nikko am
Nikko Asset Management

年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）
〈愛称 ＤＣ Ａナビ60〉

運用報告書（全体版）

第17期（決算日　2018年10月26日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
「年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）」は、2018年10月26日に第17期の決算を行ないましたので、期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申しあげます。

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／資産複合	
信託期間	2001年10月17日から原則無期限です。	
運用方針	主として投資信託の受益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す。	
主要運用対象	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	投資信託の受益証券を主要投資対象とします。
	日本株式インデックスＴＯＰＩＸ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。
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）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。
	日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	内外の公社債を主要投資対象とします。
	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	内外の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	株式への実質投資割合は、信託財産の総額の70%未満とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の総額の50%以下とします。
	日本株式インデックスＴＯＰＩＸ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。
	海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）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。
	日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行ないません。
	海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
	海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	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。	

＜958271＞

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	基準価額			合成インデックス		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率					
	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
13期(2014年10月27日)	14,311	10	6.1	138.73	5.6	59.2	1.3	34.2	0.3	2,905
14期(2015年10月26日)	16,333	10	14.2	157.76	13.7	60.0	1.1	33.6	0.4	3,316
15期(2016年10月26日)	15,609	10	△ 4.4	150.25	△ 4.8	59.3	1.1	34.3	0.4	3,188
16期(2017年10月26日)	18,058	10	15.8	172.91	15.1	58.6	1.0	34.8	0.4	3,698
17期(2018年10月26日)	17,376	10	△ 3.7	165.69	△ 4.2	57.2	0.9	36.2	0.4	3,641

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注) 合成インデックス（参考指数）は、投資先の親投資信託のそれぞれのベンチマークを標準組入比率で合成して算出しています。なお、2018年10月26日現在知りえた情報を基に弊社において日次で算出し、設定日を100として指数化しております。
(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。
(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、「債券組入比率」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、「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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

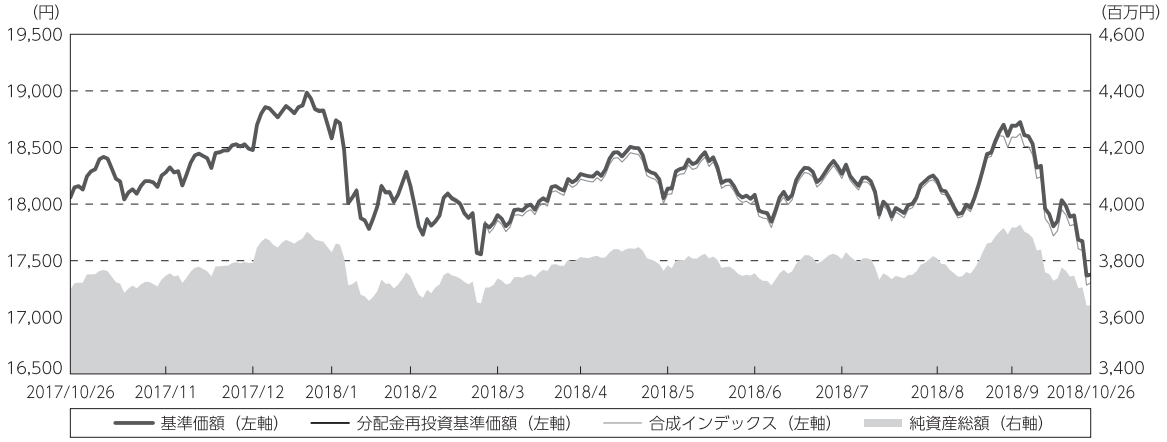
年月日	基準価額		合成インデックス		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	(参考指数)	騰落率				
(期首)	円	%		%	%	%	%	%
2017年10月26日	18,058	－	172.91	－	58.6	1.0	34.8	0.4
10月末	18,128	0.4	173.58	0.4	58.5	1.2	34.6	0.4
11月末	18,280	1.2	175.09	1.3	58.7	1.1	34.5	0.4
12月末	18,477	2.3	176.95	2.3	59.0	0.8	34.6	0.4
2018年１月末	18,580	2.9	178.02	3.0	58.9	0.7	34.7	0.3
２月末	18,159	0.6	174.02	0.6	59.2	0.9	34.3	0.3
３月末	17,903	△0.9	170.97	△1.1	58.2	1.3	34.9	0.3
４月末	18,266	1.2	174.46	0.9	59.3	1.1	34.3	0.3
５月末	18,137	0.4	173.19	0.2	58.2	1.2	34.8	0.3
６月末	18,083	0.1	172.67	△0.1	58.3	0.9	35.1	0.4
７月末	18,267	1.2	174.53	0.9	59.0	0.9	34.7	0.3
８月末	18,209	0.8	174.01	0.6	59.3	0.4	34.7	0.4
９月末	18,694	3.5	178.02	3.0	60.1	0.8	33.9	0.3
(期末) 2018年10月26日	17,386	△3.7	165.69	△4.2	57.2	0.9	36.2	0.4

(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。
(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、「債券組入比率」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、「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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

期中の基準価額等の推移



期　首：18,058円
期　末：17,376円（既払分配金(税込み)：10円）
騰落率：△ 3.7%（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す。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
（注）分配金再投資基準価額および合成インデックスは、期首（2017年10月26日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
（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）合成インデックスは当ファンドの参考指数です。

○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、マザーファンドを通じて国内株式、海外株式、国内債券、海外債券の４つの資産に実質的に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっております。各資産への投資配分は、株式に60%、債券などに40%をめどとしています。当期における各マザーファンドの騰落率は以下の通りです。

マザーファンド	騰落率
日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	△7.0%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	1.0%
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	1.6%
日本債券インデックスマザーファンド	0.2%
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	△3.6%
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	△1.7%

当作成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。

・米国において法人税減税の実施による景気の押し上げ期待が高まったことなどが株式に投資するマザーファンドの基準価額の値上がり要因となる一方、米国と中国との間の貿易摩擦の激化が懸念されたことは基準価額の値下がり要因となりました。
・米国連邦準備制度理事会（ＦＲＢ）による利上げ観測が広がったことや、追加利上げが2017年12月と2018年３月、６月、９月に実施されたこと、欧州中央銀行（ＥＣＢ）がユーロ圏の経済成長見通しを引き上げたことなどが債券に投資するマザーファンドの基準価額の値下がり要因となりました。
・為替市場で、主要通貨に対して円高が進行したことが「海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド」および「海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド」の基準価額の値下がり要因となりました。

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、期間の初めと比べて下落しました。

期間の初めから2018年１月中旬にかけては、米国において法人税減税の実施による景気の押し上げ期待が高まったことなどから、ＴＯＰＩＸは上昇しました。１月下旬から３月下旬にかけては、米国財務長官によるアメリカドル安の容認発言などを契機に円高／アメリカドル安が進行し企業業績への懸念が高まったことや、米国長期金利の急激な上昇を警戒して米国株式主導で世界的に株価が大幅に下落したことなどを背景に、ＴＯＰＩＸは下落しました。４月上旬から５月中旬にかけては、米国などによるシリアへの軍事攻撃の影響が限定的となり中東情勢を巡る警戒感が和らいだことなどから、ＴＯＰＩＸは上昇しました。５月下旬から７月上旬にかけては、イタリアの政局混迷などが嫌気されたことや、米国と中国との間の貿易摩擦の激化が懸念されたことなどから、ＴＯＰＩＸは下落しました。７月中旬から９月下旬にかけては、米国が発動した中国製品に対する追加関税が景気に配慮した税率にとどまったとの見方から両国の対立激化への懸念が後退したことなどを背景に、ＴＯＰＩＸは上昇しました。10月上旬から期間末にかけては、米国長期金利の急激な上昇を警戒し米国株式を中心に世界的に株価が下落したことなどが株価の重しとなり、ＴＯＰＩＸは下落しました。

（海外株式市況）

海外株式市場では、米国と欧州各国の株価は、期間の初めと比べて総じて下落しました。

期間の初めから2018年１月中旬にかけては、市場予想を上回る米国の主要経済指標の発表や、法人税率引き下げの実現の可能性が高まったことにより米国経済への楽観的な見方が広がったこと、英国と欧州連合（ＥＵ）が離脱交渉の前進に向けて合意したことなどから、米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。１月下旬から３月下旬にかけては、インフレ上昇の兆しが見られるなか、発表された米国の経済指標が堅調な景気拡大を示す内容であったことなどを背景に、欧米主要国の長期金利が上昇したことや、米国の保護主義的な貿易政策に対する警戒感や投資家のリスク回避姿勢が強まったことを受けて、米国と欧州各国の株価は総じて下落しました。４月上旬から６月下旬にかけては、米国連邦公開市場委員会（ＦＯＭＣ）議事要旨を受けて追加利上げペースの加速懸念が後退したことや、発表された米国と欧州企業の決算が市場予想を上回ったことなどが株価の上昇要因となったものの、イタリアやスペインの政局不安が高まったことや米朝首脳会談の中止の発表などから地政学的リスクが意識されたこと、米国と中国の貿易摩擦が激化し世界経済や企業業績に悪影響を及ぼすとの懸念が高まったことなどが株価の下落要因となり、米国と欧州各国の株価はまちまちの動きと

なりました。７月上旬から９月下旬にかけては、米国大統領が自動車関税をゼロとするとのＥＵの提案を拒否したことなどは株価の下落要因となったものの、米国が発動した中国製品に対する追加関税が景気に配慮した税率にとどまったとの見方から両国の対立激化への懸念が後退したことなどを背景に、米国と欧州各国の株価は概して上昇しました。10月上旬から期間末にかけては、米国の良好な内容の経済指標による米国長期金利の急激な上昇を警戒して、米国と欧州各国の株価は総じて下落しました。

（国内債券市況）

国内債券市場では、10年国債利回りは、期間の初めと比べて上昇（債券価格は下落）しました。

期間の初めから2018年１月下旬にかけては、内外の良好な経済指標の発表に加え、欧米の長期金利が上昇基調で推移したことなどを背景に、10年国債利回りは上昇しました。２月上旬から７月中旬にかけては、世界的な株安により投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、黒田日銀総裁を再任する人事案が提出され金融政策の継続期待が高まったこと、米国と中国の貿易摩擦の激化による世界経済の成長鈍化懸念が強まったことなどを受けて、10年国債利回りは低下（債券価格は上昇）しました。７月下旬から期間末にかけては、日銀が金融政策決定会合で緩和策を柔軟化し長期金利の変動幅の拡大を容認したことや、米国の堅調な内容の経済指標の発表を受けて米国長期金利が上昇したこと、日銀による国債買入れ減額への警戒感などを背景に、10年国債利回りは上昇しました。

（海外債券市況）

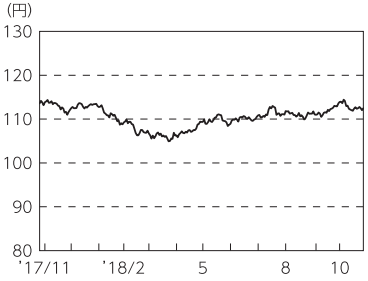
海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べてまちまちの動きとなりました。

期間の初めから2018年２月中旬にかけては、ＥＣＢがユーロ圏の経済成長見通しを引き上げたことや、米国の雇用統計にて賃金の伸びが市場予想を上回り米国の利上げペースの加速が意識されたことなどを背景に、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。２月下旬から３月下旬にかけては、フランスやドイツの景況感に関する指標が市場予想を下回ったことや、米国の保護主義的な貿易政策の発表を受けて貿易を巡る懸念が世界的に広がったこと、ＥＣＢが予想インフレ率を下方修正してインフレへの慎重な見方を示したことなどを受けて、各国の10年国債利回りは総じて低下しました。４月上旬から５月中旬にかけては、中国の市場開放政策を受けて米国と中国との間の貿易摩擦による世界経済の成長鈍化懸念が緩和したことや、商品価格の上昇によるインフレ圧力などを受けて、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。５月下旬から８月中旬にかけては、ＥＣＢが2019年夏まで利上げを据え置く方針を示したことや、米国とトルコの関係悪化などによるトルコリラの急落が新興国市場にも波及したことでリスク回避需要が高まったことなどを背景に、各国の10年国債利回りは概して低下しました。８月下旬から期間末にかけては、ＦＲＢが追加利上げを実施したことや、ＥＣＢ総裁がユーロ圏の基調的なインフレ率には上昇が見込まれるとの見解を示したことなどを受けて、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。

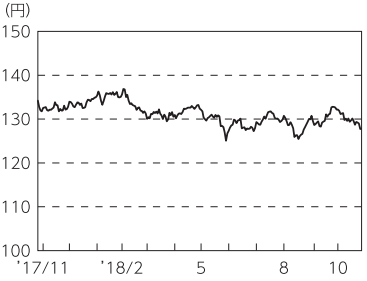
（為替市況）

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



当ファンドのポートフォリオ

（当ファンド）

各資産への投資配分は、実質的な標準組入比率（株式60%、債券および短期金融資産40%）をめどとしました。これらの組入比率の調整にあたっては、各親投資信託の受益証券および短期金融資産への投資比率を標準組入比率に修正（リバランス）することで行ないました。

当期の標準組入比率

国内株式	海外株式		国内債券	海外債券		短期金融資産
	ヘッジなし	ヘッジあり		ヘッジなし	ヘッジあり	
45.0%	7.5%	7.5%	25.0%	5.0%	5.0%	5.0%

（投資先の各マザーファンド）

各マザーファンドの運用においては、各マザーファンドがそれぞれに定めるベンチマークへの連動をめざして運用を行ないました。各マザーファンドは、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するため、随時ポートフォリオの見直しを行ないました。各マザーファンドが定めるベンチマークは以下の通りです。

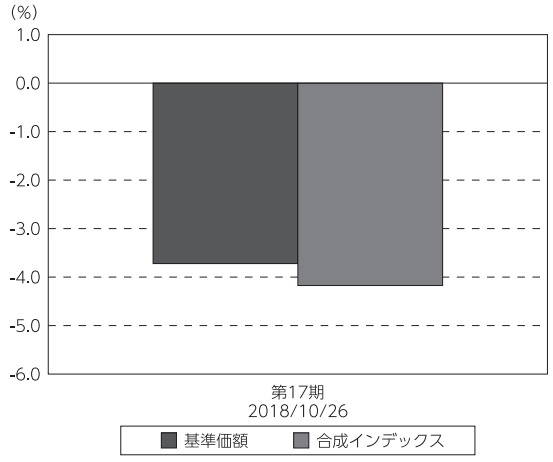
マザーファンド	ベンチマーク
日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	東証株価指数
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジなし・円ベース)
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジあり・円ベース)
日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI総合
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

グラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率です。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



（注）基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。
（注）合成インデックスは当ファンドの参考指数です。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。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す。

○分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり、税込み）

項目	第17期 2017年10月27日～ 2018年10月26日
当期分配金	10
（対基準価額比率）	0.058%
当期の収益	10
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	10,216

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

（当ファンド）

引き続き、各資産への投資配分は、実質的な標準組入比率（株式60%、債券および短期金融資産40%）をめどとします。これらの組入比率の調整にあたっては、原則として、各親投資信託の受益証券および短期金融資産への投資比率を標準組入比率に修正（リバランス）することで行ないます。

翌期の標準組入比率

国内株式	海外株式		国内債券	海外債券		短期金融資産
	ヘッジなし	ヘッジあり		ヘッジなし	ヘッジあり	
45.0%	7.5%	7.5%	25.0%	5.0%	5.0%	5.0%

（投資先の各マザーファンド）

当ファンドの投資先である各マザーファンドの運用においては、引き続き、各マザーファンドがそれぞれに定めるベンチマークへの連動をめざして運用を行なう方針です。各マザーファンドは、ベンチマーク採用銘柄の入替などに対応するため、随時ポートフォリオの見直しを行なう方針です。

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。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申しあげます。

○１万口当たりの費用明細

（2017年10月27日～2018年10月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	135	0.740	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(37)	(0.205)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(89)	(0.486)	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）	(9)	(0.049)	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	0	0.002	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.002)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（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)	
(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 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(0)	(0.001)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	3	0.017	(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)	(0.010)	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）	(1)	(0.005)	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
（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	138	0.760	
期中の平均基準価額は、18,265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、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満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10月27日～2018年10月26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	85,109	130,611	61,182	97,925
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	11,634	27,319	14,770	36,226
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	12,325	19,622	18,593	30,371
日本債券インデックスマザーファンド	73,078	101,560	55,558	77,135
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	9,662	21,723	4,873	10,919
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	15,913	23,581	10,623	15,697

○株式売買比率

（2017年10月27日～2018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		
	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	海外株式インデックス MSCI-KOKUSAI （ヘッジあり）マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	7,394,814千円	14,229,222千円	1,421,828千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	29,032,836千円	82,405,206千円	5,863,003千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.25	0.17	0.24

(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10月27日～2018年10月26日）

利害関係人の発行する有価証券等

＜年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）＞

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	8	2	101

＜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。

＜海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド＞
該当事項はございません。

＜日本債券インデックスマザーファンド＞
該当事項はございません。

＜海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド＞
該当事項はございません。

＜海外債券インデックス（ヘッジあり）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10月27日～2018年10月26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10月27日～2018年10月26日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細（2018年10月26日現在）

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	1,077,915	1,101,842	1,589,186
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	116,134	112,997	270,030
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	177,953	171,685	270,095
日本債券インデックスマザーファンド	668,276	685,795	951,198
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	80,033	84,822	188,476
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	123,932	129,222	189,026

（注）各親投資信託の2018年10月26日現在の受益権総口数は、以下の通りです。
- 日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド　19,319,878千口
- 日本債券インデックスマザーファンド　27,733,551千口
- 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド　37,961,659千口
- 海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド　66,172,631千口
- 海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド　4,317,838千口
- 海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド　16,823,343千口

○投資信託財産の構成

（2018年10月26日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド	1,589,186	43.4
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド	270,030	7.4
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド	270,095	7.4
日本債券インデックスマザーファンド	951,198	26.0
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド	188,476	5.1
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド	189,026	5.2
コール・ローン等、その他	202,549	5.5
投資信託財産総額	3,660,560	100.0

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

（注）海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（89,558,364千円）の投資信託財産総額（90,961,427千円）に対する比率は98.5%です。

（注）海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（6,590,089千円）の投資信託財産総額（6,864,369千円）に対する比率は96.0%です。

（注）海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（147,089,654千円）の投資信託財産総額（147,128,065千円）に対する比率は100.0%です。

（注）海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産（24,354,881千円）の投資信託財産総額（24,696,189千円）に対する比率は98.6%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=112.47円、1カナダドル=85.95円、1メキシコペソ=5.77円、1ユーロ=127.83円、1イギリスポンド=144.21円、1スイスフラン=112.40円、1スウェーデンクローナ=12.34円、1ノルウェークローネ=13.47円、1デンマーククローネ=17.13円、1ポーランドズロチ=29.65円、1オーストラリアドル=79.55円、1ニュージーランドドル=73.29円、1香港ドル=14.35円、1シンガポールドル=81.42円、1マレーシアリンギット=26.96円、1イスラエルシュケル=30.40円、1南アフリカランド=7.70円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年10月26日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	3,660,560,816
コール・ローン等	200,439,599
日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド(評価額)	1,589,186,790
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジなし）マザーファンド(評価額)	270,030,778
海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド(評価額)	270,095,737
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	951,198,372
海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド(評価額)	188,476,361
海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド(評価額)	189,026,646
未収入金	2,106,533
(B) 負債	18,900,312
未払収益分配金	2,095,855
未払解約金	2,617,196
未払信託報酬	14,086,307
未払利息	253
その他未払費用	100,701
(C) 純資産総額（Ａ－Ｂ）	3,641,660,504
元本	2,095,855,670
次期繰越損益金	1,545,804,834
(D) 受益権総口数	2,095,855,670口
１万口当たり基準価額（Ｃ／Ｄ）	17,376円

（注）当ファンドの期首元本額は2,048,020,393円、期中追加設定元本額は237,927,093円、期中一部解約元本額は190,091,816円です。

（注）１口当たり純資産額は1.7376円です。

○損益の状況 (2017年10月27日～2018年10月26日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	△ 88,039
受取利息	78
支払利息	△ 88,117
(B) 有価証券売買損益	△ 117,347,909
売買益	15,115,783
売買損	△ 132,463,692
(C) 信託報酬等	△ 28,165,815
(D) 当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	△ 145,601,763
(E) 前期繰越損益金	1,004,074,656
(F) 追加信託差損益金	689,427,796
（配当等相当額）	(1,098,686,398)
（売買損益相当額）	(△ 409,258,602)
(G) 計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	1,547,900,689
(H) 収益分配金	△ 2,095,855
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	1,545,804,834
追加信託差損益金	689,427,796
（配当等相当額）	(1,098,947,507)
（売買損益相当額）	(△ 409,519,711)
分配準備積立金	1,042,219,993
繰越損益金	△ 185,842,955

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

（注）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。

（注）分配金の計算過程（2017年10月27日～2018年10月26日）は以下の通りです。

項目	2017年10月27日～2018年10月26日
a. 配当等収益(経費控除後)	40,241,192円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,098,947,507円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,004,074,656円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	2,143,263,355円
f. 分配対象収益(１万口当たり)	10,226円
g. 分配金	2,095,855円
h. 分配金(１万口当たり)	10円

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。

○分配金のお知らせ

１万口当たり分配金（税込み）	10円

○お知らせ

約款変更について

2017年10月27日から2018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。

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あげます。

日本株式インデックスＴＯＰＩＸマザーファンド

運 用 報 告 書

第19期（決算日　2018年10月26日）
（2017年10月27日～2018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		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
18期(2017年10月26日)	15,511	29.6	1,753.90	26.8	98.6	1.2	29,028
19期(2018年10月26日)	14,423	△ 7.0	1,596.01	△ 9.0	98.9	1.1	27,865

(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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		東証株価指数		株式組入比率	株式先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2017年10月26日	15,511	－	1,753.90	－	98.6	1.2
10月末	15,618	0.7	1,765.96	0.7	98.3	1.5
11月末	15,854	2.2	1,792.08	2.2	98.9	1.0
12月末	16,099	3.8	1,817.56	3.6	99.7	0.4
2018年１月末	16,270	4.9	1,836.71	4.7	99.3	0.6
２月末	15,669	1.0	1,768.24	0.8	99.4	0.6
３月末	15,350	△1.0	1,716.30	△2.1	98.3	1.7
４月末	15,899	2.5	1,777.23	1.3	98.8	1.1
５月末	15,641	0.8	1,747.45	△0.4	98.9	1.1
６月末	15,512	0.0	1,730.89	△1.3	99.3	0.4
７月末	15,713	1.3	1,753.29	△0.0	99.5	0.5
８月末	15,557	0.3	1,735.35	△1.1	99.7	0.3
９月末	16,421	5.9	1,817.25	3.6	98.8	1.1
(期末) 2018年10月26日	14,423	△7.0	1,596.01	△9.0	98.9	1.1

(注) 騰落率は期首比です。
(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。

○運用経過

（2017年10月27日～2018年10月26日）

基準価額の推移

期間の初め15,511円の基準価額は、期間末に14,423円となり、騰落率は△7.0%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。

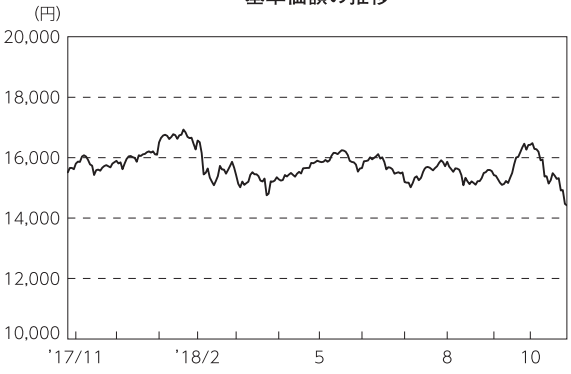
＜値上がり要因＞

・米国において法人税減税の実施による景気押し上げへの期待が高まったこと。
・米国などによるシリアへの軍事攻撃の影響が限定的となり中東情勢を巡る警戒感が和らいだこと。
・米国が発動した中国製品に対する追加関税が景気に配慮した税率にとどまったこと。

＜値下がり要因＞

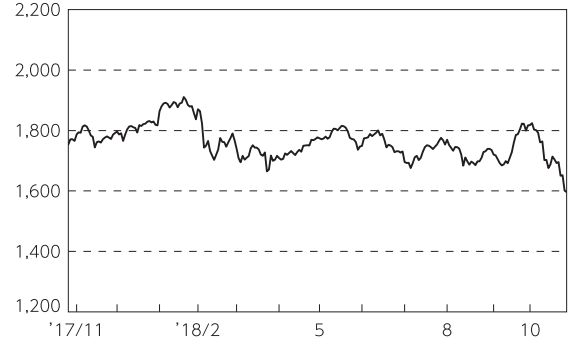
・米国財務長官によるアメリカドル安の容認発言などを契機に円高／アメリカドル安が進行し、企業業績への懸念が高まったこと。
・米国長期金利の急激な上昇を警戒して米国株式中心に世界的に株価が大幅に下落したこと（2018年１月下旬～３月下旬、2018年10月上旬～期間末）。
・米国と中国の間の貿易摩擦の激化が懸念されたこと。

基準価額の推移



期　首	期中高値	期中安値	期　末
2017/10/26	2018/01/23	2018/10/26	2018/10/26
15,511円	16,928円	14,423円	14,423円

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2018年１月中旬にかけては、米国において法人税減税の実施による景気押し上げへの期待が高まったことなどから、ＴＯＰＩＸは上昇しました。１月下旬から３月下旬にかけては、米国財務長官によるアメリカドル安の容認発言などを契機に円高／アメリカドル安が進行し、企業業績への懸念が高まったことや、米国長期金利の急激な上昇を警戒して米国株式主導で世界的に株価が大幅に下落したことなどを背景に、ＴＯＰＩＸは下落しました。４月上旬から５月中旬にかけては、米国などによるシリアへの軍事攻撃の影響が限定的となり中東情勢を巡る警戒感が和らいだことなどから、ＴＯＰＩＸは上昇しました。５月下旬から７月上旬にかけては、イタリアの政局混迷などが嫌気されたことや、米国と中国との間の貿易摩擦の激化が懸念されたことなどから、ＴＯＰＩＸは下落しました。７月中旬から９月下旬にかけては、米国が発動した中国製品に対する追加関税が景気に配慮した税率にとどまったとの見方から両国の対立激化への懸念が後退したことなどを背景に、ＴＯＰＩＸは上昇しました。10月上旬から期間末にかけては、米国長期金利の急激な上昇を警戒し米国株式中心に世界的に株価が下落したことなどが株価の重しとなり、ＴＯＰＩＸは下落しました。

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

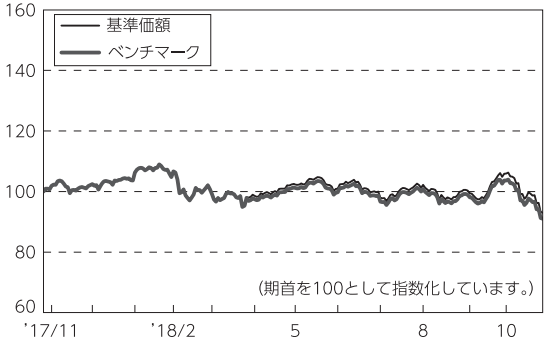
期間中における基準価額は、7.0%の値下がりとなり、ベンチマークである「東証株価指数」の下落率9.0%を概ね2.0%上回りました。

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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	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
（株式）	(0)	(0.000)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(b) その他費用	0	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）	(0)	(0.000)	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、15,800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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

株式

		買付 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	2,176 (△ 687)	4,463,439 (615)	1,367	2,931,375

（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
	証券	千円	証券	千円
国内	－	－	1,500	275
	(2,500)	(　－)	(1,000)	(　-)

(注) 金額は受け渡し代金。
(注) (　) 内は新株予約権の付与、権利行使および権利行使期間満了等による増減分で、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 2,482	百万円 2,499	百万円 －	百万円 －

(注) 金額は受け渡し代金。

○株式売買比率

(2017年10月27日～2018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	7,394,814千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	29,032,836千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.25

(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

(2017年10月27日～2018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
	百万円	百万円	百万円
株式	8	2	101

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10月27日～2018年10月26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

(2018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	0.5	0.5	1,535
日本水産	16.3	15.4	11,088
マルハニチロ	2.4	2.6	10,166
カネコ種苗	0.4	0.5	710
サカタのタネ	1.9	2	6,890
ホクト	1.3	1.4	2,675
ホクリヨウ	0.2	0.2	147
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	3.7	3.8	444
日鉄鉱業	0.3	0.4	1,802
三井松島ホールディングス	0.7	0.7	1,224
国際石油開発帝石	66.2	65.8	86,888
日本海洋掘削	0.5	－	－
石油資源開発	2	2.2	5,189
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	0.7	0.8	1,231
建設業（2.9%）			
ヒノキヤグループ	－	0.4	1,026
ショーボンドホールディングス	1.2	1.3	10,387
ミライト・ホールディングス	3.9	4.6	8,298
サンヨーホームズ	0.3	0.3	266
日本アクア	－	0.4	136
ファーストコーポレーション	0.3	0.5	512
ベステラ	－	0.3	401
ＴＡＴＥＲＵ	0.2	2	896
スペースバリューホールディングス	－	2	2,008
ダイセキ環境ソリューション	0.4	0.3	250
第一カッター興業	－	0.2	417
安藤・間	9	11.1	8,214
東急建設	4.5	5.2	5,142
コムシスホールディングス	4.9	5.3	16,059
ミサワホーム	1.5	1.3	1,069
高松コンストラクショングループ	0.9	1	2,886
東建コーポレーション	0.5	0.5	3,645
ソネック	0.1	0.2	141
ヤマウラ	0.6	0.7	606
大成建設	12.8	13.5	61,897
大林組	37.7	40.6	39,341
清水建設	38.4	41.4	36,928
飛島建設	12.5	1.3	2,106
長谷工コーポレーション	14.7	16.1	21,944
松井建設	1.4	1.5	1,195
錢高組	0.2	0.2	999
鹿島建設	55	30.1	42,681
不動テトラ	10.5	1	1,780
大末建設	0.5	0.5	583
鉄建建設	0.8	0.8	2,037
西松建設	2.9	3.1	7,502
三井住友建設	9.7	9.8	6,850
大豊建設	5	1	3,060
前田建設工業	8.3	9.7	12,144
ナカノフドー建設	1	1.1	680
奥村組	2.1	2.2	7,469
東鉄工業	1.5	1.6	4,302
イチケン	0.2	0.3	654
富士ピー・エス	－	0.4	192
淺沼組	4	0.5	1,592
戸田建設	15	15.7	11,570
熊谷組	2	2.1	5,850
青木あすなろ建設	0.8	0.9	849
北野建設	3	0.3	1,080
植木組	0.2	0.2	467
三井ホーム	2	－	－
矢作建設工業	1.7	1.9	1,504
ピーエス三菱	1.4	1.6	945
日本ハウスホールディングス	2.4	2.7	1,606
大東建託	4.6	4.8	70,560
新日本建設	1.5	1.6	1,603
ＮＩＰＰＯ	3	3.3	5,953
東亜道路工業	0.2	0.3	1,039
前田道路	4	4.2	8,387
日本道路	0.4	0.4	2,428
東亜建設工業	1	1.2	2,395
若築建設	0.8	0.8	1,158

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東洋建設	3.7	4.7	2,030
五洋建設	14.1	16.1	10,320
福田組	0.4	0.4	1,732
住友林業	8.6	8.8	14,352
日本基礎技術	1.5	1.6	564
日成ビルド工業	1.8	－	－
ヤマダ・エスバイエルホーム	7	－	－
巴コーポレーション	1.7	1.8	756
大和ハウス工業	37.1	40	130,720
ライト工業	2.5	2.6	3,868
積水ハウス	38.5	44	70,664
日特建設	1.2	1.2	856
北陸電気工事	0.7	0.8	780
ユアテック	2	2.2	1,806
西部電気工業	0.2	－	－
四電工	0.2	0.2	500
中電工	1.4	1.7	3,950
関電工	5	5.6	5,891
きんでん	8.4	9	15,363
東京エネシス	1.3	1.5	1,425
トーエネック	0.4	0.4	1,212
住友電設	0.9	1.1	1,769
日本電設工業	1.9	2.1	4,523
協和エクシオ	4.9	5.3	15,741
新日本空調	1	1.1	1,943
ＮＤＳ	0.2	－	－
九電工	2.5	2.7	10,138
三機工業	2.7	3.1	3,282
日揮	11.7	11.7	25,997
中外炉工業	0.4	0.4	858
ヤマト	1.2	1.2	744
太平電業	0.8	0.9	2,313
高砂熱学工業	3.5	3.7	6,830
三晃金属工業	0.1	0.2	592
朝日工業社	0.3	0.3	957
明星工業	2.3	2.5	1,982
大氣社	1.7	1.8	5,580
ダイダン	0.8	0.9	2,273
日比谷総合設備	1.4	1.5	2,689
東芝プラントシステム	2	2.9	6,414
ＯＳＪＢホールディングス	－	6.1	1,726
東洋エンジニアリング	1.5	1.6	1,360
千代田化工建設	9	9.2	6,532
新興プランテック	2.6	2.6	2,626
食料品（4.3%）			
日本製粉	3.7	4	7,224
日清製粉グループ本社	13.7	14.8	33,433
日東富士製粉	0.1	0.1	514
昭和産業	1	1.1	3,030
鳥越製粉	1	1.1	1,031
中部飼料	1.4	1.5	1,999
フィード・ワン	7.6	8.1	1,482
東洋精糖	0.2	0.2	226
日本甜菜製糖	0.6	0.7	1,318
三井製糖	0.9	1	3,000
塩水港精糖	1.5	1.6	392
日新製糖	0.5	0.6	1,296
森永製菓	2.4	2.9	12,557
中村屋	0.3	0.3	1,329
江崎グリコ	3.1	3.4	19,448
名糖産業	0.6	0.6	887
井村屋グループ	－	0.5	1,486
不二家	0.7	0.7	1,648
山崎製パン	9.2	9.9	19,730
第一屋製パン	0.2	0.3	322
モロゾフ	0.2	0.2	1,080
亀田製菓	0.7	0.7	3,353
寿スピリッツ	1.2	1.2	4,986
カルビー	5.1	5.5	19,030
森永乳業	2.3	2.4	6,830
六甲バター	0.6	0.9	2,081
ヤクルト本社	6.7	7.3	58,327
明治ホールディングス	7.4	8.3	61,088
雪印メグミルク	2.7	2.9	7,508
プリマハム	8	1.7	3,733
日本ハム	9	5.2	20,904
林兼産業	0.5	0.5	328
丸大食品	6	1.3	2,420
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	0.7	0.9	3,987
伊藤ハム米久ホールディングス	7.2	7.8	5,452
サッポロホールディングス	4.1	4.4	9,376
アサヒグループホールディングス	23.6	25.4	121,513

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キリンホールディングス	54.1	54.8	143,384
宝ホールディングス	9.1	9.1	14,268
オエノンホールディングス	3.3	3.5	1,382
養命酒製造	0.4	0.4	923
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールディングス	7.9	9.3	26,514
サントリー食品インターナショナル	8.6	8.1	35,518
ダイドーグループホールディングス	0.6	0.6	3,270
伊藤園	3.7	4	19,220
キーコーヒー	1.1	1.2	2,407
ユニカフェ	0.4	0.4	478
ジャパンフーズ	0.2	0.2	245
日清オイリオグループ	1.4	1.4	4,732
不二製油グループ本社	3.4	3.3	10,824
かどや製油	0.1	0.1	586
Ｊ－オイルミルズ	0.6	0.6	2,298
キッコーマン	8.8	8.7	54,549
味の素	25.9	27.9	50,415
キユーピー	6.4	6.7	17,118
ハウス食品グループ本社	4.7	4.6	14,467
カゴメ	4.5	4.9	14,587
焼津水産化学工業	0.6	0.6	597
アリアケジャパン	1	1.1	10,703
ピエトロ	0.2	0.2	326
エバラ食品工業	0.3	0.3	624
ニチレイ	5.9	5.8	15,660
東洋水産	6.2	6.6	26,895
イートアンド	0.2	0.4	648
大冷	0.1	0.1	187
ヨシムラ・フード・ホールディングス	－	0.3	203
日清食品ホールディングス	4.9	4.8	33,888
永谷園ホールディングス	1	0.7	1,944
一正蒲鉾	0.4	0.5	475
フジッコ	1.2	1.3	2,817
ロック・フィールド	1.2	1.3	2,104
日本たばこ産業	69.6	70	203,560
ケンコーマヨネーズ	0.7	0.8	1,844
わらべや日洋ホールディングス	0.7	0.8	1,443
なとり	0.6	0.7	1,213
イフジ産業	0.2	0.2	148
ピックルスコーポレーション	－	0.3	639
北の達人コーポレーション	0.6	3.8	2,112
ユーグレナ	4.3	4.8	2,976
ミヨシ油脂	0.4	0.5	602
理研ビタミン	0.4	0.5	1,880
繊維製品（0.6%）			
片倉工業	1.4	1.5	1,746
グンゼ	0.9	0.9	4,234
東洋紡	4.7	4.7	7,468
ユニチカ	3.2	3.7	2,023
富士紡ホールディングス	0.6	0.7	2,240
倉敷紡績	12	1.3	3,182
シキボウ	0.7	0.6	679
日本毛織	3.3	3.9	3,322
ダイトウボウ	1.9	2.8	252
トーア紡コーポレーション	0.5	0.5	265
ダイドーリミテッド	1.4	1.4	501
帝国繊維	1.3	1.3	3,057
帝人	9.6	10.4	20,082
東レ	85.2	91.7	72,167
サカイオーベックス	0.3	0.3	628
住江織物	3	0.3	773
日本フエルト	0.7	0.6	283
イチカワ	1	0.2	300
日東製網	0.1	0.1	149
アツギ	1	0.9	953
ダイニック	0.4	0.5	410
セーレン	2.9	2.9	4,625
ソトー	0.4	0.5	489
東海染工	0.2	0.2	227
小松マテーレ	1.7	1.9	1,729
ワコールホールディングス	3.5	3.4	10,302
ホギメディカル	0.7	1.6	5,312
レナウン	3.3	3.5	395
クラウディアホールディングス	0.3	0.3	150
ＴＳＩホールディングス	4.8	4.4	3,238
マツオカコーポレーション	－	0.3	924
三陽商会	0.6	0.7	1,309
ナイガイ	0.5	0.5	245
オンワードホールディングス	8	7.3	4,715
ルックホールディングス	2	0.4	437
キムラタン	5.3	6.3	195
ゴールドウイン	0.5	0.7	5,761

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
デサント	2.7	2.9	7,406
キング	0.6	0.6	268
ヤマトインターナショナル	0.8	0.8	356
パルプ・紙（0.3%）			
特種東海製紙	0.7	0.7	2,943
王子ホールディングス	46	53.2	39,953
日本製紙	5.3	5.7	10,978
三菱製紙	1.7	1.8	1,015
北越コーポレーション	6.6	7	3,668
中越パルプ工業	0.5	0.5	734
巴川製紙所	2	0.4	477
大王製紙	4.7	5.2	7,488
阿波製紙	0.3	0.3	166
レンゴー	11.3	12.2	11,382
トーモク	0.7	0.7	1,330
ザ・パック	0.8	0.9	2,799
化学（7.0%）			
クラレ	19.8	20	30,220
旭化成	73.2	80.6	106,029
共和レザー	0.7	0.7	609
昭和電工	7.8	7.9	35,668
住友化学	87	93.1	50,274
住友精化	0.5	0.5	2,665
日産化学	6.3	7.3	39,347
ラサ工業	0.5	0.4	701
クレハ	0.9	1.1	7,931
多木化学	0.1	0.2	2,068
テイカ	0.9	1	2,240
石原産業	2.1	2.3	2,925
片倉コープアグリ	0.4	0.3	353
日東エフシー	0.7	0.7	532
日本曹達	7	1.8	5,128
東ソー	17	18.3	26,535
トクヤマ	3.7	3.7	9,146
セントラル硝子	2.4	2.6	6,159
東亞合成	6.9	7.4	7,977
大阪ソーダ	1	1.3	3,308
関東電化工業	2.4	3	2,916
デンカ	4.6	4.6	16,399
信越化学工業	21	20.8	175,822
日本カーバイド工業	0.4	0.4	649

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
堺化学工業	0.9	0.9	2,144
第一稀元素化学工業	－	1	1,071
エア・ウォーター	9.7	10.4	18,408
大陽日酸	9.1	9.7	16,528
日本化学工業	0.5	0.5	1,434
東邦アセチレン	0.2	0.2	295
日本パーカライジング	6	6.5	8,216
高圧ガス工業	1.7	1.9	1,457
四国化成工業	1.7	1.8	2,221
戸田工業	0.2	0.2	510
ステラ　ケミファ	0.6	0.6	1,998
保土谷化学工業	0.4	0.4	1,016
日本触媒	1.8	2	14,480
大日精化工業	1	1	3,275
カネカ	16	3.4	15,623
三菱瓦斯化学	10.9	10.5	19,015
三井化学	10.7	11.5	28,060
ＪＳＲ	11.8	12.7	21,018
東京応化工業	2.2	2	5,692
大阪有機化学工業	0.8	1.1	1,425
三菱ケミカルホールディングス	79.1	84.7	72,054
ＫＨネオケム	1.8	1.8	5,814
ダイセル	15.8	17.2	20,536
住友ベークライト	10	2	7,710
積水化学工業	26.1	25.8	42,905
日本ゼオン	9.9	10.7	11,031
アイカ工業	3.8	3.5	11,375
宇部興産	5.9	6.4	14,950
積水樹脂	1.8	1.9	3,467
タキロンシーアイ	2	2.6	1,453
旭有機材	0.8	0.7	1,498
日立化成	6.5	6.2	10,980
ニチバン	0.5	0.6	1,276
リケンテクノス	2.5	2.7	1,339
大倉工業	3	0.6	1,095
積水化成品工業	1.6	1.6	1,345
群栄化学工業	0.3	0.3	848
タイガースポリマー	0.6	0.6	394
ミライアル	0.4	0.4	378
ダイキアクシス	0.4	0.4	505
ダイキョーニシカワ	2	2.5	2,625

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
竹本容器	0.1	0.2	500
森六ホールディングス	－	0.6	1,670
日本化薬	7.6	8.2	10,364
カーリットホールディングス	1.2	1.2	951
日本精化	1	1	1,032
扶桑化学工業	0.8	1.2	2,521
トリケミカル研究所	－	0.3	1,261
ＡＤＥＫＡ	5.1	5.5	9,042
日油	4.5	4.9	15,655
新日本理化	1.9	2.1	422
ハリマ化成グループ	1	1	807
花王	27.6	29.7	215,651
第一工業製薬	3	0.5	1,388
石原ケミカル	－	0.3	602
日華化学	0.4	0.4	440
ニイタカ	0.2	0.2	345
三洋化成工業	0.7	0.8	3,984
有機合成薬品工業	0.8	0.9	233
大日本塗料	1.4	1.4	1,516
日本ペイントホールディングス	9.1	9.8	33,614
関西ペイント	12.4	13.3	21,758
神東塗料	1	1	198
中国塗料	3.4	3.6	3,204
日本特殊塗料	0.8	0.8	1,752
藤倉化成	1.6	1.6	958
太陽ホールディングス	1	1	3,900
ＤＩＣ	4.6	5.4	17,172
サカタインクス	2.4	2.6	2,813
東洋インキＳＣホールディングス	11	2.5	6,322
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	0.9	0.9	939
富士フイルムホールディングス	23.3	25.1	121,433
資生堂	20.9	24	162,360
ライオン	15.6	16.8	34,473
高砂香料工業	0.8	0.8	2,804
マンダム	2.3	2.4	7,512
ミルボン	0.7	1.5	6,780
ファンケル	2.5	2.9	12,673
コーセー	1.9	2.1	33,873
コタ	0.5	0.6	841
シーズ・ホールディングス	1.5	1.5	8,820
シーボン	0.2	0.1	264
ポーラ・オルビスホールディングス	4.8	5.2	16,380
ノエビアホールディングス	0.7	0.8	3,692
アジュバンコスメジャパン	0.2	0.3	288
エステー	0.8	0.9	1,664
アグロ　カネショウ	0.5	0.5	1,133
コニシ	1.8	2	3,016
長谷川香料	1.5	1.4	2,735
星光ＰＭＣ	0.6	0.8	723
小林製薬	3.1	3.4	23,732
荒川化学工業	1	1.1	1,651
メック	0.9	0.8	1,147
日本高純度化学	0.4	0.3	650
タカラバイオ	3.4	3.2	8,406
ＪＣＵ	0.7	1.5	3,400
新田ゼラチン	0.7	0.9	672
ＯＡＴアグリオ	0.2	0.2	550
デクセリアルズ	3.1	3.1	2,948
アース製薬	0.8	0.9	4,468
北興化学工業	1.2	1.3	663
大成ラミック	0.4	0.4	1,206
クミアイ化学工業	5.1	5	3,435
日本農薬	2.9	2.9	1,684
アキレス	0.9	0.9	1,946
有沢製作所	2	2	1,636
日東電工	8.5	9.1	62,234
レック	0.7	1.4	2,935
三光合成	－	1	366
きもと	2.2	2.2	552
藤森工業	0.9	1	3,265
前澤化成工業	0.8	0.9	942
ウェーブロックホールディングス	－	0.3	241
ＪＳＰ	0.6	0.7	1,677
エフピコ	1	1	5,690
天馬	0.8	0.9	1,697
信越ポリマー	2.3	2.5	1,887
東リ	2.8	3	948
ニフコ	2.1	4.5	11,601
バルカー	0.9	1	2,526
ユニ・チャーム	23.8	25.6	76,352
医薬品（5.2%）			
協和発酵キリン	14.1	15.1	29,082

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
武田薬品工業	44	45.1	196,996
アステラス製薬	115.2	118.7	207,072
大日本住友製薬	8.3	8.9	20,959
塩野義製薬	14.9	17	120,054
田辺三菱製薬	13.7	14.7	23,887
わかもと製薬	2	1.5	411
あすか製薬	1.3	1.4	2,038
日本新薬	2.7	3.2	20,448
ビオフェルミン製薬	0.2	0.2	570
中外製薬	11.7	12.6	82,782
科研製薬	2.2	2.2	12,276
エーザイ	14.5	14.5	134,995
ロート製薬	5.8	6.6	22,803
小野薬品工業	26.7	28.5	71,392
久光製薬	3.3	3.6	22,428
持田製薬	0.8	0.8	6,952
参天製薬	21.2	22.9	37,349
扶桑薬品工業	0.4	0.4	1,053
日本ケミファ	0.2	0.2	819
ツムラ	3.9	4.3	14,749
日医工	2.7	3.2	4,979
キッセイ薬品工業	2.1	2.1	6,583
生化学工業	2.2	2.3	3,767
栄研化学	1	2	4,650
日水製薬	0.5	0.5	607
鳥居薬品	0.7	0.7	1,713
ＪＣＲファーマ	0.9	0.9	4,689
東和薬品	0.5	0.6	4,920
富士製薬工業	0.4	0.8	1,356
沢井製薬	2	2.4	13,944
ゼリア新薬工業	2.4	2.6	5,293
第一三共	34.6	34.6	151,340
キョーリン製薬ホールディングス	2.9	3.4	8,258
大幸薬品	0.6	0.7	1,254
ダイト	0.7	0.7	2,243
大塚ホールディングス	23.3	23	122,452
大正製薬ホールディングス	2.5	2.7	32,238
ペプチドリーム	4.6	5.5	20,597
石油・石炭製品（0.9%）			
日本コークス工業	9.6	10.3	1,050
昭和シェル石油	10.5	11.3	23,232
ニチレキ	1.5	1.6	1,665
ユシロ化学工業	0.6	0.7	927
ビーピー・カストロール	0.5	0.4	588
富士石油	2.8	3	1,263
ＭＯＲＥＳＣＯ	0.4	0.4	616
出光興産	7.2	10.1	49,389
ＪＸＴＧホールディングス	179	194.8	145,418
コスモエネルギーホールディングス	3.5	3.5	14,017
ゴム製品（0.8%）			
横浜ゴム	6.5	7	14,812
東洋ゴム工業	6.6	6.2	11,246
ブリヂストン	39.6	37.1	156,821
住友ゴム工業	11	10.8	16,837
藤倉ゴム工業	1	1.1	567
オカモト	4	0.8	3,852
フコク	0.5	0.5	441
ニッタ	1	1.3	5,031
住友理工	2.2	2.4	2,323
三ツ星ベルト	3	1.5	4,074
バンドー化学	2.1	2.3	3,017
ガラス・土石製品（0.9%）			
日東紡績	1.9	1.8	4,046
ＡＧＣ	11.5	12.2	47,885
日本板硝子	5.3	5.9	5,929
石塚硝子	0.2	0.2	449
日本山村硝子	5	0.5	811
日本電気硝子	4.8	5.2	15,329
オハラ	0.5	0.5	1,176
住友大阪セメント	22	2.3	9,568
太平洋セメント	7.1	7.6	23,940
日本ヒューム	1.3	1.3	1,141
日本コンクリート工業	2.7	2.7	780
三谷セキサン	0.6	0.6	1,430
アジアパイルホールディングス	1.5	1.7	1,048
東海カーボン	10.2	11	17,600
日本カーボン	0.6	0.6	3,726
東洋炭素	0.7	0.7	1,894
ノリタケカンパニーリミテド	0.7	0.7	3,766
ＴＯＴＯ	8.6	9.3	37,246
日本碍子	14.8	14.7	23,828
日本特殊陶業	9.6	10.2	26,917

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ダントーホールディングス	1	1.4	176
ＭＡＲＵＷＡ	0.4	0.4	2,208
品川リフラクトリーズ	0.3	0.3	1,225
黒崎播磨	0.2	0.2	1,392
ヨータイ	0.6	1	719
イソライト工業	0.6	0.6	286
東京窯業	1.5	1.6	648
ニッカトー	0.4	0.6	625
フジミインコーポレーテッド	1	1.1	2,690
クニミネ工業	－	0.3	293
エーアンドエーマテリアル	0.3	0.3	295
ニチアス	6	3.3	8,266
ニチハ	1.5	1.8	4,242
鉄鋼（1.1%）			
新日鐵住金	52.9	53.4	109,443
神戸製鋼所	20.3	21.9	20,629
合同製鐵	0.7	0.7	1,404
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	32.1	32.2	73,448
日新製鋼	3.8	3.3	4,761
東京製鐵	6	6.4	5,369
共英製鋼	1.3	1.3	2,460
大和工業	2.4	2.6	7,282
東京鐵鋼	0.5	0.5	791
大阪製鐵	0.7	0.8	1,585
淀川製鋼所	1.6	1.8	4,161
東洋鋼鈑	2.8	－	－
丸一鋼管	3.9	4.2	13,293
モリ工業	0.4	0.4	1,001
大同特殊鋼	2	2.1	9,376
日本高周波鋼業	0.5	0.5	344
日本冶金工業	9.8	10	2,730
山陽特殊製鋼	1.4	1.5	3,912
愛知製鋼	0.7	0.7	2,712
日立金属	12	12.9	16,550
日本金属	0.3	0.3	401
大平洋金属	0.8	0.8	2,624
新日本電工	6.7	7.2	1,800
栗本鐵工所	0.6	0.6	967
虹技	0.2	0.2	320
日本鋳鉄管	1	0.1	142
三菱製鋼	0.8	0.9	1,667

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日亜鋼業	1.7	1.8	574
日本精線	0.2	0.2	740
エンビプロ・ホールディングス	－	0.3	188
シンニッタン	1	1.9	684
新家工業	0.3	0.3	530
非鉄金属（0.8%）			
大紀アルミニウム工業所	2	2	1,266
日本軽金属ホールディングス	30.3	34.9	7,608
三井金属鉱業	3.2	3.2	9,340
東邦亜鉛	0.7	0.7	2,397
三菱マテリアル	7.3	7.9	24,411
住友金属鉱山	15.2	15.5	53,366
ＤＯＷＡホールディングス	2.6	3	9,555
古河機械金属	1.8	2	2,720
エス・サイエンス	5.4	6.1	439
大阪チタニウムテクノロジーズ	1.3	1.3	2,259
東邦チタニウム	2	2.2	2,527
ＵＡＣＪ	1.7	1.8	4,321
ＣＫサンエツ	－	0.2	568
古河電気工業	3.9	4	11,532
住友電気工業	44.2	44.6	68,260
フジクラ	15.5	14.5	6,641
昭和電線ホールディングス	1.5	1.6	1,070
タツタ電線	2.2	2.4	1,260
沖電線	0.2	－	－
カナレ電気	0.2	0.2	404
平河ヒューテック	0.6	0.6	898
リョービ	1.4	1.5	4,710
アーレスティ	1.4	1.5	1,032
アサヒホールディングス	1.8	2	4,614
金属製品（0.6%）			
稲葉製作所	0.7	0.7	919
宮地エンジニアリンググループ	0.4	0.4	1,039
トーカロ	0.8	3.3	2,946
アルファＣｏ	0.4	0.4	545
ＳＵＭＣＯ	10.2	13.2	17,173
川田テクノロジーズ	0.2	0.3	1,893
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	0.1	0.2	776
東洋製罐グループホールディングス	8.3	7.6	17,312
ホッカンホールディングス	3	0.6	1,166
コロナ	0.6	0.7	753

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
横河ブリッジホールディングス	2.1	2.2	4,276
駒井ハルテック	0.2	0.3	603
高田機工	0.1	0.1	262
三和ホールディングス	11.5	11.6	14,616
文化シヤッター	3.3	3.5	2,768
三協立山	1.5	1.7	2,104
アルインコ	0.8	0.9	891
東洋シヤッター	0.3	0.4	260
ＬＩＸＩＬグループ	16.4	17.6	31,662
日本フイルコン	0.9	0.9	522
ノーリツ	2.5	2.7	4,257
長府製作所	1.2	1.2	2,677
リンナイ	2	2.1	17,052
ダイニチ工業	0.7	0.7	511
日東精工	1.6	1.7	1,018
三洋工業	0.2	0.2	404
岡部	2.3	2.4	2,340
ジーテクト	1.2	1.3	1,983
中国工業	0.2	0.2	113
東プレ	2.2	2.2	5,090
高周波熱錬	2.2	2.3	2,212
東京製綱	0.8	0.9	1,098
サンコール	0.6	0.7	504
モリテック　スチール	0.7	1	451
パイオラックス	1.8	1.8	4,199
エイチワン	0.9	1.2	1,318
日本発條	11	11.9	11,531
中央発條	0.1	0.1	350
アドバネクス	0.2	0.2	346
立川ブラインド工業	0.5	0.5	539
三益半導体工業	1	0.9	1,245
機械（5.0%）			
日本ドライケミカル	0.2	0.3	367
日本製鋼所	3.9	3.9	8,868
三浦工業	4.8	5.2	14,081
タクマ	3.7	4.2	5,770
ツガミ	3	3.2	2,912
オークマ	1.5	1.4	7,588
東芝機械	6	1.4	2,776
アマダホールディングス	15.8	18.4	18,565
アイダエンジニアリング	3.4	3.1	2,718

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
滝澤鉄工所	0.4	0.4	616
ＦＵＪＩ	3.6	3.6	5,367
牧野フライス製作所	6	1.2	4,704
オーエスジー	5	5.9	12,985
ダイジェット工業	0.2	0.2	364
旭ダイヤモンド工業	3.3	3.6	2,437
ＤＭＧ森精機	6.2	7.6	11,749
ソディック	3	2.6	2,077
ディスコ	1.4	1.6	26,480
日東工器	0.7	0.7	1,589
日進工具	－	0.3	741
パンチ工業	0.4	1	602
冨士ダイス	0.4	0.6	455
豊和工業	0.7	0.7	560
ＯＫＫ	0.4	0.5	517
東洋機械金属	0.8	1	618
津田駒工業	3	0.3	578
島精機製作所	1.5	1.5	4,537
オプトラン	－	1.2	2,526
ＮＣホールディングス	0.4	0.4	220
フリュー	0.7	0.9	802
ヤマシンフィルタ	0.3	1.9	1,265
日阪製作所	1.6	1.7	1,676
やまびこ	2.1	2.3	2,635
平田機工	0.4	0.5	3,245
ペガサスミシン製造	1.2	1.1	878
ナブテスコ	6.1	6.6	15,219
三井海洋開発	1.2	1.3	4,277
レオン自動機	1	1.1	1,975
ＳＭＣ	3.5	3.8	121,410
新川	1	1	444
ホソカワミクロン	0.4	0.4	2,048
ユニオンツール	0.5	0.5	1,837
オイレス工業	1.4	1.6	3,214
日精エー・エス・ビー機械	0.4	0.4	1,380
サトーホールディングス	1.5	1.6	5,080
技研製作所	0.6	0.8	3,004
日本エアーテック	0.4	0.4	281
カワタ	－	0.3	660
日精樹脂工業	0.9	1	973
オカダアイヨン	0.3	0.4	594

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ワイエイシイホールディングス	0.5	0.5	363
小松製作所	54.1	58.3	155,544
住友重機械工業	6.9	6.9	23,046
日立建機	5.3	5.6	16,273
日工	0.4	0.3	738
巴工業	0.5	0.5	1,100
井関農機	1.1	1.2	2,222
ＴＯＷＡ	1	1	895
丸山製作所	0.2	0.3	472
北川鉄工所	0.6	0.6	1,542
ローツェ	0.6	0.6	958
タカキタ	0.4	0.4	266
クボタ	60.5	64.8	113,464
荏原実業	0.3	0.4	712
三菱化工機	0.4	0.4	655
月島機械	2.2	2.4	3,542
帝国電機製作所	0.9	0.9	1,350
新東工業	2.7	2.9	2,618
澁谷工業	1	1.1	3,877
アイチ　コーポレーション	1.6	2.1	1,218
小森コーポレーション	2.8	3	3,756
鶴見製作所	0.9	1	1,914
住友精密工業	2	0.2	710
酒井重工業	0.2	0.2	611
荏原製作所	5.3	5.4	16,740
石井鐵工所	0.2	0.2	333
西島製作所	1.1	1.3	1,172
北越工業	1.3	1.4	1,544
ダイキン工業	15.3	16.5	208,477
オルガノ	0.4	0.4	1,192
トーヨーカネツ	0.5	0.5	1,218
栗田工業	6.5	6.5	17,381
椿本チエイン	7	1.5	6,427
大同工業	0.4	0.6	616
木村化工機	1	1	384
アネスト岩田	2	2	1,928
ダイフク	5.6	6.2	27,745
サムコ	0.3	0.4	445
加藤製作所	0.6	0.6	1,812
油研工業	0.2	0.2	396
タダノ	5.9	5.8	6,043

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
フジテック	3.2	3.7	4,336
ＣＫＤ	3.4	3.4	3,865
キトー	1.4	0.9	1,476
平和	3.5	3.7	9,235
理想科学工業	1.1	1.2	2,721
ＳＡＮＫＹＯ	3.1	3	12,570
日本金銭機械	1.1	1.2	1,267
マースグループホールディングス	0.6	0.8	1,784
福島工業	0.7	0.7	3,482
オーイズミ	0.5	0.5	273
ダイコク電機	0.5	0.6	939
竹内製作所	2.1	2	4,300
アマノ	3.5	3.7	7,577
ＪＵＫＩ	1.7	1.7	2,058
サンデンホールディングス	1.4	1.5	1,818
蛇の目ミシン工業	1.1	1.1	638
マックス	1.7	1.9	2,753
グローリー	3.6	3.6	9,050
新晃工業	1.1	1.2	1,831
大和冷機工業	1.8	1.8	2,062
セガサミーホールディングス	11.1	12	17,220
日本ピストンリング	0.5	0.5	1,026
リケン	0.5	0.6	3,168
ＴＰＲ	1.3	1.3	3,445
ツバキ・ナカシマ	1.1	1.8	3,598
ホシザキ	3.5	3.5	36,540
大豊工業	0.9	1	1,052
日本精工	23	24.8	27,354
ＮＴＮ	26	28	10,976
ジェイテクト	11.9	12.9	18,472
不二越	10	1.1	4,785
日本トムソン	3.6	3.9	2,343
ＴＨＫ	7.9	7.5	17,085
ユーシン精機	0.5	1.1	1,094
前澤給装工業	0.4	0.5	867
イーグル工業	1.2	1.5	1,879
前澤工業	0.8	0.9	338
日本ピラー工業	1.1	1.2	1,690
キッツ	5.4	4.9	4,047
マキタ	14.6	15.7	71,984
日立造船	8.9	9.6	4,022

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱重工業	18.8	20.2	81,244
ＩＨＩ	8.6	9.3	38,362
スター精密	2	2	3,142
電気機器（12.8%）			
日清紡ホールディングス	7.1	7.8	9,555
イビデン	7.8	7.4	9,745
コニカミノルタ	26.2	28.3	32,007
ブラザー工業	13.7	14.9	29,353
ミネベアミツミ	20.5	22.4	36,064
日立製作所	269	58	188,848
三菱電機	119.6	120.7	157,935
富士電機	34	7.4	24,568
東洋電機製造	0.5	0.5	768
安川電機	13.1	14	40,558
シンフォニアテクノロジー	7	1.6	2,132
明電舎	10	2	3,224
オリジン電気	0.4	0.3	462
山洋電気	0.6	0.6	2,457
デンヨー	1	1.1	1,744
東芝テック	7	1.7	5,703
芝浦メカトロニクス	2	0.2	654
マブチモーター	3.1	3.4	12,869
日本電産	14.5	14.5	198,940
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.4	0.5	1,002
トレックス・セミコンダクター	－	0.3	414
東光高岳	0.6	0.6	923
ダブル・スコープ	1.6	1.8	1,733
ダイヘン	6	1.3	3,078
田淵電機	1.8	－	－
ヤーマン	0.1	1.8	2,961
ＪＶＣケンウッド	8.3	10	2,730
ミマキエンジニアリング	1	1.1	1,097
第一精工	0.5	0.5	664
日新電機	2.3	2.8	2,433
大崎電気工業	2.2	2.6	1,986
オムロン	11.9	12.8	54,400
日東工業	1.6	1.9	3,465
ＩＤＥＣ	1.3	1.5	2,919
不二電機工業	0.1	0.2	268
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	22	4.3	9,743
サクサホールディングス	0.3	0.3	579

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
メルコホールディングス	0.6	0.6	2,325
テクノメディカ	0.3	0.3	581
日本電気	15.4	15.6	49,998
富士通	108	12.4	86,837
沖電気工業	4.9	5	7,640
岩崎通信機	0.5	0.6	437
電気興業	0.6	0.7	1,942
サンケン電気	7	1.4	3,049
ナカヨ	0.2	0.2	300
アイホン	0.6	0.7	1,011
ルネサスエレクトロニクス	5.8	12.5	6,862
セイコーエプソン	16.7	18	33,606
ワコム	8.7	9.4	4,512
アルバック	1.9	2.8	9,324
アクセル	0.5	0.6	358
ＥＩＺＯ	1.1	1.1	4,548
ジャパンディスプレイ	20.9	25.2	2,620
日本信号	3.1	3.4	3,209
京三製作所	3	2.9	1,363
能美防災	1.3	1.6	3,520
ホーチキ	0.8	0.9	1,217
星和電機	－	0.5	236
エレコム	1	1.1	2,789
パナソニック	128.7	137.9	168,651
シャープ	－	12	20,064
アンリツ	8.2	8.8	14,423
富士通ゼネラル	3.8	3.7	5,479
日立国際電気	2.9	－	－
ソニー	79.2	80.9	471,970
ＴＤＫ	6.3	6.3	57,015
帝国通信工業	0.4	0.5	587
タムラ製作所	4.3	4.7	2,575
アルプス電気	10.4	10.5	26,250
池上通信機	4	0.4	462
パイオニア	16.9	20.5	2,050
日本電波工業	1.1	1.1	496
鈴木	0.5	0.6	421
日本トリム	0.3	0.3	1,734
ローランド　ディー．ジー．	0.6	0.6	1,392
フォスター電機	1.3	1.4	1,859
クラリオン	6	1.3	3,055

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＳＭＫ	3	0.3	672
ヨコオ	0.8	0.8	974
ホシデン	3.3	3.1	3,016
ヒロセ電機	1.8	2	20,500
日本航空電子工業	3	3.1	4,863
ＴＯＡ	1.3	1.3	1,437
マクセルホールディングス	1.7	2.4	3,741
古野電気	1.4	1.4	1,810
ユニデンホールディングス	3	0.4	966
アルパイン	2.7	2.9	5,315
スミダコーポレーション	1.1	1	1,134
アイコム	0.6	0.7	1,653
リオン	0.5	0.5	1,281
本多通信工業	0.5	1	698
船井電機	1.3	1.3	718
横河電機	12.2	12.1	26,607
新電元工業	0.4	0.4	1,812
アズビル	3.4	7.3	14,709
東亜ディーケーケー	0.6	0.6	658
日本光電工業	4.7	5.1	17,059
チノー	0.4	0.4	509
共和電業	1.4	1.3	509
日本電子材料	0.5	0.5	343
堀場製作所	2.2	2.4	11,676
アドバンテスト	7.6	6.8	12,559
小野測器	0.5	0.6	450
エスペック	1	1.1	1,859
キーエンス	5.1	5.9	303,968
日置電機	0.6	0.6	2,331
シスメックス	8.7	9.4	72,662
日本マイクロニクス	2	2	1,318
メガチップス	1.1	1	1,934
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	0.7	0.7	2,996
澤藤電機	0.2	0.1	195
コーセル	1.6	1.7	1,827
イリソ電子工業	0.9	1	4,585
新日本無線	1	—	—
オプテックスグループ	0.9	2.1	4,002
千代田インテグレ	0.5	0.5	1,097
アイ・オー・データ機器	0.5	0.5	618
レーザーテック	2.5	2.5	6,760

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
スタンレー電気	8	9.2	32,522
岩崎電気	0.4	0.5	708
ウシオ電機	6.8	7.3	9,322
岡谷電機産業	0.7	0.9	405
ヘリオス　テクノ　ホールディング	1	1.1	793
日本セラミック	1.1	1.2	3,158
遠藤照明	0.6	0.6	454
古河電池	0.8	0.9	751
双信電機	0.6	0.6	264
山一電機	1	0.9	1,025
図研	0.7	0.8	1,289
日本電子	4	2.2	4,034
カシオ計算機	9	9.8	15,993
ファナック	11.4	11.5	203,435
日本シイエムケイ	2.4	2.2	1,570
エンプラス	0.5	0.6	1,727
大真空	0.4	0.4	410
ローム	5.4	5.5	36,520
浜松ホトニクス	8.2	8.7	32,712
三井ハイテック	1.5	1.6	1,766
新光電気工業	4.2	4.6	3,307
京セラ	18.4	19.8	113,275
太陽誘電	5.5	5.9	12,277
村田製作所	11.7	12.7	197,802
ユーシン	1.6	1.9	1,369
双葉電子工業	1.8	2	3,420
北陸電気工業	0.4	0.5	542
ニチコン	3.5	3.8	3,355
日本ケミコン	1	1	2,431
ＫＯＡ	1.5	1.7	2,499
市光工業	2.4	1.8	1,288
小糸製作所	6.7	7.2	41,400
ミツバ	2.1	2.2	1,854
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2.3	2.3	13,317
キヤノン電子	1	1.1	2,223
キヤノン	60.3	65	208,390
リコー	33.7	36.3	43,451
象印マホービン	—	2.3	2,686
ＭＵＴＯＨホールディングス	0.2	0.2	446
東京エレクトロン	7.5	8.1	114,048

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
輸送用機器（8.5%）			
トヨタ紡織	3.9	3.6	7,210
芦森工業	0.3	0.3	549
ユニプレス	2.2	2.3	4,590
豊田自動織機	10.2	9.8	55,076
モリタホールディングス	1.9	2	4,154
三櫻工業	1.4	1.6	1,016
デンソー	27.6	26.8	133,651
東海理化電機製作所	2.9	3.2	6,867
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	4	4.4	8,404
川崎重工業	8.7	9.4	25,248
名村造船所	3.4	3.6	1,702
サノヤスホールディングス	1.4	1.6	339
日本車輌製造	4	0.5	1,315
三菱ロジスネクスト	1.3	1.4	1,611
近畿車輛	0.2	0.2	442
日産自動車	132.2	142.4	141,104
いすゞ自動車	32.5	35.4	50,622
トヨタ自動車	136.3	146.8	959,191
日野自動車	16	17.2	18,111
三菱自動車工業	41.1	44.7	30,396
エフテック	0.7	0.8	862
レシップホールディングス	0.4	0.5	378
ＧＭＢ	0.2	0.2	236
ファルテック	0.2	0.2	190
武蔵精密工業	1.3	2.6	4,230
日産車体	4.9	4.7	4,187
新明和工業	4.5	5.4	7,462
極東開発工業	2.2	2.3	3,583
日信工業	2.5	2.5	4,000
トピー工業	0.9	1	2,942
ティラド	0.4	0.4	1,037
曙ブレーキ工業	5.2	6.3	1,404
タチエス	1.9	2.1	3,271
ＮＯＫ	5.4	6.5	9,938
フタバ産業	3.4	3.7	2,379
ＫＹＢ	1.3	1.3	3,211
大同メタル工業	1.4	1.8	1,486
プレス工業	5.9	6.4	3,123
ミクニ	1.5	1.6	956
太平洋工業	2.5	2.5	3,987
ケーヒン	2.6	2.8	5,964
河西工業	1.5	1.5	1,510
アイシン精機	10.3	9.9	44,352
富士機工	1.1	－	－
マツダ	35.5	37.9	45,176
今仙電機製作所	1	1.1	1,103
本田技研工業	100.8	108.6	323,356
スズキ	22.2	23.9	133,290
ＳＵＢＡＲＵ	34.8	37.5	113,025
安永	0.5	0.6	1,023
ヤマハ発動機	15.8	17.1	43,793
ショーワ	2.9	3.2	4,630
ＴＢＫ	1.5	1.4	623
エクセディ	1.5	1.5	4,672
豊田合成	3.6	4.4	11,215
愛三工業	1.9	2.1	1,673
盟和産業	0.2	0.2	231
日本プラスト	－	0.8	664
ヨロズ	1	1.2	1,842
エフ・シー・シー	1.8	2.1	5,806
シマノ	4.5	4.9	75,313
テイ・エス　テック	2.6	2.8	8,820
ジャムコ	0.7	0.6	1,746
精密機器（1.8%）			
テルモ	17.2	18.5	108,965
クリエートメディック	0.4	0.4	441
日機装	3.9	3.9	5,019
島津製作所	14.4	14.6	40,923
ＪＭＳ	1	1.1	599
長野計器	0.9	1	875
ブイ・テクノロジー	0.2	0.3	3,840
東京計器	0.8	0.8	796
愛知時計電機	0.2	0.2	764
インターアクション	0.5	0.7	1,173
オーバル	1.2	1.2	315
東京精密	2.2	2.2	5,401
マニー	1.4	1.5	7,395
ニコン	19.5	21	39,669
トプコン	5.7	6.5	10,289
オリンパス	17.9	18	68,130
理研計器	1	1.1	2,179

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
タムロン	0.9	1.1	2,195
ＨＯＹＡ	23.1	24.3	147,379
シード	0.1	0.5	830
ノーリツ鋼機	1.1	1.2	2,914
エー・アンド・デイ	1	1.1	849
シチズン時計	12.3	14.4	9,158
リズム時計工業	0.5	0.4	779
大研医器	1	1.1	875
メニコン	0.8	1.6	3,974
シンシア	－	0.2	113
松風	0.6	0.6	744
セイコーホールディングス	1.6	1.9	5,048
ニプロ	7.8	8.4	11,659
その他製品（2.1%）			
中本パックス	－	0.3	524
スノーピーク	0.2	0.4	601
パラマウントベッドホールディングス	1.1	1.3	6,064
トランザクション	0.5	0.7	560
ＳＨＯ－ＢＩ	0.5	0.4	155
ニホンフラッシュ	0.5	0.6	1,116
前田工繊	1.1	1.3	2,683
永大産業	2	1.6	734
アートネイチャー	1.2	1.3	861
ダンロップスポーツ	0.7	－	－
バンダイナムコホールディングス	12.4	12.5	48,812
アイフィスジャパン	0.3	0.3	225
共立印刷	1.9	2.1	560
ＳＨＯＥＩ	0.5	0.6	2,439
フランスベッドホールディングス	1.3	1.4	1,323
パイロットコーポレーション	2	2.1	12,957
萩原工業	0.3	0.7	1,149
トッパン・フォームズ	2	2.6	2,454
フジシールインターナショナル	2.5	2.7	8,991
タカラトミー	4.4	5.1	6,262
廣済堂	1.1	1.2	525
エステールホールディングス	0.4	0.4	276
アーク	4.8	6.4	620
タカノ	0.5	0.5	419
プロネクサス	1.1	1	1,030
ホクシン	0.9	1	155
ウッドワン	0.4	0.4	465
大建工業	0.8	0.9	1,758
凸版印刷	32	17.1	26,436
大日本印刷	15.8	15.9	39,432
図書印刷	0.8	0.8	667
共同印刷	0.3	0.4	1,061
ＮＩＳＳＨＡ	2	2.5	4,457
光村印刷	0.1	0.1	225
宝印刷	0.6	0.6	1,053
アシックス	11.2	12	19,488
ツツミ	0.4	0.4	816
小松ウオール工業	0.4	0.4	813
ヤマハ	7.6	7.9	38,907
河合楽器製作所	0.5	0.4	1,510
クリナップ	1.2	1.1	755
ピジョン	6.8	7.3	34,127
兼松サステック	0.1	0.1	170
キングジム	1	1	888
リンテック	2.7	2.9	7,557
イトーキ	2.4	2.3	1,324
任天堂	6.9	7.4	257,594
三菱鉛筆	1.8	2	3,710
タカラスタンダード	2.3	2.5	4,335
コクヨ	5.4	5.8	9,877
ナカバヤシ	1	1.2	722
グローブライド	－	0.6	1,530
オカムラ	3.9	4.2	5,934
美津濃	1.2	1.2	3,078
電気・ガス業（1.9%）			
東京電力ホールディングス	95.1	96.5	55,198
中部電力	36.9	37	59,644
関西電力	45.8	49.3	82,848
中国電力	15.5	16.7	24,014
北陸電力	11	11.9	12,518
東北電力	28	28.3	39,987
四国電力	10.1	10.9	15,532
九州電力	24.8	26.7	35,137
北海道電力	10.5	12.2	8,039
沖縄電力	1.8	2.5	5,302
電源開発	8.9	9.6	29,568
エフオン	0.6	0.7	729
イーレックス	1.4	2.1	1,862

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
東京瓦斯	23.9	25.4	69,684
大阪瓦斯	21.8	23.4	48,672
東邦瓦斯	5.6	6	24,870
北海道瓦斯	3	0.7	1,013
広島ガス	2.3	2.7	961
西部瓦斯	1.3	1.5	3,774
静岡ガス	3.2	3.8	3,587
メタウォーター	0.6	0.7	1,997
陸運業（4.4%）			
ＳＢＳホールディングス	1.1	1.2	1,693
東武鉄道	12	12.7	39,179
相鉄ホールディングス	3.6	3.9	13,162
東京急行電鉄	30.5	32.8	59,925
京浜急行電鉄	15.4	16.6	27,340
小田急電鉄	18	18.2	45,081
京王電鉄	6.3	6.7	40,133
京成電鉄	8.4	8.5	28,942
富士急行	1.5	1.7	5,474
東日本旅客鉄道	21.5	21.5	204,830
西日本旅客鉄道	10.8	10.8	78,937
東海旅客鉄道	9.3	10.8	227,610
西武ホールディングス	15.5	15.4	31,046
鴻池運輸	1.6	1.8	3,033
西日本鉄道	2.7	3.3	9,038
ハマキョウレックス	0.7	0.9	3,154
サカイ引越センター	0.5	0.6	3,504
近鉄グループホールディングス	11.3	11.4	48,279
阪急阪神ホールディングス	14.2	15.3	55,615
南海電気鉄道	4.7	5.4	14,542
京阪ホールディングス	5	5.1	21,343
神戸電鉄	0.3	0.3	1,189
名古屋鉄道	8.2	9.2	24,472
山陽電気鉄道	0.8	0.9	2,132
日本通運	4.2	4.5	29,160
ヤマトホールディングス	20.1	20.1	62,591
山九	2.9	3	16,560
丸運	0.5	0.7	218
丸全昭和運輸	4	0.9	2,619
センコーグループホールディングス	5.3	6.9	5,830
トナミホールディングス	0.2	0.3	1,731
ニッコンホールディングス	3.8	4.4	11,726

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本石油輸送	0.1	0.2	560
福山通運	1.3	1.7	7,199
セイノーホールディングス	8	8.6	13,037
エスライン	－	0.3	363
神奈川中央交通	0.2	0.3	1,074
日立物流	2.3	2.5	7,112
丸和運輸機関	0.6	0.6	2,034
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	1.2	1.3	1,553
九州旅客鉄道	11.2	9.6	32,640
ＳＧホールディングス	－	10.8	29,246
海運業（0.2%）			
日本郵船	9.5	9.6	17,232
商船三井	5.9	7.2	18,777
川崎汽船	4.3	5.3	8,045
ＮＳユナイテッド海運	0.5	0.6	1,530
明治海運	1	1.3	484
飯野海運	5.8	5.9	2,902
共栄タンカー	0.1	0.1	181
乾汽船	0.8	0.9	865
空運業（0.6%）			
日本航空	19.7	21	79,527
ＡＮＡホールディングス	20.8	22.2	79,254
パスコ	1	0.3	352
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	0.3	0.3	2,112
日新	0.9	1	2,044
三菱倉庫	3.7	4	10,884
三井倉庫ホールディングス	7	1.4	2,412
住友倉庫	7	4.1	5,194
澁澤倉庫	0.6	0.6	921
東陽倉庫	2	2.1	640
日本トランスシティ	2	2.8	1,111
ケイヒン	0.2	0.2	282
中央倉庫	0.6	0.7	725
川西倉庫	0.2	0.3	460
安田倉庫	0.9	1	818
東洋埠頭	0.3	0.3	464
宇徳	0.9	1	521
上組	6.7	7.1	16,159
サンリツ	0.3	0.3	187
キムラユニティー	0.3	0.3	333

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キユーソー流通システム	0.3	0.3	732
郵船ロジスティクス	1	－	－
近鉄エクスプレス	2	2.1	3,612
東海運	0.7	0.7	207
エーアイテイー	0.7	0.8	812
内外トランスライン	0.4	0.4	624
日本コンセプト	0.2	0.3	325
情報・通信業（7.9%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	1.2	1.3	3,006
システナ	0.9	3.9	5,553
デジタルアーツ	0.5	0.6	2,826
新日鉄住金ソリューションズ	1.7	1.8	5,571
キューブシステム	0.7	0.7	588
エイジア	－	0.3	369
コア	0.5	0.5	595
ソリトンシステムズ	－	0.7	627
ソフトクリエイトホールディングス	0.5	0.6	946
ＴＩＳ	3.7	3.9	18,993
ネオス	0.4	0.4	534
電算システム	0.4	0.5	994
グリー	6.8	6.4	2,816
コーエーテクモホールディングス	2.6	2.4	4,348
三菱総合研究所	0.5	0.5	1,917
ボルテージ	0.2	0.3	214
電算	0.1	0.1	210
ＡＧＳ	0.3	0.7	504
ファインデックス	0.9	1	687
ヒト・コミュニケーションズ	0.2	0.3	555
ブレインパッド	0.2	0.3	1,527
ＫＬａｂ	2.1	2.1	1,961
ポールトゥウィン・ピットクルーＨＤ	0.8	0.9	2,181
イーブックイニシアティブジャパン	0.2	0.2	537
ネクソン	12.3	30.2	37,719
アイスタイル	2.5	3	2,931
エムアップ	0.3	0.4	932
エイチーム	0.7	0.8	1,473
テクノスジャパン	0.9	1.1	952
ｅｎｉｓｈ	0.3	－	－
コロプラ	3.6	3.4	2,301
モバイルクリエイト	1	－	－
オルトプラス	0.6	0.7	301
ブロードリーフ	2.7	5.9	3,811
クロス・マーケティンググループ	－	0.3	131
デジタルハーツホールディングス	0.6	0.6	819
メディアドゥホールディングス	0.3	0.4	1,082
じげん	－	1.3	846
ブイキューブ	0.7	0.7	373
サイバーリンクス	0.2	0.2	200
ディー・エル・イー	0.5	0.8	252
フィックスターズ	0.2	1.1	1,365
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	0.6	0.6	732
オプティム	0.2	0.2	740
セレス	0.4	0.4	718
ベリサーブ	0.1	0.2	1,138
ティーガイア	1.1	1.2	3,020
セック	－	0.2	877
日本アジアグループ	1.3	1.3	487
豆蔵ホールディングス	0.8	0.9	692
テクマトリックス	0.7	0.6	1,204
プロシップ	－	0.2	500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	29.9	28.6	5,605
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	0.8	2	11,020
ザッパラス	0.7	0.7	266
システムリサーチ	0.1	0.2	768
インターネットイニシアティブ	1.6	1.9	3,953
さくらインターネット	0.9	1.4	884
ヴィンクス	－	0.4	568
ＧＭＯクラウド	0.2	0.3	894
ＳＲＡホールディングス	0.6	0.6	1,902
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	0.3	0.2	261
システムインテグレータ	0.2	0.2	447
朝日ネット	1.1	1.1	544
ｅＢＡＳＥ	－	0.3	417
アバント	－	0.3	416
アドソル日進	0.3	0.5	1,118
フリービット	0.8	0.8	678
コムチュア	0.6	0.6	2,403
サイバーコム	0.2	0.2	323
アステリア	－	0.6	569
マークラインズ	－	0.4	582
メディカル・データ・ビジョン	0.4	1	1,601
ｇｕｍｉ	1.3	1.4	880

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ショーケース・ティービー	0.2	0.3	284
モバイルファクトリー	0.2	0.3	400
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.2	0.5	716
ＰＣＩホールディングス	0.2	0.2	528
パイプドHD	0.2	0.2	193
アイビーシー	0.1	0.2	252
ネオジャパン	－	0.3	259
ＰＲ　ＴＩＭＥＳ	－	0.1	202
ランドコンピュータ	－	0.1	104
オープンドア	0.1	0.5	1,252
マイネット	－	0.4	412
アカツキ	－	0.3	1,254
ベネフィットジャパン	－	0.1	74
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	－	0.2	201
ＬＩＮＥ	3.1	3.6	12,240
カナミックネットワーク	－	0.2	393
シンクロ・フード	－	0.4	314
オークネット	0.3	0.6	687
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	0.9	1.3	1,571
マクロミル	1.4	1.5	3,084
ビーグリー	－	0.2	263
オロ	－	0.1	498
ソルクシーズ	0.5	0.5	408
フェイス	0.5	0.4	482
ハイマックス	0.1	0.2	354
野村総合研究所	8.3	7.5	36,337
サイバネットシステム	0.9	1	610
ＣＥホールディングス	0.3	0.3	228
日本システム技術	0.1	0.2	408
インテージホールディングス	1.2	1.4	1,253
東邦システムサイエンス	0.4	0.4	348
ソースネクスト	0.7	1.8	2,426
ＦＩＧ	－	1.1	445
フォーカスシステムズ	0.6	0.7	620
クレスコ	0.3	0.3	913
フジ・メディア・ホールディングス	11.5	12.3	22,668
オービック	3.8	3.8	34,618
ジャストシステム	1.8	1.9	4,294
ＴＤＣソフト	0.5	1.1	1,111
ヤフー	79.4	85.4	30,744
トレンドマイクロ	5.4	6.3	38,997

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
インフォメーション・ディベロプメント	0.3	0.4	562
日本オラクル	1.8	1.9	14,155
アルファシステムズ	0.4	0.4	1,046
フューチャー	1.5	1.6	2,380
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	0.8	0.9	892
ソフトバンク・テクノロジー	0.5	0.5	1,040
トーセ	0.3	0.3	276
オービックビジネスコンサルタント	0.6	0.6	5,268
伊藤忠テクノソリューションズ	2.5	5.4	11,302
アイティフォー	1.5	1.5	1,353
東計電算	0.2	0.2	615
エックスネット	0.2	0.2	194
大塚商会	3.3	6.4	23,232
サイボウズ	1.5	1.4	967
ソフトブレーン	0.9	0.9	441
電通国際情報サービス	0.7	0.7	2,674
デジタルガレージ	2.2	2.2	6,287
ＥＭシステムズ	0.4	0.8	938
ウェザーニューズ	0.4	0.4	1,288
ＣＩＪ	1	0.9	668
東洋ビジネスエンジニアリング	0.1	0.1	210
日本エンタープライズ	1.2	1.3	286
WOWOW	0.5	0.6	1,944
スカラ	0.8	1	874
ＩＭＡＧＩＣＡ　ＧＲＯＵＰ	0.9	1	555
ネットワンシステムズ	4.8	4.8	10,603
システムソフト	2.7	2.9	284
アルゴグラフィックス	0.5	0.5	2,217
マーベラス	1.9	2	1,618
エイベックス	2	2.2	3,269
日本ユニシス	3.1	3.3	8,012
兼松エレクトロニクス	0.7	0.7	2,292
東京放送ホールディングス	7.3	6.6	13,655
日本テレビホールディングス	10.1	10.9	19,532
朝日放送グループホールディングス	1.1	1.2	898
テレビ朝日ホールディングス	3	3.3	6,860
スカパーＪＳＡＴホールディングス	7.2	9	4,464
テレビ東京ホールディングス	0.9	1	2,556
日本ＢＳ放送	0.4	0.4	484
ビジョン	0.3	0.4	1,516
ＵＳＥＮ－ＮＥＸＴ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	0.3	0.5	536

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ワイヤレスゲート	0.5	0.6	327
コネクシオ	0.8	0.9	1,645
日本通信	9.9	－	－
クロップス	0.3	0.3	227
日本電信電話	88.8	85.1	416,139
ＫＤＤＩ	108.1	104.5	296,362
光通信	1.3	1.4	26,292
ＮＴＴドコモ	81.4	85.2	245,929
エムティーアイ	1.5	1.4	791
ＧＭＯインターネット	4.1	4.3	6,548
アイドママーケティングコミュニケーション	0.1	0.3	184
カドカワ	3.2	3.5	3,839
学研ホールディングス	0.4	0.4	2,172
ゼンリン	1.5	2.2	6,452
昭文社	0.7	0.6	337
インプレスホールディングス	1.1	1.2	193
アイネット	0.6	0.7	1,090
松竹	0.7	0.8	8,464
東宝	7.2	7.8	27,807
東映	0.4	0.4	4,872
エヌ・ティ・ティ・データ	34.1	36.8	52,587
ピー・シー・エー	0.2	0.2	367
ビジネスブレイン太田昭和	0.2	0.2	413
ＤＴＳ	1.1	1.2	4,524
スクウェア・エニックス・ホールディングス	4.3	5.5	21,642
シーイーシー	0.7	1.4	3,214
カプコン	2.6	5.1	12,418
アイ・エス・ビー	0.2	0.2	461
ジャステック	0.7	0.7	736
ＳＣＳＫ	3	2.7	12,379
日本システムウエア	0.4	0.4	688
アイネス	1.4	1.5	1,773
ＴＫＣ	1	1	4,205
富士ソフト	1.5	1.8	9,162
ＮＳＤ	2.3	1.9	4,231
コナミホールディングス	5	4.8	20,256
福井コンピュータホールディングス	0.3	0.4	694
ＪＢＣＣホールディングス	0.9	0.9	1,377
ミロク情報サービス	1.1	1.1	2,277
ソフトバンクグループ	49.8	53.6	462,460

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
卸売業（5.0%）			
ホウスイ	0.1	0.1	95
高千穂交易	0.4	0.5	508
伊藤忠食品	0.3	0.3	1,584
エレマテック	0.4	0.6	1,348
ＪＡＬＵＸ	0.3	0.4	1,068
あらた	0.6	0.6	2,724
トーメンデバイス	0.1	0.2	477
東京エレクトロン　デバイス	0.4	0.4	704
フィールズ	0.9	1	887
双日	65.3	70.4	26,048
アルフレッサ　ホールディングス	13.1	13.2	37,329
横浜冷凍	2.6	3.1	2,672
神栄	0.2	0.2	222
山下医科器械	0.1	－	－
ラサ商事	0.5	0.6	560
ラクーン	0.7	0.8	433
アルコニックス	1.3	1.3	1,601
神戸物産	0.7	0.9	5,202
ペッパーフードサービス	0.6	－	－
あい　ホールディングス	1.6	1.9	3,940
ディーブイエックス	0.4	0.5	631
ダイワボウホールディングス	0.9	1	6,510
マクニカ・富士エレホールディングス	2	2.3	3,776
ラクト・ジャパン	－	0.3	1,941
バイタルケーエスケー・ホールディングス	2.1	2.2	2,514
八洲電機	0.9	0.9	721
メディアスホールディングス	0.2	0.7	567
ＵＫＣホールディングス	0.7	0.8	1,712
ジューテックホールディングス	－	0.3	299
大光	0.3	0.3	211
ＯＣＨＩホールディングス	0.3	0.4	485
ＴＯＫＡＩホールディングス	4.9	6.3	5,997
黒谷	－	0.2	96
Ｃｏｍｉｎｉｘ	0.2	0.2	167
三洋貿易	0.6	0.6	1,041
ビューティガレージ	0.1	0.2	345
ウイン・パートナーズ	0.8	0.9	1,026
ミタチ産業	0.3	0.3	234
シップヘルスケアホールディングス	2.1	2.5	10,212
明治電機工業	0.4	0.4	674

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
デリカフーズホールディングス	0.3	0.2	299
スターティアホールディングス	0.3	0.3	182
コメダホールディングス	2	2.3	5,062
富士興産	0.4	0.5	308
協栄産業	0.1	0.2	358
小野建	1	1	1,580
佐鳥電機	0.8	0.9	875
エコートレーディング	0.2	0.3	192
伯東	0.7	0.8	1,108
コンドーテック	0.9	0.9	914
中山福	0.7	0.7	443
ナガイレーベン	1.5	1.7	4,219
三菱食品	1.2	1.3	3,611
松田産業	0.8	0.9	1,256
第一興商	1.8	1.8	9,144
メディパルホールディングス	11.1	12.1	27,636
ＳＰＫ	0.2	0.3	714
萩原電気ホールディングス	0.4	0.4	1,156
アズワン	0.9	0.9	7,245
スズデン	0.4	0.4	502
シモジマ	0.7	0.7	686
ドウシシャ	1.3	1.3	2,780
小津産業	0.2	0.3	590
高速	0.6	0.7	709
たけびし	0.4	0.4	594
黒田電気	1.5	－	－
リックス	0.2	0.3	451
丸文	1	1	738
ハピネット	0.9	0.9	1,499
橋本総業ホールディングス	0.3	0.3	392
日本ライフライン	1.3	3.5	5,505
タカショー	－	0.6	282
エクセル	0.5	0.5	934
マルカキカイ	0.4	0.4	904
ＩＤＯＭ	3	3.8	1,364
日本エム・ディ・エム	0.9	0.8	984
進和	0.7	0.7	1,519
エスケイジャパン	0.2	0.3	254
ダイトロン	0.5	0.6	1,081
シークス	0.7	1.5	2,184
田中商事	0.4	0.4	252

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
オーハシテクニカ	0.6	0.7	978
白銅	0.3	0.4	692
伊藤忠商事	81	87.3	175,996
丸紅	108.9	100.2	88,737
高島	0.2	0.2	388
長瀬産業	6.6	7.1	11,906
蝶理	0.7	0.8	1,448
豊田通商	12.3	13.3	51,471
三共生興	1.6	2	876
兼松	4.7	5.1	7,221
ツカモトコーポレーション	0.2	0.2	237
三井物産	100.1	98	181,006
日本紙パルプ商事	0.6	0.6	2,352
日立ハイテクノロジーズ	3.8	4.1	15,149
カメイ	1.4	1.5	1,812
東都水産	0.2	0.2	409
ＯＵＧホールディングス	0.2	0.2	522
スターゼン	0.5	0.5	2,230
山善	4.2	4.7	5,578
椿本興業	0.2	0.3	876
住友商事	69.7	75	125,287
内田洋行	0.5	0.6	1,545
三菱商事	83	83.4	263,293
第一実業	0.4	0.5	1,772
キヤノンマーケティングジャパン	3.2	3.4	6,667
西華産業	0.6	0.7	1,167
佐藤商事	1	1.1	1,116
菱洋エレクトロ	1	1.1	1,713
東京産業	1.1	1.2	718
ユアサ商事	1.1	1.1	3,888
神鋼商事	0.3	0.3	808
小林産業	0.8	0.7	219
阪和興業	2.2	2.2	7,601
正栄食品工業	0.6	0.6	2,397
カナデン	1	1.1	1,239
菱電商事	0.9	0.9	1,377
フルサト工業	0.6	0.7	1,105
岩谷産業	2.5	2.6	9,880
すてきナイスグループ	0.5	0.5	581
昭光通商	4	0.5	392
ニチモウ	0.1	0.2	305

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
極東貿易	2	0.4	781
イワキ	2	1.4	733
三愛石油	2.9	3.2	4,000
稲畑産業	2.6	2.9	4,277
ＧＳＩクレオス	0.3	0.3	399
明和産業	1	1.1	452
ワキタ	2.4	2.5	2,922
東邦ホールディングス	3.5	3.5	10,090
サンゲツ	3.7	3.9	7,983
ミツウロコグループホールディングス	1.8	1.7	1,196
シナネンホールディングス	0.5	0.5	1,272
伊藤忠エネクス	2.4	2.6	2,771
サンリオ	3.4	3.4	7,850
サンワテクノス	0.7	0.8	919
リョーサン	1.5	1.3	4,121
新光商事	1.2	1.3	1,966
トーホー	0.5	0.6	1,326
三信電気	1.2	1.1	1,922
東陽テクニカ	1.3	1.4	1,181
モスフードサービス	1.5	1.6	4,740
加賀電子	1	1.1	2,591
ソーダニッカ	1.2	1.2	722
立花エレテック	0.8	0.8	1,360
フォーバル	0.5	0.5	481
ＰＡＬＴＡＣ	1.8	1.7	8,474
三谷産業	1.1	1.4	441
太平洋興発	0.5	0.5	439
西本Ｗｉｓｍｅｔｔａｃホールディングス	－	0.3	1,515
ヤマシタヘルスケアホールディングス	－	0.1	129
国際紙パルプ商事	－	2.2	708
ヤマタネ	0.6	0.6	1,068
丸紅建材リース	1	0.1	214
日鉄住金物産	1	0.9	4,149
泉州電業	－	0.4	1,045
トラスコ中山	2.3	2.5	6,965
オートバックスセブン	4.1	4.7	8,883
モリト	0.9	0.8	659
加藤産業	1.7	1.9	6,507
イノテック	1	1	1,181
イエローハット	1	1.1	2,932
ＪＫホールディングス	1.1	1.2	811
日伝	0.9	1	1,747
北沢産業	1	1.1	246
杉本商事	0.7	0.6	1,131
因幡電機産業	1.6	1.6	6,792
バイテックホールディングス	0.4	0.5	1,069
東テク	－	0.4	1,153
ミスミグループ本社	12.8	14	30,576
アルテック	1	1	254
タキヒヨー	0.3	0.4	728
蔵王産業	0.2	0.2	287
スズケン	5	5.4	28,026
ジェコス	0.8	0.8	836
ルネサスイーストン	1	1.1	508
小売業（5.1%）			
ローソン	3.5	3	20,700
サンエー	0.8	0.9	4,216
カワチ薬品	0.9	0.9	1,904
エービーシー・マート	2	2.2	14,190
ハードオフコーポレーション	0.5	0.5	461
アスクル	1.2	1	3,065
ゲオホールディングス	1.9	2	3,270
アダストリア	1.7	1.8	3,241
ジーフット	0.7	0.7	519
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	0.2	0.2	146
くらコーポレーション	0.6	0.7	4,501
キャンドゥ	0.5	0.6	996
パルグループホールディングス	0.6	0.6	1,950
エディオン	4.3	4.7	5,616
サーラコーポレーション	1.9	2.5	1,580
ワッツ	0.5	0.4	358
ハローズ	0.4	0.4	980
あみやき亭	0.2	0.3	1,189
ひらまつ	1.6	1.8	774
ゲンキー	0.4	－	－
大黒天物産	0.3	0.3	1,248
ハニーズホールディングス	1.1	1.2	1,070
ファーマライズホールディングス	0.3	0.3	181
アルペン	0.8	0.9	1,689
ハブ	－	0.4	349
クオールホールディングス	1.3	1.3	2,977
ジンズ	0.7	0.8	4,936

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ビックカメラ	6.3	6.3	9,046
ＤＣＭホールディングス	6.7	6.4	6,854
ペッパーフードサービス	－	0.9	2,812
ＭｏｎｏｔａＲＯ	3.9	7.5	18,997
東京一番フーズ	0.3	0.3	180
ＤＤホールディングス	0.3	0.3	658
きちり	0.4	0.4	316
アークランドサービスホールディングス	0.9	0.9	1,982
Ｊ．フロント　リテイリング	14	14.4	20,548
ドトール・日レスホールディングス	1.9	2.1	4,263
マツモトキヨシホールディングス	2.1	4.9	18,228
ブロンコビリー	0.6	0.6	1,749
ＺＯＺＯ	9.8	11.8	32,414
トレジャー・ファクトリー	0.3	0.4	263
物語コーポレーション	0.3	0.3	2,964
ココカラファイン	1.1	1.3	7,449
三越伊勢丹ホールディングス	22	22.2	27,661
Ｈａｍｅｅ	0.3	0.3	511
ウエルシアホールディングス	2.9	3.2	17,952
クリエイトＳＤホールディングス	1.6	1.7	4,618
丸善ＣＨＩホールディングス	1.3	1.4	478
ミサワ	0.3	0.3	133
ティーライフ	0.1	0.2	192
エー・ピーカンパニー	0.2	0.3	182
チムニー	0.3	0.4	1,110
シュッピン	0.4	0.8	1,082
ネクステージ	0.4	1.9	1,751
ジョイフル本田	1.8	3.5	5,523
鳥貴族	0.4	0.4	810
キリン堂ホールディングス	0.4	0.5	702
ホットランド	0.7	0.6	778
すかいらーくホールディングス	6.9	11.1	18,903
綿半ホールディングス	0.5	0.5	1,193
ヨシックス	0.1	0.2	494
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3.7	3.9	4,547
ブックオフコーポレーション	0.7	－	－
ゴルフダイジェスト・オンライン	0.5	0.5	432
ＢＥＥＮＯＳ	0.2	0.3	486
あさひ	0.8	0.9	1,229
日本調剤	0.4	0.4	1,386
コスモス薬品	0.5	0.6	13,332

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
トーエル	0.6	0.6	495
一六堂	0.3	0.3	108
オンリー	0.2	0.2	203
セブン＆アイ・ホールディングス	46.3	49.8	237,346
薬王堂	0.6	0.5	1,672
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3	3.2	3,817
ツルハホールディングス	2.2	2.6	28,236
サンマルクホールディングス	0.7	0.9	2,368
フェリシモ	0.4	0.3	356
トリドールホールディングス	1.4	1.5	2,857
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	0.1	1.1	651
ジャパンミート	－	0.5	985
サツドラホールディングス	0.1	0.2	394
ダイユー・リックホールディングス	0.4	0.6	612
バロックジャパンリミテッド	0.9	1	961
クスリのアオキホールディングス	0.9	0.9	6,813
力の源ホールディングス	－	0.3	278
スシローグローバルホールディングス	1	1.3	7,462
ＬＩＸＩＬビバ	1.1	1.5	2,463
メディカルシステムネットワーク	1.3	1.4	688
総合メディカル	0.5	－	－
はるやまホールディングス	0.5	0.6	529
ノジマ	1.7	2.1	5,189
カッパ・クリエイト	1.6	1.5	1,996
ライトオン	1	1	919
ジーンズメイト	0.4	0.4	242
良品計画	1.5	1.6	45,136
三城ホールディングス	1.3	1.5	706
アドヴァン	1.1	1.3	1,297
アルビス	0.3	0.4	1,128
コナカ	1.4	1.5	727
ハウス　オブ　ローゼ	0.2	0.2	362
Ｇ－７ホールディングス	0.3	0.4	964
イオン北海道	1.1	1.2	945
コジマ	1.9	1.8	864
ヒマラヤ	0.3	0.4	376
コーナン商事	1.6	1.7	4,819
エコス	0.4	0.5	952
ワタミ	1.3	1.4	1,878
マルシェ	0.3	0.4	318
ドンキホーテホールディングス	7.2	7.7	52,283

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
西松屋チェーン	1.9	2.6	2,550
ゼンショーホールディングス	5.7	6.2	12,734
幸楽苑ホールディングス	0.7	0.8	1,255
ハークスレイ	0.2	0.3	306
サイゼリヤ	1.6	2	4,038
ＶＴホールディングス	3.8	4	1,816
魚力	0.3	0.3	412
ポプラ	0.3	0.4	235
フジ・コーポレーション	0.2	0.2	416
ユナイテッドアローズ	1.5	1.5	6,795
ハイデイ日高	1.2	1.6	3,462
京都きもの友禅	0.8	0.8	379
コロワイド	3.7	4	10,804
ピーシーデポコーポレーション	1.5	1.8	964
壱番屋	0.8	0.8	3,384
トップカルチャー	0.4	－	－
ＰＬＡＮＴ	0.3	0.3	345
スギホールディングス	2.4	2.6	13,000
ヴィア・ホールディングス	0.9	1.5	1,054
スクロール	1.7	1.9	1,081
ヨンドシーホールディングス	1.1	1.2	2,763
ユニー・ファミリーマートホールディングス	4.9	3.8	48,830
木曽路	1.4	1.5	3,970
ＳＲＳホールディングス	1.3	1.4	1,381
千趣会	2	2.2	737
タカキュー	1	1.1	216
ケーヨー	1.9	2.2	1,216
上新電機	1.3	1.4	3,925
日本瓦斯	2	2.2	7,667
ロイヤルホールディングス	2	2.1	5,800
東天紅	0.1	0.1	150
いなげや	1.2	1.3	1,992
島忠	2.8	2.7	7,786
チヨダ	1.3	1.4	2,927
ライフコーポレーション	0.8	0.9	2,513
リンガーハット	1.2	1.5	3,372
さが美グループホールディングス	1	－	－
ＭｒＭａｘＨＤ	1.4	1.6	808
テンアライド	1.1	1.2	518
ＡＯＫＩホールディングス	2.2	2.4	3,501
オークワ	1	1.7	1,885

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	1.7	1.8	4,438
青山商事	2.3	2.3	7,728
しまむら	1.3	1.4	12,782
はせがわ	0.7	0.7	322
髙島屋	19	9.3	15,707
松屋	2.4	2.4	2,383
エイチ・ツー・オー　リテイリング	5.7	5.7	9,422
近鉄百貨店	0.4	0.5	1,745
パルコ	1.1	1.1	1,268
丸井グループ	11.7	10.9	26,476
アクシアル リテイリング	0.9	1	3,535
イオン	45.5	45.8	116,767
イズミ	2	2.2	12,870
東武ストア	0.1	－	－
平和堂	2.2	2.4	6,780
フジ	1.2	1.4	2,794
ヤオコー	1.2	1.3	7,826
ゼビオホールディングス	1.5	1.6	2,424
ケーズホールディングス	4.7	10.7	15,194
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	0.7	0.7	555
日産東京販売ホールディングス	1.7	1.8	601
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	－	0.5	1,770
総合メディカルホールディングス	－	1	2,309
ブックオフグループホールディングス	－	0.7	517
アインホールディングス	1.5	1.6	13,600
元気寿司	0.3	0.3	1,740
ヤマダ電機	38	40.6	21,355
アークランドサカモト	1.9	2	2,924
ニトリホールディングス	4.8	4.9	68,134
愛眼	0.9	1	303
ケーユーホールディングス	0.6	0.6	540
吉野家ホールディングス	3.9	4	7,308
松屋フーズホールディングス	0.5	0.6	2,157
サガミホールディングス	1.4	1.6	2,113
関西スーパーマーケット	0.9	0.9	909
王将フードサービス	0.8	0.9	6,867
プレナス	1.2	1.3	2,278
ミニストップ	0.8	0.9	1,831
アークス	2.1	2.2	5,779
バローホールディングス	2.4	2.8	6,591
藤久	0.1	0.1	104

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	0.5	2,780
大庄	0.6	0.6	985
ファーストリテイリング	1.8	1.6	88,848
サンドラッグ	4.2	4.5	17,572
サックスバー　ホールディングス	1.1	1.1	1,067
ヤマザワ	0.2	0.2	320
やまや	0.2	0.2	501
ベルーナ	2.4	2.9	3,004
銀行業（7.0%）			
島根銀行	0.2	0.3	348
じもとホールディングス	8.1	8.1	1,166
めぶきフィナンシャルグループ	53.4	61.9	21,107
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1.6	1.6	2,846
九州フィナンシャルグループ	18.1	19.5	9,477
ゆうちょ銀行	31.3	33.7	43,675
富山第一銀行	2.8	3	1,236
コンコルディア・フィナンシャルグループ	71.7	75.9	37,646
西日本フィナンシャルホールディングス	7.5	7.6	7,782
関西みらいフィナンシャルグループ	－	5.6	4,961
三十三フィナンシャルグループ	－	1	1,974
第四北越フィナンシャルグループ	－	2.1	8,379
新生銀行	10.5	9.8	16,091
あおぞら銀行	7	7.1	26,376
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	830	829.3	541,615
りそなホールディングス	129.4	130.7	76,341
三井住友トラスト・ホールディングス	21.9	23.3	101,401
三井住友フィナンシャルグループ	88.6	89.1	378,496
第四銀行	1.4	－	－
北越銀行	1.2	－	－
千葉銀行	43	42.2	29,582
群馬銀行	24.1	23.8	11,995
武蔵野銀行	1.8	1.9	5,540
千葉興業銀行	3.1	3.3	1,415
筑波銀行	4.7	5	1,235
七十七銀行	3.5	3.7	8,528
青森銀行	0.9	0.9	2,677
秋田銀行	0.7	0.8	2,043
山形銀行	1.2	1.3	2,927
岩手銀行	0.7	0.8	3,292
東邦銀行	9.8	10.6	4,155
東北銀行	0.6	0.6	758
みちのく銀行	0.7	0.8	1,403
ふくおかフィナンシャルグループ	45	9.7	26,316
静岡銀行	29	30	28,650
十六銀行	1.5	1.6	4,083
スルガ銀行	11.3	12.2	5,941
八十二銀行	21.3	21.5	9,911
山梨中央銀行	7	1.5	2,362
大垣共立銀行	1.7	1.9	4,814
福井銀行	1	1	2,062
北國銀行	1.2	1.4	5,117
清水銀行	0.4	0.5	952
富山銀行	0.2	0.2	720
滋賀銀行	10	2.4	6,141
南都銀行	1.3	1.4	3,526
百五銀行	9.9	11.4	4,537
京都銀行	4	4.6	22,586
紀陽銀行	4.2	4.5	7,141
三重銀行	0.5	－	－
ほくほくフィナンシャルグループ	7.4	7.9	10,815
広島銀行	16.3	17.6	11,932
山陰合同銀行	6.6	7	5,824
中国銀行	7.7	8.2	8,232
鳥取銀行	0.4	0.4	632
伊予銀行	15.8	17	11,118
百十四銀行	12	1.3	3,633
四国銀行	1.7	1.8	2,116
阿波銀行	9	1.9	5,464
大分銀行	0.6	0.7	2,569
宮崎銀行	0.7	0.8	2,288
佐賀銀行	0.7	0.7	1,460
十八銀行	7	0.7	2,264
沖縄銀行	1.1	1.2	4,374
琉球銀行	2.3	2.8	3,418
セブン銀行	41.5	44.7	15,510
みずほフィナンシャルグループ	1,502.1	1,618	305,154
高知銀行	0.4	0.5	494
山口フィナンシャルグループ	10	14.9	17,284
長野銀行	0.3	0.4	665
名古屋銀行	0.9	1	3,595
北洋銀行	18.1	18	6,048
愛知銀行	0.4	0.4	1,716

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	0.6	－	－
中京銀行	0.5	0.5	1,137
大光銀行	0.4	0.4	768
愛媛銀行	1.4	1.7	1,968
トマト銀行	0.4	0.5	677
みなと銀行	1	－	－
京葉銀行	9	5.3	4,255
関西アーバン銀行	1.5	－	－
栃木銀行	6.1	6.2	2,002
北日本銀行	0.4	0.4	964
東和銀行	2.1	2.1	1,873
福島銀行	1.2	1.2	709
大東銀行	0.6	0.6	565
トモニホールディングス	9.1	9.8	4,086
フィデアホールディングス	10.8	11.5	1,725
池田泉州ホールディングス	11.7	12.6	4,321
証券、商品先物取引業（1.0%）			
ＦＰＧ	4	3.8	3,857
マーキュリアインベストメント	－	0.5	387
ＳＢＩホールディングス	12.5	13.5	38,502
ジャフコ	1.9	1.7	6,859
大和証券グループ本社	101	101.9	66,285
野村ホールディングス	226.2	208.9	110,299
岡三証券グループ	9	10.2	5,263
丸三証券	3.5	3.8	3,306
東洋証券	4	4.4	959
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	12.7	13.2	7,590
光世証券	0.3	0.3	308
水戸証券	3.5	3.6	1,166
いちよし証券	2.5	2.5	2,330
松井証券	6.3	5.9	6,914
だいこう証券ビジネス	0.6	0.6	285
マネックスグループ	11.7	12.2	5,648
カブドットコム証券	8.2	7.6	2,986
極東証券	1.5	1.6	2,086
岩井コスモホールディングス	1.1	1.2	1,682
藍澤證券	2.1	2.3	1,651
マネーパートナーズグループ	1.4	1.6	556
保険業（2.5%）			
かんぽ生命保険	4.2	4.5	12,024
ＳＯＭＰＯホールディングス	23.1	23.4	107,172
アニコム　ホールディングス	0.8	0.8	2,580
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	31	31.1	105,771
ソニーフィナンシャルホールディングス	10.6	9.8	23,667
第一生命ホールディングス	66.7	67.4	143,022
東京海上ホールディングス	44.5	44.9	231,369
Ｔ＆Ｄホールディングス	38.8	36.8	65,136
アドバンスクリエイト	0.3	0.3	602
その他金融業（1.2%）			
全国保証	3.1	3.4	13,481
ジェイリース	－	0.2	130
イントラスト	－	0.3	131
アルヒ	－	1.4	2,494
クレディセゾン	8.4	9	15,201
芙蓉総合リース	1.3	1.4	8,442
興銀リース	2.1	2.2	5,986
東京センチュリー	2.2	2.4	13,704
日本証券金融	4.9	5.1	3,131
アイフル	18.7	20.2	5,959
ポケットカード	0.9	－	－
リコーリース	0.9	0.9	3,114
イオンフィナンシャルサービス	7.1	8.4	17,421
アコム	22.3	24	9,744
ジャックス	1.2	1.4	2,900
オリエントコーポレーション	24.3	25.9	4,273
日立キャピタル	2.6	3.3	8,906
アプラスフィナンシャル	5.9	6	588
オリックス	78.4	79.4	136,290
三菱ＵＦＪリース	28.1	30.2	17,002
九州リースサービス	－	0.6	408
日本取引所グループ	34.4	34.2	63,783
イー・ギャランティ	0.3	1.3	1,485
アサックス	0.2	0.5	275
ＮＥＣキャピタルソリューション	0.5	0.5	882
不動産業（2.4%）			
いちご	10.6	17	6,052
日本駐車場開発	13.4	14.4	2,116
ヒューリック	23.1	24.9	24,526
三栄建築設計	0.4	0.5	733
スター・マイカ	0.4	0.6	892
野村不動産ホールディングス	7.4	7.9	17,016
三重交通グループホールディングス	2	2.4	1,221

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サムティ	1	1.7	2,531
ディア・ライフ	1.1	1.5	780
コーセーアールイー	－	0.3	254
エー・ディー・ワークス	20.7	17.3	657
日本商業開発	0.6	0.7	1,172
プレサンスコーポレーション	1.7	1.7	2,108
ユニゾホールディングス	1.1	1.7	3,570
ＴＨＥグローバル社	0.5	0.6	422
日本管理センター	0.7	0.8	984
サンセイランディック	0.3	0.3	319
エストラスト	0.2	0.2	152
フージャースホールディングス	1.5	2.9	1,757
オープンハウス	1.8	1.9	8,170
東急不動産ホールディングス	26.8	28.9	18,438
飯田グループホールディングス	9.2	9.9	19,800
イーグランド	－	0.2	142
ムゲンエステート	0.7	0.8	496
ファーストブラザーズ	0.3	0.3	350
ハウスドゥ	0.2	0.4	659
シーアールイー	0.2	0.4	381
プロパティエージェント	－	0.1	93
ケイアイスター不動産	0.3	0.4	756
アグレ都市デザイン	－	0.2	147
グッドコムアセット	－	0.2	353
パーク２４	6.1	7	20,867
パラカ	0.3	0.3	583
三井不動産	58.7	60.4	154,684
三菱地所	82.3	88.7	159,748
平和不動産	2.1	2.1	4,189
東京建物	12.1	13	15,392
ダイビル	2.9	3.1	3,295
京阪神ビルディング	1.8	2	1,650
住友不動産	26	28.6	112,741
大京	2.1	1.9	4,552
テーオーシー	4.3	4.1	3,095
東京楽天地	0.2	0.2	940
レオパレス２１	13.8	14.3	7,464
スターツコーポレーション	1.5	1.6	3,595
フジ住宅	1.4	1.5	1,185
空港施設	1.3	1.2	708
明和地所	0.6	0.7	427
ゴールドクレスト	1	0.9	1,557
日本エスリード	0.4	0.5	709
日神不動産	1.3	1.6	798
日本エスコン	2	2.2	1,434
タカラレーベン	4.8	5.6	1,702
サンヨーハウジング名古屋	0.6	0.7	683
イオンモール	7.1	7.7	15,453
ファースト住建	0.4	0.4	534
カチタス	－	1.6	4,064
トーセイ	1.4	1.7	1,672
エヌ・ティ・ティ都市開発	6.9	7.4	12,432
サンフロンティア不動産	1.2	1.5	1,621
エフ・ジェー・ネクスト	1	0.9	721
インテリックス	0.4	0.4	300
ランドビジネス	0.7	0.7	388
グランディハウス	1	1.1	487
日本空港ビルデング	3.5	3.5	14,507
サービス業（4.6%）			
日本工営	0.7	0.8	1,951
ＬＩＦＵＬＬ	2.9	4	2,820
ジェイエイシーリクルートメント	0.9	0.9	1,827
日本M&Aセンター	3.4	8.1	22,202
メンバーズ	0.3	0.4	492
中広	0.1	0.1	66
タケエイ	1	1.2	848
Ｅ・Ｊホールディングス	－	0.2	237
トラスト・テック	0.5	0.6	1,992
コシダカホールディングス	0.6	3.1	3,989
アルトナー	－	0.2	155
パソナグループ	0.9	1.1	1,488
ＣＤＳ	0.3	0.3	355
リンクアンドモチベーション	2	2.1	2,240
ＧＣＡ	1.2	1.2	1,027
エス・エム・エス	1.7	4.6	8,068
パーソルホールディングス	9.1	10.8	22,690
リニカル	0.7	0.7	1,036
クックパッド	3.4	3.6	1,414
エスクリ	0.4	0.4	265
アイ・ケイ・ケイ	0.6	0.6	412
学情	0.5	0.5	738
スタジオアリス	0.5	0.6	1,506

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シミックホールディングス	0.6	0.6	1,174
ＮＪＳ	0.3	0.3	506
綜合警備保障	4.2	4.6	21,712
カカクコム	8.3	8.7	17,408
アイロムグループ	0.4	0.4	700
セントケア・ホールディング	0.2	0.6	369
サイネックス	0.1	0.2	149
ルネサンス	0.6	0.6	1,402
ディップ	1.5	1.6	3,884
オプトホールディング	0.8	0.7	1,687
新日本科学	1.3	1.6	803
ツクイ	2.8	2.7	2,527
キャリアデザインセンター	0.3	0.3	444
エムスリー	10.2	24.3	44,274
ツカダ・グローバルホールディング	0.9	0.7	414
ブラス	0.1	0.1	58
アウトソーシング	3	6.1	8,546
ウェルネット	0.9	1.2	1,244
ワールドホールディングス	0.4	0.3	762
ディー・エヌ・エー	5.3	6.2	11,494
博報堂ＤＹホールディングス	16.2	16	30,016
ぐるなび	1.7	1.8	1,639
エスアールジータカミヤ	1.3	1.4	870
ジャパンベストレスキューシステム	1.4	0.9	932
ファンコミュニケーションズ	3	3.2	1,859
ライク	0.4	0.4	628
ビジネス・ブレークスルー	0.5	0.6	236
ＷＤＢホールディングス	0.4	0.5	1,510
ティア	0.6	0.5	380
ＣＤＧ	0.1	0.1	154
バリューコマース	1	0.8	1,500
インフォマート	5.4	6.3	7,087
ＪＰホールディングス	3.4	3.6	1,011
エコナックホールディングス	2.2	2.5	277
ＥＰＳホールディングス	1.6	1.7	3,513
レッグス	0.3	0.3	306
プレステージ・インターナショナル	2.2	2.4	2,954
アミューズ	0.6	0.8	2,183
ドリームインキュベータ	0.4	0.4	715
クイック	0.6	0.7	1,190
ＴＡＣ	0.8	0.8	194

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ケネディクス	14.9	10.9	6,169
電通	13.1	14.1	74,166
テイクアンドギヴ・ニーズ	0.6	0.6	1,054
ぴあ	0.4	0.4	2,036
イオンファンタジー	0.3	0.4	1,362
シーティーエス	1.3	1.3	730
みらかホールディングス	3	3.4	8,993
アルプス技研	0.5	1	2,233
ダイオーズ	0.2	0.3	392
日本空調サービス	1.2	1.3	1,003
オリエンタルランド	12.7	13.6	137,904
ダスキン	2.9	3.1	7,821
明光ネットワークジャパン	1.4	1.5	1,408
ファルコホールディングス	0.6	0.6	996
秀英予備校	0.2	0.3	145
田谷	0.2	0.3	192
ラウンドワン	3.6	3.6	4,593
リゾートトラスト	4.5	4.9	8,011
ビー・エム・エル	1.5	1.5	4,575
ワタベウェディング	0.2	0.2	125
りらいあコミュニケーションズ	1.9	1.9	2,293
リソー教育	2	2	2,212
早稲田アカデミー	0.2	0.2	362
ユー・エス・エス	14.2	14.1	27,875
東京個別指導学院	0.4	0.4	532
サイバーエージェント	7.1	7.1	33,654
楽天	54.9	53.8	39,801
クリーク・アンド・リバー社	0.5	0.7	695
テー・オー・ダブリュー	1	1.1	921
セントラルスポーツ	0.4	0.4	1,544
フルキャストホールディングス	1	1.2	2,389
エン・ジャパン	－	1	4,415
リソルホールディングス	0.1	0.1	415
テクノプロ・ホールディングス	1.9	2.2	12,320
アトラ	0.2	0.2	114
インターワークス	0.3	0.3	261
ＫｅｅＰｅｒ技研	0.4	0.4	413
ファーストロジック	0.1	0.2	176
三機サービス	0.1	0.2	386
Ｇｕｎｏｓｙ	－	0.7	2,016
デザインワン・ジャパン	0.2	0.2	102

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
イー・ガーディアン	0.6	0.6	1,354
リブセンス	0.7	0.7	226
ジャパンマテリアル	0.9	3.2	3,977
ベクトル	1	1.4	2,630
ウチヤマホールディングス	0.6	0.6	289
ライクキッズネクスト	0.1	0.3	330
キャリアリンク	0.3	0.4	160
ＩＢＪ	0.8	0.8	494
アサンテ	0.5	0.5	1,098
Ｎ・フィールド	0.6	0.8	1,299
バリューＨＲ	0.1	0.3	634
Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	0.2	0.3	1,551
ライドオンエクスプレスホールディングス	0.3	0.5	632
ＥＲＩホールディングス	0.3	0.3	281
アビスト	0.2	0.2	699
シグマクシス	－	0.6	580
ウィルグループ	0.5	0.6	552
エスクロー・エージェント・ジャパン	0.3	1.6	742
日本ビューホテル	0.3	0.4	523
リクルートホールディングス	76.7	89	253,338
エラン	0.2	0.4	1,072
土木管理総合試験所	0.3	0.5	287
日本郵政	62.4	65.5	86,198
ベルシステム２４ホールディングス	1.8	1.9	2,857
鎌倉新書	0.1	0.9	1,006
一蔵	0.1	0.1	76
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	0.1	0.3	598
グローバルグループ	－	0.1	135
エボラブルアジア	0.2	0.3	634
アトラエ	－	0.2	358
ストライク	0.1	0.3	925
ソラスト	0.8	2.2	2,600
セラク	－	0.3	237
インソース	0.1	0.4	838
アイモバイル	－	0.3	201
キャリアインデックス	－	0.4	579
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	－	0.5	788
船場	－	0.2	203
グレイステクノロジー	－	0.3	789
フルテック	－	0.1	106
グリーンズ	－	0.3	396

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ツナグ・ソリューションズ	－	0.1	75
日総工産	－	0.4	951
キュービーネットホールディングス	－	0.6	1,248
スプリックス	－	0.3	773
アドバンテッジリスクマネジメント	－	0.4	388
リログループ	5.8	6.3	16,619
東祥	0.6	0.7	3,090
エイチ・アイ・エス	1.7	2.1	7,108
ラックランド	0.2	0.2	558
共立メンテナンス	1.9	2.1	9,880
イチネンホールディングス	1.2	1.3	1,632
建設技術研究所	0.8	0.8	1,181
スペース	0.6	0.8	992
長大	－	0.5	410
燦ホールディングス	0.2	0.3	763
スバル興業	0.1	0.1	505
東京テアトル	0.5	0.5	651
タナベ経営	0.2	0.2	343
ナガワ	0.2	0.2	978
よみうりランド	0.2	0.3	1,206
東京都競馬	0.8	0.8	3,032
常磐興産	0.5	0.5	865
カナモト	1.6	1.6	5,968
東京ドーム	4.7	4.7	4,530
西尾レントオール	0.9	1.2	4,176
トランス・コスモス	1.3	1.3	3,252
乃村工藝社	2.5	2.7	6,690
藤田観光	0.4	0.5	1,497
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	0.7	0.7	816
日本管財	1	1.2	2,415
トーカイ	0.5	1.1	2,421
白洋舎	0.1	0.1	292
セコム	12.2	12.2	109,348
セントラル警備保障	0.5	0.6	2,955
丹青社	2	2.4	2,568
メイテック	1.4	1.4	6,482
アサツー　ディ・ケイ	2	－	－
応用地質	1.2	1.2	1,554
船井総研ホールディングス	1.5	2.4	5,356
進学会ホールディングス	0.5	0.5	294
オオバ	1	1	649

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
いであ	0.2	0.2	214
学究社	0.3	0.4	664
ベネッセホールディングス	3.9	4.2	12,495
イオンディライト	1.3	1.4	5,159
ナック	0.7	0.8	790
ニチイ学館	2	2.2	2,043
ダイセキ	2	1.9	4,751
ステップ	0.4	0.4	603
合計 株数・金額	13,790	13,911	27,555,913
合計 銘柄数＜比率＞	1,990	2,063	＜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
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ先物	304	－

○投資信託財産の構成

（2018年10月26日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	27,555,913	98.2
コール・ローン等、その他	493,435	1.8
投資信託財産総額	28,049,348	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 (2018年10月26日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	28,597,473,904
コール・ローン等	204,309,310
株式(評価額)	27,555,913,710
未収配当金	255,425,884
差入委託証拠金	581,825,000
(B) 負債	731,950,392
未払金	183,396,970
未払解約金	428,164
未払利息	258
差入委託証拠金代用有価証券	548,125,000
(C) 純資産総額(A－B)	27,865,523,512
元本	19,319,878,842
次期繰越損益金	8,545,644,670
(D) 受益権総口数	19,319,878,842口
１万口当たり基準価額(C／D)	14,423円

(注) 当ファンドの期首元本額は18,714,990,799円、期中追加設定元本額は2,763,601,529円、期中一部解約元本額は2,158,713,486円です。

(注) 2018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）	4,374,639,542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	3,335,407,317円
・ＤＣインデックスバランス（株式80）	2,306,839,231円
・ＤＣインデックスバランス（株式60）	2,170,432,401円
・インデックスファンド日本株式（ＤＣ専用）	1,494,214,984円
・ＤＣインデックスバランス（株式40）	1,131,807,591円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	1,101,842,051円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	1,095,998,816円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	743,842,894円
・インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	685,436,046円
・ＤＣインデックスバランス（株式20）	391,285,298円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	259,173,263円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	69,780,983円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	60,878,867円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	50,736,936円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	41,072,726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	3,366,097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）	1,959,662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）	1,164,137円

(注) １口当たり純資産額は1.4423円です。

(注) 2018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	412,220千円

○損益の状況 (2017年10月27日～2018年10月26日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	627,224,111
受取配当金	626,652,786
受取利息	79
その他収益金	637,454
支払利息	△ 66,208
(B) 有価証券売買損益	△ 2,593,868,949
売買益	1,308,032,339
売買損	△ 3,901,901,288
(C) 先物取引等取引損益	△ 31,004,820
取引益	35,073,160
取引損	△ 66,077,980
(D) 保管費用等	△ 9,023
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	△ 1,997,658,681
(F) 前期繰越損益金	10,313,738,672
(G) 追加信託差損益金	1,521,119,305
(H) 解約差損益金	△ 1,291,554,626
(I) 計(E＋F＋G＋H)	8,545,644,670
次期繰越損益金(Ｉ)	8,545,644,670

(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し処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2017年10月27日から2018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19期（決算日　2018年10月26日）
（2017年10月27日～2018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。

投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的のため、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	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
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
18期(2017年10月26日)	23,670	33.0	163.01	30.0	96.4	1.0	2.5	82,557
19期(2018年10月26日)	23,897	1.0	161.04	△ 1.2	95.9	1.7	2.4	90,718

(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なわずに円換算したものです。なお、設定時を100として2018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	投資信託証券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率			
（期首）	円	%		%	%	%	%
2017年10月26日	23,670	－	163.01	－	96.4	1.0	2.5
10月末	23,700	0.1	163.17	0.1	96.2	1.2	2.5
11月末	23,864	0.8	164.02	0.6	96.0	1.5	2.5
12月末	24,610	4.0	168.86	3.6	96.5	1.0	2.5
2018年１月末	24,889	5.1	170.65	4.7	96.3	1.4	2.3
２月末	23,769	0.4	162.68	△0.2	95.7	2.0	2.3
３月末	22,761	△ 3.8	155.43	△4.6	95.6	2.0	2.4
４月末	23,782	0.5	162.08	△0.6	95.5	2.3	2.3
５月末	23,899	1.0	162.08	△0.6	94.9	2.7	2.3
６月末	24,092	1.8	163.28	0.2	95.8	2.7	2.4
７月末	25,045	5.8	169.61	4.1	96.7	1.1	2.4
８月末	25,591	8.1	172.82	6.0	96.1	1.4	2.4
９月末	26,237	10.8	177.07	8.6	96.0	1.8	2.3
（期末） 2018年10月26日	23,897	1.0	161.04	△1.2	95.9	1.7	2.4

(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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

基準価額の推移

期間の初め23,670円の基準価額は、期間末に23,897円となり、騰落率は＋1.0%となりました。

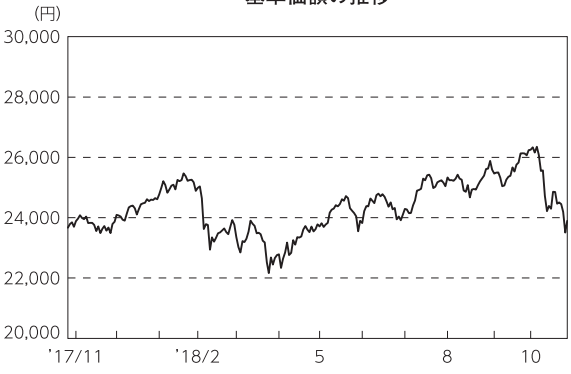
基準価額の変動要因

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＞
・米国や欧州の主要企業の決算が市場予想を上回ったこと。
・米国において法人税の減税実施による景気の押し上げ期待が高まったこと。
・米国が発動した中国製品に対する追加関税が景気に配慮した税率にとどまったこと。

＜値下がり要因＞
・米国と中国の間の貿易摩擦の激化が懸念されたこと。
・堅調な景気拡大のなか、欧米主要国の長期金利が上昇したこと。
・円高／アメリカドル安、円高／ユーロ安が進行したこと。

基準価額の推移



期　首	期中高値	期中安値	期　末
2017/10/26	2018/10/04	2018/03/26	2018/10/26
23,670円	26,353円	22,162円	23,897円

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、米国と欧州各国の株価は総じて下落しました。

期間の初めから2018年１月中旬にかけては、市場予想を上回る米国の主要経済指標の発表や、法人税率引き下げの実現の可能性が高まったことにより米国経済への楽観的な見方が広がったこと、英国と欧州連合（ＥＵ）が離脱交渉の前進に向けて合意したことなどから、米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。

１月下旬から３月下旬にかけては、インフレ上昇の兆しが見られるなか、発表された米国の経済指標が堅調な景気拡大を示す内容であったことなどを背景に、欧米主要国の長期金利が上昇したことや、米国の保護主義的な貿易政策に対する警戒感や投資家のリスク回避姿勢が強まったことを受けて、米国と欧州各国の株価は総じて下落しました。

４月上旬から６月下旬にかけては、米国連邦公開市場委員会（ＦＯＭＣ）議事要旨を受けて追加利上げペースの加速懸念が後退したことや、発表された米国と欧州企業の決算が市場予想を上回ったことなどが株価の上昇要因となったものの、イタリアやスペインの政局不安が高まったことや米朝首脳会談の中止の発表などから地政学的リスクが意識されたこと、米国と中国の貿易摩擦が激化し世界経済や企業業績に悪影響を及ぼすとの懸念が高まったことなどが株価の下落要因となり、米国と欧州各国の株価はまちまちの動きとなりました。

７月上旬から９月下旬にかけては、米国大統領が自動車関税をゼロとするとのＥＵの提案を拒否したことなどは株価の下落要因となったものの、米国が発動した中国製品に対する追加関税が景気に配慮した税率にとどまったとの見方から両国の対立激化への懸念が後退したことなどを背景に、米国と欧州各国の株価は概して上昇しました。

10月上旬から期間末にかけては、米国の良好な内容の経済指標による米国長期金利の急激な上昇を警戒して、米国と欧州各国の株価は総じて下落しました。

（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。

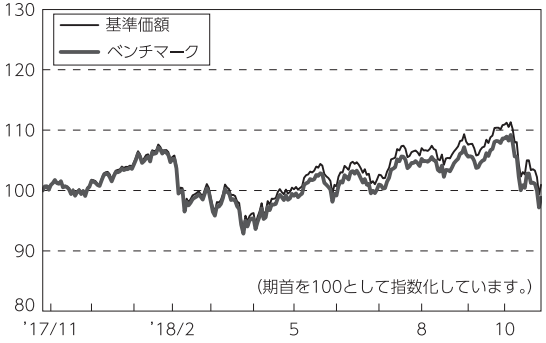
なお、外貨建資産は、為替ヘッジを行なわず、高水準の外貨エクスポージャーを維持しました。

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、1.0%の値上がりとなり、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1.2%を概ね2.2%上回りました。

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。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



＜プラス要因＞
・現物株式および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なわず、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。

○１万口当たりの費用明細

（2017年10月27日～2018年10月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	1	0.003	(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)	(0.002)	
（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	2	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）	(2)	(0.007)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	7	0.030	(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）	(6)	(0.025)	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）	(1)	(0.006)	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	10	0.040	
期中の平均基準価額は、24,353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

（2017年10月27日～2018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 8,789 (434)	千アメリカドル 67,885 (411)	百株 3,475 (130)	千アメリカドル 16,505 (735)
	カナダ	 1,302 (175)	千カナダドル 5,069 (831)	 432 (206)	千カナダドル 933 (831)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	759 (186)	3,961 (123)	103 (208)	1,237 (157)
	イタリア	1,268 (447)	985 (3)	373 (397)	119 (4)
	フランス	792 (0.5)	3,811 (△ 24)	115 (－)	490 (43)
	オランダ	586 (△ 219)	1,348 (△ 404)	233	380
	スペイン	1,540 (6,741)	1,108 (47)	6,833 (3,603)	594 (74)
	ベルギー	49	326	6	43
	オーストリア	9 (－)	44 (△ 7)	5	25
	ルクセンブルク	46	133	－	－
	フィンランド	215 (58)	314 (－)	29	51
	アイルランド	282	437	3	29
	ポルトガル	29	42	13	19
	イギリス	－ (219)	－ (404)	49 (219)	157 (404)
	スイス	23	47	－	－
	イギリス	9,106 (55,369)	千イギリスポンド 5,281 (343)	3,683 (38,875)	千イギリスポンド 1,585 (263)
	スイス	526 (41)	千スイスフラン 3,244 (210)	65 (15)	千スイスフラン 415 (319)
	スウェーデン	559 (554)	千スウェーデンクローナ 8,122 (2,205)	514 (－)	千スウェーデンクローナ 2,797 (2,205)
	ノルウェー	197 (－)	千ノルウェークローネ 2,486 (△ 26)	16	千ノルウェークローネ 369

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
		百株	千デンマーククローネ	百株	千デンマーククローネ
外国	デンマーク	166	4,984	214	2,050
			千オーストラリアドル		千オーストラリアドル
	オーストラリア	1,874	3,182	415	406
		(182)	(159)	(138)	(40)
			千ニュージーランドドル		千ニュージーランドドル
	ニュージーランド	257	305	288	126
		(68)	(27)	(34)	(10)
			千香港ドル		千香港ドル
	香港	3,699	11,186	1,357	1,609
		(444)	(1,126)	(－)	(1,126)
			千シンガポールドル		千シンガポールドル
	シンガポール	1,420	734	29	23
				(600)	(197)
			千イスラエルシュケル		千イスラエルシュケル
	イスラエル	100	330	－	－
		(2)	(16)	(8)	(226)

(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 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC	930	114	－	－
	PROLOGIS INC	3,000	197	－	－
	AMERICAN TOWER CORP	1,420	204	－	－
	AGNC INVESTMENT CORP	3,200	59	－	－
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	7,620	79	－	－
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	550	94	290	45
	BOSTON PROPERTIES INC	340	43	－	－
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	－	－	6,100	96
	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	－ (15,258)	－ (312)	8,700	170
	COLONY CAPITAL INC-A	－	－	10,000	58
	CROWN CASTLE INTL CORP	1,390	150	－	－
	DIGITAL REALTY TRUST INC	470	56	－	－
	DUKE REALTY CORPORATION	1,970	56	－	－
	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	640	43	－	－
	EQUINIX INC	210	87	100	43
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	150	33	150	33
	EXTRA SPACE STORAGE INC	570	57	－	－
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	460	57	－	－
	GGP INC	3,660	74	730 (15,475)	15 (317)
	HCP INC	1,620	43	－	－
	WELLTOWER INC	980	62	－	－
	HOST HOTELS & RESORTS INC	1,720	36	－	－
	INVITATION HOMES INC	6,200	144	－	－
	IRON MOUNTAIN INC	1,410	44	－	－
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	400	41	－	－
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,060	47	－	－
	PUBLIC STORAGE	440	88	－	－
	REALTY INCOME CORP	1,260	69	－	－
	SBA COMMUNICATIONS CORP	270	42	190	30
	SIMON PROPERTY GROUP INC	680	112	－	－
	VENTAS INC	730	43	－	－
	VORNADO REALTY TRUST	530	40	－	－
	WEYERHAEUSER CO	1,150	39	－	－
	小計	45,030 (15,258)	2,267 (312)	26,260 (15,475)	495 (317)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	1,690	49	－	－
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	1,660 (△ 2,340)	32 (△ 50)	－ (－)	－ (0)
	H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS(N)	－ (2,340)	－ (50)	－	－
	小計	3,350	81	－ (－)	－ (0)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	COVIVIO	400	35	－	－

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	ユーロ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
	フランス				
	UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	700 (△ 2,770)	135 (△ 561)	－	－
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	360	66	－	－
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD(N)	－ (2,770)	－ (561)	－	－
	小計	1,460	238	－	－
	ユーロ計	1,460	238	－	－
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND COMPANY PLC	2,930	18	4,430	28
	INTU PROPERTIES PLC	－	－	19,860	39
	SEGRO PLC	3,200	18	－	－
	小計	6,130	37	24,290	67
	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
	APA GROUP	3,980	38	－ (－)	－ (0.338)
	APA GROUP(N)	－ (1,252)	－ (9)	－	－
	APA GROUP-RIGHTS SHARE-RTS	－	－	－ (1,252)	－ (0.338)
	APA GROUP-RTS(N)	－ (1,252)	－ (0.338)	－	－
	DEXUS	5,380	49	2,620	24
	GOODMAN GROUP	6,700	54	8,360	67
	GPT GROUP	4,280	20	－	－
	MIRVAC GROUP	－	－	7,990	16
	SCENTRE GROUP	15,060	65	9,120	34
	STOCKLAND	－	－	4,810	19
	WESTFIELD CORP	－	－	41,745	367
	小計	35,400 (2,504)	229 (10)	74,645 (1,252)	530 (0.677)
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	8,500	606	5,000	326
	小計	8,500	606	5,000	326
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	－ (－)	－ (△0.852)	－	－
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	8,300	14	－	－
	SUNTEC REIT	9,600 (－)	19 (△0.643)	－	－
	小計	17,900 (－)	33 (△ 1)	－	－

(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
		口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
外国	アメリカ	1,300	27	－	－
		(　－)	(△ 3)		

(注) 金額は受け渡し代金。
(注) (　)内は分割、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
		百万円	百万円	百万円	百万円
外国	株式先物取引	12,589	11,939	－	－

(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

(2017年10月27日～2018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	14,229,222千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	82,405,206千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.17

(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10月27日～2018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。

○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10月27日～2018年10月26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

（2018年10月26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	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	121	134	2,487	279,755	資本財
ABBVIE INC	324	343	2,809	315,990	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABBOTT LABORATORIES	353	397	2,690	302,652	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	126	145	2,286	257,107	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	95	105	1,307	147,101	保険
ACUITY BRANDS INC	9	8	106	11,940	資本財
ADVANCE AUTO PARTS INC	15	17	285	32,078	小売
AES CORP	137	137	201	22,712	公益事業
AETNA INC	68	74	1,458	164,044	ヘルスケア機器・サービス
AERCAP HOLDINGS NV	26	26	132	14,850	資本財
AFLAC INC	78	173	730	82,204	保険
AFFILIATED MANAGERS GROUP	11	13	157	17,707	各種金融
AGCO CORP	12	12	63	7,113	資本財
AGILENT TECHNOLOGIES INC	66	71	447	50,278	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	50	765	86,121	素材
ALLEGHANY CORP	3	3	192	21,642	保険
ALLSTATE CORP	77	79	741	83,365	保険
ALTRIA GROUP INC	391	428	2,705	304,304	食品・飲料・タバコ
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	10	12	257	28,947	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	42	47	206	23,200	公益事業
ALBEMARLE CORP	23	23	221	24,895	素材
ALLEGION PLC	17	20	172	19,402	資本財
ALLY FINANCIAL INC	91	91	228	25,653	各種金融
AMPHENOL CORP-CL A	64	67	580	65,326	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERIPRISE FINANCIAL INC	30	33	420	47,261	各種金融
AMEREN CORPORATION	46	55	364	41,019	公益事業
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	189	204	864	97,259	保険
AMERICAN EXPRESS CO	154	164	1,704	191,720	各種金融
AMETEK INC	45	53	352	39,695	資本財
AMERICAN ELECTRIC POWER	97	107	788	88,649	公益事業
AMERICAN WATER WORKS CO INC	34	39	353	39,800	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	32	37	318	35,806	ヘルスケア機器・サービス
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	14	19	195	22,000	保険
ANADARKO PETROLEUM CORP	112	118	709	79,761	エネルギー
ANTERO RESOURCES CORP	36	45	74	8,364	エネルギー
AON PLC	53	56	840	94,580	保険
APACHE CORP	79	87	332	37,346	エネルギー
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	113	125	598	67,357	食品・飲料・タバコ
ARROW ELECTRONICS INC	19	19	126	14,228	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ARTHUR J GALLAGHER & CO	33	45	328	36,931	保険
ARAMARK	49	59	209	23,553	消費者サービス
ARCONIC INC	79	87	175	19,707	資本財
ARISTA NETWORKS INC	8	11	260	29,318	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ASSURANT INC	12	11	106	12,013	保険
AT&T INC	1,252	1,638	4,910	552,332	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	19	25	242	27,318	公益事業
ATHENE HOLDING LTD-CLASS-A	22	37	170	19,138	保険
AUTOLIV INC	17	17	141	15,929	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	5	6	460	51,767	小売
AUTONATION INC	16	—	—	—	小売
AVERY DENNISON CORP	18	22	202	22,722	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
AVNET INC	26	—	—	—	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	14	22	126	14,243	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	41	58	145	16,356	素材
BALL CORP	68	82	356	40,098	素材
BANK OF AMERICA CORP	2,020	2,174	5,782	650,387	銀行
BAXTER INTERNATIONAL INC	103	119	809	91,017	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	208	227	1,050	118,094	各種金融
BAKER HUGHES A GE CO	81	93	257	28,955	エネルギー
BB&T CORP	158	177	834	93,837	銀行
BECTON DICKINSON AND CO	52	60	1,406	158,191	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	55	55	384	43,285	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	253	287	5,812	653,786	各種金融
BLACKROCK INC	24	26	1,042	117,262	各種金融
H&R BLOCK INC	45	45	116	13,137	消費者サービス
BORGWARNER INC	43	43	163	18,369	自動車・自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	287	318	1,160	130,551	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	116	125	4,547	511,496	資本財
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	334	368	1,814	204,068	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	24	27	318	35,807	ソフトウェア・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	42	59	280	31,516	食品・飲料・タバコ
BUNGE LTD	28	28	188	21,246	食品・飲料・タバコ
CARMAX INC	39	42	303	34,159	小売
CARDINAL HEALTH INC	65	74	379	42,687	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	119	135	1,570	176,684	資本財
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	97	110	974	109,651	各種金融
CARNIVAL CORP	72	93	524	59,026	消費者サービス
CABOT OIL & GAS CORP	97	97	208	23,418	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	34	34	132	14,874	食品・飲料・タバコ
CBRE GROUP INC - A	59	75	297	33,405	不動産
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	74	79	436	49,063	メディア・娯楽
CENTENE CORP	35	44	583	65,641	ヘルスケア機器・サービス
CELANESE CORP	29	32	315	35,457	素材
CENTERPOINT ENERGY INC	81	117	325	36,553	公益事業
CENTURYLINK INC	196	212	448	50,466	電気通信サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	48	55	248	27,913	素材
CHURCH & DWIGHT CO INC	54	52	308	34,669	家庭用品・パーソナル用品
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4	5	235	26,458	消費者サービス
CHEVRON CORP	384	431	4,812	541,268	エネルギー
CHEMOURS CO/THE	—	36	119	13,474	素材
CIT GROUP INC	26	26	119	13,398	銀行
CIGNA CORP	52	56	1,178	132,497	ヘルスケア機器・サービス
CITIGROUP INC	558	575	3,737	420,359	銀行
CIMAREX ENERGY CO	20	20	166	18,678	エネルギー
CITIZENS FINANCIAL GROUP	105	105	380	42,747	銀行
CLOROX COMPANY	27	30	455	51,250	家庭用品・パーソナル用品
CMS ENERGY CORP	53	66	339	38,128	公益事業
CONCHO RESOURCES INC	30	44	601	67,700	エネルギー
COLGATE-PALMOLIVE CO	171	184	1,179	132,646	家庭用品・パーソナル用品
CONOCOPHILLIPS	252	265	1,806	203,189	エネルギー
TAPESTRY INC	56	67	280	31,548	耐久消費財・アパレル
COMERICA INC	33	39	314	35,411	銀行
CONAGRA BRANDS INC	89	108	393	44,218	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA CO/THE	825	912	4,242	477,128	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	63	69	536	60,350	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	34	37	799	89,898	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	183	183	578	65,041	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	19	19	106	11,936	エネルギー
CORE LABORATORIES N.V.	7	—	—	—	エネルギー

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	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	－	51	223	25,115	食品・飲料・タバコ
COTY INC-CL A	100	100	103	11,663	家庭用品・パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	28	28	117	13,224	素材
CSX CORP	187	189	1,255	141,221	運輸
CUMMINS INC	31	35	449	50,604	資本財
CVS HEALTH CORP	207	230	1,632	183,580	ヘルスケア機器・サービス
DAVITA INC	34	29	194	21,884	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	25	29	313	35,228	消費者サービス
DANAHER CORP	127	142	1,405	158,070	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	99	112	369	41,568	エネルギー
DEERE & CO	57	68	938	105,531	資本財
DELTA AIR LINES INC	39	36	194	21,837	運輸
APTIV PLC	54	59	437	49,190	自動車・自動車部品
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	43	43	392	44,141	ソフトウェア・サービス
DICK'S SPORTING GOODS INC	17	－	－	－	小売
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	76	80	587	66,045	各種金融
DOMINO'S PIZZA INC	10	9	246	27,674	消費者サービス
DOMINION RESOURCES INC/VA	126	146	1,068	120,220	公益事業
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	54	59	661	74,432	小売
DOVER CORP	31	38	311	35,017	資本財
DOWDUPONT INC	474	524	2,773	311,921	素材
KEURIG DR PEPPER INC	37	－	－	－	食品・飲料・タバコ
DR HORTON INC	79	85	306	34,437	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	36	40	468	52,638	公益事業
DUKE ENERGY CORP	142	157	1,316	148,122	公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	59	65	495	55,712	ソフトウェア・サービス
EATON VANCE CORP	22	32	139	15,673	各種金融
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	30	30	234	26,337	素材
EATON CORP PLC	90	96	699	78,653	資本財
ECOLAB INC	54	57	857	96,394	素材
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	44	46	670	75,453	ヘルスケア機器・サービス
EDISON INTERNATIONAL	65	71	498	56,083	公益事業
EMERSON ELECTRIC CO	129	144	968	108,899	資本財
ENTERGY CORP	38	38	321	36,128	公益事業
ENVISION HEALTHCARE CORP	23	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
EOG RESOURCES INC	118	131	1,408	158,452	エネルギー
EQUIFAX INC	24	27	271	30,561	商業・専門サービス
EQT CORP	34	57	203	22,914	エネルギー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	44	49	620	69,807	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	8	8	181	20,401	保険
EVERGY INC	－	61	351	39,508	公益事業
EXXON MOBIL CORP	861	956	7,491	842,624	エネルギー
EXELON CORP	190	208	916	103,055	公益事業
FEDEX CORP	51	57	1,235	138,925	運輸
FIRST REPUBLIC BANK/CA	30	34	301	33,960	銀行
FIRSTENERGY CORP	89	107	407	45,832	公益事業
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	64	72	749	84,326	ソフトウェア・サービス
FIRST DATA CORP- CLASS-A	61	121	268	30,154	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	19	20	399	44,959	ソフトウェア・サービス
FLOWSERVE CORP	25	32	148	16,726	資本財
FLUOR CORP	29	29	126	14,238	資本財
TECHNIPFMC PLC	93	93	252	28,417	エネルギー
FMC CORP	27	27	212	23,860	素材
FNF GROUP	52	66	214	24,099	保険
FORD MOTOR COMPANY	762	847	762	85,706	自動車・自動車部品
FOOT LOCKER INC	28	－	－	－	小売
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	31	31	147	16,622	資本財
FORTIVE CORP	63	69	528	59,441	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NEXTERA ENERGY INC	95	105	1,833	206,193	公益事業
FRANKLIN RESOURCES INC	66	79	232	26,184	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	257	316	356	40,043	素材
GAP INC/THE	51	51	135	15,287	小売
GENERAL MOTORS CORP	275	292	934	105,145	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	28	34	344	38,706	小売
GENERAL ELECTRIC CO	1,762	1,970	2,324	261,465	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	51	57	981	110,365	資本財
GENERAL MILLS INC	114	139	621	69,866	食品・飲料・タバコ
GLOBAL PAYMENTS INC	32	36	413	46,471	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	72	80	1,733	194,916	各種金融
GODADDY INC-CLASS A	—	35	259	29,148	ソフトウェア・サービス
WW GRAINGER INC	10	11	300	33,769	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	69	85	388	43,699	保険
HALLIBURTON CO	180	197	687	77,311	エネルギー
HANESBRANDS INC	79	79	133	15,056	耐久消費財・アパレル
HARRIS CORP	25	27	436	49,080	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	37	37	138	15,563	自動車・自動車部品
HCA HEALTHCARE INC	64	62	792	89,100	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	30	30	310	34,872	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	60	66	392	44,120	エネルギー
HELMERICH & PAYNE	21	26	166	18,778	エネルギー
HP INC	340	363	864	97,193	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	329	355	539	60,634	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	37	63	428	48,167	消費者サービス
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	147	168	2,485	279,591	資本財
HOME DEPOT INC	243	260	4,671	525,452	小売
HORMEL FOODS CORP	59	69	288	32,462	食品・飲料・タバコ
HOLLYFRONTIER CORP	37	37	236	26,563	エネルギー
HUMANA INC	29	31	1,021	114,833	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	9	9	210	23,650	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	182	208	2,635	296,411	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP	14	19	242	27,251	資本財
ILLINOIS TOOL WORKS	63	70	863	97,136	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	16	16	232	26,150	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	68	78	182	20,561	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	119	126	934	105,120	各種金融
INVESCO LTD	84	106	228	25,745	各種金融
INTERNATIONAL PAPER CO	81	90	393	44,295	素材
INGERSOLL-RAND PLC	53	55	532	59,903	資本財
INGREDION INC	14	18	183	20,619	食品・飲料・タバコ
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	24	30	230	25,891	資本財
JM SMUCKER CO/THE	22	27	289	32,589	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	548	605	8,385	943,160	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	11	151	17,006	不動産
JPMORGAN CHASE & CO	721	769	8,063	906,928	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	70	79	227	25,544	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	21	21	223	25,192	運輸
KEYCORP	226	246	421	47,456	銀行
KELLOGG CO	54	61	436	49,100	食品・飲料・タバコ
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	—	41	248	27,915	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KIMBERLY-CLARK CORP	72	77	811	91,300	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	407	436	724	81,452	エネルギー
KOHLS CORP	38	37	280	31,530	小売
KROGER CO	190	192	538	60,589	食品・生活必需品小売り
L3 TECHNOLOGIES INC	16	18	386	43,467	資本財
LAS VEGAS SANDS CORP	81	86	471	53,031	消費者サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	21	25	397	44,659	ヘルスケア機器・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
LEGGETT & PLATT INC	27	27	107	12,035	耐久消費財・アパレル
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	73	64	130	14,631	各種金融
LENNAR CORP-CL A	39	69	279	31,460	耐久消費財・アパレル
LENNOX INTERNATIONAL INC	7	7	157	17,765	資本財
LEAR CORP	13	16	221	24,920	自動車・自動車部品
ELI LILLY & CO	201	220	2,374	267,114	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	－	34	173	19,558	メディア・娯楽
LINCOLN NATIONAL CORP	45	55	328	36,961	保険
L BRANDS INC	53	48	148	16,719	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	53	57	1,774	199,569	資本財
LOWE'S COS INC	172	186	1,825	205,368	小売
LOEWS CORP	61	57	264	29,766	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	67	73	654	73,637	素材
M & T BANK CORP	28	31	499	56,157	銀行
MARATHON OIL CORP	178	202	381	42,872	エネルギー
MASTERCARD INC	193	209	4,271	480,456	ソフトウェア・サービス
MACQUARIE INFRASTRUCTURE COR	15	－	－	－	運輸
MACY'S INC	64	64	214	24,075	小売
MANPOWERGROUP INC	14	14	108	12,158	商業・専門サービス
MARSH & MCLENNAN COS	108	115	947	106,551	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	12	14	235	26,510	素材
MASCO CORP	67	64	194	21,841	資本財
MARKEL CORP	2	3	344	38,773	保険
MARATHON PETROLEUM CORP	108	157	1,099	123,707	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	24	－	－	－	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	28	391	44,062	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	166	178	3,124	351,378	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	54	55	990	111,427	各種金融
MCKESSON CORP	43	47	579	65,225	ヘルスケア機器・サービス
MEDNAX INC	18	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	185	195	797	89,667	保険
MERCK & CO. INC.	556	607	4,246	477,635	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDTRONIC PLC	279	307	2,817	316,914	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	5	6	324	36,498	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM RESORTS INTERNATIONAL	97	115	292	32,922	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	35	34	198	22,334	耐久消費財・アパレル
MICRON TECHNOLOGY INC	218	264	973	109,443	半導体・半導体製造装置
MOLSON COORS BREWING CO -B	38	44	252	28,379	食品・飲料・タバコ
MOHAWK INDUSTRIES INC	13	16	245	27,661	耐久消費財・アパレル
MOSAIC CO/THE	68	84	254	28,646	素材
MORGAN STANLEY	283	300	1,339	150,641	各種金融
MONSANTO CO	88	－	－	－	素材
MOODY'S CORP	36	37	588	66,222	各種金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	36	38	468	52,731	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	20	20	298	33,592	各種金融
MURPHY OIL CORP	37	－	－	－	エネルギー
NATIONAL OILWELL VARCO INC	75	86	320	36,093	エネルギー
NEWFIELD EXPLORATION CO	40	40	83	9,387	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	105	110	327	36,786	素材
NEWELL BRANDS INC	91	100	164	18,493	耐久消費財・アパレル
NIKE INC -CL B	268	291	2,129	239,559	耐久消費財・アパレル
NISOURCE INC	65	85	220	24,808	公益事業
NIELSEN HOLDINGS PLC	74	74	185	20,812	商業・専門サービス
NORDSTROM INC	28	25	156	17,568	小売
NORTHROP GRUMMAN CORP	33	37	1,016	114,292	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	58	65	1,067	120,068	運輸
NOBLE ENERGY INC	94	106	283	31,939	エネルギー
EVERSOURCE ENERGY	63	72	463	52,131	公益事業

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	
NUCOR CORP	65	69	399	44,916	素材
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	96	134	122	13,804	銀行
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	158	174	1,195	134,508	エネルギー
OGE ENERGY CORP	38	49	185	20,830	公益事業
OMNICOM GROUP	45	52	377	42,424	メディア・娯楽
ONEOK INC	76	95	617	69,469	エネルギー
ORACLE CORP	630	694	3,328	374,364	ソフトウェア・サービス
OWENS CORNING	—	29	133	15,053	資本財
P G & E CORP	101	114	541	60,900	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	27	30	441	49,663	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	19	24	221	24,930	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	19	20	390	43,950	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	44	61	151	17,084	エネルギー
PEPSICO INC	290	320	3,616	406,798	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	34	34	135	15,280	資本財
PERRIGO CO PLC	25	30	209	23,557	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	1,213	1,320	5,731	644,613	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PVH CORP	17	16	193	21,720	耐久消費財・アパレル
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	316	352	3,194	359,288	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	90	101	995	111,934	エネルギー
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	34	37	576	64,786	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	21	28	240	27,060	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	97	105	1,262	141,947	銀行
RALPH LAUREN CORP	11	11	148	16,645	耐久消費財・アパレル
POLARIS INDUSTRIES INC	12	12	107	12,059	耐久消費財・アパレル
PPL CORP	137	157	480	54,005	公益事業
PPG INDUSTRIES INC	50	57	600	67,582	素材
PROCTER & GAMBLE CO	520	569	5,068	570,049	家庭用品・パーソナル用品
PRAXAIR INC	59	125	2,075	233,453	素材
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	60	71	351	39,582	保険
PROGRESSIVE CORP	123	130	896	100,827	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	89	98	909	102,236	保険
PULTE GROUP INC	56	56	131	14,743	耐久消費財・アパレル
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	101	111	621	69,899	公益事業
QUEST DIAGNOSTICS	31	28	264	29,723	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	27	35	423	47,650	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANGE RESOURCES CORP	40	—	—	—	エネルギー
RAYTHEON COMPANY	58	64	1,145	128,887	資本財
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	25	30	231	26,004	各種金融
REGIONS FINANCIAL CORP	231	258	415	46,681	銀行
RED HAT INC	36	38	468	52,728	ソフトウェア・サービス
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	8	8	112	12,699	保険
REPUBLIC SERVICES INC	51	55	380	42,747	商業・専門サービス
RESMED INC	29	32	319	35,893	ヘルスケア機器・サービス
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	13	16	221	24,895	保険
ROCKWELL AUTOMATION INC	26	29	468	52,660	資本財
ROBERT HALF INTL INC	23	30	183	20,653	商業・専門サービス
ROPER TECHNOLOGIES INC	21	22	599	67,444	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	35	40	432	48,657	消費者サービス
ROCKWELL COLLINS INC.	33	38	500	56,313	資本財
WESTROCK CO	53	60	251	28,267	素材
ROLLINS INC	16	20	113	12,763	商業・専門サービス
SALESFORCE.COM INC	137	159	2,241	252,105	ソフトウェア・サービス
LEIDOS HOLDINGS INC	26	36	225	25,338	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	281	311	1,661	186,919	エネルギー
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	16	—	—	—	メディア・娯楽
SCANA CORP	26	26	100	11,276	公益事業

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	
SCHWAB (CHARLES) CORP	246	272	1,178	132,503	各種金融
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	34	44	185	20,841	資本財
SEALED AIR CORP	39	39	123	13,836	素材
SEMPRA ENERGY	48	56	650	73,193	公益事業
SERVICENOW INC	34	40	700	78,827	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	17	18	683	76,859	素材
SIGNET JEWELERS LTD	15	—	—	—	小売
SMITH (A.O.) CORP	30	30	136	15,345	資本財
SNAP-ON INC	12	14	214	24,118	資本財
SOUTHWEST AIRLINES CO	34	37	188	21,162	運輸
SOUTHERN CO	198	228	1,036	116,570	公益事業
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	—	27	225	25,351	資本財
SPRINT CORP	173	173	105	11,864	電気通信サービス
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	5	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
SQUARE INC - A	—	66	487	54,882	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	31	34	398	44,774	資本財
STRYKER CORP	70	76	1,269	142,810	ヘルスケア機器・サービス
STATE STREET CORP	76	81	551	62,047	各種金融
SUNTRUST BANKS INC	95	105	637	71,680	銀行
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	27	27	91	10,327	運輸
SYSCO CORP	105	108	779	87,636	食品・生活必需品小売り
SYNCHRONY FINANCIAL	163	157	453	51,004	各種金融
TARGET CORP	106	111	938	105,503	小売
TARGA RESOURCES CORP	45	54	284	32,031	エネルギー
TD AMERITRADE HOLDING CORP	52	62	315	35,506	各種金融
ANDEAVOR	30	—	—	—	エネルギー
TEXTRON INC	54	61	328	36,950	資本財
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	196	220	447	50,297	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEFLEX INC	9	10	261	29,412	ヘルスケア機器・サービス
THE WALT DISNEY CO.	317	337	3,847	432,732	メディア・娯楽
COOPER COS INC/THE	10	10	260	29,306	ヘルスケア機器・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	79	90	2,088	234,921	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	26	26	280	31,494	小売
TIME WARNER INC	157	—	—	—	メディア・娯楽
TJX COMPANIES INC	131	142	1,512	170,124	小売
TOLL BROTHERS INC	37	33	100	11,347	耐久消費財・アパレル
TORCHMARK CORP	22	28	238	26,776	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	36	38	358	40,302	ソフトウェア・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	59	61	743	83,642	保険
TRANSDIGM GROUP INC	11	11	360	40,565	資本財
TRANSUNION	—	41	261	29,456	商業・専門サービス
TWITTER INC	122	156	497	56,008	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	57	68	419	47,214	食品・飲料・タバコ
TE CONNECTIVITY LTD	69	77	587	66,130	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	188	202	649	73,086	資本財
UGI CORP	35	40	220	24,799	公益事業
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	35	35	65	7,411	耐久消費財・アパレル
UNUM GROUP	47	47	167	18,783	保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	140	156	1,688	189,864	運輸
UNITED TECHNOLOGIES CORP	154	172	2,141	240,859	資本財
UNION PACIFIC CORP	163	175	2,532	284,789	運輸
UNITEDHEALTH GROUP INC	196	217	5,744	646,092	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	18	18	220	24,744	ヘルスケア機器・サービス
UNITED RENTALS INC	18	20	224	25,292	資本財
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	41	41	70	7,875	耐久消費財・アパレル
US BANCORP	341	351	1,800	202,519	銀行
VF CORP	71	74	588	66,244	耐久消費財・アパレル
WORLDPAY INC-CLASS A	32	65	610	68,646	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	
VALERO ENERGY CORP	91	98	859	96,625	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	19	19	218	24,571	ヘルスケア機器・サービス
VAIL RESORTS INC	7	8	202	22,730	消費者サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	832	931	5,254	590,920	電気通信サービス
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS-A	19	28	249	28,097	ヘルスケア機器・サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	376	403	5,671	637,892	ソフトウェア・サービス
VISTRA ENERGY CORP	—	79	176	19,828	公益事業
VMWARE INC	15	15	220	24,766	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	41	37	159	17,889	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	27	30	278	31,318	素材
WALMART INC	309	334	3,318	373,261	食品・生活必需品小売り
WATERS CORP	16	18	342	38,540	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	115	13,045	資本財
ALLERGAN PLC	68	77	1,389	156,235	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WASTE MANAGEMENT INC	91	95	811	91,259	商業・専門サービス
WABTEC CORP	18	18	171	19,256	資本財
WASTE CONNECTIONS INC	58	60	436	49,143	商業・専門サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	—	7	55	6,287	素材
WESTERN UNION CO	104	126	227	25,592	ソフトウェア・サービス
WELLS FARGO & CO	963	1,045	5,419	609,516	銀行
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	201	—	—	—	エネルギー
ANTHEM INC	54	58	1,573	176,917	ヘルスケア機器・サービス
WESTAR ENERGY INC	28	—	—	—	公益事業
WHIRLPOOL CORP	16	14	157	17,706	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	168	271	678	76,270	エネルギー
WEC ENERGY GROUP INC	63	71	507	57,083	公益事業
WORKDAY INC-CLASS A	25	33	415	46,705	ソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO	14	—	—	—	素材
WR BERKLEY CORP	20	20	152	17,195	保険
WYNDHAM DESTINATIONS INC	22	—	—	—	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	104	113	559	62,954	公益事業
XEROX CORP	49	49	136	15,406	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
XL GROUP LTD	57	—	—	—	保険
XPO LOGISTICS INC	—	27	245	27,599	運輸
XYLEM INC	35	41	278	31,337	資本財
YUM! BRANDS INC	68	73	636	71,598	消費者サービス
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	37	50	155	17,493	電気通信サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	41	45	549	61,849	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	97	110	996	112,028	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHENIERE ENERGY INC	40	48	289	32,610	エネルギー
NVR INC	0.7	0.7	151	17,039	耐久消費財・アパレル
ABIOMED INC	—	9	313	35,218	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	146	164	1,159	130,417	ソフトウェア・サービス
ADOBE INC	100	111	2,817	316,859	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	160	202	389	43,822	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	36	36	233	26,266	ソフトウェア・サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	45	51	602	67,729	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALKERMES PLC	32	32	134	15,090	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	18	140	15,774	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	14	16	389	43,849	ヘルスケア機器・サービス
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	28	22	73	8,264	運輸
AMAZON.COM INC	82	93	16,618	1,869,109	小売
AMGEN INC	149	150	2,823	317,566	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AMERCO	1	1	50	5,647	運輸
ANALOG DEVICES INC	76	86	684	76,934	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	18	18	267	30,055	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	1,059	1,110	24,418	2,746,294	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	218	226	739	83,159	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	27	103	274	30,914	保険
AUTOMATIC DATA PROCESSING	91	100	1,408	158,419	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	41	48	634	71,356	ソフトウェア・サービス
AVNET INC	－	26	100	11,336	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
BED BATH & BEYOND INC	30	－	－	－	小売
BIOGEN INC	43	47	1,430	160,895	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	35	38	374	42,080	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	81	93	2,071	232,956	半導体・半導体製造装置
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	17	28	115	12,961	保険
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	29	34	300	33,818	運輸
CA INC	67	71	313	35,302	ソフトウェア・サービス
CADENCE DESIGN SYS INC	61	67	313	35,219	ソフトウェア・サービス
CBOE GLOBAL MARKETS INC	18	－	－	－	各種金融
CDW CORP/DE	29	35	283	31,893	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CDK GLOBAL INC	27	34	199	22,416	ソフトウェア・サービス
CELGENE CORP	158	165	1,205	135,637	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CERNER CORP	62	67	421	47,451	ヘルスケア機器・サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	26	27	296	33,292	ソフトウェア・サービス
CHARTER COMMUNICATION-A	44	38	1,196	134,580	メディア・娯楽
CINTAS CORP	17	21	367	41,355	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	1,016	1,061	4,826	542,801	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	34	39	281	31,633	保険
CITRIX SYSTEMS INC	32	32	329	37,049	ソフトウェア・サービス
CME GROUP INC	68	76	1,357	152,694	各種金融
COMCAST CORP-CLASS A	962	1,041	3,733	419,917	メディア・娯楽
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	120	134	964	108,434	ソフトウェア・サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	88	99	2,254	253,588	食品・生活必需品小売り
COPART INC	－	48	236	26,570	商業・専門サービス
COMMSCOPE HOLDING CO INC	35	40	98	11,086	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COSTAR GROUP INC	6	8	309	34,863	商業・専門サービス
COGNEX CORP	－	39	166	18,708	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
DEXCOM INC	17	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
DENTSPLY SIRONA INC	48	48	170	19,203	ヘルスケア機器・サービス
DISCOVERY COMMUNICATIONS-A	33	33	102	11,553	メディア・娯楽
DISH NETWORK CORP-A	47	47	144	16,225	メディア・娯楽
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	46	64	182	20,576	メディア・娯楽
DIAMONDBACK ENERGY INC	19	22	252	28,395	エネルギー
DOLLAR TREE INC	48	53	445	50,103	小売
E*TRADE FINANCIAL CORP	58	60	286	32,232	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	26	30	155	17,464	銀行
EBAY INC	212	222	625	70,367	小売
PAYPAL HOLDINGS INC	232	255	2,200	247,469	ソフトウェア・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	62	70	696	78,368	ソフトウェア・サービス
EXPEDIA INC	25	29	342	38,505	小売
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	122	128	1,223	137,611	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	36	43	289	32,524	運輸
F5 NETWORKS INC	12	13	228	25,745	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	480	542	8,193	921,530	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	61	64	319	35,898	資本財
FISERV INC	45	91	723	81,327	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	155	162	419	47,161	銀行
FLIR SYSTEMS INC	26	33	185	20,893	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FLEX LTD	109	109	119	13,418	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FORTINET INC	31	31	251	28,276	ソフトウェア・サービス
GARMIN LTD	23	23	148	16,741	耐久消費財・アパレル
GARTNER INC	17	20	295	33,279	ソフトウェア・サービス
GILEAD SCIENCES INC	265	295	2,025	227,857	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	111	12,562	自動車・自動車部品

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	
ALPHABET INC-CL A	60	67	7,460	839,056	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	63	71	7,791	876,331	ソフトウェア・サービス
HASBRO INC	22	27	256	28,897	耐久消費財・アパレル
HD SUPPLY HOLDINGS INC	37	37	138	15,609	資本財
HENRY SCHEIN INC	33	33	271	30,559	ヘルスケア機器・サービス
HOLOGIC INC	57	57	222	25,024	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	16	18	195	21,984	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	217	247	335	37,783	銀行
IAC/INTERACTIVECORP	—	16	319	35,892	ソフトウェア・サービス
IDEXX LABORATORIES INC	18	20	436	49,072	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	30	33	992	111,660	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	49	54	1,126	126,727	ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	959	1,054	4,670	525,325	半導体・半導体製造装置
INTUITIVE SURGICAL INC	22	25	1,269	142,754	ヘルスケア機器・サービス
INCYTE CORP	35	37	237	26,753	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IPG PHOTONICS CORP	—	7	97	10,945	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	11	14	215	24,240	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	15	19	293	32,991	ソフトウェア・サービス
KLA-TENCOR CORPORATION	31	35	314	35,336	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	306	336	1,377	154,961	食品・飲料・タバコ
KRAFT HEINZ CO/THE	122	140	788	88,654	食品・飲料・タバコ
LAM RESEARCH CORP	32	38	547	61,521	半導体・半導体製造装置
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	123	123	289	32,509	メディア・娯楽
QURATE RETAIL INC	89	108	240	27,016	小売
LIBERTY GLOBAL PLC-A	44	39	95	10,725	メディア・娯楽
LIBERTY BROADBAND-C	21	27	218	24,563	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUSXM GROUP-A	19	19	78	8,862	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	32	35	142	16,065	メディア・娯楽
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	—	47	154	17,322	メディア・娯楽
LKQ CORP	63	76	202	22,736	小売
LULULEMON ATHLETICA INC	20	23	315	35,496	耐久消費財・アパレル
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	80	137	231	26,068	半導体・半導体製造装置
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	58	67	326	36,755	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	73	73	101	11,439	耐久消費財・アパレル
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	65	66	745	83,837	消費者サービス
IHS MARKIT LTD	75	90	461	51,872	商業・専門サービス
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	41	51	88	9,963	消費者サービス
T-MOBILE US INC	60	77	510	57,449	電気通信サービス
MERCADOLIBRE INC	8	9	294	33,135	小売
MICROSOFT CORP	1,492	1,650	17,872	2,010,074	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	46	56	354	39,820	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	11	11	130	14,694	資本財
MONSTER BEVERAGE CORP	82	91	480	54,097	食品・飲料・タバコ
MYLAN NV	95	109	340	38,242	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NASDAQ INC	25	28	236	26,558	各種金融
NAVIENT CORP	71	—	—	—	各種金融
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	204	233	1,056	118,870	メディア・娯楽
NETAPP INC	52	58	444	50,042	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	95	106	475	53,493	メディア・娯楽
NETFLIX INC	87	98	3,075	345,902	小売
NEWS CORP - CLASS A	75	75	97	10,948	メディア・娯楽
NEKTAR THERAPEUTICS	—	37	139	15,673	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORTHERN TRUST CORP	44	46	420	47,262	各種金融
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	32	49	223	25,087	消費者サービス
NUANCE COMMUNICATIONS INC	58	—	—	—	ソフトウェア・サービス
NVIDIA CORP	121	130	2,711	304,936	半導体・半導体製造装置
NXP SEMICONDUCTORS NV	60	78	579	65,171	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	17	18	611	68,806	小売

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	－	14	182	20,479	運輸
ON SEMICONDUCTOR CORP	－	87	133	15,061	半導体・半導体製造装置
PACCAR INC	70	78	435	49,026	資本財
PAYCHEX INC	65	73	479	53,900	ソフトウェア・サービス
PATTERSON COS INC	20	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	63	97	150	16,896	銀行
BOOKING HOLDINGS INC	9	10	1,972	221,830	小売
QORVO INC	26	26	189	21,314	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	300	316	2,002	225,198	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	16	18	619	69,727	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROSS STORES INC	77	83	806	90,661	小売
SABRE CORP	45	61	148	16,664	ソフトウェア・サービス
SEAGATE TECHNOLOGY	62	56	242	27,239	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SEI INVESTMENTS COMPANY	27	31	167	18,880	各種金融
SEATTLE GENETICS INC	20	22	148	16,757	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SIRIUS XM HOLDINGS INC	342	342	198	22,303	メディア・娯楽
SIGNATURE BANK	9	13	147	16,637	銀行
SKYWORKS SOLUTIONS INC	39	43	353	39,773	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	28	31	298	33,596	ソフトウェア・サービス
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	31	48	247	27,884	ソフトウェア・サービス
STEEL DYNAMICS INC	45	55	220	24,827	素材
STARBUCKS CORP	293	313	1,848	207,849	消費者サービス
STERICYCLE INC	17	17	84	9,496	商業・専門サービス
SVB FINANCIAL GROUP	9	12	319	35,916	銀行
SYMANTEC CORP	130	130	247	27,882	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	32	32	287	32,332	ソフトウェア・サービス
T ROWE PRICE GROUP INC	49	53	513	57,744	各種金融
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	－	27	325	36,652	ソフトウェア・サービス
TESLA INC	26	29	913	102,695	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS INC	203	222	2,038	229,258	半導体・半導体製造装置
TESARO INC	6	－	－	－	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TRIMBLE INC	51	60	226	25,505	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRACTOR SUPPLY COMPANY	27	27	244	27,548	小売
TRIPADVISOR INC	23	23	113	12,775	小売
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	17	17	146	16,511	運輸
ULTA BEAUTY INC	12	12	337	37,967	小売
UNITED THERAPEUTICS CORP	9	9	111	12,575	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISIGN INC	18	26	362	40,792	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	51	56	930	104,679	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISK ANALYTICS INC	31	37	433	48,723	商業・専門サービス
VIACOM INC-CLASS B	72	72	215	24,194	メディア・娯楽
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	186	193	1,465	164,849	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP	58	67	362	40,808	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILLIS TOWERS WATSON PLC	25	28	397	44,704	保険
WYNN RESORTS LTD	16	20	209	23,566	消費者サービス
XILINX INC	50	57	452	50,946	半導体・半導体製造装置
ZIONS BANCORP NA	37	41	194	21,848	銀行
ZILLOW GROUP INC - C	20	27	113	12,743	ソフトウェア・サービス
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	237	237	142	15,993	不動産
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRST	970	－	－	－	運輸
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	45	45	144	16,195	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	43	51	293	33,062	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	－	25	271	30,481	各種金融
小計 株数・金額	63,409	69,028	529,403	59,542,502	
小計 銘柄数＜比率＞	599	594	－	＜65.6%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD	46	46	217	18,707	素材
AGRIUM INC	27	－	－	－	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	85	97	600	51,635	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	30	70	148	12,773	公益事業
ARC RESOURCES LTD	79	79	99	8,534	エネルギー
ATCO LTD -CLASS I	19	19	72	6,254	公益事業
AURORA CANNABIS INC	－	135	128	11,081	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BARRICK GOLD CORP	239	295	486	41,777	素材
BANK OF MONTREAL	132	142	1,416	121,715	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	243	268	1,882	161,799	銀行
BCE INC	29	29	153	13,206	電気通信サービス
BAUSCH HEALTH COS INC	67	67	203	17,531	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOMBARDIER INC 'B'	347	400	132	11,387	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	181	183	978	84,074	各種金融
CAE INC	63	56	130	11,196	資本財
CAMECO CORP	78	78	113	9,754	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	87	99	1,121	96,413	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	231	274	1,001	86,096	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	153	167	1,783	153,318	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	15	16	248	21,401	小売
CANADIAN UTILITIES LTD-A	25	25	79	6,847	公益事業
CCL INDUSTRIES INC - CL B	30	30	163	14,093	素材
CENOVUS ENERGY INC	174	253	281	24,178	エネルギー
CGI GROUP INC - CL A	46	59	462	39,766	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	46	57	108	9,303	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC	4	4	417	35,849	ソフトウェア・サービス
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	29	31	814	69,996	運輸
CRESCENT POINT ENERGY CORP	114	114	77	6,667	エネルギー
DOLLARAMA INC	21	65	259	22,299	小売
ELEMENT FLEET MANAGEMENT COR	71	－	－	－	各種金融
EMPIRE CO LTD 'A'	30	30	70	6,100	食品・生活必需品小売り
EMERA INC	－	12	51	4,406	公益事業
ENCANA CORP	210	210	290	25,007	エネルギー
ENBRIDGE INC	335	387	1,582	136,018	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	5	6	412	35,424	保険
FIRST CAPITAL REALTY INC	33	33	65	5,587	不動産
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	147	147	160	13,819	素材
FINNING INTERNATIONAL INC	28	35	98	8,455	資本財
FORTIS INC	80	102	444	38,192	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	38	38	306	26,352	素材
GILDAN ACTIVEWEAR INC	45	45	177	15,276	耐久消費財・アパレル
GOLDCORP INC	179	179	198	17,078	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	59	59	178	15,357	保険
HUSKY ENERGY INC	68	68	129	11,117	エネルギー
HYDRO ONE LTD	62	90	177	15,256	公益事業
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	17	22	103	8,884	保険
IGM FINANCIAL INC	19	19	62	5,366	各種金融
IMPERIAL OIL LTD	59	71	298	25,617	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	71	98	213	18,327	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	24	35	356	30,647	保険
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	234	234	49	4,247	素材
KEYERA CORP	35	42	141	12,184	エネルギー
KINROSS GOLD CORP	250	250	84	7,288	素材
LINAMAR CORP	9	9	53	4,590	自動車・自動車部品
LOBLAW COMPANIES LTD	49	42	277	23,835	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	－	122	60	5,214	素材
MANULIFE FINANCIAL CORP	412	441	903	77,658	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	70	74	467	40,208	自動車・自動車部品
METRO INC	43	62	257	22,155	食品・生活必需品小売り
METHANEX CORP	16	16	137	11,799	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
NATIONAL BANK OF CANADA	67	79	477	41,039	銀行
NUTRIEN LTD	—	140	942	81,039	素材
ONEX CORPORATION	19	23	196	16,869	各種金融
OPEN TEXT CORP	51	69	303	26,124	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	102	112	493	42,397	エネルギー
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	36	—	—	—	エネルギー
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	179	—	—	—	素材
POWER CORP OF CANADA	78	78	210	18,060	保険
POWER FINANCIAL CORP	57	57	161	13,871	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	41	41	86	7,396	エネルギー
BLACKBERRY LTD	103	103	123	10,616	ソフトウェア・サービス
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	46	53	394	33,903	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	71	77	524	45,056	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	295	324	3,075	264,364	銀行
SAPUTO INC	50	60	240	20,678	食品・飲料・タバコ
SEVEN GENERATIONS ENERGY -A	44	70	101	8,689	エネルギー
SHOPIFY INC - CLASS-A	18	19	350	30,124	ソフトウェア・サービス
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	81	106	261	22,447	メディア・娯楽
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	93	93	199	17,143	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	31	36	169	14,544	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC	129	136	658	56,589	保険
SUNCOR ENERGY INC	338	371	1,634	140,501	エネルギー
TELUS CORP	43	43	198	17,036	電気通信サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	119	119	296	25,513	素材
THOMSON REUTERS CORP	55	60	367	31,574	各種金融
TOURMALINE OIL CORP	45	66	130	11,200	エネルギー
TORONTO-DOMINION BANK	373	414	3,000	257,889	銀行
TRANSCANADA CORP	176	198	993	85,420	エネルギー
VERMILION ENERGY INC	26	38	136	11,710	エネルギー
WEST FRASER TIMBER CO LTD	14	14	99	8,519	素材
WESTON (GEORGE) LTD	11	11	107	9,270	食品・生活必需品小売り
WSP GLOBAL INC	—	21	138	11,876	資本財
YAMANA GOLD INC	196	—	—	—	素材
小計 株数・金額	8,367	9,207	37,470	3,220,607	
小計 銘柄数<比率>	88	88	—	<3.6%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	38	43	893	114,237	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE-REG	92	99	1,821	232,890	保険
AXEL SPRINGER SE	9	9	55	7,033	メディア・娯楽
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	66	73	545	69,758	自動車・自動車部品
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	11	11	77	9,857	自動車・自動車部品
BASF SE	186	207	1,385	177,112	素材
BAYER AG-REG	167	211	1,400	179,008	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIERSDORF AG	20	26	247	31,589	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG	30	39	179	22,934	資本財
COMMERZBANK AG	213	213	173	22,166	銀行
CONTINENTAL AG	22	24	345	44,172	自動車・自動車部品
COVESTRO AG	21	43	233	29,820	素材
DAIMLER AG	194	206	1,062	135,823	自動車・自動車部品
DEUTSCHE BOERSE AG	40	42	466	59,574	各種金融
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	424	457	403	51,553	各種金融
DEUTSCHE POST AG-REG	200	230	656	83,890	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	664	751	1,085	138,753	電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	75	75	303	38,809	不動産
VONOVIA SE	92	113	457	58,472	不動産
DELIVERY HERO SE	—	18	64	8,218	ソフトウェア・サービス
DRILLISCH AG	—	9	38	4,890	電気通信サービス
E.ON SE	446	493	420	53,812	公益事業

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…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
EVONIK INDUSTRIES AG	35	35	93	11,985	素材
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	43	51	351	44,957	ヘルスケア機器・サービス
FRAPORT AG	9	9	66	8,533	運輸
FRESENIUS SE & CO KGAA	86	94	558	71,339	ヘルスケア機器・サービス
FUCHS PETROLUB SE-PRF	17	17	68	8,807	素材
GEA GROUP AG	39	39	102	13,115	資本財
HANNOVER RUECK SE-REG	13	12	148	18,987	保険
HEIDELBERGCEMENT AG	28	38	219	28,046	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	37	39	373	47,681	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL AG & CO KGAA	18	27	234	29,959	家庭用品・パーソナル用品
HOCHTIEF AG	4	4	57	7,401	資本財
HUGO BOSS AG -ORD	12	12	74	9,490	耐久消費財・アパレル
INFINEON TECHNOLOGIES AG	234	252	415	53,085	半導体・半導体製造装置
INNOGY SE	28	28	109	14,051	公益事業
K+S AG	38	38	62	7,940	素材
KION GROUP AG	14	14	65	8,348	資本財
LANXESS AG	19	19	103	13,173	素材
LINDE AG	36	—	—	—	素材
DEUTCHE LUFTHANSA	56	49	93	11,905	運輸
MAN SE	8	8	75	9,616	資本財
MERCK KGAA	26	30	272	34,862	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
METRO WHOLESALE & FOOD SPECI	41	41	52	6,710	食品・生活必需品小売り
MTU AERO ENGINES AG	—	11	206	26,405	資本財
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	30	33	627	80,224	保険
OSRAM LICHT AG	15	20	68	8,803	資本財
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	31	31	163	20,841	自動車・自動車部品
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	48	48	95	12,238	メディア・娯楽
PUMA SE	—	2	97	12,429	耐久消費財・アパレル
QIAGEN N.V.	43	53	159	20,391	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RWE AG	106	106	189	24,189	公益事業
SAP SE	199	222	2,083	266,350	ソフトウェア・サービス
SARTORIUS AG-VORZUG-PRF	—	7	86	11,104	ヘルスケア機器・サービス
SCHAEFFLER AG-PRF	35	35	31	4,058	自動車・自動車部品
SIEMENS HEALTHINEERS AG	—	34	119	15,261	ヘルスケア機器・サービス
SIEMENS AG-REG	155	173	1,755	224,398	資本財
SYMRISE AG	26	26	189	24,223	素材
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	122	162	59	7,641	電気通信サービス
THYSSENKRUPP AG	74	87	159	20,418	素材
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	29	24	86	11,047	電気通信サービス
UNIPER SE	—	38	98	12,644	公益事業
VOLKSWAGEN AG	5	8	119	15,319	自動車・自動車部品
VOLKSWAGEN AG-PFD	38	41	570	72,905	自動車・自動車部品
WIRECARD AG	—	26	431	55,116	ソフトウェア・サービス
ZALANDO SE	17	21	73	9,351	小売
小計 株数・金額	4,852	5,485	23,388	2,989,748	
小計 銘柄数<比率>	58	65	—	<3.3%>	
(ユーロ…イタリア)					
ATLANTIA SPA	93	108	191	24,446	運輸
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	—	148	99	12,702	食品・飲料・タバコ
ENEL SPA	1,646	1,821	808	103,327	公益事業
ENI SPA	513	592	887	113,500	エネルギー
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	81	81	81	10,367	資本財
UNIPOLSAI SPA	185	—	—	—	保険
ASSICURAZIONI GENERALI	239	256	359	46,011	保険
INTESA SANPAOLO	2,709	3,355	655	83,782	銀行
INTESA SANPAOLO-RSP	200	—	—	—	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA	34	43	242	31,045	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA	116	127	99	12,690	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…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
MONCLER SPA	－	36	111	14,277	耐久消費財・アパレル
POSTE ITALIANE SPA	102	102	62	8,037	保険
PRYSMIAN SPA	34	63	105	13,481	資本財
RECORDATI SPA	17	25	75	9,634	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAIPEM SPA	123	－	－	－	エネルギー
SNAM SPA	461	592	215	27,583	エネルギー
TELECOM ITALIA SPA	2,332	2,332	114	14,604	電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RSP	1,258	1,258	52	6,763	電気通信サービス
TERNA SPA	276	356	163	20,931	公益事業
UNICREDIT SPA	397	466	519	66,396	銀行
小計 株数・金額	10,825	11,770	4,846	619,582	
小計 銘柄数＜比率＞	19	18	－	＜0.7%＞	
(ユーロ…フランス)					
ACCOR SA	34	39	157	20,139	消費者サービス
ADP	6	6	120	15,371	運輸
AIR LIQUIDE SA	89	97	1,051	134,354	素材
ALSTOM	35	32	120	15,451	資本財
AMUNDI SA	－	11	62	7,971	各種金融
ARKEMA	13	18	168	21,546	素材
ATOS SE	20	22	153	19,604	ソフトウェア・サービス
AXA	397	446	985	125,944	保険
BIOMERIEUX	－	10	69	8,822	ヘルスケア機器・サービス
SOCIETE BIC SA	5	5	46	5,958	商業・専門サービス
BNP PARIBAS	227	255	1,204	154,022	銀行
BOLLORE	204	204	75	9,643	運輸
BOUYGUES SA	42	54	172	22,040	資本財
BUREAU VERITAS SA	56	56	108	13,856	商業・専門サービス
CAP GEMINI SA	31	36	380	48,651	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA	122	122	205	26,321	食品・生活必需品小売り
CASINO GUICHARD PERRACHON	13	13	51	6,531	食品・生活必需品小売り
CNP ASSURANCES	35	35	67	8,632	保険
CREDIT AGRICOLE SA	219	271	308	39,377	銀行
DANONE	123	139	881	112,739	食品・飲料・タバコ
DASSAULT SYSTEMES SA	27	29	331	42,435	ソフトウェア・サービス
DASSAULT AVIATION SA	0.5	0.5	73	9,440	資本財
EDENRED	39	56	176	22,535	商業・専門サービス
EIFFAGE	11	15	136	17,446	資本財
EDF	78	117	172	22,084	公益事業
ESSILORLUXOTTICA	42	45	553	70,771	ヘルスケア機器・サービス
EUTELSAT COMMUNICATIONS	37	37	83	10,716	メディア・娯楽
EURAZEO SE	10	10	65	8,422	各種金融
FAURECIA	－	16	68	8,742	自動車・自動車部品
ORANGE S.A.	415	444	615	78,738	電気通信サービス
ENGIE	352	395	460	58,819	公益事業
GETLINK	87	118	131	16,832	運輸
HERMES INTERNATIONAL	6	6	350	44,833	耐久消費財・アパレル
ILIAD SA	5	5	50	6,454	電気通信サービス
IMERYS SA	8	8	44	5,665	素材
INGENICO GROUP	11	11	77	9,920	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
IPSEN	6	7	95	12,254	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JC DECAUX SA	12	15	46	5,909	メディア・娯楽
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	57	63	1,678	214,588	耐久消費財・アパレル
L'OREAL	51	57	1,108	141,639	家庭用品・パーソナル用品
LAGARDERE S.C.A.	29	－	－	－	メディア・娯楽
LEGRAND SA	56	66	377	48,305	資本財
MICHELIN (CGDE)-B	36	38	338	43,208	自動車・自動車部品
NATIXIS	191	191	97	12,445	各種金融
PERNOD-RICARD SA	44	48	637	81,462	食品・飲料・タバコ

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
PEUGEOT SA	98	138	282	36,097	自動車・自動車部品
KERING	16	17	669	85,594	耐久消費財・アパレル
PUBLICIS GROUPE	40	49	250	32,002	メディア・娯楽
REXEL SA	62	62	69	8,884	資本財
RENAULT SA	34	44	287	36,813	自動車・自動車部品
REMY COINTREAU	4	4	48	6,224	食品・飲料・タバコ
SAFRAN SA	65	76	844	107,930	資本財
SANOFI	230	254	1,924	245,974	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	101	113	358	45,839	資本財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	114	123	766	98,037	資本財
SCOR SE	31	35	145	18,550	保険
SEB SA	4	4	66	8,528	耐久消費財・アパレル
SODEXO	19	18	164	21,032	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	154	178	586	74,989	銀行
SUEZ	61	76	95	12,151	公益事業
TELEPERFORMANCE	—	14	218	27,913	商業・専門サービス
THALES SA	23	24	294	37,610	資本財
TOTAL SA	481	542	2,787	356,365	エネルギー
UBISOFT ENTERTAINMENT	—	19	161	20,670	ソフトウェア・サービス
VALEO SA	48	57	172	21,993	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	91	126	216	27,675	公益事業
VINCI SA	103	117	923	118,067	資本財
VIVENDI	205	227	488	62,410	メディア・娯楽
WENDEL	6	6	66	8,505	各種金融
ZODIAC AEROSPACE	45	—	—	—	資本財
小計 株数・金額	5,346	6,023	26,054	3,330,519	
小計 銘柄数＜比率＞	65	68	—	＜3.7%＞	
(ユーロ…オランダ)					
ABN AMRO GROUP NV-CVA	71	85	182	23,323	銀行
AEGON NV	381	381	201	25,741	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	264	291	597	76,359	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL	50	57	420	53,773	素材
ALTICE NV -A	83	—	—	—	メディア・娯楽
ALTICE NV -B	19	—	—	—	メディア・娯楽
ASML HOLDING NV	76	92	1,364	174,469	半導体・半導体製造装置
BOSKALIS WESTMINSTER	16	—	—	—	資本財
CNH INDUSTRIAL NV	223	252	223	28,516	資本財
AIRBUS GROUP SE	118	131	1,291	165,109	資本財
EXOR NV	22	22	112	14,334	各種金融
FERRARI NV	23	28	292	37,437	自動車・自動車部品
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	196	244	345	44,139	自動車・自動車部品
GEMALTO	18	—	—	—	ソフトウェア・サービス
HEINEKEN NV	52	56	439	56,236	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV	21	27	206	26,403	食品・飲料・タバコ
ING GROEP NV-CVA	794	881	913	116,771	銀行
KONINKLIJKE DSM NV	38	38	293	37,472	素材
KONINKLIJKE KPN NV	656	826	194	24,909	電気通信サービス
NN GROUP NV	63	63	236	30,237	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV	192	217	694	88,751	ヘルスケア機器・サービス
RANDSTAD NV	22	31	132	16,966	商業・専門サービス
RELX NV	205	—	—	—	商業・専門サービス
UNILEVER NV-CVA	333	350	1,698	217,068	家庭用品・パーソナル用品
VOPAK	12	12	50	6,448	エネルギー
WOLTERS KLUWER	62	62	328	41,969	商業・専門サービス
小計 株数・金額	4,023	4,156	10,220	1,306,443	
小計 銘柄数＜比率＞	26	21	—	＜1.4%＞	
(ユーロ…スペイン)					
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	120	—	—	—	運輸

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…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV		41	60	197	25,190	資本財
AENA SA		14	15	223	28,566	運輸
AMADEUS IT GROUP SA		93	102	737	94,335	ソフトウェア・サービス
BANKIA SA		237	337	94	12,049	銀行
BANKINTER SA		139	139	98	12,652	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA		1,359	1,493	762	97,508	銀行
BANCO SANTANDER SA		3,256	3,665	1,491	190,682	銀行
BANCO DE SABADELL SA		1,096	1,330	137	17,569	銀行
BANCO SANTANDER SA-RTS		3,256	—	—	—	銀行
CAIXABANK S.A		767	811	280	35,849	銀行
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		110	—	—	—	食品・生活必需品小売り
ENDESA SA		68	68	126	16,131	公益事業
ENAGAS SA		56	47	111	14,211	エネルギー
FERROVIAL SA		99	99	179	22,913	資本財
NATURGY ENERGY GROUP SA		77	77	169	21,716	公益事業
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENE		41	41	41	5,317	資本財
GRIFOLS SA		68	62	139	17,852	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA		1,178	1,327	845	108,045	公益事業
INDITEX		227	250	620	79,366	小売
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A		128	128	84	10,811	運輸
MAPFRE SA		208	208	52	6,731	保険
RED ELECTRICA CORPORACION SA		90	111	206	26,439	公益事業
REPSOL SA		247	312	469	60,041	エネルギー
TELEFONICA SA		946	1,088	754	96,421	電気通信サービス
小計	株数・金額	13,933	11,779	7,826	1,000,404	
	銘柄数＜比率＞	25	22	—	＜1.1%＞	
(ユーロ…ベルギー)						
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		154	173	1,123	143,587	食品・飲料・タバコ
PROXIMUS		24	30	70	9,027	電気通信サービス
COLRUYT SA		13	13	70	8,981	食品・生活必需品小売り
AGEAS		40	40	176	22,616	保険
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		14	16	130	16,656	各種金融
KBC GROEP NV		51	57	345	44,137	銀行
SOLVAY SA		15	15	157	20,084	素材
TELENET GROUP HOLDING NV		12	12	56	7,247	メディア・娯楽
UCB SA		27	30	214	27,443	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE		42	51	207	26,486	素材
小計	株数・金額	397	441	2,552	326,267	
	銘柄数＜比率＞	10	10	—	＜0.4%＞	
(ユーロ…オーストリア)						
ANDRITZ AG		14	14	62	7,950	資本財
ERSTE GROUP BANK AG		64	64	224	28,696	銀行
OMV AG		34	39	180	23,062	エネルギー
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL		27	27	66	8,551	銀行
VOESTALPINE AG		25	25	75	9,641	素材
小計	株数・金額	166	170	609	77,901	
	銘柄数＜比率＞	5	5	—	＜0.1%＞	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
ARCELORMITTAL		129	150	331	42,351	素材
EUROFINS SCIENTIFIC		2	2	118	15,197	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RTL GROUP		6	8	48	6,172	メディア・娯楽
SES		75	75	149	19,119	メディア・娯楽
TENARIS SA		93	116	151	19,389	エネルギー
小計	株数・金額	307	353	799	102,231	
	銘柄数＜比率＞	5	5	—	＜0.1%＞	
(ユーロ…フィンランド)						
ELISA OYJ		25	30	105	13,506	電気通信サービス
FORTUM OYJ		88	110	203	26,048	公益事業

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
KONE OYJ-B		64	76	308	39,463	資本財
METSO OYJ		24	24	64	8,275	資本財
NESTE OYJ		27	27	182	23,284	エネルギー
NOKIA OYJ		1,199	1,327	624	79,783	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
NOKIAN RENKAAT OYJ		19	25	80	10,315	自動車・自動車部品
ORION OYJ-CLASS B		18	18	53	6,826	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SAMPO OYJ-A SHS		91	100	403	51,587	保険
STORA ENSO OYJ-R SHS		120	115	152	19,522	素材
UPM-KYMMENE OYJ		108	118	328	42,008	素材
WARTSILA OYJ ABP		29	88	128	16,455	資本財
小計	株数・金額	1,817	2,063	2,636	337,078	
	銘柄数<比率>	12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
AIB GROUP PLC		—	153	63	8,175	銀行
BANK OF IRELAND GROUP PLC		186	242	151	19,395	銀行
CRH PLC		171	187	450	57,639	素材
KERRY GROUP PLC-A		33	36	335	42,902	食品・飲料・タバコ
PADDY POWER BETFAIR PLC		16	21	154	19,691	消費者サービス
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		—	46	130	16,640	素材
小計	株数・金額	407	686	1,286	164,446	
	銘柄数<比率>	4	6	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		549	549	168	21,594	公益事業
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		93	109	165	21,201	エネルギー
JERONIMO MARTINS		50	50	59	7,612	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	693	709	394	50,408	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		49	—	—	—	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	49	—	—	—	
	銘柄数<比率>	1	—	—	<—%>	
(ユーロ…スイス)						
STMICROELECTRONICS NV		127	150	182	23,298	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額	127	150	182	23,298	
	銘柄数<比率>	1	1	—	<0.0%>	
ユーロ計	株数・金額	42,947	43,791	80,797	10,328,331	
	銘柄数<比率>	234	236	—	<11.4%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
3I GROUP PLC		204	204	174	25,121	各種金融
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		73	85	199	28,835	食品・飲料・タバコ
ADMIRAL GROUP PLC		32	42	82	11,906	保険
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		70	70	23	3,437	ヘルスケア機器・サービス
ANGLO AMERICAN PLC		270	248	402	58,074	素材
ANTOFAGASTA PLC		87	87	65	9,389	素材
ASTRAZENECA PLC		256	285	1,656	238,897	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHTEAD GROUP PLC		99	112	206	29,793	資本財
AUTO TRADER GROUP PLC		179	206	81	11,779	ソフトウェア・サービス
AVIVA PLC		842	918	383	55,353	保険
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		466	519	1,875	270,493	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC ORD		655	712	387	55,942	資本財
BARCLAYS PLC		3,383	3,745	644	92,924	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		229	206	102	14,834	耐久消費財・アパレル
BABCOCK INTL GROUP PLC		62	62	37	5,413	商業・専門サービス
BERKELEY GROUP HOLDINGS		26	26	86	12,515	耐久消費財・アパレル
BHP BILLITON PLC		427	494	750	108,259	素材
BP PLC		3,991	4,504	2,412	347,863	エネルギー
SKY PLC		213	—	—	—	メディア・娯楽
BT GROUP PLC		1,733	1,848	444	64,128	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
BUNZL PLC	72	72	165	23,870	資本財
BURBERRY GROUP PLC	89	89	152	22,053	耐久消費財・アパレル
CAPITA PLC	153	—	—	—	商業・専門サービス
CARNIVAL PLC	40	38	162	23,501	消費者サービス
CENTRICA PLC	1,111	1,269	189	27,314	公益事業
COCA-COLA HBC AG-CDI	35	51	119	17,233	食品・飲料・タバコ
COBHAM PLC	487	—	—	—	資本財
COMPASS GROUP PLC	324	350	541	78,101	消費者サービス
CONVATEC GROUP PLC	277	277	41	5,960	ヘルスケア機器・サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	27	27	130	18,776	素材
DCC PLC	18	25	165	23,824	資本財
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	293	293	95	13,709	保険
DIAGEO PLC	509	553	1,485	214,280	食品・飲料・タバコ
DIXONS CARPHONE PLC	220	—	—	—	小売
EASYJET PLC	38	38	44	6,476	運輸
EXPERIAN PLC	186	204	360	51,949	商業・専門サービス
FRESNILLO PLC	39	47	43	6,202	素材
GKN PLC	330	—	—	—	自動車・自動車部品
G4S PLC	346	346	74	10,734	商業・専門サービス
GLENCORE PLC	2,503	2,618	792	114,344	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	1,000	1,117	1,711	246,812	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GVC HOLDINGS PLC	—	110	96	13,864	消費者サービス
HARGREAVES LANSDOWN PLC	57	57	103	14,913	各種金融
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	28	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	4,063	4,503	2,744	395,766	銀行
IMI PLC	61	—	—	—	資本財
IMPERIAL BRANDS PLC	192	220	603	87,048	食品・飲料・タバコ
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	38	47	189	27,377	消費者サービス
INVESTEC PLC	131	131	62	9,064	各種金融
INMARSAT PLC	100	—	—	—	電気通信サービス
INTERTEK GROUP PLC	35	33	150	21,705	商業・専門サービス
INFORMA PLC	—	288	206	29,745	メディア・娯楽
ITV PLC	772	772	112	16,172	メディア・娯楽
JOHNSON MATTHEY PLC	41	41	121	17,512	素材
KINGFISHER PLC	452	452	110	15,963	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	1,158	1,362	333	48,082	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	14,501	16,243	937	135,211	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	65	65	283	40,888	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	349	349	99	14,357	小売
MEGGITT PLC	139	162	84	12,180	資本財
MERLIN ENTERTAINME	155	155	48	7,005	消費者サービス
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	1,103	174	25,108	資本財
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	87	87	108	15,626	ソフトウェア・サービス
MONDI PLC	74	93	168	24,284	素材
WM MORRISON SUPERMARKETS	492	492	125	18,112	食品・生活必需品小売り
NATIONAL GRID PLC	683	758	637	91,993	公益事業
NEXT PLC	29	29	153	22,114	小売
NMC HEALTH PLC	—	21	68	9,874	ヘルスケア機器・サービス
OLD MUTUAL PLC	1,041	—	—	—	保険
PERSIMMON PLC	70	74	164	23,774	耐久消費財・アパレル
PEARSON PLC	177	177	160	23,159	メディア・娯楽
PRUDENTIAL PLC	522	588	885	127,748	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	18	25	156	22,524	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	131	152	1,027	148,234	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	206	439	682	98,422	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC	252	272	996	143,677	素材
ROYAL MAIL PLC	199	199	72	10,460	運輸
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	720	1,009	236	34,145	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	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	899	1,041	2,515	362,758	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	767	842	2,080	300,033	エネルギー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	330	360	314	45,289	資本財
RSA INSURANCE GROUP PLC	214	214	117	16,952	保険
SAINSBURY (J) PLC	324	428	132	19,165	食品・生活必需品小売り
SAGE GROUP PLC/THE	204	269	143	20,676	ソフトウェア・サービス
SCHRODERS PLC	19	26	69	10,057	各種金融
SSE PLC	197	239	273	39,469	公益事業
SEVERN TRENT PLC	44	60	112	16,174	公益事業
SHIRE PLC	186	208	924	133,250	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	88	82	109	15,820	資本財
SMITH & NEPHEW PLC	187	203	260	37,497	ヘルスケア機器・サービス
ST JAMES'S PLACE PLC	110	120	118	17,134	各種金融
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	531	542	141	20,464	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC	656	612	321	46,376	銀行
TATE & LYLE PLC	105	—	—	—	食品・飲料・タバコ
TAYLOR WIMPEY PLC	736	925	141	20,475	耐久消費財・アパレル
TESCO PLC	1,711	2,290	493	71,105	食品・生活必需品小売り
TRAVIS PERKINS PLC	58	52	56	8,116	資本財
TUI AG-DI	99	92	120	17,358	消費者サービス
UNILEVER PLC	260	278	1,179	170,047	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	133	170	122	17,675	公益事業
VODAFONE GROUP PLC	5,418	6,041	885	127,715	電気通信サービス
WEIR GROUP PLC/THE	38	59	84	12,171	資本財
WHITBREAD PLC	35	38	167	24,101	消費者サービス
WOOD GROUP (JOHN) PLC	130	173	123	17,814	エネルギー
FERGUSON PLC	53	54	281	40,608	資本財
WORLDPAY GROUP PLC	421	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	251	280	255	36,847	メディア・娯楽
(イギリス…非上場)					
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENT-C(N)	—	16,566	1	238	資本財
小計 株数・金額	62,685	84,600	39,953	5,761,633	
小計 銘柄数＜比率＞	103	97	—	＜6.4%＞	
(スイス)			千スイスフラン		
ABB LTD-REG	401	406	816	91,735	資本財
ADECCO GROUP AG-REG	35	33	156	17,568	商業・専門サービス
BALOISE HOLDING AG - REG	10	10	152	17,091	保険
CLARIANT AG-REG	—	44	93	10,551	素材
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	500	573	719	80,904	各種金融
DUFRY AG-REG	6	6	72	8,158	小売
VIFOR PHARMA AG	10	10	146	16,458	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	369	41,562	資本財
GIVAUDAN-REG	1	2	498	56,022	素材
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	93	109	458	51,517	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	46	55	240	27,086	各種金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	11	11	156	17,631	運輸
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	0.02	0.03	231	26,065	食品・飲料・タバコ
LONZA GROUP AG-REG	16	16	510	57,409	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA-REG	631	704	5,917	665,127	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG-REG	452	491	4,191	471,102	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDIING AG	3	3	251	28,321	各種金融
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	104	123	868	97,661	耐久消費財・アパレル
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	142	158	3,722	418,410	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	9	8	168	18,902	資本財
SGS SA-REG	1	1	255	28,717	商業・専門サービス
SIKA AG-REG	0.47	30	370	41,647	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	11	13	209	23,580	ヘルスケア機器・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	6	8	300	33,753	保険

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
SWISSCOM AG-REG		5	6	286	32,233	電気通信サービス
SWISS RE AG		65	71	631	70,963	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR		6	6	220	24,748	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG-REG		748	877	1,174	131,994	各種金融
ZURICH INSURANCE GROUP AG		31	35	1,064	119,620	保険
BARRY CALLEBAUT AG-REG		0.45	0.45	87	9,807	食品・飲料・タバコ
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		1	1	89	10,031	素材
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		0.18	0.23	153	17,282	食品・飲料・タバコ
PARGESA HOLDING SA-BR		6	7	53	6,019	各種金融
SCHINDLER HOLDING AG-REG		3	4	88	9,893	資本財
STRAUMANN HOLDING AG-REG		1	2	142	16,028	ヘルスケア機器・サービス
SWISS PRIME SITE-REG		14	15	122	13,807	不動産
TEMENOS AG		－	15	198	22,304	ソフトウェア・サービス
SWATCH GROUP AG/THE-REG		9	14	88	10,000	耐久消費財・アパレル
小計	株数・金額	3,404	3,891	25,282	2,841,724	
	銘柄数＜比率＞	36	38	－	＜3.1％＞	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
ALFA LAVAL AB		54	60	1,373	16,943	資本財
ASSA ABLOY AB-B		209	230	4,042	49,882	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS		137	152	3,270	40,352	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS		76	91	1,798	22,198	資本財
BOLIDEN AB		59	59	1,181	14,584	素材
ELECTROLUX AB - B		54	48	868	10,723	耐久消費財・アパレル
EPIROC AB-A		－	137	1,132	13,970	資本財
EPIROC AB-B		－	91	687	8,488	資本財
ERICSSON LM-B SHS		642	677	5,388	66,489	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESSITY AKTIEBOLAG-B		130	148	3,233	39,895	家庭用品・パーソナル用品
GETINGE AB-B SHS		44	－	－	－	ヘルスケア機器・サービス
HENNES & MAURITZ AB-B SHS		187	187	2,998	37,002	小売
HEXAGON AB-B SHS		52	58	2,585	31,900	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HUSQVARNA AB-B SHS		84	84	548	6,772	耐久消費財・アパレル
ICA GRUPPEN AB		14	14	441	5,453	食品・生活必需品小売り
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		27	33	616	7,610	各種金融
INVESTOR AB-B SHS		91	100	3,867	47,723	各種金融
KINNEVIK AB - B		42	48	1,204	14,859	各種金融
LUNDBERGS AB-B SHS		7	14	371	4,581	各種金融
LUNDIN PETROLEUM AB		43	43	1,164	14,372	エネルギー
MILLICOM INTL CELLULAR-SDR		13	13	687	8,486	電気通信サービス
NORDEA BANK ABP		626	659	5,236	64,613	銀行
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A		318	347	3,248	40,088	銀行
SANDVIK AB		216	257	3,568	44,029	資本財
SECURITAS AB-B SHS		58	87	1,267	15,647	商業・専門サービス
SKANSKA AB-B SHS		71	71	983	12,134	資本財
SKF AB-B SHARES-B		78	78	1,082	13,361	資本財
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		312	351	3,548	43,783	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES		179	206	4,229	52,187	銀行
SWEDISH MATCH AB		40	40	1,787	22,055	食品・飲料・タバコ
TELE2 AB-B SHS		62	75	791	9,770	電気通信サービス
TELIA CO AB		534	573	2,330	28,755	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS-B		326	352	4,722	58,277	資本財
小計	株数・金額	4,798	5,398	70,258	866,995	
	銘柄数＜比率＞	31	32	－	＜1.0％＞	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
AKER BP ASA		－	22	637	8,582	エネルギー
DNB ASA		199	210	3,228	43,486	銀行
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		42	42	532	7,173	保険
MARINE HARVEST		77	87	1,743	23,486	食品・飲料・タバコ
NORSK HYDRO A S		264	368	1,514	20,406	素材

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ノルウェー)		百株	百株	千ノルウェークローネ	千円	
ORKLA ASA		173	173	1,229	16,559	食品・飲料・タバコ
SCHIBSTED ASA-CL A		16	—	—	—	メディア・娯楽
SCHIBSTED ASA-B SHS		14	20	546	7,361	メディア・娯楽
EQUINOR ASA		232	262	5,620	75,708	エネルギー
TELENOR ASA		148	163	2,521	33,958	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		37	37	1,335	17,988	素材
小計	株数・金額	1,206	1,388	18,909	254,711	
	銘柄数<比率>	10	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	1,103	18,897	運輸
AP MOELLER - MAERSK A/S - A		0.8	0.8	596	10,223	運輸
CARLSBERG AS-B		21	27	1,950	33,416	食品・飲料・タバコ
CHR HANSEN HOLDING A/S		18	24	1,596	27,347	素材
COLOPLAST-B		25	25	1,575	26,994	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S		156	164	2,074	35,528	銀行
ORSTED A/S		29	44	1,853	31,744	公益事業
DSV A/S		38	46	2,340	40,100	運輸
GENMAB A/S		11	13	1,093	18,731	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
H LUNDBECK A/S		10	14	438	7,502	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ISS A/S		31	47	994	17,027	商業・専門サービス
NOVO NORDISK A/S-B		372	412	11,336	194,188	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		48	48	1,459	25,006	素材
PANDORA A/S		23	21	924	15,831	耐久消費財・アパレル
TDC A/S		145	—	—	—	電気通信サービス
TRYG A/S		25	25	399	6,850	保険
VESTAS WIND SYSTEMS AS		44	44	1,828	31,320	資本財
WILLIAM DEMANT HOLDING		30	26	522	8,941	ヘルスケア機器・サービス
小計	株数・金額	1,036	988	32,087	549,653	
	銘柄数<比率>	18	17	—	<0.6%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
AGL ENERGY LTD		128	147	263	20,945	公益事業
ALUMINA LTD		465	465	113	9,065	素材
AMCOR LIMITED		238	274	348	27,733	素材
AMP LTD		626	596	149	11,858	各種金融
AUST AND NZ BANKING GROUP		593	649	1,611	128,232	銀行
ARISTOCRAT LEISURE LTD		108	129	347	27,620	消費者サービス
ASX LTD		34	40	231	18,414	各種金融
BENDIGO AND ADELAIDE BANK		104	104	103	8,210	銀行
BHP BILLITON LTD		657	729	2,247	178,776	素材
BANK OF QUEENSLAND LIMITED		81	81	76	6,091	銀行
BLUESCOPE STEEL LTD		98	115	159	12,661	素材
BORAL LTD		171	252	142	11,339	素材
BRAMBLES LTD		328	383	405	32,225	商業・専門サービス
CALTEX AUSTRALIA LTD		53	53	147	11,717	エネルギー
CHALLENGER LTD		99	121	130	10,375	各種金融
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		350	396	2,591	206,115	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD		106	106	102	8,192	食品・飲料・タバコ
COCHLEAR LTD		12	12	221	17,598	ヘルスケア機器・サービス
COMPUTERSHARE LTD		114	94	182	14,515	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD		67	67	83	6,610	消費者サービス
CSL LTD		95	102	1,797	143,023	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	11	62	4,973	消費者サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		9	9	45	3,608	消費者サービス
FORTESCUE METALS GROUP LTD		296	296	107	8,589	素材
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		—	113	35	2,863	小売
HEALTHSCOPE LTD		330	330	71	5,657	ヘルスケア機器・サービス
INCITEC PIVOT LTD		315	443	166	13,271	素材
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		502	575	390	31,060	保険

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC-CDI		85	108	205	16,365	素材
CIMIC GROUP LTD		18	18	85	6,821	資本財
SYDNEY AIRPORT		241	241	153	12,183	運輸
MACQUARIE GROUP LTD		64	70	780	62,061	各種金融
MEDIBANK PRIVATE LTD		620	620	166	13,267	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		541	611	1,501	119,409	銀行
NEWCREST MINING LTD		154	188	404	32,216	素材
OIL SEARCH LTD		288	288	226	18,049	エネルギー
ORIGIN ENERGY LTD		359	431	305	24,320	エネルギー
ORICA LIMITED		69	76	125	9,945	素材
QANTAS AIRWAYS LTD		70	—	—	—	運輸
QBE INSURANCE GROUP LTD		293	292	326	25,999	保険
AURIZON HOLDINGS LTD		461	417	169	13,457	運輸
RAMSAY HEALTH CARE LTD		29	29	160	12,787	ヘルスケア機器・サービス
REA GROUP LTD		11	11	80	6,403	ソフトウェア・サービス
RIO TINTO LTD		87	99	734	58,414	素材
SANTOS LTD		331	397	264	21,030	エネルギー
SEEK LTD		80	69	124	9,919	商業・専門サービス
SONIC HEALTHCARE LTD		81	100	228	18,196	ヘルスケア機器・サービス
SOUTH32 LTD		1,060	1,221	430	34,217	素材
AUSNET SERVICES		407	407	67	5,364	公益事業
SUNCORP GROUP LTD		271	325	443	35,262	保険
TABCORP HOLDINGS LTD		153	393	180	14,349	消費者サービス
TATTS GROUP LTD		300	—	—	—	消費者サービス
TELSTRA CORPORATION LTD		873	889	271	21,582	電気通信サービス
TPG TELECOM LTD		—	78	59	4,733	電気通信サービス
TRANSURBAN GROUP		431	601	668	53,207	運輸
TREASURY WINE ESTATES LTD		159	159	238	18,989	食品・飲料・タバコ
WESTPAC BANKING CORP		679	771	1,992	158,507	銀行
WESFARMERS LTD		236	252	1,149	91,470	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS GROUP LTD		267	299	824	65,577	食品・生活必需品小売り
WOODSIDE PETROLEUM LTD		154	214	719	57,234	エネルギー
小計	株数・金額	14,894	16,397	25,426	2,022,697	
	銘柄数<比率>	58	58	—	<2.2%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
A2 MILK CO LTD		—	150	148	10,894	食品・飲料・タバコ
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		214	214	146	10,708	運輸
CONTACT ENERGY LIMITED		153	—	—	—	公益事業
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C		—	107	142	10,414	ヘルスケア機器・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		151	185	106	7,776	素材
MERIDIAN ENERGY LTD		280	280	85	6,300	公益事業
MERCURY NZ LTD		135	—	—	—	公益事業
RYMAN HEALTHCARE LTD		85	85	100	7,332	ヘルスケア機器・サービス
SPARK NEW ZEALAND LTD		351	351	134	9,881	電気通信サービス
小計	株数・金額	1,371	1,373	863	63,307	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
AIA GROUP LTD		2,463	2,739	16,261	233,349	保険
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		42	62	433	6,223	半導体・半導体製造装置
BANK OF EAST ASIA		216	260	657	9,435	銀行
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		770	800	2,576	36,965	銀行
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS L		130	160	920	13,213	公益事業
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		567	602	4,768	68,427	資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD		557	602	3,175	45,575	不動産
CLP HOLDINGS LTD		345	365	3,168	45,463	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		500	540	2,292	32,894	消費者サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD		460	460	646	9,281	不動産
HANG LUNG GROUP LTD		170	170	327	4,693	不動産

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	
HANG SENG BANK LTD	146	174	3,387	48,614	銀行
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	251	276	1,014	14,555	不動産
HKT TRUST AND HKT LTD	540	910	973	13,972	電気通信サービス
POWER ASSETS HOLDINGS	285	320	1,681	24,130	公益事業
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	560	560	420	6,027	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS	1,715	2,046	3,061	43,937	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	236	274	5,770	82,805	各種金融
HYSAN DEVELOPMENT CO	150	150	553	7,942	不動産
I-CABLE COMMUNICATIONS LTD	350	—	—	—	メディア・娯楽
KERRY PROPERTIES LTD	114	114	277	3,984	不動産
LI & FUNG LTD	1,380	1,380	209	3,010	耐久消費財・アパレル
MGM CHINA HOLDINGS LTD	168	168	196	2,825	消費者サービス
MINTH GROUP LTD	—	140	368	5,293	自動車・自動車部品
MTR CORP	340	340	1,305	18,735	運輸
NEW WORLD DEVELOPMENT	1,346	1,696	1,679	24,103	不動産
NWS HOLDINGS LTD	285	285	436	6,257	資本財
PCCW LTD	800	800	347	4,982	電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	498	614	1,937	27,798	消費者サービス
SHANGRI-LA ASIA LTD	—	280	299	4,299	消費者サービス
SINO LAND CO	630	850	1,052	15,109	不動産
SJM HOLDINGS LTD	480	480	307	4,415	消費者サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES	304	384	3,882	55,715	不動産
SWIRE PACIFIC LTD 'A'	105	105	873	12,533	不動産
SWIRE PROPERTIES LTD	232	232	638	9,155	不動産
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	290	290	1,193	17,124	耐久消費財・アパレル
WHEELOCK & CO LTD	196	176	709	10,178	不動産
WHARF HOLDINGS LTD	248	248	475	6,825	不動産
WH GROUP LTD	1,535	1,820	1,057	15,173	食品・飲料・タバコ
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	—	318	1,493	21,424	不動産
WYNN MACAU LTD	358	358	589	8,455	消費者サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	145	145	303	4,359	耐久消費財・アパレル
小計 株数・金額	19,912	22,698	71,726	1,029,271	
小計 銘柄数＜比率＞	39	41	—	＜1.1%＞	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND LTD	518	725	221	18,003	不動産
CITY DEVELOPMENTS LTD	100	100	80	6,513	不動産
COMFORTDELGRO CORP LTD	460	460	104	8,501	運輸
DBS GROUP HOLDINGS LTD	367	406	962	78,405	銀行
GENTING SINGAPORE LTD	1,145	1,250	111	9,057	消費者サービス
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	600	—	—	—	不動産
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	1,300	1,300	31	2,593	食品・飲料・タバコ
JARDINE CYCLE & CARRIAGE LTD	20	20	57	4,649	小売
KEPPEL CORP LTD	290	395	245	20,002	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	615	691	732	59,671	銀行
SEMBCORP INDUSTRIES LTD	210	210	58	4,770	資本財
SINGAPORE AIRLINES LTD	128	128	118	9,671	運輸
SATS LTD	130	130	63	5,175	運輸
SINGAPORE EXCHANGE LTD	123	220	153	12,467	各種金融
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD	325	325	85	6,996	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	1,721	1,721	542	44,159	電気通信サービス
SINGAPORE TECH ENGINEERING	330	330	113	9,215	資本財
UNITED OVERSEAS BANK LTD	263	289	721	58,708	銀行
UOL GROUP LTD	122	93	57	4,643	不動産
VENTURE CORP LTD	—	56	88	7,181	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILMAR INTERNATIONAL LTD	296	496	154	12,574	食品・飲料・タバコ
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	—	509	60	4,890	資本財
小計 株数・金額	9,066	9,857	4,763	387,854	
小計 銘柄数＜比率＞	20	21	—	＜0.4%＞	

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)		百株	百株	ｲｽﾗｴﾙｼｭｹﾙ	千円	
AZRIELI GROUP LTD		－	9	168	5,123	不動産
BANK LEUMI LE-ISRAEL		244	302	692	21,062	銀行
BANK HAPOALIM BM		212	212	528	16,066	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CO		487	487	195	5,953	電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		5	5	218	6,651	資本財
FRUTAROM		8	－	－	－	素材
INTL FLAVORS & FRAGRANCES		－	2	102	3,123	素材
ISRAEL CHEMICALS LTD		97	130	274	8,331	素材
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		29	29	178	5,426	銀行
NICE LTD		13	13	541	16,458	ソフトウェア・サービス
小計	株数・金額	1,098	1,192	2,901	88,197	
	銘柄数＜比率＞	8	9	－	＜0.1%＞	
合計	株数・金額	234,199	269,814	－	86,957,039	
	銘柄数＜比率＞	1,251	1,248	－	＜95.9%＞	

(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	2,420	301	33,929	0.0
PROLOGIS INC	10,932	13,932	917	103,245	0.1
AMERICAN TOWER CORP	8,589	10,009	1,536	172,808	0.2
AGNC INVESTMENT CORP	7,010	10,210	184	20,738	0.0
VEREIT INC	19,554	19,554	145	16,384	0.0
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC	20,020	27,640	276	31,086	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,855	3,115	553	62,249	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	3,147	3,487	407	45,869	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6,100	—	—	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	—	6,558	126	14,242	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	1,940	1,940	182	20,503	0.0
COLONY CAPITAL INC-A	10,000	—	—	—	—
CROWN CASTLE INTL CORP	8,010	9,400	1,009	113,492	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	4,135	4,605	537	60,493	0.1
DUKE REALTY CORPORATION	6,875	8,845	251	28,242	0.0
EQUITY RESIDENTIAL-REIT	7,530	8,170	539	60,701	0.1
EQUINIX INC	1,628	1,738	716	80,528	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	1,400	356	40,058	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	2,450	3,020	266	29,981	0.0
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	1,415	1,875	231	25,982	0.0
GGP INC	12,545	—	—	—	—
HCP INC	9,285	10,905	294	33,151	0.0
WELLTOWER INC	7,380	8,360	554	62,319	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC	15,169	16,889	315	35,539	0.0
INVITATION HOMES INC	—	6,200	136	15,333	0.0
IRON MOUNTAIN INC	5,515	6,925	226	25,468	0.0
KIMCO REALTY CORPORATION	8,795	8,795	139	15,678	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	3,113	3,113	136	15,300	0.0
MACERICH CO/THE	2,460	2,460	126	14,234	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,270	2,670	267	30,038	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,990	4,050	192	21,663	0.0
PUBLIC STORAGE	3,039	3,479	701	78,933	0.1
REALTY INCOME CORP	5,400	6,660	401	45,122	0.0
REGENCY CENTERS CORP	3,175	3,175	203	22,921	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	2,580	2,660	415	46,709	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	6,374	7,054	1,275	143,455	0.2
SL GREEN REALTY CORP	2,040	2,040	189	21,317	0.0
UDR INC	5,820	5,820	232	26,097	0.0
VENTAS INC	7,285	8,015	456	51,292	0.1
VORNADO REALTY TRUST	3,491	4,021	273	30,784	0.0
WEYERHAEUSER CO	15,508	16,658	482	54,238	0.1
小計 口数・金額	249,314	267,867	15,560	1,750,142	
小計 銘柄数＜比率＞	39	38	—	＜1.9%＞	
(カナダ)			千カナダドル		
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	—	1,690	50	4,366	0.0
H&R REAL ESTATE INV-REIT UTS	2,340	4,000	78	6,735	0.0

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		口	口	千カナダドル	千円	%
RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		3,380	3,380	81	6,992	0.0
小計	口数・金額	5,720	9,070	210	18,094	
	銘柄数<比率>	2	3	－	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
COVIVIO		595	995	86	11,040	0.0
GECINA SA		970	970	127	16,255	0.0
ICADE		685	685	50	6,453	0.0
KLEPIERRE		4,732	4,732	138	17,705	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE-NA		2,070	－	－	－	－
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		－	3,130	502	64,201	0.1
ユーロ計	口数・金額	9,052	10,512	904	115,655	
	銘柄数<比率>	5	5	－	<0.1%>	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND COMPANY PLC		21,701	20,201	118	17,053	0.0
HAMMERSON PLC		15,295	15,295	66	9,548	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		15,214	15,214	127	18,434	0.0
INTU PROPERTIES PLC		19,860	－	－	－	－
SEGRO PLC		18,063	21,263	133	19,232	0.0
小計	口数・金額	90,133	71,973	445	64,268	
	銘柄数<比率>	5	4	－	<0.1%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
APA GROUP		21,286	26,518	251	19,998	0.0
VICINITY CENTRES		72,862	72,862	192	15,301	0.0
DEXUS		18,487	21,247	215	17,155	0.0
GOODMAN GROUP		39,332	37,672	388	30,927	0.0
GPT GROUP		33,695	37,975	195	15,557	0.0
LENDLEASE GROUP		12,197	12,197	209	16,698	0.0
MIRVAC GROUP		86,525	78,535	171	13,681	0.0
SCENTRE GROUP		116,381	122,321	475	37,852	0.0
STOCKLAND		55,310	50,500	187	14,904	0.0
WESTFIELD CORP		41,745	－	－	－	－
小計	口数・金額	497,820	459,827	2,288	182,076	
	銘柄数<比率>	10	9	－	<0.2%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		48,000	51,500	3,731	53,542	0.1
小計	口数・金額	48,000	51,500	3,731	53,542	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		51,900	51,900	133	10,902	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		40,000	54,940	95	7,738	0.0
CAPITACOMMERCIAL TRUST(N)		6,640	－	－	－	－
CAPITALAND MALL TRUST		48,100	48,100	104	8,498	0.0
SUNTEC REIT		45,000	54,600	98	8,001	0.0
小計	口数・金額	191,640	209,540	431	35,141	
	銘柄数<比率>	5	4	－	<0.0%>	
合計	口数・金額	1,091,679	1,080,289	－	2,218,921	
	銘柄数<比率>	67	64	－	<2.4%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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	
		口	口	千アメリカドル	千円	%
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A-LP		2,027	3,327	73	8,217	0.0
合計	口数・金額	2,027	3,327	73	8,217	
	銘柄数＜比率＞	1	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
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	DJSTX5	295	－
		SP EMINI	1,209	－

(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

(2018年10月26日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	86,957,039	95.6
投資証券	2,218,921	2.4
リミテッドパートナー(出資金)	8,217	0.0
コール・ローン等、その他	1,777,250	2.0
投資信託財産総額	90,961,427	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（89,558,364千円）の投資信託財産総額（90,961,427千円）に対する比率は98.5%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=112.47円、1カナダドル=85.95円、1ユーロ=127.83円、1イギリスポンド=144.21円、1スイスフラン=112.40円、1スウェーデンクローナ=12.34円、1ノルウェークローネ=13.47円、1デンマーククローネ=17.13円、1オーストラリアドル=79.55円、1ニュージーランドドル=73.29円、1香港ドル=14.35円、1シンガポールドル=81.42円、1イスラエルシュケル=30.40円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年10月26日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	92,262,682,965
コール・ローン等	1,346,150,187
株式(評価額)	86,957,039,121
投資証券(評価額)	2,218,921,193
リミテッドパートナー(出資金)(評価額)	8,217,162
未収入金	1,413,856,029
未収配当金	77,429,302
差入委託証拠金	241,069,971
(B) 負債	1,544,620,462
未払金	1,522,038,225
未払解約金	22,580,739
未払利息	1,498
(C) 純資産総額(A－B)	90,718,062,503
元本	37,961,659,533
次期繰越損益金	52,756,402,970
(D) 受益権総口数	37,961,659,533口
1万口当たり基準価額(C／D)	23,897円

(注) 当ファンドの期首元本額は34,878,791,197円、期中追加設定元本額は6,427,442,010円、期中一部解約元本額は3,344,573,674円です。

(注) 2018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）	17,203,096,280円
・日興五大陸株式ファンド	5,375,436,468円
・国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,512,298,631円
・インデックスファンド海外株式（ヘッジなし）	4,291,920,446円
・インデックスファンド先進国株式（適格機関投資家向け）	2,627,937,561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	2,074,639,698円
・ＤＣインデックスバランス（株式80）	476,526,520円
・ＤＣインデックスバランス（株式60）	447,780,159円
・ＤＣインデックスバランス（株式40）	233,573,191円
・インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	147,464,472円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	113,413,192円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	112,997,773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）	93,227,038円
・ＤＣインデックスバランス（株式20）	80,398,407円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	76,175,076円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	26,918,914円
・グローバル3倍3分法ファンド（適格機関投資家向け）	25,916,934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	18,815,844円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	7,218,871円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	6,309,667円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	5,282,446円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,311,945円

(注) １口当たり純資産額は2.3897円です。

○損益の状況 (2017年10月27日～2018年10月26日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	1,819,024,653
受取配当金	1,816,773,250
受取利息	108,530
その他収益金	2,730,301
支払利息	△ 587,428
(B) 有価証券売買損益	△ 1,230,835,927
売買益	7,235,798,635
売買損	△ 8,466,634,562
(C) 先物取引等取引損益	2,164,992
取引益	191,052,883
取引損	△ 188,887,891
(D) 保管費用等	△ 25,843,462
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	564,510,256
(F) 前期繰越損益金	47,678,451,803
(G) 追加信託差損益金	9,349,844,169
(H) 解約差損益金	△ 4,836,403,258
(I) 計(E＋F＋G＋H)	52,756,402,970
次期繰越損益金(I)	52,756,402,970

(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し処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2017年10月27日から2018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、つみたてＮＩＳＡの対象商品に係る登録要件に適合させるため、当該マザーファンドにて行なうデリバティブ取引および外国為替予約取引の利用目的を明確化するべく、2018年９月26日付けにて信託約款に所要の変更を行ないました。（付表、第14条、第15条、第16条、第21条）

海外株式インデックスMSCI-KOKUSAI（ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日　2018年10月26日）
（2017年10月27日～2018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(円ヘッジあり・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(円ヘッジあり・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が信託財産の純資産総額を超えること、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額の合計額が外貨建資産の組入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

<935034>

【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（円ヘッジあり・円ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
15期(2014年10月27日)	11,758	9.5	86.29	6.9	90.2	8.5	2.1	1,885
16期(2015年10月26日)	12,676	7.8	91.19	5.7	92.3	5.9	2.4	2,569
17期(2016年10月26日)	13,080	3.2	92.01	0.9	91.5	5.8	2.5	3,224
18期(2017年10月26日)	15,480	18.3	106.32	15.6	92.7	5.4	2.4	5,537
19期(2018年10月26日)	15,732	1.6	105.75	△ 0.5	93.2	4.7	2.4	6,793

(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（円ヘッジあり・円ベース）とは、現地通貨ベースの指数を対円でヘッジし、円換算したものです。なお、2018年10月26日現在知りえた情報を基に弊社において日次で算出し、設定日を100として指数化しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		MSCI-KOKUSAIインデックス（円ヘッジあり・円ベース）		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率			
（期首）	円	%		%	%	%	%
2017年10月26日	15,480	－	106.32	－	92.7	5.4	2.4
10月末	15,603	0.8	107.14	0.8	91.7	5.4	2.4
11月末	15,796	2.0	108.22	1.8	90.4	7.0	2.4
12月末	16,078	3.9	110.01	3.5	89.5	7.5	2.3
2018年１月末	16,651	7.6	113.74	7.0	93.4	4.4	2.2
２月末	16,188	4.6	110.57	4.0	91.5	5.9	2.1
３月末	15,650	1.1	106.63	0.3	92.6	5.2	2.3
４月末	15,948	3.0	108.40	2.0	93.3	5.3	2.3
５月末	16,238	4.9	109.93	3.4	90.0	6.8	2.2
６月末	16,155	4.4	109.15	2.7	90.2	7.1	2.2
７月末	16,642	7.5	112.38	5.7	89.0	8.5	2.1
８月末	16,987	9.7	114.45	7.6	94.4	2.8	2.4
９月末	17,030	10.0	114.45	7.6	95.8	2.3	2.3
（期末）							
2018年10月26日	15,732	1.6	105.75	△0.5	93.2	4.7	2.4

(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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

基準価額の推移

期間の初め15,480円の基準価額は、期間末に15,732円となり、騰落率は＋1.6%となりました。

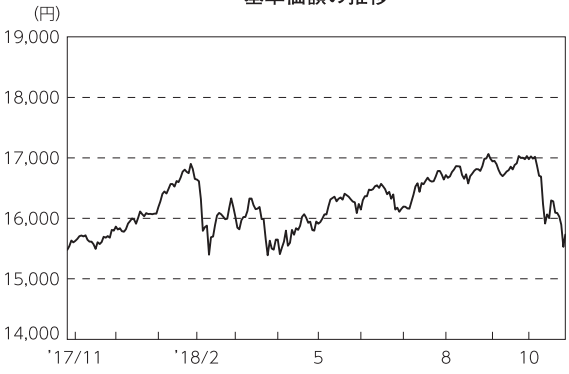
基準価額の変動要因

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＞
・米国や欧州の主要企業の決算が市場予想を上回ったこと。
・米国において法人税の減税実施による景気の押し上げ期待が高まったこと。
・米国が発動した中国製品に対する追加関税が景気に配慮した税率にとどまったこと。

＜値下がり要因＞
・米国と中国の間の貿易摩擦の激化が懸念されたこと。
・堅調な景気拡大のなか、欧米主要国の長期金利が上昇したこと。

基準価額の推移



期　首	期中高値	期中安値	期　末
2017/10/26	2018/08/30	2018/03/26	2018/10/26
15,480円	17,064円	15,389円	15,732円

MSCI-KOKUSAIインデックス
（円ヘッジあり・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、米国と欧州各国の株価は総じて下落しました。

期間の初めから2018年１月中旬にかけては、市場予想を上回る米国の主要経済指標の発表や、法人税率引き下げの実現の可能性が高まったことにより米国経済への楽観的な見方が広がったこと、英国と欧州連合（ＥＵ）が離脱交渉の前進に向けて合意したことなどから、米国と欧州各国の株価は総じて上昇しました。

１月下旬から３月下旬にかけては、インフレ上昇の兆しが見られるなか、発表された米国の経済指標が堅調な景気拡大を示す内容であったことなどを背景に、欧米主要国の長期金利が上昇したことや、米国の保護主義的な貿易政策に対する警戒感や投資家のリスク回避姿勢が強まったことを受けて、米国と欧州各国の株価は総じて下落しました。

４月上旬から６月下旬にかけては、米国連邦公開市場委員会（ＦＯＭＣ）議事要旨を受けて追加利上げペースの加速懸念が後退したことや、発表された米国と欧州企業の決算が市場予想を上回ったことなどが株価の上昇要因となったものの、イタリアやスペインの政局不安が高まったことや米朝首脳会談の中止の発表などから地政学的リスクが意識されたこと、米国と中国の貿易摩擦が激化し世界経済や企業業績に悪影響を及ぼすとの懸念が高まったことなどが株価の下落要因となり、米国と欧州各国の株価はまちまちの動きとなりました。

７月上旬から９月下旬にかけては、米国大統領が自動車関税をゼロとするとのＥＵの提案を拒否したことなどは株価の下落要因となったものの、米国が発動した中国製品に対する追加関税が景気に配慮した税率にとどまったとの見方から両国の対立激化への懸念が後退したことなどを背景に、米国と欧州各国の株価は概して上昇しました。

10月上旬から期間末にかけては、米国の良好な内容の経済指標による米国長期金利の急激な上昇を警戒して、米国と欧州各国の株価は総じて下落しました。

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。

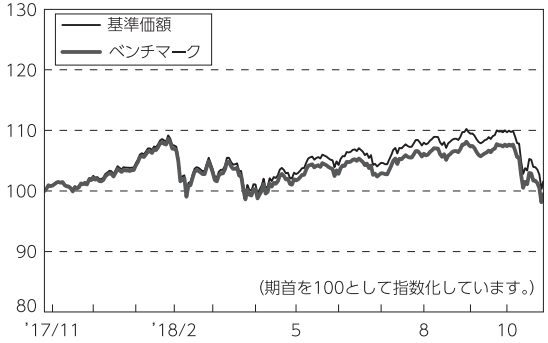
なお、外貨建資産は、原則として100%程度の為替ヘッジを行ないました。

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1.6%の値上がりとなり、ベンチマークである「MSCI-KOKUSAIインデックス(円ヘッジあり・円ベース)」の下落率0.5%を概ね2.2%上回りました。

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。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



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

＜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。
・株式の組入れに基づく要因が影響したこと。

○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ないます。

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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	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）	(4)	(0.022)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
（先物・オプション）	(0)	(0.003)	
(b) 有価証券取引税	2	0.012	(b)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(2)	(0.011)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	17	0.105	(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）	(16)	(0.097)	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）	(1)	(0.008)	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	23	0.143	
期中の平均基準価額は、16,247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

（2017年10月27日～2018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 971 (33)	千アメリカドル 7,965 (33)	百株 56 (9)	千アメリカドル 373 (57)
	カナダ	 167 (10)	千カナダドル 607 (46)	 2 (11)	千カナダドル 5 (46)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	84 (12)	498 (△ 2)	16 (－)	71 (2)
	イタリア	216 (28)	112 (－)	11 (28)	4 (0.01)
	フランス	113 (－)	451 (△ 2)	3 (－)	7 (3)
	オランダ	45 (△ 16)	140 (△ 30)	7	6
	スペイン	244 (506)	151 (3)	520 (－)	31 (3)
	ベルギー	5	49	－	－
	オーストリア	－ (－)	－ (△0.601)	－	－
	ルクセンブルク	3	10	3	5
	フィンランド	40 (8)	57 (－)	－	－
	アイルランド	4	17	－	－
	イギリス	－ (16)	－ (30)	2 (16)	9 (30)
	スイス	4	9	－	－
	イギリス	1,162 (4,361)	千イギリスポンド 697 (25)	161 (3,037)	千イギリスポンド 48 (22)
	スイス	77 (4)	千スイスフラン 406 (21)	－ (2)	千スイスフラン － (29)
	スウェーデン	65 (33)	千スウェーデンクローナ 961 (155)	20 (－)	千スウェーデンクローナ 52 (155)
	ノルウェー	26	千ノルウェークローネ 260	－	千ノルウェークローネ －
	デンマーク	16	千デンマーククローネ 617	－	千デンマーククローネ －

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
外国	オーストラリア	百株 171 (21)	千オーストラリアドル 427 (11)	百株 4 (8)	千オーストラリアドル 0.585 (2)
	ニュージーランド	46	千ニュージーランドドル 16	－	千ニュージーランドドル －
	香港	250 (37)	千香港ドル 1,141 (90)	－ (－)	千香港ドル － (90)
	シンガポール	161	千シンガポールドル 99	－	千シンガポールドル －

(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 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
外国	アメリカ	口	千アメリカドル	口	千アメリカドル
	PROLOGIS INC	150	9	－	－
	AMERICAN TOWER CORP	196	28	－	－
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	75	12	－	－
	BOSTON PROPERTIES INC	101	13	－	－
	BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A	－ (1,142)	－ (23)	750	14
	CROWN CASTLE INTL CORP	272	30	－	－
	DIGITAL REALTY TRUST INC	146	15	－	－
	EQUITY RESIDENTIAL-REIT	148	8	－	－
	EQUINIX INC	25	10	－	－
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	43	9	－	－
	FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT	84	10	－	－
	GGP INC	－	－	－ (1,159)	－ (23)
	HCP INC	557	14	－	－
	WELLTOWER INC	183	11	－	－
	HOST HOTELS & RESORTS INC	419	8	－	－
	KIMCO REALTY CORPORATION	648	10	－	－
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	102	10	－	－
	PUBLIC STORAGE	54	11	－	－
	REALTY INCOME CORP	277	13	－	－
	SIMON PROPERTY GROUP INC	47	8	－	－
	UDR INC	267	10	－	－
	VENTAS INC	219	10	－	－
	WEYERHAEUSER CO	337	11	－	－
	小計	4,350 (1,142)	273 (23)	750 (1,159)	14 (23)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	UNIBAIL-RODAMCO SE-NA	54 (△ 196)	9 (△ 38)	－	－
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	75	13	－	－
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD(N)	－ (196)	－ (38)	－	－
	小計	129	23	－	－
	ユーロ計	129	23	－	－
	イギリス		千イギリスポンド		千イギリスポンド
	BRITISH LAND COMPANY PLC	1,201	8	－	－
	HAMMERSON PLC	1,663	9	－	－
	小計	2,864	17	－	－
	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
	APA GROUP	－	－	－ (－)	－ (0.038)
	APA GROUP-RIGHTS SHARE-RTS	－	－	－ (142)	－ (0.038)

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
	オーストラリア	口	千オーストラリアドル	口	千オーストラリアドル
外国	APA GROUP-RTS(N)	－ (142)	－ (0.038)	－	－
	LENDLEASE GROUP	631	13	－	－
	SCENTRE GROUP	4,439	16	－	－
	WESTFIELD CORP	－	－	4,134	36
	小計	5,070 (142)	30 (0.038)	4,134 (142)	36 (0.076)

（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		百万円	百万円	百万円	百万円
	株式先物取引	2,732	2,728	－	－

（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

（2017年10月27日～2018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	1,421,828千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	5,863,003千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.24

（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10月27日～2018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。

○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10月27日～2018年10月26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

（2018年10月26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	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	7	9	180	20,285	資本財
ABBVIE INC	21	24	201	22,621	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ABBOTT LABORATORIES	23	29	196	22,155	ヘルスケア機器・サービス
ACCENTURE PLC-CL A	8	10	167	18,795	ソフトウェア・サービス
CHUBB LTD	6	7	89	10,043	保険
ACUITY BRANDS INC	0.69	0.69	8	925	資本財
ADVANCE AUTO PARTS INC	1	1	18	2,128	小売
AETNA INC	4	5	108	12,150	ヘルスケア機器・サービス
AFLAC INC	5	11	47	5,305	保険
AFFILIATED MANAGERS GROUP	0.74	1	15	1,690	各種金融
AGILENT TECHNOLOGIES INC	4	6	38	4,323	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	2	3	54	6,133	素材
ALLEGHANY CORP	0.27	0.27	15	1,770	保険
ALLSTATE CORP	4	5	53	6,004	保険
ALTRIA GROUP INC	25	30	192	21,673	食品・飲料・タバコ
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	0.56	0.93	18	2,119	ソフトウェア・サービス
ALLIANT ENERGY CORP	3	3	17	1,913	公益事業
ALBEMARLE CORP	1	1	15	1,770	素材
ALLEGION PLC	2	2	21	2,453	資本財
ALLY FINANCIAL INC	7	7	17	1,971	各種金融
AMPHENOL CORP-CL A	4	5	47	5,303	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AMERIPRISE FINANCIAL INC	2	2	32	3,675	各種金融
AMEREN CORPORATION	3	3	25	2,910	公益事業
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	12	13	57	6,491	保険
AMERICAN EXPRESS CO	10	11	118	13,341	各種金融
AMETEK INC	3	4	32	3,616	資本財
AMERICAN ELECTRIC POWER	6	7	58	6,542	公益事業
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2	3	33	3,772	公益事業
AMERISOURCEBERGEN CORP	2	3	30	3,403	ヘルスケア機器・サービス
ANADARKO PETROLEUM CORP	9	9	55	6,243	エネルギー
AON PLC	3	3	58	6,561	保険
APACHE CORP	6	6	25	2,887	エネルギー
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	8	8	41	4,681	食品・飲料・タバコ
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2	4	31	3,487	保険
ARAMARK	4	6	22	2,544	消費者サービス
ARCONIC INC	4	7	14	1,660	資本財
ARISTA NETWORKS INC	—	0.89	20	2,309	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
AT&T INC	80	117	352	39,676	電気通信サービス
ATMOS ENERGY CORP	1	1	18	2,129	公益事業
AUTOLIV INC	1	2	19	2,168	自動車・自動車部品
AUTOZONE INC	0.4	0.53	39	4,411	小売
BALL CORP	4	7	33	3,775	素材
BANK OF AMERICA CORP	130	156	416	46,844	銀行
BAXTER INTERNATIONAL INC	7	9	65	7,347	ヘルスケア機器・サービス
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	12	17	79	8,995	各種金融
BAKER HUGHES A GE CO	5	8	24	2,742	エネルギー
BB&T CORP	10	12	60	6,783	銀行
BECTON DICKINSON AND CO	3	4	105	11,844	ヘルスケア機器・サービス
BEST BUY CO INC	3	3	25	2,886	小売
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	16	20	419	47,159	各種金融
BLACKROCK INC	1	1	74	8,331	各種金融
BOSTON SCIENTIFIC CORP	18	22	82	9,253	ヘルスケア機器・サービス
BOEING CO/THE	7	9	335	37,681	資本財
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	22	27	133	15,054	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	2	2	32	3,659	ソフトウェア・サービス
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	3	5	27	3,051	食品・飲料・タバコ
BUNGE LTD	2	2	13	1,502	食品・飲料・タバコ
CARMAX INC	3	3	24	2,717	小売
CARDINAL HEALTH INC	5	5	25	2,893	ヘルスケア機器・サービス
CATERPILLAR INC	8	10	118	13,356	資本財
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	6	8	70	7,952	各種金融
CARNIVAL CORP	4	8	45	5,119	消費者サービス
CABOT OIL & GAS CORP	7	7	16	1,860	エネルギー
CAMPBELL SOUP CO	3	3	12	1,421	食品・飲料・タバコ
CBRE GROUP INC - A	3	6	23	2,676	不動産
CBS CORP-CLASS B NON VOTING	5	5	30	3,419	メディア・娯楽
CENTENE CORP	2	3	51	5,736	ヘルスケア機器・サービス
CELANESE CORP	2	2	24	2,721	素材
CENTERPOINT ENERGY INC	4	8	23	2,590	公益事業
CENTURYLINK INC	13	18	38	4,357	電気通信サービス
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2	4	20	2,332	素材
CHURCH & DWIGHT CO INC	3	5	32	3,666	家庭用品・パーソナル用品
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	0.39	0.39	16	1,859	消費者サービス
CHEVRON CORP	24	30	345	38,865	エネルギー
CIT GROUP INC	3	3	16	1,841	銀行
CIGNA CORP	3	3	79	8,896	ヘルスケア機器・サービス
CITIGROUP INC	36	41	267	30,039	銀行
CIMAREX ENERGY CO	2	2	20	2,310	エネルギー
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5	8	31	3,515	銀行
CLOROX COMPANY	1	2	39	4,449	家庭用品・パーソナル用品
CMS ENERGY CORP	4	4	24	2,716	公益事業
CONCHO RESOURCES INC	2	3	50	5,658	エネルギー
COLGATE-PALMOLIVE CO	11	13	83	9,338	家庭用品・パーソナル用品
CONOCOPHILLIPS	17	19	132	14,902	エネルギー
TAPESTRY INC	4	4	19	2,194	耐久消費財・アパレル
COMERICA INC	2	3	27	3,092	銀行
CONAGRA BRANDS INC	6	9	32	3,681	食品・飲料・タバコ
COCA-COLA CO/THE	53	65	303	34,121	食品・飲料・タバコ
CONSOLIDATED EDISON INC	3	4	38	4,293	公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	2	3	64	7,263	食品・飲料・タバコ
CORNING INC	11	14	46	5,203	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	5	25	2,829	食品・飲料・タバコ
CROWN HOLDINGS INC	2	2	11	1,287	素材
CSX CORP	11	13	89	10,028	運輸
CUMMINS INC	2	2	31	3,551	資本財
CVS HEALTH CORP	13	16	119	13,384	ヘルスケア機器・サービス
DAVITA INC	2	2	16	1,910	ヘルスケア機器・サービス
DARDEN RESTAURANTS INC	2	2	22	2,585	消費者サービス
DANAHER CORP	8	10	104	11,795	ヘルスケア機器・サービス
DEVON ENERGY CORPORATION	6	8	29	3,321	エネルギー
DEERE & CO	3	5	75	8,491	資本財
DELTA AIR LINES INC	3	3	18	2,071	運輸
APTIV PLC	4	5	39	4,452	自動車・自動車部品
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	1	3	30	3,412	ソフトウェア・サービス
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	5	6	48	5,509	各種金融
DOMINO'S PIZZA INC	0.93	0.93	24	2,738	消費者サービス
DOMINION RESOURCES INC/VA	8	10	72	8,204	公益事業
DOLLAR GENERAL CORP/OLD	3	4	54	6,181	小売
DOVER CORP	2	3	28	3,253	資本財
DOWDUPONT INC	30	37	197	22,206	素材
KEURIG DR PEPPER INC	2	—	—	—	食品・飲料・タバコ
DR HORTON INC	5	5	20	2,303	耐久消費財・アパレル
DTE ENERGY COMPANY	1	3	37	4,179	公益事業
DUKE ENERGY CORP	9	10	90	10,140	公益事業

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	
DXC TECHNOLOGY CO	3	5	42	4,834	ソフトウェア・サービス
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	1	2	22	2,576	素材
EATON CORP PLC	5	7	53	6,025	資本財
ECOLAB INC	3	4	69	7,833	素材
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2	3	50	5,723	ヘルスケア機器・サービス
EDISON INTERNATIONAL	4	4	30	3,476	公益事業
EMERSON ELECTRIC CO	8	10	69	7,856	資本財
ENTERGY CORP	2	2	22	2,563	公益事業
EOG RESOURCES INC	8	9	103	11,614	エネルギー
EQUIFAX INC	1	1	18	2,133	商業・専門サービス
EQT CORP	1	4	15	1,721	エネルギー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2	3	45	5,075	家庭用品・パーソナル用品
EVEREST RE GROUP LTD	0.83	0.83	17	1,937	保険
EXXON MOBIL CORP	54	68	539	60,719	エネルギー
EXELON CORP	10	15	66	7,466	公益事業
FEDEX CORP	3	4	93	10,531	運輸
FIRST REPUBLIC BANK/CA	2	3	31	3,513	銀行
FIRSTENERGY CORP	5	8	32	3,609	公益事業
FIDELITY NATIONAL INFORMATIO	4	5	61	6,864	ソフトウェア・サービス
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	1	1	30	3,443	ソフトウェア・サービス
FLUOR CORP	1	3	14	1,652	資本財
TECHNIPFMC PLC	7	7	19	2,172	エネルギー
FMC CORP	2	2	19	2,155	素材
FNF GROUP	4	4	14	1,622	保険
FORD MOTOR COMPANY	55	55	49	5,578	自動車・自動車部品
FOOT LOCKER INC	2	—	—	—	小売
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	3	3	16	1,825	資本財
FORTIVE CORP	4	5	43	4,927	資本財
NEXTERA ENERGY INC	6	7	128	14,415	公益事業
FRANKLIN RESOURCES INC	4	4	14	1,623	各種金融
FREEPORT-MCMORAN INC	21	21	24	2,764	素材
GAP INC/THE	2	4	12	1,455	小売
GENERAL MOTORS CORP	19	19	62	7,021	自動車・自動車部品
GENUINE PARTS CO	2	3	32	3,699	小売
GENERAL ELECTRIC CO	112	141	167	18,837	資本財
GENERAL DYNAMICS CORP	3	4	73	8,269	資本財
GENERAL MILLS INC	7	8	39	4,436	食品・飲料・タバコ
GLOBAL PAYMENTS INC	2	2	30	3,414	ソフトウェア・サービス
GOLDMAN SACHS GROUP INC	4	5	127	14,369	各種金融
WW GRAINGER INC	0.71	0.71	19	2,165	資本財
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	5	7	32	3,631	保険
HALLIBURTON CO	11	13	46	5,263	エネルギー
HANESBRANDS INC	4	4	7	887	耐久消費財・アパレル
HARRIS CORP	1	2	39	4,455	資本財
HARLEY-DAVIDSON INC	1	4	15	1,754	自動車・自動車部品
HCA HEALTHCARE INC	3	4	62	7,059	ヘルスケア機器・サービス
HERSHEY CO/THE	1	2	25	2,880	食品・飲料・タバコ
HESS CORP	4	6	36	4,126	エネルギー
HELMERICH & PAYNE	2	2	18	2,026	エネルギー
HP INC	22	30	73	8,262	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HEWLETT PACKARD ENTERPRIS	21	27	41	4,638	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3	5	39	4,497	消費者サービス
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	9	12	179	20,169	資本財
HOME DEPOT INC	15	18	338	38,084	小売
HORMEL FOODS CORP	3	6	29	3,265	食品・飲料・タバコ
HOLLYFRONTIER CORP	—	2	18	2,081	エネルギー
HUMANA INC	1	2	69	7,848	ヘルスケア機器・サービス
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	0.77	0.77	16	1,896	資本財
INTL BUSINESS MACHINES CORP	11	14	185	20,891	ソフトウェア・サービス
IDEX CORP	2	2	26	2,939	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
ILLINOIS TOOL WORKS	4	4	57	6,512	資本財
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	1	1	18	2,074	素材
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	7	7	16	1,873	メディア・娯楽
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6	10	76	8,653	各種金融
INVESCO LTD	6	9	21	2,398	各種金融
INTERNATIONAL PAPER CO	5	7	34	3,897	素材
INGERSOLL-RAND PLC	3	5	48	5,414	資本財
INGREDION INC	1	1	18	2,095	食品・飲料・タバコ
JM SMUCKER CO/THE	2	2	22	2,528	食品・飲料・タバコ
JOHNSON & JOHNSON	35	43	604	68,041	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JPMORGAN CHASE & CO	47	55	582	65,489	銀行
JUNIPER NETWORKS INC	4	8	22	2,582	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
KANSAS CITY SOUTHERN	1	1	16	1,866	運輸
KEYCORP	17	17	30	3,385	銀行
KELLOGG CO	4	4	30	3,388	食品・飲料・タバコ
KIMBERLY-CLARK CORP	4	5	61	6,962	家庭用品・パーソナル用品
KINDER MORGAN INC	23	30	50	5,719	エネルギー
KROGER CO	11	11	33	3,769	食品・生活必需品小売り
L3 TECHNOLOGIES INC	1	1	29	3,356	資本財
LAS VEGAS SANDS CORP	5	7	38	4,381	消費者サービス
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1	1	26	2,959	ヘルスケア機器・サービス
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	5	5	10	1,231	各種金融
LENNAR CORP-CL A	3	5	22	2,526	耐久消費財・アパレル
LEAR CORP	1	1	22	2,507	自動車・自動車部品
ELI LILLY & CO	13	16	176	19,900	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
LINCOLN NATIONAL CORP	2	4	24	2,728	保険
L BRANDS INC	2	4	13	1,472	小売
LOCKHEED MARTIN CORP	3	4	130	14,715	資本財
LOWE'S COS INC	12	13	135	15,290	小売
LOEWS CORP	3	5	26	2,958	保険
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4	5	49	5,588	素材
M & T BANK CORP	1	2	36	4,114	銀行
MARATHON OIL CORP	10	17	33	3,759	エネルギー
MASTERCARD INC	12	15	314	35,368	ソフトウェア・サービス
MACY'S INC	4	4	14	1,644	小売
MARSH & MCLENNAN COS	6	7	63	7,104	保険
MARTIN MARIETTA MATERIALS	0.94	0.94	15	1,712	素材
MASCO CORP	4	6	20	2,310	資本財
MARKEL CORP	0.19	0.27	29	3,271	保険
MARATHON PETROLEUM CORP	6	12	85	9,646	エネルギー
MALLINCKRODT PLC	1	—	—	—	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	1	2	37	4,162	食品・飲料・タバコ
MCDONALD'S CORP	10	12	225	25,375	消費者サービス
S&P GLOBAL INC	3	3	70	7,950	各種金融
MCKESSON CORP	3	3	37	4,225	ヘルスケア機器・サービス
METLIFE INC	13	13	53	6,020	保険
MERCK & CO. INC.	36	44	308	34,707	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MEDTRONIC PLC	18	21	200	22,508	ヘルスケア機器・サービス
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	0.38	0.51	27	3,076	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MGM RESORTS INTERNATIONAL	7	11	29	3,280	消費者サービス
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	1	3	18	2,035	耐久消費財・アパレル
MICRON TECHNOLOGY INC	12	20	74	8,368	半導体・半導体製造装置
MOLSON COORS BREWING CO -B	2	3	22	2,486	食品・飲料・タバコ
MOHAWK INDUSTRIES INC	1	1	18	2,038	耐久消費財・アパレル
MOSAIC CO/THE	5	8	26	2,975	素材
MORGAN STANLEY	17	22	101	11,383	各種金融
MONSANTO CO	5	—	—	—	素材
MOODY'S CORP	2	2	45	5,127	各種金融
MOTOROLA SOLUTIONS INC	3	3	41	4,664	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MSCI INC	2	2	30	3,392	各種金融

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	4	7	27	3,059	エネルギー
NEWFIELD EXPLORATION CO	3	3	7	878	エネルギー
NEWMONT MINING CORP	7	7	22	2,580	素材
NEWELL BRANDS INC	5	5	9	1,104	耐久消費財・アパレル
NIKE INC -CL B	18	21	157	17,725	耐久消費財・アパレル
NIELSEN HOLDINGS PLC	5	5	13	1,512	商業・専門サービス
NORDSTROM INC	1	—	—	—	小売
NORTHROP GRUMMAN CORP	2	2	68	7,682	資本財
NORFOLK SOUTHERN CORP	3	5	82	9,254	運輸
NOBLE ENERGY INC	7	7	19	2,139	エネルギー
EVERSOURCE ENERGY	4	4	31	3,487	公益事業
NUCOR CORP	4	6	35	4,037	素材
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	10	12	86	9,720	エネルギー
OMNICOM GROUP	3	5	36	4,123	メディア・娯楽
ONEOK INC	4	7	46	5,275	エネルギー
ORACLE CORP	39	49	238	26,813	ソフトウェア・サービス
P G & E CORP	6	9	43	4,842	公益事業
PARKER HANNIFIN CORP	2	2	38	4,355	資本財
PACKAGING CORP OF AMERICA	1	1	17	1,922	素材
PALO ALTO NETWORKS INC	0.95	1	30	3,408	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
PEPSICO INC	18	22	257	28,938	食品・飲料・タバコ
PENTAIR PLC	3	3	12	1,397	資本財
PERRIGO CO PLC	2	2	15	1,769	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PFIZER INC	77	95	414	46,587	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PVH CORP	1	1	22	2,538	耐久消費財・アパレル
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	19	25	227	25,584	食品・飲料・タバコ
PHILLIPS 66	5	7	72	8,174	エネルギー
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2	2	45	5,079	エネルギー
PINNACLE WEST CAPITAL	1	3	26	3,029	公益事業
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	6	7	89	10,050	銀行
POLARIS INDUSTRIES INC	0.85	0.85	7	826	耐久消費財・アパレル
PPL CORP	7	11	36	4,079	公益事業
PPG INDUSTRIES INC	3	4	49	5,610	素材
PROCTER & GAMBLE CO	33	40	361	40,689	家庭用品・パーソナル用品
PRAXAIR INC	3	9	149	16,813	素材
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3	5	25	2,868	保険
PROGRESSIVE CORP	6	10	71	8,089	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	6	6	58	6,523	保険
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	6	8	49	5,584	公益事業
QUEST DIAGNOSTICS	2	3	28	3,193	ヘルスケア機器・サービス
IQVIA HOLDINGS INC	1	2	33	3,803	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
RANGE RESOURCES CORP	1	—	—	—	エネルギー
RAYTHEON COMPANY	3	4	87	9,807	資本財
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	2	2	17	1,971	各種金融
REGIONS FINANCIAL CORP	19	19	31	3,504	銀行
RED HAT INC	2	3	38	4,310	ソフトウェア・サービス
REPUBLIC SERVICES INC	3	5	34	3,874	商業・専門サービス
RESMED INC	2	2	23	2,636	ヘルスケア機器・サービス
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	1	1	24	2,710	保険
ROCKWELL AUTOMATION INC	1	2	37	4,215	資本財
ROPER TECHNOLOGIES INC	1	1	47	5,371	資本財
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	2	3	37	4,224	消費者サービス
ROCKWELL COLLINS INC.	2	2	38	4,274	資本財
WESTROCK CO	3	5	23	2,626	素材
SALESFORCE.COM INC	8	12	169	19,050	ソフトウェア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	19	23	124	13,979	エネルギー
SCANA CORP	2	2	8	912	公益事業
SCHWAB (CHARLES) CORP	17	21	91	10,300	各種金融
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	3	3	15	1,691	資本財
SEALED AIR CORP	3	3	9	1,046	素材

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
SEMPRA ENERGY	2	4	50	5,692	公益事業
SERVICENOW INC	2	3	54	6,174	ソフトウェア・サービス
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	1	1	57	6,498	素材
SMITH (A.O.) CORP	3	3	16	1,880	資本財
SNAP-ON INC	0.86	1	22	2,563	資本財
SOUTHERN CO	13	15	68	7,739	公益事業
SQUARE INC - A	—	4	35	3,959	ソフトウェア・サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	2	2	27	3,087	資本財
STRYKER CORP	4	5	87	9,814	ヘルスケア機器・サービス
STATE STREET CORP	4	5	39	4,423	各種金融
SUNTRUST BANKS INC	6	8	50	5,710	銀行
SYSCO CORP	5	9	67	7,540	食品・生活必需品小売り
SYNCHRONY FINANCIAL	10	10	31	3,560	各種金融
TARGET CORP	6	8	69	7,806	小売
TARGA RESOURCES CORP	2	4	25	2,843	エネルギー
TD AMERITRADE HOLDING CORP	4	6	31	3,533	各種金融
ANDEAVOR	2	—	—	—	エネルギー
TEXTRON INC	3	5	27	3,064	資本財
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	11	17	36	4,059	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TELEFLEX INC	1	1	24	2,752	ヘルスケア機器・サービス
THE WALT DISNEY CO.	20	24	280	31,508	メディア・娯楽
COOPER COS INC/THE	0.69	1	27	3,127	ヘルスケア機器・サービス
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	5	6	158	17,837	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TIFFANY & CO	1	2	24	2,739	小売
TIME WARNER INC	10	—	—	—	メディア・娯楽
TJX COMPANIES INC	9	10	112	12,684	小売
TORCHMARK CORP	2	2	17	2,008	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	3	3	32	3,676	ソフトウェア・サービス
TRAVELERS COS INC/THE	2	4	52	5,863	保険
TRANSDIGM GROUP INC	0.64	0.94	30	3,466	資本財
TRANSUNION	—	3	20	2,284	商業・専門サービス
TWITTER INC	10	10	33	3,751	ソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	4	4	27	3,073	食品・飲料・タバコ
TE CONNECTIVITY LTD	5	6	47	5,329	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	11	13	44	5,003	資本財
UGI CORP	3	3	17	1,936	公益事業
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	1	—	—	—	耐久消費財・アパレル
UNUM GROUP	3	4	16	1,863	保険
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	9	11	123	13,860	運輸
UNITED TECHNOLOGIES CORP	10	12	155	17,433	資本財
UNION PACIFIC CORP	10	12	184	20,768	運輸
UNITEDHEALTH GROUP INC	12	15	414	46,658	ヘルスケア機器・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	1	1	22	2,515	ヘルスケア機器・サービス
UNITED RENTALS INC	1	1	14	1,627	資本財
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	4	4	6	777	耐久消費財・アパレル
US BANCORP	22	25	132	14,871	銀行
VF CORP	4	6	50	5,624	耐久消費財・アパレル
WORLDPAY INC-CLASS A	3	4	45	5,077	ソフトウェア・サービス
VALERO ENERGY CORP	5	7	66	7,498	エネルギー
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1	2	26	2,988	ヘルスケア機器・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS INC	52	66	377	42,433	電気通信サービス
VISA INC-CLASS A SHARES	24	29	412	46,401	ソフトウェア・サービス
VOYA FINANCIAL INC	3	3	13	1,527	各種金融
VULCAN MATERIALS CO	1	2	23	2,607	素材
WALMART INC	19	23	234	26,358	食品・生活必需品小売り
WATERS CORP	1	1	31	3,552	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALLERGAN PLC	4	5	104	11,720	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
WASTE MANAGEMENT INC	5	8	69	7,776	商業・専門サービス
WABTEC CORP	1	1	13	1,567	資本財
WASTE CONNECTIONS INC	4	4	33	3,800	商業・専門サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
WESTERN UNION CO	6	11	20	2,311	ソフトウェア・サービス
WELLS FARGO & CO	61	75	389	43,844	銀行
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	7	－	－	－	エネルギー
ANTHEM INC	3	4	118	13,285	ヘルスケア機器・サービス
WHIRLPOOL CORP	1	1	14	1,640	耐久消費財・アパレル
WILLIAMS COS INC	12	15	39	4,451	エネルギー
WEC ENERGY GROUP INC	4	4	33	3,715	公益事業
WORKDAY INC-CLASS A	1	2	30	3,439	ソフトウェア・サービス
WYNDHAM DESTINATIONS INC	1	－	－	－	消費者サービス
XCEL ENERGY INC	5	8	42	4,753	公益事業
XL GROUP LTD	3	－	－	－	保険
XPO LOGISTICS INC	－	2	18	2,100	運輸
XYLEM INC	3	3	26	2,947	資本財
YUM! BRANDS INC	5	5	49	5,572	消費者サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2	3	43	4,863	ヘルスケア機器・サービス
ZOETIS INC	6	7	71	8,048	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CHENIERE ENERGY INC	－	3	21	2,363	エネルギー
NVR INC	0.08	0.08	17	1,947	耐久消費財・アパレル
ABIOMED INC	－	0.7	23	2,622	ヘルスケア機器・サービス
ACTIVISION BLIZZARD INC	8	12	89	10,107	ソフトウェア・サービス
ADOBE INC	6	8	211	23,752	ソフトウェア・サービス
ADVANCED MICRO DEVICES	10	17	34	3,846	半導体・半導体製造装置
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	1	3	22	2,576	ソフトウェア・サービス
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2	3	41	4,638	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ALIGN TECHNOLOGY INC	1	1	33	3,810	ヘルスケア機器・サービス
AMAZON.COM INC	5	6	1,215	136,700	小売
AMGEN INC	10	11	210	23,715	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ANALOG DEVICES INC	5	7	55	6,297	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	1	1	25	2,840	ソフトウェア・サービス
APPLE INC	68	80	1,779	200,115	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
APPLIED MATERIALS INC	15	17	55	6,262	半導体・半導体製造装置
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1	8	22	2,501	保険
AUTOMATIC DATA PROCESSING	5	6	97	10,950	ソフトウェア・サービス
AUTODESK INC	3	4	55	6,272	ソフトウェア・サービス
BIOGEN INC	3	3	101	11,447	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2	3	34	3,915	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BROADCOM INC	5	6	152	17,096	半導体・半導体製造装置
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	1	－	－	－	保険
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	1	2	24	2,733	運輸
CA INC	6	6	28	3,199	ソフトウェア・サービス
CADENCE DESIGN SYS INC	6	6	27	3,145	ソフトウェア・サービス
CDW CORP/DE	3	3	27	3,052	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CELGENE CORP	10	11	83	9,421	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
CERNER CORP	3	5	34	3,869	ヘルスケア機器・サービス
CHECK POINT SOFTWARE TECH	1	2	31	3,574	ソフトウェア・サービス
CHARTER COMMUNICATION-A	2	2	87	9,878	メディア・娯楽
CINTAS CORP	1	1	33	3,750	商業・専門サービス
CISCO SYSTEMS INC	66	78	357	40,155	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2	2	18	2,025	保険
CITRIX SYSTEMS INC	2	2	26	2,961	ソフトウェア・サービス
CME GROUP INC	4	5	104	11,776	各種金融
COMCAST CORP-CLASS A	62	76	272	30,691	メディア・娯楽
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	7	9	66	7,508	ソフトウェア・サービス
COSTCO WHOLESALE CORP	5	7	165	18,639	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	0.8	0.8	28	3,224	商業・専門サービス
DENTSPLY SIRONA INC	2	4	15	1,697	ヘルスケア機器・サービス
DISH NETWORK CORP-A	3	3	9	1,119	メディア・娯楽
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	6	6	19	2,203	メディア・娯楽
DIAMONDBACK ENERGY INC	－	1	19	2,171	エネルギー
DOLLAR TREE INC	3	4	37	4,164	小売

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
E*TRADE FINANCIAL CORP	4	4	22	2,562	各種金融
EAST WEST BANCORP INC	3	3	16	1,903	銀行
EBAY INC	13	15	44	4,983	小売
PAYPAL HOLDINGS INC	15	19	165	18,639	ソフトウェア・サービス
ELECTRONIC ARTS INC	3	5	56	6,345	ソフトウェア・サービス
EXPEDIA INC	1	2	24	2,776	小売
EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO	7	9	92	10,398	ヘルスケア機器・サービス
EXPEDITORS INTL WASH INC	4	4	28	3,180	運輸
F5 NETWORKS INC	1	1	18	2,121	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
FACEBOOK INC-A	30	39	601	67,637	ソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	4	4	22	2,534	資本財
FISERV INC	3	7	62	7,018	ソフトウェア・サービス
FIFTH THIRD BANCORP	11	11	29	3,270	銀行
FLEX LTD	10	10	11	1,317	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
GARTNER INC	1	1	25	2,857	ソフトウェア・サービス
GILEAD SCIENCES INC	18	22	152	17,140	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	4	4	9	1,059	自動車・自動車部品
ALPHABET INC-CL A	3	4	548	61,688	ソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL C	4	5	571	64,320	ソフトウェア・サービス
HASBRO INC	1	2	26	2,944	耐久消費財・アパレル
HENRY SCHEIN INC	2	2	21	2,415	ヘルスケア機器・サービス
HOLOGIC INC	3	6	26	2,968	ヘルスケア機器・サービス
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	1	1	18	2,125	運輸
HUNTINGTON BANCSHARES INC	17	23	31	3,564	銀行
IDEXX LABORATORIES INC	1	1	35	4,030	ヘルスケア機器・サービス
ILLUMINA INC	1	2	71	8,047	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INTUIT INC	3	4	89	10,066	ソフトウェア・サービス
INTEL CORP	61	76	339	38,203	半導体・半導体製造装置
INTUITIVE SURGICAL INC	1	1	97	10,976	ヘルスケア機器・サービス
INCYTE CORP	2	3	21	2,371	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	1	1	15	1,783	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
KLA-TENCOR CORPORATION	2	3	30	3,384	半導体・半導体製造装置
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	20	22	93	10,555	食品・飲料・タバコ
KRAFT HEINZ CO/THE	8	9	54	6,094	食品・飲料・タバコ
LAM RESEARCH CORP	1	2	36	4,152	半導体・半導体製造装置
LIBERTY GLOBAL PLC-SERIES C	11	11	27	3,129	メディア・娯楽
QURATE RETAIL INC	5	5	13	1,471	小売
LIBERTY BROADBAND-C	2	2	17	1,946	メディア・娯楽
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	6	6	24	2,701	メディア・娯楽
LKQ CORP	4	7	19	2,139	小売
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	5	5	27	3,112	半導体・半導体製造装置
MATTEL INC	3	—	—	—	耐久消費財・アパレル
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	4	4	54	6,109	消費者サービス
IHS MARKIT LTD	5	7	36	4,138	商業・専門サービス
T-MOBILE US INC	4	6	41	4,676	電気通信サービス
MERCADOLIBRE INC	0.75	0.75	22	2,510	小売
MICROSOFT CORP	96	120	1,301	146,348	ソフトウェア・サービス
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	3	4	25	2,847	半導体・半導体製造装置
MONSTER BEVERAGE CORP	5	7	41	4,689	食品・飲料・タバコ
MYLAN NV	5	10	31	3,501	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	16	16	74	8,409	メディア・娯楽
NETAPP INC	3	4	36	4,133	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TWENTY-FIRST CENTURY FOX - B	5	5	25	2,901	メディア・娯楽
NETFLIX INC	5	7	228	25,652	小売
NEWS CORP - CLASS A	5	11	15	1,718	メディア・娯楽
NEKTAR THERAPEUTICS	—	2	10	1,141	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NORTHERN TRUST CORP	3	4	39	4,403	各種金融
NVIDIA CORP	7	9	201	22,627	半導体・半導体製造装置
NXP SEMICONDUCTORS NV	4	6	47	5,374	半導体・半導体製造装置
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	1	1	48	5,402	小売

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千アメリカドル	千円	
PACCAR INC	5	5	31	3,540	資本財
PAYCHEX INC	4	6	42	4,833	ソフトウェア・サービス
BOOKING HOLDINGS INC	0.66	0.81	146	16,439	小売
QUALCOMM INC	19	24	155	17,493	半導体・半導体製造装置
REGENERON PHARMACEUTICALS	1	1	46	5,191	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ROSS STORES INC	5	6	63	7,166	小売
SEAGATE TECHNOLOGY	3	6	25	2,913	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SIRIUS XM HOLDINGS INC	33	33	19	2,195	メディア・娯楽
SKYWORKS SOLUTIONS INC	2	3	30	3,415	半導体・半導体製造装置
SPLUNK INC	—	2	22	2,496	ソフトウェア・サービス
STEEL DYNAMICS INC	—	4	16	1,833	素材
STARBUCKS CORP	19	22	130	14,674	消費者サービス
STERICYCLE INC	1	2	13	1,570	商業・専門サービス
SVB FINANCIAL GROUP	1	1	27	3,146	銀行
SYMANTEC CORP	7	10	20	2,300	ソフトウェア・サービス
SYNOPSYS INC	2	4	36	4,113	ソフトウェア・サービス
T ROWE PRICE GROUP INC	4	4	44	4,984	各種金融
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	—	1	23	2,674	ソフトウェア・サービス
TESLA INC	1	1	62	7,047	自動車・自動車部品
TEXAS INSTRUMENTS INC	13	16	151	17,071	半導体・半導体製造装置
TRIMBLE INC	4	4	18	2,050	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1	2	25	2,885	小売
ULTA BEAUTY INC	0.85	0.85	23	2,602	小売
VERISIGN INC	1	1	26	2,979	ソフトウェア・サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	3	4	75	8,474	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
VERISK ANALYTICS INC	2	3	37	4,200	商業・専門サービス
VIACOM INC-CLASS B	4	4	14	1,645	メディア・娯楽
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	12	14	106	11,959	食品・生活必需品小売り
WESTERN DIGITAL CORP	3	4	24	2,782	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1	2	32	3,634	保険
WYNN RESORTS LTD	1	2	21	2,449	消費者サービス
XILINX INC	3	5	43	4,875	半導体・半導体製造装置
ZIONS BANCORP NA	—	3	16	1,840	銀行
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	20	20	12	1,349	不動産
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	5	5	16	1,799	資本財
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	4	4	22	2,558	資本財
CBOE GLOBAL MARKETS INC	—	1	20	2,352	各種金融
小計 株数・金額	3,989	4,928	38,545	4,335,219	
小計 銘柄数<比率>	496	497	—	<63.8%>	
(カナダ)			千カナダドル		
AGNICO EAGLE MINES LTD	3	3	15	1,306	素材
AGRIUM INC	1	—	—	—	素材
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	5	8	54	4,666	食品・生活必需品小売り
BARRICK GOLD CORP	13	27	45	3,876	素材
BANK OF MONTREAL	8	9	97	8,416	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA	16	18	131	11,261	銀行
BAUSCH HEALTH COS INC	2	—	—	—	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BOMBARDIER INC 'B'	16	49	16	1,402	資本財
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	12	16	85	7,321	各種金融
CAMECO CORP	3	12	18	1,582	エネルギー
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	5	6	78	6,755	銀行
CANADIAN NATURAL RESOURCES	15	21	80	6,906	エネルギー
CANADIAN NATL RAILWAY CO	10	12	136	11,747	運輸
CANADIAN TIRE CORP-CLASS A	1	1	20	1,781	小売
CENOVUS ENERGY INC	13	13	15	1,314	エネルギー
CGI GROUP INC - CL A	3	6	47	4,050	ソフトウェア・サービス
CI FINANCIAL CORP	5	9	18	1,581	各種金融
CONSTELLATION SOFTWARE INC	0.3	0.44	37	3,252	ソフトウェア・サービス
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	2	2	71	6,106	運輸
CRESCENT POINT ENERGY CORP	10	10	7	637	エネルギー

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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
DOLLARAMA INC	1	5	21	1,820	小売
ENCANA CORP	15	22	31	2,690	エネルギー
ENBRIDGE INC	22	26	107	9,252	エネルギー
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	0.27	0.45	27	2,379	保険
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	—	12	13	1,132	素材
FORTIS INC	8	8	37	3,263	公益事業
FRANCO-NEVADA CORP	3	3	24	2,126	素材
GOLDCORP INC	13	13	14	1,280	素材
GREAT-WEST LIFECO INC	6	6	18	1,604	保険
HUSKY ENERGY INC	9	9	18	1,551	エネルギー
IMPERIAL OIL LTD	4	8	36	3,160	エネルギー
INTER PIPELINE LTD	7	12	26	2,316	エネルギー
INTACT FINANCIAL CORP	3	3	32	2,800	保険
LOBLAW COMPANIES LTD	4	4	29	2,562	食品・生活必需品小売り
MANULIFE FINANCIAL CORP	26	32	66	5,711	保険
MAGNA INTERNATIONAL INC	6	6	42	3,638	自動車・自動車部品
METRO INC	5	5	21	1,805	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	5	8	51	4,387	銀行
NUTRIEN LTD	—	10	71	6,110	素材
OPEN TEXT CORP	4	6	30	2,635	ソフトウェア・サービス
PEMBINA PIPELINE CORP	8	11	50	4,302	エネルギー
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN	9	—	—	—	素材
POWER CORP OF CANADA	9	9	25	2,197	保険
POWER FINANCIAL CORP	5	5	14	1,274	保険
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	3	5	39	3,404	消費者サービス
ROGERS COMMUNICATIONS INC-B	6	6	40	3,516	電気通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	19	22	217	18,685	銀行
SAPUTO INC	4	4	19	1,699	食品・飲料・タバコ
SHOPIFY INC - CLASS-A	—	1	27	2,320	ソフトウェア・サービス
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	6	12	29	2,566	メディア・娯楽
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	11	11	23	2,060	素材
SNC-LAVALIN GROUP INC	3	6	28	2,440	資本財
SUN LIFE FINANCIAL INC	10	10	50	4,382	保険
SUNCOR ENERGY INC	20	28	124	10,739	エネルギー
TELUS CORP	6	6	27	2,380	電気通信サービス
TECK RESOURCES LTD-CLS B	7	7	19	1,692	素材
THOMSON REUTERS CORP	6	6	37	3,181	各種金融
TORONTO-DOMINION BANK	24	29	213	18,392	銀行
TRANSCANADA CORP	11	16	84	7,224	エネルギー
小計 株数・金額	477	642	2,776	238,661	
小計 銘柄数＜比率＞	56	56	—	＜3.5%＞	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	2	3	69	8,903	耐久消費財・アパレル
ALLIANZ SE-REG	5	7	138	17,651	保険
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	4	5	42	5,409	自動車・自動車部品
BASF SE	12	15	105	13,471	素材
BAYER AG-REG	11	15	105	13,486	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
BEIERSDORF AG	1	2	23	2,947	家庭用品・パーソナル用品
BRENNTAG AG	2	4	18	2,348	資本財
COMMERZBANK AG	18	18	15	1,919	銀行
CONTINENTAL AG	1	1	25	3,239	自動車・自動車部品
COVESTRO AG	—	3	17	2,222	素材
DAIMLER AG	11	15	79	10,102	自動車・自動車部品
DEUTSCHE BOERSE AG	2	3	36	4,642	各種金融
DEUTSCHE BANK AG-REGISTERED	30	30	26	3,399	各種金融
DEUTSCHE POST AG-REG	13	15	44	5,726	運輸
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	45	55	80	10,268	電気通信サービス
DEUTSCHE WOHNEN SE	5	7	29	3,818	不動産
VONOVIA SE	9	9	37	4,738	不動産
E.ON SE	32	44	38	4,902	公益事業

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…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG &	3	4	30	3,849	ヘルスケア機器・サービス
FRESENIUS SE & CO KGAA	5	8	47	6,098	ヘルスケア機器・サービス
GEA GROUP AG	2	4	10	1,398	資本財
HEIDELBERGCEMENT AG	2	2	15	1,979	素材
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1	2	25	3,313	家庭用品・パーソナル用品
HENKEL AG & CO KGAA	1	1	15	1,953	家庭用品・パーソナル用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG	16	20	34	4,354	半導体・半導体製造装置
K+S AG	1	5	8	1,115	素材
LANXESS AG	1	2	13	1,770	素材
LINDE AG	2	—	—	—	素材
MAN SE	0.83	0.83	7	968	資本財
MERCK KGAA	2	2	20	2,572	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	2	2	54	6,935	保険
PORSCHE AUTOMOBIL HLDG-PFD	—	2	13	1,759	自動車・自動車部品
PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE	3	7	14	1,877	メディア・娯楽
PUMA SE	—	0.11	4	624	耐久消費財・アパレル
RWE AG	8	8	15	1,987	公益事業
SAP SE	12	16	156	20,034	ソフトウェア・サービス
SIEMENS AG-REG	10	13	132	16,930	資本財
SYMRISE AG	2	2	21	2,725	素材
THYSSENKRUPP AG	8	8	16	2,054	素材
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	3	4	17	2,181	電気通信サービス
VOLKSWAGEN AG-PFD	2	3	43	5,516	自動車・自動車部品
WIRECARD AG	—	1	32	4,117	ソフトウェア・サービス
小計 株数・金額	307	389	1,684	215,322	
小計 銘柄数<比率>	38	41	—	<3.2%>	
(ユーロ…イタリア)					
ATLANTIA SPA	4	8	14	1,884	運輸
ENEL SPA	98	136	60	7,734	公益事業
ENI SPA	32	45	67	8,663	エネルギー
ASSICURAZIONI GENERALI	17	24	34	4,457	保険
INTESA SANPAOLO	168	280	54	6,995	銀行
LUXOTTICA GROUP SPA	3	3	17	2,270	耐久消費財・アパレル
MEDIOBANCA SPA	15	15	11	1,525	銀行
SAIPEM SPA	11	—	—	—	エネルギー
SNAM SPA	31	64	23	2,994	エネルギー
TELECOM ITALIA SPA	236	236	11	1,479	電気通信サービス
TERNA SPA	35	35	16	2,052	公益事業
UNICREDIT SPA	28	38	43	5,505	銀行
小計 株数・金額	682	887	356	45,562	
小計 銘柄数<比率>	12	11	—	<0.7%>	
(ユーロ…フランス)					
ACCOR SA	2	4	18	2,395	消費者サービス
AIR LIQUIDE SA	5	7	77	9,912	素材
ALSTOM	1	4	17	2,178	資本財
ARKEMA	2	2	18	2,377	素材
ATOS SE	1	2	14	1,864	ソフトウェア・サービス
AXA	24	34	75	9,712	保険
BNP PARIBAS	15	19	92	11,772	銀行
BOUYGUES SA	5	5	16	2,048	資本財
CAP GEMINI SA	2	3	33	4,218	ソフトウェア・サービス
CARREFOUR SA	7	10	18	2,301	食品・生活必需品小売り
CREDIT AGRICOLE SA	16	25	28	3,692	銀行
DANONE	7	10	69	8,857	食品・飲料・タバコ
DASSAULT SYSTEMES SA	2	2	26	3,432	ソフトウェア・サービス
EDENRED	3	6	20	2,603	商業・専門サービス
ESSILORLUXOTTICA	2	3	44	5,711	ヘルスケア機器・サービス
ORANGE S.A.	24	38	53	6,821	電気通信サービス
ENGIE	21	36	42	5,396	公益事業
HERMES INTERNATIONAL	0.31	0.67	33	4,309	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	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	3	4	126	16,151	耐久消費財・アパレル
L'OREAL	3	4	85	10,876	家庭用品・パーソナル用品
LAGARDERE S.C.A.	3	—	—	—	メディア・娯楽
LEGRAND SA	4	5	33	4,240	資本財
MICHELIN (CGDE)-B	2	2	25	3,297	自動車・自動車部品
PERNOD-RICARD SA	2	3	46	6,000	食品・飲料・タバコ
PEUGEOT SA	9	12	26	3,357	自動車・自動車部品
KERING	1	1	52	6,674	耐久消費財・アパレル
PUBLICIS GROUPE	4	4	20	2,622	メディア・娯楽
RENAULT SA	2	3	24	3,123	自動車・自動車部品
SAFRAN SA	4	5	61	7,899	資本財
SANOFI	15	19	145	18,605	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	7	10	32	4,202	資本財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	8	9	59	7,647	資本財
SODEXO	1	1	15	1,935	消費者サービス
SOCIETE GENERALE	10	12	41	5,317	銀行
SUEZ	5	12	15	1,955	公益事業
THALES SA	1	1	21	2,724	資本財
TOTAL SA	31	40	207	26,549	エネルギー
VALEO SA	4	4	12	1,580	自動車・自動車部品
VEOLIA ENVIRONNEMENT	10	10	17	2,260	公益事業
VINCI SA	7	8	66	8,532	資本財
VIVENDI	16	20	44	5,716	メディア・娯楽
小計 株数・金額	309	419	1,884	240,880	
小計 銘柄数<比率>	41	40	—	<3.5%>	
(ユーロ…オランダ)					
ABN AMRO GROUP NV-CVA	4	8	17	2,201	銀行
AEGON NV	25	44	23	2,991	保険
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	20	20	41	5,255	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL	4	4	29	3,783	素材
ALTICE NV -A	7	—	—	—	メディア・娯楽
ASML HOLDING NV	4	7	104	13,294	半導体・半導体製造装置
CNH INDUSTRIAL NV	21	21	18	2,381	資本財
AIRBUS GROUP SE	7	10	98	12,632	資本財
FERRARI NV	2	2	24	3,169	自動車・自動車部品
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	19	19	27	3,568	自動車・自動車部品
HEINEKEN NV	3	4	34	4,394	食品・飲料・タバコ
HEINEKEN HOLDING NV	1	1	14	1,889	食品・飲料・タバコ
ING GROEP NV-CVA	52	60	62	8,034	銀行
KONINKLIJKE DSM NV	3	3	25	3,296	素材
KONINKLIJKE KPN NV	66	66	15	1,993	電気通信サービス
NN GROUP NV	5	5	21	2,699	保険
KONINKLIJKE PHILIPS NV	12	17	55	7,156	ヘルスケア機器・サービス
RANDSTAD NV	2	2	8	1,127	商業・専門サービス
RELX NV	16	—	—	—	商業・専門サービス
UNILEVER NV-CVA	21	25	122	15,646	家庭用品・パーソナル用品
WOLTERS KLUWER	5	5	26	3,425	商業・専門サービス
小計 株数・金額	307	329	774	98,943	
小計 銘柄数<比率>	21	19	—	<1.5%>	
(ユーロ…スペイン)					
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	9	—	—	—	運輸
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	4	4	14	1,887	資本財
AENA SA	1	1	22	2,928	運輸
AMADEUS IT GROUP SA	6	7	55	7,031	ソフトウェア・サービス
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	86	102	52	6,675	銀行
BANCO SANTANDER SA	195	276	112	14,385	銀行
BANCO DE SABADELL SA	53	103	10	1,368	銀行
CAIXABANK S.A	50	79	27	3,533	銀行
ENAGAS SA	5	5	11	1,525	エネルギー
FERROVIAL SA	7	12	22	2,864	資本財

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
NATURGY ENERGY GROUP SA		7	7	15	2,024	公益事業
GRIFOLS SA		7	7	15	2,033	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
IBERDROLA SA		75	106	67	8,658	公益事業
INDITEX		12	16	40	5,192	小売
INTERNATIONAL CONSOLIDATED A		17	17	11	1,444	運輸
RED ELECTRICA CORPORACION SA		9	9	18	2,351	公益事業
REPSOL SA		21	21	31	4,086	エネルギー
TELEFONICA SA		55	78	54	6,911	電気通信サービス
小計	株数・金額	626	857	585	74,903	
	銘柄数＜比率＞	18	17	－	＜1.1%＞	
(ユーロ…ベルギー)						
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		10	13	85	10,925	食品・飲料・タバコ
AGEAS		4	4	18	2,315	保険
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA		2	2	21	2,786	各種金融
KBC GROEP NV		2	3	23	3,046	銀行
SOLVAY SA		1	1	19	2,439	素材
UCB SA		1	2	20	2,592	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
UMICORE		3	3	15	1,930	素材
小計	株数・金額	26	32	203	26,035	
	銘柄数＜比率＞	7	7	－	＜0.4%＞	
(ユーロ…オーストリア)						
ERSTE GROUP BANK AG		5	5	17	2,233	銀行
OMV AG		3	3	15	1,984	エネルギー
小計	株数・金額	8	8	32	4,217	
	銘柄数＜比率＞	2	2	－	＜0.1%＞	
(ユーロ…ルクセンブルク)						
ARCELORMITTAL		8	12	26	3,436	素材
SES		3	－	－	－	メディア・娯楽
小計	株数・金額	12	12	26	3,436	
	銘柄数＜比率＞	2	1	－	＜0.1%＞	
(ユーロ…フィンランド)						
FORTUM OYJ		10	10	18	2,426	公益事業
KONE OYJ-B		4	7	29	3,799	資本財
NOKIA OYJ		71	94	44	5,651	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMPO OYJ-A SHS		5	8	33	4,324	保険
STORA ENSO OYJ-R SHS		－	9	12	1,640	素材
UPM-KYMMENE OYJ		8	11	31	4,042	素材
WARTSILA OYJ ABP		4	12	18	2,305	資本財
小計	株数・金額	105	153	189	24,189	
	銘柄数＜比率＞	6	7	－	＜0.4%＞	
(ユーロ…アイルランド)						
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD		27	27	0	0	銀行
CRH PLC		13	16	40	5,144	素材
KERRY GROUP PLC-A		2	3	35	4,512	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	44	48	75	9,657	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.1%＞	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL SA		62	62	19	2,450	公益事業
小計	株数・金額	62	62	19	2,450	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜0.0%＞	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		2	－	－	－	食品・飲料・タバコ
小計	株数・金額	2	－	－	－	
	銘柄数＜比率＞	1	－	－	＜－%＞	
(ユーロ…スイス)						
STMICROELECTRONICS NV		6	11	14	1,795	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額	6	11	14	1,795	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜0.0%＞	
ユーロ計	株数・金額	2,501	3,211	5,846	747,395	
	銘柄数＜比率＞	153	150	－	＜11.0%＞	

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
3I GROUP PLC	16	16	13	1,995	各種金融
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	5	5	13	1,925	食品・飲料・タバコ
ANGLO AMERICAN PLC	19	23	38	5,551	素材
ANTOFAGASTA PLC	6	13	10	1,467	素材
ASTRAZENECA PLC	17	21	125	18,145	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
ASHTEAD GROUP PLC	8	8	15	2,229	資本財
AVIVA PLC	61	80	33	4,848	保険
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	30	37	136	19,662	食品・飲料・タバコ
BAE SYSTEMS PLC ORD	49	64	34	5,038	資本財
BARCLAYS PLC	240	304	52	7,543	銀行
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	13	23	11	1,689	耐久消費財・アパレル
BHP BILLITON PLC	25	34	52	7,535	素材
BP PLC	259	334	179	25,819	エネルギー
SKY PLC	10	—	—	—	メディア・娯楽
BT GROUP PLC	109	158	38	5,514	電気通信サービス
BUNZL PLC	5	8	19	2,837	資本財
BURBERRY GROUP PLC	5	9	17	2,459	耐久消費財・アパレル
CAPITA PLC	10	—	—	—	商業・専門サービス
CARNIVAL PLC	3	3	15	2,228	消費者サービス
CENTRICA PLC	86	86	12	1,854	公益事業
COMPASS GROUP PLC	20	30	46	6,768	消費者サービス
DCC PLC	2	2	14	2,043	資本財
DIAGEO PLC	33	42	113	16,340	食品・飲料・タバコ
EXPERIAN PLC	14	18	33	4,802	商業・専門サービス
GKN PLC	25	—	—	—	自動車・自動車部品
GLENCORE PLC	173	204	61	8,940	素材
GLAXOSMITHKLINE PLC	66	84	129	18,724	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
HSBC HOLDINGS PLC	257	323	197	28,427	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	11	17	47	6,880	食品・飲料・タバコ
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	4	4	16	2,401	消費者サービス
INTERTEK GROUP PLC	3	3	17	2,509	商業・専門サービス
ITV PLC	69	69	10	1,464	メディア・娯楽
JOHNSON MATTHEY PLC	2	5	14	2,147	素材
KINGFISHER PLC	21	43	10	1,518	小売
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	88	125	30	4,428	保険
LLOYDS BANKING GROUP PLC	958	1,168	67	9,727	銀行
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP	4	6	26	3,879	各種金融
MARKS & SPENCER GROUP PLC	26	26	7	1,106	小売
MELROSE INDUSTRIES PLC	—	113	17	2,574	資本財
MICRO FOCUS INTERNATIONAL	5	5	7	1,032	ソフトウェア・サービス
MONDI PLC	7	7	14	2,075	素材
NATIONAL GRID PLC	46	61	51	7,468	公益事業
NEXT PLC	1	2	14	2,147	小売
OLD MUTUAL PLC	56	—	—	—	保険
PERSIMMON PLC	4	6	14	2,110	耐久消費財・アパレル
PRUDENTIAL PLC	33	44	67	9,763	保険
RANDGOLD RESOURCES LTD	0.93	2	12	1,796	素材
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8	10	70	10,196	家庭用品・パーソナル用品
RELX PLC	16	37	58	8,502	商業・専門サービス
RIO TINTO PLC	17	19	71	10,305	素材
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	44	95	22	3,214	銀行
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	58	76	185	26,810	エネルギー
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	49	60	148	21,481	エネルギー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	20	28	25	3,643	資本財
RSA INSURANCE GROUP PLC	11	25	14	2,043	保険
SAGE GROUP PLC/THE	18	31	16	2,384	ソフトウェア・サービス
SSE PLC	17	17	19	2,879	公益事業
SEVERN TRENT PLC	4	4	9	1,314	公益事業
SHIRE PLC	13	16	71	10,301	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SMITHS GROUP PLC	8	8	11	1,623	資本財

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千イギリスポンド	千円	
SMITH & NEPHEW PLC	13	19	25	3,629	ヘルスケア機器・サービス
ST JAMES'S PLACE PLC	11	11	11	1,602	各種金融
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	28	46	12	1,765	各種金融
STANDARD CHARTERED PLC	47	47	24	3,561	銀行
TESCO PLC	117	169	36	5,259	食品・生活必需品小売り
TRAVIS PERKINS PLC	3	9	9	1,411	資本財
UNILEVER PLC	17	19	81	11,696	家庭用品・パーソナル用品
UNITED UTILITIES GROUP PLC	16	16	11	1,684	公益事業
VODAFONE GROUP PLC	361	419	61	8,877	電気通信サービス
WHITBREAD PLC	2	4	18	2,687	消費者サービス
FERGUSON PLC	4	4	21	3,102	資本財
WORLDPAY GROUP PLC	34	—	—	—	ソフトウェア・サービス
WPP PLC	17	26	23	3,437	メディア・娯楽
(イギリス…非上場)					
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC-ENT-C(N)	—	1,332	0.133	19	資本財
小計 株数・金額	3,891	6,216	2,932	422,859	
小計 銘柄数＜比率＞	72	69	—	＜6.2%＞	
(スイス)			千スイスフラン		
ABB LTD-REG	26	31	63	7,089	資本財
ADECCO GROUP AG-REG	2	4	19	2,212	商業・専門サービス
BALOISE HOLDING AG - REG	1	1	17	2,009	保険
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	28	48	60	6,791	各種金融
GEBERIT AG-REG	0.72	0.72	30	3,400	資本財
GIVAUDAN-REG	0.16	0.16	37	4,208	素材
LAFARGEHOLCIM LTD-REG	6	8	35	4,003	素材
JULIUS BAER GROUP LTD	3	5	25	2,825	各種金融
KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG	0.82	1	19	2,177	運輸
LONZA GROUP AG-REG	1	1	43	4,936	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NESTLE SA-REG	40	51	432	48,666	食品・飲料・タバコ
NOVARTIS AG-REG	29	36	311	34,963	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
PARTNERS GROUP HOLDIING AG	0.32	0.44	29	3,367	各種金融
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	7	8	59	6,722	耐久消費財・アパレル
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	9	11	276	31,134	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
SGS SA-REG	0.1	0.14	31	3,557	商業・専門サービス
SIKA AG-REG	0.03	2	29	3,320	素材
SONOVA HOLDING AG-REG	1	1	15	1,781	ヘルスケア機器・サービス
SWISS LIFE HOLDING AG-REG	0.6	0.6	21	2,439	保険
SWISSCOM AG-REG	0.57	0.57	25	2,852	電気通信サービス
SWISS RE AG	3	6	54	6,141	保険
SWATCH GROUP AG/THE-BR	0.51	0.76	24	2,766	耐久消費財・アパレル
UBS GROUP AG-REG	46	67	90	10,142	各種金融
ZURICH INSURANCE GROUP AG	2	2	71	8,028	保険
SCHINDLER HOLDING AG-REG	1	1	20	2,264	資本財
SWISS PRIME SITE-REG	2	2	17	1,913	不動産
小計 株数・金額	216	296	1,865	209,719	
小計 銘柄数＜比率＞	26	26	—	＜3.1%＞	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
ASSA ABLOY AB-B	15	15	270	3,339	資本財
ATLAS COPCO AB-A SHS	10	14	309	3,824	資本財
ATLAS COPCO AB-B SHS	6	6	119	1,470	資本財
EPIROC AB-A	—	10	86	1,064	資本財
EPIROC AB-B	—	6	45	562	資本財
ERICSSON LM-B SHS	35	51	406	5,021	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ESSITY AKTIEBOLAG-B	8	13	282	3,484	家庭用品・パーソナル用品
HENNES & MAURITZ AB-B SHS	15	15	250	3,090	小売
HEXAGON AB-B SHS	4	5	257	3,179	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
INVESTOR AB-B SHS	5	7	305	3,772	各種金融
KINNEVIK AB - B	7	7	195	2,409	各種金融
NORDEA BANK ABP	36	47	377	4,661	銀行
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	24	24	225	2,777	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	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円	
SANDVIK AB		17	23	325	4,017	資本財
SKANSKA AB-B SHS		6	6	93	1,154	資本財
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS		21	31	318	3,927	銀行
SWEDBANK AB - A SHARES		10	15	310	3,837	銀行
SWEDISH MATCH AB		4	6	282	3,488	食品・飲料・タバコ
TELIA CO AB		56	56	227	2,813	電気通信サービス
VOLVO AB-B SHS-B		25	25	341	4,211	資本財
小計	株数・金額	311	390	5,032	62,107	
	銘柄数<比率>	18	20	—	<0.9%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		14	20	318	4,283	銀行
NORSK HYDRO A S		16	35	144	1,939	素材
ORKLA ASA		19	19	136	1,840	食品・飲料・タバコ
EQUINOR ASA		18	18	398	5,364	エネルギー
TELENOR ASA		13	13	203	2,739	電気通信サービス
YARA INTERNATIONAL ASA		1	4	151	2,041	素材
小計	株数・金額	84	111	1,351	18,209	
	銘柄数<比率>	6	6	—	<0.3%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
AP MOELLER - MAERSK A/S - B		0.14	0.14	111	1,917	運輸
CARLSBERG AS-B		1	2	171	2,936	食品・飲料・タバコ
COLOPLAST-B		1	3	186	3,203	ヘルスケア機器・サービス
DANSKE BANK A/S		9	12	155	2,660	銀行
ORSTED A/S		—	3	136	2,334	公益事業
DSV A/S		4	4	229	3,931	運輸
GENMAB A/S		0.99	0.99	78	1,343	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
NOVO NORDISK A/S-B		23	29	808	13,846	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		3	5	150	2,585	素材
PANDORA A/S		1	2	88	1,510	耐久消費財・アパレル
VESTAS WIND SYSTEMS AS		3	3	156	2,680	資本財
小計	株数・金額	50	66	2,273	38,950	
	銘柄数<比率>	10	11	—	<0.6%>	
(オーストラリア)				千オーストラリアドル		
AGL ENERGY LTD		12	12	22	1,804	公益事業
AMCOR LIMITED		20	20	25	2,057	素材
AMP LTD		57	57	14	1,142	各種金融
AUST AND NZ BANKING GROUP		40	46	114	9,079	銀行
ARISTOCRAT LEISURE LTD		11	11	29	2,376	消費者サービス
ASX LTD		4	7	40	3,222	各種金融
BHP BILLITON LTD		39	55	170	13,568	素材
BRAMBLES LTD		27	27	29	2,311	商業・専門サービス
CALTEX AUSTRALIA LTD		5	5	14	1,177	エネルギー
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRAL		22	29	189	15,104	銀行
COMPUTERSHARE LTD		8	17	32	2,616	ソフトウェア・サービス
CROWN RESORTS LTD		6	16	20	1,632	消費者サービス
CSL LTD		5	7	137	10,922	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス
INSURANCE AUSTRALIA GROUP		34	51	34	2,773	保険
CIMIC GROUP LTD		2	2	10	800	資本財
MACQUARIE GROUP LTD		5	6	70	5,641	各種金融
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD		37	46	115	9,155	銀行
NEWCREST MINING LTD		9	18	39	3,168	素材
ORIGIN ENERGY LTD		29	29	20	1,654	エネルギー
ORICA LIMITED		4	10	17	1,387	素材
QBE INSURANCE GROUP LTD		26	26	29	2,322	保険
RAMSAY HEALTH CARE LTD		2	4	24	1,978	ヘルスケア機器・サービス
RIO TINTO LTD		7	7	57	4,596	素材
SANTOS LTD		39	39	26	2,071	エネルギー
SOUTH32 LTD		89	89	31	2,508	素材
SUNCORP GROUP LTD		23	23	32	2,573	保険
TABCORP HOLDINGS LTD		19	50	23	1,842	消費者サービス

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	
(オーストラリア)		百株	百株	千オーストラリアドル	千円	
TELSTRA CORPORATION LTD		53	53	16	1,302	電気通信サービス
TRANSURBAN GROUP		34	55	62	4,946	運輸
WESTPAC BANKING CORP		45	56	147	11,694	銀行
WESFARMERS LTD		14	20	93	7,446	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS GROUP LTD		18	23	65	5,205	食品・生活必需品小売り
WOODSIDE PETROLEUM LTD		10	18	63	5,057	エネルギー
小計	株数・金額	770	950	1,824	145,145	
	銘柄数＜比率＞	33	33	－	＜2.1%＞	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
SPARK NEW ZEALAND LTD		24	70	27	1,984	電気通信サービス
小計	株数・金額	24	70	27	1,984	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜0.0%＞	
(香港)				千香港ドル		
AIA GROUP LTD		168	206	1,226	17,598	保険
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		65	65	209	3,003	銀行
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		40	50	403	5,793	資本財
CK ASSET HOLDINGS LTD		35	45	242	3,480	不動産
CLP HOLDINGS LTD		36	36	320	4,601	公益事業
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		40	40	169	2,436	消費者サービス
HANG LUNG PROPERTIES LTD		60	60	84	1,210	不動産
HANG SENG BANK LTD		9	15	301	4,330	銀行
POWER ASSETS HOLDINGS		25	25	131	1,885	公益事業
HONG KONG & CHINA GAS		121	188	281	4,044	公益事業
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR		16	22	471	6,760	各種金融
LI & FUNG LTD		220	220	33	479	耐久消費財・アパレル
MTR CORP		40	40	153	2,204	運輸
NEW WORLD DEVELOPMENT		100	190	188	2,699	不動産
SANDS CHINA LTD		34	54	170	2,444	消費者サービス
SUN HUNG KAI PROPERTIES		19	29	295	4,246	不動産
SWIRE PACIFIC LTD 'A'		22	22	187	2,686	不動産
WHARF HOLDINGS LTD		20	20	38	550	不動産
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		－	30	140	2,021	不動産
小計	株数・金額	1,075	1,362	5,050	72,477	
	銘柄数＜比率＞	18	19	－	＜1.1%＞	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND LTD		60	60	18	1,489	不動産
DBS GROUP HOLDINGS LTD		22	30	71	5,795	銀行
GENTING SINGAPORE LTD		140	140	12	1,014	消費者サービス
KEPPEL CORP LTD		36	36	22	1,820	資本財
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP		48	63	66	5,444	銀行
SINGAPORE AIRLINES LTD		14	24	22	1,813	運輸
SINGAPORE PRESS HOLDINGS LTD		50	114	30	2,450	メディア・娯楽
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS		117	175	55	4,488	電気通信サービス
UNITED OVERSEAS BANK LTD		20	26	65	5,367	銀行
小計	株数・金額	507	668	364	29,683	
	銘柄数＜比率＞	9	9	－	＜0.4%＞	
(イスラエル)				千イスラエルシュケル		
BANK LEUMI LE-ISRAEL		32	32	74	2,266	銀行
BANK HAPOALIM BM		40	40	100	3,045	銀行
小計	株数・金額	72	72	174	5,311	
	銘柄数＜比率＞	2	2	－	＜0.1%＞	
合計	株数・金額	13,974	18,989	－	6,327,724	
	銘柄数＜比率＞	900	899	－	＜93.2%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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		202	202	25	2,832	0.0
PROLOGIS INC		692	842	55	6,239	0.1
AMERICAN TOWER CORP		549	745	114	12,862	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC		2,031	2,031	20	2,284	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC		157	232	41	4,636	0.1
BOSTON PROPERTIES INC		225	326	38	4,288	0.1
BROOKFIELD PROPERTY REIT I-A		－	392	7	851	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP		452	724	77	8,741	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC		184	330	38	4,335	0.1
DUKE REALTY CORPORATION		777	777	22	2,480	0.0
EQUITY RESIDENTIAL-REIT		422	570	37	4,234	0.1
EQUINIX INC		104	129	53	5,977	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC		71	114	29	3,261	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC		231	231	20	2,293	0.0
FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST-REIT		110	194	23	2,688	0.0
GGP INC		1,159	－	－	－	－
HCP INC		552	1,109	29	3,371	0.0
WELLTOWER INC		538	721	47	5,374	0.1
HOST HOTELS & RESORTS INC		948	1,367	25	2,876	0.0
IRON MOUNTAIN INC		538	538	17	1,978	0.0
KIMCO REALTY CORPORATION		540	1,188	18	2,117	0.0
MACERICH CO/THE		187	187	9	1,082	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM		178	280	28	3,150	0.0
PUBLIC STORAGE		223	277	55	6,284	0.1
REALTY INCOME CORP		279	556	33	3,767	0.1
REGENCY CENTERS CORP		312	312	20	2,252	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP		192	192	29	3,371	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC		464	511	92	10,392	0.2
SL GREEN REALTY CORP		147	147	13	1,536	0.0
UDR INC		413	680	27	3,049	0.0
VENTAS INC		431	650	36	4,159	0.1
VORNADO REALTY TRUST		292	292	19	2,235	0.0
WEYERHAEUSER CO		1,026	1,363	39	4,437	0.1
小計	口数・金額	14,626	18,209	1,150	129,445	
	銘柄数＜比率＞	32	32	－	＜1.9%＞	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
KLEPIERRE		588	588	17	2,200	0.0
UNIBAIL-RODAMCO SE-NA		142	－	－	－	－
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		－	271	43	5,558	0.1
ユーロ計	口数・金額	730	859	60	7,758	
	銘柄数＜比率＞	2	2	－	＜0.1%＞	
(イギリス)				千イギリスポンド		
BRITISH LAND COMPANY PLC		1,166	2,367	13	1,998	0.0
HAMMERSON PLC		1,445	3,108	13	1,940	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		1,694	1,694	14	2,052	0.0
小計	口数・金額	4,305	7,169	41	5,991	
	銘柄数＜比率＞	3	3	－	＜0.1%＞	

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		口	口	千オーストラリアドル	千円	%
APA GROUP		2,425	2,425	22	1,828	0.0
VICINITY CENTRES		6,167	6,167	16	1,295	0.0
DEXUS		2,875	2,875	29	2,321	0.0
GOODMAN GROUP		3,775	3,775	38	3,099	0.0
LENDLEASE GROUP		919	1,550	26	2,122	0.0
SCENTRE GROUP		7,042	11,481	44	3,552	0.1
STOCKLAND		4,905	4,905	18	1,447	0.0
WESTFIELD CORP		4,134	－	－	－	－
小計	口数・金額	32,242	33,178	196	15,666	
	銘柄数＜比率＞	8	7	－	＜0.2%＞	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		3,567	3,567	258	3,708	0.1
小計	口数・金額	3,567	3,567	258	3,708	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜0.1%＞	
合計	口数・金額	55,470	62,982	－	162,570	
	銘柄数＜比率＞	46	45	－	＜2.4%＞	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値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			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	DJSTX5	62	－
		SP EMINI	256	－

(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

(2018年10月26日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	6,327,724	92.2
投資証券	162,570	2.4
コール・ローン等、その他	374,075	5.4
投資信託財産総額	6,864,369	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（6,590,089千円）の投資信託財産総額（6,864,369千円）に対する比率は96.0%です。
(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1アメリカドル=112.47円、1カナダドル=85.95円、1ユーロ=127.83円、1イギリスポンド=144.21円、1スイスフラン=112.40円、1スウェーデンクローナ=12.34円、1ノルウェークローネ=13.47円、1デンマーククローネ=17.13円、1オーストラリアドル=79.55円、1ニュージーランドドル=73.29円、1香港ドル=14.35円、1シンガポールドル=81.42円、1イスラエルシュケル=30.40円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年10月26日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	13,350,801,894
コール・ローン等	264,527,375
株式(評価額)	6,327,724,845
投資証券(評価額)	162,570,443
未収入金	6,534,730,284
未収配当金	5,787,810
差入委託証拠金	55,461,137
(B) 負債	6,557,784,270
未払金	6,555,203,189
未払解約金	2,580,812
未払利息	269
(C) 純資産総額(A－B)	6,793,017,624
元本	4,317,838,768
次期繰越損益金	2,475,178,856
(D) 受益権総口数	4,317,838,768口
1万口当たり基準価額(C／D)	15,732円

(注) 当ファンドの期首元本額は3,576,957,718円、期中追加設定元本額は1,161,111,188円、期中一部解約元本額は420,230,138円です。

(注) 2018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あり（DC専用）	2,802,212,323円
・インデックスファンド海外株式（ヘッジあり）	535,193,381円
・インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	437,588,598円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	172,791,072円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	171,685,569円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	115,922,313円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	41,001,984円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	11,040,978円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	9,640,630円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	8,034,788円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	6,520,047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）	3,367,988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）	2,839,097円

(注) 1口当たり純資産額は1.5732円です。

○損益の状況 (2017年10月27日～2018年10月26日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	129,774,951
受取配当金	129,599,063
受取利息	25,060
その他収益金	284,694
支払利息	△ 133,866
(B) 有価証券売買損益	△ 87,929,287
売買益	911,528,261
売買損	△ 999,457,548
(C) 先物取引等取引損益	19,832,352
取引益	57,040,254
取引損	△ 37,207,902
(D) 保管費用等	△ 6,657,198
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	55,020,818
(F) 前期繰越損益金	1,960,273,937
(G) 追加信託差損益金	722,766,539
(H) 解約差損益金	△ 262,882,438
(I) 計(E＋F＋G＋H)	2,475,178,856
次期繰越損益金(I)	2,475,178,856

(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し処理しています。

○お知らせ

約款変更について

2017年10月27日から2018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。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書

第20期（決算日　2018年10月26日）
（2017年10月27日～2018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	1998年10月30日から原則無期限です。
運用方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、「NOMURA-BPI総合」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	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行ないません。

ファンド概要

主としてわが国の公社債に投資し、「NOMURA-BPI総合」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、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券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。
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

<935522>

【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		NOMURA-BPI総合		債券組入比率	純資産総額
		期騰落中率	(ベンチマーク)	期騰落中率		
	円	%		%	%	百万円
16期(2014年10月27日)	13,099	2.0	516.27	2.1	99.7	34,255
17期(2015年10月26日)	13,374	2.1	527.07	2.1	99.7	34,588
18期(2016年10月26日)	14,049	5.0	553.86	5.1	100.0	33,952
19期(2017年10月26日)	13,839	△1.5	545.42	△1.5	99.7	36,674
20期(2018年10月26日)	13,870	0.2	546.64	0.2	99.6	38,466

(注) NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、ＭＢＳ、ＡＢＳなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間１年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、ＭＢＳ、ＡＢＳについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。

※当ファンドのベンチマークは、「日興債券パフォーマンス・インデックス（総合）」が公表停止となったことに伴ない、2017年１月１日付で「NOMURA-BPI総合」に変更いたしました。なお、本運用報告書において、2017年１月１日より前の期間については「日興債券パフォーマンス・インデックス（総合）」のデータを使用しています。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2017年10月26日	13,839	－	545.42	－	99.7
10月末	13,844	0.0	545.62	0.0	99.6
11月末	13,879	0.3	547.04	0.3	99.7
12月末	13,888	0.4	547.41	0.4	99.7
2018年1月末	13,866	0.2	546.45	0.2	99.7
2月末	13,919	0.6	548.53	0.6	99.6
3月末	13,940	0.7	549.42	0.7	99.8
4月末	13,930	0.7	549.03	0.7	99.8
5月末	13,961	0.9	550.26	0.9	99.6
6月末	13,968	0.9	550.51	0.9	99.8
7月末	13,944	0.8	549.52	0.8	99.7
8月末	13,869	0.2	546.51	0.2	99.6
9月末	13,835	△0.0	545.21	△0.0	99.8
(期末)					
2018年10月26日	13,870	0.2	546.64	0.2	99.6

(注) 騰落率は期首比です。

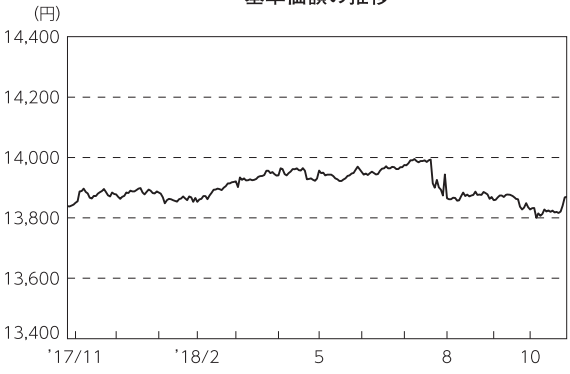
○運用経過

（2017年10月27日～2018年10月26日）

基準価額の推移

期間の初め13,839円の基準価額は、期間末に13,870となり、騰落率は＋0.2%となりました。

基準価額の推移



期　首	期中高値	期中安値	期　末
2017/10/26	2018/07/09	2018/10/04	2018/10/26
13,839円	13,995円	13,800円	13,870円

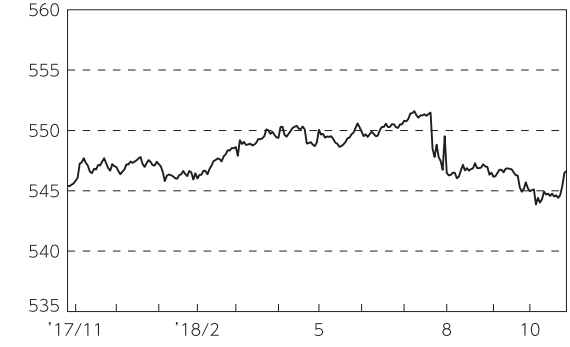
基準価額の変動要因

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＞
・黒田日銀総裁を再任する人事案が提出され金融政策の継続期待が高まったこと。
・米国と中国の貿易摩擦の激化による世界経済の成長鈍化懸念が強まったこと。

＜値下がり要因＞
・日銀が金融政策決定会合で緩和策を柔軟化し長期金利の変動幅の拡大を容認したこと。
・日銀による国債買入れの減額が警戒されたこと。

NOMURA - BPI総合の推移



（国内債券市況）

国内債券市場では、10年国債利回りは、期間の初めと比べて上昇（債券価格は下落）しました。

期間の初めから2018年１月下旬にかけては、内外の良好な経済指標の発表に加え、欧米の長期金利が上昇基調で推移したことなどを背景に、10年国債利回りは上昇しました。２月上旬から７月中旬にかけては、世界的な株安により投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、黒田日銀総裁を再任する人事案が提出され金融政策の継続期待が高まったこと、米国と中国の貿易摩擦の激化による世界経済の成長鈍化懸念が強まったことなどを受けて、10年国債利回りは低下（債券価格は上昇）しました。７月下旬から期間末にかけては、日銀が金融政策決定会合で緩和策を柔軟化し長期金利の変動幅の拡大を容認したことや、米国の堅調な内容の経済指標の発表を受けて米国長期金利が上昇したこと、日銀による国債買入れ減額への警戒感などを背景に、10年国債利回りは上昇しました。

ポートフォリオ

債券のリスクコントロールモデルを利用して国債、政府保証債、地方債、金融債、電力債、事業債などによりポートフォリオを構築し、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果をめざして運用を行ないました。また、「NOMURA-BPI総合」採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しを行ない、債券組入比率を高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

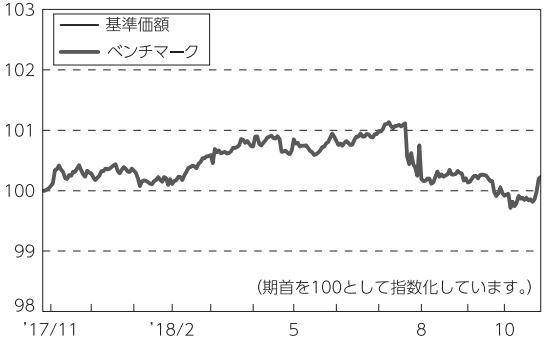
期間中における基準価額は、0.2%の値上がりとなり、ベンチマークである「NOMURA-BPI総合」の上昇率0.2%と概ね同水準となりました。

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＞
・債券種別効果。
・売買要因。

＜マイナス要因＞
・その他要因。

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、原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度や残存期間別構成比率などを「NOMURA-BPI総合」と同程度に保つことで連動性を高めるよう努めます。また、ベンチマークの採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しなどを行ない、債券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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	0	0.000	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（その他）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、13,903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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	3,964,277	2,238,532
	地方債証券	408,551	303,053
	特殊債券	625,020	1,113,792
	社債券（投資法人債券を含む）	1,342,266	614,733

（注）金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2017年10月27日～2018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。

○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10月27日～2018年10月26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

(2018年10月26日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	27,432,000	30,067,973	78.2	－	59.1	10.2	8.8
	(11,818,000)	(12,408,433)	(32.3)	(－)	(26.3)	(2.8)	(3.1)
地方債証券	2,700,000	2,792,055	7.3	－	1.1	5.9	0.3
	(2,700,000)	(2,792,055)	(7.3)	(－)	(1.1)	(5.9)	(0.3)
特殊債券(除く金融債)	2,500,000	2,606,648	6.8	－	1.1	5.1	0.5
	(2,500,000)	(2,606,648)	(6.8)	(－)	(1.1)	(5.1)	(0.5)
金融債券	500,000	499,727	1.3	－	－	1.3	－
	(500,000)	(499,727)	(1.3)	(－)	(－)	(1.3)	(－)
普通社債券(含む投資法人債券)	2,300,000	2,356,368	6.1	－	0.8	3.7	1.6
	(2,300,000)	(2,356,368)	(6.1)	(－)	(0.8)	(3.7)	(1.6)
合計	35,432,000	38,322,771	99.6	－	62.1	26.3	11.2
	(19,818,000)	(20,663,231)	(53.7)	(－)	(29.4)	(18.9)	(5.5)

(注) ( )内は非上場債で内書きです。
(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)国内(邦貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第120回利付国債（５年）	0.2	330,000	330,951	2019/9/20
第122回利付国債（５年）	0.1	300,000	300,822	2019/12/20
第123回利付国債（５年）	0.1	505,000	506,686	2020/3/20
第124回利付国債（５年）	0.1	560,000	562,161	2020/6/20
第125回利付国債（５年）	0.1	325,000	326,449	2020/9/20
第126回利付国債（５年）	0.1	220,000	221,133	2020/12/20
第１回利付国債（40年）	2.4	70,000	98,049	2048/3/20
第２回利付国債（40年）	2.2	165,000	223,380	2049/3/20
第３回利付国債（40年）	2.2	50,000	67,988	2050/3/20
第４回利付国債（40年）	2.2	95,000	129,713	2051/3/20
第５回利付国債（40年）	2.0	35,000	45,945	2052/3/20
第６回利付国債（40年）	1.9	70,000	90,037	2053/3/20
第７回利付国債（40年）	1.7	50,000	61,395	2054/3/20
第８回利付国債（40年）	1.4	95,000	108,019	2055/3/20
第９回利付国債（40年）	0.4	160,000	131,547	2056/3/20
第10回利付国債（40年）	0.9	125,000	121,870	2057/3/20
第11回利付国債（40年）	0.8	50,000	46,909	2058/3/20
第303回利付国債（10年）	1.4	331,000	335,528	2019/9/20
第305回利付国債（10年）	1.3	473,000	480,761	2019/12/20
第306回利付国債（10年）	1.4	93,000	94,986	2020/3/20
第308回利付国債（10年）	1.3	140,000	143,304	2020/6/20
第309回利付国債（10年）	1.1	134,000	136,721	2020/6/20
第310回利付国債（10年）	1.0	78,000	79,680	2020/9/20
第311回利付国債（10年）	0.8	23,000	23,408	2020/9/20
第312回利付国債（10年）	1.2	205,000	210,856	2020/12/20
第313回利付国債（10年）	1.3	370,000	382,676	2021/3/20
第315回利付国債（10年）	1.2	65,000	67,282	2021/6/20
第316回利付国債（10年）	1.1	35,000	36,136	2021/6/20
第317回利付国債（10年）	1.1	105,000	108,718	2021/9/20
第318回利付国債（10年）	1.0	185,000	191,014	2021/9/20
第319回利付国債（10年）	1.1	5,000	5,191	2021/12/20
第320回利付国債（10年）	1.0	190,000	196,680	2021/12/20
第321回利付国債（10年）	1.0	175,000	181,606	2022/3/20
第322回利付国債（10年）	0.9	75,000	77,576	2022/3/20
第323回利付国債（10年）	0.9	45,000	46,661	2022/6/20
第324回利付国債（10年）	0.8	25,000	25,831	2022/6/20
第325回利付国債（10年）	0.8	210,000	217,427	2022/9/20
第326回利付国債（10年）	0.7	30,000	30,998	2022/12/20
第327回利付国債（10年）	0.8	65,000	67,432	2022/12/20
第328回利付国債（10年）	0.6	115,000	118,522	2023/3/20
第329回利付国債（10年）	0.8	230,000	239,538	2023/6/20
第330回利付国債（10年）	0.8	210,000	219,130	2023/9/20
第331回利付国債（10年）	0.6	80,000	82,692	2023/9/20
第333回利付国債（10年）	0.6	210,000	217,610	2024/3/20
第334回利付国債（10年）	0.6	120,000	124,482	2024/6/20
第335回利付国債（10年）	0.5	490,000	506,076	2024/9/20
第336回利付国債（10年）	0.5	80,000	82,710	2024/12/20
第337回利付国債（10年）	0.3	30,000	30,646	2024/12/20
第338回利付国債（10年）	0.4	390,000	401,118	2025/3/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第339回利付国債（10年）	0.4	370,000	380,711	2025/6/20
第340回利付国債（10年）	0.4	420,000	432,474	2025/9/20
第341回利付国債（10年）	0.3	1,000,000	1,023,250	2025/12/20
第342回利付国債（10年）	0.1	130,000	131,105	2026/3/20
第343回利付国債（10年）	0.1	245,000	246,964	2026/6/20
第344回利付国債（10年）	0.1	50,000	50,354	2026/9/20
第345回利付国債（10年）	0.1	610,000	613,965	2026/12/20
第346回利付国債（10年）	0.1	490,000	492,660	2027/3/20
第347回利付国債（10年）	0.1	160,000	160,756	2027/6/20
第348回利付国債（10年）	0.1	90,000	90,317	2027/9/20
第349回利付国債（10年）	0.1	490,000	491,332	2027/12/20
第350回利付国債（10年）	0.1	480,000	480,667	2028/3/20
第351回利付国債（10年）	0.1	435,000	435,204	2028/6/20
第14回利付国債（30年）	2.4	208,000	270,067	2034/3/20
第15回利付国債（30年）	2.5	147,000	193,437	2034/6/20
第16回利付国債（30年）	2.5	35,000	46,120	2034/9/20
第18回利付国債（30年）	2.3	110,000	141,926	2035/3/20
第21回利付国債（30年）	2.3	20,000	25,909	2035/12/20
第22回利付国債（30年）	2.5	40,000	53,224	2036/3/20
第23回利付国債（30年）	2.5	55,000	73,307	2036/6/20
第24回利付国債（30年）	2.5	68,000	90,783	2036/9/20
第25回利付国債（30年）	2.3	20,000	26,053	2036/12/20
第26回利付国債（30年）	2.4	170,000	224,583	2037/3/20
第27回利付国債（30年）	2.5	29,000	38,911	2037/9/20
第28回利付国債（30年）	2.5	94,000	126,336	2038/3/20
第29回利付国債（30年）	2.4	276,000	366,897	2038/9/20
第30回利付国債（30年）	2.3	147,000	193,099	2039/3/20
第31回利付国債（30年）	2.2	120,000	155,646	2039/9/20
第32回利付国債（30年）	2.3	50,000	65,987	2040/3/20
第33回利付国債（30年）	2.0	135,000	170,418	2040/9/20
第34回利付国債（30年）	2.2	200,000	261,354	2041/3/20
第35回利付国債（30年）	2.0	168,000	212,983	2041/9/20
第36回利付国債（30年）	2.0	135,000	171,478	2042/3/20
第37回利付国債（30年）	1.9	101,000	126,325	2042/9/20
第38回利付国債（30年）	1.8	95,000	116,890	2043/3/20
第39回利付国債（30年）	1.9	75,000	94,013	2043/6/20
第40回利付国債（30年）	1.8	90,000	110,869	2043/9/20
第41回利付国債（30年）	1.7	40,000	48,396	2043/12/20
第42回利付国債（30年）	1.7	105,000	127,086	2044/3/20
第43回利付国債（30年）	1.7	235,000	284,540	2044/6/20
第44回利付国債（30年）	1.7	100,000	121,123	2044/9/20
第45回利付国債（30年）	1.5	60,000	69,912	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	100,000	116,521	2045/3/20
第47回利付国債（30年）	1.6	115,000	136,855	2045/6/20
第48回利付国債（30年）	1.4	105,000	119,871	2045/9/20
第49回利付国債（30年）	1.4	90,000	102,728	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	25,000	24,860	2046/3/20
第51回利付国債（30年）	0.3	70,000	60,905	2046/6/20
第52回利付国債（30年）	0.5	90,000	82,617	2046/9/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第53回利付国債（30年）	0.6	105,000	98,813	2046/12/20
第54回利付国債（30年）	0.8	110,000	108,991	2047/3/20
第55回利付国債（30年）	0.8	110,000	108,858	2047/6/20
第56回利付国債（30年）	0.8	50,000	49,420	2047/9/20
第57回利付国債（30年）	0.8	100,000	98,716	2047/12/20
第58回利付国債（30年）	0.8	100,000	98,592	2048/3/20
第59回利付国債（30年）	0.7	100,000	95,881	2048/6/20
第44回利付国債（20年）	2.5	51,000	52,873	2020/3/20
第47回利付国債（20年）	2.2	21,000	21,931	2020/9/21
第48回利付国債（20年）	2.5	99,000	104,589	2020/12/21
第49回利付国債（20年）	2.1	57,000	60,052	2021/3/22
第50回利付国債（20年）	1.9	237,000	248,556	2021/3/22
第51回利付国債（20年）	2.0	39,000	41,198	2021/6/21
第54回利付国債（20年）	2.2	15,000	16,095	2021/12/20
第55回利付国債（20年）	2.0	66,000	70,740	2022/3/21
第57回利付国債（20年）	1.9	52,000	55,820	2022/6/20
第58回利付国債（20年）	1.9	135,000	145,579	2022/9/20
第59回利付国債（20年）	1.7	33,000	35,470	2022/12/20
第60回利付国債（20年）	1.4	295,000	313,405	2022/12/20
第61回利付国債（20年）	1.0	27,000	28,303	2023/3/20
第63回利付国債（20年）	1.8	31,000	33,730	2023/6/20
第64回利付国債（20年）	1.9	54,000	59,266	2023/9/20
第65回利付国債（20年）	1.9	100,000	110,224	2023/12/20
第66回利付国債（20年）	1.8	34,000	37,300	2023/12/20
第67回利付国債（20年）	1.9	34,000	37,623	2024/3/20
第68回利付国債（20年）	2.2	78,000	87,577	2024/3/20
第70回利付国債（20年）	2.4	104,000	118,480	2024/6/20
第72回利付国債（20年）	2.1	112,000	126,231	2024/9/20
第73回利付国債（20年）	2.0	113,000	127,233	2024/12/20
第74回利付国債（20年）	2.1	118,000	133,590	2024/12/20
第75回利付国債（20年）	2.1	10,000	11,370	2025/3/20
第76回利付国債（20年）	1.9	21,000	23,609	2025/3/20
第77回利付国債（20年）	2.0	40,000	45,226	2025/3/20
第79回利付国債（20年）	2.0	160,000	181,612	2025/6/20
第82回利付国債（20年）	2.1	60,000	68,803	2025/9/20
第87回利付国債（20年）	2.2	130,000	151,243	2026/3/20
第88回利付国債（20年）	2.3	300,000	352,722	2026/6/20
第90回利付国債（20年）	2.2	16,000	18,763	2026/9/20
第91回利付国債（20年）	2.3	250,000	295,152	2026/9/20
第92回利付国債（20年）	2.1	60,000	70,144	2026/12/20
第93回利付国債（20年）	2.0	60,000	69,890	2027/3/20
第94回利付国債（20年）	2.1	50,000	58,660	2027/3/20
第95回利付国債（20年）	2.3	82,000	97,958	2027/6/20
第96回利付国債（20年）	2.1	98,000	115,384	2027/6/20
第97回利付国債（20年）	2.2	45,000	53,541	2027/9/20
第98回利付国債（20年）	2.1	94,000	111,011	2027/9/20
第99回利付国債（20年）	2.1	117,000	138,639	2027/12/20
第100回利付国債（20年）	2.2	30,000	35,943	2028/3/20
第101回利付国債（20年）	2.4	66,000	80,306	2028/3/20
第102回利付国債（20年）	2.4	81,000	98,930	2028/6/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第103回利付国債（20年）	2.3	11,000	13,329	2028/6/20
第104回利付国債（20年）	2.1	33,000	39,358	2028/6/20
第105回利付国債（20年）	2.1	77,000	92,085	2028/9/20
第106回利付国債（20年）	2.2	2,000	2,411	2028/9/20
第107回利付国債（20年）	2.1	130,000	155,948	2028/12/20
第108回利付国債（20年）	1.9	134,000	158,058	2028/12/20
第109回利付国債（20年）	1.9	27,000	31,915	2029/3/20
第110回利付国債（20年）	2.1	98,000	117,849	2029/3/20
第111回利付国債（20年）	2.2	25,000	30,415	2029/6/20
第112回利付国債（20年）	2.1	80,000	96,490	2029/6/20
第113回利付国債（20年）	2.1	290,000	350,795	2029/9/20
第114回利付国債（20年）	2.1	52,000	63,043	2029/12/20
第115回利付国債（20年）	2.2	55,000	67,282	2029/12/20
第116回利付国債（20年）	2.2	55,000	67,474	2030/3/20
第117回利付国債（20年）	2.1	93,000	113,053	2030/3/20
第118回利付国債（20年）	2.0	10,000	12,075	2030/6/20
第119回利付国債（20年）	1.8	30,000	35,541	2030/6/20
第120回利付国債（20年）	1.6	70,000	81,286	2030/6/20
第121回利付国債（20年）	1.9	22,000	26,359	2030/9/20
第122回利付国債（20年）	1.8	17,000	20,171	2030/9/20
第123回利付国債（20年）	2.1	65,000	79,593	2030/12/20
第124回利付国債（20年）	2.0	80,000	97,012	2030/12/20
第125回利付国債（20年）	2.2	50,000	61,977	2031/3/20
第126回利付国債（20年）	2.0	25,000	30,366	2031/3/20
第128回利付国債（20年）	1.9	65,000	78,334	2031/6/20
第129回利付国債（20年）	1.8	50,000	59,642	2031/6/20
第130回利付国債（20年）	1.8	60,000	71,660	2031/9/20
第131回利付国債（20年）	1.7	12,000	14,182	2031/9/20
第132回利付国債（20年）	1.7	35,000	41,404	2031/12/20
第133回利付国債（20年）	1.8	30,000	35,871	2031/12/20
第134回利付国債（20年）	1.8	50,000	59,885	2032/3/20
第135回利付国債（20年）	1.7	30,000	35,543	2032/3/20
第136回利付国債（20年）	1.6	180,000	210,798	2032/3/20
第137回利付国債（20年）	1.7	200,000	237,158	2032/6/20
第138回利付国債（20年）	1.5	120,000	139,143	2032/6/20
第139回利付国債（20年）	1.6	150,000	175,899	2032/6/20
第140回利付国債（20年）	1.7	450,000	534,379	2032/9/20
第141回利付国債（20年）	1.7	195,000	231,878	2032/12/20
第142回利付国債（20年）	1.8	85,000	102,227	2032/12/20
第143回利付国債（20年）	1.6	94,000	110,550	2033/3/20
第144回利付国債（20年）	1.5	130,000	151,100	2033/3/20
第145回利付国債（20年）	1.7	205,000	244,222	2033/6/20
第146回利付国債（20年）	1.7	135,000	160,911	2033/9/20
第147回利付国債（20年）	1.6	60,000	70,683	2033/12/20
第148回利付国債（20年）	1.5	120,000	139,641	2034/3/20
第149回利付国債（20年）	1.5	215,000	250,365	2034/6/20
第150回利付国債（20年）	1.4	90,000	103,448	2034/9/20
第151回利付国債（20年）	1.2	150,000	167,686	2034/12/20
第152回利付国債（20年）	1.2	90,000	100,532	2035/3/20
第153回利付国債（20年）	1.3	120,000	135,896	2035/6/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第154回利付国債（20年）	1.2	120,000	133,918	2035/9/20
第155回利付国債（20年）	1.0	140,000	151,530	2035/12/20
第156回利付国債（20年）	0.4	110,000	107,980	2036/3/20
第157回利付国債（20年）	0.2	50,000	47,261	2036/6/20
第158回利付国債（20年）	0.5	170,000	168,889	2036/9/20
第159回利付国債（20年）	0.6	150,000	151,362	2036/12/20
第160回利付国債（20年）	0.7	140,000	143,386	2037/3/20
第161回利付国債（20年）	0.6	120,000	120,504	2037/6/20
第162回利付国債（20年）	0.6	70,000	70,178	2037/9/20
第163回利付国債（20年）	0.6	165,000	165,000	2037/12/20
第164回利付国債（20年）	0.5	285,000	279,077	2038/3/20
小計		27,432,000	30,067,973	
地方債証券				
第26回東京都公募公債（20年）	1.74	100,000	116,955	2032/6/18
第690回東京都公募公債	1.29	100,000	102,724	2020/12/18
第694回東京都公募公債	1.35	200,000	206,390	2021/3/19
第708回東京都公募公債	0.89	100,000	103,191	2022/6/20
第709回東京都公募公債	0.78	100,000	102,790	2022/6/20
第712回東京都公募公債	0.77	200,000	205,886	2022/9/20
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	103,336	2024/3/19
第731回東京都公募公債	0.635	100,000	103,180	2024/3/19
平成24年度第2回京都府公募公債	0.91	200,000	206,490	2022/6/20
平成22年度第11回埼玉県公募公債	1.28	100,000	102,948	2021/2/25
平成24年度第1回埼玉県公募公債	1.05	100,000	103,601	2022/4/26
平成24年度第10回埼玉県公募公債	0.825	100,000	103,423	2023/2/27
平成24年度第9回福岡県公募公債	0.71	100,000	102,830	2022/12/26
第10回群馬県公募公債（10年）	0.67	100,000	103,141	2023/11/24
平成25年度第1回岐阜県公募公債（10年）	0.81	100,000	103,759	2023/9/29
第83回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	101,901	2020/2/25
第93回共同発行市場公募地方債	1.25	100,000	102,661	2020/12/25
第99回共同発行市場公募地方債	1.17	100,000	103,074	2021/6/25
平成24年度第1回長崎県公募公債	0.82	100,000	103,114	2022/9/28
第3回川崎市公募公債（15年）	1.82	100,000	103,875	2020/12/21
第51回川崎市公募公債（5年）	0.02	100,000	99,980	2022/9/20
第53回川崎市公募公債（5年）	0.03	100,000	99,953	2023/6/20
平成22年度第2回福井県公募公債	1.4	100,000	103,448	2021/4/23
平成23年度第2回岡山県公募公債（10年）	1.01	100,000	103,405	2022/3/30
小計		2,700,000	2,792,055	
特殊債券（除く金融債）				
第2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	103,985	2020/12/27
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	103,207	2021/11/30
第6回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	1.2	100,000	101,413	2019/12/16
第14回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.9	100,000	103,164	2022/3/14
第16回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.819	100,000	103,295	2022/9/20
第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.693	100,000	103,538	2023/12/18
第1回政府保証新関西国際空港債券	0.801	100,000	103,175	2022/8/29
第2回政府保証新関西国際空港債券	0.882	100,000	104,167	2023/6/27

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券（除く金融債）	%	千円	千円	
第5回新関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	0.9	100,000	104,015	2023/9/15
第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	0.781	100,000	102,866	2022/9/20
第36回日本政策投資銀行債券	2.23	100,000	117,231	2027/5/28
第17回道路債券	1.54	100,000	106,127	2022/12/20
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.43	100,000	101,628	2019/12/20
第86回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.934	100,000	103,010	2022/3/18
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券（財投機関債）	0.715	100,000	102,872	2023/3/20
第1回地方公営企業等金融機構債券（20年）	2.07	100,000	117,493	2028/12/20
第45回地方公共団体金融機構債券	0.791	200,000	206,332	2023/2/28
F223回地方公共団体金融機構債券	0.527	100,000	101,724	2022/5/27
F290回地方公共団体金融機構債券	0.353	100,000	101,463	2023/9/28
第35回株式会社日本政策金融公庫社債（一般担保付）	0.62	100,000	102,530	2023/5/8
第38回関西国際空港株式会社社債（一般担保付）	1.112	100,000	103,291	2021/12/20
第39回独立行政法人福祉医療機構債券	0.674	100,000	103,224	2024/6/20
第17回沖縄振興開発金融公庫債券	1.208	100,000	103,152	2021/6/18
第19回沖縄振興開発金融公庫債券	0.868	100,000	103,746	2023/6/20
小計		2,500,000	2,606,648	
金融債券				
第316回信金中金債（5年）	0.07	100,000	100,036	2021/3/26
第318回信金中金債（5年）	0.04	100,000	99,961	2021/5/27
第320回信金中金債（5年）	0.01	100,000	99,876	2021/7/27
第322回信金中金債（5年）	0.03	200,000	199,854	2021/9/27
小計		500,000	499,727	
普通社債券（含む投資法人債券）				
第563回東京電力株式会社社債（一般担保付）	1.39	100,000	101,921	2020/5/28
第299回北陸電力株式会社社債（一般担保付）	1.209	100,000	103,953	2022/8/25
第8回成田国際空港株式会社社債（一般担保付）	1.562	100,000	102,000	2020/2/10
第15回成田国際空港株式会社社債（一般担保付）	0.739	100,000	103,303	2024/2/20
第14回森永乳業株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	0.774	100,000	103,407	2025/12/10
第6回ヤンマーホールディングス株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	0.22	100,000	99,473	2026/6/2
第3回不二製油グループ本社株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	0.456	200,000	202,052	2022/12/9
第21回味の素株式会社無担保社債（特定社債間限定同順位特約付）	0.2	100,000	100,194	2023/3/2
第10回日本たばこ産業株式会社社債（一般担保付）	0.358	100,000	100,955	2022/7/15
第4回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債（社債間限定同順位特約付）	1.399	100,000	102,189	2020/6/19
第36回東レ株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	0.925	100,000	102,952	2022/7/20
第9回株式会社セブン銀行無担保社債（社債間限定同順位特約付）	0.46	200,000	201,174	2020/3/19
第20回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	1.71	100,000	106,338	2022/9/20
第30回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付）	2.01	100,000	109,261	2023/9/20
第40回東日本旅客鉄道株式会社無担保長期普通社債（社債間限定同順位特約付）	1.86	100,000	103,890	2020/12/18
第50回東日本旅客鉄道株式会社無担保長期普通社債（社債間限定同順位特約付）	0.869	200,000	206,122	2022/9/27
第6回東日本電信電話株式会社無担保電信電話債券（一般担保付）	0.69	200,000	204,762	2023/3/20
第19回沖縄電力株式会社社債（一般担保付）	1.452	100,000	102,099	2020/4/24
第11回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債（2016）	0.3	100,000	100,323	2021/1/22
小計		2,300,000	2,356,368	
合計		35,432,000	38,322,771	

○投資信託財産の構成

(2018年10月26日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	38,322,771	99.5
コール・ローン等、その他	198,494	0.5
投資信託財産総額	38,521,265	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 (2018年10月26日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	38,521,265,084
コール・ローン等	117,636,090
公社債(評価額)	38,322,771,850
未収利息	80,137,461
前払費用	719,683
(B) 負債	54,418,286
未払解約金	54,418,138
未払利息	148
(C) 純資産総額(A－B)	38,466,846,798
元本	27,733,551,245
次期繰越損益金	10,733,295,553
(D) 受益権総口数	27,733,551,245口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,870円

(注) 当ファンドの期首元本額は26,501,934,817円、期中追加設定元本額は3,531,441,697円、期中一部解約元本額は2,299,825,269円です。

(注) 2018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日本債券（1年決算型）	6,322,149,282円
・国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	4,991,215,999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	3,834,626,257円
・ＤＣインデックスバランス（株式40）	1,862,268,494円
・ＤＣインデックスバランス（株式20）	1,832,450,054円
・インデックスファンド日本債券（ＤＣ専用）	1,798,701,774円
・インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,514,625,168円
・ＤＣインデックスバランス（株式60）	1,342,863,165円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	1,252,645,847円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	1,241,071,680円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	685,795,510円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	300,427,344円
・日本債券インデックスファンド（個人型年金向け）	264,260,691円
・ＤＣインデックスバランス（株式80）	221,368,003円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	119,991,693円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	102,644,008円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	26,123,505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）	8,181,717円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,753,159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	3,933,014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）	3,454,881円

(注) 1口当たり純資産額は1.3870円です。

○損益の状況 (2017年10月27日～2018年10月26日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	389,364,531
受取利息	389,421,766
支払利息	△ 57,235
(B) 有価証券売買損益	△ 312,795,165
売買益	12,659,292
売買損	△ 325,454,457
(C) 保管費用等	△ 10,020
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	76,559,346
(E) 前期繰越損益金	10,172,786,963
(F) 追加信託差損益金	1,378,999,490
(G) 解約差損益金	△ 895,050,246
(H) 計(D＋E＋F＋G)	10,733,295,553
次期繰越損益金(H)	10,733,295,553

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

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

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

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。

○お知らせ

約款変更について

2017年10月27日から2018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。

海外債券インデックス（ヘッジなし）マザーファンド

運 用 報 告 書

第20期（決算日　2018年10月26日）
（2017年10月27日～2018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	1998年10月30日から原則無期限です。
運　用　方　針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主 要 運 用 対 象	内外の公社債を主要投資対象とします。
組　入　制　限	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

主として世界各国の債券に投資し、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、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、債券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、債券の組入総額と債券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

<935557>

【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		FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）		債券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
16期(2014年10月27日)	21,715	12.9	216.34	12.8	98.6	204,817
17期(2015年10月26日)	23,457	8.0	234.02	8.2	98.7	183,705
18期(2016年10月26日)	20,612	△12.1	205.20	△12.3	98.9	152,382
19期(2017年10月26日)	23,039	11.8	229.54	11.9	98.9	158,578
20期(2018年10月26日)	22,220	△ 3.6	221.52	△ 3.5	98.9	147,033

（注）FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、設定時を100として2018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		FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）		債券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率	
（期　首）	円	%		%	%
2017年10月26日	23,039	－	229.54	－	98.9
10月末	22,934	△0.5	228.42	△0.5	98.9
11月末	22,953	△0.4	228.74	△0.3	99.1
12月末	23,241	0.9	231.52	0.9	98.9
2018年１月末	22,667	△1.6	225.83	△1.6	98.9
２月末	22,086	△4.1	220.23	△4.1	99.0
３月末	22,235	△3.5	221.70	△3.4	98.9
４月末	22,506	△2.3	224.34	△2.3	98.8
５月末	21,926	△4.8	218.13	△5.0	99.0
６月末	22,253	△3.4	221.81	△3.4	99.0
７月末	22,420	△2.7	223.51	△2.6	98.9
８月末	22,408	△2.7	223.23	△2.7	99.1
９月末	22,782	△1.1	227.42	△0.9	99.0
（期　末）					
2018年10月26日	22,220	△3.6	221.52	△3.5	98.9

（注）騰落率は期首比です。

○運用経過

（2017年10月27日～2018年10月26日）

基準価額の推移

期間の初め23,039円の基準価額は、期間末に22,220円となり、騰落率は△3.6%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＞
・米国の保護主義的な貿易政策の発表を受けて、貿易を巡る懸念が世界的に広がったこと。
・欧州中央銀行（ＥＣＢ）が2019年夏まで利上げを据え置く方針を示したこと。
・米国とトルコの関係悪化などを背景としたトルコリラの急落が新興国市場にも波及したことで、リスク回避需要が高まったこと。

＜値下がり要因＞
・米国連邦準備制度理事会（ＦＲＢ）による利上げ観測が広がったことや、追加利上げが決定されたこと（2017年12月、2018年３月、６月、９月）。
・ＥＣＢがユーロ圏の経済成長見通しを引き上げたこと。
・円高／アメリカドル安、円高／ユーロ安、円高／イギリスポンド安となったこと。

基準価額の推移

期　首	期中高値	期中安値	期　末
2017/10/26	2017/12/28	2018/05/30	2018/10/26
23,039円	23,323円	21,795円	22,220円

FTSE世界国債インデックス
（除く日本、ヘッジなし・円ベース）（指数化）の推移

（海外債券市況）

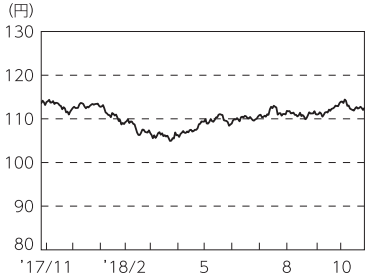
海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて、まちまちの動きとなりました。

期間の初めから2018年２月中旬にかけては、ＥＣＢがユーロ圏の経済成長見通しを引き上げたことや、米国の雇用統計にて賃金の伸びが市場予想を上回り米国の利上げペースの加速が意識されたことなどを背景に、各国の10年国債利回りは総じて上昇（債券価格は下落）しました。２月下旬から３月下旬にかけては、フランスやドイツの景況感に関する指標が市場予想を下回ったことや、米国の保護主義的な貿易政策の発表を受けて貿易を巡る懸念が世界的に広がったこと、ＥＣＢが予想インフレ率を下方修正してインフレへの慎重な見方を示したことなどを受けて、各国の10年国債利回りは総じて低下（債券価格は上昇）しました。４月上旬から５月中旬にかけては、中国の市場開放政策を受けて米中間の貿易摩擦による世界経済の成長鈍化懸念が緩和したことや、商品価格の上昇によるインフレ圧力などを受けて、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。５月下旬から８月中旬にかけては、ＥＣＢが2019年夏まで利上げを据え置く方針を示したことや、米国とトルコの関係悪化などによるトルコリラの急落が新興国市場にも波及したことでリスク回避需要が高まったことなどを背景に、各国の10年国債利回りは概して低下しました。８月下旬から期間末にかけては、米国供給管理協会（ＩＳＭ）製造業景況指数が市場予想を上回ったことや、ＦＲＢが追加利上げを実施したこと、ＥＣＢ総裁がユーロ圏の基調的なインフレ率には上昇が見込まれるとの見解を示したことなどを受けて、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。

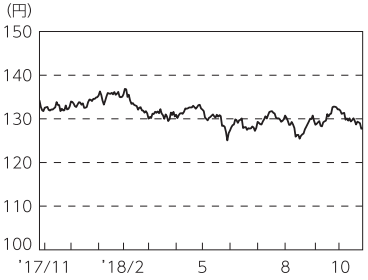
（為替市況）

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

債券のリスクコントロールモデルによりベンチマークが採用している国の債券の中からポートフォリオを構築し、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、債券の組入比率を高位に維持してベンチマークとの連動性を保つように努めました。

当ファンドのベンチマークとの差異

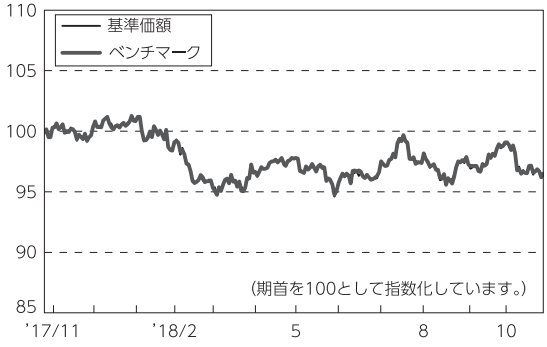
期間中における基準価額は、3.6%の値下がりとなり、ベンチマークである「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」の下落率3.5%を概ね0.1%下回りました。

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＞
・投資銘柄の選択による効果が寄与したこと。
・投資国の選択による効果が寄与したこと。

＜マイナス要因＞
・投資通貨の選択が影響したこと。
・債券および為替取引に関する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、これまでの運用方針を維持します。原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度などの属性をベンチマークと同程度に保ち、連動性を高めるように努めます。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、毎月ポートフォリオの見直しなどを行なうとともに、債券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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	3	0.014	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(3)	(0.014)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合計	3	0.014	
期中の平均基準価額は、22,534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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

公社債

			買　付　額	売　付　額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 140,126	千アメリカドル 124,184
	カナダ	国債証券	千カナダドル 7,909	千カナダドル 9,919
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 34,265	千メキシコペソ 30,276
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	11,003	15,841
	イタリア	国債証券	11,941	17,276
	フランス	国債証券	12,772	14,322
	オランダ	国債証券	1,998	3,738
	スペイン	国債証券	9,587	9,728
	ベルギー	国債証券	2,039	3,251
	オーストリア	国債証券	1,691	3,272
	フィンランド	国債証券	618	685
	アイルランド	国債証券	1,378	1,889
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 4,775	千イギリスポンド 9,495
	スイス	国債証券	千スイスフラン －	千スイスフラン 2,390
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 847	千スウェーデンクローナ 10,915
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 3,144	千ノルウェークローネ 9,275
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 1,991	千デンマーククローネ 7,536
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 4,470	千ポーランドズロチ 6,527
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 4,684	千オーストラリアドル 5,207
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 1,655	千シンガポールドル 1,110
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 3,037	千マレーシアリンギット 1,773
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 11,667	千南アフリカランド 7,453

（注）金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2017年10月27日～2018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。

○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10月27日～2018年10月26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

（2018年10月26日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	598,810	587,081	66,029,083	44.9	－	18.5	17.6	8.9
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	33,302	34,504	2,965,698	2.0	－	0.9	0.7	0.5
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	216,370	211,795	1,222,062	0.8	－	0.5	0.2	0.2
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	68,530	79,786	10,199,134	6.9	－	4.5	1.7	0.8
イタリア	95,620	99,557	12,726,391	8.7	－	5.0	2.7	1.0
フランス	102,420	119,361	15,257,970	10.4	－	7.0	2.3	1.1
オランダ	19,970	23,668	3,025,534	2.1	－	1.3	0.6	0.2
スペイン	58,715	67,096	8,576,992	5.8	－	4.0	1.3	0.6
ベルギー	23,789	28,231	3,608,866	2.5	－	1.8	0.5	0.1
オーストリア	14,907	17,405	2,224,897	1.5	－	0.9	0.4	0.2
フィンランド	6,495	7,074	904,369	0.6	－	0.4	0.2	0.1
アイルランド	8,295	9,142	1,168,649	0.8	－	0.5	0.1	0.2
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	53,652	66,591	9,603,220	6.5	－	4.8	1.2	0.5
	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
スウェーデン	39,150	43,879	541,473	0.4	－	0.2	0.1	－
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	25,470	26,096	351,517	0.2	－	0.1	0.1	－
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	42,160	52,149	893,314	0.6	－	0.4	0.1	0.1
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	29,925	30,739	911,418	0.6	－	0.2	0.3	0.1
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	36,767	38,887	3,093,539	2.1	－	1.3	0.6	0.2
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	7,335	7,412	603,542	0.4	－	0.2	0.1	0.1
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	26,585	26,428	712,519	0.5	－	0.3	0.1	0.1
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	117,440	102,952	792,732	0.5	－	0.5	0.1	0.0
合計	－	－	145,412,931	98.9	－	53.1	31.0	14.8

（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）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

（B）外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ） 国債証券	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
US TREASURY N/B	1.75	7,450	7,387	830,897	2019/9/30
US TREASURY N/B	1.0	5,100	5,018	564,477	2019/10/15
US TREASURY N/B	1.5	4,100	4,051	455,660	2019/10/31
US TREASURY N/B	3.375	10,530	10,601	1,192,335	2019/11/15
US TREASURY N/B	1.5	5,000	4,935	555,046	2019/11/30
US TREASURY N/B	1.625	1,900	1,875	210,980	2019/12/31
US TREASURY N/B	1.25	4,000	3,925	441,532	2020/1/31
US TREASURY N/B	2.0	3,000	2,971	334,259	2020/1/31
US TREASURY N/B	3.625	8,070	8,155	917,258	2020/2/15
US TREASURY N/B	1.375	3,000	2,945	331,228	2020/2/29
US TREASURY N/B	1.375	1,100	1,078	121,298	2020/3/31
US TREASURY N/B	1.375	2,430	2,378	267,542	2020/4/30
US TREASURY N/B	2.375	3,000	2,981	335,301	2020/4/30
US TREASURY N/B	3.5	7,830	7,911	889,859	2020/5/15
US TREASURY N/B	1.375	2,440	2,385	268,268	2020/5/31
US TREASURY N/B	1.5	5,100	4,995	561,822	2020/5/31
US TREASURY N/B	1.875	3,510	3,455	388,609	2020/6/30
US TREASURY N/B	1.625	4,000	3,921	441,101	2020/6/30
US TREASURY N/B	2.0	5,370	5,292	595,281	2020/7/31
US TREASURY N/B	1.625	4,000	3,916	440,504	2020/7/31
US TREASURY N/B	2.625	620	617	69,484	2020/7/31
US TREASURY N/B	8.75	4,810	5,305	596,674	2020/8/15
US TREASURY N/B	2.625	5,180	5,159	580,318	2020/8/15
US TREASURY N/B	1.5	800	781	87,872	2020/8/15
US TREASURY N/B	2.125	1,450	1,431	160,969	2020/8/31
US TREASURY N/B	1.375	2,300	2,239	251,885	2020/8/31
US TREASURY N/B	1.375	4,750	4,622	519,948	2020/9/15
US TREASURY N/B	1.375	3,700	3,598	404,719	2020/9/30
US TREASURY N/B	1.625	2,000	1,953	219,667	2020/10/15
US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,956	220,072	2020/10/31
US TREASURY N/B	1.375	1,290	1,252	140,895	2020/10/31
US TREASURY N/B	2.625	3,500	3,483	391,776	2020/11/15
US TREASURY N/B	1.75	1,400	1,369	153,982	2020/11/15
US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,964	220,999	2020/11/30
US TREASURY N/B	1.625	1,120	1,091	122,787	2020/11/30
US TREASURY N/B	1.875	2,400	2,351	264,418	2020/12/15
US TREASURY N/B	2.375	3,000	2,968	333,897	2020/12/31
US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,952	219,650	2020/12/31
US TREASURY N/B	2.0	1,900	1,864	209,661	2021/1/15
US TREASURY N/B	2.125	2,400	2,360	265,457	2021/1/31
US TREASURY N/B	1.375	2,000	1,934	217,545	2021/1/31
US TREASURY N/B	3.625	4,730	4,806	540,596	2021/2/15
US TREASURY N/B	2.25	2,500	2,464	277,209	2021/2/15
US TREASURY N/B	2.0	2,370	2,322	261,217	2021/2/28
US TREASURY N/B	1.125	2,000	1,920	216,017	2021/2/28
US TREASURY N/B	2.25	340	334	37,669	2021/3/31
US TREASURY N/B	1.25	1,270	1,221	137,399	2021/3/31
US TREASURY N/B	2.25	4,180	4,115	462,861	2021/4/30
US TREASURY N/B	1.375	2,000	1,926	216,693	2021/4/30

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ） 国債証券	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
US TREASURY N/B	3.125	4,320	4,344	488,622	2021/5/15
US TREASURY N/B	2.625	880	873	98,289	2021/5/15
US TREASURY N/B	1.375	2,060	1,981	222,895	2021/5/31
US TREASURY N/B	2.625	1,900	1,886	212,190	2021/6/15
US TREASURY N/B	2.125	6,050	5,928	666,821	2021/6/30
US TREASURY N/B	1.125	3,900	3,722	418,663	2021/6/30
US TREASURY N/B	2.625	3,000	2,977	334,892	2021/7/15
US TREASURY N/B	2.25	5,300	5,207	585,647	2021/7/31
US TREASURY N/B	1.125	5,000	4,763	535,781	2021/7/31
US TREASURY N/B	2.125	12,250	11,991	1,348,641	2021/8/15
US TREASURY N/B	1.125	4,400	4,185	470,791	2021/8/31
US TREASURY N/B	2.125	2,400	2,346	263,944	2021/9/30
US TREASURY N/B	1.125	1,500	1,424	160,250	2021/9/30
US TREASURY N/B	2.0	3,830	3,728	419,292	2021/10/31
US TREASURY N/B	1.25	2,000	1,903	214,132	2021/10/31
US TREASURY N/B	8.0	9,250	10,620	1,194,448	2021/11/15
US TREASURY N/B	2.0	4,000	3,893	437,903	2021/11/15
US TREASURY N/B	1.75	600	579	65,150	2021/11/30
US TREASURY N/B	2.125	3,120	3,044	342,387	2021/12/31
US TREASURY N/B	1.5	800	764	85,978	2022/1/31
US TREASURY N/B	2.0	2,500	2,427	272,975	2022/2/15
US TREASURY N/B	1.75	2,500	2,406	270,614	2022/2/28
US TREASURY N/B	1.75	1,800	1,730	194,652	2022/3/31
US TREASURY N/B	1.75	3,000	2,881	324,038	2022/4/30
US TREASURY N/B	1.875	3,800	3,665	412,243	2022/4/30
US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,919	215,902	2022/5/15
US TREASURY N/B	1.875	3,420	3,295	370,681	2022/5/31
US TREASURY N/B	2.125	2,500	2,428	273,135	2022/6/30
US TREASURY N/B	2.0	3,930	3,797	427,141	2022/7/31
US TREASURY N/B	1.875	9,700	9,330	1,049,366	2022/7/31
US TREASURY N/B	1.625	2,000	1,904	214,237	2022/8/15
US TREASURY N/B	1.875	1,900	1,825	205,333	2022/8/31
US TREASURY N/B	1.75	3,550	3,391	381,465	2022/9/30
US TREASURY N/B	1.875	2,000	1,920	215,955	2022/9/30
US TREASURY N/B	1.875	3,000	2,877	323,603	2022/10/31
US TREASURY N/B	2.0	1,000	963	108,417	2022/10/31
US TREASURY N/B	1.625	1,000	949	106,754	2022/11/15
US TREASURY N/B	2.0	3,410	3,284	369,395	2022/11/30
US TREASURY N/B	2.125	3,900	3,771	424,223	2022/12/31
US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,902	214,013	2023/1/31
US TREASURY N/B	2.375	1,580	1,542	173,537	2023/1/31
US TREASURY N/B	2.0	5,800	5,574	626,972	2023/2/15
US TREASURY N/B	1.5	3,100	2,915	327,907	2023/2/28
US TREASURY N/B	2.625	570	562	63,238	2023/2/28
US TREASURY N/B	1.5	2,000	1,878	211,280	2023/3/31
US TREASURY N/B	2.5	2,130	2,088	234,938	2023/3/31
US TREASURY N/B	1.625	660	622	70,035	2023/4/30
US TREASURY N/B	2.75	3,600	3,566	401,159	2023/4/30
US TREASURY N/B	1.75	8,150	7,727	869,151	2023/5/15

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ）	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
国債証券					
US TREASURY N/B	1.625	1,500	1,413	159,004	2023/5/31
US TREASURY N/B	2.75	1,300	1,288	144,894	2023/5/31
US TREASURY N/B	1.375	4,000	3,721	418,599	2023/6/30
US TREASURY N/B	2.625	1,000	984	110,765	2023/6/30
US TREASURY N/B	1.25	11,000	10,161	1,142,811	2023/7/31
US TREASURY N/B	2.5	5,300	5,187	583,482	2023/8/15
US TREASURY N/B	1.375	1,850	1,716	193,057	2023/8/31
US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,316	260,559	2023/9/30
US TREASURY N/B	1.625	1,700	1,593	179,166	2023/10/31
US TREASURY N/B	2.75	4,000	3,956	445,012	2023/11/15
US TREASURY N/B	2.125	2,910	2,792	314,023	2023/11/30
US TREASURY N/B	2.25	2,500	2,411	271,268	2023/12/31
US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,927	216,816	2024/1/31
US TREASURY N/B	2.75	3,300	3,260	366,714	2024/2/15
US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,435	161,459	2024/2/29
US TREASURY N/B	2.125	3,000	2,868	322,674	2024/3/31
US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,898	213,512	2024/4/30
US TREASURY N/B	2.5	5,800	5,649	635,380	2024/5/15
US TREASURY N/B	2.0	3,430	3,252	365,820	2024/5/31
US TREASURY N/B	2.0	1,100	1,042	117,202	2024/6/30
US TREASURY N/B	2.125	3,180	3,030	340,833	2024/7/31
US TREASURY N/B	2.375	4,620	4,460	501,688	2024/8/15
US TREASURY N/B	1.875	1,420	1,333	149,993	2024/8/31
US TREASURY N/B	2.125	2,400	2,283	256,805	2024/9/30
US TREASURY N/B	2.25	1,090	1,043	117,365	2024/10/31
US TREASURY N/B	2.25	5,930	5,673	638,132	2024/11/15
US TREASURY N/B	2.125	1,200	1,139	128,165	2024/11/30
US TREASURY N/B	2.25	1,900	1,816	204,264	2024/12/31
US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,454	163,535	2025/1/31
US TREASURY N/B	2.0	4,970	4,672	525,524	2025/2/15
US TREASURY N/B	2.75	2,060	2,025	227,810	2025/2/28
US TREASURY N/B	2.625	4,400	4,292	482,776	2025/3/31
US TREASURY N/B	2.875	2,200	2,177	244,930	2025/4/30
US TREASURY N/B	2.125	4,800	4,536	510,206	2025/5/15
US TREASURY N/B	2.875	1,150	1,137	127,968	2025/5/31
US TREASURY N/B	2.75	4,000	3,926	441,594	2025/6/30
US TREASURY N/B	2.875	4,000	3,955	444,906	2025/7/31
US TREASURY N/B	2.0	5,220	4,880	548,886	2025/8/15
US TREASURY N/B	2.25	5,940	5,632	633,519	2025/11/15
US TREASURY N/B	6.0	1,800	2,145	241,337	2026/2/15
US TREASURY N/B	1.625	5,250	4,753	534,673	2026/2/15
US TREASURY N/B	1.625	3,400	3,067	345,009	2026/5/15
US TREASURY N/B	1.5	4,000	3,560	400,498	2026/8/15
US TREASURY N/B	6.5	2,450	3,046	342,598	2026/11/15
US TREASURY N/B	2.0	5,040	4,647	522,696	2026/11/15
US TREASURY N/B	2.25	4,800	4,500	506,157	2027/2/15
US TREASURY N/B	2.375	3,030	2,864	322,147	2027/5/15
US TREASURY N/B	2.25	5,090	4,750	534,232	2027/8/15
US TREASURY N/B	6.125	3,960	4,892	550,297	2027/11/15
US TREASURY N/B	2.25	6,100	5,680	638,873	2027/11/15
US TREASURY N/B	2.75	4,000	3,877	436,119	2028/2/15
US TREASURY N/B	2.875	1,870	1,830	205,886	2028/5/15
US TREASURY N/B	5.25	1,000	1,180	132,767	2028/11/15
US TREASURY N/B	5.25	1,000	1,184	133,213	2029/2/15
US TREASURY N/B	6.25	1,060	1,376	154,785	2030/5/15
US TREASURY N/B	5.375	1,460	1,787	201,011	2031/2/15
US TREASURY N/B	5.0	1,250	1,558	175,262	2037/5/15
US TREASURY N/B	4.375	1,170	1,359	152,865	2038/2/15
US TREASURY N/B	4.5	1,220	1,440	162,000	2038/5/15
US TREASURY N/B	4.25	1,850	2,118	238,308	2039/5/15
US TREASURY N/B	4.5	1,820	2,152	242,140	2039/8/15
US TREASURY N/B	4.375	1,750	2,037	229,129	2039/11/15
US TREASURY N/B	4.625	1,680	2,021	227,370	2040/2/15
US TREASURY N/B	4.375	1,590	1,853	208,459	2040/5/15
US TREASURY N/B	3.875	1,440	1,567	176,254	2040/8/15
US TREASURY N/B	4.25	2,010	2,305	259,316	2040/11/15
US TREASURY N/B	4.75	1,500	1,840	206,973	2041/2/15
US TREASURY N/B	4.375	870	1,016	114,288	2041/5/15
US TREASURY N/B	3.75	1,960	2,094	235,562	2041/8/15
US TREASURY N/B	2.75	800	723	81,333	2042/8/15
US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,804	202,982	2042/11/15
US TREASURY N/B	3.125	2,000	1,927	216,834	2043/2/15
US TREASURY N/B	2.875	5,800	5,346	601,337	2043/5/15
US TREASURY N/B	3.625	5,120	5,364	603,300	2043/8/15
US TREASURY N/B	3.75	4,500	4,809	540,979	2043/11/15
US TREASURY N/B	3.625	3,000	3,144	353,614	2044/2/15
US TREASURY N/B	3.375	3,400	3,419	384,563	2044/5/15
US TREASURY N/B	3.125	4,050	3,897	438,341	2044/8/15
US TREASURY N/B	3.0	3,300	3,103	349,041	2044/11/15
US TREASURY N/B	2.5	3,300	2,811	316,239	2045/2/15
US TREASURY N/B	3.0	3,200	3,006	338,169	2045/5/15
US TREASURY N/B	2.875	5,300	4,859	546,505	2045/8/15
US TREASURY N/B	3.0	3,900	3,661	411,757	2045/11/15
US TREASURY N/B	2.5	2,800	2,375	267,137	2046/2/15
US TREASURY N/B	2.5	2,500	2,118	238,323	2046/5/15
US TREASURY N/B	2.25	2,150	1,723	193,849	2046/8/15
US TREASURY N/B	2.875	2,000	1,828	205,653	2046/11/15
US TREASURY N/B	3.0	2,800	2,623	295,055	2047/2/15
US TREASURY N/B	3.0	2,680	2,509	282,227	2047/5/15
US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,778	200,082	2047/8/15
US TREASURY N/B	2.75	1,870	1,662	186,986	2047/11/15
US TREASURY N/B	3.0	2,750	2,571	289,164	2048/2/15
US TREASURY N/B	3.125	2,400	2,300	258,693	2048/5/15
US TREASURY N/B	3.0	2,100	1,963	220,816	2048/8/15
小計				66,029,083	
（カナダ）		千カナダドル	千カナダドル		
国債証券					
CANADA GOVERNMENT	2.75	335	362	31,178	2064/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	950	941	80,950	2019/11/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.25	780	771	66,268	2020/2/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	2,170	2,149	184,762	2020/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.75	970	962	82,757	2020/5/1

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（カナダ） 国債証券	%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	1,150	1,172	100,757	2020/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.75	690	683	58,752	2020/8/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,020	1,964	168,825	2020/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	320	318	27,336	2020/11/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,140	2,064	177,401	2021/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.25	950	971	83,515	2021/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.75	1,470	1,406	120,855	2021/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.5	1,190	1,119	96,204	2022/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	980	992	85,326	2022/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,310	1,244	106,944	2022/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.75	1,140	1,110	95,424	2023/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,300	1,250	107,445	2023/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	660	647	55,694	2023/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,120	1,124	96,654	2024/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	1,030	1,018	87,518	2025/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,100	1,028	88,407	2026/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	8.0	370	528	45,393	2027/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,160	1,030	88,575	2027/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	1,107	1,064	91,459	2028/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	890	1,160	99,726	2029/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.25	100	98	8,423	2029/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	1,015	1,417	121,857	2033/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.0	1,090	1,494	128,453	2037/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	4.0	1,225	1,540	132,431	2041/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	1,315	1,573	135,277	2045/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,055	1,114	95,791	2048/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.0	200	178	15,328	2051/12/1
小計				2,965,698	
（メキシコ） 国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	16,000	15,466	89,242	2019/12/11
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	26,100	26,044	150,278	2020/6/11
MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	24,700	23,742	136,992	2021/6/10
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.25	2,900	2,825	16,305	2021/12/9
MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	21,400	20,285	117,046	2022/6/9
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	11,000	10,897	62,880	2023/12/7
MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	21,500	23,313	134,517	2024/12/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	10,650	9,172	52,923	2026/3/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	12,300	11,659	67,277	2027/6/3
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	11,750	11,846	68,355	2029/5/31
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	11,900	11,281	65,096	2031/5/29
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	5,800	5,433	31,352	2034/11/23
MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	7,800	8,891	51,303	2036/11/20
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	9,400	9,398	54,229	2038/11/18
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	15,500	14,294	82,481	2042/11/13
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	7,670	7,240	41,780	2047/11/7
小計				1,222,062	
（ユーロ…ドイツ） 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
BUNDESOBLIGATION	0.25	1,000	1,017	130,071	2020/10/16
BUNDESOBLIGATION	—	1,200	1,217	155,601	2021/4/9

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（ユーロ…ドイツ） 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BUNDESOBLIGATION	—	740	751	96,032	2021/10/8
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	3,220	3,374	431,378	2020/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	2,720	2,889	369,414	2020/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	1,520	1,602	204,848	2020/9/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,410	1,507	192,682	2021/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	1,730	1,908	243,916	2021/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	1,580	1,706	218,106	2021/9/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	2,000	2,159	275,997	2022/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	2,470	2,667	341,016	2022/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,600	1,716	219,468	2022/9/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,900	2,048	261,915	2023/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,720	1,859	237,711	2023/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	1,850	2,049	262,007	2023/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	790	1,054	134,780	2024/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	2,060	2,268	290,043	2024/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,950	2,125	271,760	2024/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	1,830	1,945	248,684	2024/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	2,670	2,757	352,524	2025/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	2,540	2,707	346,090	2025/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	2,760	2,842	363,309	2026/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	2,530	2,499	319,487	2026/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	2,670	2,677	342,309	2027/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	1,130	1,742	222,701	2027/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	3,000	3,059	391,155	2027/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	1,150	1,708	218,421	2028/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,545	1,568	200,516	2028/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	860	1,222	156,306	2028/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,580	1,558	199,254	2028/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	830	1,358	173,714	2030/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,420	2,261	289,109	2031/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,530	2,456	313,989	2034/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	1,775	2,745	350,951	2037/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	1,060	1,749	223,577	2039/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,280	2,274	290,744	2040/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	1,220	1,832	234,226	2042/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,690	2,282	291,728	2044/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,600	2,186	279,487	2046/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	400	423	54,087	2048/8/15
（ユーロ…イタリア） 国債証券					
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	470	467	59,775	2019/10/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.05	1,100	1,103	141,025	2019/12/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,540	2,646	338,310	2020/2/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	2,670	2,779	355,303	2020/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.7	750	744	95,205	2020/5/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	400	394	50,466	2020/6/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	2,550	2,663	340,520	2020/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.2	380	370	47,391	2020/10/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	940	924	118,156	2020/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	2,000	2,089	267,057	2021/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	280	268	34,320	2021/4/15

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,200	1,251	160,041	2021/5/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.45	1,620	1,565	200,126	2021/6/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	2,910	3,036	388,196	2021/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,890	3,095	395,723	2021/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	770	733	93,779	2021/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	1,060	1,060	135,612	2021/12/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	2,050	2,222	284,060	2022/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	1,390	1,339	171,200	2022/4/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	970	938	119,905	2022/4/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	1,270	1,200	153,417	2022/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	1,900	2,103	268,926	2022/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,310	1,262	161,335	2022/9/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	2,000	2,218	283,623	2022/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	730	681	87,079	2023/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,200	1,120	143,191	2023/3/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,365	1,469	187,897	2023/5/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,700	1,852	236,849	2023/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	380	344	44,084	2023/10/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	2,190	2,819	360,410	2023/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,650	1,774	226,786	2024/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	895	845	108,125	2024/5/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,500	1,558	199,160	2024/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	810	741	94,760	2024/11/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,400	1,364	174,387	2024/12/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	3,160	3,505	448,123	2025/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	480	434	55,507	2025/5/15
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	1,210	1,098	140,477	2025/6/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	2,060	1,914	244,730	2025/12/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,430	1,551	198,378	2026/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	1,230	1,105	141,289	2026/6/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	1,660	2,117	270,699	2026/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	1,470	1,276	163,232	2026/12/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	860	791	101,210	2027/6/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.05	950	860	110,047	2027/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	2,880	3,559	455,052	2027/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	750	673	86,120	2028/2/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,500	1,668	213,227	2028/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	2,870	3,311	423,327	2029/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	1,740	1,728	220,952	2030/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	2,740	3,375	431,430	2031/5/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	1,485	1,195	152,828	2032/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	1,740	2,115	270,380	2033/2/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	490	423	54,093	2033/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	2,080	2,377	303,892	2034/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	900	734	93,953	2036/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	2,710	2,782	355,632	2037/2/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	680	594	75,989	2038/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,850	2,103	268,932	2039/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,820	2,060	263,428	2040/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	1,310	1,446	184,897	2044/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	1,240	1,106	141,421	2046/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7	1,270	1,026	131,240	2047/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	1,135	1,026	131,270	2048/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	680	535	68,401	2067/3/1
(ユーロ…フランス)					
国債証券					
FRANCE (GOVT OF)	8.5	1,050	1,145	146,394	2019/10/25
FRANCE (GOVT OF)	3.75	3,150	3,286	420,161	2019/10/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,650	1,670	213,478	2019/11/25
FRANCE (GOVT OF)	－	1,000	1,007	128,837	2020/2/25
FRANCE (GOVT OF)	3.5	3,180	3,373	431,289	2020/4/25
FRANCE (GOVT OF)	－	1,600	1,614	206,377	2020/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.5	3,480	3,690	471,783	2020/10/25
FRANCE (GOVT OF)	0.25	2,450	2,488	318,042	2020/11/25
FRANCE (GOVT OF)	3.75	3,900	4,310	550,960	2021/4/25
FRANCE (GOVT OF)	3.25	3,920	4,345	555,543	2021/10/25
FRANCE (GOVT OF)	3.0	3,770	4,202	537,214	2022/4/25
FRANCE (GOVT OF)	2.25	2,750	3,017	385,786	2022/10/25
FRANCE (GOVT OF)	－	180	180	23,086	2023/3/25
FRANCE (GOVT OF)	8.5	960	1,332	170,273	2023/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	3,160	3,424	437,770	2023/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.25	3,930	4,770	609,780	2023/10/25
FRANCE (GOVT OF)	2.25	3,140	3,514	449,224	2024/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	3,355	3,671	469,391	2024/11/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	3,640	3,694	472,267	2025/5/25
FRANCE (GOVT OF)	6.0	2,980	4,154	531,095	2025/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	3,245	3,392	433,607	2025/11/25
FRANCE (GOVT OF)	3.5	3,080	3,794	485,033	2026/4/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	2,840	2,855	364,990	2026/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.25	2,680	2,627	335,843	2026/11/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	2,780	2,878	367,965	2027/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.75	3,330	3,959	506,082	2027/10/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,220	2,229	285,005	2028/5/25
FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,160	1,158	148,047	2028/11/25
FRANCE (GOVT OF)	5.5	2,615	3,867	494,444	2029/4/25
FRANCE (GOVT OF)	2.5	2,600	3,062	391,444	2030/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.5	3,070	3,258	416,500	2031/5/25
FRANCE (GOVT OF)	5.75	2,720	4,405	563,162	2032/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	680	688	87,958	2034/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.75	2,390	3,688	471,494	2035/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,530	1,524	194,817	2036/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	2,220	3,275	418,704	2038/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	765	815	104,234	2039/6/25
FRANCE (GOVT OF)	4.5	2,605	4,163	532,273	2041/4/25
FRANCE (GOVT OF)	3.25	2,030	2,787	356,350	2045/5/25
FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,740	1,886	241,189	2048/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,120	1,807	231,062	2055/4/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	930	1,537	196,518	2060/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	825	801	102,477	2066/5/25
(ユーロ…オランダ)					
国債証券					
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,240	1,254	160,410	2020/1/15

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	1,330	1,425	182,242	2020/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	1,460	1,610	205,853	2021/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	700	708	90,608	2022/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	1,230	1,348	172,429	2022/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	500	585	74,810	2023/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	910	1,209	154,595	2023/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	950	1,035	132,404	2023/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	180	180	23,055	2024/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	1,580	1,759	224,966	2024/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,275	1,283	164,081	2025/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	1,195	1,215	155,379	2026/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,160	1,192	152,475	2027/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	1,195	1,745	223,157	2028/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	500	510	65,273	2028/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	1,090	1,344	171,859	2033/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	1,195	1,826	233,525	2037/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	1,255	1,984	253,694	2042/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	1,025	1,444	184,711	2047/1/15
(ユーロ…スペイン) 国債証券					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3	1,850	1,937	247,620	2019/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,480	1,511	193,225	2020/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	2,000	2,127	271,979	2020/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.15	1,180	1,207	154,376	2020/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	1,790	1,967	251,504	2020/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	770	771	98,630	2021/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	2,080	2,367	302,631	2021/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	1,725	1,759	224,964	2021/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	1,790	2,120	271,045	2022/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4	1,630	1,640	209,724	2022/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	1,300	1,305	166,881	2022/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	1,675	2,026	259,039	2023/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	560	554	70,849	2023/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	1,750	2,074	265,127	2023/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	1,330	1,610	205,887	2024/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,680	1,953	249,709	2024/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,885	2,093	267,598	2024/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	1,660	1,727	220,834	2025/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	1,850	2,287	292,380	2025/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	1,690	1,810	231,413	2025/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,660	1,748	223,535	2026/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	1,620	2,176	278,169	2026/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,760	1,761	225,221	2026/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	1,495	1,507	192,680	2027/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,785	1,784	228,065	2027/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,740	1,722	220,149	2028/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	830	816	104,362	2028/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	1,455	1,932	247,069	2028/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0	2,010	2,844	363,549	2029/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,630	1,655	211,659	2030/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.75	1,700	2,487	318,023	2032/7/30

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン) 国債証券	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	1,120	1,158	148,151	2033/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2	1,560	2,026	259,104	2037/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	1,420	2,026	259,062	2040/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	1,570	2,192	280,301	2041/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	1,180	1,760	225,023	2044/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	1,260	1,327	169,664	2046/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	685	685	87,670	2048/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	560	626	80,101	2066/7/30
(ユーロ…ベルギー) 国債証券					
BELGIUM KINGDOM	3.75	1,518	1,643	210,122	2020/9/28
BELGIUM KINGDOM	4.25	1,285	1,460	186,648	2021/9/28
BELGIUM KINGDOM	4.0	1,080	1,239	158,431	2022/3/28
BELGIUM KINGDOM	4.25	1,250	1,469	187,785	2022/9/28
BELGIUM KINGDOM	2.25	1,080	1,196	152,899	2023/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.2	490	493	63,095	2023/10/22
BELGIUM KINGDOM	2.6	1,340	1,523	194,801	2024/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.5	630	639	81,781	2024/10/22
BELGIUM KINGDOM	0.8	1,295	1,334	170,529	2025/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.5	850	1,101	140,826	2026/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.0	1,210	1,253	160,179	2026/6/22
BELGIUM KINGDOM	0.8	1,070	1,081	138,184	2027/6/22
BELGIUM KINGDOM	5.5	1,715	2,464	315,031	2028/3/28
BELGIUM KINGDOM	0.8	520	519	66,426	2028/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.0	750	743	95,024	2031/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.0	660	899	115,013	2032/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.25	320	321	41,115	2033/4/22
BELGIUM KINGDOM	3.0	590	733	93,819	2034/6/22
BELGIUM KINGDOM	5.0	1,585	2,454	313,782	2035/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.45	320	319	40,854	2037/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.9	530	568	72,646	2038/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.25	1,370	2,070	264,623	2041/3/28
BELGIUM KINGDOM	3.75	815	1,179	150,812	2045/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.6	870	842	107,670	2047/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.25	260	279	35,785	2057/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.15	386	398	50,973	2066/6/22
(ユーロ…オーストリア) 国債証券					
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	525	529	67,708	2019/10/18
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	1,181	1,272	162,643	2020/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	1,260	1,404	179,509	2021/9/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	695	791	101,183	2022/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	940	1,079	138,022	2022/11/22
REPUBLIC OF AUSTRIA	—	450	451	57,722	2023/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	1,070	1,166	149,139	2023/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	855	933	119,383	2024/10/21
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	900	958	122,495	2025/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	760	1,013	129,517	2026/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	960	984	125,786	2026/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	625	623	79,746	2027/4/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	800	1,193	152,503	2027/7/15

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	460	465	59,453	2028/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	570	678	86,794	2034/5/23
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	1,074	1,611	205,944	2037/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	592	830	106,103	2044/6/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	375	382	48,906	2047/2/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	273	468	59,933	2062/1/26
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	205	188	24,095	2086/11/2
REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	337	377	48,305	2117/9/20
(ユーロ…フィンランド)					
国債証券					
FINNISH GOVERNMENT	3.375	637	674	86,216	2020/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.375	300	305	39,026	2020/9/15
FINNISH GOVERNMENT	3.5	700	769	98,324	2021/4/15
FINNISH GOVERNMENT	1.625	300	321	41,112	2022/9/15
FINNISH GOVERNMENT	1.5	550	590	75,463	2023/4/15
FINNISH GOVERNMENT	—	250	250	32,041	2023/9/15
FINNISH GOVERNMENT	2.0	520	575	73,617	2024/4/15
FINNISH GOVERNMENT	4.0	590	737	94,263	2025/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.875	320	333	42,590	2025/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	410	413	52,918	2026/4/15
FINNISH GOVERNMENT	0.5	303	301	38,567	2027/9/15
FINNISH GOVERNMENT	2.75	380	456	58,343	2028/7/4
FINNISH GOVERNMENT	0.5	210	206	26,431	2028/9/15
FINNISH GOVERNMENT	0.75	340	335	42,871	2031/4/15
FINNISH GOVERNMENT	1.125	330	336	42,969	2034/4/15
FINNISH GOVERNMENT	2.625	355	466	59,611	2042/7/4
(ユーロ…アイルランド)					
国債証券					
IRISH TREASURY	5.9	505	536	68,610	2019/10/18
IRISH TREASURY	4.5	870	933	119,379	2020/4/18
IRISH TREASURY	5.0	640	709	90,686	2020/10/18
IRISH TREASURY	0.8	480	494	63,271	2022/3/15
IRISH TREASURY	—	35	35	4,475	2022/10/18
IRISH TREASURY	3.9	570	666	85,230	2023/3/20
IRISH TREASURY	3.4	670	782	100,082	2024/3/18
IRISH TREASURY	5.4	965	1,262	161,372	2025/3/13
IRISH TREASURY	1.0	945	967	123,663	2026/5/15
IRISH TREASURY	0.9	420	417	53,361	2028/5/15
IRISH TREASURY	2.4	790	893	114,247	2030/5/15
IRISH TREASURY	1.3	175	171	21,942	2033/5/15
IRISH TREASURY	1.7	545	553	70,722	2037/5/15
IRISH TREASURY	2.0	685	716	91,604	2045/2/18
ユーロ計				57,692,807	
(イギリス)		千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券					
UK TREASURY	4.75	1,610	1,697	244,830	2020/3/7
UK TREASURY	2.0	1,870	1,910	275,564	2020/7/22
UK TREASURY	3.75	1,530	1,615	232,971	2020/9/7
UK TREASURY	1.5	2,030	2,064	297,685	2021/1/22
UK TREASURY	8.0	1,020	1,210	174,556	2021/6/7
UK TREASURY	3.75	1,110	1,202	173,459	2021/9/7

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	%	千イギリスポンド	千イギリスポンド	千円	
国債証券					
UK TREASURY	4.0	1,100	1,215	175,332	2022/3/7
UK TREASURY	1.75	2,130	2,198	316,981	2022/9/7
UK TREASURY	2.25	1,610	1,704	245,864	2023/9/7
UK TREASURY	2.75	935	1,023	147,537	2024/9/7
UK TREASURY	5.0	1,305	1,615	232,978	2025/3/7
UK TREASURY	1.5	1,490	1,519	219,155	2026/7/22
UK TREASURY	1.25	1,410	1,400	201,922	2027/7/22
UK TREASURY	4.25	1,190	1,490	214,989	2027/12/7
UK TREASURY	1.625	360	366	52,815	2028/10/22
UK TREASURY	6.0	1,000	1,437	207,232	2028/12/7
UK TREASURY	4.75	1,250	1,695	244,473	2030/12/7
UK TREASURY	4.25	1,260	1,664	240,027	2032/6/7
UK TREASURY	4.5	2,000	2,774	400,044	2034/9/7
UK TREASURY	4.25	1,670	2,292	330,619	2036/3/7
UK TREASURY	1.75	100	98	14,258	2037/9/7
UK TREASURY	4.75	1,410	2,111	304,560	2038/12/7
UK TREASURY	4.25	1,240	1,760	253,885	2039/9/7
UK TREASURY	4.25	1,415	2,033	293,268	2040/12/7
UK TREASURY	4.5	1,545	2,337	337,136	2042/12/7
UK TREASURY	3.25	1,505	1,916	276,369	2044/1/22
UK TREASURY	3.5	1,740	2,319	334,428	2045/1/22
UK TREASURY	4.25	1,560	2,366	341,296	2046/12/7
UK TREASURY	1.5	1,495	1,373	198,144	2047/7/22
UK TREASURY	1.75	160	155	22,431	2049/1/22
UK TREASURY	4.25	1,340	2,095	302,235	2049/12/7
UK TREASURY	3.75	1,440	2,130	307,257	2052/7/22
UK TREASURY	4.25	1,580	2,608	376,170	2055/12/7
UK TREASURY	1.75	665	652	94,144	2057/7/22
UK TREASURY	4.0	1,220	1,994	287,686	2060/1/22
UK TREASURY	3.5	1,660	2,578	371,860	2068/7/22
UK TREASURY	1.625	285	268	38,718	2071/10/22
UNITED KINGDOM GILT	0.5	1,665	1,641	236,661	2022/7/22
UNITED KINGDOM GILT	0.75	1,425	1,407	202,939	2023/7/22
UNITED KINGDOM GILT	2.0	1,180	1,246	179,697	2025/9/7
UNITED KINGDOM GILT	2.5	1,142	1,393	201,024	2065/7/22
小計				9,603,220	
(スウェーデン)		千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
国債証券					
SWEDISH GOVERNMENT	5.0	7,410	8,256	101,891	2020/12/1
SWEDISH GOVERNMENT	3.5	8,000	9,045	111,616	2022/6/1
SWEDISH GOVERNMENT	1.5	6,560	7,029	86,738	2023/11/13
SWEDISH GOVERNMENT	2.5	4,750	5,434	67,059	2025/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	1.0	5,090	5,308	65,504	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT	0.75	3,750	3,794	46,824	2028/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	3.5	3,590	5,011	61,839	2039/3/30
小計				541,473	
(ノルウェー)		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券					
NORWEGIAN GOVERNMENT	3.75	6,710	7,126	96,000	2021/5/25
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	4,900	4,993	67,263	2023/5/24
NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	3,120	3,332	44,893	2024/3/14

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（ノルウェー）国債証券	%	ノルウェークローネ	ノルウェークローネ	千円	
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	3,270	3,267	44,015	2025/3/13
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	3,250	3,176	42,791	2026/2/19
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	2,470	2,442	32,897	2027/2/17
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,750	1,756	23,656	2028/4/26
小計				351,517	
（デンマーク）国債証券		デンマーククローネ	デンマーククローネ		
KINGDOM OF DENMARK	4.0	6,720	7,050	120,783	2019/11/15
KINGDOM OF DENMARK	3.0	6,930	7,667	131,350	2021/11/15
KINGDOM OF DENMARK	1.5	6,640	7,194	123,238	2023/11/15
KINGDOM OF DENMARK	1.75	8,190	9,142	156,606	2025/11/15
KINGDOM OF DENMARK	0.5	3,410	3,460	59,272	2027/11/15
KINGDOM OF DENMARK	4.5	10,270	17,633	302,064	2039/11/15
小計				893,314	
（ポーランド）国債証券		ポーランドズロチ	ポーランドズロチ		
POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	1,450	1,511	44,801	2019/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	2,570	2,571	76,246	2020/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	—	220	214	6,358	2020/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	1,590	1,704	50,542	2020/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	2,160	2,173	64,453	2021/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	2,430	2,429	72,031	2021/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	1,410	1,569	46,530	2021/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	2,280	2,291	67,956	2022/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	2,070	2,344	69,504	2022/9/23
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,780	1,791	53,109	2023/1/25
POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	2,270	2,434	72,188	2023/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	2,580	2,642	78,363	2025/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,900	2,795	82,880	2026/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,590	2,470	73,253	2027/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	770	742	22,021	2028/4/25
POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	855	1,051	31,175	2029/4/25
小計				911,418	
（オーストラリア）国債証券		オーストラリアドル	オーストラリアドル		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,355	1,365	108,663	2019/10/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,940	2,010	159,940	2020/4/15
AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	2,120	2,109	167,839	2020/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	2,390	2,611	207,760	2021/5/15
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	1,355	1,353	107,636	2021/12/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	1,940	2,192	174,438	2022/7/15
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	670	672	53,523	2022/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	2,020	2,305	183,373	2023/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,990	2,035	161,954	2024/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	2,200	2,313	184,039	2025/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	2,660	2,982	237,289	2026/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	2,330	2,722	216,562	2027/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	2,240	2,270	180,601	2027/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	2,020	1,959	155,868	2028/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	1,822	144,957	2028/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,670	1,766	140,553	2029/4/21

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（オーストラリア）国債証券	%	オーストラリアドル	オーストラリアドル	千円	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,060	1,071	85,274	2029/11/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	470	462	36,797	2030/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,145	1,379	109,741	2033/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	530	519	41,354	2035/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	930	1,036	82,459	2037/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	662	686	54,621	2039/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	280	265	21,152	2041/5/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	990	969	77,132	2047/3/21
小計				3,093,539	
（シンガポール）国債証券		シンガポールドル	シンガポールドル		
SINGAPORE GOVERNMENT	1.625	450	448	36,526	2019/10/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.0	320	319	26,049	2020/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	675	689	56,165	2020/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	610	611	49,825	2021/6/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	240	234	19,058	2021/10/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	210	206	16,843	2022/4/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	380	392	31,948	2022/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	200	196	15,961	2023/2/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	655	668	54,430	2023/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	540	558	45,452	2024/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	200	199	16,235	2025/6/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	200	195	15,901	2026/6/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	540	580	47,242	2027/3/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	225	226	18,465	2028/5/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	200	204	16,671	2029/7/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	330	336	27,424	2030/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	355	379	30,892	2033/9/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	220	202	16,498	2036/8/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	375	364	29,647	2042/4/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	410	396	32,302	2046/3/1
小計				603,542	
（マレーシア）国債証券		マレーシアリンギット	マレーシアリンギット		
MALAYSIA GOVERNMENT	3.659	1,010	1,012	27,309	2020/10/15
MALAYSIA GOVERNMENT	4.048	460	465	12,536	2021/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.62	850	848	22,881	2021/11/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.882	550	553	14,935	2022/3/10
MALAYSIA GOVERNMENT	3.795	580	581	15,667	2022/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.8	800	797	21,496	2023/8/17
MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	100	100	2,702	2024/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.882	120	118	3,204	2025/3/14
MALAYSIA GOVERNMENT	3.955	980	974	26,275	2025/9/15
MALAYSIA GOVERNMENT	3.9	450	441	11,913	2026/11/30
MALAYSIA GOVERNMENT	3.899	450	438	11,829	2027/11/16
MALAYSIA GOVERNMENT	4.642	470	472	12,742	2033/11/7
MALAYSIA GOVERNMENT	4.254	600	568	15,330	2035/5/31
MALAYSIA GOVERNMENT	4.762	1,140	1,129	30,442	2037/4/7
MALAYSIA GOVERNMENT	4.935	590	590	15,922	2043/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	4.736	920	896	24,159	2046/3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	2,470	2,494	67,249	2019/11/29

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（マレーシア） 国債証券	%	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット	千円	
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.492	550	550	14,830	2020/3/31
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.889	800	805	21,721	2020/7/31
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	2,130	2,157	58,171	2021/7/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	650	642	17,319	2022/8/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	1,750	1,725	46,517	2023/3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	940	948	25,560	2024/7/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	1,270	1,286	34,695	2026/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.892	450	440	11,885	2027/3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	650	618	16,671	2027/5/31
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	430	415	11,202	2028/6/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	5.248	750	806	21,740	2028/9/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	1,210	1,212	32,687	2030/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	1,035	1,003	27,043	2031/6/30
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	450	429	11,575	2032/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	980	901	24,297	2033/4/15
小計				712,519	
（南アフリカ） 国債証券		千南アフリカランド	千南アフリカランド		
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	3,350	3,370	25,951	2020/1/15

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（南アフリカ） 国債証券	%	千南アフリカランド	千南アフリカランド	千円	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	4,650	4,536	34,927	2021/3/31
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	5,900	5,709	43,966	2023/2/28
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	15,600	16,587	127,722	2026/12/21
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	7,500	6,588	50,734	2030/1/31
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	9,600	7,637	58,810	2031/2/28
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	6,920	6,028	46,416	2032/3/31
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.875	6,610	5,948	45,801	2035/2/28
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	8,300	5,703	43,919	2036/3/31
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	8,800	7,561	58,222	2037/1/31
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0	6,310	5,594	43,080	2040/1/31
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	7,450	4,999	38,494	2041/2/28
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	10,650	9,148	70,439	2044/1/31
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	15,800	13,538	104,245	2048/2/28
小計				792,732	
合計				145,412,931	

（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

（2018年10月26日現在）

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	145,412,931	98.8
コール・ローン等、その他	1,715,134	1.2
投資信託財産総額	147,128,065	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（147,089,654千円）の投資信託財産総額（147,128,065千円）に対する比率は100.0%です。
（注）外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1アメリカドル=112.47円、1カナダドル=85.95円、1メキシコペソ=5.77円、1ユーロ=127.83円、1イギリスポンド=144.21円、1スウェーデンクローナ=12.34円、1ノルウェークローネ=13.47円、1デンマーククローネ=17.13円、1ポーランドズロチ=29.65円、1オーストラリアドル=79.55円、1シンガポールドル=81.42円、1マレーシアリンギット=26.96円、1南アフリカランド=7.70円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年10月26日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	147,202,272,399
コール・ローン等	384,582,689
公社債(評価額)	145,412,931,383
未収入金	74,206,815
未収利息	1,305,504,312
前払費用	25,047,200
(B) 負債	168,837,977
未払金	74,494,650
未払解約金	94,343,279
未払利息	48
(C) 純資産総額(A－B)	147,033,434,422
元本	66,172,631,391
次期繰越損益金	80,860,803,031
(D) 受益権総口数	66,172,631,391口
1万口当たり基準価額(C／D)	22,220円

(注) 当ファンドの期首元本額は68,830,787,765円、期中追加設定元本額は3,405,417,219円、期中一部解約元本額は6,063,573,593円です。

(注) 2018年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）毎月分配型	23,997,016,330円
・日興五大陸債券ファンド（毎月分配型）	19,440,325,696円
・インデックスファンド海外債券ヘッジなし（DC専用）	11,964,377,999円
・インデックスファンド海外債券（ヘッジなし）1年決算型	4,156,011,407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	2,370,288,668円
・国際分散型ファンド40（適格機関投資家向け）	1,029,476,088円
・世界国債インデックスファンド（適格機関投資家向け）	878,532,138円
・財産3分法ファンド（不動産・債券・株式）資産成長型	543,560,785円
・DCインデックスバランス（株式60）	331,015,030円
・DCインデックスバランス（株式80）	268,750,988円
・DCインデックスバランス（株式40）	255,247,492円
・海外債券インデックスファンド（個人型年金向け）	252,679,680円
・DCインデックスバランス（株式20）	174,920,013円
・インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	158,267,081円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	85,787,859円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	84,822,845円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	63,482,009円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	59,228,746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	21,654,534円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	14,261,162円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	8,154,550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）	5,673,700円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	3,217,087円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	2,942,188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）	2,937,316円

(注) 1口当たり純資産額は2.2220円です。

○損益の状況 (2017年10月27日～2018年10月26日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	3,990,271,287
受取利息	3,990,449,621
その他収益金	260,700
支払利息	△ 439,034
(B) 有価証券売買損益	△ 9,525,778,152
売買益	407,453,546
売買損	△ 9,933,231,698
(C) 保管費用等	△ 21,297,152
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 5,556,804,017
(E) 前期繰越損益金	89,748,198,129
(F) 追加信託差損益金	4,245,716,121
(G) 解約差損益金	△ 7,576,307,202
(H) 計(D＋E＋F＋G)	80,860,803,031
次期繰越損益金(H)	80,860,803,031

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

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

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

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。

○お知らせ

約款変更について

2017年10月27日から2018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、運用目標とするベンチマークを構成する指数の名称が「シティ世界国債インデックス」から「FTSE世界国債インデックス」へ変更となったため、2018年２月７日付けにて信託約款に所要の変更を行ないました。（付表）

海外債券インデックス（ヘッジあり）マザーファンド

運用報告書

第20期（決算日　2018年10月26日）
（2017年10月27日～2018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	1998年10月30日から原則無期限です。
運用方針	世界の主要国の債券市場の動きをとらえることを目標に、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・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	内外の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	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

主として世界各国の債券に投資し、「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジあり・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、債券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、債券の組入総額と債券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、および外国為替予約取引などの売建玉の時価総額が外貨建資産の組入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

<935565>

【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		FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）		債券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	（ベンチマーク）	期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
16期(2014年10月27日)	14,263	6.1	147.17	6.2	97.9	29,941
17期(2015年10月26日)	14,761	3.5	152.44	3.6	97.2	27,375
18期(2016年10月26日)	15,290	3.6	158.09	3.7	99.6	24,710
19期(2017年10月26日)	14,881	△2.7	153.81	△2.7	98.9	25,323
20期(2018年10月26日)	14,628	△1.7	151.39	△1.6	97.6	24,608

（注）FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した指数です。なお、設定時を100として2018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		FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）		債券組入比率
		騰落率	（ベンチマーク）	騰落率	
（期首）	円	%		%	%
2017年10月26日	14,881	－	153.81	－	98.9
10月末	14,970	0.6	154.72	0.6	97.6
11月末	14,983	0.7	154.90	0.7	97.7
12月末	14,959	0.5	154.63	0.5	98.9
2018年１月末	14,799	△0.6	153.01	△0.5	95.8
２月末	14,742	△0.9	152.47	△0.9	95.7
３月末	14,943	0.4	154.58	0.5	96.9
４月末	14,799	△0.6	153.11	△0.5	99.6
５月末	14,785	△0.6	152.99	△0.5	96.2
６月末	14,836	△0.3	153.49	△0.2	97.8
７月末	14,765	△0.8	152.79	△0.7	99.5
８月末	14,787	△0.6	153.01	△0.5	98.6
９月末	14,700	△1.2	152.02	△1.2	99.9
（期末）					
2018年10月26日	14,628	△1.7	151.39	△1.6	97.6

（注）騰落率は期首比です。

○運用経過

（2017年10月27日～2018年10月26日）

基準価額の推移

期間の初め14,881円の基準価額は、期間末に14,628円となり、騰落率は△1.7%となりました。

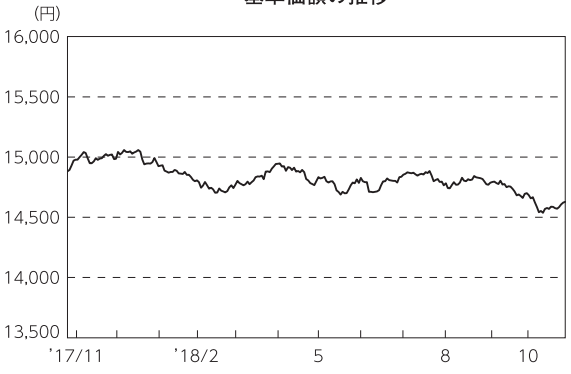
基準価額の変動要因

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＞
・米国の保護主義的な貿易政策の発表を受けて、貿易を巡る懸念が世界的に広がったこと。
・欧州中央銀行（ＥＣＢ）が2019年夏まで利上げを据え置く方針を示したこと。
・米国とトルコの関係悪化などを背景としたトルコリラの急落が新興国市場にも波及したことで、リスク回避需要が高まったこと。

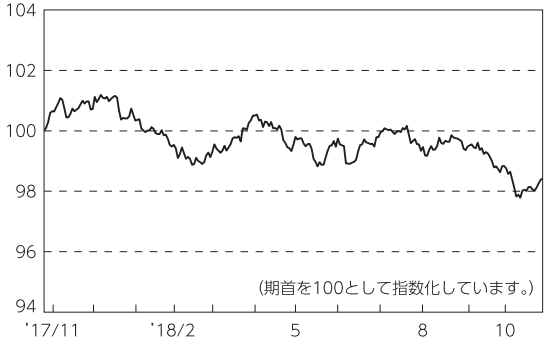
＜値下がり要因＞
・米国連邦準備制度理事会（ＦＲＢ）による利上げ観測が広がったことや、追加利上げが決定されたこと（2017年12月、2018年３月、６月、９月）。
・米国の力強い経済成長を裏付ける指標が継続的に発表されたこと。

基準価額の推移



期　首	期中高値	期中安値	期　末
2017/10/26	2017/12/07	2018/10/11	2018/10/26
14,881円	15,058円	14,538円	14,628円

FTSE世界国債インデックス
（除く日本、ヘッジあり・円ベース）（指数化）の推移



（海外債券市況）

海外債券市場では、米国、ドイツ、英国など各国の10年国債利回りは、期間の初めと比べて、まちまちの動きとなりました。

期間の初めから2018年２月中旬にかけては、ＥＣＢがユーロ圏の経済成長見通しを引き上げたことや、米国の雇用統計にて賃金の伸びが市場予想を上回り米国の利上げペースの加速が意識されたことなどを背景に、各国の10年国債利回りは総じて上昇（債券価格は下落）しました。２月下旬から３月下旬にかけては、フランスやドイツの景況感に関する指標が市場予想を下回ったことや、米国の保護主義的な貿易政策の発表を受けて貿易を巡る懸念が世界的に広がったこと、ＥＣＢが予想インフレ率を下方修正してインフレへの慎重な見方を示したことなどを受けて、各国の10年国債利回りは総じて低下（債券価格は上昇）しました。４月上旬から５月中旬にかけては、中国の市場開放政策を受けて米中間の貿易摩擦による世界経済の成長鈍化懸念が緩和したことや、商品価格の上昇によるインフレ圧力などを受けて、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。５月下旬から８月中旬にかけては、ＥＣＢが2019年夏まで利上げを据え置く方針を示したことや、米国とトルコの関係悪化などによるトルコリラの急落が新興国市場にも波及したことでリスク回避需要が高まったことなどを背景に、各国の10年国債利回りは概して低下しました。８月下旬から期間末にかけては、ＦＲＢが追加利上げを実施したことや、ＥＣＢ総裁がユーロ圏の基調的なインフレ率には上昇が見込まれるとの見解を示したことなどを受けて、各国の10年国債利回りは総じて上昇しました。

ポートフォリオ

債券のリスクコントロールモデルによりベンチマーク採用国の債券の中からポートフォリオを構築し、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、債券の組入比率を高位に維持し、ベンチマークとの連動性を保つように努めました。外貨建資産は、原則として100%程度の為替ヘッジを行ないました。

当ファンドのベンチマークとの差異

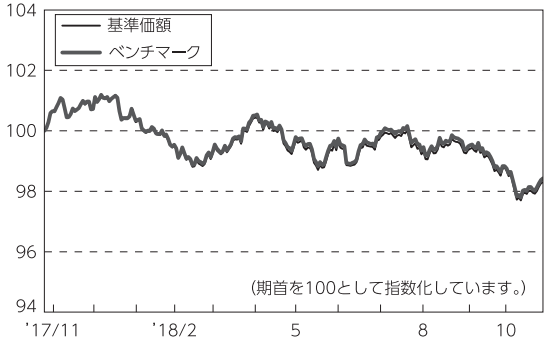
期間中における基準価額は、1.7%の値下がりとなり、ベンチマークである「FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジあり・円ベース）」の下落率1.6%を概ね0.1%下回りました。

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＞
・投資国の選択による効果。

＜マイナス要因＞
・債券および為替取引に関する諸費用。
・外国口座の管理費用。

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、これまでの運用方針を維持します。原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度などの属性をベンチマークと同程度に保ち、連動性を高めるように努めます。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、毎月ポートフォリオの見直しなどを行なうとともに、債券組入比率を高位に維持する方針です。外貨建資産は、原則として為替ヘッジを行ないます。

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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
	円	%	
(a) その他費用	2	0.015	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(2)	(0.015)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用
合計	2	0.015	
期中の平均基準価額は、14,839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

（2017年10月27日～2018年10月26日）

公社債

			買　付　額	売　付　額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 34,408	千アメリカドル 28,810
	カナダ	国債証券	千カナダドル 1,304	千カナダドル 1,550
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 7,686	千メキシコペソ 8,053
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	1,992	2,391
	イタリア	国債証券	2,345	2,359
	フランス	国債証券	2,788	2,370
	オランダ	国債証券	393	435
	スペイン	国債証券	1,623	1,276
	ベルギー	国債証券	609	436
	オーストリア	国債証券	445	480
	フィンランド	国債証券	－	171
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 1,175	千イギリスポンド 1,101
	スイス	国債証券	千スイスフラン －	千スイスフラン 306
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ －	千スウェーデンクローナ 1,570
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 993	千ノルウェークローネ 1,035
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ －	千ポーランドズロチ 1,221
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 1,396	千オーストラリアドル 1,391
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 299	千シンガポールドル －
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 1,015	千マレーシアリンギット －
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド －	千南アフリカランド 1,512

（注）金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

○利害関係人との取引状況等

（2017年10月27日～2018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。

○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10月27日～2018年10月26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

（2018年10月26日現在）

外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	99,550	96,787	10,885,677	44.2	－	18.3	16.1	9.8
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	4,840	5,421	465,940	1.9	－	0.8	0.5	0.6
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	34,500	34,388	198,424	0.8	－	0.5	－	0.3
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	10,900	13,031	1,665,863	6.8	－	4.5	1.5	0.8
イタリア	15,170	16,480	2,106,666	8.6	－	4.6	2.7	1.2
フランス	15,680	19,427	2,483,393	10.1	－	6.8	2.5	0.8
オランダ	3,040	3,806	486,610	2.0	－	1.4	0.4	0.2
スペイン	8,730	10,770	1,376,766	5.6	－	4.0	1.2	0.4
ベルギー	3,730	4,696	600,297	2.4	－	1.6	0.6	0.3
オーストリア	2,280	2,946	376,688	1.5	－	1.2	0.3	－
フィンランド	900	1,039	132,868	0.5	－	0.3	0.1	0.2
アイルランド	1,400	1,592	203,611	0.8	－	0.4	0.1	0.3
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	8,670	11,298	1,629,374	6.6	－	5.2	0.9	0.5
	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
スウェーデン	10,600	11,881	146,617	0.6	－	0.4	0.2	－
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	5,250	5,371	72,349	0.3	－	0.1	0.2	－
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	7,050	9,106	155,998	0.6	－	0.3	0.2	0.1
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	3,600	3,795	112,527	0.5	－	0.2	0.3	－
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	5,900	6,363	506,231	2.1	－	1.2	0.6	0.3
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	950	974	79,371	0.3	－	0.2	0.0	0.1
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	7,350	7,382	199,026	0.8	－	0.4	0.3	0.2
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	18,150	16,662	128,304	0.5	－	0.5	－	0.0
合計	－	－	24,012,612	97.6	－	52.8	28.6	16.1

（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）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
（注）評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

（B）外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
（アメリカ） 国債証券	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	
US TREASURY N/B	1.25	600	591	66,521	2019/10/31
US TREASURY N/B	3.375	550	553	62,277	2019/11/15
US TREASURY N/B	1.0	1,100	1,079	121,455	2019/11/30
US TREASURY N/B	1.875	1,800	1,782	200,441	2019/12/31
US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,457	276,397	2020/1/31
US TREASURY N/B	3.625	1,400	1,414	159,127	2020/2/15
US TREASURY N/B	1.375	2,600	2,552	287,064	2020/2/29
US TREASURY N/B	1.375	800	784	88,216	2020/3/31
US TREASURY N/B	1.375	1,200	1,174	132,119	2020/4/30
US TREASURY N/B	3.5	800	808	90,917	2020/5/15
US TREASURY N/B	1.5	2,400	2,350	264,387	2020/5/31
US TREASURY N/B	2.0	1,200	1,182	133,023	2020/7/31
US TREASURY N/B	8.75	390	430	48,378	2020/8/15
US TREASURY N/B	1.375	1,300	1,265	142,370	2020/8/31
US TREASURY N/B	1.375	3,200	3,112	350,027	2020/9/30
US TREASURY N/B	2.625	1,110	1,104	124,249	2020/11/15
US TREASURY N/B	1.625	1,000	974	109,631	2020/11/30
US TREASURY N/B	2.125	2,000	1,966	221,214	2021/1/31
US TREASURY N/B	3.625	1,600	1,625	182,865	2021/2/15
US TREASURY N/B	2.25	950	935	105,195	2021/4/30
US TREASURY N/B	3.125	2,450	2,463	277,112	2021/5/15
US TREASURY N/B	1.125	1,000	954	107,349	2021/6/30
US TREASURY N/B	2.25	300	294	33,149	2021/7/31
US TREASURY N/B	2.125	2,420	2,368	266,425	2021/8/15
US TREASURY N/B	2.125	700	684	76,983	2021/9/30
US TREASURY N/B	8.0	970	1,113	125,255	2021/11/15
US TREASURY N/B	2.0	1,500	1,460	164,213	2021/11/15
US TREASURY N/B	2.0	2,050	1,990	223,840	2022/2/15
US TREASURY N/B	1.75	2,700	2,596	291,978	2022/3/31
US TREASURY N/B	1.75	2,350	2,255	253,685	2022/5/15
US TREASURY N/B	1.625	2,550	2,428	273,153	2022/8/15
US TREASURY N/B	1.875	1,000	960	107,977	2022/9/30
US TREASURY N/B	1.875	1,700	1,630	183,375	2022/10/31
US TREASURY N/B	2.0	1,100	1,059	119,159	2022/11/30
US TREASURY N/B	1.75	1,600	1,522	171,211	2023/1/31
US TREASURY N/B	2.0	700	672	75,669	2023/2/15
US TREASURY N/B	1.75	2,050	1,943	218,621	2023/5/15
US TREASURY N/B	1.375	600	558	62,789	2023/6/30
US TREASURY N/B	6.25	580	664	74,781	2023/8/15
US TREASURY N/B	2.5	1,000	978	110,091	2023/8/15
US TREASURY N/B	2.75	1,440	1,424	160,204	2023/11/15
US TREASURY N/B	2.75	1,780	1,758	197,803	2024/2/15
US TREASURY N/B	2.5	1,200	1,168	131,458	2024/5/15
US TREASURY N/B	2.375	2,830	2,732	307,311	2024/8/15
US TREASURY N/B	2.25	3,000	2,870	322,832	2024/11/15
US TREASURY N/B	2.0	850	799	89,878	2025/2/15
US TREASURY N/B	2.125	1,900	1,795	201,956	2025/5/15
US TREASURY N/B	1.625	2,400	2,165	243,536	2026/5/15
US TREASURY N/B	2.0	4,300	3,965	445,951	2026/11/15
US TREASURY N/B	2.25	700	656	73,814	2027/2/15
US TREASURY N/B	6.125	1,330	1,643	184,822	2027/11/15
US TREASURY N/B	2.25	3,200	2,979	335,146	2027/11/15
US TREASURY N/B	5.25	210	247	27,881	2028/11/15
US TREASURY N/B	5.375	400	489	55,071	2031/2/15
US TREASURY N/B	4.5	390	456	51,333	2036/2/15
US TREASURY N/B	4.375	170	197	22,211	2038/2/15
US TREASURY N/B	3.5	390	403	45,361	2039/2/15
US TREASURY N/B	4.375	100	116	13,093	2039/11/15
US TREASURY N/B	4.625	450	541	60,902	2040/2/15
US TREASURY N/B	4.375	230	268	30,154	2040/5/15
US TREASURY N/B	3.875	350	380	42,839	2040/8/15
US TREASURY N/B	4.375	200	233	26,273	2041/5/15
US TREASURY N/B	3.75	200	213	24,036	2041/8/15
US TREASURY N/B	3.125	350	338	38,110	2041/11/15
US TREASURY N/B	3.125	400	386	43,523	2042/2/15
US TREASURY N/B	2.75	700	631	71,043	2042/11/15
US TREASURY N/B	3.125	900	867	97,575	2043/2/15
US TREASURY N/B	2.875	750	691	77,759	2043/5/15
US TREASURY N/B	3.625	890	932	104,870	2043/8/15
US TREASURY N/B	3.75	200	213	24,043	2043/11/15
US TREASURY N/B	3.625	550	576	64,829	2044/2/15
US TREASURY N/B	3.375	120	120	13,572	2044/5/15
US TREASURY N/B	3.0	1,150	1,081	121,635	2044/11/15
US TREASURY N/B	2.5	2,400	2,044	229,992	2045/2/15
US TREASURY N/B	3.0	450	422	47,555	2045/5/15
US TREASURY N/B	2.875	700	641	72,180	2045/8/15
US TREASURY N/B	3.0	200	187	21,115	2045/11/15
US TREASURY N/B	2.5	1,150	975	109,717	2046/2/15
US TREASURY N/B	2.25	950	761	85,654	2046/8/15
US TREASURY N/B	2.875	300	274	30,847	2046/11/15
US TREASURY N/B	2.75	1,550	1,378	155,063	2047/8/15
小計				10,885,677	
（カナダ） 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CANADA GOVERNMENT	2.75	100	108	9,307	2064/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	1.5	700	693	59,600	2020/3/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	750	764	65,711	2020/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	0.75	200	194	16,715	2020/9/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.25	700	715	61,537	2021/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	750	759	65,300	2022/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	8.0	150	214	18,402	2027/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.75	480	625	53,785	2029/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	5.0	710	973	83,671	2037/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	4.0	200	251	21,621	2041/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	100	119	10,287	2045/12/1
小計				465,940	

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)	%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円	
国債証券					
MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	8,500	8,216	47,410	2019/12/11
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	6,000	5,987	34,546	2020/6/11
MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	5,000	5,421	31,283	2024/12/5
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	6,000	6,049	34,904	2029/5/31
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	2,500	2,370	13,675	2031/5/29
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	4,500	4,499	25,960	2038/11/18
MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	2,000	1,844	10,642	2042/11/13
小計				198,424	
(ユーロ…ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	450	471	60,285	2020/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	800	849	108,651	2020/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	250	263	33,692	2020/9/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	550	587	75,159	2021/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	250	275	35,248	2021/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	300	323	41,399	2022/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	300	321	41,150	2022/9/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	500	539	68,925	2023/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	500	540	69,102	2023/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	200	221	28,325	2023/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	570	760	97,247	2024/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	900	981	125,428	2024/5/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	250	265	33,973	2024/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	500	516	66,015	2025/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	500	532	68,128	2025/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	650	669	85,562	2026/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	200	200	25,641	2027/2/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	400	407	52,154	2027/8/15
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	560	832	106,361	2028/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	200	284	36,350	2028/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	350	573	73,252	2030/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	220	350	44,791	2031/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	260	402	51,406	2037/1/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	250	412	52,730	2039/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	190	337	43,157	2040/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	150	225	28,798	2042/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	300	405	51,786	2044/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	350	478	61,137	2046/8/15
(ユーロ…イタリア)					
国債証券					
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,100	1,146	146,512	2020/2/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	750	780	99,804	2020/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	400	417	53,415	2020/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	200	208	26,705	2021/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,580	1,648	210,773	2021/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	800	867	110,852	2022/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	750	830	106,155	2022/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	950	1,023	130,771	2023/5/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	600	653	83,593	2023/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	430	553	70,765	2023/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	200	207	26,554	2024/9/1

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…イタリア)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	450	499	63,815	2025/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,250	1,356	173,408	2026/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.05	200	181	23,167	2027/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	400	494	63,201	2027/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	650	722	92,398	2028/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	750	865	110,625	2029/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	650	800	102,346	2031/5/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	250	303	38,847	2033/2/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	250	285	36,525	2034/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	560	574	73,488	2037/2/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	600	682	87,221	2039/8/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	500	566	72,370	2040/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	150	165	21,171	2044/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	500	446	57,024	2046/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	250	196	25,147	2067/3/1
(ユーロ…フランス)					
国債証券					
FRANCE (GOVT OF)	3.75	770	803	102,706	2019/10/25
FRANCE (GOVT OF)	3.5	700	742	94,937	2020/4/25
FRANCE (GOVT OF)	2.5	430	456	58,295	2020/10/25
FRANCE (GOVT OF)	3.75	530	585	74,874	2021/4/25
FRANCE (GOVT OF)	3.25	500	554	70,860	2021/10/25
FRANCE (GOVT OF)	3.0	350	390	49,874	2022/4/25
FRANCE (GOVT OF)	2.25	1,500	1,646	210,428	2022/10/25
FRANCE (GOVT OF)	8.5	200	277	35,473	2023/4/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	850	921	117,754	2023/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.25	1,150	1,395	178,434	2023/10/25
FRANCE (GOVT OF)	2.25	650	727	92,992	2024/5/25
FRANCE (GOVT OF)	1.75	350	383	48,967	2024/11/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	400	405	51,897	2025/5/25
FRANCE (GOVT OF)	6.0	950	1,324	169,309	2025/10/25
FRANCE (GOVT OF)	1.0	800	836	106,898	2025/11/25
FRANCE (GOVT OF)	3.5	400	492	62,991	2026/4/25
FRANCE (GOVT OF)	2.75	950	1,129	144,377	2027/10/25
FRANCE (GOVT OF)	5.5	490	724	92,649	2029/4/25
FRANCE (GOVT OF)	2.5	150	176	22,583	2030/5/25
FRANCE (GOVT OF)	5.75	600	971	124,227	2032/10/25
FRANCE (GOVT OF)	4.75	730	1,126	144,012	2035/4/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	1,010	1,490	190,491	2038/10/25
FRANCE (GOVT OF)	4.5	250	399	51,081	2041/4/25
FRANCE (GOVT OF)	3.25	450	617	78,994	2045/5/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	320	516	66,017	2055/4/25
FRANCE (GOVT OF)	4.0	200	330	42,262	2060/4/25
(ユーロ…オランダ)					
国債証券					
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	300	321	41,107	2020/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	300	330	42,298	2021/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	270	316	40,397	2023/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	150	163	20,905	2023/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	450	501	64,072	2024/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	150	151	19,303	2025/7/15

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	200	203	26,004	2026/7/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	620	905	115,780	2028/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	350	535	68,396	2037/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	150	237	30,321	2042/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	100	140	18,020	2047/1/15
(ユーロ…スペイン)					
国債証券					
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	300	306	39,167	2020/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	400	425	54,395	2020/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	620	681	87,113	2020/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	650	739	94,572	2021/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	700	829	105,995	2022/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	1,200	1,453	185,763	2024/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	500	520	66,516	2025/4/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	400	494	63,217	2025/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	800	1,074	137,367	2026/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	650	863	110,374	2028/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6.0	930	1,315	168,209	2029/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.2	780	1,013	129,552	2037/1/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	400	558	71,414	2041/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	150	223	28,604	2044/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	150	158	20,198	2046/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	100	111	14,303	2066/7/30
(ユーロ…ベルギー)					
国債証券					
BELGIUM KINGDOM	3.75	450	487	62,289	2020/9/28
BELGIUM KINGDOM	4.25	200	227	29,050	2021/9/28
BELGIUM KINGDOM	4.0	350	401	51,343	2022/3/28
BELGIUM KINGDOM	2.25	420	465	59,460	2023/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.6	350	398	50,880	2024/6/22
BELGIUM KINGDOM	1.0	150	155	19,856	2026/6/22
BELGIUM KINGDOM	5.5	380	546	69,802	2028/3/28
BELGIUM KINGDOM	1.0	150	148	19,004	2031/6/22
BELGIUM KINGDOM	4.0	170	231	29,624	2032/3/28
BELGIUM KINGDOM	5.0	260	402	51,472	2035/3/28
BELGIUM KINGDOM	4.25	550	831	106,235	2041/3/28
BELGIUM KINGDOM	3.75	220	318	40,709	2045/6/22
BELGIUM KINGDOM	2.15	80	82	10,564	2066/6/22
(ユーロ…オーストリア)					
国債証券					
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	250	278	35,616	2021/9/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	350	381	48,783	2023/10/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	350	382	48,870	2024/10/21
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	550	733	93,729	2026/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	200	298	38,125	2027/7/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	350	525	67,114	2037/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	150	210	26,884	2044/6/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	80	137	17,563	2062/1/26
(ユーロ…フィンランド)					
国債証券					
FINNISH GOVERNMENT	3.375	350	370	47,371	2020/4/15

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フィンランド)	%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
国債証券					
FINNISH GOVERNMENT	1.5	100	107	13,720	2023/4/15
FINNISH GOVERNMENT	4.0	200	249	31,953	2025/7/4
FINNISH GOVERNMENT	2.75	150	180	23,030	2028/7/4
FINNISH GOVERNMENT	2.625	100	131	16,791	2042/7/4
(ユーロ…アイルランド)					
国債証券					
IRISH TREASURY	4.5	600	644	82,330	2020/4/18
IRISH TREASURY	3.9	200	233	29,905	2023/3/20
IRISH TREASURY	5.4	300	392	50,167	2025/3/13
IRISH TREASURY	2.4	100	113	14,461	2030/5/15
IRISH TREASURY	2.0	200	209	26,745	2045/2/18
ユーロ計				9,432,766	
(イギリス)		千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券					
UK TREASURY	4.75	390	411	59,306	2020/3/7
UK TREASURY	2.0	350	357	51,576	2020/7/22
UK TREASURY	8.0	570	676	97,546	2021/6/7
UK TREASURY	3.75	300	325	46,880	2021/9/7
UK TREASURY	1.75	600	619	89,290	2022/9/7
UK TREASURY	2.75	800	875	126,235	2024/9/7
UK TREASURY	1.25	200	198	28,641	2027/7/22
UK TREASURY	4.25	150	187	27,099	2027/12/7
UK TREASURY	6.0	270	387	55,952	2028/12/7
UK TREASURY	4.75	350	474	68,452	2030/12/7
UK TREASURY	4.25	430	568	81,914	2032/6/7
UK TREASURY	4.5	400	554	80,008	2034/9/7
UK TREASURY	4.25	260	356	51,473	2036/3/7
UK TREASURY	4.75	170	254	36,720	2038/12/7
UK TREASURY	4.25	300	431	62,176	2040/12/7
UK TREASURY	4.5	620	938	135,291	2042/12/7
UK TREASURY	3.25	500	636	91,817	2044/1/22
UK TREASURY	4.25	450	682	98,450	2046/12/7
UK TREASURY	4.25	560	924	133,326	2055/12/7
UK TREASURY	4.0	400	654	94,323	2060/1/22
UK TREASURY	3.5	300	466	67,203	2068/7/22
UNITED KINGDOM GILT	2.0	300	316	45,685	2025/9/7
小計				1,629,374	
(スウェーデン)		千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
国債証券					
SWEDISH GOVERNMENT	5.0	2,100	2,340	28,876	2020/12/1
SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,950	2,204	27,206	2022/6/1
SWEDISH GOVERNMENT	1.5	2,500	2,678	33,055	2023/11/13
SWEDISH GOVERNMENT	2.5	1,850	2,116	26,117	2025/5/12
SWEDISH GOVERNMENT	1.0	1,500	1,564	19,303	2026/11/12
SWEDISH GOVERNMENT	3.5	700	977	12,057	2039/3/30
小計				146,617	
(ノルウェー)		千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券					
NORWEGIAN GOVERNMENT	3.75	1,400	1,487	20,029	2021/5/25
NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,400	1,426	19,218	2023/5/24
NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	450	480	6,475	2024/3/14

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ	千円	
(ノルウェー) 国債証券					
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	1,000	999	13,460	2025/3/13
NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	977	13,166	2026/2/19
小計				72,349	
		千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
(デンマーク) 国債証券					
KINGDOM OF DENMARK	4.0	1,800	1,888	32,352	2019/11/15
KINGDOM OF DENMARK	3.0	2,450	2,710	46,436	2021/11/15
KINGDOM OF DENMARK	1.75	500	558	9,560	2025/11/15
KINGDOM OF DENMARK	4.5	2,300	3,949	67,648	2039/11/15
小計				155,998	
		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
(ポーランド) 国債証券					
POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	1,000	1,072	31,787	2020/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	1,000	1,132	33,577	2022/9/23
POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	800	819	24,298	2025/7/25
POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	800	771	22,863	2026/7/25
小計				112,527	
		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
(オーストラリア) 国債証券					
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,000	1,036	82,443	2020/4/15
AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	970	1,059	84,321	2021/5/15
AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	300	339	26,974	2022/7/15
AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	300	342	27,233	2023/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	900	920	73,245	2024/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	200	210	16,730	2025/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	180	201	16,057	2026/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	800	934	74,356	2027/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	250	264	21,040	2029/4/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	550	613	48,766	2037/4/21

銘柄	当期末				
	利率	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額	
	%	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル	千円	
(オーストラリア) 国債証券					
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	450	440	35,060	2047/3/21
小計				506,231	
		千シンガポールドル	千シンガポールドル		
(シンガポール) 国債証券					
SINGAPORE GOVERNMENT	1.625	300	299	24,350	2019/10/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	100	100	8,168	2021/6/1
SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	400	429	34,994	2027/3/1
SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	150	145	11,858	2042/4/1
小計				79,371	
		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
(マレーシア) 国債証券					
MALAYSIA GOVERNMENT	4.048	1,000	1,010	27,254	2021/9/30
MALAYSIA GOVERNMENT	4.935	500	500	13,493	2043/9/30
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	1,400	1,413	38,116	2019/11/29
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	1,000	1,013	27,310	2021/7/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	600	591	15,949	2023/3/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	2,250	2,279	61,468	2026/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	600	572	15,434	2032/4/15
小計				199,026	
		千南アフリカランド	千南アフリカランド		
(南アフリカ) 国債証券					
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	1,500	1,509	11,620	2020/1/15
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	6,000	6,379	49,124	2026/12/21
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	2,100	1,443	11,112	2036/3/31
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	2,000	1,718	13,232	2037/1/31
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	6,550	5,612	43,215	2048/2/28
小計				128,304	
合計				24,012,612	

(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

(2018年10月26日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	24,012,612	97.2
コール・ローン等、その他	683,577	2.8
投資信託財産総額	24,696,189	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（24,354,881千円）の投資信託財産総額（24,696,189千円）に対する比率は98.6%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=112.47円、1カナダドル=85.95円、1メキシコペソ=5.77円、1ユーロ=127.83円、1イギリスポンド=144.21円、1スウェーデンクローナ=12.34円、1ノルウェークローネ=13.47円、1デンマーククローネ=17.13円、1ポーランドズロチ=29.65円、1オーストラリアドル=79.55円、1シンガポールドル=81.42円、1マレーシアリンギット=26.96円、1南アフリカランド=7.70円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年10月26日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	48,990,377,967
コール・ローン等	173,792,847
公社債(評価額)	24,012,612,135
未収入金	24,558,872,960
未収利息	239,886,562
前払費用	5,213,463
(B) 負債	24,382,015,361
未払金	24,329,653,640
未払解約金	52,361,625
未払利息	96
(C) 純資産総額(A－B)	24,608,362,606
元本	16,823,343,930
次期繰越損益金	7,785,018,676
(D) 受益権総口数	16,823,343,930口
1万口当たり基準価額(C／D)	14,628円

(注) 当ファンドの期首元本額は17,017,756,688円、期中追加設定元本額は1,122,522,227円、期中一部解約元本額は1,316,934,985円です。

(注) 2018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）	12,532,569,503円
・インデックスファンド海外債券ヘッジあり（DC専用）	2,098,854,047円
・インデックス・アセットバランス・オープン（適格機関投資家向け）	1,183,255,079円
・インデックスファンド海外債券（ヘッジあり）1年決算型	516,633,783円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	131,366,819円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	129,222,482円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	97,118,078円
・年金積立 アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	90,510,867円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式20）	21,827,881円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式40）	12,564,634円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式60）	4,928,627円
・アセット・ナビゲーション・ファンド（株式80）	4,492,130円

(注) 1口当たり純資産額は1.4628円です。

○損益の状況 (2017年10月27日～2018年10月26日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	712,956,361
受取利息	713,103,581
支払利息	△ 147,220
(B) 有価証券売買損益	△1,143,495,322
売買益	1,915,673,666
売買損	△3,059,168,988
(C) 保管費用等	△ 3,744,940
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 434,283,901
(E) 前期繰越損益金	8,305,805,459
(F) 追加信託差損益金	543,402,640
(G) 解約差損益金	△ 629,905,522
(H) 計(D＋E＋F＋G)	7,785,018,676
次期繰越損益金(H)	7,785,018,676

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

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

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

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。

○お知らせ

約款変更について

2017年10月27日から2018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、運用目標とするベンチマークを構成する指数の名称が「シティ世界国債インデックス」から「FTSE世界国債インデックス」へ変更となったため、2018年７月20日付けにて信託約款に所要の変更を行ないました。（付表）