

# 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

## 愛称：ネクスト10マイルド

### 運用報告書(全体版)

第6期（決算日2019年2月18日）

作成対象期間（2018年2月20日～2019年2月18日）

#### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2013年3月29日以降、無期限とします。	
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、国内および外国の株式、公社債、不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とし、為替予約取引等を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行うことを基本とします。	
主な投資対象	野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」および「野村マネー マザーファンド」の受益証券を主要投資対象とし、為替予約取引等を主要取引対象とします。
	国内株式マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式を主要投資対象とします。
	外国債券マザーファンド	外国の公社債を主要投資対象とします。
	新興国株式マザーファンド	新興国の株式を主要投資対象とします。
	新興国債券マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。
	J-REITインデックス マザーファンド	J-REITを主要投資対象とします。
	海外REITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とします。
主な投資制限	野村マネー マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
	野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
	国内株式マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。
	国内債券マザーファンド	外貨建て資産への投資は行いません。
	外国株式MSCI-KOKUSAI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。
	外国債券マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国株式マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。
	新興国債券マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
	J-REITインデックス マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
分配方針	海外REITインデックス マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行いません。
毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益等から基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。		

### 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104  
〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時  
ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

# ○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 配 金	期 騰 落 率						
	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円
2期(2015年2月17日)	10,396	5	5.2	0.9	0.0	92.1	—	2.3	36
3期(2016年2月17日)	10,274	5	△1.1	4.0	0.1	67.9	—	4.5	35
4期(2017年2月17日)	10,353	5	0.8	4.5	0.1	50.1	—	7.2	47
5期(2018年2月19日)	10,379	5	0.3	5.8	0.1	65.7	—	7.4	948
6期(2019年2月18日)	10,463	5	0.9	2.1	0.0	70.6	—	8.0	1,645

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。  
 \* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。  
 \* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。  
 \* 当ファンドは、絶対リターンを目指す運用ですので、ベンチマーク等を設けておりません。

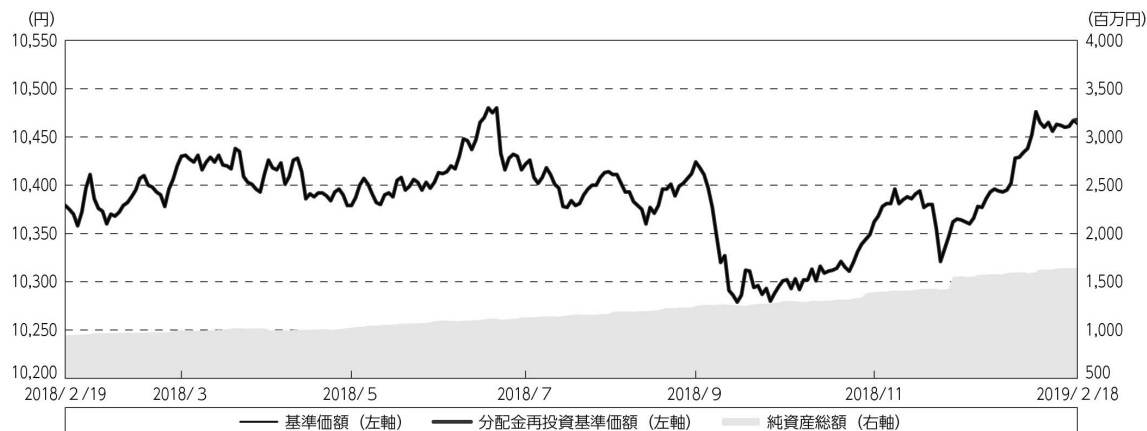
# ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%
2018年2月19日	10,379	—	5.8	0.1	65.7	—	7.4
2月末	10,386	0.1	5.8	0.1	67.4	—	7.4
3月末	10,430	0.5	6.3	0.2	67.8	—	6.2
4月末	10,411	0.3	8.0	0.1	67.6	—	7.1
5月末	10,379	0.0	8.5	0.2	64.4	—	8.7
6月末	10,413	0.3	8.7	0.1	69.0	—	9.5
7月末	10,422	0.4	8.4	0.1	71.3	—	11.1
8月末	10,402	0.2	7.7	0.1	71.7	—	11.0
9月末	10,424	0.4	6.9	0.1	70.7	—	10.7
10月末	10,302	△0.7	3.8	0.1	59.6	—	7.1
11月末	10,362	△0.2	2.9	0.0	69.2	—	8.9
12月末	10,362	△0.2	2.0	0.0	74.7	—	7.4
2019年1月末	10,452	0.7	2.1	0.0	70.9	—	8.2
(期 末)							
2019年2月18日	10,468	0.9	2.1	0.0	70.6	—	8.0

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。  
 \* 株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。  
 \* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。  
 \* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期 首：10,379円

期 末：10,463円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率： 0.9%（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。作成期首（2018年2月19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）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、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

（注）上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首10,379円から期末10,468円（分配金込み）と89円の値上がりとなりました。

当作成期間では、先進国の債券や国内のREITに投資をしたことなどが基準価額の上昇に寄与しました。一方、国内の株式に投資したことや為替などが基準価額の下落に影響しました。

## ○投資環境

当作成期間の前半は、先進国の債券市場はFRB（米連邦準備制度理事会）による持続的な利上げが示唆されたことなどから利回りは上昇（価格は下落）しましたが、利子収入などからリターンはプラスとなりました。先進国の債券市場の利回りが上昇したことなどから、新興国の債券（米ドル建ておよび現地通貨建て）市場も利回りが上昇しました。また、国内の債券市場も日本銀行の金融緩和策に変更があるとの観測が広がったことなどから利回りは上昇しました。国内の株式市場は米国での保護主義的な通商政策に対する懸念が高まったことなどから下落しましたが、先進国の株式市場は堅調な経済指標や好調な企業業績などを背景に上昇し、国内のREIT市場や先進国のREIT市場も上昇しました。為替市場では、米ドルは対円で上昇（円安）、ユーロ、英ポンドなどは対円で下落（円高）しました。

当作成期間の後半は、先進国の債券市場はFOMC（米連邦公開市場委員会）の利上げ実施などを受けて利回りが上昇する場面もありましたが、追加の利上げ観測が後退したことなどを背景に利回りは低下（価格は上昇）しました。また、新興国の債券（米ドル建ておよび現地通貨建て）市場や国内の債券市場も利回りが低下しました。先進国の株式市場は米中貿易摩擦への警戒感などから下落し、国内の株式市場も下落しました。一方で、国内のREIT市場や先進国のREIT市場は上昇しました。為替市場では、米ドル、ユーロは対円で下落、英ポンドは対円で上昇しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### [野村DC運用戦略ファンド（マイルド）]

期を通じて、外国債券マザーファンドを中心に、国内債券マザーファンド、国内株式マザーファンド、J-REITインデックス マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、海外REITインデックス マザーファンド、新興国債券マザーファンド等にバランスよく投資しました。また、投資環境の不確実性の度合いに応じて、キャッシュ比率は適宜調整しました。

実質通貨比率は、外貨建て資産に対して対円で為替ヘッジ（代替ヘッジを含みます）を行うことで、実質的な外貨比率を一定範囲内に抑えた状態を維持しました。

### [各マザーファンド]

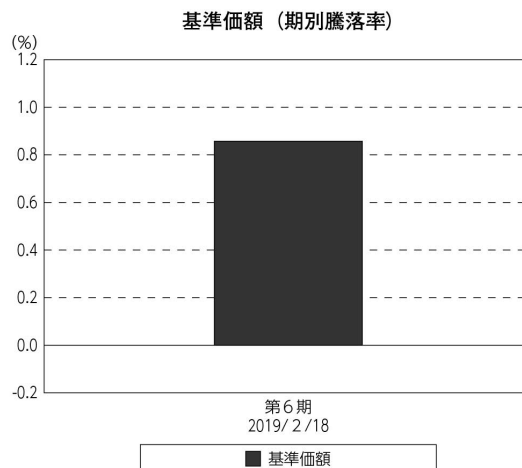
各マザーファンド（野村マネー マザーファンドを除く）は、ポートフォリオの特性値等を各指数に近似させることで、各指数の中長期的な動きを概ね捉える運用を行ないました。

野村マネー マザーファンドは、残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、絶対リターンを目指す運用ですので、ベンチマーク等を設けておりません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## ◎分配金

収益分配金は、基準価額水準等を勘案して、次の通りとさせていただきます。

なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第 6 期
	2018年2月20日～ 2019年2月18日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.048%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	869

(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

### [野村DC運用戦略ファンド（マイルド）]

引き続き、市場環境の変化に合わせて資産および通貨の配分比率を適宜見直していくことで、ポートフォリオのリスク水準を一定範囲内程度に抑えつつ効率的に収益を獲得することを目指します。

資産構成は、先進国の債券を中心に、株式やREITなどの幅広い資産にバランスよく投資を行なう予定です。キャッシュ比率は、投資環境の不確実性の度合いに応じて、適宜変更していく予定です。

外貨建て資産に対しては、対円で為替ヘッジ（代替ヘッジを含みます）を行なうことで、実質的な外貨比率を一定範囲内に抑えた状態を維持する予定です。

### [各マザーファンド]

各マザーファンド（野村マネー マザーファンドを除く）は、引き続き、ポートフォリオの特性値等を各指数に近似させることで、各指数の中長期的な動きを概ね捉える運用を行なってまいります。

野村マネー マザーファンドは、残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

引き続き、当ファンドをご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

（2018年2月20日～2019年2月18日）

## ○ 1 万口当たりの費用明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 67	% 0.646	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
( 投 信 会 社 )	(34)	(0.323)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
( 販 売 会 社 )	(28)	(0.269)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
( 受 託 会 社 )	( 6 )	(0.054)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(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 )	(0.000)	
( 投 資 信 託 証 券 )	( 0 )	(0.001)	
( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	( 0 )	(0.000)	
(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 )	(0.000)	
( 投 資 信 託 証 券 )	( 0 )	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.014	(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 )	( 1 )	(0.008)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
( 監 査 費 用 )	( 0 )	(0.003)	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 )	(0.003)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	68	0.662	
期中の平均基準価額は、10,395円です。			

\* 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。

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\* 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マザーファンド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。

\* 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

(2018年2月20日～2019年2月18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
国内株式マザーファンド	21,288	35,950	25,434	41,100
国内債券マザーファンド	164,284	221,350	39,218	52,500
外国債券マザーファンド	234,518	523,700	73,848	164,350
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	4,606	11,750	9,733	26,300
J-REITインデックス マザーファンド	34,818	72,450	18,269	37,800
海外REITインデックス マザーファンド	19,205	43,050	12,740	26,900
新興国債券マザーファンド	9,338	16,950	8,949	15,700
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	9,129	12,100	8,636	11,100

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2018年2月20日～2019年2月18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		
	国内株式マザーファンド	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	海外REITインデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	93,981,777千円	106,855,542千円	142,375千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	373,357,504千円	482,377,612千円	－千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.25	0.22	－

\* (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

(2018年2月20日～2019年2月18日)

## 利害関係人との取引状況

## &lt;野村DC運用戦略ファンド（マイルド）&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
		百万円	$\frac{B}{A}$		百万円	$\frac{D}{C}$
為替先物取引	百万円 3,275	百万円 －	% －	百万円 3,591	百万円 6	% 0.2



## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 83,499	百万円 364	% 0.4	百万円 10,481	百万円 340	% 3.2
貸付有価証券(株式)	140,099	6,924	4.9	134,802	7,285	5.4

平均保有割合 0.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

\*貸付有価証券(株式)の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

## &lt;外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 99,809	百万円 —	% —	百万円 23,085	百万円 66	% 0.3

平均保有割合 0.0%

## &lt;国内債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 22,262	百万円 2,766	% 12.4	百万円 16,056	百万円 1,255	% 7.8

平均保有割合 0.9%

## &lt;野村マネー マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 18,933	百万円 852	% 4.5	百万円 —	百万円 —	% —

平均保有割合 0.1%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 67,700	百万円 700	% 1.0	百万円 81,616	百万円 1,348	% 1.7

平均保有割合 0.1%

## &lt;新興国債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 6,798	百万円 20	% 0.3	百万円 1,891	百万円 —	% —

平均保有割合 0.1%

## &lt;新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 7,085	百万円 962	% 13.6	百万円 5,909	百万円 962	% 16.3

平均保有割合 0.2%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 13,652	百万円 1,346	% 9.9	百万円 8,955	百万円 474	% 5.3

平均保有割合 0.2%

## &lt;海外REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 7,506	百万円 34	% 0.5	百万円 5,838	百万円 —	% —

平均保有割合 0.1%

## 利害関係人の発行する有価証券等

## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 386	百万円 56	百万円 1,315

## 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	9千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.198千円
(B) / (A)	2.2%

\* 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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野村證券株式会社、野村信託銀行です。

## 〇自社による当ファンドの設定、解約状況

(2018年2月20日～2019年2月18日)

期首残高 (元 本)	当期設定 元 本	当期解約 元 本	期末残高 (元 本)	取引の理由
百万円 35	百万円 —	百万円 35	百万円 —	当初設定時における取得とその処分

# ○組入資産の明細

(2019年2月18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	評価額
国内株式マザーファンド		千口	千口	千円	千円
国内債券マザーファンド		16,403	12,257	19,346	19,346
外国債券マザーファンド		125,473	250,539	342,212	342,212
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド		189,612	350,283	786,035	786,035
野村マネー マザーファンド		11,376	6,248	16,569	16,569
J-REITインデックス マザーファンド		7,492	7,492	7,646	7,646
海外REITインデックス マザーファンド		26,961	43,509	95,077	95,077
新興国債券マザーファンド		9,488	15,953	37,838	37,838
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド		13,651	14,040	25,966	25,966
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド		11,039	11,532	15,293	15,293

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「参考情報」または「運用報告書」をご参照ください。

# ○投資信託財産の構成

(2019年2月18日現在)

項	目	当	期	末
		評価額	比率	率
国内株式マザーファンド		千円	%	%
国内債券マザーファンド		19,346	1.2	1.2
外国債券マザーファンド		342,212	20.7	20.7
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド		786,035	47.5	47.5
野村マネー マザーファンド		16,569	1.0	1.0
J-REITインデックス マザーファンド		7,646	0.5	0.5
海外REITインデックス マザーファンド		95,077	5.8	5.8
新興国債券マザーファンド		37,838	2.3	2.3
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド		25,966	1.6	1.6
コール・ローン等、その他		15,293	0.9	0.9
投資信託財産総額		307,309	18.5	18.5
		1,653,291	100.0	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（609,605,292千円）の投資信託財産総額（609,942,184千円）に対する比率は99.9%です。

\*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（552,538,280千円）の投資信託財産総額（552,692,767千円）に対する比率は100.0%です。

\*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（25,102,294千円）の投資信託財産総額（25,134,821千円）に対する比率は99.9%です。

\*新興国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（18,435,443千円）の投資信託財産総額（18,462,086千円）に対する比率は99.9%です。

\*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（7,945,998千円）の投資信託財産総額（8,100,705千円）に対する比率は98.1%です。

\*外貨建て資産は、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カタールリヤル=30.41円、1米ドル=110.54円、1カナダドル=83.51円、1英ポンド=142.67円、1スイスフラン=110.12円、1スウェーデンクローナ=11.93円、1ノルウェークローネ=12.81円、1デンマーククローネ=16.74円、1トルコリラ=20.99円、1ユーロ=124.93円、1チェココルナ=4.87円、1フォリント=0.3926円、1ズロチ=28.85円、1ルーブル=1.67円、1レイ=26.38円、1香港ドル=14.08円、1シンガポールドル=81.53円、1リンギ=27.13円、1パース=3.54円、1フリビンペソ=2.11円、1ルピア=0.0078円、1ウォン=0.0982円、1新台幣ドル=3.58円、1豪ドル=79.03円、1ニュージーランドドル=76.05円、1インドルピー=1.56円、1新シェケル=30.55円、1パキスタンルピー=0.80円、1アルゼンチンペソ=2.86円、1メキシコペソ=5.75円、1レアル=29.86円、1チリペソ=0.1665円、1コロンビアペソ=0.0353円、1ソル=33.23円、1ウルグアイペソ=3.39円、1UAEディルハム=30.14円、1エジプトポンド=6.30円、1ランド=7.86円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2019年2月18日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2, 439, 195, 391
コール・ローン等	300, 546, 666
国内株式マザーファンド(評価額)	19, 346, 376
国内債券マザーファンド(評価額)	342, 212, 505
外国債券マザーファンド(評価額)	786, 035, 583
外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド(評価額)	16, 569, 121
野村マネー マザーファンド(評価額)	7, 646, 748
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	95, 077, 916
海外REITインデックス マザーファンド(評価額)	37, 838, 803
新興国債券マザーファンド(評価額)	25, 966, 739
新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド(評価額)	15, 293, 098
未収入金	792, 661, 836
(B) 負債	793, 879, 607
未払金	788, 513, 100
未払収益分配金	786, 253
未払解約金	53, 802
未払信託報酬	4, 503, 480
未払利息	516
その他未払費用	22, 456
(C) 純資産総額（A－B）	1, 645, 315, 784
元本	1, 572, 506, 055
次期繰越損益金	72, 809, 729
(D) 受益権総口数	1, 572, 506, 055口
1万口当たり基準価額（C／D）	10, 463円

(注) 期首元本額は914, 248, 570円、期中追加設定元本額は922, 864, 885円、期中一部解約元本額は264, 607, 400円、1口当たり純資産額は1, 0463円です。

## ○損益の状況（2018年2月20日～2019年2月18日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 122, 711
支払利息	△ 122, 711
(B) 有価証券売買損益	21, 563, 726
売買益	73, 882, 683
売買損	△ 52, 318, 957
(C) 信託報酬等	△ 7, 844, 200
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	13, 596, 815
(E) 前期繰越損益金	△ 3, 622, 094
(F) 追加信託差損益金	63, 621, 261
（配当等相当額）	（ 108, 506, 323）
（売買損益相当額）	（△ 44, 885, 062）
(G) 計（D＋E＋F）	73, 595, 982
(H) 収益分配金	△ 786, 253
次期繰越損益金（G＋H）	72, 809, 729
追加信託差損益金	63, 621, 261
（配当等相当額）	（ 109, 958, 241）
（売買損益相当額）	（△ 46, 336, 980）
分配準備積立金	26, 839, 035
繰越損益金	△ 17, 650, 567

\* 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。

\* 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。

\* 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（2018年2月20日～2019年2月18日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2018年2月20日～ 2019年2月18日
a. 配当等収益(経費控除後)	18, 402, 550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	109, 958, 241円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	9, 222, 738円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	137, 583, 529円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	874円
g. 分配金	786, 253円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

## ○分配金のお知らせ

---

1 万口当たり分配金（税込み）	5円
-----------------	----

## ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## ○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2019年2月18日現在)

## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

下記は、国内株式マザーファンド全体（251,040,771千口）の内容です。

## 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			
極洋	6.1	7.5	22,222
日本水産	174.7	229.9	168,286
マルハニチロ	29.4	33.2	123,006
カネコ種苗	5.3	7	9,268
サカタのタネ	22.9	28	104,300
ホクト	15.8	19.3	37,345
ホクリョウ	2.2	3.1	1,925
<b>鉱業 (0.3%)</b>			
住石ホールディングス	40.5	49.5	4,999
日鉄鉱業	4.3	5.3	24,353
三井松島ホールディングス	7.9	9.6	15,033
国際石油開発帝石	754.6	922.3	1,053,266
日本海洋掘削	5.4	—	—
石油資源開発	24.6	33	77,847
K&Oエナジーグループ	9.1	11.2	17,068
<b>建設業 (2.9%)</b>			
ヒノキヤグループ	—	4.8	10,924
ショーボンドホールディングス	14.6	16.4	132,676
ミライト・ホールディングス	47.7	64.7	107,984
タマホーム	11.6	11.1	12,187
サンヨーホームズ	2.7	3.3	2,824
日本アクア	—	5.5	2,805
ファーストコーポレーション	5.2	7	5,131
ベステラ	2.2	4.4	5,874
TATERU	13.6	28	7,504
スペースバリューホールディングス	—	28	24,948
ダイセキ環境ソリューション	3.6	4.4	2,860
第一カッター興業	1.5	2.8	5,034
安藤・間	119.5	147	112,455
東急建設	59.7	67.3	65,079
コムシスホールディングス	54.6	81.5	231,378
ミサワホーム	13	18.1	13,194

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ビーアールホールディングス	15.4	18.8	6,711
高松コンストラクショングループ	10	14.3	38,867
東建コーポレーション	5.8	7.1	46,647
ソネック	1.9	2.4	1,699
ヤマウラ	7.3	8.9	8,704
大成建設	154.5	188.8	938,336
大林組	465.4	568.8	599,515
清水建設	474.7	580.2	542,487
飛島建設	141.2	16.2	24,381
長谷工コーポレーション	181.1	237.1	316,291
松井建設	17.1	20.9	15,486
銭高組	2.2	2.3	12,190
鹿島建設	682	444.6	709,137
不動テトラ	117.4	13	20,644
大末建設	5	6.7	6,418
鉄建建設	9.4	11.5	31,107
西松建設	35.9	40.9	100,654
三井住友建設	111.9	136.8	95,486
大豊建設	56	12.8	38,528
前田建設工業	110.7	135.3	152,077
佐田建設	10	12.2	4,477
ナカノフドー建設	11.9	14.5	7,569
奥村組	25.5	31.2	104,520
東鉄工業	18.6	22.8	68,400
イチケン	2.8	3.4	6,670
富士ビー・エス	—	5.9	3,044
浅沼組	55	6.7	17,734
戸田建設	180	220.5	156,114
熊谷組	24.4	27.1	86,855
青木あすなろ建設	10.2	9.3	9,588
北野建設	32	4	12,500
植木組	1.9	2.3	5,271
三井ホーム	20	—	—

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
矢作建設工業	21.1	25.8	19,324	
ピーエス三菱	18.4	20	12,520	
日本ハウスホールディングス	29.6	36.2	15,928	
大東建託	56.2	67.6	1,053,208	
新日本建設	18.5	22.6	22,374	
N I P P O	35.9	50.2	106,524	
東亜道路工業	3.1	3.6	11,088	
前田道路	49	59.4	128,363	
日本道路	4.2	5.1	33,558	
東亜建設工業	12.6	16.6	26,327	
若築建設	8.4	9.5	14,288	
東洋建設	48.7	69.4	29,286	
五洋建設	184.5	225.5	121,995	
世紀東急工業	20.9	27.6	17,388	
福田組	5	6.1	26,596	
住友林業	99.2	134.4	190,982	
日本基礎技術	17.2	19.5	7,195	
日成ビルド工業	22.9	—	—	
ヤマダ・エスバイエルホーム	70	—	—	
巴コーポレーション	19.3	23.6	9,133	
大和ハウス工業	458.4	525.2	1,750,491	
ライト工業	29.8	36.5	54,312	
積水ハウス	504.9	580.8	938,572	
日特建設	13.2	16.2	9,979	
北陸電気工事	8.6	9.2	8,629	
ユアテック	24.5	30.4	26,812	
西部電気工業	2.6	—	—	
四電工	2.4	2.9	7,760	
中電工	20	24.4	57,657	
関電工	61.8	86.3	88,889	
きんでん	103.2	126.1	228,619	
東京エネシス	17.6	19.6	19,992	
トーエネック	4.4	5.3	17,437	
住友電設	12.3	13.1	24,523	
日本電設工業	23.8	32.3	73,999	
協和エクシオ	55.7	74.3	208,708	
新日本空調	12	15.9	31,672	
N D S	2.4	—	—	
九電工	30.6	37.4	143,242	
三機工業	32.9	42.8	50,161	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日揮	133.7	163.4	284,316
中外炉工業	4.7	5.3	9,179
ヤマト	12.7	17	7,888
太平電業	10.5	12.8	31,590
高砂熱学工業	42.7	47.8	85,753
三晃金属工業	1.7	2.3	6,849
朝日工業社	3.2	3.9	11,497
明星工業	28.1	34.3	24,901
大気社	20.6	25.8	82,560
ダイダン	10.4	12.7	31,026
日比谷総合設備	17.3	18.1	34,082
東芝プラントシステム	33.6	41.1	84,953
ＯＳＪＢホールディングス	68.5	83.7	23,687
東洋エンジニアリング	18.2	—	—
千代田化工建設	100.8	136.8	41,176
新興プランテック	29.9	34.1	41,533
食料品（4.3%）			
日本製粉	46.1	56.4	106,765
日清製粉グループ本社	170.1	192	450,240
日東富士製粉	1	1.2	7,548
昭和産業	12.8	15.6	46,878
鳥越製粉	12.3	15.1	11,778
中部飼料	17	20.8	23,088
フィード・ワン	93.4	114.1	20,538
東洋精糖	2.3	2.6	2,657
日本甜菜製糖	7.9	9.7	17,605
三井製糖	11	13.4	39,114
塩水港精糖	16.6	18.4	4,084
日新製糖	6.6	8	16,472
森永製菓	32.6	42.7	210,938
中村屋	3.6	4.4	18,722
江崎グリコ	38.8	51.1	291,781
名糖産業	6.7	8.2	11,209
井村屋グループ	5.5	7.2	17,949
不二家	8.9	9.5	22,182
山崎製パン	113.7	138.9	264,604
第一屋製パン	2.4	2.9	3,010
モロゾフ	2.4	2.9	14,485
亀田製菓	8.6	10.6	55,014
寿スピリッツ	13.4	18	78,570



## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カルビー	63.3	77.4	244,584
森永乳業	27.8	34	117,130
六甲バター	6.9	12.4	24,378
ヤクルト本社	83.2	125.9	930,401
明治ホールディングス	91.9	120.4	1,054,704
雪印メグミルク	33.5	40.9	111,452
ブリマハム	98	23.9	51,289
日本ハム	120	73.4	319,290
林兼産業	5	5.6	3,332
丸大食品	74	18.1	34,951
S F o o d s	9.7	15.3	62,194
伊藤ハム米久ホールディングス	89.5	109.4	72,313
サッポロホールディングス	50.8	62.1	148,294
アサヒグループホールディングス	291.1	355.8	1,696,810
キリンホールディングス	668.2	768.6	1,981,066
宝ホールディングス	104.1	127.2	155,311
オエノンホールディングス	39.5	48.3	18,209
養命酒製造	4.3	5.2	10,930
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	97.6	130.1	390,300
サントリー食品インターナショナル	106.3	113.7	541,212
ダイドーグループホールディングス	7.1	9.6	51,744
伊藤園	46	51.6	262,644
キーコーヒー	13.7	16.7	34,602
ユニカフェ	4.2	5.1	5,176
ジャパンフーズ	2	2.4	2,980
日清オイリオグループ	16.4	21.9	74,898
不二製油グループ本社	37.7	41.4	149,868
かどや製油	1.5	1.9	9,462
J - オイルミルズ	7.2	8.8	35,904
キッコーマン	108.6	112.1	613,187
味の素	319.7	375.2	623,770
キュービー	77.4	94.6	241,513
ハウス食品グループ本社	53	64.8	281,556
カゴメ	55.7	68.1	202,665
焼津水産化学工業	6.7	8.2	9,372
アリアケジャパン	12.7	15.5	92,070
ピエトロ	1.8	2.2	3,612
エバラ食品工業	3	4.1	8,737
ニチレイ	66.2	88.2	241,579
東洋水産	76.3	87.4	361,836

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イートアンド	3.8	5.9	9,923
大冷	1.6	1.9	3,294
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2.1	4.6	3,031
日清食品ホールディングス	60.6	72.2	548,720
永谷園ホールディングス	15	9.1	21,921
一正蒲鉾	5.4	6.6	7,128
フジッコ	15	18.4	42,835
ロック・フィールド	15	18.3	29,463
日本たばこ産業	860.1	981.1	2,747,080
ケンコーマヨネーズ	9.2	9.5	21,384
わらべや日洋ホールディングス	9.1	11.1	21,633
なとり	7.8	9.5	16,074
イフジ産業	2.4	3	2,091
ビックルスコーポレーション	2.1	4	7,924
北の達人コーポレーション	40	66.7	28,280
ユーグレナ	53.6	72.4	46,118
ミヨシ油脂	5.3	6.5	6,812
理研ビタミン	5.3	8	28,480
<b>繊維製品 (0.7%)</b>			
片倉工業	16.7	20.4	24,704
グンゼ	10.8	11.2	57,232
東洋紡	53.6	70.2	115,198
ユニチカ	42.2	48.6	24,300
富士紡ホールディングス	8.1	8.6	24,725
倉敷紡績	146	15.8	36,261
シキボウ	7.3	8.7	9,161
日本毛織	40.9	54.5	48,559
ダイトウボウ	21.9	26.8	2,170
トリア紡コーポレーション	6.2	7	3,199
ダイドーリミテッド	16.2	19.8	6,850
帝国繊維	15.2	18.6	45,514
帝人	118.6	135.3	253,011
東レ	1,052.4	1,286.2	1,024,972
サカイオーベックス	3.7	4.1	7,671
住江織物	3.6	4.8	12,763
日本フェルト	7.7	9.4	4,305
イチカワ	10	2.3	3,208
日東製網	1.6	1.9	2,494
アツギ	9.7	13.7	13,138
ダイニツク	5.5	6.7	5,011

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
セーレン	33.4	40.8	78,825
ソトー	5.4	6.6	6,481
東海染工	2	2.3	2,341
小松マテール	22.3	27.2	22,712
ワコールホールディングス	40.1	48.3	137,606
ホギメディカル	9.1	20.6	79,001
レナウン	39.2	47.9	4,837
クラウドシアホールディングス	3.3	4.1	1,963
T S I ホールディングス	54.8	61.2	42,778
マツオカコーポレーション	2.5	5.2	16,302
ワールド	—	16.3	33,985
三陽商会	7.6	10	17,100
ナイガイ	5.3	6	3,282
オンワードホールディングス	86.7	99.6	66,831
ルックホールディングス	25	6	8,034
キムラタン	66.3	—	—
ゴールドウイン	4.1	15	196,650
デサント	33.1	40.4	102,171
キング	7.2	8.8	5,253
ヤマトインターナショナル	9.6	10.9	4,578
パルプ・紙 (0.3%)			
特種東海製紙	8	10.5	41,580
王子ホールディングス	611	746.4	494,116
日本製紙	65	79.4	160,705
三菱製紙	20.6	27	14,931
北越コーポレーション	81	110	69,960
中越パルプ工業	5.7	7	9,611
巴川製紙所	22	5.5	5,632
大王製紙	57.8	80.8	105,201
阿波製紙	3.5	4.3	1,926
レンゴー	139.9	171	155,268
トーモク	8.3	10.2	16,707
ザ・バック	10.3	12.6	41,202
化学 (7.3%)			
クラレ	244.2	279.8	430,892
旭化成	904.7	1,179.5	1,381,784
共和レザー	8.4	10.3	7,992
昭和電工	96.6	110.2	428,127
住友化学	1,068	1,305.1	730,856
住友精化	6	8.1	34,789

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
日産化学	84.4	101.8	570,080	
ラサ工業	5.1	5.8	8,317	
クレハ	12.5	15.3	107,559	
多木化学	2	4.8	26,832	
テイカ	11.1	13.5	28,215	
石原産業	26	31.8	35,679	
片倉コープアグリ	3.5	4.8	5,524	
日東エフシー	8.5	10.4	7,997	
日本曹達	100	26.2	77,787	
東ソー	209.7	256.3	422,638	
トクヤマ	42.1	47.8	137,281	
セントラル硝子	29.6	36.1	92,127	
東亜合成	85.1	104.1	127,834	
大阪ソーダ	13.1	17.8	49,662	
関東電化工業	34.6	39.3	35,094	
デンカ	53.3	65.2	227,548	
信越化学工業	241.6	292.2	2,775,023	
日本カーバイド工業	4.6	5.6	8,769	
堺化学工業	9.9	11	27,060	
第一稀元素化学工業	—	13.5	12,231	
エア・ウォーター	119.6	135.8	245,662	
大陽日酸	111.7	136.6	215,964	
日本化学工業	5.4	5.6	13,322	
東邦アセチレン	2	2.5	3,470	
日本パーカライジング	74.1	90.6	131,279	
高压ガス工業	21.5	26.3	21,408	
チタン工業	1.6	2.1	5,075	
四国化成工業	20.9	27.9	36,772	
戸田工業	2.9	3.5	7,871	
ステラ ケミファ	7.4	9.7	30,409	
保土谷化学工業	4.7	5.7	16,222	
日本触媒	22.8	27.9	210,924	
大日精化工業	11.2	13.7	42,675	
カネカ	196	44.1	198,009	
三菱瓦斯化学	119.6	170.5	306,900	
三井化学	131.9	150.5	421,249	
J S R	145.9	166.4	315,161	
東京応化工業	25.2	28.4	97,128	
大阪有機化学工業	9.4	15.3	18,390	
三菱ケミカルホールディングス	971.6	1,108.3	909,914	

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
KHネオケム	22.2	25.2	74,340
ダイセル	195.6	257.5	291,232
住友ベークライト	117	28.7	121,831
積水化学工業	301.3	362.4	633,837
日本ゼオン	122.3	149.5	175,513
アイカ工業	40.7	49.7	192,090
宇部興産	73.1	83.7	217,703
積水樹脂	22.4	27.4	59,184
タキロンシーアイ	29.3	35.9	22,114
旭有機材	8.5	11.4	19,038
日立化成	71.7	76.7	156,468
ニチバン	7.1	8.7	19,853
リケンテクノス	31.3	45.2	21,470
大倉工業	35	8.5	15,300
積水化成成品工業	18.2	24.7	23,637
群栄化学工業	3.5	4.3	12,031
タイガースポリマー	7.1	8.7	5,246
ミライアル	4.8	4.8	5,779
ダイキアクシス	4.8	5.9	6,153
ダイキョーニシカワ	28.6	35	45,955
竹本容器	1.6	5.9	8,490
森六ホールディングス	5.5	8.9	23,193
日本化薬	94.2	105.5	137,044
カーリットホールディングス	13.4	17.7	15,115
日本精化	12	13.3	16,039
扶桑化学工業	10.3	16.8	36,607
トリケミカル研究所	—	3.7	19,055
ADEKA	62.4	81.7	140,033
日油	56	63.9	241,542
新日本理化	22.9	30	5,580
ハリマ化成グループ	11.2	13.7	15,193
花王	340.6	411	3,375,132
第一工業製薬	28	6.2	19,189
石原ケミカル	—	4.2	7,606
日華化学	4.6	5.6	5,364
ニイタカ	2.1	2.6	3,861
三洋化成工業	9.1	11.1	61,494
有機合成薬品工業	9.4	12.7	2,489
大日本塗料	16.6	18.7	20,962
日本ペイントホールディングス	111.9	136.8	541,728

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
関西ペイント	152.4	186.3	374,463
神東塗料	10.7	13	2,249
中国塗料	41.6	54.5	54,772
日本特殊塗料	9.1	12.4	17,124
藤倉化成	18.3	22.4	13,664
太陽ホールディングス	11.1	13.7	51,923
D I C	57.3	75	267,000
サカタインクス	29.6	36.2	45,213
東洋インキSCホールディングス	143	35	92,925
T&K TOKA	9.7	12.8	13,017
富士フイルムホールディングス	287.7	351.6	1,769,602
資生堂	258	336.4	2,440,245
ライオン	192.9	235.8	526,305
高砂香料工業	8.7	11.7	42,295
マンダム	27	38.1	104,013
ミルボン	18.5	20.9	110,979
ファンケル	33.6	75.4	187,519
コーセー	23.5	28.7	533,533
コタ	6	8.1	11,947
シーズ・ホールディングス	18.8	5.1	29,988
シーボン	1.7	2	5,320
ポーラ・オルビスホールディングス	59.1	72.3	243,289
ノエビアホールディングス	8.8	10.8	57,348
アジューバンコスメジャパン	3.1	3.8	3,712
エステー	9.9	12.1	22,905
アグロ カネショウ	5.6	6.9	14,407
コニシ	22.8	30	51,300
長谷川香料	18.4	20.2	35,208
星光PMC	7.9	11.3	9,458
小林製薬	38.8	47.4	422,334
荒川化学工業	12.4	15.2	20,641
メック	9.5	11.6	13,282
日本高純度化学	3.8	4.6	10,805
タカラバイオ	36.2	44.3	104,813
J C U	8.5	21.9	40,821
新田ゼラチン	9.5	10.6	7,335
OATアグリオ	2.1	2.3	4,066
デクセリアルズ	35.5	43.6	34,356
アース製薬	10.4	12.8	62,848
北興化学工業	14.2	17.3	9,584

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大成ラミック	4.2	5.6	16,105
クミアイ化学工業	63	70	50,190
日本農薬	36.1	40.5	19,845
アキレス	10.5	12.3	25,657
有沢製作所	23.2	26.6	21,945
日東電工	104.6	127.9	769,446
レック	8.2	18.1	30,570
三光合成	—	14.5	5,423
きもと	23.6	28.8	5,529
藤森工業	11.6	15.2	46,132
前澤化成工業	9.5	11.6	11,971
未来工業	—	9.1	21,830
ウェーブロックホールディングス	—	3.5	2,936
J S P	8.1	9.9	24,334
エフビコ	11.4	14	90,020
天馬	10.8	11.7	23,774
信越ポリマー	28.4	30.4	25,201
東リ	34.5	42.1	11,324
ニフコ	25.4	67.8	189,975
バルカー	11.3	13.8	31,781
ユニ・チャーム	293.7	358.9	1,259,380
医薬品 (5.4%)			
協和発酵キリン	173.5	212.1	455,802
武田薬品工業	510.2	1,073.1	4,837,534
アステラス製薬	1,423.4	1,560.8	2,636,971
大日本住友製薬	102.7	125.5	336,465
塩野義製薬	198.2	221.5	1,540,311
田辺三菱製薬	169	177	288,510
わかもと製薬	16	20.1	5,708
あすか製薬	15.8	20.9	25,560
日本新薬	36.3	44.3	310,100
バイオフェルミン製薬	2.4	2.9	6,933
中外製薬	144.4	176.5	1,249,620
科研製薬	25	30.6	164,628
エーザイ	165.8	202.6	1,774,776
ロート製薬	76.1	86.8	262,570
小野薬品工業	327.1	399.8	908,945
久光製薬	40.9	50	282,000
持田製薬	9.7	12.8	143,232
参天製薬	262.2	320.9	500,283

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
扶桑薬品工業	4.9	6	14,934
日本ケミファ	1.8	2.2	6,450
ツムラ	49.5	52.4	185,758
日医工	36.5	43.5	69,556
キッセイ薬品工業	25.7	30	87,960
生化学工業	26.9	32.8	42,935
栄研化学	11.2	29.7	75,141
日水製薬	5.8	7.1	8,392
鳥居薬品	8.7	9.1	20,538
J C R ファーマ	9.8	11.9	68,425
東和薬品	6.6	8.1	71,442
富士製薬工業	4.7	11.5	20,585
沢井製薬	27.8	34.7	205,077
ゼリア新薬工業	29.7	33.5	64,286
第一三共	396.4	484.4	1,839,751
キョーリン製薬ホールディングス	38.7	37.4	84,411
大幸薬品	7.3	7.5	13,635
ダイト	8.1	9.9	27,967
大塚ホールディングス	287.9	322.5	1,434,157
大正製薬ホールディングス	31	37.9	430,544
ペプチドリーム	62	84.4	424,532
石油・石炭製品 (0.7%)			
日本コークス工業	117	143	14,300
昭和シェル石油	129.6	156.7	270,464
ニチレキ	17.7	21.6	24,688
ユシロ化学工業	7.8	8.8	11,545
ビービー・カストロール	5.9	6	8,226
富士石油	33.6	41.1	11,795
MORESCO	5	6.1	9,936
出光興産	116.3	131.2	536,608
J X T Gホールディングス	2,210.5	2,847.3	1,634,065
コスモエネルギーホールディングス	40.1	49	120,834
ゴム製品 (0.8%)			
横浜ゴム	80.2	98	229,810
TOYO TIRE	82	86.9	133,043
ブリヂストン	489.5	520.3	2,290,360
住友ゴム工業	142.6	152.1	217,046
藤倉ゴム工業	12.1	14.8	6,482
オカモト	48	11.8	69,384
フコク	6.1	7.4	6,423

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニッタ	14.3	19.1	72,771
住友理工	26.8	32.8	35,096
三ツ星ベルト	34	22.3	48,970
バンドー化学	26.4	32.3	38,598
<b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b>			
日東紡績	20.6	25.2	49,870
A G C	141.6	167.4	657,045
日本板硝子	70	80.9	79,282
石塚硝子	1.9	2.7	4,779
日本山村硝子	58	7	10,535
日本電気硝子	59.9	73.2	217,696
オハラ	5.5	6.7	11,818
住友大阪セメント	269	34.2	162,279
太平洋セメント	87.5	106.9	398,202
日本ヒューム	13.9	17	13,821
日本コンクリート工業	29.8	36.4	10,228
三谷セキサン	7.3	7.9	22,064
アジアパイルホールディングス	17.8	24	15,264
東海カーボン	125.8	153.7	235,775
日本カーボン	7.1	8.1	43,092
東洋炭素	9	9.9	21,007
ノリタケカンパニーリミテド	8.2	10.1	52,217
T O T O	106.5	130.2	565,068
日本碍子	169	206.6	345,022
日本特殊陶業	118.8	142.7	337,342
ダントーホールディングス	10	14.2	1,633
MARUWA	4.8	5.9	37,878
品川リフラクトリーズ	3.6	4.5	15,075
黒崎播磨	2.7	3.4	19,516
ヨータイ	8.3	14.8	8,924
イソライト工業	7.1	8.7	5,098
東京窯業	17.6	21.5	8,342
ニッカトー	4.7	7.7	7,815
フジミインコーポレーテッド	12.3	15.1	35,349
クニミネ工業	—	5.7	4,685
エーアンドエーマテリアル	3	3.3	3,620
ニチアス	76	46.3	95,239
ニチハ	20.9	23.5	72,262
<b>鉄鋼 (1.0%)</b>			
新日鐵住金	613	777.9	1,601,696

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
神戸製鋼所	250.7	306.4	270,244
中山製鋼所	19	23.2	11,252
合同製鐵	7.4	8.1	14,434
ジェイ エフ イー ホールディングス	369.9	452.1	878,882
日新製鋼	37.8	—	—
東京製鐵	73.3	89.6	80,102
共英製鋼	15.4	18.9	31,392
大和工業	29.1	35.6	108,046
東京鐵鋼	5.6	6.9	8,045
大阪製鐵	9.1	11.1	20,290
淀川製鋼所	20	22.6	50,420
東洋鋼板	34.7	—	—
丸一鋼管	48.5	59.3	194,504
モリ工業	4.5	5	12,735
大同特殊鋼	24.3	27.4	125,903
日本高周波鋼業	5.1	6.2	3,304
日本冶金工業	113.3	138.5	33,378
山陽特殊製鋼	15.8	21.1	52,454
愛知製鋼	7.7	9.4	33,088
日立金属	147.6	180.3	199,952
日本金属	3.5	3.9	5,019
大平洋金属	8.4	11.3	32,001
新日本電工	82	100.3	23,771
栗本鐵工所	6.9	8.5	12,784
虹技	2	2.5	3,457
日本鑄鉄管	14	1.7	1,468
三菱製鋼	10.1	12.4	20,608
日亜鋼業	20	24.5	7,913
日本精練	2.2	2.4	8,184
エンビプロ・ホールディングス	—	4.7	2,552
シンニッタン	10.6	26	8,866
新家工業	3.1	3.8	6,167
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>			
大紀アルミニウム工業所	22.5	27.5	17,160
日本軽金属ホールディングス	399.9	456.1	111,288
三井金属鉱業	37	45.2	120,186
東邦亜鉛	7.6	9.3	29,434
三菱マテリアル	90.5	110.6	339,542
住友金属鉱山	175.1	229.3	695,925
DOWAホールディングス	34.7	39.1	137,241

野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
古河機械金属	22.6	27.6	40,351
大阪チタニウムテクノロジーズ	14.2	19.3	36,071
東邦チタニウム	24.5	30	29,370
U A C J	20.8	25.4	55,880
C Kサンエツ	—	3.1	9,408
古河電気工業	45.6	48.3	171,948
住友電気工業	512.1	625.9	957,627
フジクラ	165.4	202.1	99,029
昭和電線ホールディングス	17.2	19.4	13,774
東京特殊電線	1.8	2.1	4,242
タツタ電線	27.2	33.2	17,330
沖電線	0.5	—	—
カナレ電気	2.3	2.8	5,042
平河ヒューテック	6.8	6.9	11,260
リョービ	16.8	20.6	54,940
アーレスティ	16.8	20.6	14,729
アサヒホールディングス	23.5	31.4	68,263
<b>金属製品 (0.6%)</b>			
稲葉製作所	7.7	9.4	11,919
宮地エンジニアリンググループ	3.9	5.1	10,557
トーカロ	9.5	43.2	40,996
アルファC o	4.8	5.9	8,142
SUMCO	126.1	185	294,150
川田テクノロジーズ	2.8	3.7	25,123
R S T e c h n o l o g i e s	1.9	3.4	10,812
東洋製織グループホールディングス	93.6	106.6	236,971
ホッカンホールディングス	35	8.5	15,206
コロナ	7.6	9.3	9,885
横河ブリッジホールディングス	25.5	31.1	60,987
駒井ハルテック	3	3.1	5,902
高田機工	1.3	1.5	4,083
三和ホールディングス	131.4	172.9	223,559
文化シャッター	40.4	49.3	39,587
三協立山	19	23.2	33,060
アルインコ	10	13.3	13,180
東洋シャッター	3.6	4	2,816
L I X I Lグループ	201.9	247	396,929
日本ファイルコン	10.5	12.8	7,104
ノーリツ	30.6	37.4	61,897
長府製作所	15.5	17	38,046

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リンナイ	24.4	29.8	223,500
ダイニチ工業	7.4	9	6,687
日東精工	18.9	23.1	12,705
三洋工業	1.7	2.2	4,177
岡部	27.8	33.9	32,408
ジーテクト	15.1	18.5	32,967
中国工業	2.1	2.5	1,412
東ブレ	25.6	31.2	75,067
高周波熱練	26.4	32.2	28,915
東京製鋼	9.8	10.3	10,845
サンコール	7.7	9.4	6,504
モリテック スチール	8	13	5,733
パイオラックス	20.3	26.8	64,775
エイチワン	10.1	16.4	18,597
日本発條	136.4	166.8	176,808
中央発條	1.6	2	5,850
アドパネクス	2.1	2.2	3,513
立川ブラインド工業	6	7.4	8,709
三益半導体工業	10.7	14.9	22,305
<b>機械 (4.9%)</b>			
日本ドライケミカル	1.9	4.5	5,544
日本製鋼所	44.7	50.8	104,698
三浦工業	59.3	72.4	186,574
タクマ	46.4	61.1	90,061
ツガミ	36	37.6	28,312
オークマ	16	21.3	128,439
東芝機械	77	18.9	43,866
アマダホールディングス	211.4	258.3	304,794
アイダエンジニアリング	34.8	46.4	38,372
滝澤鉄工所	4.2	5.2	8,990
F U J I	41	50.1	77,755
牧野フライス製作所	68	19.6	87,612
オーエスジー	63.1	82.5	186,862
ダイジェット工業	1.7	1.9	3,104
旭ダイヤモンド工業	40.7	43.9	34,461
DMG森精機	75.8	105.9	161,921
ソディック	29.9	36.5	30,514
ディスコ	18.5	22.7	377,728
日東工器	8.4	9.2	21,270
日進工具	3.6	4.9	12,250

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パンチ工業	11.4	11.6	7,435
富士ダイス	5.2	7.4	5,128
豊和工業	7.6	9.2	8,132
OKK	5.3	6.9	6,009
東洋機械金属	10.7	12	7,296
津田駒工業	32	3.6	7,077
エンシュウ	36	4.3	5,344
島精機製作所	17.3	23.1	85,701
オプトラン	10	16.3	35,045
NCホールディングス	4.4	5.4	2,613
フリュー	9.7	13.4	13,909
ヤマシンフィルタ	18.7	29.1	19,904
日阪製作所	19.7	20.6	18,416
やまびこ	26.6	32.5	34,320
平田機工	3.8	7.9	53,720
ベガサスミシン製造	12.8	15.7	10,330
マルマエ	—	4.6	3,367
タツモ	—	5.2	4,087
ナプテスコ	75.3	92.1	289,654
三井海洋開発	14.6	17.8	55,269
レオン自動車	12.2	16.4	26,010
SMC	43.5	49.6	1,946,800
新川	11.2	12.6	6,715
ホソカワミクロン	5.2	5.9	28,585
ユニオンツール	6.3	7.3	22,630
オイレス工業	17.7	23.4	45,559
日精エー・エス・ビー機械	4.6	4.8	19,248
サトーホールディングス	18	20.2	54,459
技研製作所	6.9	11.7	38,376
日本エアテック	4.7	5.3	3,132
カワタ	—	3.4	4,542
日精樹脂工業	11.5	14	13,132
オカダアイヨン	4	5.7	8,470
ワイエイシイホールディングス	4.6	6.7	5,467
小松製作所	668.8	766.5	2,118,989
住友重機械工業	79.3	96.9	368,704
日立建機	64.8	67.8	195,399
日工	3.8	4.6	10,248
巴工業	5.9	7.2	17,301
井関農機	13.8	16.9	28,459

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
TOWA	10.8	14.5	10,251
丸山製作所	3	3.7	4,847
北川鉄工所	6.6	7.6	18,528
ローツエ	6.8	7.4	13,186
タカキタ	4.8	5.9	3,640
クボタ	742.9	906.9	1,389,824
荏原実業	4	4.9	10,750
三菱化工機	4.8	5.8	9,042
月島機械	27.5	33.6	47,443
帝国電機製作所	9.6	11.8	14,632
東京機械製作所	5.4	6.6	2,725
新東工業	32.9	40.2	40,883
澁谷工業	12.1	14.8	49,062
アイチ コーポレーション	23.9	29.2	20,907
小森コーポレーション	34.8	45.8	54,044
鶴見製作所	11.7	13.2	23,799
住友精密工業	23	2.8	8,100
酒井重工業	2.6	3.2	7,702
荏原製作所	56.9	75	237,750
石井鐵工所	2.1	2.6	4,703
西島製作所	14.1	17.3	16,538
北越工業	15.6	17.4	20,810
ダイキン工業	189.1	231.1	2,793,999
オルガノ	5	6.1	18,849
トーヨーカネツ	5.8	6.4	15,436
栗田工業	75	91.6	272,876
椿本チエイン	82	22.1	91,162
大同工業	5.3	8	7,360
木村化工機	11.5	14.1	5,372
アネスト岩田	23.3	26.3	28,062
ダイフク	70.5	93.2	539,628
サムコ	3.8	4.6	4,383
加藤製作所	6.6	8.6	23,056
油研工業	2.7	2.8	5,367
タダノ	66.8	81.7	98,693
フジテック	44.4	61.5	74,599
CKD	38.5	47.1	51,527
キトー	10.5	12.8	24,064
平和	42.9	47.2	104,359
理想科学工業	13.8	14.9	27,907

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SANKYO	34.7	42.4	172,568
日本金銭機械	12.8	18.7	20,457
マースグループホールディングス	8.8	10.7	23,229
福島工業	8.5	10.4	40,820
オーイズミ	5.8	7.1	2,527
ダイコク電機	6.4	7.8	11,684
竹内製作所	23.2	28.3	57,477
アマノ	42.9	48.3	116,451
JUKI	20.6	23.6	30,727
サンデンホールディングス	16.9	20.7	17,615
蛇の目ミシン工業	12.6	15.4	7,530
マックス	21.3	26	38,454
グローリー	41.3	46.9	126,630
新晃工業	14	15.7	24,209
大和冷機工業	22.2	24.5	30,576
セガサミーホールディングス	137.4	167.9	216,758
日本ビストンリング	5	6.2	10,695
リケン	6.4	7.8	40,482
TPR	15.5	22.8	56,293
ツバキ・ナカシマ	13.9	25.6	49,484
ホシザキ	43.6	49.5	363,825
大豊工業	11.3	13.8	14,462
日本精工	284.5	347.7	366,823
NTN	320.6	363.8	128,421
ジェイテクト	147.6	162.4	229,471
不二越	129	15.7	70,179
日本トムソン	44.3	50.2	29,316
THK	86.3	105.5	303,101
ユースン精機	6.1	13.1	13,794
前澤給装工業	5.4	6.6	12,401
イーグル工業	17.1	20.9	27,399
前澤工業	10.1	11.3	4,045
日本ビラー工業	14	17.1	24,367
キッツ	61.7	68.6	60,436
マキタ	180.6	206	829,150
日立造船	109.8	134.2	48,043
三菱重工業	232.1	283.7	1,221,895
IHI	106.4	130.1	426,728
スター精密	22.2	28.9	48,002

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>電気機器 (13.1%)</b>			
日清紡ホールディングス	84.6	94	89,864
イビデン	84.8	103.6	162,341
コニカミノルタ	324.2	369.9	399,122
ブラザー工業	169.1	220.5	468,562
ミネベアミツミ	257.1	314.2	569,016
日立製作所	3,326	762.1	2,676,495
三菱電機	1,385	1,692.8	2,445,249
富士電機	417	109.9	378,056
東洋電機製造	5.4	6.7	8,897
安川電機	160.6	196.2	640,593
シンフォニアテクノロジー	90	23.5	33,346
明電舎	117	33.5	54,873
オリジン電気	4	4.6	10,630
山洋電気	6.7	8.2	33,743
デンヨー	12.8	15.6	22,245
東芝テック	99	21.2	62,709
芝浦メカトロニクス	20	3	10,455
マブチモーター	38.6	46.8	180,882
日本電産	166.7	203.7	2,758,098
ユニー・エム・シー・エレクトロニクス	5	9.1	16,780
トレックス・セミコンダクター	—	5.7	6,566
東光高岳	7	8.6	12,315
ダブル・スコープ	20.1	24.7	32,455
ダイヘン	76	18.5	51,892
田淵電機	19.2	—	—
ヤーマン	20.1	24.5	33,271
JVCケンウッド	101.6	129.3	34,393
ミマキエンジニアリング	12.4	15.2	12,008
第一精工	6.5	7	8,001
日新電機	32.5	39.7	40,732
大崎電気工業	29.7	33.7	24,162
オムロン	147.2	179.9	887,806
日東工業	22.2	27.1	61,462
IDEC	17.1	22.7	47,011
正興電機製作所	—	3	2,484
不二電機工業	1.5	1.8	2,329
ジーエス・ユアサ コーポレーション	249	60.9	138,121
サクサホールディングス	3.5	4.3	7,933
メルコホールディングス	6.7	7	28,070



## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
テクノメディア	3.4	3.8	8,071	
日本電気	179.2	219	819,060	
富士通	1,424	1,263.2	1,263,331	
沖電気工業	56.3	73.3	95,583	
岩崎通信機	6.1	7.9	6,383	
電気興業	7.9	8.9	23,682	
サンケン電気	81	19.8	45,025	
ナカヨ	2.7	3.3	4,596	
アイホン	7.8	9.6	16,780	
ルネサスエレクトロニクス	71.7	175.4	126,814	
セイコーエプソン	206.2	210	351,750	
ワコム	107.4	122.5	60,392	
アルバック	31.8	33.7	108,682	
アクセル	5.8	7.1	3,677	
E I Z O	12.7	15.5	73,547	
ジャパンディスプレイ	284.5	400.2	29,214	
日本信号	38.2	43.1	42,755	
京三製作所	32	36.3	14,774	
能美防災	18.3	22.4	45,628	
ホーチキ	10	10.7	11,984	
星和電機	—	6.8	2,808	
エレコム	12	15.6	52,338	
パナソニック	1,582.3	1,933.9	2,015,123	
シャープ	96.4	167.9	222,467	
アンリツ	101	108.9	239,688	
富士通ゼネラル	42.3	51.7	76,826	
日立国際電気	22.6	—	—	
ソニー	925.2	1,135.3	5,767,324	
TDK	72.4	88.5	781,455	
帝国通信工業	6.1	7.5	9,195	
タムラ製作所	53.4	65.3	39,702	
アルプスアルパイン	119.3	176.2	413,365	
池上通信機	44	5.4	6,431	
パイオニア	230.8	282.1	18,618	
日本電波工業	12.5	15.3	5,706	
鈴木	5.9	9.1	5,933	
日本トリム	3	3.2	17,824	
ローランド ディー・ジー	7.1	8.6	19,874	
フォスター電機	16.2	19.8	32,392	
クラリオン	73	14.9	37,250	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
SMK	35	4.7	12,633	
ヨコオ	9	12.1	19,747	
ティアック	100	12.2	2,464	
ホシデン	34.9	49.8	45,666	
ヒロセ電機	22.4	24.3	291,357	
日本航空電子工業	36	38.8	58,161	
T O A	14.9	18.2	19,364	
マクセルホールディングス	27.5	36.4	61,006	
古野電気	16.5	21.8	20,579	
ユニデンホールディングス	38	5	11,750	
アルパイン	33	—	—	
スミタコーポレーション	14.2	14.4	21,556	
アイコム	7.7	9.4	20,445	
リオン	5.8	7.8	14,890	
本多通信工業	10.8	14.5	8,062	
船井電機	14	17.1	12,294	
横河電機	138.6	169.4	362,854	
新電元工業	4.9	6	28,020	
アズビル	41.5	109.3	266,254	
東亜ディーケーケー	6.8	8.4	6,938	
日本光電工業	57.9	74.6	258,862	
チノー	4.8	5.8	7,522	
共和電業	15.7	17.7	6,549	
日本電子材料	5.5	6.7	4,844	
堀場製作所	27.4	33.5	203,010	
アドバンテスト	77.2	115.4	312,849	
小野測器	5.9	7.9	4,826	
エスベック	12.3	15	30,930	
キーエンス	68	83.1	5,193,750	
日置電機	7.2	8.8	39,952	
シスメックス	107.8	131.9	879,773	
日本マイクロニクス	24.1	27.3	22,631	
メガチップス	10.9	13.3	30,337	
OBARA GROUP	8.1	9.9	40,540	
澤藤電機	1.5	2	3,196	
原田工業	—	5.1	4,921	
コーセル	19.2	21.5	25,133	
イリソ電子工業	11.6	15.5	76,647	
新日本無線	8.4	—	—	
オブテックスグループ	11.3	29.7	66,528	

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
千代田インテグレ	6.7	7.1	15,215	
アイ・オー・データ機器	5.7	6.2	7,483	
レーザーテック	28.4	34.7	150,771	
スタンレー電気	106	119.7	391,419	
岩崎電気	5.4	6.6	9,075	
ウシオ電機	84.1	102.7	134,947	
岡谷電機産業	7.4	12	4,560	
ヘリオス テクノ ホールディング	11.8	15.6	11,044	
エノモト	—	3.5	3,118	
日本セラミック	14.1	17.2	47,145	
遠藤照明	7	8.5	6,196	
古河電池	9.9	12.1	8,905	
双信電機	6	8.2	3,657	
山一電機	10	12.3	14,981	
図研	9	11	17,897	
日本電子	50	33.4	59,251	
カシオ計算機	111.4	149.7	230,088	
ファナック	131.6	160.9	3,121,460	
日本シイエムケイ	24.4	43.1	30,730	
エンブラス	6.3	7.7	23,870	
大真空	5.1	6.2	5,617	
ローム	62.2	81.8	635,586	
浜松ホトニクス	100.9	121.4	495,312	
三井ハイテック	18.3	18.7	19,784	
新光電気工業	52.3	56.8	48,848	
京セラ	227.3	258	1,611,468	
太陽誘電	62.2	75.3	179,515	
村田製作所	145.3	177.6	3,069,816	
ユーシン	20.8	26.6	26,147	
双葉電子工業	22.6	27.7	48,779	
北陸電気工業	5.6	6.3	6,696	
ニチコン	43.6	53.3	54,152	
日本ケミコン	11.2	12	25,944	
KOA	19.1	25.5	41,616	
市光工業	20.7	25.3	16,951	
小糸製作所	83	101.4	680,394	
ミツバ	25.5	31.1	22,547	
SCREENホールディングス	26.2	29.4	139,650	
キャノン電子	12.7	15.5	29,000	
キャノン	745.6	911.3	2,914,337	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
リコー	416.4	509	568,044	
象印マホービン	—	31.5	37,138	
MUTOHホールディングス	1.9	2.3	4,199	
東京エレクトロン	92.4	112.9	1,794,545	
輸送用機器 (8.1%)				
トヨタ紡織	40.4	59.2	108,040	
芦森工業	2.9	3.5	6,016	
ユニプレス	26.8	32.8	67,797	
豊田自動織機	112.1	137	765,830	
モリタホールディングス	22.2	29.6	53,783	
三櫻工業	17.6	21.5	12,298	
デンソー	307.3	372.7	1,789,332	
東海理化電機製作所	36.5	44.6	89,958	
三井E&Sホールディングス	50	61.1	73,992	
川崎重工業	107.8	131.7	376,003	
名村造船所	41.6	50.8	22,555	
サノヤスホールディングス	16.8	22.3	4,014	
日本車輛製造	50	6.2	16,120	
三菱ロジスネクスト	16.5	20.1	27,918	
近畿車輛	2.1	2.5	5,122	
日産自動車	1,633.5	1,996.5	1,892,881	
いすゞ自動車	401.3	535.1	844,922	
トヨタ自動車	1,683.8	1,886.4	12,553,992	
日野自動車	197.7	211.4	218,164	
三菱自動車工業	512.7	626.6	401,024	
エフテック	8.9	11.8	12,283	
レシップホールディングス	5	6.1	4,446	
GMB	2.2	3.3	3,118	
ファルテック	2.4	3	2,658	
武蔵精密工業	14.8	41.1	63,828	
日産車体	54.1	33.1	32,934	
新明和工業	60.2	76	105,488	
極東開発工業	25.7	33.7	51,493	
日信工業	28.1	31	49,104	
トビー工業	11.4	13.9	33,332	
ティアド	5	6.1	14,219	
曙ブレーキ工業	64.3	—	—	
タチエス	23.5	28.7	47,699	
NOK	74.5	91	165,984	
フタバ産業	42.4	47.1	28,683	

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
K Y B	14.4	17.6	55,176
大同メタル工業	17.4	27.5	21,890
プレス工業	73.5	83.9	52,940
ミクニ	17.6	21.5	10,814
太平洋工業	29	35.4	59,224
ケーヒン	31.8	38.9	75,893
河西工業	17	20.8	18,304
アイシン精機	114	139.4	608,481
マツダ	434.7	531.3	681,923
今仙電機製作所	12.8	15.7	16,343
本田技研工業	1,246.3	1,428	4,288,284
スズキ	274.5	309.7	1,777,058
S U B A R U	430	525.5	1,499,251
安永	6.7	8.2	12,906
ヤマハ発動機	195.6	239.1	533,432
ショーワ	36	40	61,600
T B K	16.4	20.1	8,401
エクセディ	16.7	23	62,537
豊田合成	50.3	54.7	133,468
愛三工業	24.3	26.5	20,060
盟和産業	2.1	2.6	2,782
日本プラスト	5.6	13.3	11,132
ヨロズ	14	15.8	26,528
エフ・シー・シー	22.6	30.4	79,982
シマノ	55.8	68.2	1,148,488
ティ・エス テック	32.2	39.3	131,655
ジャムコ	6.9	8.5	21,921
精密機器（2.0%）			
テルモ	212.3	239.5	1,604,410
クリエートメディック	4.6	5.6	5,672
日機装	47.9	54.7	62,303
島津製作所	165.5	217.8	604,177
J M S	12.8	15.6	10,280
クボテック	3	3.6	1,296
長野計器	10.9	13.3	10,520
ブイ・テクノロジー	3.2	4	58,880
東京計器	8.8	10.8	11,674
愛知時計電機	1.8	2.2	8,393
インターアクション	5.5	7.9	14,306
オーバル	13.5	16.5	4,075

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京精密	25	30.6	94,554
マニー	16.9	20.6	102,691
ニコン	241.3	295	517,430
トプコン	74.4	90.9	139,349
オリンパス	206.3	252.2	1,204,255
理研計器	13.2	14.9	33,465
タムロン	11.2	15	30,225
HOYA	282	340.8	2,314,032
シード	1.5	7.2	9,223
ノーリツ鋼機	14	13.3	28,608
エー・アンド・デイ	12.6	15.4	11,503
朝日インテック	—	71.8	390,592
シチズン時計	165.3	185.2	116,861
リズム時計工業	5.2	5.7	9,399
大研医器	12.3	13.4	7,906
メニコン	19	23.2	68,416
シンシア	1.1	2.5	1,185
松風	6.8	8.3	10,557
セイコーホールディングス	21.4	26.1	67,077
ニプロ	95.9	117.1	174,127
その他製品 (2.0%)			
中本パックス	1.3	4.7	7,919
スノーピーク	4.2	6.5	8,801
パラマウントベッドホールディングス	14.6	19.5	99,840
トランザクション	6.2	9.2	6,486
SHO-BI	4.6	4.9	1,768
ニホンフラッシュ	6.5	7.2	14,817
前田工織	13.9	18.6	52,247
永大産業	18	22.1	9,878
アートネイチャー	14.8	18.1	11,439
バンダイナムコホールディングス	143.2	175	847,875
アイフィスジャパン	3.1	3.8	2,242
共立印刷	23	28.1	6,378
SHOEI	6.2	8.1	33,696
フランスベッドホールディングス	16.4	23.9	20,984
パイロットコーポレーション	24.2	29.5	155,465
萩原工業	7.7	9.4	16,280
トッパン・フォームズ	29.7	36.3	35,174
フジシールインターナショナル	31	37.9	156,906
タカラトミー	58	70.9	79,195

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
廣済堂	12.9	15.7	11,131
エステールホールディングス	4.1	4.5	3,046
アーク	58.3	64.6	6,137
タカノ	6.1	6.6	5,550
プロネクサス	12.9	14.5	17,835
ホクシン	9.8	10.4	1,487
ウッドワン	4.7	5.7	6,458
大建工業	10.8	12.8	25,113
凸版印刷	391	238.9	416,880
大日本印刷	181.3	238.6	601,272
図書印刷	9.3	15.9	14,946
共同印刷	4.3	5.2	13,228
N I S S H A	28.4	34.7	49,586
光村印刷	1.2	1.5	3,285
宝印刷	7.2	8.2	13,587
アシックス	137.6	168.1	255,343
ツツミ	4.3	5.3	10,441
小松ウオール工業	4.7	5.2	9,869
ヤマハ	93.3	100.7	532,703
河合楽器製作所	4.7	5.2	17,186
クリナップ	12.9	15.7	9,796
ビジョン	83.7	102.3	486,436
兼松サステック	1.1	1.1	1,729
キングジム	11.5	14.1	11,519
リンテック	32.9	40.2	101,545
イトーキ	29.2	31.2	18,252
任天堂	85.3	104.2	3,092,135
三菱鉛筆	22.8	27.9	64,114
タカラスタンダード	28.6	35	60,165
コクヨ	66.4	81.2	130,569
ナカバヤシ	13.6	16.6	8,930
グローブライド	6.2	8.2	23,263
オカムラ	48.3	59.1	79,371
美津濃	13.7	16.8	43,713
<b>電気・ガス業 (1.9%)</b>			
東京電力ホールディングス	1,105.7	1,351.4	883,815
中部電力	423.7	517.9	884,314
関西電力	565.2	690.7	1,101,666
中国電力	191.5	234	343,980
北陸電力	135.7	165.8	147,893

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東北電力	324.4	396.5	571,356
四国電力	124.7	152.4	220,980
九州電力	305.9	348.9	460,548
北海道電力	138.9	158.4	127,512
沖縄電力	22.4	31.3	64,571
電源開発	110.2	134.7	376,755
エフオン	6.9	8	6,872
イーレックス	21.8	29.4	23,255
レノバ	—	20.7	21,279
東京瓦斯	295.5	332.1	991,318
大阪瓦斯	268.8	328.5	725,656
東邦瓦斯	68.6	83.8	402,659
北海道瓦斯	37	9.1	13,213
広島ガス	28.5	34.8	12,040
西部瓦斯	16.8	19.1	47,654
静岡ガス	39.3	52.1	46,890
メタウォーター	7.8	8.2	25,707
<b>陸運業 (4.8%)</b>			
S B Sホールディングス	13.7	16.7	32,949
東武鉄道	148	178.5	551,565
相鉄ホールディングス	44.3	58	189,080
東京急行電鉄	376.2	459.8	832,238
京浜急行電鉄	189.7	231.9	420,666
小田急電鉄	206	271.1	666,092
京王電鉄	77.4	94.6	591,250
京成電鉄	96.4	126.9	471,433
富士急行	18.9	23.1	90,667
新京成電鉄	3.6	4.3	9,025
東日本旅客鉄道	248.8	301	3,124,380
西日本旅客鉄道	125	151.7	1,225,584
東海旅客鉄道	124	151.6	3,650,528
西武ホールディングス	176.5	215.8	424,047
鴻池運輸	19.6	26.9	47,693
西日本鉄道	38.4	46.9	125,551
ハマキョウレックス	9.8	13	54,470
サカイ引越センター	7.3	8.9	57,761
近鉄グループホールディングス	131.2	160.3	779,058
阪急阪神ホールディングス	175	213.8	862,683
南海電気鉄道	62.2	71.5	210,639
京阪ホールディングス	58.4	71.4	324,156

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
神戸電鉄	3.1	4.1	16,174
名古屋鉄道	101.8	128.4	387,126
山陽電気鉄道	10.1	12.3	26,912
日本通運	51.5	62.9	420,801
ヤマトホールディングス	230	281	828,388
山九	33.7	44.6	241,286
丸運	7.5	9.1	2,811
丸全昭和運輸	46	13	36,348
センコーグループホールディングス	78.9	88.4	80,797
トナミホールディングス	3.1	3.8	24,776
ニッコンホールディングス	49.9	61	173,789
日本石油輸送	1.6	1.9	5,553
福山通運	19.2	20.5	89,995
セイノーホールディングス	98.2	120.1	185,794
エスライン	—	4.8	5,544
神奈川中央交通	3.3	4	14,860
日立物流	28.8	35.2	112,464
丸和運輸機関	6.9	8.4	29,694
C&F ロジホールディングス	14.4	16.2	20,606
九州旅客鉄道	110.1	134.5	497,650
S Gホールディングス	92.9	151.5	466,620
<b>海運業 (0.2%)</b>			
日本郵船	109.7	134.1	240,977
商船三井	83	95.1	250,493
川崎汽船	60.6	49.4	79,040
N Sユナイテッド海運	6.2	8.8	23,267
明治海運	13.9	17	5,950
飯野海運	66.9	75.9	30,739
共栄タンカー	1	1.4	2,157
乾汽船	10.1	14.4	10,324
<b>空運業 (0.6%)</b>			
日本航空	243.4	293.5	1,185,740
A N Aホールディングス	257.1	293.1	1,199,365
バスコ	13	3.1	2,855
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
トランコム	3.7	4.5	30,960
日新	11.3	13.9	27,313
三菱倉庫	45.4	55.5	151,182
三井倉庫ホールディングス	75	19.6	39,043
住友倉庫	91	60.3	87,133

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
澁澤倉庫	7.2	8.8	14,220
東陽倉庫	23.7	28.9	9,276
日本トランスシティ	32	35.3	15,496
ケイヒン	2.5	3.1	4,274
中央倉庫	8	9.8	10,280
川西倉庫	2.7	3.3	4,042
安田倉庫	11.8	13.2	12,012
ファイズ	—	2.1	1,747
東洋埠頭	4	4.9	7,247
宇徳	11.2	13.7	7,439
上組	82.6	98.9	251,799
サンリツ	3.4	3.8	2,667
キムラユニティー	3.5	4.3	4,781
キューソー流通システム	3.8	4	8,080
近鉄エクスプレス	24.8	30.3	55,539
東海運	7.5	9.1	2,538
エーアイテイー	9.3	10.4	11,169
内外トランスライン	4.6	5.1	7,650
日本コンセプト	2.5	4.4	4,677
<b>情報・通信業 (8.3%)</b>			
N E C ネットエスアイ	15	18.3	45,658
クロスキャット	—	3.3	3,319
システナ	10.9	59.2	67,014
デジタルアーツ	6.7	8.9	75,917
新日鉄住金ソリューションズ	21.4	24.9	75,198
キューブシステム	7.9	8.8	7,858
エイジア	2.1	3.2	4,323
コア	5.7	7	9,632
ソリトンシステムズ	4.5	9.3	9,346
ソフトクリエイティブホールディングス	6.5	7.2	10,764
T I S	45.3	55.4	290,296
ネオス	4	6.1	5,941
電算システム	4.7	6.3	15,353
グリー	72.8	114.6	53,518
コーエーテクモホールディングス	23.2	34	62,832
三菱総合研究所	5.8	6.5	21,450
ボルテージ	2.7	3	1,764
電算	1.5	1.8	3,913
A G S	7.6	9.4	6,542
ファインデックス	11.2	14	10,444

野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヒト・コミュニケーションズ	3.1	3.8	6,216
ブレインパッド	2.9	3.2	16,160
K L a b	26.3	29.7	24,324
ポルトゥウィン・ビットクルーホールディ	9.8	22	19,668
イーブクイニシアティブジャパン	2.1	2.6	4,030
ネクソン	151.4	423	698,796
アイスタイル	34.1	42.5	27,625
エムアップ	4.5	5.7	12,722
エイチーム	9.3	10.4	19,988
テクノスジャパン	12.3	13.9	10,883
e n i s h	4	5.7	2,679
コロブラ	44.1	47.4	33,464
モバイルクリエイト	11	—	—
オルトプラス	6.6	10.2	3,233
ブロードリーフ	33.7	82.3	46,993
クロス・マーケティンググループ	—	4.6	1,936
デジタルハーツホールディングス	7.2	7.5	10,185
メディアドゥホールディングス	4.4	5.1	11,770
じげん	—	17.6	11,897
ブイキューブ	8.3	8.9	3,515
サイバーリンクス	2.1	2.5	2,445
ディー・エル・イー	8.7	11.8	1,604
フィックスターズ	2.3	15.9	20,383
CARTA HOLDINGS	6.9	8.8	8,958
オブティム	2.3	3.6	14,598
セレス	4.2	5.4	9,768
ベリサープ	1.8	1.6	10,688
ティーガイア	13.6	16.6	32,917
セック	1.3	2.7	9,976
日本アジアグループ	14.3	17.5	6,702
豆蔵ホールディングス	10.1	11.3	11,559
テクマトリックス	7.5	11.7	21,563
プロシップ	1.9	4.8	6,552
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	368.5	400.3	122,892
GMOペイメントゲートウェイ	9.6	27.3	178,269
ザッパラス	6.5	8.6	3,276
システムリサーチ	1.3	2.2	6,655
インターネットイニシアティブ	22.1	27	68,877
さくらインターネット	16.2	19.8	9,761
ヴィンクス	1.4	5.6	6,288

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
GMOクラウド	3	3.7	12,783
SRAホールディングス	7.2	8.8	23,619
M i n o r i ソリューションズ	2.6	3.2	5,171
システムインテグレータ	1.9	4.7	3,341
朝日ネット	12.4	13.5	6,952
e B A S E	2.7	5	8,740
アバント	—	5.9	8,248
アドソル日進	5.2	5.9	9,681
フリービット	9.1	9.8	9,623
コムチュア	6.9	9.3	28,504
サイバーコム	2.4	3	7,353
アステリア	—	8.3	6,930
マークライنز	—	5.7	8,287
メディカル・データ・ビジョン	5.2	14.7	15,317
g u m i	15.6	21.2	12,592
ショーケース・ティービー	2.6	3.6	2,836
モバイルファクトリー	2.5	4.6	7,185
テラスカイ	—	1	3,750
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2.2	7.3	11,212
P C I ホールディングス	2.3	2.9	6,545
パイプドHD	2.1	2.6	2,100
アイビーシー	1.4	2.7	3,199
ネオジャパン	—	3.1	3,211
P R T I M E S	—	1.1	2,565
ランドコンピュータ	—	1.9	2,204
ダブルスタンダード	—	1.1	5,131
オープンドア	5.4	8.2	25,625
マイネット	2.7	5.3	5,973
アカツキ	2.7	5.8	31,204
ベネフィットジャパン	—	0.9	746
U b i c o mホールディングス	1.5	3	3,915
L I N E	41	50.6	206,701
カナミックネットワーク	—	2.5	4,972
ノムラシステムコーポレーション	—	1.3	929
チェンジ	—	2.2	8,030
シンクロ・フード	1.1	7.1	4,970
オークネット	4.3	8.7	8,604
A O I T Y O H o l d i n g s	11.1	18.1	15,312
マクロミル	12.7	29.4	40,542
ビーグリー	—	3.1	2,737

野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オロ	—	1.6	7,352
ソルクシーズ	5.2	7	4,480
フェイス	4.8	6.5	4,855
ハイマックス	1.8	2	3,654
野村総合研究所	90.8	105.6	469,392
サイバネットシステム	11.1	13.6	8,146
C Eホールディングス	3.8	4.4	3,238
日本システム技術	1.6	2.7	3,788
インタージホールディングス	15.6	21.2	18,210
東邦システムサイエンス	4.5	4.9	4,508
ソースネクスト	19.1	64.4	30,912
インフォコム	—	6.8	26,588
F I G	—	14.7	4,836
アルテリア・ネットワークス	—	13.8	17,636
フォーカスシステムズ	7.7	11.1	11,288
クレスコ	3.1	5	17,525
フジ・メディア・ホールディングス	142.3	172.3	283,261
オービック	42.8	57.6	603,072
ジャストシステム	22.1	23.6	60,416
TDCソフト	5.9	14.5	12,818
ヤフー	979.9	1,083	337,896
トレンドマイクロ	66.4	88.5	465,510
インフォメーション・ディベロプメント	4.3	4.7	6,486
日本オラクル	22	33.7	281,395
アルファシステムズ	4.5	5.2	13,837
フューチャー	18.4	22.5	38,857
C A C H o l d i n g s	10.2	11.9	14,434
ソフトバンク・テクノロジー	5.7	7	15,022
トーセ	3.7	4.5	3,613
オービックビジネスコンサルタント	6.9	17	75,055
伊藤忠テクノソリューションズ	31	75.7	201,362
アイティフォー	16.5	20.1	16,803
東計電算	2.4	2.5	7,687
エクスネット	2.1	3	2,568
大塚商会	40.9	89.9	374,433
サイボウズ	18.1	19.4	12,435
ソフトブレイン	10.6	13	6,331
電通国際情報サービス	8.4	10.3	37,131
デジタルガレージ	24.4	32.3	95,026
E Mシステムズ	4.7	13.5	16,861

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ウェザーニューズ	4.6	5.6	16,884
C I J	10.6	13	10,595
東洋ビジネスエンジニアリング	1.4	1.7	3,287
日本エンタープライズ	14	17.1	3,043
WOWOW	6.5	8	23,456
スカラ	10.9	11.6	10,208
I M A G I C A G R O U P	11.5	14	7,182
ネットワンシステムズ	55.5	58.8	150,292
システムソフト	32.2	39.3	3,969
アルゴグラフィックス	6.2	7	33,845
マーベラス	23	25.4	23,063
エイベックス	25.2	28.5	40,441
日本ユニシス	37.7	51.9	148,485
兼松エレクトロニクス	8.6	9	30,195
東京放送ホールディングス	81.9	110.2	218,085
日本テレビホールディングス	124.8	152.5	269,162
朝日放送グループホールディングス	13.5	16.5	12,688
テレビ朝日ホールディングス	37.3	45.6	91,291
スカパー J S A Tホールディングス	103.7	126.8	63,400
テレビ東京ホールディングス	11.1	13.6	34,340
日本BS放送	4.6	5.6	6,008
ビジョン	3.5	5.1	23,562
スマートバリュー	—	3.6	3,088
USEN-NEXT HOLDINGS	3.5	6.3	5,751
ワイヤレスゲート	6.4	7.3	2,985
コネクシオ	9.6	11.8	16,956
日本通信	122.6	143.3	17,625
クロップス	2.9	3	2,028
日本電信電話	975.4	1,136.1	5,252,190
KDD I	1,223.8	1,463.8	3,922,984
ソフトバンク	—	1,320.9	1,756,136
光通信	16.4	19.6	392,000
N T T ドコモ	1,006.1	1,192.7	3,086,707
エムティーアイ	18.3	19.2	12,019
GMOインターネット	49.5	60.5	106,056
アイドママーケティングコミュニケーション	2.2	3.6	1,792
カドカワ	39.6	48.4	53,578
学研ホールディングス	4.6	5.6	27,944
ゼンリン	16.4	33.1	101,948
昭文社	6.3	7.6	3,708

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
インプレスホールディングス	11.2	13.7	2,123
アイネット	7.7	9.4	13,216
松竹	9	11	124,190
東宝	89.4	109.3	436,653
東映	5.1	7	93,450
エヌ・ティ・ティ・データ	422.2	442.3	528,548
ビー・シー・エー	2	2.1	4,237
ビジネスブレイン太田昭和	2.3	2.8	5,782
D T S	14.1	18.6	77,748
スクウェア・エニックス・ホールディングス	63.2	77.3	248,519
シーイーシー	8.1	17.8	40,762
カブコン	29.1	71.2	162,834
アイ・エス・ビー	2.6	3.2	6,396
ジャステック	7.9	9.6	9,312
S C S K	31.4	43.8	212,211
日本システムウエア	4.5	5.5	10,890
アイネス	17.2	21	27,510
T K C	12.6	14	54,180
富士ソフト	18.8	24.8	115,196
N S D	22.3	27.3	66,885
コナミホールディングス	55.5	67.9	306,568
福井コンピュータホールディングス	4	5.4	10,762
J B C Cホールディングス	10.7	13.1	22,139
ミロク情報サービス	12	16.5	45,457
ソフトバンクグループ	615.3	694.2	7,202,325
卸売業（5.0%）			
ハウスイ	1.1	1.3	1,134
高千穂交易	5.2	6.4	6,457
伊藤忠食品	3.4	4.1	19,967
エレマテック	6.4	7.8	14,695
J A L U X	3.8	4.7	12,079
あらた	6.7	9.2	40,388
トーマンデバイス	2	2.5	6,022
東京エレクトロン デバイス	4.9	6	11,184
フィールズ	10.4	14.6	10,731
双日	807.3	920.9	384,936
アルフレッサ ホールディングス	151.6	185.3	573,503
横浜冷凍	32.9	43.6	39,981
神栄	1.9	2.3	1,784
ラサ商事	6	8.8	7,506

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ラクーンホールディングス	8	7.9	5,435	
アルコニックス	14.5	17.7	19,700	
神戸物産	8.8	25.2	90,846	
ベッパーフードサービス	7.3	—	—	
あい ホールディングス	21.9	23.8	46,314	
ディーブイエックス	4.9	6.5	7,449	
ダイワボウホールディングス	11.6	15.2	98,496	
マクニカ・富士エレホールディングス	25.3	46.2	71,887	
ラクト・ジャパン	1.9	3.6	29,844	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	25.7	31.4	34,822	
八洲電機	10.5	12.9	10,745	
メディアスホールディングス	2.5	9.4	6,946	
U K C ホールディングス	8.8	10.7	21,881	
ジューテックホールディングス	3.1	3.8	3,876	
大光	3.1	5.3	3,360	
O C H I ホールディングス	4	4.8	5,812	
T O K A I ホールディングス	72.1	88.1	81,140	
黒谷	—	2.8	1,299	
C o m i n i x	2.1	2.9	2,401	
三洋貿易	7.5	8.4	17,707	
ビューティガレージ	1.8	2.7	4,066	
ウイン・パートナーズ	9.8	10.8	12,420	
ミタチ産業	3.2	5	3,685	
シップヘルスケアホールディングス	28.4	34.7	147,128	
明治電機工業	4.7	5.2	9,438	
デリカフーズホールディングス	2.6	2.9	3,920	
スターティアホールディングス	3.1	3.2	1,910	
コメダホールディングス	25.2	38.5	81,543	
富士興産	5.3	6.4	4,211	
協栄産業	1.6	2	2,974	
小野建	11.9	14.7	23,505	
南陽	—	3.4	7,646	
佐島電機	10	12.3	12,017	
エコートレーディング	3.1	3.8	2,219	
伯東	8.3	11.4	13,987	
コンドーテック	10.8	12.9	13,338	
中山福	7.8	9.6	5,251	
ナガイレーベン	18.1	24.1	56,827	
三菱食品	15	18.3	53,289	
松田産業	9.9	12.2	17,287	



## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第一興商	20.3	24.8	137,392
メディアバルホールディングス	136.7	179.9	470,438
S P K	2.9	3.6	8,182
萩原電気ホールディングス	4.7	6.2	18,544
アズワン	10.7	12	98,760
スズデン	4.7	5.8	9,645
尾家産業	4	5.4	6,469
シモジマ	8.3	10.2	11,709
ドウシシャ	14.5	15.7	26,595
小津産業	3	3.7	6,919
高速	8.1	9.9	11,484
たけびし	4.8	5.8	8,317
黒田電気	10.2	—	—
リックス	3.1	3.7	6,079
丸文	12.1	14.7	10,760
ハビネット	9.3	13.9	20,516
橋本総業ホールディングス	2.8	3.1	4,569
日本ライフライン	38.9	52.3	89,119
タカショー	—	8.1	3,458
エクセル	5.5	6.2	14,198
マルカキカイ	4.4	5.4	11,491
I D O M	41.4	56.2	21,187
日本エム・ディ・エム	9.1	9.7	10,592
進和	8.1	9.8	21,383
エスケイジャパン	3.3	4	2,692
ダイترون	6.2	7.6	12,448
シークス	8.7	21.2	33,199
田中商事	4.2	5.6	3,449
オーハシテクニカ	7.7	9.4	13,432
白銅	4.9	5.4	8,969
伊藤忠商事	1,001.1	1,166.2	2,355,140
丸紅	1,121	1,644.1	1,325,309
高島	2.4	2.6	4,719
長瀬産業	82.2	93.7	154,323
蝶理	8.7	10.6	17,161
豊田通商	152.3	186.1	664,377
三共生興	23.2	28.4	12,410
兼松	58.1	66.6	85,914
ツカモトコーポレーション	2.5	3	3,087
三井物産	1,158.8	1,373.6	2,441,574

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本紙パルプ商事	7.1	9.5	39,567
日立ハイテクノロジーズ	47.4	50.7	214,968
カメイ	17.8	21.7	26,257
東都水産	2.1	2.3	6,078
O U Gホールディングス	2.2	2.6	6,500
スターゼン	5.3	6.1	24,705
山善	53.3	65.1	76,427
椿本興業	3.1	3.8	14,003
住友商事	860.5	986.1	1,604,877
内田洋行	6.3	7.7	17,864
三菱商事	957.3	1,170	3,733,470
第一実業	6.2	7.6	25,840
キヤノンマーケティングジャパン	39	47.6	99,864
西華産業	8.5	9.4	14,203
佐藤商事	12.2	14.9	13,886
菱洋エレクトロ	12.7	16.9	26,195
東京産業	13.6	16.6	8,997
ユアサ商事	12.9	17	57,885
神鋼商事	3	3.7	9,253
小林産業	9	9.9	2,791
阪和興業	25.5	28.9	93,636
正栄食品工業	7.5	8.8	26,708
カナデン	13	15.9	20,749
菱電商事	9.8	13.2	19,206
フルサト工業	7.5	9.2	15,446
岩谷産業	30.3	37	134,865
すてきなイスグループ	5.8	7.1	6,319
昭光通商	48	5.9	3,717
ニチモウ	2.1	2.6	4,300
極東貿易	20	5.1	8,817
イワキ	19	20	8,180
三愛石油	36.6	44.8	44,128
稲畑産業	32.8	40	62,160
G S I クレオス	3.6	4.4	5,350
明和産業	12.6	15.4	7,068
ワキタ	29.1	35.5	43,097
東邦ホールディングス	40.4	49.4	133,725
サンゲツ	46.1	50.3	105,931
ミツウロコグループホールディングス	19.8	24.2	20,231
シナネンホールディングス	6.5	6.9	15,518

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
伊藤忠エネクス	30.2	36.9	35,018
サンリオ	38.3	51.5	120,510
サンワテクノス	8.1	10.1	9,786
リョーサン	17.2	18.4	56,856
新光商事	15	15.7	30,206
トーホー	6.2	7.5	15,735
三信電気	12.6	13.9	26,326
東陽テクニカ	15.7	19.2	17,241
モスフードサービス	17.9	21.9	59,370
加賀電子	12.3	16.6	35,457
ソーダニッカ	14.1	17.2	9,597
立花エレクトック	9.2	12.3	20,688
フォーバル	6	7.3	6,153
PALTAC	19.1	30.1	168,861
三谷産業	14.8	19.5	5,538
太平洋興発	5.7	6.5	5,024
西本Wisemettacホールディングス	2.8	3.8	17,366
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1.1	1.3	1,562
国際紙パルプ商事	—	29.2	8,176
ヤマタネ	6.8	8.3	13,695
丸紅建材リース	13	1.6	3,169
日鉄住金物産	10.7	11.9	56,644
泉州電業	4.5	5.5	14,476
トラスコ中山	28.4	34.7	107,396
オートバックスセブン	54.2	66.3	124,312
モリト	10.9	12.1	9,522
加藤産業	21.3	26.1	94,873
北恵	—	3.2	2,883
イノテック	11.8	9.9	10,543
イエローハット	12.9	15.7	46,377
JKホールディングス	13.7	15.1	8,924
日伝	11.3	13.8	20,893
北沢産業	11.3	12.5	3,275
杉本商事	7.4	9	16,182
因幡電機産業	18	23.7	109,257
バイテックホールディングス	6.2	7.6	15,397
東テック	4.5	5.5	12,265
ミスミグループ本社	158.4	208.7	575,594
アルテック	11.7	12.2	2,842
タキヒヨー	4.5	5	8,920

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
蔵王産業	2.2	2.7	3,569
スズケン	62.2	76	448,400
ジェコス	9.4	11.5	12,052
ルネサスイーストン	12.5	15.3	6,823
<b>小売業 (4.9%)</b>			
ローソン	34.5	42.2	287,804
サンエー	10.3	12.6	56,952
カワチ薬品	10.6	12.9	26,780
エービーシー・マート	24.8	26	165,620
ハードオフコーポレーション	6	6.6	5,398
アスクル	11.9	17.4	40,507
ゲオホールディングス	24.9	25.4	41,503
アダストリア	21	23.1	43,797
ジーフット	8.2	10.1	6,888
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	1.7	2.1	1,610
くらこポレーション	8	9.8	54,390
キャンドウ	6.5	7.9	12,505
パルグループホールディングス	7	8.5	25,797
エディオン	53	70.6	69,046
サーラコーポレーション	23.4	33.8	19,604
ワッツ	5.4	5.5	4,075
ハローズ	5.1	6.3	13,589
あみやき亭	2.9	3.6	13,302
ひらまつ	18.8	33.2	11,454
大黒天物産	3.3	4	16,160
ハニーズホールディングス	13.2	14.7	14,229
ファーマライズホールディングス	3.1	3.9	2,086
アルベン	10.4	12.8	21,299
ハブ	2.5	5.3	5,103
クオールホールディングス	15.1	24.5	35,108
ジンズ	9.3	11.3	61,246
ビックカメラ	79	89	112,140
DCMホールディングス	73.5	89.9	101,227
ペッパーフードサービス	—	13.1	32,095
Monotaro	48.5	105.3	259,248
東京一番フーズ	3.4	4.2	2,541
DDホールディングス	3	3.7	7,866
きちりホールディングス	3.6	4.4	3,159
アークランドサービスホールディングス	11.4	12.2	24,717
J. フロント リテイリング	162.9	213.3	269,397

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ドトール・日レスホールディングス	23.9	29.3	63,727
マツモトキヨシホールディングス	56.4	68.9	267,676
ブロンコビリー	7.1	8.7	23,159
Z O Z O	134	180.2	321,296
トレジャー・ファクトリー	3.9	4.9	3,880
物語コーポレーション	3.9	4.1	37,720
ココカラファイン	14.2	18.7	93,313
三越伊勢丹ホールディングス	255	311.9	342,778
H a m e e	3.4	5.1	4,217
ウエルシアホールディングス	36.1	44.1	181,030
クリエイトSDホールディングス	20.1	24.6	71,364
丸善CHIホールディングス	15.9	19.5	6,552
ミサワ	2.4	3	1,266
ティーライフ	1.8	2.2	2,191
エー・ピーカンパニー	2.6	3.1	1,450
チムニー	4.2	5.1	13,438
シュッピン	8.2	11.3	8,621
ネクステージ	14.4	25.6	25,241
ジョイフル本田	20	48.8	70,320
鳥貴族	5	5.5	9,889
キリン堂ホールディングス	4.9	6.6	10,124
ホットランド	7.9	8.7	11,832
すかいらくホールディングス	84.7	155.4	258,741
綿半ホールディングス	5.1	6.2	14,043
ヨシックス	2.2	2.7	8,734
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	45.3	48.4	57,450
ブックオフコーポレーション	7.8	—	—
ゴルフダイジェスト・オンライン	5.5	6.7	4,174
BEENOS	2.1	3.9	4,582
あさひ	10.2	13.8	20,203
日本調剤	4.8	5.9	22,479
コスモス薬品	6.9	7.4	158,138
トーエル	6.6	8	5,624
一六堂	2.9	1	512
オンリー	2.1	2.8	2,716
セブン&アイ・ホールディングス	571.8	698.8	3,463,252
薬王堂	5.9	7.3	19,009
クリエイト・レストランツ・ホールディング	36.7	44.8	57,388
ツルハホールディングス	29.5	36.2	364,172
サンマルクホールディングス	9.8	13.2	33,924

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フェリシモ	3.5	3.7	4,177
トリドールホールディングス	16.8	20.6	45,711
TOKYO BASE	2.9	14.9	13,991
ウイルプラスホールディングス	—	1.9	1,371
ジャパンミート	—	6.3	11,037
サツドラホールディングス	2.2	2.5	4,710
デファクトスタンダード	—	1.1	430
ダイユー・リックホールディングス	6.4	9	9,072
パロックジャパンリミテッド	10.9	13.5	12,150
クスリのアオキホールディングス	10.8	16.6	125,496
力の源ホールディングス	—	4.7	3,666
スシローグローバルホールディングス	13.1	18.3	133,224
L I X I L ビバ	13	14.1	20,684
メディカルシステムネットワーク	15.4	17.7	7,788
総合メディカル	5.9	—	—
はるやまホールディングス	6.4	7.8	6,661
ノジマ	24	29.7	59,578
カップ・クリエイト	17	23.4	32,338
ライトオン	11.5	14	11,172
ジーンズメイト	4.2	5.1	2,091
良品計画	18.1	23.6	636,256
三城ホールディングス	16.9	20.6	7,992
アドヴァン	13.9	25.5	25,857
アルビス	3.1	6.3	14,962
コナカ	17.4	21.3	9,350
ハウス オブ ローゼ	1.7	2	3,650
G-7ホールディングス	4	4.9	11,304
イオン北海道	13.7	16.7	13,126
コジマ	23.5	24.6	15,670
ヒマラヤ	3.7	5.2	5,179
コーナン商事	19.4	21.9	62,655
エコス	5.5	6.1	10,376
ワタミ	16.1	21.9	33,485
マルシェ	3.6	4.4	3,405
パン・パシフィック・インターナショナルホ	88.4	99.8	689,618
西松屋チェーン	29.9	36.6	33,306
ゼンショーホールディングス	70.8	78.6	194,928
幸楽苑ホールディングス	8.7	10.6	24,327
ハークスレイ	3.3	3.5	3,892
サイゼリヤ	20.2	27.5	56,705

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
V Tホールディングス	46.2	56.5	23,843
魚力	3.8	4.6	6,601
ポブラ	3.5	4.3	2,481
フジ・コーポレーション	2.4	3.3	7,015
ユナイテッドアローズ	16.9	19.1	70,479
ハイデイ日高	14.9	21.9	49,318
京都きもの友禅	8.7	10.6	4,664
コロワイド	45.3	55.4	129,192
ビーシーデポコーポレーション	20.4	22.1	10,166
老番屋	9.6	11.7	55,809
トップカルチャー	4.9	6	1,794
P L A N T	3.1	3.8	3,849
スギホールディングス	30	36.6	174,033
ヴィア・ホールディングス	11.9	20.4	13,525
スクロール	21	25.6	9,984
ヨンドシーホールディングス	13.9	18.5	40,737
ユニ・ファミリーマートホールディングス	43.6	46.6	589,024
木曽路	16.7	20.4	51,612
S R Sホールディングス	16.1	19.6	19,874
千趣会	24.7	30.2	7,459
タカキュー	10.5	12.9	2,412
ケーヨー	25.2	30.8	16,508
上新電機	16.1	19.7	46,196
日本瓦斯	25.1	27.1	111,516
ロイヤルホールディングス	24.2	29.1	77,115
東天紅	1	1.2	1,576
いなげや	15.2	18.6	25,593
島忠	32.9	37.8	113,589
チヨダ	16.1	17.5	33,372
ライフコーポレーション	10.3	12.6	31,613
リンガーハット	16.8	20.6	48,966
さが美グループホールディングス	12	—	—
M r M a x H D	17	22.9	11,656
テンアライド	12.6	15.4	6,314
A O K Iホールディングス	27.3	33.3	42,590
オークワ	19	23.8	24,966
コメリ	21.1	25.7	73,039
青山商事	26.2	29.1	80,607
しまむら	15.9	19.4	179,644
はせがわ	7.2	8.8	3,449

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高島屋	214	130.8	194,892
松屋	27.5	33.6	36,859
エイチ・ツー・オー リテイリング	64.6	85.5	133,722
近鉄百貨店	5.2	6.4	22,080
パルコ	13.1	16	17,760
丸井グループ	130.6	141.1	284,598
アクシアル リテイリング	11.3	13.8	49,266
井筒屋	7.4	8.4	1,764
イオン	524.9	641.6	1,499,098
イズミ	24.7	33.9	181,026
東武ストア	1.6	—	—
平和堂	27.7	33.8	84,500
フジ	16.3	20.1	37,325
ヤオコー	15.5	18.9	112,644
ゼビオホールディングス	18.5	20.1	26,491
ケーズホールディングス	57.8	173.3	172,433
O l y m p i c グループ	8	9.8	7,075
日産東京販売ホールディングス	20.1	24.5	8,036
G e n k y D r u g S t o r e s	5.3	8.1	21,173
総合メディカルホールディングス	—	14.5	28,333
ブックオフグループホールディングス	—	8.6	6,802
アインホールディングス	18.3	22.3	165,243
元気寿司	3.4	4.7	17,296
ヤマダ電機	457.2	508	272,796
アークランドサカモト	23.1	28.3	40,553
ニトリホールディングス	54.1	72.2	1,021,269
グルメ杵屋	10	11.9	14,030
愛眼	10.9	13.3	4,069
ケーユーホールディングス	7.1	8.7	7,221
吉野家ホールディングス	44.8	58.2	107,088
松屋フーズホールディングス	6.6	8	29,160
サガミホールディングス	18.2	22.3	30,506
関西スーパーマーケット	10.3	12.6	12,927
王将フードサービス	10	12.2	87,596
プレナス	15.3	18.7	34,090
ミニストップ	10.1	12.3	23,406
アークス	25.6	31.3	80,034
パローホールディングス	31.7	36	100,296
藤久	1.1	1.3	972
ベルク	6.1	8.2	41,082

野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
大庄		7.3	8.9	14,044
ファーストリテイリング		22.8	22.3	1,128,826
サンドラッグ		57.8	62.7	222,898
サックスパー ホールディングス		12.8	14.1	15,876
ヤマザワ		2.8	3.5	6,202
やまや		2.8	2.9	6,965
ペルーナ		33.5	40.9	36,360
銀行業 (6.4%)				
島根銀行		2.9	3.5	2,446
じもとホールディングス		92.3	112.8	13,874
めぶきフィナンシャルグループ		709.8	867.5	265,455
東京きらばしフィナンシャルグループ		18.5	22.6	36,318
九州フィナンシャルグループ		224.2	274	126,862
ゆうちょ銀行		387	473	594,088
富山第一銀行		34.7	39.8	15,362
コンコルディア・フィナンシャルグループ		830.6	1,063.4	482,783
西日本フィナンシャルホールディングス		92.7	107	108,498
関西みらいフィナンシャルグループ		—	78.4	65,777
三十三フィナンシャルグループ		—	14.4	22,939
第四北越フィナンシャルグループ		—	29	100,340
新生銀行		118.3	122.5	185,710
あおぞら銀行		81.4	93.3	299,959
三菱UFJ Fフィナンシャル・グループ		9,651.6	11,627.8	6,803,425
りそなホールディングス		1,499.1	1,832.2	944,315
三井住友トラスト・ホールディングス		268.6	328.2	1,371,219
三井住友フィナンシャルグループ		1,034	1,176.8	4,748,388
第四銀行		16.8	—	—
北越銀行		13.7	—	—
千葉銀行		489	591.4	406,291
群馬銀行		277.5	334	160,988
武蔵野銀行		21.8	24.9	60,208
千葉興業銀行		37.5	45.8	15,388
筑波銀行		56.8	69.4	14,643
七十七銀行		42.9	52.4	95,682
青森銀行		10.6	12.9	36,145
秋田銀行		8.8	10.7	23,454
山形銀行		15.4	18.8	35,720
岩手銀行		9.5	11.7	38,610
東邦銀行		122.2	149.3	46,432
東北銀行		7	8.5	9,265

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
みちのく銀行	8.8	10.7	17,205	
ふくおかフィナンシャルグループ	555	135.6	335,067	
静岡銀行	361	420.3	373,226	
十六銀行	18.3	22.4	51,452	
スルガ銀行	139.8	170.8	90,865	
八十二銀行	247.3	302.2	141,127	
山梨中央銀行	85	20.7	29,808	
大垣共立銀行	21.6	26.4	59,875	
福井銀行	11.7	14.3	23,065	
北國銀行	15.5	17.7	60,268	
清水銀行	4.6	6.9	11,674	
富山銀行	2.6	3.2	9,984	
滋賀銀行	128	33.5	86,664	
南都銀行	16	19.5	43,543	
百五銀行	131.1	150.3	57,715	
京都銀行	52.2	59.8	280,761	
紀陽銀行	51.4	59.1	93,141	
三重銀行	6.1	—	—	
ほくほくフィナンシャルグループ	90.9	111.1	138,097	
広島銀行	201.7	246.5	159,732	
山陰合同銀行	81	99	82,170	
中国銀行	94.5	107.8	113,405	
鳥取銀行	4.3	5.7	7,871	
伊予銀行	194.9	221.2	137,365	
百十四銀行	145	17.7	44,444	
四国銀行	20.9	23.9	24,712	
阿波銀行	109	26.7	82,236	
大分銀行	7.9	10.2	34,935	
宮崎銀行	9.1	11.1	29,514	
佐賀銀行	8.3	10.1	17,988	
十八銀行	84	10.3	28,180	
沖縄銀行	13.3	15.3	51,408	
琉球銀行	26.5	38.5	44,852	
セブン銀行	512.4	564.1	190,665	
みずほフィナンシャルグループ	18,560.9	22,687.4	3,972,563	
高知銀行	5	6.1	4,514	
山口フィナンシャルグループ	128	208.4	222,988	
長野銀行	4.5	5.5	8,481	
名古屋銀行	11	13.5	45,832	
北洋銀行	205.9	251.7	77,271	

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
愛知銀行	4.6	6	20,940
第三銀行	7.7	—	—
中京銀行	5.6	6.9	14,814
大光銀行	4.7	5.7	9,564
愛媛銀行	19	23.3	25,070
トマト銀行	5.3	6.4	6,758
みなと銀行	12.4	—	—
京葉銀行	121	73.8	51,881
関西アーバン銀行	19	—	—
栃木銀行	70.7	86.4	20,736
北日本銀行	4.3	5.2	10,852
東和銀行	24	29.3	21,066
福島銀行	12.9	14.5	5,539
大東銀行	6.6	8	4,960
トモニホールディングス	112.7	129.1	52,543
フィデアホールディングス	132.6	162.1	21,721
池田泉州ホールディングス	145	177.2	52,982
<b>証券・商品先物取引業 (0.8%)</b>			
F P G	47.7	52.4	54,548
マーキュリアインベストメント	2.8	6.4	4,185
S B I ホールディングス	154.5	198.9	458,265
日本アジア投資	12.3	14.1	2,777
ジャフコ	19.6	27.4	106,586
大和証券グループ本社	1,169	1,339.7	760,145
野村ホールディングス	2,350.2	2,937.8	1,315,253
岡三証券グループ	116	142.3	69,015
丸三証券	43.5	49.6	40,324
東洋証券	49	59.7	9,790
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	151.3	199.1	99,350
光世証券	3.3	4	3,036
水戸証券	42.3	48.3	12,944
いちよし証券	28.7	35	29,925
松井証券	66.9	81.8	96,115
だいこう証券ビジネス	6.6	6.7	2,887
マネックスグループ	144.8	155.9	62,983
カブドットコム証券	87.4	124.6	69,776
極東証券	18.3	22.4	26,947
岩井コスモホールディングス	14	17.1	21,255
藍澤證券	25.6	31.2	21,902
マネーパートナーズグループ	17.4	19.5	5,674

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
小林洋行	3.9	4.8	1,281
<b>保険業 (2.3%)</b>			
かんぽ生命保険	51.6	63.1	154,405
S O M P Oホールディングス	267.9	294.3	1,206,630
アニコム ホールディングス	9.3	13.6	41,004
MS & ADインシュアランスグループホール	357.2	436.5	1,451,362
ソニーフィナンシャルホールディングス	112.2	137.2	285,376
第一生命ホールディングス	772.8	944.6	1,618,099
東京海上ホールディングス	514.7	605.2	3,318,916
アドバンテッジリスクマネジメント	3.3	—	—
T & Dホールディングス	422.5	516.4	711,857
アドバンスクリエイト	3.2	3.9	6,758
<b>その他金融業 (1.2%)</b>			
全国保証	38.5	47.1	190,990
ジェイリース	—	3.5	1,309
イントラスト	1.1	4.7	2,044
日本モーゲージサービス	—	2.3	2,994
C a s a	—	5.6	6,081
アルヒ	11.6	15.2	32,680
プレミアグループ	—	3.4	11,152
クレディセゾン	103.7	117	182,754
アクリーティブ	7.5	—	—
芙蓉総合リース	15.6	19.1	105,814
興銀リース	25.7	31.4	84,623
東京センチュリー	27.5	33.6	172,704
日本証券金融	55.9	73.6	45,190
アイフル	229.2	254.7	77,683
リコーリース	10.7	13.1	44,867
イオンフィナンシャルサービス	97	106.7	236,127
アコム	274.6	335.6	129,541
ジャックス	16.6	18.4	34,960
オリエントコーポレーション	295.6	451.6	51,934
日立キャピタル	37.6	39.4	99,366
アプラスフィナンシャル	65.5	80.1	6,808
オリックス	911.2	1,113.9	1,826,239
三菱UFJリース	346.7	376.7	218,109
九州リースサービス	5.9	8.2	5,789
日本取引所グループ	401.4	451	889,372
イー・ギャランティ	3.6	15.6	16,926
アサックス	1.9	6.9	3,663

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
NECキャピタルソリューション	5.6	6.8	11,152
<b>不動産業 (2.4%)</b>			
いちご	195.2	212.3	81,310
日本駐車場開発	164.8	201.4	31,821
ヒューリック	285.1	348.5	348,500
三栄建築設計	5.5	6.7	11,189
スター・マイカ	5	7.7	10,448
野村不動産ホールディングス	90.8	111.2	232,074
三重交通グループホールディングス	27.7	33.8	20,651
サムティ	11.6	23.1	35,042
ディア・ライフ	13.7	21.4	9,180
コーセーアールイー	2.3	4.9	3,724
エー・ディー・ワークス	181.1	257.3	8,748
日本商業開発	7.7	10.4	15,776
プレサンスコーポレーション	18.7	26.4	35,534
ユニゾホールディングス	15.9	25.2	53,449
THEグローバル社	6.4	8.5	4,173
日本管理センター	9	11	8,492
サンセイランディック	4	4.4	3,295
エストラスト	1.9	2.3	1,814
フージャースホールディングス	33.2	36.3	23,812
オープンハウス	22.2	27.2	108,800
東急不動産ホールディングス	330.7	449.1	277,543
飯田グループホールディングス	114	139.3	276,371
イーグランド	1.6	2.3	1,561
ムゲンエステート	8.4	11.5	6,785
ビーロット	—	2.6	3,796
ファーストブラザーズ	3.7	4.6	5,073
ハウスドゥ	2.2	9.2	13,376
シーアールイー	2.2	5.5	4,994
プロパティエージェント	—	1.7	1,863
ケイアイスター不動産	4.9	4.5	8,158
アグレ都市デザイン	—	2	1,254
グッドコムアセット	—	2.9	4,149
ジェイ・エス・ビー	—	0.6	2,550
テンボイノベーション	—	1.4	2,520
グローバル・リンク・マネジメント	—	1.2	877
パーク24	75.7	97.5	257,107
バラカ	4.4	4.3	7,817
三井不動産	682.1	885.8	2,373,944

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三菱地所	1,016.8	1,169.7	2,177,396
平和不動産	24.1	31.6	63,642
東京建物	149.3	182.4	237,484
ダイビル	35.2	49.1	52,487
京阪神ビルディング	22.6	29.8	27,058
住友不動産	328	375.3	1,552,616
大京	21.8	—	—
テオーシー	47.1	38.2	30,063
東京楽天地	2.2	2.4	11,232
レオパレス21	163	205.9	41,385
スターツコーポレーション	18.6	22.7	54,048
フジ住宅	17.4	21.3	18,786
空港施設	14.2	19.5	10,686
明和地所	7.5	9.2	5,630
ゴールドクレスト	10.8	13.2	21,001
日本エスリード	5.3	6.5	10,621
日神不動産	18.2	24.7	11,683
日本エスコン	24.5	30.1	22,906
タカラレーベン	64	78.2	27,761
サンヨーハウジング名古屋	7	9.4	8,798
イオンモール	88	83.7	156,184
毎日コムネット	—	3.5	2,744
ファースト住建	5.1	6.2	7,595
カチタス	14	18.6	65,751
トーセイ	16.6	23	24,150
穴吹興産	1.5	1.8	5,018
エヌ・ティ・ティ都市開発	84.9	—	—
サンフロンティア不動産	16.5	23.1	27,904
エフ・ジェー・ネクスト	10.4	14.6	13,008
インテリックス	3.8	4.7	3,106
ランドビジネス	8.1	8.4	6,543
グランディハウス	11.9	14.6	6,424
日本空港ビルデング	40	53.3	233,720
<b>サービス業 (4.8%)</b>			
日本工営	8.9	10.9	28,797
LIFULL	46	62.7	38,247
ジェイエイシーリクルートメント	10.7	13	32,955
日本M&Aセンター	45.8	120.6	359,388
メンバーズ	3.3	5.4	7,965
中広	1.4	1.7	974

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
タケエイ	13.7	16.8	13,490	
E・Jホールディングス	—	2	2,096	
トラスト・テック	5.9	8.9	32,618	
コシダカホールディングス	6.9	43.3	65,339	
アルトナー	—	2.9	2,702	
パソナグループ	12.5	19.7	28,643	
CDS	3.6	4	5,096	
リンクアンドモチベーション	24.3	29.7	27,324	
GCA	15	16.4	14,366	
エス・エム・エス	26.1	59.4	112,147	
サニーサイドアップ	—	1.8	2,741	
パーソルホールディングス	122.1	161.7	320,974	
リニカル	8.5	9.1	15,715	
クックパッド	41.6	50.8	14,732	
エスクリ	4.6	4.4	2,631	
アイ・ケイ・ケイ	7.7	7.9	5,861	
学情	6	6.5	8,606	
スタジオアリス	6.7	8.1	19,537	
シミックホールディングス	7.3	9	14,085	
NJS	3.2	3.6	5,385	
総合警備保障	52.7	64.4	313,306	
カカココム	101.7	121.8	256,632	
セントケア・ホールディング	5.6	8.8	4,972	
サイネックス	1.9	2.7	1,838	
ルネサンス	6.4	9	17,766	
ディップ	18.7	26.1	51,678	
オプトホールディング	9.2	9.9	17,265	
新日本科学	16.1	21.9	16,622	
ツクイ	31.2	38.1	27,317	
キャリアデザインセンター	3	4.1	4,989	
ベネフィット・ワン	—	22.4	92,288	
エムスリー	139.3	340.5	565,570	
ツカダ・グローバルホールディング	10.5	10.3	6,396	
プラス	0.7	1.2	705	
アウトソーシング	39.5	85.2	118,768	
ウェルネット	13.3	15.3	16,967	
ワールドホールディングス	4.4	4.5	10,404	
ディー・エヌ・エー	71.3	87.2	146,408	
博報堂DYホールディングス	183.9	224.9	398,747	
ぐるなび	20.9	23	16,836	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
エスアールジータカミヤ	15.6	16.7	11,606	
ジャパンバストレスキューシステム	16.4	12.8	15,782	
ファンコミュニケーションズ	36.8	44.5	24,252	
ライク	5.2	6.3	6,186	
ビジネス・ブレークスルー	6.1	6.7	2,391	
WDBホールディングス	6	7.4	20,498	
ティア	6.9	8.2	5,559	
CDG	1.2	1.5	1,894	
バリューコマース	11.9	10.9	21,538	
インフォマート	66.9	88.6	111,281	
J Pホールディングス	41.6	46.2	13,444	
E P Sホールディングス	19.9	24.3	43,885	
レグス	3.3	4	3,676	
プレステージ・インターナショナル	27.5	30.2	38,203	
アミューズ	8.8	9.8	23,814	
ドリームインキュベータ	4.4	4.9	7,350	
クイック	8.2	10	15,970	
TAC	8	8.8	2,032	
ケネディクス	175.3	142	81,082	
電通	161.2	197.1	956,920	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6.2	6.2	11,389	
びあ	4.4	4.6	18,653	
イオンファンタジー	4.2	5.2	14,846	
シーティーエス	13.5	18.2	12,976	
ネクシィーズグループ	5.2	4.9	8,521	
みらかホールディングス	39.4	45.2	141,476	
アルプス技研	11.6	14.2	27,832	
ダイオーズ	2.6	3.7	5,168	
日本空調サービス	13.8	18.3	12,023	
オリエンタルランド	156.4	191.1	2,318,043	
ダスキン	35.6	43.5	115,927	
明光ネットワークジャパン	16.7	20.5	19,516	
ファルコホールディングス	6.8	8.9	12,958	
秀英予備校	2.9	3.5	1,715	
田谷	2.4	2.9	1,853	
ラウンドワン	41	50.2	70,380	
リゾートトラスト	56	68.4	106,498	
ビー・エム・エル	17	20.8	72,072	
ワタベウエディング	2.1	2.6	1,762	
りらいあコミュニケーションズ	20.9	29.2	28,294	



## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リソー教育	22.4	82.1	39,900
早稲田アカデミー	1.9	2.3	3,792
ユー・エス・エス	161.6	197.6	400,930
東京個別指導学院	4.7	5.7	7,090
サイバーエージェント	87	99.7	333,995
楽天	678.6	754	602,446
クリーク・アンド・リバー社	6.8	9.5	11,067
テー・オー・ダブリュー	12.6	14.2	10,848
セントラルスポーツ	4.9	6	20,640
フルキャストホールディングス	11.6	16.2	35,656
エン・ジャパン	—	17.6	64,504
リソルホールディングス	1.4	1.8	7,587
テクノプロ・ホールディングス	23.6	32.4	197,964
アトラ	2.3	3.2	1,270
インターワークス	2.9	3.1	2,290
アイ・アールジャパンホールディングス	—	4.9	6,864
Keeper 技研	4.2	5.9	6,743
ファーストロジック	2	3.1	2,114
三機サービス	1.4	3.4	5,103
Gunosy	6	11.2	29,041
デザインワン・ジャパン	2.6	3.2	1,065
イー・ガーディアン	6.7	7.7	16,039
リブセンス	8.5	8.9	2,554
ジャパンマテリアル	12.1	44.2	66,034
ベクトル	15.8	19.7	26,063
ウチヤマホールディングス	6.5	8	3,536
チャーム・ケア・コーポレーション	—	3.9	6,396
ライクキッズネクスト	1.4	3.9	3,217
キャリアリンク	4.3	5.9	2,306
I B J	10.5	10.9	10,104
アサンテ	4.8	6.5	14,501
N・フィールド	7.4	10.4	9,276
バリュエHR	3	3.5	7,735
M&Aキャピタルパートナーズ	2.7	4.1	22,632
ライドオンエクスプレスホールディングス	5.4	6.7	8,046
ERIホールディングス	3.7	4.5	3,573
アビスト	1.9	2.5	8,162
シグマクシス	5.3	7.7	7,137
ウィルグループ	5.7	10.5	11,718
エスクロー・エージェント・ジャパン	18.1	22.2	5,505

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本ビューホテル	4.2	5.1	5,722
リクルートホールディングス	1,021	1,158.8	3,432,365
エラン	3.2	11.1	15,451
土木管理総合試験所	4	7	3,605
日本郵政	751	1,325.8	1,796,459
ベルシステム24ホールディングス	22.2	27.1	41,056
鎌倉新書	1.8	11.8	20,579
一蔵	1.7	1.7	1,045
LITALICO	2.3	3.7	7,026
グローバルグループ	1.4	1.9	1,672
エボラブルアジア	2.7	4.7	11,820
アトラエ	—	3.1	9,027
ストライク	1.2	4.1	8,655
ソラスト	7.9	39.3	45,155
セラク	2.2	3.6	2,214
インソース	1.6	5.3	11,935
ペイカレント・コンサルティング	—	8.6	27,692
Orchestra Holdings	—	2	1,720
アイモバイル	—	3.8	3,275
キャリアインデックス	1.3	5.5	5,153
MS-Japan	1	6.5	11,667
船場	1.9	2.6	2,389
グレイステクノロジー	—	4.4	10,406
ジャパンエレベーターサービスホールディン	—	9.5	18,848
フルテック	—	1.7	1,909
グリーンズ	—	4.6	6,453
ツナグ・ソリューションズ	—	1.4	845
日総工産	—	4	9,768
キュービーネットホールディングス	—	7.3	15,381
スプリックス	—	4.5	12,073
アドバンテッジリスクマネジメント	—	6.3	6,148
リログループ	72.4	88.4	263,255
東祥	8.2	10.1	35,148
エイチ・アイ・エス	20.6	28.8	122,688
ラックランド	2.5	3.2	6,230
共立メンテナンス	23.6	24.7	128,440
イチネンホールディングス	14.8	16.8	21,823
建設技術研究所	9.1	11.2	16,867
スペース	8.6	10.5	13,755
長大	3.9	6.4	5,132

野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
燎ホールディングス		3.1	3.5	8,767
スバル興業		0.9	1.1	6,490
東京テアトル		5.5	6.3	8,076
タナベ経営		2.5	3.1	3,819
ナガワ		2.6	4.5	25,020
よみうりランド		2.9	3.5	14,542
東京都競馬		9.9	10.6	37,948
常磐興産		5.3	6.5	10,400
カナモト		20.2	24.2	70,930
東京ドーム		53.6	60.5	58,443
西尾レントオール		11.6	16.4	56,006
トランス・コスモス		14.7	18	39,168
乃村工藝社		30.9	37.8	121,338
藤田観光		5.2	6.4	17,267
KNT-CTホールディングス		8.2	8.6	11,102
日本管財		14.2	17.3	32,818
トーカイ		12.8	15.6	44,444
白洋舎		1.5	1.8	5,337
セコム		140.4	171.7	1,596,466
セントラル警備保障		6.4	7.8	31,902
丹青社		27.1	30.5	36,203

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		株 数	株 数	評 価 額
		千株	千株	千円
メイテック		15.5	20.5	101,782
アサツー ディ・ケイ		5.4	—	—
応用地質		14.9	17.4	20,184
船井総研ホールディングス		27.5	33.4	81,963
進学会ホールディングス		6	7.4	4,144
オオパ		10.4	12.7	8,089
いであ		2.7	3.3	3,234
学究社		3.6	5.3	7,276
ベネッセホールディングス		48.5	59.2	174,048
イオンディライト		16.3	19.9	82,286
ナック		8.9	10.2	10,679
ニチイ学館		25.1	23	28,543
ダイセキ		22.2	27.1	71,056
ステップ		4.8	5.9	8,401
合 計	株 数 ・ 金 額	167,404	195,607	387,375,566
	銘柄数<比率>	2,051	2,113	<97.8%>

＊各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいています。  
 ＊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。  
 ＊評価額欄のくゝ内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。  
 ＊評価額の単位未満は切り捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末
			買 建 額 売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円
			8,814 百万円 —

＊単位未満は切り捨て。

## &lt;外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド&gt;

下記は、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド全体（208,348,489千口）の内容です。

## 外国株式

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AFLAC INC	447	1,053	5,189	573,612	保険
AGCO CORP	78	—	—	—	機械
AES CORP	740	910	1,539	170,200	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AT & T INC	6,926	9,983	30,418	3,362,427	各種電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	1,963	2,415	18,172	2,008,829	ヘルスケア機器・用品
ABBVIE INC	1,797	2,084	16,849	1,862,503	バイオテクノロジー
ABIOMED INC	—	58	2,125	234,929	ヘルスケア機器・用品
ACTIVISION BLIZZARD INC	805	1,004	4,477	494,980	娯楽
ACUITY BRANDS INC	50	50	655	72,453	電気設備
ADOBE INC	558	674	17,486	1,933,005	ソフトウェア
ADVANCE AUTO PARTS	83	99	1,682	186,027	専門小売り
ADVANCED MICRO DEVICES	900	1,260	2,983	329,815	半導体・半導体製造装置
AETNA INC	372	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	65	75	817	90,333	資本市場
AGILENT TECHNOLOGIES INC	365	444	3,476	384,294	ライフサイエンス・ツール/サービス
AIR PRODUCTS	245	304	5,292	584,981	化学
AKAMAI TECHNOLOGIES	191	225	1,577	174,324	情報技術サービス
ALBEMARLE CORP	122	148	1,204	133,120	化学
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	254	307	3,973	439,196	バイオテクノロジー
ALIGN TECHNOLOGY INC	84	102	2,600	287,469	ヘルスケア機器・用品
ALLEGHANY CORP	17	21	1,362	150,617	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	54	66	1,143	126,367	情報技術サービス
ALLIANT ENERGY CORP	253	310	1,394	154,134	電力
ALLSTATE CORP	411	481	4,539	501,816	保険
ALLY FINANCIAL INC	527	574	1,550	171,378	消費者金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	99	127	1,060	117,264	バイオテクノロジー
ALPHABET INC-CL C	353	432	48,176	5,325,430	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALPHABET INC-CL A	336	410	45,983	5,082,983	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ALTRIA GROUP INC	2,162	2,597	12,657	1,399,190	タバコ
AMAZON.COM INC	461	569	91,540	10,118,897	インターネット販売・通信販売
AMERCO	6	11	440	48,683	陸運・鉄道
AMEREN CORPORATION	267	328	2,285	252,639	総合公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	146	146	511	56,566	旅客航空輸送業
AMERICAN ELECTRIC POWER	554	683	5,414	598,479	電力
AMERICAN EXPRESS CO	850	999	10,727	1,185,791	消費者金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	84	108	1,059	117,114	保険
AMERICAN INTL GROUP	1,032	1,231	5,209	575,868	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	208	247	2,421	267,709	水道
AMERISOURCEBERGEN CORP	181	220	1,906	210,746	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	173	192	2,509	277,351	資本市場
AMETEK INC	268	318	2,512	277,733	電気設備
AMGEN INC	822	891	16,781	1,854,982	バイオテクノロジー
AMPHENOL CORP-CL A	345	413	3,828	423,157	電子装置・機器・部品
ANADARKO PETE	633	713	3,224	356,480	石油・ガス・消耗燃料
ANALOG DEVICES INC	419	510	5,392	596,113	半導体・半導体製造装置
ANDEAVOR	164	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	93	115	2,006	221,813	ソフトウェア
ANTERO RESOURCES CORP	270	270	259	28,681	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
ANTHEM INC	297	354	11,054	1,222,004	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
APACHE CORPORATION	439	541	1,801	199,141	石油・ガス・消耗燃料	
APPLE INC	5,834	6,633	113,039	12,495,395	コンピュータ・周辺機器	
APPLIED MATERIALS	1,209	1,363	5,329	589,104	半導体・半導体製造装置	
ARAMARK	286	354	1,125	124,437	ホテル・レストラン・レジャー	
ARCHER DANIELS MIDLAND	644	755	3,169	350,355	食品	
ARCONIC INC	441	570	1,000	110,578	航空宇宙・防衛	
ARISTA NETWORKS INC	52	74	1,953	215,910	通信機器	
ARROW ELECTRS INC	105	121	982	108,594	電子装置・機器・部品	
ASSURANT INC	63	76	746	82,506	保険	
ATMOS ENERGY CORP	117	156	1,513	167,355	ガス	
AUTODESK INC.	227	300	4,810	531,752	ソフトウェア	
AUTOLIV INC	97	119	930	102,905	自動車部品	
AUTOMATIC DATA PROCESS	504	605	9,055	1,000,943	情報技術サービス	
AUTONATION INC	71	—	—	—	専門小売り	
AUTOZONE	32	36	3,384	374,142	専門小売り	
AVERY DENNISON CORP	99	122	1,279	141,466	容器・包装	
AVNET INC	150	—	—	—	電子装置・機器・部品	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	—	310	599	66,273	各種金融サービス	
BB&T CORPORATION	913	1,049	5,318	587,899	銀行	
BAKER HUGHES, A GE CO, LLC	473	681	1,759	194,442	エネルギー設備・サービス	
BALL CORP	368	454	2,457	271,652	容器・包装	
BANK OF AMERICA CORP	11,311	13,042	37,965	4,196,680	銀行	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,171	1,368	7,249	801,307	資本市場	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	552	696	5,110	564,939	ヘルスケア機器・用品	
BECTON, DICKINSON	297	369	9,163	1,012,960	ヘルスケア機器・用品	
BEIGENE, LTD ADR	—	46	608	67,231	バイオテクノロジー	
WR BERKLEY CORP	115	130	1,058	116,973	保険	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,430	1,783	36,603	4,046,118	各種金融サービス	
BEST BUY COMPANY INC	305	338	2,034	224,847	専門小売り	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	202	241	2,265	250,390	バイオテクノロジー	
BIOGEN INC	239	275	9,157	1,012,242	バイオテクノロジー	
BLACKROCK INC	136	165	7,144	789,747	資本市場	
H & R BLOCK INC	235	279	672	74,325	各種消費者サービス	
BOEING CO	633	750	31,368	3,467,490	航空宇宙・防衛	
BOOKING HOLDINGS INC	—	65	12,645	1,397,838	インターネット販売・通信販売	
BORGWARNER INC	236	296	1,240	137,161	自動車部品	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,561	1,891	7,565	836,333	ヘルスケア機器・用品	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	102	139	583	64,456	保険	
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,853	2,250	11,625	1,285,110	医薬品	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	130	163	1,635	180,810	情報技術サービス	
BROADCOM INC	—	594	16,760	1,852,732	半導体・半導体製造装置	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	228	356	1,741	192,550	飲料	
BURLINGTON STORES INC	—	89	1,449	160,173	専門小売り	
CBS CORP-CL B	400	470	2,380	263,094	メディア	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	112	150	1,403	155,098	資本市場	
CBRE GROUP INC	355	455	2,276	251,679	不動産管理・開発	
CDK GLOBAL INC	146	167	971	107,419	ソフトウェア	
CDW CORPORATION	182	211	2,001	221,204	電子装置・機器・部品	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	264	314	1,311	144,981	化学	
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	155	183	1,673	184,992	航空貨物・物流サービス	
CIGNA CORP	282	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CIGNA CORP	—	519	10,269	1,135,185	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CIT GROUP INC	164	167	847	93,722	銀行	

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
CME GROUP INC	382	488	8,559	946,169	資本市場	
CMS ENERGY CORP	330	378	1,994	220,494	総合公益事業	
CSX CORP	1,035	1,115	8,088	894,070	陸運・鉄道	
CVS HEALTH CORP	1,150	1,781	12,383	1,368,849	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CA INC	348	—	—	—	ソフトウェア	
CABOT OIL & GAS CORP	533	585	1,475	163,152	石油・ガス・消耗燃料	
CADENCE DESIGN SYS INC	321	378	1,987	219,700	ソフトウェア	
CAMPBELL SOUP CO	216	248	862	95,373	食品	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	543	656	5,350	591,498	消費者金融	
CARDINAL HEALTH INC	363	410	2,274	251,443	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CARMAX INC	204	239	1,483	163,956	専門小売り	
CARNIVAL CORP	394	586	3,354	370,845	ホテル・レストラン・レジャー	
CATERPILLAR INC DEL	665	811	11,045	1,221,004	機械	
CELANESE CORP-SERIES A	155	180	1,804	199,489	化学	
CELGENE CORP	880	962	8,724	964,392	バイオテクノロジー	
CENTENE CORP	198	558	3,625	400,743	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
CENTERPOINT ENERGY INC	452	653	2,017	222,972	総合公益事業	
CENTURYLINK INC	1,080	1,360	1,868	206,559	各種電気通信サービス	
CERNER CORP	342	406	2,351	259,895	ヘルスケア・テクノロジー	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	217	222	7,749	856,589	メディア	
CHEMOURS CO/THE	206	234	883	97,645	化学	
CHENIERE ENERGY INC	222	286	1,893	209,350	石油・ガス・消耗燃料	
CHEVRON CORP	2,138	2,634	31,436	3,475,022	石油・ガス・消耗燃料	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	28	33	2,053	227,045	ホテル・レストラン・レジャー	
CHURCH & DWIGHT CO INC	287	329	2,128	235,262	家庭用品	
CIMAREX ENERGY CO	106	138	1,048	115,919	石油・ガス・消耗燃料	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	170	216	1,846	204,097	保険	
CISCO SYSTEMS	5,639	6,466	31,961	3,533,017	通信機器	
CINTAS CORP	100	127	2,588	286,092	商業サービス・用品	
CITIGROUP	3,073	3,463	22,256	2,460,255	銀行	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	578	639	2,345	259,230	銀行	
CITRIX SYSTEMS INC	173	185	1,970	217,770	ソフトウェア	
CLOROX CO	150	177	2,766	305,770	家庭用品	
COCA COLA CO	4,569	5,555	25,130	2,777,960	飲料	
COGNEX CORP	192	248	1,258	139,070	電子装置・機器・部品	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	662	804	5,914	653,758	情報技術サービス	
COLGATE PALMOLIVE CO.	948	1,127	7,492	828,198	家庭用品	
COMCAST CORP-CL A	5,305	6,289	23,753	2,625,717	メディア	
COMERICA INC	204	230	1,986	219,588	銀行	
COMMSCOPE HOLDING CO INC	228	228	517	57,160	通信機器	
CONAGRA BRANDS INC	472	667	1,634	180,638	食品	
CONCHO RESOURCES INC	172	276	3,393	375,169	石油・ガス・消耗燃料	
CONOCOPHILLIPS	1,368	1,586	11,130	1,230,370	石油・ガス・消耗燃料	
CONSOLIDATED EDISON INC	345	423	3,320	367,100	総合公益事業	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	193	228	3,987	440,827	飲料	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	114	139	652	72,108	石油・ガス・消耗燃料	
THE COOPER COMPANIES, INC.	56	65	1,836	202,982	ヘルスケア機器・用品	
COPART INC	—	279	1,507	166,632	商業サービス・用品	
CORNING INC	1,039	1,127	3,889	429,920	電子装置・機器・部品	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	493	604	13,074	1,445,287	食品・生活必需品小売り	
COSTAR GROUP INC	41	51	2,108	233,082	専門サービス	
COTY INC-CL A	550	650	717	79,323	パーソナル用品	
CROWN HOLDINGS INC	145	191	1,017	112,490	容器・包装	
CUMMINS INC	180	216	3,358	371,210	機械	

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
				外貨建金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
DR HORTON INC	394	480	1,918	212,077	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	206	251	3,007	332,419	総合公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	320	378	2,474	273,518	情報技術サービス
DANAHER CORP	702	860	9,566	1,057,496	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC	143	166	1,861	205,736	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA INC	175	175	1,034	114,325	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY	306	422	6,709	741,654	機械
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	233	—	—	—	ソフトウェア
DELL TECHNOLOGIES-C	—	207	1,143	126,396	コンピュータ・周辺機器
DELTA AIR LINES INC	201	224	1,144	126,478	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC	253	303	1,320	145,965	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	573	673	1,912	211,426	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC	—	116	1,722	190,403	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC	104	216	2,278	251,898	石油・ガス・消耗燃料
DISNEY (WALT) CO	1,740	2,046	23,035	2,546,389	娯楽
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	428	463	3,300	364,862	消費者金融
DISCOVERY INC - A	193	193	565	62,509	メディア
DISCOVERY INC - C	212	398	1,100	121,645	メディア
DISH NETWORK CORP-A	251	319	985	108,960	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	312	361	4,295	474,868	複合小売り
DOLLAR TREE INC	268	324	3,202	354,030	複合小売り
DOMINION ENERGY INC	728	1,024	7,504	829,567	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC	52	52	1,484	164,074	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP	181	197	1,796	198,600	機械
DOWDUPONT INC	2,631	3,175	17,221	1,903,631	化学
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	202	—	—	—	飲料
DUKE ENERGY CORP	800	973	8,514	941,217	電力
EOG RESOURCES INC	649	800	8,020	886,530	石油・ガス・消耗燃料
EQT CORP	282	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	307	350	1,661	183,617	資本市場
EAST WEST BANCORP INC	162	207	1,116	123,401	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO.	160	186	1,538	170,055	化学
EATON VANCE CORP	138	164	673	74,417	資本市場
EBAY INC	1,157	1,277	4,671	516,361	インターネット販売・通信販売
ECOLAB INC	294	360	5,885	650,558	化学
EDISON INTERNATIONAL	368	450	2,722	300,945	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	241	284	5,048	558,111	ヘルスケア機器・用品
ELECTRONIC ARTS	351	424	4,530	500,747	娯楽
EMERSON ELEC	725	861	5,881	650,140	電気設備
ENTERGY CORP	197	254	2,282	252,301	電力
ENVISION HEALTHCARE CORP	149	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EQUIFAX INC	139	161	1,759	194,538	専門サービス
EVERGY INC	—	372	2,186	241,667	電力
EVERSOURCE ENERGY	363	442	3,102	342,987	電力
EXELON CORPORATION	1,079	1,322	6,379	705,242	電力
EXPEDIA GROUP INC	144	173	2,198	243,039	インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	197	230	1,693	187,223	航空貨物・物流サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	661	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EXXON MOBIL CORP	4,783	5,818	45,211	4,997,698	石油・ガス・消耗燃料
FLIR SYSTEMS INC	156	178	932	103,122	電子装置・機器・部品
FMC CORP	148	180	1,536	169,822	化学
FACEBOOK INC-A	2,676	3,314	53,852	5,952,855	インタラクティブ・メディアおよびサービス
FASTENAL CO	320	387	2,436	269,379	商社・流通業
FEDEX CORPORATION	286	344	6,167	681,801	航空貨物・物流サービス

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
F5 NETWORKS INC	73	81	1,387	153,359	通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	373	451	4,912	543,054	情報技術サービス
FNF GROUP	299	372	1,293	142,936	保険
FIFTH THIRD BANCORP	850	903	2,453	271,204	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	490	740	1,892	209,243	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	173	226	2,296	253,892	銀行
FISERV INC	240	562	4,820	532,895	情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	488	658	2,605	287,959	電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	102	121	2,711	299,674	情報技術サービス
FLUOR CORP	164	184	668	73,852	建設・土木
FLOWSERVE CORP	150	172	821	90,843	機械
FORD MOTOR COMPANY	4,200	5,160	4,406	487,109	自動車
FORTINET INC	170	199	1,653	182,820	ソフトウェア
FORTIVE CORP	353	406	3,321	367,112	機械
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	171	194	919	101,648	建設関連製品
FRANKLIN RESOURCES INC	368	434	1,408	155,676	資本市場
FREEPOR-T-MCMORAN INC	1,570	1,870	2,296	253,839	金属・鉱業
ARTHUR J GALLAGHER & CO	199	249	1,988	219,755	保険
GAP INC	271	315	789	87,293	専門小売り
GARTNER INC	100	127	1,820	201,243	情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS	287	345	6,045	668,300	航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	9,760	11,980	12,087	1,336,187	コングロマリット
GENERAL MILLS	650	805	3,625	400,787	食品
GENERAL MOTORS CO	1,498	1,757	6,868	759,201	自動車
GENUINE PARTS CO	161	196	2,108	233,102	販売
GILEAD SCIENCES INC	1,476	1,786	12,071	1,334,391	バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	168	212	2,613	288,947	情報技術サービス
GODADDY INC - CLASS A	—	227	1,653	182,824	情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	415	495	9,825	1,086,138	資本市場
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	283	340	638	70,619	自動車部品
WR GRACE & CO	83	—	—	—	化学
GRAINGER(W.W.) INC	62	64	2,035	225,044	商社・流通業
GRUBHUB INC	—	119	990	109,456	インターネット販売・通信販売
HCA HEALTHCARE INC	333	375	5,409	597,993	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	229	229	1,003	110,899	商社・流通業
HP INC	1,896	2,190	5,098	563,568	コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	997	1,196	3,809	421,075	エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC	433	510	957	105,816	繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC	194	224	835	92,358	自動車
HARRIS CORP	135	160	2,636	291,471	航空宇宙・防衛
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	402	482	2,348	259,634	保険
HASBRO INC	126	158	1,365	150,900	レジャー用品
HELMERICH & PAYNE	128	146	838	92,636	エネルギー設備・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	88	106	1,418	156,764	情報技術サービス
HERSHEY CO/THE	166	190	2,077	229,663	食品
HESS CORP	319	366	2,107	232,955	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,860	2,000	3,218	355,717	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC	220	395	3,229	356,947	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	197	236	1,366	151,020	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	311	370	1,712	189,325	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT	1,330	1,573	30,262	3,345,266	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	814	1,023	15,684	1,733,779	コングロマリット
HORMEL FOODS CORP	328	391	1,689	186,715	食品
HUMANA INC	162	190	5,917	654,111	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	98	118	1,340	148,163	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,260	1,540	2,157	238,494	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	51	56	1,243	137,456	航空宇宙・防衛
IAC/INTERACTIVE CORP	82	104	2,288	252,938	インタラクティブ・メディアおよびサービス
IPG PHOTONICS CORP	42	47	732	80,979	電子装置・機器・部品
IDEX CORP	85	103	1,484	164,089	機械
IDEXX LABORATORIES INC	96	121	2,544	281,229	ヘルスケア機器・用品
ILLINOIS TOOL WORKS INC	351	418	6,027	666,332	機械
ILLUMINA INC	164	201	6,029	666,487	ライフサイエンス・ツール/サービス
INCYTE CORP	198	249	2,095	231,618	バイオテク ノロジー
INGREDION INC	84	96	900	99,507	食品
INTEL CORP	5,300	6,339	32,747	3,619,883	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	666	785	5,926	655,142	資本市場
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	998	1,257	17,350	1,917,910	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	87	115	1,518	167,812	化学
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	445	523	2,465	272,585	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP	443	500	1,169	129,221	メディア
INTUIT INC	274	337	7,862	869,163	ソフトウェア
INTUITIVE SURGICAL INC	128	155	8,523	942,208	ヘルスケア機器・用品
IQVIA HOLDINGS INC	155	224	3,177	351,234	ライフサイエンス・ツール/サービス
JPMORGAN CHASE & CO	3,972	4,618	48,742	5,388,050	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	141	179	1,230	135,973	建設・土木
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	—	420	882	97,589	各種金融サービス
JOHNSON & JOHNSON	3,030	3,686	50,269	5,556,809	医薬品
JONES LANG LASALLE INC	54	63	1,039	114,878	不動産管理・開発
JUNIPER NETWORKS INC	424	467	1,266	139,999	通信機器
KLA TENCOR CORP	173	219	2,369	261,909	半導体・半導体製造装置
KANSAS CITY SOUTHERN	118	142	1,527	168,802	陸運・鉄道
KELLOGG CO	284	356	2,021	223,481	食品
KEYCORP	1,240	1,460	2,556	282,591	銀行
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	—	252	2,025	223,907	電子装置・機器・部品
KIMBERLY-CLARK CORP	399	481	5,696	629,742	家庭用品
KINDER MORGAN INC	2,260	2,730	5,132	567,335	石油・ガス・消耗燃料
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	143	167	559	61,896	陸運・鉄道
KOHL'S CORP	196	225	1,483	163,977	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE	684	847	4,033	445,853	食品
KROGER CO	1,009	1,076	3,174	350,876	食品・生活必需品小売り
L BRANDS, INC	270	303	828	91,571	専門小売り
LKQ CORP	337	450	1,221	135,052	販売
L3 TECHNOLOGIES INC	90	109	2,313	255,725	航空宇宙・防衛
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	118	142	2,132	235,717	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH	181	212	3,839	424,374	半導体・半導体製造装置
LAMB WESTON HOLDINGS INC	—	193	1,341	148,294	食品
LAS VEGAS SANDS CORP	448	549	3,311	366,000	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	253	311	4,820	532,892	パーソナル用品
LEAR CORP	77	93	1,460	161,389	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	159	189	849	93,909	家庭用耐久財
LEIDOS HOLDINGS INC	161	200	1,267	140,098	情報技術サービス
LENNAR CORP-A	326	407	1,990	220,000	家庭用耐久財
LENNOX INTERNATIONAL INC	45	51	1,258	139,083	建設関連製品
LEUCADIA NATIONAL CORP	366	—	—	—	各種金融サービス
LIBERTY BROADBAND CORP-C	124	139	1,237	136,825	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	532	—	—	—	インターネット販売・通信販売
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	98	129	525	58,079	メディア



銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	197	224	912	100,876	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	224	293	920	101,796	娯楽
ELI LILLY & CO.	1,114	1,331	16,302	1,802,032	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	244	299	1,842	203,630	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	161	208	1,171	129,538	娯楽
LOCKHEED MARTIN	293	349	10,746	1,187,962	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	333	361	1,685	186,356	保険
LOWES COS INC	942	1,118	11,654	1,288,236	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	121	138	2,085	230,480	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP	157	189	3,255	359,907	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	535	700	1,974	218,283	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	104	120	2,102	232,359	資本市場
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	95	—	—	—	運送インフラ
MACYS INC	359	437	1,087	120,185	複合小売り
MANPOWERGROUP INC	71	80	675	74,663	専門サービス
MARATHON OIL CORP	990	1,190	2,032	224,674	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	566	946	6,163	681,279	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	15	18	1,878	207,619	保険
MARSH & MCLENNAN COS	579	691	6,299	696,308	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	362	409	4,950	547,277	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	69	89	1,691	186,982	建設資材
MASCO CORP	357	428	1,603	177,227	建設関連製品
MASTERCARD INC	1,064	1,269	28,185	3,115,653	情報技術サービス
MATTEL INC	400	480	663	73,327	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	312	374	2,088	230,894	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	139	168	2,158	238,578	食品
MCDONALD'S CORP	913	1,067	19,202	2,122,677	ホテル・レストラン・レジャー
MCKESSON CORP	238	270	3,660	404,589	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	283	340	739	81,706	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC	47	57	2,073	229,182	インターネット販売・通信販売
MERCK & CO INC	3,074	3,656	29,178	3,225,395	医薬品
METLIFE INC	1,025	1,159	5,199	574,727	保険
METTLER-TOLEDO INTL	28	34	2,287	252,860	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP	8,263	10,004	108,263	11,967,423	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	267	330	3,006	332,316	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	1,187	1,606	6,743	745,436	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	65	75	947	104,684	機械
MOHAWK INDUSTRIES	72	87	1,211	133,877	家庭用耐久財
MOLSON COORS BREWING CO-B	220	256	1,559	172,364	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,707	2,024	9,747	1,077,497	食品
MONSANTO CO	502	—	—	—	化学
MONSTER BEVERAGE CORP	454	559	3,282	362,841	飲料
MOODYS CORP	195	235	3,977	439,685	資本市場
MORGAN STANLEY	1,558	1,789	7,512	830,377	資本市場
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	—	450	404	44,669	食品・生活必需品小売り
MOSAIC CO/THE	394	488	1,566	173,212	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	179	221	3,063	338,663	通信機器
NRG ENERGY INC	—	400	1,698	187,741	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NVR INC	3	4	1,278	141,288	家庭用耐久財
NASDAQ INC	127	154	1,351	149,395	資本市場
NATIONAL OILWELL VARCO INC	442	506	1,508	166,736	エネルギー設備・サービス
NEKTAR THERAPEUTICS	—	250	1,042	115,210	医薬品
NETAPP INC	300	352	2,253	249,141	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	486	599	21,383	2,363,748	娯楽

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		1,290	1,610	1,144	126,536	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		239	307	2,164	239,281	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		243	300	1,158	128,104	コングロマリット
NEW YORK COMMUNITY BANCORP		560	—	—	—	貯蓄・抵当・不動産金融
NEWELL BRANDS INC		565	670	1,149	127,090	家庭用耐久財
NEWFIELD EXPLORATION CO		229	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO		612	717	2,383	263,450	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I		460	550	701	77,516	メディア
NEXTERA ENERGY INC		527	650	11,962	1,322,345	電力
NIKE INC-B	1,484	1,764	15,061	1,664,846	繊維・アパレル・贅沢品	
NISOURCE INC		382	476	1,289	142,486	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC		518	644	1,458	161,169	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC		150	150	666	73,685	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP		326	387	7,077	782,299	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP		247	284	2,643	292,240	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP		186	228	6,568	726,134	航空宇宙・防衛
NUCOR CORP		366	427	2,540	280,843	金属・鉱業
NVIDIA CORP		676	796	12,524	1,384,432	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP		225	286	1,197	132,401	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,		98	110	4,295	474,786	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP		873	1,057	7,101	785,053	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE		69	86	1,258	139,145	陸運・鉄道
OMNICOM GROUP		268	303	2,272	251,202	メディア
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION		—	590	1,355	149,807	半導体・半導体製造装置
ONEOK INC		436	560	3,791	419,141	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,497	4,108	21,246	2,348,596	ソフトウェア	
OWENS CORNING INC		124	142	776	85,845	建設関連製品
PG&E CORP		585	—	—	—	電力
PNC FINANCIAL		542	641	7,958	879,678	銀行
PPG INDUSTRIES		289	326	3,556	393,189	化学
PPL CORPORATION		773	976	2,972	328,623	電力
PVH CORP		90	99	1,117	123,551	繊維・アパレル・贅沢品
PTC INC		—	147	1,351	149,380	ソフトウェア
PACCAR		397	478	3,255	359,827	機械
PACKAGING CORP OP AMERICA		109	132	1,299	143,680	容器・包装
PALO ALTO NETWORKS INC		107	126	2,857	315,846	ソフトウェア
PARKER HANNIFIN CORP		151	181	3,143	347,454	機械
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A		261	370	693	76,605	石油・ガス・消耗燃料
PAYCHEX INC		374	450	3,410	376,952	情報技術サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	1,286	1,549	14,701	1,625,110	情報技術サービス	
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC		410	500	867	95,838	銀行
PEPSICO INC	1,607	1,945	22,544	2,492,068	飲料	
PFIZER INC	6,708	8,057	34,161	3,776,232	医薬品	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,751	2,140	17,860	1,974,293	タバコ	
PHILLIPS 66		493	610	5,855	647,254	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP		124	154	1,385	153,140	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		192	232	3,372	372,754	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A		140	190	460	50,868	石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INDUSTRIES INC		71	83	720	79,619	レジャー用品
PRAXAIR INC		321	—	—	—	化学
T ROWE PRICE GROUP INC		275	339	3,307	365,662	資本市場
PRICELINE GROUP INC/THE		55	—	—	—	インターネット販売・通信販売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		334	380	1,930	213,344	保険
PROCTER & GAMBLE CO		2,876	3,422	33,699	3,725,182	家庭用品

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
PROGRESSIVE CO		656	808	5,757	636,468	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		484	572	5,385	595,299	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE		572	695	3,914	432,680	総合公益事業
PULTEGROUP INC		293	379	1,027	113,618	家庭用耐久財
QORVO INC		142	176	1,146	126,769	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC		1,668	1,938	10,073	1,113,549	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS INC		153	191	1,677	185,394	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
QURATE RETAIL INC - A		—	580	1,267	140,151	インターネット販売・通信販売
RALPH LAUREN CORPORATION		58	78	975	107,854	繊維・アパレル・贅沢品
RANGE RESOURCES CORP		310	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		149	177	1,457	161,083	資本市場
RAYTHEON COMPANY		329	394	7,273	804,027	航空宇宙・防衛
RED HAT INC		203	243	4,397	486,134	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS		88	110	4,680	517,396	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP		1,370	1,530	2,448	270,601	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		72	90	1,299	143,617	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A		260	308	2,391	264,301	商業サービス・用品
RESMED INC		157	192	1,928	213,191	ヘルスケア機器・用品
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC		133	171	1,145	126,607	専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC		146	168	2,980	329,426	電気設備
ROCKWELL COLLINS INC		184	—	—	—	航空宇宙・防衛
ROLLINS INC		120	210	842	93,108	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC		115	143	4,476	494,846	コングロマリット
ROSS STORES INC		443	522	4,907	542,455	専門小売り
S&P GLOBAL INC		290	344	6,822	754,126	資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY		150	191	996	110,147	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		198	306	1,831	202,477	ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP		59	74	1,827	202,004	銀行
SABRE CORP		260	360	811	89,656	情報技術サービス
SALESFORCE.COM INC		768	990	15,745	1,740,557	ソフトウェア
SCANA CORP		141	—	—	—	総合公益事業
HENRY SCHEIN INC		174	205	1,278	141,380	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD		1,564	1,911	8,589	949,532	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP		1,365	1,662	7,705	851,714	資本市場
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A		91	—	—	—	メディア
SEALED AIR CORP		219	219	923	102,037	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC		115	154	1,100	121,681	バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY		269	371	4,276	472,685	総合公益事業
SERVICENOW INC		193	241	5,660	625,750	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS		94	116	5,116	565,572	化学
SIGNATURE BANK		65	76	1,015	112,279	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC		1,820	2,290	1,380	152,641	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC		211	238	1,984	219,360	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP		165	186	960	106,174	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW		126	159	1,643	181,699	食品
SNAP-ON INC		67	74	1,167	129,063	機械
SOUTHERN CO.		1,121	1,402	6,808	752,568	電力
SOUTHWEST AIRLINES		176	198	1,142	126,287	旅客航空輸送業
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC		26	—	—	—	家庭用品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A		132	146	1,397	154,464	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC		150	197	2,684	296,703	ソフトウェア
SPRINT CORP		900	1,090	686	75,907	無線通信サービス
SQUARE INC - A		281	418	3,161	349,500	情報技術サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC		173	211	2,877	318,115	機械

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
STARBUCKS CORP		1,633	1,859	13,144	1,453,047	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP		424	522	3,688	407,721	資本市場
STEEL DYNAMICS		271	334	1,238	136,937	金属・鉱業
STERICYCLE INC		89	—	—	—	商業サービス・用品
STRYKER CORP		378	465	8,687	960,326	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.		547	635	4,135	457,096	銀行
SYMANTEC CORP		713	830	1,921	212,397	ソフトウェア
SYNOPSYS INC		166	207	2,104	232,593	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL		888	962	3,054	337,627	消費者金融
SYSCO CORP		574	678	4,579	506,186	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP		294	379	2,154	238,213	資本市場
TJX COS INC		723	1,696	8,519	941,691	専門小売り
T-MOBILE US INC		334	472	3,400	375,920	無線通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC		118	157	1,464	161,920	娯楽
TAPESTRY INC		330	383	1,375	152,031	繊維・アパレル・贅沢品
TARGET CORP		591	686	4,996	552,348	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP		249	299	1,360	150,417	石油・ガス・消耗燃料
TELEFLEX INC		49	63	1,806	199,726	ヘルスケア機器・用品
TESARO INC		37	—	—	—	バイオテクノロジー
TESLA INC		151	175	5,394	596,259	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR		1,050	1,330	2,391	264,338	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC		1,119	1,339	14,403	1,592,176	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC		294	335	1,836	203,003	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		450	555	14,013	1,549,018	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP		672	808	16,875	1,865,460	コングロマリット
TIFFANY & CO		139	144	1,307	144,581	専門小売り
TIME WARNER INC		874	—	—	—	メディア
TOLL BROTHERS INC		185	—	—	—	家庭用耐久財
TORCHMARK CORP		125	140	1,167	129,004	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC		183	222	2,059	227,681	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY		149	163	1,590	175,819	専門小売り
TRANSDIGM GROUP INC		57	63	2,794	308,911	航空宇宙・防衛
TRUNSONIC		172	253	1,597	176,553	専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE		316	367	4,724	522,274	保険
TRIMBLE INC		284	349	1,368	151,266	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC		123	146	829	91,684	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC		1,188	1,441	7,262	802,812	娯楽
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B		510	594	2,971	328,435	娯楽
TWITTER INC		700	942	2,941	325,193	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TYSON FOODS INC-CL A		327	410	2,567	283,757	食品
UGI CORP		204	227	1,213	134,094	ガス
US BANCORP		1,891	2,112	10,836	1,197,885	銀行
ULTA BEAUTY INC		65	78	2,417	267,195	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A		184	240	507	56,136	繊維・アパレル・贅沢品
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		187	250	476	52,617	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP		904	1,018	17,330	1,915,705	陸運・鉄道
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC		92	92	812	89,808	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		775	946	10,488	1,159,376	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC		94	112	1,510	166,963	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES		858	1,128	14,411	1,593,028	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP		52	63	753	83,310	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC		1,090	1,323	35,870	3,965,124	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		98	118	1,599	176,781	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP		250	312	1,133	125,262	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
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
V F CORP		378	454	3,945	436,109	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC		44	54	1,116	123,431	ホテル・レストラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP		504	580	4,895	541,115	石油・ガス・消耗燃料
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		107	129	1,712	189,282	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		126	167	2,017	223,017	ヘルスケア・テクノロジー
VERISIGN INC		101	147	2,578	285,014	情報技術サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	4,601	5,680	31,330	3,463,315	3,463,315	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	173	219	2,745	303,523	303,523	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	289	350	6,582	727,624	727,624	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B	413	502	1,463	161,756	161,756	娯楽
VISA INC-CLASS A SHARES	2,064	2,442	35,387	3,911,681	3,911,681	情報技術サービス
VISTRA ENERGY CORP	290	482	1,277	141,246	141,246	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
VMWARE INC - CLASS A	84	100	1,696	187,564	187,564	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	195	217	1,075	118,928	118,928	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	153	186	2,104	232,620	232,620	建設資材
WABCO HOLDINGS INC	60	70	817	90,354	90,354	機械
WEC ENERGY GROUP INC	358	435	3,239	358,088	358,088	総合公益事業
WABTEC CORP	103	115	861	95,239	95,239	機械
WALMART INC	1,684	2,030	20,297	2,243,737	2,243,737	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,030	1,164	8,547	944,813	944,813	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	303	368	3,047	336,901	336,901	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC	500	593	5,874	649,340	649,340	商業サービス・用品
WATERS CORP	93	106	2,487	274,991	274,991	ライフサイエンス・ツール/サービス
WAYFAIR INC - CLASS A	—	75	915	101,235	101,235	インターネット販売・通信販売
WELLCARE HEALTH PLANS INC	—	70	1,968	217,543	217,543	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WELLS FARGO CO	5,322	6,290	30,959	3,422,249	3,422,249	銀行
WESTAR ENERGY INC	158	—	—	—	—	電力
WESTERN DIGITAL CORP	329	383	1,824	201,734	201,734	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	528	590	1,050	116,089	116,089	情報技術サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	—	50	404	44,702	44,702	化学
WESTROCK CO	292	342	1,335	147,627	147,627	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	82	93	1,296	143,265	143,265	家庭用耐久財
WILLIAMS COS	935	1,681	4,584	506,724	506,724	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A	155	199	3,796	419,689	419,689	ソフトウェア
WORLDPAY INC - CL A	335	407	3,590	396,944	396,944	情報技術サービス
WYNDHAM DESTINATIONS INC	119	—	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN RESORTS LTD	91	138	1,718	189,934	189,934	ホテル・レストラン・レジャー
XPO LOGISTICS INC	—	180	935	103,405	103,405	航空貨物・物流サービス
XCEL ENERGY INC	574	708	3,784	418,390	418,390	電力
XILINX INC	286	349	4,163	460,279	460,279	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	244	289	880	97,307	97,307	コンピュータ・周辺機器
XYLEM INC	206	239	1,766	195,316	195,316	機械
YUM BRANDS INC	377	441	4,150	458,817	458,817	ホテル・レストラン・レジャー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	222	264	678	75,028	75,028	各種電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	109	160	594	65,758	65,758	インタラクティブ・メディアおよびサービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	229	284	3,511	388,178	388,178	ヘルスケア機器・用品
ZIONS BANCORP NA	226	275	1,378	152,326	152,326	銀行
ZOETIS INC	553	660	6,294	695,785	695,785	医薬品
ALKERMES PLC	174	201	654	72,299	72,299	バイオテクノロジー
ALLEGION PLC	108	136	1,245	137,646	137,646	建設関連製品
ALLERGAN PLC	379	464	6,452	713,297	713,297	医薬品
AON PLC	295	329	5,657	625,414	625,414	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	145	560	1,764	194,992	194,992	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	114	214	948	104,865	104,865	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
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円		
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD		85	—	—	—	保険	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		249	292	779	86,116	化学	
ACCENTURE PLC-CL A		698	883	14,060	1,554,193	情報技術サービス	
BUNGE LIMITED		156	191	999	110,442	食品	
CAPRI HOLDINGS LTD		—	199	885	97,866	繊維・アパレル・贅沢品	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		243	292	1,363	150,672	飲料	
EATON CORP PLC		504	601	4,731	523,039	電気設備	
EVEREST RE GROUP LTD		45	56	1,214	134,284	保険	
IHS MARKIT LTD		445	547	2,922	323,006	専門サービス	
INGERSOLL-RAND PLC		293	334	3,497	386,666	機械	
INVESCO LTD		469	580	1,093	120,917	資本市場	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		70	78	982	108,578	医薬品	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC		1,056	1,271	4,461	493,142	建設関連製品	
LIBERTY GLOBAL PLC-A		240	240	615	68,074	メディア	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C		646	695	1,724	190,680	メディア	
LINDE PLC		—	759	12,792	1,414,048	化学	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD		465	860	1,619	179,006	半導体・半導体製造装置	
MEDTRONIC PLC		1,535	1,859	17,152	1,896,091	ヘルスケア機器・用品	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD		179	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品	
APTIV PLC		303	367	2,970	328,399	自動車部品	
NIELSEN HOLDINGS PLC		393	472	1,241	137,219	専門サービス	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		200	302	1,601	177,030	ホテル・レストラン・レジャー	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD		42	59	838	92,721	保険	
SEAGATE TECHNOLOGY		324	378	1,727	190,995	コンピュータ・周辺機器	
PENTAIR PLC		189	232	991	109,556	機械	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		—	243	1,197	132,345	電気設備	
TECHNIPFMC PLC		516	610	1,435	158,728	エネルギー設備・サービス	
WILLIS TOWERS WATSON PLC		148	178	3,018	333,628	保険	
PERRIGO CO PLC		142	165	807	89,280	医薬品	
XL GROUP LTD		290	—	—	—	保険	
CHUBB LTD		527	633	8,432	932,094	保険	
GARMIN LTD		133	152	1,088	120,336	家庭用耐久財	
TE CONNECTIVITY LTD		400	479	3,934	434,920	電子装置・機器・部品	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.		153	172	2,065	228,344	ソフトウェア	
WIX.COM LTD		—	57	691	76,491	情報技術サービス	
AERCAP HOLDINGS NV		149	169	812	89,800	商社・流通業	
LYONDELLBASELL INDU-CL A		386	455	3,987	440,791	化学	
MYLAN NV		524	693	2,206	243,907	医薬品	
NXP SEMICONDUCTORS NV		386	468	4,354	481,321	半導体・半導体製造装置	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		194	—	—	—	電気設備	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		195	227	2,677	296,017	ホテル・レストラン・レジャー	
BROADCOM LTD		459	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
FLEX LTD		620	760	779	86,110	電子装置・機器・部品	
小 計	株 数 ・ 金 額	345,982	416,909	3,276,844	362,222,368		
	銘 柄 数 < 比 率 >	601	593	—	<65.6%>		
(カナダ)				千カナダドル			
ARC RESOURCES LTD		400	500	507	42,339	石油・ガス・消耗燃料	
AGNICO EAGLE MINES LTD		256	331	1,891	158,000	金属・鉱業	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B		477	596	4,350	363,285	食品・生活必需品小売り	
ALTAGAS LTD		208	338	532	44,484	ガス	
ATCO LTD CL1		96	96	401	33,494	総合公益事業	
AURORA CANNABIS INC		—	970	902	75,334	医薬品	
BCE INC		174	198	1,135	94,795	各種電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL		736	876	8,596	717,867	銀行	

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	1,355	1,682	12,576	1,050,247	銀行
BARRICK GOLD	1,340	2,366	4,050	338,264	金属・鉱業
BAUSCH HEALTH COS INC	—	425	1,430	119,500	医薬品
BLACKBERRY LTD	600	710	816	68,185	ソフトウェア
BOMBARDIER B SHEARS	2,320	2,620	655	54,699	航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	945	1,168	6,808	568,558	資本市場
CAE INC	310	360	1,001	83,666	航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B	155	212	1,258	105,127	容器・包装
CGI INC	—	338	2,970	248,053	情報技術サービス
CI FINANCIAL CORP	282	336	649	54,238	資本市場
CAMECO CORP	480	560	913	76,321	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	495	615	6,952	580,609	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	851	1,001	11,149	931,064	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,223	1,677	6,183	516,350	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	166	198	5,360	447,634	陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A	70	86	1,207	100,854	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	157	157	523	43,686	総合公益事業
CANOPY GROWTH CORP	—	275	1,727	144,244	医薬品
CENOVUS ENERGY INC	1,170	1,400	1,607	134,217	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE INC	22	27	2,979	248,796	ソフトウェア
CRESCENT POINT ENERGY CORP	650	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	120	418	1,491	124,583	複合小売り
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	490	—	—	—	各種金融サービス
EMERA INC	76	76	353	29,480	電力
EMPIRE CO LTD A	210	260	798	66,722	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	1,070	2,060	1,882	157,235	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	1,848	2,759	13,077	1,092,115	石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	32	38	2,526	210,981	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	196	240	633	52,871	商社・流通業
FIRST CAPITAL REALTY INC	180	250	545	45,554	不動産管理・開発
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	800	1,010	1,415	118,167	金属・鉱業
FORTIS INC	460	583	2,715	226,780	電力
FRANCO-NEVADA CORP	206	254	2,568	214,491	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	241	278	1,269	106,003	繊維・アパレル・贅沢品
GOLDCORP INC	1,010	1,210	1,733	144,800	金属・鉱業
GREAT-WEST LIFE CO INC	332	420	1,237	103,363	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	233	—	—	—	情報技術サービス
HUSKY ENERGY INC	430	520	812	67,830	石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD	350	420	870	72,673	電力
IGM FINANCIAL INC	103	103	351	29,348	資本市場
IA FINANCIAL CORP INC	—	147	735	61,392	保険
IMPERIAL OIL	344	375	1,358	113,427	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	121	—	—	—	保険
INTACT FINANCIAL CORP	163	189	2,064	172,370	保険
INTER PIPELINE LTD	409	520	1,108	92,582	石油・ガス・消耗燃料
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	94	—	—	—	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP	209	285	814	67,997	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP	1,400	1,740	798	66,696	金属・鉱業
LINAMAR CORP	48	—	—	—	自動車部品
LOBLAW COMPANIES	240	261	1,741	145,423	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP	730	950	618	51,646	金属・鉱業
MAGNA INTERNATIONAL INC	393	456	3,137	262,032	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	2,222	2,750	5,904	493,063	保険
METHANEX CORP	103	86	651	54,416	化学

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
METRO INC	267	334	1,622	135,473	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	392	460	2,860	238,900	銀行
NUTRIEN LTD	719	854	6,042	504,642	化学
ONEX CORPORATION	92	109	838	70,017	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP	295	354	1,759	146,925	ソフトウェア
PEMBINA PIPELINE CORP	571	706	3,435	286,889	石油・ガス・消耗燃料
POWER CORPORATION OF CANADA	409	460	1,247	104,141	保険
POWER FINANCIAL CORP	278	325	919	76,754	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	246	310	575	48,100	石油・ガス・消耗燃料
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	259	320	2,741	228,964	ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	412	502	3,644	304,311	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,642	1,983	20,109	1,679,352	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	197	—	—	—	建設・土木
SNC-LAVALIN GROUP INC	—	252	853	71,298	建設・土木
SAPUTO INC	239	321	1,336	111,596	食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	290	370	394	32,907	石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	460	630	1,698	141,840	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A	90	122	2,879	240,492	情報技術サービス
STARS GROUP INC/THE	—	230	489	40,911	ホテル・レストラン・レジャー
SUN LIFE FINANCIAL INC	694	838	4,111	343,328	保険
SUNCOR ENERGY INC	1,880	2,222	9,972	832,789	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD-CLS B	629	680	1,948	162,750	金属・鉱業
TELUS CORP	193	293	1,380	115,246	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	316	282	1,980	165,430	専門サービス
TORONTO DOMINION BANK	2,083	2,515	18,953	1,582,768	銀行
TOURMALINE OIL CORP	265	330	671	56,053	石油・ガス・消耗燃料
TRANSCANADA CORP	979	1,257	7,132	595,611	石油・ガス・消耗燃料
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	1,260	1,260	283	23,675	金属・鉱業
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	380	—	—	—	医薬品
VERMILION ENERGY INC	120	185	602	50,333	石油・ガス・消耗燃料
WSP GLOBAL INC	—	132	925	77,251	建設・土木
WEST FRASER TIMBER	84	84	599	50,071	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE)LTD	59	107	1,040	86,898	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	512	630	1,779	148,574	金属・鉱業
小計	株数・金額	46,113	58,234	247,183	20,642,288
	銘柄数<比率>	88	88	—	<3.7%>
(イギリス)			千英ポンド		
ANTOFAGASTA PLC	480	590	515	73,501	金属・鉱業
ASHTED GROUP PLC	557	680	1,382	197,232	商社・流通業
BHP BILLITON PLC	2,380	—	—	—	金属・鉱業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	1,130	1,450	817	116,592	家庭用耐久財
SKY PLC	1,140	—	—	—	メディア
AVIVA PLC	4,590	5,420	2,294	327,325	保険
DIAGEO PLC	2,848	3,391	10,391	1,482,586	飲料
SCHRODERS PLC	133	158	426	60,817	資本市場
DCC PLC	98	128	869	124,088	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC	3,600	4,410	2,324	331,575	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	2,585	3,162	9,040	1,289,759	タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	3,750	3,830	2,443	348,565	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	1,079	1,295	3,433	489,884	タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	22,670	27,380	18,232	2,601,208	銀行
LEGAL & GENERAL	6,750	8,080	2,152	307,098	保険
MEGGITT PLC	950	1,110	616	87,891	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS	2,460	3,150	748	106,824	食品・生活必需品小売り



銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千英ポンド	千円	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		392	494	1,119	159,705	食品
PEARSON		910	1,090	1,003	143,162	メディア
PERSIMMON PLC		355	426	1,024	146,169	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC		2,928	3,550	5,440	776,178	保険
RIO TINTO PLC-REG		1,387	1,620	7,124	1,016,489	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC		620	700	664	94,795	資本市場
TRAVIS PERKINS PLC		302	—	—	—	商社・流通業
SSE PLC		1,100	1,370	1,641	234,256	電力
BP PLC		22,260	27,490	14,940	2,131,606	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC		81,500	97,300	5,686	811,251	銀行
TAYLOR WIMPEY PLC		3,660	4,500	738	105,386	家庭用耐久財
TESCO PLC		9,300	13,620	3,053	435,657	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC		1,020	1,230	1,784	254,627	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC		5,560	6,830	10,798	1,540,583	医薬品
WEIR GROUP PLC		266	370	579	82,745	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC		259	390	215	30,736	商業サービス・用品
ASTRAZENECA PLC		1,424	1,745	10,890	1,553,754	医薬品
GKN PLC		1,930	—	—	—	自動車部品
BT GROUP PLC		9,560	11,450	2,647	377,681	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC		205	229	993	141,728	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC		1,810	2,080	593	84,723	複合小売り
BARCLAYS PLC		19,160	23,700	3,780	539,314	銀行
INTERTEK GROUP PLC		179	216	1,120	159,877	専門サービス
BURBERRY GROUP PLC		504	550	1,074	153,248	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC		162	198	935	133,446	複合小売り
KINGFISHER PLC		2,460	2,730	615	87,829	専門小売り
ITV PLC		4,000	5,000	665	94,946	メディア
SAINSBURY		1,990	2,550	729	104,121	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD		109	—	—	—	金属・鉱業
G4S PLC		1,790	2,190	449	64,114	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC		229	270	578	82,588	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS		148	171	653	93,219	家庭用耐久財
CENTRICA PLC		6,500	7,800	1,072	153,069	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS		5,084	6,323	15,326	2,186,696	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B		4,220	5,156	12,598	1,797,454	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE		368	444	1,104	157,603	商社・流通業
COBHAM PLC		2,540	—	—	—	航空宇宙・防衛
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC		363	426	1,995	284,742	資本市場
UNILEVER PLC		1,429	1,545	6,564	936,586	パーソナル用品
TUI AG-DI		490	600	485	69,252	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC		750	920	453	64,696	資本市場
EXPERIAN PLC		1,067	1,262	2,558	364,960	専門サービス
MONDI PLC		408	494	936	133,557	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC		277	324	630	89,907	水道
WHITBREAD PLC		206	245	1,216	173,547	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC		303	401	667	95,255	資本市場
SMITHS GROUP PLC		470	540	805	114,907	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC		1,510	1,433	2,796	398,915	金属・鉱業
3I GROUP PLC		1,140	1,320	1,250	178,343	資本市場
CAPITA PLC		760	—	—	—	専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		751	928	5,583	796,637	家庭用品
RELX PLC		1,212	2,710	4,661	665,013	専門サービス
SHIRE PLC		1,020	—	—	—	バイオテクノロジー
FRESNILLO PLC		260	260	252	35,966	金属・鉱業

銘柄		株数	株数	当 期 末		業 種 等
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		百株	百株	千英ポンド	千円	
UNITED UTILITIES GROUP PLC		760	960	784	111,898	水道
GLENCORE PLC		13,860	15,790	4,794	684,050	金属・鉱業
WOOD GROUP (JOHN) PLC		730	860	449	64,194	エネルギー設備・サービス
GVC HOLDINGS PLC		—	710	454	64,879	ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		1,880	2,280	2,214	315,984	航空宇宙・防衛
OLD MUTUAL PLC		5,740	—	—	—	保険
NMC HEALTH PLC		—	133	368	52,636	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EASYJET PLC		163	210	268	38,304	旅客航空輸送業
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		3,970	6,500	1,608	229,520	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)		1,190	1,430	942	134,447	ソフトウェア
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		375	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WPP PLC		1,440	1,690	1,430	204,029	メディア
COCA-COLA HBC AG-DI		193	290	742	106,000	飲料
CONVATEC GROUP PLC-WI		1,570	2,100	248	35,518	ヘルスケア機器・用品
COMPASS GROUP PLC		1,782	2,150	3,748	534,802	ホテル・レストラン・レジャー
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC		197	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC		480	580	974	139,017	ソフトウェア
NATIONAL GRID PLC		3,870	4,710	3,966	565,937	総合公益事業
ROYAL MAIL PLC		1,080	1,360	379	54,173	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI		890	890	314	44,860	ホテル・レストラン・レジャー
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		—	3,230	755	107,717	各種金融サービス
FERGUSON PLC		291	—	—	—	商社・流通業
FERGUSON PLC		—	325	1,778	253,770	商社・流通業
IMI PLC		320	—	—	—	機械
BHP GROUP PLC		—	2,890	5,181	739,200	金属・鉱業
VODAFONE GROUP PLC		30,000	36,500	5,153	735,292	無線通信サービス
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC		—	237	1,101	157,188	ホテル・レストラン・レジャー
RSA INSURANCE GROUP PLC		1,120	1,400	750	107,059	保険
INFORMA PLC		—	1,730	1,218	173,908	メディア
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC		3,110	—	—	—	各種金融サービス
AUTO TRADER GROUP PLC		1,190	1,380	626	89,424	インタラクティブ・メディアおよびサービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		1,570	1,830	640	91,432	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC		155	172	887	126,573	化学
MELROSE INDUSTRIES PLC		—	6,800	1,156	164,926	電気設備
JOHNSON MATTHEY PLC		218	267	826	117,897	化学
小計	株数・金額	343,951	410,828	241,961	34,520,667	
	銘柄数<比率>	98	92	—	<6.2%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SIKA AG-BR		2	—	—	—	化学
SGS SA-REG		6	7	1,852	203,977	専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG		2	3	512	56,392	食品
SWISSCOM AG-REG		29	35	1,570	172,968	各種電気通信サービス
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC		1	1	879	96,817	食品
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG		0.12	0.15	1,081	119,094	食品
GIVAUDAN-REG		10	12	3,058	336,845	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG		169	207	6,670	734,576	保険
NOVARTIS-REG		2,508	2,981	26,852	2,957,035	医薬品
ABB LTD		2,107	2,500	4,943	544,405	電気設備
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)		792	966	26,331	2,899,575	医薬品
ADECCO GROUP AG-REG		180	215	1,137	125,244	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD		515	670	3,210	353,555	建設資材
CLARIANT AG-REG		259	259	535	58,924	化学
NESTLE SA-REG		3,511	4,210	37,511	4,130,722	食品
BALOISE HOLDING AG		58	66	1,037	114,251	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	
TEMENOS AG-REG		—	84	1,183	130,333	ソフトウェア
SONOVA HOLDING AG-REG		58	76	1,439	158,469	ヘルスケア機器・用品
STRAUMANN HOLDING AG-REG		11	14	1,070	117,919	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		2,730	3,470	4,077	448,986	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B		35	41	1,172	129,076	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG		60	74	408	44,941	繊維・アパレル・贅沢品
LONZA AG-REG		85	103	3,038	334,548	ライフサイエンス・ツール/サービス
SWISS LIFE HOLDING AG		35	45	1,888	207,984	保険
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		9	12	676	74,495	化学
SWISS PRIME SITE-REG		81	101	854	94,093	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES		43	58	457	50,425	各種金融サービス
DUFREY AG-REG		36	44	438	48,317	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG		18	24	1,710	188,384	資本市場
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		44	55	1,229	135,425	機械
SCHINDLER HOLDING AG-REG		24	30	652	71,820	機械
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		59	73	1,010	111,256	海運業
GEBERIT AG-REG		40	50	1,974	217,376	建設関連製品
JULIUS BAER GROUP LTD		259	310	1,265	139,313	資本市場
SWISS RE LTD		361	414	4,020	442,766	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A		586	716	5,173	569,740	繊維・アパレル・贅沢品
SIKA AG-REG		—	180	2,345	258,275	化学
UBS GROUP AG		4,180	5,330	6,926	762,728	資本市場
VIFOR PHARMA AG		57	57	729	80,343	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額	18,969	23,497	160,928	17,721,409	
	銘 柄 数 < 比 率 >	37	38	—	<3.2%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS		46	92	2,651	31,631	各種金融サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB		1,750	2,210	21,693	258,801	銀行
SWEDBANK AB		1,026	1,260	26,409	315,066	銀行
SWEDISH MATCH AB		215	234	10,590	126,348	タバコ
NORDEA BANK AB		3,420	—	—	—	銀行
SECURITAS AB-B SHS		333	450	6,502	77,574	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS		516	617	25,420	303,265	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B		1,075	1,180	16,092	191,987	専門小売り
ERICSSON LM-B		3,490	4,170	36,145	431,216	通信機器
TELIA CO AB		2,870	3,960	15,733	187,695	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS		382	450	7,317	87,291	建設・土木
LUNDIN PETROLEUM AB		217	248	7,400	88,285	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB		350	389	7,737	92,304	機械
GETINGE AB-B SHS		268	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR		68	97	5,480	65,382	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB		78	105	3,688	44,005	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS		450	550	4,141	49,408	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B		265	340	8,078	96,375	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES		427	550	8,596	102,556	機械
VOLVO AB-B SHS		1,760	2,140	28,943	345,295	機械
SANDVIK AB		1,250	1,580	23,881	284,908	機械
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		206	250	4,683	55,877	各種金融サービス
BOLIDEN AB		301	—	—	—	金属・鉱業
HEXAGON AB-B SHS		285	361	17,017	203,019	電子装置・機器・部品
TELE 2 AB-B SHS		420	690	8,173	97,504	無線通信サービス
KINNEVIK AB - B		266	337	7,329	87,443	各種金融サービス
ATLAS COPCO AB-A		—	940	23,645	282,093	機械
ATLAS COPCO AB-B		—	529	12,365	147,518	機械

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	
BOLIDEN AB		—	363	8,672	103,457	金属・鉱業
EPIROC AB - A		—	920	8,328	99,362	機械
EPIROC AB - B		—	580	4,925	58,759	機械
ESSITY AKTIEBOLAG-B		696	817	21,119	251,955	家庭用品
ATLAS COPCO AB-A		757	—	—	—	機械
ATLAS COPCO AB-B		450	—	—	—	機械
SVENSKA HANDELSBANKEN-A		1,730	2,120	21,761	259,618	銀行
ASSA ABLOY AB-B		1,137	1,360	25,697	306,567	建設関連製品
NORDEA BANK ABP		—	4,130	35,063	418,309	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	26,504	34,019	465,288	5,550,890	
	銘柄 数 < 比 率 >	31	32	—	<1.0%>	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		1,120	1,350	21,978	281,538	銀行
TELENOR ASA		856	1,020	16,595	212,587	各種電気通信サービス
EQUINOR ASA		1,315	1,610	32,248	413,100	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA		206	232	7,892	101,104	化学
MOWI ASA		467	568	11,235	143,920	食品
NORSK HYDRO		1,480	1,840	6,381	81,742	金属・鉱業
AKER AB ASA		—	141	4,122	52,813	石油・ガス・消耗燃料
ORKLA ASA		910	1,150	7,783	99,702	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		250	250	3,802	48,710	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS		91	129	3,831	49,078	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額	6,695	8,290	115,870	1,484,299	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	10	—	<0.3%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG B		117	145	11,562	193,552	飲料
A P MOLLER-MAERSK A/S		7	8	7,958	133,228	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A		4	5	4,404	73,729	海運業
DANSKE BANK AS		854	970	12,066	201,998	銀行
GENMAB A/S		63	84	8,517	142,584	バイオテクノロジー
TDC A/S		970	—	—	—	各種電気通信サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		239	268	14,847	248,542	電気設備
H LUNDBECK A/S		82	105	2,969	49,707	医薬品
DSV A/S		221	265	14,193	237,597	陸運・鉄道
PANDORA A/S		124	162	5,422	90,766	繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S		114	137	9,009	150,812	化学
NOVOZYMES A/S-B SHARES		252	311	9,283	155,403	化学
COLOPLAST-B		130	164	10,289	172,243	ヘルスケア機器・用品
NOVO NORDISK A/S-B		2,099	2,503	82,774	1,385,640	医薬品
ISS A/S		186	218	4,220	70,650	商業サービス・用品
TRYG A/S		118	160	2,764	46,282	保険
ORSTED A/S		218	254	12,047	201,670	電力
WILLIAM DEMANT HOLDING		130	130	2,854	47,789	ヘルスケア機器・用品
小 計	株 数 ・ 金 額	5,929	5,890	215,185	3,602,201	
	銘柄 数 < 比 率 >	18	17	—	<0.7%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		211	258	5,138	641,899	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA		468	576	2,722	340,081	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		144	168	552	68,988	各種電気通信サービス
FUCHS PETROLUB SE -PPD		82	105	433	54,097	化学
HANNOVER RUECK SE		71	79	1,016	127,020	保険
GEA GROUP AG		207	242	496	62,008	機械
CONTINENTAL AG		124	154	2,135	266,751	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG		1,111	1,371	3,667	458,171	航空貨物・物流サービス

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
AXEL SPRINGER SE		59	59	314	39,286	メディア
MERCK KGAA		151	173	1,676	209,472	医薬品
RWE AG		579	720	1,608	200,947	総合公益事業
SAP SE		1,107	1,354	12,768	1,595,133	ソフトウェア
E.ON SE		2,490	3,070	2,959	369,727	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA		115	144	1,164	145,448	家庭用品
PUMA SE		—	10	469	58,653	繊維・アパレル・贅沢品
BAYER AG-REG		931	1,273	8,678	1,084,147	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		201	246	2,137	267,067	家庭用品
BASF SE		1,034	1,254	8,316	1,038,983	化学
BEIERSDORF AG		118	137	1,255	156,811	パーソナル用品
HOCHTIEF AG		20	26	347	43,395	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG		173	203	1,254	156,780	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE		244	294	2,013	251,596	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG		506	592	11,256	1,406,248	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		267	310	693	86,635	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		174	207	4,226	528,071	保険
VOLKSWAGEN AG		38	45	663	82,922	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF		209	252	3,638	454,605	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		1,089	1,257	6,361	794,764	自動車
MAN SE		37	—	—	—	機械
THYSSENKRUPP AG		481	620	822	102,707	金属・鉱業
SIEMENS AG		862	1,054	9,972	1,245,920	コングロマリット
1&1 DRILLISCH AG		59	80	273	34,120	無線通信サービス
DEUTSCHE BANK AG-REG		2,330	2,750	2,123	265,295	資本市場
BAYER MOTOREN WERK		373	449	3,177	396,974	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD		64	78	482	60,269	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG		3,740	4,600	6,559	819,490	各種電気通信サービス
SARTORIUS AG-VORZUG		—	45	667	83,428	ヘルスケア機器・用品
INFINEON TECHNOLOGIES AG		1,280	1,550	3,097	386,992	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG		221	269	2,993	374,036	資本市場
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE		171	203	1,137	142,121	自動車
FRAPORT AG		49	63	443	55,440	運送インフラ
WIRECARD AG		131	159	1,588	198,440	情報技術サービス
LANXESS		103	120	584	73,024	化学
MTU AERO ENGINES AG		58	69	1,351	168,782	航空宇宙・防衛
DEUTSCHE WOHNEN SE		413	484	2,061	257,585	不動産管理・開発
SYMRISE AG		136	163	1,262	157,695	化学
BRENNTAG AG		170	206	894	111,769	商社・流通業
K+S AG		233	—	—	—	化学
EVONIK INDUSTRIES AG		195	227	569	71,181	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG		746	970	289	36,197	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG		76	93	578	72,290	繊維・アパレル・贅沢品
COMMERZBANK AG		1,240	1,350	899	112,425	銀行
OSRAM LICHT AG		116	143	588	73,514	電気設備
KION GROUP AG		80	99	535	66,960	機械
VONOVIA SE		555	664	2,934	366,654	不動産管理・開発
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE		256	340	527	65,838	メディア
SIEMENS HEALTHINEERS AG		—	199	709	88,629	ヘルスケア機器・用品
METRO AG		182	250	381	47,629	食品・生活必需品小売り
INNOGY SE		146	195	790	98,785	総合公益事業
LINDE AG - TENDER		209	—	—	—	化学
ZALANDO SE		117	134	350	43,759	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG		188	270	1,379	172,298	化学

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		
QIAGEN NV		245	314	1,069	133,571	ライフサイエンス・ツール/サービス	
SCHAEFFLER AG		210	—	—	—	自動車部品	
UNIPER SE		224	262	673	84,185	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
DELIVERY HERO SE		—	119	426	53,222	インターネット販売・通信販売	
小 計	株 数 ・ 金 額	27,621	33,170	140,166	17,510,959		
	銘 柄 数 < 比 率 >	62	62	—	<3.2%>		
(ユーロ…イタリア)							
ASSICURAZIONI GENERALI		1,420	1,620	2,467	308,234	保険	
INTESA SANPAOLO		15,120	20,620	4,220	527,318	銀行	
INTESA SANPAOLO-RSP		1,180	—	—	—	銀行	
MEDIOBANCA S. P. A.		680	880	730	91,314	銀行	
LUXOTTICA GROUP SPA		186	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品	
ENEL SPA		9,120	11,240	5,885	735,246	電力	
ENI SPA		2,890	3,520	5,322	664,907	石油・ガス・消耗燃料	
SNAM SPA		2,520	2,980	1,247	155,803	石油・ガス・消耗燃料	
TENARIS SA		530	600	708	88,450	エネルギー設備・サービス	
TELECOM ITALIA SPA		12,400	15,300	785	98,170	各種電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RNC		6,800	8,800	389	48,702	各種電気通信サービス	
ATLANTIA SPA		500	700	1,467	183,297	運送インフラ	
TERNA SPA		1,630	1,850	990	123,695	電力	
RECORDATI SPA		112	141	477	59,591	医薬品	
LEONARDO SPA		470	550	489	61,180	航空宇宙・防衛	
PRYSMIAN SPA		230	309	582	72,728	電気設備	
UNIPOLSAI SPA		1,070	—	—	—	保険	
FERRARI NV		143	171	1,903	237,770	自動車	
CNH INDUSTRIAL NV		1,130	1,410	1,328	165,934	機械	
MONCLER SPA		—	252	865	108,141	繊維・アパレル・贅沢品	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		1,230	1,500	1,953	244,100	自動車	
UNICREDIT SPA		2,290	2,710	3,041	380,000	銀行	
UNICREDIT SPA-RIGHTS		2,290	—	—	—	銀行	
EXOR NV		121	151	851	106,357	各種金融サービス	
POSTE ITALIANE SPA		640	770	596	74,513	保険	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		650	760	622	77,808	飲料	
PIRELLI & C. SPA		—	530	321	40,217	自動車部品	
小 計	株 数 ・ 金 額	65,352	77,364	37,248	4,653,489		
	銘 柄 数 < 比 率 >	25	23	—	<0.8%>		
(ユーロ…フランス)							
BOUYGUES		234	314	973	121,606	建設・土木	
AIRBUS SE		653	804	8,922	1,114,724	航空宇宙・防衛	
VEOLIA ENVIRONNEMENT		523	710	1,355	169,328	総合公益事業	
LOREAL-ORD		282	344	7,636	954,037	パーソナル用品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		313	382	11,261	1,406,958	繊維・アパレル・贅沢品	
DASSAULT AVIATION SA		2	3	435	54,460	航空宇宙・防衛	
THALES SA		124	141	1,506	188,217	航空宇宙・防衛	
CAPGEMINI SA		182	219	2,245	280,573	情報技術サービス	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA		59	83	373	46,661	食品・生活必需品小売り	
INGENICO GROUP		67	81	444	55,575	電子装置・機器・部品	
PUBLICIS GROUPE		239	292	1,391	173,898	メディア	
FAURECIA		85	105	413	51,683	自動車部品	
LAGARDERE S. C. A		148	—	—	—	メディア	
BOLLORE		1,060	1,060	392	49,050	航空貨物・物流サービス	
MICHELIN (CGDE)		193	238	2,413	301,496	自動車部品	
PERNOD RICARD SA		239	291	4,381	547,318	飲料	
RENAULT SA		218	255	1,520	189,964	自動車	

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
REMY COINTREAU	23	30	337	42,201	飲料
SEB SA	24	30	417	52,095	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	636	754	5,139	642,048	電気設備
VIVENDI SA	1,164	1,437	3,450	431,038	娯楽
ORANGE SA	2,270	2,770	3,718	464,580	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	36	44	2,395	299,300	繊維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA	28	38	319	39,853	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	150	178	2,284	285,418	ソフトウェア
KERING SA	85	105	4,971	621,120	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	212	212	427	53,447	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE	674	800	1,450	181,248	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	104	136	1,126	140,715	情報技術サービス
SANOFI	1,284	1,551	11,669	1,457,898	医薬品
ACCOR SA	214	262	1,038	129,781	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV	710	970	1,425	178,077	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE	863	1,043	2,560	319,826	銀行
TELEPERFORMANCE	64	77	1,198	149,681	専門サービス
EURAZEO SE	54	56	362	45,228	各種金融サービス
SODEXO	101	121	1,137	142,155	ホテル・レストラン・レジャー
AXA	2,197	2,650	5,497	686,793	保険
PEUGEOT CITROEN	674	820	1,745	218,100	自動車
JC DECAUX SA	93	93	252	31,509	メディア
ESSILORLUXOTTICA	235	399	4,221	527,382	繊維・アパレル・贅沢品
CREDIT AGRICOLE SA	1,290	1,540	1,570	196,163	銀行
BNP PARIBAS	1,270	1,554	6,543	817,528	銀行
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	564	669	2,185	273,049	建設関連製品
WENDEL	29	34	360	45,024	各種金融サービス
ILIAD SA	31	39	344	43,041	各種電気通信サービス
SES FDR	430	480	863	107,819	メディア
IMERYS	38	38	188	23,603	建設資材
SAFRAN SA	375	457	5,262	657,426	航空宇宙・防衛
ENGIE	2,060	2,510	3,544	442,766	総合公益事業
ALSTOM	181	205	769	96,193	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	200	241	426	53,231	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	670	820	1,147	143,317	電力
IPSEN	40	55	688	85,958	医薬品
ARKEMA	77	99	828	103,520	化学
LEGRAND SA	302	370	2,124	265,418	電気設備
EIFFAGE SA	87	108	890	111,258	建設・土木
TOTAL SA	2,677	3,300	16,399	2,048,770	石油・ガス・消耗燃料
ADP	34	39	659	82,341	運送インフラ
NATIXIS	1,110	1,280	565	70,600	資本市場
UBISOFT ENTERTAINMENT	70	111	744	93,049	娯楽
SCOR SE	206	232	888	111,007	保険
REXEL SA	350	450	490	61,306	商社・流通業
VINCI	566	702	5,652	706,167	建設・土木
DANONE	677	844	5,544	692,641	食品
AIR LIQUIDE	479	592	6,325	790,247	化学
BUREAU VERITAS SA	301	342	671	83,935	専門サービス
GETLINK	530	620	783	97,827	運送インフラ
SUEZ	385	520	576	72,077	総合公益事業
EDENRED	253	328	1,216	151,983	商業サービス・用品
VALEO SA	276	331	869	108,589	自動車部品
BIOMERIEUX	46	59	411	51,374	ヘルスケア機器・用品

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
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	ライフサイエンス・ツール/サービス 資本市場
SARTORIUS STEDIM BIOTECH		—	41	418	52,296	
AMUNDI SA		67	82	446	55,749	
小 計	株 数 ・ 金 額	32,191	38,992	173,219	21,640,346	
	銘 柄 数 < 比 率 >	72	72	—	<3.9%>	
(ユーロ…オランダ)						
RELX NV		1,095	—	—	—	専門サービス
RANDSTAD NV		135	174	814	101,776	専門サービス
AKZO NOBEL		286	—	—	—	化学
WOLTERS KLUWER		351	390	2,184	272,847	専門サービス
VOPAK		71	90	392	49,000	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV		1,930	2,460	1,123	140,356	保険
KONINKLIJKE KPN NV		4,000	4,460	1,214	151,666	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV		1,058	1,318	4,624	577,784	ヘルスケア機器・用品
HEINEKEN NV		293	357	3,128	390,785	飲料
HEINEKEN HOLDING NV		135	160	1,345	168,105	飲料
KONINKLIJKE DSM NV		209	247	2,331	291,296	化学
UNILEVER NV-CVA		1,841	2,127	10,408	1,300,330	パーソナル用品
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA		96	—	—	—	建設・土木
ASML HOLDING NV		440	560	9,132	1,140,920	半導体・半導体製造装置
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		1,450	1,711	3,930	490,995	食品・生活必需品小売り
AKZO NOBEL		—	310	2,515	314,231	化学
NN GROUP NV		346	429	1,624	202,910	保険
ARCELORMITTAL		761	885	1,783	222,784	金属・鉱業
ABN AMRO GROUP NV-CVA		489	581	1,190	148,725	銀行
ALTICE EUROPE N.V.		640	—	—	—	メディア
ING GROEP NV		4,370	5,380	5,940	742,158	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	19,996	21,639	53,683	6,706,676	
	銘 柄 数 < 比 率 >	20	17	—	<1.2%>	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		763	—	—	—	運送インフラ
ENDESA S.A.		356	444	955	119,313	電力
BANKINTER S.A.		750	880	608	75,989	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.		7,490	9,230	4,794	598,922	銀行
NATURGY ENERGY GROUP SA		412	493	1,165	145,599	ガス
REPSOL SA		1,435	1,882	2,855	356,727	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA		18,190	22,420	9,192	1,148,381	銀行
TELEFONICA SA		5,190	6,400	4,800	599,664	各種電気通信サービス
ENAGAS		267	304	752	93,959	石油・ガス・消耗燃料
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA		236	300	410	51,290	電気設備
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV		282	346	1,287	160,843	建設・土木
ACS, ACTIVIDADES CONS Y S-RTS		—	345	16	2,115	建設・土木
FERROVIAL SA		540	665	1,317	164,647	建設・土木
MAPFRE SA		1,260	1,630	399	49,890	保険
BANCO DE SABADELL SA		6,250	7,900	752	94,016	銀行
CAIXABANK		4,130	5,050	1,520	189,962	銀行
IBERDROLA SA		6,590	8,586	6,225	777,730	電力
AMADEUS IT GROUP SA		495	595	4,065	507,845	情報技術サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP		750	870	658	82,321	旅客航空輸送業
RED ELECTRICA CORPORACION SA		482	590	1,142	142,773	電力
INDITEX SA		1,228	1,480	3,787	473,149	専門小売り
AENA SME SA		74	93	1,428	178,401	運送インフラ
GRIFOLS SA		329	401	954	119,230	バイオテクノロジー



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
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	銀行
BANKIA SA		1,075	1,510	384	48,066	
小 計	株 数 ・ 金 額	58,577	72,415	49,474	6,180,842	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	23	—	<1.1%>	
(ユーロ…ベルギー)						
KBC GROEP NV		285	346	2,132	266,443	銀行
SOLVAY SA		87	103	1,017	127,056	化学
UCB SA		139	165	1,300	162,433	医薬品
COLRUYT SA		73	87	543	67,930	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAM		89	110	906	113,264	各種金融サービス
PROXIMUS		184	216	474	59,258	各種電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		54	67	256	32,058	メディア
AGEAS		213	258	1,069	133,665	保険
UMICORE		214	280	991	123,830	化学
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		862	1,052	7,200	899,613	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額	2,200	2,684	15,893	1,985,555	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	10	—	<0.4%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG		171	210	972	121,443	石油・ガス・消耗燃料
VERBUND AG		—	90	385	48,168	電力
VOESTALPINE AG		128	165	425	53,162	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		332	400	1,280	159,910	銀行
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		169	201	452	56,524	銀行
ANDRITZ AG		75	92	405	50,640	機械
小 計	株 数 ・ 金 額	875	1,158	3,920	489,849	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	6	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルグ)						
EUROFINS SCIENTIFIC SE		12	14	487	60,919	ライフサイエンス・ツール/サービス
RTL GROUP		39	54	253	31,680	メディア
AROUNDTOWN SA		—	1,070	811	101,392	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額	51	1,138	1,552	193,992	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	3	—	<0.0%>	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA OYJ		162	630	896	112,037	機械
UPM-KYMMENE OYJ		615	733	1,965	245,509	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R		620	730	886	110,761	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS		506	612	2,594	324,178	保険
FORTUM OYJ		500	600	1,179	147,404	電力
ELISA OYJ		150	195	700	87,481	各種電気通信サービス
METSO OYJ		124	162	464	58,003	機械
NOKIA OYJ		6,580	7,810	4,348	543,271	通信機器
NESTE OYJ		146	176	1,537	192,128	石油・ガス・消耗燃料
NOKIAN RENKAAT OYJ		134	158	475	59,453	自動車部品
KONE OYJ		384	456	2,031	253,792	機械
ORION OYJ		130	130	379	47,423	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額	10,051	12,392	17,461	2,181,446	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
CRH PLC		971	1,136	3,055	381,766	建設資材
KINGSPAN GROUP PLC		—	222	842	105,280	建設関連製品
KERRY GROUP PLC-A		183	221	2,034	254,145	食品
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD		1,398	1,398	—	—	銀行
SMURFIT KAPPA GROUP PLC		—	320	850	106,260	容器・包装
BANK OF IRELAND GROUP PLC		1,090	1,330	726	90,804	銀行
AIB GROUP PLC		1,050	1,250	486	60,715	銀行

銘柄	銘柄	期首(前期末)	当期		期末	業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…アイルランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
PADDY POWER PLC		94	126	889	111,132	ホテル・レストラン・レジャー
小 計	株 数 ・ 金 額	4,786	6,003	8,885	1,110,105	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	8	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL		2,620	3,610	1,172	146,483	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		570	670	963	120,406	石油・ガス・消耗燃料
JERONIMO MARTINS		267	310	395	49,359	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	3,457	4,590	2,531	316,250	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	225,157	271,547	504,038	62,969,515	
	銘柄 数 < 比 率 >	240	239	—	<11.4%>	
(香港)				千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		290	380	3,306	46,548	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		2,130	2,510	4,523	63,684	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA		1,400	1,670	4,627	65,156	銀行
CLP HLDGS		1,870	2,270	21,338	300,439	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD		1,316	1,624	40,762	573,934	資本市場
LI & FUNG LTD		7,496	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
MTR CORP		1,630	2,010	8,803	123,957	陸運・鉄道
FIRST PACIFIC CO		2,260	—	—	—	各種金融サービス
HANG LUNG GROUP LTD		1,030	1,030	2,430	34,225	不動産管理・開発
HANG SENG BANK		870	1,058	19,329	272,161	銀行
HENDERSON LAND		1,325	1,858	8,307	116,974	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,520	1,910	10,132	142,666	電力
WHARF (HOLDING)		1,340	1,740	4,228	59,533	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS		9,602	12,903	22,657	319,024	ガス
HYSAN DEVELOPMENT		650	830	3,486	49,082	不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		2,710	3,330	17,216	242,402	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES		790	790	2,603	36,650	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		4,210	4,950	15,196	213,966	銀行
NWS HOLDINGS LTD		1,595	2,205	4,233	59,609	コングロマリット
PCCW LTD		5,500	5,500	2,618	36,861	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		750	970	2,502	35,236	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT		6,796	8,396	10,512	148,017	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD		1,603	1,603	1,651	23,252	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO.LTD		3,600	4,800	6,969	98,131	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,660	2,170	28,730	404,529	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A		535	640	5,830	82,092	不動産管理・開発
WHEELLOCK & COMPANY LTD		980	1,170	6,025	84,839	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		1,560	1,950	9,165	129,043	家庭用耐久財
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD		4,500	—	—	—	資本市場
MINTH GROUP LTD		820	1,120	3,309	46,599	自動車部品
SJM HOLDINGS LIMITED		2,700	2,700	2,176	30,640	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD		1,840	2,280	4,076	57,399	ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD		940	1,240	1,807	25,455	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD		13,590	16,630	121,731	1,713,980	保険
HKT TRUST AND HKT LTD		4,496	5,196	6,193	87,206	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD		2,680	3,360	12,096	170,311	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD		1,460	1,730	5,363	75,511	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		1,340	1,640	8,905	125,385	不動産管理・開発
WH GROUP LIMITED		10,200	11,700	8,646	121,739	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		3,040	3,710	29,571	416,372	コングロマリット
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		750	890	5,638	79,385	電力

銘柄	株数	金額	株数	金額	業種等
期首(前期末)	株数	金額	株数	金額	業種等
当	株数	金額	株数	金額	業種等
末	株数	金額	株数	金額	業種等
評価額	株数	金額	株数	金額	業種等
外貨建金額	株数	金額	株数	金額	業種等
邦貨換算金額	株数	金額	株数	金額	業種等
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CK ASSET HOLDINGS LTD	2,980	3,610	23,196	326,611	不動産管理・開発
小計	118,358	126,076	499,901	7,038,619	
銘柄数 < 比率 >	42	39	—	< 1.3% >	
(シンガポール)	株数	株数	千シンガポールドル	株数	業種等
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,610	1,980	734	59,890	航空宇宙・防衛
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	9,400	9,400	244	19,926	食品
DBS GROUP HLDGS	2,020	2,490	6,172	503,261	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	510	510	479	39,127	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	100	140	505	41,205	販売
SATS LTD	770	770	389	31,765	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD	930	1,110	864	70,498	資本市場
CAPITALAND LIMITED	2,850	3,300	1,108	90,400	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE LTD	7,200	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
COMFORTDELGRO CORP LTD	2,500	3,100	744	60,658	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD	630	770	751	61,303	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK	1,490	1,850	4,750	387,332	銀行
UOL GROUP LIMITED	487	650	429	34,976	不動産管理・開発
VENTURE CORP LTD	—	350	563	45,942	電子装置・機器・部品
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	1,870	2,400	595	48,526	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	9,250	11,100	3,318	270,589	各種電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES	990	1,400	359	29,342	コングロマリット
OCBC-ORD	3,550	4,330	4,988	406,684	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,750	2,470	815	66,455	食品
STARHUB LTD	690	—	—	—	無線通信サービス
KEPPEL CORP.	1,620	2,020	1,228	100,131	コングロマリット
YANGZIJANG SHIPBUILDING	2,700	3,800	532	43,373	機械
GENTING SINGAPORE LTD	—	8,700	939	76,605	ホテル・レストラン・レジャー
小計	52,918	62,641	30,516	2,487,997	
銘柄数 < 比率 >	21	21	—	< 0.5% >	
(オーストラリア)	株数	株数	千豪ドル	株数	業種等
RAMSAY HEALTH CARE LTD	158	205	1,200	94,857	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	3,300	3,930	10,536	832,686	銀行
AMCOR	1,340	1,550	2,284	180,559	容器・包装
WESTPAC BANKING CORP	3,839	4,690	12,306	972,587	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	420	560	557	44,035	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,870	2,230	1,398	110,500	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	4,870	5,900	1,876	148,276	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	540	670	661	52,261	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD	600	770	647	51,177	飲料
ASX LTD	219	263	1,784	141,004	資本市場
BHP GROUP LIMITED	3,611	4,063	14,817	1,171,047	金属・鉱業
CALTIX AUSTRALIA LIMITED	291	333	934	73,845	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	530	971	345	27,323	複合小売り
COMPUTERSHARE LTD	560	630	1,149	90,864	情報技術サービス
CSL LIMITED	513	618	11,433	903,549	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	54	69	538	42,544	インタラクティブ・メディアおよびサービス
TRANSURBAN GROUP	2,570	3,560	4,336	342,680	運送インフラ
COCHLEAR LTD	67	81	1,599	126,415	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	2,050	2,390	1,792	141,661	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,950	2,424	17,164	1,356,498	銀行
BORAL LTD	1,330	1,530	746	59,006	建設資材
RIO TINTO LTD	480	512	4,674	369,430	金属・鉱業
APA GROUP	1,250	1,590	1,465	115,856	ガス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	630	760	1,881	148,715	ホテル・レストラン・レジャー

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
(オーストラリア)		百株	百株	千豪ドル	千円	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		2,620	3,080	2,303	182,072	保険
TPG TELECOM LTD		359	520	349	27,657	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		52	73	314	24,882	ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD		420	500	910	71,917	化学
BLUESCOPE STEEL LTD		670	800	969	76,627	金属・鉱業
WORLEYPARSONS LTD		—	470	718	56,756	エネルギー設備・サービス
SUNCORP GROUP LTD		1,490	1,810	2,371	187,388	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK		3,016	3,780	9,155	723,532	銀行
NEWCREST MINING		890	1,030	2,562	202,525	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD		1,620	1,790	1,451	114,727	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD		1,960	2,330	764	60,397	化学
AMP LIMITED		3,220	3,900	850	67,191	各種金融サービス
QBE INSURANCE		1,520	1,790	2,011	159,005	保険
CHALLENGER LIMITED		660	800	583	46,090	各種金融サービス
SANTOS LTD.		2,120	2,550	1,711	135,224	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE LTD		440	620	1,467	115,979	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON		—	170	491	38,827	石油・ガス・消耗燃料
TABCORP HOLDINGS		2,184	2,470	1,146	90,574	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LIMITED		1,275	1,540	5,128	405,281	複合小売り
ALUMINA LTD		2,900	3,500	917	72,470	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM		955	1,270	4,579	361,927	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD		1,463	1,810	5,435	429,562	食品・生活必需品小売り
SEEK LTD		400	480	822	65,019	専門サービス
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L		59	85	392	31,055	ホテル・レストラン・レジャー
BRAMBLES LTD		1,760	2,180	2,450	193,648	商業サービス・用品
MACQUARIE GROUP LIMITED		366	439	5,453	430,970	資本市場
CROWN RESORTS LTD		430	550	666	52,681	ホテル・レストラン・レジャー
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC		520	580	1,015	80,215	建設資材
TREASURY WINE ESTATES LTD		820	1,000	1,619	127,949	飲料
SYDNEY AIRPORT		1,250	1,440	993	78,524	運送インフラ
AURIZON HOLDINGS LTD		2,390	2,730	1,261	99,677	陸運・鉄道
HEALTHSCOPE LTD		1,760	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSNET SERVICES		2,300	2,300	400	31,627	電力
MEDIBANK PRIVATE LTD		3,080	3,500	994	78,555	保険
AGL ENERGY LTD		730	930	2,050	162,062	総合公益事業
SOUTH32 LTD		5,800	7,000	2,667	210,773	金属・鉱業
CIMIC GROUP LTD		117	117	582	46,056	建設・土木
COLES GROUP LTD		—	1,610	2,028	160,320	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	84,658	101,843	165,723	13,097,145	
	銘柄 数 < 比 率 >	59	61	—	<2.4%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
RYMAN HEALTHCARE LTD		450	580	651	49,534	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
A2 MILK CO LTD		—	1,060	1,346	102,378	食品
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L		640	740	999	76,030	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD		690	1,126	587	44,710	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,890	2,600	1,056	80,377	各種電気通信サービス
MERCURY NZ LTD		880	—	—	—	電力
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		1,080	1,300	975	74,148	運送インフラ
MERIDIAN ENERGY LTD		1,590	1,590	596	45,344	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 ・ 金 額	7,220	8,996	6,213	472,524	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	<0.1%>	
(イスラエル)				千新シケル		
BANK HAPOALIM BM		1,250	1,410	3,461	105,750	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		1,610	2,140	5,110	156,120	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	
(イスラエル)			百株	百株	千新シェケル	千円	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP			2,040	2,800	904	27,629	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD			28	36	1,715	52,405	航空宇宙・防衛
FRUTAROM			48	—	—	—	化学
ISRAEL CHEMICALS LIMITED			500	910	1,851	56,574	化学
NICE LTD			68	86	3,587	109,610	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD			170	170	1,150	35,159	銀行
AZRIELI GROUP			41	65	1,291	39,456	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額		5,755	7,617	19,073	582,707	
	銘 柄 数 < 比 率 >		9	8	—	<0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額		1,288,212	1,536,390	—	532,392,636	
	銘 柄 数 < 比 率 >		1,260	1,245	—	<96.4%>	

\* 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。  
\* 邦貨換算金額欄の< >内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。  
\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。  
\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORP	42,800	71,000	1,251	138,287	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,000	14,400	1,941	214,666	0.0
AMERICAN TOWER CORP	48,200	60,200	10,704	1,183,304	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	132,000	176,000	1,793	198,246	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	15,600	19,200	3,764	416,132	0.1
BOSTON PROPERTIES	17,700	20,700	2,765	305,746	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	37,000	—	—	—	—
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	—	25,000	500	55,297	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	10,500	13,100	1,292	142,924	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	59,000	—	—	—	—
CROWN CASTLE INTL CORP	45,600	56,800	6,823	754,256	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	23,200	27,800	3,197	353,488	0.1
DUKE REALTY CORP	38,900	47,800	1,423	157,351	0.0
EQUINIX INC	8,770	10,930	4,605	509,124	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	41,500	51,300	3,755	415,152	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,590	9,030	2,517	278,311	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	14,100	17,900	1,784	197,312	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	7,900	9,800	1,327	146,764	0.0
GGP INC	68,200	—	—	—	—
HCP INC	51,600	66,100	2,038	225,338	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	82,000	100,000	1,864	206,046	0.0
INVITATION HOMES INC	34,000	45,000	1,058	116,995	0.0
IRON MOUNTAIN INC	31,300	38,300	1,345	148,686	0.0
KIMCO REALTY CORP	51,000	58,000	1,030	113,865	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	16,900	19,800	941	104,050	0.0
MACERICH CO /THE	14,200	14,200	620	68,578	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	12,400	15,000	1,562	172,740	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	17,100	22,000	1,156	127,843	0.0
PROLOGIS INC	59,700	86,300	6,143	679,124	0.1
PUBLIC STORAGE	17,640	21,500	4,466	493,716	0.1
REALTY INCOME CORP	30,000	39,300	2,754	304,486	0.1
REGENCY CENTERS CORP	17,000	21,000	1,392	153,951	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	13,800	16,000	2,968	328,082	0.1
SL GREEN REALTY CORP	11,000	12,500	1,145	126,568	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	35,200	42,300	7,756	857,362	0.2
UDR INC	30,800	36,700	1,636	180,893	0.0
VENTAS INC	40,200	49,200	3,208	354,649	0.1
VEREIT INC	109,000	125,000	1,033	114,270	0.0
VORNADO REALTY TRUST	18,800	24,200	1,664	184,044	0.0
WP CAREY INC	—	21,500	1,616	178,721	0.0
WELLTOWER INC	41,400	51,700	4,012	443,534	0.1
WEYERHAEUSER CO	85,000	106,000	2,707	299,258	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	
(アメリカ)		口	口	千米ドル	千円	%
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST		509,000	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	1,958,600	1,662,560	103,575	11,449,180	
	銘 柄 数 < 比 率 >	41	39	—	<2.1%>	
(カナダ)				千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		—	20,000	449	37,529	0.0
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		13,600	—	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		16,900	22,000	552	46,169	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		6,900	11,000	369	30,892	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	37,400	53,000	1,372	114,591	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.0%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		114,000	128,000	750	107,086	0.0
HAMMERSON PLC		89,000	108,000	410	58,597	0.0
SEGRO PLC		118,000	145,000	928	132,397	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		80,625	99,000	879	125,480	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	401,625	480,000	2,968	423,563	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
ICADE		3,700	5,100	378	47,276	0.0
KLEPIERRE		24,900	28,000	841	105,081	0.0
GECINA SA		5,600	6,400	807	100,903	0.0
COVIVIO		4,000	6,600	571	71,446	0.0
UNIBAIL RODAMCO-NA		11,280	—	—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		—	19,100	2,771	346,279	0.1
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	49,480	65,200	5,370	670,986	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		252,000	288,000	24,940	351,166	0.1
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		260,000	370,000	2,982	41,989	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	512,000	658,000	27,923	393,155	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		310,000	310,000	740	60,405	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		282,000	380,000	1,048	85,508	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		299,972	369,972	691	56,406	0.0
SUNTEC REIT		300,000	300,000	570	46,472	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,191,972	1,359,972	3,051	248,792	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		430,000	490,000	1,259	99,522	0.0
GPT GROUP		203,000	256,000	1,507	119,164	0.0
LENDLEASE GROUP		61,000	77,000	1,043	82,455	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP		274,000	348,000	1,294	102,309	0.0
DEXUS		113,000	140,000	1,688	133,434	0.0
GOODMAN GROUP		200,000	227,000	2,914	230,347	0.0
SCENTRE GROUP		612,000	723,000	2,877	227,411	0.0
WESTFIELD CORP		220,000	—	—	—	—

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	千豪ドル	千円	%	
VICINITY CENTRES		373,000	480,000	1,228	97,112	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,486,000	2,741,000	13,814	1,091,757		
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	8	—	<0.2%>		
合 計	口 数 ・ 金 額	6,637,077	7,019,732	—	14,392,028		
	銘 柄 数 < 比 率 >	68	65	—	<2.6%>		

\* 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。  
\* 比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。  
\* 金額の単位未満は切り捨て。  
\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	CAN60	百万円 204	百万円 —
		EUR050	651	—
		FT100	359	—
		SPI200	142	—
		SPEMINI	3,821	—
		SWISSMKT	181	—

\* 単位未満は切り捨て。  
\* 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。

## <国内債券マザーファンド>

下記は、国内債券マザーファンド全体（19,423,740千口）の内容です。

## 国内公社債

### (A) 国内（邦貨建）公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 23,822,000	千円 26,349,042	% 99.3	% —	% 65.4	% 22.0	% 11.9
	( 30,000)	( 44,527)	( 0.2)	(一) (一)	( 0.2)	( 一)	( 一)
合 計	23,822,000	26,349,042	99.3	—	65.4	22.0	11.9
	( 30,000)	( 44,527)	( 0.2)	(一)	( 0.2)	( 一)	( 一)

\* ( )内は非上場債で内書きです。  
\* 組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。  
\* 金額の単位未満は切り捨て。  
\* 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。  
\* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。



## (B) 国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

銘柄	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	
国庫債券	利付（2年）第387回	0.1	450,000	451,503	2020/4/15
国庫債券	利付（2年）第388回	0.1	100,000	100,358	2020/5/15
国庫債券	利付（2年）第389回	0.1	80,000	80,296	2020/6/1
国庫債券	利付（2年）第390回	0.1	50,000	50,197	2020/7/1
国庫債券	利付（2年）第391回	0.1	100,000	100,413	2020/8/1
国庫債券	利付（2年）第393回	0.1	120,000	120,553	2020/10/1
国庫債券	利付（2年）第394回	0.1	170,000	170,810	2020/11/1
国庫債券	利付（2年）第395回	0.1	120,000	120,600	2020/12/1
国庫債券	利付（2年）第396回	0.1	150,000	150,786	2021/1/1
国庫債券	利付（5年）第124回	0.1	320,000	321,216	2020/6/20
国庫債券	利付（5年）第125回	0.1	380,000	381,687	2020/9/20
国庫債券	利付（5年）第126回	0.1	500,000	502,570	2020/12/20
国庫債券	利付（5年）第128回	0.1	580,000	583,799	2021/6/20
国庫債券	利付（5年）第129回	0.1	320,000	322,323	2021/9/20
国庫債券	利付（5年）第130回	0.1	160,000	161,275	2021/12/20
国庫債券	利付（5年）第131回	0.1	420,000	423,641	2022/3/20
国庫債券	利付（5年）第132回	0.1	100,000	100,938	2022/6/20
国庫債券	利付（5年）第133回	0.1	120,000	121,233	2022/9/20
国庫債券	利付（5年）第134回	0.1	440,000	444,840	2022/12/20
国庫債券	利付（5年）第135回	0.1	40,000	40,460	2023/3/20
国庫債券	利付（5年）第136回	0.1	130,000	131,588	2023/6/20
国庫債券	利付（5年）第137回	0.1	50,000	50,647	2023/9/20
国庫債券	利付（40年）第1回	2.4	30,000	44,527	2048/3/20
国庫債券	利付（40年）第2回	2.2	30,000	43,165	2049/3/20
国庫債券	利付（40年）第3回	2.2	60,000	86,969	2050/3/20
国庫債券	利付（40年）第4回	2.2	75,000	109,490	2051/3/20
国庫債券	利付（40年）第5回	2.0	100,000	140,976	2052/3/20
国庫債券	利付（40年）第6回	1.9	60,000	83,247	2053/3/20
国庫債券	利付（40年）第7回	1.7	80,000	106,583	2054/3/20
国庫債券	利付（40年）第8回	1.4	100,000	124,095	2055/3/20
国庫債券	利付（40年）第10回	0.9	120,000	129,354	2057/3/20
国庫債券	利付（40年）第11回	0.8	20,000	20,837	2058/3/20
国庫債券	利付（10年）第306回	1.4	45,000	45,771	2020/3/20
国庫債券	利付（10年）第307回	1.3	30,000	30,481	2020/3/20
国庫債券	利付（10年）第308回	1.3	30,000	30,592	2020/6/20
国庫債券	利付（10年）第309回	1.1	130,000	132,220	2020/6/20
国庫債券	利付（10年）第310回	1.0	30,000	30,561	2020/9/20
国庫債券	利付（10年）第311回	0.8	190,000	192,956	2020/9/20
国庫債券	利付（10年）第312回	1.2	70,000	71,775	2020/12/20
国庫債券	利付（10年）第314回	1.1	30,000	30,801	2021/3/20
国庫債券	利付（10年）第315回	1.2	70,000	72,261	2021/6/20
国庫債券	利付（10年）第316回	1.1	130,000	133,894	2021/6/20
国庫債券	利付（10年）第317回	1.1	30,000	30,996	2021/9/20
国庫債券	利付（10年）第318回	1.0	80,000	82,449	2021/9/20
国庫債券	利付（10年）第319回	1.1	70,000	72,550	2021/12/20
国庫債券	利付（10年）第320回	1.0	90,000	93,023	2021/12/20

銘		柄	当 期 末			
			利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券			%	千円	千円	
国庫債券	利付（10年）	第321回	1.0	150,000	155,481	2022/ 3 /20
国庫債券	利付（10年）	第322回	0.9	130,000	134,347	2022/ 3 /20
国庫債券	利付（10年）	第323回	0.9	70,000	72,533	2022/ 6 /20
国庫債券	利付（10年）	第324回	0.8	150,000	154,926	2022/ 6 /20
国庫債券	利付（10年）	第325回	0.8	330,000	341,662	2022/ 9 /20
国庫債券	利付（10年）	第326回	0.7	240,000	248,150	2022/12/20
国庫債券	利付（10年）	第327回	0.8	230,000	238,698	2022/12/20
国庫債券	利付（10年）	第328回	0.6	230,000	237,323	2023/ 3 /20
国庫債券	利付（10年）	第329回	0.8	350,000	364,892	2023/ 6 /20
国庫債券	利付（10年）	第330回	0.8	220,000	229,911	2023/ 9 /20
国庫債券	利付（10年）	第331回	0.6	150,000	155,370	2023/ 9 /20
国庫債券	利付（10年）	第332回	0.6	350,000	363,219	2023/12/20
国庫債券	利付（10年）	第333回	0.6	80,000	83,176	2024/ 3 /20
国庫債券	利付（10年）	第334回	0.6	180,000	187,506	2024/ 6 /20
国庫債券	利付（10年）	第335回	0.5	410,000	425,604	2024/ 9 /20
国庫債券	利付（10年）	第336回	0.5	270,000	280,737	2024/12/20
国庫債券	利付（10年）	第337回	0.3	220,000	226,157	2024/12/20
国庫債券	利付（10年）	第338回	0.4	390,000	403,653	2025/ 3 /20
国庫債券	利付（10年）	第339回	0.4	440,000	456,051	2025/ 6 /20
国庫債券	利付（10年）	第340回	0.4	335,000	347,713	2025/ 9 /20
国庫債券	利付（10年）	第341回	0.3	400,000	412,996	2025/12/20
国庫債券	利付（10年）	第342回	0.1	300,000	305,802	2026/ 3 /20
国庫債券	利付（10年）	第343回	0.1	250,000	254,915	2026/ 6 /20
国庫債券	利付（10年）	第344回	0.1	350,000	356,846	2026/ 9 /20
国庫債券	利付（10年）	第345回	0.1	100,000	101,941	2026/12/20
国庫債券	利付（10年）	第346回	0.1	330,000	336,332	2027/ 3 /20
国庫債券	利付（10年）	第347回	0.1	230,000	234,257	2027/ 6 /20
国庫債券	利付（10年）	第348回	0.1	150,000	152,662	2027/ 9 /20
国庫債券	利付（10年）	第349回	0.1	240,000	244,058	2027/12/20
国庫債券	利付（10年）	第350回	0.1	160,000	162,558	2028/ 3 /20
国庫債券	利付（10年）	第352回	0.1	60,000	60,807	2028/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）	第 3 回	2.3	40,000	50,149	2030/ 5 /20
国庫債券	利付（30年）	第 5 回	2.2	10,000	12,571	2031/ 5 /20
国庫債券	利付（30年）	第 6 回	2.4	10,000	12,895	2031/11/20
国庫債券	利付（30年）	第 7 回	2.3	15,000	19,263	2032/ 5 /20
国庫債券	利付（30年）	第 8 回	1.8	20,000	24,464	2032/11/22
国庫債券	利付（30年）	第 9 回	1.4	20,000	23,387	2032/12/20
国庫債券	利付（30年）	第10回	1.1	30,000	33,882	2033/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）	第11回	1.7	10,000	12,149	2033/ 6 /20
国庫債券	利付（30年）	第12回	2.1	10,000	12,746	2033/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）	第13回	2.0	10,000	12,629	2033/12/20
国庫債券	利付（30年）	第14回	2.4	30,000	39,748	2034/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）	第15回	2.5	70,000	94,019	2034/ 6 /20
国庫債券	利付（30年）	第16回	2.5	10,000	13,455	2034/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）	第17回	2.4	20,000	26,670	2034/12/20
国庫債券	利付（30年）	第18回	2.3	120,000	158,516	2035/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）	第19回	2.3	10,000	13,237	2035/ 6 /20
国庫債券	利付（30年）	第20回	2.5	10,000	13,593	2035/ 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	
国庫債券	利付（30年）第21回		2.3	60,000	79,739	2035/12/20
国庫債券	利付（30年）第22回		2.5	50,000	68,259	2036/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第23回		2.5	40,000	54,723	2036/ 6 /20
国庫債券	利付（30年）第24回		2.5	80,000	109,762	2036/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）第25回		2.3	50,000	66,983	2036/12/20
国庫債券	利付（30年）第26回		2.4	80,000	108,810	2037/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第27回		2.5	100,000	138,238	2037/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）第28回		2.5	30,000	41,647	2038/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第29回		2.4	120,000	164,934	2038/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）第30回		2.3	80,000	108,858	2039/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第31回		2.2	60,000	80,769	2039/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）第32回		2.3	90,000	123,362	2040/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第33回		2.0	130,000	170,985	2040/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）第34回		2.2	110,000	149,713	2041/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第35回		2.0	122,000	161,426	2041/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）第36回		2.0	130,000	172,669	2042/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第37回		1.9	130,000	170,370	2042/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）第38回		1.8	90,000	116,269	2043/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第39回		1.9	80,000	105,323	2043/ 6 /20
国庫債券	利付（30年）第40回		1.8	120,000	155,514	2043/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）第41回		1.7	100,000	127,493	2043/12/20
国庫債券	利付（30年）第42回		1.7	60,000	76,557	2044/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第43回		1.7	90,000	115,057	2044/ 6 /20
国庫債券	利付（30年）第44回		1.7	110,000	140,738	2044/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）第45回		1.5	90,000	110,970	2044/12/20
国庫債券	利付（30年）第46回		1.5	100,000	123,498	2045/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第47回		1.6	110,000	138,637	2045/ 6 /20
国庫債券	利付（30年）第48回		1.4	110,000	133,386	2045/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）第49回		1.4	120,000	145,550	2045/12/20
国庫債券	利付（30年）第50回		0.8	110,000	116,893	2046/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第54回		0.8	160,000	169,728	2047/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第55回		0.8	80,000	84,798	2047/ 6 /20
国庫債券	利付（30年）第56回		0.8	80,000	84,730	2047/ 9 /20
国庫債券	利付（30年）第57回		0.8	110,000	116,408	2047/12/20
国庫債券	利付（30年）第58回		0.8	110,000	116,310	2048/ 3 /20
国庫債券	利付（30年）第59回		0.7	30,000	30,902	2048/ 6 /20
国庫債券	利付（20年）第44回		2.5	10,000	10,290	2020/ 3 /20
国庫債券	利付（20年）第45回		2.4	10,000	10,279	2020/ 3 /20
国庫債券	利付（20年）第46回		2.2	5,000	5,159	2020/ 6 /22
国庫債券	利付（20年）第47回		2.2	15,000	15,567	2020/ 9 /21
国庫債券	利付（20年）第48回		2.5	30,000	31,480	2020/12/21
国庫債券	利付（20年）第49回		2.1	40,000	41,908	2021/ 3 /22
国庫債券	利付（20年）第52回		2.1	25,000	26,481	2021/ 9 /21
国庫債券	利付（20年）第53回		2.1	10,000	10,649	2021/12/20
国庫債券	利付（20年）第54回		2.2	10,000	10,677	2021/12/20
国庫債券	利付（20年）第55回		2.0	10,000	10,675	2022/ 3 /21
国庫債券	利付（20年）第56回		2.0	10,000	10,730	2022/ 6 /20
国庫債券	利付（20年）第57回		1.9	10,000	10,697	2022/ 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	
国庫債券	利付（20年）	第58回	1.9	10,000	10,750	2022/9/20
国庫債券	利付（20年）	第59回	1.7	30,000	32,170	2022/12/20
国庫債券	利付（20年）	第60回	1.4	10,000	10,607	2022/12/20
国庫債券	利付（20年）	第61回	1.0	10,000	10,482	2023/3/20
国庫債券	利付（20年）	第62回	0.8	10,000	10,425	2023/6/20
国庫債券	利付（20年）	第63回	1.8	10,000	10,862	2023/6/20
国庫債券	利付（20年）	第64回	1.9	10,000	10,956	2023/9/20
国庫債券	利付（20年）	第65回	1.9	10,000	11,008	2023/12/20
国庫債券	利付（20年）	第66回	1.8	20,000	21,919	2023/12/20
国庫債券	利付（20年）	第67回	1.9	10,000	11,060	2024/3/20
国庫債券	利付（20年）	第68回	2.2	10,000	11,214	2024/3/20
国庫債券	利付（20年）	第69回	2.1	30,000	33,489	2024/3/20
国庫債券	利付（20年）	第70回	2.4	40,000	45,530	2024/6/20
国庫債券	利付（20年）	第71回	2.2	10,000	11,275	2024/6/20
国庫債券	利付（20年）	第72回	2.1	20,000	22,559	2024/9/20
国庫債券	利付（20年）	第73回	2.0	10,000	11,278	2024/12/20
国庫債券	利付（20年）	第74回	2.1	10,000	11,337	2024/12/20
国庫債券	利付（20年）	第75回	2.1	40,000	45,563	2025/3/20
国庫債券	利付（20年）	第76回	1.9	17,000	19,155	2025/3/20
国庫債券	利付（20年）	第77回	2.0	15,000	16,994	2025/3/20
国庫債券	利付（20年）	第78回	1.9	10,000	11,321	2025/6/20
国庫債券	利付（20年）	第79回	2.0	10,000	11,385	2025/6/20
国庫債券	利付（20年）	第80回	2.1	10,000	11,449	2025/6/20
国庫債券	利付（20年）	第81回	2.0	10,000	11,440	2025/9/20
国庫債券	利付（20年）	第82回	2.1	15,000	17,261	2025/9/20
国庫債券	利付（20年）	第83回	2.1	15,000	17,341	2025/12/20
国庫債券	利付（20年）	第84回	2.0	50,000	57,461	2025/12/20
国庫債券	利付（20年）	第85回	2.1	13,000	15,103	2026/3/20
国庫債券	利付（20年）	第86回	2.3	10,000	11,761	2026/3/20
国庫債券	利付（20年）	第88回	2.3	20,000	23,641	2026/6/20
国庫債券	利付（20年）	第90回	2.2	20,000	23,596	2026/9/20
国庫債券	利付（20年）	第91回	2.3	10,000	11,874	2026/9/20
国庫債券	利付（20年）	第92回	2.1	30,000	35,307	2026/12/20
国庫債券	利付（20年）	第93回	2.0	20,000	23,468	2027/3/20
国庫債券	利付（20年）	第94回	2.1	20,000	23,632	2027/3/20
国庫債券	利付（20年）	第95回	2.3	10,000	12,026	2027/6/20
国庫債券	利付（20年）	第96回	2.1	15,000	17,787	2027/6/20
国庫債券	利付（20年）	第97回	2.2	50,000	59,956	2027/9/20
国庫債券	利付（20年）	第99回	2.1	30,000	35,833	2027/12/20
国庫債券	利付（20年）	第100回	2.2	20,000	24,148	2028/3/20
国庫債券	利付（20年）	第101回	2.4	20,000	24,513	2028/3/20
国庫債券	利付（20年）	第102回	2.4	20,000	24,605	2028/6/20
国庫債券	利付（20年）	第103回	2.3	25,000	30,522	2028/6/20
国庫債券	利付（20年）	第104回	2.1	10,000	12,021	2028/6/20
国庫債券	利付（20年）	第105回	2.1	70,000	84,410	2028/9/20
国庫債券	利付（20年）	第106回	2.2	10,000	12,154	2028/9/20
国庫債券	利付（20年）	第107回	2.1	20,000	24,189	2028/12/20
国庫債券	利付（20年）	第108回	1.9	80,000	95,179	2028/12/20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第109回	1.9	30,000	35,799	2029/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第110回	2.1	90,000	109,215	2029/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第111回	2.2	10,000	12,279	2029/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第112回	2.1	85,000	103,495	2029/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第113回	2.1	210,000	256,401	2029/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第114回	2.1	130,000	159,227	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第115回	2.2	50,000	61,782	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第116回	2.2	110,000	136,358	2030/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第117回	2.1	60,000	73,714	2030/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第118回	2.0	40,000	48,843	2030/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第119回	1.8	50,000	59,926	2030/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第120回	1.6	110,000	129,356	2030/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第121回	1.9	100,000	121,306	2030/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第122回	1.8	130,000	156,200	2030/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第123回	2.1	100,000	123,968	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第124回	2.0	100,000	122,793	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第125回	2.2	100,000	125,513	2031/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第126回	2.0	30,000	36,935	2031/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第127回	1.9	120,000	146,304	2031/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第128回	1.9	100,000	122,149	2031/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第129回	1.8	50,000	60,464	2031/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第130回	1.8	90,000	109,080	2031/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第131回	1.7	35,000	41,985	2031/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第132回	1.7	60,000	72,117	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第133回	1.8	150,000	182,193	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第134回	1.8	70,000	85,198	2032/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第135回	1.7	60,000	72,253	2032/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第136回	1.6	30,000	35,740	2032/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第137回	1.7	40,000	48,260	2032/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第138回	1.5	50,000	59,015	2032/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第139回	1.6	60,000	71,604	2032/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第140回	1.7	140,000	169,225	2032/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第141回	1.7	140,000	169,521	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第142回	1.8	100,000	122,443	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第143回	1.6	130,000	155,883	2033/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第144回	1.5	80,000	94,825	2033/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第145回	1.7	140,000	170,086	2033/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第146回	1.7	140,000	170,360	2033/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第147回	1.6	150,000	180,640	2033/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第148回	1.5	120,000	142,939	2034/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第149回	1.5	40,000	47,699	2034/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第150回	1.4	130,000	153,112	2034/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第151回	1.2	40,000	45,892	2034/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第153回	1.3	120,000	139,660	2035/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第155回	1.0	160,000	178,518	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第157回	0.2	40,000	39,211	2036/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第158回	0.5	40,000	41,198	2036/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第160回	0.7	70,000	74,355	2037/ 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	
国庫債券	利付 (20年) 第161回	0.6	110,000	114,736	2037/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第162回	0.6	140,000	145,852	2037/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第163回	0.6	190,000	197,693	2037/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第164回	0.5	90,000	91,838	2038/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第166回	0.7	40,000	42,217	2038/ 9 /20
合 計			23,822,000	26,349,042	

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ＜野村マネー マザーファンド＞

下記は、野村マネー マザーファンド全体（11,039,670千口）の内容です。

### 国内公社債

#### (A) 国内（邦貨建）公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	430,000	431,576	3.8	—	—	—	3.8
	( 430,000)	( 431,576)	( 3.8)	(—)	(—)	(—)	( 3.8)
特殊債券 (除く金融債)	790,000	790,927	7.0	—	—	—	7.0
	( 790,000)	( 790,927)	( 7.0)	(—)	(—)	(—)	( 7.0)
金融債券	1,400,000	1,400,312	12.4	—	—	—	12.4
	(1,400,000)	(1,400,312)	(12.4)	(—)	(—)	(—)	(12.4)
普通社債券 (含む投資法人債券)	3,540,000	3,543,570	31.5	—	—	—	31.5
	(3,540,000)	(3,543,570)	(31.5)	(—)	(—)	(—)	(31.5)
合 計	6,160,000	6,166,387	54.7	—	—	—	54.7
	(6,160,000)	(6,166,387)	(54.7)	(—)	(—)	(—)	(54.7)

\*（ ）内は非上場債で内書きです。

\*組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*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。

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (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
地方債証券		%	千円	千円	
北海道	公募平成21年度第2回	1.66	100,000	100,447	2019/5/29
京都府	公募（5年）平成26年度第1回	0.214	30,000	30,012	2019/4/30
愛知県	公募平成21年度第3回	1.66	100,000	100,563	2019/6/26
千葉市	公募平成21年度第1回	1.59	200,000	200,553	2019/4/26
小	計		430,000	431,576	
特殊債券(除く金融債)					
日本政策金融公庫債券	政府保証第27回	0.372	60,000	60,124	2019/8/19
地方公営企業等金融機構債券	第3回	1.65	250,000	250,744	2019/4/26
日本学生支援債券	財投機関債第46回	0.001	190,000	190,009	2019/2/20
東日本高速道路	第27回	0.248	60,000	60,048	2019/6/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第97回	0.001	230,000	230,000	2019/3/20
小	計		790,000	790,927	
金融債券					
商工債券	利付第765回い号	0.25	900,000	900,062	2019/2/27
農林債券	利付第766回い号	0.3	100,000	100,028	2019/3/27
農林債券	利付第767回い号	0.3	200,000	200,111	2019/4/26
しんきん中金債券	利付第293回	0.25	100,000	100,045	2019/4/26
しんきん中金債券	利付第294回	0.25	100,000	100,063	2019/5/27
小	計		1,400,000	1,400,312	
普通社債券(含む投資法人債券)					
中国電力	第390回	0.14	100,000	100,033	2019/5/24
四国電力	第288回	0.14	40,000	40,016	2019/6/25
三菱電機	第44回社債間限定同順位特約付	0.27	500,000	500,383	2019/6/5
トヨタ自動車	第10回社債間限定同等特約付	1.772	300,000	301,664	2019/6/20
三菱東京UFJ銀行	第154回特定社債間限定同順位特約付	0.255	500,000	500,209	2019/4/22
三井住友銀行	第59回社債間限定同順位特約付	0.254	500,000	500,220	2019/4/19
みずほ銀行	第36回特定社債間限定同順位特約付	0.3	500,000	500,276	2019/4/26
東京センチュリーリース	第15回社債間限定同順位特約付	0.11	100,000	100,019	2019/4/12
トヨタファイナンス	第69回社債間限定同順位特約付	0.02	200,000	200,000	2019/4/26
トヨタファイナンス	第71回社債間限定同順位特約付	0.001	200,000	200,000	2019/6/14
三菱UFJリース	第29回社債間限定同順位特約付	0.304	300,000	300,247	2019/6/12
三菱地所	第108回担保提供制限等財務上特約無	0.631	300,000	300,497	2019/5/31
小	計		3,540,000	3,543,570	
合	計		6,160,000	6,166,387	

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## 国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 1,999,998	% 17.8

\* 比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

## ＜外国債券マザーファンド＞

下記は、外国債券マザーファンド全体（271, 259, 590千口）の内容です。

## 外国公社債

## (A) 外国（外貨建）公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 2,494,780	千米ドル 2,525,035	千円 279,117,473	% 45.9	% —	% 19.9	% 16.2	% 9.7
カナダ	千カナダドル 133,180	千カナダドル 148,237	12,379,271	2.0	—	1.0	0.5	0.5
イギリス	千英ポンド 223,630	千英ポンド 287,493	41,016,767	6.7	—	5.3	1.3	0.2
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 164,500	千スウェーデンクローナ 184,583	2,202,079	0.4	—	0.2	0.2	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 103,400	千ノルウェークローネ 109,190	1,398,727	0.2	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 145,970	千デンマーククローネ 188,996	3,163,800	0.5	—	0.4	0.2	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	226,200	290,551	36,298,577	6.0	—	3.8	1.8	0.3
イタリア	383,850	440,602	55,044,496	9.0	—	5.2	2.9	0.9
フランス	377,470	472,771	59,063,306	9.7	—	6.2	2.7	0.7
オランダ	72,350	90,391	11,292,634	1.9	—	1.3	0.5	0.1
スペイン	256,700	313,916	39,217,640	6.4	—	3.9	1.7	0.9
ベルギー	89,600	114,251	14,273,482	2.3	—	1.8	0.5	0.0
オーストリア	53,700	67,645	8,450,903	1.4	—	1.0	0.4	0.0
フィンランド	23,200	26,142	3,265,958	0.5	—	0.4	0.1	0.0
アイルランド	42,760	47,051	5,878,195	1.0	—	0.7	0.3	0.0
ポーランド	千ズロチ 119,400	千ズロチ 128,593	3,709,921	0.6	—	0.3	0.2	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 28,130	千シンガポールドル 29,272	2,386,611	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千リンギ 102,500	千リンギ 103,609	2,810,923	0.5	—	0.3	0.2	0.0
オーストラリア	千豪ドル 146,430	千豪ドル 160,787	12,707,039	2.1	—	1.4	0.5	0.2
メキシコ	千メキシコペソ 857,200	千メキシコペソ 833,120	4,790,444	0.8	—	0.4	0.3	0.0
南アフリカ	千ランド 485,800	千ランド 438,297	3,445,015	0.6	—	0.5	0.1	—
合 計	—	—	601,913,271	98.9	—	54.2	30.8	13.8

\* 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。  
 \* 組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。  
 \* 金額の単位未満は切り捨て。  
 \* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。



## (B) 外国（外貨建）公社債 銘柄別開示

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY BOND	8.75	12,700	13,840	1,529,930	2020/ 8 /15	
	US TREASURY BOND	8.0	24,200	27,692	3,061,176	2021/11/15	
	US TREASURY BOND	6.25	13,800	15,975	1,765,889	2023/ 8 /15	
	US TREASURY BOND	2.375	47,100	46,735	5,166,165	2024/ 8 /15	
	US TREASURY BOND	6.0	39,200	47,707	5,273,600	2026/ 2 /15	
	US TREASURY BOND	6.5	18,300	23,281	2,573,485	2026/11/15	
	US TREASURY BOND	6.125	23,000	29,188	3,226,489	2027/11/15	
	US TREASURY BOND	5.5	18,300	22,601	2,498,417	2028/ 8 /15	
	US TREASURY BOND	5.25	28,300	34,510	3,814,793	2028/11/15	
	US TREASURY BOND	5.25	35,600	43,554	4,814,500	2029/ 2 /15	
	US TREASURY BOND	4.375	100	123	13,607	2038/ 2 /15	
	US TREASURY BOND	2.875	27,500	27,018	2,986,652	2043/ 5 /15	
	US TREASURY BOND	3.75	16,000	18,171	2,008,649	2043/11/15	
	US TREASURY N/B	1.375	100	98	10,935	2020/ 1 /31	
	US TREASURY N/B	1.25	200	197	21,848	2020/ 1 /31	
	US TREASURY N/B	3.625	5,400	5,456	603,118	2020/ 2 /15	
	US TREASURY N/B	1.375	4,100	4,054	448,150	2020/ 2 /15	
	US TREASURY N/B	1.25	2,700	2,664	294,564	2020/ 2 /29	
	US TREASURY N/B	1.375	5,000	4,940	546,158	2020/ 2 /29	
	US TREASURY N/B	2.25	1,000	996	110,207	2020/ 2 /29	
	US TREASURY N/B	1.625	4,300	4,258	470,772	2020/ 3 /15	
	US TREASURY N/B	1.125	4,000	3,938	435,354	2020/ 3 /31	
	US TREASURY N/B	1.375	19,400	19,155	2,117,502	2020/ 3 /31	
	US TREASURY N/B	2.25	2,500	2,492	275,475	2020/ 3 /31	
	US TREASURY N/B	1.5	600	592	65,536	2020/ 4 /15	
	US TREASURY N/B	1.125	7,800	7,670	847,864	2020/ 4 /30	
	US TREASURY N/B	1.375	6,700	6,607	730,434	2020/ 4 /30	
	US TREASURY N/B	2.375	9,300	9,280	1,025,893	2020/ 4 /30	
	US TREASURY N/B	3.5	57,900	58,549	6,472,018	2020/ 5 /15	
	US TREASURY N/B	1.375	13,000	12,808	1,415,801	2020/ 5 /31	
	US TREASURY N/B	1.5	7,300	7,202	796,193	2020/ 5 /31	
	US TREASURY N/B	2.5	2,000	1,998	220,950	2020/ 5 /31	
	US TREASURY N/B	1.5	500	493	54,516	2020/ 6 /15	
	US TREASURY N/B	1.875	8,500	8,423	931,184	2020/ 6 /30	
	US TREASURY N/B	1.625	10,400	10,272	1,135,515	2020/ 6 /30	
	US TREASURY N/B	2.5	1,200	1,199	132,570	2020/ 6 /30	
	US TREASURY N/B	1.5	20,800	20,496	2,265,731	2020/ 7 /15	
	US TREASURY N/B	2.0	13,400	13,294	1,469,548	2020/ 7 /31	
	US TREASURY N/B	1.625	8,900	8,782	970,816	2020/ 7 /31	
	US TREASURY N/B	2.625	15,000	15,014	1,659,719	2020/ 7 /31	
US TREASURY N/B	2.625	32,180	32,211	3,560,650	2020/ 8 /15		
US TREASURY N/B	1.5	1,100	1,083	119,736	2020/ 8 /15		
US TREASURY N/B	2.125	36,200	35,965	3,975,600	2020/ 8 /31		
US TREASURY N/B	1.375	37,700	37,034	4,093,777	2020/ 8 /31		
US TREASURY N/B	2.0	6,000	5,948	657,540	2020/ 9 /30		
US TREASURY N/B	1.625	300	295	32,668	2020/10/15		

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY N/B	1.75	1,600	1,578	174,528	2020/10/31	
	US TREASURY N/B	1.375	700	686	75,878	2020/10/31	
	US TREASURY N/B	2.625	52,600	52,653	5,820,309	2020/11/15	
	US TREASURY N/B	2.0	13,700	13,571	1,500,200	2020/11/30	
	US TREASURY N/B	1.625	1,000	984	108,786	2020/11/30	
	US TREASURY N/B	2.375	6,800	6,779	749,411	2020/12/31	
	US TREASURY N/B	1.75	1,400	1,380	152,579	2020/12/31	
	US TREASURY N/B	2.0	12,400	12,277	1,357,149	2021/ 1 /15	
	US TREASURY N/B	2.125	35,300	35,026	3,871,881	2021/ 1 /31	
	US TREASURY N/B	1.375	4,200	4,107	454,075	2021/ 1 /31	
	US TREASURY N/B	3.625	47,200	48,208	5,328,970	2021/ 2 /15	
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,979	218,800	2021/ 2 /28	
	US TREASURY N/B	1.125	3,900	3,792	419,216	2021/ 2 /28	
	US TREASURY N/B	2.25	11,800	11,734	1,297,136	2021/ 3 /31	
	US TREASURY N/B	1.25	600	584	64,629	2021/ 3 /31	
	US TREASURY N/B	2.375	10,300	10,268	1,135,048	2021/ 4 /15	
	US TREASURY N/B	2.25	10,800	10,738	1,187,023	2021/ 4 /30	
	US TREASURY N/B	1.375	4,200	4,098	453,023	2021/ 4 /30	
	US TREASURY N/B	3.125	42,600	43,164	4,771,361	2021/ 5 /15	
	US TREASURY N/B	2.625	1,000	1,002	110,794	2021/ 5 /15	
	US TREASURY N/B	2.0	22,500	22,247	2,459,266	2021/ 5 /31	
	US TREASURY N/B	1.375	300	292	32,332	2021/ 5 /31	
	US TREASURY N/B	2.625	1,000	1,002	110,846	2021/ 6 /15	
	US TREASURY N/B	2.125	34,000	33,707	3,726,061	2021/ 6 /30	
	US TREASURY N/B	1.125	800	775	85,689	2021/ 6 /30	
	US TREASURY N/B	2.625	2,100	2,105	232,723	2021/ 7 /15	
	US TREASURY N/B	2.25	9,700	9,642	1,065,871	2021/ 7 /31	
	US TREASURY N/B	1.125	3,800	3,676	406,367	2021/ 7 /31	
	US TREASURY N/B	2.125	24,600	24,372	2,694,109	2021/ 8 /15	
	US TREASURY N/B	2.0	6,800	6,716	742,393	2021/ 8 /31	
	US TREASURY N/B	2.125	16,000	15,848	1,751,920	2021/ 9 /30	
	US TREASURY N/B	2.0	16,800	16,584	1,833,278	2021/10/31	
	US TREASURY N/B	1.25	1,900	1,838	203,216	2021/10/31	
	US TREASURY N/B	2.0	10,300	10,166	1,123,751	2021/11/15	
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	983	108,704	2021/11/30	
	US TREASURY N/B	1.75	3,700	3,626	400,849	2021/11/30	
	US TREASURY N/B	2.125	12,400	12,274	1,356,774	2021/12/31	
	US TREASURY N/B	2.0	8,000	7,892	872,436	2021/12/31	
	US TREASURY N/B	1.5	8,000	7,775	859,448	2022/ 1 /31	
	US TREASURY N/B	1.875	14,000	13,751	1,520,114	2022/ 1 /31	
US TREASURY N/B	2.0	33,700	33,226	3,672,812	2022/ 2 /15		
US TREASURY N/B	1.75	7,300	7,142	789,542	2022/ 2 /28		
US TREASURY N/B	1.875	900	883	97,698	2022/ 2 /28		
US TREASURY N/B	1.75	9,900	9,681	1,070,236	2022/ 3 /31		
US TREASURY N/B	1.875	1,300	1,276	141,086	2022/ 3 /31		
US TREASURY N/B	1.75	70,300	68,701	7,594,293	2022/ 4 /30		
US TREASURY N/B	1.875	21,300	20,898	2,310,170	2022/ 4 /30		

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘 柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	1.75	11,100	10,843	1,198,619	2022/ 5 /15
		US TREASURY N/B	1.875	1,700	1,667	184,291	2022/ 5 /31
		US TREASURY N/B	1.75	2,900	2,832	313,077	2022/ 5 /31
		US TREASURY N/B	2.125	27,100	26,786	2,960,996	2022/ 6 /30
		US TREASURY N/B	1.75	600	585	64,764	2022/ 6 /30
		US TREASURY N/B	2.0	2,800	2,754	304,458	2022/ 7 /31
		US TREASURY N/B	1.875	1,000	979	108,268	2022/ 7 /31
		US TREASURY N/B	1.625	10,300	9,999	1,105,294	2022/ 8 /15
		US TREASURY N/B	1.875	20,000	19,582	2,164,684	2022/ 8 /31
		US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,948	215,380	2022/ 9 /30
		US TREASURY N/B	2.0	1,500	1,473	162,882	2022/10/31
		US TREASURY N/B	1.625	11,400	11,043	1,220,776	2022/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	28,200	27,821	3,075,340	2022/12/31
		US TREASURY N/B	1.75	47,900	46,556	5,146,361	2023/ 1 /31
		US TREASURY N/B	2.0	17,000	16,671	1,842,917	2023/ 2 /15
		US TREASURY N/B	1.5	24,200	23,273	2,572,662	2023/ 2 /28
		US TREASURY N/B	2.625	14,300	14,365	1,588,008	2023/ 2 /28
		US TREASURY N/B	1.5	11,000	10,572	1,168,727	2023/ 3 /31
		US TREASURY N/B	1.625	5,000	4,825	533,441	2023/ 4 /30
		US TREASURY N/B	1.75	49,300	47,813	5,285,281	2023/ 5 /15
		US TREASURY N/B	1.625	24,000	23,148	2,558,862	2023/ 5 /31
		US TREASURY N/B	1.25	13,700	12,981	1,435,010	2023/ 7 /31
		US TREASURY N/B	2.5	19,400	19,400	2,144,476	2023/ 8 /15
		US TREASURY N/B	1.375	13,900	13,234	1,462,921	2023/ 8 /31
		US TREASURY N/B	1.375	5,200	4,946	546,831	2023/ 9 /30
		US TREASURY N/B	1.625	15,000	14,418	1,593,848	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2.75	15,600	15,773	1,743,554	2023/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	9,200	9,043	999,647	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.25	3,000	2,965	327,785	2023/12/31
		US TREASURY N/B	2.75	27,500	27,811	3,074,285	2024/ 2 /15
		US TREASURY N/B	2.125	6,900	6,771	748,544	2024/ 3 /31
		US TREASURY N/B	2.5	30,100	30,074	3,324,394	2024/ 5 /15
		US TREASURY N/B	2.125	10,000	9,798	1,083,119	2024/ 7 /31
		US TREASURY N/B	2.125	46,000	45,029	4,977,581	2024/ 9 /30
		US TREASURY N/B	2.25	5,600	5,516	609,738	2024/10/31
		US TREASURY N/B	2.25	34,200	33,673	3,722,283	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	3,500	3,422	378,366	2024/11/30
		US TREASURY N/B	2.0	44,700	43,338	4,790,587	2025/ 2 /15
		US TREASURY N/B	2.75	3,400	3,438	380,064	2025/ 2 /28
		US TREASURY N/B	2.625	35,000	35,147	3,885,221	2025/ 3 /31
US TREASURY N/B	2.875	30,000	30,546	3,376,565	2025/ 4 /30		
US TREASURY N/B	2.125	6,500	6,336	700,434	2025/ 5 /15		
US TREASURY N/B	2.75	5,000	5,055	558,788	2025/ 6 /30		
US TREASURY N/B	2.0	27,000	26,086	2,883,617	2025/ 8 /15		
US TREASURY N/B	3.0	19,200	19,702	2,177,914	2025/ 9 /30		
US TREASURY N/B	2.25	70,300	68,888	7,614,935	2025/11/15		
US TREASURY N/B	1.625	2,000	1,878	207,607	2026/ 2 /15		

野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	1.625	800	749	82,801	2026/5/15
		US TREASURY N/B	1.5	2,000	1,851	204,637	2026/8/15
		US TREASURY N/B	2.0	13,000	12,451	1,376,395	2026/11/15
		US TREASURY N/B	2.25	22,300	21,709	2,399,756	2027/2/15
		US TREASURY N/B	2.375	1,400	1,375	152,023	2027/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	500	504	55,723	2028/2/15
		US TREASURY N/B	6.25	4,200	5,634	622,808	2030/5/15
		US TREASURY N/B	5.375	15,500	19,703	2,177,987	2031/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	2,700	3,338	369,038	2036/2/15
		US TREASURY N/B	5.0	200	263	29,132	2037/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	100	125	13,825	2038/5/15
		US TREASURY N/B	3.5	300	329	36,460	2039/2/15
		US TREASURY N/B	4.25	100	121	13,410	2039/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	100	125	13,848	2039/8/15
		US TREASURY N/B	4.375	100	123	13,630	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4.625	100	127	14,079	2040/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	100	123	13,635	2040/5/15
		US TREASURY N/B	3.875	200	230	25,508	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.25	5,800	7,042	778,524	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4.75	5,200	6,744	745,499	2041/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	6,700	8,286	915,936	2041/5/15
		US TREASURY N/B	3.75	700	793	87,739	2041/8/15
		US TREASURY N/B	3.125	6,500	6,692	739,840	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	500	514	56,854	2042/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	3,000	3,020	333,925	2042/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	4,200	4,047	447,365	2042/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	17,600	16,940	1,872,547	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	24,200	24,823	2,744,034	2043/2/15
		US TREASURY N/B	3.625	14,000	15,580	1,722,264	2043/8/15
		US TREASURY N/B	3.625	12,700	14,148	1,563,985	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.375	18,900	20,225	2,235,776	2044/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	24,000	24,626	2,722,185	2044/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	36,900	37,035	4,093,903	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	46,800	42,679	4,717,781	2045/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	21,700	21,776	2,407,150	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	16,000	15,683	1,733,681	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	14,400	14,455	1,597,869	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	30,500	27,716	3,063,823	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	21,600	19,608	2,167,551	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	1,400	1,204	133,198	2046/8/15
US TREASURY N/B	2.875	14,200	13,892	1,535,699	2046/11/15		
US TREASURY N/B	3.0	1,700	1,703	188,299	2047/5/15		
US TREASURY N/B	2.75	2,300	2,190	242,086	2047/8/15		
US TREASURY N/B	2.75	100	95	10,522	2047/11/15		
US TREASURY N/B	3.0	8,000	8,000	884,320	2048/2/15		
US TREASURY N/B	3.125	200	204	22,653	2048/5/15		
小	計					279,117,473	

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

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			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.75	5,500	5,667	473,267	2022/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	15,800	15,753	1,315,591	2020/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	7,800	7,968	665,467	2020/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	3,600	3,598	300,539	2020/ 8 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	3,500	3,446	287,810	2020/ 9 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	1,500	1,505	125,738	2020/11/ 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	1,700	1,715	143,247	2021/ 2 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	7,400	7,250	605,466	2021/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.25	10,050	10,379	866,761	2021/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	300	292	24,420	2021/ 9 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,800	2,694	224,998	2022/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	6,700	6,518	544,348	2022/ 9 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	1,600	1,597	133,380	2023/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,600	4,543	379,455	2023/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	1,100	1,109	92,666	2023/ 9 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	1,600	1,634	136,502	2024/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	7,900	8,173	682,575	2024/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	5,400	5,532	461,988	2025/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	2,400	2,341	195,569	2026/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	4,750	6,962	581,454	2027/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	200	186	15,586	2027/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	100	100	8,426	2028/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	10,080	13,656	1,140,427	2029/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	4,200	6,136	512,469	2033/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	3,400	4,881	407,646	2037/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	8,200	10,858	906,802	2041/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	9,900	12,575	1,050,161	2045/12/ 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	300	339	28,344	2048/12/ 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	600	579	48,366	2051/12/ 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	200	236	19,787	2064/12/ 1
小 計						12,379,271	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	4.75	200	208	29,727	2020/ 3 / 7
		UK TREASURY	2.0	490	498	71,176	2020/ 7 / 22
		UK TREASURY	3.75	1,850	1,936	276,225	2020/ 9 / 7
		UK TREASURY	1.5	5,500	5,581	796,306	2021/ 1 / 22
		UK TREASURY	8.0	740	863	123,162	2021/ 6 / 7
		UK TREASURY	3.75	670	721	102,887	2021/ 9 / 7
		UK TREASURY	4.0	6,150	6,755	963,758	2022/ 3 / 7
		UK TREASURY	0.5	11,100	11,008	1,570,587	2022/ 7 / 22
		UK TREASURY	1.75	7,900	8,173	1,166,079	2022/ 9 / 7
		UK TREASURY	0.75	21,900	21,842	3,116,318	2023/ 7 / 22
		UK TREASURY	2.25	3,800	4,044	577,087	2023/ 9 / 7
		UK TREASURY	1.0	1,200	1,207	172,332	2024/ 4 / 22
		UK TREASURY	2.75	9,350	10,307	1,470,535	2024/ 9 / 7
		UK TREASURY	5.0	11,850	14,715	2,099,503	2025/ 3 / 7
		UK TREASURY	2.0	1,200	1,283	183,166	2025/ 9 / 7

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

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			%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
	国債証券	UK TREASURY	1.5	700	726	103,663	2026/7/22
		UK TREASURY	4.25	9,630	12,200	1,740,691	2027/12/7
		UK TREASURY	1.625	200	208	29,742	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	6,500	9,418	1,343,691	2028/12/7
		UK TREASURY	4.75	5,700	7,864	1,121,998	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	5,250	7,074	1,009,301	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	6,600	9,364	1,336,067	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	2,900	4,076	581,639	2036/3/7
		UK TREASURY	1.75	200	204	29,187	2037/9/7
		UK TREASURY	4.75	4,100	6,301	899,005	2038/12/7
		UK TREASURY	4.25	5,200	7,588	1,082,705	2039/9/7
		UK TREASURY	4.25	3,800	5,618	801,617	2040/12/7
		UK TREASURY	4.5	5,900	9,194	1,311,787	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	23,800	32,815	4,681,778	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	6,700	10,503	1,498,547	2046/12/7
		UK TREASURY	1.5	2,800	2,686	383,217	2047/7/22
		UK TREASURY	4.25	5,350	8,680	1,238,429	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	8,750	13,538	1,931,466	2052/7/22
		UK TREASURY	1.75	3,000	3,133	447,099	2057/7/22
		UK TREASURY	2.5	200	260	37,228	2065/7/22
		UK TREASURY	3.5	3,850	6,382	910,540	2068/7/22
UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	21,800	28,712	4,096,452	2044/1/22		
UNITED KINGDOM(GOVERNEN	4.25	6,800	11,789	1,682,056	2055/12/7		
小 計					41,016,767		
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	1,700	1,866	22,268	2020/12/1
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	50,750	56,994	679,947	2022/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	29,900	32,188	384,007	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	34,350	39,540	471,715	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	12,000	12,717	151,725	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	15,300	15,839	188,969	2028/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	10,000	10,232	122,079	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	10,500	15,202	181,364	2039/3/30
		小 計					2,202,079
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	20,600	21,811	279,402	2021/5/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	11,700	12,065	154,560	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	44,900	48,635	623,023	2024/3/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	4,700	4,801	61,504	2025/3/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	4,700	4,710	60,339	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	9,600	9,744	124,824	2027/2/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	7,200	7,421	95,072	2028/4/26
小 計					1,398,727		
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	0.25	5,000	5,074	84,951	2020/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	34,100	37,407	626,204	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	16,070	17,509	293,101	2023/11/15

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
デンマーク			%	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ	千円	
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	1.75	36,600	41,389	692,853	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	12,200	12,716	212,877	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	42,000	74,899	1,253,811	2039/11/15
小 計						3,163,800	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDES Obligation	—	100	100	12,575	2020/4/17
		BUNDES Obligation	0.25	2,000	2,026	253,220	2020/10/16
		BUNDES Obligation	—	1,600	1,619	202,272	2021/4/9
		BUNDES Obligation	—	3,300	3,354	419,042	2022/4/8
		BUNDES Obligation	—	1,900	1,934	241,630	2022/10/7
		BUNDES Obligation	—	1,000	1,018	127,266	2023/4/14
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	100	104	13,107	2020/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	100	104	13,038	2020/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	13,300	14,079	1,758,953	2021/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	4,800	5,235	654,065	2021/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	6,400	6,857	856,759	2021/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	14,300	15,351	1,917,860	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	6,500	7,000	874,523	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,000	5,358	669,399	2022/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	3,000	3,238	404,533	2023/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	11,000	11,918	1,489,005	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	5,600	6,217	776,760	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	13,900	18,430	2,302,565	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	2,200	2,436	304,446	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,500	1,647	205,836	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	10,300	11,061	1,381,949	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	2,700	2,829	353,501	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	9,100	9,849	1,230,517	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	8,800	9,238	1,154,210	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	1,012	126,436	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	700	720	90,000	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	19,400	30,168	3,768,932	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,047	130,890	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	6,000	9,036	1,128,949	2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	3,200	3,346	418,061	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	6,300	9,103	1,137,253	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	6,500	10,835	1,353,662	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	5,300	8,637	1,079,124	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	7,800	12,951	1,618,063	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	4,500	7,248	905,551	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	6,200	10,674	1,333,540	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	7,200	13,348	1,667,633	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	3,900	6,163	770,055	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	5,800	8,301	1,037,059	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	7,200	10,456	1,306,275	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	5,600	6,383	797,455	2048/8/15
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	100	100	12,586	2020/6/12

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	100	104	13,001	2020/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	24,200	25,198	3,148,047	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.7	3,000	3,014	376,547	2020/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,800	1,800	224,948	2020/6/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	7,200	7,589	948,185	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.2	4,000	3,984	497,721	2020/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	2,000	2,006	250,639	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	11,400	12,106	1,512,431	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	100	98	12,293	2021/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	12,000	12,771	1,595,555	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.45	100	99	12,413	2021/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	8,000	8,541	1,067,102	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	14,400	15,756	1,968,457	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.3	400	413	51,606	2021/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	550	541	67,635	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	100	103	12,869	2021/12/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	18,688	2,334,731	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	300	300	37,479	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	400	401	50,161	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.9	400	394	49,227	2022/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	7,400	8,441	1,054,556	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	2,100	2,105	263,047	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	30,400	34,774	4,344,385	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	100	97	12,204	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,100	1,227	153,364	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	500	565	70,654	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	18,700	24,803	3,098,723	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	15,900	17,865	2,231,904	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	1,000	997	124,605	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	800	871	108,859	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	6,700	6,490	810,915	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	19,504	2,436,709	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	5,300	5,068	633,193	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	3,000	2,885	360,518	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	2,959	369,692	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	11,500	13,123	1,639,556	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	16,100	21,525	2,689,205	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	15,500	20,129	2,514,822	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	7,300	8,556	1,068,942	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	19,700	23,903	2,986,324	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	18,300	23,780	2,970,941	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	429	53,657	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	10,900	14,008	1,750,104	2033/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	4,500	4,154	519,009	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	11,100	13,447	1,680,014	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	1,500	1,634	204,223	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	500	464	58,011	2038/9/1



## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,000	9,720	1,214,419	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	13,300	16,086	2,009,667	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	14,800	17,511	2,187,694	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	5,300	5,042	630,015	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	2,800	2,701	337,490	2048/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	2,200	1,809	226,005	2067/3/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	100	100	12,558	2020/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,000	1,006	125,750	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	5,700	5,753	718,744	2021/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	8,000	8,079	1,009,334	2021/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	3,000	3,028	378,294	2023/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	5,970	6,478	809,362	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	100	100	12,542	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	3,500	3,935	491,629	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	11,000	11,316	1,413,742	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,800	1,838	229,708	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	2,500	2,635	329,281	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,000	2,040	254,912	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	12,000	14,369	1,795,232	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,000	1,036	129,473	2034/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	100	101	12,721	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	100	108	13,598	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	5,100	5,651	705,993	2048/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	6,000	6,284	785,159	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.5	24,900	26,159	3,268,130	2020/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	0.25	1,100	1,114	139,214	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.75	11,800	12,886	1,609,871	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	17,600	19,350	2,417,435	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.0	9,500	10,525	1,314,953	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	—	2,900	2,932	366,411	2022/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.25	17,600	19,264	2,406,652	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	8.5	7,200	9,852	1,230,856	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.25	29,300	35,432	4,426,580	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.75	3,000	3,308	413,370	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	6.0	19,800	27,621	3,450,743	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.0	6,000	6,357	794,217	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	34,100	42,304	5,285,096	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.75	7,200	8,677	1,084,072	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.5	27,000	40,311	5,036,053	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.5	13,500	14,636	1,828,514	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.75	17,600	28,813	3,599,721	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.75	7,300	11,417	1,426,327	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	4,000	5,993	748,705	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.5	17,500	28,403	3,548,499	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	21,200	29,624	3,700,960	2045/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	5,200	8,534	1,066,170	2055/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	3,200	5,384	672,703	2060/4/25

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	3,800	4,017	501,922	2020/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	6,350	6,934	866,272	2021/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	2,300	2,332	291,372	2022/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	1,500	1,639	204,798	2022/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	1,600	1,863	232,864	2023/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	6,300	8,262	1,032,227	2023/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	1,400	1,530	191,188	2023/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	100	101	12,652	2024/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	13,500	15,142	1,891,808	2024/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,000	1,023	127,879	2025/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	4,000	4,151	518,659	2026/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	4,000	4,214	526,568	2027/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	7,300	10,802	1,349,561	2028/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	1,050	131,186	2028/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	4,600	5,854	731,392	2033/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	4,000	6,316	789,074	2037/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	5,200	8,582	1,072,190	2042/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	4,400	6,571	821,013	2047/ 1 /15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	100	101	12,695	2020/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	18,050	18,974	2,370,457	2020/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.15	6,900	7,042	879,806	2020/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	10,900	11,848	1,480,280	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	3,600	3,615	451,717	2021/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	15,900	17,878	2,233,503	2021/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	5,900	6,030	753,449	2021/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	1,000	1,003	125,345	2021/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	14,550	17,092	2,135,407	2022/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4	5,350	5,425	677,826	2022/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	13,500	16,321	2,039,039	2023/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	4,800	5,720	714,654	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	10,900	13,277	1,658,731	2024/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	7,800	9,153	1,143,521	2024/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	450	506	63,297	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	900	955	119,346	2025/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	15,600	19,529	2,439,779	2025/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	5,000	5,467	683,002	2025/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	6,000	6,466	807,865	2026/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	22,400	30,506	3,811,128	2026/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	3,100	3,188	398,398	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	2,000	2,039	254,797	2028/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	5,000	5,069	633,332	2028/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	9,300	12,602	1,574,421	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	2,000	2,100	262,371	2030/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	3,400	3,636	454,282	2033/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	4,400	6,482	809,866	2040/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	8,400	12,122	1,514,422	2041/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	8,100	12,534	1,565,945	2044/10/31

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	4,000	4,407	550,658	2046/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	2,000	2,099	262,304	2048/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	3,500	4,143	517,703	2066/ 7 /30
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	16,000	23,083	2,883,834	2029/ 1 /31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	13,900	20,811	2,599,928	2032/ 7 /30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	2,000	2,677	334,517	2037/ 1 /31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.75	1,800	1,923	240,307	2020/ 9 /28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	5,700	6,400	799,582	2021/ 9 /28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	1,800	2,047	255,768	2022/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	4,800	5,599	699,568	2022/ 9 /28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	7,900	8,761	1,094,524	2023/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	0.2	2,900	2,946	368,166	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	4,000	4,560	569,680	2024/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	1,000	1,027	128,317	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,000	1,042	130,289	2025/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	8,400	10,943	1,367,162	2026/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	1,053	131,612	2026/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	2,000	2,061	257,551	2027/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,000	1,021	127,653	2028/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	1,000	1,022	127,681	2029/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,500	1,522	190,237	2031/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	4,840	604,779	2032/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM	1.25	500	515	64,370	2033/ 4 /22
		BELGIUM KINGDOM	1.45	1,000	1,024	127,979	2037/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	500	546	68,285	2038/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	5,400	8,294	1,036,197	2041/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	5,500	8,135	1,016,315	2045/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	2,700	2,691	336,288	2047/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	2.25	1,200	1,329	166,069	2057/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	1,000	1,065	133,139	2066/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	11,500	16,630	2,077,670	2028/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	11,000	17,243	2,154,283	2035/ 3 /28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	1,800	1,908	238,366	2020/ 7 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	2,000	2,206	275,670	2021/ 9 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,000	3,384	422,781	2022/ 4 /20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	1,600	1,619	202,346	2022/ 9 /20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	6,600	7,539	941,869	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	2,000	2,021	252,583	2023/ 7 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	1,550	1,696	211,964	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	4,800	5,284	660,230	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,300	1,404	175,401	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,222	902,306	2026/ 3 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,090	261,178	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	7,600	11,435	1,428,604	2027/ 7 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	1,000	1,225	153,076	2034/ 5 /23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	4,100	6,321	789,778	2037/ 3 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	5,700	8,271	1,033,364	2044/ 6 /20

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	1,500	1,605	200,568	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	450	811	101,322	2062/1/26
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	1,300	1,596	199,486	2117/9/20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	3.375	100	104	13,053	2020/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.375	1,000	1,013	126,610	2020/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	3.5	600	651	81,395	2021/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	1,500	1,517	189,604	2022/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	3,200	3,427	428,159	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	1,200	1,289	161,108	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	400	404	50,497	2023/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	2,900	3,224	402,783	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	3,600	4,531	566,097	2025/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	100	105	13,222	2025/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,060	257,472	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,300	4,047	505,612	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	800	815	101,916	2031/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	1,500	1,581	197,632	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	1,000	1,367	170,791	2042/7/4
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	4.5	680	719	89,879	2020/4/18
		IRISH GOVERNMENT	5.0	500	545	68,149	2020/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.4	2,430	3,183	397,774	2025/3/13
		IRISH GOVERNMENT	0.9	6,000	6,093	761,273	2028/5/15
		IRISH TSY 0.8% 2022	0.8	2,500	2,581	322,447	2022/3/15
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	4,600	4,793	598,871	2026/5/15
		IRISH TSY 1.3% 2033	1.3	1,400	1,413	176,526	2033/5/15
		IRISH TSY 1.35% 2031	1.35	2,000	2,070	258,660	2031/3/18
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	1,300	1,357	169,619	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	2,800	3,040	379,909	2045/2/18
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	4,600	5,310	663,465	2030/5/15
		IRISH TSY 2022	—	2,000	2,010	251,209	2022/10/18
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	5,200	6,076	759,119	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	6,750	7,854	981,288	2023/3/20
小 計						232,785,196	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	4,000	4,005	115,566	2020/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	22,200	23,554	679,538	2020/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	600	606	17,500	2021/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	3,800	3,820	110,211	2021/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	13,500	14,964	431,713	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	1,800	1,824	52,631	2022/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	10,000	11,343	327,245	2022/9/23
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	14,400	15,650	451,520	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,100	1,113	32,115	2024/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	22,900	24,082	694,788	2025/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	11,500	11,505	331,940	2026/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,200	2,183	63,006	2027/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	2,200	2,212	63,829	2028/4/25

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

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	
ポーランド			%	千ズロチ	千ズロチ	千円	
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	9,200	11,726	338,312	2029/4/25
小 計						3,709,921	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	2,400	2,447	199,540	2020/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	2,480	2,498	203,710	2021/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	1,000	983	80,168	2021/10/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	1,800	1,791	146,034	2022/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	1,400	1,457	118,798	2022/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	300	297	24,280	2023/2/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	3,000	3,099	252,661	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	1,900	2,000	163,117	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	1,100	1,123	91,611	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	700	703	57,356	2026/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	3,900	4,307	351,194	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	300	319	26,085	2029/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	2,400	2,557	208,488	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	850	956	77,955	2033/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	800	781	63,698	2036/8/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	3,000	3,120	254,373	2042/4/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	800	828	67,534	2046/3/1
小 計						2,386,611	
マレーシア				千リンギ	千リンギ		
	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3.882	1,100	1,110	30,120	2022/3/10
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	400	404	10,975	2024/9/30
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.642	600	624	16,933	2033/11/7
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.762	400	415	11,260	2037/4/7
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.492	5,300	5,302	143,867	2020/3/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.889	2,400	2,413	65,476	2020/7/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.659	600	601	16,324	2020/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	6,000	6,081	165,004	2021/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	8,700	8,800	238,748	2021/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	4,600	4,559	123,707	2022/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.795	500	501	13,607	2022/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	13,000	12,880	349,456	2023/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.8	2,200	2,205	59,828	2023/8/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	5,800	5,912	160,415	2024/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.955	600	603	16,381	2025/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	8,800	9,076	246,232	2026/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.892	3,400	3,397	92,164	2027/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	7,000	6,815	184,897	2027/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	1,800	1,772	48,094	2028/6/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	5.248	2,700	2,980	80,871	2028/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	5,700	5,942	161,224	2030/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	4,400	4,443	120,550	2031/6/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	5,100	5,063	137,372	2032/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	800	762	20,699	2033/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.254	900	884	23,999	2035/5/31

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

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			%	千リンギ	千リンギ	千円	
	国債証券	MALYSIAN GOVERNMENT	4.935	9,700	10,051	272,703	2043/9/30
小 計						2,810,923	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	7,750	7,990	631,450	2020/4/15
AUSTRALIAN GOVERNMENT		1.75	5,200	5,199	410,951	2020/11/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		5.75	11,100	12,076	954,405	2021/5/15	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.0	5,100	5,146	406,761	2021/12/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		5.75	7,500	8,501	671,883	2022/7/15	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.25	2,500	2,550	201,566	2022/11/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		5.5	8,100	9,346	738,649	2023/4/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.75	6,400	6,702	529,715	2024/4/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		3.25	13,200	14,280	1,128,550	2025/4/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		4.25	12,780	14,720	1,163,321	2026/4/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		4.75	11,700	14,108	1,115,026	2027/4/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.75	3,200	3,375	266,793	2027/11/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.25	17,800	17,986	1,421,504	2028/5/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.75	1,200	1,268	100,234	2028/11/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		3.25	10,100	11,155	881,657	2029/4/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.75	1,400	1,480	116,981	2029/11/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.5	500	518	40,973	2030/5/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		4.5	7,300	9,292	734,410	2033/4/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		2.75	1,800	1,893	149,630	2035/6/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT		3.75	5,000	5,960	471,042	2037/4/21	
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,400	1,554	122,812	2039/6/21		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,500	1,542	121,911	2041/5/21		
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	3,900	4,135	326,802	2047/3/21		
小 計						12,707,039	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	52,600	52,476	301,739	2020/6/11
MEX BONOS DESARR FIX RT		6.5	103,000	99,384	571,462	2021/6/10	
MEX BONOS DESARR FIX RT		7.25	54,600	53,320	306,595	2021/12/9	
MEX BONOS DESARR FIX RT		6.5	108,100	102,939	591,901	2022/6/9	
MEX BONOS DESARR FIX RT		10.0	40,000	43,296	248,956	2024/12/5	
MEX BONOS DESARR FIX RT		5.75	47,700	41,328	237,640	2026/3/5	
MEX BONOS DESARR FIX RT		7.5	86,300	81,959	471,264	2027/6/3	
MEX BONOS DESARR FIX RT		8.5	49,600	49,801	286,360	2029/5/31	
MEX BONOS DESARR FIX RT		7.75	46,500	43,697	251,260	2031/5/29	
MEX BONOS DESARR FIX RT		7.75	10,000	9,225	53,043	2034/11/23	
MEX BONOS DESARR FIX RT		10.0	56,300	62,753	360,833	2036/11/20	
MEX BONOS DESARR FIX RT		8.5	40,300	39,250	225,693	2038/11/18	
MEX BONOS DESARR FIX RT		7.75	64,200	57,563	330,987	2042/11/13	
MEX BONOS DESARR FIX RT		8.0	15,000	13,740	79,006	2047/11/7	
MEXICAN FIXED RATE BONDS		8.0	83,000	82,382	473,699	2023/12/7	
小 計						4,790,444	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	5,900	5,857	46,042	2021/3/31
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA		7.75	63,200	62,741	493,147	2023/2/28	

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			%	千ランド	千ランド	千円	
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10. 5	59, 300	64, 680	508, 389	2026/12/21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 0	34, 000	30, 808	242, 156	2030/ 1 /31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7. 0	30, 000	24, 651	193, 756	2031/ 2 /28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 25	46, 400	41, 732	328, 021	2032/ 3 /31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 875	6, 800	6, 317	49, 656	2035/ 2 /28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6. 25	38, 100	27, 190	213, 716	2036/ 3 /31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 5	32, 000	28, 380	223, 073	2037/ 1 /31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9. 0	11, 800	10, 848	85, 272	2040/ 1 /31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6. 5	30, 600	21, 343	167, 756	2041/ 2 /28	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 75	77, 500	69, 042	542, 670	2044/ 1 /31	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8. 75	50, 200	44, 701	351, 356	2048/ 2 /28	
小 計					3, 445, 015		
合 計					601, 913, 271		

\* 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。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## <新興国債券マザーファンド>

下記は、新興国債券マザーファンド全体（9, 969, 921千口）の内容です。

### 外国公社債

#### (A) 外国（外貨建）公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	163, 845	163, 969	18, 125, 224	98. 3	41. 9	73. 1	20. 3	4. 9
合 計	163, 845	163, 969	18, 125, 224	98. 3	41. 9	73. 1	20. 3	4. 9

\* 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。

\* 組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 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。

\* S&Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。

## (B) 外国（外貨建）公社債 銘柄別開示

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	ARGENT-GLOBAL	11.608874	640	786	86,889	2033/12/31	
	ARGENT-GLOBAL	11.608874	420	503	55,686	2033/12/31	
	ARGENT-GLOBAL	2.5	1,900	1,113	123,127	2038/12/31	
	BRAZIL GLOBAL	8.75	650	810	89,634	2025/ 2 / 4	
	BRAZIL GLOBAL	8.25	1,070	1,367	151,130	2034/ 1 / 20	
	BRAZIL GLOBAL	7.125	900	1,059	117,071	2037/ 1 / 20	
	COLOMBIA GLOBAL	8.125	250	297	32,920	2024/ 5 / 21	
	COLOMBIA GLOBAL	7.375	1,220	1,537	169,957	2037/ 9 / 18	
	CROATIA	6.625	1,000	1,044	115,408	2020/ 7 / 14	
	CROATIA	6.375	500	526	58,171	2021/ 3 / 24	
	CROATIA	5.5	800	859	94,953	2023/ 4 / 4	
	CROATIA	6.0	800	885	97,876	2024/ 1 / 26	
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.875	1,930	1,991	220,169	2021/ 1 / 22	
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2.625	1,100	1,058	116,973	2023/ 1 / 5	
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.25	1,800	1,815	200,713	2025/ 1 / 7	
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	6.0	900	986	109,086	2026/ 4 / 7	
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.625	1,700	1,695	187,403	2028/ 1 / 13	
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.625	1,200	1,210	133,808	2041/ 1 / 7	
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.0	1,600	1,469	162,383	2045/ 1 / 27	
	FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.625	1,500	1,482	163,841	2047/ 2 / 21	
	HUNGARY	5.375	1,100	1,178	130,280	2023/ 2 / 21	
	HUNGARY	5.75	750	822	90,966	2023/11/22	
	HUNGARY	5.375	1,100	1,196	132,235	2024/ 3 / 25	
	INDONESIA GLOBAL	5.875	1,200	1,308	144,612	2024/ 1 / 15	
	MEXICO GLOBAL	6.75	880	1,043	115,392	2034/ 9 / 27	
	PANAMA GLOBAL	7.125	300	359	39,709	2026/ 1 / 29	
	PANAMA GLOBAL	9.375	250	357	39,559	2029/ 4 / 1	
	PANAMA GLOBAL	6.7	950	1,206	133,366	2036/ 1 / 26	
	PERU GLOBAL	7.35	900	1,109	122,616	2025/ 7 / 21	
	PERU GLOBAL	6.55	670	873	96,539	2037/ 3 / 14	
	PHILIPPINES GLOBAL	3.0	1,000	968	107,030	2028/ 2 / 1	
	PHILIPPINES GLOBAL	9.5	750	1,136	125,601	2030/ 2 / 2	
	PHILIPPINES GLOBAL	7.75	800	1,105	122,245	2031/ 1 / 14	
	PHILIPPINES GLOBAL	6.375	500	632	69,936	2032/ 1 / 15	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	6.875	2,400	2,298	254,087	2021/ 4 / 22	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	5.625	2,250	2,039	225,397	2022/ 1 / 26	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	4.625	600	514	56,914	2023/ 1 / 11	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	7.5	3,500	3,061	338,383	2026/ 4 / 22	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	6.875	1,900	1,582	174,977	2027/ 1 / 26	
	REPUBLIC OF ARGENTINA	5.875	1,800	1,409	155,844	2028/ 1 / 11	
REPUBLIC OF ARGENTINA	6.625	1,500	1,224	135,342	2028/ 7 / 6		
REPUBLIC OF ARGENTINA	7.125	2,100	1,647	182,080	2036/ 7 / 6		
REPUBLIC OF ARGENTINA	7.625	1,350	1,094	120,931	2046/ 4 / 22		
REPUBLIC OF ARGENTINA	6.875	1,300	984	108,854	2048/ 1 / 11		
REPUBLIC OF ARGENTINA	7.125	900	690	76,330	2117/ 6 / 28		
REPUBLIC OF COLOMBIA	4.375	1,100	1,126	124,481	2021/ 7 / 12		



銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2.625	600	577	63,861	2023/3/15	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	4.0	1,600	1,613	178,323	2024/2/26	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	4.5	1,000	1,028	113,731	2026/1/28	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	3.875	1,000	984	108,800	2027/4/25	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	6.125	1,020	1,152	127,408	2041/1/18	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	5.625	1,100	1,192	131,807	2044/2/26	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	5.0	2,200	2,208	244,160	2045/6/15	
	REPUBLIC OF HUNGARY	6.375	1,500	1,593	176,134	2021/3/29	
	REPUBLIC OF HUNGARY	7.625	600	877	96,951	2041/3/29	
	REPUBLIC OF INDONESIA	4.875	1,000	1,031	113,986	2021/5/5	
	REPUBLIC OF INDONESIA	3.75	1,500	1,508	166,725	2022/4/25	
	REPUBLIC OF INDONESIA	3.375	1,300	1,285	142,130	2023/4/15	
	REPUBLIC OF INDONESIA	4.125	1,200	1,212	134,054	2025/1/15	
	REPUBLIC OF INDONESIA	4.75	1,200	1,246	137,820	2026/1/8	
	REPUBLIC OF INDONESIA	4.35	700	710	78,540	2027/1/8	
	REPUBLIC OF INDONESIA	3.85	400	392	43,331	2027/7/18	
	REPUBLIC OF INDONESIA	3.5	400	382	42,231	2028/1/11	
	REPUBLIC OF INDONESIA	4.1	700	697	77,104	2028/4/24	
	REPUBLIC OF INDONESIA	7.75	900	1,206	133,325	2038/1/17	
	REPUBLIC OF INDONESIA	5.25	1,200	1,262	139,515	2042/1/17	
	REPUBLIC OF INDONESIA	4.625	800	784	86,669	2043/4/15	
	REPUBLIC OF INDONESIA	6.75	800	1,001	110,656	2044/1/15	
	REPUBLIC OF INDONESIA	5.125	800	832	91,974	2045/1/15	
	REPUBLIC OF INDONESIA	5.95	800	919	101,590	2046/1/8	
	REPUBLIC OF INDONESIA	5.25	800	844	93,298	2047/1/8	
	REPUBLIC OF INDONESIA	4.35	700	663	73,336	2048/1/11	
	REPUBLIC OF PANAMA	3.75	1,100	1,113	123,053	2025/3/16	
	REPUBLIC OF PANAMA	3.875	1,300	1,316	145,571	2028/3/17	
	REPUBLIC OF PANAMA	4.5	500	506	55,947	2047/5/15	
	REPUBLIC OF PANAMA	4.5	800	799	88,387	2050/4/16	
	REPUBLIC OF PERU	4.125	600	635	70,237	2027/8/25	
	REPUBLIC OF PERU	5.625	1,200	1,464	161,830	2050/11/18	
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	4.0	1,600	1,630	180,236	2021/1/15	
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	4.2	800	838	92,646	2024/1/21	
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	5.5	800	908	100,407	2026/3/30	
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	6.375	800	1,039	114,918	2034/10/23	
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	5.0	800	924	102,241	2037/1/13	
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.95	1,200	1,230	136,031	2040/1/20	
	REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.7	1,600	1,575	174,153	2042/2/2	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.5	200	203	22,480	2020/3/9	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.875	750	784	86,666	2022/5/30		
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.665	700	698	77,173	2024/1/17		
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.875	1,350	1,407	155,583	2025/9/16		
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.875	500	491	54,382	2026/4/14		
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.3	1,800	1,662	183,809	2028/10/12		
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.375	400	368	40,684	2044/7/24		
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.0	500	441	48,827	2046/10/12		

## 野村DC運用戦略ファンド（マイルド）

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5. 65	700	658	72, 761	2047/ 9 /27
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6. 3	300	302	33, 421	2048/ 6 /22
		REPUBLIC OF TURKEY	5. 625	1, 100	1, 109	122, 656	2021/ 3 /30
		REPUBLIC OF TURKEY	5. 125	600	590	65, 308	2022/ 3 /25
		REPUBLIC OF TURKEY	6. 25	1, 700	1, 721	190, 344	2022/ 9 /26
		REPUBLIC OF TURKEY	3. 25	200	181	20, 066	2023/ 3 /23
		REPUBLIC OF TURKEY	4. 25	400	349	38, 646	2026/ 4 /14
		REPUBLIC OF TURKEY	4. 875	1, 300	1, 165	128, 807	2026/10/ 9
		REPUBLIC OF TURKEY	6. 0	2, 100	2, 003	221, 415	2027/ 3 /25
		REPUBLIC OF TURKEY	5. 125	1, 100	985	108, 919	2028/ 2 /17
		REPUBLIC OF TURKEY	6. 125	1, 100	1, 043	115, 364	2028/10/24
		REPUBLIC OF TURKEY	6. 75	600	565	62, 547	2040/ 5 /30
		REPUBLIC OF TURKEY	6. 0	1, 200	1, 038	114, 787	2041/ 1 /14
		REPUBLIC OF TURKEY	4. 875	2, 200	1, 680	185, 792	2043/ 4 /16
		REPUBLIC OF TURKEY	6. 625	1, 400	1, 297	143, 427	2045/ 2 /17
		REPUBLIC OF TURKEY	5. 75	1, 600	1, 335	147, 571	2047/ 5 /11
		ROMANIA	6. 75	900	978	108, 214	2022/ 2 / 7
		ROMANIA	4. 375	300	307	33, 975	2023/ 8 /22
		ROMANIA	4. 875	500	526	58, 198	2024/ 1 /22
		ROMANIA	6. 125	600	680	75, 220	2044/ 1 /22
		ROMANIA	5. 125	600	600	66, 392	2048/ 6 /15
		RUSSIA	7. 5	1, 452	1, 608	177, 797	2030/ 3 /31
		RUSSIA FOREIGN BOND	5. 0	1, 100	1, 123	124, 158	2020/ 4 /29
		RUSSIAN FEDERATION	4. 5	1, 200	1, 226	135, 595	2022/ 4 / 4
		RUSSIAN FEDERATION	4. 875	1, 800	1, 857	205, 303	2023/ 9 /16
		RUSSIAN FEDERATION	4. 75	1, 400	1, 409	155, 861	2026/ 5 /27
		RUSSIAN FEDERATION	4. 25	1, 400	1, 358	150, 181	2027/ 6 /23
		RUSSIAN FEDERATION	4. 375	800	774	85, 613	2029/ 3 /21
		RUSSIAN FEDERATION	5. 625	1, 400	1, 486	164, 317	2042/ 4 / 4
		RUSSIAN FEDERATION	5. 875	800	875	96, 825	2043/ 9 /16
		RUSSIAN FEDERATION	5. 25	3, 200	3, 118	344, 681	2047/ 6 /23
		TURKEY GLOBAL	7. 0	850	872	96, 437	2020/ 6 / 5
		TURKEY GLOBAL	5. 75	1, 500	1, 470	162, 528	2024/ 3 /22
		TURKEY GLOBAL	7. 375	1, 200	1, 251	138, 388	2025/ 2 / 5
		TURKEY GLOBAL	11. 875	650	884	97, 734	2030/ 1 /15
		UKRAINE GOVERNMENT	7. 75	600	529	58, 526	2027/ 9 / 1
UKRAINE GOVERNMENT	7. 375	1, 400	1, 182	130, 725	2032/ 9 /25		
UKRAINE GOVERNMENT REGS	7. 75	965	943	104, 271	2020/ 9 / 1		
UKRAINE GOVERNMENT REGS	7. 75	409	393	43, 525	2021/ 9 / 1		
UKRAINE GOVERNMENT REGS	7. 75	709	663	73, 309	2022/ 9 / 1		
UKRAINE GOVERNMENT REGS	7. 75	700	651	72, 007	2023/ 9 / 1		
UKRAINE GOVERNMENT REGS	7. 75	800	731	80, 827	2024/ 9 / 1		
UKRAINE GOVERNMENT REGS	7. 75	1, 200	1, 063	117, 592	2026/ 9 / 1		
UNITED MEXICAN STATES	3. 5	400	401	44, 359	2021/ 1 /21		
UNITED MEXICAN STATES	3. 625	1, 100	1, 102	121, 899	2022/ 3 /15		
UNITED MEXICAN STATES	4. 0	1, 650	1, 665	184, 113	2023/10/ 2		
UNITED MEXICAN STATES	3. 6	1, 200	1, 171	129, 530	2025/ 1 /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			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	4.125	1,000	996	110,194	2026/1/21
		UNITED MEXICAN STATES	4.15	2,200	2,164	239,296	2027/3/28
		UNITED MEXICAN STATES	3.75	1,100	1,045	115,575	2028/1/11
		UNITED MEXICAN STATES	6.05	1,910	2,098	231,927	2040/1/11
		UNITED MEXICAN STATES	4.75	1,800	1,696	187,531	2044/3/8
		UNITED MEXICAN STATES	5.55	1,300	1,368	151,246	2045/1/21
		UNITED MEXICAN STATES	4.6	1,500	1,381	152,752	2046/1/23
		UNITED MEXICAN STATES	4.35	900	805	89,015	2047/1/15
		UNITED MEXICAN STATES	4.6	1,600	1,477	163,267	2048/2/10
		UNITED MEXICAN STATES	5.75	1,300	1,273	140,792	2110/10/12
合 計						18,125,224	

\* 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。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

下記は、J-REITインデックス マザーファンド全体（17, 119, 807千口）の内容です。

## 国内投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	—	271	27, 127	0. 1
日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1, 252	1, 355	739, 830	2. 0
MCUBS MidCity投資法人 投資証券	4, 205	4, 596	416, 397	1. 1
森ヒルズリート投資法人 投資証券	4, 048	4, 677	658, 989	1. 8
産業ファンド投資法人 投資証券	4, 095	4, 752	562, 161	1. 5
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3, 489	3, 975	1, 208, 400	3. 2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	855	2, 436	444, 082	1. 2
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1, 705	2, 143	984, 708	2. 6
GLP投資法人 投資証券	7, 422	10, 106	1, 189, 476	3. 2
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1, 428	1, 691	473, 649	1. 3
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	4, 740	5, 471	1, 284, 590	3. 4
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	572	621	327, 888	0. 9
One リート投資法人 投資証券	412	594	160, 677	0. 4
イオンリート投資法人 投資証券	3, 579	4, 186	527, 854	1. 4
ヒューリックリート投資法人 投資証券	2, 559	3, 297	575, 656	1. 5
日本リート投資法人 投資証券	1, 013	1, 317	503, 752	1. 3
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	2, 088	24, 176	380, 046	1. 0
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	183	187	31, 546	0. 1
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	2, 364	10, 523	815, 532	2. 2
トーセイ・リート投資法人 投資証券	606	785	86, 664	0. 2
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1, 370	1, 495	386, 906	1. 0
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	464	854	94, 964	0. 3
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	654	816	77, 030	0. 2
ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	208	—	—	—
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	10, 995	12, 088	1, 890, 563	5. 1
いちごホテルリート投資法人 投資証券	590	713	94, 543	0. 3
ラサールロジポート投資法人 投資証券	2, 843	3, 077	328, 315	0. 9
スターアジア不動産投資法人 投資証券	884	1, 266	131, 284	0. 4
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	302	351	37, 241	0. 1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	713	990	323, 730	0. 9
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	633	658	53, 429	0. 1
さくら総合リート投資法人 投資証券	906	882	72, 853	0. 2
投資法人みらい 投資証券	479	1, 098	203, 349	0. 5
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	816	957	129, 577	0. 3
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	349	432	105, 667	0. 3
CRE ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	24	408	41, 697	0. 1
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	29	376	43, 728	0. 1
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	—	610	56, 547	0. 2
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	—	631	55, 023	0. 1
日本ビルファンド投資法人 投資証券	3, 649	3, 949	2, 843, 280	7. 6
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3, 562	4, 078	2, 565, 062	6. 9
日本リテールファンド投資法人 投資証券	7, 250	7, 708	1, 707, 322	4. 6

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
オリックス不動産投資法人 投資証券		7,271	8,126	1,487,870	4.0
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券		2,379	2,582	1,110,260	3.0
プレミア投資法人 投資証券		3,404	3,878	495,220	1.3
東急リアル・エステート投資法人 投資証券		2,527	2,734	441,541	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券		605	2,608	314,003	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券		8,312	8,995	1,552,537	4.2
森トラスト総合リート投資法人 投資証券		2,693	2,915	495,841	1.3
インヴィンシブル投資法人 投資証券		10,336	14,070	652,144	1.7
フロンティア不動産投資法人 投資証券		1,282	1,387	623,456	1.7
平和不動産リート投資法人 投資証券		2,347	2,540	305,054	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券		2,510	2,691	599,554	1.6
福岡リート投資法人 投資証券		1,829	2,109	358,530	1.0
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券		1,102	1,262	921,260	2.5
積水ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券		2,857	—	—	—
いちごオフィスリート投資法人 投資証券		2,918	3,384	338,738	0.9
大和証券オフィス投資法人 投資証券		813	941	692,576	1.9
阪急阪神リート投資法人 投資証券		1,645	1,835	259,652	0.7
スターツプロシード投資法人 投資証券		594	643	107,702	0.3
大和ハウスリート投資法人 投資証券		3,876	5,106	1,304,583	3.5
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券		10,877	13,128	1,092,249	2.9
日本賃貸住宅投資法人 投資証券		4,239	4,587	389,436	1.0
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券		3,375	3,652	570,807	1.5
合 計	口 数 ・ 金 額	161,126	219,769	36,754,168	
	銘 柄 数<比 率>	61	62	<98.2%>	

\*評価額の単位未満は切り捨て。  
\*比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。  
\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末
			買 建 額 売 建 額
国 内	REIT先物取引	東証REIT指数	百万円
			653 百万円 —

\*単位未満は切り捨て。

## &lt;海外REITインデックス マザーファンド&gt;

下記は、海外REITインデックス マザーファンド全体（10,568,270千口）の内容です。

## 外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
ACADIA REALTY TRUST	13,900	15,300	451	49,858	0.2
AGREE REALTY CORP	4,900	6,500	426	47,170	0.2
ALEXANDER & BALDWIN INC	11,800	—	—	—	—
ALEXANDERS INC	670	750	277	30,620	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,300	20,730	2,795	309,030	1.2
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,800	7,600	334	37,006	0.1
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,000	26,100	1,190	131,646	0.5
AMERICAN FINANCE TRUST INC	—	10,000	110	12,192	0.0
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	42,400	49,500	1,137	125,685	0.5
AMERICOLD REALTY TRUST	—	11,000	316	34,958	0.1
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	26,900	30,100	1,493	165,065	0.7
APPLE HOSPITALITY REIT INC	36,100	40,700	665	73,603	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	7,600	—	—	—	—
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	4,800	—	—	—	—
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,600	15,600	84	9,294	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,570	26,580	5,211	576,083	2.3
BRT APARTMENTS CORP	—	1,600	21	2,327	0.0
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	4,200	43	4,842	0.0
BOSTON PROPERTIES	26,360	29,720	3,971	438,974	1.8
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	—	6,000	71	7,885	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	29,800	34,800	555	61,433	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	51,400	56,900	1,020	112,837	0.5
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	28,400	31,000	70	7,744	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	15,880	17,970	1,773	196,058	0.8
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	13,500	16,200	363	40,148	0.2
CEDAR REALTY TRUST INC	12,000	16,000	56	6,278	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	7,500	9,500	199	22,021	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	9,900	11,600	339	37,519	0.1
CITY OFFICE REIT INC	6,300	8,000	96	10,717	0.0
CLIPPER REALTY INC	2,400	2,400	30	3,369	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	92,000	—	—	—	—
COLONY CAPITAL INC	—	96,000	585	64,732	0.3
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,900	22,200	506	56,000	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,900	3,500	121	13,405	0.1
CORESITE REALTY CORP	5,790	6,940	712	78,801	0.3
CORECIVIC INC	19,600	23,500	477	52,837	0.2
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	16,600	20,500	536	59,280	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	71,100	79,500	753	83,309	0.3
CUBESMART	31,100	35,800	1,117	123,508	0.5
CYRUSONE INC	15,400	20,100	1,153	127,534	0.5
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	15,690	—	—	—	—

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	千米ドル	千円	%	
DDR CORP	53,100	—	—	—	—	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,500	41,400	446	49,378	0.2	
DIGITAL REALTY TRUST INC	35,070	39,690	4,565	504,674	2.0	
DOUGLAS EMMETT INC	27,400	30,700	1,185	130,992	0.5	
DUKE REALTY CORP	61,000	69,200	2,060	227,798	0.9	
EPR PROPERTIES	10,850	14,120	1,066	117,857	0.5	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	7,300	12,200	219	24,220	0.1	
EASTGROUP PROPERTIES	5,850	6,820	733	81,132	0.3	
EDUCATION REALTY TRUST INC	12,600	—	—	—	—	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	21,900	26,300	408	45,206	0.2	
EQUITY COMMONWEALTH	21,400	23,200	757	83,783	0.3	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,050	17,320	1,887	208,647	0.8	
EQUITY RESIDENTIAL	62,740	70,850	5,186	573,363	2.3	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	—	6,500	107	11,905	0.0	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,280	12,720	3,546	392,040	1.6	
EXTRA SPACE STORAGE INC	21,540	24,430	2,436	269,293	1.1	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	5,500	30	3,416	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,430	14,280	1,934	213,856	0.9	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	20,000	24,200	820	90,711	0.4	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	44,900	—	—	—	—	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,300	12,700	353	39,111	0.2	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	17,600	20,100	143	15,841	0.1	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	—	10,000	113	12,491	0.0	
GEO GROUP INC/THE	20,600	23,700	534	59,076	0.2	
GGP INC	106,700	—	—	—	—	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	34,200	38,800	1,442	159,506	0.6	
GETTY REALTY CORP	5,500	6,400	214	23,706	0.1	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,700	5,400	112	12,469	0.0	
GLADSTONE LAND CORP	1,600	2,500	31	3,451	0.0	
GLOBAL NET LEASE INC	11,900	15,100	287	31,814	0.1	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	3,000	5,000	52	5,775	0.0	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	16,500	—	—	—	—	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	27,700	—	—	—	—	
HCP INC	80,300	92,100	2,840	313,973	1.3	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	21,500	23,700	777	85,903	0.3	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	34,500	39,800	1,134	125,385	0.5	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6,600	6,600	123	13,599	0.1	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,800	19,800	928	102,605	0.4	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	27,700	31,200	855	94,601	0.4	
HOST HOTELS & RESORTS INC	126,500	143,200	2,669	295,058	1.2	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26,700	29,700	1,001	110,736	0.4	
ISTAR INC	11,300	—	—	—	—	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	13,600	18,500	196	21,676	0.1	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	—	12,500	267	29,583	0.1	
INFRAREIT INC	6,200	8,000	169	18,694	0.1	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	—	2,000	129	14,367	0.1	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	18,300	—	—	—	—	

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	千米ドル	千円	%
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	—	2,200	132	14,618	0.1
INVITATION HOMES INC	48,900	56,400	1,326	146,634	0.6
IRON MOUNTAIN INC	48,200	54,600	1,917	211,966	0.8
JBG SMITH PROPERTIES	16,100	20,600	843	93,293	0.4
KILROY REALTY CORP	16,870	19,170	1,418	156,746	0.6
KIMCO REALTY CORP	73,000	81,200	1,442	159,411	0.6
KITE REALTY GROUP TRUST	13,800	17,000	287	31,758	0.1
LTC PROPERTIES INC	6,500	7,600	360	39,837	0.2
LASALLE HOTEL PROPERTIES	19,200	—	—	—	—
LEXINGTON REALTY TRUST	35,500	41,300	397	43,963	0.2
LIBERTY PROPERTY TRUST	25,300	28,500	1,354	149,769	0.6
LIFE STORAGE INC	7,870	8,840	884	97,717	0.4
MACERICH CO /THE	18,590	20,100	878	97,072	0.4
MACK-CALI REALTY CORP	15,800	16,900	356	39,380	0.2
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	5,600	5,600	60	6,685	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	61,500	69,400	1,274	140,848	0.6
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,440	21,980	2,289	253,122	1.0
MONMOUTH REIT-CLASS A	12,000	18,000	247	27,318	0.1
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,910	8,060	681	75,347	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	25,600	30,700	1,613	178,400	0.7
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,700	10,800	308	34,048	0.1
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,500	15,000	86	9,550	0.0
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3,000	4,100	157	17,389	0.1
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	9,500	9,700	167	18,496	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME	—	9,250	289	31,952	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	33,400	38,700	1,411	155,972	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,800	2,800	77	8,592	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,450	3,880	572	63,296	0.3
PARAMOUNT GROUP INC	35,300	38,500	562	62,219	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC	27,200	38,200	1,156	127,818	0.5
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	11,500	24,200	801	88,544	0.4
PENN REAL ESTATE INVEST TST	12,700	11,500	77	8,606	0.0
PHYSICIANS REALTY TRUST	29,800	34,400	642	70,994	0.3
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	24,000	25,100	520	57,544	0.2
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	6,800	8,000	125	13,901	0.1
PROLOGIS INC	90,780	120,960	8,611	951,875	3.8
PUBLIC STORAGE	25,540	28,830	5,989	662,039	2.6
QTS REALTY TRUST INC CL A	8,600	9,600	426	47,169	0.2
QUALITY CARE PROPERTIES	16,700	—	—	—	—
RLJ LODGING TRUST	29,500	33,100	632	69,921	0.3
RPT REALTY	—	15,700	209	23,185	0.1
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	14,200	—	—	—	—
REALTY INCOME CORP	48,200	56,790	3,980	439,994	1.8
REGENCY CENTERS CORP	25,340	32,700	2,168	239,724	1.0
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,200	22,400	399	44,124	0.2
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	37,700	42,000	535	59,240	0.2
RETAIL VALUE INC	—	2,680	82	9,174	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	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	12,900	17,500	612	67,744	0.3
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,830	9,830	832	92,079	0.4
SL GREEN REALTY CORP	15,890	16,440	1,505	166,462	0.7
SABRA HEALTH CARE REIT INC	30,800	34,100	681	75,350	0.3
SAFETY INCOME & GROWTH INC	—	1,500	28	3,157	0.0
SAUL CENTERS INC	2,070	2,400	137	15,206	0.1
SELECT INCOME REIT	10,500	—	—	—	—
SENIOR HOUSING PROP TRUST	40,200	46,200	652	72,161	0.3
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	4,600	5,300	231	25,631	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	53,010	59,410	10,893	1,204,158	4.8
SITE CENTERS CORP	—	28,700	384	42,511	0.2
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	78,600	—	—	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	—	16,200	655	72,471	0.3
SPIRIT MTA REIT	—	7,210	56	6,232	0.0
STAG INDUSTRIAL INC	16,100	21,200	609	67,350	0.3
STORE CAPITAL CORP	28,000	36,000	1,170	129,371	0.5
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	18,300	20,300	230	25,513	0.1
SUN COMMUNITIES INC	13,600	16,670	1,909	211,081	0.8
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	38,900	43,500	637	70,444	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16,400	18,400	399	44,197	0.2
TAUBMAN CENTERS INC	10,280	11,900	600	66,429	0.3
TERRENO REALTY CORP	9,000	11,600	480	53,137	0.2
TIER REIT INC	8,200	10,300	250	27,655	0.1
UDR INC	45,800	53,200	2,372	262,221	1.0
UMH PROPERTIES INC	5,000	7,200	98	10,895	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,290	2,630	199	22,077	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	18,400	22,400	451	49,918	0.2
URSTADT BIDDLE-CL A	5,000	6,000	129	14,299	0.1
VENTAS INC	60,800	68,600	4,473	494,490	2.0
VEREIT INC	167,000	186,500	1,542	170,491	0.7
VICI PROPERTIES INC	—	69,400	1,483	164,016	0.7
VORNADO REALTY TRUST	29,480	33,420	2,299	254,164	1.0
WP CAREY INC	18,330	31,100	2,338	258,522	1.0
WASHINGTON PRIME GROUP INC	30,400	37,000	207	22,944	0.1
WASHINGTON REAL ESTATE INV	13,600	15,400	413	45,656	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,200	23,200	693	76,653	0.3
WELLTOWER INC	63,230	72,230	5,605	619,661	2.5
WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,250	—	—	—	—
WHITESTONE REIT	5,900	7,400	106	11,770	0.0
XENIA HOTELS & RESORTS INC	18,200	22,000	419	46,400	0.2
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	165,990	225,007	195	21,638	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	3,966,910	4,305,007	164,600	18,194,940
	銘 柄 数 < 比 率 >	158	157	—	< 72.6% >
(カナダ)			千カナダドル		
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN	3,200	3,200	45	3,792	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,500	9,600	457	38,208	0.2
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	12,700	14,700	157	13,184	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	
(カナダ)		口	口	千カナダドル	千円	%
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		4,100	4,200	171	14,282	0.1
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		4,900	9,500	127	10,638	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		11,700	13,500	642	53,686	0.2
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST		6,300	—	—	—	—
CHOICE PROPERTIES REIT		7,000	26,200	351	29,318	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U		14,800	16,500	195	16,286	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT		6,700	8,200	112	9,415	0.0
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS		6,400	6,200	147	12,302	0.0
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT		6,600	9,000	98	8,222	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS		13,900	17,300	224	18,766	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		3,900	4,400	270	22,586	0.1
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		—	26,400	593	49,538	0.2
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		24,300	—	—	—	—
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		7,300	11,000	152	12,722	0.1
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		6,300	8,200	146	12,216	0.0
MINTO APARTMENT REAL ESTATE		—	1,500	28	2,403	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		3,300	3,300	57	4,773	0.0
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS		4,300	—	—	—	—
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST		4,500	5,800	156	13,097	0.1
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		9,100	9,400	100	8,383	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE		23,900	—	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		27,200	28,600	718	60,020	0.2
SLATE OFFICE REIT		5,900	5,900	39	3,266	0.0
SLATE RETAIL REIT		4,300	4,300	55	4,650	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		11,400	13,700	460	38,475	0.2
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT		4,100	8,000	88	7,355	0.0
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E		—	5,000	32	2,676	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	245,600	273,600	5,631	470,272	
	銘 柄 数 < 比 率 >	27	26	—	< 1.9% >	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		173,900	188,000	1,102	157,283	0.6
CAPITAL & REGIONAL PLC		93,000	93,000	29	4,245	0.0
DERWENT LONDON PLC		19,100	21,600	682	97,442	0.4
BIG YELLOW GROUP PLC		24,600	29,500	275	39,267	0.2
HAMMERSON PLC		133,600	147,000	559	79,758	0.3
INTU PROPERTIES PLC		151,000	162,000	190	27,203	0.1
UNITE GROUP PLC		41,000	49,600	434	61,918	0.2
SHAFTESBURY PLC		42,400	43,400	373	53,250	0.2
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST		78,700	110,000	64	9,165	0.0
PICTON PROPERTY INCOME LTD		—	104,000	92	13,190	0.1
HANSTEEN HOLDINGS PLC		70,000	82,000	76	10,915	0.0
UK COMMERCIAL PROPERTY REIT		—	125,000	108	15,479	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC		34,400	38,900	223	31,911	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		114,000	129,000	241	34,471	0.1
SEGRO PLC		170,300	194,700	1,246	177,778	0.7
WORKSPACE GROUP PLC		20,900	24,900	236	33,766	0.1
RDI REIT PLC		230,000	—	—	—	—

銘柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		口	口	千英ポンド	千円	%
NEWRIVER REIT PLC		54,000	63,000	135	19,279	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		29,000	122,000	121	17,336	0.1
AEW UK LONG LEASE REIT PLC		15,000	—	—	—	—
TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING		—	63,000	64	9,212	0.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		—	54,900	398	56,888	0.2
TRITAX BIG BOX REIT PLC		227,000	290,000	392	56,062	0.2
RDI REIT PLC		—	56,000	82	11,744	0.0
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		93,857	108,000	106	15,131	0.1
ASSURA PLC		407,000	444,000	257	36,803	0.1
LXI REIT PLC		39,000	64,000	78	11,230	0.0
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		102,000	151,000	176	25,162	0.1
REGIONAL REIT LTD		46,125	56,000	56	8,117	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		128,600	144,900	1,287	183,657	0.7
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		55,500	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	2,593,982	3,159,400	9,095	1,297,676	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	28	—	<5.2%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG		14,100	15,400	135	16,930	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		23,700	30,800	404	50,560	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	37,800	46,200	540	67,491	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.3%>	
(ユーロ…イタリア)						
BENI STABILI SPA		177,000	—	—	—	—
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		53,604	—	—	—	—
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		—	10,000	61	7,700	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	230,604	10,000	61	7,700	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	1	—	<0.0%>	
(ユーロ…フランス)						
ICADE		7,750	8,560	635	79,349	0.3
ALTAREA		590	680	120	15,070	0.1
KLEPIERRE		35,000	39,500	1,186	148,239	0.6
GECINA SA		8,240	10,580	1,335	166,806	0.7
COVIVIO		9,130	12,020	1,041	130,118	0.5
MERCIALYS		9,300	10,400	130	16,305	0.1
UNIBAIL RODAMCO-NA		16,950	—	—	—	—
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD		—	26,470	3,841	479,896	1.9
小 計	口 数 ・ 金 額	86,960	108,210	8,290	1,035,787	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	<4.1%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPRTI-CVA		8,000	7,600	198	24,743	0.1
VASTNED RETAIL NV		2,700	3,100	101	12,664	0.1
WERELDHAVE NV		7,000	7,700	197	24,626	0.1
NSI NV		3,300	3,800	141	17,683	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	21,000	22,200	638	79,717	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.3%>	
(ユーロ…スペイン)						
IMMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		55,600	51,900	453	56,668	0.2

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		口	口	千ユーロ	千円	%
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		16,300	14,000	114	14,341	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		18,800	—	—	—	—
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		56,300	70,300	791	98,847	0.4
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		11,100	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	158,100	136,200	1,359	169,858	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	3	—	<0.7%>	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO S. C. A.		3,800	4,300	206	25,785	0.1
COFINIMMO		3,420	4,030	464	58,049	0.2
RETAIL ESTATES		1,080	1,500	115	14,373	0.1
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES		2,400	4,114	87	10,947	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA		2,770	3,420	448	56,056	0.2
MONTEA		—	1,200	78	9,774	0.0
AEDIFICA		3,150	3,630	301	37,640	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	16,620	22,194	1,701	212,627	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	7	—	<0.8%>	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		116,000	126,000	180	22,509	0.1
HIBERNIA REIT PLC		113,000	140,000	174	21,757	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		64,000	70,000	105	13,152	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	293,000	336,000	459	57,420	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.2%>	
ユ ー ロ 計		口 数 ・ 金 額	844,084	681,004	13,052	1,630,602
		銘 柄 数 < 比 率 >	29	27	—	<6.5%>
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		370,100	409,100	35,428	498,827	2.0
PROSPERITY REIT		180,000	220,000	706	9,943	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		194,000	268,000	1,452	20,452	0.1
CHAMPION REIT		353,000	386,000	2,296	32,337	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT		174,000	195,000	1,099	15,485	0.1
FORTUNE REIT		225,000	263,000	2,527	35,586	0.1
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN		170,000	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	1,666,100	1,741,100	43,510	612,631	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	6	—	<2.4%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		455,000	538,000	1,285	104,832	0.4
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		405,000	491,000	1,355	110,486	0.4
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		432,964	543,964	1,017	82,933	0.3
SUNTEC REIT		377,000	429,000	815	66,455	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		350,000	444,000	617	50,317	0.2
STARHILL GLOBAL REIT		209,900	260,000	180	14,732	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST		221,000	227,000	256	20,913	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		103,000	139,000	207	16,885	0.1
KEPPEL REIT		292,000	340,000	414	33,818	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		94,000	106,000	241	19,704	0.1
ESR REIT		200,000	390,000	208	17,011	0.1
CDL HOSPITALITY TRUSTS		128,000	145,000	229	18,678	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	
(シンガポール)		口	口	千シンガポールドル	千円	%
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST		96,000	128,000	183	14,923	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		88,000	120,000	126	10,272	0.0
PARKWAY LIFE REAL ESTATE		61,000	72,000	201	16,436	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST		340,000	340,000	79	6,514	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		195,000	236,000	469	38,289	0.2
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		314,025	371,025	664	54,146	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST		180,860	209,860	150	12,233	0.0
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT		111,000	112,000	154	12,601	0.1
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		133,764	133,764	56	4,634	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL		306,000	402,000	502	40,968	0.2
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		129,000	150,000	127	10,395	0.0
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		142,000	162,000	103	8,453	0.0
SPH REIT		121,000	124,000	126	10,311	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST		200,043	220,043	157	12,827	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		106,700	136,700	82	6,687	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST		—	140,000	102	8,332	0.0
KEPPEL DC REIT		119,756	190,956	276	22,574	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI		178,000	299,000	331	27,058	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	6,090,012	7,600,312	10,725	874,430	
	銘 柄 数 < 比 率 >	29	30	—	<3.5%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
BWP TRUST		80,000	89,000	333	26,376	0.1
MIRVAC GROUP		621,000	713,000	1,832	144,815	0.6
INVESTA OFFICE FUND		83,000	—	—	—	—
CROMWELL PROPERTY GROUP		208,000	304,000	329	26,067	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT		55,000	66,000	302	23,889	0.1
GPT GROUP		308,000	346,000	2,037	161,058	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP		54,000	60,000	221	17,497	0.1
STOCKLAND TRUST GROUP		417,000	463,000	1,722	136,118	0.5
DEXUS		172,900	194,700	2,348	185,568	0.7
GOODMAN GROUP		274,200	305,900	3,927	310,410	1.2
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP		9,800	9,800	—	—	—
CHARTER HALL GROUP		81,000	90,000	773	61,098	0.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		46,000	56,000	223	17,658	0.1
INGENIA COMMUNITIES GROUP		32,000	39,000	122	9,647	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		120,000	176,000	438	34,634	0.1
ARENA REIT		43,220	52,000	141	11,178	0.0
PROPERTYLINK GROUP		66,000	80,000	92	7,302	0.0
CHARTER HALL LONG WALE REIT		27,702	40,444	183	14,511	0.1
INDUSTRIA REIT		20,000	20,000	58	4,583	0.0
NATIONAL STORAGE REIT		89,000	130,000	243	19,212	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L		22,680	27,000	84	6,678	0.0
GDI PROPERTY GROUP		96,000	90,000	129	10,206	0.0
CHARTER HALL EDUCATION TRUST		—	42,000	141	11,152	0.0
RURAL FUNDS GROUP		40,000	60,000	133	10,526	0.0
SCENTRE GROUP		910,000	1,027,000	4,087	323,031	1.3
WESTFIELD CORP		326,800	—	—	—	—

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	千豪ドル	千円	%
FOLKESTONE EDUCATION TRUST		33,250	—	—	—	—
VICINITY CENTRES		551,000	611,000	1,564	123,615	0.5
VIVA ENERGY REIT		69,000	80,000	194	15,363	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	4,856,552	5,171,844	21,665	1,712,202	
	銘 柄 数 < 比 率 >	28	26	—	<6.8%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND		177,000	201,000	309	23,540	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST		61,000	64,000	134	10,196	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST		175,000	190,000	313	23,841	0.1
ARGOSY PROPERTY LTD		138,000	160,000	199	15,149	0.1
INVESTORE PROPERTY LTD		32,000	—	—	—	—
STRIDE STAPLED GROUP		58,000	69,000	136	10,389	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD		234,545	290,000	417	31,758	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	875,545	974,000	1,510	114,876	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	6	—	<0.5%>	
(イスラエル)				千新シェケル		
REIT 1 LTD		28,000	34,000	534	16,328	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	28,000	34,000	534	16,328	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	21,166,785	23,940,267	—	24,923,961	
	銘 柄 数 < 比 率 >	312	307	—	<99.4%>	

\* 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。  
\* 比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。  
\* 金額の単位未満は切り捨て。  
\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	REIT先物取引	DJREA	百万円 125	百万円 —

\* 単位未満は切り捨て。  
\* 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。

# 国内株式マザーファンド

## 運用報告書

第17期（決算日2018年5月10日）

作成対象期間（2017年5月11日～2018年5月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資は行いません。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

# ○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク 東 証 株 価 指 数 ( T O P I X )		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率			
	円	%		%	%	%	百万円
13期(2014年 5 月12日)	10,381	△ 2.4	1,157.91	△ 4.4	97.7	2.3	174,610
14期(2015年 5 月11日)	14,594	40.6	1,598.33	38.0	98.1	1.9	259,915
15期(2016年 5 月10日)	12,439	△14.8	1,334.90	△16.5	97.7	2.3	279,492
16期(2017年 5 月10日)	15,104	21.4	1,585.19	18.7	98.6	1.4	335,246
17期(2018年 5 月10日)	17,299	14.5	1,777.62	12.1	98.4	1.6	379,913

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。  
東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

# ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク 東 証 株 価 指 数 ( T O P I X )		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2017年 5 月10日	15,104	—	1,585.19	—	98.6	1.4
5 月 末	14,950	△ 1.0	1,568.37	△ 1.1	98.2	1.7
6 月 末	15,382	1.8	1,611.90	1.7	98.8	1.0
7 月 末	15,445	2.3	1,618.61	2.1	98.8	1.2
8 月 末	15,439	2.2	1,617.41	2.0	97.8	2.2
9 月 末	16,109	6.7	1,674.75	5.6	97.7	2.3
10月 末	16,988	12.5	1,765.96	11.4	97.6	1.8
11月 末	17,244	14.2	1,792.08	13.1	98.3	1.7
12月 末	17,510	15.9	1,817.56	14.7	98.4	1.6
2018年 1 月 末	17,697	17.2	1,836.71	15.9	97.9	2.1
2 月 末	17,042	12.8	1,768.24	11.5	97.4	2.6
3 月 末	16,695	10.5	1,716.30	8.3	97.3	2.7
4 月 末	17,291	14.5	1,777.23	12.1	98.1	1.7
(期 末)						
2018年 5 月10日	17,299	14.5	1,777.62	12.1	98.4	1.6

\*騰落率は期首比です。

\*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。



## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首15,104円から期末17,299円に2,195円の値上がりとなりました。

衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったことや、国内企業の好決算などを背景に、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

期首から株式市場は一進一退の動きとなりましたが、2017年9月以降は、FOMC（米連邦公開市場委員会）において保有資産縮小が決定されたことなどから米国金利が上昇し外国為替市場で円安が進んだこと、衆議院議員選挙において安倍政権の経済政策が継続するとの期待が高まったことや、国内企業の好決算などを背景に上昇しました。

2018年1月下旬以降は、米国の長期金利の上昇などから米国株式市場が下落したこと、外国為替市場で円高ドル安が進行したことや、トランプ米大統領の保護主義的な通商政策が世界的な景気減速や貿易摩擦の拡大につながるとの懸念などから下落しました。3月下旬以降は、米中貿易摩擦懸念が薄れたこと、円高ドル安が一服したことなどから上昇しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

実質株式組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指すため、現物株式につきましては、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証株価指数（TOPIX）でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行いました。ただし、財務評価の視点から一部の銘柄は組み入れを見合わせました。

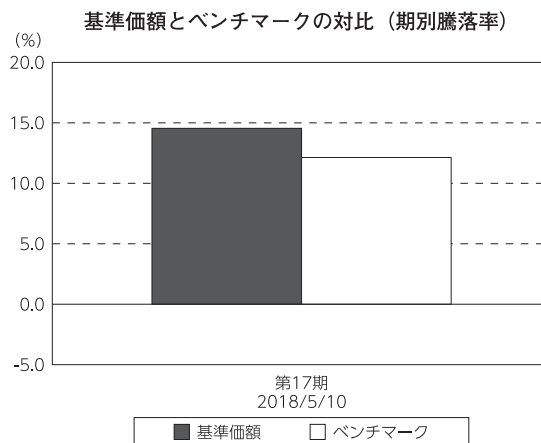
なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+14.5%となり、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）の+12.1%を2.4ポイント上回りました。

### （プラス要因）

保有銘柄の配当権利落ちによりファンドには未収配当金が計上されたこと



（注）ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、実質株式組入比率をできるだけ高位に維持し、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年 5 月11日～2018年 5 月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 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)	
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、16,482円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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 5 月11日～2018年 5 月10日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		21,546	43,310,316	23,728	39,206,384
		(△35,771)	( 8,700)		

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）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
国	内	証券	千円	証券	千円
		—	—	127,900	1,917
		(145,300)	(—)	( 17,400)	( —)

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は権利割当、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 76,981	百万円 76,476	百万円 －	百万円 －

\*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2017年5月11日～2018年5月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	82,516,700千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	344,337,401千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.23

\*(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5月11日～2018年5月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 43,310	百万円 358	% 0.8	百万円 39,206	百万円 1,277	% 3.3
貸付有価証券(株式)	114,186	9,436	8.3	118,420	11,311	9.6

\*貸付有価証券（株式）の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

利害関係人の発行する有価証券等

種 別	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 150	百万円 416	百万円 1,522

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	4,557千円
うち利害関係人への支払額 (B)	156千円
(B) / (A)	3.4%

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野村證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2018年5月10日現在)

## 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>			
極洋	6.3	6.5	24,797
日本水産	207.8	185.5	111,671
マルハニチロ	30.4	31.3	125,513
カネコ種苗	5.5	5.6	9,268
サカタのタネ	23.6	24.3	96,957
ホクト	16.3	16.8	32,810
ホクリヨウ	2.3	2.7	3,331
<b>鉱業 (0.4%)</b>			
住石ホールディングス	44.4	43	7,353
日鉄鉱業	4.4	4.6	29,624
三井松島産業	9.8	8.4	13,137
国際石油開発帝石	843	801.6	1,161,518
日本海洋掘削	5.6	5.8	11,159
石油資源開発	25.3	26.1	72,558
K&Oエナジーグループ	10.8	9.7	18,071
<b>建設業 (3.2%)</b>			
ヒノキヤグループ	—	4.2	13,566
ショーボンドホールディングス	15.5	15.6	127,764
ミライト・ホールディングス	49.2	50.7	86,798
タマホーム	12	12.4	15,128
サンヨーホームズ	3.4	2.9	3,448
日本アクア	—	4.7	1,983
ファーストコーポレーション	3.5	5.5	7,194
ベステラ	—	3.1	5,142
T A T E R U	2	15.7	30,049
ダイセキ環境ソリューション	4.5	3.8	4,157
第一カッター興業	—	2.2	5,306
安藤・間	115	128.2	103,842
東急建設	56.8	63.4	74,368
コムシスホールディングス	62.5	58	178,930
ミサワホーム	18.9	13.8	12,972
ビーアールホールディングス	15.8	16.3	6,846
高松コンストラクショングループ	12.1	10.7	31,725
東建コーポレーション	6	6.2	65,844

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソネック	2	2.1	1,776
ヤマウラ	7.5	7.7	6,899
大成建設	814	164.1	979,677
大林組	479.9	494.4	605,640
清水建設	490	504.3	545,652
飛島建設	154.1	150	28,050
長谷工コーポレーション	186.7	192.4	319,961
松井建設	17.6	18.2	16,252
銭高組	23	2.4	13,632
鹿島建設	703	724	748,616
不動テトラ	129.2	124.7	23,069
大末建設	5.6	5.3	5,400
鉄建建設	97	10	33,600
西松建設	185	38.1	120,015
三井住友建設	613.2	118.9	76,928
大豊建設	58	60	39,960
前田建設工業	105	117.6	151,351
佐田建設	11	10.6	5,183
ナカノフドー建設	12.2	12.6	8,127
奥村組	132	27.1	121,950
東鉄工業	19.2	19.8	70,191
イチケン	15	3	7,470
浅沼組	56	58	25,636
戸田建設	186	192	172,608
熊谷組	251	25.9	95,312
青木あすなろ建設	10.5	10.8	11,059
北野建設	33	34	13,634
植木組	20	2	5,350
三井ホーム	21	21	15,750
矢作建設工業	21.8	22.4	20,137
ビーエス三菱	16.8	19.5	14,040
日本ハウスホールディングス	32.6	31.5	18,459
大東建託	57.9	58.7	1,094,461
新日本建設	19	19.6	24,480
N I P P O	37	38.2	94,774

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東亜道路工業	30	3.3	12,820
前田道路	50	51.6	121,518
日本道路	48	4.5	24,120
東亜建設工業	13	13.4	38,216
若築建設	92	8.9	15,308
東洋建設	46	51.7	27,659
五洋建設	177.6	196	166,992
大林道路	16.6	—	—
世紀東急工業	23.3	22.2	15,784
福田組	26	5.3	33,496
住友林業	110.1	105.3	187,749
日本基礎技術	17.8	18.3	7,393
日成ビルド工業	47	24.4	32,866
ヤマダ・エスバイエルホーム	81	75	5,250
巴コーポレーション	19.9	20.5	12,382
バナホーム	60	—	—
大和ハウス工業	472.7	486.9	1,982,169
ライト工業	30.8	31.7	37,596
積水ハウス	503.5	536.3	1,066,968
日特建設	13.6	14	8,806
北陸電気工事	7.8	9.1	11,666
ユアテック	25	23.1	23,354
西部電気工業	2.7	2.7	10,179
四電工	12	2.5	7,117
中電工	18	21.2	63,239
関電工	64	65.6	83,049
きんでん	106.4	109.6	204,732
東京エネシス	16.5	18.7	24,534
トーエネック	23	4.6	15,111
住友電設	11.1	13	27,027
日本電設工業	26.1	25.3	62,440
協和エクシオ	62.7	59.2	175,764
新日本空調	12.3	12.7	20,726
N D S	2.5	2.6	15,678
九電工	31.1	32.5	171,925
三機工業	35.5	34.9	41,007
日揮	149.3	142	355,852
中外炉工業	48	5	14,030
ヤマト	14.3	13.5	9,747
太平電業	22	11.2	31,416

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高砂熟学工業	44	45.4	91,481
三晃金属工業	1.4	1.8	6,498
朝日工業社	3.6	3.4	11,815
明星工業	29	29.8	23,959
大気社	21.2	20.8	79,872
ダイダン	21	11	29,304
日比谷総合設備	17.9	18.4	41,087
東芝プラントシステム	26	35.7	79,111
ＯＳＪＢホールディングス	48.9	72.8	22,349
東洋エンジニアリング	94	19.4	20,331
千代田化工建設	115	107	112,992
新興ブランテック	32.9	31.7	33,380
<b>食料品 (4.3%)</b>			
日本製粉	47.6	49	87,024
日清製粉グループ本社	175.5	180.7	437,655
日東富士製粉	1	1.1	5,742
昭和産業	66	13.6	39,671
鳥越製粉	12.7	13.1	12,759
中部飼料	17.5	18	37,818
フィード・ワン	96.3	99.2	24,204
東洋精糖	24	2.5	3,187
日本甜菜製糖	8.2	8.4	20,193
三井製糖	11.3	11.6	49,242
塩水港精糖	17.1	17.6	4,646
日新製糖	6.8	7	14,833
森永製菓	31.2	34.7	182,522
中村屋	3.7	3.8	18,335
江崎グリコ	40	41.2	238,960
名糖産業	6.9	7.1	12,432
井村屋グループ	—	5.8	20,590
不二家	91	9.4	25,389
山崎製パン	117.2	120.7	281,834
第一屋製パン	25	2.5	3,025
モロゾフ	24	2.5	16,650
亀田製菓	8.9	9.2	53,360
寿スピリッツ	15.2	14.2	72,136
カルビー	65.3	67.3	255,403
森永乳業	144	29.6	132,460
六甲バター	7.1	9.8	24,392
ヤクルト本社	85.8	85.9	627,070

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
明治ホールディングス	94.8	97.6	840,336
雪印メグミルク	34.5	35.6	105,838
ブリマハム	101	104	69,888
日本ハム	112	63.8	299,541
林兼産業	5.1	5.3	4,452
丸大食品	76	79	41,475
S F o o d s	8.6	10.3	46,916
伊藤ハム米久ホールディングス	92.3	95.1	98,523
サッポロホールディングス	52.4	54	166,320
アサヒグループホールディングス	300.2	309.3	1,807,858
キリンホールディングス	689	709.8	2,120,882
宝ホールディングス	115.8	110.6	144,996
オエノンホールディングス	41	41.9	19,944
養命酒製造	4.9	4.5	11,191
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	100.9	103.6	463,610
サントリー食品インターナショナル	109.6	112.9	558,855
ダイドーグループホールディングス	7.3	7.6	47,804
伊藤園	47.5	48.9	213,204
キーコーヒー	14.1	14.5	31,349
ユニカフェ	4.3	4.4	4,972
ジャパンフーズ	2	2.1	3,078
日清オイリオグループ	92	17.4	58,377
不二製油グループ本社	42.7	40	143,600
かどや製油	1.6	1.6	10,112
J-オイルミルズ	7.4	7.7	28,913
キッコーマン	112	115.3	567,852
味の素	329.7	339.6	714,518
キューピー	81.4	82.2	217,172
ハウス食品グループ本社	59.2	56.3	215,629
カゴメ	57.4	59.2	221,704
焼津水産化学工業	7.5	7.2	9,043
アリアケジャパン	13.1	13.5	126,225
ビエトロ	1.9	1.9	3,127
エバラ食品工業	3.8	3.2	6,771
ニチレイ	78.7	70.3	207,736
東洋水産	78.7	81	343,035
イートアンド	1.8	4.1	8,696
大冷	1.6	1.6	3,246
ヨシムラ・フード・ホールディングス	0.3	3	2,832
日清食品ホールディングス	62.5	64.4	515,200

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
永谷園ホールディングス	15	16	23,792
一正蒲鉾	5.6	5.7	7,786
フジッコ	15.5	16	40,240
ロック・フィールド	15.4	15.9	32,451
日本たばこ産業	886.9	913.6	2,735,318
ケンコーマヨネーズ	8.6	9.8	37,387
わらべや日洋ホールディングス	9.4	9.7	26,616
なとり	8	8.2	16,547
イフジ産業	2.5	2.6	2,085
ビックスコーポレーション	—	2.9	5,945
北の達人コーポレーション	6.9	45.1	35,719
ユーグレナ	55.3	58.8	58,270
ミヨシ油脂	55	5.6	7,912
理研ビタミン	4.7	5.6	22,596
<b>繊維製品 (0.7%)</b>			
片倉工業	18.7	17.7	24,337
グンゼ	112	11.5	78,085
東洋紡	592	56.9	115,734
ユニチカ	410	44.8	31,718
富士紡ホールディングス	7.3	8.6	35,518
倉敷紡績	151	155	55,645
シキボウ	81	7.6	10,328
日本毛織	42.2	43.5	49,633
ダイトウボウ	20	23.3	2,423
トーア紡コーポレーション	6.3	6.5	3,835
ダイドーリミテッド	16.7	17.2	8,066
帝国繊維	15.6	16.1	37,915
帝人	122.3	126.6	269,404
東レ	1,085.2	1,117.9	1,054,179
サカイオーベックス	3.5	3.8	9,158
住江織物	41	3.9	11,290
日本フェルト	8.6	8.2	4,255
イチカワ	10	10	3,730
日東製網	1.6	1.7	3,009
アツギ	123	10.3	12,607
ダイニック	28	5.8	6,026
セーレン	37.3	35.4	66,693
ソトー	5.6	5.7	5,996
東海染工	21	2.1	3,045
小松精練	21	23.6	25,157

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ワコールホールディングス	89	42.6	139,941
ホギメディカル	9.4	19.4	88,755
レナウン	40.4	41.6	6,780
クラウディアホールディングス	3.4	3.5	1,988
T S I ホールディングス	61.6	53.2	45,273
マツオカコーポレーション	—	3.6	11,592
三陽商会	78	8.1	19,359
ナイガイ	55	5.6	3,281
オンワードホールディングス	97	92	83,352
ルックホールディングス	27	26	9,646
キムラタン	632	70.4	2,886
ゴールドウイン	6.3	8.7	62,640
デサント	34.1	35.1	68,374
キング	7.4	7.6	4,309
ヤマトインターナショナル	9.9	9.5	6,422
パルプ・紙 (0.3%)			
特種東海製紙	8.7	8.4	36,456
王子ホールディングス	585	649	485,452
日本製紙	67	69	143,658
三菱製紙	21.3	21.9	14,913
北越紀州製紙	83.5	86	53,836
中越パルプ工業	59	6.1	12,029
巴川製紙所	23	24	6,816
大王製紙	59.6	61.4	92,591
阿波製紙	3.6	3.7	2,397
レンゴー	144.2	148.6	141,021
トーモク	47	8.8	19,087
ザ・バック	10.6	10.9	41,038
化学 (7.2%)			
クラレ	251.8	259.4	466,660
旭化成	933	961	1,459,278
共和レザー	8.7	9	9,243
昭和電工	99.6	102.6	436,563
住友化学	1,101	1,134	730,296
住友精化	6.2	6.4	34,112
日産化学工業	81.9	89.7	440,875
ラサ工業	56	5.4	12,571
クレハ	11.3	13.3	101,346
多木化学	10	2.1	9,817
テイカ	23	11.7	36,913

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
石原産業	26.9	27.7	34,680	
片倉コープアグリ	20	3.7	4,599	
日東エフシー	8.7	9	6,768	
日本曹達	90	107	67,731	
東ソー	432	222.7	434,710	
トクヤマ	233	44.7	174,553	
セントラル硝子	152	31.4	81,169	
東亜合成	93.7	90.4	110,649	
大阪ソーダ	64	14.9	46,935	
関東電化工業	30.6	36.8	37,830	
デンカ	310	56.6	237,437	
信越化学工業	268.3	256.6	2,891,882	
日本カーバイド工業	51	4.9	10,584	
堺化学工業	56	10.5	30,576	
エア・ウォーター	123.4	127.1	269,706	
大陽日酸	115.2	118.7	196,804	
日本化学工業	55	5.7	18,667	
東邦アセチレン	—	2.2	3,159	
日本バーカライジング	76.4	78.7	136,938	
高圧ガス工業	22.2	22.8	22,800	
チタン工業	17	1.7	4,673	
四国化成工業	22	22.2	35,342	
戸田工業	30	3.1	11,718	
ステラ ケミファ	7.3	7.8	27,807	
保土谷化学工業	5.2	5	23,550	
日本触媒	23.5	24.2	173,272	
大日精化工業	62	11.9	53,312	
カネカ	202	208	225,680	
三菱瓦斯化学	139.4	127	355,346	
三井化学	680	140.1	442,716	
J S R	150.4	154.9	322,656	
東京応化工業	28	26.8	107,602	
大阪有機化学工業	9.7	13.3	19,324	
三菱ケミカルホールディングス	1,007.8	1,032.1	1,072,351	
KHネオケム	24.4	23.6	75,638	
ダイセル	201.7	207.8	256,009	
住友ベークライト	132	125	123,625	
積水化学工業	339.6	320.1	583,542	
日本ゼオン	126	130	182,390	
アイカ工業	48	43.2	176,040	



銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
宇部興産	754	77.6	258,408
積水樹脂	23.1	23.8	54,954
タキロンシーアイ	31	31.2	22,058
旭有機材	48	9	16,326
日立化成	83.2	76.1	183,401
ニチバン	15	7.6	26,030
リケンテクノス	32.2	33.2	18,857
大倉工業	36	37	23,088
積水化成成品工業	20.8	19.3	26,518
群栄化学工業	3.6	3.7	13,634
タイガースポリマー	7.4	7.6	6,634
ミライアル	5.4	5.1	8,246
ダイキアクシス	2.5	5.1	7,634
ダイキョーニシカワ	26.2	30.4	58,124
竹本容器	—	2.3	7,429
森六ホールディングス	—	7.7	23,908
日本化薬	97	100	137,300
カーリットホールディングス	13.9	14.3	15,386
日本精化	12.4	12.7	15,506
扶桑化学工業	10.6	14.6	37,989
トリケミカル研究所	—	3.6	16,452
ADEKA	64.3	66.3	131,472
日油	116	59.5	196,350
新日本理化	23.6	24.3	6,366
ハリマ化成グループ	12.7	11.9	10,959
花王	373.2	361.8	2,772,473
第一工業製薬	33	29	22,301
石原ケミカル	—	3.6	7,336
日華化学	4.7	4.9	6,100
ニイタカ	2.2	2.2	4,052
三洋化成工業	9.4	9.7	51,604
有機合成薬品工業	9.7	10	3,080
大日本塗料	86	17.6	27,614
日本ベイントホールディングス	115.4	118.9	560,613
関西ベイント	157.2	161.9	392,121
神東塗料	11	11.3	2,655
中国塗料	42.9	44.2	47,515
日本特殊塗料	10.5	9.7	21,233
藤倉化成	20.3	19.4	13,599
太陽ホールディングス	12.2	11.8	54,103

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
D I C	59.1	60.9	224,416
サカタインクス	30.5	31.5	50,494
東洋インキＳＣホールディングス	148	152	105,032
T & K T O K A	10.8	10.3	12,833
富士フイルムホールディングス	296.7	305.6	1,289,937
資生堂	283.8	274.1	1,973,794
ライオン	185.7	204.9	438,895
高砂香料工業	9.8	9.2	31,924
マンダム	15	28.7	101,741
ミルボン	8.1	19.7	99,288
ファンケル	31.8	35.7	160,471
コーセー	24.2	24.9	514,434
コタ	6.2	7	11,011
シーズ・ホールディングス	19.4	17.8	100,748
シーボン	1.7	1.8	5,769
ポーラ・オルビスホールディングス	61	62.8	318,396
ノエビアホールディングス	9.4	9.4	71,910
アジュバンコスメジャパン	2.8	3.3	3,240
エステー	10.2	10.5	28,129
アグロ カネショウ	5.8	6	16,212
コニシ	23.5	24.2	44,891
長谷川香料	18.9	17.6	42,398
星光PMC	8.2	8.4	10,197
小林製薬	40	41.2	397,580
荒川化学工業	12.8	13.2	25,304
メック	11.6	10.1	19,321
日本高純度化学	4.2	4	10,168
タカラバイオ	42.7	38.5	82,120
J C U	9.4	17.8	47,401
新田ゼラチン	9	10.1	8,989
O A T アグリオ	1.7	2.3	8,556
デクセリアルズ	39.3	37.8	41,731
アース製薬	10.7	11.1	60,162
北興化学工業	15	15.1	10,192
大成ラミック	4.6	4.5	14,175
クミアイ化学工業	63.299	66.9	46,896
日本農薬	37.3	35.2	24,182
アキレス	12.2	11.2	25,177
有沢製作所	25.3	24.7	30,702
日東電工	107.9	111.1	931,240

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
レック	9.3	8.7	35,191
きもと	26.7	25	7,975
藤森工業	11.1	12.3	44,772
前澤化成工業	9.8	10.1	12,493
J S P	7	8.6	29,326
エフビコ	13.3	12.1	81,675
天馬	9.9	11.4	23,461
信越ポリマー	29.3	30.2	32,887
東リ	35.6	36.6	13,615
ニフコ	26.2	54	208,710
日本バルカー工業	11.6	12	36,900
ユニ・チャーム	302.8	311.9	994,337
<b>医薬品 (4.5%)</b>			
協和発酵キリン	178.9	184.3	411,357
武田薬品工業	560.9	542	2,504,582
アステラス製薬	1,528.2	1,512	2,503,116
大日本住友製薬	105.9	109.1	210,563
塩野義製薬	189.7	207.3	1,174,976
田辺三菱製薬	174.3	179.5	343,024
わかもと製薬	17	17.5	5,197
あすか製薬	16.3	16.8	27,636
日本新薬	34.3	38.5	301,455
ビオフェルミン製薬	2.4	2.5	7,032
中外製薬	148.9	153.4	885,118
科研製薬	27.9	26.6	163,856
エーザイ	184.1	176.1	1,292,397
ロート製薬	73.2	80.8	254,116
小野薬品工業	339.7	347.5	873,441
久光製薬	42.2	43.5	375,405
持田製薬	10	10.2	77,724
参天製薬	270.2	278.8	536,968
扶桑薬品工業	5	5.2	15,324
日本ケミファ	2.1	1.9	9,101
ツムラ	50.2	52.6	206,981
日医工	35	38.8	67,395
キッセイ薬品工業	26.5	26	74,230
生化学工業	27.7	28.5	50,929
栄研化学	12.6	23.9	55,376
日水製薬	6	6.2	8,748
鳥居薬品	10.2	9.2	25,778

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
J C Rファーマ	11.5	10.4	57,096
東和薬品	6.9	7.1	47,215
富士製薬工業	4.9	5	22,425
沢井製薬	25.4	29.6	136,900
ゼリア新薬工業	30.6	31.5	73,269
第一三共	440.2	421	1,614,535
キョーリン製薬ホールディングス	36.6	41.1	89,228
大幸薬品	7.5	7.8	16,458
ダイト	8.9	8.6	31,648
大塚ホールディングス	321.6	305.8	1,617,987
大正製薬ホールディングス	32	32.9	338,541
ペプチドリーム	28	67.3	295,447
<b>石油・石炭製品 (0.7%)</b>			
日本コークス工業	120.7	124.3	14,418
昭和シェル石油	133.7	137.7	224,175
ニチレキ	18.3	18.8	22,315
ユシロ化学工業	8	8.3	15,230
ビービー・カストロール	6.1	6.3	10,766
富士石油	34.7	35.7	14,458
MORESCO	5.1	5.3	10,472
出光興産	71	123.5	501,410
J X T Gホールディングス	2,280.7	2,348	1,688,681
コスモエネルギーホールディングス	45.1	42.6	165,501
<b>ゴム製品 (0.8%)</b>			
横浜ゴム	90.2	85.2	217,089
東洋ゴム工業	79	87.1	152,512
ブリヂストン	504.8	487	2,196,857
住友ゴム工業	140	151.5	285,274
藤倉ゴム工業	12.5	12.9	9,997
オカモト	45	51	55,896
フコク	6.2	6.4	6,355
ニッタ	13.4	15.2	64,828
住友理工	27.7	28.5	34,200
三ツ星ベルト	35	36	46,080
パンドー化学	27.2	28	36,848
<b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b>			
日東紡績	121	21.9	48,880
旭硝子	737	148.3	708,132
日本板硝子	68.1	74.4	70,084
石塚硝子	21	2	5,160

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本山村硝子	59	61	11,468
日本電気硝子	309	63.6	204,474
オハラ	5.6	5.8	14,262
住友大阪セメント	278	286	144,144
太平洋セメント	902	92.9	381,354
日本ヒューム	14.3	14.7	12,303
日本コンクリート工業	33.3	31.7	14,296
三谷セキサン	7.5	7.7	19,496
アジアパイルホールディングス	18.4	18.9	12,303
東海カーボン	139.7	133.6	230,994
日本カーボン	73	7.6	43,472
東洋炭素	8.3	9.6	34,800
ノリタケカンパニーリミテド	8.4	8.1	39,649
TOTO	109.9	113.2	648,636
日本碍子	188.8	179.5	375,334
日本特殊陶業	128.9	126.2	378,600
ダントーホールディングス	12	11	1,551
MARUWA	5.5	5.1	47,787
品川リフラクトリーズ	38	3.9	12,012
黒崎播磨	32	2.9	14,819
ヨータイ	9	11.7	9,324
イソライト工業	7.3	7.5	6,442
東京窯業	18.2	18.7	8,714
ニッカトー	4.8	6.7	7,470
フジミインコーポレーテッド	12.7	13.1	30,457
クニミネ工業	—	4	4,132
エーアンドエーマテリアル	31	3.2	4,137
ニチアス	78	81	118,503
ニチハ	19.9	22.2	106,116
<b>鉄鋼 (1.1%)</b>			
新日鐵住金	674.3	651.1	1,590,637
神戸製鋼所	258.5	266.3	313,435
中山製鋼所	16.8	20.2	15,008
合同製鐵	8.4	7.8	19,008
ジェイ エフ イー ホールディングス	408.7	392.9	921,546
日新製鋼	48.7	40.1	59,147
東京製鐵	75.6	77.9	69,642
共英製鋼	15.9	16.4	35,834
大和工業	30	30.9	114,484
東京鐵鋼	31	6	10,548

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大阪製鐵	9.4	9.7	22,494
淀川製鋼所	20.7	21.3	67,947
東洋鋼板	35.8	36.8	26,385
丸一鋼管	50	51.5	199,305
モリ工業	4.7	4.7	16,285
大同特殊鋼	250	25.8	151,446
日本高周波鋼業	52	5.4	4,503
日本冶金工業	123.7	120.3	39,819
山陽特殊製鋼	89	16.8	46,233
愛知製鋼	8.8	8.2	38,376
日立金属	152.2	156.7	207,157
日本金属	3.6	3.7	8,798
大太平洋金属	95	8.9	32,307
新日本電工	84.6	87.1	29,352
栗本鐵工所	7.1	7.3	14,848
缸技	21	2.2	4,428
日本鑄鉄管	15	15	2,535
三菱製鋼	104	10.8	27,237
日亜鋼業	20.7	21.3	7,561
日本精線	10	2.4	11,628
シンニッタン	12.2	22.6	11,028
新家工業	32	3.3	7,144
<b>非鉄金属 (0.9%)</b>			
大紀アルミニウム工業所	25	23.9	17,709
日本軽金属ホールディングス	384.9	424.8	125,740
三井金属鉱業	407	39.3	190,212
東邦亜鉛	84	8.1	39,730
三菱マテリアル	93.3	96.1	319,532
住友金属鉱山	387	186	874,386
DOWAホールディングス	165	36.8	151,248
古河機械金属	233	24	44,760
大阪チタニウムテクノロジーズ	16.3	15.1	30,109
東邦チタニウム	25.3	26	31,772
UACJ	211	22.1	58,565
CKサンエツ	—	2.7	12,865
古河電気工業	50.1	48.4	233,046
住友電気工業	563.3	544	905,216
フジクラ	196.8	175.7	130,545
昭和電線ホールディングス	178	18.3	16,744
東京特殊電線	2.1	1.9	5,346

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タツタ電線	28	28.8	20,073
沖電線	16	—	—
カナレ電気	2.1	2.4	5,762
平河ヒューテック	7	7.2	10,792
リョービ	91	17.9	50,979
アーレスティ	17.3	17.8	18,921
アサヒホールディングス	22.5	24.9	50,372
<b>金属製品 (0.7%)</b>			
稲葉製作所	7.9	8.2	11,693
宮地エンジニアリンググループ	43	4.1	8,495
トーカロ	9.8	40.4	55,711
アルファC o	5	5.1	9,603
SUMCO	156.1	134	381,498
川田テクノロジーズ	2.9	2.9	17,951
R S Technologies	0.7	2.3	15,847
東洋製織グループホールディングス	106.2	99.5	170,742
ホッカンホールディングス	39	37	14,541
コロナ	7.8	8	10,240
横河ブリッジホールディングス	26.3	27.1	65,934
駒井ハルテック	2.9	3.2	7,990
高田機工	13	1.3	4,498
三和ホールディングス	148.4	139.5	195,300
文化シャッター	41.6	42.9	46,246
三協立山	19.6	20.2	33,188
アルインコ	10.3	10.6	11,511
東洋シャッター	3.7	3.8	2,511
L I X I Lグループ	208.2	214.5	535,821
日本フィルコン	10.8	11.1	7,092
ノーリツ	29.3	32.5	65,877
長府製作所	16	16.4	41,508
リンナイ	25.5	25.9	277,907
ダイニチ工業	7.6	7.8	6,606
日東精工	21.3	20.1	15,798
三洋工業	19	1.8	3,796
岡部	31	29.5	30,267
ジーテクト	15.6	16.1	34,035
中国工業	2.1	2.2	1,658
東プレ	28.7	27.1	92,004
高周波熱錬	27.2	28	30,940
東京製綱	10.1	10.4	24,429

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サンコー	7.9	8.2	6,010
モリテック スチール	7.5	11.3	8,362
バイオラックス	22.6	21.5	67,187
エイチワン	11.3	14.3	18,304
日本発條	140.7	144.9	174,894
中央発條	17	1.8	6,489
アドバネクス	2.6	2.3	5,324
立川ブラインド工業	6.2	6.4	9,894
三益半導体工業	12.6	11.4	22,002
<b>機械 (5.3%)</b>			
日本ドライケミカル	1.9	2	5,038
日本製鋼所	49.4	47.5	166,012
三浦工業	61.1	63	203,490
タクマ	47.8	49.3	58,420
ツガミ	40	39	50,193
オークマ	97	17	116,960
東芝機械	89	82	51,004
アマダホールディングス	201.2	224.5	292,748
アイダエンジニアリング	42.5	37	47,249
滝澤鉄工所	44	4.5	9,049
F U J I	45.5	43.6	80,398
牧野フライス製作所	74	74	77,330
オーエスジー	68.1	67	168,103
ダイジェット工業	17	1.8	3,497
旭ダイヤモンド工業	42	43.3	45,854
DMG森精機	86.1	80.5	173,558
ソディック	37.9	31.7	40,417
ディスコ	17.5	19.7	405,623
日東工器	8.7	9	26,226
日進工具	—	3.9	11,442
パンチ工業	5.4	12.1	14,616
富士ダイス	—	7.3	7,387
豊和工業	8.3	8	8,832
OKK	54	5.6	6,395
東洋機械金属	10.1	11.3	8,802
津田駒工業	33	34	8,262
エンシユウ	37	38	6,118
島精機製作所	19.5	18.4	107,272
オプトラン	—	14.2	42,174
N Cホールディングス	4.8	4.7	3,929

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
フリーー	8.8	10.3	10,114	
ヤマシンフィルタ	3.9	22.1	25,879	
日阪製作所	20.3	20.9	24,641	
やまびこ	27.4	28.2	43,653	
平田機工	—	5.4	55,944	
ベガスサミシン製造	14.3	13.6	10,635	
ナブテスコ	77.7	80	290,800	
三井海洋開発	15	15.5	47,585	
レオン自動機	12.6	13	27,183	
SMC	44.8	46.2	1,921,920	
新川	12.4	11.9	12,447	
ホソカワミクロン	5.3	5.1	37,740	
ユニオンツール	6.5	6.6	28,347	
オイレス工業	18.3	18.8	45,721	
日精エー・エス・ビー機械	4.8	4.2	22,764	
サトーホールディングス	18.6	19.1	57,395	
技研製作所	—	10	25,010	
日本エアータック	4.8	5	4,620	
カワタ	—	3	5,418	
日精樹脂工業	11.9	12.2	15,896	
オカダアイヨン	4.2	4.9	7,805	
ワイエイシイホールディングス	5.6	4.9	5,257	
小松製作所	689.6	710.4	2,544,652	
住友重機械工業	436	84.2	350,693	
日立建機	66.8	68.8	273,136	
日工	4.5	4	10,016	
巴工業	6.1	6.3	13,274	
井関農機	153	14.7	32,457	
TOWA	12.2	11.4	16,530	
丸山製作所	3.1	3.2	6,176	
北川鉄工所	6.8	7.1	19,943	
ローツェ	7	7.3	19,074	
タカキタ	5	5.1	4,105	
クボタ	715.5	789.2	1,456,074	
荏原実業	4.2	4.3	10,414	
三菱化工機	49	5.1	11,668	
月島機械	28.3	29.2	44,938	
帝国電機製作所	10.9	10.3	16,922	
東京機械製作所	56	5.8	3,062	
新東工業	33.9	34.9	40,518	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
澁谷工業	12.5	12.9	49,084	
アイチ コーポレーション	21.1	25.4	19,024	
小森コーポレーション	35.9	37	51,319	
鶴見製作所	11.1	12.4	26,052	
住友精密工業	24	24	9,216	
酒井重工業	28	2.7	12,312	
住原製作所	67.7	60.5	251,075	
石井鐵工所	2.2	2.2	4,268	
西島製作所	14.6	15	15,660	
北越工業	16.1	16.5	18,546	
ダイキン工業	195	200.8	2,634,496	
オルガノ	28	5.3	18,576	
トーヨーカネツ	69	6.2	20,739	
栗田工業	84.5	79.6	256,710	
椿本チエイン	85	87	79,083	
大同工業	29	5.6	8,360	
木村化工機	12.8	12.2	6,185	
アネスト岩田	25.9	24.8	28,718	
ダイフク	71.3	74.9	443,408	
サムコ	3.9	4	5,212	
加藤製作所	7.8	7	18,172	
油研工業	28	2.9	8,552	
タダノ	74.7	71	106,287	
フジテック	41.6	47.1	70,037	
CKD	42.8	40.9	91,043	
キトー	18	11.1	23,676	
平和	44.3	45.6	99,681	
理想科学工業	14.2	14.6	34,222	
SANKYO	39.7	36.8	142,416	
日本金銭機械	13.2	13.5	16,456	
マースエンジニアリング	8.1	9.3	23,184	
福島工業	8.8	9.1	45,181	
オーイズミ	6	6.2	3,503	
ダイコク電機	5.9	6.8	12,022	
竹内製作所	26.1	24.6	61,327	
アマノ	44.2	45.5	126,945	
JUKI	22.5	21.8	26,596	
サンデンホールディングス	87	17.9	27,924	
蛇の目ミシン工業	13.9	13.4	9,835	
マックス	22	22.6	33,312	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
グローリー	45.7	43.9	161,113
新晃工業	13.3	14.9	25,896
大和冷機工業	22.9	23.6	29,783
セガサミーホールディングス	141.7	145.9	264,662
日本ビストンリング	5.6	5.4	12,096
リケン	6.6	6.8	41,888
T P R	16	16.5	53,707
ツバキ・ナカシマ	16	14.8	38,228
ホシザキ	41.7	46.3	478,279
大豊工業	11.6	12	18,072
日本精工	293.4	302.2	431,239
N T N	331	340.5	162,418
ジェイテクト	152.2	156.8	271,420
不二越	144	137	77,268
日本トムソン	45.6	47	37,412
T H K	100.9	91.7	345,250
ユースン精機	6.3	13	18,447
前澤給装工業	5.4	5.8	11,292
イーグル工業	15.4	18.2	35,945
前澤工業	9.5	10.8	5,173
日本ビラー工業	14.4	14.9	25,195
キッツ	68.5	59.6	62,401
日立工機	10.9	—	—
マキタ	186.3	191.9	931,674
日立造船	113.2	116.6	69,843
三菱重工業	2,394	246.6	1,014,512
I H I	1,097	113	444,090
スター精密	25	23.5	45,472
電気機器 (13.5%)			
日清紡ホールディングス	79.3	89.8	132,724
イビデン	99.9	90.1	150,196
コニカミノルタ	334.4	344.4	329,246
ブラザー工業	184.6	179.7	439,905
ミネベアミツミ	259.9	273.1	587,711
日立製作所	3,429	3,533	3,053,571
東芝	3,195	—	—
三菱電機	1,523.5	1,471.2	2,403,940
富士電機	430	443	349,084
東洋電機製造	6	5.8	10,869
安川電機	165.6	170.5	766,397

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シンフォニアテクノロジー	92	95	39,615
明電舎	131	125	52,750
オリジン電気	21	4.3	7,804
山洋電気	37	7.1	69,225
デンヨー	13.2	13.6	26,955
東芝テック	89	105	66,885
芝浦メカトロニクス	23	21	9,156
マブチモーター	40.3	41	216,890
日本電産	185.1	177	2,996,610
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	2.2	5.4	17,442
トレックス・セミコンダクター	—	4.2	5,913
東光高岳	7.2	7.4	14,200
ダブル・スコープ	13.8	21.4	34,860
ダイヘン	78	80	68,000
田淵電機	21.6	20.4	5,956
ヤーマン	1.8	21.3	53,846
J V C ケンウッド	104.8	107.9	38,196
ミマキエンジニアリング	12.8	13.2	11,880
第一精工	6.7	6.9	14,993
日新電機	28.7	34.5	39,847
大崎電気工業	28	31.5	25,578
オムロン	151.8	156.4	943,092
日東工業	21	23.6	44,533
I D E C	18.6	18.2	48,266
不二電機工業	1.6	1.6	2,246
ジーエス・ユアサ コーポレーション	275	264	147,840
サクサホールディングス	36	3.7	7,966
メルコホールディングス	7.9	7.1	30,033
テクノメディカ	3.2	3.6	7,322
日本電気	1,964	190.4	582,624
富士通	1,377	1,513	1,027,780
神電気工業	61.9	59.8	80,610
岩崎通信機	63	6.4	5,344
電気興業	41	8.4	27,342
サンケン電気	83	86	63,296
ナカヨ	15	2.8	5,432
アイホン	8.1	8.3	15,413
ルネサスエレクトロニクス	73.9	76.2	84,505
セイコーエプソン	212.7	219.1	446,964
ワコム	110.8	114.1	64,010

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アルバック	24.1	33.8	211,250	
アクセル	6	6.1	5,075	
E I Z O	14.1	13.5	67,770	
ジャパンディスプレイ	266.7	302.2	42,610	
日本信号	39.4	40.6	44,132	
京三製作所	33	34.4	25,112	
能美防災	16.2	19.5	48,516	
ホーチキ	10.3	10.7	23,475	
星和電機	—	5	3,250	
エレコム	12.4	12.8	38,720	
日本無線	8.7	—	—	
パナソニック	1,640.2	1,680.8	2,625,409	
シャープ	—	136.6	434,388	
アンリツ	104.1	107.3	151,400	
富士通ゼネラル	48.5	44.9	77,901	
日立国際電気	37.3	—	—	
ソニー	1,008.7	983.5	5,024,701	
T D K	80.5	77	759,220	
帝国通信工業	31	6.5	8,417	
タムラ製作所	55	56.7	47,968	
アルプス電気	131.8	126.8	337,288	
池上通信機	45	47	8,084	
バイオニア	214.6	245.1	43,627	
日本電波工業	13.8	13.3	9,243	
鈴木	5.5	6.4	6,969	
日本トリム	3.5	3.2	14,448	
ローランド ディー・ジー・	7.3	7.5	19,432	
フォスター電機	16.7	17.2	33,505	
クラリオン	75	77	23,177	
SMK	37	38	14,972	
ヨコオ	10.2	9.5	19,636	
ティアック	103	106	4,452	
ホシデン	43.3	37.1	48,601	
ヒロセ電機	23.1	25	362,250	
日本航空電子工業	41	38	69,806	
T O A	16.8	15.8	19,971	
マクセルホールディングス	21.3	29.2	50,253	
古野電気	18.4	17.5	16,905	
ユニデンホールディングス	42	40	10,960	
アルバイン	34	35.1	77,606	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
スミダコーポレーション	12.9	15	20,970	
アイコム	7.9	8.1	22,104	
リオン	5.5	6.2	14,055	
本多通信工業	6.1	11.4	13,326	
船井電機	16	14.9	11,234	
横河電機	154.9	147.2	300,288	
新電元工業	55	5.2	35,360	
アズビル	43.3	44.1	221,823	
東亜ディーケーケー	7.1	7.3	10,636	
日本光電工業	59.7	61.5	184,807	
チノー	5.1	5.1	8,358	
共和電業	16.2	16.7	7,398	
日本電子材料	5.6	5.8	4,906	
堀場製作所	28.3	29.1	270,921	
アドバンテスト	97.3	82	226,074	
小野測器	6.9	6.3	5,304	
エスベック	12.7	13	35,152	
キーエンス	64.7	72.2	4,887,218	
日置電機	7.5	7.7	32,686	
シスメックス	111	114.5	1,024,775	
日本マイクロニクス	24.8	23.8	30,725	
メガチップス	13.3	11.6	41,238	
OBARA GROUP	8.3	8.6	54,438	
澤藤電機	9	1.6	3,155	
コーセル	19.8	20.4	29,784	
イリソ電子工業	6	12.4	84,196	
新日本無線	12.1	8.9	8,455	
オブテックスグループ	10.8	24	67,512	
千代田インテグレ	7.5	6.8	16,653	
アイ・オー・データ機器	5.9	6.1	6,838	
レーザーテック	31.4	30.1	113,928	
スタンレー電気	101.9	112.6	442,518	
岩崎電気	52	5.7	9,633	
ウシオ電機	86.7	89.3	142,612	
岡谷電機産業	7.6	10.5	6,625	
ヘリオス テクノ ホールディング	13.1	12.5	9,825	
日本セラムック	11.7	14.9	43,031	
遠藤照明	7.2	7.4	7,370	
古河電池	10	10.5	10,479	
双信電機	6.9	6.4	4,089	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
山一電機	13.4	10.7	21,314	
図研	9.3	9.6	16,329	
日本電子	52	54	52,218	
カシオ計算機	114.9	118.3	203,830	
ファナック	144.8	139.8	3,219,594	
日本シイエムケイ	30.8	25.9	21,781	
エンブラス	6.5	6.7	22,143	
大真空	5.2	5.4	7,333	
ローム	69	66	706,200	
浜松ホトニクス	104	107.1	468,562	
三井ハイテック	18.8	19.4	30,419	
新光電気工業	53.9	55.6	51,874	
京セラ	234.4	241.5	1,630,125	
太陽誘電	69.5	66	132,792	
村田製作所	149.8	154.4	2,229,536	
ユーシン	19.8	22.1	16,199	
双葉電子工業	23.4	24.1	54,803	
北陸電気工業	57	5.9	8,378	
ニチコン	45	46.3	59,264	
日本ケミコン	123	11.9	32,165	
K O A	19.7	20.3	49,430	
市光工業	30	22	32,582	
小糸製作所	85.6	88.1	659,869	
ミツバ	26.3	27.1	36,693	
S C R E E Nホールディングス	29.3	27.8	270,772	
キャノン電子	13.1	13.5	34,114	
キャノン	768.9	792	3,001,680	
リコー	429.4	442.3	460,876	
象印マホービン	—	27.4	43,319	
M U T O Hホールディングス	19	2	4,974	
東京エレクトロン	95.2	98.1	2,084,134	
輸送用機器 (8.9%)				
トヨタ紡織	49.9	42.9	97,039	
芦森工業	32	3	7,557	
ユニプレス	27.6	28.4	73,357	
豊田自動織機	130	119.1	832,509	
モリタホールディングス	25	23.6	53,241	
三櫻工業	18.1	18.6	14,508	
デンソー	352.1	326.4	1,801,075	
東海理化電機製作所	37.6	38.7	85,372	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
三井E & Sホールディングス	516	53.1	88,623	
川崎重工業	1,111	114.5	400,177	
名村造船所	42.9	44.2	28,288	
サノヤスホールディングス	17.3	17.9	4,833	
日本車輛製造	52	54	15,822	
三菱ロジスネクスト	17	17.5	20,982	
近畿車輛	2.1	2.2	6,061	
日産自動車	1,684.5	1,735.2	1,926,939	
いすゞ自動車	413.9	426.3	701,476	
トヨタ自動車	1,736.4	1,788.6	13,579,051	
日野自動車	203.8	210	268,590	
三菱自動車工業	523.4	544.6	467,266	
エフテック	8.2	9.4	13,498	
レシップホールディングス	4.7	5.3	4,467	
GMB	2.3	2.4	3,720	
ファルテック	2.5	2.6	3,502	
武蔵精密工業	16.6	15.7	65,469	
日産車体	62.8	57.5	63,767	
新明和工業	58	63.9	80,961	
極東開発工業	28.4	27.3	47,392	
日信工業	31.9	29.9	62,221	
トビー工業	11.7	12.1	42,047	
ティラド	56	5.3	20,908	
曙ブレーキ工業	66.3	68.3	17,143	
タチエス	24.2	25	50,950	
N O K	69.1	79.1	179,319	
フタバ産業	43.5	45	38,700	
K Y B	160	15.3	78,642	
大同メタル工業	17.9	18.5	23,809	
プレス工業	75.8	78.1	48,109	
ミクニ	18.1	18.7	11,986	
太平洋工業	32.1	30.8	47,863	
ケーヒン	32.8	33.8	75,374	
河西工業	19.3	18	26,910	
アイシン精機	130.7	121.1	721,756	
富士機工	14.1	—	—	
マツダ	452.2	461.8	668,917	
今仙電機製作所	13.1	13.6	16,592	
本田技研工業	1,285.2	1,323.9	4,699,845	
スズキ	283.1	291.6	1,644,040	



銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
S U B A R U	443.4	456.8	1,686,505
安永	6.9	7.1	16,841
ヤマハ発動機	201.7	207.8	708,598
ショーワ	37.1	38.2	75,215
T B K	18.3	17.5	9,625
エクセディ	19.4	17.8	65,415
豊田合成	46.1	53.4	154,272
愛三工業	25	25.9	29,810
盟和産業	2.2	2.2	2,959
日本プラス	—	8	8,056
ヨロズ	13.3	14.9	27,475
エフ・シー・シー	23.3	24	70,416
シマノ	57.6	59.3	882,977
タカタ	25.8	—	—
テイ・エス テック	33.2	34.2	171,000
ジャムコ	8.3	7.4	16,746
<b>精密機器 (1.6%)</b>			
テルモ	218.9	225.5	1,371,040
クリエートメディック	4.7	4.9	6,850
日機装	49.4	50.9	58,484
島津製作所	183.8	175.8	519,840
J M S	26	13.6	8,812
クボテック	3.1	3.2	1,747
長野計器	11.2	11.5	15,318
ブイ・テクノロジ	2.9	3.4	93,670
東京計器	49	9.4	11,383
愛知時計電機	1.9	1.9	8,094
インターアクション	5.3	7.8	9,016
オーバル	13.9	14.4	4,406
東京精密	27.6	26.6	114,247
マニー	17.4	17.9	80,997
ニコン	248.9	256.4	470,237
トプコン	71.9	79	159,264
オリンパス	227.9	219.2	885,568
理研計器	12.6	14.1	36,096
タムロン	12.7	11.9	27,084
H O Y A	293.8	296.2	1,746,691
シード	1.8	2.1	14,196
ノーリツ銅機	14.4	14.9	42,688
エー・アンド・デイ	13	13.4	9,889

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シチズン時計	156.3	175.6	146,099
リズム時計工業	57	5.6	13,462
大研医器	12.7	13.1	9,798
メニコン	9.8	20.2	58,216
シンシア	—	1.6	1,161
松風	7.5	7.2	10,274
セイコーホールディングス	101	22.7	67,101
ニプロ	98.8	101.8	132,645
<b>その他製品 (2.2%)</b>			
中本パックス	—	3.7	6,730
スノーピーク	2.2	4.5	6,624
パラマウントベッドホールディングス	13.7	15.5	79,980
トランザクション	6.4	8	7,952
S H O - B I	4.8	4.3	1,892
ニホンフラッシュ	6.7	6.9	19,934
前田工織	14.3	16.2	29,613
永大産業	19	19.2	10,713
アートネイチャー	15.3	15.7	11,461
ダンロップスポーツ	9	—	—
バンダイナムコホールディングス	157.5	152.1	622,849
アイフィスジャパン	3.2	3.3	2,343
共立印刷	23.7	24.4	9,003
S H O E I	6.4	7.1	29,820
フランスベッドホールディングス	17.9	17.4	17,139
パイロットコーポレーション	24.9	25.7	159,340
萩原工業	4	8.2	16,416
トップパン・フォームズ	25.5	31.5	37,863
フジシールインターナショナル	32	33	142,725
タカラトミー	55.5	61.6	68,560
廣済堂	14.4	13.7	7,398
A s - m e エステール	3.8	4.3	3,784
アーク	60.1	74.9	9,062
タカノ	6.3	6.5	6,461
プロネクス	13.3	13.7	18,495
ホクシン	10.1	10.4	1,830
ウッドワン	24	4.9	7,668
大建工業	10	11.5	32,407
凸版印刷	403	415	378,480
大日本印刷	412	192.5	451,412
図書印刷	19	9.9	10,167

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
共同印刷	44	4.5	15,300
N I S S H A	24.9	30.2	83,472
光村印刷	13	1.3	3,168
宝印刷	7.5	7.7	15,723
アシックス	141.9	146.1	261,226
ツツミ	5.3	4.6	9,641
小松ウオール工業	4.8	5	12,100
ヤマハ	96.2	99.1	579,735
河合楽器製作所	5.6	4.9	19,183
クリナップ	16.7	13.7	11,288
ビジョン	86.3	88.9	464,058
兼松サステック	15	1.1	2,401
キングジム	11.9	12.2	13,456
リンテック	34	35	116,025
T A S A K I	3.9	—	—
イトーキ	30.1	31	21,266
任天堂	88	90.6	4,122,300
三菱鉛筆	11.8	24.2	54,692
タカスタンダード	29.5	30.4	56,604
コクヨ	74.2	70.6	144,659
ナカバヤシ	26	14.5	9,207
グローブライド	6.9	6.6	21,516
オカムラ	49.8	51.3	86,697
美津濃	77	14.6	58,765
<b>電気・ガス業 (1.7%)</b>			
東京電力ホールディングス	1,211.5	1,174.5	640,102
中部電力	470.6	450.1	781,148
関西電力	582.8	600.3	953,876
中国電力	197.5	203.4	285,370
北陸電力	139.9	144.1	159,374
東北電力	356.8	344.6	495,534
四国電力	128.6	132.5	181,260
九州電力	315.4	324.9	423,344
北海道電力	133.7	147.5	114,460
沖縄電力	21	23.8	75,327
電源開発	113.6	117.1	350,011
エフオン	7	7.4	10,744
イーレックス	17.9	23.2	20,044
レノバ	—	7.6	7,904
東京瓦斯	1,532	313.9	901,363

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大阪瓦斯	1,386	285.5	684,200
東邦瓦斯	358	72.9	249,318
北海道瓦斯	36	40	12,240
広島ガス	29.4	30.3	11,423
西部瓦斯	161	17.8	52,510
静岡ガス	43.9	41.8	40,964
メタウォーター	8	8.3	25,149
<b>陸運業 (4.2%)</b>			
S B S ホールディングス	14.1	14.5	20,720
東武鉄道	763	155.2	524,576
相鉄ホールディングス	228	47.1	149,071
東京急行電鉄	776	399.6	740,858
京浜急行電鉄	391	201.5	368,946
小田急電鉄	228.8	218.8	514,617
京王電鉄	399	82.2	402,780
京成電鉄	107	102.4	363,520
富士急行	39	20.1	65,325
新京成電鉄	18	3.8	8,705
東日本旅客鉄道	276.3	264.2	2,829,582
西日本旅客鉄道	137.5	132.7	1,063,059
東海旅客鉄道	118.8	131.7	2,811,795
西武ホールディングス	197.2	187.5	351,750
鴻池運輸	20.2	20.8	40,123
西日本鉄道	172	40.8	124,440
ハマキョウレックス	9.3	10.4	38,220
サカイ引越センター	6.6	7.7	46,354
近鉄グループホールディングス	1,437	139.3	615,009
阪急阪神ホールディングス	180.4	185.8	792,437
南海電気鉄道	302	66	201,630
京阪ホールディングス	320	62	224,130
神戸電鉄	35	3.3	13,134
名古屋鉄道	520	110.9	310,741
山陽電気鉄道	52	10.7	29,703
日本通運	531	54.7	448,540
ヤマトホールディングス	255.4	244.3	708,103
山九	188	35.7	205,275
丸運	7.7	7.9	2,757
丸全昭和運輸	48	49	25,480
センコーグループホールディングス	67.8	83.8	76,593
トナミホールディングス	29	3.3	24,288

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニッコンホールディングス	48.4	53	161,915
日本石油輸送	1.6	1.7	5,669
福山通運	87	20.4	108,324
セイノーホールディングス	101.3	104.4	221,954
エスライン	－	3.8	4,666
神奈川中央交通	17	3.5	12,967
日立物流	29.7	30.6	94,860
丸和運輸機関	3.6	7.3	32,047
C＆F ロジホールディングス	14.8	15.3	22,123
九州旅客鉄道	141.9	116.9	402,136
S G ホールディングス	－	131.6	307,812
海運業 (0.2%)			
日本郵船	1,207	116.5	280,299
商船三井	749	88.2	288,414
川崎汽船	542	64.4	155,526
N S ユナイテッド海運	64	6.6	14,836
明治海運	12.8	14.8	6,645
飯野海運	73.9	71	37,062
共栄タンカー	12	1	1,900
乾汽船	10.4	10.7	9,148
空運業 (0.6%)			
日本航空	251	258.5	1,030,122
A N A ホールディングス	2,651	270.6	1,115,683
バスコ	13	13	4,368
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	4.1	3.9	32,331
日新	58	12	33,036
三菱倉庫	94	48.2	120,259
三井倉庫ホールディングス	83	80	28,640
住友倉庫	104	97	71,489
滋澤倉庫	37	7.6	14,136
東陽倉庫	24.4	25.1	9,437
日本トランスシティ	33	33.7	17,827
ケイヒン	26	2.7	4,455
中央倉庫	8.2	8.5	9,724
川西倉庫	－	2.8	5,712
安田倉庫	11.1	12.5	12,487
東洋埠頭	41	4.2	7,245
宇徳	11.6	11.9	6,104
上組	170	85.9	210,283

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サンリツ	3.5	3.6	2,876
キムラユニティー	3.6	3.7	4,303
キューソー流通システム	4.5	4.1	11,529
郵船ロジスティクス	13.1	—	—
近鉄エクスプレス	25.5	26.3	54,362
東海運	7.7	7.9	3,152
エーアイテイ	8.8	9.9	12,335
内外トランスライン	4.3	4.9	8,673
日本コンセプト	—	2.7	4,068
情報・通信業 (7.4%)			
NEC ネットエスアイ	15.5	15.9	43,804
システナ	11.2	11.6	58,232
デジタルアーツ	6.3	7.1	38,908
新日鉄住金ソリューションズ	23.5	21.6	65,772
キューブシステム	8.1	8.4	7,047
エイジア	—	2.9	4,245
コア	5.9	6.1	9,204
ソリトンシステムズ	—	6.3	10,080
ソフトクリエイトホールディングス	6.7	6.9	11,778
T I S	46.7	48.1	211,640
ネオス	4.2	4.3	1,741
電算システム	4.9	5	10,075
グリー	85.8	77.4	48,994
コーエーテクモホールディングス	33.4	24.6	54,661
三菱総合研究所	6	5.6	24,668
ボルテージ	2.5	2.8	2,517
電算	1.6	1.6	3,780
AGS	3.5	8.1	7,484
ファインデックス	10.4	11.9	9,758
ヒト・コミュニケーションズ	3.2	3.3	6,788
ブレインパッド	3	3.1	8,351
KL a b	26.9	27.4	51,265
ポルトゥウィン・ビッドクルーホールディ	10.1	10.4	20,883
イーブックイニシアティブジャパン	2.2	2.3	2,881
ネクソン	154.9	324.3	512,718
アイスタイル	29.7	36.7	42,572
エムアップ	4	4.8	6,950
エイチーム	9.5	9	20,232
テクノスジャパン	10.9	13	12,909
e n i s h	4.2	4.9	5,110

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コロブラ	45.2	41.2	34,031
モバイルクリエイト	10.3	11.6	4,431
オルトプラス	5.5	8.2	6,937
ブロードリーフ	34.7	71.5	38,610
クロス・マーケティンググループ	—	4	2,516
ハーツユナイテッドグループ	7.4	7.6	13,832
メディアドゥホールディングス	4	4.7	9,639
ブイキューブ	7.7	8.9	5,375
サイバーリンクス	2.1	2.2	2,613
ディー・エル・イー	6.3	9.3	4,315
フィックスターズ	2.4	13.8	18,988
VOYAGE GROUP	7	7.6	8,732
オブティム	3	2.5	6,557
セレス	3.3	4.4	8,888
ベリサープ	1.6	1.9	6,175
ティーガイア	14	14.4	42,552
セック	—	1.9	5,392
日本アジアグループ	15.9	15.2	8,542
豆蔵ホールディングス	10.3	10.7	14,231
テクマトリックス	8.8	7.9	16,108
プロシッパ	—	2.1	5,793
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	295.5	391.4	113,506
GMOペイメントゲートウェイ	9.9	11.9	136,374
ザッパラス	7.3	6.9	2,608
システムリサーチ	1.4	1.9	4,408
インターネットイニシアティブ	20.7	23.5	47,517
さくらインターネット	11.4	17.2	14,792
ヴィンクス	—	4	6,316
GMOクラウド	3.1	3.2	8,192
SRAホールディングス	7.4	7.7	24,216
Minor iソリューションズ	3.1	2.8	4,802
システムインテグレータ	2	2	2,230
朝日ネット	12.8	13.2	7,246
eBASE	—	3.8	5,487
アバント	—	3.9	3,779
アドソル日進	3.7	5.5	7,276
フリービット	10.4	9.6	11,097
コムチュア	2.4	7.3	28,287
サイバーコム	2.5	2.6	6,338
インフォテリア	—	7.2	9,619

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メディカル・データ・ビジョン	6.2	11	16,797
gumi	16	16.6	16,517
ショーケース・ティービー	2.1	2.8	4,006
モバイルファクトリー	—	3.5	4,896
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	2.1	6.4	7,852
P C I ホールディングス	2.3	2.5	7,612
パイプドHD	2.5	2.2	2,241
アイビーシー	1.5	2.3	3,010
ネオジャパン	—	3.4	4,586
オープンドア	1.8	5.7	11,628
マイネット	—	3.8	4,761
アカツキ	—	3.8	18,202
ベネフィットジャパン	—	0.8	956
U b i c o mホールディングス	—	2.1	1,887
L I N E	31.6	43.6	174,618
シンクロ・フード	—	4.9	5,022
オークネット	4.4	6.1	8,680
AOI TYO Holdings	11.5	11.8	18,726
マクロミル	18.1	18.1	47,802
ビーグリー	—	3.3	5,685
オロ	—	1.4	2,879
ソルクシーズ	5.4	5.5	7,122
フェイス	3.7	5.1	5,732
ハイマックス	1.9	1.9	3,496
野村総合研究所	105.4	91.7	513,520
サイバネットシステム	11.5	11.8	10,478
C E ホールディングス	2	3.7	3,378
日本システム技術	—	2.3	3,125
インテージホールディングス	8	17	20,859
東邦システムサイエンス	4.6	4.8	4,204
ソースネクスト	8.4	20.3	16,524
フォーカスシステムズ	7.2	8.2	7,699
クレスコ	3.2	3.3	12,441
フジ・メディア・ホールディングス	146.8	151.2	278,359
オービック	48.6	45.5	425,880
ジャストシステム	22.8	23.5	59,737
TDCソフト	6.1	6.3	9,078
ヤフー	1,010.3	1,040.9	423,646
トレンドマイクロ	74.7	70.5	458,250
インフォメーション・ディベロプメント	4	4.5	6,336

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本オラクル	22.6	23.4	210,132
アルファシステムズ	4.6	4.7	11,665
フューチャー	19	19.6	27,890
CAC Holdings	10.5	10.8	11,858
ソフトバンク・テクノロジー	3.4	6.1	10,284
トーセ	3.8	3.9	4,703
オービックビジネスコンサルタント	7.2	7.4	57,424
伊藤忠テクノソリューションズ	31.9	65.8	135,548
アイティフォー	18.3	17.5	21,280
東計電算	2.5	2.6	8,255
エクスネット	2.6	2.3	2,051
大塚商会	37.9	86.8	384,958
サイボウズ	18.7	19.3	10,769
ソフトブレイン	19.2	11.3	5,977
電通国際情報サービス	8.7	8.9	28,925
デジタルガレージ	27.3	25.9	98,808
EMシステムズ	4.8	10	10,360
ウェザーニューズ	4.7	4.9	17,346
C I J	11.8	11.3	8,554
東洋ビジネスエンジニアリング	1.4	1.4	2,616
日本エンタープライズ	14.4	14.8	3,404
WOWOW	6.7	6.9	23,943
スカラ	9.7	11.6	9,500
日本コロムビア	4.2	—	—
イマジカ・ロボット ホールディングス	11.8	12.2	12,444
ネットワンシステムズ	61	58.9	107,669
システムソフト	33.2	34.2	4,890
アルゴグラフィックス	6.4	6.6	25,311
マーベラス	23.8	24.5	23,520
エイベックス	25.9	26.8	40,173
日本ユニシス	38.9	40.1	105,463
兼松エレクトロニクス	8.9	9.2	33,810
東京放送ホールディングス	92.9	79.8	187,769
日本テレビホールディングス	128.7	132.6	246,238
朝日放送グループホールディングス	13.9	14.3	12,012
テレビ朝日ホールディングス	38.5	39.7	94,406
スカパーJ SATホールディングス	91.7	110.2	54,769
テレビ東京ホールディングス	11.5	11.8	34,562
日本BS放送	4.7	4.9	7,168
ビジョン	2.2	3.7	11,747

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
USEN-NEXT HOLDINGS	3.6	3.8	3,537
ワイヤレスゲート	6.5	6.8	10,880
コネクシオ	12.4	10.2	22,134
日本通信	117.9	130.2	14,973
クロップス	3	3.1	2,926
日本電信電話	1,131.5	1,036.1	5,456,102
KDDI	1,394.5	1,300	3,749,200
光通信	16.9	17.4	299,454
NTTドコモ	1,037.6	1,036.6	2,894,705
エムティーアイ	18.9	16.7	11,422
GMOインターネット	51.4	52.6	114,825
アイドママーケティングコミュニケーション	1.8	3.1	2,070
カドカワ	40.9	42.1	48,709
学研ホールディングス	4.7	4.8	24,048
ゼンリン	18.6	26.2	66,338
昭文社	8.1	6.6	5,603
インプレスホールディングス	11.6	11.9	2,403
アイネット	7.9	8.2	13,538
松竹	93	9.5	152,095
東宝	92.2	95	364,800
東映	52	5.4	65,448
エス・ティ・ティ・データ	87.1	448.4	556,464
ビー・シー・エー	2	2.1	3,725
ビジネスブレイン太田昭和	2.4	2.5	5,547
DTS	14.5	15	60,225
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54.3	67.1	324,764
シーイーシー	8.3	8.6	29,627
カブコン	33	61.9	149,179
アイ・エス・ビー	2.7	2.8	6,056
ジャステック	8.9	8.4	10,323
SCSK	38.3	33.3	167,166
日本システムウエア	4.6	4.8	12,412
アイネス	17.8	18.3	21,850
TKC	13	12.2	51,667
富士ソフト	20.9	20	86,500
NSD	29.9	23.7	55,149
コナミホールディングス	63.6	59	325,680
福井コンピュータホールディングス	4.1	4.2	9,193
JBCホールディングス	11.8	11.4	12,289
ミロク情報サービス	13.9	12.7	39,116

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソフトバンクグループ	634.5	653.6	5,460,828
卸売業 (4.8%)			
ハウスイ	11	1.1	1,287
高千穂交易	5.4	5.6	7,285
伊藤忠食品	3.5	3.6	22,248
エレマテック	5.6	6.8	17,414
J A L U X	4.5	4.1	11,865
あらた	6.4	7.2	54,792
トーメンデバイス	2.1	2.2	6,410
東京エレクトロン デバイス	5.1	5.2	10,992
フィールズ	10.8	11.1	12,964
双日	832.5	857.5	359,292
アルフレッサ ホールディングス	166.7	161	396,060
横浜冷凍	33.1	36.7	40,370
神栄	19	2	2,892
山下医科器械	1.1	—	—
ラサ商事	6	6.4	6,080
ラクーン	8.9	8.5	5,584
アルコニックス	8	15.4	30,676
神戸物産	7.6	9.4	48,692
ベッパーフードサービス	—	10.4	62,504
あい ホールディングス	20.1	23.3	68,898
ディーブイエックス	5	5.2	7,165
ダイワボウホールディングス	120	12.3	61,746
マクニカ・富士エレホールディングス	26.1	27.7	53,959
ラクト・ジャパン	—	2.7	14,013
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26.5	27.3	29,183
八洲電機	10.9	11.2	10,785
メディアスホールディングス	2.2	8	8,296
UKCホールディングス	9.1	9.3	21,324
ジュエテックホールディングス	—	3.3	3,798
大光	—	3.6	3,211
OCHIホールディングス	4.1	4.2	6,787
TOKAIホールディングス	61.9	76.6	90,388
Cominix	2.1	2.2	2,211
三洋貿易	7.7	7.3	16,636
ビューティガレージ	1.9	1.9	4,436
ウイン・パートナーズ	10.1	10.5	15,592
ミタチ産業	3.3	3.4	3,944
シップヘルスケアホールディングス	27.1	30.2	112,948

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
明治電機工業	4.8	5	10,195
デリカフーズホールディングス	3	2.8	4,594
スターティアホールディングス	3.2	3.3	3,022
コメダホールディングス	25.5	26.8	57,325
富士興産	5	5.6	3,707
協栄産業	17	1.8	3,691
小野建	12.2	12.8	24,051
佐島電機	10.3	10.7	12,230
エコトレーディング	3.2	3.3	2,412
伯東	9.6	8.8	16,332
コンドーテック	11.2	11.5	10,798
中山福	8.1	8.3	6,183
ナガイレーベン	18.7	21	59,955
三菱食品	15.5	15.9	49,449
松田産業	10.3	10.6	20,118
第一興商	22.9	21.6	124,416
メディカルホールディングス	141	145.2	337,880
S P K	3	3.1	8,711
萩原電気ホールディングス	4.8	5.2	16,146
アズワン	11	11.3	80,795
スズデン	5	5	8,560
尾家産業	4.5	4.2	5,804
シモジマ	8.6	8.9	10,048
ドウシシャ	16.6	15.4	39,008
小津産業	3.1	3.2	7,545
高速	8.4	8.6	11,739
たけびし	4.9	5.1	8,863
黒田電気	19.2	—	—
リックス	3.2	3.3	6,949
丸文	12.4	12.8	12,300
ハビネット	11.7	9.9	15,523
橋本総業ホールディングス	2.9	3	5,286
日本ライフライン	16	41.3	106,058
エクセル	6	5.8	16,675
マルカキカイ	4.5	4.7	9,719
I DOM	37.9	43.9	34,988
日本エム・ディ・エム	10.6	9.7	11,067
進和	8.3	8.6	22,136
エスケイジャパン	2.6	3.5	1,960
ダイترون	6.4	6.6	15,820

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
シークス	10.1	18.4	39,486	
田中商事	4.3	4.4	3,264	
オーハシテクニカ	7.9	8.2	14,661	
白銅	3.5	5.2	12,220	
伊藤忠商事	1,032.4	1,063.4	2,162,423	
丸紅	1,387.2	1,190.8	1,032,304	
高島	24	2.5	5,617	
長瀬産業	84.7	87.3	171,195	
蝶理	9	9.2	19,375	
豊田通商	157	161.7	657,310	
三共生興	21.3	24.7	12,275	
兼松	300	61.8	106,728	
ツカモトコーポレーション	25	2.6	3,317	
三井物産	1,274.7	1,230.9	2,381,176	
日本紙バルブ商事	73	7.5	33,675	
日立ハイテクノロジーズ	48.9	50.3	254,015	
カメイ	18.3	18.9	29,597	
東都水産	2.1	2.2	4,136	
ＯＵＧホールディングス	22	2.3	6,159	
スターゼン	5.9	5.7	31,065	
山善	54.1	56.6	63,278	
椿本興業	16	3.3	13,447	
住友商事	887.3	914	1,759,907	
内田洋行	6.5	6.7	20,368	
三菱商事	1,057.7	1,016.9	3,240,860	
第一実業	32	6.6	21,285	
キャノンマーケティングジャパン	40.2	41.4	99,691	
西華産業	44	8.8	25,300	
佐藤商事	12.6	12.9	15,441	
菱洋エレクトロ	13.1	13.5	25,771	
東京産業	14	14.4	8,107	
ユアサ商事	13.3	13.8	49,335	
神鋼商事	3.5	3.2	10,832	
小林産業	10.2	9.6	3,456	
阪和興業	141	27.1	129,944	
正栄食品工業	—	8	35,200	
カナデン	13.4	13.8	18,795	
菱電商事	22	10.4	18,792	
フルサト工業	7.8	8	14,824	
岩谷産業	156	32.1	129,042	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
すてきナイスグループ	60	6.2	9,008	
昭光通商	50	51	5,610	
ニチモウ	20	2.2	3,997	
極東貿易	22	21	10,542	
イワキ	21	20.4	8,180	
三愛石油	37.8	38.9	68,308	
稲畑産業	33.8	34.8	58,846	
G S I クレオス	34	3.8	6,410	
明和産業	13	13.4	7,155	
ワキタ	30	30.9	37,110	
東邦ホールディングス	45.1	42.9	119,176	
サンゲツ	48.3	48.3	108,578	
ミツウロコグループホールディングス	22.7	21	19,803	
シナネンホールディングス	6	6	16,488	
伊藤忠エネクス	31.1	32	34,912	
サンリオ	43.4	40.7	83,028	
サンワテクノス	8.3	9.4	15,745	
リョーサン	21	18.2	77,623	
新光商事	15.4	15.9	30,305	
トーホー	6.3	6.5	16,900	
三信電気	15.6	13.4	29,386	
東陽テクニカ	16.2	16.7	16,032	
モスフードサービス	18.5	19	62,225	
加賀電子	12.7	13.1	34,269	
ソーダニッカ	14.5	14.9	11,696	
立花エレテック	9.5	9.8	20,041	
フォーバル	6.1	6.3	5,531	
P A L T A C	22.5	20.3	125,860	
三谷産業	14.9	15.7	6,688	
太平洋興発	59	6	6,246	
西本W i s m e t t a c ホールディングス	—	3.9	18,388	
ヤマシタヘルスケアホールディングス	—	1.2	1,880	
ヤマタネ	7	7.3	14,315	
丸紅建材リース	14	14	3,388	
日鉄住金物産	12.4	11.3	68,704	
泉州電業	—	4.8	14,928	
トラスコ中山	32.2	30.2	85,617	
オートバックスセブン	52.2	57.6	118,252	
モリト	11.3	11.6	12,087	
加藤産業	22	22.7	91,027	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イノテック	12.1	12.5	17,337
イエローハット	13.3	13.7	45,210
J Kホールディングス	14.1	14.5	13,311
日伝	5.8	12	25,140
北沢産業	11.6	12	3,612
杉本商事	8.1	7.8	15,826
因幡電機産業	19.8	19.2	91,968
パイテックホールディングス	5.7	6.6	17,674
東テク	—	4.8	12,931
ミスミグループ本社	158.9	168.3	515,839
アルテック	12	12.4	4,476
タキヒヨー	21	4.8	11,510
蔵王産業	2.3	2.4	4,264
スズケン	64.2	66.1	322,898
ジェコス	9.7	10	11,480
ルネサスイーストン	12.9	13.3	9,097
<b>小売業 (4.9%)</b>			
ローソン	44.5	36.7	254,698
サンエー	10.6	11	61,930
カワチ薬品	10.9	11.2	29,433
エービーシー・マート	25.6	26.4	189,552
ハードオフコーポレーション	6.2	6.4	7,212
アスクル	14.7	12.6	43,407
ゲオホールディングス	23.6	26.5	43,460
アダストリア	21.6	22.3	37,129
ジーフット	8.5	8.7	6,933
シー・ヴィ・エス・ペイエリア	1.8	1.9	1,508
くらコーポレーション	9.2	8.5	66,470
キャンドウ	7.4	6.9	12,640
バルグループホールディングス	7.2	7.4	21,534
エディオン	54.6	56.3	63,056
サーラコーポレーション	17.6	24.9	17,629
ワッツ	5.6	4.8	5,668
ハローズ	4.6	5.4	14,736
あみやき亭	2.7	3.1	16,833
ひらまつ	19.4	20	10,000
ゲンキー	5.6	—	—
大黒天物産	3.4	3.5	20,615
ハニースホールディングス	13.6	14	14,700
ファーマライズホールディングス	3.2	3.3	2,385

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルペン	10.8	11.1	25,718
ハブ	—	3.6	4,132
クオール	15.9	16	33,568
ジンズ	9.6	9.9	58,014
ビックカメラ	80.9	77.1	141,247
DCMホールディングス	85.5	78.1	83,567
Monotaro	50	51.5	216,815
東京一番フーズ	3.5	3.6	2,412
DDホールディングス	3.1	3.2	9,145
きちり	3.7	3.9	2,847
アークランドサービスホールディングス	5.9	12.1	29,729
J. フロント リテイリング	178.3	173	309,324
ドトール・日レスホールディングス	24.7	25.4	59,258
マツモトキヨシホールディングス	26.7	59.9	294,408
ブロンコビリー	7.4	7.6	33,364
スタートトゥデイ	128.7	142.4	516,200
トレジャー・ファクトリー	4	4.2	3,322
物語コーポレーション	4	4.1	52,275
ココカラファイン	14.7	15.1	116,572
三越伊勢丹ホールディングス	280.4	271	358,262
Hamee	4.2	3.7	5,968
ウエルシアホールディングス	37.2	38.3	220,608
クリエイトSDホールディングス	20.7	21.4	69,657
丸善CH I ホールディングス	16.4	16.9	6,033
ミサワ	2.5	2.6	1,110
ティーライフ	1.9	1.9	2,551
エー・ピーカンパニー	2.3	2.7	2,127
チムニー	4.3	4.4	12,513
シュッピン	5.3	8.7	12,815
ネクステージ	5.5	15.3	17,931
ジョイフル本田	22.9	21.2	84,482
鳥貴族	5.2	4.8	13,344
キリン堂ホールディングス	4.5	5.2	16,042
ホットランド	6.5	8.4	11,440
すかいらーく	60.5	90	143,280
綿半ホールディングス	5.7	5.4	21,195
ヨシックス	1.8	2.4	8,016
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	46.7	48.1	68,157
ブックオフコーポレーション	8	8.2	6,765
ゴルフダイジェスト・オンライン	5.7	5.8	7,824



銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
BEENOS	2.2	3.4	5,280
あさひ	10.5	10.8	14,169
日本調剤	5	5.1	16,804
コスモス薬品	7.1	7.3	180,675
トーエル	6.8	7	7,357
一六堂	3	3.1	1,302
オンリー	2.1	2.5	2,467
セブン&アイ・ホールディングス	590	607.4	2,892,438
薬王堂	7	6.3	25,042
クリエイト・レストランツ・ホールディング	37.8	38.9	52,515
ツルハホールディングス	28.2	31.4	505,226
サンマルクホールディングス	9.1	10.4	32,292
フェリシモ	4	3.7	5,057
トリドールホールディングス	17.3	17.9	66,498
TOKYO BASE	1.8	12.9	13,467
ウイルプラスホールディングス	—	1.3	1,484
サツドラホールディングス	1.9	2.4	5,700
ダイユー・リックホールディングス	4.5	6.8	7,446
パロックジャパンリミテッド	11.1	11.6	13,305
クスリのアオキホールディングス	11.2	11.5	88,550
力の源ホールディングス	—	3.2	6,080
スシローグローバルホールディングス	12.8	15.9	89,676
L I X I L ビバ	—	18.4	35,438
メディカルシステムネットワーク	15.9	16.7	8,166
総合メディカル	6.8	12.6	30,681
はるやまホールディングス	6.6	6.8	7,432
ノジマ	22	25.5	69,130
カッパ・クリエイト	19.7	18.1	26,679
ライトオン	11.8	12.2	12,505
ジーンズメイト	4.5	4.4	3,744
良品計画	18.7	19.2	728,640
三城ホールディングス	17.4	17.9	9,236
アドヴァン	14.3	14.7	14,832
アルビス	3.7	4.7	18,189
コナカ	18	18.5	10,952
ハウス オブ ローゼ	1.7	1.8	3,267
G-7ホールディングス	4.1	4.3	10,547
イオン北海道	14.1	14.6	11,811
コジマ	24.2	21.4	9,844
ヒマラヤ	3.8	4.5	5,319

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コーナン商事	20	20.6	56,959
エコス	5.5	5.9	10,897
ワタミ	16.6	17.1	25,650
マルシェ	3.1	3.8	3,093
ドンキホーテホールディングス	91.2	93.9	507,999
西松屋チェーン	24.7	31.8	41,244
ゼンショーホールディングス	73	75.2	201,460
幸楽苑ホールディングス	8.9	9.2	16,504
ハークスレイ	3.4	3.5	3,979
サイゼリヤ	20.9	23.9	60,562
V Tホールディングス	47.6	49.1	24,157
魚力	4.4	4	5,732
ポプラ	3.5	3.8	3,420
フジ・コーポレーション	2.1	2.5	6,345
ユナイテッドアローズ	18.8	17.9	71,600
ハイデイ日高	15.4	19	53,105
京都きもの友禅	8.9	9.2	6,504
コロワイド	46.7	48.1	145,262
ビーシーデポコーポレーション	18.7	21.6	15,400
老番屋	9.9	10.2	46,053
トップカルチャー	5.1	5.2	2,558
P L A N T	3.2	3.3	4,441
スギホールディングス	30.9	31.8	208,290
ヴィア・ホールディングス	10.7	17.4	12,075
スクロール	21.3	22.3	12,510
ヨンドシーホールディングス	14.3	14.7	40,175
ユニー・ファミリーマートホールディングス	61.8	46.3	503,281
木曽路	17.2	17.8	51,086
S R Sホールディングス	16.6	17.1	16,706
千趣会	25.5	26.2	15,065
タカキュー	10.9	11.2	2,441
ケーヨー	23.7	26.8	15,168
上新電機	33	17.1	75,753
日本瓦斯	25.8	26.6	144,970
ベスト電器	45.4	—	—
ロイヤルホールディングス	23.2	25.7	72,910
東天紅	11	1.1	2,115
いなげや	15.7	16.2	28,593
島忠	36.5	32.8	113,980
チヨダ	16.6	17.1	45,400

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ライフコーポレーション	10.7	11	31,053
リンガーハット	15.9	17.9	47,578
さが美グループホールディングス	13	13	1,937
MrMaxHD	17.6	18.1	12,869
テンアライド	13	13.4	6,445
AOKIホールディングス	28.1	29	48,430
オークワ	20	21	24,465
コメリ	21.7	22.4	65,273
青山商事	29.5	27.8	116,899
しまむら	16.4	16.9	209,729
はせがわ	7.4	7.7	3,788
高島屋	236	227	207,932
松屋	30.7	29.2	40,354
エイチ・ツー・オー リテイリング	72.2	68.6	141,727
近鉄百貨店	54	5.5	21,752
丸栄	29	—	—
バルコ	13.5	13.9	18,876
丸井グループ	148.3	138.8	311,189
アクシアル リテイリング	10.9	12	49,800
井筒屋	7.6	7.9	2,804
イオン	580	557.6	1,197,446
イズミ	28	26.2	180,780
東武ストア	1.7	1.7	5,210
平和堂	28.6	29.4	76,440
フジ	15.7	17.3	39,772
ヤオコー	16	16.4	103,320
ゼビオホールディングス	19.1	19.7	38,828
ケーズホールディングス	59.6	127.1	174,254
Olympicグループ	8.3	8.5	4,785
日産東京販売ホールディングス	20.7	21.3	8,520
Genky DrugStores	—	5.7	24,624
アインホールディングス	18.4	19.4	140,262
元気寿司	3.5	3.7	10,955
ヤマダ電機	471.4	485.6	275,335
アークランドサカモト	23.9	24.6	42,754
ニトリホールディングス	60.9	57.5	1,052,250
グلمエ杵屋	10	10	11,820
愛眼	10.3	11.6	5,776
ケーユーホールディングス	7.3	7.6	8,565
吉野家ホールディングス	49.1	47.6	95,866

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
松屋フーズ	6.8	7	26,250
サガミチェーン	17.6	19.4	27,606
関西スーパーマーケット	11.5	10.9	12,447
王将フードサービス	10.3	10.6	58,724
ブレナス	15.7	16.2	30,763
ミニストップ	10.4	10.7	23,861
アークス	26.4	27.2	81,300
パローホールディングス	30.4	33.7	93,652
藤久	1.1	1.2	1,843
ベルク	6.2	6.4	36,992
大庄	7.5	7.7	13,336
ファーストリテイリング	23.5	19.4	943,810
サンドラッグ	53.6	61.4	338,314
サックスパー ホールディングス	13.2	13.6	15,884
ヤマザワ	2.9	3	5,394
やまや	2.9	3	11,790
ペルーナ	30.2	35.5	44,872
<b>銀行業 (7.1%)</b>			
島根銀行	3	3.1	4,107
じもとホールディングス	101.1	98	18,718
めぶきフィナンシャルグループ	679.7	754	321,958
東京きらぼしフィナンシャルグループ	20.4	19.6	57,310
九州フィナンシャルグループ	231.2	238.1	132,383
ゆうちょ銀行	399.1	411.1	621,583
富山第一銀行	35.8	36.9	18,413
コンコルディア・フィナンシャルグループ	913.6	866.5	542,429
西日本フィナンシャルホールディングス	95.6	93	122,946
関西みらいフィナンシャルグループ	—	63.5	55,054
三十三フィナンシャルグループ	—	12.2	27,657
新生銀行	1,342	125.6	218,795
あおぞら銀行	892	86.5	381,465
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,681.4	10,158.9	7,304,249
りそなホールディングス	1,649	1,592.4	985,695
三井住友トラスト・ホールディングス	294.3	285.3	1,335,489
三井住友フィナンシャルグループ	1,128.7	1,098.4	4,934,012
第四銀行	173	17.8	87,309
北越銀行	15.2	14.6	35,390
千葉銀行	544	514	438,956
群馬銀行	313.2	294.7	193,028
武蔵野銀行	22.5	23.2	83,984

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
千葉興業銀行	38.6	39.8	20,059	
筑波銀行	58.6	60.3	23,517	
七十七銀行	221	45.5	124,169	
青森銀行	109	11.2	37,856	
秋田銀行	90	9.3	28,411	
山形銀行	79	16.3	39,967	
岩手銀行	9.2	10.1	43,581	
東邦銀行	126	129.8	54,126	
東北銀行	72	7.4	11,077	
みちのく銀行	84	9.3	16,451	
ふくおかフィナンシャルグループ	572	589	345,743	
静岡銀行	372	383.1	431,753	
十六銀行	189	19.5	55,458	
スルガ銀行	144.1	148.5	237,006	
八十二銀行	272	262.6	143,642	
山梨中央銀行	87	90	43,740	
大垣共立銀行	218	22.9	64,623	
福井銀行	120	12.4	31,198	
北國銀行	150	16.4	72,242	
清水銀行	4.8	4.9	15,778	
富山銀行	2.7	2.8	11,956	
滋賀銀行	132	136	75,480	
南都銀行	13.6	17	50,099	
百五銀行	127	139.3	70,207	
京都銀行	252	55.4	358,438	
紀陽銀行	53	54.6	97,952	
三重銀行	6.3	—	—	
ほくほくフィナンシャルグループ	93.8	96.6	159,100	
広島銀行	416	214.2	181,213	
山陰合同銀行	83.5	86	90,816	
中国銀行	99.9	100.3	130,089	
鳥取銀行	4.5	4.6	8,008	
伊予銀行	201	207.1	178,520	
百十四銀行	155	154	55,902	
四国銀行	108	22.3	34,252	
阿波銀行	120	116	83,056	
大分銀行	81	8.3	33,656	
宮崎銀行	94	9.7	34,726	
佐賀銀行	85	8.8	22,158	
十八銀行	87	89	26,700	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
沖縄銀行	13.7	14.1	64,084
琉球銀行	29	28.1	47,376
セブン銀行	528.4	544.3	201,391
みずほフィナンシャルグループ	19,137.8	19,715.9	3,905,719
高知銀行	51	5.3	6,974
山口フィナンシャルグループ	132	181	254,305
長野銀行	4.6	4.8	8,856
名古屋銀行	11.4	11.7	48,028
北洋銀行	230.1	218.7	82,012
愛知銀行	4.7	4.9	25,676
第三銀行	8	—	—
中京銀行	5.8	6	13,932
大光銀行	48	5	11,975
愛媛銀行	17.9	20.3	26,126
トマト銀行	5.4	5.6	8,584
みなと銀行	12.8	—	—
京葉銀行	115	128	64,768
関西アーバン銀行	19.6	—	—
栃木銀行	77.8	75.1	30,941
北日本銀行	4.4	4.5	13,171
東和銀行	264	25.5	34,833
福島銀行	153	13.7	11,083
大東銀行	73	7	9,415
トモニホールディングス	116.2	119.7	59,371
フィデアホールディングス	136.8	140.9	27,193
池田泉州ホールディングス	149.5	154	66,528
証券・商品先物取引業 (1.0%)			
F P G	50.3	46.4	67,094
マーキュリアインベストメント	—	4	4,276
S B I ホールディングス	159.3	164.1	477,202
日本アジア投資	13.5	13.1	4,847
ジャフコ	23.6	20.8	98,384
大和証券グループ本社	1,281	1,242	812,889
野村ホールディングス	2,881.7	2,496.5	1,522,865
岡三証券グループ	120	124	72,912
丸三証券	44.8	46.2	46,939
東洋証券	50	52	14,768
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	161.8	160.7	119,560
光世証券	34	3.5	4,931
水戸証券	43.6	42	17,136

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
いちよし証券	31.5	30.4	39,155
松井証券	80.5	71.1	72,237
だいこう証券ビジネス	6.8	7	4,144
マネックスグループ	149.3	147.8	102,425
カブドットコム証券	105.1	92.8	37,398
極東証券	18.9	19.5	29,659
岩井コスモホールディングス	13.3	14.9	22,856
藍澤証券	26.4	27.1	21,652
マネーパートナーズグループ	18	18.5	8,306
小林洋行	4	4.1	1,213
<b>保険業 (2.3%)</b>			
かんば生命保険	53.2	54.8	142,863
SOMPOホールディングス	294.7	284.6	1,334,774
アニコム ホールディングス	9.5	9.9	35,343
MS&ADインシュアランスグループホール	421.2	379.4	1,403,400
ソニーフィナンシャルホールディングス	135	119.2	246,624
第一生命ホールディングス	850	820.9	1,750,979
東京海上ホールディングス	567.7	546.7	2,869,628
アドバンテッジリスクマネジメント	—	4.7	6,547
T&Dホールディングス	513.7	448.8	812,103
アドバンスクリエイト	3.3	3.4	6,953
<b>その他金融業 (1.3%)</b>			
全国保証	39.7	40.9	206,954
ジェイリース	—	2.7	1,987
イントラスト	—	3	2,109
アルヒ	—	16.5	24,766
クレディセゾン	106.9	110.1	211,832
アクリーティブ	11.6	7.9	2,654
芙蓉総合リース	16.1	16.6	133,962
興銀リース	26.5	27.3	84,630
東京センチュリー	28.4	29.2	214,036
日本証券金融	62.1	59.4	40,510
アイフル	236.4	243.5	96,182
ポケットカード	10.6	—	—
リコーリース	11.1	11.4	42,978
イオンフィナンシャルサービス	90	103	279,130
アコム	283.1	291.7	145,558
ジャックス	78	17.6	43,524
オリエントコーポレーション	304.8	314	53,380
日立キャピタル	33.2	39.9	117,904

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アブラスフィナンシャル	67.6	69.6	8,212
オリックス	998.2	968	1,888,084
三菱UFJリース	357.5	368.3	276,593
九州リースサービス	—	6.2	4,904
日本取引所グループ	438.3	416.5	859,656
イー・ギャランティ	4.2	7.7	18,133
アサックス	2.4	2	3,714
NECキャピタルソリューション	5.7	5.9	12,095
<b>不動産業 (2.5%)</b>			
いちご	134	207.4	101,211
日本駐車場開発	169.9	175.1	32,043
ヒューリック	294	302.9	361,359
三栄建築設計	5.6	5.8	11,089
スター・マイカ	—	7	18,123
野村不動産ホールディングス	93.6	96.6	267,195
三重交通グループホールディングス	25	29.4	15,934
サムティ	11.3	12.4	25,866
ディア・ライフ	12.5	16.2	9,655
コーセーアールイー	—	3.2	3,126
エー・ディー・ワークス	129.2	192.4	7,888
日本商業開発	7.9	8.2	14,997
プレサンスコーポレーション	21.9	19.9	33,670
ユニゾホールディングス	11.6	16.9	37,433
THEグローバル社	6.6	6.8	5,725
日本管理センター	10.1	9.6	15,427
サンセイランディック	2.9	4.2	5,644
エストラスト	2.5	2	2,028
フージャースホールディングス	18.2	35.2	27,772
オープンハウス	22.9	23.6	142,308
東急不動産ホールディングス	341	351.3	298,253
飯田グループホールディングス	117.5	121	252,769
イーグランド	—	2.3	2,801
ムゲンエステート	6.5	8.9	10,644
ビーロット	—	2.2	4,736
ファーストブラザーズ	1.9	4	5,584
ハウスドゥ	2.3	2.3	12,926
シーアールイー	2.2	2.4	4,317
ケイアイスター不動産	3.8	5.2	14,882
パーク 2 4	71.5	81	251,100
バラカ	4.5	3.7	8,972

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井不動産	747.4	724.6	2,021,271
三菱地所	1,048.4	1,080.1	2,166,140
平和不動産	26.6	25.6	59,571
東京建物	163.6	158.6	253,918
ダイビル	36.3	37.4	44,992
京阪神ビルディング	23.3	24	21,936
住友不動産	338	348	1,531,896
大京	262	23.1	57,472
テオオーシー	54.6	50	49,050
東京楽天地	23	2.4	13,536
レオパレス 2 1	177.9	173.1	169,638
スターツコーポレーション	19.2	19.7	60,577
フジ住宅	18	18.5	17,538
空港施設	17	14.5	9,439
明和地所	7.7	8	6,136
住友不動産販売	12.7	—	—
ゴールドクレスト	12.7	11.4	24,156
日本エスリード	5.5	5.7	11,713
日神不動産	16.7	19.3	16,366
日本エスコン	24.5	26.2	21,300
タカラレーベン	60.5	68	31,280
サンヨーハウジング名古屋	7.3	8.2	10,028
イオンモール	90.8	93.5	201,960
ファースト住建	5.2	5.4	8,704
カチタス	—	19.8	72,765
トーセイ	19.3	17.7	23,859
穴吹興産	1.5	1.6	5,232
エヌ・ティ・ティ都市開発	87.6	90.2	110,585
サンフロンティア不動産	15.2	17.5	25,322
エフ・ジェー・ネクスト	12.3	11.1	10,933
インテリックス	4.3	4.1	4,530
ランドビジネス	8.3	7.3	2,489
グランディハウス	12.3	12.7	6,502
日本空港ビルデング	45	42.4	195,676
<b>サービス業 (4.4%)</b>			
日本工営	10	9.4	30,409
L I F U L L	36.9	48.8	38,991
ジェイエイシーリクルートメント	9.2	11.3	25,684
日本M&Aセンター	43.1	97.3	319,144
メンバーズ	—	4.6	5,276

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
中広	1.4	1.4	1,044
タケエイ	13.1	14.6	19,432
トラスト・テック	6	6.6	25,113
コシダカホールディングス	6.8	9.4	64,766
パソナグループ	11.1	13.3	23,408
C D S	3.4	3.8	5,624
リンクアンドモチベーション	35.1	25.8	29,747
G C A	13.2	16	15,888
エス・エム・エス	21.2	27.8	105,779
パーソルホールディングス	115.4	129.7	337,479
リニカル	8.8	9	15,912
クックパッド	33.3	44.2	27,890
エスクリ	5.3	4.9	4,468
アイ・ケイ・ケイ	6.6	8.2	6,568
学情	6.2	6.4	8,665
スタジオアリス	6.1	7.1	17,466
シミックホールディングス	7.6	7.8	18,571
N J S	3.3	3.4	5,814
総合警備保障	54.3	55.9	309,127
カカコム	106.4	105.8	238,579
セントケア・ホールディング	1.9	6	4,776
サイネックス	1.4	2.1	1,822
ルネサンス	7.6	6.8	13,035
ディップ	19.2	19.8	51,816
オプトホールディング	10.9	9.8	16,571
新日本科学	16.6	17.1	9,405
ツクイ	35.3	33.1	28,101
キャリアデザインセンター	3.1	3.5	7,623
エムスリー	129.2	148	631,960
ツカダ・グローバルホールディング	10.9	11.2	7,291
プラス	—	1	906
アウトソーシング	9.6	41.9	85,224
ウエルネット	11.2	14.2	18,218
ワールドホールディングス	4.5	4.6	16,652
ディー・エヌ・エー	66.9	75.8	165,092
博報堂D Yホールディングス	206.8	195.3	300,957
ぐるなび	21.6	22.2	25,907
エスアールジータカミヤ	16.1	16.6	11,022
ジャパンベストレスキューシステム	16.9	11.1	9,279
ファンコミュニケーションズ	37.9	39.1	27,995

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ライク	2.7	5.5	11,599
ビジネス・ブレイクスルー	6.3	6.5	3,146
WDBホールディングス	5.3	6.4	23,072
ティア	7.2	6.5	6,948
CDG	1	1.3	2,520
バリュエコマース	13.8	12.6	20,676
インフォマート	63.3	71.1	74,868
J Pホールディングス	42.9	44.1	15,920
E P Sホールディングス	20.5	21.2	43,311
レッグス	3.4	3.5	3,545
プレステージ・インターナショナル	28.2	29.2	37,054
アミューズ	8.3	9.4	29,469
ドリームインキュベータ	4.5	4.7	12,027
クイック	7.6	8.7	14,911
TAC	8.2	8.5	2,635
ケネディクス	189.2	186.2	122,519
電通	166.3	171.3	885,621
テイクアンドグヴ・ニーズ	6.9	6.6	7,827
びあ	4.5	4.7	28,811
イオンファンタジー	4.4	4.5	28,575
シーティーエス	7.9	13.9	11,745
ネクシィーズグループ	5.4	4.3	7,116
みらかホールディングス	38.1	41.9	175,142
アルプス技研	6	12.3	28,290
ダイオーズ	2.7	2.8	3,920
日本空調サービス	14.3	14.7	12,039
オリエンタルランド	161.3	166.1	1,864,472
ダスキン	36.7	37.8	107,352
明光ネットワークジャパン	17.3	17.8	22,036
ファルコホールディングス	7	7.2	13,327
秀英予備校	3	3.1	1,519
田谷	2.5	2.6	1,739
ラウンドワン	46.6	43.6	85,238
リゾートトラスト	57.7	59.5	137,326
ビー・エム・エル	19.5	18.1	49,340
ワタベウェディング	2.2	2.3	1,327
りらいあコミュニケーションズ	24.7	22.2	31,035
リソー教育	25.4	23.8	19,944
早稲田アカデミー	1.9	2	3,984
ユー・エス・エス	180.6	171.7	399,889

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京個別指導学院	4.8	5	6,270
サイバーエージェント	89.7	86.6	508,342
楽天	762.4	720.8	586,659
クリーク・アンド・リバー社	7	7.2	8,424
テー・オー・ダブリュー	11.9	13.4	12,314
セントラルスポーツ	5.1	5.2	20,358
フルキャストホールディングス	15.4	12.3	29,901
リソルホールディングス	15	1.5	6,682
テクノプロ・ホールディングス	24.3	26.5	178,080
アトラ	2.3	2.4	2,520
インターワークス	3	3.1	3,307
Keepertech	2.2	4.5	6,457
ファーストロジック	1	2.7	2,357
三機サービス	—	2.1	3,759
Gunosy	—	8.4	14,187
デザインワン・ジャパン	2.7	2.8	3,970
イー・ガーディアン	6.9	6.7	21,339
リブセンス	10	9	4,410
ジャパンマテリアル	10.9	38.4	58,214
ベクトル	12.1	16.9	36,132
ウチヤマホールディングス	6.7	6.9	4,478
ライクキッズネクスト	1.4	2.9	2,987
キャリアリンク	3.3	4.6	2,672
IBJ	11.6	11.3	11,232
アサンテ	5.5	5.1	10,332
N・フィールド	7	7.8	13,837
バリュエHR	1.5	3.2	6,288
M&Aキャピタルパートナーズ	2.5	3.6	32,292
ライドオンエクスプレスホールディングス	3.7	5.8	6,165
ERIホールディングス	3.8	3.9	4,258
アビスト	1.9	2.2	11,396
シグマクシス	—	7.5	12,840
ウィルグループ	5.9	6.1	8,430
エスクロー・エージェント・ジャパン	3.3	19.3	8,685
日本ビューホテル	3	4.4	6,626
リクルートホールディングス	325.9	1,084.6	3,005,426
エラン	2	3.4	6,575
土木管理総合試験所	2	4.6	2,723
日本郵政	389.3	797.7	1,049,773
ベルシステム24ホールディングス	22.7	23.5	39,879

## 国内株式マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
鎌倉新書	—	2.5	9,562
一蔵	1.5	1.8	1,848
L I T A L I C O	1.7	3.2	5,206
グローバルグループ	—	1.6	2,016
エボラブルアジア	2.8	4	8,092
ストライク	—	1.8	12,366
ソラスト	9.4	8.5	25,585
セラク	—	3.1	2,542
インソース	—	4.6	10,170
キャリアインデックス	—	1.9	4,446
MS-J a p a n	—	1.4	10,290
船場	—	2.7	3,515
フルテック	—	1.5	1,873
グリーンズ	—	3	5,019
日総工産	—	2.3	10,695
キュービーネットホールディングス	—	7	13,664
リログループ	74.6	76.9	196,248
東祥	4.2	8.8	36,080
エイチ・アイ・エス	24.3	21.9	81,468
ラックランド	2.6	2.7	6,979
共立メンテナンス	24.2	25.1	131,273
イチネンホールディングス	15.3	15.7	22,890
建設技術研究所	9.4	9.7	14,268
スペース	8	9.1	13,549
長大	—	5.6	4,356
燦ホールディングス	3	3.3	9,352
スバル興業	11	1	7,020
東京アートル	57	5.9	8,637
タナベ経営	2.9	2.7	5,691
ナガワ	2.7	2.8	12,796
よみうりランド	30	3.1	15,500
東京都競馬	102	10.5	49,612
常磐興産	5.5	5.6	10,600

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カナモト	20.8	21.4	79,073
東京ドーム	59.5	56.9	61,110
西尾レントオール	12	14.3	48,977
トランス・コスモス	17.3	15.6	38,844
乃村工藝社	31.9	32.9	72,478
藤田観光	49	5.6	18,032
KNT-CTホールディングス	85	8.7	15,198
日本管財	12.8	15	32,190
トーカイ	6.6	13.6	33,347
白洋舎	1.4	1.6	5,240
セコム	155.2	149.2	1,255,816
セントラル警備保障	6.6	6.8	26,622
丹青社	25.8	28.8	37,497
メイテック	17.3	16.4	90,856
アサツー ディ・ケイ	24.3	—	—
応用地質	14.1	15.1	23,661
船井総研ホールディングス	18.9	29.2	77,088
進学会ホールディングス	6.2	6.4	4,019
オオバ	11.6	11	7,260
いであ	2.7	2.8	3,250
学究社	3.9	5.1	9,210
ベネッセホールディングス	50	51.5	213,210
イオンディライト	16.8	17.3	66,951
ナック	9.1	9.4	8,732
ニチイ学館	25.9	26.7	32,173
ダイセキ	26	23.6	81,656
ステップ	5	5.1	8,782
合 計	株 数 ・ 金 額	216,435	178,482
	銘柄数<比率>	2,001	2,072
			<98.4%>

\*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいてい  
ます。

\*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。

\*評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*評価額の単位未満は切り捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	末
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 5,940	百万円 —

\*単位未満は切り捨て。

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2018年5月10日現在)

区 分	当 期	末
	数	量
貸付有価証券<株式>総株数 ( 野 村 證 券 株 式 会 社 )		株 7,765,100 ( 958,000)

\* ( ) 内は利害関係人との貸付状況です。

○投資信託財産の構成

(2018年5月10日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
株式	千円 373,917,977	% 93.2
コール・ローン等、その他	27,092,192	6.8
投資信託財産総額	401,010,169	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。



○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	401,010,169,618
コール・ローン等	23,536,774,796
株式(評価額)	373,917,977,030
未収入金	16,373,874
未収配当金	3,324,430,603
その他未収収益	64,575,485
差入委託証拠金	150,037,830
(B) 負債	21,096,233,472
未払金	7,041,974,024
未払解約金	414,972,081
未払利息	△ 389,557
受入担保金	13,639,676,924
(C) 純資産総額(A－B)	379,913,936,146
元本	219,619,412,649
次期繰越損益金	160,294,523,497
(D) 受益権総口数	219,619,412,649口
1万口当たり基準価額(C／D)	17,299円

(注) 期首元本額は221,965,622,884円、期中追加設定元本額は37,786,584,546円、期中一部解約元本額は40,132,794,781円、1口当たり純資産額は1.7299円です。

○損益の状況 (2017年5月11日～2018年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	7,289,415,949
受取配当金	7,050,006,604
その他収益金	232,623,283
支払利息	6,786,062
(B) 有価証券売買損益	39,395,214,823
売買益	48,635,259,553
売買損	△ 9,240,044,730
(C) 先物取引等取引損益	630,682,293
取引益	1,493,803,222
取引損	△ 863,120,929
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	47,315,313,065
(E) 前期繰越損益金	113,281,223,493
(F) 追加信託差損益金	25,302,142,773
(G) 解約差損益金	△ 25,604,155,834
(H) 計(D＋E＋F＋G)	160,294,523,497
次期繰越損益金(H)	160,294,523,497

\* 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。

\* 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。

\* 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。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)	79,863,358,943
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	31,966,520,764
マイバランス70(確定拠出年金向け)	17,342,524,183
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,714,941,149
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	9,516,569,907
野村世界6資産分散投信(成長コース)	6,783,681,358
のむらっ・ファンド(普通型)	5,578,789,436
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	4,825,569,698
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,188,637,674
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,079,682,525
マイバランスDC50	3,659,982,029
マイバランスDC70	3,563,828,748
マイ・ロード	3,433,307,510
野村世界6資産分散投信(分配コース)	3,391,134,768
マイバランスDC30	2,685,575,422
のむらっ・ファンド(保守型)	2,441,723,184
ノムラPOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	1,759,810,349
のむらっ・ファンド(積極型)	1,608,832,227
野村インデックスファンド・TOPIX	1,591,052,619

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,519,180,180
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,338,139,453
野村日本株インデックス(野村SMA・EW向け)	1,254,213,994
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	1,196,608,362
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,177,430,172
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	1,133,358,861
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,080,997,465
野村日本株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	910,611,686
野村DC運用戦略ファンド	866,934,587
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	805,332,287
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	673,497,312
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	648,640,191
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	638,976,686
ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	503,152,527
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	502,246,294
バランスセレクト70	461,604,109
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	455,296,560
バランスセレクト50	364,923,277
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	352,015,902

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用)	296,862,970
野村グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)	291,755,012
のむらっぴ・ファンド (やや保守型)	217,642,950
野村資産設計ファンド2040	185,786,276
のむらっぴ・ファンド (やや積極型)	173,853,069
ファンドラップ (ウエルス・スクエア) 日本株式	165,773,906
バランスセレクト30	158,614,130
ネクストコア	138,179,820
野村グローバル・インデックス・バランス25VA (適格機関投資家専用)	115,892,510
国内債券・株式バランスファンド (確定拠出年金向け)	101,497,894
野村ワールド・インデックス・バランス35VA (適格機関投資家専用)	100,010,921
野村資産設計ファンド2030	97,588,105
野村資産設計ファンド2025	92,084,461
野村資産設計ファンド2035	74,432,386
野村6資産均等バランス	67,168,288
野村資産設計ファンド2020	63,410,638
マイターゲット2040 (確定拠出年金向け)	58,142,923
野村資産設計ファンド2015	53,107,592
バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)	40,372,293
野村資産設計ファンド2050	36,922,406
バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)	29,281,604
マイターゲット2030 (確定拠出年金向け)	28,821,444
野村DC運用戦略ファンド (マイルド)	26,928,880
野村資産設計ファンド2045	24,356,783
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型 (適格機関投資家専用)	15,656,876

ファンド名	当期末
	元本額
	円
インデックス・ブレンド (タイプⅢ)	14,682,972
インデックス・ブレンド (タイプⅤ)	14,294,383
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	12,609,204
バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)	6,950,216
インデックス・ブレンド (タイプⅡ)	5,693,366
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	3,889,326
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型 (適格機関投資家専用)	3,774,755
野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース	3,448,300
インデックス・ブレンド (タイプⅠ)	2,946,666
インデックス・ブレンド (タイプⅣ)	2,896,586
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	2,673,975
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型 (適格機関投資家専用)	2,636,335
マイターゲット2045 (確定拠出年金向け)	1,792,873
マイターゲット2035 (確定拠出年金向け)	1,552,970
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	1,543,616
マイターゲット2060 (確定拠出年金向け)	1,349,834
野村資産設計ファンド (DC) 2050	1,177,955
野村資産設計ファンド (DC) 2040	594,220
野村世界6資産分散投信 (DC) 安定コース	583,078
マイターゲット2055 (確定拠出年金向け)	551,585
野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース	544,634
野村資産設計ファンド (DC) 2030	399,265

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日2018年4月2日）

作成対象期間（2017年4月1日～2018年4月2日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	外国の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12- 1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落 中 率	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし)	期 騰 落 中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
12期(2014年3月31日)	17,747	30.7	187.86	30.9	96.6	1.2	270,114
13期(2015年3月31日)	22,274	25.5	236.44	25.9	95.4	2.1	331,520
14期(2016年3月31日)	20,145	△ 9.6	214.69	△ 9.2	94.8	2.5	326,431
15期(2017年3月31日)	23,082	14.6	246.86	15.0	95.0	2.4	364,352
16期(2018年4月2日)	24,752	7.2	265.15	7.4	95.6	1.9	454,743

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)をもとに、営業日当日の米ドル為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で当社が円換算しています。なお、設定時を100として再指数化しています。(以下同じ)

\*MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。  
ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目録見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。  
(出所) MSCI

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

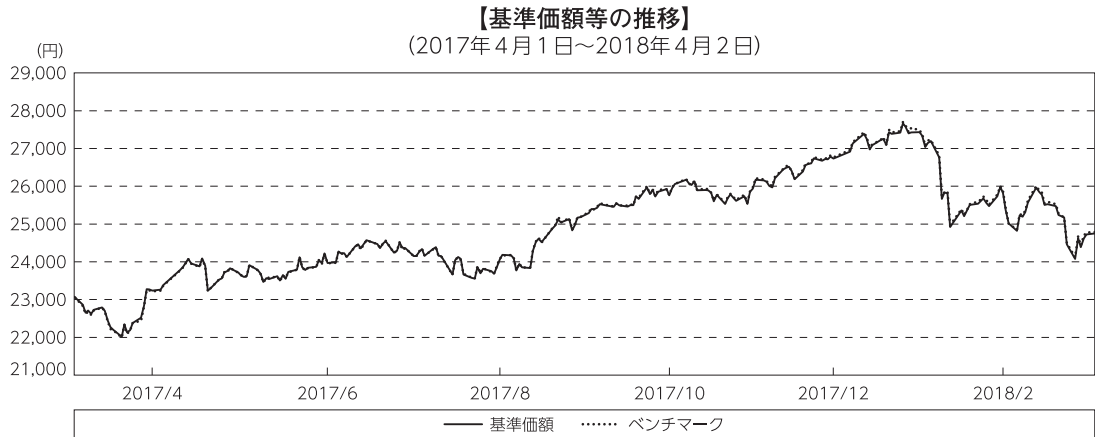
年 月 日	基 準 価 額	ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落 率	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし)			
(期 首)	円	%		%	%	%
2017年3月31日	23,082	—	246.86	—	95.0	2.4
4月末	23,241	0.7	248.33	0.6	95.5	1.8
5月末	23,598	2.2	252.36	2.2	95.7	1.7
6月末	23,970	3.8	256.26	3.8	95.7	1.2
7月末	24,153	4.6	258.34	4.7	95.5	1.9
8月末	24,060	4.2	257.51	4.3	96.1	1.2
9月末	25,180	9.1	269.39	9.1	96.1	1.3
10月末	25,764	11.6	275.60	11.6	96.2	1.2
11月末	25,930	12.3	277.66	12.5	96.2	1.2
12月末	26,737	15.8	286.27	16.0	96.0	1.5
2018年1月末	27,036	17.1	289.56	17.3	96.8	0.9
2月末	25,818	11.9	276.66	12.1	96.6	1.1
3月末	24,724	7.1	265.00	7.3	95.6	1.9
(期 末)						
2018年4月2日	24,752	7.2	265.15	7.4	95.6	1.9

\*騰落率は期首比です。

\*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首23,082円から期末24,752円に1,670円の値上がりとなりました。

米国政権による税制改革期待の高まりや堅調な欧米企業の決算や経済指標の発表を受け、主要投資国の株式市場が上昇したことから、基準価額は上昇しました。

## ○投資環境

主要投資国の株式市場は、期首から2017年5月にかけて、米国政権の経済・金融政策への期待やフランス大統領選の結果に対する安堵感、市場予想を上回る結果となった欧米の企業決算や経済指標の堅調さなどを背景に上昇しました。その後は、米国政権とロシアとの関係を巡る疑惑や緊迫化する北朝鮮情勢の行方を巡り一進一退の展開となりましたが、9月以降は、米国政権による税制改革期待の高まりや米朝の軍事衝突への過度な警戒感の緩和、ECB（欧州中央銀行）が量的金融緩和の縮小を慎重に進める姿勢を見せたこと、引き続き堅調な欧米企業の決算や経済指標の発表などを背景に上昇しました。

2018年1月下旬以降は、米国長期金利の上昇などをきっかけに株式の価格変動率が高まり投資家心理が悪化したことや、米国政権の通商・外交政策への不透明感が高まったこと、米中貿易摩擦への懸念などから下落しました。

為替市場は、期首から2017年5月中旬にかけてはフランス大統領選の結果に対する安堵感などから主要通貨は対円で上昇（円安）しました。その後は、米国の利上げの行方や欧州の金融緩和策の縮小観測、緊迫化する北朝鮮情勢の行方を巡り、一進一退の展開となりました。2018年以降は米財務長官のドル安容認発言や世界的な株安を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、米国の財政赤字の拡大への懸念などを受けて主要通貨は対円で下落（円高）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・株式組入比率

株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指し、現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+7.2%となり、ベンチマークであるMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の+7.4%を0.2ポイント下回りました。

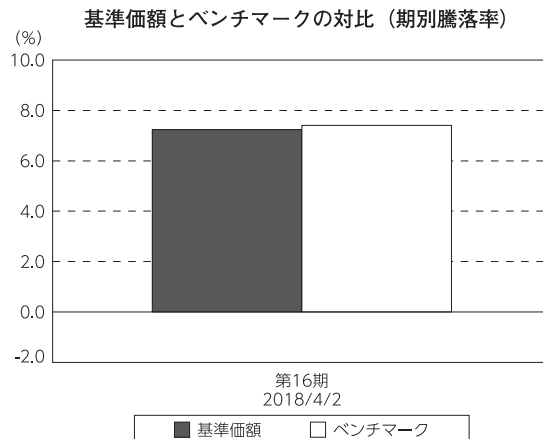
主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

### （その他、差異を生じた要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）



（注）ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを捉える投資成果を目指して運用を行います。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年 4 月 1 日～2018年 4 月 2 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 1	% 0.003	(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)	(0)	(0.002)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	3	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)	(3)	(0.011)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	3	0.011	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用
(保 管 費 用)	(3)	(0.010)	
(そ の 他)	(0)	(0.000)	
合 計	7	0.026	
期中の平均基準価額は、24,868円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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4月1日～2018年4月2日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 68,441 ( 1,630)	千米ドル 499,072 ( 1,896)	百株 16,567 ( 2,543)	千米ドル 84,528 (16,464)
	カナダ	9,835 ( 207)	千カナダドル 39,769 ( 3,689)	2,628	千カナダドル 5,173
	イギリス	79,226 ( 212,030)	千英ポンド 46,133 ( 592)	10,971 (214,110)	千英ポンド 6,337 ( 808)
	スイス	4,264 ( 2,133)	千スイスフラン 26,557 (△ 561)	2,692 ( 185)	千スイスフラン 3,567 ( 6,650)
	スウェーデン	5,139 ( 1,197)	千スウェーデンクローナ 72,545 ( 14,969)	1,314 ( 245)	千スウェーデンクローナ 11,219 (14,621)
	ノルウェー	1,261 ( -)	千ノルウェークローネ 16,545 (△ 419)	128	千ノルウェークローネ 2,480
	デンマーク	1,319	千デンマーククローネ 41,861	216	千デンマーククローネ 6,958
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	5,942 ( 385)	29,920 ( 3,005)	638 ( 203)	2,693 ( 3,205)
	イタリア	14,161 (△ 2,958)	7,992 ( 4)	1,968 ( 2,290)	846 ( 1)
	フランス	7,206 ( 43)	32,500 (△ 123)	793	5,455
	イギリス	26	92	245	795
	オランダ	4,110 (△ 1,183)	10,210 ( 9)	609	1,485
	スペイン	11,793 ( 39,843)	9,615 ( 1,088)	5,428 ( 40,996)	1,644 ( 378)
	ベルギー	407 ( 107)	3,069 ( -)	35	302
	オーストリア	223 (△ 456)	783 (△ 30)	85	137
	ルクセンブルグ	2	101	—	—
	フィンランド	1,919 ( 350)	2,506 ( -)	262	233
	アイルランド	1,507 (△ 27,550)	1,743 ( -)	95	154
	ボルトガル	420	324	—	—

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	香港	百株 26,792 ( 3,775)	千香港ドル 82,381 ( 5,744)	百株 3,772 ( 0.22)	千香港ドル 9,703 ( 5,744)
	シンガポール	11,714	千シンガポールドル 5,091	610 ( 3,020)	千シンガポールドル 551 ( 848)
	オーストラリア	16,090 ( 1,677)	千豪ドル 26,630 ( 905)	2,188 ( 3,855)	千豪ドル 3,032 ( 1,283)
	ニュージーランド	1,978	千ニュージーランドドル 1,383	760	千ニュージーランドドル 415
	イスラエル	894	千新シェケル 2,579	—	千新シェケル —

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

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

## 投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口 千米ドル	口 千米ドル	
	AGNC INVESTMENT CORP	9,900	205	—
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,400	408	—
	AMERICAN TOWER CORP	10,300	1,449	268
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	37,000	432	—
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	3,070	554	—
	BOSTON PROPERTIES	3,500	431	700 83
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	7,000	126	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,300	207	—
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	8,000	116	—
	CROWN CASTLE INTL CORP	13,000	1,342	1,200 135
	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,000	1,059	—
	DUKE REALTY CORP	4,900	140	—
	EQUINIX INC	1,670	744	—
	EQUITY RESIDENTIAL	8,600	564	—
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,400	352	—
	EXTRA SPACE STORAGE INC	2,300	183	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	990	131	—
	GGP INC	11,700	252	—
	HCP INC	6,900	204	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	17,900	326	—
	INVITATION HOMES INC	34,000	789	—
	IRON MOUNTAIN INC	6,900	260	—
	JBG SMITH PROPERTIES	—	—	8,700 298
		( 8,700)	( —)	
	KIMCO REALTY CORP	11,000	201	—
	LIBERTY PROPERTY TRUST	2,600	107	—
	MACERICH CO /THE	1,900	126	—
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,500	241	—
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	2,600	109	—
	PROLOGIS INC	10,000	619	—
	PUBLIC STORAGE	3,850	791	—
	REALTY INCOME CORP	7,400	407	—
	REGENCY CENTERS CORP	1,900	122	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,800	269	—
	SL GREEN REALTY CORP	1,200	122	—
	SIMON PROPERTY GROUP INC	6,180	985	800 130
	UDR INC	5,500	216	—
	VENTAS INC	5,400	354	—
	VEREIT INC	14,000	118	—
	VORNADO REALTY TRUST	4,000	304	—
	WELLTOWER INC	8,200	546	—
	WEYERHAEUSER CO	16,000	548	—
	小 計	309,760	16,478	13,200 917
		( 8,700)	( —)	
	イギリス	千英ポンド	千英ポンド	
	BRITISH LAND	22,000	142	—
	HAMMERSON PLC	15,000	87	—
	INTU PROPERTIES PLC	—	—	88,000 172
	LAND SECURITIES GROUP PLC	8,500	87	—
		(△ 86,000)	(△ 883)	

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	イギリス	口	千英ポンド	口	千英ポンド
	SEGRO PLC	26,800	142	—	—
	LAND SECURITIES GROUP PLC	8,375	77	—	—
		( 80,625)	( 883)	( —)	( 51)
	小 計	80,675	537	88,000	172
		(△ 5,375)	( —)	( —)	( 51)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	KLEPIERRE	4,400	152	—	—
	GECINA SA	1,600	220	—	—
	GECINA SA - RTS	—	—	4,000	9
		( 4,000)	( —)		
	FONCIERE DES REGIONS	900	79	—	—
		( —)	(△ 3)		
	UNIBAIL RODAMCO-NA	2,110	453	—	—
	小 計	9,010	905	4,000	9
		( 4,000)	(△ 3)		
	ユ ー ロ 計	9,010	905	4,000	9
		( 4,000)	(△ 3)		
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	37,000	2,303	—	—
	小 計	37,000	2,303	—	—
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND MALL TRUST	60,100	123	—	—
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	43,000	115	—	—
		( —)	(△ 1)		
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	76,100	125	—	—
		( 31,872)	( 52)		
	CAPITACOMMERCIAL TRUST RIGHTS	—	—	—	—
		( 31,872)	( 43)	(31,872)	( 8)
	SUNTEC REIT	57,000	106	—	—
		( —)	(△ 3)		
	小 計	236,200	471	—	—
		( 63,744)	( 91)	(31,872)	( 8)
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	MIRVAC GROUP	90,000	213	—	—
	GPT GROUP	24,000	116	—	—
	LENDLEASE GROUP	8,000	135	—	—
	STOCKLAND TRUST GROUP	47,000	209	—	—
	DEXUS	22,000	216	—	—
	GOODMAN GROUP	40,000	332	—	—
	SCENTRE GROUP	94,000	404	—	—
	WESTFIELD CORP	55,000	451	12,000	95
	VICINITY CENTRES	44,296	120	—	—
	小 計	424,296	2,199	12,000	95

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\* ( ) 内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外国 株式先物取引	百万円 78,491	百万円 78,841	百万円 —	百万円 —

\*単位未満は切り捨て。

\*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4月1日～2018年4月2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	101,031,067千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	410,066,616千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.24

\* (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4月1日～2018年4月2日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 95,526	百万円 2,260	% 2.4	百万円 31,171	百万円 425	% 1.4

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野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2018年4月2日現在)

## 外国株式

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	評 価 額	外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
AFLAC INC	400	924	4,043	429,815	保険	
AGCO CORP	63	78	505	53,769	機械	
AES CORP	650	740	841	89,438	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AT & T INC	5,980	7,144	25,468	2,707,286	各種電気通信サービス	
ABBOTT LABORATORIES	1,680	2,012	12,055	1,281,542	ヘルスケア機器・用品	
ABBVIE INC	1,585	1,858	17,585	1,869,388	バイオテクノロジー	
ACTIVISION BLIZZARD INC	577	840	5,666	602,363	ソフトウェア	
ACUITY BRANDS INC	43	50	695	73,979	電気設備	
ADOBE SYSTEMS INC.	486	574	12,418	1,320,045	ソフトウェア	
ADVANCE AUTO PARTS	71	83	983	104,595	専門小売り	
ADVANCED MICRO DEVICES	780	900	904	96,148	半導体・半導体製造装置	
AETNA INC	343	381	6,438	684,455	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	52	65	1,232	130,990	資本市場	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	312	365	2,441	259,568	ライフサイエンス・ツール/サービス	
AIR PRODUCTS	199	251	3,991	424,312	化学	
AKAMAI TECHNOLOGIES	166	191	1,355	144,112	インターネットソフトウェア・サービス	
ALBEMARLE CORP	111	122	1,131	120,270	化学	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	216	263	2,931	311,607	バイオテクノロジー	
ALIGN TECHNOLOGY INC	71	88	2,225	236,518	ヘルスケア機器・用品	
ALLEGHANY CORP	15	17	1,056	112,341	保険	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	49	59	1,268	134,857	情報技術サービス	
ALLIANT ENERGY CORP	229	253	1,033	109,888	電力	
ALLSTATE CORP	361	411	3,896	414,174	保険	
ALLY FINANCIAL INC	421	527	1,430	152,094	消費者金融	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	99	1,179	125,337	バイオテクノロジー	
ALPHABET INC-CL C	302	365	37,742	4,012,067	インターネットソフトウェア・サービス	
ALPHABET INC-CL A	288	346	35,978	3,824,502	インターネットソフトウェア・サービス	
ALTRIA GROUP INC	1,901	2,223	13,853	1,472,652	タバコ	
AMAZON.COM INC	393	476	68,907	7,324,905	インターネット販売・通信販売	
AMERCO	6	6	234	24,945	陸運・鉄道	
AMEREN CORPORATION	229	287	1,625	172,767	総合公益事業	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	125	146	758	80,640	旅客航空輸送業	
AMERICAN ELECTRIC POWER	482	573	3,930	417,781	電力	
AMERICAN EXPRESS CO	752	862	8,040	854,730	消費者金融	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	84	942	100,203	保険	
AMERICAN INTL GROUP	1,003	1,052	5,724	608,565	保険	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	168	208	1,708	181,592	水道	
AMERISOURCEBERGEN CORP	156	192	1,655	175,951	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	150	173	2,559	272,060	資本市場	
AMETEK INC	219	268	2,035	216,426	電気設備	
AMGEN INC	725	785	13,382	1,422,578	バイオテクノロジー	
AMPHENOL CORP-CL A	304	359	3,092	328,686	電子装置・機器・部品	
ANADARKO PETE	536	633	3,823	406,486	石油・ガス・消耗燃料	
ANALOG DEVICES INC	357	433	3,945	419,452	半導体・半導体製造装置	
ANDEAVOR	—	177	1,779	189,204	石油・ガス・消耗燃料	
ANSYS INC	83	99	1,551	164,895	ソフトウェア	
ANTERO RESOURCES CORP	147	270	535	56,971	石油・ガス・消耗燃料	
ANTHEM INC	257	297	6,531	694,317	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
APACHE CORPORATION		366	439	1,689	179,569	石油・ガス・消耗燃料
APPLE INC		5,189	5,967	100,114	10,642,152	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS		1,058	1,236	6,873	730,641	半導体・半導体製造装置
ARAMARK		232	286	1,131	120,269	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND		549	644	2,793	296,898	食品
ARCONIC INC		436	516	1,188	126,376	航空宇宙・防衛
ARISTA NETWORKS INC		—	56	1,439	153,060	通信機器
ARROW ELECTRS INC		89	105	808	85,965	電子装置・機器・部品
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC		58	—	—	—	化学
ASSURANT INC		52	63	575	61,216	保険
ATMOS ENERGY CORP		105	117	985	104,770	ガス
AUTODESK INC.		189	227	2,850	303,025	ソフトウェア
AUTOLIV INC		84	97	1,415	150,480	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS		436	514	5,832	620,034	情報技術サービス
AUTONATION INC		71	71	332	35,306	専門小売り
AUTOZONE		27	32	2,101	223,416	専門小売り
AVERY DENNISON CORP		87	99	1,051	111,814	容器・包装
AVNET		122	150	626	66,586	電子装置・機器・部品
BB&T CORPORATION		795	913	4,751	505,058	銀行
BAKER HUGHES		383	—	—	—	エネルギー設備・サービス
BAKER HUGHES, A GE CO, LLC		—	473	1,313	139,627	エネルギー設備・サービス
BALL CORP		158	397	1,576	167,580	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP		9,841	11,525	34,563	3,674,097	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP		1,021	1,197	6,168	655,673	資本市場
BARD (C R)		69	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
BAXTER INTERNATIONAL INC.		471	571	3,713	394,775	ヘルスケア機器・用品
B/E AEROSPACE INC		101	—	—	—	航空宇宙・防衛
BECTON, DICKINSON		205	309	6,711	713,400	ヘルスケア機器・用品
BED BATH & BEYOND		156	—	—	—	専門小売り
WR BERKLEY CORP		99	115	836	88,872	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B		1,192	1,478	29,483	3,134,058	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC		284	319	2,232	237,333	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC		168	202	1,637	174,078	バイオテクノロジー
BIOGEN INC		212	247	6,768	719,526	バイオテクノロジー
BLACKROCK INC		118	138	7,508	798,125	資本市場
H & R BLOCK INC		224	235	597	63,475	各種消費者サービス
BOEING CO		571	658	21,594	2,295,460	航空宇宙・防衛
BOOKING HOLDINGS INC		—	56	11,837	1,258,317	インターネット販売・通信販売
BORGWARNER INC		213	236	1,185	126,010	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP		1,314	1,611	4,401	467,853	ヘルスケア機器・用品
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC		—	102	524	55,730	保険
BRISTOL MYERS SQUIBB		1,630	1,908	12,068	1,282,839	医薬品
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC		114	130	1,425	151,580	情報技術サービス
BROWN-FORMAN CORP-CL B		200	285	1,550	164,807	飲料
CBS CORP-CL B		374	400	2,055	218,510	メディア
CBOE GLOBAL MARKETS INC		—	122	1,392	147,971	資本市場
CBRE GROUP INC		296	355	1,676	178,191	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC		128	146	924	98,302	ソフトウェア
CDW CORPORATION		140	182	1,279	136,025	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC		229	264	996	105,882	化学
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC		136	155	1,452	154,401	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP		251	284	4,763	506,393	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CIT GROUP INC		194	164	844	89,780	銀行
CME GROUP INC		332	398	6,437	684,279	資本市場

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
CMS ENERGY CORP		273	330	1,494	158,872	総合公益事業
CSX CORP		903	978	5,448	579,168	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP		1,041	1,183	7,359	782,308	食品・生活必需品小売り
CA INC		309	348	1,179	125,404	ソフトウェア
CABOT OIL & GAS CORP		457	533	1,278	135,865	石油・ガス・消耗燃料
CADENCE DESIGN SYS INC		268	321	1,180	125,467	ソフトウェア
CALPINE CORP		347	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CAMPBELL SOUP CO		191	216	935	99,443	食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP		472	557	5,337	567,341	消費者金融
CARDINAL HEALTH INC		310	363	2,275	241,862	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARMAX INC		183	204	1,263	134,318	専門小売り
CARNIVAL CORP		332	411	2,695	286,514	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC DEL		572	688	10,139	1,077,854	機械
CELANESE CORP-SERIES A		135	155	1,553	165,111	化学
CELGENE CORP		756	911	8,127	863,903	バイオテクノロジー
CENTENE CORP		168	198	2,116	224,933	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC		384	452	1,238	131,650	総合公益事業
CENTURYLINK INC		522	1,080	1,775	188,773	各種電気通信サービス
CERNER CORP		301	342	1,983	210,856	ヘルスケア・テクノロジー
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A		211	217	6,765	719,217	メディア
CHEMOURS CO/THE		—	206	1,003	106,664	化学
CHENIERE ENERGY INC		195	243	1,298	138,066	石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP		1,839	2,210	25,202	2,679,061	石油・ガス・消耗燃料
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC		27	28	933	99,261	ホテル・レストラン・レジャー
CHURCH & DWIGHT CO INC		257	287	1,445	153,638	家庭用品
CIMAREX ENERGY CO		90	106	991	105,353	石油・ガス・消耗燃料
CINCINNATI FINANCIAL CORP		155	184	1,366	145,246	保険
CISCO SYSTEMS		4,890	5,753	24,674	2,622,911	通信機器
CINTAS CORP		78	107	1,825	194,019	商業サービス・用品
CITIGROUP		2,776	3,077	20,769	2,207,824	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP		504	578	2,426	257,930	銀行
CITRIX SYSTEMS INC		149	173	1,605	170,658	ソフトウェア
CLOROX CO		124	150	1,996	212,243	家庭用品
COACH INC		279	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
COCA COLA CO		3,992	4,712	20,464	2,175,346	飲料
COGNEX CORP		—	192	998	106,109	電子装置・機器・部品
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP		587	680	5,474	581,886	情報技術サービス
COLGATE PALMOLIVE CO.		825	967	6,931	736,813	家庭用品
COMCAST CORP-CL A		4,644	5,431	18,557	1,972,686	メディア
COMERICA INC		162	204	1,956	208,026	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC		—	228	911	96,872	通信機器
COMPUTER SCIENCES CORP		138	—	—	—	情報技術サービス
CONAGRA BRANDS INC		400	472	1,740	185,040	食品
CONCHO RESOURCES INC		142	172	2,585	274,857	石油・ガス・消耗燃料
CONOCOPHILLIPS		1,211	1,377	8,164	867,857	石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC		293	359	2,798	297,432	総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A		171	198	4,519	480,439	飲料
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK		94	114	672	71,436	石油・ガス・消耗燃料
THE COOPER COMPANIES, INC.		47	56	1,288	136,935	ヘルスケア機器・用品
CORNING INC		907	1,001	2,790	296,660	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORPORATION		426	510	9,609	1,021,535	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC		32	41	1,490	158,452	専門サービス
COTY INC-CL A		476	550	1,006	106,990	パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC		131	145	735	78,223	容器・包装



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	千円ドル 千円		
CUMMINS INC	156	180	2,917	310,143	機械
DR HORTON INC	336	420	1,841	195,728	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	170	206	2,150	228,613	総合公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	—	333	3,347	355,855	情報技術サービス
DANAHER CORP	609	732	7,167	761,853	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC	118	143	1,219	129,587	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA INC	157	175	1,153	122,664	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY	258	314	4,877	518,430	機械
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	217	233	1,705	181,325	ソフトウェア
DELTA AIR LINES INC	177	201	1,101	117,108	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC	220	272	1,368	145,464	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	458	573	1,821	193,632	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC	83	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC	85	104	1,315	139,870	石油・ガス・消耗燃料
DICK S SPORTING GOODS INC	82	—	—	—	専門小売り
DISNEY (WALT) CO	1,473	1,759	17,667	1,878,044	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	385	428	3,078	327,255	消費者金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	143	193	413	43,965	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	212	353	689	73,310	メディア
DISH NETWORK CORP-A	218	251	951	101,095	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	271	312	2,918	310,264	複合小売り
DOLLAR TREE INC	227	280	2,657	282,460	複合小売り
DOMINION ENERGY INC	613	747	5,037	535,435	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC	46	52	1,230	130,840	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP	153	181	1,777	188,978	機械
DOW CHEM CO	1,095	—	—	—	化学
DOWDUPONT INC	—	2,725	17,360	1,845,471	化学
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	178	211	2,497	265,518	飲料
DU PONT E I DE NEMOURS	849	—	—	—	化学
DUKE ENERGY CORP	673	819	6,344	674,451	電力
DUN & BRADSTREET CORP	36	—	—	—	専門サービス
EOG RESOURCES INC	563	676	7,116	756,457	石油・ガス・消耗燃料
EQT CORP	165	282	1,339	142,418	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	256	307	1,701	180,825	資本市場
EAST WEST BANCORP INC	—	162	1,013	107,697	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO.	141	171	1,805	191,915	化学
EATON VANCE CORP	117	138	768	81,664	資本市場
EBAY INC	1,023	1,157	4,655	494,908	インターネットソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	257	303	4,153	441,487	化学
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	58	—	—	—	パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	317	368	2,342	249,027	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	211	249	3,474	369,291	ヘルスケア機器・用品
ELECTRONIC ARTS	290	361	4,376	465,250	ソフトウェア
EMERSON ELEC	630	745	5,088	540,891	電気設備
ENBRIDGE INC	666	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ENTERGY CORP	171	210	1,654	175,860	電力
ENVISION HEALTHCARE CORP	116	149	572	60,868	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EQUIFAX INC	117	139	1,637	174,072	専門サービス
EVERSOURCE ENERGY	307	363	2,138	227,354	電力
EXELON CORPORATION	905	1,107	4,318	459,046	電力
EXPEDIA GROUP INC	117	144	1,589	169,006	インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	177	213	1,348	143,323	航空貨物・物流サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	604	661	4,566	485,385	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EXXON MOBIL CORP	4,037	4,928	36,767	3,908,417	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FLIR SYSTEMS INC	127	156	780	82,930	電子装置・機器・部品
FMC CORP	132	148	1,133	120,462	化学
FACEBOOK INC-A	2,279	2,773	44,309	4,710,128	インターネットソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	276	341	1,861	197,879	商社・流通業
FEDEX CORPORATION	246	297	7,148	759,840	航空貨物・物流サービス
F5 NETWORKS INC	62	73	1,055	112,215	通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	303	384	3,697	393,088	情報技術サービス
FNF GROUP	244	299	1,196	127,198	保険
FIFTH THIRD BANCORP	737	813	2,581	274,389	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	302	490	784	83,339	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	145	185	1,713	182,122	銀行
FISERV INC	207	480	3,422	363,852	情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	418	520	1,768	187,993	電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	88	102	2,065	219,562	情報技術サービス
FLUOR CORP	139	164	938	99,752	建設・土木
FLOWSERVE CORP	122	150	649	69,089	機械
FOOT LOCKER INC	134	—	—	—	専門小売り
FORD MOTOR COMPANY	3,630	4,310	4,775	507,633	自動車
FORTINET INC	139	170	910	96,824	ソフトウェア
FORTIVE CORP	295	369	2,860	304,069	機械
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	153	171	1,007	107,046	建設関連製品
FRANKLIN RESOURCES INC	359	397	1,376	146,353	資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC	1,241	1,570	2,758	293,227	金属・鉱業
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	1,140	—	—	—	各種電気通信サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	166	214	1,470	156,348	保険
GAP INC	229	271	845	89,878	専門小売り
GARTNER INC	81	100	1,176	125,030	情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS	253	292	6,463	687,073	航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	8,614	10,100	13,614	1,447,253	コングロマリット
GENERAL MILLS	580	650	2,928	311,342	食品
GENERAL MOTORS CO	1,344	1,498	5,443	578,668	自動車
GENUINE PARTS CO	144	172	1,545	164,259	販売
GILEAD SCIENCES INC	1,285	1,510	11,383	1,210,107	バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	146	189	2,107	224,051	情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	349	415	10,462	1,112,138	資本市場
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	248	283	752	79,960	自動車部品
WR GRACE & CO	67	83	508	54,022	化学
GRAINGER(W.W.) INC	55	62	1,750	186,032	商社・流通業
HCA HEALTHCARE INC	286	333	3,230	343,359	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	229	868	92,356	商社・流通業
HP INC	1,670	1,942	4,256	452,504	コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	846	1,023	4,801	510,448	エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC	377	433	797	84,783	繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC	168	194	831	88,427	自動車
HARRIS CORP	119	135	2,177	231,444	航空宇宙・防衛
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	359	424	2,184	232,206	保険
HASBRO INC	107	126	1,062	112,909	レジャー用品
HELMERICH & PAYNE	106	128	851	90,564	エネルギー設備・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	88	1,064	113,141	情報技術サービス
HERSHEY CO/THE	137	166	1,642	174,622	食品
HESS CORP	274	319	1,614	171,650	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,632	1,860	3,262	346,797	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	189	220	1,732	184,188	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	166	197	962	102,318	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額	外貨建金額		邦貨換算金額
			株数			
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円		
HOLOGIC INC	247	311	1,161	123,509	ヘルスケア機器・用品	
HOME DEPOT	1,187	1,359	24,222	2,574,885	専門小売り	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	706	844	12,196	1,296,503	コングロマリット	
HORMEL FOODS CORP	273	328	1,125	119,661	食品	
HUMANA INC	146	166	4,478	476,086	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	87	98	1,148	122,039	陸運・鉄道	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,070	1,260	1,902	202,246	銀行	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	46	51	1,319	140,287	航空宇宙・防衛	
IAC/INTERACTIVE CORP	—	91	1,423	151,271	インターネットソフトウェア・サービス	
IPG PHOTONICS CORP	—	42	980	104,194	電子装置・機器・部品	
IDEX CORP	—	85	1,211	128,764	機械	
IDEXX LABORATORIES INC	86	102	1,952	207,516	ヘルスケア機器・用品	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	305	358	5,608	596,175	機械	
ILLUMINA INC	142	170	4,019	427,234	ライフサイエンス・ツール/サービス	
INCYTE CORP	167	212	1,766	187,789	バイオテクノロジー	
INGREDION INC	68	84	1,082	115,115	食品	
INTEL CORP	4,617	5,445	28,357	3,014,408	半導体・半導体製造装置	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	584	685	4,967	528,058	資本市場	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	880	1,024	15,711	1,670,103	情報技術サービス	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	76	87	1,191	126,615	化学	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	376	445	2,377	252,742	容器・包装	
INTERPUBLIC GROUP	392	443	1,020	108,450	メディア	
INTUIT INC	235	280	4,853	515,958	ソフトウェア	
INTUITIVE SURGICAL INC	37	131	5,416	575,755	ヘルスケア機器・用品	
IQVIA HOLDINGS INC	—	155	1,520	161,650	ライフサイエンス・ツール/サービス	
JPMORGAN CHASE & CO	3,484	4,035	44,372	4,716,838	銀行	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	123	141	834	88,655	建設・土木	
JOHNSON & JOHNSON	2,648	3,124	40,034	4,255,620	医薬品	
JONES LANG LASALLE INC	47	54	943	100,246	不動産管理・開発	
JUNIPER NETWORKS INC	335	424	1,031	109,658	通信機器	
KLA TENCOR CORP	150	183	1,994	212,056	半導体・半導体製造装置	
KANSAS CITY SOUTHERN	106	118	1,296	137,789	陸運・鉄道	
KELLOGG CO	255	302	1,963	208,699	食品	
KEYCORP	1,028	1,240	2,424	257,692	銀行	
KIMBERLY-CLARK CORP	350	409	4,504	478,808	家庭用品	
KINDER MORGAN INC	1,858	2,330	3,508	373,004	石油・ガス・消耗燃料	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	—	143	657	69,939	陸運・鉄道	
KOHL'S CORP	172	196	1,283	136,488	複合小売り	
KRAFT HEINZ CO/THE	595	702	4,372	464,824	食品	
KROGER CO	860	1,009	2,415	256,772	食品・生活必需品小売り	
L BRANDS, INC	240	270	1,031	109,666	専門小売り	
LKQ CORP	300	363	1,377	146,437	販売	
L3 TECHNOLOGIES INC	72	90	1,872	198,993	航空宇宙・防衛	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	98	118	1,908	202,889	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
LAM RESEARCH	160	188	3,819	406,003	半導体・半導体製造装置	
LAS VEGAS SANDS CORP	421	465	3,343	355,398	ホテル・レストラン・レジャー	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	214	262	3,922	416,979	パーソナル用品	
LEAR CORP	69	77	1,432	152,316	自動車部品	
LEGGETT & PLATT INC	134	159	705	74,975	家庭用耐久財	
LEIDOS HOLDINGS INC	—	161	1,052	111,927	情報技術サービス	
LENNAR CORP-A	201	326	1,921	204,249	家庭用耐久財	
LENNOX INTERNATIONAL INC	—	45	919	97,760	建設関連製品	
LEUCADIA NATIONAL CORP	322	366	831	88,432	各種金融サービス	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	301	—	—	—	各種電気通信サービス	

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 千円ドル		邦貨換算金額 千円
(アメリカ)	百株	百株			
LIBERTY BROADBAND CORP-C	101	124	1,062	112,949	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	423	532	1,339	142,340	インターネット販売・通信販売
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	98	98	405	43,121	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	193	197	804	85,544	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	—	224	691	73,457	メディア
ELI LILLY & CO.	969	1,157	8,951	951,566	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	223	258	1,884	200,369	保険
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	—	161	678	72,119	メディア
LOCKHEED MARTIN	257	301	10,175	1,081,610	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	277	333	1,656	176,033	保険
LOWES COS INC	849	960	8,424	895,471	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	106	121	1,078	114,628	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP	137	157	2,894	307,680	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	449	535	1,873	199,160	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	85	104	1,554	165,242	資本市場
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	76	95	350	37,293	運送インフラ
MACYS INC	304	359	1,067	113,492	複合小売り
MANPOWERGROUP INC	62	80	920	97,881	専門サービス
MARATHON OIL CORP	812	990	1,596	169,747	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	510	563	4,116	437,540	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	13	16	1,907	202,768	保険
MARSH & MCLENNAN COS	495	593	4,897	520,613	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	322	362	4,922	523,259	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	59	75	1,554	165,269	建設資材
MASCO CORP	329	357	1,443	153,466	建設関連製品
MASTERCARD INC	939	1,094	19,162	2,036,974	情報技術サービス
MATTEL INC	334	400	526	55,913	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	270	329	1,981	210,605	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	113	139	1,478	157,198	食品
MCDONALD'S CORP	810	929	14,527	1,544,294	ホテル・レストラン・レジャー
MCKESSON CORP	218	238	3,352	356,392	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	178	—	—	—	食品
MEDNAX INC	91	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	184	283	820	87,180	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC	39	49	1,774	188,663	インターネットソフトウェア・サービス
MERCK & CO INC	2,686	3,173	17,283	1,837,218	医薬品
METLIFE INC	914	1,025	4,703	500,005	保険
METTLER-TOLEDO INTL	26	30	1,730	183,988	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP	7,189	8,519	77,752	8,265,134	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	206	267	2,439	259,298	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	1,009	1,337	6,971	741,029	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	57	65	804	85,532	機械
MOHAWK INDUSTRIES	59	72	1,685	179,212	家庭用耐久財
MOLSON COORS BREWING CO-B	179	220	1,657	176,166	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,508	1,731	7,223	767,854	食品
MONSANTO CO	428	515	6,009	638,813	化学
MONSTER BEVERAGE CORP	384	454	2,597	276,096	飲料
MOODYS CORP	168	202	3,258	346,353	資本市場
MORGAN STANLEY	1,372	1,580	8,525	906,279	資本市場
MOSAIC CO/THE	312	394	956	101,689	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	145	190	2,000	212,674	通信機器
MURPHY OIL CORP	167	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
NVR INC	—	3	1,108	117,865	家庭用耐久財
NASDAQ INC	111	140	1,207	128,312	資本市場

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額	業 種 等	
			外貨建金額		
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	365	442	1,627	172,950	エネルギー設備・サービス
NAVIENT CORP	299	—	—	—	消費者金融
NETAPP INC	267	300	1,850	196,729	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	419	504	14,888	1,582,657	インターネット販売・通信販売
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,140	1,430	985	104,734	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	241	255	1,571	167,030	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	220	266	1,019	108,409	コングロマリット
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	471	560	729	77,564	貯蓄・抵当・不動産金融
NEWELL BRANDS INC	422	565	1,439	153,031	家庭用耐久財
NEWFIELD EXPLORATION CO	188	229	559	59,444	石油・ガス・消耗燃料
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	510	612	2,391	254,172	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	374	460	726	77,258	メディア
NEXTERA ENERGY INC	452	549	8,966	953,172	電力
NIKE INC-B	1,292	1,531	10,171	1,081,279	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	303	382	913	97,090	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC	407	518	1,569	166,842	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	127	150	726	77,189	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	280	335	4,548	483,519	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	207	247	2,547	270,779	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	162	193	6,751	717,735	航空宇宙・防衛
NUANCE COMMUNICATIONS INC	250	—	—	—	ソフトウェア
NUCOR CORP	306	366	2,235	237,675	金属・鉱業
NVIDIA CORP	521	705	16,345	1,737,539	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	196	225	737	78,377	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	92	98	2,444	259,809	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	747	896	5,820	618,710	石油・ガス・消耗燃料
OLD DOMINION FREIGHT LINE	—	69	1,014	107,798	陸運・鉄道
OMNICOM GROUP	230	268	1,947	207,025	メディア
ONEOK INC	198	436	2,481	263,805	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,001	3,645	16,675	1,772,645	ソフトウェア
OWENS CORNING INC	—	124	996	105,976	建設関連製品
PG&E CORP	496	585	2,569	273,180	電力
PNC FINANCIAL	470	550	8,318	884,224	銀行
PPG INDUSTRIES	257	299	3,336	354,706	化学
PPL CORPORATION	668	815	2,305	245,089	電力
PVH CORP	80	90	1,362	144,873	繊維・アパレル・贅沢品
PACCAR	341	415	2,746	291,905	機械
PACKAGING CORP OP AMERICA	88	109	1,228	130,582	容器・包装
PALO ALTO NETWORKS INC	90	107	1,942	206,462	通信機器
PARKER HANNIFIN CORP	127	157	2,685	285,433	機械
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	217	261	756	80,430	石油・ガス・消耗燃料
PATTERSON COS INC	87	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PAYCHEX INC	315	374	2,303	244,858	情報技術サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	1,062	1,332	10,105	1,074,255	情報技術サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	305	410	765	81,325	銀行
PEPSICO INC	1,397	1,656	18,075	1,921,398	飲料
PFIZER INC	5,910	6,937	24,619	2,617,043	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,511	1,808	17,971	1,910,372	タバコ
PHILLIPS 66	450	505	4,843	514,912	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	111	124	989	105,185	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	166	198	3,401	361,552	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	140	190	413	43,928	石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INDUSTRIES INC	62	71	813	86,431	レジャー用品
PRAXAIR INC	280	329	4,747	504,656	化学

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
T ROWE PRICE GROUP INC		239	285	3,077	327,100	資本市場
PRICELINE GROUP INC/THE		48	—	—	—	インターネット販売・通信販売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		279	334	2,034	216,256	保険
PROCTER & GAMBLE CO		2,490	2,953	23,411	2,488,630	家庭用品
PROGRESSIVE CO		565	677	4,124	438,483	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		418	497	5,146	547,066	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE		487	597	2,999	318,828	総合公益事業
PULTEGROUP INC		289	293	864	91,849	家庭用耐久財
QORVO INC		127	142	1,000	106,341	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC		1,441	1,720	9,530	1,013,094	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS INC		133	153	1,534	163,126	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
QUINTILES IMS HOLDINGS INC		142	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
RALPH LAUREN CORPORATION		58	68	760	80,813	繊維・アパレル・贅沢品
RANGE RESOURCES CORP		190	310	450	47,913	石油・ガス・消耗燃料
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		121	149	1,332	141,613	資本市場
RAYTHEON COMPANY		287	334	7,227	768,316	航空宇宙・防衛
RED HAT INC		178	203	3,035	322,626	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS		76	92	3,185	338,600	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP		1,210	1,370	2,545	270,582	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		63	72	1,108	117,865	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A		229	276	1,827	194,310	商業サービス・用品
RESMED INC		141	169	1,664	176,898	ヘルスケア機器・用品
REYNOLDS AMERICAN INC		836	—	—	—	タバコ
RITE AID CORP		990	—	—	—	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC		133	151	874	92,920	専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC		124	146	2,543	270,354	電気設備
ROCKWELL COLLINS INC		128	192	2,589	275,223	航空宇宙・防衛
ROLLINS INC		—	120	612	65,093	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC		99	119	3,351	356,257	コングロマリット
ROSS STORES INC		390	443	3,454	367,214	専門小売り
S&P GLOBAL INC		254	296	5,655	601,166	資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY		127	150	1,123	119,443	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		—	198	1,062	112,898	ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP		—	59	1,416	150,527	銀行
SABRE CORP		200	260	557	59,283	情報技術サービス
SALESFORCE.COM INC		624	794	9,234	981,597	ソフトウェア
SCANA CORP		129	141	529	56,281	総合公益事業
HENRY SCHEIN INC		76	174	1,169	124,312	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD		1,357	1,616	10,468	1,112,796	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP		1,167	1,409	7,357	782,133	資本市場
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A		78	—	—	—	メディア
SEALED AIR CORP		192	219	937	99,613	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC		97	134	701	74,554	バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY		229	279	3,103	329,852	総合公益事業
SERVICENOW INC		157	202	3,342	355,264	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS		75	97	3,819	405,986	化学
SIGNATURE BANK		50	65	922	98,080	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC		1,630	1,820	1,135	120,722	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC		181	211	2,115	224,876	半導体・半導体製造装置
SMITH (A. O.) CORP		144	165	1,049	111,533	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW		113	135	1,674	177,960	食品
SNAP-ON INC		54	67	988	105,079	機械
SOUTHERN CO.		948	1,151	5,140	546,420	電力
SOUTHWEST AIRLINES		153	176	1,008	107,164	旅客航空輸送業

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	468	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	26	26	269	28,660	家庭用品
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	—	132	1,104	117,444	航空宇宙・防衛
SPLUNK INC	128	162	1,593	169,433	ソフトウェア
SPRINT CORP	750	900	439	46,686	無線通信サービス
SQUARE INC - A	—	319	1,569	166,835	情報技術サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	144	181	2,772	294,761	機械
STAPLES INC	620	—	—	—	専門小売り
STARBUCKS CORP	1,420	1,656	9,586	1,019,053	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	372	435	4,338	461,156	資本市場
STEEL DYNAMICS	—	271	1,198	127,385	金属・鉱業
STERICYCLE INC	79	89	520	55,373	商業サービス・用品
STRYKER CORP	330	394	6,340	673,968	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.	469	547	3,721	395,626	銀行
SYMANTEC CORP	608	713	1,843	195,922	ソフトウェア
SYNOPSYS INC	149	180	1,498	159,271	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	805	920	3,084	327,909	消費者金融
SYSCO CORP	496	574	3,441	365,853	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	253	334	1,978	210,291	資本市場
TJX COS INC	628	740	6,035	641,567	専門小売り
T-MOBILE US INC	283	334	2,038	216,717	無線通信サービス
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	—	135	1,320	140,319	ソフトウェア
TAPESTRY INC	—	330	1,736	184,550	繊維・アパレル・贅沢品
TARGET CORP	510	591	4,103	436,182	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP	178	249	1,095	116,462	石油・ガス・消耗燃料
TEGNA INC	206	—	—	—	メディア
TELEFLEX INC	43	53	1,366	145,279	ヘルスケア機器・用品
TESARO INC	—	37	211	22,473	バイオテクノロジー
TESORO CORP	113	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
TESLA INC	124	156	4,154	441,600	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	888	1,050	1,794	190,750	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC	975	1,149	11,936	1,268,898	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	264	313	1,845	196,204	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	382	468	9,662	1,027,105	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	586	693	15,230	1,618,980	コングロマリット
TIFFANY & CO	119	139	1,357	144,299	専門小売り
TIME WARNER INC	745	909	8,597	913,895	メディア
TOLL BROTHERS INC	142	185	800	85,053	家庭用耐久財
TORCHMARK CORP	112	125	1,052	111,840	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	163	195	1,682	178,804	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	130	149	938	99,815	専門小売り
TRANSDIGM GROUP INC	52	60	1,869	198,702	航空宇宙・防衛
TRUNSONION	—	218	1,237	131,578	専門サービス
TRAVELERS COS INC/THE	275	316	4,387	466,441	保険
TRIMBLE INC	232	284	1,018	108,318	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	123	123	502	53,463	インターネット販売・通信販売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,015	1,225	4,494	477,768	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	428	510	1,854	197,172	メディア
TWITTER INC	539	741	2,149	228,506	インターネットソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	276	349	2,554	271,525	食品
UGI CORP	163	204	906	96,325	ガス
US BANCORP	1,658	1,918	9,685	1,029,611	銀行
ULTA BEAUTY INC	56	65	1,329	141,357	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	184	184	300	31,979	繊維・アパレル・贅沢品

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C		187	187	268	28,525	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP		804	918	12,340	1,311,813	陸運・鉄道
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC		76	92	639	67,938	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B		673	802	8,393	892,253	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC		79	101	1,744	185,448	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES		763	885	11,135	1,183,657	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP		43	52	584	62,108	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC		938	1,127	24,132	2,565,314	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B		86	98	1,160	123,352	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP		225	250	1,190	126,523	保険
V F CORP		319	393	2,912	309,642	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC		—	44	990	105,343	ホテル・レストラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP		440	504	4,675	497,017	石油・ガス・消耗燃料
VALSPAR CORP		73	—	—	—	化学
VANTIV INC - CL A		161	—	—	—	情報技術サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC		87	107	1,312	139,503	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A		—	126	920	97,801	ヘルスケア・テクノロジー
VERISIGN INC		88	101	1,197	127,289	インターネットソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS		3,971	4,801	22,958	2,440,476	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC		150	184	1,913	203,415	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS		238	296	4,824	512,813	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B		341	413	1,282	136,359	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES		1,820	2,110	25,239	2,682,992	情報技術サービス
VISTRA ENERGY CORP		—	290	604	64,212	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
VMWARE INC - CLASS A		62	84	1,018	108,284	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC		187	217	1,095	116,488	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO		128	153	1,746	185,684	建設資材
WABCO HOLDINGS INC		52	60	803	85,382	機械
WEC ENERGY GROUP INC		306	358	2,244	238,607	総合公益事業
WABTEC CORP		90	103	838	89,124	機械
WALMART INC		1,508	1,740	15,480	1,645,606	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC		899	970	6,350	675,067	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC		165	303	2,173	231,066	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC		433	500	4,206	447,097	商業サービス・用品
WATERS CORP		80	93	1,847	196,383	ライフサイエンス・ツール/サービス
WELLS FARGO CO		4,646	5,442	28,521	3,031,837	銀行
WESTAR ENERGY INC		134	158	830	88,327	電力
WESTERN DIGITAL CORP		278	342	3,155	335,443	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO		458	528	1,015	107,931	情報技術サービス
WESTROCK CO		243	292	1,873	199,181	容器・包装
WHIRLPOOL CORP		71	82	1,255	133,459	家庭用耐久財
WHITEWAVE FOODS CO - CL A		175	—	—	—	食品
WHOLE FOODS MARKET INC		316	—	—	—	食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS		785	976	2,426	257,919	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A		120	155	1,970	209,432	ソフトウェア
WORLDPAY INC - CL A		—	350	2,878	305,973	情報技術サービス
WYNDHAM WORLDWIDE CORP		109	119	1,361	144,750	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN RESORTS LTD		77	98	1,787	189,971	ホテル・レストラン・レジャー
XCEL ENERGY INC		494	600	2,728	290,071	電力
XILINX INC		250	286	2,066	219,622	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP		840	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
XEROX CORP		—	244	702	74,647	コンピュータ・周辺機器
XYLEM INC		170	206	1,584	168,437	機械
YAHOO! INC		887	—	—	—	インターネットソフトウェア・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	千米ドル 千円		
YUM BRANDS INC	332	377	3,209	341,159	ホテル・レストラン・レジャー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	155	222	758	80,612	各種電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	109	133	715	76,061	インターネットソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	197	239	2,606	277,023	ヘルスケア機器・用品
ZIONS BANCORPORATION	—	226	1,191	126,677	銀行
ZOETIS INC	458	567	4,735	503,332	医薬品
ALKERMES PLC	152	174	1,008	107,203	バイオテクノロジー
ALLEGION PLC	—	108	921	97,916	建設関連製品
ALLERGAN PLC	365	386	6,495	690,524	医薬品
AON PLC	257	288	4,041	429,611	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	121	145	1,241	131,924	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	—	189	903	96,053	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	85	85	489	52,017	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	212	249	751	79,909	化学
ACCENTURE PLC-CL A	605	717	11,005	1,169,932	情報技術サービス
BUNGE LIMITED	138	156	1,153	122,613	食品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	—	243	1,012	107,611	飲料
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	259	—	—	—	自動車部品
EATON CORP PLC	434	504	4,027	428,119	電気設備
EVEREST RE GROUP LTD	40	45	1,171	124,487	保険
IHS MARKIT LTD	353	469	2,262	240,499	専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC	251	293	2,505	266,328	機械
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	850	—	—	—	エネルギー設備・サービス
INVESCO LTD	396	469	1,501	159,584	資本市場
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	56	70	1,056	112,351	医薬品
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	917	1,086	3,827	406,816	建設関連製品
LIBERTY GLOBAL PLC-A	240	240	751	79,878	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	595	646	1,965	208,962	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	112	—	—	—	メディア
MALLINCKRODT PLC	97	—	—	—	医薬品
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	410	465	976	103,801	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,359	1,578	12,658	1,345,621	ヘルスケア機器・用品
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	161	179	1,111	118,123	繊維・アパレル・贅沢品
APTIV PLC	—	303	2,574	273,679	自動車部品
NIELSEN HOLDINGS PLC	342	427	1,357	144,295	専門サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	161	245	1,297	137,952	ホテル・レストラン・レジャー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	42	42	581	61,839	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	286	343	2,007	213,369	コンピュータ・周辺機器
PENTAIR PLC	167	205	1,396	148,465	機械
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	—	194	1,005	106,884	電気設備
SIGNET JEWELERS LTD	54	—	—	—	専門小売り
TECHNIPFMC PLC	433	516	1,519	161,535	エネルギー設備・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	126	148	2,252	239,431	保険
PERRIGO CO PLC	138	142	1,183	125,798	医薬品
XL GROUP LTD	264	290	1,602	170,350	保険
CHUBB LTD	454	542	7,412	787,994	保険
GARMIN LTD	114	133	783	83,314	家庭用耐久財
TE CONNECTIVITY LTD	343	413	4,125	438,579	電子装置・機器・部品
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	126	153	1,519	161,565	ソフトウェア
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	15	—	—	—	医薬品
AERCAP HOLDINGS NV	150	149	755	80,333	商社・流通業
CORE LABORATORIES N.V.	43	—	—	—	エネルギー設備・サービス
MOBILEYE NV	170	—	—	—	ソフトウェア
LYONDELLBASELL INDU-CL A	337	386	4,079	433,624	化学

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価	額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
MYLAN NV		431	524	2,157	229,321	医薬品
NXP SEMICONDUCTORS NV		280	386	4,516	480,072	半導体・半導体製造装置
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		169	—	—	—	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		169	195	2,295	244,057	ホテル・レストラン・レジャー
BROADCOM LTD		392	471	11,113	1,181,338	半導体・半導体製造装置
FLEX LTD		505	620	1,012	107,624	電子装置・機器・部品
小 計		株 数 ・ 金 額	303,712	354,673	2,679,143	284,792,908
銘 柄 数 < 比 率 >			599	600	—	< 62.6% >
(カナダ)				千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD		329	400	561	46,309	石油・ガス・消耗燃料
AGNICO EAGLE MINES LTD		216	281	1,523	125,588	金属・鉱業
AGRIUM INC		124	—	—	—	化学
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B		404	506	2,918	240,626	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD		166	208	495	40,889	石油・ガス・消耗燃料
ATCO LTD CL1		68	96	397	32,757	総合公益事業
BCE INC		154	174	964	79,545	各種電気通信サービス
BANK OF MONTREAL		632	753	7,328	604,283	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX		1,179	1,400	11,110	916,163	銀行
BARRICK GOLD		1,120	1,340	2,150	177,346	金属・鉱業
BLACKBERRY LTD		509	600	888	73,273	ソフトウェア
BOMBARDIER B SHEARS		1,890	2,320	870	71,740	航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		856	969	4,866	401,276	資本市場
CAE INC		260	310	743	61,299	航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B		26	155	1,008	83,129	容器・包装
CI FINANCIAL CORP		242	336	927	76,470	資本市場
CAMECO CORP		386	480	562	46,349	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE		389	507	5,765	475,431	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO		750	865	8,144	671,623	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD		1,083	1,262	5,111	421,461	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		136	166	3,771	310,999	陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A		64	77	1,304	107,559	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A		124	157	539	44,522	総合公益事業
CENOVUS ENERGY INC		785	1,170	1,283	105,836	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE INC		19	24	2,097	172,997	ソフトウェア
CRESCENT POINT ENERGY CORP		537	650	569	46,952	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC		107	120	1,878	154,939	複合小売り
ELDORADO GOLD CORPORATION		708	—	—	—	金属・鉱業
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP		360	490	203	16,768	各種金融サービス
EMERA INC		49	76	309	25,544	電力
EMPIRE CO LTD A		162	210	543	44,780	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP		950	1,170	1,657	136,709	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC		918	1,934	7,836	646,203	石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		21	32	2,115	174,480	保険
FINNING INTERNATIONAL INC		152	196	608	50,215	商社・流通業
FIRST CAPITAL REALTY INC		113	180	366	30,205	不動産管理・開発
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		650	800	1,447	119,336	金属・鉱業
FORTIS INC		384	490	2,131	175,723	電力
FRANCO-NEVADA CORP		169	222	1,951	160,910	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC		208	241	896	73,946	繊維・アパレル・贅沢品
GOLDCORP INC		829	1,010	1,796	148,163	金属・鉱業
GREAT-WEST LIFECO INC		300	332	1,091	90,014	保険
CGI GROUP INC - CLASS A		214	300	2,229	183,803	情報技術サービス
HUSKY ENERGY INC		357	430	792	65,384	石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD		173	350	732	60,377	電力

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	
IGM FINANCIAL INC		103	103	388	31,994	資本市場
IMPERIAL OIL		285	344	1,173	96,785	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC		99	121	641	52,881	保険
INTACT FINANCIAL CORP		126	163	1,578	130,122	保険
INTER PIPELINE LTD		362	460	1,028	84,815	石油・ガス・消耗燃料
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A		94	94	230	19,037	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP		178	245	820	67,699	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP		1,186	1,400	712	58,760	金属・鉱業
LINAMAR CORP		48	65	457	37,722	自動車部品
LOBLAW COMPANIES		210	240	1,562	128,815	食品・生活必需品小売り
LUNDIN MINING CORP		—	730	616	50,865	金属・鉱業
MAGNA INTERNATIONAL INC		377	393	2,852	235,176	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP		1,934	2,280	5,453	449,717	保険
METHANEX CORP		82	103	803	66,290	化学
METRO INC		232	267	1,097	90,489	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA		334	392	2,377	196,014	銀行
NUTRIEN LTD		—	744	4,530	373,561	化学
ONEX CORPORATION		80	92	854	70,492	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP		262	295	1,322	109,027	ソフトウェア
PEMBINA PIPELINE CORP		374	571	2,295	189,280	石油・ガス・消耗燃料
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP		172	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC		812	—	—	—	化学
POWER CORPORATION OF CANADA		348	409	1,202	99,154	保険
POWER FINANCIAL CORP		243	278	896	73,952	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		207	246	692	57,143	石油・ガス・消耗燃料
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC		213	259	1,898	156,590	ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B		347	412	2,370	195,483	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA		1,448	1,699	16,908	1,394,270	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC		145	197	1,114	91,895	建設・土木
SAPUTO INC		239	239	988	81,492	食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		226	290	464	38,261	石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		404	520	1,290	106,426	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A		—	104	1,667	137,487	インターネットソフトウェア・サービス
SILVER WHEATON CORP		416	—	—	—	金属・鉱業
SUN LIFE FINANCIAL INC		591	721	3,814	314,569	保険
SUNCOR ENERGY INC		1,628	1,919	8,537	704,013	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD-CLS B		549	665	2,206	181,945	金属・鉱業
TELUS CORP		193	193	873	71,998	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP		324	341	1,697	140,003	資本市場
TORONTO DOMINION BANK		1,812	2,155	15,755	1,299,174	銀行
TOURMALINE OIL CORP		216	265	579	47,746	石油・ガス・消耗燃料
TRANSCANADA CORP		846	1,004	5,349	441,104	石油・ガス・消耗燃料
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		980	1,260	496	40,936	金属・鉱業
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL		313	380	779	64,267	医薬品
VERESEN INC		290	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
VERMILION ENERGY INC		120	120	498	41,104	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER		68	84	719	59,298	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE)LTD		48	59	611	50,461	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		—	512	1,344	110,826	金属・鉱業
YAMANA GOLD INC		970	—	—	—	金属・鉱業
小 計	株 数 ・ 金 額	39,808	47,222	198,048	16,331,098	
	銘 柄 数 < 比 率 >	91	88	—	<3.6%>	
(イギリス)				千英ポンド		
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC		940	—	—	—	資本市場

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
ANTOFAGASTA PLC	410	480	442	65,989	金属・鉱業
ASHTAD GROUP PLC	476	590	1,144	170,854	商社・流通業
BHP BILLITON PLC	2,071	2,430	3,410	509,122	金属・鉱業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	980	1,130	599	89,465	家庭用耐久財
SKY PLC	990	1,210	1,569	234,350	メディア
AVIVA PLC	3,950	4,590	2,276	339,765	保険
DIAGEO PLC	2,456	2,889	6,968	1,040,153	飲料
SCHRODERS PLC	133	133	424	63,370	資本市場
DCC PLC	86	98	642	95,962	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC	3,060	3,720	2,162	322,842	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,817	2,672	11,038	1,647,647	タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	3,220	3,830	2,729	407,453	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	938	1,111	2,695	402,325	タバコ
HSBC HOLDINGS PLC	19,290	23,270	15,483	2,311,275	銀行
LEGAL & GENERAL	5,770	7,040	1,814	270,911	保険
MEGGITT PLC	780	950	410	61,232	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS	2,130	2,460	525	78,398	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	340	422	1,051	156,912	食品
PEARSON	780	910	681	101,740	メディア
PERSIMMON PLC	295	355	898	134,066	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,521	3,021	5,372	802,005	保険
RIO TINTO PLC-REG	1,210	1,417	5,116	763,782	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC	490	620	673	100,552	資本市場
TRAVIS PERKINS PLC	247	302	372	55,628	商社・流通業
SSE PLC	990	1,160	1,480	220,943	電力
BP PLC	18,450	23,050	11,046	1,648,942	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC	62,800	84,100	5,437	811,716	銀行
TATE & LYLE ORD.	480	—	—	—	食品
TAYLOR WIMPEY PLC	3,190	3,660	675	100,852	家庭用耐久財
TESCO PLC	7,870	11,210	2,308	344,535	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	840	1,020	1,357	202,651	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,755	5,740	8,001	1,194,392	医薬品
WEIR GROUP PLC	220	266	530	79,193	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC	259	259	173	25,856	商業サービス・用品
ASTRAZENECA PLC	1,235	1,477	7,230	1,079,319	医薬品
GKN PLC	1,690	1,930	893	133,386	自動車部品
BT GROUP PLC	8,160	9,930	2,259	337,212	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC	187	220	1,007	150,404	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC	1,530	1,810	489	73,002	複合小売り
BARCLAYS PLC	16,400	19,600	4,047	604,155	銀行
INTERTEK GROUP PLC	163	179	834	124,512	専門サービス
WILLIAM HILL PLC	850	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
BURBERRY GROUP PLC	419	504	854	127,593	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	140	162	770	115,080	複合小売り
KINGFISHER PLC	2,140	2,460	719	107,407	専門小売り
ITV PLC	3,530	4,000	576	86,069	メディア
SAINSBURY	1,500	1,990	475	70,934	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	88	109	641	95,702	金属・鉱業
G4S PLC	1,520	1,790	444	66,290	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	219	229	422	63,033	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	124	148	560	83,706	家庭用耐久財
CENTRICA PLC	5,240	6,500	924	137,970	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,261	5,294	11,824	1,764,990	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	3,653	4,365	9,939	1,483,610	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
BUNZLE	331	405	848	126,651	商社・流通業
COBHAM PLC	1,695	2,540	312	46,597	航空宇宙・防衛
NATIONAL GRID PLC	3,680	—	—	—	総合公益事業
INMARSAT PLC	425	—	—	—	各種電気通信サービス
PETROFAC LTD	260	—	—	—	エネルギー設備・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	139	—	—	—	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	300	363	1,497	223,567	資本市場
UNILEVER PLC	1,254	1,429	5,652	843,735	パーソナル用品
TUI AG-DI	490	490	748	111,761	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	610	750	412	61,529	資本市場
EXPERIAN PLC	909	1,067	1,640	244,879	専門サービス
MONDI PLC	343	408	781	116,627	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	237	277	510	76,245	水道
WHITBREAD PLC	173	206	762	113,773	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	250	303	494	73,858	資本市場
SMITHS GROUP PLC	371	470	711	106,182	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,364	1,554	2,581	385,294	金属・鉱業
3I GROUP PLC	970	1,140	979	146,174	資本市場
PROVIDENT FINANCIAL PLC	143	—	—	—	消費者金融
CAPITA PLC	640	760	109	16,341	専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	616	782	4,718	704,343	家庭用品
RELX PLC	1,058	1,212	1,775	265,040	専門サービス
SHIRE PLC	874	1,047	3,738	558,018	バイオテクノロジー
FRESNILLO PLC	209	260	329	49,230	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	670	760	543	81,158	水道
GLENCORE PLC	11,970	14,300	5,059	755,207	金属・鉱業
DIXONS CARPHONE PLC	920	—	—	—	専門小売り
WOOD GROUP (JOHN) PLC	—	730	394	58,842	エネルギー設備・サービス
GVC HOLDINGS PLC	—	630	578	86,422	ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,740	1,880	1,638	244,595	航空宇宙・防衛
OLD MUTUAL PLC	4,880	5,740	1,373	205,034	保険
EASYJET PLC	163	163	261	39,039	旅客航空輸送業
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,410	4,250	1,099	164,182	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,050	1,290	824	123,083	ソフトウェア
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	375	375	225	33,641	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WPP PLC	1,234	1,440	1,630	243,429	メディア
COCA-COLA HBC AG-CDI	167	223	587	87,678	飲料
CONVATEC GROUP PLC-WI	—	1,570	312	46,659	ヘルスケア機器・用品
COMPASS GROUP PLC	—	1,843	2,682	400,414	ホテル・レストラン・レジャー
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	—	213	909	135,698	ホテル・レストラン・レジャー
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	—	516	509	76,006	ソフトウェア
NATIONAL GRID PLC	—	3,970	3,184	475,385	総合公益事業
ROYAL MAIL PLC	880	1,080	584	87,183	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	690	890	308	46,045	ホテル・レストラン・レジャー
FERGUSON PLC	242	291	1,558	232,564	商社・流通業
IMI PLC	259	320	345	51,587	機械
VODAFONE GROUP PLC	25,990	31,140	6,048	902,786	無線通信サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	987	1,240	781	116,609	保険
COMPASS GROUP PLC	1,611	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,870	3,110	1,118	166,983	各種金融サービス
AUTO TRADER GROUP PLC	950	1,190	417	62,277	インターネットソフトウェア・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,360	1,570	598	89,359	保険
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	181	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDPAY GROUP PLC	1,660	—	—	—	情報技術サービス

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	千英ポンド	千円	
CRODA INTERNATIONAL PLC		120	155	708	105,689	化学
JOHNSON MATTHEY PLC		191	218	663	98,989	化学
小 計	株 数 ・ 金 額	289,196	355,372	207,983	31,045,685	
	銘柄 数 < 比 率 >	104	99	—	<6.8%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SYNGENTA AG-REG		89	—	—	—	化学
SIKA AG-BR		2	2	1,863	207,586	化学
SGS SA-REG		5	6	1,420	158,219	専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG		2	2	429	47,853	食品
SWISSCOM AG-REG		25	29	1,416	157,721	各種電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG-PC		1	1	740	82,490	食品
LINDT&SPRUENGLI AG-REG		0.1	0.12	834	92,890	食品
GIVAUDAN-REG		8	10	2,374	264,417	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG		147	177	5,553	618,543	保険
NOVARTIS-REG		2,175	2,589	20,002	2,227,891	医薬品
ABB LTD		1,841	2,159	4,905	546,346	電気設備
ROCHE HOLDING (GENUSSSCHEINE)		684	818	17,922	1,996,194	医薬品
ADECCO GROUP AG-REG		153	193	1,312	146,175	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD		439	537	2,808	312,811	建設資材
CLARIANT AG-REG		—	259	590	65,800	化学
NESTLE SA-REG		3,030	3,621	27,382	3,049,807	食品
BALOISE HOLDING AG		50	58	847	94,381	保険
SONOVA HOLDING AG-REG		50	58	880	98,063	ヘルスケア機器・用品
STRAUMANN HOLDING AG-REG		—	11	674	75,096	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		1,950	2,800	4,477	498,670	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B		29	35	1,491	166,151	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG		46	60	480	53,495	繊維・アパレル・贅沢品
LONZA AG-REG		57	85	1,923	214,206	ライフサイエンス・ツール/サービス
SWISS LIFE HOLDING AG		31	38	1,313	146,304	保険
GALENICA AG-REG		3	—	—	—	医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		8	9	590	65,818	化学
SWISS PRIME SITE-REG		68	81	748	83,406	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES		32	43	364	40,565	各種金融サービス
DUFREY AG-REG		45	44	550	61,332	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG		16	20	1,462	162,904	資本市場
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		38	44	922	102,790	機械
SCHINDLER HOLDING AG-REG		19	24	490	54,576	機械
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		52	65	976	108,812	海運業
GEBERIT AG-REG		35	43	1,841	205,124	建設関連製品
ARYZTA AG		85	—	—	—	食品
JULIUS BAER GROUP LTD		220	259	1,521	169,449	資本市場
SWISS RE LTD		309	361	3,511	391,145	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A		511	601	5,154	574,072	繊維・アパレル・贅沢品
ACTELION LTD-NEW LINE		93	—	—	—	バイオテクノロジー
UBS GROUP AG		3,570	4,240	7,121	793,145	資本市場
VIFOR PHARMA AG		—	57	839	93,484	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額	15,927	19,447	127,740	14,227,749	
	銘柄 数 < 比 率 >	38	37	—	<3.1%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS		34	46	2,750	34,962	各種金融サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB		1,500	1,750	15,302	194,488	銀行
SWEDBANK AB		881	1,069	19,990	254,076	銀行
SWEDISH MATCH AB		189	215	8,116	103,157	タバコ
NORDEA BANK AB		2,950	3,510	31,274	397,493	銀行

銘柄	株数	当株数	期末評価額		業種等
			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	
SECURITAS AB-B SHS	290	333	4,720	59,994	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	441	539	19,899	252,927	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B	917	1,075	13,456	171,036	専門小売り
ERICSSON LM-B	2,970	3,490	18,469	234,742	通信機器
TELIA CO AB	2,470	3,300	12,939	164,458	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	341	382	6,518	82,854	建設・土木
LUNDIN PETROLEUM AB	171	217	4,548	57,809	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB	277	350	6,900	87,702	機械
GETINGE AB-B SHS	191	268	2,544	32,339	ヘルスケア機器・用品
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	68	82	4,669	59,354	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB	78	105	3,101	39,422	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	380	450	3,621	46,030	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B	233	265	6,956	88,413	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES	388	427	7,280	92,533	機械
VOLVO AB-B SHS	1,520	1,820	27,709	352,187	機械
SANDVIK AB	1,030	1,310	19,970	253,830	機械
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	168	206	3,995	50,781	各種金融サービス
SVENSKA CELLULOSA AB-B	600	—	—	—	紙製品・林産品
BOLIDEN AB	263	327	9,564	121,567	金属・鉱業
HEXAGON AB-B SHS	258	302	14,979	190,385	電子装置・機器・部品
TELE 2 AB-B SHS	340	420	4,206	53,462	無線通信サービス
KINNEVIK AB - B	236	266	7,990	101,561	各種金融サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B	—	696	16,049	203,992	家庭用品
ATLAS COPCO AB-A	660	783	28,281	359,463	機械
ATLAS COPCO AB-B	382	450	14,602	185,597	機械
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	1,480	1,810	18,860	239,713	銀行
ASSA ABLOY AB-B	963	1,184	21,353	271,402	建設関連製品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,669 31	27,447 31	380,624 —	4,837,743 <1.1%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	940	1,120	17,040	230,732	銀行
TELENOR ASA	719	856	15,151	205,147	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	78	—	—	—	メディア
STATOIL ASA	1,113	1,363	25,167	340,771	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	168	206	6,820	92,351	化学
MARINE HARVEST ASA	372	467	7,341	99,400	食品
NORSK HYDRO	1,300	1,610	7,397	100,168	金属・鉱業
ORKLA ASA	800	910	7,656	103,672	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	197	250	3,590	48,608	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	91	129	2,561	34,688	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,778 10	6,911 9	92,728 —	1,255,541 <0.3%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG B	105	126	9,082	159,572	飲料
A P MOLLER-MAERSK A/S	6	7	6,821	119,847	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A	3	4	3,896	68,456	海運業
DANSKE BANK AS	669	881	19,857	348,900	銀行
GENMAB A/S	54	69	8,956	157,360	バイオテクノロジー
TDC A/S	768	970	4,861	85,419	各種電気通信サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	212	252	10,830	190,299	電気設備
H LUNDBECK A/S	—	82	2,769	48,668	医薬品
DSV A/S	190	221	10,482	184,169	陸運・鉄道
PANDORA A/S	108	124	8,057	141,570	繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S	91	114	5,939	104,355	化学

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	評価額	
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(デンマーク)	百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	225	271	8,466	148,748	化学
COLOPLAST-B	117	142	7,250	127,391	ヘルスケア機器・用品
NOVO NORDISK A/S-B	1,867	2,155	64,111	1,126,434	医薬品
ISS A/S	161	186	4,158	73,072	商業サービス・用品
TRYG A/S	118	118	1,657	29,129	保険
ORSTED A/S	141	218	8,545	150,146	電力
WILLIAM DEMANT HOLDING	130	130	2,914	51,209	ヘルスケア機器・用品
小計	株数・金額	株数	188,659	3,314,751	
	銘柄数<比率>		—	<0.7%>	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ		
ADIDAS AG	184	216	4,265	558,546	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA	396	484	3,003	393,335	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	112	144	735	96,358	インターネットソフトウェア・サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD	64	82	361	47,354	化学
HANNOVER RUECK SE	56	71	787	103,108	保険
GEA GROUP AG	170	207	715	93,653	機械
CONTINENTAL AG	104	128	2,875	376,550	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	926	1,138	4,042	529,322	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE	44	59	401	52,537	メディア
MERCK KGAA	125	151	1,176	154,035	医薬品
RWE AG	496	579	1,161	152,095	総合公益事業
SAP SE	959	1,146	9,737	1,275,133	ソフトウェア
E.ON SE	2,150	2,600	2,345	307,103	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	99	123	1,258	164,773	家庭用品
CECONOMY AG	182	—	—	—	専門小売り
BAYER AG-REG	807	964	8,848	1,158,718	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	173	208	2,222	291,033	家庭用品
BASF SE	896	1,071	8,832	1,156,620	化学
BEIERSDORF AG	100	118	1,085	142,190	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	20	20	303	39,730	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	143	173	1,380	180,736	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE	208	255	2,115	277,088	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG	445	520	9,540	1,249,324	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	226	267	692	90,695	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	155	179	3,384	443,159	保険
VOLKSWAGEN AG	32	38	619	81,124	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF	179	216	3,485	456,466	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	940	1,124	7,752	1,015,154	自動車
MAN SE	37	37	350	45,907	機械
THYSSENKRUPP AG	363	518	1,097	143,736	金属・鉱業
SIEMENS AG	746	892	9,233	1,209,190	コングロマリット
1&1 DRILLISCH AG	—	59	323	42,300	無線通信サービス
LINDE AG	182	—	—	—	化学
DEUTSCHE BANK AG-REG	2,026	2,410	2,729	357,436	資本市場
BAYER MOTOREN WERK	316	385	3,393	444,414	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	53	64	487	63,819	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG	3,199	3,900	5,167	676,684	各種電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,089	1,324	2,878	376,923	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG	—	221	2,444	320,075	資本市場
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	152	171	1,154	151,149	自動車
FRAPORT AG	38	49	392	51,396	運送インフラ
WIRECARD AG	—	140	1,342	175,850	情報技術サービス
LANXESS	89	103	640	83,894	化学
MTU AERO ENGINES AG	—	58	793	103,900	航空宇宙・防衛



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	
DEUTSCHE WOHNEN SE		342	413	1,565	204,972	不動産管理・開発
SYMRISE AG		121	136	888	116,400	化学
BRENTTAG AG		151	186	898	117,642	商社・流通業
K+S AG		188	234	548	71,825	化学
EVONIK INDUSTRIES AG		169	195	558	73,132	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG		746	746	284	37,278	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG		63	76	537	70,421	繊維・アパレル・贅沢品
COMMERZBANK AG		1,020	1,240	1,307	171,211	銀行
OSRAM LICHT AG		88	116	693	90,776	電気設備
KION GROUP AG		—	80	605	79,345	機械
VONOVIA SE		446	555	2,233	292,525	不動産管理・開発
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE		223	256	721	94,468	メディア
SIEMENS HEALTHINEERS AG		—	174	581	76,102	ヘルスケア機器・用品
METRO AG		—	182	261	34,295	食品・生活必需品小売り
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER		189	—	—	—	資本市場
INNOGY SE		127	171	657	86,143	総合公益事業
LINDE AG - TENDER		—	214	3,661	479,478	化学
ZALANDO SE		81	134	593	77,699	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG		88	188	1,501	196,604	化学
QIAGEN NV		214	245	643	84,217	ライフサイエンス・ツール/サービス
SCHAEFFLER AG		160	210	263	34,470	自動車部品
UNIPER SE		—	224	554	72,598	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 ・ 金 額	23,102	28,588	135,122	17,694,243	
	銘 柄 数 < 比 率 >	57	63	—	<3.9%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		1,120	1,470	2,296	300,775	保険
INTESA SANPAOLO		12,340	15,780	4,660	610,308	銀行
INTESA SANPAOLO-RSP		920	1,180	363	47,561	銀行
MEDIOBANCA S. P. A.		530	680	649	85,021	銀行
SAIPEM SPA		5,897	—	—	—	エネルギー設備・サービス
LUXOTTICA GROUP SPA		165	203	1,025	134,243	繊維・アパレル・贅沢品
ENEL SPA		7,470	9,360	4,651	609,168	電力
ENI SPA		2,490	2,960	4,229	553,820	石油・ガス・消耗燃料
SNAM SPA		2,330	2,740	1,022	133,941	石油・ガス・消耗燃料
TENARIS SA		460	530	739	96,817	エネルギー設備・サービス
TELECOM ITALIA SPA		11,300	13,600	1,048	137,308	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC		5,700	6,800	459	60,230	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA		387	532	1,337	175,208	運送インフラ
TERNA SPA		1,520	1,630	774	101,366	電力
RECORDATI SPA		—	112	335	43,969	医薬品
LEONARDO SPA		410	470	440	57,718	航空宇宙・防衛
PRYSMIAN SPA		194	230	586	76,802	電気設備
UNIPOLSAI SPA		1,070	1,070	206	27,084	保険
FERRARI NV		116	143	1,394	182,651	自動車
CNH INDUSTRIAL NV		990	1,210	1,213	158,924	機械
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		890	1,230	2,029	265,795	自動車
UNICREDIT SPA		1,843	2,350	3,992	522,775	銀行
EXOR NV		104	121	698	91,457	各種金融サービス
POSTE ITALIANE SPA		500	640	474	62,185	保険
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA		—	650	399	52,347	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額	58,746	65,691	35,032	4,587,485	
	銘 柄 数 < 比 率 >	23	24	—	<1.0%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES		201	257	1,046	137,006	建設・土木

銘柄	株数	期首(前期末)	当期末		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
AIRBUS SE	567	679	6,369	834,023	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT	461	569	1,095	143,395	総合公益事業
LOREAL-ORD	246	294	5,403	707,565	パーソナル用品
CHRISTIAN DIOR SE	53	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	272	325	8,141	1,066,130	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT AVIATION SA	2	2	418	54,837	航空宇宙・防衛
THALES SA	105	124	1,226	160,656	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA	158	190	1,922	251,790	情報技術サービス
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	59	59	234	30,757	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	55	67	441	57,800	電子装置・機器・部品
PUBLICIS GROUPE	181	239	1,352	177,078	メディア
FAURECIA	—	85	558	73,151	自動車部品
LAGARDERE S. C. A	116	148	343	44,962	メディア
BOLLORE	870	1,060	458	60,103	航空貨物・物流サービス
MICHELIN (CGDE)	175	200	2,398	314,018	自動車部品
PERNOD RICARD SA	207	247	3,340	437,461	飲料
RENAULT SA	186	227	2,235	292,797	自動車
REMY COINTREAU	23	23	266	34,877	飲料
SEB SA	20	24	380	49,792	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	544	663	4,729	619,372	電気設備
VIVENDI SA	1,000	1,209	2,538	332,468	メディア
ORANGE SA	1,940	2,340	3,225	422,404	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	26	36	1,752	229,510	繊維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA	28	28	227	29,750	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	128	150	1,656	216,853	ソフトウェア
KERING SA	74	88	3,429	449,055	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	165	212	434	56,910	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE	552	674	1,135	148,718	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	86	112	1,244	162,943	情報技術サービス
SANOFI	1,132	1,326	8,662	1,134,388	医薬品
ACCOR SA	164	214	938	122,882	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV	600	753	1,354	177,341	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE	742	884	3,903	511,195	銀行
TELEPERFORMANCE	—	64	806	105,598	専門サービス
EURAZEO SE	40	54	403	52,857	各種金融サービス
SODEXO	89	101	827	108,320	ホテル・レストラン・レジャー
AXA	1,897	2,249	4,857	636,134	保険
PEUGEOT CITROEN	473	674	1,317	172,548	自動車
JC DECAUX SA	68	93	262	34,416	メディア
ESSILOR INTERNATIONAL	204	242	2,652	347,321	ヘルスケア機器・用品
CREDIT AGRICOLE SA	1,080	1,290	1,703	223,066	銀行
ZODIAC AEROSPACE	195	—	—	—	航空宇宙・防衛
BNP PARIBAS	1,034	1,311	7,888	1,032,971	銀行
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	481	583	2,498	327,209	建設関連製品
WENDEL	29	34	430	56,410	各種金融サービス
ILIAD SA	27	31	529	69,298	各種電気通信サービス
SES FDR	344	430	472	61,854	メディア
IMERYS	38	38	299	39,261	建設資材
SAFRAN SA	304	385	3,310	433,474	航空宇宙・防衛
ENGIE	1,520	2,130	2,887	378,080	総合公益事業
ALSTOM	155	181	662	86,772	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	163	200	322	42,165	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	370	670	787	103,178	電力
IPSEN	—	40	504	66,077	医薬品

銘柄		株数	期首(前期末)	当期末		業種等
			株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ARKEMA		67	77	816	106,881	化学
LEGRAND SA		264	302	1,923	251,913	電気設備
EIFFAGE SA		61	87	804	105,359	建設・土木
TOTAL SA		2,219	2,798	12,907	1,690,194	石油・ガス・消耗燃料
ADP		28	34	601	78,805	運送インフラ
NATIXIS		870	1,110	739	96,777	資本市場
UBISOFT ENTERTAINMENT		—	70	479	62,808	ソフトウェア
SCOR SE		154	206	685	89,721	保険
REXEL SA		286	350	481	63,019	商社・流通業
VINCI		489	594	4,746	621,496	建設・土木
DANONE		578	695	4,568	598,210	食品
AIR LIQUIDE		376	501	4,983	652,647	化学
BUREAU VERITAS SA		255	301	635	83,207	専門サービス
GETLINK		450	530	614	80,508	運送インフラ
SUEZ		333	450	529	69,357	総合公益事業
EDENRED		214	253	714	93,560	商業サービス・用品
VALEO SA		228	276	1,480	193,866	自動車部品
BIOMERIEUX		—	46	308	40,358	ヘルスケア機器・用品
SFR GROUP SA		77	—	—	—	各種電気通信サービス
AMUNDI SA		—	67	437	57,256	資本市場
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	26,601 69	33,058 72	144,749 —	18,954,974 <4.2%>	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		219	—	—	—	飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	219 1	— —	— —	— <—%>	
(ユーロ…オランダ)						
RELX NV		954	1,095	1,842	241,325	専門サービス
RANDSTAD HOLDING NV		116	135	721	94,437	専門サービス
AKZO NOBEL		248	297	2,279	298,458	化学
WOLTERS KLUWER		299	351	1,515	198,516	専門サービス
VOPAK		71	90	358	46,965	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV		1,700	2,080	1,139	149,153	保険
KONINKLIJKE KPN NV		3,410	4,000	974	127,650	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV		916	1,085	3,381	442,794	ヘルスケア機器・用品
HEINEKEN NV		223	303	2,645	346,387	飲料
ARCELORMITTAL		1,780	—	—	—	金属・鉱業
HEINEKEN HOLDING NV		97	135	1,129	147,966	飲料
KONINKLIJKE DSM NV		180	209	1,685	220,699	化学
UNILEVER NV-CVA		1,589	1,901	8,719	1,141,869	パーソナル用品
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA		93	96	228	29,925	建設・土木
ASML HOLDING NV		362	453	7,254	950,015	半導体・半導体製造装置
GEMALTO		76	—	—	—	ソフトウェア
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		1,232	1,495	2,876	376,701	食品・生活必需品小売り
NN GROUP NV		300	346	1,246	163,292	保険
ARCELORMITTAL		—	761	1,955	256,108	金属・鉱業
ABN AMRO GROUP NV-CVA		279	489	1,196	156,692	銀行
ALTICE NV - B		100	—	—	—	メディア
ALTICE NV - A		368	640	428	56,134	メディア
ING GROEP NV		3,790	4,540	6,219	814,482	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	18,183 22	20,501 20	47,801 —	6,259,577 <1.4%>	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		630	809	1,473	193,020	運送インフラ

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	
ENDESA S. A.		317	356	636	83,376	電力
BANKINTER S. A.		650	750	626	82,066	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S. A.		6,420	7,660	4,924	644,878	銀行
GAS NATURAL SDG		328	412	798	104,611	ガス
REPSOL SA		1,087	1,435	2,069	271,044	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA		14,220	18,810	9,959	1,304,248	銀行
TELEFONICA SA		4,430	5,430	4,359	570,837	各種電気通信サービス
ZARDOYA OTIS S. A		175	—	—	—	機械
ENAGAS		228	267	593	77,724	石油・ガス・消耗燃料
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA		—	300	390	51,168	電気設備
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV		190	282	894	117,175	建設・土木
FERROVIAL SA		464	540	917	120,131	建設・土木
MAPFRE SA		980	1,260	340	44,565	保険
BANCO DE SABADELL SA		5,300	6,250	1,038	135,942	銀行
CAIXABANK		3,450	4,130	1,599	209,406	銀行
IBERDROLA SA		5,410	6,810	4,066	532,564	電力
AMADEUS IT GROUP SA		426	511	3,064	401,358	情報技術サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP		800	750	526	68,945	旅客航空輸送業
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		560	—	—	—	食品・生活必需品小売り
BANKIA SA		4,300	—	—	—	銀行
BCO POPULAR ESPANOL		3,002	—	—	—	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA		432	482	806	105,596	電力
INDITEX SA		1,068	1,270	3,229	422,917	専門小売り
AENA SME SA		65	80	1,309	171,439	運送インフラ
GRIFOLS SA		288	329	757	99,132	バイオテクノロジー
BANKIA SA		—	1,510	549	71,955	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	55,222	60,435	44,934	5,884,109	
		25	23	—	<1.3%>	
(ユーロ…ベルギー)						
UMICORE		94	—	—	—	化学
KBC GROEP NV		244	285	2,015	263,932	銀行
SOLVAY SA		73	87	981	128,566	化学
UCB SA		121	151	999	130,860	医薬品
COLRUYT SA		60	73	327	42,940	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAM		78	89	825	108,154	各種金融サービス
PROXIMUS		151	184	464	60,791	各種電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		52	67	363	47,597	メディア
AGEAS		190	213	893	117,036	保険
UMICORE		—	247	1,060	138,855	化学
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		743	889	7,936	1,039,349	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,806	2,285	15,869	2,078,083	
		10	10	—	<0.5%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG		150	171	808	105,871	石油・ガス・消耗燃料
VOESTALPINE AG		110	128	544	71,354	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		289	353	1,440	188,599	銀行
IMMOEAST AG-RIGHTS		500	—	—	—	不動産管理・開発
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		110	169	533	69,910	銀行
ANDRITZ AG		72	92	417	54,695	機械
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	1,231	913	3,745	490,430	
		6	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルグ)						
EUROFINS SCIENTIFIC SE		10	12	531	69,660	ライフサイエンス・ツール/サービス

銘柄		柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
			株 数	株 数	評 価 額		業 種 等
(ユーロ…ルクセンブルグ)			百株	百株	千ユーロ	千円	
RTL GROUP			39	39	263	34,447	メディア
小	計	株 数 ・ 金 額	49	51	795	104,107	
		銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フィンランド)							
WARTSILA OYJ			147	525	942	123,404	機械
UPM-KYMMENE OYJ			529	615	1,851	242,408	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R			540	620	925	121,174	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS			430	527	2,385	312,342	保険
FORTUM OYJ			440	500	872	114,253	電力
ELISA OYJ			145	172	632	82,818	各種電気通信サービス
METSO OYJ			103	124	317	41,585	機械
NOKIA OYJ			5,680	6,800	3,049	399,371	通信機器
NESTE OYJ			125	146	826	108,211	石油・ガス・消耗燃料
NOKIAN RENKAAT OYJ			113	134	494	64,749	自動車部品
KONE OYJ			323	384	1,556	203,804	機械
ORION OYJ			95	130	323	42,337	医薬品
小	計	株 数 ・ 金 額	8,670	10,677	14,176	1,856,460	
		銘柄 数 < 比 率 >	12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)							
BANK OF IRELAND			28,500	—	—	—	銀行
CRH PLC			823	996	2,745	359,585	建設資材
KERRY GROUP PLC-A			158	193	1,590	208,252	食品
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD			1,398	1,398	—	—	銀行
BANK OF IRELAND GROUP PLC			—	1,090	774	101,484	銀行
AIB GROUP PLC			—	1,050	513	67,263	銀行
PADDY POWER PLC			87	101	842	110,370	ホテル・レストラン・レジャー
小	計	株 数 ・ 金 額	30,966	4,828	6,467	846,956	
		銘柄 数 < 比 率 >	5	6	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)							
ENERGIAS DE PORTUGAL			2,350	2,620	809	105,945	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS			500	570	872	114,238	石油・ガス・消耗燃料
JERONIMO MARTINS			230	310	458	60,100	食品・生活必需品小売り
小	計	株 数 ・ 金 額	3,080	3,500	2,140	280,284	
		銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計		株 数 ・ 金 額	227,877	230,528	450,834	59,036,713	
		銘柄 数 < 比 率 >	235	240	—	<13.0%>	
(香港)					千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY			219	380	4,164	56,391	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD			2,130	2,510	4,588	62,125	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA			1,208	1,400	4,383	59,357	銀行
CLP HLDGS			1,590	1,870	14,941	202,305	電力
CATHAY PACIFIC AIRWAYS			1,070	—	—	—	旅客航空輸送業
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD			650	—	—	—	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD			1,120	1,380	35,217	476,846	資本市場
LI & FUNG LTD			5,636	7,496	2,878	38,974	繊維・アパレル・贅沢品
MTR CORP			1,480	1,810	7,638	103,421	陸運・鉄道
FIRST PACIFIC CO			2,260	2,260	965	13,066	各種金融サービス
HANG LUNG GROUP LTD			810	1,030	2,641	35,772	不動産管理・開発
HANG SENG BANK			756	870	15,799	213,921	銀行
HENDERSON LAND			1,078	1,325	6,775	91,744	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD			1,320	1,630	11,401	154,381	電力
WHARF(HOLDING)			1,330	1,340	3,611	48,897	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS			7,548	9,602	15,479	209,597	ガス
HYSAN DEVELOPMENT			650	650	2,697	36,524	不動産管理・開発

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	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		2,230	2,710	19,308	261,440	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES		570	790	2,792	37,812	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		3,635	4,210	16,082	217,752	銀行
NWS HOLDINGS LTD		1,595	1,595	2,271	30,753	コングロマリット
PCCW LTD		3,860	5,500	2,497	33,809	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		750	970	3,021	40,911	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT		5,496	6,796	7,530	101,965	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD		1,083	1,603	2,533	34,300	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO.LTD		3,140	3,600	4,572	61,904	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,390	1,660	20,584	278,707	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A		535	535	4,234	57,335	不動産管理・開発
WHEELLOCK & COMPANY LTD		750	980	5,620	76,098	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		1,400	1,560	7,137	96,634	家庭用耐久財
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD		—	4,500	1,579	21,386	資本市場
MINTH GROUP LTD		—	820	2,931	39,692	自動車部品
SJM HOLDINGS LIMITED		1,660	2,700	1,841	24,932	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD		1,484	1,840	5,234	70,879	ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD		940	1,240	2,511	33,998	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD		11,760	14,080	93,491	1,265,870	保険
HKT TRUST AND HKT LTD		3,796	4,496	4,437	60,084	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD		2,336	2,864	12,086	163,645	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD		1,168	1,460	4,015	54,363	不動産管理・開発
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT		—	1,470	7,511	101,708	不動産管理・開発
WH GROUP LIMITED		8,100	10,200	8,527	115,458	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		2,645	3,120	29,300	396,729	コングロマリット
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING		2,610	—	—	—	不動産管理・開発
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		—	750	4,811	65,144	電力
CK ASSET HOLDINGS LTD		—	2,980	19,625	265,735	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額	93,790	120,586	429,274	5,812,382	
	銘 柄 数 < 比 率 >	40	42	—	<1.3%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		1,610	1,980	710	57,704	航空宇宙・防衛
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		6,203	9,400	329	26,708	食品
DBS GROUP HLDGS		1,720	2,067	5,684	461,447	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD		410	510	663	53,822	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD		100	100	345	28,007	販売
SATS LTD		590	770	395	32,066	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD		770	930	685	55,641	資本市場
CAPITALAND LIMITED		2,460	2,850	1,017	82,596	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE PLC		6,146	7,200	777	63,125	ホテル・レストラン・レジャー
COMFORTDELGRO CORP LTD		2,070	2,500	512	41,604	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD		520	630	683	55,474	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK		1,300	1,550	4,262	346,029	銀行
UOL GROUP LIMITED		487	650	555	45,115	不動産管理・開発
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		1,480	1,870	471	38,255	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED		7,860	9,650	3,252	264,001	各種電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES		990	990	308	25,004	コングロマリット
OCBC-ORD		3,030	3,670	4,704	381,947	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,840	1,750	556	45,176	食品
STARHUB LTD		690	690	158	12,883	無線通信サービス
KEPPEL CORP.		1,427	1,620	1,258	102,184	コングロマリット
YANGZIJANG SHIPBUILDING		1,630	2,700	326	26,521	機械

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額	評価額	
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	2,660	—	—	—	不動産管理・開発
小計	株数・金額	45,994	54,078	27,658	2,245,319
銘柄数＜比率＞	22	21	—	<0.5%＞	
(オーストラリア)			千豪ドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	141	158	984	80,505	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	2,857	3,432	9,218	753,692	銀行
AMCOR	1,120	1,340	1,898	155,244	容器・包装
WESTPAC BANKING CORP	3,263	3,962	11,339	927,096	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD	351	420	460	37,635	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,480	1,870	809	66,201	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD	4,140	4,870	1,529	125,025	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	443	540	531	43,443	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD	600	600	520	42,531	飲料
ASX LTD	196	219	1,227	100,377	資本市場
BHP BILLITON LIMITED	3,137	3,750	10,578	864,918	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	255	291	913	74,707	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	530	530	195	15,989	複合小売り
COMPUTERSHARE LTD	470	560	969	79,254	情報技術サービス
CSL LIMITED	446	524	8,146	666,025	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	54	54	427	34,971	インターネットソフトウェア・サービス
TRANSURBAN GROUP	1,980	2,570	2,934	239,960	運送インフラ
COCHLEAR LTD	58	67	1,216	99,489	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,750	2,050	1,783	145,818	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,680	2,043	14,772	1,207,835	銀行
BORAL LTD	1,150	1,330	989	80,903	建設資材
RIO TINTO LTD	408	480	3,489	285,309	金属・鉱業
APA GROUP	1,110	1,440	1,134	92,774	ガス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	520	630	1,515	123,930	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	2,280	2,770	2,071	169,403	保険
TPG TELECOM LTD	330	359	197	16,142	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	52	73	416	34,014	ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD	366	420	745	60,986	化学
BLUESCOPE STEEL LTD	—	670	1,011	82,661	金属・鉱業
SUNCORP GROUP LTD	1,260	1,490	1,987	162,511	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,594	3,138	8,940	730,947	銀行
NEWCREST MINING	750	890	1,740	142,331	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	1,290	1,620	1,158	94,702	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	1,610	1,960	687	56,247	化学
AMP LIMITED	2,810	3,440	1,716	140,345	各種金融サービス
QANTAS AIRWAYS LIMITED	441	—	—	—	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE	1,320	1,520	1,463	119,677	保険
CHALLENGER LIMITED	560	660	761	62,271	各種金融サービス
SANTOS LTD.	1,760	2,120	1,074	87,878	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE LTD	380	490	1,121	91,662	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TABCORP HOLDINGS	780	2,184	958	78,389	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LIMITED	1,107	1,308	5,436	444,451	食品・生活必需品小売り
ALUMINA LTD	2,330	2,900	684	55,956	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM	735	1,107	3,236	264,646	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS GROUP LTD	1,236	1,522	4,001	327,149	食品・生活必需品小売り
DUET GROUP	2,290	—	—	—	総合公益事業
SEEK LTD	328	400	744	60,829	専門サービス
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	59	59	246	20,129	ホテル・レストラン・レジャー
TATTS GROUP LTD	1,470	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
BRAMBLES LTD	1,530	1,890	1,886	154,217	商業サービス・用品

銘柄	株数	当期末	期末		業種等
			評価額	外貨建金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円	
MACQUARIE GROUP LIMITED	295	378	3,889	318,015	資本市場
CROWN RESORTS LTD	360	430	545	44,613	ホテル・レストラン・レジャー
VOCUS GROUP LTD	540	—	—	—	各種電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	440	520	1,189	97,232	建設資材
TREASURY WINE ESTATES LTD	720	820	1,382	113,034	飲料
SYDNEY AIRPORT	1,079	1,250	838	68,576	運送インフラ
AURIZON HOLDINGS LTD	1,910	2,390	1,010	82,656	陸運・鉄道
HEALTHSCOPE LTD	1,760	1,760	340	27,844	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSNET SERVICES	1,634	2,300	385	31,498	電力
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,610	3,080	893	73,028	保険
AGL ENERGY LTD	657	790	1,712	140,031	総合公益事業
SOUTH32 LTD	5,070	6,140	1,977	161,646	金属・鉱業
CIMIC GROUP LTD	89	117	520	42,539	建設・土木
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	74,971 62	86,695 59	134,563 —	11,001,918 <2.4%>
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
CONTACT ENERGY LTD	760	—	—	—	電力
RYMAN HEALTHCARE LTD	350	450	476	36,651	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	—	640	844	64,973	ヘルスケア機器・用品
FLETCHER BUILDING LTD	690	690	416	31,999	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,890	2,290	764	58,825	各種電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	600	880	283	21,793	電力
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	911	1,080	660	50,834	運送インフラ
MERIDIAN ENERGY LTD	1,200	1,590	453	34,912	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,401 7	7,620 7	3,900 —	299,990 <0.1%>
(イスラエル)			千新シェケル		
BANK HAPOLIM BM	1,020	1,250	3,003	91,404	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,420	1,610	3,379	102,834	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	2,040	2,040	903	27,500	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	23	28	1,211	36,876	航空宇宙・防衛
FRUTAROM	38	48	1,560	47,500	化学
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	500	910	1,374	41,813	化学
NICE LTD	59	68	2,214	67,374	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	130	170	1,134	34,525	銀行
AZRIELI GROUP	41	41	684	20,835	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,271 9	6,165 9	15,467 —	470,664 <0.1%>
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,136,364 1,265	1,322,817 1,260	— —	434,672,468 <95.6%>

\* 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。

\* 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。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。



## 外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORP	32,900	42,800	809	86,079	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,600	11,000	1,373	146,033	0.0
AMERICAN TOWER CORP	41,600	50,100	7,281	774,027	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	95,000	132,000	1,376	146,349	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,230	16,300	2,680	284,958	0.1
BOSTON PROPERTIES	14,900	17,700	2,180	231,839	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	30,000	37,000	564	59,979	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	8,200	10,500	883	93,957	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	51,000	59,000	331	35,246	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	35,000	46,800	5,129	545,292	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	15,300	24,300	2,560	272,206	0.1
DUKE REALTY CORP	34,000	38,900	1,030	109,496	0.0
EQUINIX INC	7,450	9,120	3,813	405,368	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	34,800	43,400	2,674	284,278	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,190	7,590	1,826	194,184	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	11,800	14,100	1,231	130,937	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,910	7,900	917	97,505	0.0
GGP INC	56,500	68,200	1,395	148,328	0.0
HCP INC	44,700	51,600	1,198	127,418	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	70,100	88,000	1,640	174,366	0.0
INVITATION HOMES INC	—	34,000	776	82,512	0.0
IRON MOUNTAIN INC	24,400	31,300	1,028	109,331	0.0
KIMCO REALTY CORP	40,000	51,000	734	78,066	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	14,300	16,900	671	71,373	0.0
MACERICH CO /THE	12,300	14,200	795	84,559	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,200	13,700	1,249	132,873	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	14,500	17,100	671	71,364	0.0
PROLOGIS INC	51,400	61,400	3,867	411,124	0.1
PUBLIC STORAGE	14,450	18,300	3,667	389,816	0.1
REALTY INCOME CORP	24,700	32,100	1,660	176,514	0.0
REGENCY CENTERS CORP	15,100	17,000	1,002	106,582	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	12,000	13,800	2,358	250,729	0.1
SL GREEN REALTY CORP	9,800	11,000	1,065	113,223	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	30,720	36,100	5,572	592,307	0.1
UDR INC	25,300	30,800	1,097	116,621	0.0
VENTAS INC	34,800	40,200	1,991	211,654	0.0
VEREIT INC	95,000	109,000	758	80,643	0.0
VORNADO REALTY TRUST	16,500	20,500	1,379	146,656	0.0
WELLTOWER INC	35,300	43,500	2,367	251,687	0.1
WEYERHAEUSER CO	72,200	88,200	3,087	328,148	0.1
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	509,000	150	15,961	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,680,150	1,985,410	76,854	8,169,607
	銘柄 数 < 比 率 >	40	41	—	<1.8%>
(カナダ)			千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	13,600	286	23,584	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,900	16,900	399	32,944	0.0

銘	柄	期首(前期末)				
		口 数	口 数	当 期 末		比 率
				評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		口	口	千カナダドル	千円	%
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV		6,900	6,900	200	16,562	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	37,400	37,400	886	73,091	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.0%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		92,000	114,000	731	109,247	0.0
HAMMERSON PLC		74,000	89,000	477	71,287	0.0
INTU PROPERTIES PLC		88,000	—	—	—	—
LAND SECURITIES GROUP PLC		77,500	—	—	—	—
SEGRO PLC		91,200	118,000	709	105,894	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		—	89,000	834	124,494	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	422,700	410,000	2,752	410,923	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	4	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
ICADE		3,700	3,700	291	38,228	0.0
KLEPIERRE		20,500	24,900	815	106,786	0.0
GECINA SA		4,000	5,600	790	103,471	0.0
FONCIERE DES REGIONS		3,100	4,000	358	46,958	0.0
UNIBAIL RODAMCO-NA		9,570	11,680	2,168	283,950	0.1
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	40,870	49,880	4,424	579,395	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		215,000	252,000	16,884	228,609	0.1
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		260,000	260,000	1,976	26,755	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	475,000	512,000	18,860	255,364	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		249,900	310,000	644	52,344	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		239,000	282,000	741	60,207	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		192,000	299,972	548	44,563	0.0
SUNTEC REIT		243,000	300,000	567	46,029	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	923,900	1,191,972	2,502	203,145	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		340,000	430,000	924	75,587	0.0
GPT GROUP		179,000	203,000	962	78,671	0.0
LENDLEASE GROUP		53,000	61,000	1,055	86,331	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP		227,000	274,000	1,104	90,281	0.0
DEXUS		91,000	113,000	1,053	86,106	0.0
GOODMAN GROUP		174,000	214,000	1,804	147,496	0.0
SCENTRE GROUP		518,000	612,000	2,343	191,642	0.0
WESTFIELD CORP		191,000	234,000	1,993	163,003	0.0
VICINITY CENTRES		328,704	373,000	898	73,496	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	2,101,704	2,514,000	12,140	992,615	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.2%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	5,681,724	6,700,662	—	10,684,143	
	銘柄 数 < 比 率 >	68	68	—	<2.3%>	

\* 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。

\* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	CAN60	百万円 328	百万円 —
		EUR050	1,241	—
		FT100	657	—
		SPI200	222	—
		SPEMINI	6,068	—
		SWISSMKT	296	—

\*単位未満は切り捨て。  
\*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4月2日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 434,672,468	% 95.5
投資信託受益証券	15,961	0.0
投資証券	10,668,182	2.3
コール・ローン等、その他	9,743,380	2.2
投資信託財産総額	455,099,991	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。  
\*当期末における外貨建て純資産（452,461,712千円）の投資信託財産総額（455,099,991千円）に対する比率は99.4%です。  
\*外貨建て資産は、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米ドル＝106.30円、1カナダドル＝82.46円、1英ポンド＝149.27円、1スイスフラン＝111.38円、1スウェーデンクローナ＝12.71円、1ノルウェークローネ＝13.54円、1デンマーククローネ＝17.57円、1ユーロ＝130.95円、1香港ドル＝13.54円、1シンガポールドル＝81.18円、1豪ドル＝81.76円、1ニュージーランドドル＝76.91円、1新シェケル＝30.43円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年4月2日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	457,256,523,637
コール・ローン等	7,358,421,996
株式(評価額)	434,672,468,713
投資信託受益証券(評価額)	15,961,476
投資証券(評価額)	10,668,182,276
未収入金	2,201,590,739
未収配当金	601,632,756
差入委託証拠金	1,738,265,681
(B) 負債	2,512,984,202
未払金	2,437,774,376
未払解約金	71,844,770
未払利息	4,356
その他未払費用	3,360,700
(C) 純資産総額(A-B)	454,743,539,435
元本	183,716,815,590
次期繰越損益金	271,026,723,845
(D) 受益権総口数	183,716,815,590口
1万円当たり基準価額(C/D)	24,752円

(注) 期首元本額は157,848,148,117円、期中追加設定元本額は49,564,279,714円、期中一部解約元本額は23,695,612,241円、1口当たり純資産額は2.4752円です。

## ○損益の状況 (2017年4月1日～2018年4月2日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	8,852,206,372
受取配当金	8,815,882,981
受取利息	9,956,529
その他収益金	28,639,530
支払利息	△ 2,272,668
(B) 有価証券売買損益	16,526,454,707
売買益	53,419,330,649
売買損	△ 36,892,875,942
(C) 先物取引等取引損益	609,061,281
取引益	1,104,865,376
取引損	△ 495,804,095
(D) 保管費用等	△ 44,982,203
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	25,942,740,157
(F) 前期繰越損益金	206,504,332,201
(G) 追加信託差損益金	74,480,399,073
(H) 解約差損益金	△ 35,900,747,586
(I) 計(E+F+G+H)	271,026,723,845
次期繰越損益金(I)	271,026,723,845

\* 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。

\* 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。

\* 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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	60,403,768,252
野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	32,999,732,915
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	16,480,377,326
野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	7,336,473,597
野村世界6資産分散投信(分配コース)	6,764,091,334
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,393,383,900
のむらップ・ファンド(普通型)	6,120,073,528
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,714,523,059
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,505,795,387
のむらップ・ファンド(積極型)	4,440,763,495
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	3,688,400,811
野村インデックスファンド・外国株式	3,572,487,698
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,741,108,774
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,630,926,716
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	2,450,799,019
野村外国株(含む新興国)インデックス B コース(野村投資一任口座向け)	1,793,990,076
マイバランスDC50	1,653,268,237
マイ・ロード	1,508,044,775

ファンド名	当期末 元本額
	円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,391,884,417
マイバランスDC70	1,319,877,016
のむらップ・ファンド(保守型)	1,035,730,143
マイバランスDC30	917,433,468
野村外国株インデックス Bコース(野村SMA・EW向け)	870,877,154
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	847,762,993
野村外国株式インデックスファンド	544,047,701
ノムラFoFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)	447,212,561
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	434,532,788
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	430,932,416
野村つみたて外国株投信	429,657,264
野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	406,260,726
野村DC運用戦略ファンド	380,742,340
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	334,803,381
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	305,837,359
ファンドラップ(ウェルズ・スクエア)外国株式	296,500,306
のむらップ・ファンド(やや積極型)	227,904,805
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	208,794,545

ファンド名	当期末
	元本額
	円
バランスセレクト70	167,453,388
バランスセレクト50	163,700,590
のむらップ・ファンド（やや保守型）	160,286,079
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	153,098,374
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数（為替ヘッジなし）連動型上場投信	149,113,545
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	124,532,124
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	93,264,601
野村資産設計ファンド2040	73,981,479
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	63,495,349
ネクストコア	62,177,227
バランスセレクト30	52,044,705
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	51,307,837
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	39,600,162
野村資産設計ファンド2030	38,709,082
野村資産設計ファンド2025	36,685,426
野村資産設計ファンド2035	29,161,830
野村資産設計ファンド2020	25,166,947
野村6資産均等バランス	24,434,244
野村資産設計ファンド2015	21,344,295
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	21,271,180
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	14,482,390
野村資産設計ファンド2050	14,270,581
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	13,331,256
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	12,704,484
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	11,607,280

ファンド名	当期末
	元本額
	円
インデックス・ブレンド（タイプV）	11,286,298
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	11,120,311
インデックス・ブレンド（タイプIII）	10,184,136
野村資産設計ファンド2045	9,688,465
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	4,959,357
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	3,863,569
インデックス・ブレンド（タイプII）	2,650,615
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	2,515,467
インデックス・ブレンド（タイプIV）	2,470,942
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	2,329,518
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	1,775,486
インデックス・ブレンド（タイプI）	1,636,844
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	1,502,693
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	1,038,609
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	1,034,444
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	1,012,765
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	585,268
野村資産設計ファンド（DC）2050	435,783
野村資産設計ファンド（DC）2040	174,321
野村資産設計ファンド（DC）2030	150,108
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	99,541
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	98,050
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	92,540
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	85,723

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 国内債券マザーファンド

## 運用報告書

第17期（決算日2018年5月10日）

作成対象期間（2017年5月11日～2018年5月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	NOMURA-BPI国債の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資は行いません。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額	ベンチマーク NOMURA-BPI国債		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
		騰 落 率	騰 落 率			
	円	%	%	%	%	百万円
13期(2014年 5 月12日)	12,400	1.8	1.8	99.1	—	6,349
14期(2015年 5 月11日)	12,749	2.8	2.8	99.3	—	6,933
15期(2016年 5 月10日)	13,701	7.5	7.5	99.5	—	8,223
16期(2017年 5 月10日)	13,380	△2.3	△2.3	99.5	—	16,780
17期(2018年 5 月10日)	13,482	0.8	0.8	99.6	—	23,470

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

NOMURA-BPI国債は、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。  
NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	ベンチマーク NOMURA-BPI国債		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2017年 5 月10日	円 13,380	% —	% —	% 99.5	% —
5 月 末	13,396	0.1	0.1	99.6	—
6 月 末	13,356	△0.2	△0.2	99.5	—
7 月 末	13,357	△0.2	△0.2	99.6	—
8 月 末	13,432	0.4	0.4	99.5	—
9 月 末	13,380	0.0	0.0	99.6	—
10月 末	13,380	0.0	0.0	99.5	—
11月 末	13,418	0.3	0.3	99.4	—
12月 末	13,428	0.4	0.4	99.7	—
2018年 1 月 末	13,405	0.2	0.2	99.5	—
2 月 末	13,460	0.6	0.6	99.3	—
3 月 末	13,482	0.8	0.8	99.6	—
4 月 末	13,470	0.7	0.7	99.5	—
(期 末) 2018年 5 月10日	13,482	0.8	0.8	99.6	—

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI国債です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首13,380円から期末13,482円に102円の値上がりとなりました。

日銀による長短金利を誘導目標とした金融政策などを背景に、国内債券利回りは横ばいとなりましたが、利金収入などからリターンはプラスとなり、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

海外中央銀行の金融緩和姿勢の後退懸念から、国内債券利回りは上昇（価格は下落）する局面もありました。しかしながら2018年2月以降は黒田日銀総裁の続投により、金利上昇抑制などの緩和的な市場環境が継続するとの期待感が広がったことや、米国が鉄鋼輸入に関して高い関税をかけることなどを発端として、保護主義的な通商政策が世界的な景気減速や貿易摩擦の拡大につながるなどの懸念が高まったことから、国内債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

当運用期間では国内債券利回りはほぼ変わらずとなりました。



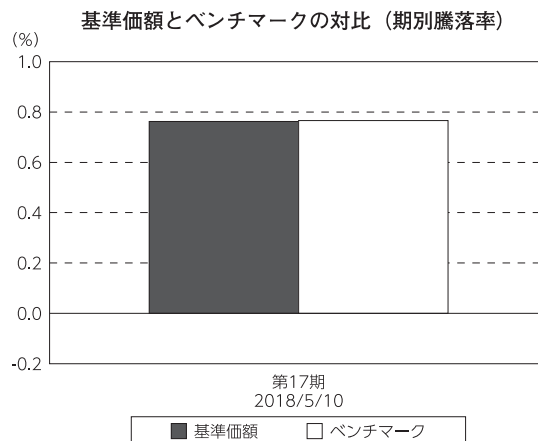
## ○当ファンドのポートフォリオ

NOMURA-BPI国債の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、デュレーション（金利感応度）などを考慮して選択した日本国債に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて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

今期の基準価額の騰落率は+0.8%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の+0.8%とほぼ同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

- ・ 資金流入に伴う取引で価格差や取引コストが生じること
- ・ ベンチマークとファンドで評価時価に違いがあること



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI国債です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、債券組入比率を高位に保ち、満期構成、デュレーション、流動性などを考慮して選択した日本国債に分散投資することでNOMURA-BPI国債との連動を高めるように運用を行ってまいります。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年 5 月11日～2018年 5 月10日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2017年 5 月11日～2018年 5 月10日)

### 公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円	千円
		30,769,413	24,110,993

\*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2017年 5 月11日～2018年 5 月10日)

### 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 30,769	百万円 3,869	% 12.6	百万円 24,110	百万円 1,155	% 4.8

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野村證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2018年 5 月10日現在)

### 国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 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
国債証券	千円	千円	%	%	%	%	%
	21,612,000 ( 10,000)	23,375,637 ( 14,429)	99.6 ( 0.1)	— (—)	64.0 ( 0.1)	25.0 ( —)	10.7 ( —)
合 計	21,612,000 ( 10,000)	23,375,637 ( 14,429)	99.6 ( 0.1)	— (—)	64.0 ( 0.1)	25.0 ( —)	10.7 ( —)

\* ( ) 内は非上場債で内書きです。

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*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。

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	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	
国庫債券	利付 (2年) 第378回	0.1	260,000	260,735	2019/7/15
国庫債券	利付 (2年) 第379回	0.1	380,000	381,151	2019/8/15
国庫債券	利付 (2年) 第380回	0.1	100,000	100,324	2019/9/15
国庫債券	利付 (2年) 第381回	0.1	100,000	100,343	2019/10/15
国庫債券	利付 (2年) 第382回	0.1	100,000	100,364	2019/11/15
国庫債券	利付 (2年) 第383回	0.1	100,000	100,384	2019/12/15
国庫債券	利付 (2年) 第385回	0.1	100,000	100,425	2020/2/15
国庫債券	利付 (2年) 第386回	0.1	170,000	170,753	2020/3/15
国庫債券	利付 (2年) 第387回	0.1	100,000	100,464	2020/4/15
国庫債券	利付 (5年) 第118回	0.2	110,000	110,414	2019/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第120回	0.2	110,000	110,501	2019/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第121回	0.1	80,000	80,256	2019/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第122回	0.1	120,000	120,445	2019/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第123回	0.1	280,000	281,170	2020/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第124回	0.1	320,000	321,520	2020/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第125回	0.1	430,000	432,287	2020/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第126回	0.1	360,000	362,120	2020/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第127回	0.1	310,000	311,999	2021/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第128回	0.1	350,000	352,401	2021/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第129回	0.1	300,000	302,226	2021/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第130回	0.1	210,000	211,635	2021/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第131回	0.1	180,000	181,463	2022/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第132回	0.1	210,000	211,776	2022/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第133回	0.1	200,000	201,796	2022/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第134回	0.1	250,000	252,372	2022/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第135回	0.1	80,000	80,800	2023/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第1回	2.4	10,000	14,429	2048/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第2回	2.2	30,000	41,897	2049/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第3回	2.2	60,000	84,211	2050/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第4回	2.2	35,000	49,353	2051/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第5回	2.0	40,000	54,232	2052/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第6回	1.9	60,000	79,727	2053/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第7回	1.7	50,000	63,422	2054/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第8回	1.4	60,000	70,548	2055/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第9回	0.4	90,000	76,751	2056/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第10回	0.9	110,000	110,958	2057/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第301回	1.5	45,000	45,819	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第302回	1.4	40,000	40,684	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第303回	1.4	45,000	45,945	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第304回	1.3	30,000	30,589	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第305回	1.3	110,000	112,547	2019/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第306回	1.4	45,000	46,281	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第307回	1.3	30,000	30,798	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第308回	1.3	30,000	30,907	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第309回	1.1	130,000	133,381	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第310回	1.0	30,000	30,799	2020/9/20

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	
国庫債券	利付 (10年)	第311回	0.8	190,000	194,161	2020/ 9 /20
国庫債券	利付 (10年)	第312回	1.2	70,000	72,429	2020/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第314回	1.1	30,000	31,053	2021/ 3 /20
国庫債券	利付 (10年)	第315回	1.2	70,000	72,895	2021/ 6 /20
国庫債券	利付 (10年)	第316回	1.1	130,000	134,971	2021/ 6 /20
国庫債券	利付 (10年)	第317回	1.1	30,000	31,235	2021/ 9 /20
国庫債券	利付 (10年)	第318回	1.0	80,000	83,024	2021/ 9 /20
国庫債券	利付 (10年)	第319回	1.1	70,000	73,083	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第320回	1.0	90,000	93,638	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第321回	1.0	150,000	156,450	2022/ 3 /20
国庫債券	利付 (10年)	第322回	0.9	130,000	135,085	2022/ 3 /20
国庫債券	利付 (10年)	第323回	0.9	70,000	72,903	2022/ 6 /20
国庫債券	利付 (10年)	第324回	0.8	150,000	155,602	2022/ 6 /20
国庫債券	利付 (10年)	第325回	0.8	210,000	218,278	2022/ 9 /20
国庫債券	利付 (10年)	第326回	0.7	240,000	248,892	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第327回	0.8	180,000	187,504	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第328回	0.6	230,000	237,856	2023/ 3 /20
国庫債券	利付 (10年)	第329回	0.8	280,000	292,866	2023/ 6 /20
国庫債券	利付 (10年)	第330回	0.8	220,000	230,549	2023/ 9 /20
国庫債券	利付 (10年)	第331回	0.6	120,000	124,460	2023/ 9 /20
国庫債券	利付 (10年)	第332回	0.6	220,000	228,494	2023/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第333回	0.6	240,000	249,602	2024/ 3 /20
国庫債券	利付 (10年)	第334回	0.6	200,000	208,222	2024/ 6 /20
国庫債券	利付 (10年)	第335回	0.5	230,000	238,300	2024/ 9 /20
国庫債券	利付 (10年)	第336回	0.5	60,000	62,229	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第337回	0.3	150,000	153,583	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第338回	0.4	240,000	247,514	2025/ 3 /20
国庫債券	利付 (10年)	第339回	0.4	280,000	288,988	2025/ 6 /20
国庫債券	利付 (10年)	第340回	0.4	335,000	346,008	2025/ 9 /20
国庫債券	利付 (10年)	第341回	0.3	270,000	277,006	2025/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第342回	0.1	280,000	282,864	2026/ 3 /20
国庫債券	利付 (10年)	第343回	0.1	230,000	232,240	2026/ 6 /20
国庫債券	利付 (10年)	第344回	0.1	240,000	242,208	2026/ 9 /20
国庫債券	利付 (10年)	第345回	0.1	250,000	252,152	2026/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第346回	0.1	330,000	332,626	2027/ 3 /20
国庫債券	利付 (10年)	第347回	0.1	260,000	261,890	2027/ 6 /20
国庫債券	利付 (10年)	第348回	0.1	160,000	161,120	2027/ 9 /20
国庫債券	利付 (10年)	第349回	0.1	220,000	221,368	2027/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第350回	0.1	190,000	191,024	2028/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年)	第 3 回	2.3	40,000	50,276	2030/ 5 /20
国庫債券	利付 (30年)	第 5 回	2.2	10,000	12,594	2031/ 5 /20
国庫債券	利付 (30年)	第 6 回	2.4	10,000	12,923	2031/11/20
国庫債券	利付 (30年)	第 7 回	2.3	15,000	19,270	2032/ 5 /20
国庫債券	利付 (30年)	第 8 回	1.8	20,000	24,398	2032/11/22
国庫債券	利付 (30年)	第 9 回	1.4	20,000	23,274	2032/12/20
国庫債券	利付 (30年)	第10回	1.1	30,000	33,628	2033/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年)	第11回	1.7	10,000	12,093	2033/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年)	第12回	2.1	10,000	12,699	2033/ 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	
国庫債券	利付 (30年) 第13回		2.0	10,000	12,563	2033/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第14回		2.4	30,000	39,596	2034/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第15回		2.5	10,000	13,380	2034/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第16回		2.5	10,000	13,410	2034/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第17回		2.4	20,000	26,561	2034/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第18回		2.3	20,000	26,270	2035/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第19回		2.3	10,000	13,169	2035/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第20回		2.5	10,000	13,518	2035/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第21回		2.3	10,000	13,201	2035/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第22回		2.5	20,000	27,135	2036/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第23回		2.5	40,000	54,368	2036/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第24回		2.5	10,000	13,615	2036/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第25回		2.3	20,000	26,536	2036/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第26回		2.4	80,000	107,772	2037/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第27回		2.5	20,000	27,375	2037/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第28回		2.5	30,000	41,172	2038/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第29回		2.4	120,000	163,038	2038/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第30回		2.3	50,000	67,189	2039/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第31回		2.2	60,000	79,686	2039/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第32回		2.3	90,000	121,800	2040/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第33回		2.0	130,000	168,373	2040/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第34回		2.2	60,000	80,510	2041/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第35回		2.0	122,000	158,950	2041/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第36回		2.0	70,000	91,406	2042/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第37回		1.9	80,000	102,869	2042/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第38回		1.8	90,000	113,977	2043/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第39回		1.9	80,000	103,144	2043/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第40回		1.8	30,000	38,007	2043/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第41回		1.7	60,000	74,651	2043/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第42回		1.7	60,000	74,689	2044/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第43回		1.7	60,000	74,729	2044/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第44回		1.7	50,000	62,376	2044/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第45回		1.5	90,000	107,967	2044/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第46回		1.5	100,000	119,984	2045/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第47回		1.6	60,000	73,476	2045/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第48回		1.4	80,000	94,047	2045/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第49回		1.4	60,000	70,534	2045/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第50回		0.8	110,000	112,695	2046/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第51回		0.3	50,000	44,776	2046/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第52回		0.5	40,000	37,793	2046/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第53回		0.6	60,000	58,153	2046/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第54回		0.8	70,000	71,423	2047/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第55回		0.8	80,000	81,540	2047/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第56回		0.8	80,000	81,452	2047/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第57回		0.8	60,000	61,022	2047/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第58回		0.8	80,000	81,272	2048/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第43回		2.9	10,000	10,414	2019/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第44回		2.5	10,000	10,489	2020/ 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	
国庫債券	利付 (20年) 第45回	2.4	10,000	10,471	2020/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第46回	2.2	5,000	5,247	2020/ 6 /22
国庫債券	利付 (20年) 第47回	2.2	15,000	15,826	2020/ 9 /21
国庫債券	利付 (20年) 第48回	2.5	30,000	32,064	2020/12/21
国庫債券	利付 (20年) 第49回	2.1	40,000	42,557	2021/ 3 /22
国庫債券	利付 (20年) 第52回	2.1	25,000	26,874	2021/ 9 /21
国庫債券	利付 (20年) 第53回	2.1	10,000	10,803	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第54回	2.2	10,000	10,839	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第55回	2.0	10,000	10,817	2022/ 3 /21
国庫債券	利付 (20年) 第56回	2.0	10,000	10,868	2022/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第57回	1.9	10,000	10,827	2022/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第58回	1.9	10,000	10,878	2022/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第59回	1.7	30,000	32,501	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第60回	1.4	10,000	10,694	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第61回	1.0	10,000	10,534	2023/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第62回	0.8	10,000	10,459	2023/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第63回	1.8	10,000	10,972	2023/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第64回	1.9	10,000	11,069	2023/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第65回	1.9	10,000	11,115	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第66回	1.8	20,000	22,119	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第67回	1.9	10,000	11,161	2024/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第68回	2.2	10,000	11,338	2024/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第69回	2.1	30,000	33,828	2024/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第70回	2.4	40,000	46,048	2024/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第71回	2.2	10,000	11,389	2024/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第72回	2.1	20,000	22,751	2024/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第73回	2.0	10,000	11,359	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第74回	2.1	10,000	11,426	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第75回	2.1	40,000	45,901	2025/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第76回	1.9	17,000	19,274	2025/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第77回	2.0	15,000	17,110	2025/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第78回	1.9	10,000	11,387	2025/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第79回	2.0	10,000	11,458	2025/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第80回	2.1	10,000	11,529	2025/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第81回	2.0	10,000	11,506	2025/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第82回	2.1	15,000	17,370	2025/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第83回	2.1	15,000	17,443	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第84回	2.0	50,000	57,764	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第85回	2.1	13,000	15,174	2026/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第86回	2.3	10,000	11,830	2026/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第88回	2.3	20,000	23,768	2026/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第90回	2.2	20,000	23,698	2026/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第91回	2.3	10,000	11,933	2026/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第92回	2.1	30,000	35,409	2026/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第93回	2.0	20,000	23,522	2027/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第94回	2.1	20,000	23,699	2027/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第95回	2.3	10,000	12,073	2027/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第96回	2.1	15,000	17,836	2027/ 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	
国庫債券	利付 (20年) 第97回	2.2	50,000	60,157	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第99回	2.1	30,000	35,934	2027/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第100回	2.2	20,000	24,229	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第101回	2.4	20,000	24,622	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第102回	2.4	20,000	24,715	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第103回	2.3	25,000	30,642	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第104回	2.1	10,000	12,055	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第105回	2.1	70,000	84,660	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第106回	2.2	10,000	12,197	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第107回	2.1	20,000	24,263	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第108回	1.9	80,000	95,369	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第109回	1.9	30,000	35,857	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第110回	2.1	90,000	109,509	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第111回	2.2	10,000	12,314	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第112回	2.1	35,000	42,714	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第113回	2.1	110,000	134,638	2029/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第114回	2.1	130,000	159,567	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第115回	2.2	50,000	61,944	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第116回	2.2	10,000	12,424	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第117回	2.1	60,000	73,845	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第118回	2.0	40,000	48,888	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第119回	1.8	50,000	59,919	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第120回	1.6	110,000	129,200	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第121回	1.9	100,000	121,312	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第122回	1.8	20,000	24,019	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第123回	2.1	100,000	124,134	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第124回	2.0	20,000	24,564	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第125回	2.2	100,000	125,621	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第126回	2.0	30,000	36,930	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第127回	1.9	20,000	24,368	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第128回	1.9	70,000	85,474	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第129回	1.8	20,000	24,165	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第130回	1.8	70,000	84,740	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第131回	1.7	35,000	41,913	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第132回	1.7	30,000	35,962	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第133回	1.8	70,000	84,896	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第134回	1.8	30,000	36,447	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第135回	1.7	30,000	36,043	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第136回	1.6	30,000	35,639	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第137回	1.7	40,000	48,134	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第138回	1.5	50,000	58,798	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第139回	1.6	10,000	11,896	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第140回	1.7	140,000	168,728	2032/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第141回	1.7	140,000	168,852	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第142回	1.8	20,000	24,421	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第143回	1.6	130,000	155,140	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第144回	1.5	30,000	35,371	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第145回	1.7	80,000	96,748	2033/6/20

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	
国庫債券	利付 (20年) 第146回	1.7	110,000	133,103	2033/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第147回	1.6	210,000	251,084	2033/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第148回	1.5	70,000	82,652	2034/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第149回	1.5	140,000	165,433	2034/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第150回	1.4	90,000	105,030	2034/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第151回	1.2	120,000	136,225	2034/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第152回	1.2	100,000	113,440	2035/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第153回	1.3	120,000	138,068	2035/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第154回	1.2	90,000	102,019	2035/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第155回	1.0	100,000	109,961	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第156回	0.4	80,000	79,668	2036/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第157回	0.2	120,000	115,072	2036/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第158回	0.5	110,000	111,026	2036/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第159回	0.6	110,000	112,735	2036/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第160回	0.7	80,000	83,259	2037/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第161回	0.6	70,000	71,470	2037/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第162回	0.6	140,000	142,597	2037/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第163回	0.6	90,000	91,525	2037/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第164回	0.5	90,000	89,676	2038/ 3 /20
合 計			21,612,000	23,375,637	

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2018年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 23,375,637	% 99.5
コール・ローン等、その他	114,114	0.5
投資信託財産総額	23,489,751	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。



○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	23,489,751,296
コール・ローン等	67,587,941
公社債(評価額)	23,375,637,570
未收利息	40,721,930
前払費用	5,803,855
(B) 負債	18,867,024
未払解約金	18,866,929
未払利息	95
(C) 純資産総額(A－B)	23,470,884,272
元本	17,409,321,655
次期繰越損益金	6,061,562,617
(D) 受益権総口数	17,409,321,655口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,482円

(注) 期首元本額は12,541,631,820円、期中追加設定元本額は23,462,757,889円、期中一部解約元本額は18,595,068,054円、1口当たり純資産額は1.3482円です。

○損益の状況 (2017年5月11日～2018年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	146,934,124
受取利息	147,137,912
支払利息	△ 203,788
(B) 有価証券売買損益	21,741,160
売買益	110,325,990
売買損	△ 88,584,830
(C) 当期損益金(A＋B)	168,675,284
(D) 前期繰越損益金	4,239,236,151
(E) 追加信託差損益金	7,993,291,609
(F) 解約差損益金	△6,339,640,427
(G) 計(C＋D＋E＋F)	6,061,562,617
次期繰越損益金(G)	6,061,562,617

\*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。  
 \*損益の状況の中で(E)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。  
 \*損益の状況の中で(F)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。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	8,975,496,449
野村日本国債インデックスファンド(確定拠出年金向け)	4,449,027,531
野村DC運用戦略ファンド	1,880,490,046
バランスセレクト50	624,671,139
バランスセレクト30	559,648,333
ネクストコア	297,879,584
バランスセレクト70	262,490,528
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	132,246,393
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	129,862,802
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	50,014,102
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	24,456,198
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	23,038,550

○お知らせ

信用リスク集中回避のための投資制限に関する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2017年11月9日＞

# 野村マネー マザーファンド

## 運用報告書

第16期（決算日2018年8月20日）

作成対象期間（2017年8月22日～2018年8月20日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	本邦通貨表示の公社債等に投資を行い、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落	中 率			
	円		%	%	%	百万円
12期(2014年 8 月19日)	10, 199		0. 1	59. 7	—	8, 648
13期(2015年 8 月19日)	10, 206		0. 1	44. 7	—	22, 034
14期(2016年 8 月19日)	10, 211		0. 0	68. 6	—	19, 722
15期(2017年 8 月21日)	10, 208		△0. 0	64. 0	—	17, 754
16期(2018年 8 月20日)	10, 206		△0. 0	38. 7	—	13, 511

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\* 当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

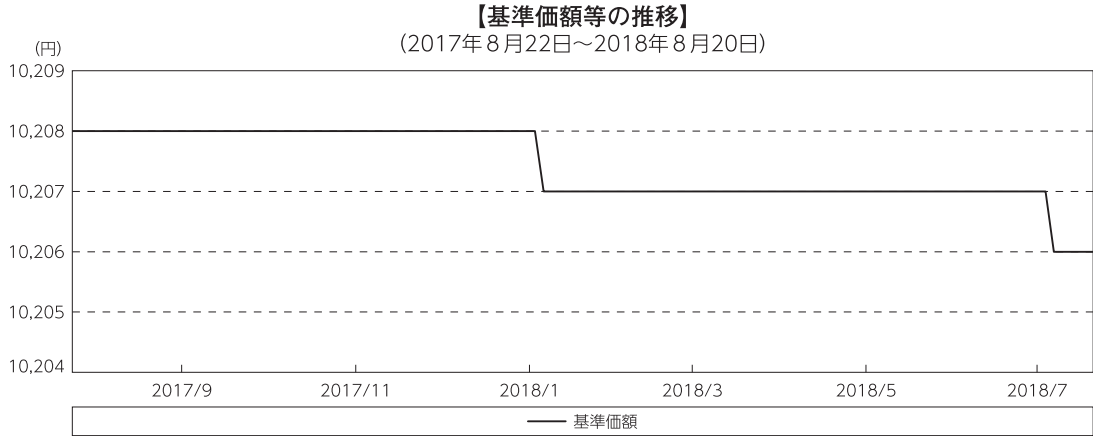
年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落	率		
(期 首) 2017年 8 月21日	円		%	%	%
	10, 208		—	64. 0	—
8 月末	10, 208		0. 0	56. 6	—
9 月末	10, 208		0. 0	63. 9	—
10 月末	10, 208		0. 0	51. 7	—
11 月末	10, 208		0. 0	66. 0	—
12 月末	10, 208		0. 0	51. 5	—
2018年 1 月末	10, 208		0. 0	46. 2	—
2 月末	10, 207		△0. 0	55. 1	—
3 月末	10, 207		△0. 0	45. 2	—
4 月末	10, 207		△0. 0	46. 3	—
5 月末	10, 207		△0. 0	40. 7	—
6 月末	10, 207		△0. 0	24. 4	—
7 月末	10, 207		△0. 0	35. 3	—
(期 末) 2018年 8 月20日	10, 206		△0. 0	38. 7	—

\* 騰落率は期首比です。

\* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

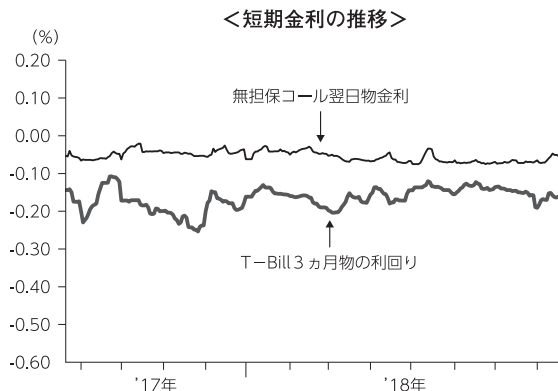
投資している短期有価証券やコール・ローンなどのマイナス金利環境を要因とする支払利息等。

## ○投資環境

国内経済は、高水準にある企業収益や雇用・所得環境の改善継続等を背景に、緩やかな回復基調が続きました。

このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2018年7月には金融緩和の持続性を高める観点から、政策金利の「フォワードガイダンス」追加、長期金利目標の柔軟化等の「強力な金融緩和継続のための枠組み強化」を導入しました。

マイナス金利政策のもと、無担保コール翌日物金利は $-0.05\%$ 程度、T-Bill（国庫短期証券）3ヵ月物の利回りは概ね $-0.1\%$ 台で推移しました。



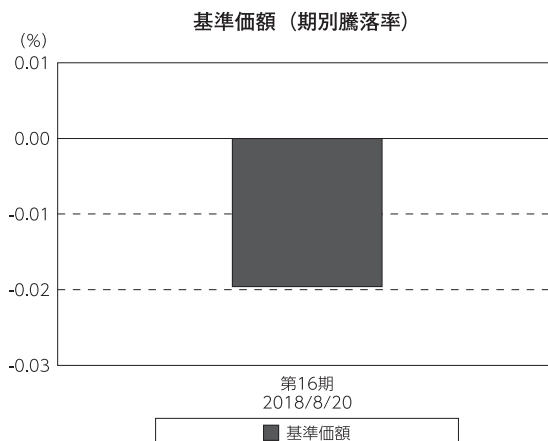
## ○当ファンドのポートフォリオ

残存1年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図りました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



## ◎今後の運用方針

残存１年以内の公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用いたします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○１万口当たりの費用明細

(2017年８月22日～2018年８月20日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2017年８月22日～2018年８月20日)

### 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	690,234	690,233
	地方債証券	3,695,131	— ( 7,082,100)
	特殊債券	13,257,967	— (13,445,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	7,946,048	— (10,449,000)

\*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は償還等による増減分です。

\*社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

### その他有価証券

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	コマーシャル・ペーパー	22,599,981	— (19,100,000)

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

(2017年8月22日～2018年8月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 24,899	百万円 1,719	% 6.9	百万円 —	百万円 —	% —

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野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2018年8月20日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちB B格以下 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	%	%	%	%	%
地方債証券	622,000	624,351	4.6	—	—	—	4.6
	( 622,000)	( 624,351)	( 4.6)	(—)	(—)	(—)	( 4.6)
特殊債券 (除く金融債)	1,340,000	1,342,467	9.9	—	—	—	9.9
	(1,340,000)	(1,342,467)	( 9.9)	(—)	(—)	(—)	( 9.9)
金融債券	1,750,000	1,751,319	13.0	—	—	—	13.0
	(1,750,000)	(1,751,319)	(13.0)	(—)	(—)	(—)	(13.0)
普通社債券 (含む投資法人債券)	1,500,000	1,505,675	11.1	—	—	—	11.1
	(1,500,000)	(1,505,675)	(11.1)	(—)	(—)	(—)	(11.1)
合 計	5,212,000	5,223,813	38.7	—	—	—	38.7
	(5,212,000)	(5,223,813)	(38.7)	(—)	(—)	(—)	(38.7)

\* ( ) 内は非上場債で内書きです。

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*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。

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(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
地方債証券		%	千円	千円	
神奈川県	公募第158回	1. 53	30, 000	30, 150	2018/12/20
大阪府	公募第322回	1. 62	252, 000	253, 785	2019/ 1 /29
大阪府	公募（5年）第100回	0. 244	300, 000	300, 210	2018/11/28
横浜市	公募公債平成20年度5回	1. 58	40, 000	40, 205	2018/12/20
小	計		622, 000	624, 351	
特殊債券(除く金融債)					
地方公営企業等金融機構債券	政府保証第1回	1. 6	110, 000	110, 259	2018/10/16
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第44回	1. 62	130, 000	130, 696	2018/12/20
地方公共団体金融機構債券	F39回	0. 808	100, 000	100, 026	2018/ 8 /28
中日本高速道路債券	財投機関債第5回	1. 86	1, 000, 000	1, 001, 484	2018/ 9 /20
小	計		1, 340, 000	1, 342, 467	
金融債券					
農林債券	利付第762回い号	0. 3	700, 000	700, 563	2018/11/27
しんきん中金債券	利付第287回	0. 3	450, 000	450, 266	2018/10/26
しんきん中金債券	利付第288回	0. 3	600, 000	600, 489	2018/11/27
小	計		1, 750, 000	1, 751, 319	
普通社債券(含む投資法人債券)					
関西電力	第469回	1. 7	300, 000	300, 916	2018/10/25
トヨタ自動車	第8回社債間限定同等特約付	2. 01	100, 000	100, 664	2018/12/20
みずほ銀行	第35回特定社債間限定同順位特約付	0. 285	200, 000	200, 244	2019/ 1 /25
住友不動産	第91回社債間限定同順位特約付	0. 355	100, 000	100, 065	2018/10/29
N T T ドコモ	第17回社債間限定同順位特約付	1. 77	200, 000	200, 305	2018/ 9 /20
N T T データ	第22回社債間限定同順位特約付	1. 78	600, 000	603, 478	2018/12/20
小	計		1, 500, 000	1, 505, 675	
合	計		5, 212, 000	5, 223, 813	

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コマーシャル・ペーパー	4,399,994	32.6

\* 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2018年8月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	5,223,813	38.7
その他有価証券	4,399,994	32.6
コール・ローン等、その他	3,887,777	28.7
投資信託財産総額	13,511,584	100.0

\* 金額の単位未満は切り捨て。



○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年8月20日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	13,511,584,519
コール・ローン等	3,870,450,958
公社債(評価額)	5,223,813,703
その他有価証券	4,399,994,713
未収利息	7,275,528
前払費用	10,049,617
(B) 負債	7,765
未払利息	7,765
(C) 純資産総額(A－B)	13,511,576,754
元本	13,238,234,160
次期繰越損益金	273,342,594
(D) 受益権総口数	13,238,234,160口
1万口当たり基準価額(C／D)	10,206円

(注) 期首元本額は17,392,173,897円、期中追加設定元本額は3,349,850,829円、期中一部解約元本額は7,503,790,566円、1口当たり純資産額は1.0206円です。

○損益の状況 (2017年8月22日～2018年8月20日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	61,118,125
受取利息	63,841,658
支払利息	△ 2,723,533
(B) 有価証券売買損益	△ 63,824,623
売買損	△ 63,824,623
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 2,706,498
(D) 前期繰越損益金	361,951,541
(E) 追加信託差損益金	69,639,721
(F) 解約差損益金	△155,542,170
(G) 計(C＋D＋E＋F)	273,342,594
次期繰越損益金(G)	273,342,594

\*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。  
\*損益の状況の中で(E)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。  
\*損益の状況の中で(F)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。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	5,423,785,404
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)	3,324,627,145
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプライス(適格機関投資家専用)	3,161,244,481
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Zプライス(適格機関投資家専用)	389,222,673
野村日本ブランド株投資(マネーボールファンド)年2回決算型	184,452,030
野村世界高金利通貨投信	151,953,753
野村日経225 ショート・ファンド(適格機関投資家専用)	120,493,731
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134
ノムラ・アジア・シリーズ(マネーボール・ファンド)	68,081,734
野村高金利国際機関債投信(毎月分配型)	49,354,623
野村米国ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	21,108,661
ネクストコア	19,922,154
野村世界業種別投資シリーズ(マネーボール・ファンド)	15,498,603
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(マネーボールファンド)年2回決算型	13,341,293
野村新中国株投資 マネーボール・ファンド	12,802,829
野村新エマージング債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	11,360,223
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405
野村新米国ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	6,950,162
第12回 野村短期公社債ファンド	6,664,982
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831
野村新興国消費関連株投信 マネーボール・ファンド	5,061,963
第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169
野村グローバルCB投信(マネーボールファンド)年2回決算型	3,907,760
野村ビクテ・ヘルスケア マネーボール・ファンド	3,546,551

ファンド名	当期末 元本額
	円
第1回 野村短期公社債ファンド	3,037,421
米国変動好金利ファンド Aコース	2,952,997
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729
第10回 野村短期公社債ファンド	1,959,728
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757
第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(マネーボールファンド)年2回決算型	1,230,043
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981
野村・グリーン・テクノロジー マネーボール・ファンド	1,019,915
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型	984,252

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース) 毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(円コース) 年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(豪ドルコース) 年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(ブラジルレアルコース) 年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース) 毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース) 毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資(円コース) 年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース) 年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース) 年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド(円コース) 毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース) 毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース) 毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(円コース) 年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース) 年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース) 年2回決算型	983,672
野村テンプルトン・トータル・リターン Aコース	983,381
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンプルトン・トータル・リターン Dコース	983,381
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース) 毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース) 年2回決算型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース) 年2回決算型	983,091
野村アジアハイ・イールド債券投資(円コース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投資(円コース) 年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投資(アジア通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,898
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	982,609
野村日本ブランド株投資(円コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース) 毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース) 年2回決算型	982,609
野村米国ハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,609
野村新世界高金利通貨投資	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資(円コース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース) 毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース) 年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資(円コース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース) 年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資(円コース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資(豪ドルコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資(南アフリカランドコース) 毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投資(トルコリラコース) 毎月分配型	982,608

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村新米国ハイ・イールド債券投資(ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投資 Aコース	982,608
野村新エマージング債券投資(円コース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投資(インドネシアルピアコース) 毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投資(円コース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投資(ブラジルレアルコース) 年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投資(中国元コース) 年2回決算型	982,608
野村アジアCB投資(毎月分配型)	982,608
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(アジア通貨コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(円コース) 年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投資(豪ドルコース) 毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投資(中国元コース) 毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(円コース) 毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投資(資源国通貨コース) 毎月分配型	982,607
野村日本高配当株プレミアム(円コース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(円コース) 年2回決算型	982,415
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,415
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース) 毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース) 年2回決算型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース) 年2回決算型	982,029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547
野村通貨選択日本株投資(米ドルコース) 毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投資(ブラジルレアルコース) 毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投資(メキシコペソコース) 毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投資(米ドルコース) 年2回決算型	981,451
野村通貨選択日本株投資(メキシコペソコース) 年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
米国変動好金利ファンド Bコース	981,066
野村グローバルボンド投資 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投資 Dコース	980,489
野村グローバルボンド投資 Fコース	980,489
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース) 毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース) 年2回決算型	980,297
ノムラ THE ASIA Bコース	979,912
グローバル・ストック Bコース	979,528
グローバル・ストック Dコース	979,528
第7回 野村短期公社債ファンド	686,093
野村通貨選択日本株投資(インドルビーコース) 毎月分配型	568,479
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401
野村通貨選択日本株投資(豪ドルコース) 毎月分配型	457,265
野村通貨選択日本株投資(豪ドルコース) 年2回決算型	434,099
野村通貨選択日本株投資(ブラジルレアルコース) 年2回決算型	406,687
野村通貨選択日本株投資(インドルビーコース) 年2回決算型	220,902
野村通貨選択日本株投資(トルコリラコース) 毎月分配型	123,377
野村米国ハイ・イールド債券投資(通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,262
野村米国ハイ・イールド債券投資(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投資(ユーロコース) 毎月分配型	98,261

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース) 年2回決算型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(米ドルコース) 毎月分配型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(米ドルコース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース) 年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資(円コース) 毎月分配型	98,261
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投資(通貨セレクトコース) 年2回決算型	98,261
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース) 年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース) 年2回決算型	98,260
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース	98,260
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース) 年2回決算型	98,260
ノムラ THE EUROPE Aコース	98,117
ノムラ THE EUROPE Bコース	98,117
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
ノムラ THE ASIA Aコース	97,992
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース) 毎月分配型	80,956
野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 毎月分配型	58,906
野村通貨選択日本株投信(中国元コース) 年2回決算型	57,201
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース) 年2回決算型	52,622
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース) 年2回決算型	36,702
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース) 年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース) 年2回決算型	9,826

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース) 年2回決算型	9,826
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンブルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型	9,809
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,808
野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資(米ドルコース) 年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース) 年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース) 年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース) 毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース) 年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース) 年2回決算型	9,803
野村新興国高配当株トリプルウイング ブラジルリアル毎月分配型	9,803
ビムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)	9,803
ビムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)	9,803
ビムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり) 毎月分配型	9,797
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり) 年2回決算型	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース) 年2回決算型	4,908
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース) 毎月分配型	1,963

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 外国債券マザーファンド

## 運用報告書

第17期（決算日2018年5月10日）

作成対象期間（2017年5月11日～2018年5月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。 外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

# ○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準	価 額	ベンチマーカー	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		期 中 騰 落 率				
	円	%		%	%	百万円
13期(2014年5月12日)	20,704	5.2	209.27	6.3	98.6	— 293,247
14期(2015年5月11日)	23,251	12.3	236.29	12.9	98.9	— 526,058
15期(2016年5月10日)	21,725	△ 6.6	220.26	△ 6.8	99.0	— 632,898
16期(2017年5月10日)	22,009	1.3	223.71	1.6	99.0	— 664,754
17期(2018年5月10日)	22,325	1.4	226.02	1.0	99.0	— 616,573

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*ベンチマーク（＝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、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日  
前日の指数値をもとにしています。  
\*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により運営されている債券インデックスで  
す。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。こ  
のインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、  
またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利は  
FTSE Fixed Income LLCに帰属します。  
※名称変更しております（旧名称はシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））。  
(出所) FTSE Fixed Income LLC

# ○当期中の基準価額と市況等の推移

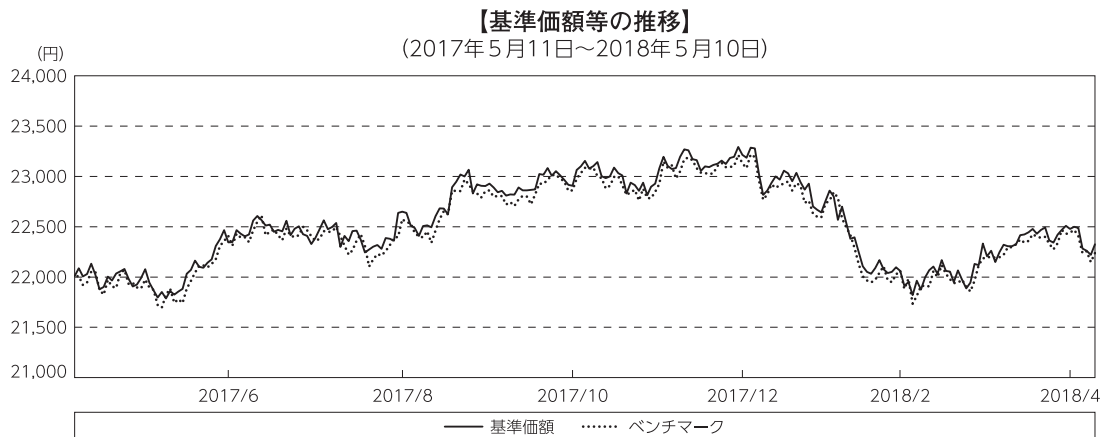
年          月          日	基          準	価          額	ベン          チ	マ          ー	債          券	債券
		騰          落          率		騰          落          率		
(期  首)	円	%		%	%	%
2017年5月10日	22,009	－	223.71	－	99.0	－
5月末	21,924	△0.4	222.56	△0.5	99.1	－
6月末	22,344	1.5	227.78	1.8	99.0	－
7月末	22,327	1.4	227.76	1.8	98.9	－
8月末	22,650	2.9	229.48	2.6	98.6	－
9月末	22,904	4.1	232.29	3.8	99.0	－
10月末	22,907	4.1	232.37	3.9	99.0	－
11月末	22,928	4.2	232.25	3.8	99.1	－
12月末	23,214	5.5	235.10	5.1	99.0	－
2018年1月末	22,643	2.9	229.63	2.6	98.9	－
2月末	22,061	0.2	224.27	0.3	99.0	－
3月末	22,207	0.9	225.62	0.9	98.8	－
4月末	22,479	2.1	228.11	2.0	98.8	－
(期  末)						
2018年5月10日	22,325	1.4	226.02	1.0	99.0	－

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首22,009円から期末22,325円へと上昇し、値上がり額は316円となりました。

利金収入などから外国債券のリターンがプラスとなったこと、ECB（欧州中央銀行）による金融緩和姿勢の後退観測などからユーロが対円で上昇（円安）したことなどを受けて、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

当運用期間では、米国における継続的な政策金利の引き上げに伴い米国債券利回りは短期債中心に上昇（価格は下落）しました。一方、ユーロ圏ではECB（欧州中央銀行）による金融緩和姿勢の後退懸念などの金利上昇要因はありましたが、周縁国の財政改善期待などを背景に、債券利回りは周縁国を中心に低下（価格は上昇）しました。外国債券全体の利回りは米国を中心に上昇しましたが、利金収入などから外国債券のリターンはプラスとなりました。

為替市場は、日米の内外金利差拡大などプラス要因はありましたが、米国の保護主義的な通商政策などを受けて米ドルは対円で下落（円高）しました。一方、ECBによる金融緩和姿勢の後退観測などからユーロは対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

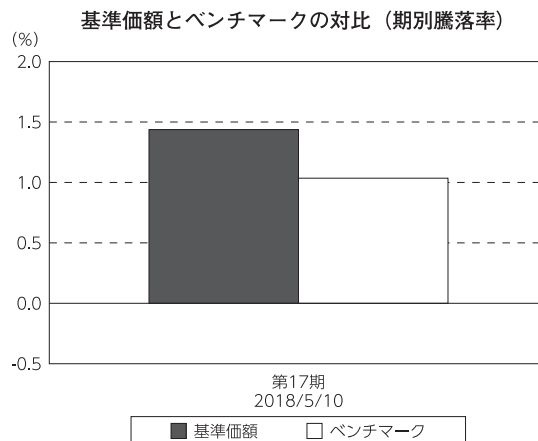
今期の基準価額の騰落率は+1.4%となり、ベンチマークの+1.0%を0.4ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

### （その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること



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

## ◎今後の運用方針

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることでFTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年 5 月11日～2018年 5 月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 2	% 0.011	(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)	(0.011)	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)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	2	0.011	
期中の平均基準価額は、22,549円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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 5 月11日～2018年 5 月10日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 671,739	千米ドル 764,566
	カナダ	国債証券	千カナダドル 55,496	千カナダドル 61,013
	イギリス	国債証券	千英ポンド 38,316	千英ポンド 71,762
	スイス	国債証券	千スイスフラン 54	千スイスフラン 915
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 24,268	千スウェーデンクローナ 62,157
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 6,555	千ノルウェークローネ 8,950
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 24,060	千デンマーククローネ 51,829
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	50,398	73,216
	イタリア	国債証券	84,161	111,780
	フランス	国債証券	47,098	100,316



			買付額	売付額
外国	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	オランダ	国債証券	4,993	25,936
	スペイン	国債証券	78,637	68,867
	ベルギー	国債証券	11,736	26,221
	オーストリア	国債証券	9,528	22,689
	フィンランド	国債証券	6,736	14,259
	アイルランド	国債証券	29,384	37,762
	ポーランド	国債証券	千ズロチ 17,879	千ズロチ 35,086
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 4,661	千シンガポールドル 4,697
	マレーシア	国債証券	千リンギ 12,597	千リンギ 10,226
	オーストラリア	国債証券	千豪ドル 37,044	千豪ドル 43,437
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 126,320	千メキシコペソ 235,281
	南アフリカ	国債証券	千ランド 61,484	千ランド 54,915

\*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

\*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2017年5月11日～2018年5月10日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A			売付額等 C		
		うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 52,198	百万円 179	% 0.3	百万円 111,149	百万円 797	% 0.7

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野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2018年5月10日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	2,387,670	2,389,838	262,786,626	42.6	—	19.0	16.2	7.4
カナダ	千カナダドル 142,030	千カナダドル 153,348	13,125,057	2.1	—	1.0	0.6	0.5
イギリス	千英ポンド 228,410	千英ポンド 286,902	42,719,734	6.9	—	5.3	1.6	0.1
スイス	千スイスフラン 7,950	千スイスフラン 9,570	1,046,419	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 164,500	千スウェーデンクローナ 187,827	2,370,380	0.4	—	0.2	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 128,700	千ノルウェークローネ 135,451	1,843,500	0.3	—	0.2	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 170,470	千デンマーククローネ 209,359	3,659,606	0.6	—	0.4	0.1	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	248,300	307,878	40,095,023	6.5	—	4.4	1.9	0.2
イタリア	406,680	492,400	64,125,326	10.4	—	6.2	2.9	1.4
フランス	377,400	471,126	61,354,782	10.0	—	6.6	2.4	0.9
オランダ	78,350	94,748	12,339,148	2.0	—	1.3	0.5	0.2
スペイン	261,700	323,797	42,168,198	6.8	—	4.2	1.5	1.1
ベルギー	90,900	116,182	15,130,504	2.5	—	1.9	0.5	0.1
オーストリア	50,800	63,361	8,251,585	1.3	—	1.0	0.3	0.0
フィンランド	21,900	24,064	3,133,863	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	35,760	40,153	5,229,130	0.8	—	0.5	0.3	0.0
ポーランド	千ズロチ 120,000	千ズロチ 127,301	3,889,073	0.6	—	0.3	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 29,930	千シンガポールドル 30,419	2,481,332	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千リンギ 109,700	千リンギ 108,996	3,034,473	0.5	—	0.2	0.2	0.1
オーストラリア	千豪ドル 147,930	千豪ドル 157,206	12,897,237	2.1	—	1.3	0.6	0.2
メキシコ	千メキシコペソ 845,600	千メキシコペソ 854,134	4,800,234	0.8	—	0.5	0.2	0.1
南アフリカ	千ランド 469,600	千ランド 440,823	3,857,205	0.6	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	610,338,447	99.0	—	55.7	30.9	12.4

\* 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。

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 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	
			%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	8.125	19,840	21,260	2,337,812	2019/8/15
		US TREASURY BOND	8.75	12,700	14,419	1,585,618	2020/8/15
		US TREASURY BOND	8.0	22,100	25,984	2,857,284	2021/11/15
		US TREASURY BOND	6.25	13,800	16,093	1,769,605	2023/8/15
		US TREASURY BOND	2.375	47,100	45,629	5,017,470	2024/8/15
		US TREASURY BOND	6.0	39,200	47,459	5,218,653	2026/2/15
		US TREASURY BOND	6.5	18,800	23,772	2,614,018	2026/11/15
		US TREASURY BOND	6.125	21,400	26,926	2,960,824	2027/11/15
		US TREASURY BOND	5.5	17,000	20,733	2,279,840	2028/8/15
		US TREASURY BOND	5.25	6,300	7,570	832,488	2028/11/15
		US TREASURY BOND	5.25	800	964	106,049	2029/2/15
		US TREASURY BOND	4.375	100	119	13,124	2038/2/15
		US TREASURY BOND	2.875	19,500	18,613	2,046,724	2043/5/15
		US TREASURY BOND	3.75	16,000	17,698	1,946,154	2043/11/15
		US TREASURY N/B	1.25	5,000	4,950	544,344	2019/4/30
		US TREASURY N/B	1.625	6,600	6,558	721,143	2019/4/30
		US TREASURY N/B	3.125	27,600	27,819	3,059,080	2019/5/15
		US TREASURY N/B	0.875	3,900	3,844	422,696	2019/5/15
		US TREASURY N/B	1.125	1,400	1,382	152,019	2019/5/31
		US TREASURY N/B	1.5	23,600	23,396	2,572,653	2019/5/31
		US TREASURY N/B	1.25	2,100	2,076	228,345	2019/5/31
		US TREASURY N/B	0.875	900	885	97,413	2019/6/15
		US TREASURY N/B	1.0	1,400	1,378	151,616	2019/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	7,900	7,836	861,693	2019/6/30
		US TREASURY N/B	1.25	1,900	1,876	206,369	2019/6/30
		US TREASURY N/B	0.75	10,500	10,303	1,133,021	2019/7/15
		US TREASURY N/B	1.625	14,500	14,365	1,579,596	2019/7/31
		US TREASURY N/B	1.375	600	592	65,184	2019/7/31
		US TREASURY N/B	3.625	32,400	32,887	3,616,283	2019/8/15
		US TREASURY N/B	0.75	10,000	9,796	1,077,221	2019/8/15
		US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,945	323,939	2019/8/31
		US TREASURY N/B	1.625	26,750	26,477	2,911,440	2019/8/31
		US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,941	323,475	2019/9/30
		US TREASURY N/B	1.75	18,500	18,328	2,015,347	2019/9/30
		US TREASURY N/B	1.5	2,300	2,268	249,400	2019/10/31
		US TREASURY N/B	3.375	50,800	51,492	5,662,120	2019/11/15
		US TREASURY N/B	1.0	8,800	8,601	945,838	2019/11/30
		US TREASURY N/B	1.5	1,800	1,773	194,974	2019/11/30
		US TREASURY N/B	1.125	12,000	11,741	1,291,119	2019/12/31
		US TREASURY N/B	1.625	5,400	5,326	585,665	2019/12/31
		US TREASURY N/B	1.375	600	589	64,767	2020/1/15
		US TREASURY N/B	1.375	2,000	1,962	215,779	2020/1/31
		US TREASURY N/B	1.25	5,400	5,286	581,351	2020/1/31
		US TREASURY N/B	3.625	51,800	52,797	5,805,619	2020/2/15
		US TREASURY N/B	1.375	5,300	5,195	571,337	2020/2/15
		US TREASURY N/B	1.25	2,700	2,639	290,281	2020/2/29
		US TREASURY N/B	1.375	5,000	4,899	538,718	2020/2/29

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	
アメリカ	国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
		1.625	5,000	4,918	540,887	2020/3/15
		1.125	4,000	3,896	428,466	2020/3/31
		1.375	21,300	20,850	2,292,743	2020/3/31
		1.5	600	588	64,684	2020/4/15
		1.375	6,700	6,549	720,213	2020/4/30
		3.5	46,200	47,055	5,174,214	2020/5/15
		1.5	5,200	5,089	559,686	2020/5/31
		1.5	500	489	53,783	2020/6/15
		1.875	16,600	16,358	1,798,740	2020/6/30
		1.625	12,400	12,156	1,336,766	2020/6/30
		1.5	10,000	9,771	1,074,472	2020/7/15
		2.0	13,400	13,229	1,454,700	2020/7/31
		2.625	32,180	32,211	3,541,968	2020/8/15
		2.125	36,200	35,812	3,937,947	2020/8/31
		2.0	6,000	5,914	650,379	2020/9/30
		1.625	300	293	32,221	2020/10/15
		1.75	1,600	1,566	172,238	2020/10/31
		1.375	700	679	74,674	2020/10/31
		2.625	52,600	52,600	5,783,896	2020/11/15
		2.0	13,700	13,483	1,482,678	2020/11/30
		1.625	1,000	975	107,219	2020/11/30
		2.375	6,800	6,752	742,528	2020/12/31
		1.75	1,400	1,368	150,444	2020/12/31
		2.125	2,300	2,268	249,390	2021/1/31
		1.375	1,900	1,836	201,921	2021/1/31
		3.625	45,800	46,977	5,165,613	2021/2/15
		2.0	2,000	1,964	215,985	2021/2/28
		1.125	2,500	2,396	263,474	2021/2/28
		2.25	11,800	11,663	1,282,525	2021/3/31
		1.25	600	576	63,373	2021/3/31
		2.25	10,900	10,764	1,183,675	2021/4/30
		3.125	39,300	39,785	4,374,770	2021/5/15
		2.0	22,500	22,038	2,423,361	2021/5/31
		1.375	300	288	31,712	2021/5/31
		2.125	34,000	33,407	3,673,505	2021/6/30
		2.25	9,700	9,559	1,051,196	2021/7/31
		2.125	25,300	24,823	2,729,608	2021/8/15
		2.0	7,300	7,131	784,208	2021/8/31
		2.125	16,000	15,682	1,724,447	2021/9/30
		2.0	16,800	16,387	1,802,010	2021/10/31
		2.0	25,300	24,677	2,713,524	2021/11/15
		1.875	8,000	7,767	854,079	2021/11/30
		1.75	3,700	3,575	393,152	2021/11/30
		2.125	12,400	12,130	1,333,890	2021/12/31
		2.0	8,000	7,790	856,657	2021/12/31
		1.5	8,000	7,642	840,369	2022/1/31
		1.875	13,600	13,172	1,448,489	2022/1/31
		2.0	33,700	32,786	3,605,193	2022/2/15

銘	柄	当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ	国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
		1.75	7,300	7,032	773,296	2022/2/28
		1.875	500	483	53,210	2022/2/28
		1.75	9,900	9,526	1,047,526	2022/3/31
		1.875	1,300	1,256	138,212	2022/3/31
		1.75	38,400	36,912	4,058,843	2022/4/30
		1.875	21,300	20,574	2,262,368	2022/4/30
		1.75	3,900	3,747	412,092	2022/5/15
		2.125	27,100	26,394	2,902,391	2022/6/30
		1.75	600	575	63,300	2022/6/30
		1.875	1,000	963	105,922	2022/7/31
		1.625	10,300	9,813	1,079,099	2022/8/15
		1.75	2,000	1,912	210,332	2022/9/30
		2.0	10,000	9,658	1,062,058	2022/10/31
		1.625	9,900	9,402	1,033,918	2022/11/15
		2.125	29,800	28,896	3,177,479	2022/12/31
		1.75	22,000	20,956	2,304,400	2023/1/31
		2.0	17,000	16,371	1,800,242	2023/2/15
		1.5	24,200	22,755	2,502,201	2023/2/28
		2.625	14,300	14,169	1,558,054	2023/2/28
		1.5	11,000	10,331	1,136,041	2023/3/31
		1.625	5,000	4,718	518,873	2023/4/30
		1.75	49,600	47,077	5,176,628	2023/5/15
		1.625	34,400	32,432	3,566,305	2023/5/31
		1.25	20,900	19,275	2,119,517	2023/7/31
		2.5	19,400	19,062	2,096,059	2023/8/15
		1.375	13,900	12,882	1,416,557	2023/8/31
		2.75	16,800	16,698	1,836,215	2023/11/15
		2.125	4,200	4,038	444,044	2023/11/30
		2.75	26,800	26,603	2,925,286	2024/2/15
		2.125	6,900	6,611	726,982	2024/3/31
		2.5	30,100	29,427	3,235,842	2024/5/15
		2.125	10,000	9,548	1,049,989	2024/7/31
		2.125	6,000	5,719	628,885	2024/9/30
		2.25	5,600	5,374	590,976	2024/10/31
		2.25	34,200	32,815	3,608,443	2024/11/15
		2.125	3,500	3,330	366,233	2024/11/30
		2.0	44,700	42,108	4,630,283	2025/2/15
		2.75	3,400	3,358	369,307	2025/2/28
		2.625	35,000	34,284	3,769,974	2025/3/31
		2.125	6,500	6,158	677,160	2025/5/15
		2.0	24,500	22,961	2,524,801	2025/8/15
		2.25	50,300	47,859	5,262,648	2025/11/15
		1.625	2,000	1,811	199,233	2026/2/15
		1.625	800	722	79,459	2026/5/15
		1.5	2,000	1,782	196,020	2026/8/15
		2.0	13,000	12,031	1,322,938	2026/11/15
		2.25	26,200	24,693	2,715,297	2027/2/15
		2.375	1,800	1,711	188,232	2027/5/15

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	
			%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2. 75	500	489	53, 811	2028/ 2 /15
		US TREASURY N/B	6. 25	3, 000	3, 973	436, 884	2030/ 5 /15
		US TREASURY N/B	5. 375	11, 100	13, 861	1, 524, 216	2031/ 2 /15
		US TREASURY N/B	4. 5	8, 000	9, 602	1, 055, 890	2036/ 2 /15
		US TREASURY N/B	5. 0	5, 000	6, 401	703, 958	2037/ 5 /15
		US TREASURY N/B	4. 5	2, 800	3, 400	373, 915	2038/ 5 /15
		US TREASURY N/B	3. 5	1, 000	1, 065	117, 141	2039/ 2 /15
		US TREASURY N/B	4. 25	100	118	12, 982	2039/ 5 /15
		US TREASURY N/B	4. 5	100	122	13, 418	2039/ 8 /15
		US TREASURY N/B	4. 375	100	120	13, 216	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4. 625	100	124	13, 658	2040/ 2 /15
		US TREASURY N/B	4. 375	13, 500	16, 245	1, 786, 338	2040/ 5 /15
		US TREASURY N/B	3. 875	200	224	24, 715	2040/ 8 /15
		US TREASURY N/B	4. 25	12, 800	15, 166	1, 667, 763	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4. 75	14, 000	17, 737	1, 950, 398	2041/ 2 /15
		US TREASURY N/B	4. 375	6, 700	8, 089	889, 546	2041/ 5 /15
		US TREASURY N/B	3. 125	6, 500	6, 506	715, 410	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3. 125	4, 500	4, 504	495, 283	2042/ 2 /15
		US TREASURY N/B	3. 0	4, 500	4, 407	484, 614	2042/ 5 /15
		US TREASURY N/B	2. 75	9, 200	8, 607	946, 508	2042/ 8 /15
		US TREASURY N/B	2. 75	17, 600	16, 450	1, 808, 896	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3. 125	24, 200	24, 158	2, 656, 458	2043/ 2 /15
		US TREASURY N/B	3. 625	15, 400	16, 699	1, 836, 263	2043/ 8 /15
		US TREASURY N/B	3. 625	13, 200	14, 320	1, 574, 733	2044/ 2 /15
		US TREASURY N/B	3. 375	18, 900	19, 676	2, 163, 646	2044/ 5 /15
		US TREASURY N/B	3. 125	16, 000	15, 946	1, 753, 449	2044/ 8 /15
		US TREASURY N/B	3. 0	36, 900	35, 940	3, 951, 964	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2. 5	27, 600	24, 378	2, 680, 666	2045/ 2 /15
		US TREASURY N/B	3. 0	21, 700	21, 128	2, 323, 309	2045/ 5 /15
		US TREASURY N/B	2. 875	2, 000	1, 899	208, 906	2045/ 8 /15
		US TREASURY N/B	3. 0	15, 100	14, 687	1, 614, 994	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2. 5	16, 000	14, 073	1, 547, 549	2046/ 2 /15
US TREASURY N/B	2. 5	15, 700	13, 796	1, 517, 049	2046/ 5 /15		
US TREASURY N/B	2. 25	2, 300	1, 913	210, 368	2046/ 8 /15		
US TREASURY N/B	2. 875	12, 700	12, 037	1, 323, 612	2046/11/15		
US TREASURY N/B	2. 75	2, 300	2, 122	233, 386	2047/ 8 /15		
US TREASURY N/B	2. 75	900	830	91, 278	2047/11/15		
小 計						262, 786, 626	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	CANADA GOVERNMENT	2. 75	5, 500	5, 626	481, 595	2022/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 75	400	396	33, 927	2019/ 5 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	3. 75	8, 000	8, 168	699, 174	2019/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 75	550	543	46, 493	2019/ 8 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 75	8, 000	7, 992	684, 096	2019/ 9 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 25	5, 100	5, 055	432, 685	2019/11/ 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 5	16, 300	16, 172	1, 384, 207	2020/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	3. 5	7, 800	8, 039	688, 124	2020/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 75	3, 500	3, 402	291, 258	2020/ 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	
			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
カナダ	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	0.75	8,200	7,909	676,985	2021/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.25	10,050	10,396	889,812	2021/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	300	287	24,573	2021/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,800	2,632	225,287	2022/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	6,700	6,378	545,921	2022/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,600	4,441	380,142	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	7,900	7,998	684,599	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	5,400	5,373	459,888	2025/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	2,400	2,250	192,608	2026/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	3,650	5,313	454,765	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	800	710	60,817	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	100	96	8,261	2028/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	7,180	9,500	813,111	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	4,200	5,948	509,143	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	6,200	8,594	735,629	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	6,100	7,741	662,554	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	9,800	11,839	1,013,315	2045/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	300	319	27,348	2048/12/1
CANADIAN GOVERNMENT	2.75	200	218	18,727	2064/12/1		
小 計						13,125,057	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	1.75	1,880	1,903	283,369	2019/7/22
		UK TREASURY	3.75	100	104	15,487	2019/9/7
		UK TREASURY	4.75	1,000	1,072	159,690	2020/3/7
		UK TREASURY	2.0	19,890	20,402	3,037,971	2020/7/22
		UK TREASURY	3.75	7,050	7,529	1,121,201	2020/9/7
		UK TREASURY	1.5	3,300	3,355	499,669	2021/1/22
		UK TREASURY	8.0	7,540	9,173	1,365,917	2021/6/7
		UK TREASURY	3.75	670	732	109,028	2021/9/7
		UK TREASURY	4.0	4,250	4,734	705,024	2022/3/7
		UK TREASURY	0.5	9,200	8,994	1,339,235	2022/7/22
		UK TREASURY	1.75	10,100	10,398	1,548,344	2022/9/7
		UK TREASURY	0.75	2,100	2,055	306,095	2023/7/22
		UK TREASURY	2.25	5,100	5,386	802,052	2023/9/7
		UK TREASURY	2.75	9,750	10,648	1,585,556	2024/9/7
		UK TREASURY	5.0	11,850	14,738	2,194,535	2025/3/7
		UK TREASURY	4.25	10,030	12,518	1,864,026	2027/12/7
		UK TREASURY	6.0	6,100	8,754	1,303,577	2028/12/7
		UK TREASURY	4.75	5,700	7,691	1,145,276	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	5,750	7,553	1,124,671	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	6,600	9,118	1,357,753	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	2,900	3,970	591,147	2036/3/7
		UK TREASURY	1.75	2,500	2,449	364,693	2037/9/7
		UK TREASURY	4.75	2,300	3,438	511,958	2038/12/7
		UK TREASURY	4.25	5,800	8,227	1,225,131	2039/9/7
		UK TREASURY	4.25	2,800	4,024	599,197	2040/12/7
		UK TREASURY	4.5	5,900	8,933	1,330,151	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	20,100	26,809	3,991,916	2045/1/22

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	
					千英ポンド	千円	
イギリス			%	千英ポンド			
	国債証券	UK TREASURY	4.25	6,400	9,732	1,449,166	2046/12/ 7
		UK TREASURY	1.5	3,600	3,300	491,387	2047/ 7 /22
		UK TREASURY	4.25	5,350	8,429	1,255,226	2049/12/ 7
		UK TREASURY	3.75	8,750	13,113	1,952,618	2052/ 7 /22
		UK TREASURY	1.75	1,500	1,516	225,851	2057/ 7 /22
		UK TREASURY	2.5	400	509	75,909	2065/ 7 /22
		UK TREASURY	3.5	4,750	7,714	1,148,756	2068/ 7 /22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	20,300	25,852	3,849,370	2044/ 1 /22
		UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	7,100	12,013	1,788,765	2055/12/ 7
小 計						42,719,734	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	SWITZERLAND GOVERNMENT	2.0	4,800	5,181	566,503	2021/ 4 /28
		SWITZERLAND GOVERNMENT	4.0	3,150	4,389	479,916	2028/ 4 / 8
小 計						1,046,419	
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	9,700	11,090	139,955	2020/12/ 1
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	48,850	56,096	707,942	2022/ 6 / 1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	28,300	30,459	384,403	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	33,750	38,802	489,685	2025/ 5 /12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	12,000	12,468	157,346	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	14,100	14,147	178,544	2028/ 5 /12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	17,800	24,762	312,501	2039/ 3 /30
							2,370,380
小 計						2,370,380	
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	4.5	21,200	22,002	299,452	2019/ 5 /22
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.75	27,600	29,726	404,578	2021/ 5 /25
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	16,000	16,412	223,367	2023/ 5 /24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	44,900	48,447	659,365	2024/ 3 /14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	4,700	4,723	64,286	2025/ 3 /13
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	4,700	4,612	62,780	2026/ 2 /19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	9,600	9,527	129,669	2027/ 2 /17
							1,843,500
小 計						1,843,500	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	4.0	10,300	11,019	192,629	2019/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.25	5,000	5,092	89,012	2020/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	37,100	41,351	722,827	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	32,470	35,072	613,066	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	31,400	34,753	607,491	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	12,200	12,122	211,901	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	42,000	69,947	1,222,677	2039/11/15
							3,659,606
小 計						3,659,606	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	0.25	100	101	13,186	2019/10/11
		BUNDESOBLIGATION	—	800	808	105,332	2020/ 4 /17
		BUNDESOBLIGATION	0.25	2,000	2,036	265,270	2020/10/16
		BUNDESOBLIGATION	—	1,600	1,620	211,018	2021/ 4 / 9
		BUNDESOBLIGATION	—	3,300	3,333	434,112	2022/ 4 / 8
		BUNDESOBLIGATION	—	900	906	118,056	2022/10/ 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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	—	1,000	1,003	130,623	2023/4/14
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5	500	523	68,238	2019/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	6,700	7,133	928,950	2020/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	4,100	4,414	574,864	2020/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	13,300	14,161	1,844,313	2020/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	13,300	14,360	1,870,156	2021/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	7,000	7,811	1,017,256	2021/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	8,400	9,134	1,189,563	2021/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	14,300	15,512	2,020,211	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	6,500	7,037	916,474	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,000	5,368	699,126	2022/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,603	729,780	2023/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,610	730,606	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	11,600	12,836	1,671,659	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	15,400	20,807	2,709,707	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	4,700	5,159	671,887	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,500	1,626	211,863	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	10,300	10,861	1,414,554	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	10,500	10,719	1,395,980	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	4,100	4,323	563,021	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	300	304	39,642	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	969	126,285	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	700	689	89,768	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	19,400	29,953	3,900,832	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,000	130,315	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	6,000	8,901	1,159,239	2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	994	129,498	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	3,400	4,812	626,735	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	6,500	10,602	1,380,811	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	5,300	8,371	1,090,207	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	7,800	12,320	1,604,446	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	4,800	7,261	945,613	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	7,000	11,250	1,465,122	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	7,200	12,433	1,619,170	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	3,900	5,654	736,443	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	6,500	8,425	1,097,273	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	6,200	8,116	1,056,969	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	3,000	3,001	390,830	2048/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	5,100	5,242	682,670	2019/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	1,800	1,840	239,716	2019/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	15,630	16,569	2,157,889	2019/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.05	400	408	53,188	2019/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	8,100	8,765	1,141,593	2020/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	29,200	31,573	4,111,762	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	1,800	1,819	236,898	2020/6/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	16,200	17,735	2,309,728	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	2,000	2,036	265,174	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	11,400	12,593	1,640,069	2021/3/1

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	3,000	2,996	390,248	2021/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	10,000	11,085	1,443,599	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.45	100	101	13,164	2021/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	8,000	8,924	1,162,276	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	14,400	16,571	2,158,109	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	2,550	2,561	333,597	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	1,400	1,493	194,555	2021/12/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	19,760	2,573,365	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.2	300	309	40,291	2022/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	800	828	107,955	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	7,400	8,973	1,168,585	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	2,100	2,182	284,176	2022/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	20,100	24,469	3,186,694	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	700	709	92,346	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,100	1,303	169,721	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	7,300	8,789	1,144,617	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	11,700	16,789	2,186,496	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	15,900	19,049	2,480,854	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	3,000	3,140	408,935	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	2,300	2,668	347,513	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	8,400	8,541	1,112,419	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	20,919	2,724,287	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	3,000	3,033	395,088	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	3,118	406,083	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	10,500	12,839	1,672,075	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	12,200	17,660	2,299,955	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	16,500	23,289	3,033,024	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	7,300	9,203	1,198,521	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	19,700	26,135	3,403,689	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	18,300	26,128	3,402,745	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	465	60,667	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	7,900	11,233	1,462,977	2033/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	3,000	3,028	394,440	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,900	11,962	1,557,875	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	5,800	7,062	919,694	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	900	940	122,444	2038/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,000	10,948	1,425,862	2039/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	13,300	18,171	2,366,512	2040/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	11,600	15,592	2,030,639	2044/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	5,300	5,692	741,295	2046/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	2,000	2,190	285,331	2048/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	3,200	2,947	383,897	2067/3/1		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0	7,000	7,113	926,379	2019/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	10,300	10,467	1,363,166	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,800	2,825	368,011	2020/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,100	1,110	144,679	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,700	2,726	355,110	2021/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	3,000	2,993	389,810	2023/3/25

銘	柄		当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.5	7,000	7,066	920,248	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	2,000	2,058	268,101	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	12,000	14,115	1,838,262	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,000	1,005	130,988	2034/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	100	98	12,864	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	2,000	2,125	276,752	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	2,000	2,158	281,134	2048/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	500	566	73,716	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	5,500	5,846	761,333	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	14,800	15,962	2,078,757	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.5	26,700	28,630	3,728,538	2020/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	0.25	2,000	2,033	264,809	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	11,800	13,236	1,723,808	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	15,100	16,938	2,205,841	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.0	14,500	16,324	2,125,951	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	17,600	19,420	2,529,187	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	7,200	10,231	1,332,393	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	31,300	38,375	4,997,623	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	3,000	3,282	427,455	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	19,800	28,031	3,650,538	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	6,000	6,246	813,416	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	33,100	40,944	5,332,228	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	9,200	10,942	1,425,039	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	24,500	36,498	4,753,200	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	9,000	9,503	1,237,618	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	16,100	26,248	3,418,285	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	7,300	11,308	1,472,744	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	5,300	7,831	1,019,936	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	17,500	28,052	3,653,217	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	17,700	24,236	3,156,333	2045/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	5,200	8,419	1,096,505	2055/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	3,700	6,149	800,788	2060/4/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	5,900	6,223	810,516	2019/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	2,900	2,941	383,126	2020/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	4,800	5,224	680,394	2020/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	6,350	7,086	922,854	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	400	403	52,544	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	1,500	1,652	215,221	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	2,500	2,946	383,722	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	4,300	5,831	759,453	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	1,400	1,525	198,677	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	1,000	992	129,227	2024/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	13,500	14,978	1,950,617	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	1,000	993	129,383	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	4,000	4,004	521,545	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	2,000	2,028	264,160	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	7,300	10,666	1,389,132	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	1,004	130,770	2028/7/15

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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	4,400	5,337	695,087	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	4,000	6,019	783,979	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	6,200	9,565	1,245,725	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	3,900	5,321	693,008	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	100	103	13,426	2019/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6	8,700	9,238	1,203,093	2019/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3	11,900	12,726	1,657,319	2019/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	3,800	3,915	509,859	2020/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	25,250	27,397	3,567,982	2020/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.15	200	206	26,876	2020/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	10,900	12,271	1,598,179	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	3,600	3,619	471,394	2021/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	10,900	12,729	1,657,700	2021/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	5,900	6,062	789,564	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	14,550	17,724	2,308,309	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.4	5,250	5,319	692,711	2022/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	11,900	14,785	1,925,523	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	7,400	8,990	1,170,889	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	13,900	17,290	2,251,774	2024/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	6,700	7,968	1,037,800	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	450	510	66,434	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	900	951	123,883	2025/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	15,600	19,811	2,579,990	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	5,000	5,458	710,874	2025/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	6,000	6,441	838,908	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	18,400	25,494	3,320,104	2026/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	3,100	3,161	411,708	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	9,300	12,736	1,658,654	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	2,000	2,088	271,937	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	400	427	55,660	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	5,400	8,040	1,047,121	2040/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	8,400	12,290	1,600,592	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	7,300	11,474	1,494,296	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	3,500	3,903	508,345	2046/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	3,500	4,224	550,129	2066/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	16,000	23,426	3,050,797	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	12,500	18,955	2,468,509	2032/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	3,000	4,053	527,845	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.0	3,800	3,985	519,013	2019/9/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	5,800	6,383	831,364	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	5,200	6,002	781,687	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	1,800	2,095	272,937	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	7,618	992,165	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	5,000	5,565	724,735	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	7,000	7,994	1,041,058	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,000	1,024	133,394	2025/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	8,400	11,020	1,435,134	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	1,033	134,645	2026/6/22

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	0.8	2,000	2,017	262,698	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,000	995	129,696	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	991	129,121	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	4,827	628,732	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.25	1,000	1,004	130,816	2033/4/22
		BELGIUM KINGDOM	1.45	1,000	1,009	131,515	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	1,000	1,083	141,085	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	5,400	8,335	1,085,573	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	5,500	8,126	1,058,346	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	1,000	988	128,793	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.25	1,200	1,342	174,897	2057/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	1,000	1,077	140,354	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	10,900	15,890	2,069,406	2028/3/28
BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	10,000	15,766	2,053,328	2035/3/28		
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.95	100	102	13,381	2019/6/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	500	505	65,834	2019/10/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	2,300	2,519	328,074	2020/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	2,000	2,254	293,616	2021/9/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,000	3,448	449,059	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	5,000	5,787	753,706	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	2,000	1,989	259,053	2023/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	2,550	2,777	361,693	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	4,200	4,566	594,716	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,300	1,372	178,703	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,227	941,289	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,026	263,924	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	6,100	9,168	1,194,073	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	1,000	1,183	154,068	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	5,200	7,785	1,013,969	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	5,400	7,477	973,756	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	1,000	1,001	130,431	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	450	756	98,576	2062/1/26
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.1	1,300	1,410	183,656	2117/9/20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	4.375	100	105	13,769	2019/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	3.375	100	107	14,000	2020/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.375	1,000	1,019	132,715	2020/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	3.5	2,000	2,226	289,961	2021/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	3,200	3,440	448,016	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	1,200	1,286	167,546	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	—	2,400	2,385	310,649	2023/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	2,900	3,206	417,624	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	1,000	1,256	163,581	2025/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	1,000	1,033	134,654	2025/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,002	260,792	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	2,700	3,238	421,716	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	700	682	88,909	2031/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	1,600	2,072	269,925	2042/7/4
アイルランド	国債証券	IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	4.4	100	105	13,727	2019/6/18

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			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	5.9	400	437	56,921	2019/10/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	680	745	97,140	2020/ 4 /18
		IRISH GOVERNMENT	5.0	500	566	73,710	2020/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.4	2,430	3,234	421,190	2025/ 3 /13
		IRISH GOVERNMENT	0.9	600	595	77,584	2028/ 5 /15
		IRISH TSY 0.8% 2022	0.8	3,600	3,723	484,955	2022/ 3 /15
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	3,000	3,073	400,277	2026/ 5 /15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	1,800	1,847	240,555	2037/ 5 /15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	3,500	3,710	483,184	2045/ 2 /18
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	4,600	5,239	682,386	2030/ 5 /15
		IRISH TSY 2022	－	1,800	1,795	233,851	2022/10/18
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	6,600	7,792	1,014,832	2024/ 3 /18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	6,150	7,285	948,811	2023/ 3 /20
小 計						251,827,564	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	100	102	3,123	2019/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	5,700	6,034	184,339	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	6,100	6,094	186,172	2020/ 4 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	30,700	33,318	1,017,886	2020/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	13,500	15,166	463,338	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	700	700	21,404	2022/ 4 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	10,000	11,404	348,399	2022/ 9 /23
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	3,400	3,399	103,859	2023/ 1 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	12,500	13,354	407,976	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	19,700	19,916	608,455	2025/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	9,500	9,065	276,947	2026/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,200	2,071	63,278	2027/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	2,200	2,114	64,588	2028/ 4 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	3,700	4,559	139,304	2029/ 4 /25
小 計						3,889,073	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.5	2,500	2,518	205,455	2019/ 6 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	4,200	4,316	352,118	2020/ 9 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	2,980	2,992	244,099	2021/ 6 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.25	1,000	971	79,220	2021/10/ 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.75	300	295	24,074	2022/ 4 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	1,400	1,456	118,765	2022/ 9 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	3,000	3,057	249,408	2023/ 7 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	2,200	2,271	185,286	2024/ 9 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	1,100	1,091	89,018	2025/ 6 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	3,900	4,176	340,709	2027/ 3 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	2,400	2,424	197,725	2030/ 9 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	850	902	73,602	2033/ 9 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	3,300	3,179	259,355	2042/ 4 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	800	766	62,491	2046/ 3 / 1
小 計						2,481,332	
マレーシア				千リンギ	千リンギ		
	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3.882	800	802	22,348	2022/ 3 /10

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			%	千リンギ	千リンギ	千円	
	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	400	400	11,146	2024/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.654	2,400	2,401	66,849	2019/10/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	9,600	9,708	270,276	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.492	6,600	6,573	183,009	2020/3/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.889	2,400	2,407	67,029	2020/7/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	6,000	6,063	168,820	2021/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	8,700	8,758	243,832	2021/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	4,600	4,516	125,744	2022/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.795	500	498	13,866	2022/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	13,000	12,704	353,704	2023/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.8	2,200	2,182	60,747	2023/8/17
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	5,800	5,823	162,134	2024/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.955	600	590	16,436	2025/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	8,800	8,912	248,129	2026/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	7,000	6,591	183,517	2027/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	1,800	1,740	48,454	2028/6/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	5.248	2,700	2,881	80,215	2028/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	5,700	5,713	159,051	2030/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	4,400	4,248	118,269	2031/6/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	4,700	4,498	125,237	2032/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	400	367	10,223	2033/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.254	900	840	23,389	2035/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.935	9,700	9,771	272,037	2043/9/30
小 計						3,034,473	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	303	24,896	2019/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	12,850	13,450	1,103,507	2020/4/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	12,300	12,190	1,000,129	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	10,300	11,370	932,808	2021/5/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	5,100	5,055	414,781	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	8,800	9,995	820,065	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	300	298	24,470	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	8,100	9,263	759,949	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	7,200	7,283	597,569	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	12,500	12,994	1,066,033	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	12,780	14,187	1,163,907	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	11,700	13,548	1,111,535	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	3,200	3,193	262,012	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	10,300	9,814	805,211	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,200	1,195	98,040	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	10,100	10,520	863,092	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,400	1,387	113,810	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	7,500	8,891	729,425	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	1,728	141,787	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	5,400	5,907	484,663	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,400	1,415	116,165	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	3,400	3,210	263,371	2047/3/21
		小 計					

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	107,000	103,072	579,264	2019/12/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	52,600	53,146	298,683	2020/ 6 /11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	126,000	122,180	686,656	2021/ 6 /10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	71,100	68,305	383,874	2022/ 6 / 9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	39,000	43,806	246,193	2024/12/ 5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	8,000	7,098	39,895	2026/ 3 / 5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	86,300	85,147	478,531	2027/ 6 / 3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	49,600	52,372	294,331	2029/ 5 /31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	46,500	46,375	260,632	2031/ 5 /29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	9,933	55,826	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	46,000	55,683	312,938	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	41,300	44,008	247,327	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	64,200	63,381	356,203	2042/11/13
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	15,000	15,215	85,508	2047/11/ 7		
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	83,000	84,406	474,366	2023/12/ 7
小計						4,800,234	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	9,300	9,295	81,334	2020/ 1 /15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	20,300	19,911	174,229	2021/ 3 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	26,700	26,633	233,046	2023/ 2 /28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	71,300	80,129	701,136	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	28,000	26,236	229,572	2030/ 1 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	30,000	25,563	223,676	2031/ 2 /28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	46,400	43,524	380,841	2032/ 3 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.875	6,800	6,624	57,962	2035/ 2 /28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	38,100	28,323	247,833	2036/ 3 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	32,000	29,833	261,044	2037/ 1 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0	8,800	8,523	74,579	2040/ 1 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	30,600	22,470	196,617	2041/ 2 /28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	71,100	66,676	583,416	2044/ 1 /31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	50,200	47,075	411,913	2048/ 2 /28
小計						3,857,205	
合計						610,338,447	

\* 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。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。



# ○投資信託財産の構成

(2018年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 610,338,447	% 98.3
コール・ローン等、その他	10,504,656	1.7
投資信託財産総額	620,843,103	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。  
 \*当期末における外貨建て純資産（612,909,673千円）の投資信託財産総額（620,843,103千円）に対する比率は98.7%です。  
 \*外貨建て資産は、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米ドル＝109.96円、1カナダドル＝85.59円、1英ポンド＝148.90円、1スイスフラン＝109.34円、1スウェーデンクローナ＝12.62円、1ノルウェークローネ＝13.61円、1デンマーククローネ＝17.48円、1ユーロ＝130.23円、1ズロチ＝30.55円、1シンガポールドル＝81.57円、1リンギ＝27.84円、1豪ドル＝82.04円、1メキシコペソ＝5.62円、1ランド＝8.75円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2018年5月10日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	624,395,668,526
コール・ローン等	4,363,627,629
公社債(評価額)	610,338,447,382
未収入金	3,572,829,000
未収利息	5,900,191,511
前払費用	220,573,004
(B) 負債	7,822,449,058
未払金	7,172,571,350
未払解約金	642,037,447
未払利息	6,061
その他未払費用	7,834,200
(C) 純資産総額(A－B)	616,573,219,468
元本	276,186,579,860
次期繰越損益金	340,386,639,608
(D) 受益権総口数	276,186,579,860口
1万口当たり基準価額(C／D)	22,325円

(注) 期首元本額は302,031,601,625円、期中追加設定元本額は30,697,775,468円、期中一部解約元本額は56,542,797,233円、1口当たり純資産額は2.2325円です。

## ○損益の状況（2017年5月11日～2018年5月10日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	18,678,134,423
受取利息	18,679,661,999
支払利息	△ 1,527,576
(B) 有価証券売買損益	△ 7,977,392,516
売買益	18,355,953,899
売買損	△ 26,333,346,415
(C) 保管費用等	△ 70,934,432
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	10,629,807,475
(E) 前期繰越損益金	362,722,546,350
(F) 追加信託差損益金	38,366,369,174
(G) 解約差損益金	△ 71,332,083,391
(H) 計(D＋E＋F＋G)	340,386,639,608
次期繰越損益金(H)	340,386,639,608

\*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。  
 \*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。  
 \*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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村外国債券インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	156,845,660,313
野村世界 6 資産分散投信 (分配コース)	26,079,236,407
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	13,213,433,425
のむらっ・ファンド (普通型)	8,759,668,164
マイ・ロード	8,721,369,818
野村外国債券 (含む新興国) インデックス Bコース (野村投資一任口座向け)	5,616,286,529
のむらっ・ファンド (保守型)	5,377,925,941
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	5,367,089,850
野村DC外国債券インデックスファンド	4,111,162,995
マイバランス50 (確定拠出年金向け)	3,208,836,041
野村DC運用戦略ファンド	3,138,164,454
グローバル・インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用)	3,049,671,026
マイバランス70 (確定拠出年金向け)	2,944,450,873
マイバランス30 (確定拠出年金向け)	2,321,785,728
野村グローバル・インデックス・バランス75VA (適格機関投資家専用)	2,119,961,341
野村世界 6 資産分散投信 (安定コース)	2,057,545,159
のむらっ・ファンド (積極型)	1,922,556,267
野村外国債券インデックス Bコース(野村SMA・EW向け)	1,872,007,163
グローバル・インデックス・バランス25VA (適格機関投資家専用)	1,853,428,064
ノムラ外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	1,716,212,474
グローバル・インデックス・バランス60VA (適格機関投資家専用)	1,547,863,471
マイバランスDC30	1,524,923,135
野村世界 6 資産分散投信 (成長コース)	1,490,687,361
野村外国債券インデックス (野村SMA向け)	1,096,013,046
野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用)	995,516,422
ノムラFOfsインデックスファンド・外国債券 (適格機関投資家専用)	942,037,923
マイバランスDC50	916,838,883
野村インデックスファンド・外国債券	763,635,039
野村世界 6 資産分散投信 (配分変更コース)	664,341,689
マイバランスDC70	608,200,515
グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)	560,319,155
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	546,770,118
野村ワールド・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)	517,783,138
ネクストコア	498,613,002
のむらっ・ファンド (やや保守型)	407,883,922
野村外国債券インデックスファンド	289,090,123
NEXT FUND 外国債券・シティ世界国債インデックス (除く日本・為替ヘッジなし) 運動型上場投信	287,384,725
ファンドラップ (ウエルス・スクエア) 外国債券	229,462,754
野村グローバル・インデックス・バランス50VA (適格機関投資家専用)	224,302,890
野村DC運用戦略ファンド (マイルド)	211,880,272
野村グローバル・インデックス・バランス25VA (適格機関投資家専用)	207,995,190
のむらっ・ファンド (やや積極型)	193,325,509
野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用)	171,253,090

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA (適格機関投資家専用)	138,399,327
野村インデックスファンド・海外 5 資産バランス	110,681,254
バランスセレクト50	94,062,808
バランスセレクト30	91,988,817
バランスセレクト70	78,743,549
野村資産設計ファンド2040	62,777,476
マイターゲット2050 (確定拠出年金向け)	61,310,350
野村 6 資産均等バランス	51,647,278
野村資産設計ファンド2025	48,376,731
野村資産設計ファンド2030	42,936,105
野村資産設計ファンド2020	40,139,034
野村資産設計ファンド2015	33,497,454
野村資産設計ファンド2035	29,327,373
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型 (適格機関投資家専用)	16,057,021
マイターゲット2040 (確定拠出年金向け)	11,750,613
野村外国債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	11,479,625
マイターゲット2030 (確定拠出年金向け)	8,043,709
野村資産設計ファンド2050	7,517,517
バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)	7,513,925
バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)	6,981,460
野村資産設計ファンド2045	6,601,120
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	4,811,097
野村世界 6 資産分散投信 (DC) インカムコース	4,189,734
インデックス・ブレンド (タイプⅢ)	4,079,352
バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)	4,014,450
インデックス・ブレンド (タイプⅤ)	2,917,626
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型 (適格機関投資家専用)	2,903,420
インデックス・ブレンド (タイプⅡ)	1,536,664
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	1,530,317
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	1,258,110
インデックス・ブレンド (タイプⅠ)	1,222,782
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	922,539
野村世界 6 資産分散投信 (DC) 安定コース	896,553
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型 (適格機関投資家専用)	811,114
野村世界 6 資産分散投信 (DC) 成長コース	757,455
インデックス・ブレンド (タイプⅣ)	704,372
マイターゲット2035 (確定拠出年金向け)	342,147
マイターゲット2045 (確定拠出年金向け)	335,196
野村資産設計ファンド (DC) 2050	239,787
マイターゲット2060 (確定拠出年金向け)	230,624
野村資産設計ファンド (DC) 2040	200,703
野村資産設計ファンド (DC) 2030	175,627
マイターゲット2055 (確定拠出年金向け)	94,241

## ○お知らせ

投資信託約款に記載されているインデックスの名称を「シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)」から「FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)」に変更する所要の約款変更を行いました。 <変更適用日: 2018年2月21日>

# 新興国債券マザーファンド

## 運用報告書

第10期（決算日2018年5月10日）

作成対象期間（2017年5月11日～2018年5月10日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。なお、一部ローンに投資する場合があります。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行います。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落 中 率		期 騰 落 中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
6 期(2014年 5 月12日)	14, 674	△ 2. 1	150. 77	△ 1. 3	98. 2	—	5, 526
7 期(2015年 5 月11日)	17, 412	18. 7	181. 84	20. 6	98. 2	—	6, 502
8 期(2016年 5 月10日)	16, 574	△ 4. 8	173. 87	△ 4. 4	98. 2	—	6, 873
9 期(2017年 5 月10日)	18, 613	12. 3	196. 18	12. 8	98. 1	—	9, 252
10期(2018年 5 月10日)	17, 532	△ 5. 8	183. 46	△ 6. 5	98. 5	—	14, 290

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*ベンチマーク（＝JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース））は、JP Morgan Emerging Market Bond Index（EMBI）Plus（US\$ベース）をもとに、当社が円換算したものです。なお指数の算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。

\*JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（JP Morgan Emerging Market Bond Index（EMBI）Plus）は、J.P. Morgan Securities LLCが公表している、エマージング諸国が発行する米ドル建てのブレディ債、ローン、ユーロボンドを対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

（出所）J.P. Morgan Securities LLC、ブルームバーグ

○当期中の基準価額と市況等の推移

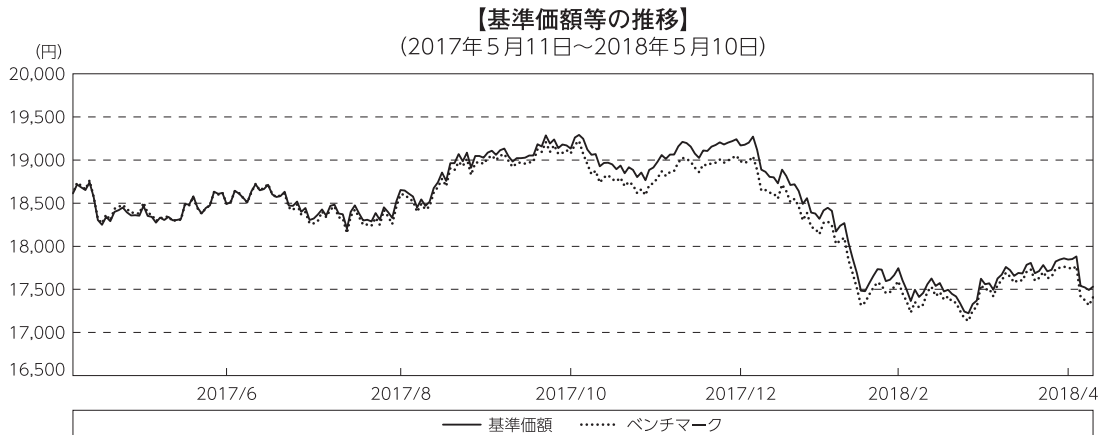
年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
	円	%		%	%	%
（期 首） 2017年 5 月10日	18, 613	—	196. 18	—	98. 1	—
5 月 末	18, 360	△1. 4	193. 82	△1. 2	98. 1	—
6 月 末	18, 490	△0. 7	194. 93	△0. 6	97. 8	—
7 月 末	18, 306	△1. 6	192. 53	△1. 9	98. 0	—
8 月 末	18, 652	0. 2	196. 06	△0. 1	98. 1	—
9 月 末	19, 028	2. 2	199. 79	1. 8	98. 3	—
10月 末	19, 135	2. 8	201. 08	2. 5	98. 2	—
11月 末	18, 913	1. 6	197. 41	0. 6	98. 5	—
12月 末	19, 169	3. 0	200. 12	2. 0	98. 0	—
2018年 1 月 末	18, 318	△1. 6	191. 21	△2. 5	98. 2	—
2 月 末	17, 745	△4. 7	185. 45	△5. 5	98. 1	—
3 月 末	17, 561	△5. 7	184. 41	△6. 0	98. 5	—
4 月 末	17, 847	△4. 1	187. 15	△4. 6	98. 2	—
（期 末） 2018年 5 月10日	17, 532	△5. 8	183. 46	△6. 5	98. 5	—

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首18,613円から期末17,532円へと下落し、値下がり額は1,081円となりました。

新興国債券（米ドル建て）利回りが上昇（価格は下落）したことに加え、米ドルが対円で下落（円高）となったことを受けて、基準価額は下落しました。

### ○当ファンドのポートフォリオ

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、地域構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ポートフォリオの特性値（地域構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

2017年11月にベネズエラ国債のデフォルト懸念が急速に高まったことから、流動性確保のため保有していたベネズエラ国債を全て売却し、期末時点でも非保有としています。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は－5.8%となり、ベンチマークであるJP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の－6.5%を0.7ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### （プラス要因）

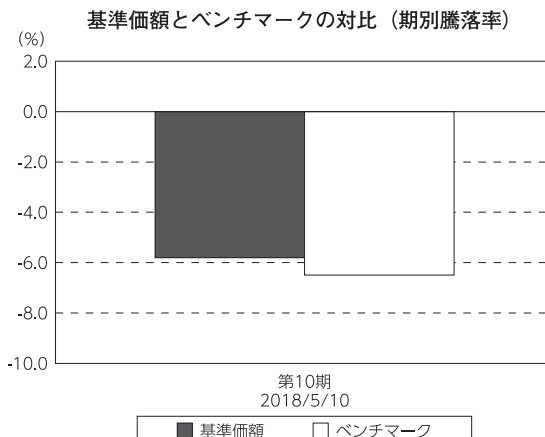
2017年11月以降非保有としているベネズエラ国債の価格下落が相対的に大きかったこと。

### （マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること。

### （その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること。



（注）ベンチマークは、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

\* 本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含まれますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行うものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行い、又はそのマーケット・メイカーとして行っている可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。ジェー・ビー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ビー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・エー、JPMSL、ジェー・ビー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。当情報に関して追加が必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、[index.research@jpmorgan.com](mailto:index.research@jpmorgan.com)宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、[www.morganmarkets.com](http://www.morganmarkets.com)もご覧ください。当情報の著作権は、ジェー・ビー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年 5 月11日～2018年 5 月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 4	% 0.021	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
( 保 管 費 用 )	(4)	(0.021)	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)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	4	0.021	
期中の平均基準価額は、18,460円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。  
\*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 5 月11日～2018年 5 月10日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外 国	アメリカ	国債証券	千米ドル 75,311	千米ドル 16,377 ( 844)

\*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）  
\*単位未満は切り捨て。  
\*（ ）内は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。

○利害関係人との取引状況等

(2017年 5 月11日～2018年 5 月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 6,523	百万円 77	% 1.2	百万円 729	百万円 —	% —

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野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2018年5月10日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	127,520	127,958	14,070,263	98.5	51.0	76.5	18.4	3.5
合 計	127,520	127,958	14,070,263	98.5	51.0	76.5	18.4	3.5

\* 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。

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 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。

\* S&Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	ARGENT-GLOBAL		11.608874	640	916	100,764	2033/12/31
	ARGENT-GLOBAL		11.608874	420	589	64,831	2033/12/31
	ARGENT-GLOBAL		2.5	1,600	998	109,740	2038/12/31
	BRAZIL GLOBAL		8.875	350	378	41,661	2019/10/14
	BRAZIL GLOBAL		8.75	650	814	89,521	2025/2/4
	BRAZIL GLOBAL		8.25	820	1,003	110,342	2034/1/20
	BRAZIL GLOBAL		7.125	700	782	86,016	2037/1/20
	COLOMBIA GLOBAL		8.125	250	302	33,228	2024/5/21
	COLOMBIA GLOBAL		7.375	620	773	85,048	2037/9/18
	CROATIA		6.625	600	635	69,825	2020/7/14
	CROATIA		6.375	500	531	58,471	2021/3/24
	CROATIA		5.5	800	839	92,274	2023/4/4
	CROATIA		6.0	600	645	70,979	2024/1/26
	FED REPUBLIC OF BRAZIL		4.875	1,630	1,679	184,701	2021/1/22
	FED REPUBLIC OF BRAZIL		2.625	600	557	61,291	2023/1/5
	FED REPUBLIC OF BRAZIL		4.25	1,400	1,354	148,979	2025/1/7
	FED REPUBLIC OF BRAZIL		6.0	900	962	105,792	2026/4/7
	FED REPUBLIC OF BRAZIL		4.625	1,300	1,230	135,264	2028/1/13
	FED REPUBLIC OF BRAZIL		5.625	850	787	86,596	2041/1/7
	FED REPUBLIC OF BRAZIL		5.0	1,600	1,356	149,105	2045/1/27
	FED REPUBLIC OF BRAZIL		5.625	1,200	1,098	120,802	2047/2/21
	HUNGARY		5.375	800	849	93,363	2023/2/21
	HUNGARY		5.75	750	811	89,180	2023/11/22
	HUNGARY		5.375	1,100	1,171	128,860	2024/3/25
	INDONESIA GLOBAL		5.875	800	857	94,270	2024/1/15
	MEXICO GLOBAL		6.75	380	453	49,865	2034/9/27



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	%	千米ドル	千米ドル	千円	
		7.125	300	357	39,296	2026/1/29
		9.375	250	353	38,898	2029/4/1
		6.7	750	915	100,613	2036/1/26
		7.35	700	855	94,098	2025/7/21
		6.55	820	1,029	113,159	2037/3/14
		9.5	650	953	104,860	2030/2/2
		7.75	500	664	73,074	2031/1/14
		6.375	500	604	66,511	2032/1/15
		6.875	2,200	2,221	244,270	2021/4/22
		5.625	1,750	1,693	186,176	2022/1/26
		7.5	2,500	2,478	272,494	2026/4/22
		6.875	1,600	1,518	166,919	2027/1/26
		6.625	800	735	80,820	2028/7/6
		7.125	1,400	1,254	137,972	2036/7/6
		7.625	1,350	1,222	134,400	2046/4/22
		7.125	900	779	85,727	2117/6/28
		4.375	700	715	78,646	2021/7/12
		2.625	600	563	61,976	2023/3/15
		4.0	1,100	1,094	120,381	2024/2/26
		4.5	1,000	1,011	111,265	2026/1/28
		3.875	900	864	95,030	2027/4/25
		6.125	1,020	1,134	124,777	2041/1/18
		5.625	900	951	104,654	2044/2/26
		5.0	1,700	1,653	181,791	2045/6/15
		6.75	300	313	34,490	2019/11/5
		6.25	720	753	82,892	2020/1/29
		6.375	1,000	1,073	118,003	2021/3/29
		7.625	450	622	68,396	2041/3/29
		4.875	500	515	56,637	2021/5/5
		3.75	1,200	1,183	130,182	2022/4/25
		3.375	900	864	95,053	2023/4/15
		4.125	1,400	1,371	150,862	2025/1/15
		4.75	1,200	1,213	133,489	2026/1/8
		4.35	700	684	75,249	2027/1/8
		3.85	400	375	41,294	2027/7/18
		7.75	600	771	84,815	2038/1/17
		5.25	600	595	65,482	2042/1/17
		4.625	200	182	20,106	2043/4/15
		6.75	800	951	104,672	2044/1/15
		5.125	800	775	85,328	2045/1/15
		5.95	800	867	95,356	2046/1/8
		5.25	800	788	86,698	2047/1/8
		5.2	850	878	96,620	2020/1/30
		3.75	400	391	42,994	2025/3/16
		3.875	900	875	96,242	2028/3/17
		4.5	500	476	52,368	2047/5/15
		4.125	600	612	67,295	2027/8/25

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	REPUBLIC OF PERU	5.625	700	803	88,325	2050/11/18
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	4.0	1,300	1,325	145,792	2021/ 1 /15
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	4.2	1,900	1,957	215,217	2024/ 1 /21
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	5.5	300	332	36,539	2026/ 3 /30
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	6.375	600	738	81,166	2034/10/23
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	5.0	600	649	71,426	2037/ 1 /13
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.95	1,200	1,141	125,555	2040/ 1 /20
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.7	1,100	1,009	111,011	2042/ 2 / 2
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.5	900	927	102,021	2020/ 3 / 9
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.875	250	263	29,028	2022/ 5 /30
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.665	300	295	32,476	2024/ 1 /17
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.875	950	981	107,972	2025/ 9 /16
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.875	700	676	74,336	2026/ 4 /14
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.3	900	810	89,111	2028/10/12
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.375	200	181	19,947	2044/ 7 /24
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.0	500	427	47,053	2046/10/12
		REPUBLIC OF TURKEY	5.625	800	809	89,020	2021/ 3 /30
		REPUBLIC OF TURKEY	5.125	600	593	65,207	2022/ 3 /25
		REPUBLIC OF TURKEY	6.25	1,200	1,225	134,742	2022/ 9 /26
		REPUBLIC OF TURKEY	4.25	400	345	38,002	2026/ 4 /14
		REPUBLIC OF TURKEY	4.875	1,300	1,161	127,677	2026/10/ 9
		REPUBLIC OF TURKEY	6.0	1,600	1,534	168,734	2027/ 3 /25
		REPUBLIC OF TURKEY	6.75	400	380	41,864	2040/ 5 /30
		REPUBLIC OF TURKEY	6.0	900	784	86,311	2041/ 1 /14
		REPUBLIC OF TURKEY	4.875	2,000	1,505	165,533	2043/ 4 /16
		REPUBLIC OF TURKEY	6.625	1,100	1,010	111,121	2045/ 2 /17
		REPUBLIC OF TURKEY	5.75	1,400	1,148	126,275	2047/ 5 /11
		ROMANIA	6.75	400	436	47,974	2022/ 2 / 7
		ROMANIA	4.375	800	805	88,539	2023/ 8 /22
		ROMANIA	4.875	700	720	79,234	2024/ 1 /22
		ROMANIA	6.125	400	456	50,141	2044/ 1 /22
		RUSSIA	7.5	1,557	1,724	189,658	2030/ 3 /31
		RUSSIA FOREIGN BOND	5.0	1,300	1,326	145,815	2020/ 4 /29
		RUSSIAN FEDERATION	4.5	1,000	1,007	110,783	2022/ 4 / 4
		RUSSIAN FEDERATION	4.875	1,400	1,432	157,523	2023/ 9 /16
		RUSSIAN FEDERATION	4.75	1,400	1,392	153,094	2026/ 5 /27
		RUSSIAN FEDERATION	4.25	1,000	953	104,863	2027/ 6 /23
		RUSSIAN FEDERATION	5.625	1,200	1,201	132,116	2042/ 4 / 4
		RUSSIAN FEDERATION	5.875	400	411	45,248	2043/ 9 /16
		RUSSIAN FEDERATION	5.25	2,800	2,577	283,453	2047/ 6 /23
TURKEY GLOBAL	7.0	650	675	74,241	2020/ 6 / 5		
TURKEY GLOBAL	5.75	1,800	1,765	194,141	2024/ 3 /22		
TURKEY GLOBAL	7.375	1,250	1,309	144,004	2025/ 2 / 5		
TURKEY GLOBAL	11.875	450	623	68,595	2030/ 1 /15		
UKRAINE GOVERNMENT	7.375	1,200	1,068	117,437	2032/ 9 /25		
UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	765	776	85,364	2020/ 9 / 1		
UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	409	414	45,595	2021/ 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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	509	506	55,723	2022/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	700	689	75,784	2023/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	800	776	85,377	2024/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	1,300	1,241	136,529	2026/9/1
		UNITED MEXICAN STATES	3.5	900	914	100,547	2021/1/21
		UNITED MEXICAN STATES	3.625	1,100	1,101	121,153	2022/3/15
		UNITED MEXICAN STATES	4.0	1,750	1,755	193,079	2023/10/2
		UNITED MEXICAN STATES	3.6	1,200	1,157	127,267	2025/1/30
		UNITED MEXICAN STATES	4.125	1,000	986	108,448	2026/1/21
		UNITED MEXICAN STATES	4.15	1,400	1,369	150,557	2027/3/28
		UNITED MEXICAN STATES	6.05	1,610	1,741	191,508	2040/1/11
		UNITED MEXICAN STATES	4.75	1,600	1,476	162,302	2044/3/8
		UNITED MEXICAN STATES	5.55	1,300	1,339	147,343	2045/1/21
		UNITED MEXICAN STATES	4.6	1,300	1,173	129,082	2046/1/23
		UNITED MEXICAN STATES	4.35	700	607	66,773	2047/1/15
		UNITED MEXICAN STATES	4.6	900	806	88,721	2048/2/10
		UNITED MEXICAN STATES	5.75	1,100	1,069	117,629	2110/10/12
		合 計					

\* 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。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2018年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	14,070,263	97.5
コール・ローン等、その他	358,094	2.5
投資信託財産総額	14,428,357	100.0

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 当期末における外貨建て純資産（14,158,567千円）の投資信託財産総額（14,428,357千円）に対する比率は98.1%です。

\* 外貨建て資産は、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米ドル＝109.96円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	14,573,145,575
コール・ローン等	181,169,123
公社債(評価額)	14,070,263,162
未収入金	145,031,600
未収利息	158,054,156
前払費用	18,627,534
(B) 負債	283,097,881
未払金	265,239,728
未払解約金	17,489,943
未払利息	210
その他未払費用	368,000
(C) 純資産総額(A－B)	14,290,047,694
元本	8,150,871,203
次期繰越損益金	6,139,176,491
(D) 受益権総口数	8,150,871,203口
1万口当たり基準価額(C／D)	17,532円

(注) 期首元本額は4,971,155,882円、期中追加設定元本額は4,260,888,874円、期中一部解約元本額は1,081,173,553円、1口当たり純資産額は1.7532円です。

○損益の状況 (2017年5月11日～2018年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	605,770,860
受取利息	605,802,587
支払利息	△ 31,727
(B) 有価証券売買損益	△1,362,422,993
売買益	7,405,199
売買損	△1,369,828,192
(C) 保管費用等	△ 2,469,736
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 759,121,869
(E) 前期繰越損益金	4,281,557,523
(F) 追加信託差損益金	3,514,923,823
(G) 解約差損益金	△ 898,182,986
(H) 計(D＋E＋F＋G)	6,139,176,491
次期繰越損益金(H)	6,139,176,491

\*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。

\*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。

\*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。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村新興国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	3,283,307,644
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	1,431,704,829
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	1,393,916,200
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	795,539,197
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	411,530,134
野村DC運用戦略ファンド	365,321,676
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	214,338,087
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	96,523,004
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	71,765,670
ネクストコア	57,505,358
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	11,396,163
インデックス・ブレンド(タイプⅢ)	6,219,771
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,498,331
インデックス・ブレンド(タイプⅡ)	3,170,480
インデックス・ブレンド(タイプⅤ)	2,118,955
インデックス・ブレンド(タイプⅠ)	1,941,862
インデックス・ブレンド(タイプⅣ)	1,073,842

○お知らせ

該当事項はございません。

# 新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド

## 運用報告書

第9期（決算日2019年2月18日）

作成対象期間（2018年2月20日～2019年2月18日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。
主な投資対象	現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク JPモルガン・ガバメント・ボンド・ インデックス・エマージング・ マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円換算ベース)		債組入比率	債先物比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
5期(2015年2月18日)	13,863	10.9	142.69	10.9	97.4	—	百万円 2,077
6期(2016年2月18日)	11,485	△17.2	118.83	△16.7	97.0	—	1,612
7期(2017年2月20日)	12,644	10.1	131.55	10.7	96.4	—	4,218
8期(2018年2月19日)	13,772	8.9	144.15	9.6	97.8	—	7,008
9期(2019年2月18日)	13,261	△3.7	139.01	△3.6	97.4	—	7,946

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*ベンチマーク（＝JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース））は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース) をもとに、当社が円換算したものです。なお指数の算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。（設定時を100として指数化しています。）

\*JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数です（ただし、国別の組入比率には上限が設定されています）。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ エマージング・マーケット・グローバル・ ディバーシファイド(円換算ベース)		債組入比率	債先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) 2018年2月19日	13,772	—	144.15	—	97.8	—
2月末	13,783	0.1	144.38	0.2	97.4	—
3月末	13,744	△0.2	143.84	△0.2	98.0	—
4月末	13,701	△0.5	143.51	△0.4	97.4	—
5月末	12,974	△5.8	135.82	△5.8	97.5	—
6月末	12,710	△7.7	133.42	△7.4	97.6	—
7月末	13,130	△4.7	137.49	△4.6	97.8	—
8月末	12,271	△10.9	128.64	△10.8	98.0	—
9月末	12,858	△6.6	135.27	△6.2	97.7	—
10月末	12,666	△8.0	132.97	△7.8	97.3	—
11月末	13,047	△5.3	136.99	△5.0	97.6	—
12月末	12,783	△7.2	134.08	△7.0	97.6	—
2019年1月末	13,119	△4.7	137.28	△4.8	97.4	—
(期末) 2019年2月18日	13,261	△3.7	139.01	△3.6	97.4	—

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首13,772円から期末13,261円に511円の値下がりとなりました。

新興国債券のリターンは利金収入などからプラスとなりましたが、新興国通貨が概ね対円で下落（円高）したことなどがマイナスに影響し、基準価額は下落しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債などに分散投資しました。毎月の指数構成銘柄の変更に対応し、ポートフォリオの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

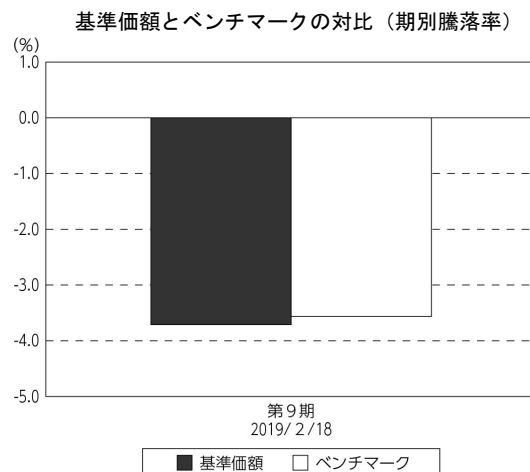
今期の基準価額の騰落率は－3.7%となり、ベンチマークの－3.6%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用や利金に対する課税などのコスト）が生じること。

（その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること。



（注）ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）です。



◎今後の運用方針

当ファンドでは引き続き、新興国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

\*本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含まれますが、これに限られません。）（以下、「本インデックス」といいます。）に関する情報（以下、「当情報」といいます。）は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行うものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できるとされるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション（ロング若しくはショート）を有し、取引を行い、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があります。あるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。

ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エル・エル・シー（以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。）は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引（以下「該当商品」といいます。）を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有効性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有効性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できるとされる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。

JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

当情報に関して追加が必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、[index.research@jpmorgan.com](mailto:index.research@jpmorgan.com)宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、[www.morganmarkets.com](http://www.morganmarkets.com)もご覧ください。

当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

○ 1 万口当たりの費用明細

（2018年 2 月20日～2019年 2 月18日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) そ の 他 費 用	14	0.107	(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 ）	(13)	(0.099)	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)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	14	0.107	
期中の平均基準価額は、13,065円です。			

\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。  
\* 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

(2018年2月20日～2019年2月18日)

## 公社債

			買 付 額	売 付 額
外	トルコ	国債証券	千トルコリラ 8,572	千トルコリラ 6,560
	チェコ	国債証券	千チェココルナ 46,235	千チェココルナ 31,607
	ハンガリー	国債証券	千フォリント 430,607	千フォリント 247,395
	ポーランド	国債証券	千ズロチ 12,415	千ズロチ 7,770
	ロシア	国債証券	千ルーブル 127,201	千ルーブル 56,548
	ルーマニア	国債証券	千レイ 4,586	千レイ 3,213
	マレーシア	国債証券	千リンギ 9,005	千リンギ 6,162
	タイ	国債証券	千バーツ 95,918	千バーツ 70,024
	インドネシア	国債証券	千ルピア 40,668,660	千ルピア 20,184,260
	アルゼンチン	国債証券	千アルゼンチンペソ 8,100	千アルゼンチンペソ —
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 66,234	千メキシコペソ 41,179
	ブラジル	国債証券	千レアル 16,700	千レアル 13,077
	チリ	国債証券	千チリペソ 602,541	千チリペソ 91,561
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ 8,734,884	千コロンビアペソ 5,228,983
	ペルー	国債証券	千ソル 3,342	千ソル 1,256
	南アフリカ	国債証券	千ランド 40,120	千ランド 20,395

\*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

\*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2018年2月20日～2019年2月18日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 7,085	百万円 962	% 13.6	百万円 5,909	百万円 962	% 16.3

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野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2019年2月18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
トルコ	千トルコリラ 21,570	千トルコリラ 17,812	千円 373,892	% 4.7	% 4.7	% 1.8	% 2.7	% 0.2
チェコ	千チェココルナ 70,100	千チェココルナ 66,286	322,815	4.1	—	2.1	1.2	0.7
ハンガリー	千フォリント 848,000	千フォリント 907,243	356,183	4.5	—	1.8	2.0	0.7
ポーランド	千ズロチ 23,410	千ズロチ 24,340	702,216	8.8	—	2.8	4.7	1.3
ロシア	千ルーブル 345,000	千ルーブル 336,397	561,784	7.1	—	3.9	2.3	0.8
ルーマニア	千レイ 8,270	千レイ 8,331	219,782	2.8	—	1.0	1.7	—
マレーシア	千リング 17,320	千リング 17,394	471,902	5.9	—	3.6	1.4	0.9
タイ	千バーツ 178,800	千バーツ 186,858	661,480	8.3	—	4.5	3.6	0.2
フィリピン	千フィリピンペソ 10,000	千フィリピンペソ 9,992	21,084	0.3	—	—	—	0.3
インドネシア	千ルピア 95,360,000	千ルピア 94,156,324	734,419	9.2	—	7.2	1.6	0.4
アルゼンチン	千アルゼンチンペソ 18,600	千アルゼンチンペソ 16,925	48,408	0.6	0.6	0.4	0.2	—
メキシコ	千メキシコペソ 142,100	千メキシコペソ 136,408	784,346	9.9	—	5.4	3.6	0.9
ブラジル	千レアル 14,047	千レアル 26,536	792,370	10.0	10.0	2.7	3.2	4.0
チリ	千チリペソ 1,405,000	千チリペソ 1,526,611	254,180	3.2	—	2.2	0.4	0.6
コロンビア	千コロンビアペソ 12,880,000	千コロンビアペソ 15,351,329	541,901	6.8	—	5.5	1.4	—
ペルー	千ソル 6,920	千ソル 7,417	246,470	3.1	—	3.1	—	—
ウルグアイ	千ウルグアイペソ 4,000	千ウルグアイペソ 3,558	12,061	0.2	—	0.2	—	—
南アフリカ	千ランド 89,050	千ランド 80,898	635,859	8.0	8.0	7.2	0.8	—
合 計	—	—	7,741,160	97.4	23.3	55.5	30.8	11.1

\* 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。

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 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。

\* S&amp;Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。

## (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	
					外貨建金額	邦貨換算金額
						償還年月日
トルコ			%	千トルコリラ	千トルコリラ	千円
国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	9.4	950	845	17,747	2020/7/8
	TURKEY GOVERNMENT BOND	10.7	1,000	886	18,597	2021/2/17
	TURKEY GOVERNMENT BOND	9.2	1,300	1,110	23,303	2021/9/22
	TURKEY GOVERNMENT BOND	9.5	2,550	2,152	45,174	2022/1/12
	TURKEY GOVERNMENT BOND	11.0	1,200	1,052	22,089	2022/3/2
	TURKEY GOVERNMENT BOND	8.5	1,390	1,125	23,632	2022/9/14
	TURKEY GOVERNMENT BOND	12.2	1,300	1,164	24,449	2023/1/18
	TURKEY GOVERNMENT BOND	7.1	2,270	1,695	35,592	2023/3/8
	TURKEY GOVERNMENT BOND	8.8	1,160	917	19,259	2023/9/27
	TURKEY GOVERNMENT BOND	10.4	520	435	9,135	2024/3/20
	TURKEY GOVERNMENT BOND	9.0	1,610	1,266	26,578	2024/7/24
	TURKEY GOVERNMENT BOND	8.0	1,020	746	15,665	2025/3/12
	TURKEY GOVERNMENT BOND	10.6	1,300	1,075	22,566	2026/2/11
	TURKEY GOVERNMENT BOND	11.0	1,000	835	17,526	2027/2/24
	TURKEY GOVERNMENT BOND	10.5	2,100	1,694	35,571	2027/8/11
	TURKEY GOVERNMENT BOND	12.4	900	810	17,001	2028/3/8
小 計					373,892	
チェコ				千チェココルナ	千チェココルナ	
国債証券	CZECH REPUBLIC	—	5,000	4,913	23,927	2020/2/10
	CZECH REPUBLIC	3.75	6,700	6,902	33,614	2020/9/12
	CZECH REPUBLIC	0.45	20,800	19,700	95,942	2023/10/25
	CZECH REPUBLIC	1.0	20,700	19,678	95,834	2026/6/26
	CZECH REPUBLIC	0.95	16,900	15,091	73,496	2030/5/15
小 計					322,815	
ハンガリー				千フォリント	千フォリント	
国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND	1.0	58,000	58,663	23,031	2020/9/23
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	7.5	81,000	90,894	35,685	2020/11/12
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	2.5	120,000	124,610	48,922	2021/10/27
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	7.0	50,000	59,216	23,248	2022/6/24
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	1.75	122,000	122,992	48,286	2022/10/26
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	6.0	77,000	92,138	36,173	2023/11/24
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.0	65,000	68,200	26,775	2024/6/26
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	5.5	63,000	74,563	29,273	2025/6/24
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	2.75	30,000	30,120	11,825	2026/12/22
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.0	182,000	185,845	72,962	2027/10/27
小 計					356,183	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ	
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	2,230	2,233	64,428	2020/4/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	1,230	1,305	37,650	2020/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	900	909	26,250	2021/4/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	1,800	1,809	52,205	2021/7/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	1,080	1,197	34,537	2021/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	2,200	2,229	64,326	2022/4/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	1,580	1,792	51,704	2022/9/23
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	400	409	11,806	2023/1/25
	POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	4,240	4,608	132,947	2023/10/25

銘 柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ポーランド			%	千ズロチ	千ズロチ	千円	
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	1,900	1,998	57,646	2025/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,050	2,051	59,172	2026/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,900	1,886	54,414	2027/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	1,900	1,910	55,125	2028/ 4 /25
小 計						702,216	
ロシア				千ルーブル	千ルーブル		
	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	6.4	40,500	39,884	66,606	2020/ 5 /27
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.5	8,000	7,952	13,280	2021/ 8 /18
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.6	67,000	66,423	110,927	2022/ 7 /20
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.0	37,000	35,878	59,917	2023/ 1 /25
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	6.5	40,000	37,549	62,708	2024/ 2 /28
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.75	59,000	57,999	96,859	2026/ 9 /16
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.05	21,000	19,463	32,503	2028/ 1 /19
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	8.5	35,000	35,616	59,479	2031/ 9 /17
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.7	37,500	35,628	59,500	2033/ 3 /23
小 計						561,784	
ルーマニア				千レイ	千レイ		
	国債証券	ROMANIA	3.25	2,290	2,281	60,192	2021/ 3 /22
		ROMANIA	5.95	300	315	8,317	2021/ 6 /11
		ROMANIA	4.0	500	502	13,257	2021/10/27
		ROMANIA	3.4	400	395	10,429	2022/ 3 /8
		ROMANIA	3.5	1,500	1,477	38,985	2022/12/19
		ROMANIA	5.85	250	266	7,026	2023/ 4 /26
		ROMANIA	3.25	1,100	1,052	27,766	2024/ 4 /29
		ROMANIA	4.75	920	942	24,863	2025/ 2 /24
		ROMANIA	5.8	1,010	1,097	28,944	2027/ 7 /26
小 計						219,782	
マレーシア				千リンギ	千リンギ		
	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3.899	2,600	2,594	70,388	2027/11/16
		MALAYSIA GOVERNMENT	4.762	1,000	1,037	28,152	2037/ 4 /7
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.659	2,700	2,707	73,460	2020/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	620	628	17,050	2021/ 7 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.62	2,800	2,804	76,090	2021/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.757	700	701	19,020	2023/ 4 /20
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	2,600	2,650	71,910	2024/ 7 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.9	2,000	2,004	54,375	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	2,300	2,265	61,453	2028/ 6 /15
小 計						471,902	
タイ				千バーツ	千バーツ		
	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	2.55	3,500	3,536	12,519	2020/ 6 /26
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.65	17,900	18,798	66,546	2021/12/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	1.875	23,000	22,953	81,257	2022/ 6 /17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	2.0	14,000	13,991	49,528	2022/12/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.625	21,700	23,083	81,716	2023/ 6 /16
		THAILAND GOVERNMENT BOND	2.4	2,600	2,627	9,301	2023/12/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.85	4,000	4,394	15,558	2025/12/12
		THAILAND GOVERNMENT BOND	2.125	18,900	18,544	65,647	2026/12/17

銘 柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
タイ			%	千バーツ	千バーツ	千円	
	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	2.875	9,000	9,334	33,043	2028/12/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	4.875	12,500	15,098	53,446	2029/6/22
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.65	15,000	16,453	58,246	2031/6/20
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.775	5,200	5,763	20,403	2032/6/25
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.4	22,500	23,872	84,508	2036/6/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	2.875	9,000	8,405	29,755	2046/6/17
小 計						661,480	
フィリピン				千フィリピンペソ	千フィリピンペソ		
	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	4.95	10,000	9,992	21,084	2021/1/15
小 計						21,084	
インドネシア				千ルピア	千ルピア		
	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	11.0	4,100,000	4,373,607	34,114	2020/11/15
		INDONESIA GOVERNMENT	12.8	1,700,000	1,897,350	14,799	2021/6/15
		INDONESIA GOVERNMENT	7.0	7,780,000	7,679,733	59,901	2022/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	5.625	7,100,000	6,588,587	51,390	2023/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.375	9,230,000	9,409,246	73,392	2024/3/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.125	2,300,000	2,331,236	18,183	2024/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	11.0	5,580,000	6,436,530	50,204	2025/9/15
		INDONESIA GOVERNMENT	7.0	6,150,000	5,740,348	44,774	2027/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	6.125	12,500,000	10,975,500	85,608	2028/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	9.0	4,030,000	4,286,534	33,434	2029/3/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.25	3,000,000	3,050,414	23,793	2029/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	10.5	1,110,000	1,287,080	10,039	2030/8/15
		INDONESIA GOVERNMENT	9.5	2,400,000	2,645,633	20,635	2031/7/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.25	4,100,000	4,106,354	32,029	2032/6/15
		INDONESIA GOVERNMENT	7.5	3,200,000	2,988,704	23,311	2032/8/15
		INDONESIA GOVERNMENT	6.625	4,900,000	4,258,198	33,213	2033/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.375	4,280,000	4,314,313	33,651	2034/3/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.25	11,000,000	10,962,490	85,507	2036/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	7.5	900,000	824,463	6,430	2038/5/15
		小 計					
アルゼンチン				千アルゼンチンペソ	千アルゼンチンペソ		
	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	18.2	5,300	4,856	13,888	2021/10/3
		REPUBLIC OF ARGENTINA	15.5	13,300	12,069	34,519	2026/10/17
小 計						48,408	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	12,250	12,221	70,271	2020/6/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	10,700	10,324	59,365	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.25	9,000	8,789	50,537	2021/12/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	17,900	17,045	98,011	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	7,500	8,118	46,679	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	10,500	9,097	52,310	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	21,150	20,086	115,495	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	1,200	1,204	6,928	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	7,900	7,423	42,687	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	6,200	5,719	32,887	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	2,700	3,009	17,304	2036/11/20

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	8.5	6,400	6,233	35,842	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	9,700	8,697	50,008	2042/11/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	5,500	5,038	28,969	2047/11/7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	13,500	13,399	77,047	2023/12/7
小 計						784,346	
ブラジル				千レアル	千レアル		
	国債証券	LETRA TESOIRO NACIONAL	—	6,900	6,326	188,904	2020/7/1
		LETRA TESOIRO NACIONAL	—	5,700	4,623	138,051	2022/1/1
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL	10.0	406	4,321	129,046	2021/1/1
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL	10.0	370	3,990	119,142	2023/1/1
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL	10.0	451	4,885	145,880	2025/1/1
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL	10.0	220	2,389	71,344	2027/1/1
小 計						792,370	
チリ				千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS	4.5	170,000	176,910	29,455	2021/3/1
		BONOS TESORERIA PESOS	4.5	180,000	188,235	31,341	2026/3/1
		BONOS TESORERIA PESOS	5.0	490,000	530,743	88,368	2035/3/1
		BONOS TESORERIA PESOS	6.0	265,000	322,293	53,661	2043/1/1
		REPUBLIC OF CHILE	5.5	300,000	308,429	51,353	2020/8/5
小 計						254,180	
コロンビア				千コロンビアペソ	千コロンビアペソ		
	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	7.75	2,940,000	3,068,919	108,332	2021/4/14
		REPUBLIC OF COLOMBIA	9.85	9,940,000	12,282,410	433,569	2027/6/28
小 計						541,901	
ペルー				千ソル	千ソル		
	国債証券	BONOS DE TESORERIA	5.7	1,400	1,463	48,639	2024/8/12
		BONOS DE TESORERIA	5.94	900	925	30,748	2029/2/12
		BONOS DE TESORERIA	6.15	1,300	1,344	44,666	2032/8/12
		PERU BONO SOBERANO	8.2	800	947	31,488	2026/8/12
		PERU BONO SOBERANO	6.95	1,100	1,213	40,330	2031/8/12
		PERU BONO SOBERANO	6.9	620	672	22,362	2037/8/12
		REPUBLIC OF PERU	6.35	800	849	28,234	2028/8/12
小 計						246,470	
ウルグアイ				千ウルグアイペソ	千ウルグアイペソ		
	国債証券	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	8.5	4,000	3,558	12,061	2028/3/15
小 計						12,061	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	440	436	3,433	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	8,000	7,941	62,423	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	13,500	14,724	115,737	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	5,700	5,164	40,596	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	6,760	5,554	43,659	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	7,000	6,295	49,485	2032/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.875	4,000	3,716	29,209	2035/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	5,700	4,067	31,973	2036/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	8,800	7,804	61,345	2037/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0	3,100	2,850	22,402	2040/1/31



銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
南アフリカ			%	千ランド	千ランド	千円	
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	4,450	3,103	24,395	2041/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	4,600	4,097	32,210	2044/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	17,000	15,138	118,985	2048/2/28
小 計						635,859	
合 計						7,741,160	

\* 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。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2019年2月18日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	7,741,160	95.6
コール・ローン等、その他	359,545	4.4
投資信託財産総額	8,100,705	100.0

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 当期末における外貨建て純資産（7,945,998千円）の投資信託財産総額（8,100,705千円）に対する比率は98.1%です。

\* 外貨建て資産は、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米ドル=110.54円、1トルコリラ=20.99円、1チェココルナ=4.87円、1フォリント=0.3926円、1ズロチ=28.85円、1ルーブル=1.67円、1レイ=26.38円、1リンギ=27.13円、1バーツ=3.54円、1フィリピンペソ=2.11円、1ルピア=0.0078円、1アルゼンチンペソ=2.86円、1メキシコペソ=5.75円、1レアル=29.86円、1チリペソ=0.1665円、1コロンビアペソ=0.0353円、1ソル=33.23円、1ウルグアイペソ=3.39円、1ランド=7.86円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2019年2月18日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,102,912,553
コール・ローン等	231,957,164
公社債(評価額)	7,741,160,101
未収入金	2,207,134
未収利息	113,369,709
前払費用	14,218,445
(B) 負債	156,524,822
未払金	2,210,400
未払解約金	153,913,857
未払利息	265
その他未払費用	400,300
(C) 純資産総額(A－B)	7,946,387,731
元本	5,992,467,619
次期繰越損益金	1,953,920,112
(D) 受益権総口数	5,992,467,619口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,261円

(注) 期首元本額は5,088,965,742円、期中追加設定元本額は2,334,814,912円、期中一部解約元本額は1,431,313,035円、1口当たり純資産額は1.3261円です。

## ○損益の状況（2018年2月20日～2019年2月18日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	463,680,452
受取利息	463,696,807
支払利息	△ 16,355
(B) 有価証券売買損益	△ 699,946,951
売買益	139,360,550
売買損	△ 839,307,501
(C) 保管費用等	△ 8,150,423
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 244,416,922
(E) 前期繰越損益金	1,919,411,809
(F) 追加信託差損益金	704,004,557
(G) 解約差損益金	△ 425,079,332
(H) 計(D+E+F+G)	1,953,920,112
次期繰越損益金(H)	1,953,920,112

\* 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。

\* 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。

\* 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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
ノムラFPIs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）	4,158,917,759
野村インデックスファンド・新興国債券	698,107,270
野村DC新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド	363,203,605
野村DC運用戦略ファンド	271,552,842
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	211,466,533
世界6資産分散ファンド	130,302,049
ネクストコア	35,913,200
野村資産設計ファンド2040	24,383,987
野村資産設計ファンド2025	19,695,649
野村資産設計ファンド2030	18,181,439
野村資産設計ファンド2020	14,275,729
野村資産設計ファンド2015	12,214,915

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村資産設計ファンド2035	11,871,206
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	11,532,387
野村資産設計ファンド2050	3,569,529
野村資産設計ファンド2045	2,980,601
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	2,089,610
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	703,945
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	552,497
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	422,875
野村資産設計ファンド（DC）2030	194,950
野村資産設計ファンド（DC）2050	191,203
野村資産設計ファンド（DC）2040	143,839

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# J-REITインデックス マザーファンド

## 運用報告書

第13期（決算日2018年6月11日）

作成対象期間（2017年6月13日～2018年6月11日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国のREIT（不動産投資信託証券）（「J-REIT」といいます。）を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	J-REITを主要投資対象とします。
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への直接投資は行いません。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12- 1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 額
	騰 落 率	中 率	東証REIT指数 (配当込み)	騰 落 率		
9期(2014年6月10日)	円	%		%	%	百万円
	15,508	25.0	2,615.87	25.0	97.4	14,020
10期(2015年6月10日)	19,029	22.7	3,206.37	22.6	97.7	16,967
11期(2016年6月10日)	20,222	6.3	3,401.82	6.1	98.2	21,436
12期(2017年6月12日)	19,362	△ 4.3	3,254.14	△ 4.3	98.2	28,442
13期(2018年6月11日)	20,182	4.2	3,387.54	4.1	97.8	33,180

東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、東証REIT指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は東証が有します。東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		投 資 信 託 組 入 比
	騰 落 率	率	東証REIT指数 (配当込み)	騰 落 率	
(期 首)	円	%		%	%
2017年6月12日	19,362	—	3,254.14	—	98.2
6月末	18,924	△2.3	3,180.48	△2.3	98.1
7月末	19,160	△1.0	3,220.02	△1.0	98.0
8月末	18,974	△2.0	3,188.63	△2.0	98.1
9月末	18,685	△3.5	3,139.87	△3.5	98.0
10月末	18,447	△4.7	3,099.44	△4.8	98.0
11月末	18,985	△1.9	3,189.89	△2.0	97.5
12月末	18,983	△2.0	3,189.59	△2.0	98.3
2018年1月末	19,981	3.2	3,357.09	3.2	96.3
2月末	19,591	1.2	3,291.44	1.1	97.5
3月末	19,497	0.7	3,274.92	0.6	97.7
4月末	20,003	3.3	3,358.59	3.2	97.5
5月末	20,135	4.0	3,379.45	3.9	97.4
(期 末)					
2018年6月11日	20,182	4.2	3,387.54	4.1	97.8

\*騰落率は期首比です。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首19,362円から期末20,182円に820円の値上がりとなりました。

世界的な株式市場の上昇に伴うリスク選好の高まりや、日本銀行の金融緩和政策が継続されるとの観測などを受け長期金利の上昇が抑制されるとの見方が広がったことなどをを受けて、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

期首より、長期金利が上昇したことなどをを受け、国内REIT市場は下落しました。

2017年7月中旬以降、長期金利の上昇が一服したことが好感される一方、公募増資が発表され需給悪化が懸念されたことや、地政学的リスクの高まりに伴いリスク回避の姿勢が強まったことなどを背景に、国内REIT市場は一進一退の展開となりました。

2018年1月上旬以降は、世界的な株式市場の上昇に伴うリスク選好の高まりや、日本銀行の金融緩和政策が継続されるとの観測などを受け長期金利の上昇が抑制されるとの見方が広がったことなどを背景に、国内REIT市場は上昇しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・REIT組入比率

REITの実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

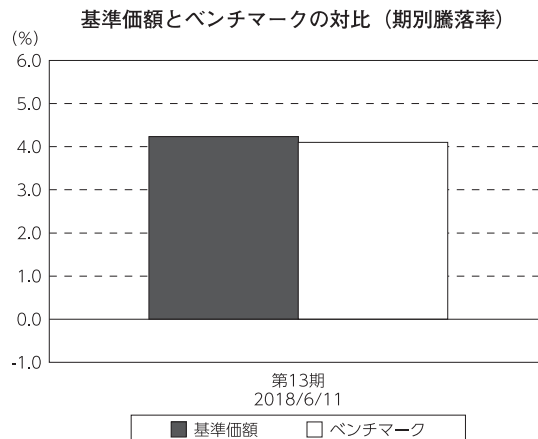
東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果を目指すため、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証REIT指数でほぼ同水準になるよう銘柄間の投資比率調整を行ってまいりました。なお、組入比率を高位に維持する為、東証REIT指数先物を利用しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+4.2%となり、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の+4.1%を0.1ポイント上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

- ・ベンチマークの変更に起因する売買の影響。
- ・実質REIT組入比率が100%に満たないことの影響が、指数の上昇時にはマイナスに、下落時にはプラスに作用したこと。



（注）ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、REITの組入比率をできるだけ高位に維持し、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年 6 月13日～2018年 6 月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 0	% 0.002	(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
( 投 資 信 託 証 券 )	(0)	(0.001)	
( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	(0)	(0.001)	
合 計	0	0.002	
期中の平均基準価額は、19,280円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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 6 月13日～2018年 6 月11日)

## 投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	口 595	千円 275,462	口 467	千円 213,733
	MCUBS Mid City投資法人 投資証券	1,407 ( 2,976)	168,018 ( —)	670	103,415
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	1,916	261,344	1,501	206,026
	産業ファンド投資法人 投資証券	1,224 ( 3,168)	274,136 ( —)	746	187,631
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	1,658	456,162	1,301	357,812
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	498 ( 1,075)	127,472 ( 30,902)	364	94,805
	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	862	407,493	615	291,513
	GLP投資法人 投資証券	4,460	525,076	2,490	296,671
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	717	172,789	519	123,312
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	2,826	667,897	1,725	410,725
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	369	204,042	187	104,897
	One リート投資法人 投資証券	193	46,374	151	34,620
	イオンリート投資法人 投資証券	1,893	221,909	1,266	149,086
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	1,280	211,218	881	146,787
	日本リート投資法人 投資証券	479	155,696	375	119,124

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	口 8,208 ( 14,798)	千円 190,866 ( ー)	口 1,568	千円 89,048
	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	91	15,177	72	12,028
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	1,487 ( 7,258)	168,334 ( 345,157)	1,029	126,346
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	379	40,770	190	20,580
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	656	154,009	516	121,663
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	218	22,848	171	17,376
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	312	28,178	245	21,664
	ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	81 (△ 210)	12,453 (△ 30,902)	69	10,119
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	5,480	798,781	4,011	590,157
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	278	33,543	223	26,007
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	1,348	152,460	1,057	117,268
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	486	52,340	299	31,324
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	212	23,177	94	9,859
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	402	142,137	230	77,719
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	411	35,769	200	17,576
	さくら総合リート投資法人 投資証券	428	39,398	335	30,294
	投資法人みらい 投資証券	308	55,144	184	32,531
	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	387	55,829	303	44,208
	三菱地所物流リート投資法人 投資証券	431	117,245	62	16,855
	CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	411	46,461	13	1,480
	ザイマックス・リート投資法人 投資証券	379	42,679	12	1,376
	日本ビルファンド投資法人 投資証券	1,731	989,059	1,357	779,039
	ジャパリアルエステイト投資法人 投資証券	1,882	1,033,962	1,318	728,477
	日本リテールファンド投資法人 投資証券	3,435	706,202	2,833	580,254
	オリックス不動産投資法人 投資証券	3,674	593,512	2,710	438,802
	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,129	427,250	886	340,889
	プレミア投資法人 投資証券	1,619	174,413	1,270	137,831
	東急リアル・エスデート投資法人 投資証券	1,197	167,177	938	129,200
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	417 ( 1,848)	113,916 ( ー)	315	91,074
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	3,940	648,179	3,088	507,887
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	1,276	209,044	1,000	168,860	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	6,389	304,177	3,487	168,060	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	608	274,145	476	217,266	
平和不動産リート投資法人 投資証券	1,113	106,217	873	82,004	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,273	271,385	905	195,596	
福岡リート投資法人 投資証券	995	168,016	681	114,584	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	586	377,014	408	258,885	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,211 (△ 2,930)	138,465 (△ 345,157)	1,005	115,988	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	1,385	107,494	1,086	82,989	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	391	229,480	308	177,298	
阪急リート投資法人 投資証券	836	111,212	571	77,182	
スタートアップ投資法人 投資証券	280	45,190	219	34,438	
大和ハウスイリート投資法人 投資証券	2,385	623,131	1,450	385,889	



銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	口 千円			口 千円	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	5,749	449,149	4,021	310,095
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	2,010	165,169	1,575	129,202
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	1,598	215,558	1,252	167,295
合 計		89,879 ( 27,983)	15,051,232 ( —)	58,173	10,674,752

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	REIT先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		2,639	2,459	—	—

\*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2017年6月13日～2018年6月11日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
投資信託証券	百万円 15,051	百万円 1,067	% 7.1	百万円 10,674	百万円 681	% 6.4

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野村證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2018年6月11日現在)

## 国内投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,194	1,322	644,475	1.9
MCUBS Mid City投資法人 投資証券	727	4,440	369,852	1.1
森ヒルズリート投資法人 投資証券	3,860	4,275	591,232	1.8
産業ファンド投資法人 投資証券	976	4,622	555,102	1.7
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,327	3,684	1,041,466	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	815	2,024	323,030	1.0
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,553	1,800	865,800	2.6
GLP投資法人 投資証券	6,291	8,261	998,754	3.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,310	1,508	396,754	1.2
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	4,203	5,304	1,225,224	3.7
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	447	629	350,353	1.1
Oneリート投資法人 投資証券	393	435	109,315	0.3
イオンリート投資法人 投資証券	3,152	3,779	464,817	1.4
ヒューリックリート投資法人 投資証券	2,304	2,703	453,293	1.4
日本リート投資法人 投資証券	965	1,069	343,149	1.0
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	2,010	23,448	343,278	1.0
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	174	193	33,118	0.1
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	2,254	9,970	701,888	2.1
トーセイ・リート投資法人 投資証券	451	640	72,064	0.2
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,307	1,447	350,318	1.1
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	443	490	52,920	0.2
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	624	691	66,819	0.2
ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	198	—	—	—
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	10,308	11,777	1,811,302	5.5
いちごホテルリート投資法人 投資証券	568	623	82,796	0.2
ラサールロジポート投資法人 投資証券	2,711	3,002	331,420	1.0
スターアジア不動産投資法人 投資証券	746	933	99,364	0.3
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	201	319	37,259	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	581	753	256,396	0.8
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	457	668	58,116	0.2
さくら総合リート投資法人 投資証券	864	957	88,522	0.3
投資法人みらい 投資証券	457	581	108,414	0.3
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	778	862	124,559	0.4
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	—	369	99,519	0.3
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	—	398	45,411	0.1
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	—	367	41,838	0.1
日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,480	3,854	2,389,480	7.2
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,396	3,960	2,245,320	6.8
日本リテールファンド投資法人 投資証券	6,912	7,514	1,508,811	4.5
オリックス不動産投資法人 投資証券	6,932	7,896	1,364,428	4.1
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,269	2,512	1,024,896	3.1
プレミア投資法人 投資証券	3,245	3,594	382,761	1.2
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,409	2,668	393,796	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	577	2,527	276,959	0.8

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券		7,925	8,777	1,499,989	4.5
森トラスト総合リート投資法人 投資証券		2,568	2,844	452,196	1.4
インヴィンシブル投資法人 投資証券		8,012	10,914	550,065	1.7
フロンティア不動産投資法人 投資証券		1,222	1,354	607,946	1.8
平和不動産リート投資法人 投資証券		2,238	2,478	259,446	0.8
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券		2,283	2,651	589,052	1.8
福岡リート投資法人 投資証券		1,744	2,058	354,799	1.1
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券		1,050	1,228	827,672	2.5
積水ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券		2,724	—	—	—
いちごオフィスリート投資法人 投資証券		2,782	3,081	256,647	0.8
大和証券オフィス投資法人 投資証券		775	858	543,114	1.6
阪急リート投資法人 投資証券		1,472	1,737	237,621	0.7
スターツプロシード投資法人 投資証券		566	627	102,639	0.3
大和ハウスリート投資法人 投資証券		3,695	4,630	1,211,208	3.7
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券		9,758	11,486	933,811	2.8
日本賃貸住宅投資法人 投資証券		4,041	4,476	388,069	1.2
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券		3,218	3,564	511,790	1.5
合 計	口 数 ・ 金 額	141,942	201,631	32,450,471	
	銘 柄 数<比 率>	58	59	<97.8%>	

\*評価額の単位未満は切り捨て。

\*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末
			買 建 額 売 建 額
国 内	REIT先物取引	東証REIT指数	百万円 百万円
			727 ー

\*単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2018年6月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	32,450,471	97.4
コール・ローン等、その他	857,441	2.6
投資信託財産総額	33,307,912	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年6月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	33,307,912,496
コール・ローン等	541,944,033
投資証券(評価額)	32,450,471,720
未収入金	95,953,240
未収配当金	205,551,503
差入委託証拠金	13,992,000
(B) 負債	127,128,331
未払金	681,792
未払解約金	126,445,383
未払利息	1,156
(C) 純資産総額(A-B)	33,180,784,165
元本	16,440,628,966
次期繰越損益金	16,740,155,199
(D) 受益権総口数	16,440,628,966口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,182円

(注) 期首元本額は14,690,222,837円、期中追加設定元本額は7,995,850,020円、期中一部解約元本額は6,245,443,891円、1口当たり純資産額は2,0182円で。

## ○損益の状況 (2017年6月13日～2018年6月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,160,413,002
受取配当金	1,152,067,985
その他収益金	8,617,706
支払利息	△ 272,689
(B) 有価証券売買損益	145,962,617
売買益	950,181,233
売買損	△ 804,218,616
(C) 先物取引等取引損益	33,301,332
取引益	50,211,152
取引損	△ 16,909,820
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,339,676,951
(E) 前期繰越損益金	13,752,450,913
(F) 追加信託差損益金	7,324,082,701
(G) 解約差損益金	△ 5,676,055,366
(H) 計(D+E+F+G)	16,740,155,199
次期繰越損益金(H)	16,740,155,199

\* 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。

\* 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。

\* 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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,876,295,021
野村インデックスファンド・J-REIT	2,818,073,476
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	2,167,220,220
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,736,274,574
ノムラFOPs用インデックスファンド・J-REIT(適格機関投資家専用)	1,263,029,136
野村DC運用戦略ファンド	1,200,458,754
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,168,653,393
野村世界6資産分散投信(成長コース)	828,501,338
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	791,732,783
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	564,125,628
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	494,036,841
ネクストコア	184,859,807
野村6資産均等バランス	76,365,832
野村世界REITインデックスAコース(野村投資一任口座向け)	59,359,954
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	36,597,337
野村資産設計ファンド2040	33,925,777
野村資産設計ファンド2030	25,222,826
野村資産設計ファンド2015	22,466,549

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村資産設計ファンド2025	21,982,017
野村資産設計ファンド2020	20,678,293
野村資産設計ファンド2035	19,894,264
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	12,516,879
野村資産設計ファンド2050	4,690,074
インデックス・ブレンド(タイプV)	3,681,059
野村資産設計ファンド2045	3,317,033
インデックス・ブレンド(タイプⅢ)	2,334,571
インデックス・ブレンド(タイプⅡ)	1,054,430
インデックス・ブレンド(タイプⅠ)	701,390
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	577,619
インデックス・ブレンド(タイプⅣ)	559,930
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	556,157
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	492,581
野村資産設計ファンド(DC)2050	173,852
野村資産設計ファンド(DC)2040	112,348
野村資産設計ファンド(DC)2030	107,223

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 海外REITインデックス マザーファンド

## 運用報告書

第13期（決算日2018年6月11日）

作成対象期間（2017年6月13日～2018年6月11日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	日本を除く世界各国のREIT（不動産投資信託証券）を主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とします。
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		投 資 信 託 券 率 組 入 比	純 資 産 額
	騰 落	中 率	騰 落	中 率		
	円	%		%	%	百万円
9期(2014年6月10日)	16,826	17.2	175.20	17.7	99.8	16,578
10期(2015年6月10日)	21,126	25.6	220.55	25.9	99.5	17,563
11期(2016年6月10日)	20,525	△ 2.8	215.72	△ 2.2	99.2	17,911
12期(2017年6月12日)	21,472	4.6	226.73	5.1	99.4	20,175
13期(2018年6月11日)	22,049	2.7	234.01	3.2	98.5	20,604

ベンチマーク（＝S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース））は、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、ドルベース）をもとに、当社が独自に円換算した指数です（設定時を100としています。）。なお、算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の為替レート（対顧客電信売買相場仲値）で円換算しております。

（出所）スタンダード・アンド・プアーズ、ブルームバーグ

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		投 資 信 託 券 率 組 入 比
	騰 落	率	騰 落	率	
	円	%		%	%
(期 首) 2017年6月12日	21,472	—	226.73	—	99.4
6月末	21,915	2.1	231.63	2.2	98.0
7月末	21,878	1.9	231.45	2.1	99.4
8月末	21,730	1.2	229.92	1.4	99.3
9月末	22,257	3.7	235.50	3.9	99.1
10月末	22,177	3.3	234.71	3.5	99.4
11月末	22,579	5.2	239.11	5.5	99.4
12月末	23,070	7.4	244.55	7.9	99.2
2018年1月末	21,323	△0.7	226.08	△0.3	99.3
2月末	19,844	△7.6	210.56	△7.1	99.3
3月末	20,203	△5.9	214.31	△5.5	99.2
4月末	20,820	△3.0	220.87	△2.6	99.6
5月末	21,617	0.7	229.31	1.1	99.2
(期 末) 2018年6月11日	22,049	2.7	234.01	3.2	98.5

\*騰落率は期首比です。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首21,472円から期末22,049円に577円の値上がりとなりました。

主要投資国のREIT市場のリターン（配当金を含みます。）がプラスとなり、基準価額は上昇しました。

## ○投資環境

当運用期間中のREIT市場は、米国における急激な利上げへの過度な警戒感が後退したことなどを背景に、期首から2017年12月にかけて緩やかに上昇しました。2018年1月から3月にかけては、米国の長期金利が大きく上昇したことや、世界的に株安になったことなどを受けて大きく下落し、米中貿易摩擦への警戒感などから上値の重い展開となりました。4月以降は、米中貿易摩擦への警戒感が緩和したことなどを背景に上昇しました。

為替市場は、期首から米国の利上げの行方や欧州の金融緩和策の縮小観測、緊迫化する北朝鮮情勢の行方を巡り、一進一退の展開となりました。2018年1月から3月にかけては、米財務長官のドル安容認発言や世界的な株安を背景に投資家のリスク回避姿勢が強まったこと、米国の財政赤字の拡大への懸念などを受けて主要通貨は対円で下落（円高）しましたが、4月以降は、米中貿易摩擦への警戒感が緩和したことや日米金利差が拡大したことなどを背景に上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・REIT組入比率

REITの実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

### ・期中の主な動き

「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）」の動きをとらえるために、「S&P先進国REIT指数（除く日本）」を構成する全銘柄を投資対象とし、各銘柄への投資比率を「S&P先進国REIT指数（除く日本）」の中で各銘柄が占める比率にほぼ一致させました。期中の資金流出入や「S&P先進国REIT指数（除く日本）」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行い、また期中の資金流出入に対しても速やかに対応しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。



## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+2.7%となり、ベンチマークである「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）」の+3.2%を0.5ポイント下回りました。

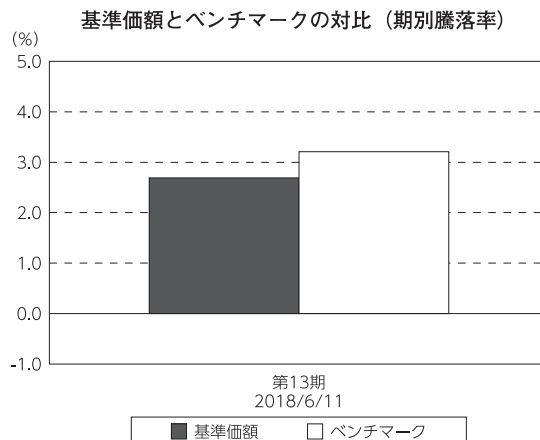
主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

- ①コスト負担（売買コストや保管費用など）
- ②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

### （その他の要因）

為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）



（注）ベンチマークは、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、「S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）」の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

「S&P先進国REIT指数（除く日本）」はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービスズ エル エル シーの所有する登録商標であり、野村アセットマネジメントに対して利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関しいかなる意思表示等を行なうものではありません。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2017年6月13日～2018年6月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 6	% 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
( 投 資 信 託 証 券 )	( 5 )	(0.024)	
( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	( 0 )	(0.002)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	3	0.014	(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
( 投 資 信 託 証 券 )	( 3 )	(0.014)	
(c) そ の 他 費 用	9	0.040	(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 )	(0.029)	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 )	( 2 )	(0.010)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	18	0.080	
期中の平均基準価額は、21,617円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*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6月13日～2018年6月11日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	オーストラリア	百株 — (1,335)	千豪ドル — (1,637)	百株 —	千豪ドル —

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分です。

## 投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口 千米ドル	口 千米ドル	口 千米ドル
	ACADIA REALTY TRUST	1,900 47	1,800 48	
	AGREE REALTY CORP	1,900 94	1,000 51	
	ALEXANDER & BALDWIN INC	11,500 445 ( 3,025) ( 83)	3,725 97	
	ALEXANDERS INC	130 48	100 38	
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,220 650	2,960 365	
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	800 24	700 23	
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	4,100 163	3,200 132	
	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	13,400 279	9,900 206	
	AMERICOLD REALTY TRUST	8,400 154	1,000 21	
	APARTMENT INVT&MGMT CO-A	6,600 269	6,700 274	
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	14,500 270	4,700 84	
	ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	— — (△ 4,800) (△ 48)	— —	
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	3,500 24	— —	
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,900 994	5,430 923	
	BOSTON PROPERTIES	7,230 876	6,770 822	
	BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	— — ( 4,800) ( 48)	— —	
	BRANDYWINE REALTY TRUST	4,900 80	4,800 76	
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	15,600 269	8,100 124	
	CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	2,500 21	— —	
	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,790 419	3,710 322	
	CARE CAPITAL PROPERTIES INC	— — (△ 13,800) (△ 349)	— —	
	CARETRUST REIT INC ACQUIRES	1,500 23	1,500 22	
	CHATHAM LODGING TRUST	2,700 57	1,200 23	
	CHESAPEAKE LODGING TRUST	3,800 98	3,000 77	
	CITY OFFICE REIT INC	3,000 39	— —	
	CLIPPER REALTY INC	2,400 26 ( —) (△ 0.114)	— —	
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	22,000 217	28,200 241	
	COLONY STARWOOD HOMES	4,000 140 (△ 20,000) (△ 693)	— —	
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	3,400 72	2,800 57	
	COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	900 22	— —	
	CORESITE REALTY CORP	1,420 149	1,070 111	
	CORECIVIC INC	4,100 99	3,900 93	
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3,500 93	3,000 80	
	COUSINS PROPERTIES INC	11,800 104	9,500 85	
	CUBESMART	6,700 180	5,200 141	
	CYRUSONE INC	5,440 307	2,160 111	
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	2,360 139	1,660 101	

	銘 柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	DDR CORP	8,100 (△ 50,400)	67 (△ 455)	8,100	70
	DDR CORP	— ( 25,200)	— ( 455)	—	—
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	4,300	47	3,800	41
	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,160 ( 6,926)	991 ( 773)	8,096	881
	DOUGLAS EMMETT INC	8,800	335	6,200	234
	DUKE REALTY CORP	14,900	399	13,800	378
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY	430 (△ 12,710)	26 (△ 773)	470	28
	EPR PROPERTIES	1,770	107	1,330	81
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	5,300	107	2,100	43
	EASTGROUP PROPERTIES	640	53	570	50
	EDUCATION REALTY TRUST INC	2,700	88	1,900	60
	EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	2,700	48	1,500	24
	EQUITY COMMONWEALTH	3,900	116	3,600	109
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,240	365	2,880	249
	EQUITY RESIDENTIAL	16,790	1,037	15,710	993
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,600	614	2,360	573
	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,160	444	4,850	419
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,730	328	2,550	306
	FELCOR LODGING TRUST INC	— (△ 20,100)	— (△ 151)	—	—
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	3,900	115	3,300	95
	FIRST POTOMAC REALTY TRUST	2,000	22	— ( 10,400)	— ( 117)
	FOREST CITY REALTY TRUST- A	13,200	317	4,000	80
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1,900	44	1,700	39
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	4,200	38	4,600	42
	GEO GROUP INC/THE	5,800	143	4,700	109
	GGP INC	34,200	747	24,800	533
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	7,800	273	6,700	231
	GETTY REALTY CORP	2,379	59	800	22
	GLADSTONE COMMERCIAL CORP	2,100	42	1,000	22
	GLADSTONE LAND CORP	1,600	20	—	—
	GLOBAL NET LEASE INC	2,400	45	1,200	22
	GLOBAL MEDICAL REIT INC	3,000	28	—	—
	GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	7,100	120	1,800	24
	GRAMERCY PROPERTY TRUST	6,800	180	4,900	124
	HCP INC	21,200	521	19,800	505
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	6,300	188	4,700	140
	HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	7,200	194	4,200	106
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,000	17	1,600	29
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	4,200	194	3,300	147
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	4,300	118	3,600	96

	銘 柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	HOST HOTELS & RESORTS INC	32,500	641	31,700	614
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	7,700	249	7,400	240
	ISTAR INC	2,100	25	1,300	15
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	6,900	67	1,500	13
	INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	3,500	72	—	—
	INFRAREIT INC	7,400	162	1,200	23
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	3,700	17	3,900	21
	INVITATION HOMES INC	11,952	267	11,000	249
		( 33,248)	( 716)		
	IRON MOUNTAIN INC	14,800	530	8,300	278
	JBG SMITH PROPERTIES	3,500	118	1,700	58
		( 13,800)	( —)		
	KILROY REALTY CORP	4,070	289	3,960	285
	KIMCO REALTY CORP	16,100	258	14,300	225
	KITE REALTY GROUP TRUST	2,700	45	2,900	50
	LTC PROPERTIES INC	700	26	700	26
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	2,800	80	2,100	62
	LEXINGTON REALTY TRUST	10,300	91	10,700	95
	LIBERTY PROPERTY TRUST	4,800	196	4,000	164
	LIFE STORAGE INC	1,650	135	1,570	128
	MACERICH CO /THE	4,070	251	5,900	336
	MACK-CALI REALTY CORP	2,500	48	2,700	50
	MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	2,500	29	—	—
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	12,800	166	10,500	138
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,330	411	4,270	413
	MONMOUTH REIT-CLASS A	1,700	24	1,400	21
	MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	4,800	51	30,400	362
	NATL HEALTH INVESTORS INC	2,200	160	1,810	132
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	6,000	237	4,600	183
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,000	52	500	14
	NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	2,500	17	—	—
	NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	800	20	600	15
	NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	—	—	1,600	22
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	6,600	181	5,300	151
	ONE LIBERTY PROPERTIES INC	700	18	—	—
	PS BUSINESS PARKS INC/CA	340	39	170	19
	PARAMOUNT GROUP INC	40,000	629	7,100	103
	PARK HOTELS & RESORTS INC	19,200	531	6,700	196
	PARKWAY INC	—	—	6,473	123
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	3,900	140	4,300	150
	PENN REAL ESTATE INVEST TST	2,200	24	1,200	13
	PHYSICIANS REALTY TRUST	9,200	157	3,900	57
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2,900	54	5,600	101
	PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	1,400	22	—	—
	PROLOGIS INC	23,940	1,501	22,050	1,389
	PUBLIC STORAGE	6,770	1,357	6,310	1,290

	銘 柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	QTS REALTY TRUST INC CL A	2,020	93	900	37
	QUALITY CARE PROPERTIES	3,100	49	2,200	44
	RLJ LODGING TRUST	6,224 ( 7,276)	134 ( 151)	4,500	93
	RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	2,000	26	1,900	23
	REALTY INCOME CORP	12,400	655	9,620	511
	REGENCY CENTERS CORP	5,340	326	4,930	293
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	6,200	114	4,900	88
	RETAIL PROPERTIES OF AME-A	9,200	112	8,700	106
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	5,100	151	3,100	90
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1,840	137	1,480	112
	SL GREEN REALTY CORP	3,760	369	5,420	523
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	7,703 ( 15,497)	146 ( 349)	3,800	64
	SAUL CENTERS INC	370	22	—	—
	SELECT INCOME REIT	2,000	39	1,300	25
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	8,700	154	6,900	122
	SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	600	24	600	25
	SIMON PROPERTY GROUP INC	12,930	2,054	13,560	2,134
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	19,500	156	27,200	219
	SPIRIT MTA REIT	— ( 7,210)	— ( —)	—	—
	STAG INDUSTRIAL INC	3,900	99	2,900	73
	STARWOOD WAYPOINT HOMES	600 (△ 600)	22 (△ 22)	—	—
	STORE CAPITAL CORP	4,400	108	4,500	113
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3,200	49	3,200	48
	SUN COMMUNITIES INC	3,880	345	2,350	215
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	5,800	92	4,000	61
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	3,800	91	4,700	108
	TAUBMAN CENTERS INC	1,470	85	1,470	80
	TERRENO REALTY CORP	2,500	89	1,900	69
	TIER REIT INC	1,000	19	—	—
	UDR INC	9,200	329	9,000	329
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	390	25	360	22
	URBAN EDGE PROPERTIES	3,900	94	2,700	62
	VENTAS INC	15,420	870	14,240	811
	VEREIT INC	42,200	311	39,700	291
	VORNADO REALTY TRUST	7,800	570	7,210	533
	WP CAREY INC	5,000	326	4,630	302
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	9,000	65	7,100	53
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	2,300	64	1,900	54
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3,400	99	2,900	81
	WELLTOWER INC	16,320	978	14,110	842
	WHITESTONE REIT	1,800	19	1,100	11
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	3,400	75	3,100	69

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	58,000 ( 48,790)	53 ( 39)	27,800 ( —)	24 ( 1)
	MANULIFE US REAL ESTATE INV - RTS	— ( 85,307)	— ( 65)	— ( 48,790)	— ( 8)
	小 計	1,046,878 ( 128,669)	34,580 ( 189)	807,794 ( 59,190)	28,306 ( 126)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2,700	108	2,200	85
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	3,300	45	3,200	43
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	600	25	500	21
	BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	—	—	— ( 2,000)	— ( 64)
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	2,100	78	1,600	61
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	700 (△ 6,300)	31 (△ 300)	—	—
	CHOICE PROPERTIES REIT	2,100 ( 26,986)	24 ( 300)	14,786	171
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	6,200	86	5,200	69
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVEST TRUS	—	—	3,400	75
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	2,200	20	—	—
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	7,500	87	3,800	49
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	7,600	157	6,900	145
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	2,100	20	—	—
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	1,500	21	1,900	26
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	1,600	40	1,400	37
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	2,100	24	1,600	18
	ONEREIT	—	—	6,570	27
	PLAZA RETAIL REIT	—	—	7,500	32
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	7,800	62	30,800	248
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6,900	166	7,000	167
	SLATE RETAIL REIT	2,000	26	—	—
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	3,200	96	3,100	91
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	6,000	46	—	—
	小 計	68,200 ( 20,686)	1,170 ( —)	101,456 ( 2,000)	1,373 ( 64)
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND	39,500	260	42,100	271
	CAPITAL & REGIONAL PLC	29,000	17	—	—
	DERWENT LONDON PLC	3,600	107	2,900	88
	BIG YELLOW GROUP PLC	10,000	83	11,200	93
	HAMMERSON PLC	29,500	152	30,400	166
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	—	—	14,200	30
	MUCKLOW < A & J > GROUP PLC	—	—	9,200	44
	INTU PROPERTIES PLC	40,000	90	45,000	101
	UNITE GROUP PLC	13,300	103	7,000	57
	SHAFTESBURY PLC	16,100	161	21,100	209

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	イギリス	口	千英ポンド	口	千英ポンド
	LAND SECURITIES GROUP PLC	5,500 (△ 126,400)	56 (△ 1,336)	8,000	81
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	23,300	14	14,000	8
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	29,000 ( — )	39 (△ 24)	79,000	108
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	7,400	37	5,000	25
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	18,000	31	16,000	27
	SEGRO PLC	36,900	217	34,400	206
	WORKSPACE GROUP PLC	2,900	29	3,200	30
	RDI REIT PLC	37,000	13	—	—
	NEWRIVER REIT PLC	14,000 ( — )	47 ( 0.85082)	4,000 ( — )	11 (0.85082)
	NEWRIVER REIT PLC - RTS	— ( 40,000)	— ( 0.6846)	— ( 40,000)	— ( 0.6846)
	CIVITAS SOCIAL HOUSING - RTS	— ( 43,500)	— ( — )	— ( 43,500)	— ( — )
	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	15,000	15	—	—
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	— ( 50,172)	— ( 304)	2,972	19
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	60,000	89	33,000	48
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	12,000 ( 11,857)	13 ( 13)	13,000	14
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC-RIGHTS	— ( 11,857)	— ( 12)	— ( 11,857)	— (0.26738)
	ASSURA PLC	151,000 ( — )	95 ( 0.7645)	20,000	11
	ASSURA PLC-RIGHTS	— ( 52,727)	— ( 30)	— ( 52,727)	— ( 0.7645)
	LXI REIT PLC	39,000	41	—	—
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	43,000 ( 6,000)	50 ( 6)	17,000	20
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES-RIGHTS	— ( 6,000)	— ( 6)	— ( 6,000)	— (0.34431)
	REGIONAL REIT LTD	14,875 ( 5,125)	14 ( 5)	15,000	14
	REGIONAL REIT LTD - RTS	— ( 5,125)	— ( 5)	— ( 5,125)	— (0.11784)
	LAND SECURITIES GROUP PLC	24,600 ( 118,500)	239 ( 1,336)	20,400 ( — )	194 ( 75)
	IMPACT HEALTHCARE REIT PLC	20,000	20	20,000	20
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	5,700	37	— ( 58,200)	— ( 358)
	小 計	740,175 ( 224,463)	2,079 ( 362)	488,072 ( 217,409)	1,909 ( 437)



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
	ドイツ				
	HAMBORNER REIT AG	4,500	41	2,900	26
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	8,500	104	2,400	29
		( - )	(△ 12)		
	小 計	13,000	146	5,300	56
		( - )	(△ 12)		
	イタリア				
	BENI STABILI SPA	19,000	14	17,000	13
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	-	-	-	-
		(△ 53,604)	(△ 44)		
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	1,640	12	1,200	9
		( 7,860)	( 62)		
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ - RTS	-	-	-	-
		( 7,000)	( - )	( 7,000)	( 5)
	小 計	20,640	26	18,200	22
		(△ 38,744)	( 18)	( 7,000)	( 5)
	フランス				
	ICADE	1,990	160	1,600	125
	ALTAREA	210	41	70	15
		( - )	(△ 5)		
	KLEPIERRE	6,900	243	6,900	234
	GECINA SA	3,080	437	1,800	256
	GECINA SA - RTS	-	-	6,570	16
		( 6,570)	( - )		
	COVIVIO	1,800	159	1,450	130
	MERCIALYS	1,920	34	1,000	17
	UNIBAIL RODAMCO-NA	4,190	848	3,920	779
		(△ 16,380)	(△ 3,708)		
	UNIBAIL GROUP STAPLED	-	-	-	-
		( 16,380)	( 3,708)		
	小 計	20,090	1,925	23,310	1,575
		( 6,570)	(△ 5)		
	オランダ				
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	800	26	500	16
	VASTNED RETAIL NV	900	35	1,600	60
	WERELDHAVE NV	900	33	1,000	33
	NSI NV	-	-	-	-
		(△ 22,000)	(△ 85)		
	NSI NV	550	19	400	14
		( 2,750)	( 85)		
	小 計	3,150	114	3,500	124
		(△ 19,250)	( - )		
	スペイン				
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	64,300	541	12,200	111
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	2,090	19	1,200	11
		( - )	(△ 4)		

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
	スペイン				
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	5,300	86	5,200	84
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	11,000	127	32,800	382
		( - )	(△ 12)		
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	3,000	52	10,800	171
	小 計	85,690	826	62,200	761
		( - )	(△ 17)		
	ベルギー				
	BEFIMMO S.C.A.	370	19	330	17
	COFINIMMO	550	58	630	67
	RETAIL ESTATES	-	-	-	-
		( 216)	( 15)		
	RETAIL ESTATES - RTS	-	-	-	-
		( 1,080)	( - )	( 1,080)	(0.98883)
	WERELDHAVE BELGIUM	-	-	290	27
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,200	27	400	9
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	570	57	540	55
	MONTEA SCA	-	-	940	43
	AEDIFICA	653	50	570	43
	XIOR STUDENT HOUSING NV	450	16	1,200	49
		( 250)	( 8)		
	XIOR STUDENT HOUSING NV - RTS	-	-	-	-
				( 500)	( 1)
	小 計	3,793	231	4,900	313
		( 1,546)	( 23)	( 1,580)	( 2)
	アイルランド				
	GREEN REIT PLC	26,000	40	24,000	36
	HIBERNIA REIT PLC	24,000	34	27,000	37
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	11,200	16	10,000	13
	小 計	61,200	91	61,000	87
	シンガポール				
	CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE	82,000	47	-	-
	小 計	82,000	47	-	-
	ユ ー ロ 計	289,563	3,411	178,410	2,942
		(△ 49,878)	( 6)	( 8,580)	( 7)
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	88,600	5,962	92,500	6,122
	PROSPERITY REIT	90,000	298	90,000	290
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	34,000	168	-	-
	CHAMPION REIT	31,000	178	65,000	365
	REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	-	-	120,000	276
	FORTUNE REIT	67,000	643	67,000	625
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	46,000	153	-	-
	小 計	356,600	7,404	434,500	7,681
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	CAPITALAND MALL TRUST	99,000	204	91,000	189

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	105,000 ( )	282 (△ 3)	114,000	302
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	137,200 ( 58,764)	244 ( 97)	119,000	209
	CAPITACOMMERCIAL TRUST RIGHTS	— ( 58,764)	— ( 80)	— ( 58,764)	— ( 17)
	SUNTEC REIT	84,000 ( )	165 (△ 4)	120,000	228
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	145,400 ( 22,600)	182 ( 24)	96,000 ( )	117 ( 1)
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST RIGHTS	— ( 22,600)	— ( 1)	— ( 22,600)	— ( 1)
	STARHILL GLOBAL REIT	37,100 ( )	27 (△0.44079)	20,000	14
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	51,000 ( )	61 (△ 4)	46,000	51
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	64,000 ( )	90 (△ 1)	65,000	91
	KEPPEL REIT	78,000 ( )	95 (△ 0.4845)	78,000	92
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	12,000	26	12,000	26
	ESR REIT	— ( 39,800)	— ( 22)	—	—
	ESR REIT - RTS	— ( 39,800)	— ( 21)	— ( 39,800)	— ( 1)
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	18,000 ( 22,800)	29 ( 35)	26,800	42
	CDL HOSPITALITY TRUSTS - RTS	— ( 22,800)	— ( 29)	— ( 22,800)	— ( 6)
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	36,000 ( )	58 (△ 6)	50,000	80
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	43,500 ( )	60 (△ 3)	36,000	49
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	22,000 ( )	63 (△ 1)	19,000	53
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	137,200 ( )	58 (△ 4)	80,000	34
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	43,000 ( )	86 (△ 0.4988)	34,000	65
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	73,000	119	48,000	75
	CACHE LOGISTICS TRUST	31,000 ( 22,860)	26 ( 18)	—	—
	CACHE LOGISTICS TRUST - RTS	— ( 22,860)	— ( 14)	— ( 22,860)	— ( 4)
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	21,600 ( )	28 (△ 0.4237)	17,000	23

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	シンガポール	口	千シンガポールドル	口	千シンガポールドル
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	101,000 ( - )	120 (△ 6)	64,000	73
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	- ( - )	- (△ 1)	-	-
	SPH REIT	28,500	28	45,000	45
	QUE HOSPITALITY TRUST	-	-	17,000	13
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	- ( - )	- (△0.23895)	79,650	56
	KEPPEL DC REIT	27,000 ( - )	37 (△0.28741)	-	-
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	75,000 ( 18,000)	80 ( 16)	23,000 ( - )	25 ( 1)
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI - RTS	- ( 18,000)	- ( 17)	- ( 18,000)	- ( 1)
	小 計	1,469,500 ( 369,648)	2,177 ( 338)	1,300,450 ( 184,824)	1,960 ( 34)
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	BWP TRUST	17,000	49	19,000	56
	MIRVAC GROUP	117,000	257	109,000	241
	INVESTA OFFICE FUND	21,000	94	42,000	186
	CROMWELL PROPERTY GROUP	74,000	77	26,000	27
	CHARTER HALL RETAIL REIT	7,000	26	7,000	27
	ASPEN GROUP	-	-	13,000	13
	GPT GROUP	73,000	360	64,000	310
	ABACUS PROPERTY GROUP	9,000	34	-	-
	ALE PROPERTY GROUP	-	-	26,000	123
	STOCKLAND TRUST GROUP	104,000	441	100,000	420
	DEXUS	45,600	438	38,000	363
	GOODMAN GROUP	64,600	543	55,500	476
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	2,800	20	- ( - )	- ( 66)
	360 CAPITAL GROUP LTD	-	-	19,000	18
	CHARTER HALL GROUP	21,000	123	21,000	119
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	8,450	27	5,000	17
	GENERATION HEALTHCARE REIT	-	-	22,000	50
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	7,000	19	-	-
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	25,000	57	26,000	59
	ARENA REIT	8,000	17	-	-
	PROPERTYLINK GROUP	-	-	43,000	42
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	- ( 2,702)	- ( 11)	-	-
	CHARTER HALL LONG WALE REIT - RTS	- ( 2,702)	- ( 11)	- ( 2,702)	- (0.35895)
	INDUSTRIA REIT	9,000	22	12,000	29
	GDI PROPERTY GROUP	25,700	31	22,000	28
	RURAL FUNDS GROUP	40,000	91	-	-

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	オーストラリア	口	千豪ドル	口	千豪ドル
	SCENTRE GROUP	230,000	930	217,000	876
	WESTFIELD CORP	79,300	688	71,900	615
				( 318,800)	( 2,688)
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	8,750	24	—	—
	CENTURIA METROPOLITAN REIT	—	—	9,768	23
		( 9,768)	( 24)		
	VICINITY CENTRES	116,000	301	118,000	302
	CENTURIA URBAN REIT	—	—	—	—
				( 11,100)	( 27)
	VIVA ENERGY REIT	11,000	22	9,000	18
	小 計	1,124,200	4,701	1,095,168	4,449
		( 15,172)	( 47)	( 332,602)	( 2,782)
	ニュージーランド		千ニュージーランドドル		千ニュージーランドドル
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	18,429	24	24,000	30
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	12,967	28	8,000	16
	GOODMAN PROPERTY TRUST	24,000	32	23,000	28
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	—	—	67,525	110
	STRIDE STAPLED GROUP	14,000	23	16,000	27
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	24,455	32	22,000	29
		( 19,545)	( 27)		
	KIWI PROPERTY GROUP LTD-RIGHTS	—	—	—	—
		( 19,545)	( 26)	( 19,545)	( 1)
	小 計	93,851	141	160,525	242
		( 39,090)	( 54)	( 19,545)	( 1)
	イスラエル		千新シェケル		千新シェケル
	REIT 1 LTD	4,000	57	4,000	57
	小 計	4,000	57	4,000	57

\*金額は受け渡し代金。  
\*金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。  
\*（ ）内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。  
\*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	REIT先物取引	百万円 792	百万円 783	百万円 —	百万円 —

\*単位未満は切り捨て。  
\*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6月13日～2018年6月11日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 4,900	百万円 59	% 1.2	百万円 5,008	百万円 9	% 0.2

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野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2018年6月11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	
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円	石油・ガス・消耗燃料 インターネットソフトウェア・サービス
UNIBAIL-RODAMCO-WTFIELD-CDI	—	1,175	1,737	144,632	
ONEMARKET LTD	—	159	21	1,777	
合 計	株 数 ・ 金 額	—	1,335	1,758	146,410
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	2	—	<0.7%>

\* 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。

\* 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。

\* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
ACADIA REALTY TRUST	13,900	14,000	380	41,648	0.2
AGREE REALTY CORP	4,000	4,900	261	28,585	0.1
ALEXANDER & BALDWIN INC	—	10,800	235	25,724	0.1
ALEXANDERS INC	590	620	236	25,902	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,490	16,750	2,130	233,090	1.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,800	6,900	256	28,106	0.1
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	21,800	22,700	961	105,230	0.5
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	38,200	41,700	873	95,582	0.5
AMERICOLD REALTY TRUST	—	7,400	160	17,569	0.1
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	25,700	25,600	1,067	116,797	0.6
APPLE HOSPITALITY REIT INC	25,100	34,900	655	71,709	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	7,600	7,600	110	12,131	0.1
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	4,800	—	—	—	—
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,100	15,600	113	12,374	0.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	22,310	22,780	3,822	418,267	2.0
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	4,200	37	4,154	0.0
BOSTON PROPERTIES	25,010	25,470	3,123	341,785	1.7
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	—	4,800	50	5,482	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	28,100	28,200	463	50,692	0.2
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	43,000	50,500	848	92,823	0.5
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	25,900	28,400	162	17,773	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	14,040	15,120	1,377	150,754	0.7
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	13,800	—	—	—	—
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	12,000	12,000	200	21,899	0.1
CEDAR REALTY TRUST INC	12,000	12,000	54	5,947	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	5,900	7,400	151	16,524	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	9,200	10,000	321	35,208	0.2
CITY OFFICE REIT INC	3,300	6,300	78	8,547	0.0
CLIPPER REALTY INC	—	2,400	22	2,473	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	89,000	82,800	481	52,724	0.3
COLONY STARWOOD HOMES	16,000	—	—	—	—
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,400	20,000	454	49,672	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,000	2,900	80	8,769	0.0
CORESITE REALTY CORP	5,360	5,710	613	67,077	0.3
CORECIVIC INC	19,400	19,600	420	45,976	0.2
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	15,800	16,300	452	49,506	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	67,700	70,000	684	74,902	0.4
CUBESMART	28,700	30,200	946	103,586	0.5
CYRUSONE INC	12,620	15,900	932	101,993	0.5
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	14,800	15,500	1,034	113,181	0.5
DDR CORP	50,400	—	—	—	—
DDR CORP	—	25,200	427	46,816	0.2
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,000	33,500	418	45,742	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	25,900	33,890	3,713	406,275	2.0

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	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
DOUGLAS EMMETT INC	23,800	26,400	1,017	111,290	0.5
DUKE REALTY CORP	58,000	59,100	1,697	185,707	0.9
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	12,750	—	—	—	—
EPR PROPERTIES	10,340	10,780	674	73,809	0.4
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	4,200	7,400	147	16,119	0.1
EASTGROUP PROPERTIES	5,530	5,600	532	58,224	0.3
EDUCATION REALTY TRUST INC	11,800	12,600	502	54,977	0.3
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	20,500	21,700	374	40,978	0.2
EQUITY COMMONWEALTH	19,800	20,100	624	68,349	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	13,090	14,450	1,332	145,734	0.7
EQUITY RESIDENTIAL	59,640	60,720	3,922	429,162	2.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,660	10,900	2,626	287,397	1.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,540	20,850	2,043	223,603	1.1
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	5,500	47	5,235	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,770	11,950	1,444	158,018	0.8
FELCOR LODGING TRUST INC	20,100	—	—	—	—
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	19,400	20,000	670	73,348	0.4
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	8,400	—	—	—	—
FOREST CITY REALTY TRUST- A	35,000	44,200	898	98,265	0.5
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,100	10,300	235	25,750	0.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	18,100	17,700	139	15,240	0.1
GEO GROUP INC/THE	19,600	20,700	516	56,551	0.3
GGP INC	95,100	104,500	2,160	236,327	1.1
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	31,500	32,600	1,146	125,478	0.6
GETTY REALTY CORP	3,921	5,500	146	16,012	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,600	4,700	87	9,590	0.0
GLADSTONE LAND CORP	—	1,600	20	2,226	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	9,500	10,700	207	22,746	0.1
GLOBAL MEDICAL REIT INC	—	3,000	26	2,888	0.0
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	11,000	16,300	231	25,306	0.1
GRAMERCY PROPERTY TRUST	24,800	26,700	736	80,597	0.4
HCP INC	76,200	77,600	1,888	206,651	1.0
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	19,200	20,800	565	61,831	0.3
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	30,900	33,900	845	92,539	0.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,200	6,600	140	15,388	0.1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	16,200	17,100	837	91,599	0.4
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	26,500	27,200	779	85,320	0.4
HOST HOTELS & RESORTS INC	120,400	121,200	2,677	292,924	1.4
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	25,400	25,700	914	100,101	0.5
ISTAR INC	10,500	11,300	124	13,649	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	9,000	14,400	142	15,613	0.1
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	—	3,500	74	8,194	0.0
INFRAREIT INC	—	6,200	131	14,353	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	18,300	18,100	104	11,466	0.1
INVITATION HOMES INC	13,000	47,200	1,045	114,437	0.6
IRON MOUNTAIN INC	39,500	46,000	1,592	174,187	0.8
JBG SMITH PROPERTIES	—	15,600	593	64,909	0.3



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	千米ドル	千円	%	
KILROY REALTY CORP	15,990	16,100	1,238	135,547	0.7	
KIMCO REALTY CORP	68,600	70,400	1,153	126,166	0.6	
KITE REALTY GROUP TRUST	13,900	13,700	224	24,567	0.1	
LTC PROPERTIES INC	6,500	6,500	270	29,570	0.1	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	18,100	18,800	661	72,382	0.4	
LEXINGTON REALTY TRUST	36,200	35,800	310	33,959	0.2	
LIBERTY PROPERTY TRUST	23,600	24,400	1,096	119,998	0.6	
LIFE STORAGE INC	7,670	7,750	729	79,806	0.4	
MACERICH CO /THE	19,770	17,940	1,022	111,880	0.5	
MACK-CALI REALTY CORP	14,500	14,300	288	31,588	0.2	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,100	5,600	57	6,274	0.0	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	58,100	60,400	843	92,252	0.4	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,510	18,570	1,788	195,636	0.9	
MONMOUTH REIT-CLASS A	12,000	12,300	190	20,885	0.1	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	25,600	—	—	—	—	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,310	6,700	494	54,054	0.3	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	24,100	25,500	1,069	117,066	0.6	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	6,700	8,200	241	26,439	0.1	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,500	15,000	110	12,111	0.1	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3,000	3,200	88	9,722	0.0	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	9,500	7,900	112	12,290	0.1	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	31,600	32,900	1,007	110,219	0.5	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,100	2,800	72	7,912	0.0	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,110	3,280	404	44,248	0.2	
PARAMOUNT GROUP INC	—	32,900	501	54,821	0.3	
PARK HOTELS & RESORTS INC	20,300	32,800	1,036	113,401	0.6	
PARKWAY INC	6,473	—	—	—	—	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	11,800	11,400	461	50,439	0.2	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10,500	11,500	136	14,985	0.1	
PHYSICIANS REALTY TRUST	24,600	29,900	444	48,612	0.2	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	23,300	20,600	401	43,882	0.2	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	5,400	6,800	102	11,256	0.1	
PROLOGIS INC	85,960	87,850	5,793	633,889	3.1	
PUBLIC STORAGE	24,240	24,700	5,348	585,210	2.8	
QTS REALTY TRUST INC CL A	7,480	8,600	355	38,916	0.2	
QUALITY CARE PROPERTIES	14,700	15,600	330	36,184	0.2	
RLJ LODGING TRUST	20,100	29,100	668	73,164	0.4	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	12,200	12,300	155	17,010	0.1	
REALTY INCOME CORP	44,120	46,900	2,498	273,345	1.3	
REGENCY CENTERS CORP	23,840	24,250	1,442	157,785	0.8	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	17,100	18,400	339	37,182	0.2	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	37,400	37,900	488	53,450	0.3	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	11,000	13,000	403	44,149	0.2	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,170	8,530	717	78,450	0.4	
SL GREEN REALTY CORP	16,400	14,740	1,452	158,931	0.8	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	10,100	29,500	618	67,650	0.3	
SAUL CENTERS INC	1,700	2,070	104	11,482	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	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
SELECT INCOME REIT	9,800	10,500	223	24,469	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	37,800	39,600	696	76,211	0.4
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	4,000	4,000	176	19,260	0.1
SIMON PROPERTY GROUP INC	51,890	51,260	8,477	927,510	4.5
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	79,800	72,100	564	61,766	0.3
SPIRIT MTA REIT	—	7,210	66	7,320	0.0
STAG INDUSTRIAL INC	14,100	15,100	407	44,556	0.2
STORE CAPITAL CORP	27,600	27,500	739	80,875	0.4
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	16,500	16,500	239	26,194	0.1
SUN COMMUNITIES INC	11,410	12,940	1,253	137,173	0.7
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	35,800	37,600	638	69,811	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16,000	15,100	338	37,023	0.2
TAUBMAN CENTERS INC	9,800	9,800	554	60,655	0.3
TERRENO REALTY CORP	8,300	8,900	338	36,982	0.2
TIER REIT INC	7,200	8,200	182	19,934	0.1
UDR INC	43,600	43,800	1,641	179,562	0.9
UMH PROPERTIES INC	5,000	5,000	73	8,025	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,900	1,930	121	13,311	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	16,200	17,400	388	42,548	0.2
URSTADT BIDDLE-CL A	5,000	5,000	109	11,953	0.1
VENTAS INC	57,620	58,800	3,224	352,802	1.7
VEREIT INC	156,200	158,700	1,139	124,668	0.6
VORNADO REALTY TRUST	28,010	28,600	2,047	224,045	1.1
WP CAREY INC	17,060	17,430	1,167	127,693	0.6
WASHINGTON PRIME GROUP INC	28,500	30,400	236	25,843	0.1
WASHINGTON REAL ESTATE INV	12,200	12,600	369	40,433	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	19,400	19,900	592	64,860	0.3
WELLTOWER INC	58,890	61,100	3,543	387,660	1.9
WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,250	1,250	4	523	0.0
WHITESTONE REIT	5,900	6,600	80	8,853	0.0
XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,900	17,200	432	47,290	0.2
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	87,000	165,990	147	16,163	0.1
MANULIFE US REAL ESTATE INV - RTS	—	36,517	0.91292	99	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	3,572,834	3,881,397	132,985	14,549,990
	銘 柄 数 < 比 率 >	158	162	—	<70.6%>
(カナダ)			千カナダドル		
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN	3,200	3,200	43	3,636	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,000	7,500	321	27,127	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	11,100	11,200	149	12,595	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,500	3,600	170	14,367	0.1
BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	2,000	—	—	—	—
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,900	4,900	63	5,394	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,800	11,300	460	38,849	0.2
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	5,600	—	—	—	—
CHOICE PROPERTIES REIT	7,000	21,300	255	21,544	0.1
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,500	14,500	176	14,911	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	6,700	6,700	86	7,274	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	%
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	8,400	5,000	121	10,275	0.0
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	4,400	6,600	70	5,979	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	10,400	14,100	204	17,273	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,900	3,900	209	17,708	0.1
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	23,300	24,000	487	41,174	0.2
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,200	7,300	80	6,792	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6,700	6,300	93	7,925	0.0
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	3,300	50	4,304	0.0
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4,300	4,300	56	4,810	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	3,500	3,700	96	8,153	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	7,000	7,500	84	7,123	0.0
ONEREIT	6,570	—	—	—	—
PLAZA RETAIL REIT	7,500	—	—	—	—
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	23,000	—	—	—	—
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	26,400	26,300	634	53,603	0.3
SLATE OFFICE REIT	5,900	5,900	44	3,760	0.0
SLATE RETAIL REIT	2,300	4,300	55	4,672	0.0
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,600	10,700	323	27,318	0.1
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	—	6,000	52	4,397	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	237,970	223,400	4,393	370,974
	銘 柄 数 < 比 率 >	29	25	—	< 1.8% >
(イギリス)			千英ポンド		
BRITISH LAND	167,100	164,500	1,125	165,108	0.8
CAPITAL & REGIONAL PLC	64,000	93,000	48	7,096	0.0
DERWENT LONDON PLC	17,700	18,400	560	82,215	0.4
BIG YELLOW GROUP PLC	24,800	23,600	223	32,795	0.2
HAMMERSON PLC	129,900	129,000	688	100,969	0.5
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	14,200	—	—	—	—
MUCKLOW < A & J > GROUP PLC	9,200	—	—	—	—
INTU PROPERTIES PLC	149,000	144,000	284	41,806	0.2
UNITE GROUP PLC	36,100	42,400	364	53,538	0.3
SHAFTESBURY PLC	45,800	40,800	391	57,475	0.3
LAND SECURITIES GROUP PLC	128,900	—	—	—	—
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	78,700	88,000	53	7,915	0.0
HANSTEEN HOLDINGS PLC	120,000	70,000	77	11,340	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	33,000	35,400	198	29,141	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	112,000	114,000	216	31,767	0.2
SEGRO PLC	159,800	162,300	1,090	159,995	0.8
WORKSPACE GROUP PLC	19,900	19,600	223	32,787	0.2
RDI REIT PLC	193,000	230,000	81	12,015	0.1
NEWRIVER REIT PLC	40,000	50,000	144	21,240	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	29,000	29,000	29	4,361	0.0
AEW UK LONG LEASE REIT PLC	—	15,000	13	2,016	0.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	—	47,200	330	48,455	0.2
TRITAX BIG BOX REIT PLC	217,000	244,000	371	54,530	0.3
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	83,000	93,857	82	12,037	0.1
ASSURA PLC	256,000	387,000	225	33,050	0.2

銘柄	銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)		口	口	千英ポンド	千円	%
LXI REIT PLC		—	39,000	44	6,466	0.0
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		91,000	123,000	139	20,467	0.1
REGIONAL REIT LTD		41,000	46,000	43	6,412	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		—	122,700	1,152	169,120	0.8
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		52,500	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	2,312,600	2,571,757	8,205	1,204,128	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	26	—	< 5.8% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG		12,100	13,700	126	16,319	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		16,500	22,600	286	36,926	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	28,600	36,300	412	53,245	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.3% >	
(ユーロ…イタリア)						
BENI STABILI SPA		158,000	160,000	121	15,724	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		53,604	—	—	—	—
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		—	8,300	59	7,681	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	211,604	168,300	181	23,406	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.1% >	
(ユーロ…フランス)						
ICADE		7,120	7,510	603	77,926	0.4
ALTAREA		460	600	120	15,603	0.1
KLEPIERRE		33,800	33,800	1,125	145,262	0.7
GECINA SA		6,570	7,850	1,167	150,651	0.7
COVIVIO		8,570	8,920	789	101,882	0.5
MERCIALYS		8,380	9,300	143	18,579	0.1
UNIBAIL RODAMCO-NA		16,110	—	—	—	—
UNIBAIL GROUP STAPLED		—	16,380	3,146	406,099	2.0
小 計	口 数 ・ 金 額	81,010	84,360	7,097	916,006	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 4.4% >	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA		8,000	8,300	296	38,306	0.2
VASTNED RETAIL NV		3,400	2,700	111	14,356	0.1
WERELDHAVE NV		6,500	6,400	211	27,323	0.1
NSI NV		22,000	—	—	—	—
NSI NV		—	2,900	104	13,530	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	39,900	20,300	724	93,516	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.5% >	
(ユーロ…スペイン)						
INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA		—	52,100	483	62,398	0.3
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		14,210	15,100	130	16,857	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		17,900	18,000	318	41,072	0.2
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		77,000	55,200	667	86,166	0.4
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		10,000	2,200	37	4,826	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	119,110	142,600	1,637	211,321	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	5	—	< 1.0% >	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO S.C.A.		3,800	3,840	202	26,117	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	
(ユーロ…ベルギー)			口	口	千ユーロ	千円	%
COFINIMMO			3,370	3,290	352	45,475	0.2
RETAIL ESTATES			1,080	1,296	98	12,762	0.1
WERELDHAVE BELGIUM			290	—	—	—	—
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES			1,900	2,700	58	7,509	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA			2,550	2,580	276	35,694	0.2
MONTEA SCA			940	—	—	—	—
AEDIFICA			2,787	2,870	229	29,632	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV			500	—	—	—	—
XIOR STUDENT HOUSING NV - RTS			500	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額		17,717	16,576	1,217	157,191	
	銘 柄 数 < 比 率 >		10	6	—	<0.8%>	
(ユーロ…アイルランド)							
GREEN REIT PLC			114,000	116,000	176	22,725	0.1
HIBERNIA REIT PLC			118,000	115,000	174	22,470	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES			52,800	54,000	73	9,422	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		284,800	285,000	423	54,618	
	銘 柄 数 < 比 率 >		3	3	—	<0.3%>	
(ユーロ…シンガポール)							
CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE			—	82,000	47	6,191	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		—	82,000	47	6,191	
	銘 柄 数 < 比 率 >		—	1	—	<0.0%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額		782,741	835,436	11,742	1,515,497	
	銘 柄 数 < 比 率 >		32	30	—	<7.4%>	
(香港)					千香港ドル		
LINK REIT			359,500	355,600	26,065	363,352	1.8
PROSPERITY REIT			180,000	180,000	583	8,129	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST			160,000	194,000	1,061	14,792	0.1
CHAMPION REIT			358,000	324,000	1,788	24,931	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT			174,000	174,000	951	13,267	0.1
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT			120,000	—	—	—	—
FORTUNE REIT			228,000	228,000	2,138	29,812	0.1
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN			124,000	170,000	564	7,867	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		1,703,500	1,625,600	33,153	462,155	
	銘 柄 数 < 比 率 >		8	7	—	<2.2%>	
(シンガポール)					千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST			438,000	446,000	927	76,097	0.4
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT			399,000	390,000	1,033	84,778	0.4
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST			355,000	431,964	734	60,237	0.3
SUNTEC REIT			408,000	372,000	654	53,706	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST			255,000	327,000	405	33,261	0.2
STARHILL GLOBAL REIT			209,900	227,000	155	12,755	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST			193,000	198,000	217	17,866	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST			105,000	104,000	144	11,858	0.1
KEPPEL REIT			285,000	285,000	330	27,119	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST			94,000	94,000	206	16,963	0.1
ESR REIT			200,000	239,800	118	9,737	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS			114,000	128,000	212	17,429	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	
(シンガポール)	口	口	千シンガポールドル	千円	%
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	110,000	96,000	151	12,442	0.1
FIRST REAL ESTATE INV'T TRUST	83,500	91,000	123	10,152	0.0
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	59,000	62,000	167	13,731	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	282,800	340,000	107	8,785	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	197,000	206,000	403	33,120	0.2
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	292,025	317,025	504	41,348	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST	127,000	180,860	142	11,720	0.1
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	89,400	94,000	131	10,795	0.1
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	133,764	133,764	58	4,773	0.0
MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	303,000	340,000	397	32,631	0.2
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	129,000	129,000	97	7,989	0.0
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	142,000	142,000	93	7,629	0.0
SPH REIT	120,500	104,000	102	8,445	0.0
QUE HOSPITALITY TRUST	200,043	183,043	146	12,012	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	106,700	106,700	70	5,776	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	79,650	—	—	—	—
KEPPEL DC REIT	119,756	146,756	203	16,733	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	178,000	248,000	257	21,157	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	5,809,038	6,162,912	8,302	681,055
銘 柄 数 < 比 率 >	30	29	—	< 3.3% >	
(オーストラリア)			千豪ドル		
BWP TRUST	83,000	81,000	260	21,643	0.1
MIRVAC GROUP	595,000	603,000	1,320	109,924	0.5
INVESTA OFFICE FUND	103,000	82,000	414	34,537	0.2
CROMWELL PROPERTY GROUP	208,000	256,000	281	23,440	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	55,000	55,000	231	19,274	0.1
ASPEN GROUP	13,000	—	—	—	—
GPT GROUP	288,000	297,000	1,490	124,105	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP	45,000	54,000	204	17,035	0.1
ALE PROPERTY GROUP	26,000	—	—	—	—
STOCKLAND TRUST GROUP	393,000	397,000	1,643	136,811	0.7
DEXUS	157,000	164,600	1,609	133,998	0.7
GOODMAN GROUP	256,200	265,300	2,499	208,027	1.0
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	7,000	9,800	—	—	—
360 CAPITAL GROUP LTD	19,000	—	—	—	—
CHARTER HALL GROUP	76,000	76,000	483	40,234	0.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	37,550	41,000	146	12,217	0.1
GENERATION HEALTHCARE REIT	22,000	—	—	—	—
INGENIA COMMUNITIES GROUP	32,000	39,000	102	8,537	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	122,000	121,000	295	24,575	0.1
ARENA REIT	35,220	43,220	96	8,022	0.0
PROPERTYLINK GROUP	109,000	66,000	69	5,768	0.0
CHARTER HALL LONG WALE REIT	25,000	27,702	118	9,823	0.0
INDUSTRIA REIT	23,000	20,000	51	4,245	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	89,000	89,000	141	11,742	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	22,680	22,680	73	6,078	0.0
GDI PROPERTY GROUP	70,300	74,000	95	7,946	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	
(オーストラリア)		口	口	千豪ドル	千円	%
RURAL FUNDS GROUP		—	40,000	85	7,092	0.0
SCENTRE GROUP		866,000	879,000	3,665	305,110	1.5
WESTFIELD CORP		311,400	—	—	—	—
FOLKESTONE EDUCATION TRUST		33,250	42,000	113	9,439	0.0
VICINITY CENTRES		525,000	523,000	1,370	114,060	0.6
CENTURIA URBAN REIT		11,100	—	—	—	—
VIVA ENERGY REIT		69,000	71,000	146	12,174	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	4,727,700	4,439,302	17,009	1,415,869	
	銘 柄 数 < 比 率 >	32	27	—	<6.9%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND		158,571	153,000	201	15,500	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST		48,033	53,000	108	8,349	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST		174,000	175,000	253	19,548	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD		67,525	—	—	—	—
ARGOSY PROPERTY LTD		138,000	138,000	152	11,747	0.1
INVESTORE PROPERTY LTD		32,000	32,000	48	3,722	0.0
STRIDE STAPLED GROUP		58,000	56,000	104	8,024	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD		215,000	237,000	323	24,922	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	891,129	844,000	1,191	91,816	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	7	—	<0.4%>	
(イスラエル)				千新シェケル		
REIT 1 LTD		28,000	28,000	417	12,804	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	28,000	28,000	417	12,804	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	20,065,512	20,611,804	—	20,304,292	
	銘 柄 数 < 比 率 >	324	314	—	<98.5%>	

\* 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。

\* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

\* 金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

\* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	REIT先物取引		百万円	百万円
		DJREA	92	—
		FTEPR	17	—

\* 単位未満は切り捨て。

\* 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6月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	146,410	0.7
投資証券	20,304,292	98.5
コール・ローン等、その他	171,443	0.8
投資信託財産総額	20,622,145	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。  
 \*当期末における外貨建て純資産（20,597,441千円）の投資信託財産総額（20,622,145千円）に対する比率は99.9%です。  
 \*外貨建て資産は、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米ドル＝109.41円、1カナダドル＝84.43円、1英ポンド＝146.74円、1ユーロ＝129.06円、1香港ドル＝13.94円、1シンガポールドル＝82.03円、1豪ドル＝83.24円、1ニュージーランドドル＝77.04円、1新シェケル＝30.67円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2018年6月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	20,623,879,925
コール・ローン等	40,099,357
株式(評価額)	146,410,536
投資証券(評価額)	20,304,292,710
未収入金	97,524,140
未収配当金	12,804,771
差入委託証拠金	22,748,411
(B) 負債	19,216,104
未払金	4,566,349
未払解約金	14,324,209
未払利息	46
その他未払費用	325,500
(C) 純資産総額(A－B)	20,604,663,821
元本	9,345,070,948
次期繰越損益金	11,259,592,873
(D) 受益権総口数	9,345,070,948口
1万口当たり基準価額(C／D)	22,049円

(注) 期首元本額は9,395,943,368円、期中追加設定元本額は2,831,384,927円、期中一部解約元本額は2,882,257,347円、1口当たり純資産額は2.2049円です。

## ○損益の状況 (2017年6月13日～2018年6月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	831,089,016
受取配当金	830,974,724
受取利息	83,252
その他収益金	56,847
支払利息	△ 25,807
(B) 有価証券売買損益	△ 288,658,605
売買益	1,158,267,537
売買損	△ 1,446,926,142
(C) 先物取引等取引損益	△ 2,051,218
取引益	10,392,973
取引損	△ 12,444,191
(D) 保管費用等	△ 7,956,077
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	532,423,116
(F) 前期繰越損益金	10,779,418,439
(G) 追加信託差損益金	3,199,173,620
(H) 解約差損益金	△ 3,251,422,302
(I) 計(E＋F＋G＋H)	11,259,592,873
次期繰越損益金(I)	11,259,592,873

\*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。  
 \*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。  
 \*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。



# ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村世界 6 資産分散投信（分配コース）	2,678,457,830
野村インデックスファンド・外国REIT	1,432,294,055
ノムラPOFs用インデックスファンド・外国REIT（適格機関投資家専用）	1,224,630,804
野村世界 6 資産分散投信（安定コース）	1,088,270,116
野村世界 6 資産分散投信（成長コース）	771,515,240
野村世界 6 資産分散投信（配分変更コース）	482,167,057
NEIT FUNDS 外国REIT・SAP先進国REIT指数（除く日本・為替ヘッジなし）連動型上場投信	452,999,918
ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA（適格機関投資家専用）	348,558,205
野村DC運用戦略ファンド	255,622,919
野村インデックスファンド・海外 5 資産バランス	224,583,599
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	116,097,572
野村 6 資産均等バランス	71,113,200
ネクストコア	39,532,340
野村資産設計ファンド2040	31,592,423
野村資産設計ファンド2030	23,487,974
野村資産設計ファンド2015	20,921,731
野村資産設計ファンド2025	20,472,518

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村資産設計ファンド2020	19,264,083
野村資産設計ファンド2035	18,532,780
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	7,778,900
野村資産設計ファンド2050	4,367,773
インデックス・ブレンド（タイプV）	3,474,790
野村資産設計ファンド2045	3,088,905
インデックス・ブレンド（タイプIII）	2,576,336
インデックス・ブレンド（タイプII）	768,735
野村世界 6 資産分散投信（DC）成長コース	537,890
インデックス・ブレンド（タイプIV）	520,945
野村世界 6 資産分散投信（DC）安定コース	517,963
インデックス・ブレンド（タイプI）	499,230
野村世界 6 資産分散投信（DC）インカムコース	458,753
野村資産設計ファンド（DC）2050	161,897
野村資産設計ファンド（DC）2040	104,619
野村資産設計ファンド（DC）2030	99,848

## ○お知らせ

該当事項はございません。