46	140	14,678	各種金融	
VULCAN MATERIALS CO	28	28	320	33,403	素材	
WAL-MART STORES INC	342	347	2,411	251,259	食品・生活必需品小売り	
WATERS CORP	18	18	261	27,232	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WABCO HOLDINGS INC	11	11	107	11,207	資本財	
ALLERGAN PLC	83	86	1,952	203,373	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
WASTE MANAGEMENT INC	99	99	622	64,865	商業・専門サービス	
WABTEC CORP	20	20	164	17,116	資本財	
WASTE CONNECTIONS INC	—	38	291	30,358	商業・専門サービス	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	9	—	—	—	素材	
WESTERN UNION CO	104	104	212	22,167	ソフトウェア・サービス	
WELLS FARGO & CO	1,037	1,058	4,837	503,936	銀行	
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	169	201	124	12,962	エネルギー	
ANTHEM INC	56	56	697	72,712	ヘルスケア機器・サービス	
WESTAR ENERGY INC	—	28	164	17,126	公益事業	
WHITING PETROLEUM CORP	31	—	—	—	エネルギー	
WHIRLPOOL CORP	18	18	275	28,742	耐久消費財・アパレル	
WHITEWAVE FOODS CO	35	35	192	20,073	食品・飲料・タバコ	
WILLIAMS COS INC	147	156	455	47,480	エネルギー	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	29	—	—	—	保険	
WEC ENERGY GROUP INC	68	68	398	41,544	公益事業	
WORKDAY INC-CLASS A	20	25	221	23,026	ソフトウェア・サービス	
WR GRACE & CO	—	14	96	10,003	素材	

銘柄	株数	当期				業種等
		株数	株数	評価額	外貨建金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円		
WR BERKLEY CORP	25	20	115	11,999	保険	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	25	25	172	17,956	消費者サービス	
XCEL ENERGY INC	97	115	466	48,599	公益事業	
XEROX CORP	226	197	189	19,777	ソフトウェア・サービス	
XL GROUP PLC	63	—	—	—	保険	
XL GROUP LTD	—	63	214	22,390	保険	
XYLEM INC	43	43	209	21,856	資本財	
YUM! BRANDS INC	92	92	789	82,293	消費者サービス	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	35	44	560	58,380	ヘルスケア機器・サービス	
ZOETIS INC	102	102	509	53,121	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CHENIERE ENERGY INC	50	43	175	18,293	エネルギー	
ACTIVISION BLIZZARD INC	102	128	576	60,087	ソフトウェア・サービス	
ADOBE SYSTEMS INC	105	109	1,198	124,821	ソフトウェア・サービス	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	42	42	249	25,969	ソフトウェア・サービス	
ALTERA CORPORATION	59	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	46	49	596	62,104	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALKERMES PLC	32	32	175	18,269	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	15	15	56	5,845	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	40	32	130	13,603	運輸	
AMAZON.COM INC	83	87	7,337	764,374	小売	
AMGEN INC	160	164	2,595	270,446	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
AMERCO	—	1	50	5,307	運輸	
ANALOG DEVICES INC	64	64	415	43,252	半導体・半導体製造装置	
ANSYS INC	20	20	190	19,840	ソフトウェア・サービス	
APPLE INC	1,220	1,200	14,192	1,478,585	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
APPLIED MATERIALS INC	248	248	716	74,663	半導体・半導体製造装置	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	31	27	216	22,503	保険	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	98	101	884	92,123	ソフトウェア・サービス	
AUTODESK INC	52	44	315	32,859	ソフトウェア・サービス	
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	53	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
BED BATH & BEYOND INC	42	35	143	14,898	小売	
B/E AEROSPACE INC	25	25	153	15,981	資本財	
BIOGEN INC	49	48	1,373	143,107	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	35	35	283	29,520	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
BROADCOM CORP-CL A	117	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
BROADCOM LTD	—	85	1,486	154,857	半導体・半導体製造装置	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	32	32	225	23,507	運輸	
CA INC	67	67	219	22,824	ソフトウェア・サービス	
CADENCE DESIGN SYS INC	—	61	157	16,391	ソフトウェア・サービス	
CDW CORP/DE	—	34	153	15,951	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CDK GLOBAL INC	27	27	147	15,401	ソフトウェア・サービス	
CELGENE CORP	169	169	1,658	172,745	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CERNER CORP	65	65	388	40,437	ヘルスケア機器・サービス	
CHARTER COMMUNICATION-A	17	—	—	—	メディア	
CHECK POINT SOFTWARE TECH	—	29	234	24,458	ソフトウェア・サービス	
CHARTER COMMUNICATION-A	—	47	1,208	125,895	メディア	
CINTAS CORP	20	20	217	22,649	商業・専門サービス	
CISCO SYSTEMS INC	1,083	1,100	3,338	347,785	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	26	34	244	25,421	保険	
CITRIX SYSTEMS INC	36	36	308	32,089	ソフトウェア・サービス	
CME GROUP INC	66	75	774	80,736	各種金融	
COMCAST CORP-CLASS A	451	529	3,416	355,960	メディア	
COMCAST CORP-SPECIAL CL A	85	—	—	—	メディア	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	126	132	669	69,733	ソフトウェア・サービス	
COSTCO WHOLESALE CORP	93	96	1,450	151,150	食品・生活必需品小売り	
DENTSPLY SIRONA INC	29	53	305	31,825	ヘルスケア機器・サービス	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	33	33	86	9,055	メディア	
DISH NETWORK CORP-A	47	47	280	29,193	メディア	

銘柄	株数	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	千アメリカドル	千円	
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	65	56	142	14,859	メディア
DOLLAR TREE INC	48	48	371	38,673	小売
E*TRADE FINANCIAL CORP	58	58	164	17,090	各種金融
EBAY INC	229	245	712	74,198	ソフトウェア・サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	229	229	1,038	108,185	ソフトウェア・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	69	65	539	56,199	ソフトウェア・サービス
ENDO INTERNATIONAL PLC	41	41	89	9,309	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
EXPEDIA INC	22	26	343	35,761	小売
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	153	144	1,013	105,585	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	36	36	183	19,134	運輸
F5 NETWORKS INC	14	14	169	17,646	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	452	506	6,697	697,781	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	61	61	237	24,768	資本財
FISERV INC	52	49	493	51,403	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	165	165	352	36,710	銀行
FIREYE INC	18	—	—	—	ソフトウェア・サービス
FLIR SYSTEMS INC	31	31	93	9,775	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLEX LTD	146	125	169	17,683	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORTINET INC	—	31	95	9,905	ソフトウェア・サービス
FRONTIER COMMUNICATIONS CORP	213	257	105	11,035	電気通信サービス
GARMIN LTD	28	28	141	14,777	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	17	17	150	15,719	ソフトウェア・サービス
GILEAD SCIENCES INC	314	297	2,211	230,421	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	54	54	168	17,604	自動車・自動車部品
ALPHABET INC-CL A	60	64	5,319	554,163	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	65	67	5,477	570,658	ソフトウェア・サービス
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	28	—	—	—	食品・飲料・タバコ
HASBRO INC	21	25	211	22,025	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	16	18	278	29,023	ヘルスケア機器・サービス
HOLOGIC INC	45	57	215	22,400	ヘルスケア機器・サービス
HUDSON CITY BANCORP INC	123	—	—	—	銀行
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	23	20	157	16,427	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	177	242	246	25,690	銀行
IDEXX LABORATORIES INC	—	18	203	21,158	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	29	31	438	45,706	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	53	53	581	60,554	ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	1,002	1,034	3,631	378,294	半導体・半導体製造装置
INTUITIVE SURGICAL INC	8	8	557	58,048	ヘルスケア機器・サービス
INCYTE CORP	33	36	320	33,430	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IONIS PHARMACEUTICALS INC	25	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	13	13	158	16,483	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA-TENCOR CORPORATION	37	31	239	24,962	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	347	340	1,454	151,483	食品・飲料・タバコ
KRAFT HEINZ CO/THE	123	131	1,165	121,427	食品・飲料・タバコ
LAM RESEARCH CORP	32	32	318	33,177	半導体・半導体製造装置
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	135	136	430	44,850	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORP-A	97	97	183	19,089	小売
LIBERTY GLOBAL PLC-A	53	62	200	20,874	メディア
LINEAR TECHNOLOGY CORP	55	49	298	31,131	半導体・半導体製造装置
LIBERTY MEDIA CORP-A	24	—	—	—	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-C	49	—	—	—	メディア
LIBERTY BROADBAND-C	—	21	145	15,117	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	—	29	81	8,472	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	—	19	67	7,003	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	—	49	166	17,313	メディア
LKQ CORP	69	69	230	24,009	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	27	24	134	14,008	耐久消費財・アパレル
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	92	92	121	12,687	半導体・半導体製造装置

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			期首(前期末)	当 期 末	
			株数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	58	58	234	24,396	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	63	73	239	24,959	耐久消費財・アパレル
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	48	77	517	53,935	消費者サービス
IHS MARKIT LTD	—	75	283	29,555	商業・専門サービス
MELCO CROWN ENTERTAINME-ADR	—	41	68	7,163	消費者サービス
T-MOBILE US INC	—	63	316	32,926	電気通信サービス
MEDIVATION INC	33	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MICROSOFT CORP	1,626	1,639	9,998	1,041,626	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	37	46	281	29,278	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	29	29	438	45,729	食品・飲料・タバコ
MYLAN NV	85	107	415	43,258	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	30	25	169	17,663	各種金融
NAVIENT CORP	86	86	114	11,894	各種金融
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	275	245	628	65,431	メディア
NETAPP INC	70	70	238	24,816	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	97	97	251	26,165	メディア
NETFLIX INC	88	92	1,175	122,440	小売
NEWS CORP - CLASS A	75	75	95	9,976	メディア
NORTHERN TRUST CORP	46	46	329	34,358	各種金融
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	29	37	140	14,661	消費者サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	42	58	79	8,314	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	115	115	826	86,142	半導体・半導体製造装置
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	63	637	66,441	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	22	21	601	62,630	小売
PACCAR INC	76	76	421	43,868	資本財
PAYCHEX INC	67	70	393	41,024	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	20	20	90	9,453	ヘルスケア機器・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	63	63	103	10,803	銀行
PRICELINE GROUP INC/THE	10	10	1,604	167,182	小売
QORVO INC	31	31	174	18,192	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	350	324	2,198	228,987	半導体・半導体製造装置
RED HAT INC	40	40	314	32,797	ソフトウェア・サービス
REGENERON PHARMACEUTICALS	16	16	616	64,220	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROSS STORES INC	92	85	541	56,377	小売
SANDISK CORP	46	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SABRE CORP	—	45	116	12,153	ソフトウェア・サービス
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	25	25	297	30,945	電気通信サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	69	69	238	24,898	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEI INVESTMENTS COMPANY	32	32	145	15,159	各種金融
SIRIUS XM HOLDINGS INC	559	425	178	18,556	メディア
SIGMA-ALDRICH	27	—	—	—	素材
SIGNATURE BANK	—	9	115	11,987	銀行
SKYWORKS SOLUTIONS INC	42	42	327	34,164	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	25	28	167	17,436	ソフトウェア・サービス
STARBUCKS CORP	318	322	1,728	180,119	消費者サービス
STERICYCLE INC	17	17	129	13,481	商業・専門サービス
STAPLES INC	137	137	103	10,781	小売
SYMANTEC CORP	139	139	347	36,201	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	32	32	187	19,581	ソフトウェア・サービス
T ROWE PRICE GROUP INC	57	54	360	37,599	各種金融
TESLA MOTORS INC	19	24	501	52,277	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS INC	220	220	1,567	163,350	半導体・半導体製造装置
TOWERS WATSON & CO-CL-A	16	—	—	—	商業・専門サービス
TRIMBLE INC	60	60	173	18,051	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRACTOR SUPPLY COMPANY	29	29	186	19,470	小売
TRIPADVISOR INC	23	23	148	15,421	小売
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	19	19	104	10,898	運輸
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	13	13	326	33,965	小売

銘柄	株数	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	千アメリカドル	千円	
UNITED THERAPEUTICS CORP	9	9	105	10,984	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
URBAN OUTFITTERS INC	20	—	—	—	小売
VERISIGN INC	27	22	176	18,419	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	53	53	418	43,624	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISK ANALYTICS INC	31	31	260	27,110	商業・専門サービス
VIACOM INC-CLASS B	77	77	290	30,212	メディア
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	185	199	1,644	171,294	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP	47	60	324	33,791	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WHOLE FOODS MARKET INC	77	70	202	21,087	食品・生活必需品小売り
WILLIS TOWERS WATSON PLC	—	27	348	36,332	保険
WYNN RESORTS LTD	16	16	158	16,527	消費者サービス
XILINX INC	61	50	255	26,599	半導体・半導体製造装置
YAHOO! INC	182	204	871	90,762	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - A	10	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	20	20	65	6,867	ソフトウェア・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	237	161	16,814	不動産
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	970	970	43	4,496	運輸
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	—	53	322	33,631	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	68,077	68,936	414,172	43,148,489
		602	588	—	<62.3%>
(カナダ)			千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD	46	46	310	24,260	素材
AGRIUM INC	30	30	373	29,098	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	86	91	613	47,880	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	30	30	104	8,177	エネルギー
ARC RESOURCES LTD	79	79	189	14,812	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	19	19	87	6,846	公益事業
BARRICK GOLD CORP	261	261	589	45,978	素材
BANK OF MONTREAL	137	139	1,202	93,771	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	256	261	1,876	146,371	銀行
BAYTEX ENERGY CORP	33	—	—	—	エネルギー
BCE INC	29	29	177	13,844	電気通信サービス
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL IN	67	67	198	15,460	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOMBARDIER INC 'B'	347	347	62	4,878	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	189	189	895	69,889	各種金融
CAE INC	63	63	117	9,167	資本財
CAMECO CORP	78	78	83	6,476	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	82	82	833	65,045	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	240	240	1,049	81,861	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	170	171	1,503	117,277	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	15	15	202	15,809	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	25	25	95	7,447	公益事業
CANADIAN OIL SANDS LTD	111	—	—	—	エネルギー
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	6	147	11,522	素材
CENOVUS ENERGY INC	174	174	357	27,858	エネルギー
CGI GROUP INC - CL A	46	46	294	23,012	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	34	55	134	10,503	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3	4	244	19,070	ソフトウェア・サービス
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	33	31	613	47,871	運輸
CRESCENT POINT ENERGY CORP	73	114	196	15,352	エネルギー
DOLLARAMA INC	29	25	253	19,811	小売
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	—	71	93	7,315	各種金融
ELDORADO GOLD CORP	146	146	70	5,489	素材
EMPIRE CO LTD 'A'	30	30	57	4,516	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	179	210	292	22,811	エネルギー
ENBRIDGE INC	179	199	1,160	90,501	エネルギー
ENERPLUS CORP	46	—	—	—	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4	4	345	26,929	保険

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		125	147	178	13,942	素材
FINNING INTERNATIONAL INC		28	28	70	5,497	資本財
FORTIS INC		47	85	372	29,079	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP		29	38	329	25,720	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC		40	54	185	14,486	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC		179	179	373	29,114	素材
GREAT-WEST LIFECO INC		59	59	201	15,709	保険
HUSKY ENERGY INC		67	68	105	8,251	エネルギー
HYDRO ONE LTD		—	34	84	6,580	公益事業
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC		17	17	87	6,864	保険
IGM FINANCIAL INC		25	25	90	7,051	各種金融
IMPERIAL OIL LTD		69	69	304	23,773	エネルギー
INTER PIPELINE LTD		71	71	202	15,817	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP		30	24	226	17,679	保険
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		134	234	96	7,508	素材
KEYERA CORP		41	41	169	13,235	エネルギー
KINROSS GOLD CORP		250	250	130	10,166	素材
LOBLAW COMPANIES LTD		45	49	330	25,745	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP		399	430	833	65,043	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC		83	83	453	35,377	自動車・自動車部品
MEG ENERGY CORP		27	—	—	—	エネルギー
METRO INC		57	57	241	18,848	食品・生活必需品小売り
METHANEX CORP		23	23	115	9,004	素材
NATIONAL BANK OF CANADA		73	73	342	26,722	銀行
ONEX CORPORATION		19	19	161	12,566	各種金融
OPEN TEXT CORP		30	30	260	20,304	ソフトウェア・サービス
PARAMOUNT RESOURCES LTD -A		10	—	—	—	エネルギー
PEMBINA PIPELINE CORP		62	79	327	25,556	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP		36	36	130	10,162	エネルギー
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN		179	179	398	31,057	素材
POWER CORP OF CANADA		78	78	223	17,469	保険
POWER FINANCIAL CORP		57	57	180	14,119	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		25	53	159	12,446	エネルギー
BLACKBERRY LTD		103	103	100	7,831	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC		43	49	294	22,951	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B		83	83	446	34,804	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA		304	325	2,716	211,902	銀行
SAPUTO INC		50	50	235	18,361	食品・飲料・タバコ
SEVEN GENERATIONS ENERGY -A		—	59	174	13,577	エネルギー
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		83	96	255	19,908	メディア
SILVER WHEATON CORP		86	93	304	23,753	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC		31	31	172	13,459	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC		119	133	588	45,874	保険
SUNCOR ENERGY INC		296	362	1,413	110,283	エネルギー
TELUS CORP		43	43	187	14,614	電気通信サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B		138	138	390	30,491	素材
THOMSON REUTERS CORP		80	80	423	33,044	各種金融
TOURMALINE OIL CORP		40	45	167	13,062	エネルギー
TORONTO-DOMINION BANK		390	406	2,454	191,469	銀行
TRANSALTA CORP		47	—	—	—	公益事業
TRANSCANADA CORP		145	176	1,080	84,278	エネルギー
VERESIN INC		53	53	71	5,556	エネルギー
VERMILION ENERGY INC		18	26	142	11,131	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD		14	14	64	5,031	素材
WESTON (GEORGE) LTD		9	11	127	9,934	食品・生活必需品小売り
YAMANA GOLD INC		196	196	100	7,869	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	8,195	8,659	34,111	2,661,022	
	銘柄 数 < 比 率 >	89	87	—	< 3.8% >	

銘柄	株数	当期首(前期末)	当期		業種等
			株数	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ADIDAS AG	44	41	632	71,649	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE-REG	96	99	1,422	161,190	保険
AXEL SPRINGER SE	9	9	44	5,085	メディア
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	72	71	569	64,558	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	11	11	82	9,303	自動車・自動車部品
BASF SE	193	200	1,610	182,520	素材
BAYER AG	174	181	1,657	187,865	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIERSDORF AG	20	20	161	18,334	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG	37	37	182	20,680	資本財
COMMERZBANK AG	235	235	144	16,422	銀行
CONTINENTAL AG	24	23	409	46,366	自動車・自動車部品
COVESTRO AG	—	13	70	7,969	素材
DAIMLER AG	203	210	1,363	154,470	自動車・自動車部品
DEUTSCHE BOERSE AG	38	—	—	—	各種金融
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	288	303	398	45,182	各種金融
DEUTSCHE POST AG-REG	209	209	592	67,079	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	673	704	1,066	120,799	電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	66	75	229	25,983	不動産
VONOVIA SE	100	100	332	37,647	不動産
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	—	40	280	31,785	各種金融
E.ON SE	405	440	294	33,364	公益事業
EVONIK INDUSTRIES AG	18	35	99	11,244	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	46	46	348	39,452	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG	9	9	53	6,013	運輸
FRESENIUS SE & CO KGAA	84	90	620	70,298	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB SE-PRF	17	17	70	7,998	素材
GEA GROUP AG	32	39	146	16,545	資本財
HANNOVER RUECK SE-REG	13	13	137	15,545	保険
HEIDELBERGCEMENT AG	32	32	277	31,478	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	39	39	465	52,764	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL AG & CO KGAA	20	21	219	24,914	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	—	4	55	6,279	資本財
HUGO BOSS AG -ORD	14	14	80	9,106	耐久消費財・アパレル
INFINEON TECHNOLOGIES AG	247	247	396	44,919	半導体・半導体製造装置
INNOGY SE	—	28	106	12,110	公益事業
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	4	—	—	—	メディア
K+S AG	38	38	71	8,052	素材
LANXESS AG	19	19	113	12,854	素材
LINDE AG	38	41	604	68,538	素材
DEUTSCHE LUFTHANSA	56	56	65	7,385	運輸
MAN SE	6	8	76	8,677	資本財
MERCK KGAA	29	29	280	31,822	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METRO AG	32	41	114	12,947	食品・生活必需品小売り
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	37	36	651	73,805	保険
OSRAM LICHT AG	23	19	103	11,758	資本財
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	34	34	170	19,282	自動車・自動車部品
PROSIEBENSAT. 1 MEDIA SE	48	48	187	21,255	メディア
QIAGEN N.V.	51	51	119	13,487	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	106	106	150	17,059	公益事業
SAP SE	207	216	1,752	198,620	ソフトウェア・サービス
SCHAEFFLER AG-PRF	—	35	48	5,545	自動車・自動車部品
SIEMENS AG-REG	167	168	1,796	203,524	資本財
SYMRISE AG	26	26	164	18,633	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	111	160	58	6,648	電気通信サービス
THYSSENKRUPP AG	74	74	162	18,408	素材
TUI AG	55	—	—	—	消費者サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	29	29	111	12,625	ソフトウェア・サービス
VOLKSWAGEN AG	7	7	103	11,776	自動車・自動車部品

銘柄		株数	期首(前期末)		当期		業種等
			株数	価額	評価	価額	
		株数	株数	外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円		
VOLKSWAGEN AG-PFD		34	40	507	57,559	自動車・自動車部品	
ZALANDO SE		—	17	68	7,748	小売	
小計	株数・金額	4,725	4,979	22,107	2,504,945		
銘柄数<比率>		54	57	—	<3.6%>		
(ユーロ…イタリア)							
ATLANTIA SPA		93	93	213	24,160	運輸	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA		528	—	—	—	銀行	
BANCO POPOLARE SC		55	—	—	—	銀行	
ENEL GREEN POWER SPA		436	—	—	—	公益事業	
ENEL SPA		1,458	1,670	652	73,988	公益事業	
ENI SPA		555	540	738	83,713	エネルギー	
EXOR SPA		17	29	112	12,726	各種金融	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA		96	96	105	11,981	資本財	
UNIPOLSAI SPA		126	185	31	3,560	保険	
ASSICURAZIONI GENERALI		257	258	311	35,349	保険	
INTESA SANPAOLO		2,750	2,922	629	71,332	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA		39	39	176	20,048	耐久消費財・アパレル	
MEDIOBANCA SPA		116	116	79	8,991	銀行	
POSTE ITALIANE SPA		—	102	63	7,143	保険	
PRYSMIAN SPA		30	51	119	13,495	資本財	
SAIPEM SPA		53	1,235	51	5,856	エネルギー	
SNAM SPA		475	594	286	32,493	公益事業	
TELECOM ITALIA SPA		2,077	2,397	191	21,692	電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RSP		1,258	1,258	82	9,300	電気通信サービス	
TERNA SPA		344	344	151	17,212	公益事業	
UBI BANCA SCPA		225	225	57	6,469	銀行	
UNICREDIT SPA		981	1,103	253	28,759	銀行	
小計	株数・金額	11,980	13,268	4,309	488,274		
銘柄数<比率>		21	19	—	<0.7%>		
(ユーロ…フランス)							
ACCOR SA		49	41	143	16,215	消費者サービス	
ADP		6	6	58	6,649	運輸	
AIR LIQUIDE SA		74	84	790	89,545	素材	
ALSTOM		44	35	85	9,652	資本財	
ALCATEL-LUCENT SA		559	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
ARKEMA		16	16	139	15,832	素材	
ATOS SE		16	20	197	22,326	ソフトウェア・サービス	
AXA		404	421	875	99,178	保険	
SOCIETE BIC SA		7	7	93	10,560	商業・専門サービス	
BNP PARIBAS		223	231	1,222	138,505	銀行	
BOLLORE		110	204	61	6,934	運輸	
BOUYGUES SA		42	42	127	14,416	資本財	
BUREAU VERITAS SA		56	56	99	11,219	商業・専門サービス	
CAP GEMINI SA		32	36	300	34,075	ソフトウェア・サービス	
CARREFOUR SA		111	122	296	33,600	食品・生活必需品小売り	
CASINO GUICHARD PERRACHON		13	13	62	7,063	食品・生活必需品小売り	
CHRISTIAN DIOR SE		10	13	229	26,013	耐久消費財・アパレル	
CNP ASSURANCES		35	35	55	6,275	保険	
CREDIT AGRICOLE SA		219	219	217	24,664	銀行	
DANONE		119	130	820	93,026	食品・飲料・タバコ	
DASSAULT SYSTEMES SA		30	27	198	22,534	ソフトウェア・サービス	
EDENRED		39	39	84	9,582	商業・専門サービス	
EIFFAGE		—	11	76	8,718	資本財	
EDF		60	60	60	6,869	公益事業	
ESSILOR INTERNATIONAL		44	44	455	51,579	ヘルスケア機器・サービス	
EUTELSAT COMMUNICATIONS		37	37	66	7,482	メディア	
EURAZEO		9	9	50	5,704	各種金融	
ORANGE S.A.		412	433	635	71,991	電気通信サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	外貨建金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ENGIE	300	325	429	48,686	公益事業
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	87	87	75	8,609	運輸
HERMES INTERNATIONAL	5	6	240	27,213	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	5	5	97	11,041	電気通信サービス
IMERY'S SA	5	8	56	6,374	素材
INGENICO GROUP	11	11	88	10,017	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JC DECAUX SA	11	19	53	6,050	メディア
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	58	60	1,017	115,246	耐久消費財・アパレル
L'OREAL	54	55	915	103,721	家庭用品・パーソナル用品
LAGARDERE S. C. A.	29	29	66	7,575	メディア
LEGRAND SA	56	56	291	33,071	資本財
MICHELIN (CGDE)-B	41	41	410	46,509	自動車・自動車部品
NATIXIS	229	229	105	11,954	銀行
SFR GROUP SA	22	22	56	6,373	電気通信サービス
PERNOD-RICARD SA	42	46	500	56,723	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	75	98	130	14,757	自動車・自動車部品
KERING	15	18	344	39,002	耐久消費財・アパレル
PUBLICIS GROUPE	40	40	249	28,239	メディア
REXEL SA	72	72	93	10,558	資本財
RENAULT SA	41	41	315	35,785	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	4	4	35	4,036	食品・飲料・タバコ
SAFRAN SA	61	67	426	48,278	資本財
SANOFI	250	255	1,748	198,106	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	92	105	415	47,051	資本財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	118	119	743	84,196	資本財
SCOR SE	26	31	93	10,636	保険
SODEXO	19	19	204	23,214	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	150	176	632	71,673	銀行
SUEZ	61	61	87	9,886	公益事業
TECHNIP SA	24	24	149	16,994	エネルギー
THALES SA	23	23	199	22,564	資本財
TOTAL SA	451	488	2,171	246,079	エネルギー
VALEO SA	16	48	259	29,362	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	91	91	181	20,604	公益事業
VINCI SA	104	109	738	83,725	資本財
VIVENDI	253	253	462	52,408	メディア
WENDEL	7	7	78	8,906	各種金融
ZODIAC AEROSPACE	45	45	100	11,337	資本財
小計	株数・金額	5,803	5,614	21,770	2,466,791
	銘柄数<比率>	65	65	—	<3.6%>
(ユーロ…オランダ)					
ABN AMRO GROUP NV-CVA	—	46	95	10,821	銀行
AEGON NV	381	381	150	17,104	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	197	282	582	66,048	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL	50	58	349	39,610	素材
ALTICE NV -A	58	83	142	16,169	メディア
ALTICE NV -B	19	19	33	3,790	メディア
ASML HOLDING NV	75	79	763	86,491	半導体・半導体製造装置
BOSKALIS WESTMINSTER	16	16	52	5,945	資本財
CNH INDUSTRIAL NV	223	223	156	17,679	資本財
DELTA LLOYD NV	36	—	—	—	保険
AIRBUS GROUP SE	126	126	673	76,273	資本財
FERRARI NV	—	31	153	17,395	自動車・自動車部品
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	196	196	116	13,245	自動車・自動車部品
GEMALTO	18	18	102	11,627	ソフトウェア・サービス
HEINEKEN NV	50	50	397	45,052	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV	25	21	155	17,642	食品・飲料・タバコ
ING GROEP NV-CVA	813	851	1,017	115,345	銀行

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		外 貨 建 金 額 邦 貨 換 算 金 額
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
KONINKLIJKE DSM NV		34	38	235	26,668	素材
KONINKLIJKE KPN NV		610	750	220	24,981	電気通信サービス
NN GROUP NV		44	71	200	22,690	保険
OCI NV		20	20	25	2,893	素材
KONINKLIJKE PHILIPS NV		198	198	542	61,448	資本財
RANDSTAD HOLDING NV		28	28	134	15,230	商業・専門サービス
RELX NV		205	205	315	35,781	商業・専門サービス
TNT EXPRESS NV		90	—	—	—	運輸
UNILEVER NV-CVA		343	357	1,394	157,969	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK		12	12	59	6,715	エネルギー
WOLTERS KLUWER		56	69	246	27,942	商業・専門サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	3,935	4,241	8,318	942,565	
	銘 柄 数 < 比 率 >	26	26	—	<1.4%>	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		105	130	178	20,247	運輸
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		41	41	113	12,891	資本財
AENA SA		12	14	202	22,952	運輸
AMADEUS IT GROUP SA		96	96	415	47,068	ソフトウェア・サービス
BANKIA SA		950	950	76	8,633	銀行
BANKINTER SA		139	139	96	10,909	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		1,338	1,423	897	101,679	銀行
BANCO SANTANDER SA		3,036	3,150	1,399	158,550	銀行
BANCO POPULAR ESPANOL		393	758	84	9,540	銀行
BANCO DE SABADELL SA		1,083	1,096	135	15,350	銀行
BANCO SANTANDER SA-RTS		3,036	—	—	—	銀行
CAIXABANK S. A		549	685	185	21,043	銀行
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		110	110	56	6,375	食品・生活必需品小売り
ENDESA SA		68	68	130	14,799	公益事業
ENAGAS		41	56	146	16,630	公益事業
FERROVIAL SA		99	99	186	21,113	資本財
GAS NATURAL SDG SA		77	77	136	15,522	公益事業
GRIFOLS SA		38	68	125	14,176	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA		1,151	1,178	727	82,466	公益事業
INDITEX		227	242	790	89,550	小売
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A		169	169	75	8,600	運輸
MAPFRE SA		208	208	55	6,249	保険
RED ELECTRICA CORPORACION SA		26	104	199	22,588	公益事業
REPSOL SA		219	247	319	36,257	エネルギー
TELEFONICA SA		946	984	908	102,920	電気通信サービス
ZARDOYA OTIS SA		42	44	34	3,899	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	14,211	12,148	7,678	870,017	
	銘 柄 数 < 比 率 >	26	25	—	<1.3%>	
(ユーロ…ベルギー)						
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		169	176	2,003	226,988	食品・飲料・タバコ
PROXIMUS		37	37	99	11,320	電気通信サービス
COLRUYT SA		13	13	67	7,657	食品・生活必需品小売り
DELHAIZE GROUP		24	—	—	—	食品・生活必需品小売り
AGEAS		40	40	135	15,384	保険
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		18	18	149	16,942	各種金融
KBC GROEP NV		55	55	296	33,587	銀行
SOLVAY SA		12	15	166	18,881	素材
TELENET GROUP HOLDING NV		8	12	59	6,779	メディア
UCB SA		27	27	181	20,534	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE		21	21	118	13,416	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	430	419	3,278	371,493	
	銘 柄 数 < 比 率 >	11	10	—	<0.5%>	
(ユーロ…オーストリア)						
ANDRITZ AG		19	19	97	11,041	資本財

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	外貨建金額	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ERSTE GROUP BANK AG	48	64	186	21,169	銀行
IMMOEAST AG-TEMPORARY	161	161	0	0	不動産
IMMOFINANZ AG-TEMPORARY	130	130	0	0	不動産
OMV AG	34	34	98	11,216	エネルギー
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL	27	27	41	4,751	銀行
VOESTALPINE AG	25	25	81	9,282	素材
小計	株数・金額	株数	507	57,462	
銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルク)					
ARCELORMITTAL	229	389	244	27,745	素材
RTL GROUP	9	9	64	7,354	メディア
SES	67	86	165	18,724	メディア
TENARIS SA	93	93	125	14,257	エネルギー
小計	株数・金額	株数	600	68,081	
銘柄数<比率>	4	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…フィンランド)					
ELISA OYJ	25	25	80	9,111	電気通信サービス
FORTUM OYJ	98	98	150	17,099	公益事業
KONE OYJ-B	64	74	324	36,735	資本財
METSO OYJ	24	24	59	6,778	資本財
NESTE OYJ	27	27	105	11,953	エネルギー
NOKIA OYJ	799	1,260	571	64,703	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOKIAN RENKAAT OYJ	29	29	90	10,219	自動車・自動車部品
ORION OYJ-CLASS B	25	25	96	10,917	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ-A SHS	96	96	405	45,915	保険
STORA ENSO OYJ-R SHS	120	120	104	11,810	素材
UPM-KYMMENE OYJ	126	126	265	30,053	素材
WARTSILA OYJ ABP	24	32	129	14,658	資本財
小計	株数・金額	株数	2,382	269,956	
銘柄数<比率>	12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)					
BANK OF IRELAND	5,585	5,585	107	12,151	銀行
CRH PLC	160	190	575	65,195	素材
KERRY GROUP PLC-A	37	33	231	26,181	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC	—	18	171	19,376	消費者サービス
小計	株数・金額	株数	1,084	122,904	
銘柄数<比率>	3	4	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)					
BANCO COMERCIAL PORTUGUES	7,500	—	—	—	銀行
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	492	549	165	18,749	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	93	93	118	13,457	エネルギー
JERONIMO MARTINS	50	50	80	9,166	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	株数	365	41,372	
銘柄数<比率>	4	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…イギリス)					
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	49	169	19,160	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	株数	169	19,160	
銘柄数<比率>	—	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…スイス)					
STMICROELECTRONICS NV	167	127	92	10,454	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額	株数	92	10,454	
銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
ユーロ計	株数・金額	株数	72,663	8,233,481	
銘柄数<比率>	234	234	—	<11.9%>	
(イギリス)					
3I GROUP PLC	204	204	136	17,253	各種金融
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	77	77	190	24,109	食品・飲料・タバコ
ABERDEEN ASSET MGMT PLC	227	227	72	9,222	各種金融

銘柄	柄	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ADMIRAL GROUP PLC		49	49	96	12,223	保険
AGGREKO PLC		60	60	49	6,227	商業・専門サービス
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		—	70	63	8,016	ヘルスケア機器・サービス
AMEC FOSTER WHEELER PLC		88	—	—	—	エネルギー
ANGLO AMERICAN PLC		290	302	337	42,750	素材
ANTOFAGASTA PLC		87	87	47	5,981	素材
ARM HOLDINGS PLC		306	—	—	—	半導体・半導体製造装置
ASTRAZENCA PLC		266	277	1,333	169,023	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHTREAD GROUP PLC		109	109	142	18,064	資本財
AUTO TRADER GROUP PLC		—	233	88	11,180	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC		839	892	400	50,760	保険
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		393	408	1,925	244,073	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC ORD		710	696	376	47,709	資本財
BARCLAYS PLC	3,484	3,640	668	84,772	銀行	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		201	229	107	13,614	耐久消費財・アパレル
BABCOCK INTL GROUP PLC		62	62	63	8,049	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS		—	26	61	7,768	耐久消費財・アパレル
BG GROUP PLC		719	—	—	—	エネルギー
BHP BILLITON PLC		459	459	579	73,466	素材
BP PLC	3,859	4,082	2,021	256,269	エネルギー	
SKY PLC		232	232	187	23,771	メディア
BT GROUP PLC	1,778	1,831	710	90,029	電気通信サービス	
BUNZL PLC		72	72	161	20,521	資本財
BURBERRY GROUP PLC		93	103	150	19,069	耐久消費財・アパレル
CAPITA PLC		153	153	92	11,769	商業・専門サービス
CARNIVAL PLC		36	44	166	21,077	消費者サービス
CENTRICA PLC	1,001	1,190	256	32,561	公益事業	
COCA-COLA HBC AG-CDI		50	50	91	11,554	食品・飲料・タバコ
COBHAM PLC		232	348	50	6,442	資本財
COMPASS GROUP PLC		361	366	538	68,231	消費者サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		28	27	98	12,522	素材
DCC PLC		—	18	121	15,383	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		293	293	103	13,062	保険
DIAGEO PLC		530	551	1,216	154,159	食品・飲料・タバコ
DIXONS CARPHONE PLC		220	220	71	9,007	小売
EASYJET PLC		38	38	35	4,502	運輸
EXPERIAN PLC		205	205	321	40,756	商業・専門サービス
FRESNILLO PLC		51	51	84	10,746	素材
GKN PLC		330	330	103	13,156	自動車・自動車部品
G4S PLC		346	346	78	9,971	商業・専門サービス
GLENCORE PLC	2,408	2,668	656	83,254	素材	
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,027	1,066	1,738	220,334	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
HARGREAVES LANSDOWN PLC		57	57	66	8,461	各種金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC		—	28	52	6,677	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	4,067	4,352	2,725	345,521	銀行	
ICAP PLC		122	122	59	7,565	各種金融
IMI PLC		61	61	61	7,822	資本財
IMPERIAL BRANDS PLC		200	210	825	104,643	食品・飲料・タバコ
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC		57	40	127	16,141	消費者サービス
INVESTEC PLC		131	131	66	8,390	各種金融
INMARSAT PLC		100	100	69	8,818	電気通信サービス
INTERTEK GROUP PLC		35	35	121	15,453	商業・専門サービス
ITV PLC		772	772	131	16,672	メディア
JOHNSON MATTHEY PLC		44	41	144	18,363	素材
KINGFISHER PLC		503	503	180	22,889	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,270	1,270	265	33,602	保険	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	12,081	14,109	780	98,995	銀行	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP		65	65	190	24,093	各種金融

銘柄	株数	当期末	期末		業種等
			評価額	価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	349	349	116	14,823	小売
MELROSE INDUSTRIES PLC	209	—	—	—	資本財
MEGGITT PLC	208	139	59	7,582	資本財
MERLIN ENTERTAINME	155	155	71	9,008	消費者サービス
MONDI PLC	74	74	120	15,214	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	379	492	112	14,235	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	786	822	870	110,301	公益事業
NEXT PLC	29	29	140	17,871	小売
OLD MUTUAL PLC	1,041	1,041	209	26,564	保険
PETROFAC LTD	50	50	45	5,764	エネルギー
PERSIMMON PLC	58	70	118	15,022	耐久消費財・アパレル
PEARSON PLC	177	177	132	16,795	メディア
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	33	102	12,952	各種金融
PRUDENTIAL PLC	541	565	793	100,520	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	22	22	162	20,535	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	136	139	1,009	127,919	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	236	236	345	43,768	商業・専門サービス
REXAM PLC	117	—	—	—	素材
RIO TINTO PLC	270	270	755	95,782	素材
ROYAL MAIL PLC	149	199	97	12,373	運輸
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	572	795	152	19,386	銀行
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	824	937	1,953	247,645	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	514	820	1,790	226,963	エネルギー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	382	434	320	40,678	資本財
RSA INSURANCE GROUP PLC	247	247	138	17,544	保険
SABMILLER PLC	204	—	—	—	食品・飲料・タバコ
SAINSBURY (J) PLC	234	447	107	13,628	食品・生活必需品小売り
SAGE GROUP PLC/THE	220	244	176	22,423	ソフトウェア・サービス
SCHRODERS PLC	22	29	84	10,759	各種金融
SSE PLC	214	214	338	42,887	公益事業
SEVERN TRENT PLC	54	54	127	16,188	公益事業
SHIRE PLC	124	197	965	122,329	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	88	88	127	16,164	資本財
SMITH & NEPHEW PLC	193	193	234	29,669	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD	468	—	—	—	素材
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	54	—	—	—	小売
ST JAMES'S PLACE PLC	110	110	106	13,441	保険
STANDARD LIFE PLC	407	407	138	17,537	保険
STANDARD CHARTERED PLC	540	722	509	64,603	銀行
TATE & LYLE PLC	121	105	81	10,384	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	661	736	105	13,324	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	1,778	1,778	373	47,372	食品・生活必需品小売り
TRAVIS PERKINS PLC	43	58	78	9,895	資本財
TULLOW OIL PLC	199	—	—	—	エネルギー
TUI AG-DI	33	112	115	14,691	消費者サービス
UNILEVER PLC	270	281	979	124,162	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	162	162	151	19,207	公益事業
VODAFONE GROUP PLC	5,596	5,810	1,313	166,457	電気通信サービス
WEIR GROUP PLC/THE	38	38	67	8,552	資本財
WHITBREAD PLC	41	41	153	19,411	消費者サービス
WILLIAM HILL PLC	180	180	52	6,604	消費者サービス
WOLSELEY PLC	50	55	246	31,292	資本財
WORLDPAY GROUP PLC	—	421	118	15,072	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	271	289	492	62,432	メディア
(イギリス…非上場)					
ROLLS-ROYCE HOLDINGS-ENTITL-C(N)	35,499	—	—	—	資本財

銘 柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
		外貨建金額	邦貨換算金額			
(イギリス…非上場)		百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-C(N)		—	19,975	1	253	資本財
小	株 数 ・ 金 額	96,986	85,173	38,533	4,884,542	
計	銘 柄 数 < 比 率 >	109	107	—	<7.1%>	
(スイス)				千スイスフラン		
ABB LTD-REG		462	425	935	97,900	資本財
ACTELION LTD-REG		20	23	332	34,817	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ADECCO GROUP AG-REG		35	35	209	21,891	商業・専門サービス
ARYZTA AG		21	21	91	9,562	食品・飲料・タバコ
BALOISE HOLDING AG - REG		10	10	128	13,497	保険
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		318	411	562	58,890	各種金融
DUFREY AG-REG		—	10	126	13,232	小売
GALENICA AG-REG		—	0.7	68	7,213	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GEBERIT AG-REG		8	8	339	35,557	資本財
GIVAUDAN-REG		2	2	391	41,008	素材
LAFARGEHOLCIM LTD		103	99	533	55,812	素材
JULIUS BAER GROUP LTD		52	52	211	22,184	各種金融
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		10	11	155	16,250	運輸
LONZA GROUP AG-REG		12	12	221	23,197	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA-REG		683	698	5,039	527,461	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG-REG		487	490	3,555	372,119	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG		113	118	769	80,528	耐久消費財・アパレル
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN		148	154	3,520	368,508	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		10	10	202	21,220	資本財
SGS SA-REG		1	1	280	29,401	商業・専門サービス
SIKA AG-BR		0.47	0.47	212	22,211	素材
SONOVA HOLDING AG-REG		11	11	155	16,269	ヘルスケア機器・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG		6	6	164	17,256	保険
SWISSCOM AG-REG		4	5	267	27,977	電気通信サービス
SWISS RE AG		77	74	692	72,452	保険
SYNGENTA AG-REG		19	21	849	88,919	素材
SWATCH GROUP AG/THE-BR		6	6	209	21,979	耐久消費財・アパレル
TRANSOCEAN LTD		79	—	—	—	エネルギー
UBS GROUP AG-REG		770	798	1,093	114,422	各種金融
ZURICH INSURANCE GROUP AG		31	33	856	89,626	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG		—	0.45	56	5,925	食品・飲料・タバコ
DUFREY AG-REG		8	—	—	—	小売
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		1	2	110	11,559	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.02	0.02	123	12,956	食品・飲料・タバコ
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.25	0.25	128	13,489	食品・飲料・タバコ
PARGESA HOLDING SA-BR		6	6	43	4,579	各種金融
PARTNERS GROUP HOLDING AG		3	3	185	19,460	各種金融
SCHINDLER HOLDING AG-REG		3	3	66	6,937	資本財
SULZER AG-REG		5	—	—	—	資本財
SWISS PRIME SITE-REG		13	18	151	15,821	不動産
SWATCH GROUP AG/THE-REG		9	13	79	8,336	耐久消費財・アパレル
小	株 数 ・ 金 額	3,563	3,604	23,124	2,420,440	
計	銘 柄 数 < 比 率 >	38	38	—	<3.5%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
ALFA LAVAL AB		46	69	881	10,278	資本財
ASSA ABLOY AB-B		209	209	3,454	40,277	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		130	151	4,054	47,274	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS		86	86	2,064	24,071	資本財
BOLIDEN AB		45	72	1,501	17,505	素材
ELECTROLUX AB - B		45	54	1,125	13,128	耐久消費財・アパレル
ERICSSON LM-B SHS		642	642	2,861	33,367	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GETINGE AB-B SHS		44	44	675	7,871	ヘルスケア機器・サービス
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		197	205	5,238	61,082	小売
HEXAGON AB-B SHS		48	59	2,188	25,514	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	外貨建金額	
(スウェーデン)	百株	百株	千円	千円	
HUSQVARNA AB-B SHS	84	84	590	6,886	耐久消費財・アパレル
ICA GRUPPEN AB	14	14	399	4,659	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	26	44	707	8,244	各種金融
INVESTOR AB-B SHS	90	101	3,311	38,617	各種金融
KINNEVIK AB - B	—	55	1,274	14,866	各種金融
LUNDIN PETROLEUM AB	43	43	714	8,326	エネルギー
MILICOM INTL CELLULAR-SDR	13	13	588	6,867	電気通信サービス
NORDEA BANK AB	663	646	5,993	69,882	銀行
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	318	318	2,936	34,243	銀行
SANDVIK AB	216	216	2,182	25,442	資本財
SECURITAS AB-B SHS	72	72	1,033	12,053	商業・専門サービス
SKANSKA AB-B SHS	71	71	1,470	17,146	資本財
SKF AB-B SHARES-B	74	89	1,335	15,571	資本財
SVENSKA CELLULOSA AB-B SHS	130	130	3,282	38,272	家庭用品・パーソナル用品
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	310	326	4,087	47,657	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES	185	199	4,202	49,005	銀行
SWEDISH MATCH AB	48	48	1,478	17,243	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS	62	62	491	5,725	電気通信サービス
TELIA CO AB	534	534	1,979	23,078	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS-B	313	339	3,249	37,894	資本財
(スウェーデン…非上場)					
KINNEVIK AB - B	55	—	—	—	各種金融
小計	株数・金額	株数	評価額	外貨建金額	
銘柄数<比率>	4,827	5,009	65,356	762,057	
	30	30	—	<1.1%>	
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
SUBSEA 7 SA	43	—	—	—	エネルギー
DNB ASA	222	222	2,590	32,585	銀行
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	42	42	664	8,363	保険
MARINE HARVEST	—	77	1,163	14,635	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO A S	309	309	1,134	14,269	素材
ORKLA ASA	193	193	1,543	19,418	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA-CL A	—	16	330	4,153	メディア
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	24	451	5,682	メディア
SEADRILL LTD	97	—	—	—	エネルギー
STATOIL ASA	246	246	3,386	42,600	エネルギー
TELENOR ASA	152	173	2,419	30,434	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA	37	37	1,098	13,813	素材
小計	株数・金額	株数	評価額	外貨建金額	
銘柄数<比率>	1,344	1,342	14,782	185,957	
	9	10	—	<0.3%>	
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
AP MOELLER - MAERSK A/S - B	1	1	1,414	21,542	運輸
AP MOELLER - MAERSK A/S - A	0.9	0.9	881	13,426	運輸
CARLSBERG AS-B	23	23	1,480	22,549	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	18	730	11,128	素材
COLOPLAST-B	25	25	1,226	18,678	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S	149	149	3,173	48,327	銀行
DSV A/S	36	43	1,447	22,040	運輸
GENMAB A/S	—	12	1,425	21,716	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S	31	31	834	12,714	商業・専門サービス
NOVO NORDISK A/S-B	415	416	11,542	175,793	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVOZYMES A/S-B SHARES	56	48	1,391	21,190	素材
PANDORA A/S	26	25	2,237	34,077	耐久消費財・アパレル
TDC A/S	145	145	544	8,287	電気通信サービス
TRYG A/S	25	25	342	5,223	保険
VESTAS WIND SYSTEMS AS	52	46	2,541	38,714	資本財
WILLIAM DEMANT HOLDING	6	30	388	5,912	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	株数	評価額	外貨建金額	
銘柄数<比率>	997	1,045	31,603	481,324	
	14	16	—	<0.7%>	

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
AGL ENERGY LTD		153	153	295	23,623	公益事業
ALUMINA LTD		465	465	74	5,959	素材
AMCOR LIMITED		264	264	399	31,989	素材
AMP LTD		626	626	330	26,438	各種金融
AUST AND NZ BANKING GROUP		583	638	1,820	145,755	銀行
ARISTOCRAT LEISURE LTD		100	125	194	15,578	消費者サービス
ASCIANO LTD		248	—	—	—	運輸
ASX LTD		49	49	238	19,091	各種金融
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		104	104	117	9,380	銀行
BHP BILLITON LTD		677	702	1,628	130,394	素材
BANK OF QUEENSLAND LIMITED		81	81	92	7,419	銀行
BORAL LTD		171	171	114	9,169	素材
BRAMBLES LTD		297	355	425	34,103	商業・専門サービス
CALTEX AUSTRALIA LTD		53	53	164	13,167	エネルギー
CHALLENGER LTD		—	99	104	8,374	各種金融
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		353	375	2,826	226,319	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD		151	106	102	8,238	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD		12	12	163	13,074	ヘルスケア機器・サービス
COMPUTERSHARE LTD		114	114	122	9,790	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD		67	67	72	5,779	消費者サービス
CSL LTD		103	100	1,031	82,565	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L		—	11	78	6,261	消費者サービス
DUET GROUP		—	540	125	10,084	公益事業
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		9	9	33	2,693	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD		296	296	161	12,923	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		87	143	76	6,110	小売
HEALTHSCOPE LTD		199	443	101	8,103	ヘルスケア機器・サービス
ILUKA RESOURCES LTD		87	—	—	—	素材
INCITEC PIVOT LTD		315	315	92	7,402	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		502	502	285	22,837	保険
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI		109	109	227	18,244	素材
CIMIC GROUP LTD		18	18	56	4,554	資本財
SYDNEY AIRPORT		133	241	159	12,767	運輸
MACQUARIE GROUP LTD		64	67	559	44,788	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD		620	620	163	13,057	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		554	581	1,616	129,483	銀行
NEWCREST MINING LTD		149	172	376	30,180	素材
OIL SEARCH LTD		—	364	254	20,379	エネルギー
ORIGIN ENERGY LTD		266	419	234	18,760	エネルギー
ORICA LIMITED		69	69	114	9,152	素材
ORIGIN ENERGY LTD-RTS		152	—	—	—	エネルギー
QANTAS AIRWAYS LTD		139	131	41	3,328	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD		272	293	303	24,303	保険
AURIZON HOLDINGS LTD		461	461	226	18,108	運輸
RAMSAY HEALTH CARE LTD		29	29	212	17,028	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD		—	11	58	4,696	メディア
RIO TINTO LTD		99	99	523	41,933	素材
SANTOS LTD		237	376	139	11,159	エネルギー
SEEK LTD		80	80	123	9,870	商業・専門サービス
SONIC HEALTHCARE LTD		98	98	209	16,782	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD		708	1,176	310	24,876	素材
AUSNET SERVICES		291	407	60	4,878	公益事業
SUNCORP GROUP LTD		290	290	363	29,118	保険
TABCORP HOLDINGS LTD		153	153	75	6,030	消費者サービス
TATTS GROUP LTD		377	377	156	12,498	消費者サービス
TELSTRA CORPORATION LTD		931	931	470	37,675	電気通信サービス
TPG TELECOM LTD		—	72	53	4,295	電気通信サービス
TRANSURBAN GROUP		431	431	468	37,496	運輸

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			当	期	
			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	千オーストラリアドル	千円	
TREASURY WINE ESTATES LTD	140	159	182	14,621	食品・飲料・タバコ
TREASURY WINE ESTATES LTD-RTS	18	—	—	—	食品・飲料・タバコ
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	—	120	70	5,664	電気通信サービス
WESTPAC BANKING CORP	658	731	2,259	180,960	銀行
WESFARMERS LTD	236	244	1,076	86,194	食品・生活必需品小売り
WESTPAC BANKING CORP-RTS(N)	28	—	—	—	銀行
WORLEYPARSONS LTD	43	—	—	—	エネルギー
WOOLWORTHS LTD	262	276	698	55,933	食品・生活必需品小売り
WOODSIDE PETROLEUM LTD	165	165	477	38,264	エネルギー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,473 60	16,717 61	23,597 —	1,889,719 <2.7%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	245	245	169	12,614	運輸
CONTACT ENERGY LIMITED	94	193	92	6,924	公益事業
FLETCHER BUILDING LTD	171	171	174	13,045	素材
MERIDIAN ENERGY LTD	—	280	71	5,325	公益事業
RYMAN HEALTHCARE LTD	—	85	72	5,433	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD	451	451	161	12,058	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	962 4	1,426 6	742 —	55,401 <0.1%>
(香港)			千香港ドル		
AIA GROUP LTD	2,542	2,642	14,002	188,054	保険
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	42	42	301	4,044	半導体・半導体製造装置
BANK OF EAST ASIA	216	216	693	9,314	銀行
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	770	770	2,148	28,851	銀行
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	250	250	262	3,525	運輸
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	150	150	958	12,872	公益事業
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	567	582	5,733	77,000	資本財
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	542	602	3,338	44,836	不動産
CLP HOLDINGS LTD	425	380	2,990	40,163	公益事業
FIRST PACIFIC CO	442	442	257	3,458	各種金融
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	500	500	1,572	21,118	消費者サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD	570	570	1,014	13,626	不動産
HANG SENG BANK LTD	163	163	2,326	31,238	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	244	268	1,246	16,744	不動産
HKT TRUST AND HKT LTD	670	670	737	9,897	電気通信サービス
POWER ASSETS HOLDINGS	275	325	2,377	31,928	公益事業
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	560	426	5,723	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	1,355	1,799	2,706	36,342	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	235	245	5,110	68,636	各種金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	150	150	550	7,393	不動産
KERRY PROPERTIES LTD	169	114	285	3,836	不動産
LI & FUNG LTD	1,380	1,380	542	7,283	耐久消費財・アパレル
MGM CHINA HOLDINGS LTD	168	168	220	2,964	消費者サービス
MTR CORP	340	340	1,485	19,954	運輸
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,346	1,346	1,326	17,814	不動産
NWS HOLDINGS LTD	285	285	387	5,197	資本財
PCCW LTD	—	800	380	5,103	電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	498	498	1,745	23,441	消費者サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	280	—	—	—	消費者サービス
SINO LAND CO	630	630	844	11,346	不動産
SJM HOLDINGS LTD	480	480	269	3,622	消費者サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	364	334	3,880	52,112	不動産
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	130	130	1,080	14,509	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD	232	232	530	7,119	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	290	290	865	11,625	耐久消費財・アパレル
WHEELLOCK & CO LTD	196	196	945	12,700	不動産
WHARF HOLDINGS LTD	278	278	1,612	21,654	不動産

銘柄		株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
			株 数	評 価 額	外貨建金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
WH GROUP LTD		635	1,535	1,079	14,492	食品・飲料・タバコ
WYNN MACAU LTD		358	358	436	5,865	消費者サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		145	145	421	5,657	耐久消費財・アパレル
小 計	株数・金額	18,316	20,869	67,094	901,077	
	銘柄数<比率>	38	39	—	<1.3%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND LTD		461	686	216	16,256	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD		100	100	87	6,584	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD		460	460	122	9,210	運輸
DBS GROUP HOLDINGS LTD		367	367	552	41,464	銀行
GENTING SINGAPORE PLC		1,020	1,565	120	9,036	消費者サービス
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L		600	600	109	8,188	不動産
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		1,300	1,300	52	3,899	食品・飲料・タバコ
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD		20	20	85	6,416	小売
KEPPEL CORP LTD		346	346	185	13,879	資本財
NOBLE GROUP LTD		828	—	—	—	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		622	682	590	44,264	銀行
SEMBCORP MARINE LTD		160	—	—	—	資本財
SEMBCORP INDUSTRIES LTD		210	210	53	4,015	資本財
SINGAPORE AIRLINES LTD		128	128	131	9,857	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD		200	200	144	10,858	各種金融
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		325	325	124	9,299	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		1,649	1,721	674	50,614	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING		330	330	105	7,894	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD		292	292	552	41,407	銀行
UOL GROUP LTD		122	122	70	5,318	不動産
WILMAR INTERNATIONAL LTD		447	447	150	11,296	食品・飲料・タバコ
YANGZIJANG SHIPBUILDING		420	—	—	—	資本財
小 計	株数・金額	10,410	9,903	4,130	309,763	
	銘柄数<比率>	22	19	—	<0.4%>	
(イスラエル)				千イスラエルシェケル		
BANK LEUMI LE-ISRAEL		293	364	544	14,737	銀行
BANK HAPOLIM BM		277	277	618	16,736	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		487	487	344	9,337	電気通信サービス
ISRAEL CHEMICALS LTD		97	97	138	3,755	素材
NICE LTD		13	13	355	9,631	ソフトウェア・サービス
TEVA PHARMACEUTICALS INDUS R		183	200	3,369	91,210	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISRAEL CORP LIMITED/THE		0.78	—	—	—	素材
小 計	株数・金額	1,354	1,442	5,371	145,409	
	銘柄数<比率>	7	6	—	<0.2%>	
合 計	株数・金額	286,991	274,484	—	66,078,687	
	銘柄数<比率>	1,256	1,241	—	<95.5%>	

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

(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千アメリカドル	千円		%
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	—	1,490	159	16,662	0.0	
PROLOGIS INC	10,732	11,402	600	62,528	0.1	
AMERICAN TOWER CORP	8,759	9,269	1,082	112,738	0.2	
AGNC INVESTMENT CORP	7,010	7,010	141	14,737	0.0	
VEREIT INC	18,644	24,234	234	24,439	0.0	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	20,020	207	21,628	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,745	3,085	514	53,631	0.1	
BOSTON PROPERTIES INC	3,417	3,417	428	44,615	0.1	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	3,340	7,800	208	21,680	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	2,200	1,940	153	16,015	0.0	
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	3,071	—	—	—	—	
CROWN CASTLE INTL CORP	7,300	7,430	697	72,714	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,235	3,235	313	32,657	0.0	
DUKE REALTY CORPORATION	6,875	6,875	178	18,622	0.0	
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,970	7,980	481	50,188	0.1	
EQUINIX INC	1,177	1,478	551	57,467	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	1,400	286	29,844	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,220	2,800	210	21,959	0.0	
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	1,415	209	21,795	0.0	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	12,545	12,545	326	34,045	0.0	
HCP INC	10,125	10,125	360	37,541	0.1	
WELLTOWER INC	6,990	7,680	545	56,783	0.1	
HOST HOTELS & RESORTS INC	14,569	16,589	255	26,614	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	3,285	5,515	188	19,678	0.0	
KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	8,795	243	25,352	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	3,113	124	13,004	0.0	
MACERICH CO/THE	3,250	2,870	219	22,885	0.0	
MID AMERICA APARTMENT COMMUNITIES	—	1,500	139	14,501	0.0	
PLUM CREEK TIMBER CO	3,408	—	—	—	—	
PUBLIC STORAGE	3,089	3,209	681	70,991	0.1	
REALTY INCOME CORP	5,400	5,400	336	35,048	0.1	
REGENCY CENTERS CORPORATION	2,355	2,355	173	18,069	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	6,674	6,814	1,344	140,038	0.2	
SL GREEN REALTY CORP	2,260	2,260	227	23,662	0.0	
UDR INC	5,820	5,820	195	20,336	0.0	
VENTAS INC	6,675	7,285	501	52,215	0.1	
VORNADO REALTY TRUST	3,321	3,811	359	37,416	0.1	
WEYERHAEUSER CO	10,286	16,498	513	53,539	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	223,490	244,464	13,396	1,395,653	
	銘 柄 数 < 比 率 >	36	36	—	<2.0%>	
(カナダ)			千カナダドル			
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	2,340	53	4,167	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,380	3,380	89	6,963	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	5,720	5,720	142	11,131	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
FONCIERE DES REGIONS	595	595	48	5,494	0.0	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	口	口	千ユーロ	千円	%
GECINA SA	580	970	131	14,859	0.0
ICADE	685	685	46	5,251	0.0
KLEPIERRE	3,142	4,732	185	21,029	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	2,070	2,070	475	53,864	0.1
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	7,072	886	100,500	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	—	<0.1%>	
(イギリス)			千イギリスポンド		
BRITISH LAND COMPANY PLC	21,701	21,701	130	16,546	0.0
HAMMERSON PLC	15,295	15,295	86	10,925	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC	16,229	16,229	166	21,086	0.0
INTU PROPERTIES PLC	19,860	19,860	56	7,204	0.0
SEGRO PLC	15,053	15,053	67	8,517	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	88,138	507	64,280	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	—	<0.1%>	
(オーストラリア)			千オーストラリアドル		
APA GROUP	26,406	26,406	212	17,022	0.0
VICINITY CENTRES	72,862	72,862	215	17,270	0.0
DEXUS PROPERTY GROUP	18,487	18,487	165	13,249	0.0
GOODMAN GROUP	43,442	39,332	272	21,795	0.0
GPT GROUP	33,165	44,885	212	17,001	0.0
LENLEASE GROUP	12,197	12,197	168	13,488	0.0
MIRVAC GROUP	86,525	86,525	180	14,481	0.0
SCENTRE GROUP	116,381	116,381	508	40,727	0.1
STOCKLAND	55,310	55,310	252	20,241	0.0
WESTFIELD CORP	41,745	41,745	381	30,587	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	506,520	2,570	205,867	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	—	<0.3%>	
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	52,000	48,000	2,712	36,422	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	52,000	2,712	36,422	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	—	<0.1%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	39,000	51,900	126	9,496	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	40,000	40,000	63	4,769	0.0
CAPITALAND MALL TRUST	41,800	66,300	142	10,689	0.0
SUNTEC REIT	45,000	45,000	78	5,854	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	165,800	410	30,810	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	—	<0.0%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	1,048,740	—	1,844,665	
	銘 柄 数 < 比 率 >	63	—	<2.7%>	

(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により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。

リミテッドパートナー（出資金）

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	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A-LP		口 —	口 5,400	千アメリカドル 71	千円 7,425	% 0.0
合 計	口 数 ・ 金 額	—	5,400	71	7,425	
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	1	—	<0.0%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算しています。

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	DJSTX5	百万円 289	百万円 —
		SP EMINI	1,002	—

(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により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2016年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 66,078,687	% 95.4
投資証券	1,844,665	2.7
リミテッドパートナー(出資金)	7,425	0.0
コール・ローン等、その他	1,362,187	1.9
投資信託財産総額	69,292,964	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（68,949,194千円）の投資信託財産総額（69,292,964千円）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により邦貨換算したものです。1アメリカドル=104.18円、1カナダドル=78.01円、1ユーロ=113.31円、1イギリスポンド=126.76円、1スイスフラン=104.67円、1スウェーデンクローナ=11.66円、1ノルウェークローネ=12.58円、1デンマーククローネ=15.23円、1オーストラリアドル=80.08円、1ニュージーランドドル=74.59円、1香港ドル=13.43円、1シンガポールドル=74.99円、1イスラエルシェケル=27.07円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年10月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	69,668,193,562
コール・ローン等	1,002,709,361
株式(評価額)	66,078,687,682
投資証券(評価額)	1,844,665,412
リミテッドパートナー(出資金)(評価額)	7,425,950
未収入金	385,682,535
未収配当金	67,364,205
差入委託証拠金	281,658,417
(B) 負債	453,403,701
未払金	380,668,230
未払解約金	72,735,081
未払利息	390
(C) 純資産総額(A－B)	69,214,789,861
元本	38,877,746,606
次期繰越損益金	30,337,043,255
(D) 受益権総口数	38,877,746,606口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,803円

(注) 当ファンドの期首元本額は39,171,763,417円、期中追加設定元本額は3,330,056,187円、期中一部解約元本額は3,624,072,998円です。

(注) 2016年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・インデックスファンド海外株式ヘッジなし(DC専用)	14,771,411,678円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	7,445,144,841円
・日興五大陸株式ファンド	6,931,109,823円
・インデックスファンド海外株式(ヘッジなし)	4,750,975,993円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	3,533,390,362円
・DCインデックスバランス(株式80)	370,479,311円
・DCインデックスバランス(株式60)	327,631,735円
・DCインデックスバランス(株式40)	178,940,471円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	134,087,849円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	133,359,275円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	99,681,217円
・DCインデックスバランス(株式20)	53,008,910円
・インデックスファンド海外先進国株式(適格機関投資家向け)	39,075,632円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	33,731,074円
・全世界株式債券ファンド(日本・先進国・新興国)毎月分配型	31,269,716円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	11,084,688円
・グローバルバランスファンド35(適格機関投資家向け)	9,975,313円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	8,664,553円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	7,043,309円
・アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	5,843,299円
・日興ストラテジック・アロケーション・ファンド(株式資産)	1,837,557円

(注) 1口当たり純資産額は1.7803円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上し処理しています。

○損益の状況（2015年10月27日～2016年10月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,517,741,644
受取配当金	1,514,505,341
受取利息	320,343
その他収益金	3,048,485
支払利息	△ 132,525
(B) 有価証券売買損益	△11,103,152,237
売買益	5,073,081,136
売買損	△16,176,233,373
(C) 先物取引等取引損益	103,847,691
取引益	239,246,212
取引損	△ 135,398,521
(D) 保管費用等	△ 18,903,190
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 9,500,466,092
(F) 前期繰越損益金	40,338,432,212
(G) 追加信託差損益金	2,544,655,642
(H) 解約差損益金	△ 3,045,578,507
(I) 計(E+F+G+H)	30,337,043,255
次期繰越損益金(I)	30,337,043,255

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

○お知らせ

約款変更について

2015年10月27日から2016年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2に定める信用リスクを適正に管理する方法として、一般社団法人投資信託協会規則に従って委託会社が合理的な方法を定めるべく、2016年8月22日付けにて信託約款に所要の変更を行ないました。（付表）

海外新興国株式インデックス MSCI エマージング（ヘッジなし）マザーファンド

運用報告書

第11期（決算日 2017年5月16日）
（2016年5月17日～2017年5月16日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2006年5月17日から原則無期限です。
運用方針	主として金融商品取引所に上場されている新興国の株式に投資し、「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース）」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	新興国の株式を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

ファンド概要

主として、新興国の株式に投資し、「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース）」の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

運用の効率化をはかるため、株価指数等先物取引や外国為替予約取引などを活用することがあります。このため、株式の組入総額と株価指数等先物取引などの買建玉の時価総額の合計額および外貨建資産の組入総額と外国為替予約取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

ただし、市況動向に急激な変化が生じたとき、ならびに残存信託期間、残存元本が運用に支障をきたす水準となったときなどやむを得ない事情が発生した場合には、上記のような運用ができない場合があります。

日興アセットマネジメント

<936561>

【運用報告書の表記について】

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		MSCI エマージング・マーケット・インデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率 (ベンチマーク)	期 騰 落 率	中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
7期(2013年5月16日)	14,442	44.3	117.96	40.5	98.0	1.8	0.0	9,470
8期(2014年5月16日)	14,426	△ 0.1	115.43	△ 2.1	97.1	2.5	0.3	9,099
9期(2015年5月18日)	17,570	21.8	137.78	19.4	97.7	1.9	0.4	11,029
10期(2016年5月16日)	12,482	△29.0	95.62	△30.6	95.0	4.0	1.0	8,619
11期(2017年5月16日)	16,996	36.2	126.85	32.7	95.1	4.1	0.8	12,095

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

(注) 「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」は、「MSCI Inc.」が発表している、世界の新興国の株式市場の合成パフォーマンスを表す指数です。(円ヘッジなし・円ベース)とは、現地通貨ベースの指数をヘッジを行わずに円換算したものです。なお、設定時を100として2017年5月16日現在知りえた情報に基づいて指数化しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額	MSCI エマージング・マーケット・インデックス (円ヘッジなし・円ベース)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首)	円	%		%	%	%	%
2016年5月16日	12,482	—	95.62	—	95.0	4.0	1.0
5月末	12,956	3.8	98.89	3.4	93.8	5.0	0.9
6月末	12,346	△ 1.1	93.34	△ 2.4	96.4	2.5	0.9
7月末	13,352	7.0	100.90	5.5	96.0	3.1	0.8
8月末	13,568	8.7	102.37	7.1	95.7	3.4	0.8
9月末	13,500	8.2	101.94	6.6	96.0	3.2	0.8
10月末	13,855	11.0	104.56	9.4	95.8	3.4	0.8
11月末	14,159	13.4	106.52	11.4	95.3	3.8	0.8
12月末	14,678	17.6	110.37	15.4	95.7	3.4	0.8
2017年1月末	15,227	22.0	114.69	19.9	96.1	2.9	0.8
2月末	15,554	24.6	116.82	22.2	95.9	3.4	0.8
3月末	15,951	27.8	120.04	25.5	95.3	3.8	0.8
4月末	16,082	28.8	120.33	25.8	95.1	4.0	0.8
(期 末)							
2017年5月16日	16,996	36.2	126.85	32.7	95.1	4.1	0.8

(注) 騰落率は期首比です。

(注) 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

○運用経過

(2016年5月17日～2017年5月16日)

基準価額の推移

期間の初め12,482円の基準価額は、期間末に16,996円となり、騰落率は+36.2%となりました。

基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

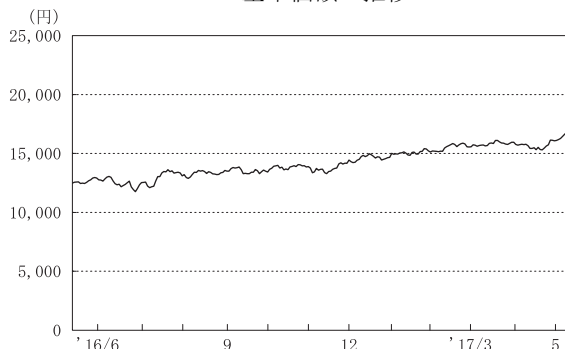
<値上がり要因>

- ・米国において市場予想を上回る経済指標の発表から景況感が改善したこと。
- ・石油輸出国機構（OPEC）による原油減産の実施合意を受けて原油価格の上昇期待が高まったこと。
- ・好調な企業業績の発表を受けて世界の景況感に対する楽観的な見方が強まったこと。
- ・新興国の通貨が対円で概して上昇したこと。

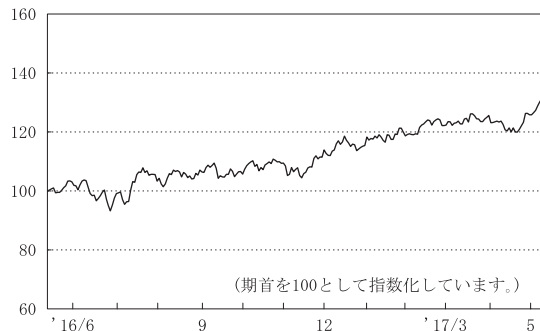
<値下がり要因>

- ・米国大統領選挙における保護主義的政策を掲げる候補の当選を受けて貿易の縮小による新興国経済の減速が懸念されたこと。
- ・フランス大統領選挙をめぐる政治的不透明感や、シリアや北朝鮮の情勢緊迫化を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。
- ・米国新政権が掲げる財政出動による景気浮揚策は実現が遅れるとの見方が強まったこと。

基準価額の推移



期 首	期中高値	期中安値	期 末
2016/05/16	2017/05/16	2016/06/28	2017/05/16
12,482円	16,996円	11,763円	16,996円

MSCI エマージング・マーケット・インデックス
(円ヘッジなし・円ベース) (指数化) の推移

（新興国株式市況）

新興国株式市場では、期間の初めと比べて、新興国各国の株価は総じて上昇しました。

期間の初めから2016年8月中旬にかけては、英国の欧州連合（E U）離脱懸念を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことなどは株価の重しとなったものの、米国における追加利上げ観測が後退したことや、一部の先進国や新興国の中央銀行による金融緩和に期待が高まったことなどが支援材料となり、新興国各国の株価は総じて上昇しました。8月下旬から12月中旬にかけては、O P E Cによる原油減産の合意を受けた原油価格の上昇期待などが支援材料となったものの、米国の追加利上げ観測を背景とする外国人投資家などによる新興国株式の売却懸念や、米国大統領選挙における保護主義的政策を掲げる候補の当選を受けて貿易の縮小による新興国経済の減速が懸念されたことなどから、新興国各国の株価は概して下落しました。12月下旬から期間末にかけては、米国新政権が掲げる財政出動による景気浮揚策は実現が遅れるとの見方や、シリアや北朝鮮の情勢緊迫化を背景とする投資家のリスク回避姿勢などが株価の重しとなったものの、米国の追加利上げは緩やかに進むとの見方や、好調な企業業績の発表を受けて世界の景況感に対する楽観的な見方が強まったことなどから、新興国各国の株価は総じて上昇しました。

（為替市況）

期間中の新興国通貨は、期間の初めと比べて対円で概して上昇しました。

期間の初めから2016年8月上旬にかけては、世界経済の減速懸念や英国のE U離脱懸念によるリスク回避需要などから円が買われたことや、一部の新興国における利下げの実施などを受けた新興国通貨への売り需要などを背景に、新興国通貨は対円で総じて下落しました。8月中旬から12月中旬にかけては、欧州中央銀行（E C B）が追加緩和策の必要性を否定したことなどから投資家のリスク回避姿勢が強まり、新興国通貨が売られる局面があったものの、原油価格が堅調な推移となったことや、米国次期政権の景気刺激策に対する期待が継続しリスク回避の円買い需要が後退したことなどにより、新興国通貨は対円で総じて上昇しました。12月下旬から2017年4月中旬にかけては、英国がE U単一市場から完全に離脱するとの懸念や、シリアや北朝鮮の情勢緊迫化、米国新大統領の政策に対する不透明感の高まりを背景に、円に対する逃避需要が強まり、新興国通貨は対円で総じて下落しました。4月下旬から期間末にかけては、フランス大統領選挙の結果を受けてE Uの混乱が回避されるとの期待が高まったことや、米国連邦準備制度理事会（F R B）が追加利上げを見送ったことなどが支援材料となり、新興国通貨は対円で総じて上昇しました。

ポートフォリオ

ベンチマークが採用している国の株式の中からリスクコントロールモデルを使用して構築したポートフォリオで運用を行ない、期間を通じて株式組入比率を高位に維持しました。また、ベンチマーク採用銘柄の入替えなどに対応するために、随時ポートフォリオの見直しを行ないました。

なお、外貨建資産は、為替ヘッジを行わず、高位の外貨エクスポージャーを維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、36.2%の値上がりとなり、ベンチマークである「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース）」の上昇率32.7%を概ね3.5%上回ることとなりました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

<プラス要因>

- ・株式の銘柄選択に基づく要因。
- ・株式配当金の受取り。

<マイナス要因>

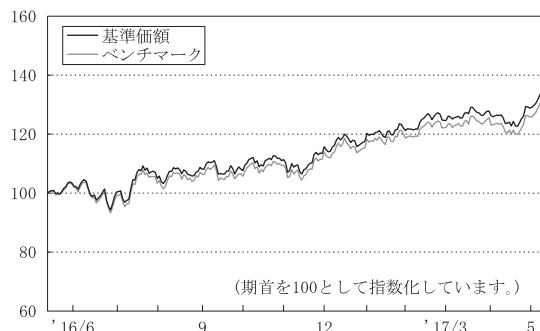
- ・海外コストディ・フィーや売買手数料などの諸費用。

○今後の運用方針

引き続き、ベンチマークである「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（円ヘッジなし・円ベース）」に連動する投資成果をめざし、原則としてリスクコントロールモデルにより構築した現物株式ポートフォリオへの投資を継続するとともに、現物株式と株式先物取引を合計した実質的な株式組入比率を高位に維持する方針です。また、外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行わず、高位の外貨エクスポージャーを維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年 5 月17日～2017年 5 月16日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 4	% 0.026	(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)	(3)	(0.021)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.005)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.007	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.007)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	30	0.209	(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)	(27)	(0.190)	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)	(3)	(0.019)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合 計	35	0.242	
期中の平均基準価額は、14,269円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2016年5月17日～2017年5月16日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 780 (79)	千アメリカドル 3,127 (ー)	百株 293 (12)	千アメリカドル 245 (68)
	メキシコ	569 (115)	千メキシコペソ 1,746 (△ 26)	85	千メキシコペソ 328
	ブラジル	395 (320)	千ブラジルリアル 562 (62)	168 (81)	千ブラジルリアル 226 (206)
	チリ	1,525 (1,148)	千チリペソ 23,343 (4,816)	16 (7)	千チリペソ 9,347 (820)
	コロンビア	ー (0.39)	千コロンビアペソ ー (ー)	ー	千コロンビアペソ ー
	トルコ	ー (10)	千トルコリラ ー (ー)	230	千トルコリラ 98
	チェコ	80 (ー)	千チェココルナ 670 (△ 5)	ー	千チェココルナ ー
	ハンガリー	8	千ハンガリーフォリント 6,567	ー	千ハンガリーフォリント ー
	ポーランド	13 (15)	千ポーランドズロチ 150 (18)	105 (15)	千ポーランドズロチ 92 (35)
	香港	9,474 (685)	千香港ドル 5,654 (376)	10,929 (5,874)	千香港ドル 2,866 (986)
	マレーシア	240 (449)	千マレーシアリンギット 226 (121)	2,015 (273)	千マレーシアリンギット 835 (102)
	タイ	884 (1,070)	千タイバーツ 4,919 (604)	613 (350)	千タイバーツ 20 (654)
	フィリピン	250 (138)	千フィリピンペソ 3,299 (813)	50 (60)	千フィリピンペソ 1,111 (304)
	インドネシア	6,200 (2,137)	千インドネシアルピア 559,187 (10,744)	318 (195)	千インドネシアルピア 282,839 (4,823)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	韓国	百株 27 (89)	千韓国ウォン 300,501 (63,342)	百株 31 (27)	千韓国ウォン 599,016 (48,867)
	台湾	1,460 (1,770)	千新台幣ドル 6,925 (243)	367 (606)	千新台幣ドル 2,380 (2,345)
	インド	1,401 (684)	千インドルピー 66,546 (3,888)	243 (19)	千インドルピー 6,862 (3,888)
	カタール	— (29)	千カタールリアル — (40)	105 (10)	千カタールリアル 95 (14)
	南アフリカ	222 (210)	千南アフリカランド 5,614 (1,916)	152 (142)	千南アフリカランド 991 (3,385)
	アラブ首長国連邦	— (141)	千アラブディルハム — (32)	683 (45)	千アラブディルハム 82 (17)

(注) 金額は受け渡し代金。

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

新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	タイ	証券 — (17,500)	千タイバーツ — (137)	証券 17,500	千タイバーツ 137

(注) 金額は受け渡し代金。

(注) ()内は権利行使および権利行使期間満了等による増減分です。

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	メキシコ	口	千メキシコペソ	口	千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	11,000 (-)	346 (△ 66)	-	-
	小 計	11,000 (-)	346 (△ 66)	-	-
	南アフリカ		千南アフリカランド		千南アフリカランド
	REDEFINE PROPERTIES LTD	19,000	210	-	-
	小 計	19,000	210	-	-

(注) 金額は受け渡し代金。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		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 1,816	百万円 1,777	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受け渡し代金。

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

○株式売買比率

(2016年5月17日～2017年5月16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	875,913千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	9,571,301千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.09

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月17日～2017年5月16日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2016年5月17日～2017年5月16日）

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

○組入資産の明細

（2017年5月16日現在）

外国株式

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千アメリカドル		邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	百株	百株			
58.COM INC-ADR	8	16	68	7,783	ソフトウェア・サービス
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	18	18	81	9,311	銀行
ALIBABA GROUP HOLDING-SP-ADR	109	247	2,998	341,148	ソフトウェア・サービス
BRASKEM SA-SPON ADR	17	17	38	4,341	素材
BRF SA-ADR	59	59	84	9,647	食品・飲料・タバコ
CEMIG SA -SPONS ADR	43	—	—	—	公益事業
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	20	14	38	4,338	食品・飲料・タバコ
CEMEX SAB-SPONS ADR PART CER	26	27	23	2,710	素材
CIA BRASILEIRA-SP ADR PREF	23	23	57	6,487	食品・生活必需品小売り
CIA SIDERURGICA NACL-SP ADR	101	101	24	2,834	素材
CREDICORP LTD	14	14	244	27,872	銀行
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	24	24	24	2,842	エネルギー
EMBRAER SA ADR	8	—	—	—	資本財
GERDAU SA -SPON ADR	36	—	—	—	素材
GRUPO FIN SANTANDER B-ADR	26	26	24	2,750	銀行
GRUPO AVAL ACCIONES Y VALORE-ADR	18	18	15	1,795	銀行
ITAU UNIBANCO HLDNG-PREF ADR	20	22	28	3,226	銀行
LATAM AIRLINES GROUP-SP -ADR	22	22	29	3,351	運輸
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	46	46	58	6,639	素材
MOBILE TELESYSTEMS-SP ADR	125	125	118	13,534	電気通信サービス
NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP-ADR	14	26	184	20,975	消費者サービス
PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	37	82	85	9,770	エネルギー
QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	6	—	—	—	ソフトウェア・サービス
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	11	11	37	4,312	素材
CIA SANEAMENTO BASICO DE-ADR	61	61	60	6,855	公益事業
BANCO SANTANDER-CHILE-ADR	19	19	48	5,466	銀行
SOUTHERN COPPER CORP(US)	36	20	72	8,206	素材
FANG HOLDINGS LTD-ADR	30	—	—	—	ソフトウェア・サービス
TAL EDUCATION GROUP- ADR	—	10	120	13,741	消費者サービス
GRUPO TELEvisa SA-SPONS ADR	20	20	50	5,765	メディア
TELEF BRASIL-ADR	39	39	60	6,848	電気通信サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADR	42	77	113	12,947	小売
YUM CHINA HOLDINGS INC	—	87	294	33,455	消費者サービス
BAIDU INC - SPON ADR	30	60	1,120	127,486	ソフトウェア・サービス
CTrip.COM INTERNATIONAL-ADR	31	81	449	51,145	小売
JD.COM INC-ADR	36	154	619	70,485	小売
NETEASE INC-ADR	8	17	503	57,240	ソフトウェア・サービス
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	6	—	—	—	小売
SINA CORP	—	11	95	10,899	ソフトウェア・サービス

銘	柄	期首(前期末)	当		期	末	業	種	等		
		株	数	株	数	評				価	額
						外貨建金額				邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千アメリカドル	千円						
WEIBO CORP-SPON-ADR		—	6	42	4,866		ソフトウェア・サービス				
YY INC-ADR		3	3	19	2,205		ソフトウェア・サービス				
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR		28	28	13	1,513		電気通信サービス				
GAZPROM PAO-SPON ADR		1,327	1,217	560	63,815		エネルギー				
LUKOIL PJSC-SPON-ADR		113	95	485	55,270		エネルギー				
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS		60	69	246	27,995		食品・生活必需品小売り				
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S		23	23	281	32,046		エネルギー				
ROSNEFT PJSC-REG S GDR		265	265	146	16,622		エネルギー				
RUSHYDRO PJSC-ADR		280	420	63	7,167		公益事業				
SEVERSTAL - GDR REG S		56	72	94	10,711		素材				
SURGUTNEFTEGAS-SP ADR		385	385	190	21,677		エネルギー				
TATNEFT-SPONSORED-ADR		54	54	220	25,088		エネルギー				
VTB BANK OJSC-GDR-REG S		660	660	152	17,390		銀行				
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B		95	171	26	3,036		不動産				
MEGAFON-REG S-GDR		26	—	—	—		電気通信サービス				
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR		133	133	200	22,781		素材				
PHOSAGRO PJSC REG S-GDR		—	37	53	6,082		素材				
ROSTELECOM-SPONSORED-ADR		26	26	20	2,385		電気通信サービス				
SBERBANK-SPONSORED ADR		610	628	782	88,993		銀行				
DP WORLD LTD		44	44	100	11,386		運輸				
小	計	株数・金額	5,396	5,949	11,578	1,317,255					
	銘柄数<比率>		54	52	—	<10.9%>					
(メキシコ)					千メキシコペソ						
ALFA S.A.B.-A		610	610	1,656	10,102		資本財				
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L		7,058	7,508	11,096	67,690		電気通信サービス				
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV		93	93	1,229	7,501		食品・飲料・タバコ				
CEMEX SAB-CPO		2,739	2,849	4,666	28,466		素材				
GENTERA SAB DE CV		300	300	951	5,802		各種金融				
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L		109	109	1,590	9,702		食品・飲料・タバコ				
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1		44	44	632	3,860		小売				
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		389	389	6,723	41,015		食品・飲料・タバコ				
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		521	521	5,622	34,298		銀行				
GRUPO FIN SANTANDER-B		320	320	1,111	6,781		銀行				
GRUPO AEROPORT DEL PACIFIC-B		66	79	1,587	9,685		運輸				
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O		540	540	1,767	10,784		銀行				
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1		137	137	1,180	7,202		資本財				
GRUPO MEXICO SA-SER B		820	820	4,391	26,791		素材				
GRUPO BIMBO SAB- SERIES A		365	365	1,683	10,266		食品・飲料・タバコ				
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B		40	40	1,444	8,812		運輸				
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA		85	—	—	—		食品・生活必需品小売り				
GRUPO LALA SAB DE CV		130	130	462	2,823		食品・飲料・タバコ				
GRUMA S.A.B.-B		30	30	723	4,415		食品・飲料・タバコ				
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV		37	37	1,561	9,527		素材				
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N		—	106	924	5,637		公益事業				
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A		416	416	1,675	10,220		家庭用品・パーソナル用品				
MEXICHEM SAB DE CV-*		231	237	1,208	7,374		素材				
OHL MEXICO SAB DE CV		210	210	478	2,919		運輸				
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF		50	50	1,027	6,268		運輸				
GRUPO TELEvisa SAB		431	431	3,994	24,369		メディア				
WALMART DE MEXICO -SER V		1,202	1,202	5,203	31,741		食品・生活必需品小売り				
小	計	株数・金額	16,975	17,575	64,600	394,061					
	銘柄数<比率>		26	26	—	<3.3%>					

銘 柄	期首(前期末) 株 数	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千ブラジルレアル		邦貨換算金額 千円
(ブラジル)	百株	百株			
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	—	55	73	2,695	公益事業
AMBEV SA	1,020	1,020	2,013	73,653	食品・飲料・タバコ
B2W CIA DIGITAL	33	—	—	—	小売
BANCO BRADESCO S.A.	188	207	640	23,423	銀行
BANCO DO BRASIL S.A.	192	192	667	24,406	銀行
BANCO BRADESCO SA-PRF	604	664	2,127	77,825	銀行
BANCO SAN. BRASIL-UNIT	77	77	223	8,159	銀行
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	140	140	434	15,875	保険
BM&FBOVESPA SA	375	419	855	31,298	各種金融
BRASKEM SA-PREF A	10	10	33	1,216	素材
BR MALLS PARTICIPACOES SA	136	156	207	7,602	不動産
BRF SA	84	84	372	13,615	食品・飲料・タバコ
CCR SA	206	261	495	18,140	運輸
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	47	—	—	—	各種金融
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	28	—	—	—	公益事業
CIA ENERGETICA MINAS GER-PRF	143	143	128	4,687	公益事業
CIA SIDERURGICA NACIONAL	78	78	60	2,196	素材
CIA BRASILEIRA DE DIS-PRF	8	8	63	2,316	食品・生活必需品小売り
CIELO SA	208	250	594	21,732	ソフトウェア・サービス
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PRF-B	30	30	87	3,215	公益事業
COSAN SA INDUSTRIA COMERCIO	26	26	98	3,614	エネルギー
CPFL ENERGIA SA	36	36	93	3,435	公益事業
DURATEX SA	72	72	66	2,416	素材
EDP-ENERGIAS DO BRASIL-RTS	20	—	—	—	公益事業
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	73	73	100	3,671	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS	—	45	76	2,806	公益事業
CENTRAIS ELETRICAS BRAS-PR B	23	48	101	3,724	公益事業
EMBRAER SA	105	160	255	9,346	資本財
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	38	38	204	7,497	公益事業
ESTACIO PARTICIPACOES SA	75	—	—	—	消費者サービス
FIBRIA CELULOSE SA	59	59	174	6,387	素材
GERDAU SA-PREF	160	160	159	5,841	素材
HYPERMARCAS SA	80	80	250	9,174	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF	640	704	2,838	103,834	銀行
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PRF	834	834	859	31,430	銀行
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PRF(N)	—	13	14	514	銀行
JBS SA	181	181	195	7,144	食品・飲料・タバコ
KLABIN SA - UNIT	133	133	212	7,759	素材
KROTON EDUCACIONAL SA	294	294	462	16,933	消費者サービス
LOJAS AMERICANAS SA	60	60	84	3,105	小売
LOJAS AMERICANAS SA-PRF	130	130	223	8,189	小売
LOJAS RENNER S.A.	140	154	446	16,336	小売
LOCALIZA RENT A CAR	29	30	147	5,387	運輸
M DIAS BRANCO SA	9	28	162	5,931	食品・飲料・タバコ
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	15	15	106	3,896	不動産
NATURA COSMETICOS SA	33	33	115	4,243	家庭用品・パーソナル用品
ODONTOPREV S.A.	47	47	56	2,076	ヘルスケア機器・サービス
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	533	533	863	31,601	エネルギー
PETROBRAS - PETROLEO BRAS-PR	851	851	1,334	48,811	エネルギー
PORTO SEGURO SA	32	32	98	3,585	保険
QUALICORP SA	50	50	133	4,870	ヘルスケア機器・サービス
RAIA DROGASIL SA	47	47	329	12,069	食品・生活必需品小売り

銘柄	株数	株数	当 期 末		業 種 等
			評 価 額	外貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千ブラジルレアル	千円	
RUMO SA	—	160	162	5,928	運輸
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	21	21	65	2,390	公益事業
SUL AMERICA SA - UNITS	55	63	116	4,247	保険
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	90	90	114	4,187	素材
TELEFONICA BRASIL S.A. -PREF	53	53	254	9,311	電気通信サービス
TIM PARTICIPACOES SA	169	169	174	6,400	電気通信サービス
TOTVS SA	32	—	—	—	ソフトウェア・サービス
ENGIE BRASIL SA	37	37	128	4,693	公益事業
ULTRAPAR PARTICIPACOES SA	81	81	615	22,500	エネルギー
VALE SA	257	257	686	25,112	素材
VALE SA-PREF A	461	461	1,159	42,423	素材
WEG SA	128	128	261	9,576	資本財
小 計	株 数 ・ 金 額	9,827	10,293	23,085	844,472
銘柄 数 < 比 率 >	60	58	—	< 7.0% >	
(チリ)			千チリペソ		
AES GENER SA	800	800	20,700	3,523	公益事業
AGUAS ANDINAS SA-A	560	560	21,936	3,733	公益事業
BANCO DE CHILE	4,241	5,836	49,167	8,368	銀行
BANCO DE CREDITO E INVERSION	9	9	35,902	6,110	銀行
BANCO SANTANDER CHILE SA	7,470	7,470	30,268	5,151	銀行
CENCOSUD SA	301	301	56,513	9,618	食品・生活必需品小売り
COLBUN SA	2,080	2,080	32,281	5,494	公益事業
ITAU CORPBANCA	26,000	26,000	16,637	2,831	銀行
EMBOTELLADORA ANDINA-PRF B	56	56	14,739	2,508	食品・飲料・タバコ
EMPRESAS CMPC SA	200	200	31,406	5,345	素材
EMPRESAS COPEC SA	114	98	76,268	12,980	エネルギー
ENEL GENERACION CHILE SA	577	577	31,156	5,302	公益事業
ENEL AMERICAS SA	4,195	5,810	78,768	13,406	公益事業
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	27	34	26,216	4,462	電気通信サービス
ENDESA AMERICAS SA	577	—	—	—	公益事業
ENEL CHILE SA	4,195	4,195	31,814	5,414	公益事業
LATAM AIRLINES GROUP SA	53	53	45,412	7,729	運輸
S.A.C.I. FALABELLA	108	133	72,922	12,411	小売
SOC QUIMICA Y MINERA CHILE-B-PRF	14	14	32,300	5,497	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	51,579	54,229	704,413	119,891
銘柄 数 < 比 率 >	19	18	—	< 1.0% >	
(コロンビア)			千コロンビアペソ		
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	18	18	56,635	2,225	各種金融
GRUPO DE INV SURAMERICANA	66	66	265,320	10,427	各種金融
INTERCONEXION ELECTRICA SA	130	130	164,840	6,478	公益事業
BANCOLOMBIA SA-PRF	20	20	63,600	2,499	銀行
CEMENTOS ARGOS SA	88	88	111,836	4,395	素材
ECOPETROL SA	500	500	74,000	2,908	エネルギー
GRUPO AVAL ACCIONES-PRF	470	470	57,575	2,262	銀行
GRUPO ARGOS SA	57	57	122,457	4,812	素材
小 計	株 数 ・ 金 額	1,350	1,351	916,264	36,009
銘柄 数 < 比 率 >	8	8	—	< 0.3% >	
(トルコ)			千トルコリラ		
ARBANK T.A.S.	492	492	454	14,585	銀行
ANADOLU EFES BIRACILIK	55	55	112	3,623	食品・飲料・タバコ
ARCELIK A.S.	65	65	154	4,954	耐久消費財・アパレル
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	44	44	282	9,047	食品・生活必需品小売り

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	外貨換算金額	
(トルコ)	百株	百株	千ドル	千円	
COCA-COLA ICECEK URETIM AS	20	20	74	2,385	食品・飲料・タバコ
ENKA INSAAT VE SANAYI AS	219	—	—	—	資本財
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	460	460	296	9,506	素材
HACI OMER SABANCI HOLDING	277	277	296	9,499	各種金融
KOC HOLDING AS	121	121	201	6,452	資本財
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	33	33	94	3,019	自動車・自動車部品
TURKIYE HALK BANKASI	146	146	177	5,695	銀行
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	170	170	199	6,390	電気通信サービス
TURK HAVA YOLLARI AO	195	195	130	4,176	運輸
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	120	120	75	2,406	電気通信サービス
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	17	17	167	5,380	エネルギー
TURKIYE IS BANKASI-C	399	399	280	8,986	銀行
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	196	196	116	3,750	銀行
TURKIYE GARANTI BANKASI	527	527	493	15,819	銀行
YAPI VE KREDI BANKASI	180	180	77	2,470	銀行
小計	株数・金額	株数	3,683	118,150	
	銘柄数<比率>	19	18	<1.0%>	
(チェコ)			千チェココルナ		
CEZ AS	35	35	1,558	7,356	公益事業
KOMERCNI BANKA AS	18	18	1,764	8,326	銀行
MONETA MONEY BANK AS	—	80	648	3,062	銀行
O2 CZECH REPUBLIC AS	13	13	351	1,656	電気通信サービス
小計	株数・金額	66	4,322	20,401	
	銘柄数<比率>	3	4	<0.2%>	
(ハンガリー)			千ハンガリーフォリント		
RICHTER GEDEON NYRT	27	27	19,153	7,747	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PL	10	10	24,168	9,775	エネルギー
OTP BANK PLC	45	53	45,772	18,514	銀行
小計	株数・金額	83	89,094	36,038	
	銘柄数<比率>	3	3	<0.3%>	
(ポーランド)			千ポーランドズロチ		
ALIOR BANK SA	15	15	111	3,333	銀行
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	8	8	63	1,883	銀行
BANK MILLENNIUM SA	130	130	93	2,782	銀行
BANK PEKAO SA	31	31	456	13,587	銀行
BANK ZACHODNI WBK SA	8	8	287	8,568	銀行
MBANK	2	4	181	5,394	銀行
CCC SA	6	6	134	4,001	耐久消費財・アパレル
CYFROWY POLSAT SA	45	45	119	3,556	メディア
ENERGA SA	50	—	—	—	公益事業
ENEA SA	55	—	—	—	公益事業
EUROCASH SA	21	21	66	1,969	食品・生活必需品小売り
GRUPA AZOTY SA	14	14	94	2,804	素材
GRUPA LOTOS SA	30	30	176	5,255	エネルギー
KGHM POLSKA MIEDZ SA	37	37	435	12,977	素材
LPP SA	0.2	0.2	123	3,661	耐久消費財・アパレル
PKO BANK POLSKI SA	184	184	660	19,658	銀行
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	379	379	254	7,576	エネルギー
POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN	61	73	848	25,269	エネルギー
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	184	184	209	6,228	公益事業
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN SA	120	120	540	16,097	保険
TAURON POLSKA ENERGIA SA	220	220	73	2,187	公益事業

銘柄		柄	期首(前期末)	当期		業種等
			株数	株数	評価額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ポーランド)			百株	百株	千ポーランドズロチ	千円
ORANGE POLSKA SA			141	141	63	1,889
小計	株数・金額		1,744	1,653	4,994	148,684
	銘柄数<比率>		22	20	—	<1.2%>
(香港)					千香港ドル	
3SBIO INC			—	250	254	3,710
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC			180	180	1,651	24,128
AGRICULTURAL BANK OF CHINA			4,850	5,400	1,998	29,190
AIR CHINA LTD-H			580	580	418	6,118
ALIBABA PICTURES GROUP LTD			1,800	1,800	228	3,339
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD			890	890	318	4,655
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD			250	250	543	7,944
ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-H			330	230	593	8,669
AVICHINA INDUSTRY & TECH-H			520	520	268	3,920
BANK OF CHINA LTD - H			17,840	17,840	6,939	101,389
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H			2,162	2,162	1,286	18,798
BEIJING ENTERPRISES WATER GR			900	900	535	7,823
BEIJING CAPITAL INTL AIRPO-H			400	400	455	6,650
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS			1,030	1,450	884	12,922
BEIJING ENTERPRISES HLDGS			120	120	436	6,372
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE			640	640	876	12,810
BYD CO LTD-H			145	145	631	9,225
CAR INC			190	—	—	—
CGN POWER CO LTD-H			1,860	1,860	437	6,386
CHINA STATE CONSTRUCTION INT			520	520	719	10,514
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H			740	740	344	5,038
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD			550	550	546	7,979
CHINA EVERBRIGHT LTD			180	180	313	4,581
CHINA CONSTRUCTION BANK-H			18,369	18,369	11,903	173,906
CHINA RESOURCES POWER HOLDIN			470	470	700	10,231
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H			5,393	5,393	3,478	50,820
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN			370	370	683	9,989
CHINA UNICOM HONG KONG LTD			1,238	1,238	1,318	19,257
CHINA LIFE INSURANCE CO-H			1,590	1,590	3,967	57,958
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING			210	210	456	6,673
CHINA OVERSEAS LAND & INVEST			863	863	1,929	28,186
CHINA COMMUNICATIONS SERVI-H			600	600	274	4,014
CHINA COSCO HOLDINGS-H			658	—	—	—
CHINA OILFIELD SERVICES-H			460	460	310	4,529
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LT			780	960	1,102	16,101
CHINA RESOURCES LAND LTD			617	617	1,294	18,908
CHINA SOUTHERN AIRLINES CO-H			380	380	207	3,031
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H			730	730	1,356	19,816
CHINA TELECOM CORP LTD			3,150	3,150	1,206	17,626
CHINA MOBILE LTD			1,337	1,337	11,438	167,109
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H			480	480	288	4,214
CRRC CORP LTD- H			790	790	588	8,598
CHINA TAIPING INSURANCE HOLD			349	349	702	10,260
CHINA MENGNIU DAIRY CO			580	580	874	12,778
CHINA COAL ENERGY CO - H			850	850	294	4,309
CHINA MERCHANTS BANK - H			981	811	1,736	25,371
CHINA CITIC BANK - H			2,060	2,060	1,017	14,867
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H			960	960	1,059	15,484

銘柄	期首(前期末)	当期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価	額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA MINSHENG BANKING-H		1,312	1,312	1,011	14,778	銀行
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H		1,000	1,000	669	9,774	資本財
CHINA RAILWAY CONSTRUCTION-H		460	460	514	7,513	資本財
CHINA SHIPPING CONTAINER-H		1,007	—	—	—	運輸
CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD		546	546	1,613	23,572	保険
CHINA GAS HOLDINGS LTD		540	540	600	8,773	公益事業
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD		300	300	664	9,708	公益事業
CHINA INTERNATIONAL MARINE-H		118	—	—	—	資本財
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING		240	240	335	4,894	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H		1,710	1,710	501	7,320	各種金融
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS		1,600	900	37	552	食品・飲料・タバコ
CHINA VANKE CO LTD-H		303	303	597	8,729	不動産
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H		900	900	323	4,720	銀行
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H		750	750	388	5,675	銀行
CHINA POWER INTERNATIONAL		550	550	160	2,338	公益事業
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H		630	630	447	6,544	各種金融
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS		310	310	468	6,838	資本財
CHINA HUARONG ASSET MANAGEME		—	1,610	545	7,973	各種金融
CITIC SECURITIES CO LTD-H		460	460	736	10,766	各種金融
CITIC LTD		940	940	1,082	15,820	資本財
ALIBABA HEALTH INFORMATION T		500	760	249	3,641	ヘルスケア機器・サービス
CNOOC LTD		3,880	3,880	3,569	52,151	エネルギー
KUNLUN ENERGY CO LTD		660	660	461	6,740	エネルギー
COSCO SHIPPING PORTS LTD		320	320	279	4,086	運輸
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO		1,007	1,007	772	11,285	不動産
DATANG INTL POWER GEN CO-H		230	—	—	—	公益事業
DALIAN WANDA COMMERCIAL PR-H		107	—	—	—	不動産
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H		600	600	511	7,468	自動車・自動車部品
CHINA EVERGRANDE GROUP		960	960	792	11,571	不動産
FAR EAST HORIZON LTD		400	400	293	4,283	各種金融
FOSUN INTERNATIONAL LTD		490	490	579	8,461	資本財
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP		1,100	1,100	260	3,808	不動産
FULLSHARE HOLDINGS LTD		—	1,025	346	5,061	不動産
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP-H		—	100	283	4,134	自動車・自動車部品
GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD		2,980	2,980	277	4,049	半導体・半導体製造装置
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT		1,000	1,000	1,110	16,217	自動車・自動車部品
GF SECURITIES CO LTD-H		306	306	496	7,260	各種金融
GOME ELECTRICAL APPLIANCES		1,911	1,911	193	2,820	小売
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H		750	750	611	8,930	自動車・自動車部品
GUANGDONG INVEST		620	620	705	10,308	公益事業
YUEXIU PROPERTY CO LTD		2,128	—	—	—	不動産
GUANGZHOU R&F PROPERTIES - H		264	264	322	4,705	不動産
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H		763	523	670	9,799	自動車・自動車部品
HAITONG SECURITIES CO LTD-H		676	676	877	12,819	各種金融
HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD		170	360	684	9,993	耐久消費財・アパレル
HANERGY THIN FILM POWER GROU		2,400	2,400	828	12,097	半導体・半導体製造装置
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS		120	120	224	3,274	資本財
HENGAN INTL GROUP CO LTD		155	175	984	14,381	家庭用品・パーソナル用品
HUANENG RENEWABLES CORP-H		640	640	168	2,468	公益事業
HUANENG POWER INTL INC-H		1,060	1,060	612	8,951	公益事業
HUADIAN POWER INTL CORP-H		260	—	—	—	公益事業
HUATAI SECURITIES CO LTD-H		320	320	476	6,956	各種金融

銘柄	株数	株数	当 期 末		業 種 等
			評 価	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
IND & COMM BK OF CHINA - H	16,365	16,365	8,428	123,138	銀行
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	240	240	264	3,857	運輸
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	310	310	363	5,317	素材
KINGSOFT CORP LTD	160	160	352	5,154	ソフトウェア・サービス
LENOVO GROUP LTD	1,540	1,540	759	11,092	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LONGFOR PROPERTIES	310	310	413	6,041	不動産
LUYE PHARMA GROUP LTD	320	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NEW CHINA LIFE INSURANCE CO-H	140	140	575	8,406	保険
NEW WORLD CHINA LAND LTD	720	—	—	—	不動産
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	420	420	368	5,381	素材
PEOPLE'S INSURANCE CO GROU-H	1,630	1,630	533	7,787	保険
PETROCHINA CO LTD-H	4,670	4,670	2,484	36,297	エネルギー
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	793	993	1,291	18,866	保険
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,140	1,140	5,335	77,947	保険
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	—	680	571	8,355	半導体・半導体製造装置
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	5,000	—	—	—	半導体・半導体製造装置
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	130	130	275	4,026	ヘルスケア機器・サービス
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	130	130	688	10,056	耐久消費財・アパレル
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	700	700	247	3,620	資本財
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	375	375	448	6,552	不動産
SHUI ON LAND LTD	429	—	—	—	不動産
SHANGHAI INDUSTRIAL HLDG LTD	130	130	308	4,510	資本財
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	320	320	193	2,833	ヘルスケア機器・サービス
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	110	110	338	4,941	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOPHARM GROUP CO-H	264	264	909	13,287	ヘルスケア機器・サービス
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	645	645	288	4,212	素材
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	650	650	239	3,504	不動産
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,020	1,020	661	9,671	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	320	320	237	3,468	資本財
SOHO CHINA LTD	650	650	275	4,026	不動産
SUN ART RETAIL GROUP	430	430	293	4,290	食品・生活必需品小売り
SUNNY OPTICAL TECH	—	140	900	13,151	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	400	400	408	5,972	不動産
TENCENT HOLDINGS LTD	1,140	1,249	32,349	472,620	ソフトウェア・サービス
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	380	380	385	5,629	食品・飲料・タバコ
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	200	200	428	6,253	ソフトウェア・サービス
TSINGTAO BREWERY CO LTD-H	60	60	202	2,954	食品・飲料・タバコ
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	1,320	1,320	712	10,414	食品・飲料・タバコ
WEICHAI POWER CO LTD-H	192	192	242	3,540	資本財
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	120	120	438	6,399	公益事業
YANZHOU COAL MINING CO-H	500	500	293	4,288	エネルギー
ZHEJIANG EXPRESSWAY CO-H	430	430	398	5,823	運輸
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC	90	90	374	5,469	資本財
ZIJIN MINING GROUP CO LTD	1,477	1,477	382	5,590	素材
ZTE CORP-H	216	216	319	4,664	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	280	280	285	4,172	自動車・自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	168,268	161,624	162,480	2,373,833
	銘 柄 数 < 比 率 >	140	134	—	< 19.6% >
(マレーシア)			千マレーシアリンギット		
ATRASIA BHD	470	470	167	4,408	運輸
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	370	370	166	4,377	銀行
AMMB HOLDINGS BHD	326	326	178	4,698	銀行

銘柄	株数	株数	当 期 末		業 種 等
			評 価	額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)	百株	百株	千マレーシアリンギット	千円	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	300	300	82	2,165	メディア
AXIATA GROUP BERHAD	519	519	277	7,316	電気通信サービス
BERJAYA SPORTS TOTO BERHAD	276	276	77	2,047	消費者サービス
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	25	25	114	3,026	食品・飲料・タバコ
BUMI ARMADA BERHAD	600	—	—	—	エネルギー
CIMB GROUP HOLDINGS BHD	1,098	756	449	11,832	銀行
DIALOG GROUP BHD	700	700	134	3,541	エネルギー
DIGI.COM BHD	740	740	378	9,963	電気通信サービス
FELDA GLOBAL VENTURES	430	430	82	2,175	食品・飲料・タバコ
GAMUDA BHD	560	300	162	4,284	資本財
GENTING BHD	453	453	451	11,888	消費者サービス
GENTING MALAYSIA BHD	725	725	420	11,080	消費者サービス
HARTALEGA HOLDINGS BHD	170	170	96	2,539	ヘルスケア機器・サービス
HAP SENG CONSOLIDATED	100	100	89	2,353	資本財
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	50	50	87	2,300	銀行
HONG LEONG BANK BERHAD	123	123	172	4,550	銀行
IHH HEALTHCARE BHD	540	720	444	11,705	ヘルスケア機器・サービス
IJM CORP BHD	700	700	248	6,547	資本財
IOI CORPORATION BERHAD	696	416	193	5,095	食品・飲料・タバコ
IOI PROPERTIES GROUP BHD	534	668	145	3,822	不動産
KUALA LUMPUR KEPONG BERHAD	120	120	298	7,873	食品・飲料・タバコ
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	180	180	145	3,841	運輸
MAXIS BHD	440	440	289	7,617	電気通信サービス
MALAYAN BANKING BHD	1,031	678	636	16,770	銀行
MISC BHD	300	300	226	5,968	運輸
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	710	530	385	10,152	素材
PETRONAS DAGANGAN BHD	50	50	120	3,169	エネルギー
PETRONAS GAS BERHAD	140	140	260	6,854	公益事業
PPB GROUP BERHAD	117	117	200	5,271	食品・飲料・タバコ
PUBLIC BANK BERHAD	553	613	1,226	32,309	銀行
RHB CAPITAL BHD	140	—	—	—	銀行
RHB BANK BHD	—	182	100	2,636	銀行
SAPURA ENERGY BHD	700	700	135	3,578	エネルギー
SIME DARBY BERHAD	647	647	603	15,911	資本財
TENAGA NASIONAL BERHAD	661	661	925	24,393	公益事業
TELEKOM MALAYSIA BHD	250	250	162	4,268	電気通信サービス
UMW HOLDINGS BHD	117	117	67	1,788	自動車・自動車部品
YTL POWER INTERNATIONAL BHD	735	735	112	2,963	公益事業
YTL CORPORATION BERHAD	1,447	1,447	218	5,757	公益事業
小 計	株 数 ・ 金 額	18,846	17,248	10,734	282,849
	銘 柄 数 < 比 率 >	41	40	—	< 2.3% >
(タイ)			千タイバーツ		
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	208	248	4,451	14,690	電気通信サービス
AIRPORTS OF THAILAND PC-NVDR	80	800	3,300	10,890	運輸
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	1,100	1,100	2,266	7,477	ヘルスケア機器・サービス
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	350	525	924	3,049	エネルギー
BANGKOK BANK-FOREIGN REG	66	66	1,231	4,064	銀行
BANGKOK EXPRESSWAY AND METRO-NVDR	1,740	1,740	1,244	4,105	運輸
BEC WORLD PUBLIC CO LTD-NVDR	310	310	533	1,759	メディア
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	—	230	994	3,282	資本財
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	1,600	1,600	1,328	4,382	運輸
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	80	80	1,480	4,884	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	百株	百株	千タイバツ	千円	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	310	310	1,929	6,368	不動産
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	700	700	1,715	5,659	食品・飲料・タバコ
CP ALL PCL-NVDR	988	988	6,347	20,948	食品・生活必需品小売り
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	120	120	1,164	3,841	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ELECTRICITY GENERA PCL-NVDR	—	30	624	2,059	公益事業
GLOW ENERGY PCL - NVDR	100	100	787	2,598	公益事業
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	390	390	1,384	4,568	素材
IRPC PCL - NVDR	1,918	1,918	968	3,196	エネルギー
KASIKORNBANK PCL-FOREIGN	242	242	4,489	14,814	銀行
KASIKORNBANK PCL-NVDR	132	132	2,442	8,058	銀行
KCE ELECTRONICS -NVDR	—	64	668	2,207	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KRUNG THAI BANK - NVDR	751	751	1,404	4,635	銀行
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	550	550	1,980	6,534	消費者サービス
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	287	287	2,720	8,976	エネルギー
PTT PCL-NVDR	216	216	8,337	27,514	エネルギー
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	390	390	2,840	9,373	素材
ROBINSON PCL-NVDR	—	120	699	2,306	小売
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	363	363	5,517	18,208	銀行
SIAM CEMENT PCL-NVDR	26	26	1,326	4,375	素材
SIAM CEMENT PUB CO-FOR REG	73	73	3,723	12,285	素材
THAI OIL PCL-NVDR	280	280	2,114	6,976	エネルギー
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	—	400	808	2,666	食品・飲料・タバコ
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	4,000	4,000	872	2,877	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR	1,827	1,827	1,141	3,768	電気通信サービス
TRUE CORP PCL-TSR NVDR-RTS	613	—	—	—	電気通信サービス
(タイ…非上場)					
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR-RTS	175	—	—	—	エネルギー
小計	株数・金額	19,987	20,977	73,759	243,405
銘柄数<比率>	31	34	—	<2.0%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ		
ABOITIZ POWER CORP	460	460	1,830	4,192	公益事業
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	520	520	3,936	9,014	資本財
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	540	540	793	1,817	資本財
AYALA CORPORATION	49	49	4,269	9,778	各種金融
AYALA LAND INC	1,569	1,569	5,878	13,460	不動産
BDO UNIBANK INC	310	370	4,516	10,343	銀行
BANK OF THE PHILIPPINE ISLAN	177	177	1,880	4,306	銀行
DMCI HOLDINGS INC	1,150	1,150	1,513	3,465	資本財
ENERGY DEVELOPMENT CORP	1,750	1,750	1,048	2,400	公益事業
GLOBE TELECOM INC	6	6	1,260	2,885	電気通信サービス
GT CAPITAL HOLDINGS INC	17	17	2,099	4,807	各種金融
INTL CONTAINER TERM SVCS INC	100	100	979	2,241	運輸
JG SUMMIT HOLDINGS INC	500	650	5,521	12,644	資本財
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	100	100	2,060	4,717	消費者サービス
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	3,200	3,200	2,128	4,873	各種金融
METROPOLITAN BANK & TRUST	188	188	1,675	3,837	銀行
PLDT INC	21	21	3,542	8,112	電気通信サービス
SECURITY BANK CORP	—	50	1,075	2,461	銀行
SM INVESTMENTS CORP	33	49	3,840	8,794	資本財
SM PRIME HOLDINGS INC	1,767	1,767	5,654	12,949	不動産

銘柄		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	
(フィリピン)		百株	百株	千フィリピンペソ	千円	
UNIVERSAL ROBINA CORP		210	210	3,357	7,689	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	12,669	12,946	58,862	134,795	
	銘柄数<比率>	20	21	—	<1.1%>	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
ADARO ENERGY TBK PT		2,700	2,700	400,950	3,448	エネルギー
AKR CORPORINDO TBK PT		450	450	283,500	2,438	資本財
ASTRA INTERNATIONAL TBK PT		4,950	4,950	4,306,500	37,035	自動車・自動車部品
PT BANK CENTRAL ASIA		2,700	2,700	4,927,500	42,376	銀行
BANK RAKYAT INDONESIA		2,480	2,480	3,546,400	30,499	銀行
PT BANK NEGARA INDONESIA		1,800	1,800	1,174,500	10,100	銀行
BANK MANDIRI TBK		2,090	2,090	2,534,125	21,793	銀行
BUMI SERPONG DAMAI PT		1,700	1,700	306,000	2,631	不動産
CHAROEN POKPHAND INDONESIA PT		2,000	2,000	610,000	5,246	食品・飲料・タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT		76	1,900	731,500	6,290	食品・飲料・タバコ
PT INDOFOOD SUKSES MAK TBK		1,360	1,360	1,152,600	9,912	食品・飲料・タバコ
KALBE FARMA TBK PT		5,500	5,500	838,750	7,213	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MATAHARI DEPARTMENT STORE TB		520	520	781,300	6,719	小売
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT		1,000	1,000	192,500	1,655	メディア
GUDANG GARAM TBK PT		150	150	1,104,000	9,494	食品・飲料・タバコ
PAKUWON JATI TBK PT		—	5,200	325,000	2,795	不動産
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT		2,135	2,135	516,670	4,443	公益事業
BANK DANAMON INDONESIA TBK		480	480	242,400	2,084	銀行
INDOCEMENT TUNGGA PRKARSA		320	320	569,600	4,898	素材
TELEKOMUNIKASI INDONESIA PER		11,150	11,150	4,861,400	41,808	電気通信サービス
SEMEN GRESIK (PERSERO) PT		660	660	587,400	5,051	素材
SURYA CITRA MEDIA PT TBK		1,000	1,000	286,000	2,459	メディア
SUMMARECON AGUNG TBK PT		1,850	1,850	247,900	2,131	不動産
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE		360	360	203,400	1,749	電気通信サービス
PT UNILEVER INDONESIA TBK		300	300	1,440,000	12,384	家庭用品・パーソナル用品
UNITED TRACTORS TBK PT		535	335	822,425	7,072	エネルギー
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT		—	1,000	226,000	1,943	資本財
XL AXIATA TBK PT		780	780	243,360	2,092	電気通信サービス
(インドネシア…非上場)						
LIPPO KARAWACI TBK/PT		4,500	4,500	344,250	2,960	不動産
小計	株数・金額	53,546	61,370	33,805,930	290,730	
	銘柄数<比率>	27	29	—	<2.4%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
AMOREPACIFIC GROUP		7	7	114,375	11,654	家庭用品・パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP		7	7	252,580	25,737	家庭用品・パーソナル用品
BGF RETAIL CO LTD		1	3	47,310	4,820	食品・生活必需品小売り
BNK FINANCIAL GROUP INC		64	64	63,478	6,468	銀行
CELLTRION INC		14	17	171,565	17,482	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHEIL WORLDWIDE INC		23	23	45,120	4,597	メディア
SAMSUNG C&T CORP		16	16	207,953	21,190	資本財
CJ KOREA EXPRESS CORP		1	1	22,945	2,338	運輸
CJ CORP		2	2	56,000	5,706	資本財
CJ CHEILJEDANG CORP		1	1	68,676	6,998	食品・飲料・タバコ
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR		36	36	28,382	2,892	資本財
POSCO DAEWOO CORP		14	14	33,914	3,455	資本財
DAELIM INDUSTRIAL CO LTD		6	6	49,410	5,034	資本財
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD		45	98	91,482	9,322	各種金融
DGB FINANCIAL GROUP INC		25	25	32,195	3,280	銀行

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
				外貨建金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
DONGBU INSURANCE CO LTD	8	8	54,880	5,592	保険
DOOSAN CORP	2	—	—	—	資本財
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	8	8	19,160	1,952	資本財
DONGSUH COMPANIES INC	—	8	26,265	2,676	食品・生活必需品小売り
E-MART CO LTD	4	4	105,492	10,749	食品・生活必需品小売り
GS RETAIL CO LTD	6	6	33,420	3,405	食品・生活必需品小売り
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	12	12	36,330	3,702	資本財
GS HOLDINGS	12	12	79,629	8,114	エネルギー
HANA FINANCIAL GROUP	60	60	256,241	26,110	銀行
HANMI SCIENCE CO LTD	2	2	19,339	1,970	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANWHA CHEMICAL CORP	20	20	55,500	5,655	素材
HANWHA CORPORATION	11	11	49,474	5,041	資本財
HANKOOK TIRE CO LTD	14	14	89,661	9,136	自動車・自動車部品
HANON SYSTEMS	54	54	51,300	5,227	自動車・自動車部品
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	60	60	39,600	4,035	保険
HANMI PHARM CO LTD	1	1	42,522	4,332	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HANSSEM CO LTD	1	1	37,825	3,854	耐久消費財・アパレル
HOTEL SHILLA CO LTD	8	8	48,223	4,913	小売
LOTTE CHEMICAL CORP	3	3	127,650	13,007	素材
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	4	4	61,000	6,215	運輸
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	20	12	44,580	4,542	保険
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	15	15	71,216	7,256	資本財
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	8	8	87,550	8,921	自動車・自動車部品
HYUNDAI DEPT STORE CO	3	3	42,180	4,298	小売
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	13	13	63,011	6,420	資本財
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	8	6	113,390	11,554	資本財
HYUNDAI MOBIS	15	15	370,500	37,753	自動車・自動車部品
HYOSUNG CORPORATION	5	5	80,850	8,238	素材
HYUNDAI MOTOR CO	34	34	528,220	53,825	自動車・自動車部品
HYUNDAI STEEL CO	18	18	101,565	10,349	素材
SK HYNIX INC	126	126	702,228	71,557	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI WIA CORP	3	3	21,344	2,174	自動車・自動車部品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PRF	4	4	46,416	4,729	自動車・自動車部品
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD	—	1	50,830	5,179	半導体・半導体製造装置
INDUSTRIAL BANK OF KOREA	64	64	82,432	8,399	銀行
KANGWON LAND INC	27	27	106,783	10,881	消費者サービス
KB FINANCIAL GROUP INC	80	80	432,270	44,048	銀行
KCC CORP	1	1	42,720	4,353	資本財
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINE	4	4	24,570	2,503	商業・専門サービス
KIA MOTORS CORPORATION	56	56	207,552	21,149	自動車・自動車部品
KUMHO PETRO CHEMICAL CO LTD	4	4	35,052	3,571	素材
KOREAN AIR LINES CO LTD	8	8	27,820	2,834	運輸
KOREA ELECTRIC POWER CORP	56	56	243,648	24,827	公益事業
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	9	9	51,188	5,216	各種金融
KOREA GAS CORPORATION	8	8	40,282	4,104	公益事業
KOREA ZINC CO LTD	1	1	66,495	6,775	素材
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	10	15	95,400	9,721	資本財
KT CORP	10	10	31,888	3,249	電気通信サービス
KT&G CORP	22	25	264,907	26,994	食品・飲料・タバコ
LG INNOTEK CO LTD	2	2	37,240	3,794	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG CHEM LTD	10	10	285,570	29,099	素材
LG CORP	20	20	141,400	14,408	資本財

銘柄	株数	株数	当 期 末		業 種 等
			評 価 額	外貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千韓国ウォン	千円	
LG ELECTRONICS INC	20	20	168,885	17,209	耐久消費財・アパレル
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	2	2	194,400	19,809	家庭用品・パーソナル用品
LG DISPLAY CO LTD	55	55	160,128	16,317	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
LG UPLUS CORP.	50	50	66,000	6,725	電気通信サービス
LG CHEM LTD-PRF	2	2	43,010	4,382	素材
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.15	1	32,025	3,263	食品・飲料・タバコ
LOTTE SHOPPING CO	2	2	59,125	6,024	小売
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	0.15	0.15	26,775	2,728	食品・飲料・タバコ
MIRAE ASSET SECURITIES CO LT	17	—	—	—	各種金融
NCSOFT CORPORATION	3	3	125,650	12,803	ソフトウェア・サービス
NAVER CORP	6	6	526,892	53,690	ソフトウェア・サービス
OCI CO LTD	3	3	26,592	2,709	素材
ORION CORP	0.8	0.8	57,760	5,885	食品・飲料・タバコ
OTTOGI CORPORATION	0.3	0.3	24,090	2,454	食品・飲料・タバコ
POSCO	14	16	436,310	44,459	素材
S-OIL CORPORATION	8	8	87,862	8,953	エネルギー
S1 CORPORATION	4	4	42,210	4,301	商業・専門サービス
SAMSUNG SDS CO LTD	6	6	94,900	9,670	ソフトウェア・サービス
SAMSUNG CARD CO	6	6	28,497	2,903	各種金融
SAMSUNG ELECTRONICS-PFD	4	3	658,875	67,139	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO	13	13	101,612	10,354	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG SECURITIES CO LTD	15	15	57,494	5,858	各種金融
SAMSUNG FIRE & MARINE INS	7	7	217,230	22,135	保険
SAMSUNG SDI CO LTD	12	12	189,112	19,270	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	36	59	67,286	6,856	資本財
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	24	21	4,990,325	508,514	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HANWHA TECHWIN CO LTD	—	7	36,423	3,711	資本財
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD	17	14	172,200	17,547	保険
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	—	3	60,612	6,176	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	94	94	470,940	47,988	銀行
SHINSEGAE CO LTD	1	1	38,243	3,896	小売
SK HOLDINGS CO LTD	8	10	254,229	25,905	資本財
SK INNOVATION CO LTD	14	14	254,904	25,974	エネルギー
SK NETWORKS CO LTD	19	19	14,488	1,476	資本財
SK TELECOM	4	4	94,400	9,619	電気通信サービス
COWAY CO LTD	10	10	114,450	11,662	耐久消費財・アパレル
NH INVESTMENT & SECURITIES C	31	31	44,076	4,491	各種金融
WOORI BANK	84	84	135,837	13,841	銀行
YUHAN CORPORATION	2	2	60,984	6,214	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CJ E&M CORP	4	4	39,057	3,979	メディア
KAKAO CORP	6	6	61,908	6,308	ソフトウェア・サービス
DONGSUH COMPANIES INC	8	—	—	—	食品・生活必需品小売り
PARADISE CO LTD	10	—	—	—	消費者サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	1,881	1,940	17,395,800	1,772,631
銘 柄 数 < 比 率 >		106	106	—	<14.7%>
(台湾)			千新台幣ドル		
ACER INC	648	648	968	3,662	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGR	1,277	1,317	4,915	18,579	半導体・半導体製造装置
ADVANTECH CO LTD	65	65	1,594	6,026	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	500	500	485	1,835	電気通信サービス
ASIA CEMENT CORP	579	579	1,623	6,136	素材
ASUSTEK COMPUTER INC	157	157	4,423	16,719	テクノロジー・ハードウェアおよび機器

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	
(台湾)	百株	百株	千新台湾ドル	千円		
AU OPTRONICS CORP	1,739	1,739	2,018	7,629	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CASETEK HOLDINGS LTD	30	30	257	974	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO	1,855	1,855	9,239	34,926	保険	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	134	134	4,430	16,746	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD	3,284	3,997	7,795	29,465	銀行	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	131	131	1,079	4,079	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
CHINA STEEL CORP	2,691	2,691	6,500	24,572	素材	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	752	783	2,314	8,747	保険	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	885	938	1,642	6,208	銀行	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL	3,507	3,507	2,914	11,016	銀行	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	833	833	8,837	33,405	電気通信サービス	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	459	459	2,756	10,420	自動車・自動車部品	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	153	153	1,195	4,519	各種金融	
CHINA AIRLINES LTD	670	670	621	2,350	運輸	
COMPAL ELECTRONICS	869	869	1,782	6,738	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
DELTA ELECTRONICS INC	425	425	7,189	27,176	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
E. SUN FINANCIAL HOLDING CO	1,613	1,880	3,469	13,115	銀行	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	31	31	1,053	3,980	耐久消費財・アパレル	
EVA AIRWAYS CORP	411	431	632	2,391	運輸	
EVERGREEN MARINE CORP LTD	452	452	603	2,281	運輸	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	420	420	3,213	12,145	電気通信サービス	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORP	759	759	1,838	6,948	資本財	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	61	69	830	3,139	耐久消費財・アパレル	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	1,960	2,048	3,933	14,869	銀行	
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	270	270	2,884	10,901	エネルギー	
FORMOSA CHEMICALS & FIBRE	660	660	6,023	22,768	素材	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	235	237	2,140	8,092	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
FORMOSA PLASTICS CORP	854	854	7,602	28,738	素材	
FORMOSA TAFFETA CO.	—	180	558	2,109	耐久消費財・アパレル	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO	1,377	1,377	6,604	24,966	各種金融	
GIANT MANUFACTURING	50	50	875	3,307	耐久消費財・アパレル	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	68	39	827	3,128	資本財	
HTC CORP	170	170	1,197	4,526	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	149	149	750	2,836	不動産	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	70	70	2,439	9,221	小売	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	3,161	3,477	36,167	136,713	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,223	1,649	2,836	10,722	銀行	
INOTERA MEMORIES INC	450	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
INVENTEC CORP	621	621	1,439	5,439	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
INNOLUX CORP	1,892	1,892	2,460	9,301	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LARGAN PRECISION CO LTD	22	22	10,956	41,415	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	455	457	2,330	8,809	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
MERIDA INDUSTRY CO LTD	52	52	805	3,046	耐久消費財・アパレル	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,223	2,223	5,514	20,844	銀行	
MEDIATEK INC	331	331	7,106	26,863	半導体・半導体製造装置	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO	—	130	928	3,508	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
NANYA TECHNOLOGY CORP	—	150	804	3,039	半導体・半導体製造装置	
NAN YA PLASTICS CORP	1,031	1,031	7,292	27,565	素材	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	—	30	955	3,611	耐久消費財・アパレル	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	125	125	1,502	5,679	半導体・半導体製造装置	
PEGATRON CORP	348	438	3,968	15,002	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	
POU CHEN	381	381	1,619	6,120	耐久消費財・アパレル	

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(台湾)		百株	百株	千新台幣ドル	千円	
POWERTECH TECHNOLOGY INC		116	116	1,076	4,068	半導体・半導体製造装置
PRESIDENT CHAIN STORE CORP		124	124	3,404	12,869	食品・生活必需品小売り
QUANTA COMPUTER INC		634	634	4,109	15,533	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR		77	—	—	—	半導体・半導体製造装置
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP		118	118	1,205	4,555	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD		283	283	1,036	3,917	不動産
RUENTEX INDUSTRIES LTD		120	120	555	2,097	耐久消費財・アパレル
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS		1,213	1,213	976	3,692	保険
SILICONWARE PRECISION INDS		420	420	2,045	7,730	半導体・半導体製造装置
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS		2,136	2,242	2,081	7,867	銀行
STANDARD FOODS CORP		70	77	586	2,217	食品・飲料・タバコ
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP		305	321	1,047	3,958	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TAIWAN FERTILIZER CO LTD		200	200	807	3,050	素材
TAIWAN CEMENT		761	761	2,635	9,962	素材
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		5,423	5,433	111,931	423,099	半導体・半導体製造装置
TAIWAN MOBILE CO LTD		331	331	3,783	14,301	電気通信サービス
TAISHIN FINANCIAL HOLDING		1,696	1,818	2,364	8,938	銀行
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL		1,788	1,914	2,995	11,323	銀行
TAIWAN BUSINESS BANK		1,283	1,347	1,131	4,278	銀行
TECO ELECTRIC & MACHINERY		520	360	1,083	4,096	資本財
TRANSCEND INFORMATION INC		73	73	734	2,776	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO		1,097	1,097	6,253	23,636	食品・飲料・タバコ
UNITED MICROELECTRONICS CORP		2,385	2,385	2,922	11,048	半導体・半導体製造装置
WISTRON CORP		483	498	1,385	5,236	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WPG HOLDINGS LTD		400	400	1,602	6,055	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
YULON MOTOR COMPANY		350	350	928	3,507	自動車・自動車部品
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO		2,172	2,172	2,824	10,676	各種金融
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING		70	70	532	2,013	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
OBI PHARMA INC		20	20	539	2,037	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TAI-MED BIOLOGICS INC		—	30	540	2,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HERMES MICROVISION INC		10	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PHISON ELECTRONICS CORP		30	30	880	3,328	半導体・半導体製造装置
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD		60	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI		220	220	1,218	4,607	半導体・半導体製造装置
小 計	株 数 ・ 金 額	68,591	70,847	373,971	1,413,610	
	銘 柄 数 < 比 率 >	87	88	—	<11.7%>	
(インド)				千インドルピー		
NESTLE INDIA LIMITED		5	5	3,701	6,625	食品・飲料・タバコ
AMBUJA CEMENTS LIMITED		109	109	2,831	5,069	素材
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE		23	23	3,004	5,378	ヘルスケア機器・サービス
ASIAN PAINTS LTD		50	50	5,740	10,275	素材
ACC LIMITED		13	13	2,236	4,004	素材
ASHOK LEYLAND LTD		270	270	2,327	4,166	資本財
AUROBINDO PHARMA LTD		75	75	4,604	8,242	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AXIS BANK LTD		110	369	18,493	33,103	銀行
BAJAJ AUTO LTD		24	24	7,199	12,886	自動車・自動車部品
BAJAJ FINSERV LTD		—	7	3,276	5,865	保険
BAJAJ FINANCE LTD		—	32	4,265	7,635	各種金融
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		44	105	7,642	13,679	エネルギー
BHARAT HEAVY ELECTRICALS		131	131	2,258	4,042	資本財
BHARAT FORGE LIMITED		18	18	2,019	3,615	自動車・自動車部品
BHARTI AIRTEL LTD		260	260	9,467	16,947	電気通信サービス

銘柄	期首(前期末)	当期 末				業 種 等
		株 数	株 数	評 価	額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円		
BHARTI INFRATEL LTD	113	113	4,226	7,565	電気通信サービス	
BOSCH LTD	1	1	3,871	6,929	自動車・自動車部品	
CADILA HEALTHCARE LTD	53	53	2,588	4,632	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
CAIRN INDIA LTD	91	91	2,596	4,648	エネルギー	
CIPLA LTD	76	76	4,352	7,791	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
COAL INDIA LTD	140	140	3,888	6,960	エネルギー	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	14	17	2,069	3,704	運輸	
DABUR INDIA LTD	95	95	2,616	4,684	家庭用品・パーソナル用品	
DIVI'S LABORATORIES LTD	19	19	1,186	2,123	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
DR. REDDY'S LABORATORIES	21	21	5,860	10,489	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
EICHER MOTORS LTD	2	2	8,100	14,500	資本財	
GAIL INDIA LTD	108	145	6,003	10,745	公益事業	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER HEA	2	—	—	—	食品・飲料・タバコ	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	29	29	2,074	3,712	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	37	37	7,126	12,755	家庭用品・パーソナル用品	
GRASIM INDUSTRIES LTD	—	39	4,573	8,187	素材	
HAVELLS INDIA LTD	—	61	3,135	5,612	資本財	
HCL TECHNOLOGIES LTD	119	119	10,097	18,074	ソフトウェア・サービス	
HERO MOTOCORP LTD	14	14	4,921	8,809	自動車・自動車部品	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	155	155	15,260	27,315	家庭用品・パーソナル用品	
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	292	292	5,810	10,401	素材	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	—	81	4,350	7,788	エネルギー	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	325	325	50,800	90,933	銀行	
ICICI BANK LTD	193	238	7,190	12,870	銀行	
IDEA CELLULAR LTD	260	260	2,237	4,004	電気通信サービス	
IDFC BANK LTD	—	290	1,847	3,306	銀行	
INFOSYS LTD	401	401	38,195	68,369	ソフトウェア・サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE L	58	58	6,164	11,033	銀行	
ITC LTD	505	757	21,058	37,695	食品・飲料・タバコ	
JSW STEEL LTD	20	200	4,034	7,220	素材	
LARSEN & TOUBRO LTD	69	69	12,161	21,769	資本財	
LIC HOUSING FINANCE LTD	70	70	4,791	8,576	銀行	
LUPIN LTD	41	41	5,304	9,495	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	74	74	2,452	4,389	各種金融	
MAHINDRA & MAHINDRA LIMITED	86	86	11,830	21,176	自動車・自動車部品	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	23	23	15,694	28,093	自動車・自動車部品	
MARICO LTD	86	86	2,667	4,774	家庭用品・パーソナル用品	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	60	60	2,503	4,480	自動車・自動車部品	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECON	150	150	5,343	9,563	運輸	
NTPC LIMITED	200	200	3,195	5,719	公益事業	
OIL & NATURAL GAS CORP LTD	154	301	5,637	10,091	エネルギー	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	20	20	5,732	10,261	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
POWER FINANCE CORPORATION	—	130	2,080	3,724	各種金融	
RELIANCE COMMUNICATION LTD	90	—	—	—	電気通信サービス	
RELIANCE INDUSTRIES LTD	289	289	38,906	69,642	エネルギー	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	110	—	—	—	各種金融	
VEDANTA LTD	232	232	5,603	10,029	素材	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	40	40	3,984	7,132	各種金融	
SHREE CEMENT LTD	2	2	4,046	7,243	素材	
SIEMENS INDIA LIMITED	18	18	2,686	4,809	資本財	
STATE BANK OF INDIA	340	340	10,247	18,343	銀行	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS	208	208	13,615	24,371	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	外貨建金額	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円	
TATA STEEL LIMITED	54	54	2,469	4,421	素材
TATA CONSULTANCY SVS LTD	104	104	24,715	44,240	ソフトウェア・サービス
TATA POWER CO LTD	296	296	2,476	4,432	公益事業
TATA MOTORS LTD	216	335	14,480	25,920	自動車・自動車部品
TATA MOTORS LTD-A-DVR	—	57	1,503	2,691	自動車・自動車部品
TECH MAHINDRA LTD	52	100	4,426	7,922	ソフトウェア・サービス
TITAN CO LTD	—	60	2,901	5,194	耐久消費財・アパレル
ULTRATECH CEMENT LTD	11	17	7,765	13,901	素材
UNITED BREWERIES LTD	18	—	—	—	食品・飲料・タバコ
UNITED SPIRITS LIMITED	13	13	2,862	5,124	食品・飲料・タバコ
UPL LTD	59	80	6,698	11,989	素材
WIPRO LTD	136	136	6,905	12,361	ソフトウェア・サービス
YES BANK LTD	—	68	10,068	18,023	銀行
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	96	136	7,163	12,822	メディア
小計	株数・金額	7,708	9,532	568,234	1,017,140
	銘柄数<比率>	71	77	—	<8.4%>
(カタール)			千カタールリアル		
BARWA REAL ESTATE CO	30	30	101	3,183	不動産
COMMERCIAL BANK QSC	30	37	111	3,490	銀行
DOHA BANK QSC	23	23	73	2,296	銀行
DOHA BANK QSC(N)	—	4	14	459	銀行
EZDAN HOLDING GROUP	159	159	252	7,912	不動産
INDUSTRIES QATAR	33	33	355	11,130	資本財
MASRAF AL RAYAN	92	92	392	12,291	銀行
OOREDOO QSC	21	21	229	7,179	電気通信サービス
QATAR NATIONAL BANK	47	51	731	22,891	銀行
QATAR ISLAMIC BANK	16	16	169	5,315	銀行
QATAR INSURANCE CO	15	21	150	4,722	保険
QATAR INSURANCE CO(N)	3	—	—	—	保険
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	4	4	89	2,799	公益事業
QATAR GAS TRANSPORT (NAKILAT)	52	52	98	3,087	エネルギー
VODAFONE QATAR	105	—	—	—	電気通信サービス
小計	株数・金額	633	547	2,771	86,761
	銘柄数<比率>	14	13	—	<0.7%>
(エジプト)			千エジプトポンド		
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	226	226	1,735	10,900	銀行
GLOBAL TELECOM HOLDING	600	600	399	2,505	電気通信サービス
T M G HOLDING	230	230	197	1,242	不動産
小計	株数・金額	1,056	1,056	2,332	14,648
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>
(南アフリカ)			千南アフリカランド		
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	69	89	1,281	11,068	銀行
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	16	16	538	4,654	素材
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	85	85	1,279	11,057	素材
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	73	83	2,296	19,840	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BARLOWORLD LTD	65	—	—	—	資本財
BIDVEST GROUP LTD	63	63	1,081	9,345	資本財
BID CORP LTD	—	75	2,206	19,067	食品・生活必需品小売り
BRAIT SE	70	70	603	5,214	各種金融
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	8	8	624	5,391	銀行
CORONATION FUND MANAGERS LTD	32	32	200	1,736	各種金融
DISCOVERY LTD	85	85	1,131	9,775	保険

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	外貨換算金額	
(南アフリカ)	百株	百株	千南アフリカランド	千円	
EXXARO RESOURCES LTD	35	35	365	3,158	エネルギー
FIRSTRAND LTD	708	708	3,527	30,481	各種金融
FOSCHINI GROUP LTD/THE	41	41	605	5,228	小売
GOLD FIELDS LTD	165	165	800	6,917	素材
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	38	58	713	6,166	不動産
IMPERIAL HOLDINGS LTD	36	36	579	5,010	小売
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	114	114	502	4,343	素材
INVESTEC LTD	65	65	658	5,686	各種金融
LIFE HEALTHCARE GROUP	200	268	773	6,686	ヘルスケア機器・サービス
LIBERTY HOLDINGS LTD	40	40	431	3,725	保険
MASSMART HOLDINGS LTD	27	27	338	2,928	食品・生活必需品小売り
MMI HOLDINGS LTD	244	244	547	4,727	保険
MONDI LTD	27	27	942	8,143	素材
MR PRICE GROUP LTD	53	53	773	6,685	小売
MTN GROUP LTD	362	362	4,385	37,895	電気通信サービス
NASPERS LTD-N SHS	87	95	26,153	225,965	メディア
NEW EUROPE PROPERTY INVEST	47	47	735	6,352	不動産
NEDBANK GROUP LTD	52	52	1,155	9,981	銀行
NETCARE LTD	221	221	589	5,092	ヘルスケア機器・サービス
PIONEER FOODS LTD	27	27	442	3,825	食品・飲料・タバコ
PICK'N PAY STORES LTD	70	70	436	3,768	食品・生活必需品小売り
PSG GROUP LTD	21	21	511	4,422	各種金融
REMGRO LTD	102	116	2,615	22,593	各種金融
RMB HOLDINGS LTD	175	175	1,086	9,390	各種金融
RAND MERCHANT INVESTMENT HOL	198	198	840	7,261	保険
SANLAM LTD	373	286	2,021	17,461	保険
SAPPI LIMITED	144	144	1,460	12,621	素材
SASOL LTD	123	123	5,024	43,412	素材
SHOPRITE HOLDINGS LTD	97	97	1,947	16,826	食品・生活必需品小売り
SIBANYE GOLD LTD	130	180	509	4,405	素材
SPAR GROUP LIMITED/THE	33	33	596	5,152	食品・生活必需品小売り
STANDARD BANK GROUP LTD	261	286	4,265	36,851	銀行
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	629	629	4,252	36,740	耐久消費財・アパレル
TELKOM SA SOC LTD	37	37	291	2,522	電気通信サービス
TIGER BRANDS LTD	34	34	1,386	11,980	食品・飲料・タバコ
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	106	106	813	7,028	小売
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	100	100	255	2,203	消費者サービス
VODACOM GROUP LTD	90	90	1,381	11,932	電気通信サービス
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	214	214	1,484	12,829	小売
小計	株数・金額	6,104	6,243	87,449	755,560
銘柄数<比率>	49	49	—	—	<6.2%>
(アラブ首長国連邦)			千アラブディルハム		
ARABTEC HOLDING CO PJSC	283	—	—	—	資本財
DUBAI ISLAMIC BANK	180	225	130	4,042	銀行
DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC	400	—	—	—	各種金融
EMAAR PROPERTIES PJSC	787	787	584	18,131	不動産
EMAAR MALLS PJSC	360	360	93	2,893	不動産
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	442	442	318	9,886	銀行
ALDAR PROPERTIES PJSC	846	846	192	5,985	不動産
EMIRATES TELECOM GROUP CO	360	360	631	19,604	電気通信サービス
FIRST GULF BANK	201	—	—	—	銀行

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		外貨建金額
(アラブ首長国連邦)		百株	百株	千円		
FIRST ABU DHABI BANK PJSC		196	449	503	15,623	銀行
小	計	株 数 ・ 金 額	4,057	3,470	2,454	76,166
		銘柄 数 < 比 率 >	10	7	—	<0.6%>
合	計	株 数 ・ 金 額	454,121	462,619	—	11,497,101
		銘柄 数 < 比 率 >	813	808	—	<95.1%>

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

(注) 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

外国投資信託証券

銘 柄		期首(前期末)		当 期 末		比 率
		口 数	口 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ) GLOBAL X MSCI GREECE-ETF		口 41,500	口 41,500	千アメリカドル 397	千円 45,184	% 0.4
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	41,500 1	41,500 1	397 —	45,184 <0.4%>	
(メキシコ) FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		46,000	57,000	千メキシコペソ 1,914	11,675	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	46,000 1	57,000 1	1,914 —	11,675 <0.1%>	
(トルコ) EMLAK KONUT GAYRIMEN		58,000	58,000	千トルコリラ 166	5,340	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	58,000 1	58,000 1	166 —	5,340 <0.0%>	
(南アフリカ) FORTRESS INCOME FUND LTD-B FORTRESS INCOME FUND LTD-A GROWTHPOINT PROPERTIES LTD REDEFINE PROPERTIES LTD RESILIENT REIT LTD		12,000 24,000 60,000 91,000 5,400	12,000 24,000 60,000 110,000 5,400	千南アフリカランド 408 418 1,530 1,223 635	3,530 3,612 13,224 10,568 5,489	0.0 0.0 0.1 0.1 0.0
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	192,400 5	211,400 5	4,215 —	36,424 <0.3%>	
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	337,900 8	367,900 8	— —	98,625 <0.8%>	

(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により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。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当期期末	
		買建額	売建額
外国	株式先物取引	百万円	百万円
	MINMSCIE	491	—

(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により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成

(2017年5月16日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	11,497,101	94.7
投資信託受益証券	45,184	0.4
投資証券	53,440	0.4
コール・ローン等、その他	541,166	4.5
投資信託財産総額	12,136,891	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

(注) 当期末における外貨建純資産（12,078,265千円）の投資信託財産総額（12,136,891千円）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により邦貨換算したものです。1アメリカドル=113.77円、1メキシコペソ=6.10円、1ブラジルレアル=36.58円、1チリペソ=0.1702円、1コロンビアペソ=0.0393円、1ユーロ=124.96円、1トルコリラ=32.08円、1チェココルナ=4.72円、1ハンガリーフォリント=0.4045円、1ポーランドズロチ=29.77円、1香港ドル=14.61円、1マレーシアリンギット=26.35円、1タイバーツ=3.30円、1フィリピンペソ=2.29円、1インドネシアルピア=0.0086円、1韓国ウォン=0.1019円、1新台幣ドル=3.78円、1インドルピー=1.79円、1カタールリアル=31.30円、1エジプトポンド=6.28円、1南アフリカランド=8.64円、1アラブディルハム=31.03円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月16日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	12,136,891,591
コール・ローン等	200,299,630
株式(評価額)	11,497,101,357
投資信託受益証券(評価額)	45,184,324
投資証券(評価額)	53,440,694
未収入金	38,568,161
未収配当金	11,382,870
差入委託託拠金	290,914,555
(B) 負債	41,358,066
未払解約金	41,358,000
未払利息	66
(C) 純資産総額(A－B)	12,095,533,525
元本	7,116,705,284
次期繰越損益金	4,978,828,241
(D) 受益権総口数	7,116,705,284口
1万口当たり基準価額(C／D)	16,996円

(注) 当ファンドの期首元本額は6,905,549,620円、期中追加設定元本額は1,223,678,696円、期中一部解約元本額は1,012,523,032円です。

(注) 2017年5月16日現在の元本の内訳は以下の通りです。

- ・インデックスファンド海外新興国（エマージング）株式 5,083,455,959円
- ・日興五大陸株式ファンド 2,004,463,408円
- ・全世界株式債券ファンド（日本・先進国・新興国）毎月分配型 27,209,073円
- ・日興ストラテジック・アロケーション・ファンド（株式資産） 1,576,844円

(注) 1口当たり純資産額は1.6996円です。

○損益の状況 (2016年5月17日～2017年5月16日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	236,227,405
受取配当金	236,256,643
受取利息	54
その他収益金	42
支払利息	△ 29,334
(B) 有価証券売買損益	2,861,710,822
売買益	3,146,506,738
売買損	△ 284,795,916
(C) 先物取引等取引損益	104,506,137
取引益	117,657,608
取引損	△ 13,151,471
(D) 保管費用等	△ 21,088,208
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	3,181,356,156
(F) 前期繰越損益金	1,713,927,659
(G) 追加信託差損益金	496,517,138
(H) 解約差損益金	△ 412,972,712
(I) 計(E＋F＋G＋H)	4,978,828,241
次期繰越損益金(I)	4,978,828,241

(注) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2016年5月17日から2017年5月16日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

- 当ファンドについて、金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号の2に定める信用リスクを適正に管理する方法として、一般社団法人投資信託協会規則に従って委託会社が合理的な方法を定めるべく、2017年2月17日付けにて信託約款に所要の変更を行ないました。（付表）