

# 野村資産設計ファンド<愛称:未来時計>

2015/2020/2025/2030/2035/2040/2045/2050

## 運用報告書(全体版)

2015 作成対象期間 (2016年6月23日~2016年12月22日) 第28期 (決算日2016年7月22日) 第29期 (決算日2016年8月22日) 第30期 (決算日2016年9月23日)  
第31期 (決算日2016年10月24日) 第32期 (決算日2016年11月22日) 第33期 (決算日2016年12月22日)

2020/2025/2030/2035/2040 作成対象期間 (2016年6月23日~2016年12月22日) 第18期 (決算日2016年12月22日)

2045 作成対象期間 (2016年6月23日~2016年12月22日) 第13期 (決算日2016年12月22日)

2050 作成対象期間 (2016年6月23日~2016年12月22日) 第3期 (決算日2016年12月22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	野村資産設計ファンド								
	2015	2020	2025	2030	2035	2040	2045	2050	
追加型投信/内外/資産複合/インデックス型	2007年6月11日以降、無期限とします。(2015/2020/2025/2030/2035/2040)								
信託期間	2010年9月10日以降、無期限とします。(2045) 2015年9月17日以降、無期限とします。(2050)								
運用方針	各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内及び外国の各債券、各株式、各不動産投資信託証券(REIT)に実質的に投資し、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行うことを基本とします。各ファンドには、それぞれ安定運用開始時期(ターゲットイヤー)が定められており、当初設定以降、安定運用開始時期に近づくにしたがって、定期的に各マザーファンド受益証券への基本投資割合を変更し、株式の実質組み入れの漸減と公社債の実質組み入れの漸増を行い、リスクの漸減を図ることを基本とします。なお、各マザーファンド受益証券への基本投資割合の最終決定は、家計や市場の構造変化等を考慮した上でを行います。<2016年7月1日時点の各マザーファンド受益証券への基本投資割合>								
	2015	2020	2025	2030	2035	2040	2045	2050	
	国内債券NOMJRA-BPI総合 マザーファンド	60%	48%	37%	27%	21%	16%	13%	10.5%
	外国債券マザーファンド	10%	11.7%	12.5%	12.5%	12.5%	12.5%	10.8%	8.8%
	新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド		2.3%	2.5%	2.5%	2.5%	2.5%	2.2%	1.7%
	国内株式マザーファンド	10%	14%	19%	22%	24.5%	29%	32%	34.5%
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	10%	8.4%	11.5%	13.3%	14.8%	17.5%	19.3%	20.8%
	新興国株式マザーファンド		5.6%	7.5%	8.7%	9.7%	11.5%	12.7%	13.7%
	J-REITインデックス マザーファンド	5%	5%	5%	7%	7.5%	5.5%	5%	5%
	海外REITインデックス マザーファンド	5%	5%	5%	7%	7.5%	5.5%	5%	5%
	※安定運用開始時期の到来以降の各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、国内債券NOMJRA-BPI総合 マザーファンド:60%、外国債券マザーファンド、新興国債券(現地通貨建て) マザーファンドの合計:10%、国内株式マザーファンド:10%、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、新興国株式マザーファンドの合計:10%、J-REITインデックス マザーファンド:5%、海外REITインデックス マザーファンド:5%を基本とします。なお、家計や市場の構造変化等を考慮し、基本投資割合が変更となる場合があります。 ※「野村資産設計ファンド2015」は、2016年6月22日の翌日より安定運用を開始しました。								
野村資産設計ファンド	主な投資対象			主な投資制限					
	「国内債券NOMJRA-BPI総合 マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「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」の受益証券を主要投資対象とします。			外貨建て資産への直接投資は行いません。デリバティブの直接利用は行いません。株式への直接投資は行いません。					
国内債券NOMJRA-BPI総合 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。			外貨建て資産への投資は行いません。					
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。			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	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。			外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。					
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。			株式への投資割合には制限を設けません。					
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。			株式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	新興国の株式を主要投資対象とします。			株式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	J-REITを主要投資対象とします。			投資信託証券への投資割合には制限を設けません。					
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。			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	安定運用開始時期前は年2回決算、安定運用開始時期以降は毎月決算を行い、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、利子・配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案して分配します。								

## 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/>

－目 次－

■野村資産設計ファンド（2015／2020／2025／2030／2035／2040／2045／2050）の運用状況のご報告

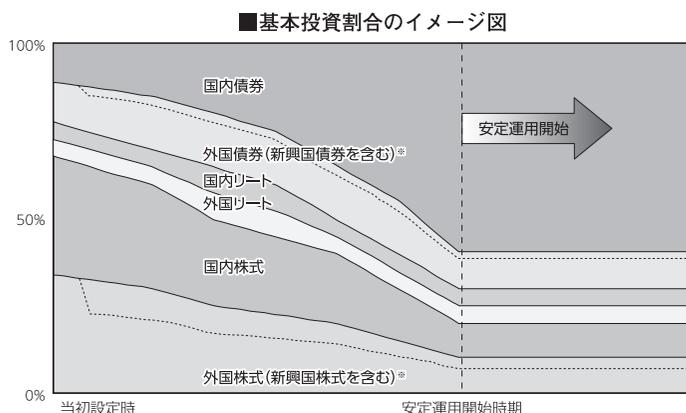
	2015	2020	2025	2030	2035	2040	2045	2050
運用の概要	1ページ							
各ファンドの運用状況	3ページ	9ページ	15ページ	21ページ	27ページ	33ページ	39ページ	45ページ
マザーファンドの運用経過	51ページ							
各ファンドの信託財産の状況	54ページ	63ページ	71ページ	79ページ	87ページ	95ページ	103ページ	111ページ
マザーファンドの組入資産の明細 (2016年12月22日現在)	119ページ							

■各マザーファンドの運用状況のご報告

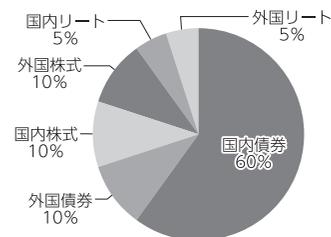
- |                                   |        |
|-----------------------------------|--------|
| 1. 国内株式マザーファンド 運用報告書              | 247ページ |
| 2. 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 運用報告書  | 281ページ |
| 3. 新興国株式マザーファンド 運用報告書             | 325ページ |
| 4. 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド 運用報告書 | 356ページ |
| 5. 外国債券マザーファンド 運用報告書              | 386ページ |
| 6. 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド 運用報告書     | 408ページ |
| 7. J-REITインデックス マザーファンド 運用報告書     | 419ページ |
| 8. 海外REITインデックス マザーファンド 運用報告書     | 429ページ |

## ◎運用の概要

- (1) [野村資産設計ファンド2015/2020/2025/2030/2035/2040/2045/2050]の各ファンドは、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「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」の各受益証券への投資を通じて、国内及び外国（新興国を含む）の各債券、国内及び外国（新興国を含む）の各株式、国内及び外国の各不動産投資信託証券（REIT）に実質的に投資します。
- (2) 各ファンドには、それぞれ安定運用開始時期（ターゲットイヤー）が定められており、当初設定以降、安定運用開始時期に近づくにしたがって、定期的に株式の実質組み入れの漸減と公社債の実質組み入れの漸増を行い、リスクの漸減を図ることを基本とします。なお、各資産への資産配分比率の最終決定は、家計や市場の構造変化等を考慮した上で行います。



■安定運用開始時期の到来以降の基本投資割合



※家計や市場の構造変化等を考慮し、変更となる場合があります。  
外国債券、外国株式は各々、2本のマザーファンドの合計の投資割合とします。

- ※2010年9月より、基本投資割合に新興国債券、新興国株式が追加されています。  
※新興国債券、新興国株式の割合は、各々外国債券、外国株式内に点線で示しています。  
※上記の図表は基本投資割合に変更がない場合のイメージ図であり、また、実際に上記のような運用を行うことを保証するものではありません。

資産	実質的な投資をするマザーファンド	各マザーファンドの対象指数
国内債券	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券	外国債券マザーファンド	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)
(新興国)	新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド	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)
国内株式	国内株式マザーファンド	東証株価指数 (TOPIX)
外国株式	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・為替ヘッジなし)
(新興国)	新興国株式マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース)
国内REIT	J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数 (配当込み)
外国REIT	海外REITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース)

\* 「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、委託会社が円換算したものです。

\* 「MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・為替ヘッジなし)」は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

\* 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース)」は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・ドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

\* 「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、委託会社が独自に円換算したものです。

## ○最近20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	純資産額
	(分配率)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
14期(2014年12月22日)	10,688	5	7.4	112.31	7.8	21.0	0.5	67.5	—	10.2	1,852
15期(2015年6月22日)	10,906	5	2.1	114.99	2.4	21.1	0.4	67.9	—	9.9	1,613
16期(2015年7月22日)	10,889	10	△0.1	114.99	△0.0	19.6	0.4	69.1	—	10.1	1,538
17期(2015年8月24日)	10,597	10	△2.6	112.16	△2.5	17.9	0.3	71.2	—	9.8	1,450
18期(2015年9月24日)	10,460	10	△1.2	110.84	△1.2	18.5	0.4	70.2	—	10.0	1,404
19期(2015年10月24日)	10,666	10	2.1	113.15	2.1	20.5	0.4	68.1	—	10.2	1,409
20期(2015年11月22日)	10,757	10	0.9	114.26	1.0	19.7	0.4	69.0	—	10.0	1,374
21期(2015年12月22日)	10,658	10	△0.8	113.35	△0.8	18.7	0.4	70.0	—	10.0	1,337
22期(2016年1月22日)	10,317	10	△3.1	109.83	△3.1	17.6	0.3	71.4	—	9.5	1,277
23期(2016年2月22日)	10,392	10	0.8	110.87	0.9	18.3	0.4	70.6	—	10.0	1,272
24期(2016年3月22日)	10,738	10	3.4	114.76	3.5	20.1	0.4	68.6	—	10.2	1,295
25期(2016年4月22日)	10,772	10	0.4	115.22	0.4	19.7	0.4	69.5	—	9.8	1,279
26期(2016年5月23日)	10,646	10	△1.1	114.06	△1.0	19.0	0.5	69.8	—	9.9	1,248
27期(2016年6月22日)	10,549	10	△0.8	113.20	△0.8	18.4	0.5	70.5	—	9.9	1,228
28期(2016年7月22日)	10,710	10	1.6	115.15	1.7	20.5	0.3	68.0	—	10.3	1,235
29期(2016年8月22日)	10,505	10	△1.8	113.07	△1.8	19.5	0.3	69.8	—	9.7	1,197
30期(2016年9月23日)	10,515	10	0.2	113.36	0.3	19.6	0.3	69.5	—	9.9	1,183
31期(2016年10月24日)	10,517	10	0.1	113.46	0.1	20.0	0.3	69.3	—	9.8	1,155
32期(2016年11月22日)	10,548	10	0.4	114.01	0.5	20.1	0.4	68.7	—	10.0	1,138
33期(2016年12月22日)	10,814	10	2.6	117.09	2.7	20.3	0.3	68.4	—	10.2	1,119

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 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。

\* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

	'14年7月～'15年6月22日	'15年6月22日の翌日以降 <sup>(注1)</sup>
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合	57%	60%
[外国債券マザーファンド] 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)	8.8%	10% <sup>(注2)</sup>
[新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド] 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・ディバシファイド(円換算ベース)	2.2%	
[国内株式マザーファンド] 東証株価指数(TOPIX)	11%	10%
[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)	6.7%	10% <sup>(注2)</sup>
[新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース)	4.3%	
[J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数(配当込み)	5%	5%
[海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	5%	5%

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式(新興国を含む)・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

(注1) 「野村資産設計ファンド2015」は、2015年6月22日の翌日より安定運用を開始しました。

(注2) 各々、2本のマザーファンドの合計の投資割合とします。

## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
		円	騰落率		騰落率					
第28期	(期首) 2016年6月22日	10,549	—	113.20	—	18.4	0.5	70.5	—	9.9
	6月末	10,542	△0.1	113.10	△0.1	18.0	0.4	70.3	—	9.8
	(期末) 2016年7月22日	10,720	1.6	115.15	1.7	20.5	0.3	68.0	—	10.3
第29期	(期首) 2016年7月22日	10,710	—	115.15	—	20.5	0.3	68.0	—	10.3
	7月末	10,668	△0.4	114.75	△0.3	20.4	0.3	68.1	—	10.3
	(期末) 2016年8月22日	10,515	△1.8	113.07	△1.8	19.5	0.3	69.8	—	9.7
第30期	(期首) 2016年8月22日	10,505	—	113.07	—	19.5	0.3	69.8	—	9.7
	8月末	10,566	0.6	113.73	0.6	19.7	0.3	69.3	—	9.8
	(期末) 2016年9月23日	10,525	0.2	113.36	0.3	19.6	0.3	69.5	—	9.9
第31期	(期首) 2016年9月23日	10,515	—	113.36	—	19.6	0.3	69.5	—	9.9
	9月末	10,507	△0.1	113.30	△0.1	19.2	0.4	69.6	—	9.9
	(期末) 2016年10月24日	10,527	0.1	113.46	0.1	20.0	0.3	69.3	—	9.8
第32期	(期首) 2016年10月24日	10,517	—	113.46	—	20.0	0.3	69.3	—	9.8
	10月末	10,525	0.1	113.62	0.1	20.0	0.4	69.0	—	9.7
	(期末) 2016年11月22日	10,558	0.4	114.01	0.5	20.1	0.4	68.7	—	10.0
第33期	(期首) 2016年11月22日	10,548	—	114.01	—	20.1	0.4	68.7	—	10.0
	11月末	10,671	1.2	115.36	1.2	20.1	0.4	68.3	—	10.3
	(期末) 2016年12月22日	10,824	2.6	117.09	2.7	20.3	0.3	68.4	—	10.2

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

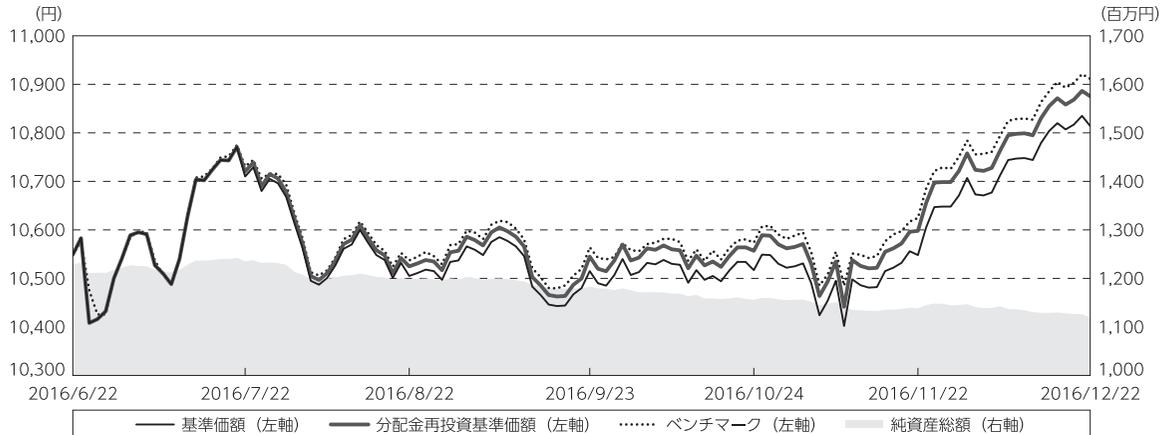
\* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

\* 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

### ○作成期間中の基準価額等の推移



第28期首：10,549円

第33期末：10,814円 (既払分配金(税込み)：60円)

騰落率： 3.1% (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(2016年6月22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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2016年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、第28期首10,549円から第33期末10,814円(分配落ち後)となりました。この間、分配金として1万口当たり合計60円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値上がり額は325円となりました。

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、国内株式(+21.5%)、外国株式(+19.8%)、新興国株式(+17.4%)、新興国債券(+9.6%)、外国REIT(+7.1%)、外国債券(+5.2%)、国内REIT(+0.7%)が上昇し、国内債券(-2.3%)は下落しました。

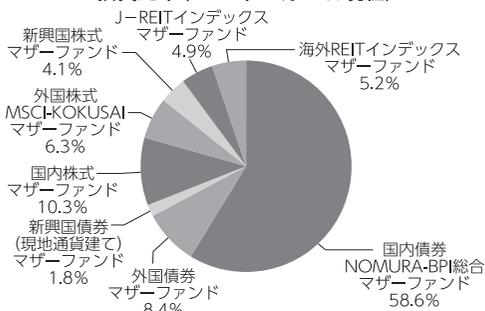
国内株式や外国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

## ○投資環境

資 産	変動要因等
国内債券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことに加え、外国債券利回りの上昇（価格は下落）などを受けて、国内債券利回りは上昇しました。
外国債券 (新興国)	堅調な経済指標の発表などから米国の年内利上げ観測が高まったことに加え、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、同氏の拡張的な財政政策方針による景気加速や財政赤字拡大、インフレ率上昇への警戒感が高まったことなどを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。 米国の新政権による保護主義的な貿易政策や米国金利上昇による資金流出への懸念、メキシコやトルコにおける政策金利の引上げなどを背景に、新興国債券の利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内株式	円安の進展に伴い国内輸出関連企業の業績悪化懸念が後退したことや、国内外の長期金利が上昇したことに伴い銀行の収益回復期待が高まったこと、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国株式 (新興国)	米国における堅調な経済指標の発表や、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、インフラ投資の拡大や法人税率の引き下げなど成長政策への期待が高まったこと、ユーロ圏の景気回復期待の高まりなどを背景に、上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。 原油など商品価格の上昇や、ブラジルにおける経済改革推進への期待やインフレ率鈍化に伴う政策金利の引き下げ、外国株式市場の上昇などを背景に、ロシア・ブラジル・中国などを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内REIT	東京都心オフィスビルの平均賃料や首都圏中古マンション価格の上昇、国内株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国REIT	英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことに伴い英国からの資本流出懸念が高まったこと、米国を中心とした海外長期金利の上昇などを背景に、英国・米国を中心に下落しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2016年12月22日現在)>



当作成期末の各マザーファンドへの投資比率は上記の通りとしました。また、当作成期間を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

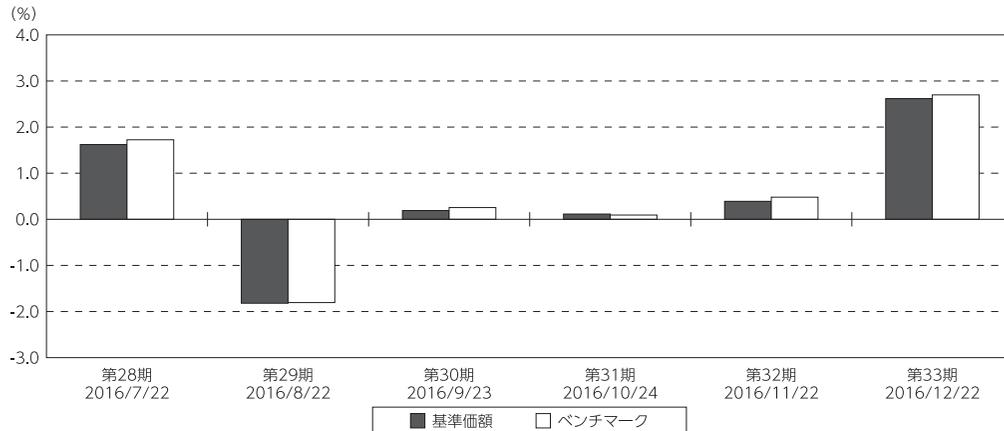
## ○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率※は+3.1%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+3.4%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。

※基準価額の騰落率は、分配金（税込み）を再投資して算出しております。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。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。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第28期	第29期	第30期	第31期	第32期	第33期
	2016年6月23日～ 2016年7月22日	2016年7月23日～ 2016年8月22日	2016年8月23日～ 2016年9月23日	2016年9月24日～ 2016年10月24日	2016年10月25日～ 2016年11月22日	2016年11月23日～ 2016年12月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.093%	10 0.095%	10 0.095%	10 0.095%	10 0.095%	10 0.092%
当期の収益	10	4	10	10	9	10
当期の収益以外	—	5	—	—	0	—
翌期繰越分配対象額	1,545	1,539	1,541	1,545	1,545	1,548

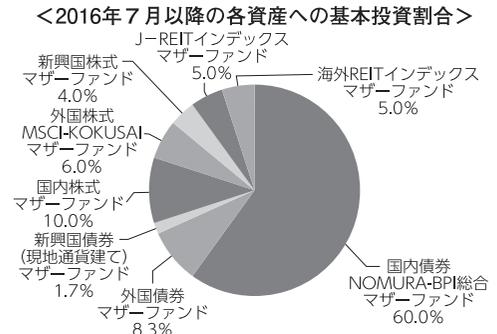
(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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

国内および外国(新興国を含む)の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行う8つのマザーファンドへの投資を通じて行います。なお、2016年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

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。



## ○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	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
14期(2014年12月22日)	10,550	5	8.8	110.28	9.2	30.7	0.7	57.6	—	10.3	1,139
15期(2015年6月22日)	10,890	5	3.3	114.20	3.5	30.8	0.5	58.0	—	10.0	1,085
16期(2015年12月22日)	10,541	5	△3.2	110.97	△2.8	28.3	0.6	60.2	—	10.1	1,013
17期(2016年6月22日)	10,223	5	△3.0	108.01	△2.7	27.9	0.7	60.6	—	10.0	885
18期(2016年12月22日)	10,732	5	5.0	113.83	5.4	28.3	0.4	60.4	—	10.2	903

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 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。

\* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

	'14年7月～'15年6月末	'15年7月～'16年6月末	'16年7月以降
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合	43%	45%	48%
[外国債券マザーファンド] 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)	12%	12.1%	11.7%
[新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド] 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・ディバシファイド(円換算ベース)	3%	2.9%	2.3%
[国内株式マザーファンド] 東証株価指数(TOPIX)	16%	15%	14%
[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)	9.8%	9.1%	8.4%
[新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース)	6.2%	5.9%	5.6%
[J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数(配当込み)	5%	5%	5%
[海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	5%	5%	5%

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式(新興国を含む)・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		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 組入比率
	円	騰 落 率	108.01	騰 落 率					
(期 首)	円	%	108.01	%	%	%	%	%	%
2016年6月22日	10,223	—	108.01	—	27.9	0.7	60.6	—	10.0
6月末	10,170	△0.5	107.39	△0.6	27.4	0.6	60.8	—	10.1
7月末	10,371	1.4	109.73	1.6	28.5	0.4	60.1	—	10.3
8月末	10,294	0.7	108.88	0.8	27.5	0.5	61.3	—	9.9
9月末	10,231	0.1	108.34	0.3	27.0	0.6	61.7	—	10.0
10月末	10,294	0.7	109.02	0.9	27.9	0.6	61.0	—	9.7
11月末	10,517	2.9	111.44	3.2	28.0	0.6	60.3	—	10.3
(期 末)									
2016年12月22日	10,737	5.0	113.83	5.4	28.3	0.4	60.4	—	10.2

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

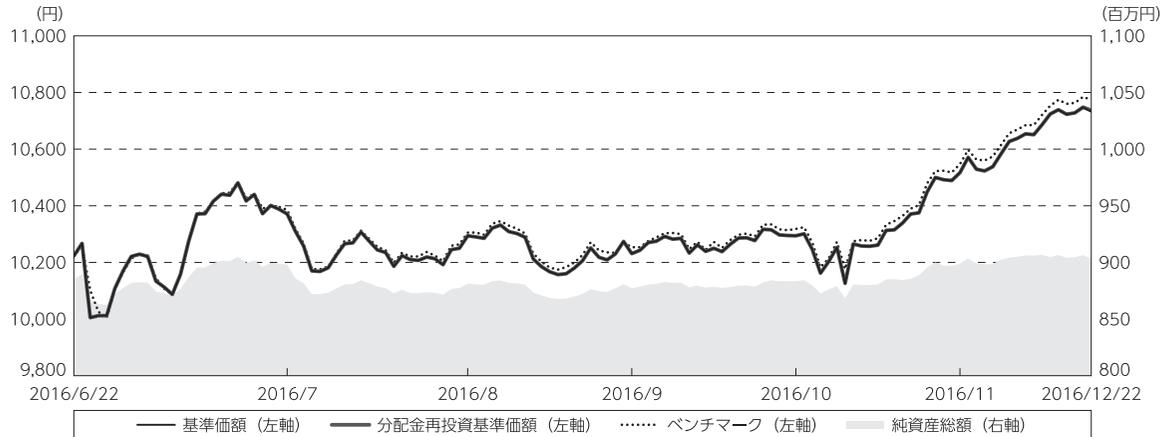
\* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

\* 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：10,223円

期末：10,732円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率： 5.0%（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（2016年6月22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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首（2016年6月22日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首10,223円から期末10,737円（分配金込み）と514円の値上がりとなりました。

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、国内株式（+21.5%）、外国株式（+19.8%）、新興国株式（+17.4%）、新興国債券（+9.6%）、外国REIT（+7.1%）、外国債券（+5.2%）、国内REIT（+0.7%）が上昇し、国内債券（-2.3%）は下落しました。

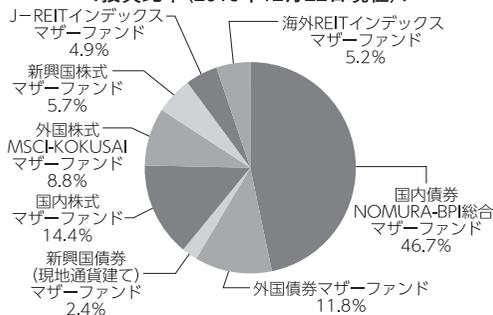
国内株式や外国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

## ○投資環境

資 産	変動要因等
国内債券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことに加え、外国債券利回りの上昇（価格は下落）などを受けて、国内債券利回りは上昇しました。
外国債券	堅調な経済指標の発表などから米国の年内利上げ観測が高まったことに加え、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、同氏の拡張的な財政政策方針による景気加速や財政赤字拡大、インフレ率上昇への警戒感が高まったことなどを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
(新興国)	米国の新政権による保護主義的な貿易政策や米国金利上昇による資金流出への懸念、メキシコやトルコにおける政策金利の引上げなどを背景に、新興国債券の利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内株式	円安の進展に伴い国内輸出関連企業の業績悪化懸念が後退したことや、国内外の長期金利が上昇したことに伴い銀行の収益回復期待が高まったこと、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国株式	米国における堅調な経済指標の発表や、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、インフラ投資の拡大や法人税率の引き下げなど成長政策への期待が高まったこと、ユーロ圏の景気回復期待の高まりなどを背景に、上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
(新興国)	原油など商品価格の上昇や、ブラジルにおける経済改革推進への期待やインフレ率鈍化に伴う政策金利の引き下げ、外国株式市場の上昇などを背景に、ロシア・ブラジル・中国などを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内REIT	東京都心オフィスビルの平均賃料や首都圏中古マンション価格の上昇、国内株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国REIT	英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことに伴い英国からの資本流出懸念が高まったこと、米国を中心とした海外長期金利の上昇などを背景に、英国・米国を中心に下落しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2016年12月22日現在)>



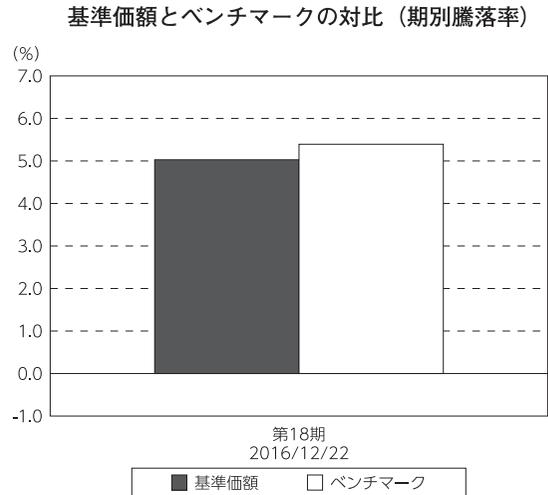
期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとなりました。また、期を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+5.0%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+5.4%を0.4ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。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。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第18期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.047%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,388

(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。

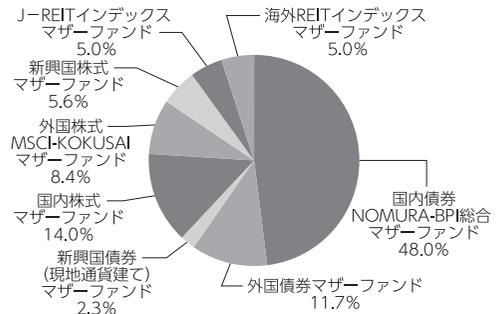
(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎今後の運用方針

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行う8つのマザーファンドへの投資を通じて行います。なお、2016年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

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。

<2016年7月以降の各資産への基本投資割合>



## ○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	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
14期(2014年12月22日)	10,645	5	9.9	110.88	10.3	39.4	0.8	47.7	—	11.4	940
15期(2015年6月22日)	11,110	5	4.4	116.03	4.6	39.6	0.7	48.0	—	11.0	917
16期(2015年12月22日)	10,634	5	△4.2	111.45	△3.9	37.9	0.8	50.4	—	10.2	852
17期(2016年6月22日)	10,118	5	△4.8	106.43	△4.5	37.4	1.0	50.7	—	10.2	831
18期(2016年12月22日)	10,857	5	7.4	114.61	7.7	38.1	0.5	50.5	—	10.3	878

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 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。

\* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

	'14年7月～'15年6月末	'15年7月～'16年6月末	'16年7月以降
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合	33%	35%	37%
[外国債券マザーファンド] 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)	12%	12.1%	12.5%
[新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド] 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・ディバシファイド(円換算ベース)	3%	2.9%	2.5%
[国内株式マザーファンド] 東証株価指数(TOPIX)	20.5%	20%	19%
[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)	12.5%	12.1%	11.5%
[新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース)	8%	7.9%	7.5%
[J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数(配当込み)	5.5%	5%	5%
[海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	5.5%	5%	5%

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式(新興国を含む)・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算してあります。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		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 組入比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%	%	%
2016年6月22日	10,118	—	106.43	—	37.4	1.0	50.7	—	10.2
6月末	10,029	△0.9	105.41	△1.0	36.9	0.8	51.0	—	10.3
7月末	10,304	1.8	108.53	2.0	38.3	0.5	50.1	—	10.3
8月末	10,242	1.2	107.85	1.3	37.3	0.7	51.4	—	10.0
9月末	10,171	0.5	107.19	0.7	36.7	0.7	51.8	—	10.1
10月末	10,276	1.6	108.30	1.8	37.7	0.8	50.9	—	9.8
11月末	10,571	4.5	111.47	4.7	37.7	0.8	50.4	—	10.3
(期 末)									
2016年12月22日	10,862	7.4	114.61	7.7	38.1	0.5	50.5	—	10.3

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

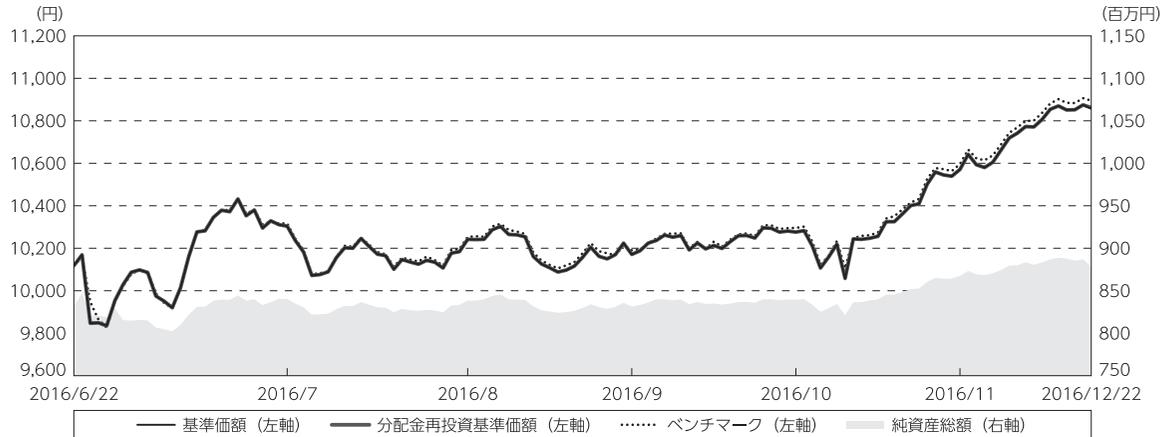
\* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

\* 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：10,118円

期末：10,857円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率： 7.4% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2016年6月22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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2016年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

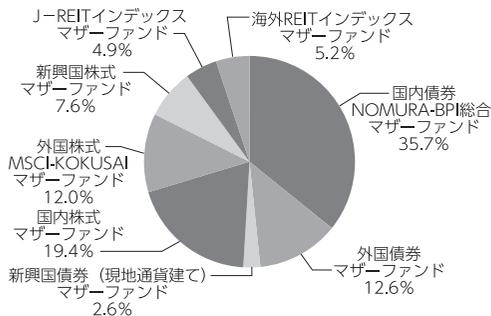
基準価額は、期首10,118円から期末10,862円(分配金込み)と744円の値上がりとなりました。投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、国内株式(+21.5%)、外国株式(+19.8%)、新興国株式(+17.4%)、新興国債券(+9.6%)、外国REIT(+7.1%)、外国債券(+5.2%)、国内REIT(+0.7%)が上昇し、国内債券(-2.3%)は下落しました。国内株式や外国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

## ○投資環境

資 産	変動要因等
国内債券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことに加え、外国債券利回りの上昇（価格は下落）などを受けて、国内債券利回りは上昇しました。
外国債券 (新興国)	堅調な経済指標の発表などから米国の年内利上げ観測が高まったことに加え、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、同氏の拡張的な財政政策方針による景気加速や財政赤字拡大、インフレ率上昇への警戒感が高まったことなどを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。 米国の新政権による保護主義的な貿易政策や米国金利上昇による資金流出への懸念、メキシコやトルコにおける政策金利の引上げなどを背景に、新興国債券の利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内株式	円安の進展に伴い国内輸出関連企業の業績悪化懸念が後退したことや、国内外の長期金利が上昇したことに伴い銀行の収益回復期待が高まったこと、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国株式 (新興国)	米国における堅調な経済指標の発表や、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、インフラ投資の拡大や法人税率の引き下げなど成長政策への期待が高まったこと、ユーロ圏の景気回復期待の高まりなどを背景に、上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。 原油など商品価格の上昇や、ブラジルにおける経済改革推進への期待やインフレ率鈍化に伴う政策金利の引き下げ、外国株式市場の上昇などを背景に、ロシア・ブラジル・中国などを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内REIT	東京都心オフィスビルの平均賃料や首都圏中古マンション価格の上昇、国内株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国REIT	英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことに伴い英国からの資本流出懸念が高まったこと、米国を中心とした海外長期金利の上昇などを背景に、英国・米国を中心に下落しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

< 投資比率 (2016年12月22日現在) >



期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、期を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

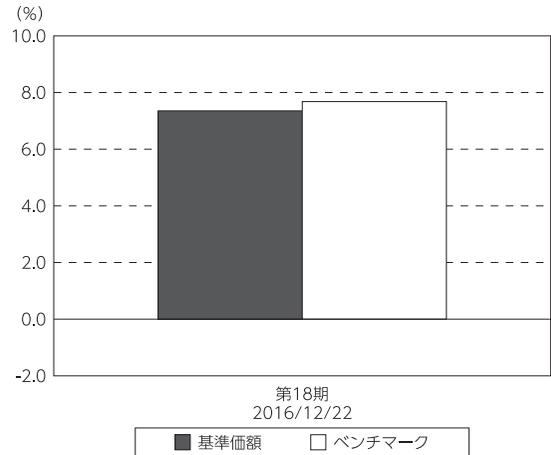
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+7.4%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+7.7%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。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。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第18期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.046%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,551

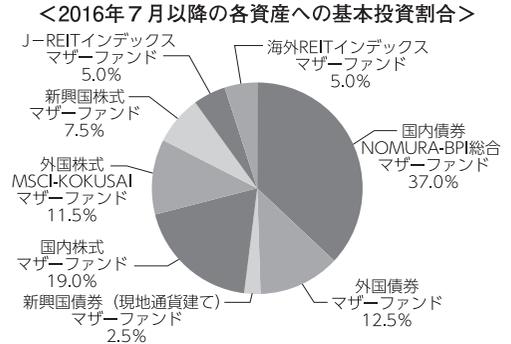
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して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

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行う8つのマザーファンドへの投資を通じて行います。なお、2016年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

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。



## ○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	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
14期(2014年12月22日)	10,775	5	11.2	111.78	11.5	44.2	0.9	38.7	—	15.5	777
15期(2015年6月22日)	11,318	5	5.1	117.71	5.3	44.5	0.8	39.0	—	15.0	800
16期(2015年12月22日)	10,756	5	△4.9	112.24	△4.6	42.7	0.9	40.4	—	15.3	733
17期(2016年6月22日)	10,116	5	△5.9	105.93	△5.6	42.3	1.1	40.6	—	15.3	687
18期(2016年12月22日)	11,020	5	9.0	115.78	9.3	43.9	0.6	40.7	—	14.2	733

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 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。

\* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

	'14年7月～'15年6月末	'15年7月～'16年6月末	'16年7月以降
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合	24%	25%	27%
[外国債券マザーファンド] 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)	12%	12.1%	12.5%
[新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド] 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・ディバシファイド(円換算ベース)	3%	2.9%	2.5%
[国内株式マザーファンド] 東証株価指数(TOPIX)	23%	22.5%	22%
[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)	14.1%	13.6%	13.3%
[新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース)	8.9%	8.9%	8.7%
[J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数(配当込み)	7.5%	7.5%	7%
[海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	7.5%	7.5%	7%

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式(新興国を含む)・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		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 組入比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首)	円	%	%	%	%	%	%	%	%
2016年6月22日	10,116	—	105.93	—	42.3	1.1	40.6	—	15.3
6月末	10,004	△1.1	104.68	△1.2	41.8	0.9	40.9	—	15.4
7月末	10,341	2.2	108.43	2.4	44.1	0.6	40.2	—	14.3
8月末	10,282	1.6	107.79	1.8	43.2	0.8	41.5	—	13.9
9月末	10,199	0.8	107.00	1.0	42.5	0.9	41.8	—	14.1
10月末	10,317	2.0	108.24	2.2	43.6	0.9	41.1	—	13.6
11月末	10,675	5.5	112.03	5.8	43.4	1.0	40.5	—	14.3
(期 末)									
2016年12月22日	11,025	9.0	115.78	9.3	43.9	0.6	40.7	—	14.2

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

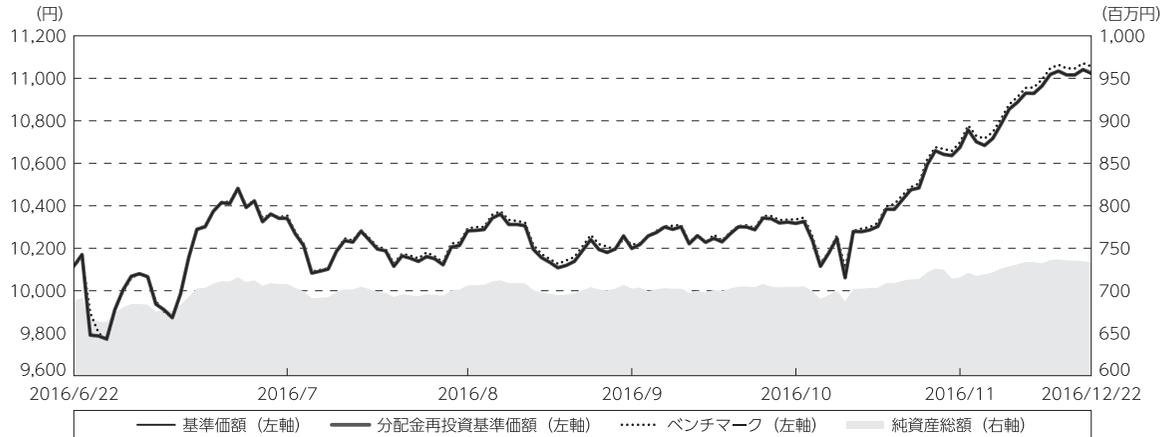
\* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

\* 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：10,116円

期末：11,025円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率： 9.0% (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(2016年6月22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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2016年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首10,116円から期末11,025円(分配金込み)と909円の値上がりとなりました。投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、国内株式(+21.5%)、外国株式(+19.8%)、新興国株式(+17.4%)、新興国債券(+9.6%)、外国REIT(+7.1%)、外国債券(+5.2%)、国内REIT(+0.7%)が上昇し、国内債券(-2.3%)は下落しました。

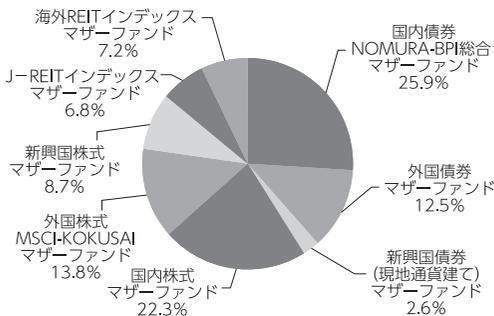
国内株式や外国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

## ○投資環境

資 産	変動要因等
国内債券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことに加え、外国債券利回りの上昇（価格は下落）などを受けて、国内債券利回りは上昇しました。
外国債券 (新興国)	堅調な経済指標の発表などから米国の年内利上げ観測が高まったことに加え、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、同氏の拡張的な財政政策方針による景気加速や財政赤字拡大、インフレ率上昇への警戒感が高まったことなどを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。 米国の新政権による保護主義的な貿易政策や米国金利上昇による資金流出への懸念、メキシコやトルコにおける政策金利の引上げなどを背景に、新興国債券の利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内株式	円安の進展に伴い国内輸出関連企業の業績悪化懸念が後退したことや、国内外の長期金利が上昇したことに伴い銀行の収益回復期待が高まったこと、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国株式 (新興国)	米国における堅調な経済指標の発表や、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、インフラ投資の拡大や法人税率の引き下げなど成長政策への期待が高まったこと、ユーロ圏の景気回復期待の高まりなどを背景に、上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。 原油など商品価格の上昇や、ブラジルにおける経済改革推進への期待やインフレ率鈍化に伴う政策金利の引き下げ、外国株式市場の上昇などを背景に、ロシア・ブラジル・中国などを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内REIT	東京都心オフィスビルの平均賃料や首都圏中古マンション価格の上昇、国内株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国REIT	英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことに伴い英国からの資本流出懸念が高まったこと、米国を中心とした海外長期金利の上昇などを背景に、英国・米国を中心に下落しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

< 投資比率 (2016年12月22日現在) >



期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、期を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

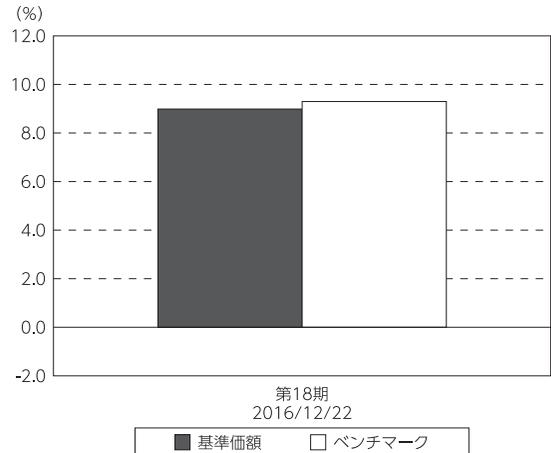
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+9.0%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+9.3%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。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。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第18期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.045%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,150

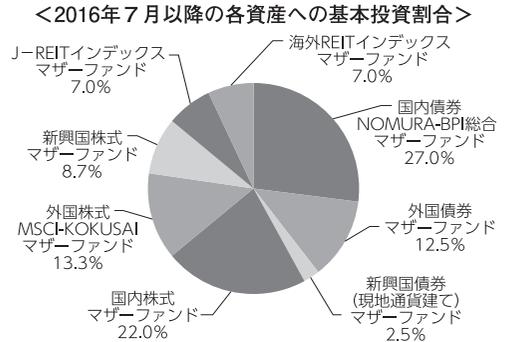
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して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

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行う8つのマザーファンドへの投資を通じて行います。なお、2016年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

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。



## ○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	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
14期(2014年12月22日)	10,546	5	11.6	108.67	11.9	50.0	1.1	33.7	—	14.5	555
15期(2015年6月22日)	11,158	5	5.9	115.21	6.0	50.3	0.9	34.0	—	14.1	528
16期(2015年12月22日)	10,546	5	△5.4	109.23	△5.2	47.6	1.0	35.3	—	15.3	481
17期(2016年6月22日)	9,829	0	△6.8	102.09	△6.5	47.2	1.3	35.6	—	15.4	454
18期(2016年12月22日)	10,824	5	10.2	112.78	10.5	48.7	0.7	34.8	—	15.2	495

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 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。

\* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

	'14年7月～'15年6月末	'15年7月～'16年6月末	'16年7月以降
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合	19%	20%	21%
[外国債券マザーファンド] 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)	12%	12.1%	12.5%
[新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド] 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・ディバシファイド(円換算ベース)	3%	2.9%	2.5%
[国内株式マザーファンド] 東証株価指数(TOPIX)	26%	25%	24.5%
[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)	15.9%	15.2%	14.8%
[新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース)	10.1%	9.8%	9.7%
[J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数(配当込み)	7%	7.5%	7.5%
[海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	7%	7.5%	7.5%

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式(新興国を含む)・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		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 組入比率
	円	騰 落 率		騰 落 率					
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%
2016年6月22日	9,829	—	102.09	—	47.2	1.3	35.6	—	15.4
6月末	9,701	△ 1.3	100.68	△ 1.4	46.7	1.0	35.9	—	15.5
7月末	10,069	2.4	104.71	2.6	48.9	0.7	34.4	—	15.3
8月末	10,017	1.9	104.16	2.0	48.0	0.8	35.5	—	14.9
9月末	9,931	1.0	103.32	1.2	47.4	1.0	35.8	—	15.1
10月末	10,063	2.4	104.70	2.6	48.5	1.1	35.2	—	14.5
11月末	10,450	6.3	108.76	6.5	48.2	1.1	34.7	—	15.3
(期 末)									
2016年12月22日	10,829	10.2	112.78	10.5	48.7	0.7	34.8	—	15.2

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

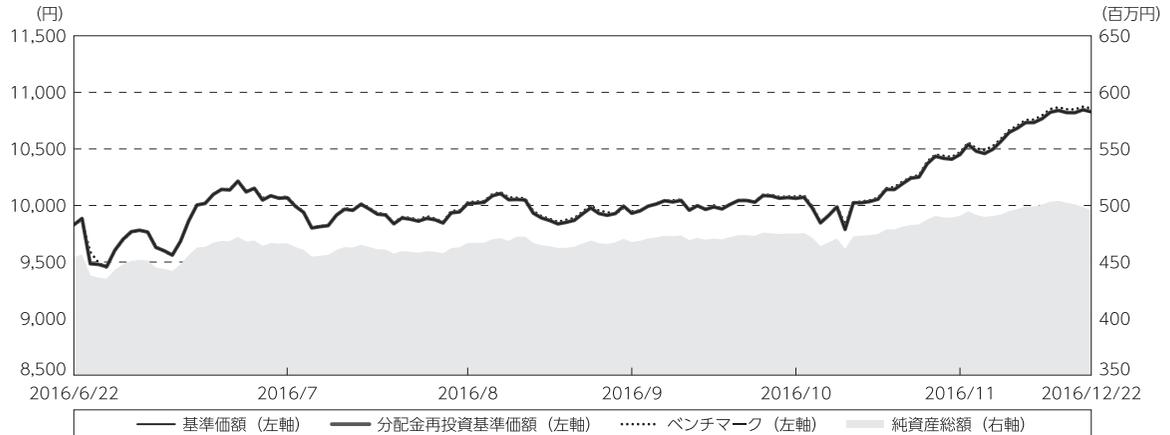
\* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

\* 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：9,829円

期 末：10,824円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率：10.2% (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。作成年首(2016年6月22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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成年首(2016年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首9,829円から期末10,829円(分配金込み)と1,000円の値上がりとなりました。投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、国内株式(+21.5%)、外国株式(+19.8%)、新興国株式(+17.4%)、新興国債券(+9.6%)、外国REIT(+7.1%)、外国債券(+5.2%)、国内REIT(+0.7%)が上昇し、国内債券(-2.3%)は下落しました。

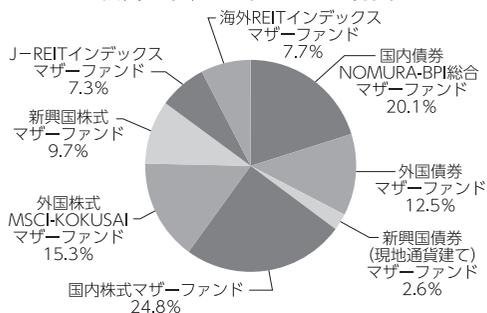
国内株式や外国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

## ○投資環境

資 産	変動要因等
国内債券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことに加え、外国債券利回りの上昇（価格は下落）などを受けて、国内債券利回りは上昇しました。
外国債券	堅調な経済指標の発表などから米国の年内利上げ観測が高まったことに加え、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、同氏の拡張的な財政政策方針による景気加速や財政赤字拡大、インフレ率上昇への警戒感が高まったことなどを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
(新興国)	米国の新政権による保護主義的な貿易政策や米国金利上昇による資金流出への懸念、メキシコやトルコにおける政策金利の引き上げなどを背景に、新興国債券の利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内株式	円安の進展に伴い国内輸出関連企業の業績悪化懸念が後退したことや、国内外の長期金利が上昇したことに伴い銀行の収益回復期待が高まったこと、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国株式	米国における堅調な経済指標の発表や、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、インフラ投資の拡大や法人税率の引き下げなど成長政策への期待が高まったこと、ユーロ圏の景気回復期待の高まりなどを背景に、上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
(新興国)	原油など商品価格の上昇や、ブラジルにおける経済改革推進への期待やインフレ率鈍化に伴う政策金利の引き下げ、外国株式市場の上昇などを背景に、ロシア・ブラジル・中国などを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内REIT	東京都心オフィスビルの平均賃料や首都圏中古マンション価格の上昇、国内株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国REIT	英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことに伴い英国からの資本流出懸念が高まったこと、米国を中心とした海外長期金利の上昇などを背景に、英国・米国を中心に下落しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2016年12月22日現在)>



期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、期を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

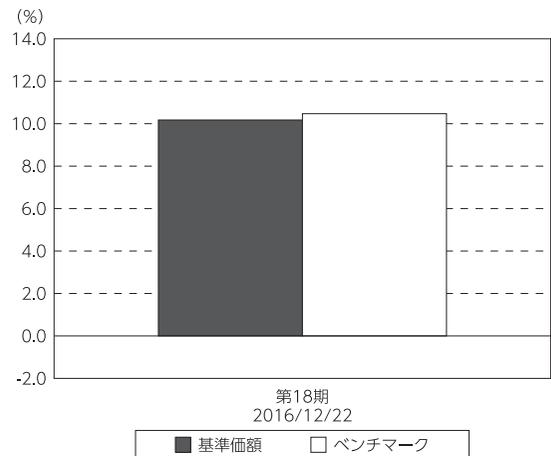
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+10.2%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+10.5%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。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。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第18期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.046%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,284

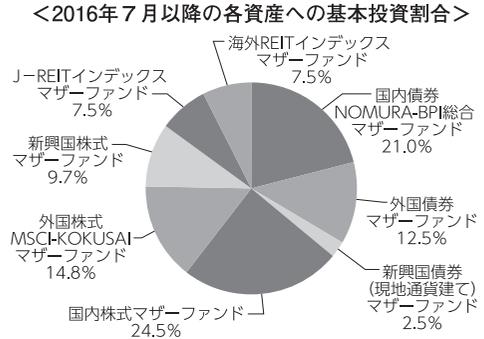
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して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

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行う8つのマザーファンドへの投資を通じて行います。なお、2016年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

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。



## ○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	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
14期(2014年12月22日)	10,406	5	11.7	106.74	12.0	58.8	1.3	28.8	—	10.6	1,648
15期(2015年6月22日)	11,121	5	6.9	114.27	7.0	59.1	1.0	29.0	—	10.3	1,554
16期(2015年12月22日)	10,407	5	△6.4	107.23	△6.2	57.3	1.2	30.4	—	10.5	1,385
17期(2016年6月22日)	9,537	0	△8.4	98.50	△8.1	56.9	1.5	30.5	—	10.5	1,257
18期(2016年12月22日)	10,669	5	11.9	110.49	12.2	57.5	0.8	29.9	—	11.3	1,342

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 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。

\* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

	'14年7月～'15年6月末	'15年7月～'16年6月末	'16年7月以降
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合	14.5%	15%	16%
[外国債券マザーファンド] 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)	11.6%	12.1%	12.5%
[新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド] 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)	2.9%	2.9%	2.5%
[国内株式マザーファンド] 東証株価指数(TOPIX)	30.5%	30%	29%
[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)	18.6%	18.2%	17.5%
[新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース)	11.9%	11.8%	11.5%
[J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数(配当込み)	5%	5%	5.5%
[海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	5%	5%	5.5%

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式(新興国を含む)・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		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 組入比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%
2016年6月22日	9,537	—	98.50	—	56.9	1.5	30.5	—	10.5
6月末	9,382	△ 1.6	96.80	△ 1.7	56.5	1.2	30.8	—	10.7
7月末	9,783	2.6	101.14	2.7	57.7	0.8	29.5	—	11.4
8月末	9,751	2.2	100.82	2.3	56.7	1.0	30.5	—	11.1
9月末	9,668	1.4	99.97	1.5	56.1	1.1	30.8	—	11.3
10月末	9,843	3.2	101.78	3.3	57.1	1.2	30.1	—	10.8
11月末	10,261	7.6	106.14	7.8	56.8	1.2	29.8	—	11.4
(期 末)									
2016年12月22日	10,674	11.9	110.49	12.2	57.5	0.8	29.9	—	11.3

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

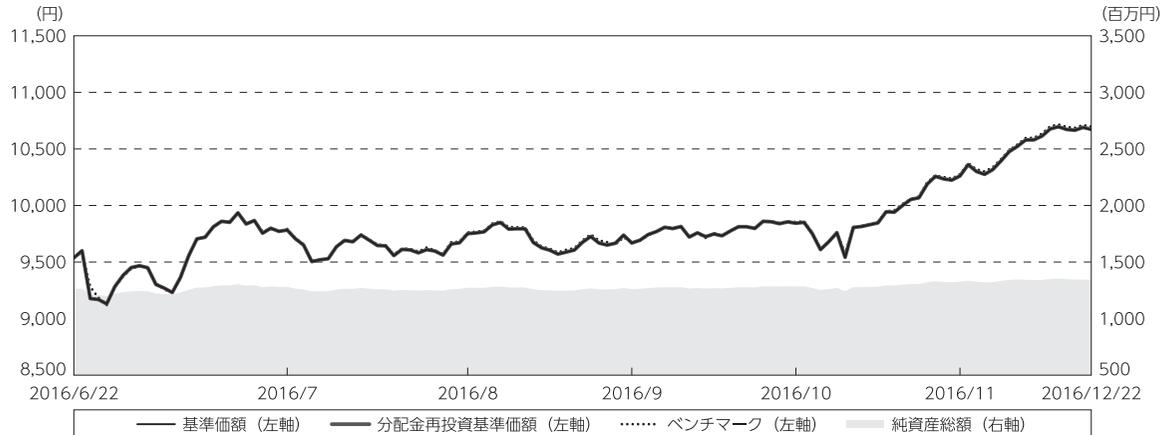
\* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

\* 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：9,537円

期末：10,669円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率：11.9% (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。作成年首(2016年6月22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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成年首(2016年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首9,537円から期末10,674円(分配金込み)と1,137円の値上がりとなりました。投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、国内株式(+21.5%)、外国株式(+19.8%)、新興国株式(+17.4%)、新興国債券(+9.6%)、外国REIT(+7.1%)、外国債券(+5.2%)、国内REIT(+0.7%)が上昇し、国内債券(-2.3%)は下落しました。

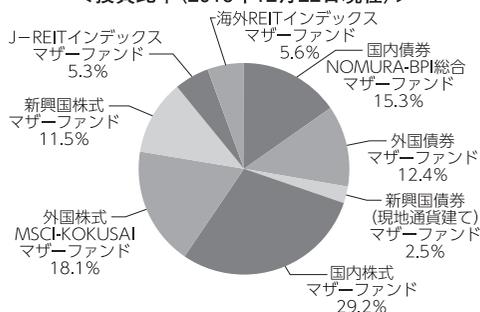
国内株式や外国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

## ○投資環境

資 産	変動要因等
国内債券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことに加え、外国債券利回りの上昇（価格は下落）などを受けて、国内債券利回りは上昇しました。
外国債券	堅調な経済指標の発表などから米国の年内利上げ観測が高まったことに加え、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、同氏の拡張的な財政政策方針による景気加速や財政赤字拡大、インフレ率上昇への警戒感が高まったことなどを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
(新興国)	米国の新政権による保護主義的な貿易政策や米国金利上昇による資金流出への懸念、メキシコやトルコにおける政策金利の引上げなどを背景に、新興国債券の利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内株式	円安の進展に伴い国内輸出関連企業の業績悪化懸念が後退したことや、国内外の長期金利が上昇したことに伴い銀行の収益回復期待が高まったこと、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国株式	米国における堅調な経済指標の発表や、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、インフラ投資の拡大や法人税率の引き下げなど成長政策への期待が高まったこと、ユーロ圏の景気回復期待の高まりなどを背景に、上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
(新興国)	原油など商品価格の上昇や、ブラジルにおける経済改革推進への期待やインフレ率鈍化に伴う政策金利の引き下げ、外国株式市場の上昇などを背景に、ロシア・ブラジル・中国などを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内REIT	東京都心オフィスビルの平均賃料や首都圏中古マンション価格の上昇、国内株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国REIT	英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことに伴い英国からの資本流出懸念が高まったこと、米国を中心とした海外長期金利の上昇などを背景に、英国・米国を中心に下落しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2016年12月22日現在)>



期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、期を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

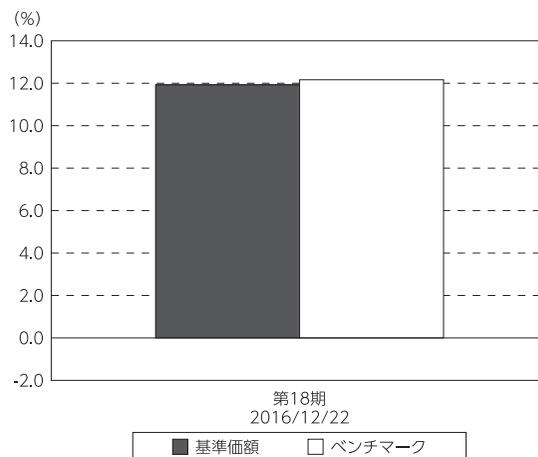
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+11.9%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+12.2%を0.3ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



- (注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。  
 (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。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。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第18期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.047%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,865

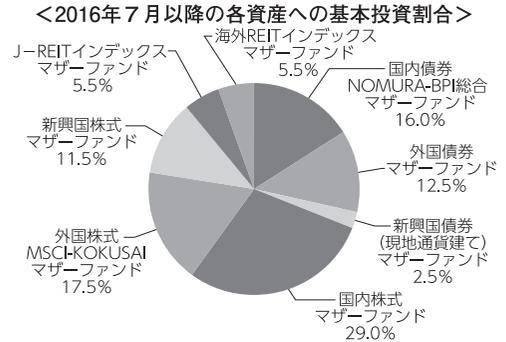
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して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

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行う8つのマザーファンドへの投資を通じて行います。なお、2016年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

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。



## ○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	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
9期(2014年12月22日)	18,203	5	12.1	181.23	12.2	63.7	1.4	23.8	—	10.6	86
10期(2015年6月22日)	19,595	5	7.7	195.16	7.7	64.0	1.1	24.1	—	10.3	135
11期(2015年12月22日)	18,275	5	△ 6.7	182.28	△ 6.6	62.2	1.3	25.3	—	10.6	121
12期(2016年6月22日)	16,647	5	△ 8.9	166.40	△ 8.7	61.8	1.6	25.5	—	10.6	113
13期(2016年12月22日)	18,834	5	13.2	188.56	13.3	63.2	0.9	25.1	—	10.3	123

\* 基準価額の騰落率は分配金込み。

\* 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。

\* ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

	'14年7月～'15年6月末	'15年7月～'16年6月末	'16年7月以降
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合	12%	12.5%	13%
[外国債券マザーファンド] 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)	9.6%	10.1%	10.8%
[新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド] 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)	2.4%	2.4%	2.2%
[国内株式マザーファンド] 東証株価指数(TOPIX)	33%	32.5%	32%
[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)	20.2%	19.7%	19.3%
[新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース)	12.8%	12.8%	12.7%
[J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数(配当込み)	5%	5%	5%
[海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	5%	5%	5%

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式(新興国を含む)・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		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 組入比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%
2016年6月22日	16,647	—	166.40	—	61.8	1.6	25.5	—	10.6
6月末	16,352	△ 1.8	163.29	△ 1.9	61.4	1.3	25.8	—	10.7
7月末	17,111	2.8	171.18	2.9	63.4	0.9	24.7	—	10.4
8月末	17,076	2.6	170.82	2.7	62.5	1.1	25.6	—	10.2
9月末	16,931	1.7	169.33	1.8	62.0	1.3	25.8	—	10.4
10月末	17,284	3.8	172.85	3.9	62.8	1.4	25.2	—	9.9
11月末	18,066	8.5	180.71	8.6	62.5	1.4	24.9	—	10.4
(期 末)									
2016年12月22日	18,839	13.2	188.56	13.3	63.2	0.9	25.1	—	10.3

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

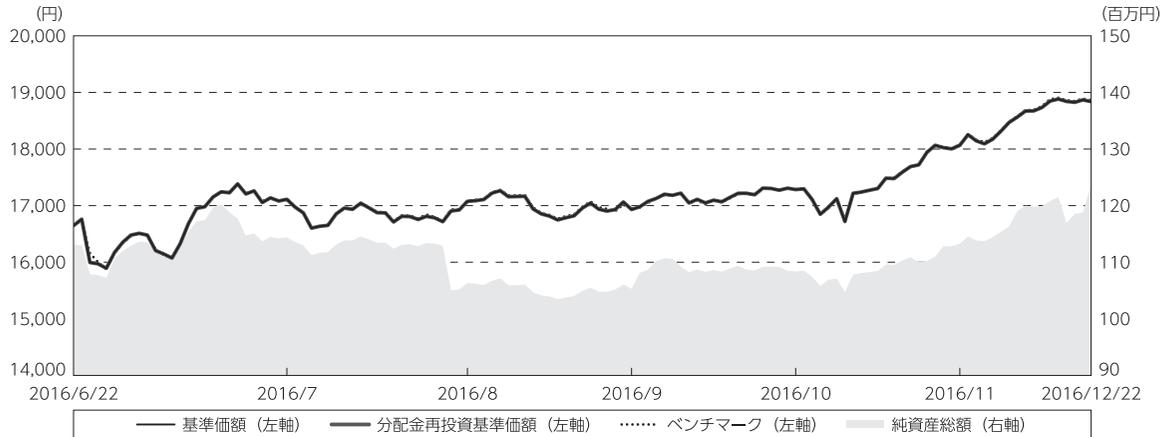
\* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

\* 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：16,647円

期末：18,834円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率：13.2% (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。作定期首(2016年6月22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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作定期首(2016年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首16,647円から期末18,839円(分配金込み)と2,192円の値上がりとなりました。

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、国内株式(+21.5%)、外国株式(+19.8%)、新興国株式(+17.4%)、新興国債券(+9.6%)、外国REIT(+7.1%)、外国債券(+5.2%)、国内REIT(+0.7%)が上昇し、国内債券(-2.3%)は下落しました。

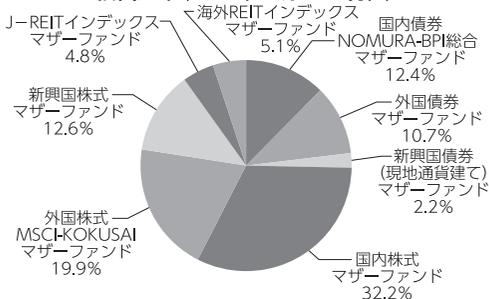
国内株式や外国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

## ○投資環境

資 産	変動要因等
国内債券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことに加え、外国債券利回りの上昇（価格は下落）などを受けて、国内債券利回りは上昇しました。
外国債券	堅調な経済指標の発表などから米国の年内利上げ観測が高まったことに加え、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、同氏の拡張的な財政政策方針による景気加速や財政赤字拡大、インフレ率上昇への警戒感が高まったことなどを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
(新興国)	米国の新政権による保護主義的な貿易政策や米国金利上昇による資金流出への懸念、メキシコやトルコにおける政策金利の引上げなどを背景に、新興国債券の利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内株式	円安の進展に伴い国内輸出関連企業の業績悪化懸念が後退したことや、国内外の長期金利が上昇したことに伴い銀行の収益回復期待が高まったこと、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国株式	米国における堅調な経済指標の発表や、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、インフラ投資の拡大や法人税率の引き下げなど成長政策への期待が高まったこと、ユーロ圏の景気回復期待の高まりなどを背景に、上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
(新興国)	原油など商品価格の上昇や、ブラジルにおける経済改革推進への期待やインフレ率鈍化に伴う政策金利の引き下げ、外国株式市場の上昇などを背景に、ロシア・ブラジル・中国などを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内REIT	東京都心オフィスビルの平均賃料や首都圏中古マンション価格の上昇、国内株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国REIT	英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことに伴い英国からの資本流出懸念が高まったこと、米国を中心とした海外長期金利の上昇などを背景に、英国・米国を中心に下落しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2016年12月22日現在)>



期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、期を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

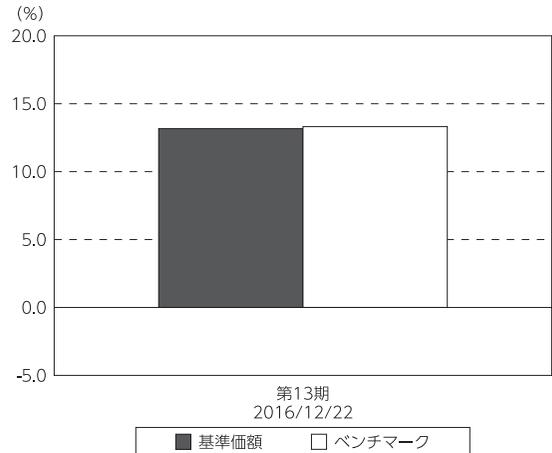
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+13.2%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+13.3%を0.1ポイント下回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。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。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第13期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.027%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	8,833

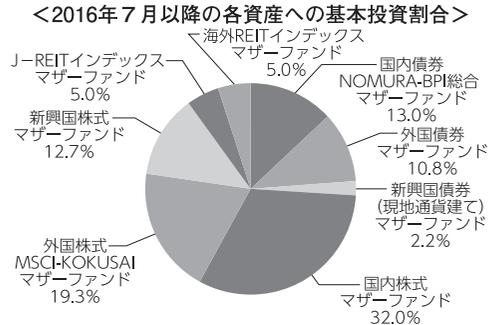
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して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

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行う8つのマザーファンドへの投資を通じて行います。なお、2016年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

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。



## ○設定以来の運用実績

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	純資産額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率						
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
2015年9月17日	10,000	—	—	100.00	—	—	—	—	—	—	1
1期(2015年12月22日)	10,144	5	1.5	101.41	1.4	67.1	1.5	20.3	—	10.6	31
2期(2016年6月22日)	9,193	0	△9.4	91.99	△9.3	66.7	1.8	20.4	—	10.7	63
3期(2016年12月22日)	10,500	5	14.3	105.07	14.2	68.0	0.9	20.2	—	10.4	91

\*基準価額の騰落率は分配金込み。

\*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。

\*ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

	当初設定時～'16年6月末	'16年7月以降
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合	10%	10.5%
[外国債券マザーファンド] 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)	8.1%	8.8%
[新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド] 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・ディバシファイド(円換算ベース)	1.9%	1.7%
[国内株式マザーファンド] 東証株価指数(TOPIX)	35%	34.5%
[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)	21.2%	20.8%
[新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース)	13.8%	13.7%
[J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数(配当込み)	5%	5%
[海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	5%	5%

対象指数の合成にあたっては、基準価額への反映を考慮して、海外指数については営業日前日の指数値をもとにしています。なお、新興国債券・外国株式(新興国を含む)・外国REIT指数については、営業日前日のドルベース指数を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しています。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		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 組入比率
	円	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首) 2016年6月22日	9,193	—	91.99	—	66.7	1.8	20.4	—	10.7
6 月 末	9,018	△ 1.9	90.15	△ 2.0	66.4	1.4	20.7	—	10.8
7 月 末	9,468	3.0	94.77	3.0	68.1	1.0	19.8	—	10.4
8 月 末	9,452	2.8	94.65	2.9	67.4	1.2	20.6	—	10.2
9 月 末	9,373	2.0	93.80	2.0	66.8	1.4	20.8	—	10.4
10 月 末	9,587	4.3	95.92	4.3	67.6	1.5	20.3	—	9.9
11 月 末	10,046	9.3	100.51	9.3	67.2	1.5	20.1	—	10.4
(期 末) 2016年12月22日	10,505	14.3	105.07	14.2	68.0	0.9	20.2	—	10.4

\* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

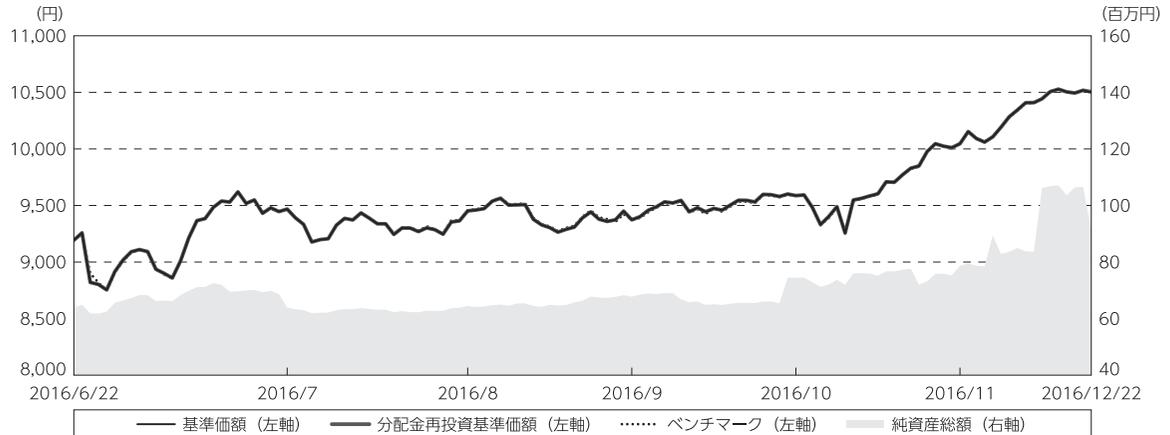
\* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

\* 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：9,193円

期末：10,505円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率：14.3% (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(2016年6月22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、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。ベンチマークは、作成期首(2016年6月22日)の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首9,193円から期末10,505円(分配金込み)と1,312円の値上がりとなりました。

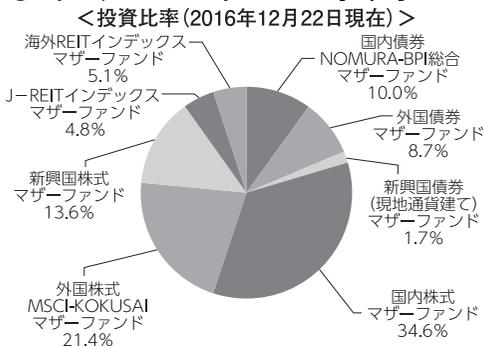
投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、国内株式(+21.5%)、外国株式(+19.8%)、新興国株式(+17.4%)、新興国債券(+9.6%)、外国REIT(+7.1%)、外国債券(+5.2%)、国内REIT(+0.7%)が上昇し、国内債券(-2.3%)は下落しました。

国内株式や外国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

## ○投資環境

資 産	変動要因等
国内債券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことに加え、外国債券利回りの上昇（価格は下落）などを受けて、国内債券利回りは上昇しました。
外国債券	堅調な経済指標の発表などから米国の年内利上げ観測が高まったことに加え、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、同氏の拡張的な財政政策方針による景気加速や財政赤字拡大、インフレ率上昇への警戒感が高まったことなどを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に上昇（価格は下落）しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
(新興国)	米国の新政権による保護主義的な貿易政策や米国金利上昇による資金流出への懸念、メキシコやトルコにおける政策金利の引上げなどを背景に、新興国債券の利回りは上昇（価格は下落）しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内株式	円安の進展に伴い国内輸出関連企業の業績悪化懸念が後退したことや、国内外の長期金利が上昇したことに伴い銀行の収益回復期待が高まったこと、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国株式	米国における堅調な経済指標の発表や、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、インフラ投資の拡大や法人税率の引き下げなど成長政策への期待が高まったこと、ユーロ圏の景気回復期待の高まりなどを背景に、上昇しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。
(新興国)	原油など商品価格の上昇や、ブラジルにおける経済改革推進への期待やインフレ率鈍化に伴う政策金利の引き下げ、外国株式市場の上昇などを背景に、ロシア・ブラジル・中国などを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇（円安）しました。
国内REIT	東京都心オフィスビルの平均賃料や首都圏中古マンション価格の上昇、国内株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外国REIT	英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱派が勝利したことに伴い英国からの資本流出懸念が高まったこと、米国を中心とした海外長期金利の上昇などを背景に、英国・米国を中心に下落しました。為替レートは、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ



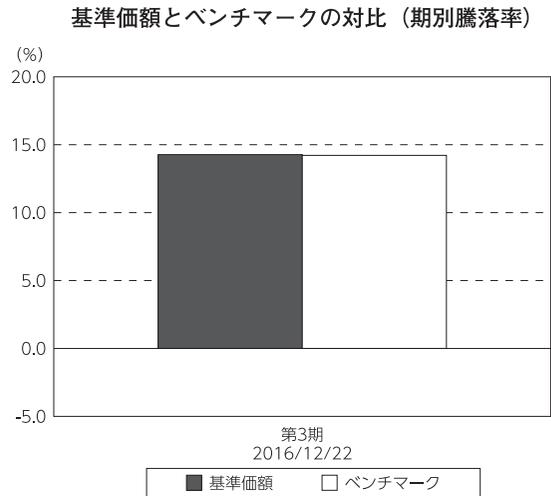
期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、期を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は+14.3%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+14.2%を0.1ポイント上回りました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。また、ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートが異なることなどから、評価上の差異が生じる場合があります。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークは、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数です。

## ◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。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。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第3期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.048%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	695

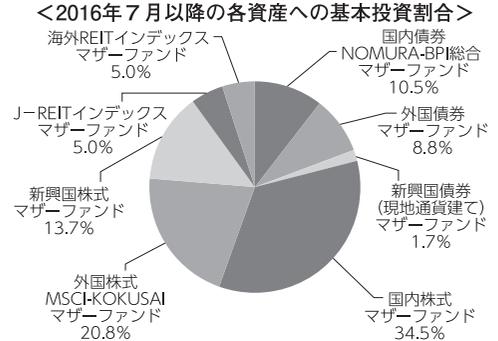
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して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。

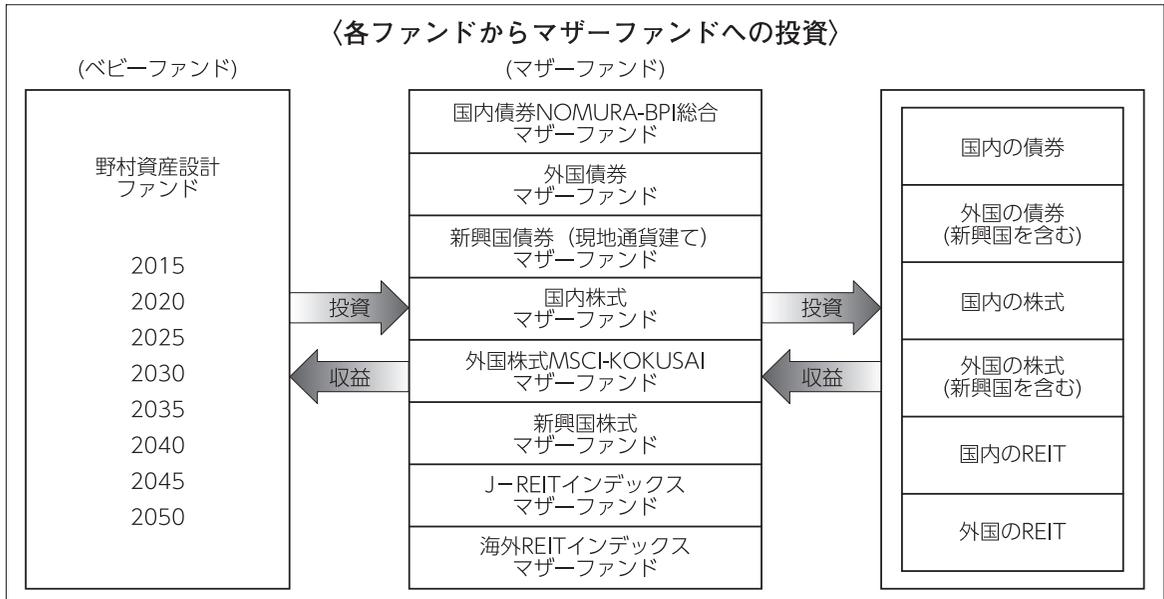
## ◎今後の運用方針

国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行う8つのマザーファンドへの投資を通じて行います。なお、2016年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願ひ申し上げます。



## ◎マザーファンドの運用経過



### [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]

NOMURA-BPI総合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、種別構成、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債券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。組入比率は期を通じて高位に維持しました。

### [外国債券マザーファンド]

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）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。

**[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]**

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、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。

**[国内株式マザーファンド]**

東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果を目指し、先物を含む実質の株式組入比率は高位に維持しました。現物株式につきましては、東証1部上場銘柄に幅広く分散投資し、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ってまいりました。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。また、日々の追加設定・解約による資金移動に対しては売買にかかるコストなどを考慮し、従来通り株式先物を利用してまいりました。

**[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]**

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、株式（投資信託証券や先物を含む）組入比率は期を通じて高位に維持しました。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。

**[新興国株式マザーファンド]**

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・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すため、新興国の株式（DR（預託証券）を含む）に幅広く分散投資し、株式先物への投資も一部行いました。期中の資金流入出や「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」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した。実質株式組入比率（投資信託証券や株式先物を含む）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）は行いませんでした。

**[J-REITインデックス マザーファンド]**

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、実質投資信託証券組入比率（先物を含む）は期を通じて高位に維持しました。J-REITへの投資にあたっては、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証REIT指数（配当込み）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ってまいりました。また、組入比率を高位に維持する為、東証REIT指数先物を利用してまいりました。

**[海外REITインデックス マザーファンド]**

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、実質投資信託証券組入比率（先物を含む）は期を通じて高位に維持しました。REITへの投資にあたっては、組入銘柄の構成比率がS&P先進国REIT指数（除く日本）の銘柄構成比とほぼ同水準になるように運用を行いました。なお、為替ヘッジは行いませんでした。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	第28期～第33期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	44	0.417	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(16)	(0.152)	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 ）	(25)	(0.238)	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 ）	( 3 )	(0.027)	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＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※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 )	(0.001)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※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)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.008	(d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 0 )	(0.005)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0 )	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	45	0.427	
作成期間の平均基準価額は、10,579円です。			

\* 作成期間の費用（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）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2016年6月23日～2016年12月22日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第28期～第33期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
国内株式マザーファンド	千口	千円	千口	千円
国内株式マザーファンド	8,489	9,896	26,136	33,837
外国債券マザーファンド	3,888	8,071	7,217	15,218
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	3,329	6,159	9,715	19,574
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	20,644	27,292	80,574	106,719
J-REITインデックスマザーファンド	1,451	2,850	4,110	8,066
海外REITインデックスマザーファンド	3,699	7,309	6,613	13,559
新興国株式マザーファンド	3,386	2,942	12,645	12,058
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	222	262	4,644	5,425

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2016年6月23日～2016年12月22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	第28期～第33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	新興国株式 マザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	33,709,014千円	24,798,553千円	2,111,172千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	283,388,922千円	300,070,775千円	14,886,456千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	0.08	0.14

\*(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

(2016年6月23日～2016年12月22日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村資産設計ファンド2015&gt;

該当事項はございません。

## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

区分	第28期～第33期					
	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 18,228	百万円 8	% 0.0	百万円 15,480	百万円 29	% 0.2
貸株	87,600	3,346	3.8	91,075	3,373	3.7

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。

\*貸株の買付額等は貸付、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	第28期～第33期					
	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 16,261	百万円 142	% 0.9	百万円 23,456	百万円 1,259	% 5.4

平均保有割合 0.0%

## &lt;新興国株式マザーファンド&gt;

区分	第28期～第33期					
	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 3,488	百万円 1,039	% 29.8	百万円 1,836	百万円 726	% 39.5

平均保有割合 0.3%

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド&gt;

区分	第28期～第33期					
	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 60,067	百万円 386	% 0.6	百万円 37,090	百万円 301	% 0.8

平均保有割合 0.1%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区 分	第28期～第33期					
	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 34,126	百万円 956	% 2.8	百万円 28,565	百万円 1,675	% 5.9

平均保有割合 0.0%

## &lt;新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド&gt;

区 分	第28期～第33期					
	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 2,076	百万円 215	% 10.4	百万円 1,224	百万円 215	% 17.6

平均保有割合 0.6%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	第28期～第33期					
	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 5,153	百万円 513	% 10.0	百万円 2,578	百万円 170	% 6.6

平均保有割合 0.3%

## &lt;海外REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	第28期～第33期					
	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 1,515	百万円 30	% 2.0	百万円 1,964	百万円 74	% 3.8

平均保有割合 0.3%

## 利害関係人の発行する有価証券等

## ＜国内株式マザーファンド＞

種 類	第28期～第33期		
	買 付 額	売 付 額	第33期末保有額
株式	百万円 156	百万円 44	百万円 2,069

## 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	第28期～第33期
売買委託手数料総額 (A)	16千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.002千円
(B) / (A)	0.0%

\*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証券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年12月22日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	第27期末	第33期末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式マザーファンド	97,091	79,444	115,535
外国債券マザーファンド	45,928	42,599	94,387
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	37,569	31,184	71,018
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	563,195	503,265	656,106
J-REITインデックスマザーファンド	30,686	28,027	55,354
海外REITインデックスマザーファンド	29,881	26,967	58,314
新興国株式マザーファンド	53,643	44,383	45,657
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	20,184	15,762	19,851

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2016年12月22日現在)

項 目	第33期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式マザーファンド	115,535	10.2
外国債券マザーファンド	94,387	8.4
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	71,018	6.3
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	656,106	58.2
J-REITインデックス マザーファンド	55,354	4.9
海外REITインデックス マザーファンド	58,314	5.2
新興国株式マザーファンド	45,657	4.0
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	19,851	1.8
コール・ローン等、その他	11,815	1.0
投資信託財産総額	1,128,037	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、第33期末における外貨建て純資産（669,955,104千円）の投資信託財産総額（670,758,177千円）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、第33期末における外貨建て純資産（358,958,844千円）の投資信託財産総額（359,590,036千円）に対する比率は99.8%です。

\*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、第33期末における外貨建て純資産（18,507,617千円）の投資信託財産総額（18,553,427千円）に対する比率は99.8%です。

\*新興国株式マザーファンドにおいて、第33期末における外貨建て純資産（17,630,982千円）の投資信託財産総額（17,681,087千円）に対する比率は99.7%です。

\*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、第33期末における外貨建て純資産（4,020,044千円）の投資信託財産総額（4,030,530千円）に対する比率は99.7%です。

\*外貨建て資産は、第33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=32.39円、1米ドル=117.72円、1カナダドル=87.60円、1英ポンド=145.61円、1スイスフラン=114.70円、1スウェーデンクローナ=12.77円、1ノルウェークローネ=13.56円、1デンマーククローネ=16.51円、1トルコリラ=33.57円、1ユーロ=122.76円、1チェココルナ=4.55円、1フォリント=0.3956円、1ズロチ=27.82円、1ルーブル=1.93円、1レイ=27.20円、1香港ドル=15.17円、1シンガポールドル=81.48円、1リンギ=26.29円、1バーツ=3.27円、1フィリピンペソ=2.36円、1ルピア=0.0088円、1ウォン=0.0986円、1新台湾ドル=3.68円、1豪ドル=85.25円、1ニュージーランドドル=81.32円、1インドルピー=1.75円、1新シェケル=30.77円、1メキシコペソ=5.73円、1レアル=35.31円、1チリペソ=0.1747円、1コロンビアペソ=0.0393円、1ヌエボソル=34.69円、1UAEディルハム=32.11円、1エジプトポンド=6.12円、1ランド=8.43円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第28期末	第29期末	第30期末	第31期末	第32期末	第33期末
	2016年7月22日現在	2016年8月22日現在	2016年9月23日現在	2016年10月24日現在	2016年11月22日現在	2016年12月22日現在
	円	円	円	円	円	円
<b>(A) 資産</b>	<b>1,238,237,896</b>	<b>1,200,303,632</b>	<b>1,186,337,289</b>	<b>1,160,882,539</b>	<b>1,140,437,592</b>	<b>1,128,037,734</b>
コール・ローン等	3,881,809	3,722,274	3,770,791	3,640,929	3,450,796	3,580,291
国内株式マザーファンド(評価額)	129,144,869	119,588,945	120,299,950	119,035,334	117,654,514	115,535,660
外国債券マザーファンド(評価額)	102,835,824	97,990,297	96,295,842	95,441,871	95,836,427	94,387,616
外国株式MSCI-HOKUSAIマザーファンド(評価額)	78,079,072	71,020,057	70,143,187	70,302,908	72,727,614	71,018,764
国内債券XOMURA-DPI総合マザーファンド(評価額)	723,039,452	722,075,089	710,058,264	689,279,272	673,262,788	656,106,915
J-REITインデックスマザーファンド(評価額)	61,247,212	58,896,835	58,759,054	56,342,429	54,942,886	55,354,559
海外REITインデックスマザーファンド(評価額)	64,743,405	57,189,618	57,835,700	56,270,628	58,049,020	58,314,303
新興国株式マザーファンド(評価額)	52,816,610	48,705,469	47,686,956	47,395,779	45,004,899	45,657,391
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額)	21,166,961	20,640,137	20,208,798	20,067,738	18,976,275	19,851,171
未収入金	1,282,682	474,911	1,278,747	3,105,651	532,373	8,231,064
<b>(B) 負債</b>	<b>3,201,399</b>	<b>2,322,729</b>	<b>3,258,759</b>	<b>5,015,791</b>	<b>2,201,012</b>	<b>8,936,094</b>
未払収益分配金	1,153,116	1,140,366	1,125,181	1,099,053	1,079,128	1,034,839
未払解約金	1,207,738	322,314	1,261,437	3,088,019	362,269	7,120,611
未払信託報酬	837,288	856,715	868,761	825,509	756,675	777,623
未払利息	4	5	6	4	4	3
その他未払費用	3,253	3,329	3,374	3,206	2,936	3,018
<b>(C) 純資産総額(A-B)</b>	<b>1,235,036,497</b>	<b>1,197,980,903</b>	<b>1,183,078,530</b>	<b>1,155,866,748</b>	<b>1,138,236,580</b>	<b>1,119,101,640</b>
元本	1,153,116,552	1,140,366,661	1,125,181,199	1,099,053,836	1,079,128,334	1,034,839,512
次期繰越損益金	81,919,945	57,614,242	57,897,331	56,812,912	59,108,246	84,262,128
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>1,153,116,552口</b>	<b>1,140,366,661口</b>	<b>1,125,181,199口</b>	<b>1,099,053,836口</b>	<b>1,079,128,334口</b>	<b>1,034,839,512口</b>
1万口当たり基準価額(C/D)	10,710円	10,505円	10,515円	10,517円	10,548円	10,814円

(注) 第28期首元本額は1,164,727,048円、第28～33期中追加設定元本額は2,859,684円、第28～33期中一部解約元本額は132,747,220円、1口当たり純資産額は、第28期1.0710円、第29期1.0505円、第30期1.0515円、第31期1.0517円、第32期1.0548円、第33期1.0814円です。

## ○損益の状況

項 目	第28期	第29期	第30期	第31期	第32期	第33期
	2016年6月23日～ 2016年7月22日	2016年7月23日～ 2016年8月22日	2016年8月23日～ 2016年9月23日	2016年9月24日～ 2016年10月24日	2016年10月25日～ 2016年11月22日	2016年11月23日～ 2016年12月22日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 135	△ 148	△ 141	△ 126	△ 98	△ 126
支払利息	△ 135	△ 148	△ 141	△ 126	△ 98	△ 126
(B) 有価証券売買損益	20,566,463	△ 21,441,159	3,000,409	2,106,680	5,101,274	29,272,280
売買益	20,732,012	96,659	5,867,528	4,482,671	14,052,442	32,258,027
売買損	△ 165,549	△ 21,537,818	△ 2,867,119	△ 2,375,991	△ 8,951,168	△ 2,985,747
(C) 信託報酬等	△ 840,541	△ 860,044	△ 872,135	△ 828,715	△ 759,611	△ 780,641
(D) 当期損益金(A+B+C)	19,725,787	△ 22,301,351	2,128,133	1,277,839	4,341,565	28,491,513
(E) 前期繰越損益金	107,717,196	124,885,889	100,097,429	98,791,888	97,197,661	96,416,542
(F) 追加信託差損益金	△ 44,369,922	△ 43,829,930	△ 43,203,050	△ 42,157,762	△ 41,351,852	△ 39,611,088
(配当等相当額)	( 26,491,443)	( 26,258,592)	( 25,973,024)	( 25,431,897)	( 25,032,338)	( 24,066,007)
(売買損益相当額)	(△ 70,861,365)	(△ 70,088,522)	(△ 69,176,074)	(△ 67,589,659)	(△ 66,384,190)	(△ 63,677,095)
(G) 計(D+E+F)	83,073,061	58,754,608	59,022,512	57,911,965	60,187,374	85,296,967
(H) 収益分配金	△ 1,153,116	△ 1,140,366	△ 1,125,181	△ 1,099,053	△ 1,079,128	△ 1,034,839
次期繰越損益金(G+H)	81,919,945	57,614,242	57,897,331	56,812,912	59,108,246	84,262,128
追加信託差損益金	△ 44,369,922	△ 43,829,930	△ 43,203,050	△ 42,157,762	△ 41,351,852	△ 39,611,088
(配当等相当額)	( 26,492,147)	( 26,259,022)	( 25,973,632)	( 25,432,775)	( 25,032,773)	( 24,066,515)
(売買損益相当額)	(△ 70,862,069)	(△ 70,088,952)	(△ 69,176,682)	(△ 67,590,537)	(△ 66,384,625)	(△ 63,677,603)
分配準備積立金	151,700,574	149,333,005	147,479,941	144,384,818	141,714,619	136,225,660
繰越損益金	△ 25,410,707	△ 47,888,833	△ 46,379,560	△ 45,414,144	△ 41,254,521	△ 12,352,444

\* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は各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(2016年6月23日～2016年12月22日)は以下の通りです。

項 目	第28期	第29期	第30期	第31期	第32期	第33期
	2016年6月23日～ 2016年7月22日	2016年7月23日～ 2016年8月22日	2016年8月23日～ 2016年9月23日	2016年9月24日～ 2016年10月24日	2016年10月25日～ 2016年11月22日	2016年11月23日～ 2016年12月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,917,248円	467,684円	1,276,982円	1,408,690円	1,024,364円	1,300,221円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金繰戻後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	26,492,147円	26,259,022円	25,973,632円	25,432,775円	25,032,773円	24,066,515円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	150,936,442円	150,005,687円	147,328,140円	144,075,181円	141,769,383円	135,960,278円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	179,345,837円	176,732,393円	174,578,754円	170,916,646円	167,826,520円	161,327,014円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,555円	1,549円	1,551円	1,555円	1,555円	1,558円
g. 分配金	1,153,116円	1,140,366円	1,125,181円	1,099,053円	1,079,128円	1,034,839円
h. 分配金(1万口当たり)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

## ○分配金のお知らせ

	第28期	第29期	第30期	第31期	第32期	第33期
1 万口当たり分配金 (税込み)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	48	0.466	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(18)	(0.179)	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 ）	(27)	(0.260)	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 ）	( 3 )	(0.027)	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	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	( 0 )	(0.001)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 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 )	(0.001)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.010	(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 )	(0.006)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0 )	(0.002)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	49	0.479	
期中の平均基準価額は、10,312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

(2016年6月23日～2016年12月22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	2,343	2,947	18,932	24,513
外国債券マザーファンド	2,153	4,456	3,827	8,094
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,567	3,014	7,271	14,686
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	32,257	42,796	16,096	21,188
J-REITインデックスマザーファンド	1,725	3,375	1,534	3,002
海外REITインデックスマザーファンド	3,058	6,029	3,134	6,478
新興国株式マザーファンド	1,328	1,237	10,438	9,731
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	731	863	6,001	6,947

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2016年6月23日～2016年12月22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	新興国株式 マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33,709,014千円	24,802,758千円	2,111,837千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	283,388,922千円	300,070,775千円	14,886,456千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	0.08	0.14

\* (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

(2016年6月23日～2016年12月22日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村資産設計ファンド2020&gt;

該当事項はございません。

## &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 18,228	百万円 8	% 0.0	百万円 15,480	百万円 29	% 0.2
貸株	87,600	3,346	3.8	91,075	3,373	3.7

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。

\*貸株の買付額等は貸付、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 16,261	百万円 142	% 0.9	百万円 23,456	百万円 1,259	% 5.4

平均保有割合 0.0%

## &lt;新興国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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,488	百万円 1,039	% 29.8	百万円 1,836	百万円 726	% 39.5

平均保有割合 0.3%

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド&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 60,067	百万円 386	% 0.6	百万円 37,090	百万円 301	% 0.8

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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 34,126	百万円 956	% 2.8	百万円 28,565	百万円 1,675	% 5.9

平均保有割合 0.0%

## &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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 2,076	百万円 215	% 10.4	百万円 1,224	百万円 215	% 17.6

平均保有割合 0.6%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 5,153	百万円 513	% 10.0	百万円 2,578	百万円 170	% 6.6

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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 1,515	百万円 30	% 2.0	百万円 1,964	百万円 74	% 3.8

平均保有割合 0.3%

## 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
	百万円	百万円	百万円
株式	156	44	2,069

## 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)	15千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.002千円
(B) / (A)	0.0%

\* 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証券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年12月22日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式マザーファンド	105,902	89,313	129,888
外国債券マザーファンド	49,895	48,221	106,844
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	40,762	35,058	79,841
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	307,145	323,306	421,495
J-REITインデックスマザーファンド	22,316	22,506	44,450
海外REITインデックスマザーファンド	21,731	21,655	46,827
新興国株式マザーファンド	59,008	49,897	51,329
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	22,395	17,124	21,567

\* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

(2016年12月22日現在)

## ○投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式マザーファンド	129,888	14.3
外国債券マザーファンド	106,844	11.7
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	79,841	8.8
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	421,495	46.3
J-REITインデックス マザーファンド	44,450	4.9
海外REITインデックス マザーファンド	46,827	5.1
新興国株式マザーファンド	51,329	5.6
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	21,567	2.4
コール・ローン等、その他	7,624	0.9
投資信託財産総額	909,865	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（669,955,104千円）の投資信託財産総額（670,758,177千円）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（358,958,844千円）の投資信託財産総額（359,590,036千円）に対する比率は99.8%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（18,507,617千円）の投資信託財産総額（18,553,427千円）に対する比率は99.8%です。

\*新興国株式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（17,630,982千円）の投資信託財産総額（17,681,087千円）に対する比率は99.7%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（4,020,044千円）の投資信託財産総額（4,030,530千円）に対する比率は99.7%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カタールリヤル=32.39円、1米ドル=117.72円、1カナダドル=87.60円、1英ポンド=145.61円、1スイスフラン=114.70円、1スウェーデンクローナ=12.77円、1ノルウェークローネ=13.56円、1デンマーククローネ=16.51円、1トルコリラ=33.57円、1ユーロ=122.76円、1チェココルナ=4.55円、1フォリント=0.3956円、1ズロチ=27.82円、1ルーブル=1.93円、1レイ=27.20円、1香港ドル=15.17円、1シンガポールドル=81.48円、1リンギ=26.29円、1バーツ=3.27円、1フィリピンペソ=2.36円、1ルピア=0.0088円、1ウォン=0.0986円、1新台幣ドル=3.68円、1豪ドル=85.25円、1ニュージーランドドル=81.32円、1インドルピー=1.75円、1新シケル=30.77円、1メキシコペソ=5.73円、1レアル=35.31円、1チリペソ=0.1747円、1コロンビアペソ=0.0393円、1ヌエボソル=34.69円、1UAEディルハム=32.11円、1エジプトポンド=6.12円、1ランド=8.43円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	909,865,881
コール・ローン等	5,376,876
国内株式マザーファンド(評価額)	129,888,967
外国債券マザーファンド(評価額)	106,844,169
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	79,841,610
国内債券NOMURA-BPTI総合マザーファンド(評価額)	421,495,161
J-REITインデックスマザーファンド(評価額)	44,450,997
海外REITインデックスマザーファンド(評価額)	46,827,740
新興国株式マザーファンド(評価額)	51,329,546
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額)	21,567,114
未収入金	2,243,701
(B) 負債	6,689,161
未払収益分配金	420,787
未払解約金	2,138,523
未払信託報酬	4,115,549
未払利息	4
その他未払費用	14,298
(C) 純資産総額(A-B)	903,176,720
元本	841,574,878
次期繰越損益金	61,601,842
(D) 受益権総口数	841,574,878口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,732円

(注) 期首元本額は865,951,162円、期中追加設定元本額は30,499,022円、期中一部解約元本額は54,875,306円、1口当たり純資産額は1.0732円です。

## ○損益の状況 (2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 667
支払利息	△ 667
(B) 有価証券売買損益	46,948,816
売買益	58,350,679
売買損	△ 11,401,863
(C) 信託報酬等	△ 4,129,847
(D) 当期損益金(A+B+C)	42,818,302
(E) 前期繰越損益金	82,488,856
(F) 追加信託差損益金	△ 63,284,529
(配当等相当額)	( 51,456,511)
(売買損益相当額)	(△114,741,040)
(G) 計(D+E+F)	62,022,629
(H) 収益分配金	△ 420,787
次期繰越損益金(G+H)	61,601,842
追加信託差損益金	△ 63,284,529
(配当等相当額)	( 51,494,796)
(売買損益相当額)	(△114,779,325)
分配準備積立金	149,491,236
繰越損益金	△ 24,604,865

\* 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(2016年6月23日～2016年12月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	7,466,662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	51,494,796円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	142,445,361円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	201,406,819円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,393円
g. 分配金	420,787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
------------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	48	0.466	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(18)	(0.179)	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 ）	(27)	(0.260)	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 ）	( 3 )	(0.027)	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	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	( 0 )	(0.001)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 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 )	(0.001)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.012	(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 )	(0.007)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0 )	(0.002)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	49	0.481	
期中の平均基準価額は、10,265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

(2016年6月23日～2016年12月22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	7,128	8,835	23,471	30,113
外国債券マザーファンド	6,242	13,011	3,625	7,662
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	3,608	6,971	8,462	17,019
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	33,773	44,754	18,780	24,935
J-REITインデックスマザーファンド	2,718	5,338	2,064	4,063
海外REITインデックスマザーファンド	3,433	6,815	3,049	6,274
新興国株式マザーファンド	4,517	4,195	14,625	13,413
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	1,794	2,105	4,975	5,767

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2016年6月23日～2016年12月22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	新興国株式 マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33,709,014千円	24,802,758千円	2,111,837千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	283,388,922千円	300,070,775千円	14,886,456千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	0.08	0.14

\* (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

(2016年6月23日～2016年12月22日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;野村資産設計ファンド2025&gt;

該当事項はございません。

## &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 18,228	百万円 8	% 0.0	百万円 15,480	百万円 29	% 0.2
貸株	87,600	3,346	3.8	91,075	3,373	3.7

平均保有割合 0.1%

※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。

\*貸株の買付額等は貸付、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 16,261	百万円 142	% 0.9	百万円 23,456	百万円 1,259	% 5.4

平均保有割合 0.0%

## &lt;新興国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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,488	百万円 1,039	% 29.8	百万円 1,836	百万円 726	% 39.5

平均保有割合 0.4%

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド&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 60,067	百万円 386	% 0.6	百万円 37,090	百万円 301	% 0.8

平均保有割合 0.0%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 34,126	百万円 956	% 2.8	百万円 28,565	百万円 1,675	% 5.9

平均保有割合 0.0%

## &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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 2,076	百万円 215	% 10.4	百万円 1,224	百万円 215	% 17.6

平均保有割合 0.6%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 5,153	百万円 513	% 10.0	百万円 2,578	百万円 170	% 6.6

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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 1,515	百万円 30	% 2.0	百万円 1,964	百万円 74	% 3.8

平均保有割合 0.2%

## 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 156	百万円 44	百万円 2,069

## 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)	18千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.003千円
(B) / (A)	0.0%

\*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証券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年12月22日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式マザーファンド	133,418	117,075	170,263
外国債券マザーファンド	47,144	49,760	110,254
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	51,212	46,358	105,577
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	225,719	240,712	313,816
J-REITインデックスマザーファンド	21,085	21,738	42,934
海外REITインデックスマザーファンド	20,533	20,916	45,229
新興国株式マザーファンド	74,654	64,546	66,399
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	21,160	17,979	22,642

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

(2016年12月22日現在)

## ○投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式マザーファンド	170,263	19.1
外国債券マザーファンド	110,254	12.4
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	105,577	11.9
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	313,816	35.2
J-REITインデックス マザーファンド	42,934	4.8
海外REITインデックス マザーファンド	45,229	5.1
新興国株式マザーファンド	66,399	7.5
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	22,642	2.5
コール・ローン等、その他	13,467	1.5
投資信託財産総額	890,581	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（669,955,104千円）の投資信託財産総額（670,758,177千円）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（358,958,844千円）の投資信託財産総額（359,590,036千円）に対する比率は99.8%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（18,507,617千円）の投資信託財産総額（18,553,427千円）に対する比率は99.8%です。

\*新興国株式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（17,630,982千円）の投資信託財産総額（17,681,087千円）に対する比率は99.7%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（4,020,044千円）の投資信託財産総額（4,030,530千円）に対する比率は99.7%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カタールリヤル=32.39円、1米ドル=117.72円、1カナダドル=87.60円、1英ポンド=145.61円、1スイスフラン=114.70円、1スウェーデンクローナ=12.77円、1ノルウェークローネ=13.56円、1デンマーククローネ=16.51円、1トルコリラ=33.57円、1ユーロ=122.76円、1チェココルナ=4.55円、1フォロント=0.3956円、1ズロチ=27.82円、1ルーブル=1.93円、1レイ=27.20円、1香港ドル=15.17円、1シンガポールドル=81.48円、1リンギ=26.29円、1バーツ=3.27円、1フィリピンペソ=2.36円、1ルピア=0.0088円、1ウォン=0.0986円、1新台湾ドル=3.68円、1豪ドル=85.25円、1ニュージーランドドル=81.32円、1インドルピー=1.75円、1新シケル=30.77円、1メキシコペソ=5.73円、1レアル=35.31円、1チリペソ=0.1747円、1コロンビアペソ=0.0393円、1ヌエボソル=34.69円、1UAEディルハム=32.11円、1エジプトポンド=6.12円、1ランド=8.43円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	890,581,498
コール・ローン等	5,190,221
国内株式マザーファンド(評価額)	170,263,020
外国債券マザーファンド(評価額)	110,254,891
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	105,577,276
国内債券NOMURA-BPT総合マザーファンド(評価額)	313,816,728
J-REITインデックスマザーファンド(評価額)	42,934,276
海外REITインデックスマザーファンド(評価額)	45,229,919
新興国株式マザーファンド(評価額)	66,399,191
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額)	22,642,797
未収入金	8,273,179
(B) 負債	12,542,413
未払収益分配金	404,365
未払解約金	8,217,680
未払信託報酬	3,906,802
未払利息	4
その他未払費用	13,562
(C) 純資産総額(A-B)	878,039,085
元本	808,730,428
次期繰越損益金	69,308,657
(D) 受益権総口数	808,730,428口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,857円

(注) 期首元本額は821,348,419円、期中追加設定元本額は53,755,751円、期中一部解約元本額は66,373,742円、1口当たり純資産額は1.0857円です。

## ○損益の状況 (2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 636
支払利息	△ 636
(B) 有価証券売買損益	63,172,842
売買益	72,600,666
売買損	△ 9,427,824
(C) 信託報酬等	△ 3,920,364
(D) 当期損益金(A+B+C)	59,251,842
(E) 前期繰越損益金	65,775,805
(F) 追加信託差損益金	△ 55,314,625
(配当等相当額)	( 52,065,473)
(売買損益相当額)	(△107,380,098)
(G) 計(D+E+F)	69,713,022
(H) 収益分配金	△ 404,365
次期繰越損益金(G+H)	69,308,657
追加信託差損益金	△ 55,314,625
(配当等相当額)	( 52,147,555)
(売買損益相当額)	(△107,462,180)
分配準備積立金	154,162,743
繰越損益金	△ 29,539,461

\* 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(2016年6月23日～2016年12月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	7,877,419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	52,147,555円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	146,689,689円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	206,714,663円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,556円
g. 分配金	404,365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
------------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	48	0.466	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(18)	(0.179)	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 ）	(27)	(0.260)	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 ）	( 3 )	(0.027)	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	0.003	(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 )	(0.001)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.001)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	( 0 )	(0.001)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.013	(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 )	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0 )	(0.004)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	49	0.483	
期中の平均基準価額は、10,303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

(2016年6月23日～2016年12月22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	7,934	9,566	20,185	26,285
外国債券マザーファンド	4,814	10,001	2,697	5,686
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	3,945	7,447	7,291	14,876
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	22,290	29,579	10,497	13,834
J-REITインデックスマザーファンド	3,186	6,262	4,216	8,311
海外REITインデックスマザーファンド	3,691	7,270	4,987	10,134
新興国株式マザーファンド	3,687	3,450	11,454	10,759
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	1,446	1,693	4,125	4,785

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2016年6月23日～2016年12月22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	新興国株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33,709,014千円	24,802,758千円	2,111,837千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	283,388,922千円	300,070,775千円	14,886,456千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	0.08	0.14

\*(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

(2016年6月23日～2016年12月22日)

## 利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2030＞  
該当事項はございません。

## &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 18,228	百万円 8	% 0.0	百万円 15,480	百万円 29	% 0.2
貸株	87,600	3,346	3.8	91,075	3,373	3.7

平均保有割合 0.1%

※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。

\*貸株の買付額等は貸付、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 16,261	百万円 142	% 0.9	百万円 23,456	百万円 1,259	% 5.4

平均保有割合 0.0%

## &lt;新興国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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,488	百万円 1,039	% 29.8	百万円 1,836	百万円 726	% 39.5

平均保有割合 0.4%

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド&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 60,067	百万円 386	% 0.6	百万円 37,090	百万円 301	% 0.8

平均保有割合 0.0%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 34,126	百万円 956	% 2.8	百万円 28,565	百万円 1,675	% 5.9

平均保有割合 0.0%

## &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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 2,076	百万円 215	% 10.4	百万円 1,224	百万円 215	% 17.6

平均保有割合 0.5%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 5,153	百万円 513	% 10.0	百万円 2,578	百万円 170	% 6.6

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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 1,515	百万円 30	% 2.0	百万円 1,964	百万円 74	% 3.8

平均保有割合 0.3%

## 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
	百万円	百万円	百万円
株式	156	44	2,069

## 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)	18千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.003千円
(B) / (A)	0.0%

\*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証券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年12月22日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式マザーファンド	124,861	112,610	163,769
外国債券マザーファンド	39,218	41,335	91,587
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	47,883	44,537	101,430
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	134,122	145,915	190,230
J-REITインデックスマザーファンド	26,311	25,281	49,931
海外REITインデックスマザーファンド	25,621	24,325	52,601
新興国株式マザーファンド	69,964	62,198	63,983
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	17,603	14,924	18,795

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式マザーファンド	163,769	22.1
外国債券マザーファンド	91,587	12.4
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	101,430	13.7
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	190,230	25.7
J-REITインデックス マザーファンド	49,931	6.8
海外REITインデックス マザーファンド	52,601	7.1
新興国株式マザーファンド	63,983	8.7
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	18,795	2.5
コール・ローン等、その他	7,234	1.0
投資信託財産総額	739,560	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（669,955,104千円）の投資信託財産総額（670,758,177千円）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（358,958,844千円）の投資信託財産総額（359,590,036千円）に対する比率は99.8%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（18,507,617千円）の投資信託財産総額（18,553,427千円）に対する比率は99.8%です。

\*新興国株式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（17,630,982千円）の投資信託財産総額（17,681,087千円）に対する比率は99.7%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（4,020,044千円）の投資信託財産総額（4,030,530千円）に対する比率は99.7%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カタールリヤル=32.39円、1米ドル=117.72円、1カナダドル=87.60円、1英ポンド=145.61円、1スイスフラン=114.70円、1スウェーデンクローナ=12.77円、1ノルウェークローネ=13.56円、1デンマーククローネ=16.51円、1トルコリラ=33.57円、1ユーロ=122.76円、1チェココルナ=4.55円、1フォリント=0.3956円、1ズロチ=27.82円、1ルーブル=1.93円、1レイ=27.20円、1香港ドル=15.17円、1シンガポールドル=81.48円、1リンギ=26.29円、1バーツ=3.27円、1フィリピンペソ=2.36円、1ルピア=0.0088円、1ウォン=0.0986円、1新台湾ドル=3.68円、1豪ドル=85.25円、1ニュージーランドドル=81.32円、1インドルピー=1.75円、1新シェケル=30.77円、1メキシコペソ=5.73円、1レアル=35.31円、1チリペソ=0.1747円、1コロンビアペソ=0.0393円、1ヌエボソル=34.69円、1UAEディルハム=32.11円、1エジプトポンド=6.12円、1ランド=8.43円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	739,560,369
コール・ローン等	4,385,967
国内株式マザーファンド(評価額)	163,769,973
外国債券マザーファンド(評価額)	91,587,898
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	101,430,661
国内債券NOMURA-BPTI総合マザーファンド(評価額)	190,230,235
J-REITインデックスマザーファンド(評価額)	49,931,578
海外REITインデックスマザーファンド(評価額)	52,601,569
新興国株式マザーファンド(評価額)	63,983,140
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額)	18,795,903
未収入金	2,843,445
(B) 負債	6,477,083
未払収益分配金	332,627
未払解約金	2,857,245
未払信託報酬	3,275,840
未払利息	3
その他未払費用	11,368
(C) 純資産総額(A-B)	733,083,286
元本	665,255,620
次期繰越損益金	67,827,666
(D) 受益権総口数	665,255,620口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,020円

(注) 期首元本額は679,809,120円、期中追加設定元本額は32,037,161円、期中一部解約元本額は46,590,661円、1口当たり純資産額は1.1020円です。

## ○損益の状況 (2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 487
支払利息	△ 487
(B) 有価証券売買損益	63,160,649
売買益	69,720,602
売買損	△ 6,559,953
(C) 信託報酬等	△ 3,287,208
(D) 当期損益金(A+B+C)	59,872,954
(E) 前期繰越損益金	69,171,377
(F) 追加信託差損益金	△ 60,884,038
(配当等相当額)	( 51,252,516)
(売買損益相当額)	(△112,136,554)
(G) 計(D+E+F)	68,160,293
(H) 収益分配金	△ 332,627
次期繰越損益金(G+H)	67,827,666
追加信託差損益金	△ 60,884,038
(配当等相当額)	( 51,295,738)
(売買損益相当額)	(△112,179,776)
分配準備積立金	158,304,990
繰越損益金	△ 29,593,286

\* 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(2016年6月23日～2016年12月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	7,145,555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	51,295,738円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	151,492,062円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	209,933,355円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,155円
g. 分配金	332,627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
------------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	47	0.466	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(18)	(0.179)	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 ）	(26)	(0.260)	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 ）	( 3 )	(0.027)	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	0.003	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	( 0 )	(0.002)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.001)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	( 0 )	(0.001)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 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 )	(0.009)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0 )	(0.004)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	48	0.484	
期中の平均基準価額は、10,038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

(2016年6月23日～2016年12月22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	5,607	6,766	13,008	17,043
外国債券マザーファンド	3,230	6,715	1,356	2,902
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,518	4,753	4,575	9,461
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	10,928	14,471	5,533	7,320
J-REITインデックスマザーファンド	2,334	4,598	1,511	2,968
海外REITインデックスマザーファンド	2,603	5,133	2,014	4,147
新興国株式マザーファンド	2,587	2,445	6,894	6,520
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	1,014	1,188	2,611	3,032

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2016年6月23日～2016年12月22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	新興国株式 マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33,709,014千円	24,802,758千円	2,111,837千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	283,388,922千円	300,070,775千円	14,886,456千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	0.08	0.14

\*(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

(2016年6月23日～2016年12月22日)

## 利害関係人との取引状況

<野村資産設計ファンド2035>  
該当事項はございません。

## &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 18,228	百万円 8	% 0.0	百万円 15,480	百万円 29	% 0.2
貸株	87,600	3,346	3.8	91,075	3,373	3.7

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。

\*貸株の買付額等は貸付、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 16,261	百万円 142	% 0.9	百万円 23,456	百万円 1,259	% 5.4

平均保有割合 0.0%

## &lt;新興国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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,488	百万円 1,039	% 29.8	百万円 1,836	百万円 726	% 39.5

平均保有割合 0.3%

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド&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 60,067	百万円 386	% 0.6	百万円 37,090	百万円 301	% 0.8

平均保有割合 0.0%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 34,126	百万円 956	% 2.8	百万円 28,565	百万円 1,675	% 5.9

平均保有割合 0.0%

## &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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 2,076	百万円 215	% 10.4	百万円 1,224	百万円 215	% 17.6

平均保有割合 0.4%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 5,153	百万円 513	% 10.0	百万円 2,578	百万円 170	% 6.6

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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 1,515	百万円 30	% 2.0	百万円 1,964	百万円 74	% 3.8

平均保有割合 0.2%

## 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 156	百万円 44	百万円 2,069

## 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)	13千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.002千円
(B) / (A)	0.0%

\*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証券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年12月22日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式マザーファンド	91,910	84,509	122,901
外国債券マザーファンド	25,981	27,855	61,719
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	35,454	33,397	76,060
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	71,083	76,478	99,705
J-REITインデックスマザーファンド	17,430	18,253	36,051
海外REITインデックスマザーファンド	16,974	17,563	37,978
新興国株式マザーファンド	51,038	46,731	48,072
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	11,661	10,064	12,675

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式マザーファンド	122,901	24.4
外国債券マザーファンド	61,719	12.3
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	76,060	15.1
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	99,705	19.8
J-REITインデックス マザーファンド	36,051	7.2
海外REITインデックス マザーファンド	37,978	7.5
新興国株式マザーファンド	48,072	9.5
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	12,675	2.5
コール・ローン等、その他	8,598	1.7
投資信託財産総額	503,759	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（669,955,104千円）の投資信託財産総額（670,758,177千円）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（358,958,844千円）の投資信託財産総額（359,590,036千円）に対する比率は99.8%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（18,507,617千円）の投資信託財産総額（18,553,427千円）に対する比率は99.8%です。

\*新興国株式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（17,630,982千円）の投資信託財産総額（17,681,087千円）に対する比率は99.7%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（4,020,044千円）の投資信託財産総額（4,030,530千円）に対する比率は99.7%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カタールリヤル=32.39円、1米ドル=117.72円、1カナダドル=87.60円、1英ポンド=145.61円、1スイスフラン=114.70円、1スウェーデンクローナ=12.77円、1ノルウェークローネ=13.56円、1デンマーククローネ=16.51円、1トルコリラ=33.57円、1ユーロ=122.76円、1チェココルナ=4.55円、1フォロント=0.3956円、1ズロチ=27.82円、1ルーブル=1.93円、1レイ=27.20円、1香港ドル=15.17円、1シンガポールドル=81.48円、1リンギ=26.29円、1バーツ=3.27円、1フィリピンペソ=2.36円、1ルピア=0.0088円、1ウォン=0.0986円、1新台湾ドル=3.68円、1豪ドル=85.25円、1ニュージーランドドル=81.32円、1インドルピー=1.75円、1新シケル=30.77円、1メキシコペソ=5.73円、1レアール=35.31円、1チリペソ=0.1747円、1コロンビアペソ=0.0393円、1ヌエボソル=34.69円、1UAEディルハム=32.11円、1エジプトポンド=6.12円、1ランド=8.43円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	503,759,846
コール・ローン等	2,905,938
国内株式マザーファンド(評価額)	122,901,579
外国債券マザーファンド(評価額)	61,719,477
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	76,060,452
国内債券NOMURA-BPTI総合マザーファンド(評価額)	99,705,231
J-REITインデックスマザーファンド(評価額)	36,051,219
海外REITインデックスマザーファンド(評価額)	37,978,834
新興国株式マザーファンド(評価額)	48,072,662
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額)	12,675,128
未収入金	5,689,326
(B) 負債	8,081,399
未払収益分配金	228,979
未払解約金	5,657,840
未払信託報酬	2,187,011
未払利息	2
その他未払費用	7,567
(C) 純資産総額(A-B)	495,678,447
元本	457,959,045
次期繰越損益金	37,719,402
(D) 受益権総口数	457,959,045口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,824円

(注) 期首元本額は461,979,262円、期中追加設定元本額は20,465,186円、期中一部解約元本額は24,485,403円、1口当たり純資産額は1.0824円です。

## ○損益の状況 (2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 297
支払利息	△ 297
(B) 有価証券売買損益	47,562,628
売買益	51,510,416
売買損	△ 3,947,788
(C) 信託報酬等	△ 2,194,578
(D) 当期損益金(A+B+C)	45,367,753
(E) 前期繰越損益金	44,192,731
(F) 追加信託差損益金	△ 51,612,103
(配当等相当額)	( 40,353,906)
(売買損益相当額)	(△ 91,966,009)
(G) 計(D+E+F)	37,948,381
(H) 収益分配金	△ 228,979
次期繰越損益金(G+H)	37,719,402
追加信託差損益金	△ 51,612,103
(配当等相当額)	( 40,389,643)
(売買損益相当額)	(△ 92,001,746)
分配準備積立金	110,006,887
繰越損益金	△ 20,675,382

\* 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(2016年6月23日～2016年12月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	4,991,750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	40,389,643円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	105,244,116円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	150,625,509円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,289円
g. 分配金	228,979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
------------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	46	0.466	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(17)	(0.179)	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 ）	(25)	(0.260)	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 ）	( 3 )	(0.027)	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	0.003	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	( 0 )	(0.002)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.001)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	( 0 )	(0.001)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	2	0.016	(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 )	(0.010)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0 )	(0.004)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	48	0.487	
期中の平均基準価額は、9,781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

(2016年6月23日～2016年12月22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	5,260	6,459	42,432	55,374
外国債券マザーファンド	7,307	15,192	4,492	9,535
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	3,553	6,757	15,194	31,206
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	20,967	27,756	12,190	16,118
J-REITインデックス マザーファンド	6,192	12,218	2,430	4,741
海外REITインデックス マザーファンド	7,098	14,033	3,854	7,948
新興国株式マザーファンド	5,251	4,981	26,862	24,983
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	2,232	2,624	7,568	8,773

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2016年6月23日～2016年12月22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	新興国株式 マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33,709,014千円	24,802,758千円	2,111,837千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	283,388,922千円	300,070,775千円	14,886,456千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	0.08	0.14

\*(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

(2016年6月23日～2016年12月22日)

## 利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2040＞  
該当事項はございません。

## &lt;国内株式マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	18,228	8	0.0	15,480	29	0.2
貸株	87,600	3,346	3.8	91,075	3,373	3.7

平均保有割合 0.1%

※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。

\*貸株の買付額等は貸付、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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	16,261	142	0.9	23,456	1,259	5.4

平均保有割合 0.1%

## &lt;新興国株式マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	3,488	1,039	29.8	1,836	726	39.5

平均保有割合 1.0%

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	60,067	386	0.6	37,090	301	0.8

平均保有割合 0.0%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 34,126	百万円 956	% 2.8	百万円 28,565	百万円 1,675	% 5.9

平均保有割合 0.0%

## &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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 2,076	百万円 215	% 10.4	百万円 1,224	百万円 215	% 17.6

平均保有割合 1.0%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 5,153	百万円 513	% 10.0	百万円 2,578	百万円 170	% 6.6

平均保有割合 0.3%

## &lt;海外REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 1,515	百万円 30	% 2.0	百万円 1,964	百万円 74	% 3.8

平均保有割合 0.4%

## 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
	百万円	百万円	百万円
株式	156	44	2,069

## 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)	39千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.008千円
(B) / (A)	0.0%

\* 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証券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年12月22日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式マザーファンド	306,976	269,804	392,377
外国債券マザーファンド	72,315	75,130	166,467
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	118,156	106,515	242,577
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	148,385	157,163	204,893
J-REITインデックスマザーファンド	32,343	36,104	71,307
海外REITインデックスマザーファンド	31,495	34,739	75,120
新興国株式マザーファンド	171,045	149,434	153,722
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	32,458	27,122	34,158

\* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式マザーファンド	392,377	29.0
外国債券マザーファンド	166,467	12.3
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	242,577	17.9
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	204,893	15.1
J-REITインデックス マザーファンド	71,307	5.3
海外REITインデックス マザーファンド	75,120	5.6
新興国株式マザーファンド	153,722	11.4
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	34,158	2.5
コール・ローン等、その他	12,832	0.9
投資信託財産総額	1,353,453	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（669,955,104千円）の投資信託財産総額（670,758,177千円）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（358,958,844千円）の投資信託財産総額（359,590,036千円）に対する比率は99.8%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（18,507,617千円）の投資信託財産総額（18,553,427千円）に対する比率は99.8%です。

\*新興国株式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（17,630,982千円）の投資信託財産総額（17,681,087千円）に対する比率は99.7%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（4,020,044千円）の投資信託財産総額（4,030,530千円）に対する比率は99.7%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カタールリヤル=32.39円、1米ドル=117.72円、1カナダドル=87.60円、1英ポンド=145.61円、1スイスフラン=114.70円、1スウェーデンクローナ=12.77円、1ノルウェークローネ=13.56円、1デンマーククローネ=16.51円、1トルコリラ=33.57円、1ユーロ=122.76円、1チェココルナ=4.55円、1フォロント=0.3956円、1ズロチ=27.82円、1ルーブル=1.93円、1レイ=27.20円、1香港ドル=15.17円、1シンガポールドル=81.48円、1リンギ=26.29円、1バーツ=3.27円、1フィリピンペソ=2.36円、1ルピア=0.0088円、1ウォン=0.0986円、1新台湾ドル=3.68円、1豪ドル=85.25円、1ニュージーランドドル=81.32円、1インドルピー=1.75円、1新シェケル=30.77円、1メキシコペソ=5.73円、1レアル=35.31円、1チリペソ=0.1747円、1コロンビアペソ=0.0393円、1ヌエボソル=34.69円、1UAEディルハム=32.11円、1エジプトポンド=6.12円、1ランド=8.43円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,353,453,878
コール・ローン等	7,989,145
国内株式マザーファンド(評価額)	392,377,404
外国債券マザーファンド(評価額)	166,467,703
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	242,577,340
国内債券NOMURA-BPTI総合マザーファンド(評価額)	204,893,632
J-REITインデックスマザーファンド(評価額)	71,307,199
海外REITインデックスマザーファンド(評価額)	75,120,385
新興国株式マザーファンド(評価額)	153,722,770
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額)	34,158,018
未収入金	4,840,282
(B) 負債	11,452,262
未払収益分配金	628,916
未払解約金	4,863,225
未払信託報酬	5,939,456
未払利息	7
その他未払費用	20,658
(C) 純資産総額(A-B)	1,342,001,616
元本	1,257,832,564
次期繰越損益金	84,169,052
(D) 受益権総口数	1,257,832,564口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,669円

(注) 期首元本額は1,318,949,655円、期中追加設定元本額は30,127,316円、期中一部解約元本額は91,244,407円、1口当たり純資産額は1,0669円です。

## ○損益の状況 (2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 989
支払利息	△ 989
(B) 有価証券売買損益	147,971,330
売買益	158,447,849
売買損	△ 10,476,519
(C) 信託報酬等	△ 5,960,114
(D) 当期損益金(A+B+C)	142,010,227
(E) 前期繰越損益金	80,110,467
(F) 追加信託差損益金	△ 137,322,726
(配当等相当額)	( 60,912,844)
(売買損益相当額)	(△ 198,235,570)
(G) 計(D+E+F)	84,797,968
(H) 収益分配金	△ 628,916
次期繰越損益金(G+H)	84,169,052
追加信託差損益金	△ 137,322,726
(配当等相当額)	( 60,955,714)
(売買損益相当額)	(△ 198,278,440)
分配準備積立金	299,535,123
繰越損益金	△ 78,043,345

\* 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(2016年6月23日～2016年12月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	13,459,234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	60,955,714円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	286,704,805円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	361,119,753円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,870円
g. 分配金	628,916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
----------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	80	0.466	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(31)	(0.179)	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 ）	(45)	(0.260)	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 ）	( 5)	(0.027)	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	1	0.003	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	( 0)	(0.002)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0)	(0.001)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 株 式 ）	( 0)	(0.001)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	3	0.016	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 2)	(0.010)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	( 0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 1)	(0.004)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	84	0.487	
期中の平均基準価額は、17,136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

(2016年6月23日～2016年12月22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	6,260	8,215	8,841	11,315
外国債券マザーファンド	1,951	4,125	1,419	2,991
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,662	5,399	3,381	6,789
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	3,768	4,973	3,164	4,195
J-REITインデックス マザーファンド	914	1,796	809	1,596
海外REITインデックス マザーファンド	919	1,862	852	1,743
新興国株式マザーファンド	3,488	3,382	5,026	4,756
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	622	742	845	992

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2016年6月23日～2016年12月22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	新興国株式 マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33,709,014千円	24,802,758千円	2,111,837千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	283,388,922千円	300,070,775千円	14,886,456千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	0.08	0.14

\*(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

(2016年6月23日～2016年12月22日)

## 利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2045＞  
該当事項はございません。

## &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 18,228	百万円 8	% 0.0	百万円 15,480	百万円 29	% 0.2
貸株	87,600	3,346	3.8	91,075	3,373	3.7

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。

\*貸株の買付額等は貸付、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 16,261	百万円 142	% 0.9	百万円 23,456	百万円 1,259	% 5.4

平均保有割合 0.0%

## &lt;新興国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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,488	百万円 1,039	% 29.8	百万円 1,836	百万円 726	% 39.5

平均保有割合 0.1%

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド&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 60,067	百万円 386	% 0.6	百万円 37,090	百万円 301	% 0.8

平均保有割合 0.0%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 34,126	百万円 956	% 2.8	百万円 28,565	百万円 1,675	% 5.9

平均保有割合 0.0%

## &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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 2,076	百万円 215	% 10.4	百万円 1,224	百万円 215	% 17.6

平均保有割合 0.1%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 5,153	百万円 513	% 10.0	百万円 2,578	百万円 170	% 6.6

平均保有割合 0.0%

## &lt;海外REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 1,515	百万円 30	% 2.0	百万円 1,964	百万円 74	% 3.8

平均保有割合 0.0%

## 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 156	百万円 44	百万円 2,069

## 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)	3千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B) / (A)	0.0%

\*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証券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年12月22日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式マザーファンド	29,965	27,384	39,825
外国債券マザーファンド	5,439	5,970	13,229
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	11,524	10,805	24,607
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	11,142	11,745	15,312
J-REITインデックスマザーファンド	2,914	3,019	5,962
海外REITインデックスマザーファンド	2,837	2,904	6,281
新興国株式マザーファンド	16,718	15,179	15,615
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	2,420	2,197	2,767

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式マザーファンド	39,825	32.0
外国債券マザーファンド	13,229	10.6
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	24,607	19.8
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	15,312	12.3
J-REITインデックス マザーファンド	5,962	4.8
海外REITインデックス マザーファンド	6,281	5.1
新興国株式マザーファンド	15,615	12.6
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	2,767	2.2
コール・ローン等、その他	736	0.6
投資信託財産総額	124,334	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（669,955,104千円）の投資信託財産総額（670,758,177千円）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（358,958,844千円）の投資信託財産総額（359,590,036千円）に対する比率は99.8%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（18,507,617千円）の投資信託財産総額（18,553,427千円）に対する比率は99.8%です。

\*新興国株式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（17,630,982千円）の投資信託財産総額（17,681,087千円）に対する比率は99.7%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（4,020,044千円）の投資信託財産総額（4,030,530千円）に対する比率は99.7%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カタールリヤル=32.39円、1米ドル=117.72円、1カナダドル=87.60円、1英ポンド=145.61円、1スイスフラン=114.70円、1スウェーデンクローナ=12.77円、1ノルウェークローネ=13.56円、1デンマーククローネ=16.51円、1トルコリラ=33.57円、1ユーロ=122.76円、1チェココルナ=4.55円、1フォロント=0.3956円、1ズロチ=27.82円、1ルーブル=1.93円、1レイ=27.20円、1香港ドル=15.17円、1シンガポールドル=81.48円、1リンギ=26.29円、1バーツ=3.27円、1フィリピンペソ=2.36円、1ルピア=0.0088円、1ウォン=0.0986円、1新台湾ドル=3.68円、1豪ドル=85.25円、1ニュージーランドドル=81.32円、1インドルピー=1.75円、1新シェケル=30.77円、1メキシコペソ=5.73円、1レアル=35.31円、1チリペソ=0.1747円、1コロンビアペソ=0.0393円、1ヌエボソル=34.69円、1UAEディルハム=32.11円、1エジプトポンド=6.12円、1ランド=8.43円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	124,334,721
コール・ローン等	646,944
国内株式マザーファンド(評価額)	39,825,464
外国債券マザーファンド(評価額)	13,229,782
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	24,607,823
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額)	15,312,914
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	5,962,758
海外REITインデックス マザーファンド(評価額)	6,281,583
新興国株式マザーファンド(評価額)	15,615,373
新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド(評価額)	2,767,136
未収入金	84,944
(B) 負債	613,609
未払収益分配金	32,845
未払解約金	63,716
未払信託報酬	515,307
その他未払費用	1,741
(C) 純資産総額(A-B)	123,721,112
元本	65,691,056
次期繰越損益金	58,030,056
(D) 受益権総口数	65,691,056口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,834円

(注) 期首元本額は67,943,245円、期中追加設定元本額は16,608,757円、期中一部解約元本額は18,860,946円、1口当たり純資産額は1.8834円です。

## ○損益の状況 (2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 28
その他収益金	1
支払利息	△ 29
(B) 有価証券売買損益	13,156,428
売買益	14,902,739
売買損	△ 1,746,311
(C) 信託報酬等	△ 517,048
(D) 当期損益金(A+B+C)	12,639,352
(E) 前期繰越損益金	△ 6,097,431
(F) 追加信託差損益金	51,520,980
(配当等相当額)	( 36,809,803)
(売買損益相当額)	( 14,711,177)
(G) 計(D+E+F)	58,062,901
(H) 収益分配金	△ 32,845
次期繰越損益金(G+H)	58,030,056
追加信託差損益金	51,520,980
(配当等相当額)	( 36,838,004)
(売買損益相当額)	( 14,682,976)
分配準備積立金	8,588,343
繰越損益金	△ 2,079,267

\* 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(2016年6月23日～2016年12月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,196,539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	49,441,713円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	7,424,649円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	58,062,901円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	8,838円
g. 分配金	32,845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
------------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○お知らせ

---

該当事項はございません。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	44	0.466	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(17)	(0.179)	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 ）	(25)	(0.260)	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 ）	( 3 )	(0.027)	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	0.004	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	( 0 )	(0.002)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.001)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	( 0 )	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	(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 )	(0.002)	
（ 新 株 予 約 権 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	( 0 )	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	2	0.017	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	( 1 )	(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
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	( 0 )	(0.005)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	46	0.489	
期中の平均基準価額は、9,490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

(2016年6月23日～2016年12月22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	18,146	24,365	14,682	19,817
外国債券マザーファンド	3,241	6,868	2,129	4,578
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	7,305	15,023	5,754	12,118
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	6,175	8,113	4,238	5,579
J-REITインデックスマザーファンド	1,940	3,785	1,368	2,684
海外REITインデックスマザーファンド	1,905	3,869	1,373	2,854
新興国株式マザーファンド	9,950	9,747	8,101	7,941
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	1,067	1,277	902	1,082

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2016年6月23日～2016年12月22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	新興国株式マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	33,709,014千円	24,802,758千円	2,111,837千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	283,388,922千円	300,070,775千円	14,886,456千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.11	0.08	0.14

\*(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

(2016年6月23日～2016年12月22日)

## 利害関係人との取引状況

<野村資産設計ファンド2050>  
該当事項はございません。

## &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	$\frac{D}{C}$
貸株	87,600	3,346	3.8	91,075	3,373	3.7

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。

\*貸株の買付額等は貸付、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	$\frac{D}{C}$

平均保有割合 0.0%

## &lt;新興国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	$\frac{D}{C}$

平均保有割合 0.1%

## &lt;国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド&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	$\frac{D}{C}$

平均保有割合 0.0%

## &lt;外国債券マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 34,126	百万円 956	% 2.8	百万円 28,565	百万円 1,675	% 5.9

平均保有割合 0.0%

## &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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 2,076	百万円 215	% 10.4	百万円 1,224	百万円 215	% 17.6

平均保有割合 0.0%

## &lt;J-REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 5,153	百万円 513	% 10.0	百万円 2,578	百万円 170	% 6.6

平均保有割合 0.0%

## &lt;海外REITインデックス マザーファンド&gt;

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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 1,515	百万円 30	% 2.0	百万円 1,964	百万円 74	% 3.8

平均保有割合 0.0%

## 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 156	百万円 44	百万円 2,069

## 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)	2千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B) / (A)	0.0%

\*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証券株式会社、野村信託銀行です。

## ○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2016年6月23日～2016年12月22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 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

## ○組入資産の明細

(2016年12月22日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内株式マザーファンド	18,248	21,712	31,576
外国債券マザーファンド	2,466	3,578	7,927
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	7,012	8,564	19,503
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	5,040	6,977	9,096
J-REITインデックスマザーファンド	1,647	2,220	4,385
海外REITインデックスマザーファンド	1,604	2,136	4,619
新興国株式マザーファンド	10,192	12,042	12,387
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	1,083	1,248	1,572

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式マザーファンド	31,576	29.5
外国債券マザーファンド	7,927	7.4
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	19,503	18.2
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	9,096	8.5
J-REITインデックス マザーファンド	4,385	4.1
海外REITインデックス マザーファンド	4,619	4.3
新興国株式マザーファンド	12,387	11.6
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	1,572	1.5
コール・ローン等、その他	15,884	14.9
投資信託財産総額	106,949	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（669,955,104千円）の投資信託財産総額（670,758,177千円）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（358,958,844千円）の投資信託財産総額（359,590,036千円）に対する比率は99.8%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（18,507,617千円）の投資信託財産総額（18,553,427千円）に対する比率は99.8%です。

\*新興国株式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（17,630,982千円）の投資信託財産総額（17,681,087千円）に対する比率は99.7%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（4,020,044千円）の投資信託財産総額（4,030,530千円）に対する比率は99.7%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カタールリヤル=32.39円、1米ドル=117.72円、1カナダドル=87.60円、1英ポンド=145.61円、1スイスフラン=114.70円、1スウェーデンクローナ=12.77円、1ノルウェークローネ=13.56円、1デンマーククローネ=16.51円、1トルコリラ=33.57円、1ユーロ=122.76円、1チェココルナ=4.55円、1フォリント=0.3956円、1ズロチ=27.82円、1ルーブル=1.93円、1レイ=27.20円、1香港ドル=15.17円、1シンガポールドル=81.48円、1リンギ=26.29円、1バーツ=3.27円、1フィリピンペソ=2.36円、1ルピア=0.0088円、1ウォン=0.0986円、1新台湾ドル=3.68円、1豪ドル=85.25円、1ニュージーランドドル=81.32円、1インドルピー=1.75円、1新シケル=30.77円、1メキシコペソ=5.73円、1レアル=35.31円、1チリペソ=0.1747円、1コロンビアペソ=0.0393円、1ヌエボソル=34.69円、1UAEディルハム=32.11円、1エジプトポンド=6.12円、1ランド=8.43円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年12月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	106,949,330
コール・ローン等	563,390
国内株式マザーファンド(評価額)	31,576,868
外国債券マザーファンド(評価額)	7,927,991
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	19,503,915
国内債券NOMURA-BPTI総合マザーファンド(評価額)	9,096,187
J-REITインデックスマザーファンド(評価額)	4,385,212
海外REITインデックスマザーファンド(評価額)	4,619,677
新興国株式マザーファンド(評価額)	12,387,849
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額)	1,572,915
未収入金	15,315,326
(B) 負債	15,741,406
未払収益分配金	43,432
未払解約金	15,369,929
未払信託報酬	326,974
その他未払費用	1,071
(C) 純資産総額(A-B)	91,207,924
元本	86,864,327
次期繰越損益金	4,343,597
(D) 受益権総口数	86,864,327口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,500円

(注) 期首元本額は69,412,102円、期中追加設定元本額は81,663,130円、期中一部解約元本額は64,210,905円、1口当たり純資産額は1.0500円です。

## ○損益の状況 (2016年6月23日～2016年12月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 27
支払利息	△ 27
(B) 有価証券売買損益	7,344,392
売買益	10,680,544
売買損	△ 3,336,152
(C) 信託報酬等	△ 328,045
(D) 当期損益金(A+B+C)	7,016,320
(E) 前期繰越損益金	△ 1,604,376
(F) 追加信託差損益金	△ 1,024,915
(配当等相当額)	( 604,718)
(売買損益相当額)	(△ 1,629,633)
(G) 計(D+E+F)	4,387,029
(H) 収益分配金	△ 43,432
次期繰越損益金(G+H)	4,343,597
追加信託差損益金	△ 1,024,915
(配当等相当額)	( 670,654)
(売買損益相当額)	(△ 1,695,569)
分配準備積立金	5,368,512

\* 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(2016年6月23日～2016年12月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年6月23日～ 2016年12月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	745,195円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	4,467,238円
c. 信託約款に定める収益調整金	670,654円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	199,511円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	6,082,598円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	700円
g. 分配金	43,432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
------------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

## ○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

(2016年12月22日現在)

※組入資産の明細の期首（前期末）および当期末は、野村資産設計ファンドの各ファンドの作成対象期間の期首と期末を掲載しております。

## ＜国内株式マザーファンド＞

下記は、国内株式マザーファンド全体(223,480,635千口)の内容です。

## 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				
極洋	66	6.3	17,192	
日本水産	179.2	207.7	114,027	
マルハニチロ	31.8	30.3	92,566	
カネコ種苗	—	5.5	8,712	
サカタのタネ	22.9	23.6	80,004	
ホクト	15.8	16.3	34,719	
ホクリヨウ	1.5	1.7	1,269	
<b>鉱業 (0.4%)</b>				
住石ホールディングス	45.7	44.4	4,262	
日鉄鉱業	43	4.4	25,212	
三井松島産業	102	9.8	13,190	
国際石油開発帝石	819.2	842.7	1,025,565	
日本海洋掘削	4.7	5.6	13,983	
石油資源開発	24.6	25.3	67,399	
K&Oエナジーグループ	10.5	10.8	20,433	
<b>建設業 (3.0%)</b>				
ショーボンドホールディングス	16.3	16.8	82,992	
ミライト・ホールディングス	47.8	49.2	51,168	
タマホーム	11.7	12	6,420	
サンヨーホームズ	3.3	3.4	2,220	
ダイセキ環境ソリューション	3.6	3.7	5,057	
安藤・間	103.8	114.9	90,885	
東急建設	50.6	56.8	53,392	
コムシスホールディングス	66.8	62.5	133,000	
ミサワホーム	18.4	18.9	19,107	
ピーアールホールディングス	6.1	15.8	3,776	
高松コンストラクショングループ	11.7	12.1	30,177	
東建コーポレーション	6.4	6.6	56,628	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ソネック	1.7	2	1,236	
ヤマウラ	7.3	7.5	4,162	
大成建設	808	813	679,668	
大林組	466.4	479.8	545,532	
清水建設	476	489	535,944	
飛鳥建設	124.8	154.1	29,279	
長谷工コーポレーション	181.5	186.7	223,853	
松井建設	17.1	17.6	18,744	
銭高組	22	23	11,362	
鹿島建設	729	703	573,648	
不動テトラ	109.8	129.1	27,240	
大末建設	5.9	5.6	5,146	
鉄建建設	95	97	33,368	
西松建設	180	185	107,855	
三井住友建設	595.9	613	76,625	
大豊建設	60	58	33,060	
前田建設工業	96	99	101,277	
佐田建設	10.7	11	4,895	
ナカノフドー建設	11.9	12.2	7,795	
奥村組	148	132	87,912	
東鉄工業	18.7	19.2	58,272	
イチケン	17	14	5,922	
浅沼組	50	51	19,788	
戸田建設	181	186	117,180	
熊谷組	228	251	76,053	
青木あすなろ建設	10.2	10.5	8,179	
北野建設	32	33	10,725	
植木組	19	20	5,160	
三井ホーム	20	21	10,584	

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	21.8	23,086
ピーエス三菱	18.4	16.8	6,501
日本ハウスホールディングス	31.7	32.6	16,658
大東建託	57.2	58.9	1,034,873
新日本建設	18.5	19	17,974
N I P P O	36	37	81,585
東亜道路工業	29	30	10,560
前田道路	49	50	97,550
日本道路	46	48	22,464
東亜建設工業	136	13	26,182
若築建設	89	92	14,444
東洋建設	48.8	46	18,998
五洋建設	172.6	177.5	100,642
大林道路	18.2	16.6	12,068
世紀東急工業	24.4	23.3	11,650
福田組	25	26	31,980
住友林業	107	110.1	174,508
日本基礎技術	17.3	17.8	6,390
日成ビルド工業	43	47	25,004
ヤマダ・エスバイエルホーム	79	81	6,399
巴コーポレーション	19.3	19.9	7,124
バナホーム	58	60	58,980
大和ハウス工業	459.4	472.5	1,546,020
ライト工業	29.9	30.7	37,300
積水ハウス	519.9	503.4	986,915
日特建設	17	13.6	6,432
北陸電気工事	7.5	7.7	6,591
ユアテック	25	25	20,025
西部電気工業	13	2.7	5,934
四電工	12	12	5,400
中電工	22.5	20.2	51,247
関電工	62	64	67,200
きんでん	94	106.4	156,514
東京エネシス	18	17	17,578
トーエネック	22	22	12,760
住友電設	12.3	11.1	14,296
日本電設工業	25.3	26.1	49,616
協和エクシオ	60.9	62.7	105,712
新日本空調	13.1	12.3	15,990
N D S	24	2.5	7,247

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
九電工	28.5	31.1	95,788
三機工業	34.5	35.5	34,719
日揮	156	149.3	317,561
中外炉工業	47	48	10,656
ヤマト	13.9	14.3	8,151
太平電業	23	22	25,234
高砂熟学工業	46.4	44	66,880
三晃金属工業	15	1.4	4,340
朝日工業社	18	3.6	10,641
明星工業	28.2	29	16,704
大気社	19	21.2	59,656
ダイダマン	21	21	20,328
日比谷総合設備	18.7	17.9	29,427
東芝プラントシステム	25.3	26	43,888
ＯＳＪＢホールディングス	31.7	48.9	11,736
東洋エンジニアリング	83	94	28,670
千代田化工建設	112	115	95,335
新興ブランテック	31.9	32.8	27,912
<b>食料品 (4.4%)</b>			
日本製粉	100	47.6	76,588
日清製粉グループ本社	170.5	175.4	308,353
日東富士製粉	12	1	3,790
昭和産業	64	66	40,194
鳥越製粉	12.3	12.7	10,591
中部飼料	14.4	17.5	17,692
フィード・ワン	93.6	96.3	14,541
東洋精糖	24	24	2,760
日本甜菜製糖	79	8.2	18,909
三井製糖	61	11.3	28,103
塩水港精糖	16.6	17.1	4,172
日新製糖	6.6	6.8	11,254
森永製菓	140	31.2	146,640
中村屋	36	3.7	18,000
江崎グリコ	35.9	40	210,800
名糖産業	6.9	6.9	9,528
不二家	89	91	20,657
山崎製パン	114	117.2	268,153
第一屋製パン	24	25	3,475
モロゾフ	24	24	11,664
亀田製菓	8.7	8.9	46,814

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
寿スピリッツ	11.1	11.4	31,327
カルビー	57.6	65.2	238,958
森永乳業	139	143	115,115
六甲バター	6.9	7.1	17,955
ヤクルト本社	83.4	85.8	459,030
明治ホールディングス	92.1	94.8	862,680
雪印メグミルク	36.6	34.5	108,330
ブリマハム	98	101	40,804
日本ハム	114	109	341,715
林兼産業	50	5.1	4,396
丸大食品	80	76	36,860
S Foods	9.7	8.6	25,344
伊藤ハム米久ホールディングス	92.9	92.3	98,853
サッポロホールディングス	238	52.4	158,248
アサヒグループホールディングス	291.8	300.1	1,101,066
キリンホールディングス	630.2	688.8	1,332,139
宝ホールディングス	112.6	115.8	119,158
オエノンホールディングス	42	41	11,152
養命酒製造	4.8	4.9	9,040
コカ・コーラウエスト	52.7	54.2	186,177
コカ・コーライーストジャパン	55	62.3	159,612
サントリー食品インターナショナル	106.5	109.6	535,396
ダイドードリンコ	7.9	7.3	42,851
伊藤園	46.1	47.5	177,887
キーコーヒー	13.7	14.1	30,315
ユニカフェ	4.2	4.3	4,403
ジャパンフーズ	2	2	2,460
日清オイリオグループ	82	92	48,668
不二製油グループ本社	41.5	42.7	95,562
かどや製油	1.5	1.6	5,728
J-オイルミルズ	65	7.4	28,268
キッコーマン	118	112	419,440
味の素	327	329.6	778,185
キュービー	79.1	81.4	224,338
ハウス食品グループ本社	53.1	59.2	142,257
カゴメ	55.8	57.4	166,517
焼津水産化学工業	7.3	7.5	8,107
アリアケジャパン	12.7	13.1	79,517
ビエトロ	1.5	1.9	3,047
エバラ食品工業	3.7	3.8	7,698

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニチレイ	166	78.7	189,588
東洋水産	76.5	78.6	325,797
イトアンド	1.7	1.8	3,861
日清食品ホールディングス	65.8	62.5	375,625
永谷園ホールディングス	15	15	20,265
一正蒲鉾	5.4	5.6	6,350
フジッコ	15.1	15.5	36,580
ロック・フィールド	16.2	16.6	25,680
日本たばこ産業	919.4	886.6	3,479,018
ケンコーマヨネーズ	5.1	5.7	18,610
わらべや日洋ホールディングス	8.4	9.4	23,067
なとり	7.8	8	14,584
北の達人コーポレーション	2.9	3.4	1,611
ユーグレナ	49.8	51.4	64,661
ミヨシ油脂	53	55	7,975
理研ビタミン	4.6	4.7	22,395
<b>繊維製品 (0.7%)</b>			
片倉工業	18.2	18.7	26,909
グンゼ	118	112	41,440
東洋紡	576	592	101,232
ユニチカ	423	410	34,030
富士紡ホールディングス	71	7.3	23,615
倉敷紡績	149	151	34,428
シキボウ	89	81	11,664
日本毛織	44.7	42.2	36,460
ダイトボウ	21	20	1,460
トーア紡コーポレーション	6.2	6.3	3,672
ダイドーリミテッド	16.2	16.7	6,763
帝国繊維	15.2	15.6	25,084
帝人	594	122.2	289,858
東レ	1,055	1,085	1,063,300
サカイオーベックス	38	3.6	6,379
住江織物	36	37	9,620
日本フェルト	7.7	8.6	4,454
イチカワ	10	10	2,960
日東製網	16	1.6	3,384
芦森工業	31	—	—
アツギ	112	123	15,252
ダイニック	27	28	4,956
セーレン	36.2	37.2	53,716

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソトー	—	5.6	6,344
東海染工	20	21	2,982
小松精練	22.3	21	15,897
ワコールホールディングス	87	89	123,087
ホギメディカル	9.2	9.4	65,612
レナウン	39.3	40.4	4,605
クラウディア	3.3	3.4	1,764
T S I ホールディングス	64.9	61.6	43,920
三陽商会	82	78	13,728
ナイガイ	53	55	3,465
オンワードホールディングス	94	97	78,958
ルック	26	27	4,752
キムラタン	613	631	4,417
ゴールドウイン	6.2	6.3	32,760
デサント	33.2	34.1	45,455
キング	7.2	7.4	2,937
ヤマトインターナショナル	9	9.2	3,716
<b>パルプ・紙 (0.2%)</b>			
特種東海製紙	84	8.7	34,452
王子ホールディングス	596	585	288,990
日本製紙	75.1	67	137,752
三菱製紙	221	21.3	16,230
北越紀州製紙	90.2	83.5	57,197
中越パルプ工業	58	59	14,278
巴川製紙所	22	23	5,129
大王製紙	64.4	59.6	76,168
阿波製紙	—	2.7	1,657
レンゴー	128	144.2	95,748
トーモク	46	47	15,228
ザ・バック	10.3	10.6	28,418
<b>化学 (6.5%)</b>			
クラレ	229.4	251.7	447,522
旭化成	907	933	978,717
共和レザー	9.5	8.7	7,334
昭和電工	968	99.5	174,324
住友化学	1,070	1,101	636,378
日本化成	27	28	4,592
住友精化	30	6.2	29,264
日産化学工業	87.4	81.9	324,733
ラサ工業	55	56	7,560

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クレハ	110	11.3	49,833
多木化学	9	10	8,690
テイカ	24	23	15,019
石原産業	261	26.9	25,662
片倉コープアグリ	18	20	4,600
日東エフシー	8.5	8.7	7,943
日本曹達	94	90	48,600
東ソー	392	432	361,584
トクヤマ	241	233	106,248
セントラル硝子	157	152	82,536
東亜合成	91	93.6	110,448
大阪ソーダ	63	64	30,400
関東電化工業	35	31	32,426
デンカ	301	310	161,510
信越化学工業	260.7	268.2	2,479,240
日本カーバイド工業	49	51	7,956
堺化学工業	59	56	21,896
エア・ウォーター	120	123.3	261,765
大陽日酸	112	115.2	157,708
日本化学工業	54	55	13,420
日本パーカライジング	74.3	76.4	106,196
高圧ガス工業	22	22.2	16,983
チタン工業	17	17	3,332
四国化成工業	21	22	23,056
戸田工業	29	30	8,550
ステラ ケミファ	7.4	7.1	23,146
保土谷化学工業	44	5.2	14,227
日本触媒	21.1	23.5	175,310
大日精化工業	56	62	39,618
カネカ	196	202	198,970
三菱瓦斯化学	250	139.3	277,346
三井化学	617	680	360,400
J S R	136.4	150.3	280,760
東京応化工業	29.2	28	110,740
大阪有機化学工業	10.4	9.7	9,253
三菱ケミカルホールディングス	973.7	1,001.6	781,848
KHネオケム	—	18.3	23,277
日本合成化学工業	34	—	—
ダイセル	204.5	201.7	264,428
住友パークライト	128	132	86,196

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
積水化学工業	330	339.5	624,340
日本ゼオン	123	126	144,774
アイカ工業	43.7	47.9	147,053
宇部興産	778	753	188,250
積水樹脂	22.4	23.1	43,197
タキロン	34	31	16,399
旭有機材	47	48	10,560
日立化成	71.8	83.1	241,737
ニチバン	14	15	12,405
リケンテクノス	31.3	32.2	17,130
大倉工業	35	36	18,396
積水化成成品工業	37	21.3	17,466
群栄化学工業	39	3.6	11,700
タイガースポリマー	7.2	7.4	6,038
ミライアル	5.2	5.4	5,124
ダイキアクシス	2.7	2.5	2,900
ダイキョーニシカワ	18.7	26.2	38,880
日本化薬	94	97	140,553
カーリットホールディングス	13.5	13.9	7,686
日本精化	12	12.4	11,284
扶桑化学工業	9.2	10.6	26,309
ADEKA	71.5	64.3	104,487
日油	109	120	133,560
新日本理化	22.9	23.6	3,799
ハリマ化成グループ	12.4	12.7	9,652
花王	391	379.8	2,121,562
第一工業製薬	32	33	12,606
ニイタカ	2.1	2.2	3,236
三洋化成工業	46	9.4	47,846
有機合成薬品工業	—	9.7	2,454
大日本塗料	83	86	20,124
日本ペイントホールディングス	112.2	115.4	365,818
関西ペイント	164.5	157.1	341,221
神東塗料	11	11	2,453
中国塗料	42	42.9	37,237
日本特殊塗料	10.2	10.5	18,112
藤倉化成	19.7	20.3	13,540
太陽ホールディングス	10.7	12.2	56,059
D I C	574	59.1	216,010
サカティンクス	29.7	30.5	44,408

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東洋インキＳＣホールディングス	144	148	79,624
T&K TOKA	10.5	10.8	11,124
富士フイルムホールディングス	332.7	296.6	1,344,191
資生堂	275.8	283.7	844,716
ライオン	168	186	348,564
高砂香料工業	9.6	9.8	30,135
マンダム	13.5	15	74,775
ミルボン	8.6	8.1	35,194
ファンケル	33.7	31.8	51,484
コーセー	23.5	24.2	234,740
コタ	5	5.6	7,224
シーブズ・ホールディングス	18.3	19.4	63,632
シーボン	1.7	1.7	4,035
ポーラ・オルビスホールディングス	14.8	15.2	146,376
ノエビアホールディングス	9.2	9.4	34,639
アジupanコスメジャパン	2.7	2.8	2,581
エステー	9.9	10.2	15,238
アグロ カネショウ	5.6	5.8	6,965
コニシ	22.8	23.5	29,610
長谷川香料	18.4	18.9	37,667
星光PMC	7.9	8.2	9,635
小林製薬	22	41.5	209,575
荒川化学工業	12.4	12.8	23,116
メック	11.2	11.6	10,857
日本高純度化学	4.1	4.2	10,273
タカラバイオ	31.1	32	45,504
J C U	4.3	4.7	26,038
新田ゼラチン	9.5	9	6,534
OATアグリオ	1.7	1.7	2,325
デクセリアルズ	43.4	39.1	44,495
アース製薬	10.4	10.7	52,644
イハラケミカル工業	22.3	20.7	23,701
北興化学工業	16	15	6,915
大成ラミック	4.1	4.2	13,083
クミアイ化学工業	30	30.8	22,514
日本農薬	33.2	34.1	22,267
アキレス	119	12.2	19,617
有沢製作所	21.5	25.3	16,495
日東電工	112.3	107.8	983,243
レック	4.5	4.7	14,617

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
きもと	23.6	26.7	6,701
藤森工業	12.5	11.1	33,211
前澤化成工業	10.2	9.8	11,564
J S P	9.5	7	19,327
エフビコ	12.9	13.3	71,288
天馬	11.2	9.9	19,988
信越ポリマー	28.5	29.3	25,901
東リ	37	35.6	13,029
ニフコ	27.8	26.2	161,916
日本バルカー工業	56	11.6	17,991
ユニ・チャーム	294.3	302.7	773,701
<b>医薬品 (4.6%)</b>			
協和発酵キリン	173.9	178.9	283,914
武田薬品工業	579	560.6	2,706,016
アステラス製薬	1,627.7	1,527.6	2,477,767
大日本住友製薬	102.9	105.8	207,156
塩野義製薬	211.9	202.4	1,104,496
田辺三菱製薬	169.4	174.2	395,434
わかもと製薬	17	17	4,097
あすか製薬	18.4	16.3	26,748
日本新薬	33.3	34.3	192,766
ビオフェルミン製薬	2.4	2.4	6,943
中外製薬	144.7	148.9	489,881
科研製薬	25.1	27.9	170,190
エーザイ	178.9	184.1	1,238,624
ロート製薬	71.2	73.2	131,833
小野薬品工業	330.1	339.6	828,454
久光製薬	45.1	42.2	236,742
有機合成薬品工業	9	—	—
持田製薬	9.9	10.2	81,294
参天製薬	267.7	275.5	387,904
扶桑薬品工業	49	5	13,665
日本ケミファ	20	2.1	11,634
ツムラ	45.7	50.2	155,118
日医工	34	35	58,555
キッセイ薬品工業	25.7	26.5	75,286
生化学工業	27.8	27.7	45,898
栄研化学	12.2	12.5	36,525
日水製薬	5.8	6	7,734
鳥居薬品	9.9	10.2	26,622

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	11.2	11.5	30,084
東和薬品	6.7	6.9	31,360
富士製薬工業	4.7	4.8	12,662
沢井製薬	24.7	25.4	157,226
ゼリア新薬工業	29.8	30.6	54,100
第一三共	488.9	440	1,044,560
キョーリン製薬ホールディングス	38.8	36.5	89,023
大幸薬品	7.2	7.4	13,349
ダイト	8.1	8.3	18,384
大塚ホールディングス	312.5	321.5	1,616,502
大正製薬ホールディングス	35	32	307,840
ペプチドリーム	24.2	25.4	136,144
<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>			
日本コークス工業	117.3	120.6	13,507
昭和シェル石油	146.2	133.6	152,036
ニチレキ	17.8	18.3	16,561
東燃ゼネラル石油	219	243	308,853
ユシロ化学工業	7.8	8	11,656
ビービー・カストロール	5.9	6.1	9,272
富士石油	33.7	34.7	14,157
MORESCO	4.6	5.1	7,910
出光興産	75.8	70.9	222,980
J X ホールディングス	1,720.7	1,659.4	835,839
コスモエネルギーホールディングス	43.8	45.1	75,768
<b>ゴム製品 (0.9%)</b>			
横浜ゴム	87.7	90.2	195,463
東洋ゴム工業	65.8	78.9	120,717
ブリヂストン	490.6	504.6	2,223,772
住友ゴム工業	136	139.9	268,468
藤倉ゴム工業	12.1	12.5	8,575
オカモト	45	45	47,430
フコク	5.3	6.2	5,778
ニッタ	15.7	13.4	42,545
住友理工	31.4	27.7	31,411
三ツ星ベルト	35	36	35,928
バンドー化学	53	27.2	28,124
<b>ガラス・土石製品 (1.0%)</b>			
日東紡績	96	121	55,902
旭硝子	767	736	610,880
日本板硝子	701	68.1	60,064

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
石塚硝子	20	21	4,137
日本山村硝子	58	59	12,154
日本電気硝子	300	309	198,378
オハラ	5.5	5.6	4,244
住友大阪セメント	288	278	123,154
太平洋セメント	907	902	339,152
デイ・シイ	13.4	—	—
日本ヒューム	13.9	14.3	10,124
日本コンクリート工業	29.9	33.3	11,588
三谷セキサン	7.3	7.5	23,212
アジアパイルホールディングス	17.9	18.4	9,807
東海カーボン	126	140	54,180
日本カーボン	71	73	17,228
東洋炭素	8	8.3	15,645
ノリタケカンパニーリミテド	82	8.4	23,268
ＴＯＴＯ	106.8	109.8	513,864
日本硝子	184	188.8	441,980
日本特殊陶業	125.2	128.8	346,085
ダントーホールディングス	17	12	2,292
MARUWA	5.3	5.5	21,807
品川リフラクトリーズ	37	38	9,424
黒崎播磨	31	32	10,048
ヨータイ	8	9	3,087
イソライト工業	7.1	7.3	2,000
東京窯業	17.6	18.1	3,402
ニッカトー	5.1	4.8	1,963
フジミインコーポレーテッド	12.8	12.7	27,533
エーアンドエーマテリアル	30	31	3,999
ニチアス	74	78	85,956
ニチハ	19.3	19.9	56,874
<b>鉄鋼 (1.3%)</b>			
新日鐵住金	655.3	674	1,828,562
神戸製鋼所	2,669	258.4	304,912
中山製鋼所	163	16.8	12,196
合同製鐵	81	8.4	18,160
ジェイ エフ イー ホールディングス	397.2	408.6	753,049
日新製鋼	66.3	68.2	97,526
東京製鐵	80.2	75.6	67,964
共英製鋼	15.5	15.9	34,948
大和工業	32.1	30	97,800

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京鐵鋼	30	31	14,725
大阪製鐵	9.1	9.4	19,843
淀川製鋼所	21.6	20.7	63,652
東洋鋼板	34.8	35.7	13,601
丸一鋼管	48.6	50	187,500
モリ工業	23	4.8	9,508
大同特殊鋼	243	250	123,500
日本高周波鋼業	57	52	4,576
日本冶金工業	106.9	123.7	23,874
山陽特殊製鋼	86	89	50,463
愛知製鋼	86	8.8	43,912
日立金属	166.4	152.1	239,101
日本金属	38	3.6	4,662
大洋洋金属	101	95	36,290
新日本電工	82.2	84.6	21,150
栗本鐵工所	69	7.1	16,699
缸技	20	21	5,607
日本鑄鉄管	16	15	2,970
三菱製鋼	101	104	24,128
日亜鋼業	20.1	20.6	5,768
日本精練	10	10	5,630
シンニクタン	13	12.2	8,283
新家工業	29	32	5,056
<b>非鉄金属 (0.9%)</b>			
大紀アルミニウム工業所	23	25	12,975
日本軽金属ホールディングス	328.9	338.3	83,560
三井金属鉱業	370	406	121,394
東邦亜鉛	76	84	39,144
三菱マテリアル	907	93.3	344,277
住友金属鉱山	401	387	592,497
DOWAホールディングス	187	165	150,810
古河機械金属	227	233	51,027
大阪チタニウムテクノロジーズ	14.3	16.3	26,846
東邦チタニウム	24.6	25.3	20,164
UACJ	203	190	62,700
古河電気工業	457	50.1	166,081
住友電気工業	581.7	563.1	964,308
フジクラ	202	196.7	126,871
昭和電線ホールディングス	173	178	15,664
東京特殊電線	2.1	2.1	2,782

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	30.2	28	12,936
沖電線	17	16	3,760
カナレ電気	2.3	2.1	4,443
平河ヒューテック	6.8	7	8,484
リョービ	89	91	42,952
アーレスティ	16.8	17.3	21,849
アサヒホールディングス	21.9	22.5	46,035
<b>金属製品 (0.7%)</b>			
稲葉製作所	7.7	7.9	10,451
宮地エンジニアリンググループ	45	43	8,299
トーカロ	10.2	9.8	25,548
アルファC o	4.8	5	5,640
SUMCO	113.8	156	241,176
川田テクノロジーズ	2.7	2.8	19,544
RS Technologies	—	0.5	2,032
東洋製織グループホールディングス	103.2	106.2	233,109
ホッカンホールディングス	38	39	18,018
コロナ	7.6	7.8	9,079
横河ブリッジホールディングス	27.5	26.3	35,952
駒井ハルテック	26	2.9	6,249
高田機工	13	13	2,990
三和ホールディングス	144.2	148.3	166,392
文化シャッター	40.4	41.6	38,064
三協立山	19	19.6	32,046
アルインコ	10.9	10.3	10,701
東洋シャッター	3.6	3.7	2,301
L I X I Lグループ	202.4	208.2	566,512
日本フィルコン	10.5	10.8	6,307
ノーリツ	28.5	29.3	59,332
長府製作所	15.5	15.9	43,820
リンナイ	27	25.5	241,740
ダイニチ工業	7.4	7.6	5,472
日東精工	21	21	8,967
三洋工業	18	19	3,762
岡部	30.1	31	30,783
ジーテクト	15.1	15.6	36,816
中国工業	2.2	2.1	1,472
東プレ	27.9	28.7	84,779
高周波熱練	27	27.8	24,908
東京製綱	98	10.1	20,008

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サンコール	7.7	7.9	4,297
モリテック スチール	7.3	7.5	2,122
バイオラックス	7.3	7.5	55,725
日本発條	136.7	140.7	160,679
中央発條	19	17	5,440
アドパネクス	2.7	2.6	4,479
立川ブラインド工業	6	6.2	5,542
三益半導体工業	10.7	11	18,172
<b>機械 (4.9%)</b>			
日本ドライケミカル	1.9	1.9	4,461
日本製鋼所	240	49.4	103,097
三浦工業	64.8	61.1	109,735
タクマ	54	48	45,936
ツガミ	42	40	27,760
オークマ	95	97	110,871
東芝機械	79	89	42,008
アマダホールディングス	211.8	201.1	263,441
アイダエンジニアリング	38.1	42.4	46,682
滝澤鉄工所	45	44	7,128
富士機械製造	47.4	45.5	61,698
牧野フライス製作所	72	74	68,598
オーエスジー	66.2	68.1	160,035
ダイジェット工業	17	17	2,856
旭ダイヤモンド工業	39.1	42.7	35,526
DMG森精機	80.2	88.4	132,423
ソディック	36.8	37.9	37,483
ディスコ	18.5	17.5	246,050
日東工器	8.5	8.7	21,915
パンチ工業	5.7	5.4	4,887
豊和工業	8.1	8.3	5,104
OKK	56	54	6,426
東洋機械金属	10.7	10.1	4,646
津田駒工業	35	33	5,610
エンシュウ	36	37	3,626
島精機製作所	20.5	19.5	75,172
NCホールディングス	4.7	4.8	4,382
フリーユー	2.8	2.9	9,396
ヤマシンフィルタ	2.8	2.9	3,100
日阪製作所	18.3	20.3	17,843
やまびこ	26.6	27.4	42,086

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ベガススミシン製造	15	14.3	9,995
ナブテスコ	75.5	77.7	216,938
三井海洋開発	17	15	28,920
レオン自動車	12.2	12.6	11,062
SMC	43.5	44.8	1,271,424
新川	13	12.4	9,324
ホソカワミクロン	24	25	19,300
ユニオンツール	6.3	6.5	20,637
オイレス工業	18.8	19.3	40,877
日精エー・エス・ビー機械	4.6	4.8	11,448
サトーホールディングス	19.6	18.6	45,700
日本エアータック	5.1	4.8	3,134
日精樹脂工業	10.6	11.8	12,118
オカダアイオン	2.8	3.1	3,109
ワイエイシイ	5.8	5.6	6,731
小松製作所	712.1	689.4	1,858,277
住友重機械工業	424	436	334,412
日立建機	64.9	66.8	173,479
日工	22	4.5	9,499
巴工業	5.9	6.1	9,692
井関農機	149	153	34,884
TOWA	14	12.2	18,031
丸山製作所	30	31	5,952
北川鉄工所	67	6.8	15,898
ローツェ	—	5.3	8,851
タカキタ	4.8	5	2,735
クボタ	697.4	717.4	1,220,297
荏原実業	4.3	4.2	5,665
三菱化工機	48	49	10,584
月島機械	27.5	28.3	35,205
帝国電機製作所	10.5	10.9	10,365
東京機械製作所	54	56	3,976
新東工業	32.9	33.9	34,781
澁谷工業	12.1	12.5	32,037
アイチ コーポレーション	20.5	21.1	18,061
小森コーポレーション	35.3	35.9	54,280
鶴見製作所	10.8	11.1	19,092
住友精密工業	23	24	8,736
酒井重工業	28	28	8,596
荏原製作所	321	62	202,740

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
石井鐵工所	21	2.2	3,766
西島製作所	15.5	14.6	16,279
北越工業	15.6	16	12,976
ダイキン工業	202.1	194.9	2,084,455
オルガノ	25	28	12,880
トーヨーカネツ	78	69	21,114
栗田工業	87.3	84.5	212,855
椿本チエイン	82	85	83,045
大同工業	28	29	7,134
木村化工機	12.4	12.8	4,416
アネスト岩田	23.4	25.9	29,163
ダイフク	74.6	71.2	165,041
サムコ	3.5	3.6	3,578
加藤製作所	33	7.8	23,556
油研工業	27	28	6,020
タダノ	67	74.6	110,930
フジテック	40.4	41.6	56,243
CKD	38.6	42.8	59,577
キトー	17.5	18	23,202
平和	43	44.2	117,969
理想科学工業	15.3	14.2	28,002
SANKYO	38.6	39.7	150,661
日本金銭機械	12.8	13.1	18,602
マースエンジニアリング	7.8	8.1	18,281
福島工業	8.6	8.8	29,040
オーイズミ	5.8	6	4,188
ダイコク電機	5.7	5.9	10,572
竹内製作所	27.5	26.1	66,894
アマノ	42.9	44.2	90,610
JUKI	20.6	22.5	24,435
サンデンホールディングス	85	87	32,538
蛇の目シン工業	13.5	13.8	11,523
マックス	21	22	31,130
グローリー	47.3	45.6	167,352
新晃工業	9.7	10	13,660
大和冷機工業	22.3	22.9	20,793
セガサミーホールディングス	149.2	141.6	246,950
日本ビストンリング	5.8	5.6	11,804
リケン	64	6.6	29,337
T P R	17.1	16	54,400

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ツバキ・ナカシマ	17.1	15.9	28,810
ホシザキ	30.4	31.3	281,700
大豊工業	11.2	11.5	19,239
日本精工	285.1	293.2	404,029
NTN	344	330	164,010
ジェイテクト	147.9	152.2	297,398
不二越	129	144	74,736
日本トムソン	47.5	45.6	23,119
THK	92.3	100.9	269,302
ユースン精機	5.4	6.3	16,587
前澤給装工業	5.7	5.4	8,186
イーグル工業	17.2	15.4	24,547
前澤工業	10.2	10.4	3,827
日本ビラー工業	14	14.4	17,784
キッツ	61.8	68.5	45,347
日立工機	37.1	38.2	47,750
マキタ	90.5	93.1	737,352
日立造船	110	113.2	69,844
三菱重工業	2,472	2,393	1,294,373
I H I	1,067	1,097	345,555
スター精密	—	25	40,375
<b>電気機器 (12.4%)</b>			
日清紡ホールディングス	77.1	79.3	91,670
イビデン	85	99.9	161,638
コニカミノルタ	346.6	334.2	389,008
ブラザー工業	179.4	184.5	394,461
ミネベア	223.6	230	272,090
日立製作所	3,541	3,428	2,196,662
東芝	2,922	3,193	1,424,397
三菱電機	1,481	1,522.9	2,508,216
富士電機	418	430	256,280
東洋電機製造	27	5.6	8,982
安川電機	172.4	165.5	304,685
シンフォニアテクノロジー	90	92	24,472
明電舎	128	131	52,531
オリジン電気	20	21	6,594
山洋電気	36	37	30,340
デンヨー	12.8	13.2	21,502
東芝テック	99	89	49,484
芝浦メカトロニクス	22	23	6,026

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マブチモーター	39.2	40.3	257,114
日本電産	167	185	1,894,400
ユニー・エム・シー・エレクトロニクス	1.6	1.7	5,096
東光高岳	7.7	7.2	14,803
ダブル・スコープ	6	13.7	23,180
ダイヘン	82	78	56,394
田淵電機	15.7	21.5	8,793
ヤーマン	1.8	1.8	10,278
JVCケンウッド	101.8	104.8	33,745
ミマキエンジニアリング	12.4	12.8	8,883
第一精工	5.8	6.7	9,205
日新電機	32.5	28.7	35,559
大崎電気工業	26	28	34,132
オムロン	156.7	151.8	692,208
日東工業	22.2	21	34,104
I D E C	18.1	18.6	20,646
不二電機工業	1.3	1.6	2,230
ジーエス・ユアサ コーポレーション	267	275	133,925
サクサホールディングス	35	36	7,848
メルコホールディングス	7.7	7.9	25,280
テクノメディカ	3.1	3.2	6,227
日本電気	1,908	1,963	606,567
富士通	1,338	1,376	910,912
沖電気工業	601	61.9	103,311
岩崎通信機	65	63	5,355
電気興業	36	41	24,067
サンケン電気	76	83	45,899
ナカヨ	13	15	5,835
アイホン	7.9	8.1	15,965
ルネサスエレクトロニクス	71.8	73.9	71,683
セイコーエプソン	206.7	212.6	515,980
ワコム	109.3	110.7	34,206
アルパック	25.5	26.3	90,866
アクセル	6.3	6	6,024
E I Z O	13.7	14.1	50,125
ジャパンディスプレイ	259.2	266.6	93,043
日本信号	38.3	39.4	39,715
京三製作所	32	33	12,969
能美防災	15.7	16.2	27,799
ホーチキ	10.1	10.3	14,224

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エレコム	12	12.4	24,626
日本無線	41	8.7	12,310
パナソニック	1,585.7	1,631.1	2,018,486
シャープ	1,173	—	—
アンリツ	83.3	104.1	66,728
富士通ゼネラル	42	48	116,448
日立国際電気	31.7	37.3	87,058
ソニー	979.3	1,007.9	3,368,401
TDK	83.8	80.4	664,908
帝国通信工業	33	31	5,425
ミツミ電機	52.8	50.4	35,128
タムラ製作所	54	55	24,640
アルプス電気	119.6	131.8	376,157
池上通信機	44	45	6,930
バイオニア	224.6	214.5	52,981
日本電波工業	12.5	13.8	12,558
鈴木	5.3	5.5	2,794
日本トリム	3.7	3.5	15,802
ローランド ディー. ジー.	6.8	7.3	23,141
フォスター電機	17.4	16.7	37,307
クラリオン	73	75	30,825
SMK	41	37	16,021
ヨコオ	9.9	10.2	8,996
ティアック	100	103	5,871
ホシデン	42.1	43.3	40,961
ヒロセ電機	22.4	23.1	338,646
日本航空電子工業	40	45	76,320
TOA	16.4	16.8	17,690
日立マクセル	23	21.3	43,686
古野電気	16.5	18.4	15,566
ユニデンホールディングス	44	42	7,014
アルパイン	33.1	34	52,632
スミダコーポレーション	11.4	11.7	11,700
アイコム	7.7	7.9	18,027
リオン	5.3	5.5	8,794
本多通信工業	3.6	4.6	5,694
船井電機	14	16	15,232
横河電機	138.9	154.8	261,302
新電元工業	49	55	24,420
アズビル	45.3	43.3	142,024

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東亜ディーケーケー	7.7	7.1	3,777
日本光電工業	58	59.7	151,638
チノー	4.9	5.1	5,594
共和電業	16.9	16.2	6,463
日本電子材料	5.5	5.6	3,410
堀場製作所	25.7	28.3	154,801
アドバンテスト	94.6	97.3	183,605
小野測器	6.7	6.9	6,065
エスベック	14.3	12.7	16,624
パナソニック デバイスSUNX	12.2	12.5	10,437
キーエンス	31.4	32.3	2,550,731
日置電機	7.3	7.5	16,072
シスメックス	107.7	110.9	728,613
日本マイクロニクス	25.9	26.6	30,164
メガチップス	13.9	13.3	33,170
OBARA GROUP	8.1	8.3	44,405
澤藤電機	7	9	1,962
コーセル	19.2	19.8	25,324
イリソ電子工業	—	4.5	29,115
新日本無線	10.1	12.1	4,658
オブテックス	10.2	10.5	26,670
千代田インテグレ	7.3	7.5	18,727
アイ・オー・データ機器	4.3	4.4	5,170
レーザーテック	16.3	16.7	33,951
スタンレー電気	99.2	102.1	330,293
岩崎電気	47	52	9,516
ウシオ電機	84.2	86.7	129,183
岡谷電機産業	7.4	7.6	3,146
ヘリオス テクノ ホールディング	11.8	13.1	6,589
日本セラミック	7.9	11.7	24,008
遠藤照明	7	7.2	6,184
日本デジタル研究所	11.7	13.5	32,319
古河電池	10	10	7,470
双信電機	6.7	6.9	1,980
山一電機	12	13.4	15,115
図研	10	9.3	11,113
日本電子	55	52	26,624
カシオ計算機	139.1	119.3	201,020
ファナック	142	144.7	2,910,640
日本シイエムケイ	29.9	30.7	22,380

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エンプラス	7.1	6.5	23,205
大真空	25	5.2	7,306
ローム	68.4	69	464,370
浜松ホトニクス	108.3	111.4	348,682
三井ハイテック	20.1	18.8	16,130
新光電気工業	52.4	53.9	43,443
京セラ	227.8	234.4	1,393,039
太陽誘電	67.5	69.4	100,421
村田製作所	146.4	149.8	2,403,541
ユーシン	18.3	18.9	14,175
双葉電子工業	22.7	23.3	45,528
北陸電気工業	56	57	7,695
ニチコン	43.7	45	46,620
日本ケミコン	112	123	32,841
KOA	19.2	19.7	22,655
市光工業	33	30	11,370
小糸製作所	83.2	85.5	532,665
ミツバ	23.6	26.3	48,102
スター精密	26.3	—	—
S C R E E Nホールディングス	142	29.3	210,960
キャノン電子	12.7	13.1	23,737
キャノン	747.2	768.6	2,639,372
リコー	449.4	429.3	432,305
M U T O Hホールディングス	17	19	4,826
東京エレクトロン	113.9	95.2	1,042,440
<b>輸送用機器 (10.0%)</b>			
トヨタ紡織	48.5	49.9	136,426
芦森工業	—	32	5,152
鬼怒川ゴム工業	32	—	—
ユニプレス	28.8	27.5	65,120
豊田自動織機	126.4	130	755,300
モリタホールディングス	24.3	25	39,325
三櫻工業	17.6	18.1	15,240
デンソー	342.9	352	1,850,816
東海理化電機製作所	40.6	37.6	92,496
三井造船	537	516	94,428
川崎重工業	1,080	1,111	415,514
名村造船所	41.6	42.8	35,267
サノヤスホールディングス	16.9	17.3	4,844
日本車輛製造	57	52	14,144

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニチユ三菱フォークリフト	16	16.4	13,956
近畿車輛	21	2.1	5,371
日産自動車	1,937	1,708.7	2,070,944
いすゞ自動車	402.2	413.7	627,789
トヨタ自動車	1,726.2	1,775.7	12,589,713
日野自動車	198.1	203.8	249,451
三菱自動車工業	551.1	523.2	358,392
エフテック	7.3	7.5	10,042
レシッパホールディングス	4.6	4.7	4,037
GMB	2.2	2.3	2,631
ファルテック	2.4	2.5	3,312
武蔵精密工業	14.8	16.6	52,290
日産車体	67.8	62.7	73,421
新明和工業	60	58	63,046
極東開発工業	27.6	28.4	44,502
日信工業	31	31.9	58,855
トピー工業	114	11.7	34,807
ティラド	54	55	16,335
曙ブレーキ工業	70.3	66.3	20,553
タチエス	22	24.2	47,843
NOK	67.2	69.1	171,644
フタバ産業	42.3	43.5	31,189
KYB	155	160	89,440
大同メタル工業	19.4	17.9	21,426
プレス工業	73.7	75.8	40,325
ミクニ	17.6	18.1	7,185
カルソニックカンセイ	106	97	173,242
太平洋工業	30.8	29.3	44,184
ケーヒン	31.9	32.8	67,404
河西工業	17	19.3	27,058
アイシン精機	142.3	130.6	694,792
富士機工	16	14.1	6,570
マツダ	439.5	452.1	909,625
ダイハツ工業	165.7	—	—
今仙電機製作所	12.7	13.1	13,414
本田技研工業	1,249	1,284.8	4,586,736
スズキ	253.9	283	1,179,261
富士重工業	438.6	443.3	2,162,860
安永	4.6	5.2	11,013
ヤマハ発動機	196	201.6	539,280

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ショーワ	36	37.1	29,086
T B K	16.5	18.3	8,985
エクセディ	18.8	19.4	64,699
豊田合成	50.4	46.1	129,587
愛三工業	24.3	25	25,375
盟和産業	2.3	2.2	2,578
ヨロズ	13	13.3	23,261
エフ・シー・シー	22.7	23.3	50,561
シマノ	55.9	57.5	1,069,500
タカタ	25.1	25.8	15,505
テイ・エス テック	32.2	33.2	102,920
ジャムコ	8.1	8.3	19,687
<b>精密機器 (1.5%)</b>			
テルモ	212.8	218.8	932,088
クリエートメディック	4.6	4.7	4,596
日機装	50	49.4	50,585
島津製作所	179	184	324,760
J M S	26	26	7,904
クボテック	3	3.1	2,077
長野計器	8.4	11.2	7,683
ブイ・テクノロジー	3.3	2.9	36,801
東京計器	44	49	11,123
愛知時計電機	18	1.9	7,115
オーバル	13.5	13.9	3,683
東京精密	26.8	27.6	94,392
マニー	18.4	19	52,364
ニコン	259.1	248.8	447,591
トプコン	46.6	71.9	121,511
オリンパス	206.7	227.9	894,507
理研計器	11.2	12.6	20,475
タムロン	11.2	12.7	25,501
HOYA	313.9	293.7	1,425,032
ノーリツ鋼機	12.5	14.4	12,009
エー・アンド・デイ	12.6	13	6,214
シチズン時計	170.8	161.1	116,636
リズム時計工業	61	57	10,317
大研医器	11	12.7	10,058
メニコン	9.3	9.8	30,380
松風	6.8	7.5	10,005
セイコーホールディングス	89	101	43,430

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニプロ	103.4	98.8	124,191
<b>その他製品 (1.8%)</b>			
スノーピーク	1.5	2.2	6,721
パラマウントベッドホールディングス	14.6	13.7	61,787
トランザクション	2.8	3.1	4,743
S H O - B I	4.6	4.8	2,049
ニホンフラッシュ	5.4	6.7	8,837
前田工織	13.9	14.3	17,917
永大産業	20	19	9,576
アートネイチャー	14.8	15.2	10,883
ダンロップスポーツ	8.7	9	9,252
バンダイナムコホールディングス	143.5	157.5	507,150
アイフイスジャパン	3.1	3.2	1,366
共立印刷	23.1	23.7	7,512
S H O E I	6.2	6.4	13,894
フランスベッドホールディングス	19.3	17.9	16,485
パイロットコーポレーション	24.2	24.9	119,769
萩原工業	3.9	4	9,924
トッパン・フォームズ	24.8	25.5	30,523
フジシールインターナショナル	16.9	16	77,120
タカラトミー	45.6	55.5	69,208
廣済堂	12.9	14.4	4,996
A s - m e エステール	3.7	3.8	2,660
アーク	58.4	60.1	7,512
タカノ	6.1	6.3	5,147
プロネクサス	13	13.3	14,018
ホクシン	11	10.1	1,999
ウッドワン	25	24	6,552
大建工業	54	10	20,480
凸版印刷	392	403	453,778
大日本印刷	411	412	477,508
図書印刷	26	19	9,272
共同印刷	47	44	17,556
日本写真印刷	23.3	24	67,512
光村印刷	14	13	2,769
宝印刷	6.7	6.9	10,626
アシックス	129.3	141.8	337,909
ツツミ	6.9	5.3	10,356
小松ウオール工業	4.7	4.8	9,177
ヤマハ	102	96.2	344,877

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
河合楽器製作所	5.2	5.6	12,964
クリナップ	16.3	16.7	15,714
ビジョン	78.6	86.3	255,534
兼松サステック	14	15	2,715
キングジム	11.5	11.9	10,115
リンテック	33	33.9	87,902
TASAKI	2.6	3.9	6,310
イトーキ	29.2	30	23,040
任天堂	85.5	87.9	2,074,000
三菱鉛筆	10.4	11.8	74,458
タカラスタンダード	57	29.5	57,023
コクヨ	72.1	74.2	100,466
ナカバヤシ	28	26	6,942
グローブライド	6.7	6.9	13,372
岡村製作所	48.4	49.8	51,045
美津濃	74	77	44,198
アデランス	24.1	26.4	16,684
<b>電気・ガス業 (1.9%)</b>			
東京電力ホールディングス	1,177.3	1,211	605,500
中部電力	424.7	470.4	794,740
関西電力	566.4	582.6	772,818
中国電力	191.9	197.4	284,256
北陸電力	136	139.9	189,284
東北電力	346.7	356.7	539,330
四国電力	125	128.6	158,306
九州電力	306.5	315.3	416,511
北海道電力	129.9	133.6	126,519
沖縄電力	22	21	55,629
電源開発	118.3	113.6	315,694
エフオン	5.6	5.8	5,249
イーレックス	4.2	5.9	16,885
東京瓦斯	1,549	1,531	831,639
大阪瓦斯	1,437	1,385	639,593
東邦瓦斯	350	360	343,800
北海道瓦斯	34	35	9,660
広島ガス	24.2	29.4	11,025
西部瓦斯	156	161	41,055
静岡ガス	39.4	43.9	37,490
メタウォーター	8.9	8	22,624

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>陸運業 (4.3%)</b>			
SBSホールディングス	13.7	14.1	11,942
東武鉄道	742	763	444,829
相鉄ホールディングス	238	228	132,240
東京急行電鉄	808	776	685,208
京浜急行電鉄	380	391	522,376
小田急電鉄	445	228.7	536,758
京王電鉄	388	399	385,434
京成電鉄	208	107	307,625
富士急行	38	39	42,237
新京成電鉄	18	18	7,416
東日本旅客鉄道	253.7	276.2	2,868,337
西日本旅客鉄道	133.6	137.4	1,002,607
東海旅客鉄道	124.3	118.7	2,319,991
西武ホールディングス	147.4	197.2	415,697
鴻池運輸	19.6	20.2	31,491
西日本鉄道	180	172	92,708
ハマキョウレックス	10.7	9.3	20,162
サカイ引越センター	5.5	4.9	13,043
近鉄グループホールディングス	1,397	1,437	648,087
阪急阪神ホールディングス	931	180.4	684,618
南海電気鉄道	312	302	180,294
京阪ホールディングス	311	320	248,000
神戸電鉄	34	35	13,020
名古屋鉄道	505	520	298,480
山陽電気鉄道	51	52	30,940
日本通運	537	552	347,760
ヤマトホールディングス	248.2	255.3	618,847
山九	183	188	136,112
丸運	7.5	7.7	1,909
丸全昭と運輸	47	48	22,128
センコー	62.4	64.2	51,681
トナミホールディングス	28	29	9,918
ニッコンホールディングス	44.1	48.4	118,967
日本石油輸送	16	1.6	3,900
福山通運	84	87	59,856
セイノーホールディングス	98.4	101.3	136,248
神奈川中央交通	16	17	12,325
日立物流	28.9	29.7	71,933
丸和運輸機関	4.1	3.6	10,418

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
C&Fロジホールディングス	13.3	14.8	20,868
九州旅客鉄道	—	106.4	325,584
<b>海運業 (0.2%)</b>			
日本郵船	1,246	1,206	273,762
商船三井	676	749	246,421
川崎汽船	607	541	146,070
N Sユナイテッド海運	62	64	13,440
明治海運	12.4	12.8	5,657
飯野海運	71.8	73.9	35,028
共栄タンカー	12	12	2,640
乾汽船	11	10.4	9,848
<b>空運業 (0.6%)</b>			
日本航空	265.7	257.3	903,123
ANAホールディングス	2,576	2,650	854,095
バスコ	13	13	4,992
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
トランコム	4	4.1	23,370
日新	57	58	21,344
三菱倉庫	99	94	156,698
三井倉庫ホールディングス	80	83	29,299
住友倉庫	101	104	63,752
滋澤倉庫	36	37	12,876
東陽倉庫	24	24.4	7,393
日本トランスシティ	32	33	13,992
ケイヒン	25	26	3,952
中央倉庫	8	8.2	8,782
安田倉庫	10.8	11.1	8,558
東洋埠頭	40	41	7,626
宇徳	11.2	11.6	4,895
上組	166	170	190,060
サンリツ	3.4	3.5	1,834
キムラユニティ	3.5	3.6	4,262
キユーソー流通システム	3.8	4.5	10,935
郵船ロジスティクス	12.7	13.1	16,650
近鉄エクスプレス	24.8	25.5	43,630
東海運	7.5	7.7	3,380
ユーアイティ	8.5	8.8	9,266
内外トランスライン	4.6	4.3	5,108
<b>情報・通信業 (7.7%)</b>			
NECネットエスアイ	17.2	15.4	32,802

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
システナ	13.4	11.2	18,726
デジタルアーツ	6.7	6.3	15,983
新日鉄住金ソリューションズ	22.8	23.5	48,997
キューブシステム	5.9	6.1	4,123
コア	5.8	5.9	6,767
ソフトクリエイトホールディングス	6.5	6.7	9,232
T I S	45.4	46.7	115,816
ネオス	4.1	4.2	1,827
電算システム	4.8	4.9	9,295
グリー	83.1	85.6	53,414
コーエーテクモホールディングス	32.5	33.4	67,301
三菱総合研究所	5.3	5.5	17,902
ボルテージ	2.7	2.8	3,068
電算	1.5	1.6	3,561
AGS	3.1	3.5	4,749
ファインデックス	9	10.4	9,141
ヒト・コミュニケーションズ	3.1	3.2	4,681
ブレインパッド	2	2.1	2,129
KL a b	21.2	26.9	17,485
ポールトゥウィン・ビットクルーホールディ	9	10.1	10,221
イーブックイニシアティブジャパン	3	2.2	1,900
ネクソン	131.3	155	265,515
アイスタイル	20.9	21.5	16,920
エムアップ	3.5	4	2,372
エイチーム	7.5	7.8	17,269
テクノスジャパン	4	10.8	12,171
e n i s h	4	4.1	1,939
コプロラ	38.1	39.2	38,180
モバイルクリエイト	9	9.2	3,422
オルトプラス	5	5.8	3,300
ブロードリーフ	13.7	34.8	22,515
ハーツユナイテッドグループ	4.1	7.4	11,403
メディアドゥ	2.9	3	4,182
ブイキューブ	9	7.7	4,820
サイバーリンクス	2.1	2.1	2,242
ディー・エル・イー	3.8	4.1	2,496
VOYAGE GROUP	4.6	4.8	5,116
オブティム	1.1	1.5	7,432
バリサーブ	1.6	1.6	4,673
ティーガイア	13.6	14	26,544

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本アジアグループ	15.5	15.9	6,805
豆蔵ホールディングス	10.8	10.3	9,506
テクマトリックス	5.9	4.4	8,685
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	319.1	295.4	72,373
GMOペイメントゲートウェイ	11.2	11.5	53,647
ザッパラス	7.6	7.9	3,365
インターネットイニシアティブ	22.1	20.7	36,390
さくらインターネット	9	10.8	10,162
GMOクラウド	3	3.1	3,806
SRAホールディングス	7.9	7.4	18,951
Minorisソリューションズ	2.7	3.1	3,258
システムインテグレータ	1.9	2	1,274
朝日ネット	12.4	12.8	6,156
アドソル日進	—	2.8	3,144
フリービット	—	7.8	6,169
コムチュア	2.3	2.4	7,716
サイバーコム	1.6	1.9	1,577
gumi	14.1	14.6	11,753
PCIホールディングス	—	1.6	3,904
パイブドHD	1.7	2.5	2,827
LINE	—	23.5	95,762
ソルクシーズ	—	4	2,268
フェイス	3.6	3.7	4,521
ハイマックス	1.8	1.9	2,555
野村総合研究所	96	95.8	378,410
サイバネットシステム	11.2	11.5	7,417
CEホールディングス	2.1	2.1	2,284
インテージホールディングス	7.2	8	15,912
東邦システムサイエンス	4	4.6	2,934
ソースネクスト	6.8	8.4	4,737
ティー・ワイ・オー	26.9	27.7	4,155
フォーカスシステムズ	5.3	5.4	2,543
クレスコ	3.1	3.2	7,388
フジ・メディア・ホールディングス	142.6	146.7	243,375
オービック	47.2	48.6	244,944
ジャストシステム	24.9	22.8	23,871
TDCソフトウェアエンジニアリング	6	6.1	6,825
ヤフー	981.8	1,009.9	451,425
トレンドマイクロ	66.5	74.6	319,288
インフォメーション・ディベロップメント	2.6	2.7	4,228

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	22.6	130,854
アルファシステムズ	4.5	4.6	8,519
フューチャー	16.4	19	13,680
CAC Holdings	10.2	10.5	9,817
ソフトバンク・テクノロジー	3.7	3.3	10,180
トーセ	3.7	3.8	3,036
オービックビジネスコンサルタント	7	7.2	36,432
伊藤忠テクノソリューションズ	31	31.9	95,636
アイティフォー	17.8	18.3	11,400
東計電算	2.4	2.5	5,527
エクスネット	1.2	1.3	2,200
大塚商会	36.8	37.9	211,103
サイボウズ	18.2	18.7	8,620
ソフトブレーン	20	19.2	7,257
電通国際情報サービス	8.4	8.7	15,964
デジタルガレージ	—	22	43,582
EMシステムズ	4.6	4.8	7,617
ウエザーニューズ	4.6	4.7	16,896
C I J	12.4	12.8	6,796
東洋ビジネスエンジニアリング	1.4	1.4	2,136
日本エンタープライズ	14	14.4	3,960
WOWOW	6.5	6.7	22,646
スカラ	8.5	8.8	8,694
日本コロムビア	4.7	4.2	2,620
イマジカ・ロボット ホールディングス	11.5	11.8	7,516
ネットワンシステムズ	59.3	61	45,567
システムソフト	—	24.8	3,645
アルゴグラフィックス	6.2	6.4	14,662
マーベラス	23.1	23.8	18,302
エイベックス・グループ・ホールディングス	25.2	25.9	45,195
日本ユニシス	37.8	38.9	56,677
兼松エレクトロニクス	8.6	8.9	22,098
東京放送ホールディングス	82.1	92.9	175,302
日本テレビホールディングス	125.1	128.6	275,075
朝日放送	13.5	13.9	9,771
テレビ朝日ホールディングス	37.4	38.5	87,587
スカパー J SATホールディングス	104	91.7	50,343
テレビ東京ホールディングス	12.4	11.5	26,806
日本BS放送	3.1	3.2	3,478
U-NEXT	4.2	3.6	1,926

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ワイヤレスゲート	4	4.9	8,281
コネクシオ	12	12.4	18,476
日本通信	97	117.8	19,908
クロップス	2.5	3	1,641
日本電信電話	1,058.8	1,131.1	5,636,271
KDD I	1,391.6	1,394	4,211,274
光通信	16.5	16.9	185,562
NTTドコモ	1,023.6	1,052.9	2,874,417
エムティーアイ	20.8	21.5	15,480
GMOインターネット	50	51.4	76,072
カドカワ	42.8	40.9	68,875
学研ホールディングス	46	47	15,040
ゼンリン	18.1	18.6	36,009
昭文社	7.5	7.7	5,035
インプレスホールディングス	11.3	11.6	1,647
アイネット	7.6	7.9	8,405
松竹	90	93	118,482
東宝	97.7	92.2	302,416
東映	51	52	51,948
AOI Pro.	6.9	6.5	5,622
エス・ティ・ティ・データ	84.6	87	510,690
ビー・シー・エー	1.7	2	2,708
ビジネスブレイン太田昭和	2.1	2.4	2,392
DTS	15.2	14.5	37,018
スクウェア・エニックス・ホールディングス	58	54.2	160,052
シーイーシー	8.9	8.3	14,010
カプコン	35	33	87,813
アイ・エス・ビー	2.2	2.7	2,548
ジャステック	8.7	8.9	9,451
SCSK	32.6	38.3	157,987
日本システムウエア	5.1	4.6	6,509
アイネス	19.4	17.7	22,036
TKC	12.7	13	39,975
富士ソフト	20.3	20.9	58,331
NSD	29.1	29.9	54,537
コナミホールディングス	61.8	63.6	285,564
福井コンピュータホールディングス	4	4.1	10,541
JBCホールディングス	11.4	11.8	8,897
ミロク情報サービス	10.1	10.4	17,607
ソフトバンクグループ	776.1	634.3	5,019,850

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
卸売業 (4.4%)			
ハウスイ	11	11	1,397
高千穂交易	5.3	5.4	5,383
伊藤忠食品	3.4	3.5	15,102
エレマテック	6.4	5.6	10,567
JALUX	4.4	4.5	8,721
あらた	6.2	6.3	15,939
トーマンデバイス	2.1	2.1	4,260
東京エレクトロン デバイス	5	5.1	8,063
フィールズ	12	10.8	15,098
双日	862.9	832.2	243,002
アルフレッサ ホールディングス	172.2	166.7	319,230
横浜冷凍	33.9	34.9	36,051
神栄	19	19	3,458
山下医科器械	1.1	1.1	1,918
ラサ商事	6.4	6	3,756
ラクーン	5.9	6.1	2,799
アルコニックス	7.8	8	13,848
神戸物産	8.8	7.6	28,918
あい ホールディングス	24.4	25.1	57,704
ディーブイエックス	4.9	5	6,840
ダイワボウホールディングス	125	120	35,280
マクニカ・富士エレホールディングス	24.7	26.1	39,489
パイトルケーエスケー・ホールディングス	23.7	26.5	26,102
八洲電機	10.6	10.9	6,561
UKCホールディングス	8.8	9	19,422
OCHIホールディングス	4	4.1	4,915
TOKAIホールディングス	60.2	61.9	48,901
大阪工機	—	1.6	1,166
三洋貿易	7.5	7.7	12,173
ビューティガレージ	—	1.2	1,281
ウイン・パートナーズ	4.9	5.1	10,694
ミタチ産業	3.5	3.6	2,246
シツヘルスケアホールディングス	27.8	27	80,487
明治電機工業	4.3	4.8	5,832
デリカフーズ	2.9	3	3,003
スターティア	2.6	3.2	1,664
コマダホールディングス	—	19	34,713
富士興産	5.3	5	2,255
協栄産業	18	17	2,601

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
小野建	11.9	12.2	16,823
佐鳥電機	10.8	11.1	8,069
エコートレーディング	3.1	3.2	2,150
伯東	10.4	9.6	9,926
コンドーテック	10.8	11.2	9,385
中山福	8.5	8.1	6,617
ナガイレーベン	19.8	20.3	51,480
三菱食品	15	15.5	53,397
松田産業	10	10.3	15,686
第一興商	24.2	22.9	103,393
メディバルホールディングス	137	140.9	254,465
アドヴァン	13.9	—	—
S P K	3.2	3	6,957
萩原電気	4.7	4.8	10,046
アズワン	10.7	11	53,460
スズデン	4.4	5	5,150
尾家産業	4.4	4.5	5,148
シモジマ	9.4	8.6	9,692
ドウシシャ	16.1	16.6	34,245
小津産業	3	3.1	6,522
高速	8.1	8.4	9,055
たけびし	4.8	4.9	5,816
黒田電気	25.5	19.2	45,369
リックス	—	3.2	4,688
丸文	12.1	12.4	8,630
ハビネット	12.4	11.7	14,940
橋本総業ホールディングス	2.8	2.9	4,419
日本ライフライン	—	12	27,312
エクセル	6.7	6	8,940
マルカキカイ	4.4	4.5	7,128
I D O M	36.9	37.9	25,430
日本エム・ディ・エム	11.4	10.6	8,533
進和	8.1	8.3	14,267
エスケイジャパン	3.3	2.6	803
ダイトエレクトロン	6.2	6.4	6,272
シークス	8.7	10.1	40,349
田中商事	4.2	4.3	3,014
オーハシテクニカ	7.7	7.9	11,067
白銅	3.9	3.5	5,033
伊藤忠商事	1,074.9	1,032	1,643,460

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丸紅	1,348.1	1,386.8	945,520
高島	26	24	4,584
長瀬産業	82.4	84.7	131,030
蝶理	8.7	9	15,642
豊田通商	152.6	157	482,775
三共生興	20.7	21.3	8,307
兼松	291	300	60,300
ツカモトコーポレーション	25	25	3,250
三井物産	1,238.7	1,274.2	2,113,897
日本紙パルプ商事	71	73	27,521
日立ハイテクノロジーズ	47.5	48.8	223,992
カメイ	17.8	18.3	22,746
東都水産	23	2.1	3,866
O U G ホールディングス	20	22	5,720
スターゼン	4.9	5.9	28,379
山善	52.6	54.1	53,559
椿本興業	15	16	5,568
住友商事	862.3	887	1,253,774
内田洋行	34	35	17,045
三菱商事	1,027.9	1,057.3	2,737,349
第一実業	31	32	21,248
キヤノンマーケティングジャパン	39.1	40.2	79,797
西華産業	44	45	15,705
佐藤商事	12.2	12.6	10,987
菱洋エレクトロ	15.5	13.5	19,332
東京産業	13.6	14	6,860
ユアサ商事	13	13.3	39,567
神鋼商事	31	3.5	8,659
小林産業	9.1	10.2	2,631
阪和興業	137	141	108,711
カナデン	13.1	13.4	14,070
菱電商事	22	22	16,346
フルサト工業	7.5	7.8	13,049
岩谷産業	162	156	98,592
すてきなリスグループ	58	60	9,120
昭光通商	49	50	5,000
ニチモウ	21	20	3,480
極東貿易	20	22	5,170
イワキ	21	21	4,599
三愛石油	33.7	37.8	33,150

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
稲畑産業	32.8	33.8	43,940
G S Iクレオス	36	34	4,318
明和産業	12.6	13	5,239
ワキタ	29.1	30	29,310
東邦ホールディングス	43.8	45.1	104,406
サンゲツ	47.7	48.3	98,676
ミツウロコグループホールディングス	22	22.7	16,434
シナネンホールディングス	29	6	12,672
伊藤忠エネクス	35.3	31.1	29,109
サンリオ	42.2	43.4	98,127
サンワテクノス	8.7	8.3	7,918
リョーサン	21.7	20.9	73,150
新光商事	16.1	15.4	18,834
トーホー	6.2	6.3	16,014
三信電気	18.9	15.6	17,144
東陽テクニカ	18.2	18.7	19,298
モスフードサービス	17.9	18.4	64,492
加賀電子	12.4	12.7	24,015
ソーダニッカ	14.1	14.5	7,453
立花エレテック	10.1	9.5	12,806
フォーバル	7.2	6.1	4,355
PAL TAC	21.9	22.5	61,942
三谷産業	14.5	14.9	5,185
太平洋興発	57	59	5,959
ヤマタネ	64	7	11,284
丸紅建材リース	12	14	3,122
日鉄住金物産	120	12.4	56,854
トラスコ中山	15.6	16.1	78,890
オートバックスセブン	52.5	52.2	92,237
加藤産業	21.4	22	59,950
イノテック	12.6	12.1	6,884
イエローハット	12.9	13.3	32,797
J Kホールディングス	13.7	14.1	8,445
日伝	5.7	5.8	18,328
北沢産業	11.3	11.6	2,169
杉本商事	7.9	8.1	11,971
因幡電機産業	19.2	19.8	79,794
バイテックホールディングス	5.6	5.7	7,142
ミスミグループ本社	153.8	158.4	306,187
アルテック	11.7	12	2,400

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タキヒヨー	23	21	9,534
蔵王産業	2.2	2.3	3,252
スズケン	62.4	64.1	241,016
ジェコス	9.4	9.7	10,146
ルネサスイーストン	11.4	12.9	6,695
<b>小売業 (4.8%)</b>			
ローソン	51.9	48.9	403,914
サンエー	9.3	10.6	59,360
ダイユーエイト	3.6	—	—
カワチ薬品	10.6	10.9	31,348
エービーシー・マート	17.8	25.6	169,216
ハードオフコーポレーション	6.6	6.2	7,489
アスクル	16.7	17.1	71,734
ゲオホールディングス	22.9	23.5	32,430
アダストリア	25.2	21.6	73,332
ジーフット	8.2	8.5	6,706
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	20	1.8	1,267
くらコーポレーション	8	9.2	44,712
キャンドウ	7.2	7.4	13,009
バルグループホールディングス	8	7.2	20,592
エディオン	57.9	54.6	62,244
サーラコーポレーション	11.7	17.6	11,510
ワッツ	5.9	6	6,540
ハローズ	4.5	4.6	10,994
あみやき亭	2.7	2.7	10,584
ひらまつ	18.9	19.4	12,978
ゲンキー	2.7	2.8	15,372
サッポロドラッグストアー	1.8	—	—
大黒天物産	3.3	3.4	17,340
ハニーズ	12	12.4	15,004
ファーマライズホールディングス	3.1	3.2	1,680
アルペン	12.2	12.6	27,556
クオール	13.9	15.9	22,260
ジェイアイエヌ	9.3	9.6	50,304
ビックカメラ	78.6	80.9	87,291
DCMホールディングス	67.3	85.5	85,756
Monotaro	48.4	49.8	118,573
東京一番フーズ	3.4	3.5	1,914
ダイヤモンドダイニング	2.9	3.1	3,716
きちり	3.6	3.7	2,538

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アーランドサービスホールディングス	4.3	4.4	13,037
J. フロント リテイリング	173.3	178.3	302,040
ドトール・日レスホールディングス	24	24.7	53,105
マツモトキヨシホールディングス	28.3	26.6	155,610
ブロンコピリー	7.1	7.3	21,936
スタートトゥデイ	41.7	128.6	253,342
トレジャー・ファクトリー	3.9	4	3,524
物語コーポレーション	3.6	3.7	15,614
ココカラファイン	14.3	14.7	64,018
三越伊勢丹ホールディングス	272.4	280.3	366,912
H a m e e	—	2.1	1,967
ウエルシアホールディングス	11.9	13.9	98,412
クリエイトSDホールディングス	20.2	20.7	52,474
丸善CH Iホールディングス	16	16.4	5,904
ミサワ	2.1	2.5	1,220
ティーライフ	—	1.3	1,748
エー・ピーカンパニー	2.2	2.3	1,674
チムニー	3.3	4.3	12,577
シュッピン	5.2	5.3	7,478
ネクステージ	2.2	2.7	5,340
ジョイフル本田	22.2	22.9	73,967
鳥貴族	3.4	3.5	8,487
キリン堂ホールディングス	4.4	4.5	3,820
ホットランド	4.7	6.5	8,092
すかいらく	41.9	60.4	96,640
綿半ホールディングス	5.1	5.7	9,370
ヨシックス	—	1.4	1,856
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	45.4	46.7	45,812
ブックオフコーポレーション	7.8	8	6,352
ゴルフダイジェスト・オンライン	3.8	5.6	5,056
BEENOS	—	1.6	2,384
あさひ	10.2	10.5	13,618
日本調剤	3.5	5	22,625
コスモス薬品	6.9	7.1	151,798
トーエル	6.6	6.8	6,337
一六堂	3.3	3	1,068
オンリー	—	1.6	1,262
セブン&アイ・ホールディングス	573	589.7	2,680,776
薬王堂	2.6	7	15,176
クリエイト・レストランツ・ホールディング	36.7	37.8	38,140

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ツルハホールディングス	31.5	32.5	368,225
サンマルクホールディングス	10.8	9.1	32,168
フェリシモ	3.9	4	4,116
トリドールホールディングス	16.8	17.3	42,021
クスリのアオキ	12.2	—	—
サツドラホールディングス	—	1.9	3,718
ダイユー・リックホールディングス	—	4.5	3,123
クスリのアオキホールディングス	—	12.5	66,625
メディカルシステムネットワーク	15.5	15.9	6,884
総合メディカル	6.6	6.8	28,526
はるやま商事	5.7	6.6	5,616
ノジマ	—	16.3	21,157
カップ・クリエイト	19.2	19.7	25,334
ライトオン	10.2	10.5	11,130
ジーンズメイト	4.4	4.5	855
良品計画	15.7	18.7	427,856
三城ホールディングス	16.9	17.4	7,934
アドヴァン	—	14.3	17,131
アルビス	3.6	3.7	12,302
コナカ	17.4	17.9	10,131
ハウス オブ ローゼ	1.7	1.7	2,604
G-7ホールディングス	4	4.1	5,990
イオン北海道	9.2	14.1	8,248
コジマ	20.1	20.7	6,003
ヒマラヤ	4.2	4.4	3,731
コーナン商事	19.4	20	45,480
エコス	5.3	5.4	6,615
ワタミ	16.2	16.6	18,226
マルシェ	3.3	3.1	2,554
ドンキホーテホールディングス	88.6	91.1	399,929
西松屋チェーン	27	24.7	35,642
ゼンショーホールディングス	70.4	73	139,211
幸楽苑ホールディングス	8.6	8.9	14,560
ハークスレイ	3.8	3.4	3,695
サイゼリヤ	22.5	23.2	61,897
V Tホールディングス	46.3	47.6	27,893
魚力	4.3	4.4	5,557
ポプラ	3.4	3.5	1,746
フジ・コーポレーション	—	2.1	4,781
ユナイテッドアローズ	19.5	18.8	64,484

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ハイデイ日高	12.5	12.8	34,739
京都きもの友禅	9.4	8.9	8,383
コロワイド	45.4	46.7	88,309
ピーシーデポコーポレーション	15.1	18.7	11,743
老番屋	12.4	12.7	48,006
トップカルチャー	4.9	5.1	2,458
P L A N T	3.1	3.2	3,808
スギホールディングス	24.6	30.9	171,804
スクロール	20.7	21.3	7,518
ヨンドシーホールディングス	10.4	10.7	25,958
ユニー・ファミリーマートホールディングス	42.1	61.8	483,276
木曽路	16.8	17.2	40,557
サトレストランシシステムズ	16.1	16.6	13,512
千趣会	27	25.5	18,717
タカキュー	10.5	10.8	2,062
ケーヨー	23.1	23.7	13,106
上新電機	32	33	32,274
日本瓦斯	20.9	25.8	87,333
ベスト電器	44.1	45.4	7,218
ロイヤルホールディングス	22.7	23.3	46,250
東天紅	10	11	1,661
いなげや	15.2	15.7	23,110
島忠	35.4	36.4	114,660
チヨダ	16.1	16.6	45,948
ライフコーポレーション	8.6	10.7	35,952
リンガーハット	12.4	15.9	35,536
さが美	11	13	1,599
M r M a x	11.9	17.6	7,462
テンアライド	12.6	13	4,901
A O K I ホールディングス	31.3	28.1	41,082
オークワ	21	20	23,860
コメリ	21.1	21.7	59,132
青山商事	26.3	29.5	121,245
しまむら	15.9	16.4	233,372
はせがわ	6.4	7.4	3,278
高島屋	199	236	245,676
松屋	27.6	30.7	33,340
エイチ・ツー・オー リテイリング	70.1	72.2	132,992
近鉄百貨店	52	54	19,062
丸栄	28	29	2,610

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ニッセンホールディングス	20.1	—	—
バルコ	13.1	13.5	14,013
丸井グループ	168.1	148.2	261,721
アクシアル リテイリング	10.6	10.9	43,600
井筒屋	74	7.6	3,055
イオン	563.6	579.8	989,138
ユニーグループ・ホールディングス	131.2	—	—
イズミ	27.2	28	141,960
東武ストア	16	1.7	4,797
平和堂	27.8	28.5	72,618
フジ	15.2	15.6	38,017
ヤオコー	15.5	16	73,760
ゼビオホールディングス	18.6	19.1	35,411
ケーズホールディングス	57.9	64.9	136,354
O l y m p i c グループ	8.1	8.3	5,104
日産東京販売ホールディングス	23	20.7	6,975
アインホールディングス	16.5	17	129,540
元気寿司	3.8	3.5	7,350
ヤマダ電機	416.5	471.3	300,218
アークランドサカモト	23.2	23.8	33,534
ニトリホールディングス	59.2	60.9	791,091
グルメ軒屋	10	10	10,000
愛眼	10.9	10.3	2,039
ケーユーホールディングス	7.1	7.3	6,015
吉野家ホールディングス	50.5	49.1	77,381
松屋フーズ	6.6	6.8	25,704
サガミチェーン	18.3	17.6	22,580
関西スーパーマーケット	11.1	11.5	17,342
王将フードサービス	10	10.3	44,702
ブレナス	15.3	15.7	35,780
ミニストップ	10.1	10.4	21,528
アークス	25.6	26.4	69,828
パローホールディングス	29.5	30.3	93,021
藤久	1.1	1.1	1,918
ベルク	6.7	6.2	28,458
大庄	7.3	7.5	11,685
ファーストリテイリング	22.9	23.5	1,021,780
サンドラッグ	28.9	26.8	216,812
サックスパー ホールディングス	12.9	13.2	15,760
ヤマザワ	2.8	2.9	5,133

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
やまや	2.8	2.9	5,034
ペルーナ	34.1	35.1	25,201
<b>銀行業 (8.7%)</b>			
島根銀行	2.9	3	4,113
じもとホールディングス	98.3	101.1	20,725
めぶきフィナンシャルグループ	100.5	679.5	297,621
東京TYフィナンシャルグループ	18.9	20.4	88,128
九州フィナンシャルグループ	209.7	231.1	188,808
ゆうちょ銀行	351	399	573,762
富山第一銀行	34.8	35.8	19,761
コンコルディア・フィナンシャルグループ	954.3	922.5	528,131
西日本フィナンシャルホールディングス	—	95.5	117,178
新生銀行	1,185	1,341	272,223
あおぞら銀行	867	891	377,784
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,990.9	10,677.7	7,958,089
りそなホールディングス	1,602.5	1,648.4	1,015,414
三井住友トラスト・ホールディングス	2,860	294.2	1,314,485
三井住友フィナンシャルグループ	1,096.9	1,128.3	5,193,564
第四銀行	173	173	92,036
北越銀行	148	15.2	40,356
西日本シティ銀行	446	—	—
千葉銀行	528	543	394,761
常陽銀行	495	—	—
群馬銀行	304	313.1	206,019
武蔵野銀行	21.9	22.5	78,862
千葉興業銀行	37.5	38.6	23,391
筑波銀行	56.9	58.6	20,920
七十七銀行	215	221	129,506
青森銀行	99	109	42,946
秋田銀行	89	92	35,144
山形銀行	77	79	39,026
岩手銀行	9.6	9.2	44,344
東邦銀行	122	126	55,944
東北銀行	70	72	11,088
みちのく銀行	68	70	15,610
ふくおかフィナンシャルグループ	593	572	307,736
静岡銀行	401	383	388,745
十六銀行	172	189	79,002
スルガ銀行	130.1	144.1	380,279
八十二銀行	247.8	271.9	191,417

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
山梨中央銀行	85	87	50,373
大垣共立銀行	183	188	87,044
福井銀行	117	120	36,120
北國銀行	145	150	62,550
清水銀行	4.7	4.8	18,216
富山銀行	2.6	2.7	12,001
滋賀銀行	129	132	85,800
南都銀行	132	13.6	61,812
百五銀行	123	127	61,722
京都銀行	261	252	230,832
紀陽銀行	53.8	55.3	105,291
三重銀行	61	6.3	15,019
ほくほくフィナンシャルグループ	932	93.7	193,771
広島銀行	404	416	234,208
山陰合同銀行	82.3	84.7	84,107
中国銀行	97.1	99.9	170,629
鳥取銀行	44	4.5	8,523
伊予銀行	146.5	150.7	127,944
百十四銀行	150	155	62,620
四国銀行	106	109	31,501
阿波銀行	110	120	86,040
大分銀行	79	81	36,369
宮崎銀行	91	94	34,122
佐賀銀行	83	85	25,755
十八銀行	84	87	31,059
沖縄銀行	10.4	13.7	58,567
琉球銀行	28.2	29	45,472
セブン銀行	513.3	528.2	180,116
みずほフィナンシャルグループ	19,420.1	19,131.1	4,155,274
高知銀行	53	51	6,732
山口フィナンシャルグループ	128	132	171,072
長野銀行	45	4.6	9,338
名古屋銀行	115	11.8	50,209
北洋銀行	206.4	230	114,540
愛知銀行	4.6	4.7	32,336
第三銀行	77	8	14,848
中京銀行	56	5.8	13,537
大光銀行	48	50	13,600
愛媛銀行	81	16.6	23,007
トマト銀行	53	5.4	8,834

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
みなと銀行	124	12.8	27,161
京葉銀行	113	115	61,410
関西アーバン銀行	19.1	19.6	29,380
栃木銀行	71	77.7	45,299
北日本銀行	4.3	4.4	13,552
東和銀行	256	264	30,360
福島銀行	169	153	14,994
大東銀行	82	73	12,410
トモニホールディングス	105.1	116.1	72,678
フィデアホールディングス	111.8	136.7	29,663
池田泉州ホールディングス	145.3	149.5	82,972
<b>証券、商品先物取引業 (1.3%)</b>			
F P G	48.8	50.2	48,342
S B I ホールディングス	164.5	159.3	243,729
日本アジア投資	9.3	13.4	7,611
ジャフコ	22.9	23.5	91,180
大和証券グループ本社	1,282	1,318	984,414
野村ホールディングス	2,635.7	2,880.7	2,069,206
岡三証券グループ	117	120	88,200
丸三証券	40.7	44.8	45,516
東洋証券	53	50	14,150
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	157.2	161.7	103,973
光世証券	33	34	7,072
水戸証券	42.4	43.6	14,736
いちよし証券	30.6	31.5	29,389
松井証券	67	80.5	83,156
だいちこう証券ビジネス	6.6	6.8	4,399
マネックスグループ	159.2	151.1	50,467
カブドットコム証券	116.8	105.1	43,406
極東証券	18.4	18.9	33,642
岩井コスモホールディングス	12.9	13.3	15,148
藍澤證券	25.6	26.3	17,515
マネースクウェアHD	4.7	1	1,242
マネーパートナーズグループ	12.7	18	9,810
小林洋行	3.9	4	1,112
<b>保険業 (2.6%)</b>			
かんぽ生命保険	55.7	53.2	136,564
S O M P Oホールディングス	304.3	294.6	1,181,935
アニコム ホールディングス	9.3	9.5	21,736
MS&ADインシュアランスグループホール	409.4	421.1	1,539,541

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソニーフィナンシャルホールディングス	131.2	135	250,425
第一生命ホールディングス	877.7	849.7	1,667,111
東京海上ホールディングス	555	570.9	2,804,831
T & Dホールディングス	499.3	513.6	794,539
アドバンスクリエイト	—	3.3	5,923
<b>その他金融業 (1.3%)</b>			
全国保証	35.6	39.7	146,691
クレディセゾン	103.9	106.9	228,552
アクリーティブ	11.2	11.6	5,579
芙蓉総合リース	15.7	16.1	91,770
興銀リース	25.7	26.5	69,854
東京センチュリー	32.2	28.4	114,736
日本証券金融	60.3	62.1	40,613
アイフル	229.4	236.3	82,705
ポケットカード	13.7	10.5	5,817
リコーリース	10.8	11.1	40,681
イオンフィナンシャルサービス	89.9	90	194,580
アコム	275.2	283	146,311
ジャックス	76	78	41,652
オリエントコーポレーション	592.3	304.7	66,424
日立キャピタル	32.3	33.2	97,674
アブラスフィナンシャル	65.7	67.6	8,382
オリックス	970	997.8	1,848,923
三菱UFJリース	347.5	357.4	216,941
日本取引所グループ	402.3	438.1	750,903
イー・ギャランティ	4.5	4.1	10,024
アサックス	2.4	2.4	3,890
NECキャピタルソリューション	5.6	5.7	10,516
<b>不動産業 (2.6%)</b>			
いちご	151.6	133.8	58,470
日本駐車場開発	164.7	169.8	28,356
ヒューリック	285.6	293.8	314,072
三栄建築設計	5.5	5.6	9,402
野村不動産ホールディングス	90.9	93.5	188,122
三重交通グループホールディングス	24.3	25	9,800
サムティ	9.9	11.3	12,531
ディア・ライフ	9.3	9.5	3,600
エー・ディー・ワークス	125.4	129	5,676
日本商業開発	6	7.8	15,529
プレサンスコーポレーション	4.6	21.9	32,214

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユニゾホールディングス	8.5	11.6	36,076
THE グローバル社	—	4.9	2,263
日本管理センター	9	10.1	13,635
サンセイランディック	3.1	2.9	2,067
エストラスト	2.4	2.5	1,542
フージャースホールディングス	19	18.2	11,284
オープンハウス	19.8	20.4	59,078
東急不動産ホールディングス	331.4	340.9	240,334
飯田グループホールディングス	126.9	117.5	265,080
ムゲンエステート	2	4.9	3,743
ファーストブラザーズ	—	1.4	2,433
シーアールイー	—	2	3,080
パーク 2 4	69.2	71.4	221,697
バラカ	3.9	4	7,952
三井不動産	726	747	2,054,623
三菱地所	1,019	1,048	2,472,232
平和不動産	25.9	26.6	43,969
東京建物	149.6	163.5	261,763
ダイビル	35.2	36.3	36,808
京阪神ビルディング	22.7	23.3	14,306
住友不動産	328	338	1,087,346
大京	254	262	62,618
テーオーシー	53.1	54.6	50,778
東京楽天地	22	23	11,914
レオパレス 2 1	161.4	177.8	111,302
スターツコーポレーション	15.7	14.4	28,454
フジ住宅	17.5	18	13,464
空港施設	16.6	17	9,656
明和地所	7.5	7.7	5,366
住友不動産販売	9.9	12.7	36,182
ゴールドクレスト	10.8	12.7	27,470
日本エスリード	5.3	5.5	7,452
日神不動産	18.2	16.7	9,201
日本エスコン	—	18.8	8,121
タカラレーベン	59.7	61.4	41,690
サンヨーハウジング名古屋	7.1	7.3	7,876
イオンモール	88.4	90.7	155,278
ファースト住建	5.1	5.2	7,794
トーセイ	20.8	19.3	17,119
穴吹興産	15	15	3,870

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・ティ・ティ都市開発	85.1	87.5	94,500
サンフロンティア不動産	16.6	15.2	15,777
エフ・ジェー・ネクスト	11.9	12.3	9,052
インテリックス	—	2.9	2,134
ランドビジネス	8.1	8.3	2,232
グランディハウス	12	12.3	4,932
日本空港ビルデング	43.7	44.9	199,356
<b>サービス業 (3.6%)</b>			
日本工営	49	50	25,800
ネクスト	41	36.9	28,191
ジェイエイシーリクルートメント	8.9	9.2	11,665
日本M&Aセンター	22.4	43	135,235
ノバレーゼ	3.7	—	—
アコーディア・ゴルフ	40.2	45.1	54,255
中広	1.4	1.4	971
タケエイ	12.7	13.1	11,632
トラスト・テック	5.8	6	10,044
パソナグループ	12.6	12.9	9,868
CDS	3.3	3.4	3,546
リンクアンドモチベーション	29.2	35.1	14,461
GCA	12.8	13.2	11,919
エス・エム・エス	18.1	20.4	52,570
テンブホールディングス	101.6	115.3	203,389
リニカル	8.5	8.8	10,700
クックパッド	32.3	33.3	36,197
エスクリ	6.2	5.3	3,227
アイ・ケイ・ケイ	7.7	6.6	4,349
学情	5.4	6.2	7,309
スタジオアリス	6.7	6.1	13,871
シミックホールディングス	7.3	7.5	11,145
N J S	2.9	3.3	4,629
総合警備保障	48.4	54.3	244,350
カカココム	104.1	106.4	203,756
ルネサンス	7.4	7.6	10,951
ディップ	16	19.2	45,523
オプトホールディング	9	10.7	7,778
新日本科学	13.7	16.6	9,428
ツクイ	17.2	35.3	26,086
キャリアデザインセンター	3	3.1	3,763
エムスリー	125.5	129.2	362,793

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ツカダ・グローバルホールディング	10.5	10.9	7,880
アウトソーシング	6.8	8.5	27,072
ウェルネット	5.4	11.2	14,280
ワールドホールディングス	—	3.4	7,425
ディー・エヌ・エー	65	66.9	167,785
博報堂DYホールディングス	200.9	206.7	293,307
ぐるなび	16.8	21.6	49,204
エスアールジータカミヤ	15.6	16.1	9,724
ジャパンベストレスキューシステム	17.9	18.5	4,495
ファンコムコミュニケーションズ	33.4	37.9	27,818
ライク	3	3.1	5,716
WDBホールディングス	5.2	5.3	6,402
ティア	7	7.2	4,536
バリューコマース	13.4	13.8	4,512
インフォマート	28	31.6	41,332
J Pホールディングス	36	42.8	10,999
E P Sホールディングス	18	18.5	24,457
レグス	2.8	3.4	3,002
プレステージ・インターナショナル	12.2	21.1	15,888
アミューズ	8	8.3	15,081
ドリームインキュベータ	4.8	4.5	9,000
クイック	7.4	7.6	7,820
TAC	8	8.2	1,886
ケネディクス	194.6	200.2	84,684
電通	161.6	166.2	930,720
テイクアンドグヴィ・ニース	6.8	6.9	4,995
びあ	4.4	4.5	13,135
イオンファンタジー	5.1	4.4	13,508
シーティーエス	4.3	4	4,876
ネクシィーズグループ	5.2	5.4	7,884
みらかホールディングス	37	38.1	195,453
アルプス技研	5.3	6	14,988
ダイオーズ	2.6	2.7	2,937
日本空調サービス	12.7	14.3	8,594
オリエンタルランド	156.7	161.2	1,072,302
ダスキン	37.2	38.2	88,853
明光ネットワークジャパン	18	18.5	19,776
ファルコホールディングス	6.3	7	10,087
秀英予備校	2.6	3	1,212
田谷	2.4	2.5	1,577

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ラウンドワン	45.2	46.5	35,851
リゾートトラスト	60.8	57.7	124,516
ビー・エム・エル	8.5	19.5	53,137
ワタベウエディング	4.3	2.2	915
りらいあコミュニケーションズ	24	24.6	27,576
リソー教育	26.9	25.4	14,427
早稲田アカデミー	1.9	1.9	1,905
ユー・エス・エス	175.5	180.5	337,896
東京個別指導学院	7	4.8	3,662
サイバーエージェント	38.1	78.5	216,817
楽天	678.5	761.8	876,070
クリーク・アンド・リバー社	—	5.3	3,990
テー・オー・ダブリュー	11.6	11.9	7,889
セントラルスポーツ	4.9	5.1	13,810
フルキャストホールディングス	13.3	15.4	14,306
リソルホールディングス	14	15	4,905
テクノプロ・ホールディングス	23.5	24.2	90,266
アトラ	—	1.7	1,434
インターワークス	2.5	3	2,976
Ke e P e r 技研	1.6	1.6	3,000
ファーストロジック	0.8	0.8	1,669
デザインワン・ジャパン	—	1	2,238
イー・ガーディアン	—	4.8	6,038
リブセンス	9.7	10	4,370
ジャパンマテリアル	6	5.4	19,359
ベクトル	4.5	12	12,456
ウチヤマホールディングス	7.5	6.7	2,914
サクセスホールディングス	1.4	1.2	1,438
キャリアリンク	3.8	3.3	2,633
I B J	11.3	11.6	7,284
アサンテ	5.3	5.5	9,449
N・フィールド	6.8	7	9,723
M&Aキャピタルパートナーズ	1.8	1.9	5,291
ライドオン・エクスプレス	3.1	3.7	3,196
E R Iホールディングス	3.7	3.8	2,899
アビスト	2.2	2.3	7,176
ウィルグループ	3.3	5.9	3,516
エスクロー・エージェント・ジャパン	—	2.5	3,745
日本ビューホテル	2.1	2.1	3,120
リクルートホールディングス	292.3	325.8	1,495,422

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エラン	1.6	2	2,622
土木管理総合試験所	—	1.5	1,186
日本郵政	426.3	389.2	587,692
ベルシステム24ホールディングス	28.4	22.7	21,587
ソラスト	—	6.8	8,064
リログループ	5.4	5.6	88,144
東祥	4.3	3.2	16,928
エイチ・アイ・エス	23.6	24.3	73,264
ラックランド	2	2.6	5,311
共立メンテナンス	10.9	12.1	85,184
イチネンホールディングス	15.2	15.6	17,612
建設技術研究所	8.5	9.4	10,048
スペース	7.8	8	10,296
燦ホールディングス	2.9	3	4,692
スバル興業	10	11	5,423
東京テアトル	55	57	8,664
タナベ経営	—	2.9	3,717
ナガワ	2.6	2.7	11,826
よみうりランド	29	30	15,000
東京都競馬	99	102	28,356
常磐興産	53	5.5	8,574
カナモト	20.2	20.8	65,000
東京ドーム	116	59.5	69,734
西尾レントオール	11.7	12	42,480
トランス・コスモス	16.8	17.3	46,710
乃村工藝社	31	31.9	53,304
藤田観光	53	49	18,081

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
KNT-CTホールディングス	—	84	12,096
日本管財	12.4	12.8	22,950
トーカイ	6.4	6.6	25,971
白洋舎	15	1.4	3,788
セコム	150.8	155.1	1,330,447
セントラル警備保障	6.4	6.6	12,837
丹青社	27.1	25.8	21,233
メイテック	17.5	18	79,380
アサツー ディ・ケイ	25.4	24.3	71,004
応用地質	13.7	14.1	19,373
船井総研ホールディングス	20.2	19.2	34,291
進学会	6.9	6.2	3,552
オオバ	10.5	10.8	4,870
学究社	2.1	3.9	5,538
ベネッセホールディングス	48.6	50	163,000
イオンディライト	14	16.8	54,600
ナック	8.9	9.1	8,836
ニチイ学館	25.2	25.9	22,403
ダイセキ	27.2	26	58,760
ステップ	4.8	5	6,650
計	株数・金額 230,874	215,677	321,725,187
	銘柄数<比率>	1,940	1,974 <99.0%>

\*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、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 3,279	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(157,485,899千口)の内容です。

## 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			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	408	400	2,812	331,028	保険
AGCO CORP	63	63	362	42,695	機械
AGL RESOURCES INC	115	—	—	—	ガス
AES CORP	650	650	778	91,668	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AT & T INC	5,943	5,985	25,352	2,984,491	各種電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	1,426	1,440	5,506	648,232	ヘルスケア機器・用品
ABBVIE INC	1,559	1,582	9,721	1,144,402	バイオテクノロジー
ACTIVISION BLIZZARD INC	566	577	2,129	250,641	ソフトウェア
ACUITY BRANDS INC	41	43	1,008	118,766	電気設備
ADOBE SYSTEMS INC.	479	488	5,148	606,127	ソフトウェア
ADVANCE AUTO PARTS	71	71	1,233	145,225	専門小売り
AETNA INC	337	343	4,230	498,062	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	52	52	765	90,168	資本市場
AGILENT TECHNOLOGIES INC	318	312	1,436	169,098	ライフサイエンス・ツール/サービス
AIR PRODUCTS	198	199	2,932	345,186	化学
AKAMAI TECHNOLOGIES	167	166	1,126	132,628	インターネットソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	111	111	991	116,661	化学
ALCOA INC	1,250	—	—	—	金属・鋳業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	216	216	2,570	302,562	バイオテクノロジー
ALIGN TECHNOLOGY INC	—	71	700	82,503	ヘルスケア機器・用品
ALLEGHANY CORP	15	15	930	109,521	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	57	57	1,345	158,450	情報技術サービス
ALLIANT ENERGY CORP	216	229	863	101,604	電力
ALLSTATE CORP	367	362	2,694	317,223	保険
ALLY FINANCIAL INC	421	421	831	97,831	消費者金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	72	—	—	—	バイオテクノロジー
ALPHABET INC-CL C	300	300	23,908	2,814,486	インターネットソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A	282	286	23,293	2,742,157	インターネットソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	1,889	1,899	12,774	1,503,822	タバコ
AMAZON.COM INC	387	392	30,215	3,556,936	インターネット販売・通信販売
AMERCO	6	6	252	29,759	陸運・鉄道
AMEREN CORPORATION	231	242	1,257	147,996	総合公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	148	125	618	72,795	旅客航空輸送業
AMERICAN ELECTRIC POWER	475	480	3,014	354,855	電力
AMERICAN EXPRESS CO	793	769	5,792	681,846	消費者金融
AMERICAN INTL GROUP	1,113	1,039	6,925	815,325	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	171	178	1,295	152,546	水道
AMERISOURCEBERGEN CORP	188	182	1,435	168,936	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	164	157	1,772	208,680	資本市場
AMETEK INC	233	233	1,148	135,223	電気設備
AMGEN INC	726	727	10,626	1,250,958	バイオテクノロジー
AMPHENOL CORP-CL A	296	305	2,080	244,941	電子装置・機器・部品
ANADARKO PETE	495	536	3,792	446,417	石油・ガス・消耗燃料
ANALOG DEVICES INC	304	304	2,237	263,391	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	84	83	785	92,480	ソフトウェア
ANTERO RESOURCES CORP	147	147	359	42,344	石油・ガス・消耗燃料
ANTHEM INC	252	257	3,725	438,623	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
APACHE CORPORATION	369	366	2,439	287,121	石油・ガス・消耗燃料

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	
APPLE INC	5,362	5,245	61,397	7,227,769	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS	1,096	1,056	3,440	405,009	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	216	232	841	99,057	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND	577	567	2,615	307,905	食品
ARCONIC INC	—	436	874	102,910	航空宇宙・防衛
ARROW ELECTRS INC	89	89	643	75,780	電子装置・機器・部品
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	—	58	635	74,825	化学
ASHLAND INC	59	—	—	—	化学
ASSURANT INC	62	62	572	67,381	保険
ATMOS ENERGY CORP	97	105	779	91,802	ガス
AUTODESK INC.	199	199	1,505	177,172	ソフトウェア
AUTOLIV INC	85	84	948	111,631	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS	444	446	4,570	537,999	情報技術サービス
AUTONATION INC	71	71	351	41,406	専門小売り
AUTOZONE	29	28	2,290	269,616	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	87	87	622	73,299	容器・包装
AVNET	122	122	595	70,143	電子装置・機器・部品
BB&T CORPORATION	786	796	3,773	444,162	銀行
BAKER HUGHES	404	396	2,569	302,498	エネルギー設備・サービス
BALL CORP	130	158	1,205	141,934	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP	9,989	9,927	22,464	2,644,556	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,042	1,045	4,968	584,947	資本市場
BARD (C R)	70	72	1,594	187,731	ヘルスケア機器・用品
BAXTER INTERNATIONAL INC.	478	471	2,076	244,461	ヘルスケア機器・用品
B/E AEROSPACE INC	101	101	603	71,076	航空宇宙・防衛
BECTON, DICKINSON	204	205	3,417	402,287	ヘルスケア機器・用品
BED BATH & BEYOND	156	156	710	83,667	専門小売り
WR BERKLEY CORP	99	99	660	77,757	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,152	1,185	19,665	2,314,972	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	284	284	1,329	156,530	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	153	168	1,428	168,203	バイオテクノロジー
BIOGEN INC	211	212	6,016	708,213	バイオテクノロジー
BLACKROCK INC	119	119	4,694	552,673	資本市場
H & R BLOCK INC	224	224	519	61,203	各種消費者サービス
BOEING CO	609	576	9,070	1,067,820	航空宇宙・防衛
BORGWARNER INC	213	213	864	101,726	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,306	1,314	2,822	332,261	ヘルスケア機器・用品
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,614	1,623	9,525	1,121,328	医薬品
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	114	114	747	88,022	情報技術サービス
BROWN-FORMAN CORP-CL B	108	200	906	106,748	飲料
CBS CORP-CL B	409	396	2,559	301,286	メディア
CBRE GROUP INC	296	296	946	111,365	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC	128	128	773	91,071	ソフトウェア
CDW CORPORATION	141	140	741	87,282	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	229	229	661	77,908	化学
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	137	136	1,014	119,482	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP	249	251	3,440	405,010	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CIT GROUP INC	194	194	847	99,709	銀行
CME GROUP INC	327	331	4,011	472,220	資本市場
CMS ENERGY CORP	273	273	1,134	133,563	総合公益事業
CSX CORP	932	924	3,372	397,022	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	1,063	1,035	8,264	972,893	食品・生活必需品小売り
CA INC	309	309	1,002	117,965	ソフトウェア
CABOT OIL & GAS CORP	436	457	1,025	120,722	石油・ガス・消耗燃料

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	
CADENCE DESIGN SYS INC	291	291	750	88,313	ソフトウェア
CALPINE CORP	310	347	399	47,017	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CAMPBELL SOUP CO	195	191	1,150	135,379	食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	511	495	4,476	527,006	消費者金融
CARDINAL HEALTH INC	317	310	2,251	265,013	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARMAX INC	193	183	1,207	142,182	専門小売り
CARNIVAL CORP	403	348	1,847	217,491	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC DEL	563	572	5,366	631,744	機械
CELANESE CORP-SERIES A	143	143	1,162	136,860	化学
CELGENE CORP	756	753	8,723	1,026,931	バイオテクノロジー
CENTENE CORP	161	168	982	115,695	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	389	412	1,015	119,554	総合公益事業
CENTURYLINK INC	530	522	1,240	146,066	各種電気通信サービス
CERNER CORP	293	303	1,470	173,138	ヘルスケア・テクノロジー
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	208	210	6,121	720,665	メディア
CHENIERE ENERGY INC	195	195	806	94,966	石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP	1,819	1,835	21,636	2,547,047	石油・ガス・消耗燃料
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	29	29	1,149	135,262	ホテル・レストラン・レジャー
CHURCH & DWIGHT CO INC	128	256	1,140	134,317	家庭用品
CIMAREX ENERGY CO	90	95	1,291	152,015	石油・ガス・消耗燃料
CINCINNATI FINANCIAL CORP	147	155	1,180	139,020	保険
CISCO SYSTEMS	4,868	4,890	14,875	1,751,129	通信機器
CINTAS CORP	84	84	1,003	118,177	商業サービス・用品
CITIGROUP	2,852	2,825	17,161	2,020,295	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	501	504	1,815	213,709	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	149	149	1,371	161,475	ソフトウェア
CLOROX CO	126	124	1,482	174,525	家庭用品
COACH INC	265	279	994	117,121	繊維・アパレル・贅沢品
COCA COLA CO	3,979	3,987	16,573	1,951,086	飲料
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	588	587	3,303	388,904	情報技術サービス
COLGATE PALMOLIVE CO.	821	829	5,475	644,581	家庭用品
COLUMBIA PIPELINE GROUP	387	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
COMCAST CORP-CL A	2,354	2,336	16,545	1,947,781	メディア
COMERICA INC	173	173	1,196	140,827	銀行
COMPUTER SCIENCES CORP	—	138	842	99,177	情報技術サービス
CONAGRA BRANDS INC	400	400	1,520	178,934	食品
CONCHO RESOURCES INC	123	139	1,898	223,519	石油・ガス・消耗燃料
CONOCOPHILLIPS	1,194	1,213	6,244	735,105	石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC	286	293	2,142	252,205	総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	168	171	2,594	305,394	飲料
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	94	94	485	57,187	石油・ガス・消耗燃料
THE COOPER COMPANIES, INC.	47	47	820	96,614	ヘルスケア機器・用品
CORNING INC	1,079	1,010	2,507	295,221	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	423	425	6,930	815,897	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	—	32	612	72,061	インターネットソフトウェア・サービス
COTY INC-CL A	—	476	893	105,198	パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	133	131	703	82,827	容器・包装
CUMMINS INC	161	156	2,163	254,713	機械
DR HORTON INC	340	336	945	111,344	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	170	177	1,738	204,634	総合公益事業
DANAHER CORP	595	608	4,764	560,851	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC	118	118	893	105,210	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA INC	160	157	1,015	119,523	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY	260	258	2,659	313,102	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	
(アメリカ)	百株	百株	千円ドル	千円	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	—	217	1,243	146,355	ソフトウェア
DELTA AIR LINES INC	191	177	901	106,099	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC	229	232	1,386	163,265	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	444	458	2,132	251,085	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC	—	83	529	62,278	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	77	781	91,958	石油・ガス・消耗燃料
DICK S SPORTING GOODS INC	83	82	469	55,321	専門小売り
DISNEY (WALT) CO	1,499	1,484	15,665	1,844,096	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	402	394	2,871	338,076	消費者金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	143	143	406	47,875	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	235	212	586	69,079	メディア
DISH NETWORK CORP-A	220	218	1,298	152,899	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	281	271	2,098	247,018	複合小売り
DOLLAR TREE INC	227	227	1,908	224,628	複合小売り
DOMINION RESOURCES INC/VA	572	615	4,688	551,960	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC	48	46	749	88,257	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP	153	153	1,161	136,686	機械
DOW CHEM CO	1,080	1,093	6,457	760,170	化学
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	181	178	1,607	189,216	飲料
DU PONT E I DE NEMOURS	846	848	6,399	753,291	化学
DUKE ENERGY CORP	666	674	5,189	610,943	電力
DUN & BRADSTREET CORP	36	36	430	50,698	専門サービス
EMC CORP	1,873	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
EOG RESOURCES INC	532	559	5,732	674,835	石油・ガス・消耗燃料
EQT CORP	165	165	1,106	130,256	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	275	275	964	113,532	資本市場
EASTMAN CHEMICAL CO.	142	141	1,077	126,796	化学
EATON VANCE CORP	117	117	494	58,178	資本市場
EBAY INC	1,083	1,047	3,073	361,870	インターネットソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	256	256	3,055	359,737	化学
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	58	58	433	51,030	パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	318	317	2,274	267,713	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	208	210	1,920	226,025	ヘルスケア機器・用品
ELECTRONIC ARTS	296	290	2,310	271,949	ソフトウェア
EMERSON ELEC	623	629	3,580	421,469	電気設備
ENTERGY CORP	174	171	1,246	146,748	電力
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	188	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ENVISION HEALTHCARE CORP	—	116	761	89,634	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EQUIFAX INC	113	117	1,388	163,419	専門サービス
EVERSOURCE ENERGY	309	307	1,686	198,589	電力
EXELON CORPORATION	894	900	3,162	372,301	電力
EXPEDIA INC	117	123	1,412	166,312	インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	177	177	955	112,495	航空貨物・物流サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	647	617	4,226	497,537	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EXXON MOBIL CORP	4,017	4,036	36,437	4,289,364	石油・ガス・消耗燃料
FLIR SYSTEMS INC	126	127	459	54,105	電子装置・機器・部品
FMC CORP	132	132	754	88,852	化学
FMC TECHNOLOGIES INC	225	225	786	92,598	エネルギー設備・サービス
FACEBOOK INC-A	2,219	2,260	26,903	3,167,025	インターネットソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	279	276	1,328	156,410	商社・流通業
FEDEX CORPORATION	253	246	4,743	558,398	航空貨物・物流サービス
F5 NETWORKS INC	67	67	978	115,240	通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	298	303	2,323	273,546	情報技術サービス
FNFG GROUP	244	244	843	99,326	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	
FIFTH THIRD BANCORP	767	737	2,040	240,237	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	—	302	443	52,225	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	137	145	1,323	155,826	銀行
FISERV INC	216	214	2,323	273,510	情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	403	418	1,313	154,608	電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	89	88	1,256	147,865	情報技術サービス
FLUOR CORP	139	139	752	88,622	建設・土木
FLOWERVE CORP	123	122	602	70,918	機械
FOOT LOCKER INC	134	134	1,006	118,434	専門小売り
FORD MOTOR COMPANY	3,580	3,630	4,588	540,137	自動車
FORTINET INC	139	139	410	48,352	ソフトウェア
FORTIVE CORP	—	307	1,661	195,589	機械
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	153	153	847	99,763	建設関連製品
FRANKLIN RESOURCES INC	378	359	1,450	170,778	資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC	1,150	1,241	1,743	205,257	金属・鉱業
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	1,140	1,140	375	44,152	各種電気通信サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	168	179	925	109,004	保険
GAP INC	229	229	543	64,024	専門小売り
GARTNER INC	81	81	843	99,348	情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS	257	253	4,418	520,164	航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	9,025	8,719	28,014	3,297,825	コングロマリット
GENERAL MILLS	575	580	3,618	425,983	食品
GENERAL MOTORS CO	1,346	1,368	4,982	586,511	自動車
GENUINE PARTS CO	145	144	1,408	165,838	販売
GILEAD SCIENCES INC	1,322	1,282	9,481	1,116,182	バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	149	146	1,034	121,805	情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	367	354	8,556	1,007,286	資本市場
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	252	248	795	93,597	自動車部品
WR GRACE & CO	67	67	454	53,546	化学
GRAINGER(W.W.) INC	56	55	1,320	155,405	商社・流通業
HCA HOLDINGS INC	308	295	2,168	255,315	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HP INC	1,670	1,670	2,528	297,640	コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	832	842	4,627	544,764	エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC	377	377	832	97,992	繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC	179	179	1,068	125,820	自動車
HARMAN INTERNATIONAL	70	70	775	91,262	家庭用耐久財
HARRIS CORP	119	119	1,235	145,396	通信機器
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	385	375	1,807	212,823	保険
HASBRO INC	108	107	856	100,780	レジャー用品
HELMERICH & PAYNE	106	106	842	99,202	エネルギー設備・サービス
HERSHEY CO/THE	143	144	1,485	174,890	食品
HESS CORP	275	274	1,741	205,014	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,686	1,624	3,879	456,722	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	525	569	1,577	185,742	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	166	166	529	62,278	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	247	247	987	116,278	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT	1,225	1,201	16,433	1,934,526	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	706	702	8,227	968,534	コングロマリット
HORMEL FOODS CORP	276	292	1,014	119,484	食品
HUMANA INC	143	145	2,907	342,222	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	87	843	99,354	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	750	1,070	1,426	167,905	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	—	46	850	100,098	航空宇宙・防衛
IMS HEALTH HOLDINGS INC	163	—	—	—	ヘルスケア・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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
IDEXX LABORATORIES INC	86	86	1,028	121,041	ヘルスケア機器・用品
IHS INC-CLASS A	66	—	—	—	専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	317	312	3,890	458,006	機械
ILLUMINA INC	142	142	1,815	213,666	ライフサイエンス・ツール/サービス
INCYTE CORP	160	167	1,665	196,120	バイオテクノロジー
INGREDION INC	69	73	918	108,072	食品
INTEL CORP	4,561	4,592	16,981	1,999,028	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	114	582	3,336	392,785	資本市場
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	883	882	14,773	1,739,144	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	77	76	898	105,786	化学
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	376	376	2,028	238,797	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP	392	392	921	108,443	メディア
INTUIT INC	236	235	2,765	325,579	ソフトウェア
INTUITIVE SURGICAL INC	35	37	2,338	275,273	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	121	—	—	—	バイオテクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	3,550	3,515	30,492	3,589,591	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	123	123	719	84,647	建設・土木
JOHNSON & JOHNSON	2,669	2,662	30,695	3,613,476	医薬品
JOHNSON CONTROLS INC	619	—	—	—	自動車部品
JONES LANG LASALLE INC	42	47	479	56,390	不動産管理・開発
JUNIPER NETWORKS INC	335	335	953	112,235	通信機器
KLA TENCOR CORP	150	150	1,184	139,462	半導体・半導体製造装置
KANSAS CITY SOUTHERN	106	106	906	106,677	陸運・鉄道
KELLOGG CO	257	255	1,865	219,586	食品
KEYCORP	810	1,070	1,960	230,759	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	351	352	4,034	474,914	家庭用品
KINDER MORGAN INC	1,836	1,856	3,929	462,539	石油・ガス・消耗燃料
KOHL'S CORP	185	185	972	114,444	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE	586	596	5,161	607,665	食品
KROGER CO	890	880	3,098	364,753	食品・生活必需品小売り
L BRANDS, INC	240	240	1,649	194,181	専門小売り
LKQ CORP	300	300	971	114,317	販売
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	77	77	1,185	139,601	航空宇宙・防衛
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	99	98	1,258	148,164	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH	154	154	1,639	193,036	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	423	421	2,295	270,201	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	216	214	1,671	196,800	パーソナル用品
LEAR CORP	74	69	938	110,476	自動車部品
LEGETT & PLATT INC	134	134	665	78,288	家庭用耐久財
LENNAR CORP-A	168	180	782	92,111	家庭用耐久財
LEUCADIA NATIONAL CORP	322	322	765	90,140	各種金融サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	290	301	1,687	198,676	各種電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND CORP-C	—	101	756	89,054	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	423	423	854	100,636	インターネット販売・通信販売
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	81	98	347	40,875	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	193	193	670	78,974	メディア
ELI LILLY & CO.	965	964	7,061	831,256	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	234	223	1,511	177,933	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP	225	238	1,487	175,164	半導体・半導体製造装置
LINKEDIN CORP - A	113	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス
LOCKHEED MARTIN	266	256	6,469	761,596	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	279	277	1,326	156,194	保険
LOWES COS INC	881	863	6,402	753,713	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	106	106	709	83,567	繊維・アパレル・贅沢品

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
M & T BANK CORP	139	137	2,135	251,446	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	423	449	1,314	154,763	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	93	85	677	79,709	資本市場
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	—	76	628	73,935	運送インフラ
MACYS INC	304	304	1,140	134,236	複合小売り
MANPOWERGROUP INC	70	70	633	74,567	専門サービス
MARATHON OIL CORP	794	812	1,468	172,824	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	508	510	2,498	294,122	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	13	13	1,212	142,719	保険
MARSH & MCLENNAN COS	501	507	3,463	407,701	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	199	322	2,732	321,631	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	59	59	1,332	156,851	建設資材
MASCO CORP	329	329	1,078	126,995	建設関連製品
MASTERCARD INC	949	942	9,812	1,155,164	情報技術サービス
MATTEL INC	334	334	952	112,136	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	271	270	1,057	124,531	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	113	113	1,053	124,004	食品
MCDONALD'S CORP	872	829	10,211	1,202,112	ホテル・レストラン・レジャー
MCKESSON CORP	221	218	3,086	363,361	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	181	178	1,275	150,157	食品
MEDIVATION INC	154	—	—	—	バイオテクノロジー
MEDNAX INC	91	91	599	70,584	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	184	184	286	33,725	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC	—	39	603	71,068	インターネットソフトウェア・サービス
MERCK & CO INC	2,685	2,689	15,980	1,881,251	医薬品
METLIFE INC	903	914	4,988	587,259	保険
METTLER-TOLEDO INTL	26	26	1,108	130,482	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP	7,267	7,205	45,780	5,389,288	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	207	206	1,342	158,039	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	1,010	1,009	2,076	244,448	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	—	57	750	88,404	機械
MOHAWK INDUSTRIES	60	63	1,292	152,180	家庭用耐久財
MOLSON COORS BREWING CO-B	180	186	1,809	213,069	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,518	1,509	6,770	797,068	食品
MONSANTO CO	427	428	4,502	530,091	化学
MONSTER BEVERAGE CORP	137	384	1,742	205,092	飲料
MOODYS CORP	169	168	1,621	190,827	資本市場
MORGAN STANLEY	1,421	1,405	6,093	717,325	資本市場
MOSAIC CO/THE	313	334	961	113,158	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	151	145	1,218	143,382	通信機器
MURPHY OIL CORP	150	167	545	64,226	石油・ガス・消耗燃料
NRG ENERGY INC	294	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NASDAQ INC	111	111	749	88,188	資本市場
NATIONAL OILWELL VARCO INC	366	365	1,418	166,929	エネルギー設備・サービス
NAVIENT CORP	339	299	499	58,745	消費者金融
NETAPP INC	279	267	971	114,409	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	414	420	5,313	625,446	インターネット販売・通信販売
NETSUITE INC	39	—	—	—	ソフトウェア
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,140	1,140	705	83,070	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	234	241	1,319	155,385	コングロマリット
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	471	471	750	88,325	貯蓄・抵当・不動産金融
NEWELL BRANDS INC	427	422	1,948	229,362	家庭用耐久財
NEWFIELD EXPLORATION CO	190	188	817	96,227	石油・ガス・消耗燃料
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	517	510	1,609	189,417	金属・鉱業

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	374	374	438	51,599	メディア
NEXTERA ENERGY INC	445	452	5,360	631,063	電力
NIKE INC-B	1,306	1,309	6,846	805,919	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	308	303	676	79,649	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC	411	426	1,686	198,588	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	127	127	650	76,561	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	287	286	3,090	363,781	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	214	207	1,864	219,507	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	166	165	3,867	455,336	航空宇宙・防衛
NUANCE COMMUNICATIONS INC	250	250	379	44,674	ソフトウェア
NUCOR CORP	307	306	1,901	223,842	金属・鉱業
NVIDIA CORP	522	524	5,545	652,815	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	196	196	657	77,456	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	94	92	2,641	310,916	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	738	748	5,397	635,401	石油・ガス・消耗燃料
OMNICOM GROUP	231	230	1,976	232,687	メディア
ONEOK INC	198	210	1,229	144,717	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,049	3,005	11,668	1,373,605	ソフトウェア
PG&E CORP	473	496	3,031	356,874	電力
PNC FINANCIAL	487	481	5,658	666,116	銀行
PPG INDUSTRIES	258	257	2,463	290,045	化学
PPL CORPORATION	654	669	2,303	271,152	電力
PVH CORP	80	80	740	87,112	繊維・アパレル・贅沢品
PACCAR	341	341	2,228	262,371	機械
PACKAGING CORP OF AMERICA	89	96	830	97,765	容器・包装
PALO ALTO NETWORKS INC	85	85	1,071	126,188	通信機器
PARKER HANNIFIN CORP	132	133	1,893	222,936	機械
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	—	150	532	62,721	石油・ガス・消耗燃料
PATTERSON COS INC	87	87	353	41,581	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PAYCHEX INC	317	315	1,933	227,645	情報技術サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	1,057	1,063	4,261	501,671	情報技術サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	305	305	590	69,475	銀行
PEPSICO INC	1,398	1,399	14,647	1,724,307	飲料
PFIZER INC	5,965	5,900	19,116	2,250,335	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,497	1,508	13,769	1,620,951	タバコ
PHILLIPS 66	460	460	3,991	469,924	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	105	111	855	100,693	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	156	166	3,083	362,946	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	240	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	—	90	316	37,226	石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INDUSTRIES INC	62	62	500	58,921	レジャー用品
PRAXAIR INC	276	279	3,306	389,298	化学
T ROWE PRICE GROUP INC	240	239	1,850	217,821	資本市場
PRICELINE GROUP INC/THE	48	47	7,224	850,484	インターネット販売・通信販売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	280	279	1,649	194,140	保険
PROCTER & GAMBLE CO	2,616	2,487	20,960	2,467,462	家庭用品
PROGRESSIVE CO	569	565	2,018	237,646	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	432	427	4,546	535,186	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE	493	487	2,122	249,899	総合公益事業
PULTEGROUP INC	295	289	553	65,150	家庭用耐久財
QORVO INC	134	127	698	82,212	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,450	1,432	9,617	1,132,149	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS INC	141	133	1,224	144,104	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	88	142	1,071	126,107	ライフサイエンス・ツール/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	
RALPH LAUREN CORPORATION	58	58	538	63,368	繊維・アパレル・贅沢品
RANGE RESOURCES CORP	167	190	649	76,516	石油・ガス・消耗燃料
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	120	121	878	103,469	資本市場
RAYTHEON COMPANY	291	289	4,119	485,004	航空宇宙・防衛
REALOGY HOLDINGS CORP	140	—	—	—	不動産管理・開発
RED HAT INC	178	178	1,420	167,193	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS	74	75	2,763	325,319	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1,260	1,210	1,758	206,967	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	—	63	799	94,158	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	229	229	1,311	154,441	商業サービス・用品
RESMED INC	132	141	868	102,280	ヘルスケア機器・用品
REYNOLDS AMERICAN INC	825	838	4,686	551,745	タバコ
RITE AID CORP	1,000	990	838	98,711	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	133	133	650	76,561	専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	129	124	1,681	197,895	電気設備
ROCKWELL COLLINS INC	128	128	1,202	141,535	航空宇宙・防衛
ROPER TECHNOLOGIES INC	96	99	1,850	217,860	コングロマリット
ROSS STORES INC	394	390	2,652	312,193	専門小売り
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	121	120	1,254	147,719	各種電気通信サービス
S&P GLOBAL INC	258	255	2,848	335,307	資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY	129	141	701	82,561	資本市場
SABRE CORP	200	200	503	59,213	情報技術サービス
ST JUDE MEDICAL INC	270	277	2,196	258,519	ヘルスケア機器・用品
SALESFORCE.COM INC	610	630	4,416	519,960	ソフトウェア
SCANA CORP	131	129	957	112,724	総合公益事業
HENRY SCHEIN INC	80	80	1,233	145,207	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,345	1,352	11,648	1,371,300	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,148	1,165	4,657	548,300	資本市場
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	78	78	562	66,230	メディア
SEALED AIR CORP	192	192	901	106,140	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC	—	97	595	70,088	バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY	230	229	2,332	274,539	総合公益事業
SERVICENOW INC	155	157	1,212	142,773	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS	76	75	2,044	240,728	化学
SIGNATURE BANK	48	50	752	88,553	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,990	1,630	738	86,923	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	182	181	1,394	164,215	半導体・半導体製造装置
SMITH (A. O.) CORP	72	144	699	82,402	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	116	113	1,452	171,001	食品
SNAP-ON INC	54	58	1,012	119,156	機械
SOUTHERN CO.	883	948	4,667	549,511	電力
SOUTHWEST AIRLINES	153	153	774	91,226	旅客航空輸送業
SOUTHWESTERN ENERGY CO	380	468	513	60,492	石油・ガス・消耗燃料
SPECTRA ENERGY CORP	653	677	2,786	328,030	石油・ガス・消耗燃料
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	—	26	315	37,175	家庭用品
SPLUNK INC	128	128	684	80,524	ソフトウェア
SPRINT CORP	710	750	630	74,251	無線通信サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	145	144	1,681	197,961	機械
STAPLES INC	620	620	601	70,796	専門小売り
STARBUCKS CORP	1,430	1,424	8,179	962,885	ホテル・レストラン・レジャー
STARWOOD HOTELS & RESORTS	162	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	388	381	3,004	353,697	資本市場
STERICYCLE INC	81	79	604	71,153	商業サービス・用品
STRYKER CORP	325	329	3,928	462,434	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
SUNTRUST BKS INC.	490	483	2,705	318,522	銀行
SYMANTEC CORP	634	608	1,474	173,566	ソフトウェア
SYNOFPSYS INC	149	149	895	105,417	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	805	805	2,986	351,576	消費者金融
SYSCO CORP	520	514	2,891	340,418	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	254	253	1,119	131,790	資本市場
TECO ENERGY INC	224	—	—	—	総合公益事業
TJX COS INC	643	643	4,980	586,249	専門小売り
T-MOBILE US INC	271	283	1,636	192,625	無線通信サービス
TARGET CORP	554	534	4,118	484,858	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP	—	164	942	110,971	石油・ガス・消耗燃料
TEGNA INC	206	206	456	53,714	メディア
TELEFLEX INC	—	43	694	81,755	ヘルスケア機器・用品
TESORO CORP	113	113	1,013	119,282	石油・ガス・消耗燃料
TESLA MOTORS INC	95	124	2,577	303,430	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	—	883	3,211	378,054	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC	973	974	7,224	850,427	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	264	264	1,285	151,350	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	383	386	5,433	639,657	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	585	587	10,477	1,233,400	コングロマリット
TIFFANY & CO	127	119	952	112,125	専門小売り
TIME WARNER INC	765	755	7,247	853,145	メディア
TOLL BROTHERS INC	164	164	521	61,374	家庭用耐久財
TORCHMARK CORP	112	112	838	98,660	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	163	163	819	96,421	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	130	130	1,009	118,832	専門小売り
TRANSDIGM GROUP INC	52	52	1,302	153,278	航空宇宙・防衛
TRAVELERS COS INC/THE	286	281	3,444	405,453	保険
TRIMBLE INC	232	255	777	91,556	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	115	123	569	67,011	インターネット販売・通信販売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,085	1,038	2,953	347,640	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	428	428	1,187	139,765	メディア
TWITTER INC	540	539	920	108,374	インターネットソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	285	289	1,790	210,828	食品
UGI CORP	165	163	737	86,788	ガス
US BANCORP	1,681	1,662	8,670	1,020,709	銀行
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	59	56	1,493	175,821	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	171	184	552	65,089	繊維・アパレル・贅沢品
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	172	187	487	57,345	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP	819	809	8,466	996,639	陸運・鉄道
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	88	76	575	67,744	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	668	671	7,790	917,075	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC	86	86	932	109,824	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES	769	772	8,529	1,004,131	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP	43	43	620	73,079	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC	918	926	14,939	1,758,637	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	87	86	918	108,072	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP	227	225	1,003	118,132	保険
V F CORP	331	319	1,741	205,000	繊維・アパレル・贅沢品
VALERO ENERGY CORP	456	450	3,056	359,852	石油・ガス・消耗燃料
VALSPAR CORP	72	73	754	88,857	化学
VANTIV INC - CL A	151	148	867	102,165	情報技術サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	95	95	859	101,165	ヘルスケア機器・用品
VERISIGN INC	96	96	747	88,035	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	
VERIZON COMMUNICATIONS	3,940	3,965	21,002	2,472,426	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	152	159	1,310	154,288	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	240	238	1,727	203,406	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B	341	341	1,202	141,502	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	1,857	1,834	14,330	1,687,030	情報技術サービス
VMWARE INC - CLASS A	74	74	606	71,354	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	203	203	815	95,947	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	128	128	1,615	190,145	建設資材
WABCO HOLDINGS INC	52	52	570	67,121	機械
WEC ENERGY GROUP INC	302	306	1,788	210,586	総合公益事業
WABTEC CORP	90	90	755	88,922	機械
WAL-MART STORES INC	1,545	1,503	10,707	1,260,471	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	886	893	7,666	902,489	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	167	175	1,383	162,850	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC	428	432	3,053	359,494	商業サービス・用品
WATERS CORP	80	80	1,085	127,740	ライフサイエンス・ツール/サービス
WELLS FARGO CO	4,665	4,664	25,983	3,058,735	銀行
WESTAR ENERGY INC	136	134	753	88,731	電力
WESTERN DIGITAL CORP	266	278	1,924	226,530	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	491	491	1,063	125,195	情報技術サービス
WESTROCK CO	243	243	1,271	149,666	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	75	75	1,357	159,840	家庭用耐久財
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	175	175	970	114,294	食品
WHOLE FOODS MARKET INC	316	316	1,027	120,935	食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS	695	694	2,125	250,158	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A	107	120	814	95,918	ソフトウェア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	109	109	848	99,931	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN RESORTS LTD	77	77	687	80,918	ホテル・レストラン・レジャー
XCEL ENERGY INC	483	494	2,020	237,906	電力
XILINX INC	250	250	1,506	177,286	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	840	840	763	89,886	情報技術サービス
XYLEM INC	170	170	864	101,723	機械
YAHOO! INC	869	884	3,460	407,412	インターネットソフトウェア・サービス
YUM BRANDS INC	396	361	2,317	272,787	ホテル・レストラン・レジャー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	—	155	516	60,852	各種電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	109	109	417	49,195	インターネットソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	184	198	2,012	236,954	ヘルスケア機器・用品
ZOETIS INC	460	458	2,432	286,400	医薬品
ALKERMES PLC	138	152	864	101,724	バイオテクノロジー
ALLERGAN PLC	381	384	7,455	877,606	医薬品
AON PLC	263	257	2,884	339,601	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	121	121	1,053	124,052	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	95	85	555	65,410	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	173	212	578	68,056	化学
ACCENTURE PLC-CL A	607	604	7,121	838,302	情報技術サービス
BUNGE LIMITED	138	138	994	117,096	食品
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	207	—	—	—	飲料
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	269	269	1,861	219,101	自動車部品
EATON CORP PLC	445	444	3,011	354,479	電気設備
ENDO INTERNATIONAL PLC	205	205	321	37,864	医薬品
EVEREST RE GROUP LTD	40	40	868	102,190	保険
IHS MARKIT LTD	—	353	1,252	147,451	専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC	251	251	1,925	226,719	機械
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	850	850	421	49,630	エネルギー設備・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		
INVESCO LTD	405	396	1,245	146,564	資本市場	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	58	62	669	78,847	医薬品	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	—	914	3,912	460,618	建設関連製品	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	275	240	745	87,753	メディア	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	600	595	1,786	210,270	メディア	
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - A	34	—	—	—	メディア	
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	74	112	242	28,591	メディア	
MALLINCKRODT PLC	111	111	581	68,509	医薬品	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	410	410	589	69,405	半導体・半導体製造装置	
MEDTRONIC PLC	1,362	1,354	9,691	1,140,934	ヘルスケア機器・用品	
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	179	161	711	83,790	繊維・アパレル・贅沢品	
NIELSEN HOLDINGS PLC	350	342	1,479	174,165	専門サービス	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	150	161	723	85,155	ホテル・レストラン・レジャー	
RENAISSANCE HOLDINGS LTD	42	42	566	66,697	保険	
SEAGATE TECHNOLOGY	290	286	1,112	131,001	コンピュータ・周辺機器	
PENTAIR PLC	167	167	952	112,175	機械	
SIGNET JEWELERS LTD	71	71	672	79,201	専門小売り	
TYCO INTERNATIONAL PLC	403	—	—	—	商業サービス・用品	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	127	126	1,549	182,427	保険	
PERRIGO CO PLC	139	138	1,170	137,744	医薬品	
XL GROUP PLC	288	—	—	—	保険	
XL GROUP LTD	—	264	990	116,636	保険	
CHUBB LTD	446	451	6,012	707,818	保険	
GARMIN LTD	114	114	570	67,167	家庭用耐久財	
TE CONNECTIVITY LTD	358	343	2,423	285,310	電子装置・機器・部品	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	127	127	1,087	128,065	ソフトウェア	
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	15	15	158	18,650	医薬品	
AERCAP HOLDINGS NV	165	150	645	75,982	商社・流通業	
CORE LABORATORIES N. V.	43	43	516	60,849	エネルギー設備・サービス	
MOBILEYE NV	170	170	598	70,443	ソフトウェア	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	356	345	3,028	356,463	化学	
MYLAN NV	404	449	1,684	198,316	医薬品	
NXP SEMICONDUCTORS NV	284	287	2,803	330,085	半導体・半導体製造装置	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	169	169	691	81,448	電気設備	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	169	169	1,440	169,522	ホテル・レストラン・レジャー	
BROADCOM LTD	377	383	6,996	823,603	半導体・半導体製造装置	
FLEX LTD	550	550	807	95,111	電子装置・機器・部品	
小 計	株 数	金 額	303,099	302,711	1,945,398	229,012,261
	銘柄 数 < 比 率 >		596	602	—	< 63.9% >
(カナダ)					千カナダドル	
ARC RESOURCES LTD	335	329	753	66,027	石油・ガス・消耗燃料	
AGNICO EAGLE MINES LTD	206	216	1,107	97,011	金属・鉱業	
AGRIUM INC	126	131	1,753	153,589	化学	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	401	404	2,495	218,606	食品・生活必需品小売り	
ALTAGAS LTD	141	166	564	49,470	石油・ガス・消耗燃料	
ATCO LTD CL1	68	68	300	26,329	総合公益事業	
BCE INC	141	138	792	69,462	各種電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL	618	631	6,127	536,781	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	1,162	1,167	8,848	775,101	銀行	
BARRICK GOLD	1,130	1,120	2,125	186,216	金属・鉱業	
BLACKBERRY LTD	509	509	497	43,607	コンピュータ・周辺機器	
BOMBARDIER B SHEARS	1,890	1,890	393	34,437	航空宇宙・防衛	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	861	833	3,721	326,033	資本市場	
CAE INC	260	260	485	42,568	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	26	26	708	62,040	容器・包装
CI FINANCIAL CORP	242	242	704	61,753	資本市場
CAMECO CORP	386	386	542	47,508	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	383	382	4,273	374,352	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	769	758	6,909	605,309	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,063	1,076	4,717	413,225	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	140	136	2,643	231,588	陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A	70	70	981	85,958	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	124	124	446	39,126	総合公益事業
CENOVUS ENERGY INC	790	830	1,733	151,887	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE INC	17	19	1,173	102,800	ソフトウェア
CRESCENT POINT ENERGY CORP	488	537	998	87,496	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	115	107	1,047	91,726	複合小売り
ELDORADO GOLD CORPORATION	708	708	291	25,552	金属・鉱業
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	360	360	451	39,546	各種金融サービス
EMERA INC	—	49	220	19,290	電力
EMPIRE CO LTD A	162	162	248	21,797	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	790	950	1,567	137,313	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	883	913	5,167	452,680	石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	21	21	1,458	127,768	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	149	152	403	35,325	商社・流通業
FIRST CAPITAL REALTY INC	113	113	233	20,431	不動産管理・開発
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	704	650	936	81,993	金属・鉱業
FORTIS INC	273	384	1,562	136,841	電力
FRANCO-NEVADA CORP	173	169	1,290	113,031	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	231	208	738	64,665	繊維・アパレル・贅沢品
GOLDCORP INC	800	829	1,380	120,912	金属・鉱業
GREAT-WEST LIFE CO INC	280	300	1,066	93,399	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	214	214	1,355	118,758	情報技術サービス
HUSKY ENERGY INC	357	357	590	51,697	石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD	173	173	406	35,613	電力
IGM FINANCIAL INC	103	103	402	35,279	資本市場
IMPERIAL OIL	283	285	1,370	120,086	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	99	99	538	47,212	保険
INTACT FINANCIAL CORP	127	126	1,221	106,965	保険
INTER PIPELINE LTD	331	331	978	85,681	石油・ガス・消耗燃料
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	94	94	195	17,086	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP	178	178	723	63,384	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP	1,186	1,186	473	41,453	金属・鉱業
LINAMAR CORP	48	48	276	24,211	自動車部品
LOBLAW COMPANIES	214	223	1,573	137,837	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	388	377	2,255	197,589	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,918	1,927	4,742	415,429	保険
METHANEX CORP	82	82	494	43,321	化学
METRO INC	232	232	933	81,739	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	334	334	1,863	163,203	銀行
ONEX CORPORATION	80	80	740	64,852	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP	121	121	1,006	88,178	ソフトウェア
PEMBINA PIPELINE CORP	362	374	1,575	138,027	石油・ガス・消耗燃料
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	151	172	581	50,912	石油・ガス・消耗燃料
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	818	812	1,958	171,568	化学
POWER CORPORATION OF CANADA	350	376	1,145	100,327	保険
POWER FINANCIAL CORP	243	243	837	73,375	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	207	207	669	58,661	石油・ガス・消耗燃料

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	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	214	213	1,374	120,405	ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	348	347	1,787	156,545	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,439	1,443	13,269	1,162,436	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	145	145	848	74,370	建設・土木
SAPUTO INC	239	258	1,225	107,331	食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	188	226	687	60,224	石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	404	404	1,079	94,563	メディア
SILVER WHEATON CORP	420	416	972	85,164	金属・鉱業
SUN LIFE FINANCIAL INC	588	591	3,095	271,179	保険
SUNCOR ENERGY INC	1,524	1,630	7,167	627,838	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD	582	549	1,550	135,812	金属・鉱業
TELUS CORP	193	193	817	71,634	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	330	324	1,925	168,648	資本市場
TORONTO DOMINION BANK	1,789	1,801	12,057	1,056,254	銀行
TOURMALINE OIL CORP	194	216	774	67,852	石油・ガス・消耗燃料
TRANSCANADA CORP	688	836	5,162	452,217	石油・ガス・消耗燃料
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	980	980	425	37,258	金属・鉱業
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	313	313	595	52,150	医薬品
VERESEN INC	290	290	363	31,882	石油・ガス・消耗燃料
VERMILION ENERGY INC	105	120	690	60,517	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER	68	68	337	29,551	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE)LTD	48	48	539	47,282	食品・生活必需品小売り
YAMANA GOLD INC	970	970	332	29,145	金属・鉱業
BROOKFIELD BUSINESS PART	17	—	—	—	建設・土木
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
	銘柄 数 < 比 率 >				
	91	91	159,854	14,003,287	< 3.9% >
(イギリス)			千英ポンド		
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	940	940	241	35,176	資本市場
ANTOFAGASTA PLC	410	410	276	40,267	金属・鉱業
ASHTED GROUP PLC	468	476	752	109,579	商社・流通業
BHP BILLITON PLC	2,043	2,063	2,664	387,958	金属・鉱業
ARM HOLDINGS PLC	1,365	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	980	980	460	67,125	家庭用耐久財
SKY PLC	998	990	976	142,207	メディア
AVIVA PLC	3,890	3,950	1,889	275,156	保険
DIAGEO PLC	2,427	2,443	5,096	742,042	飲料
SCHRODERS PLC	133	133	394	57,439	資本市場
DCC PLC	86	86	503	73,381	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC	3,060	3,060	1,823	265,557	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,804	1,811	8,259	1,202,602	タバコ
STANDARD CHARTERED PLC	3,164	3,200	2,134	310,836	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC	926	938	3,289	478,993	タバコ
SABMILLER PLC	938	—	—	—	飲料
HSBC HOLDINGS PLC	19,050	19,340	12,677	1,845,951	銀行
LEGAL & GENERAL	5,760	5,770	1,416	206,261	保険
MEGGITT PLC	780	780	364	53,062	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS	2,130	2,130	487	70,931	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	344	340	913	132,976	食品
PEARSON	790	780	643	93,643	メディア
PERSIMMON PLC	295	295	515	75,042	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,493	2,525	4,022	585,690	保険
RIO TINTO PLC-REG	1,201	1,211	3,768	548,662	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC	499	490	483	70,457	保険
TRAVIS PERKINS PLC	247	247	358	52,150	商社・流通業

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
SSE PLC	969	996	1,524	222,037	電力
BP PLC	17,890	18,250	9,065	1,320,054	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC	62,100	62,900	4,043	588,732	銀行
TATE & LYLE ORD.	425	480	335	48,820	食品
TAYLOR WIMPEY PLC	3,190	3,190	492	71,671	家庭用耐久財
TESCO PLC	7,870	7,870	1,607	234,060	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	858	890	1,051	153,178	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,712	4,735	7,235	1,053,499	医薬品
WEIR GROUP PLC	220	220	415	60,480	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC	259	259	242	35,261	商業サービス・用品
ASTRAZENECA PLC	1,219	1,227	5,291	770,486	医薬品
GKN PLC	1,690	1,690	556	81,083	自動車部品
BT GROUP PLC	8,170	8,160	3,029	441,110	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC	187	187	773	112,646	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC	1,550	1,530	541	78,798	複合小売り
BARCLAYS PLC	16,300	16,550	3,785	551,252	銀行
INTERTEK GROUP PLC	151	163	540	78,750	専門サービス
WILLIAM HILL PLC	850	850	248	36,189	ホテル・レストラン・レジャー
BURBERRY GROUP PLC	423	419	616	89,746	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	140	140	690	100,520	複合小売り
KINGFISHER PLC	2,170	2,140	742	108,064	専門小売り
ICAP PLC	540	—	—	—	資本市場
ITV PLC	3,530	3,530	706	102,800	メディア
SAINSBURY	1,338	1,700	421	61,413	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	90	88	497	72,397	金属・鉱業
G4S PLC	1,520	1,520	348	50,728	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	198	219	391	56,953	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	124	124	350	51,007	家庭用耐久財
CENTRICA PLC	5,240	5,240	1,204	175,336	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,071	4,204	9,238	1,345,187	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	3,625	3,639	8,453	1,230,899	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE	331	331	683	99,574	商社・流通業
COBHAM PLC	1,695	1,695	286	41,735	航空宇宙・防衛
NATIONAL GRID PLC	3,626	3,680	3,439	500,854	総合公益事業
INMARSAT PLC	425	425	313	45,577	各種電気通信サービス
PETROFAC LTD	260	260	225	32,899	エネルギー設備・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	139	139	249	36,310	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	302	300	843	122,836	資本市場
UNILEVER PLC	1,244	1,256	4,061	591,453	パーソナル用品
TUI AG-DI	466	490	546	79,554	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	610	610	319	46,498	資本市場
EXPERIAN PLC	946	946	1,442	210,064	専門サービス
MONDI PLC	342	370	586	85,446	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	221	237	522	76,059	水道
WHITBREAD PLC	175	173	625	91,063	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	250	250	301	43,901	資本市場
SMITHS GROUP PLC	375	371	523	76,278	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,370	1,364	1,547	225,325	金属・鉱業
3I GROUP PLC	970	970	661	96,326	資本市場
PROVIDENT FINANCIAL PLC	143	143	396	57,760	消費者金融
CAPITA PLC	640	640	316	46,129	専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	617	619	4,174	607,854	家庭用品
RELX PLC	1,066	1,058	1,500	218,450	専門サービス
SHIRE PLC	866	881	4,015	584,711	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	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
FRESNILLO PLC	209	209	228	33,262	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	670	670	594	86,583	水道
GLENCORE PLC	11,880	11,970	3,251	473,472	金属・鉱業
DIXONS CARPHONE PLC	920	920	317	46,203	専門小売り
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,770	1,830	1,253	182,529	航空宇宙・防衛
OLD MUTUAL PLC	4,680	4,880	975	142,044	保険
EASYJET PLC	163	163	167	24,398	旅客航空輸送業
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,410	3,410	778	113,407	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,050	1,050	686	99,990	ソフトウェア
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	375	375	281	41,034	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WPP PLC	1,243	1,251	2,241	326,427	メディア
COCA-COLA HBC AG-CDI	198	167	281	40,949	飲料
NEX GROUP PLC	—	540	254	37,026	資本市場
ROLLS-ROYCE HOLDINGS C-ENTITLEMENT	125,670	—	—	—	航空宇宙・防衛
ROYAL MAIL PLC	880	880	396	57,700	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	690	690	301	43,956	ホテル・レストラン・レジャー
WOLSELEY PLC	242	242	1,195	174,038	商社・流通業
IMI PLC	259	259	264	38,467	機械
VODAFONE GROUP PLC	25,610	25,820	5,153	750,426	無線通信サービス
AGGREKO PLC	262	—	—	—	商業サービス・用品
RSA INSURANCE GROUP PLC	987	987	562	81,960	保険
COMPASS GROUP PLC	1,585	1,602	2,313	336,837	ホテル・レストラン・レジャー
REXAM PLC	655	—	—	—	容器・包装
STANDARD LIFE PLC	1,860	1,870	678	98,787	保険
AUTO TRADER GROUP PLC	950	950	366	53,395	インターネットソフトウェア・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,360	1,360	489	71,254	保険
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	181	181	639	93,143	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDPAY GROUP PLC	1,350	1,850	488	71,088	情報技術サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	122	136	427	62,201	化学
JOHNSON MATTHEY PLC	191	191	599	87,250	化学
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC C-ENTITLEMENT	—	84,180	8	1,225	航空宇宙・防衛
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	415,346 110	374,341 106	171,636 —	24,992,056 <7.0%>
(スイス)			千スイスフラン		
SYNGENTA AG-REG	90	91	3,748	429,982	化学
SIKA AG-BR	2	2	989	113,484	化学
SGS SA-REG	5	5	1,122	128,759	専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG	1	2	277	31,789	食品
SWISSCOM AG-REG	24	25	1,157	132,751	各種電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.95	1	534	61,314	食品
LINDT&SPRUENGLI AG-REG	0.1	0.1	606	69,542	食品
GIVAUDAN-REG	8	8	1,614	185,159	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	145	147	4,120	472,578	保険
NOVARTIS-REG	2,199	2,171	16,000	1,835,230	医薬品
ABB LTD	1,914	1,840	3,978	456,285	電気設備
ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	678	683	15,929	1,827,158	医薬品
ADECCO GROUP AG-REG	163	163	1,092	125,357	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD	443	439	2,342	268,634	建設資材
NESTLE SA-REG	3,080	3,027	22,081	2,532,801	食品
BALOISE HOLDING AG	50	50	641	73,580	保険
SONOVA HOLDING AG-REG	50	50	602	69,106	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,802	1,940	3,001	344,235	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B	29	29	919	105,459	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG	46	46	283	32,475	繊維・アパレル・贅沢品

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		
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
LONZA AG-REG	50	53	929	106,602	ライフサイエンス・ツール/サービス	
SWISS LIFE HOLDING AG	31	31	914	104,864	保険	
GALENICA AG-REG	3	3	409	46,990	医薬品	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	8	8	425	48,838	化学	
SWISS PRIME SITE-REG	68	68	550	63,098	不動産管理・開発	
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	32	32	210	24,096	各種金融サービス	
DUFREY AG-REG	45	45	561	64,363	専門小売り	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	16	16	802	92,026	資本市場	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	43	38	684	78,479	機械	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	19	19	340	39,049	機械	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	52	52	704	80,751	海運業	
GEBERIT AG-REG	36	35	1,438	164,948	建設関連製品	
ACTELION LTD	97	93	2,018	231,562	バイオテクノロジー	
ARYZTA AG	85	85	376	43,180	食品	
JULIUS BAER GROUP LTD	220	220	1,011	116,025	資本市場	
SWISS RE LTD	325	316	3,036	348,316	保険	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	506	510	3,409	391,052	繊維・アパレル・贅沢品	
UBS GROUP AG	3,540	3,548	5,843	670,255	資本市場	
小 計	株 数 ・ 金 額	15,916	15,900	104,709	12,010,189	
	銘柄 数 < 比 率 >	38	38	—	< 3.3% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
LUNDBERGS AB-B SHS	—	34	1,863	23,793	各種金融サービス	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	1,460	1,510	14,586	186,270	銀行	
SWEDBANK AB	865	881	19,567	249,870	銀行	
SWEDISH MATCH AB	189	189	5,435	69,413	タバコ	
NORDEA BANK AB	2,930	2,970	30,323	387,233	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	294	325	4,631	59,141	商業サービス・用品	
INVESTOR AB-B SHS	444	441	15,046	192,149	各種金融サービス	
HENNES&MAURITZ AB-B	923	917	23,135	295,445	専門小売り	
ERICSSON LM-B	2,920	2,970	15,948	203,667	通信機器	
TELIA CO AB	2,510	2,470	9,040	115,443	各種電気通信サービス	
SKANSKA AB-B SHS	342	342	7,407	94,596	建設・土木	
LUNDIN PETROLEUM AB	201	171	3,346	42,734	石油・ガス・消耗燃料	
ALFA LAVAL AB	277	277	4,202	53,660	機械	
GETINGE AB-B SHS	191	191	2,738	34,976	ヘルスケア機器・用品	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	61	68	2,665	34,039	無線通信サービス	
ICA GRUPPEN AB	78	78	2,123	27,112	食品・生活必需品小売り	
HUSQVARNA AB-B SHS	380	380	2,641	33,725	家庭用耐久財	
ELECTROLUX AB-B	233	233	5,279	67,422	家庭用耐久財	
SKF AB-B SHARES	388	388	6,541	83,537	機械	
VOLVO AB-B SHS	1,500	1,490	15,943	203,592	機械	
SANDVIK AB	1,030	1,030	11,803	150,734	機械	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	168	168	2,822	36,042	各種金融サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB-B	584	600	15,294	195,304	家庭用品	
BOLIDEN AB	260	274	6,655	84,990	金属・鉱業	
HEXAGON AB-B SHS	244	258	8,400	107,274	電子装置・機器・部品	
TELE 2 AB-B SHS	284	340	2,458	31,391	無線通信サービス	
KINNEVIK AB - B	236	236	5,184	66,211	各種金融サービス	
ATLAS COPCO AB-A	648	646	18,184	232,221	機械	
ATLAS COPCO AB-B	382	382	9,607	122,685	機械	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	1,450	1,480	18,988	242,481	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	970	963	16,380	209,180	建設関連製品	
小 計	株 数 ・ 金 額	22,442	22,702	308,249	3,936,343	
	銘柄 数 < 比 率 >	30	31	—	< 1.1% >	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円		
DNB ASA	956	940	11,975	162,389	銀行	
TELENOR ASA	719	749	9,474	128,478	各種電気通信サービス	
SCHIBSTED ASA	78	78	1,523	20,656	メディア	
STATOIL ASA	1,079	1,105	17,403	235,994	石油・ガス・消耗燃料	
YARA INTERNATIONAL ASA	168	168	5,594	75,860	化学	
MARINE HARVEST ASA	365	359	5,546	75,211	食品	
NORSK HYDRO	1,300	1,300	5,349	72,539	金属・鉱業	
ORKLA ASA	800	800	6,096	82,661	食品	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	197	197	2,649	35,929	保険	
SCHIBSTED ASA-B SHS	91	91	1,656	22,458	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,753	5,787	67,269	912,179	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	10	—	< 0.3% >	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG B	105	105	6,321	104,359	飲料	
A P MOLLER-MAERSK A/S	6	6	7,043	116,283	海運業	
A P MOLLER - MAERSK A/S-A	3	3	4,031	66,555	海運業	
DANSKE BANK AS	686	669	14,276	235,704	銀行	
GENMAB A/S	54	54	6,318	104,326	バイオテクノロジー	
TDC A/S	768	768	2,711	44,771	各種電気通信サービス	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	216	212	9,313	153,760	電気設備	
DSV A/S	182	193	5,984	98,811	陸運・鉄道	
PANDORA A/S	112	110	9,806	161,905	繊維・アパレル・贅沢品	
CHR HANSEN HOLDING A/S	93	100	3,850	63,563	化学	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	225	225	5,460	90,156	化学	
COLOPLAST-B	117	117	5,475	90,402	ヘルスケア機器・用品	
NOVO NORDISK A/S-B	1,795	1,855	47,024	776,370	医薬品	
ISS A/S	161	161	3,823	63,130	商業サービス・用品	
TRYG A/S	118	118	1,466	24,215	保険	
DONG ENERGY A/S	—	76	1,983	32,749	電力	
WILLIAM DEMANT HOLDING	130	130	1,575	26,013	ヘルスケア機器・用品	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,772	4,903	136,467	2,253,079	
	銘柄 数 < 比 率 >	16	17	—	< 0.6% >	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ADIDAS AG	184	184	2,663	326,958	繊維・アパレル・贅沢品	
FRESENIUS SE & CO KGAA	398	396	2,890	354,874	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	116	129	477	58,617	インターネットソフトウェア・サービス	
FUCHS PETROLUB SE -PFD	64	64	253	31,092	化学	
HANNOVER RUECK SE	57	62	635	78,052	保険	
GEA GROUP AG	175	186	695	85,431	機械	
CONTINENTAL AG	106	108	2,017	247,692	自動車部品	
DEUTSCHE POST AG-REG	940	947	2,953	362,595	航空貨物・物流サービス	
AXEL SPRINGER SE	44	44	200	24,665	メディア	
MERCK KGAA	126	125	1,236	151,762	医薬品	
RWE AG	462	496	574	70,539	総合公益事業	
SAP SE	948	954	7,871	966,299	ソフトウェア	
E. ON SE	1,940	1,990	1,332	163,627	総合公益事業	
HENKEL AG & CO KGAA	100	99	975	119,745	家庭用品	
METRO AG	166	182	571	70,210	食品・生活必需品小売り	
BAYER AG-REG	801	803	7,925	972,947	医薬品	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	174	173	1,958	240,408	家庭用品	
BASF SE	887	892	7,814	959,346	化学	
BEIERSDORF AG	100	100	805	98,920	パーソナル用品	
HOCHTIEF AG	20	20	269	33,071	建設・土木	
HEIDELBERGCEMENT AG	137	143	1,244	152,725	建設資材	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
FRESENIUS MEDICAL CARE	209	208	1,686	207,030	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
ALLIANZ SE-REG	440	443	6,995	858,776	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	226	226	286	35,179	旅客航空輸送業	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	160	155	2,776	340,837	保険	
VOLKSWAGEN AG	32	32	468	57,531	自動車	
VOLKSWAGEN AG-PREF	178	181	2,512	308,407	自動車	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	929	934	6,654	816,937	自動車	
MAN SE	32	37	350	43,059	機械	
THYSSENKRUPP AG	363	363	837	102,781	金属・鋳業	
SIEMENS AG	742	743	8,511	1,044,818	コングロマリット	
QIAGEN NV	223	223	589	72,380	ライフサイエンス・ツール/サービス	
LINDE AG	179	181	2,879	353,458	化学	
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,331	1,330	2,393	293,805	資本市場	
BAYER MOTOREN WERK	318	323	2,909	357,140	自動車	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	53	53	389	47,827	自動車	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	3,114	3,174	5,099	625,957	各種電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,090	1,089	1,812	222,452	半導体・半導体製造装置	
DEUTSCHE BOERSE AG	189	—	—	—	各種金融サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	152	152	814	99,996	自動車	
FRAPORT AG	38	38	213	26,239	運送インフラ	
LANXESS	83	85	529	65,059	化学	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	329	329	973	119,548	不動産管理・開発	
SYMRISE AG	121	121	701	86,078	化学	
BRENTAG AG	151	151	797	97,916	商社・流通業	
K+S AG	188	188	406	49,919	化学	
EVONIK INDUSTRIES AG	138	169	481	59,168	化学	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	746	746	306	37,684	各種電気通信サービス	
HUGO BOSS AG	63	63	366	44,941	繊維・アパレル・贅沢品	
COMMERZBANK AG	1,020	1,020	779	95,714	銀行	
OSRAM LICHT AG	88	88	444	54,592	電気設備	
VONOVIA SE	452	446	1,352	165,977	不動産管理・開発	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	209	223	821	100,878	メディア	
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	—	189	1,493	183,316	資本市場	
INNOGY SE	—	145	470	57,761	総合公益事業	
ZALANDO SE	81	81	291	35,742	インターネット販売・通信販売	
COVESTRO AG	68	68	446	54,777	化学	
SCHAEFFLER AG	160	160	224	27,498	自動車部品	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	21,844 56	22,258 57	104,437 —	12,820,781 <3.6%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	1,137	1,120	1,594	195,787	保険	
INTESA SANPAOLO	12,160	12,370	3,030	372,042	銀行	
INTESA SANPAOLO-RSP	920	920	207	25,411	銀行	
MEDIOBANCA S. P. A.	530	530	416	51,139	銀行	
SAIPEM SPA	5,497	5,897	291	35,739	エネルギー設備・サービス	
LUXOTTICA GROUP SPA	165	165	844	103,707	繊維・アパレル・贅沢品	
ENEL SPA	7,387	7,440	3,041	373,371	電力	
ENI SPA	2,448	2,480	3,762	461,842	石油・ガス・消耗燃料	
SNAM SPA	2,370	2,330	890	109,378	石油・ガス・消耗燃料	
TENARIS SA	460	460	758	93,118	エネルギー設備・サービス	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	900	—	—	—	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	9,900	9,900	831	102,087	各種電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RNC	5,700	5,700	391	48,001	各種電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	393	416	931	114,290	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…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
TERNA SPA	1,420	1,520	655	80,497	電力	
EXOR SPA	112	—	—	—	各種金融サービス	
LEONARDO-FINMECCANICA SPA	410	410	551	67,645	航空宇宙・防衛	
PRYSMIAN SPA	194	194	469	57,609	電気設備	
UNICREDIT SPA	4,841	5,031	1,425	175,054	銀行	
UNIPOLSAI SPA	1,070	1,070	218	26,769	保険	
FERRARI NV	127	116	648	79,602	自動車	
CNH INDUSTRIAL NV	990	990	823	101,054	機械	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	890	890	776	95,271	自動車	
EXOR NV	—	112	461	56,646	各種金融サービス	
POSTE ITALIANE SPA	500	500	314	38,608	保険	
小 計	株 数 銘柄 数 < 比 率 >	60,522 24	60,561 23	23,335 —	2,864,677 <0.8%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES	201	201	687	84,375	建設・土木	
AIRBUS GROUP SE	574	566	3,565	437,737	航空宇宙・防衛	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	437	461	739	90,802	総合公益事業	
LOREAL-ORD	245	246	4,202	515,880	パーソナル用品	
CHRISTIAN DIOR SE	53	53	1,067	131,099	繊維・アパレル・贅沢品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	268	273	4,908	602,563	繊維・アパレル・贅沢品	
DASSAULT AVIATION SA	—	2	211	25,989	航空宇宙・防衛	
THALES SA	99	105	960	117,967	航空宇宙・防衛	
CAP GEMINI SA	160	158	1,258	154,528	情報技術サービス	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	59	59	268	32,962	食品・生活必需品小売り	
INGENICO GROUP	55	55	404	49,713	電子装置・機器・部品	
PUBLICIS GROUPE	184	191	1,250	153,532	メディア	
LAGARDERE S. C. A	116	116	303	37,309	メディア	
BOLLORE	870	870	289	35,490	航空貨物・物流サービス	
MICHELIN (CGDE)	178	175	1,855	227,827	自動車部品	
PERNOD RICARD SA	205	207	2,120	260,338	飲料	
RENAULT SA	188	186	1,595	195,910	自動車	
REMY COINTREAU	23	23	184	22,621	飲料	
SEB SA	—	20	253	31,095	家庭用耐久財	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	538	544	3,561	437,151	電気設備	
VIVENDI SA	1,132	1,000	1,832	224,957	メディア	
TECHNIP SA	105	104	695	85,398	エネルギー設備・サービス	
ORANGE SA	1,925	1,950	2,767	339,683	各種電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	24	26	1,015	124,623	繊維・アパレル・贅沢品	
SOCIETE BIC SA	28	28	353	43,343	商業サービス・用品	
DASSAULT SYSTEMES SA	121	128	918	112,711	ソフトウェア	
KERING SA	72	75	1,599	196,396	繊維・アパレル・贅沢品	
CNP ASSURANCES	165	165	289	35,568	保険	
CARREFOUR SUPERMARCHE	541	563	1,282	157,441	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	86	86	850	104,348	情報技術サービス	
SANOFI	1,137	1,127	8,475	1,040,395	医薬品	
ACCOR SA	173	173	620	76,221	ホテル・レストラン・レジャー	
STMICROELECTRONICS NV	577	600	643	78,959	半導体・半導体製造装置	
SOCIETE GENERALE	742	742	3,475	426,655	銀行	
EURAZEO	40	40	222	27,298	各種金融サービス	
SODEXO	90	89	956	117,396	ホテル・レストラン・レジャー	
AXA	1,881	1,898	4,554	559,079	保険	
PEUGEOT CITROEN	473	473	743	91,278	自動車	
JC DECAUX SA	68	68	186	22,897	メディア	
ESSILOR INTERNATIONAL	199	204	2,149	263,828	ヘルスケア機器・用品	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			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		
CREDIT AGRICOLE SA	1,030	1,080	1,292	158,632	銀行	
ZODIAC AEROSPACE	195	195	435	53,430	航空宇宙・防衛	
BNP PARIBAS	1,023	1,032	6,316	775,459	銀行	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	455	481	2,099	257,713	建設関連製品	
WENDEL	29	29	332	40,798	各種金融サービス	
ILIAD SA	24	27	487	59,832	各種電気通信サービス	
SES FDR	352	344	724	88,956	メディア	
IMERYS	38	38	270	33,190	建設資材	
SAFRAN SA	301	304	2,069	253,993	航空宇宙・防衛	
ENGIE	1,411	1,452	1,780	218,531	総合公益事業	
ALSTOM	155	155	404	49,624	機械	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	163	163	308	37,918	メディア	
ELECTRICITE DE FRANCE	228	228	222	27,258	電力	
ARKEMA	67	67	626	76,968	化学	
LEGRAND SA	253	264	1,415	173,807	電気設備	
EIFFAGE SA	55	61	399	48,996	建設・土木	
TOTAL SA	2,137	2,189	10,418	1,278,980	石油・ガス・消耗燃料	
ADP	28	28	284	34,905	運送インフラ	
NATIXIS	870	870	469	57,651	銀行	
SCOR SE	154	154	498	61,148	保険	
REXEL SA	286	286	452	55,560	商社・流通業	
VINCI	485	489	3,140	385,510	建設・土木	
DANONE	567	577	3,404	417,911	食品	
AIR LIQUIDE	334	376	3,957	485,810	化学	
BUREAU VERITAS SA	255	255	465	57,113	専門サービス	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	450	450	403	49,563	運送インフラ	
SUEZ	299	333	465	57,189	総合公益事業	
EDENRED	187	214	405	49,782	商業サービス・用品	
VALEO SA	228	228	1,248	153,241	自動車部品	
SFR GROUP SA	110	77	201	24,793	各種電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	26,205 68	26,499 70	108,322 -	13,297,657 <3.7%>	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	-	219	681	83,610	飲料	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	- -	219 1	681 -	83,610 <0.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
RELX NV	970	954	1,518	186,443	専門サービス	
RANDSTAD HOLDING NV	116	116	608	74,703	専門サービス	
AKZO NOBEL	240	237	1,398	171,626	化学	
WOLTERS KLUWER	289	299	1,024	125,825	専門サービス	
VOPAK	71	71	313	38,507	石油・ガス・消耗燃料	
AEGON NV	1,800	1,800	949	116,604	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	3,300	3,430	962	118,109	各種電気通信サービス	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	903	916	2,636	323,682	コングロマリット	
ING GROEP NV	3,750	-	-	-	銀行	
HEINEKEN NV	220	223	1,589	195,132	飲料	
ARCELORMITTAL	1,792	1,780	1,301	159,711	金属・鉱業	
HEINEKEN HOLDING NV	97	97	644	79,067	飲料	
KONINKLIJKE DSM NV	175	182	1,041	127,909	化学	
UNILEVER NV-CVA	1,571	1,580	6,173	757,804	パーソナル用品	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	81	93	307	37,720	建設・土木	
ASML HOLDING NV	356	360	3,805	467,126	半導体・半導体製造装置	
GEMALTO	76	76	420	51,658	ソフトウェア	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	—	1,249	2,459	301,901	食品・生活必需品小売り	
OCI	80	—	—	—	化学	
KONINKLIJKE AHOLD NV	812	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
NN GROUP NV	306	300	951	116,836	保険	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	227	279	594	73,021	銀行	
ALTICE NV - B	100	100	188	23,194	メディア	
ALTICE NV - A	368	368	693	85,112	メディア	
ING GROEP NV	—	3,780	5,152	632,476	銀行	
小 計	株数・金額	17,700	18,290	34,735	4,264,176	
	銘柄数<比率>	23	22	—	<1.2%>	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	502	630	853	104,810	運送インフラ	
ABERTIS INFRASTRUCTURAS-RIGHTS	502	—	—	—	運送インフラ	
ENDESA S. A.	317	317	647	79,503	電力	
BANKINTER S. A.	650	650	485	59,630	銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S. A.	6,306	6,433	4,152	509,801	銀行	
GAS NATURAL SDG	328	328	580	71,229	ガス	
REPSOL SA	1,043	1,059	1,427	175,265	石油・ガス・消耗燃料	
REPSOL SA-RTS	1,043	1,059	37	4,593	石油・ガス・消耗燃料	
BANCO SANTANDER SA	13,978	14,173	7,048	865,266	銀行	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	102	—	—	—	電力	
TELEFONICA SA	4,356	4,644	4,101	503,540	各種電気通信サービス	
ZARDOYA OTIS S. A	168	175	141	17,360	機械	
ENAGAS	213	228	554	68,083	ガス	
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV	185	190	576	70,729	建設・土木	
FERROVIAL SA	463	464	815	100,051	建設・土木	
FERROVIAL SA-RIGHTS	463	—	—	—	建設・土木	
MAPPRE SA	1,110	980	287	35,249	保険	
BANCO DE SABADELL SA	5,045	4,995	684	84,018	銀行	
CAIXABANK	2,482	3,358	1,072	131,659	銀行	
IBERDROLA SA	5,287	5,284	3,218	395,144	電力	
AMADEUS IT GROUP SA	430	426	1,836	225,499	情報技術サービス	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	800	800	427	52,492	旅客航空輸送業	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	570	560	260	32,001	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	4,300	4,300	419	51,519	銀行	
BCO POPULAR ESPANOL	3,132	3,002	286	35,164	銀行	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	—	432	761	93,469	電力	
INDITEX SA	1,056	1,066	3,413	419,020	専門小売り	
AENA SA	65	65	861	105,766	運送インフラ	
GRIFOLS SA	288	288	531	65,265	バイオテクノロジー	
小 計	株数・金額	55,189	55,913	35,484	4,356,136	
	銘柄数<比率>	28	26	—	<1.2%>	
(ユーロ…ベルギー)						
UMICORE	88	94	500	61,424	化学	
DELHAIZE GROUP	98	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
KBC GROEP NV	240	240	1,438	176,568	銀行	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	777	—	—	—	飲料	
SOLVAY SA	73	73	813	99,875	化学	
UCB SA	123	121	727	89,346	医薬品	
COLRUYT SA	70	70	323	39,687	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAM	78	78	619	76,094	各種金融サービス	
PROXIMUS	151	151	405	49,724	各種電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	52	52	276	33,890	メディア	
AGEAS	200	190	716	87,898	保険	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)	百株	百株	千ユーロ	千円	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	—	740	7,343	901,519	飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,950 11	1,809 10	13,164 —	1,616,030 <0.5%>
(ユーロ…オーストリア)					
OMV AG	140	138	473	58,124	石油・ガス・消耗燃料
VOESTALPINE AG	110	110	409	50,233	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG	268	307	883	108,501	銀行
IMMOEAST AG-RIGHTS	500	500	—	—	不動産管理・開発
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	110	110	195	23,982	銀行
ANDRITZ AG	72	72	340	41,820	機械
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,200 6	1,237 6	2,302 —	282,662 <0.1%>
(ユーロ…ルクセンブルグ)					
EUROFINS SCIENTIFIC SE	—	10	414	50,823	ライフサイエンス・ツール/サービス
RTL GROUP	39	39	269	33,053	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	39 1	49 2	683 —	83,877 <0.0%>
(ユーロ…フィンランド)					
WARTSILA OYJ	147	147	629	77,253	機械
UPM-KYMMENE OYJ	505	531	1,206	148,101	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R	540	540	536	65,892	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS	432	430	1,841	226,085	保険
FORTUM OYJ	440	440	648	79,563	電力
ELISA OYJ	137	149	452	55,513	各種電気通信サービス
METSO OYJ	104	103	280	34,430	機械
NOKIA OYJ	5,600	5,680	2,685	329,672	通信機器
NESTE OYJ	125	125	457	56,178	石油・ガス・消耗燃料
NOKIAN RENKAAT OYJ	113	113	397	48,801	自動車部品
KONE OYJ	326	323	1,373	168,598	機械
ORION OYJ	96	95	397	48,747	医薬品
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	8,565 12	8,676 12	10,906 —	1,338,839 <0.4%>
(ユーロ…アイルランド)					
BANK OF IRELAND	28,500	28,500	675	82,918	銀行
CRH PLC	822	823	2,650	325,321	建設資材
KERRY GROUP PLC-A	161	166	1,101	135,209	食品
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	1,398	1,398	—	—	銀行
PADDY POWER PLC	81	84	849	104,252	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	30,962 5	30,971 5	5,276 —	647,701 <0.2%>
(ユーロ…ポルトガル)					
ENERGIAS DE PORTUGAL	2,200	2,350	682	83,747	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	445	480	677	83,113	石油・ガス・消耗燃料
JERONIMO MARTINS	252	230	332	40,827	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,897 3	3,060 3	1,691 —	207,688 <0.1%>
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	227,076 237	229,544 237	341,021 —	41,863,839 <11.7%>
(香港)			千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	219	219	1,726	26,195	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD	2,130	2,130	3,480	52,797	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA	1,208	1,208	3,692	56,011	銀行
CLP HLDGS	1,605	1,590	11,511	174,630	電力
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	1,070	1,070	1,097	16,653	旅客航空輸送業

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	650	650	3,965	60,149	電力	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	1,102	1,129	20,559	311,881	資本市場	
LI & FUNG LTD	5,636	5,636	2,079	31,548	繊維・アパレル・贅沢品	
MTR CORP	1,395	1,485	5,576	84,590	陸運・鉄道	
FIRST PACIFIC CO	2,260	2,260	1,236	18,753	各種金融サービス	
HANG LUNG GROUP LTD	—	810	2,235	33,914	不動産管理・開発	
HANG SENG BANK	730	762	11,071	167,960	銀行	
HENDERSON LAND	1,078	1,078	4,398	66,732	不動産管理・開発	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,350	1,320	9,068	137,567	電力	
WHARF (HOLDING)	1,330	1,330	6,816	103,402	不動産管理・開発	
HONG KONG & CHINA GAS	7,288	7,588	10,395	157,702	ガス	
HYSAN DEVELOPMENT	650	650	2,106	31,948	不動産管理・開発	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	2,230	2,230	7,559	114,680	ホテル・レストラン・レジャー	
KERRY PROPERTIES	570	570	1,199	18,201	不動産管理・開発	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,635	3,635	10,141	153,848	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	1,355	1,595	2,022	30,680	コングロマリット	
PCCW LTD	3,860	3,860	1,640	24,886	各種電気通信サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	750	750	2,115	32,084	繊維・アパレル・贅沢品	
NEW WORLD DEVELOPMENT	5,166	5,696	4,716	71,554	不動産管理・開発	
SHANGRI-LA ASIA LTD	1,083	1,083	883	13,410	ホテル・レストラン・レジャー	
SINO LAND CO. LTD	2,860	3,140	3,604	54,683	不動産管理・開発	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,410	1,390	13,677	207,489	不動産管理・開発	
SWIRE PACIFIC-A	535	535	3,913	59,368	不動産管理・開発	
WHEELLOCK & COMPANY LTD	870	750	3,255	49,378	不動産管理・開発	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,280	1,400	4,025	61,059	家庭用耐久財	
SJM HOLDINGS LIMITED	1,660	1,660	992	15,058	ホテル・レストラン・レジャー	
WYNN MACAU LTD	1,684	1,684	2,057	31,217	ホテル・レストラン・レジャー	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	780	940	1,391	21,104	ホテル・レストラン・レジャー	
AIA GROUP LTD	11,624	11,690	51,494	781,170	保険	
HKT TRUST AND HKT LTD	2,596	2,596	2,455	37,254	各種電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	2,348	2,336	7,778	118,005	ホテル・レストラン・レジャー	
SWIRE PROPERTIES LTD	1,168	1,168	2,522	38,272	不動産管理・開発	
WH GROUP LIMITED	5,900	8,100	5,062	76,798	食品	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	2,625	2,635	23,165	351,415	コングロマリット	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	2,635	2,610	12,673	192,256	不動産管理・開発	
小計	株数	金額	88,327	92,970	269,368	4,086,321
	銘柄数	<比率>	39	40	—	<1.1%>
(シンガポール)			千シンガポールドル			
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,410	1,610	528	43,027	航空宇宙・防衛	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,153	6,203	266	21,733	食品	
DBS GROUP HLDGS	1,710	1,730	3,048	248,372	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	370	410	338	27,560	不動産管理・開発	
SEMBCORP MARINE	726	—	—	—	機械	
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	100	100	399	32,510	販売	
SATS LTD	—	590	287	23,459	運送インフラ	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	770	770	555	45,235	資本市場	
CAPITALAND LIMITED	2,460	2,460	735	59,931	不動産管理・開発	
GENTING SINGAPORE PLC	6,146	6,146	565	46,071	ホテル・レストラン・レジャー	
COMFORTDELGRO CORP LTD	2,070	2,070	527	43,009	陸運・鉄道	
SINGAPORE AIRLINES LTD	550	550	536	43,725	旅客航空輸送業	
UNITED OVERSEAS BANK	1,255	1,250	2,587	210,829	銀行	
UOL GROUP LIMITED	487	487	294	23,967	不動産管理・開発	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	1,510	1,480	528	43,050	メディア	
NOBLE GROUP LTD	4,124	—	—	—	商社・流通業	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	7,700	7,750	2,821	229,855	各種電気通信サービス	
SEBACORP INDUSTRIES	990	990	289	23,563	コングロマリット	
OCBC-ORD	2,975	3,030	2,745	223,677	銀行	
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,840	1,840	688	56,071	食品	
STARHUB LTD	530	690	193	15,741	無線通信サービス	
KEPPEL CORP.	1,427	1,427	841	68,600	コングロマリット	
YANGZIJIANG SHIPBUILDING	1,630	1,630	131	10,691	機械	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	2,660	2,660	595	48,549	不動産管理・開発	
小 計	株 数	金 額	49,594	45,874	19,504	1,589,235
	銘柄 数 < 比 率 >		23	22	-	< 0.4% >
(オーストラリア)			千豪ドル			
RAMSAY HEALTH CARE LTD	141	141	954	81,377	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	2,817	2,840	8,605	733,593	銀行	
AMCOR	1,130	1,120	1,677	143,029	容器・包装	
WESTPAC BANKING CORP	3,228	3,249	10,552	899,622	銀行	
BANK OF QUEENSLAND LTD	351	351	423	36,102	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,420	1,480	880	75,071	金属・鉱業	
TELSTRA CORP LTD	4,170	4,140	2,082	177,526	各種電気通信サービス	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	443	443	564	48,151	銀行	
COCA-COLA AMATIL LTD	520	600	599	51,098	飲料	
ASX LTD	182	196	960	81,924	資本市場	
BHP BILLITON LIMITED	3,084	3,115	7,840	668,398	金属・鉱業	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	255	255	785	66,977	石油・ガス・消耗燃料	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	530	530	269	22,952	複合小売り	
COMPUTERSHARE LTD	470	470	576	49,162	情報技術サービス	
CSL LIMITED	451	446	4,406	375,652	バイオテクノロジー	
REA GROUP LTD	54	54	295	25,158	メディア	
TRANSURBAN GROUP	1,950	1,980	2,057	175,378	運送インフラ	
COCHLEAR LTD	52	58	695	59,279	ヘルスケア機器・用品	
ORIGIN ENERGY LTD	1,750	1,750	1,114	95,032	石油・ガス・消耗燃料	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,646	1,666	13,676	1,165,895	銀行	
BORAL LTD	670	1,150	625	53,332	建設資材	
RIO TINTO LTD	410	408	2,452	209,109	金属・鉱業	
APA GROUP	1,070	1,110	961	81,947	ガス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	520	520	798	68,046	ホテル・レストラン・レジャー	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	2,320	2,450	1,470	125,317	保険	
TPG TELECOM LTD	330	330	214	18,286	各種電気通信サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	52	52	163	13,897	ホテル・レストラン・レジャー	
ORICA LTD	366	366	641	54,727	化学	
SUNCORP GROUP LTD	1,260	1,260	1,707	145,547	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,554	2,602	7,951	677,883	銀行	
NEWCREST MINING	750	750	1,332	113,553	金属・鉱業	
OIL SEARCH LTD	1,300	1,290	887	75,661	石油・ガス・消耗燃料	
INCITEC PIVOT LTD	1,610	1,610	577	49,273	化学	
AMP LIMITED	2,850	2,810	1,424	121,453	各種金融サービス	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	441	441	148	12,679	旅客航空輸送業	
QBE INSURANCE	1,330	1,320	1,668	142,237	保険	
CHALLENGER LIMITED	560	560	626	53,421	各種金融サービス	
SANTOS LTD.	1,670	1,480	587	50,089	石油・ガス・消耗燃料	
SONIC HEALTHCARE LTD	373	405	854	72,850	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
TABCORP HOLDINGS	780	780	371	31,651	ホテル・レストラン・レジャー	
WESFARMERS LIMITED	1,079	1,100	4,627	394,511	食品・生活必需品小売り	
ALUMINA LTD	2,330	2,330	424	36,151	金属・鉱業	
WOODSIDE PETROLEUM	711	735	2,281	194,492	石油・ガス・消耗燃料	

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		
WOOLWORTHS LIMITED	1,229	1,266	2,990	254,922	食品・生活必需品小売り	
DUET GROUP	2,290	2,290	643	54,857	総合公益事業	
SEEK LTD	328	328	488	41,663	専門サービス	
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	59	59	381	32,532	ホテル・レストラン・レジャー	
TATTS GROUP LTD	1,470	1,470	665	56,768	ホテル・レストラン・レジャー	
BRAMBLES LTD	1,550	1,530	1,877	160,040	商業サービス・用品	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	250	—	—	—	資本市場	
ASCIANO LTD	610	—	—	—	陸運・鉄道	
MACQUARIE GROUP LIMITED	296	295	2,559	218,165	資本市場	
CROWN RESORTS LTD	360	360	410	34,955	ホテル・レストラン・レジャー	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	430	540	203	17,355	各種電気通信サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	440	440	947	80,796	建設資材	
TREASURY WINE ESTATES LTD	720	720	751	64,080	飲料	
SYDNEY AIRPORT	1,079	1,079	654	55,834	運送インフラ	
AURIZON HOLDINGS LTD	2,090	2,090	1,053	89,798	陸運・鉄道	
HEALTHSCOPE LTD	1,760	1,760	396	33,759	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AUSNET SERVICES	1,634	1,634	249	21,243	電力	
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,610	2,610	730	62,300	保険	
AGL ENERGY LTD	645	657	1,430	121,988	総合公益事業	
SOUTH32 LTD	5,000	5,070	1,353	115,402	金属・鉱業	
CIMIC GROUP LTD	89	89	300	25,586	建設・土木	
小 計	株 数 ・ 金 額	74,919	75,030	109,906	9,369,556	
	銘柄 数 < 比 率 >	64	62	—	< 2.6% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
CONTACT ENERGY LTD	760	760	353	28,738	電力	
RYMAN HEALTHCARE LTD	350	350	288	23,481	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	690	690	731	59,477	建設資材	
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,700	1,680	571	46,449	各種電気通信サービス	
MERCURY NZ LTD	600	600	176	14,320	電力	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	971	971	623	50,698	運送インフラ	
MERIDIAN ENERGY LTD	1,200	1,200	303	24,688	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,271	6,251	3,047	247,854	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 0.1% >	
(イスラエル)			千新シエケル			
BANK HAPOALIM BM	1,020	1,050	2,407	74,083	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,380	1,420	2,279	70,127	銀行	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	2,010	2,040	1,389	42,746	各種電気通信サービス	
ELBIT SYSTEMS LTD	—	23	884	27,211	航空宇宙・防衛	
FRUTAROM	—	38	754	23,209	化学	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	440	500	746	22,969	化学	
NICE LTD	59	59	1,534	47,201	ソフトウェア	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	889	—	—	—	医薬品	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	130	130	721	22,188	銀行	
AZRIELI GROUP	41	41	682	20,992	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,969	5,301	11,398	350,731	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	9	—	< 0.1% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	1,258,368	1,220,978	—	344,626,937	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,269	1,272	—	< 96.1% >	

\* 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。

\* 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	—	32,900	595	70,062	0.0	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,000	7,600	828	97,546	0.0	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	32,900	—	—	—	—	
AMERICAN TOWER CORP	41,000	41,600	4,434	522,036	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	91,000	95,000	972	114,518	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,330	13,230	2,287	269,327	0.1	
BOSTON PROPERTIES	14,700	14,900	1,856	218,534	0.1	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	20,300	30,000	734	86,488	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	8,300	8,200	667	78,566	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	32,300	32,900	2,866	337,453	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	14,400	15,300	1,458	171,682	0.0	
DUKE REALTY CORP	34,000	34,000	883	104,024	0.0	
EQUINIX INC	6,680	7,010	2,453	288,842	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	35,100	36,100	2,290	269,685	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,300	6,540	1,488	175,211	0.0	
EXTRA SPACE STORAGE INC	12,000	12,700	934	110,005	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,520	6,910	966	113,719	0.0	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	54,400	56,500	1,433	168,806	0.0	
HCP INC	45,600	44,700	1,312	154,547	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	73,900	73,900	1,416	166,769	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	24,400	24,400	786	92,605	0.0	
KIMCO REALTY CORP	40,500	40,000	1,012	119,179	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	14,300	14,300	559	65,904	0.0	
MACERICH CO /THE	12,300	12,300	843	99,300	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,200	11,200	1,056	124,370	0.0	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	—	14,500	622	73,261	0.0	
PROLOGIS INC	50,700	51,400	2,667	314,036	0.1	
PUBLIC STORAGE	14,240	14,380	3,093	364,174	0.1	
REALTY INCOME CORP	23,800	24,700	1,389	163,528	0.0	
REGENCY CENTERS CORP	9,400	10,300	690	81,262	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	9,800	9,800	1,054	124,144	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	29,970	30,470	5,428	639,083	0.2	
UDR INC	25,700	25,300	891	104,955	0.0	
VENTAS INC	32,500	34,600	2,115	249,070	0.1	
VEREIT INC	84,000	95,000	796	93,716	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	16,600	16,500	1,700	200,162	0.1	
WELLTOWER INC	34,500	35,300	2,305	271,396	0.1	
WEYERHAEUSER CO	76,000	72,200	2,225	261,951	0.1	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	509,000	223	26,364	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,564,640	1,615,640	59,346	6,986,300	
	銘柄 数 < 比 率 >	37	38	—	<1.9%>	
(カナダ)				千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	13,600	299	26,198	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	14,400	16,900	443	38,846	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	%
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		6,900	6,900	219	19,203	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	34,900	37,400	961	84,247	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.0% >	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		94,000	92,000	585	85,199	0.0
HAMMERSON PLC		73,000	74,000	415	60,556	0.0
INTU PROPERTIES PLC		88,000	88,000	242	35,276	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		77,500	77,500	812	118,264	0.0
SEGRO PLC		70,000	86,000	381	55,524	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	402,500	417,500	2,436	354,820	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.1% >	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
ICADE		3,700	3,700	246	30,205	0.0
KLEPIERRE		21,200	22,400	826	101,482	0.0
GECINA SA		4,000	4,000	512	62,926	0.0
FONCIERE DES REGIONS		3,100	3,100	252	31,045	0.0
UNIBAIL RODAMCO-NA		9,600	9,570	2,124	260,808	0.1
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	41,600	42,770	3,962	486,468	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.1% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		219,000	215,000	10,750	163,077	0.0
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		260,000	260,000	1,648	25,006	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	479,000	475,000	12,398	188,083	
	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	249,900	472	38,483	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		213,000	239,000	544	44,400	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		192,000	192,000	285	23,231	0.0
SUNTEC REIT		243,000	243,000	402	32,768	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	897,900	923,900	1,704	138,883	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.0% >	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		350,000	381,000	807	68,858	0.0
GPT GROUP		179,000	179,000	895	76,298	0.0
LENLEASE GROUP		53,000	53,000	753	64,249	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP		230,000	227,000	1,028	87,663	0.0
DEXUS PROPERTY GROUP		92,000	91,000	873	74,474	0.0
GOODMAN GROUP		174,000	174,000	1,226	104,576	0.0
SCENTRE GROUP		513,000	527,000	2,334	199,025	0.1
WESTFIELD CORP		193,000	191,000	1,761	150,126	0.0
VICINITY CENTRES		328,704	328,704	976	83,225	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	2,112,704	2,151,704	10,656	908,498	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	9	—	< 0.3% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	5,533,244	5,663,914	—	9,147,303	
	銘 柄 数 < 比 率 >	65	66	—	< 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	
			買建額	売建額
外国	株式先物取引	CAN60	189	—
		EURO50	584	—
		FT100	345	—
		SPI200	142	—
		SPEMINI	3,259	—
		SWISSMKT	167	—
				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。

## ＜新興国株式マザーファンド＞

下記は、新興国株式マザーファンド全体(17, 139, 087千口)の内容です。

## 外国株式

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カタル)	百株	百株	千カタルリヤル	千円		
QATAR INSURANCE CO	37	46	386	12,513		保険
QATAR NATIONAL BANK	73	78	1,294	41,926		銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR	56	56	178	5,767		銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR-RIGHTS	—	10	5	169		銀行
OOREDOO QSC	27	33	337	10,935		各種電気通信サービス
DOHA BANK LTD	42	42	144	4,686		銀行
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8	10	233	7,559		総合公益事業
INDUSTRIES QATAR	50	58	675	21,885		コングロマリット
QATAR ISLAMIC BANK	21	21	216	7,026		銀行
QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	96	96	220	7,152		石油・ガス・消耗燃料
MASRAF AL RAYAN	133	133	502	16,282		銀行
BARWA REAL ESTATE CO	32	32	104	3,379		不動産管理・開発
EZDAN HOLDING GROUP	253	301	476	15,430		不動産管理・開発
VODAFONE QATAR	99	—	—	—		無線通信サービス
小計	株数	金額	933	922	4,776	154,716
銘柄数<比率>	13	13	—	—	<0.9%>	
(アメリカ)			千米ドル			
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	334	423	3,778	444,845		インターネットソフトウェア・サービス
BAIDU INC - SPON ADR	92	102	1,678	197,597		インターネットソフトウェア・サービス
BANCO DE CHILE-ADR	12	16	110	12,987		銀行
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	52	58	127	14,964		銀行
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	36	42	151	17,809		銀行
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	25	25	51	6,012		飲料
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	66	66	67	7,924		金属・鉱業
CTRIIP.COM INTERNATIONAL -ADR	112	141	573	67,555		インターネット販売・通信販売
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	88	88	80	9,530		石油・ガス・消耗燃料
ENEL GENERACION CHILE-SP ADR	37	44	83	9,774		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ENDESA AMERICAS SA - ADR	37	—	—	—		独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ENEL AMERICAS S.A-ADR	135	217	176	20,756		電力
ENEL CHILE SA-ADR	135	135	61	7,212		電力
58.COM INC-ADR	25	30	87	10,291		インターネットソフトウェア・サービス
ITAU CORPBANCA-ADR	31	39	48	5,733		銀行
JD.COM INC-ADR	228	255	659	77,688		インターネット販売・通信販売
STATE BANK OF INDIA-GDR	52	56	210	24,742		銀行
PJSC GAZPROM-ADR	1,988	2,228	1,124	132,399		石油・ガス・消耗燃料
LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR	109	109	91	10,804		旅客航空輸送業
TRANSNEFT PJSC	0.52	0.58	187	22,064		石油・ガス・消耗燃料
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	176	202	184	21,740		無線通信サービス
NETEASE INC-ADR	26	30	669	78,797		インターネットソフトウェア・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	44	50	211	24,862		各種消費者サービス
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	275	275	40	4,778		不動産管理・開発
QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	30	—	—	—		インターネットソフトウェア・サービス
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	8	13	38	4,586		インターネット販売・通信販売
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	35	35	99	11,672		化学
SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	94	—	—	—		インターネットソフトウェア・サービス
SOUTHERN COPPER CORP	26	33	108	12,758		金属・鉱業
TAL EDUCATION GROUP-ADR	14	17	113	13,396		各種消費者サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	133	152	172	20,344		インターネット販売・通信販売

銘柄	株数	当期	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		
WEIBO CORP-SPON ADR	—	12	51	6,030	インターネットソフトウェア・サービス	
YY INC-ADR	10	10	43	5,064	インターネットソフトウェア・サービス	
YUM CHINA HOLDINGS INC	—	151	402	47,336	ホテル・レストラン・レジャー	
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	530	530	265	31,195	石油・ガス・消耗燃料	
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR	56	56	48	5,753	無線通信サービス	
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	31	33	437	51,480	石油・ガス・消耗燃料	
ROSTELECOM-SPONSORED ADR	38	56	47	5,597	各種電気通信サービス	
ROSNEFT OJSC - GDR	392	415	270	31,898	石油・ガス・消耗燃料	
PJSC ALROSA	682	1,002	160	18,840	金属・鉱業	
SEVERSTAL-GDR REG S	65	81	123	14,565	金属・鉱業	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	873	924	214	25,235	銀行	
DP WORLD LTD	57	67	118	13,927	運送インフラ	
PJSC RUSHYDRO	38,910	38,910	57	6,769	電力	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	99	118	497	58,513	食品・生活必需品小売り	
INTER RAO UES PJSC	—	11,000	68	8,076	電力	
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	3,638	4,050	1,157	136,292	銀行	
PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	25	37	53	6,272	化学	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	374	516	101	11,971	資本市場	
MEGAFON PJSC-GDR	31	—	—	—	無線通信サービス	
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	195	214	363	42,737	金属・鉱業	
TATNEFT-SPONSORED ADR	80	88	356	41,933	石油・ガス・消耗燃料	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	141	160	901	106,127	石油・ガス・消耗燃料	
CREDICORP LTD	22	25	395	46,593	銀行	
SINA CORP	—	21	134	15,875	インターネットソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	50,717 51	63,369 51	17,258 —	2,031,721 <11.5%>	
(トルコ)			千トルコリラ			
AKBANK T. A. S	771	856	668	22,455	銀行	
ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYII	59	78	141	4,759	飲料	
ARCELIK A. S	84	84	173	5,830	家庭用耐久財	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	464	560	284	9,556	金属・鉱業	
FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	23	23	70	2,365	自動車	
KOC HLDGS	235	235	312	10,501	コングロマリット	
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	205	205	75	2,531	化学	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	181	273	97	3,271	コングロマリット	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	43	43	104	3,506	自動車	
TURK HAVA YOLLARI AO	183	183	92	3,105	旅客航空輸送業	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	305	355	332	11,166	無線通信サービス	
TURKIYE GARANTI BANKASI	818	898	697	23,408	銀行	
TURKIYE IS BANKASI AS-C	545	651	335	11,256	銀行	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	40	48	345	11,599	石油・ガス・消耗燃料	
ULKER BISKUVI SANAYI AS	45	60	101	3,404	食品	
YAPI VE KREDI BANKASI A. S.	250	331	113	3,819	銀行	
HACI OMER SABANCI HOLDING	334	334	308	10,353	各種金融サービス	
COCA-COLA ICECEK AS	20	28	94	3,180	飲料	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	71	81	397	13,340	食品・生活必需品小売り	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	240	240	106	3,562	銀行	
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	44	67	93	3,154	運送インフラ	
TURKIYE HALK BANKASI	222	222	208	6,998	銀行	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	155	155	80	2,710	各種電気通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,346 23	6,019 23	5,238 —	175,840 <1.0%>	
(ユーロ…ギリシャ)			千ユーロ			
HELLENIC TELECOM	76	92	80	9,822	各種電気通信サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ギリシャ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
OPAP SA	75	75	62	7,637	ホテル・レストラン・レジャー	
JUMBO SA	31	40	58	7,128	専門小売り	
TITAN CEMENT CO	15	15	34	4,257	建設資材	
FF GROUP	8	13	23	2,928	専門小売り	
PIRAEUS BANK S. A.	2,006	2,616	54	6,712	銀行	
EUROBANK ERGASIAS SA	676	676	43	5,317	銀行	
ALPHA BANK A. E.	474	554	106	13,059	銀行	
NATIONAL BANK OF GREECE	1,999	1,999	48	6,014	銀行	
ユーロ計	株数・金額	5,364	6,084	512	62,879	
	銘柄数<比率>	9	9	—	<0.4%>	
(チェコ)			千チェココルナ			
KOMERCNI BANKA AS	24	28	2,503	11,388	銀行	
O2 CZECH REPUBLIC AS	18	18	472	2,151	各種電気通信サービス	
CEZ AS	58	58	2,463	11,209	電力	
MONETA MONEY BANK AS	—	160	1,334	6,071	銀行	
小計	株数・金額	101	266	6,773	30,821	
	銘柄数<比率>	3	4	—	<0.2%>	
(ハンガリー)			千フォリント			
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	13	13	27,265	10,786	石油・ガス・消耗燃料	
OTP BANK NYRT	76	89	75,066	29,696	銀行	
RICHTER GEDEON NYRT	46	52	32,639	12,912	医薬品	
小計	株数・金額	136	156	134,970	53,394	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.3%>	
(ポーランド)			千ズロチ			
BANK MILLENNIUM SA	190	190	103	2,868	銀行	
MBANK	4	5	199	5,550	銀行	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	8	12	93	2,587	銀行	
KGHM POLSKA MIEDZ S. A.	48	57	525	14,609	金属・鉱業	
BANK PEKAO SA	45	61	766	21,324	銀行	
ORANGE POLSKA SA	217	217	112	3,138	各種電気通信サービス	
POLSKI KONCERN NAFTOWY S. A.	112	124	1,058	29,440	石油・ガス・消耗燃料	
LPP SA	0.4	0.5	280	7,795	繊維・アパレル・贅沢品	
BANK ZACHODNI WBK SA	12	12	386	10,749	銀行	
PKO BANK POLSKI SA	306	339	937	26,092	銀行	
CCC SA	7	10	196	5,479	繊維・アパレル・贅沢品	
SYNTHOS SA	181	181	79	2,219	化学	
EUROCASH SA	25	25	95	2,668	食品・生活必需品小売り	
GRUPA LOTOS SA	25	35	138	3,844	石油・ガス・消耗燃料	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	587	688	380	10,587	石油・ガス・消耗燃料	
CYFROWY POLSAT SA	62	75	177	4,924	メディア	
GRUPA AZOTY SA	15	15	96	2,690	化学	
ENEA SA	56	—	—	—	電力	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	299	299	311	8,673	電力	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	286	401	118	3,291	電力	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	204	204	664	18,494	保険	
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	—	19	137	3,828	金属・鉱業	
ALIOR BANK SA	16	29	152	4,242	銀行	
ALIOR BANK SA-ALLOTMENT SHS	12	—	—	—	銀行	
ENERGA SA	62	—	—	—	電力	
小計	株数・金額	2,788	3,006	7,013	195,102	
	銘柄数<比率>	24	22	—	<1.1%>	
(香港)			千香港ドル			
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	450	450	503	7,632	金属・鉱業	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	360	480	457	6,939	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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	500	500	210	3,193	旅客航空輸送業
CHINA MOBILE LTD	2,075	2,320	18,966	287,714	無線通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	450	450	960	14,574	建設資材
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	170	170	588	8,922	コングロマリット
HUANENG POWER INTL INC-H	1,460	1,460	722	10,963	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
YANZHOU COAL MINING-H	460	700	375	5,702	石油・ガス・消耗燃料
HENGAN INTL GROUP CO LTD	250	270	1,502	22,793	パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H	500	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE-H	268	268	293	4,447	自動車
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1,040	1,240	1,302	19,751	自動車
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	1,520	1,520	1,254	19,023	医薬品
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	1,320	1,460	3,007	45,625	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES LAND LTD	944	1,044	1,827	27,727	不動産管理・開発
CITIC LTD	1,520	1,710	1,887	28,638	コングロマリット
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	480	480	354	5,373	運送インフラ
LENOVO GROUP LTD	2,460	2,880	1,350	20,490	コンピュータ・周辺機器
PETROCHINA CO LTD-H	7,180	7,860	4,676	70,945	石油・ガス・消耗燃料
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	2,000	2,240	2,022	30,684	各種電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	536	660	1,055	16,016	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	8,469	9,649	5,461	82,848	石油・ガス・消耗燃料
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	280	370	570	8,655	情報技術サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	260	320	1,008	15,291	ガス
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	1,180	1,180	700	10,632	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING PORTS LTD	520	520	423	6,429	運送インフラ
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	480	480	924	14,024	運送インフラ
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,320	1,320	415	6,307	金属・鉱業
CHINA EVERBRIGHT LTD	280	360	527	8,006	資本市場
CHINA GAS HOLDINGS LTD	520	660	674	10,232	ガス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD	1,900	1,900	1,402	21,271	自動車
CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD	320	320	691	10,485	ガス
BYD CO LTD-H	205	245	1,016	15,424	自動車
CHINA TELECOM CORP LTD-H	4,700	5,180	1,869	28,367	各種電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	520	720	529	8,038	エネルギー設備・サービス
SINOTRANS LIMITED-H	610	610	210	3,192	航空貨物・物流サービス
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	810	980	813	12,339	商業サービス・用品
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	1,562	1,722	2,098	31,832	保険
AVIC CHINA INDUSTRY&TECH-H	720	720	378	5,734	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	700	700	859	13,040	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,130	1,130	818	12,410	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2,470	2,760	5,630	85,413	保険
ZIJIN MINING GROUP CO-H	2,010	2,010	482	7,318	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	520	720	363	5,515	ヘルスケア機器・用品
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	9,180	—	—	—	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD-H	264	384	466	7,071	機械
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	1,140	1,140	476	7,228	化学
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS CO	130	190	399	6,067	コングロマリット
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	580	740	696	10,563	食品
TSING TAO BREWERY CO-H	100	140	410	6,233	飲料
GUANGDONG INVESTMENT	900	1,060	1,081	16,401	水道
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	380	613	899	13,639	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	460	460	345	5,247	運送インフラ
CNOOC LTD	6,020	6,730	6,662	101,073	石油・ガス・消耗燃料
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,540	1,540	816	12,381	医薬品
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	1,130	—	—	—	海運業

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	910	1,050	1,537	23,319	食品
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,730	1,985	7,781	118,040	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,510	1,510	764	11,590	水道
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	3,833	3,833	348	5,292	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	1,150	1,150	318	4,832	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA LIMITED-H	540	540	277	4,202	旅客航空輸送業
ZTE CORP-H	234	234	272	4,141	通信機器
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	880	880	302	4,592	電気設備
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	1,185	1,330	1,973	29,941	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING HOLDINGS - H	760	-	-	-	海運業
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3,147	3,467	1,910	28,987	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	560	720	815	12,364	建設・土木
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	28,480	31,800	17,553	266,288	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	210	210	991	15,036	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	900	1,120	859	13,031	自動車
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	570	570	406	6,173	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,070	1,070	406	6,168	建設資材
BANK OF CHINA LTD-H	26,600	29,790	10,069	152,747	銀行
SHUI ON LAND LTD	1,261	-	-	-	不動産管理・開発
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	420	420	423	6,422	不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	276	380	351	5,326	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK-H	1,291	1,521	2,757	41,834	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	25,040	27,610	12,590	190,992	銀行
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	864	864	418	6,343	各種電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1,600	1,600	1,364	20,704	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO-H	880	880	325	4,939	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	230	230	352	5,345	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	180	225	866	13,141	電気設備
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	420	420	516	7,836	家庭用耐久財
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,933	1,933	839	12,731	不動産管理・開発
CHINA CITIC BANK-H	3,210	3,210	1,576	23,909	銀行
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	2,100	2,480	1,083	16,440	繊維・アパレル・贅沢品
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	-	260	859	13,035	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	320	400	898	13,622	繊維・アパレル・贅沢品
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	784	974	1,081	16,407	コングロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	1,280	1,280	262	3,980	不動産管理・開発
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	1,015	1,015	336	5,111	不動産管理・開発
SOHO CHINA LTD	655	655	246	3,746	不動産管理・開発
KINGSOFT CORP LTD	270	270	420	6,373	ソフトウェア
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	4,092	5,382	511	7,756	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,480	1,480	936	14,211	建設・土木
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTION-H	595	750	740	11,229	建設・土木
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	1,960	2,360	1,135	17,220	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	906	980	2,724	41,329	保険
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	1,470	-	-	-	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD-H	1,533	1,533	1,076	16,330	機械
SUN ART RETAIL GROUP LTD	720	975	661	10,028	食品・生活必需品小売り
SINOPHARM GROUP CO-H	428	428	1,369	20,776	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	739	739	685	10,395	自動車
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	680	960	434	6,597	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,000	1,230	722	10,952	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	241	241	410	6,229	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	1,120	1,560	371	5,632	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	520	740	484	7,352	不動産管理・開発

銘柄	株数	当期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
LONGFOR PROPERTIES	500	500	493	7,486	不動産管理・開発	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	257	317	1,139	17,287	保険	
CHINA MINSHENG BANKING-H	2,030	2,250	1,849	28,056	銀行	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	960	960	330	5,009	銀行	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	8,110	9,450	3,014	45,730	銀行	
FAR EAST HORIZON LTD	580	770	507	7,697	各種金融サービス	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	715	830	1,316	19,969	資本市場	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	360	470	562	8,527	医薬品	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	1,092	1,228	1,647	24,999	資本市場	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	265	265	1,812	27,497	電子装置・機器・部品	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	2,190	2,710	831	12,620	保険	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	130	130	303	4,604	医薬品	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	325	475	303	4,604	建設・土木	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	1,140	1,140	809	12,278	資本市場	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	1,440	1,440	408	6,203	食品	
CHINA EVERGRANDE GROUP	—	1,470	712	10,815	不動産管理・開発	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	—	1,120	1,169	17,737	半導体・半導体製造装置	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	2,930	3,570	953	14,459	資本市場	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	495	495	702	10,662	機械	
TENCENT HOLDINGS LTD	1,903	2,140	38,990	591,490	インターネットソフトウェア・サービス	
CHINA VANKE CO LTD-H	441	537	992	15,054	不動産管理・開発	
LUYE PHARMA GROUP LTD	370	—	—	—	医薬品	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	3,400	4,300	567	8,610	メディア	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LTD	3,670	3,670	78	1,196	半導体・半導体製造装置	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	1,080	1,080	414	6,291	ヘルスケア・テクノロジー	
CGN POWER CO LTD-H	3,920	3,920	838	12,725	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
FULLSHARE HOLDINGS LIMITED	—	2,500	860	13,046	不動産管理・開発	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PROP	194	—	—	—	不動産管理・開発	
GF SECURITIES CO LTD-H	496	496	812	12,324	資本市場	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	—	180	422	6,403	自動車部品	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	464	558	842	12,781	資本市場	
3SBIO, INC	335	335	251	3,816	バイオテクノロジー	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	—	1,860	500	7,590	資本市場	
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	—	8,200	340	5,162	繊維・アパレル・贅沢品	
小計	株数・金額	254,834	282,352	234,651	3,559,666	
	銘柄数<比率>	137	136	—	<20.2%>	
(マレーシア)				千リンギ		
AMMB HOLDING	657	657	286	7,530	銀行	
GENTING PLANTATIONS BHD	85	85	90	2,382	食品	
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	880	1,127	511	13,451	銀行	
DIGI.COM BERHAD	1,112	1,351	672	17,687	無線通信サービス	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	243	243	150	3,964	運送インフラ	
RHB BANK BHD	170	222	104	2,745	銀行	
HAP SENG CONSOLIDATED	168	257	209	5,513	コングロマリット	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	173	173	51	1,360	ホテル・レストラン・レジャー	
GAMUDA BERHAD	523	663	321	8,453	建設・土木	
YTL CORPORATION	1,573	1,573	245	6,451	総合公益事業	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	63	63	94	2,476	銀行	
HONG LEONG BANK	201	252	334	8,792	銀行	
IJM CORP	1,017	1,017	329	8,662	建設・土木	
KUALA LUMPUR KEPONG	134	166	392	10,325	食品	
MALAYAN BANKING	1,211	1,326	1,043	27,435	銀行	
LAFARGE MALAYSIA BHD	129	129	91	2,404	建設資材	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	395	395	146	3,852	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		
(マレーシア)	百株	百株	千リンギ	千円		
MISC BHD	348	434	321	8,454	海運業	
PPB GROUP BERHAD	149	185	292	7,684	食品	
PETRONAS DAGANGAN BHD	83	83	195	5,132	石油・ガス・消耗燃料	
PETRONAS GAS BERHAD	251	251	534	14,042	ガス	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	45	45	194	5,108	タバコ	
TELEKOM MALAYSIA	401	401	238	6,272	各種電気通信サービス	
TENAGA NASIONAL	1,129	1,293	1,779	46,774	電力	
UMW HOLDINGS BHD	213	213	101	2,676	自動車	
DIALOG GROUP BHD	1,231	1,231	187	4,920	建設・土木	
PUBLIC BANK BHD	940	1,051	2,075	54,574	銀行	
YTL POWER INTL	720	720	103	2,709	総合公益事業	
ATRASIA BHD	456	456	107	2,817	旅客航空輸送業	
GENTING BHD	813	813	643	16,928	ホテル・レストラン・レジャー	
GENTING MALAYSIA BHD	1,004	1,164	535	14,076	ホテル・レストラン・レジャー	
IOI CORP	750	910	398	10,478	食品	
SIME DARBY BERHAD	775	937	755	19,854	コングロマリット	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	197	197	93	2,465	ヘルスケア機器・用品	
AXIATA GROUP BERHAD	882	1,030	465	12,239	無線通信サービス	
MAXIS BHD	634	634	377	9,934	無線通信サービス	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	796	940	650	17,101	化学	
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	1,173	1,553	260	6,859	エネルギー設備・サービス	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	500	500	133	3,509	メディア	
IHH HEALTHCARE BHD	904	1,286	817	21,502	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
FELDA GLOBAL VENTURES	386	386	62	1,654	食品	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	332	332	142	3,753	運送インフラ	
IOI PROPERTIES GROUP BHD	564	564	114	3,011	不動産管理・開発	
小 計	株 数	金 額	24,414	27,312	16,661	438,027
銘 柄 数 < 比 率 >	43	43	—	< 2.5% >		
(タイ)			千バーツ			
BANGKOK BANK (F)	75	75	1,181	3,862	銀行	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	—	444	2,142	7,005	コングロマリット	
KRUNG THAI BANK-NVDR	1,172	1,172	2,028	6,632	銀行	
ROBINSON DEPT STORE-NVDR	166	166	1,029	3,365	複合小売り	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	524	666	9,690	31,687	銀行	
TRUE CORP PCL-NVDR	3,739	3,739	2,617	8,558	各種電気通信サービス	
KASIKORN BANK PCL-NVDR	195	235	4,018	13,140	銀行	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	4,404	4,404	924	3,024	銀行	
IRPC PCL - NVDR	3,392	3,392	1,621	5,301	石油・ガス・消耗燃料	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	429	429	793	2,595	石油・ガス・消耗燃料	
ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	44	44	858	2,805	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	963	963	2,744	8,974	食品	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	350	396	5,742	18,776	無線通信サービス	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	1,350	1,350	1,344	4,395	専門小売り	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	151	151	1,211	3,962	電子装置・機器・部品	
PTT PCL-NVDR	317	385	13,975	45,699	石油・ガス・消耗燃料	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	577	577	1,171	3,830	食品	
SIAM CEMENT PUBLIC (F)	101	116	5,521	18,055	建設資材	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	40	40	1,904	6,226	建設資材	
KCE ELECTRONICS-NVDR	—	107	1,294	4,233	電子装置・機器・部品	
BEC WORLD PCL NVDR	276	276	466	1,525	メディア	
AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	144	164	6,379	20,861	運送インフラ	
KASIKORN BANK PCL (F)	401	445	7,609	24,883	銀行	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	420	514	2,878	9,412	不動産管理・開発	
BANGKOK DUST MED SERVI-NVDR	1,436	1,436	3,187	10,424	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)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(タイ)	百株	百株	千円	千円		
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	132	132	2,376	7,769	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	626	816	2,815	9,205	ホテル・レストラン・レジャー	
THAI OIL PCL-NVDR	251	326	2,339	7,648	石油・ガス・消耗燃料	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	187	187	1,430	4,677	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
CP ALL PCL-NVDR	1,750	1,860	11,485	37,557	食品・生活必需品小売り	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	1,808	2,387	2,005	6,556	陸運・鉄道	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	461	551	5,000	16,351	石油・ガス・消耗燃料	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	535	535	1,754	5,736	化学	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	731	853	5,379	17,592	化学	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	363	363	1,043	3,412	石油・ガス・消耗燃料	
BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	2,000	2,600	1,937	6,333	運送インフラ	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	29,513 34	32,299 36	119,903 -	392,083 <2.2%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
AYALA LAND LTD	2,639	2,639	8,180	19,306	不動産管理・開発	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	666	806	5,654	13,343	コングロマリット	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	272	272	2,406	5,678	銀行	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	546	546	690	1,628	コングロマリット	
DMCI HOLDINGS INC	1,275	1,275	1,637	3,863	コングロマリット	
GLOBE TELECOM INC	10	10	1,502	3,546	無線通信サービス	
INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	130	203	1,425	3,363	運送インフラ	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	869	1,051	7,230	17,064	コングロマリット	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	156	156	2,964	6,995	ホテル・レストラン・レジャー	
METROPOLITAN BANK & TRUST	215	215	1,557	3,676	銀行	
MEGAWORLD CORP	3,740	3,740	1,361	3,212	不動産管理・開発	
PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO.	33	-	-	-	無線通信サービス	
ROBINSONS LAND CO	491	491	1,247	2,943	不動産管理・開発	
SECURITY BANK CORP	160	80	1,568	3,700	銀行	
SM PRIME HLDGS	2,641	3,093	8,430	19,895	不動産管理・開発	
UNIVERSAL ROBINA CORP	281	339	5,322	12,560	食品	
SM INVESTMENTS CORP	53	96	5,960	14,067	コングロマリット	
AYALA CORPORATION	89	89	6,375	15,046	各種金融サービス	
ENERGY DEVELOPMENT CORPORATION	3,415	3,415	1,724	4,069	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	4,338	4,338	2,737	6,459	各種金融サービス	
ABOITIZ POWER CORP	536	536	2,310	5,451	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
BDO UNIBANK INC	571	669	7,164	16,907	銀行	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	24	30	3,650	8,616	各種金融サービス	
PLDT INC	-	39	5,303	12,517	無線通信サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	23,154 23	24,133 23	86,405 -	203,917 <1.2%>	
(インドネシア)			千ルピア			
AKR CORPORINDO TBK PT	533	533	303,810	2,673	商社・流通業	
UNITED TRACTORS TBK PT	506	640	1,290,607	11,357	石油・ガス・消耗燃料	
INDOFOOD SUKSES MAK TBK	1,457	1,757	1,295,787	11,402	食品	
PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	2,557	2,557	774,771	6,817	食品	
GUDANG GARAM TBK	160	195	1,209,000	10,639	タバコ	
HM SAMPOERNA TBK PT	3,400	3,400	1,271,600	11,190	タバコ	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	456	577	888,580	7,819	建設資材	
SUMMARECON AGUNG TBK PT	3,233	3,233	404,125	3,556	不動産管理・開発	
BANK DANAMON PT	1,251	1,251	414,398	3,646	銀行	
BANK MANDIRI	3,088	3,625	3,896,875	34,292	銀行	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	774	908	1,316,600	11,586	複合小売り	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	517	562	2,163,700	19,040	家庭用品	
BANK RAKYAT INDONESIA	3,819	4,301	4,731,100	41,633	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		
(インドネシア)	百株	百株	千ルピア	千円		
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	3,658	4,408	1,137,264	10,007	ガス	
BANK NEGARA INDONESIA PT	2,527	2,987	1,598,045	14,062	銀行	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	1,016	1,216	1,109,600	9,764	建設資材	
BANK CENTRAL ASIA	4,094	4,590	6,735,825	59,275	銀行	
XL AXIATA TBK PT	1,382	1,382	306,804	2,699	無線通信サービス	
LIPPO KARAWACI TBK PT	5,925	5,925	423,637	3,728	不動産管理・開発	
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	2,587	—	—	—	メディア	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	1,465	1,465	242,457	2,133	メディア	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	692	738	316,116	2,781	運送インフラ	
BUMI SERPONG DAMAI PT	2,209	2,937	502,227	4,419	不動産管理・開発	
ADARO ENERGY PT	5,337	5,337	891,279	7,843	石油・ガス・消耗燃料	
PAKUWON JATI TBK PT	—	9,200	506,000	4,452	不動産管理・開発	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	353	890	705,325	6,206	食品	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	887	887	447,935	3,941	無線通信サービス	
KALBE FARMA PT	7,685	7,685	1,118,167	9,839	医薬品	
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	1,575	1,575	371,700	3,270	建設・土木	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	6,711	7,554	5,816,580	51,185	自動車	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	1,961	1,961	494,172	4,348	メディア	
TELEKOMUNIKASI	17,389	19,081	7,212,618	63,471	各種電気通信サービス	
小 計	株 数	金 額	89,205	103,359	49,896,707	439,091
	銘柄 数 < 比 率 >		31	31	—	< 2.5% >
(韓国)					千ウォン	
CHEL WORLDWIDE INC	22	22	34,608	3,412	メディア	
HANMI SCIENCE CO LTD	3	4	28,317	2,792	医薬品	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	13	13	135,340	13,344	自動車	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	11	12	355,395	35,041	保険	
DONGBU INSURANCE CO LTD	14	18	120,428	11,874	保険	
COWAY CO LTD	19	19	173,550	17,112	家庭用耐久財	
KT & G CORP	38	43	456,665	45,027	タバコ	
S-1 CORPORATION	6	6	56,110	5,532	商業サービス・用品	
KOREA GAS CORPORATION	6	10	52,532	5,179	ガス	
CJ CORP	4	5	101,468	10,004	コングロマリット	
KAKAO CORP	9	12	92,842	9,154	インターネットソフトウェア・サービス	
SK TELECOM CO LTD	6	7	177,100	17,462	無線通信サービス	
DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	9	9	78,396	7,729	建設・土木	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	55	55	39,669	3,911	資本市場	
NCSOFT CORPORATION	6	6	175,100	17,264	ソフトウェア	
LG UPLUS CORP	68	86	103,518	10,206	各種電気通信サービス	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	17	17	48,498	4,781	電気設備	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	27	49	25,498	2,514	建設・土木	
POSCO DAEWOO CORP	11	18	50,832	5,012	商社・流通業	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	3	3	309,222	30,489	パーソナル用品	
LG CHEMICALS LTD	15	17	467,976	46,142	化学	
LG CHEM LTD - PREFERRED	2	2	49,868	4,916	化学	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	0.7	0.7	35,770	3,526	パーソナル用品	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	141	159	758,430	74,781	銀行	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	18	22	99,892	9,849	建設・土木	
S-OIL CORPORATION	16	16	136,594	13,468	石油・ガス・消耗燃料	
HANWHA CHEMICAL CORP	33	42	108,360	10,684	化学	
SAMSUNG SECURITIES	18	18	59,011	5,818	資本市場	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	5	6	213,805	21,081	化学	
HOTEL SHILLA CO LTD	12	12	59,802	5,896	専門小売り	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	14	16	245,884	24,244	機械	
HYUNDAI MOBIS	23	25	673,100	66,367	自動車部品	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千ウォン	千円	
SK HYNIX INC	192	219	988,650	97,480	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	25	25	107,750	10,624	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	8	8	77,760	7,667	自動車
HYUNDAI MOTOR CO LTD	47	58	832,300	82,064	自動車
HYUNDAI STEEL CO	28	28	170,451	16,806	金属・鉱業
INDUSTRIAL BK OF KOREA	85	104	139,107	13,715	銀行
KCC CORP	1	2	87,537	8,631	建設関連製品
KIA MOTORS CORP	90	96	379,940	37,462	自動車
KOREA ZINC CO LTD	3	3	147,405	14,534	金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER	87	99	452,184	44,585	電力
HANWHA CORPORATION	14	18	66,123	6,519	コングロマリット
KOREAN AIR LINES CO LTD	10	10	30,101	2,967	旅客航空輸送業
OCI COMPANY LTD	6	6	47,554	4,688	化学
CJ KOREA EXPRESS CO LTD	2	2	48,060	4,738	陸運・鉄道
KUMHO PETRO CHEMICAL CO	6	6	56,274	5,548	化学
KT CORP	8	8	26,488	2,611	各種電気通信サービス
LG ELECTRONICS INC	34	40	194,969	19,223	家庭用耐久財
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	1	1	34,010	3,353	食品
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	0.2	0.2	29,680	2,926	飲料
HANSSEM CO LTD	3	4	78,720	7,761	家庭用耐久財
LG CORP	33	37	213,860	21,086	コングロマリット
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	43	43	43,516	4,290	資本市場
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	14	19	51,191	5,047	建設・土木
NAVER CORP	9	10	817,950	80,649	インターネットソフトウェア・サービス
PARADISE CO LTD	12	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
HYUNDAI DEPT STORE CO	4	6	65,400	6,448	複合小売り
DONGSUH COMPANIES INC	10	10	27,522	2,713	食品・生活必需品小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	13	13	59,005	5,817	資本市場
OTTOGI CORPORATION	0.4	0.4	27,240	2,685	食品
AMOREPACIFIC GROUP	10	10	130,560	12,873	パーソナル用品
KANGWON LAND INC	42	42	156,068	15,388	ホテル・レストラン・レジャー
POSCO	23	28	749,760	73,926	金属・鉱業
SAMSUNG SDI CO,LTD	19	19	213,300	21,031	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	20	20	98,842	9,745	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRONICS	34	37	6,750,700	665,619	コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	47	97	94,156	9,283	機械
HANWHA TECHWIN CO LTD	—	14	64,207	6,330	航空宇宙・防衛
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	6	6	945,120	93,188	コンピュータ・周辺機器
SHINSEGAE CO LTD	2	2	41,334	4,075	複合小売り
HYOSUNG CORPORATION	7	7	115,115	11,350	化学
ORION CORP	1	1	86,591	8,537	食品
YUHAN CORPORATION	2	2	58,487	5,766	医薬品
HANON SYSTEMS	62	62	60,822	5,997	自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	20	20	66,664	6,573	保険
GS HOLDINGS CORP	17	21	113,096	11,151	石油・ガス・消耗燃料
LG DISPLAY CO LTD	84	84	265,230	26,151	電子装置・機器・部品
SK NETWORKS CO LTD	23	48	33,691	3,322	商社・流通業
CELLTRION INC	26	29	302,202	29,797	バイオテクノロジー
HANA FINANCIAL HOLDINGS	97	110	371,542	36,634	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	6	6	100,750	9,933	航空貨物・物流サービス
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	26	26	54,243	5,348	資本市場
LOTTE SHOPPING CO	3	3	86,385	8,517	複合小売り
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	23	26	293,245	28,913	保険
AMOREPACIFIC CORP	10	12	391,140	38,566	パーソナル用品

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(韓国)	百株	百株	千ウォン	千円		
AMOREPACIFIC CORP-PREF	3	3	55,800	5,501	パーソナル用品	
SAMSUNG CARD CO	9	13	56,032	5,524	消費者金融	
SK INNOVATION CO LTD	21	25	369,180	36,401	石油・ガス・消耗燃料	
CJ CHEILJEDANG CORP	2	3	117,600	11,595	食品	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	7	7	45,583	4,494	商業サービス・用品	
LG INNOTEK CO LTD	4	4	38,824	3,828	電子装置・機器・部品	
SK HOLDINGS CO LTD	15	17	399,093	39,350	コングロマリット	
KB FINANCIAL GROUP INC	134	151	664,400	65,509	銀行	
HYUNDAI WIA CORP	5	5	39,024	3,847	自動車部品	
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	19	27	191,820	18,913	航空宇宙・防衛	
BNK FINANCIAL GROUP INC	82	104	93,306	9,200	銀行	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	1	1	56,248	5,546	医薬品	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	61	86	57,428	5,662	保険	
CJ E&M CORP	5	5	38,247	3,771	メディア	
E-MART CO	5	7	137,826	13,589	食品・生活必需品小売り	
DGB FINANCIAL GROUP INC	62	62	62,690	6,181	銀行	
GS RETAIL CO LTD	8	8	38,556	3,801	食品・生活必需品小売り	
HANKOOK TIRE CO LTD/NEW	27	27	153,260	15,111	自動車部品	
BGF RETAIL CO LTD	3	7	59,940	5,910	食品・生活必需品小売り	
SAMSUNG SDS CO LTD	12	13	191,115	18,843	情報技術サービス	
WOORI BANK	111	111	149,386	14,729	銀行	
SAMSUNG C&T CORP	26	28	380,010	37,468	コングロマリット	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	—	6	94,720	9,339	ライフサイエンス・ツール/サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,711	3,125	25,957,677	2,559,426	
	銘柄 数 < 比 率 >	107	108	—	<14.5%>	
(台湾)				千新台幣ドル		
ACER INC	917	917	1,211	4,457	コンピュータ・周辺機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	238	268	7,063	25,992	コンピュータ・周辺機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	154	154	1,557	5,730	半導体・半導体製造装置	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	2,256	2,466	8,014	29,495	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT	729	959	2,572	9,465	建設資材	
TAIWAN BUSINESS BANK	1,118	1,174	953	3,508	銀行	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	230	230	925	3,406	化学	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	250	340	1,880	6,919	半導体・半導体製造装置	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	—	250	1,812	6,670	コンピュータ・周辺機器	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	142	203	1,495	5,501	コンピュータ・周辺機器	
QUANTA COMPUTER INC	876	996	5,881	21,643	コンピュータ・周辺機器	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	281	281	1,277	4,701	不動産管理・開発	
EVA AIRWAYS CORP	567	596	870	3,203	旅客航空輸送業	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	208	238	5,364	19,739	コンピュータ・周辺機器	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	1,653	1,752	2,979	10,965	銀行	
CHINA AIRLINES	795	795	743	2,734	旅客航空輸送業	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	630	740	4,405	16,210	自動車部品	
CHINA STEEL	3,945	4,605	11,605	42,709	金属・鉱業	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	972	1,313	4,202	15,465	保険	
ADVANTECH CO., LTD.	102	132	3,303	12,157	コンピュータ・周辺機器	
COMPAL ELECTRONICS	1,575	1,575	2,891	10,641	コンピュータ・周辺機器	
DELTA ELECTRONICS INC	676	726	11,592	42,660	電子装置・機器・部品	
NANYA TECHNOLOGY CO	230	230	1,091	4,016	半導体・半導体製造装置	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,310	1,470	14,853	54,661	各種電気通信サービス	
AU OPTRONICS CORP	2,620	3,270	3,956	14,561	電子装置・機器・部品	
TAIWAN MOBILE CO LTD	592	592	6,038	22,221	無線通信サービス	
EVERGREEN MARINE	447	447	496	1,827	海運業	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	1,144	1,144	2,792	10,277	コングロマリット	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千新台幣ドル	千円	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	92	143	1,717	6,321	繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	62	62	2,099	7,727	繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	200	200	2,106	7,750	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTIC	1,414	1,604	14,277	52,542	化学
FORMOSA TAFFETA CO.	200	200	586	2,156	繊維・アパレル・贅沢品
FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	1,059	1,209	11,748	43,235	化学
TRANSCEND INFORMATION INC	43	43	363	1,339	コンピュータ・周辺機器
GIANT MANUFACTURING	97	97	1,804	6,639	レジャー用品
MEDIATEK INC	505	565	12,240	45,044	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,295	2,465	12,943	47,631	各種金融サービス
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	2,292	2,924	4,737	17,432	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	90	90	3,294	12,121	専門小売り
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	580	580	4,129	15,196	無線通信サービス
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	83	—	—	—	電子装置・機器・部品
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	3,493	3,493	4,122	15,171	資本市場
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,805	3,015	14,638	53,868	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	4,847	4,847	3,892	14,325	銀行
E. SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	2,428	3,071	5,605	20,626	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	4,785	5,798	48,298	177,737	電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	3,773	4,133	9,569	35,216	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	30	40	14,705	54,116	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	2,641	3,492	4,121	15,165	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	2,745	2,745	2,177	8,011	保険
INVENTEC CO.,LTD	779	1,029	2,181	8,028	コンピュータ・周辺機器
HTC CORPORATION	237	237	1,900	6,995	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	745	748	3,628	13,353	コンピュータ・周辺機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	2,999	3,831	3,460	12,733	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING	5,316	6,762	11,968	44,045	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	3,084	3,723	6,329	23,291	銀行
MERIDA INDUSTRY CO LTD	52	82	1,183	4,356	レジャー用品
POWERTECH TECHNOLOGY INC	211	271	2,326	8,561	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	1,667	1,797	13,066	48,083	化学
WISTRON CORP	861	886	2,070	7,620	コンピュータ・周辺機器
POU CHEN CORP	714	884	3,512	12,924	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	1,598	1,858	9,849	36,245	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	208	208	4,787	17,618	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	403	463	4,937	18,169	石油・ガス・消耗燃料
PHISON ELECTRONICS CORP	43	43	1,098	4,040	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	272	272	999	3,677	不動産管理・開発
RUENTEX INDUSTRIES LTD	147	207	1,111	4,092	繊維・アパレル・贅沢品
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	274	348	2,915	10,729	コンピュータ・周辺機器
SILICONWARE PRECISION INDUSTRIES	702	842	3,975	14,628	半導体・半導体製造装置
STANDARD FOODS CORP	135	150	1,147	4,222	食品
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	424	445	1,448	5,330	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT	1,103	1,313	4,714	17,349	建設資材
TECO ELECTRIC & MACHINERY	680	680	1,893	6,969	電気設備
TAIWAN SEMICONDUCTOR	8,310	9,280	167,040	614,707	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	3,955	4,545	5,135	18,899	半導体・半導体製造装置
YULON MOTOR CO	290	290	779	2,868	自動車
INOTERA MEMORIES INC	770	—	—	—	半導体・半導体製造装置
INNOLUX CORP	2,933	3,583	4,228	15,559	電子装置・機器・部品
WPG HOLDINGS CO LTD	490	490	1,863	6,856	電子装置・機器・部品
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	67	68	984	3,623	機械
TAIMED BIOLOGICS INC	50	50	792	2,916	バイオテクノロジー

銘柄	株数	期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	期末		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千新台幣ドル	千円		
HERMES MICROVISION INC	20	—	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP	646	746	5,751	21,164	—	コンピュータ・周辺機器
CHAILEASE HOLDING CO LTD	346	346	1,883	6,933	—	各種金融サービス
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	560	560	579	2,132	—	各種電気通信サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	134	134	862	3,173	—	電子装置・機器・部品
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	2,416	3,145	4,388	16,147	—	銀行
OBI PHARMA INC	40	40	916	3,370	—	バイオテクノロジー
CASETEK HOLDINGS LTD	50	50	416	1,530	—	コンピュータ・周辺機器
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	50	50	1,637	6,026	—	家庭用耐久財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	105,031	119,168	578,779	2,129,908	
		90	88	—	<12.1%>	
(インド)				千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	436	496	52,769	92,345	—	石油・ガス・消耗燃料
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	30	192	11,784	20,623	—	石油・ガス・消耗燃料
EICHER MOTORS LTD	4	5	11,291	19,760	—	機械
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	131	145	17,285	30,249	—	自動車
SHREE CEMENT LIMITED	2	2	3,947	6,907	—	建設資材
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	—	152	6,413	11,223	—	石油・ガス・消耗燃料
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	9	9	1,059	1,854	—	陸運・鉄道
LIC HOUSING FINANCE	84	112	6,106	10,685	—	貯蓄・抵当・不動産金融
TATA STEEL LIMITED	101	101	4,085	7,149	—	金属・鉄業
JSW STEEL LTD	30	30	4,774	8,355	—	金属・鉄業
NESTLE INDIA LIMITED	7	9	5,495	9,617	—	食品
GAIL INDIA LTD	118	118	5,088	8,905	—	ガス
VEDANTA LTD	316	403	9,121	15,963	—	金属・鉄業
TITAN CO LTD	113	113	3,622	6,338	—	繊維・アパレル・贅沢品
OIL&NATURAL GAS CORP LTD	264	498	10,052	17,592	—	石油・ガス・消耗燃料
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER	3	—	—	—	—	食品
LUPIN LTD	78	78	11,516	20,153	—	医薬品
ACC LIMITED	12	18	2,392	4,186	—	建設資材
BAJAJ FINANCE LTD	5	—	—	—	—	消費者金融
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	503	572	70,713	123,748	—	貯蓄・抵当・不動産金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	193	228	10,065	17,613	—	メディア
INFOSYS LTD	615	699	70,088	122,654	—	情報技術サービス
WIPRO LTD	190	227	10,501	18,377	—	情報技術サービス
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	227	246	19,649	34,385	—	家庭用品
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	23	31	3,681	6,441	—	ヘルスクア・プロバイダー/ヘルスクア・サービス
HCL TECHNOLOGIES LTD	176	204	16,809	29,417	—	情報技術サービス
DABUR INDIA LTD	176	176	4,798	8,396	—	パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	15	19	5,862	10,258	—	自動車
DR. REDDYS LABORATORIES	40	46	14,151	24,765	—	医薬品
BHARTI AIRTEL LIMITED	308	366	11,057	19,350	—	無線通信サービス
UNITED SPIRITS LIMITED	24	24	4,603	8,055	—	飲料
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	328	351	21,617	37,830	—	医薬品
DIVIS LABORATORIES LTD	25	25	2,963	5,185	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	34	38	19,883	34,796	—	自動車
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	50	50	4,742	8,299	—	医薬品
AUROBINDO PHARMA LTD	93	93	6,222	10,889	—	医薬品
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	96	161	5,216	9,128	—	自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	54	54	4,428	7,750	—	消費者金融
CIPLA LIMITED	110	135	7,625	13,345	—	医薬品
LARSEN&TOUBRO LIMITED	103	114	15,339	26,843	—	建設・土木
ULTRATECH CEMENT LTD	12	33	10,662	18,659	—	建設資材
ASHOK LEYLAND LIMITED	341	464	3,604	6,307	—	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		
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円		
BOSCH LTD	2	3	5,794	10,139	自動車部品	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	162	179	41,482	72,594	情報技術サービス	
NTPC LIMITED	601	601	9,841	17,223	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	21	29	4,593	8,038	医薬品	
YES BANK LTD	38	122	13,978	24,463	銀行	
AMBUJA CEMENTS LTD	236	236	4,782	8,370	建設資材	
BHARAT FORGE LIMITED	36	36	3,377	5,910	自動車部品	
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	406	406	6,858	12,002	金属・鉱業	
ITC LTD	780	1,312	29,691	51,960	タバコ	
UPL LTD	93	137	8,702	15,230	化学	
SIEMENS INDIA LIMITED	23	23	2,541	4,448	コングロマリット	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	44	44	6,413	11,224	パーソナル用品	
CAIRN INDIA LIMITED	127	183	4,644	8,128	石油・ガス・消耗燃料	
IDEA CELLULAR LIMITED	336	475	3,461	6,057	無線通信サービス	
MARICO LIMITED	156	156	3,896	6,819	パーソナル用品	
POWER FINANCE CORPORATION	63	241	3,078	5,386	各種金融サービス	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	287	287	7,872	13,776	運送インフラ	
BAJAJ FINSERV LTD	—	14	3,777	6,609	保険	
BAJAJ AUTO LIMITED	29	29	7,523	13,165	自動車	
COAL INDIA LTD	217	265	7,746	13,555	石油・ガス・消耗燃料	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	114	149	4,444	7,778	自動車	
TATA MOTORS LTD	544	581	27,233	47,658	自動車	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	169	239	2,896	5,069	電気設備	
TATA POWER COMPANY LIMITED	327	452	3,443	6,025	電力	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	84	113	2,917	5,105	消費者金融	
BHARTI INFRATEL LTD	197	197	6,618	11,581	各種電気通信サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	96	118	7,583	13,270	貯蓄・抵当・不動産金融	
ASIAN PAINTS LTD	104	104	9,036	15,813	化学	
BAJAJ FINANCE LTD	—	59	4,652	8,142	消費者金融	
AXIS BANK LIMITED	216	625	28,642	50,125	銀行	
HAVELLS INDIA LTD	91	91	2,934	5,135	電気設備	
ICICI BANK LTD	392	392	9,950	17,412	銀行	
TECH MAHINDRA LTD	67	90	4,279	7,489	情報技術サービス	
CADILA HEALTHCARE LTD	61	61	2,258	3,952	医薬品	
IDFC BANK LTD	—	505	3,062	5,359	銀行	
小 計	株 数	金 額	11,630	15,423	811,108	1,419,439
	銘柄 数 < 比 率 >		73	75	—	< 8.1% >
(メキシコ)					千メキシコペソ	
ALFA S. A. B. -A	992	992	2,580	14,784	コングロマリット	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	177	177	2,288	13,114	飲料	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	631	694	10,786	61,808	飲料	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-CI	60	76	1,139	6,528	複合小売り	
GRUPO FIN SANTANDER-B	626	626	1,856	10,635	銀行	
GRUPO TELEvisa SAB - SER CPO	831	940	8,135	46,617	メディア	
GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	524	614	2,765	15,846	食品	
GRUMA S. A. B. -B	62	82	2,126	12,184	食品	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	77	100	1,738	9,959	運送インフラ	
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	183	232	1,816	10,408	コングロマリット	
CEMEX SAB - CPO	4,715	5,281	8,714	49,935	建設資材	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	822	937	9,310	53,351	銀行	
MEXICHEM SAB DE CV-*	380	389	1,825	10,460	化学	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	40	52	1,976	11,323	金属・鉱業	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	525	525	1,935	11,091	家庭用品	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	76	76	2,284	13,089	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	
(メキシコ)	百株	百株	千円	千円	
GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	1,311	1,463	8,077	46,283	金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	10,765	12,412	15,874	90,963	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	800	930	2,714	15,555	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	131	167	1,775	10,172	飲料
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	119	143	2,400	13,753	運送インフラ
OHL MEXICO SAB DE CV	241	241	488	2,801	運送インフラ
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	123	—	—	—	食品・生活必需品小売り
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	—	200	1,739	9,969	ガス
GRUPO LALA SAB DE CV	198	198	591	3,387	食品
GENEREA SAB DE CV	362	362	1,145	6,565	消費者金融
WALMART DE MEXICO-SER V	1,807	2,007	7,391	42,354	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数	株 数	金 額	金 額	
	銘柄 数 < 比 率 >				
	26	26	103,481	592,948	< 3.4% >
(ブラジル)			千リアル		
BRF SA	202	234	1,087	38,387	食品
VALE SA	415	497	1,316	46,469	金属・鉱業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	34	34	90	3,204	電力
VALE SA-PREF A	675	733	1,683	59,451	金属・鉱業
TIM PARTICIPACOES SA	301	301	233	8,261	無線通信サービス
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	87	87	216	7,658	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	—	75	168	5,932	電力
BANCO DO BRASIL SA	275	322	845	29,845	銀行
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	1,290	1,493	1,188	41,965	銀行
LOJAS AMERICANAS S.A. (PREF)	202	202	329	11,621	複合小売り
LOJAS AMERICANAS SA	46	46	54	1,937	複合小売り
GERDAU SA PFD NPV	313	363	391	13,817	金属・鉱業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	990	1,116	1,846	65,216	石油・ガス・消耗燃料
PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	1,354	1,481	2,123	74,989	石油・ガス・消耗燃料
KROTON EDUCACIONAL SA	498	498	615	21,741	各種消費者サービス
CCR SA	281	329	497	17,564	運送インフラ
WEG SA	173	213	312	11,029	機械
BANCO BRADESCO SA - PREF	952	1,058	2,873	101,466	銀行
BANCO BRADESCO S.A.	275	310	837	29,581	銀行
NATURA COSMETICOS SA	63	63	141	5,005	パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	215	215	211	7,462	金属・鉱業
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA-PREF	119	163	220	7,792	紙製品・林産品
CPFL ENERGIA SA	66	66	167	5,913	電力
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	984	1,226	3,900	137,724	銀行
PORTO SEGURO SA	32	32	81	2,893	保険
FIBRIA CELULOSE SA	75	99	307	10,853	紙製品・林産品
BRASKEM SA-PREF A	44	63	214	7,587	化学
TRACTEBEL ENERGIA SA	54	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
LOCALIZA RENT A CAR	45	61	209	7,398	陸運・鉄道
LOJAS RENNER S.A.	222	255	549	19,412	複合小売り
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	112	112	146	5,180	電力
ULTRAPAR PARTICIPACOES	122	134	876	30,953	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	42	42	153	5,415	石油・ガス・消耗燃料
TOTVS SA	38	—	—	—	ソフトウェア
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	65	80	421	14,895	電力
EMBRAER SA	224	272	415	14,685	航空宇宙・防衛
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	49	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
M DIAS BRANCO SA	13	13	144	5,104	食品
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	20	—	—	—	電力
ODONTOPREV S.A.	68	106	129	4,577	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ブラジル)	百株	百株	千リアル	千円		
BR MALLS PARTICIPACOES SA	195	195	215	7,608	不動産管理・開発	
JBS SA	221	280	320	11,330	食品	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	235	302	220	7,770	電力	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	125	125	332	11,740	水道	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	29	29	161	5,709	不動産管理・開発	
DURATEX SA	113	113	72	2,550	紙製品・林産品	
SUL AMERICA SA - UNITS	53	53	91	3,247	保険	
HYPERMARCAS S.A	117	142	349	12,324	パーソナル用品	
BM&F BOVESPA SA	589	629	979	34,603	資本市場	
TELEFONICA BRASIL-PREF	158	176	767	27,109	各種電気通信サービス	
QUALICORP SA	77	77	138	4,893	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	126	162	433	15,307	銀行	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	76	76	328	11,615	資本市場	
CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF	57	57	297	10,515	食品・生活必需品小売り	
CIELO SA	352	378	1,062	37,508	情報技術サービス	
RAIA DROGASIL SA	73	86	511	18,055	食品・生活必需品小売り	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	226	255	670	23,662	保険	
ENGIE BRASIL SA	—	54	181	6,412	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AMBEV SA	1,608	1,772	2,896	102,270	飲料	
KLABIN SA-UNIT	202	202	348	12,310	容器・包装	
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL	266	266	157	5,560	陸運・鉄道	
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT	68	70	94	3,323	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>	16,009	17,901	35,639	1,258,432	
		60	58	—	<7.1%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION	12	13	43,578	7,613	銀行	
EMPRESAS CMPC SA	414	500	67,523	11,796	紙製品・林産品	
EMPRESAS COPEC SA	149	172	109,120	19,063	石油・ガス・消耗燃料	
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	42	53	37,249	6,507	無線通信サービス	
EMPRESA NACIONAL DE TELE-OSA	11	—	—	—	無線通信サービス	
COLBUN SA	2,920	2,920	37,592	6,567	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AGUAS ANDINAS SA-A	953	953	39,650	6,926	水道	
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	76	103	25,018	4,370	飲料	
S.A.C.I. FALABELLA	158	232	119,080	20,803	複合小売り	
CENCOSUD SA	422	562	107,965	18,861	食品・生活必需品小売り	
AES GENER SA	780	1,215	28,809	5,033	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>	5,939	6,725	615,590	107,543	
		11	10	—	<0.6%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA	107	151	149,490	5,874	電力	
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	25	35	132,756	5,217	各種金融サービス	
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF	30	41	152,602	5,997	各種金融サービス	
GRUPO AVAL ACCIONES-PFD	1,299	1,299	152,632	5,998	銀行	
CEMENTOS ARGOS SA	135	176	206,976	8,134	建設資材	
GRUPO ARGOS SA	102	102	191,760	7,536	建設資材	
GRUPO DE INV SURAMERICANA	78	92	351,808	13,826	各種金融サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,776	1,896	1,338,024	52,584	
		7	7	—	<0.3%>	
(アラブ首長国連邦)				千UAEディルハム		
FIRST GULF BANK	283	323	409	13,147	銀行	
DUBAI ISLAMIC BANK	450	450	249	8,007	銀行	
EMIRATES TELECOM CORPORATION	586	669	1,234	39,633	各種電気通信サービス	
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	618	738	502	16,137	銀行	
NATIONAL BANK OF ABU DHABI	251	251	247	7,951	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		
(アラブ首長国連邦)	百株	百株	千UAEDィルハム	千円		
EMAAR PROPERTIES PJSC	1,151	1,341	972	31,220	不動産管理・開発	
ARABTEC HOLDING CO	637	—	—	—	建設・土木	
ALDAR PROPERTIES PJSC	1,092	1,092	288	9,262	不動産管理・開発	
DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC	608	—	—	—	資本市場	
EMAAR MALLS PJSC	660	660	173	5,573	不動産管理・開発	
DXB ENTERTAINMENTS PJSC	—	1,189	154	4,963	ホテル・レストラン・レジャー	
小 計	株 数 ・ 金 額	6,339	6,714	4,232	135,896	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	9	—	< 0.8% >	
(エジプト)			千エジプトポンド			
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	368	388	2,793	17,096	銀行	
GLOBAL TELECOM HOLDING	955	955	716	4,386	無線通信サービス	
T M G HOLDING	247	247	230	1,413	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,572	1,592	3,741	22,896	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.1% >	
(南アフリカ)			千ランド			
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	344	344	—	—	各種金融サービス	
BIDVEST GROUP LTD	110	130	2,321	19,567	コングロマリット	
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	143	179	1,424	12,006	専門小売り	
DISCOVERY LTD	109	135	1,548	13,050	保険	
GOLD FIELDS LTD	288	288	1,106	9,331	金属・鉱業	
REMGRO LTD	169	202	4,531	38,199	各種金融サービス	
THE FOSCHINI GROUP LTD	64	82	1,306	11,015	専門小売り	
EXXARO RESOURCES LTD	37	57	507	4,282	石油・ガス・消耗燃料	
CAPIPEC BANK HOLDINGS LTD	12	16	1,085	9,149	銀行	
LIBERTY HOLDINGS LTD	42	42	463	3,910	保険	
MTN GROUP LTD	550	619	7,558	63,718	無線通信サービス	
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	139	156	2,149	18,122	金属・鉱業	
TELKOM SA SOC LTD	62	99	721	6,084	各種電気通信サービス	
FIRSTRAND LTD	1,106	1,285	6,722	56,667	各種金融サービス	
PSG GROUP LTD	29	29	608	5,130	各種金融サービス	
NASPERS LTD-N SHS	148	165	33,136	279,341	メディア	
CORONATION FUND MANAGERS LTD	68	68	467	3,943	資本市場	
NEDBANK GROUP LTD	61	76	1,815	15,304	銀行	
NETCARE LTD	307	384	1,198	10,104	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
PICKN PAY STORES LTD	79	129	829	6,992	食品・生活必需品小売り	
RMB HOLDINGS LTD	250	250	1,635	13,790	各種金融サービス	
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	14	21	530	4,470	金属・鉱業	
SAPPI LIMITED	175	215	1,881	15,860	紙製品・林産品	
SASOL LTD	187	206	8,182	68,980	石油・ガス・消耗燃料	
SHOPRITE HOLDINGS LTD	131	159	2,768	23,337	食品・生活必需品小売り	
BRAIT SE	115	115	1,001	8,446	資本市場	
STANDARD BANK GROUP LTD	450	498	7,564	63,771	銀行	
SPAR GROUP LIMITED/THE	68	68	1,344	11,337	食品・生活必需品小売り	
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	326	372	2,600	21,920	複合小売り	
IMPERIAL HOLDINGS LTD	53	53	969	8,171	販売	
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	114	134	3,688	31,095	医薬品	
TIGER BRANDS LTD	52	62	2,484	20,942	食品	
SANLAM LIMITED	503	543	3,358	28,308	保険	
INVESTEC LTD	85	85	776	6,544	資本市場	
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	209	209	865	7,297	金属・鉱業	
PIONEER FOODS LTD	36	50	762	6,431	食品	
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENT P LC	59	95	1,467	12,368	不動産管理・開発	
MASSMART HOLDINGS LTD	25	41	532	4,487	食品・生活必需品小売り	
MONDI LTD	37	47	1,291	10,891	紙製品・林産品	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額		邦貨換算金額	
(南アフリカ)	百株	百株	千ランド	千円		
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	335	335	1,077	9,081	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MMI HOLDINGS LTD	400	400	928	7,824	保険	
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	126	126	349	2,943	ホテル・レストラン・レジャー	
VODACOM GROUP	130	130	1,917	16,163	無線通信サービス	
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	155	155	2,586	21,807	銀行	
SIBANYE GOLD LTD	232	285	629	5,307	金属・鉱業	
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	237	237	924	7,791	保険	
MR PRICE GROUP LTD	80	97	1,511	12,744	専門小売り	
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	997	1,144	7,999	67,436	家庭用耐久財	
BID CORP LTD	110	120	2,933	24,732	食品・生活必需品小売り	
小 計	株数・金額	9,583	10,759	134,069	1,130,205	
	銘柄数<比率>	49	49	—	<6.4%>	
合 計	株数・金額	673,684	762,507	—	17,146,545	
	銘柄数<比率>	830	827	—	<97.3%>	

\* 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。

\* 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。

## 外国新株予約権証券

2016年12月22日現在の組入れはございません。

銘柄	柄	期首(前期末)	
		証 券 数	
(タイ)			証券
BANPU PUBLIC CO-CW17			14,300
合 計	証券柄	数	14,300
	銘柄柄	数	1

## 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	
(トルコ)	口	口	千トルコリラ	千円	%
EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	64,400	64,400	191	6,420	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	64,400	191	6,420	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	<0.0%>	
(メキシコ)			千メキシコペソ		
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	80,400	94,400	2,961	16,968	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	80,400	2,961	16,968	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	—	<0.1%>	
(南アフリカ)			千ランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	75,380	75,380	1,898	16,007	0.1
REDEFINE PROPERTIES LTD	161,710	161,710	1,718	14,490	0.1
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	7,790	7,790	893	7,532	0.0
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	29,380	29,380	490	4,136	0.0
FORTRESS INCOME FUND LTD	21,220	29,020	938	7,914	0.0
RESILIENT REIT LTD	9,072	11,572	1,259	10,620	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	304,552	7,200	60,701	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	—	<0.3%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	449,352	—	84,090	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	—	<0.5%>	

\* 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、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	百万円	百万円
	MSCIN	388	—

\* 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NOMURA-BPI総合 マザーファンド>

下記は、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド全体(519,154,233千円)の内容です。

### 国内公社債

#### (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	491,765,000 ( 2,360,000)	541,127,558 ( 3,309,261)	80.0 ( 0.5)	— (—)	51.6 ( 0.4)	20.4 ( 0.1)	7.9 ( —)
地方債証券	47,636,420 ( 47,636,420)	50,150,954 ( 50,150,954)	7.4 ( 7.4)	— (—)	3.7 ( 3.7)	2.0 ( 2.0)	1.7 ( 1.7)
特殊債券 (除く金融債)	47,326,494 ( 47,326,494)	50,252,010 ( 50,252,010)	7.4 ( 7.4)	— (—)	4.8 ( 4.8)	1.4 ( 1.4)	1.2 ( 1.2)
金融債券	3,200,000 ( 3,200,000)	3,216,430 ( 3,216,430)	0.5 ( 0.5)	— (—)	— ( —)	0.3 ( 0.3)	0.2 ( 0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	27,407,000 ( 27,407,000)	28,291,393 ( 28,291,393)	4.2 ( 4.2)	— (—)	1.8 ( 1.8)	1.8 ( 1.8)	0.6 ( 0.6)
合 計	617,334,914 (127,929,914)	673,038,347 (135,220,050)	99.4 (20.0)	— (—)	62.0 (10.8)	25.8 ( 5.5)	11.6 ( 3.7)

\* ( )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	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360回	0.1	2,200,000	2,208,932	2018/1/15
国庫債券	利付(2年)第362回	0.1	1,400,000	1,406,048	2018/3/15
国庫債券	利付(2年)第366回	0.1	4,000,000	4,019,240	2018/7/15
国庫債券	利付(2年)第368回	0.1	1,500,000	1,507,620	2018/9/15
国庫債券	利付(2年)第369回	0.1	1,500,000	1,507,845	2018/10/15
国庫債券	利付(5年)第109回	0.1	2,800,000	2,812,404	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第110回	0.3	1,000,000	1,006,890	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第111回	0.4	1,400,000	1,411,368	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第112回	0.4	2,200,000	2,220,394	2018/6/20
国庫債券	利付(5年)第113回	0.3	7,000,000	7,054,530	2018/6/20
国庫債券	利付(5年)第114回	0.3	1,500,000	1,513,020	2018/9/20
国庫債券	利付(5年)第115回	0.2	7,300,000	7,350,078	2018/9/20
国庫債券	利付(5年)第116回	0.2	8,100,000	8,161,965	2018/12/20
国庫債券	利付(5年)第117回	0.2	5,900,000	5,949,442	2019/3/20
国庫債券	利付(5年)第118回	0.2	5,000,000	5,046,050	2019/6/20
国庫債券	利付(5年)第119回	0.1	4,700,000	4,731,584	2019/6/20
国庫債券	利付(5年)第120回	0.2	5,500,000	5,553,515	2019/9/20
国庫債券	利付(5年)第121回	0.1	3,500,000	3,524,465	2019/9/20
国庫債券	利付(5年)第122回	0.1	7,800,000	7,856,004	2019/12/20
国庫債券	利付(5年)第123回	0.1	7,300,000	7,354,385	2020/3/20
国庫債券	利付(5年)第124回	0.1	8,100,000	8,162,208	2020/6/20
国庫債券	利付(5年)第125回	0.1	8,200,000	8,266,010	2020/9/20
国庫債券	利付(5年)第126回	0.1	5,500,000	5,546,145	2020/12/20
国庫債券	利付(5年)第127回	0.1	6,000,000	6,052,200	2021/3/20
国庫債券	利付(5年)第128回	0.1	6,200,000	6,254,374	2021/6/20
国庫債券	利付(5年)第129回	0.1	3,500,000	3,531,570	2021/9/20
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	1,960,000	2,910,815	2048/3/20
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	900,000	1,294,119	2049/3/20
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	900,000	1,302,543	2050/3/20
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	1,300,000	1,893,320	2051/3/20
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	1,300,000	1,821,313	2052/3/20
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	1,300,000	1,789,606	2053/3/20
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	1,400,000	1,843,380	2054/3/20
国庫債券	利付(40年)第8回	1.4	1,500,000	1,830,450	2055/3/20
国庫債券	利付(40年)第9回	0.4	1,500,000	1,324,800	2056/3/20
国庫債券	利付(10年)第290回	1.4	1,250,000	1,275,462	2018/3/20
国庫債券	利付(10年)第291回	1.3	1,400,000	1,426,796	2018/3/20
国庫債券	利付(10年)第292回	1.7	1,600,000	1,638,512	2018/3/20
国庫債券	利付(10年)第293回	1.8	750,000	772,537	2018/6/20
国庫債券	利付(10年)第294回	1.7	500,000	514,285	2018/6/20
国庫債券	利付(10年)第295回	1.5	1,600,000	1,640,832	2018/6/20
国庫債券	利付(10年)第297回	1.4	1,100,000	1,134,540	2018/12/20
国庫債券	利付(10年)第298回	1.3	1,500,000	1,544,130	2018/12/20
国庫債券	利付(10年)第299回	1.3	1,400,000	1,446,004	2019/3/20
国庫債券	利付(10年)第300回	1.5	1,000,000	1,037,330	2019/3/20
国庫債券	利付(10年)第301回	1.5	1,500,000	1,561,785	2019/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
国庫債券 利付 (10年) 第302回	1.4	700,000	727,090	2019/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第303回	1.4	3,300,000	3,440,283	2019/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第304回	1.3	1,000,000	1,039,760	2019/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第305回	1.3	4,100,000	4,276,710	2019/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第306回	1.4	3,000,000	3,148,230	2020/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第307回	1.3	1,700,000	1,778,489	2020/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第308回	1.3	1,700,000	1,784,031	2020/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第309回	1.1	3,000,000	3,127,320	2020/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第310回	1.0	3,700,000	3,853,883	2020/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第311回	0.8	1,800,000	1,861,362	2020/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第312回	1.2	4,950,000	5,208,192	2020/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第313回	1.3	3,200,000	3,390,176	2021/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第314回	1.1	2,200,000	2,312,068	2021/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第315回	1.2	2,600,000	2,750,826	2021/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第316回	1.1	1,400,000	1,474,928	2021/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第317回	1.1	1,800,000	1,901,772	2021/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第318回	1.0	3,200,000	3,365,728	2021/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第319回	1.1	1,850,000	1,959,150	2021/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第320回	1.0	3,500,000	3,689,000	2021/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第321回	1.0	3,200,000	3,380,512	2022/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第322回	0.9	2,400,000	2,522,784	2022/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第323回	0.9	2,700,000	2,844,045	2022/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第324回	0.8	3,200,000	3,353,120	2022/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第325回	0.8	4,900,000	5,143,824	2022/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第326回	0.7	2,100,000	2,195,781	2022/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第327回	0.8	3,100,000	3,260,022	2022/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第328回	0.6	5,500,000	5,725,060	2023/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第329回	0.8	5,300,000	5,592,825	2023/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第330回	0.8	3,800,000	4,016,790	2023/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第331回	0.6	1,900,000	1,982,745	2023/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第332回	0.6	4,400,000	4,593,908	2023/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第333回	0.6	5,000,000	5,220,550	2024/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第334回	0.6	4,100,000	4,283,967	2024/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第335回	0.5	4,700,000	4,879,775	2024/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第336回	0.5	2,700,000	2,805,489	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第337回	0.3	3,700,000	3,785,544	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第338回	0.4	4,900,000	5,054,987	2025/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第339回	0.4	5,900,000	6,089,744	2025/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第340回	0.4	6,000,000	6,198,720	2025/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第341回	0.3	7,200,000	7,374,096	2025/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第342回	0.1	7,500,000	7,544,775	2026/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第343回	0.1	6,900,000	6,942,366	2026/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第344回	0.1	5,800,000	5,830,856	2026/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第345回	0.1	1,500,000	1,507,440	2026/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第1回	2.8	100,000	133,106	2029/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第2回	2.4	200,000	257,534	2030/2/20
国庫債券 利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	204,497	2030/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第4回	2.9	900,000	1,229,427	2030/11/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	191,305	2031/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第6回	2.4	700,000	916,167	2031/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第7回	2.3	600,000	779,442	2032/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	122,676	2032/11/22
国庫債券	利付 (30年) 第9回	1.4	65,000	75,672	2032/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	279,217	2033/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第11回	1.7	160,000	193,955	2033/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第12回	2.1	220,000	281,074	2033/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	366,107	2033/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	1,063,864	2034/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第15回	2.5	900,000	1,213,722	2034/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第16回	2.5	915,000	1,236,210	2034/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第17回	2.4	1,200,000	1,602,576	2034/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第18回	2.3	1,500,000	1,977,450	2035/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第19回	2.3	1,600,000	2,110,384	2035/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第20回	2.5	1,900,000	2,577,312	2035/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第21回	2.3	1,400,000	1,851,290	2035/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	815,496	2036/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	1,143,282	2036/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	954,002	2036/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	663,490	2036/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,145,613	2037/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第27回	2.5	1,550,000	2,130,304	2037/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第28回	2.5	700,000	966,812	2038/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第29回	2.4	800,000	1,093,656	2038/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第30回	2.3	900,000	1,216,764	2039/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第31回	2.2	1,000,000	1,337,440	2039/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第32回	2.3	1,900,000	2,592,816	2040/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第33回	2.0	2,000,000	2,611,480	2040/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第34回	2.2	2,300,000	3,117,972	2041/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	3,022,729	2041/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第36回	2.0	1,800,000	2,375,568	2042/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第37回	1.9	2,300,000	2,993,151	2042/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第38回	1.8	1,400,000	1,792,896	2043/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第39回	1.9	1,600,000	2,091,984	2043/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第40回	1.8	1,100,000	1,412,213	2043/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第41回	1.7	1,000,000	1,259,820	2043/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第42回	1.7	1,200,000	1,512,468	2044/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,641,198	2044/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,770,342	2044/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第45回	1.5	1,900,000	2,306,923	2044/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第46回	1.5	1,300,000	1,580,514	2045/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第47回	1.6	1,900,000	2,362,137	2045/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第48回	1.4	1,400,000	1,670,382	2045/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第49回	1.4	1,400,000	1,672,370	2045/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第50回	0.8	1,900,000	1,967,583	2046/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第51回	0.3	2,400,000	2,165,400	2046/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第52回	0.5	2,000,000	1,910,960	2046/9/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券 利付 (20年) 第38回	2.7	170,000	176,184	2018/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第39回	2.6	511,000	528,961	2018/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第40回	2.3	525,000	547,706	2018/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第41回	1.5	255,000	264,491	2019/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第42回	2.6	683,000	725,216	2019/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第43回	2.9	400,000	433,460	2019/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第44回	2.5	150,000	162,732	2020/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第45回	2.4	242,000	261,756	2020/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第46回	2.2	90,000	97,306	2020/6/22
国庫債券 利付 (20年) 第47回	2.2	1,230,000	1,336,530	2020/9/21
国庫債券 利付 (20年) 第48回	2.5	200,000	220,796	2020/12/21
国庫債券 利付 (20年) 第49回	2.1	200,000	218,702	2021/3/22
国庫債券 利付 (20年) 第50回	1.9	183,000	198,556	2021/3/22
国庫債券 利付 (20年) 第51回	2.0	310,000	339,155	2021/6/21
国庫債券 利付 (20年) 第52回	2.1	100,000	110,386	2021/9/21
国庫債券 利付 (20年) 第53回	2.1	250,000	277,322	2021/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第54回	2.2	250,000	278,572	2021/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第55回	2.0	231,000	256,100	2022/3/21
国庫債券 利付 (20年) 第56回	2.0	120,000	133,699	2022/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第57回	1.9	210,000	232,818	2022/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第58回	1.9	180,000	200,462	2022/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第59回	1.7	230,000	254,373	2022/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第60回	1.4	780,000	848,608	2022/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第61回	1.0	300,000	319,977	2023/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	464,310	2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	336,075	2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	452,528	2023/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	516,607	2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	338,523	2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	352,950	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	336,475	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	645,691	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	636,930	2024/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	232,908	2024/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第72回	2.1	670,000	778,479	2024/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第73回	2.0	1,600,000	1,853,904	2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第74回	2.1	1,300,000	1,516,658	2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	702,792	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	1,050,949	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	814,177	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	927,312	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	1,004,136	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第80回	2.1	900,000	1,058,463	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	422,128	2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	968,657	2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,624,724	2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,412,364	2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	476,408	2026/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
国庫債券 利付 (20年) 第86回	2.3	1,400,000	1,693,216	2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	600,115	2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,336,027	2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	566,406	2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,814,070	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	304,767	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第92回	2.1	1,550,000	1,866,479	2026/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	359,343	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第94回	2.1	200,000	241,596	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第95回	2.3	700,000	862,841	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	484,724	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第97回	2.2	1,300,000	1,594,931	2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	364,866	2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第99回	2.1	2,100,000	2,561,748	2027/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第100回	2.2	1,520,000	1,876,470	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	314,187	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第102回	2.4	500,000	630,515	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	749,808	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	490,792	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,337,912	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	496,824	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第107回	2.1	300,000	370,155	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,936,368	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	1,091,727	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第110回	2.1	1,100,000	1,360,821	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第111回	2.2	800,000	1,002,128	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,232,702	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第113回	2.1	1,800,000	2,238,498	2029/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第114回	2.1	2,500,000	3,116,750	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第115回	2.2	500,000	629,710	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,388,871	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第117回	2.1	1,900,000	2,374,373	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	619,345	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	969,912	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	948,248	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第121回	1.9	1,500,000	1,842,015	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第122回	1.8	1,100,000	1,336,104	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第123回	2.1	2,000,000	2,515,100	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第124回	2.0	1,000,000	1,243,960	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第125回	2.2	900,000	1,146,627	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第126回	2.0	1,000,000	1,245,560	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第127回	1.9	800,000	985,408	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第128回	1.9	1,500,000	1,849,710	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第129回	1.8	500,000	609,570	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第130回	1.8	1,600,000	1,952,352	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	964,808	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,568,788	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,709,638	2031/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第134回	1.8	900,000	1,100,592	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第135回	1.7	400,000	483,304	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	835,555	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,209,770	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	943,400	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第139回	1.6	700,000	836,465	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第140回	1.7	3,000,000	3,630,930	2032/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第141回	1.7	1,700,000	2,058,224	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第142回	1.8	1,250,000	1,532,425	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第143回	1.6	2,500,000	2,989,025	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第144回	1.5	1,500,000	1,770,315	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第145回	1.7	2,600,000	3,151,772	2033/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第146回	1.7	3,700,000	4,485,954	2033/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第147回	1.6	2,700,000	3,230,577	2033/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第148回	1.5	2,500,000	2,950,325	2034/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第149回	1.5	2,600,000	3,067,220	2034/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第150回	1.4	2,930,000	3,406,652	2034/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第151回	1.2	2,700,000	3,044,439	2034/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第152回	1.2	3,200,000	3,604,288	2035/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第153回	1.3	3,450,000	3,943,557	2035/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第154回	1.2	3,500,000	3,936,450	2035/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第155回	1.0	2,800,000	3,042,676	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第156回	0.4	2,900,000	2,829,269	2036/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第157回	0.2	3,900,000	3,650,166	2036/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第158回	0.5	3,700,000	3,660,521	2036/9/20
メキシコ合衆国	第22回円貨社債 (2016)	0.7	300,000	297,600	2021/6/16
ポーランド共和国	第15回円貨債券 (2013)	0.91	100,000	100,846	2020/11/13
小 計			491,765,000	541,127,558	
<b>地方債証券</b>					
東京都	公募第655回	1.42	100,000	101,757	2018/3/20
東京都	公募第659回	1.62	300,000	307,239	2018/6/20
東京都	公募第660回	1.58	100,000	102,352	2018/6/20
東京都	公募第664回	1.4	100,000	102,783	2018/12/20
東京都	公募第668回	1.54	200,000	206,882	2019/3/20
東京都	公募第671回	1.42	100,000	103,529	2019/6/20
東京都	公募第685回	1.13	100,000	103,975	2020/6/19
東京都	公募第690回	1.29	200,000	210,304	2020/12/18
東京都	公募第703回	0.99	100,000	104,865	2021/12/20
東京都	公募第707回	0.87	100,000	104,417	2022/3/18
東京都	公募第708回	0.89	100,000	104,715	2022/6/20
東京都	公募第710回	0.81	100,000	104,277	2022/6/20
東京都	公募第712回	0.77	100,000	104,213	2022/9/20
東京都	公募第715回	0.76	100,000	104,305	2022/12/20
東京都	公募第716回	0.77	200,000	208,730	2022/12/20
東京都	公募 (30年) 第7回	2.51	100,000	134,269	2038/9/17
東京都	公募第10回	2.31	200,000	262,904	2039/9/20
東京都	公募 (7年) 第3回	0.58	100,000	101,003	2018/9/20
東京都	公募第1回	1.54	300,000	328,926	2023/6/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
東京都	公募(20年)第3回	2.26	100,000	115,652	2024/3/19
東京都	公募第7回	2.16	100,000	117,697	2025/9/19
東京都	公募(20年)第16回	2.01	200,000	240,140	2028/12/20
東京都	公募(20年)第17回	2.09	200,000	241,996	2028/12/20
東京都	公募第23回	2.12	100,000	123,285	2030/12/20
東京都	公募(20年)第26回	1.74	300,000	356,028	2032/6/18
北海道	公募平成20年度第7回	1.72	300,000	309,057	2018/9/25
北海道	公募平成21年度第6回	1.6	100,000	104,279	2019/8/28
北海道	公募平成21年度第10回	1.5	100,000	104,382	2019/11/27
北海道	公募平成24年度第6回	0.84	100,000	104,393	2022/8/31
北海道	公募平成24年度第9回	0.79	100,000	104,230	2022/10/31
北海道	公募平成25年度第1回	0.58	300,000	309,561	2023/4/26
北海道	公募(5年)平成25年度第8回	0.31	100,000	100,536	2018/9/25
北海道	公募(5年)平成26年度第8回	0.178	200,000	200,954	2019/9/25
北海道	公募(5年)平成26年度第10回	0.147	100,000	100,416	2019/11/28
北海道	公募平成27年度第7回	0.529	100,000	103,247	2025/8/28
宮城県	公募(5年)第9回1号	0.35	500,000	502,745	2018/7/26
神奈川県	公募第155回	1.61	100,000	102,397	2018/6/20
神奈川県	公募第156回	1.66	101,000	103,916	2018/9/20
神奈川県	公募第184回	1.02	100,000	104,577	2021/6/18
神奈川県	公募第188回	1.05	200,000	210,498	2022/3/18
神奈川県	公募第196回	0.678	100,000	103,809	2023/3/20
神奈川県	公募第200回	0.825	100,000	104,997	2023/9/20
神奈川県	公募第205回	0.664	100,000	103,985	2024/3/19
神奈川県	公募第206回	0.654	100,000	103,965	2024/6/20
神奈川県	公募第210回	0.451	200,000	205,078	2024/12/20
神奈川県	公募(30年)第3回	2.62	100,000	134,629	2037/3/19
神奈川県	公募第7回	2.22	300,000	360,096	2027/3/19
神奈川県	公募(5年)第56回	0.29	100,000	100,353	2018/3/20
大阪府	公募第320回	1.84	400,000	414,176	2018/11/27
大阪府	公募第337回	1.44	200,000	209,622	2020/4/28
大阪府	公募第346回	1.25	100,000	105,085	2021/1/28
大阪府	公募第356回	1.06	100,000	105,335	2021/12/27
大阪府	公募第378回	0.7	104,000	108,333	2023/11/28
大阪府	公募第384回	0.67	100,000	103,976	2024/5/29
大阪府	公募第387回	0.521	300,000	308,802	2024/8/28
大阪府	公募第5回	2.16	100,000	122,827	2030/5/28
大阪府	公募第8回	1.83	100,000	119,136	2031/12/22
大阪府	公募第98回	0.295	200,000	201,024	2018/9/27
大阪府	公募(5年)第99回	0.24	240,000	241,046	2018/10/30
大阪府	公募(5年)第101回	0.23	148,000	148,668	2018/12/26
大阪府	公募第102回	0.223	100,000	100,459	2019/1/30
大阪府	公募(5年)第130回	0.001	600,000	600,048	2021/5/28
京都府	公募平成20年度第3回	1.57	140,000	144,366	2018/12/19
京都府	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	104,710	2022/6/20
京都府	公募平成24年度第6回	0.8	100,000	104,329	2022/10/21
京都府	公募平成26年度第5回	1.455	100,000	114,092	2034/8/10
京都府	公募平成26年度第7回	0.564	200,000	206,730	2024/9/19

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	
地方債証券		%	千円	千円	償還年月日
兵庫県	公募平成20年度第3回	1.76	100,000	102,480	2018/5/22
兵庫県	公募平成20年度第12回	1.82	100,000	103,506	2018/11/27
兵庫県	公募平成20年度第16回	1.6	100,000	103,329	2019/1/23
兵庫県	公募平成21年度第13回	1.48	100,000	103,787	2019/7/17
兵庫県	公募平成21年度第25回	1.54	100,000	104,471	2019/11/20
兵庫県	公募平成22年度第1回	1.46	100,000	104,828	2020/4/16
兵庫県	公募(30年)第2回	2.36	100,000	132,507	2040/3/19
兵庫県	公募(15年)第1回	1.66	300,000	342,537	2026/7/29
兵庫県	公募(15年)第3回	1.35	100,000	111,153	2027/7/16
兵庫県	公募(12年)第3回	0.56	300,000	310,227	2025/4/16
兵庫県	公募第2回	2.37	100,000	122,041	2027/9/17
兵庫県	公募第9回	2.25	100,000	123,468	2029/11/19
兵庫県	公募(20年)第14回	1.72	100,000	117,716	2032/5/24
静岡県	公募平成21年度第2回	1.65	100,000	104,124	2019/6/25
静岡県	公募平成21年度第7回	1.54	100,000	104,492	2019/11/25
静岡県	公募平成24年度第10回	0.678	100,000	103,813	2023/3/22
静岡県	公募平成25年度第5回	0.926	101,000	106,633	2023/7/25
静岡県	公募平成26年度第3回	0.679	165,000	171,791	2024/5/27
静岡県	公募平成26年度第8回	0.564	100,000	103,373	2024/9/25
静岡県	公募平成26年度第9回	0.554	200,000	206,578	2024/10/24
静岡県	公募平成27年度第11回	0.11	115,400	114,926	2026/3/19
静岡県	公募平成28年度第2回	0.08	300,000	297,951	2026/3/19
静岡県	公募(20年)第11回	1.841	100,000	119,264	2030/10/18
静岡県	公募(20年)第14回	1.736	100,000	118,446	2032/6/18
愛知県	公募平成20年度第7回	1.39	210,000	216,127	2019/1/30
愛知県	公募平成20年度第8回	2.04	100,000	120,278	2028/12/20
愛知県	公募平成20年度第10回	1.48	100,000	103,333	2019/3/27
愛知県	公募平成21年度第3回	1.66	114,000	118,736	2019/6/26
愛知県	公募平成21年度第17回	1.41	100,000	104,469	2020/2/26
愛知県	公募平成22年度第3回	1.364	100,000	104,679	2020/5/28
愛知県	公募平成22年度第9回	1.153	100,000	104,333	2020/9/30
愛知県	公募平成23年度第19回	1.006	100,000	104,971	2022/2/28
愛知県	公募平成24年度第2回	0.982	100,000	104,995	2022/4/27
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	1.687	100,000	117,717	2032/6/11
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	1.314	400,000	446,888	2027/12/13
愛知県	公募平成24年度第17回	1.829	100,000	120,013	2033/2/8
愛知県	公募平成26年度第8回	1.814	100,000	123,836	2044/6/20
愛知県	公募平成26年度第13回	1.363	100,000	112,423	2034/11/14
愛知県	公募平成27年度第15回	0.471	100,000	102,874	2025/11/27
広島県	公募平成20年度第3回	1.6	300,000	308,415	2018/9/25
広島県	公募平成22年度第6回	1.26	200,000	210,314	2021/1/25
広島県	公募平成24年度第4回	0.81	100,000	104,434	2022/11/28
広島県	公募平成25年度第3回	0.8	200,000	209,678	2023/9/25
広島県	公募(5年)平成25年度第6回	0.21	300,000	301,338	2019/2/25
広島県	公募平成26年度第5回	0.33	109,650	111,362	2025/1/27
埼玉県	公募平成19年度第7回	1.65	200,000	203,896	2018/2/27
埼玉県	公募平成20年度第1回	1.55	100,000	102,066	2018/4/24
埼玉県	公募平成21年度第5回	1.41	100,000	103,876	2019/9/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
埼玉県	公募平成22年度第2回	1.37	200,000	209,376	2020/5/26
埼玉県	公募平成24年度第4回	0.84	100,000	104,402	2022/7/25
埼玉県	公募平成25年度第4回	0.921	100,000	105,543	2023/7/24
埼玉県	公募平成25年度第6回	0.806	148,000	155,226	2023/9/27
埼玉県	公募（5年）平成25年度第7回	0.261	100,000	100,471	2018/10/25
埼玉県	公募平成25年度第10回	0.67	100,000	104,031	2024/2/26
埼玉県	公募平成25年度第11回	0.655	100,000	103,930	2024/3/26
埼玉県	公募平成26年度第3回	0.67	100,000	104,078	2024/5/20
埼玉県	公募平成26年度第6回	0.554	200,000	206,594	2024/9/26
埼玉県	公募平成26年度第7回	0.476	400,000	410,968	2024/12/25
埼玉県	公募平成26年度第9回	0.429	100,000	102,377	2025/2/25
福岡県	公募平成20年度第3回	1.59	100,000	102,366	2018/6/20
福岡県	公募平成22年度第5回	0.94	100,000	103,607	2020/10/28
福岡県	公募平成23年度第5回	1.02	100,000	104,897	2021/10/25
福岡県	公募平成24年度第10回	0.18	100,000	100,193	2018/1/29
福岡県	公募平成26年度第4回	0.135	100,000	100,359	2019/9/26
福岡県	公募平成23年度第1回	1.491	100,000	112,569	2026/11/27
福岡県	公募（30年）平成19年度第1回	2.62	100,000	135,135	2037/9/18
福岡県	公募（30年）平成26年度第1回	1.827	100,000	124,132	2044/6/20
福岡県	公募（20年）平成20年度第2回	2.05	100,000	120,394	2028/12/20
福岡県	公募（20年）平成24年度第2回	1.635	100,000	116,888	2032/8/16
千葉県	公募平成20年度第1回	1.55	100,000	102,069	2018/4/25
千葉県	公募平成20年度第6回	1.64	200,000	206,022	2018/10/25
千葉県	公募平成21年度第1回	1.53	100,000	103,569	2019/4/25
千葉県	公募平成21年度第11回	1.42	180,000	187,873	2020/1/24
千葉県	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,352	2022/4/25
千葉県	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	104,649	2022/5/25
千葉県	公募平成24年度第8回	0.84	100,000	104,734	2023/1/25
千葉県	公募平成25年度第2回	0.26	900,000	903,258	2018/5/25
千葉県	公募平成25年度第3回	0.89	100,000	105,306	2023/6/23
千葉県	公募平成25年度第4回	0.92	100,000	105,539	2023/7/25
千葉県	公募（20年）第8回	2.18	100,000	123,454	2030/4/19
千葉県	公募（20年）第17回	1.403	100,000	113,195	2034/10/13
新潟県	公募平成20年度第2回	1.52	200,000	206,616	2019/2/27
新潟県	公募平成21年度第2回	1.55	150,000	156,793	2019/11/27
長野県	公募平成25年度第1回	0.24	1,100,000	1,105,192	2018/12/25
群馬県	公募第8回	1.03	100,000	105,073	2021/11/25
群馬県	公募第12回	0.519	100,000	103,237	2025/8/15
群馬県	公募（5年）第4回	0.235	600,000	602,646	2018/11/22
群馬県	公募（20年）第3回	1.687	100,000	117,758	2032/6/25
岐阜県	公募平成26年度第1回	0.554	186,670	192,831	2024/9/30
共同発行市場地方債	公募第58回	1.59	270,500	275,187	2018/1/25
共同発行市場地方債	公募第62回	1.74	100,000	102,468	2018/5/25
共同発行市場地方債	公募第63回	1.88	200,000	205,656	2018/6/25
共同発行市場地方債	公募第64回	1.78	262,000	269,396	2018/7/25
共同発行市場地方債	公募第65回	1.62	700,000	718,893	2018/8/24
共同発行市場地方債	公募第66回	1.55	181,000	185,921	2018/9/25
共同発行市場地方債	公募第68回	1.69	900,000	929,079	2018/11/22

銘柄		当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
共同発行市場地方債	公募第70回	1.42	110,000	113,258	2019/1/25
共同発行市場地方債	公募第74回	1.57	500,000	518,935	2019/5/24
共同発行市場地方債	公募第75回	1.64	310,000	322,710	2019/6/25
共同発行市場地方債	公募第82回	1.42	300,000	313,122	2020/1/24
共同発行市場地方債	公募第84回	1.38	500,000	522,375	2020/3/25
共同発行市場地方債	公募第85回	1.44	100,000	104,798	2020/4/24
共同発行市場地方債	公募第88回	1.17	100,000	104,189	2020/7/24
共同発行市場地方債	公募第89回	1.04	100,000	103,807	2020/8/25
共同発行市場地方債	公募第92回	1.03	110,000	114,441	2020/11/25
共同発行市場地方債	公募第93回	1.25	300,000	315,030	2020/12/25
共同発行市場地方債	公募第94回	1.24	300,000	315,225	2021/1/25
共同発行市場地方債	公募第96回	1.29	100,000	105,471	2021/3/25
共同発行市場地方債	公募第101回	1.05	300,000	314,709	2021/8/25
共同発行市場地方債	公募第102回	1.03	150,000	157,320	2021/9/24
共同発行市場地方債	公募第103回	1.0	100,000	104,835	2021/10/25
共同発行市場地方債	公募第108回	1.01	200,000	210,116	2022/3/25
共同発行市場地方債	公募第110回	0.89	200,000	209,082	2022/5/25
共同発行市場地方債	公募第111回	0.89	200,000	209,220	2022/6/24
共同発行市場地方債	公募第113回	0.77	200,000	208,086	2022/8/25
共同発行市場地方債	公募第115回	0.8	100,000	104,337	2022/10/25
共同発行市場地方債	公募第116回	0.8	200,000	208,738	2022/11/25
共同発行市場地方債	公募第118回	0.84	100,000	104,703	2023/1/25
共同発行市場地方債	公募第119回	0.8	200,000	209,040	2023/2/24
共同発行市場地方債	公募第120回	0.68	300,000	311,484	2023/3/24
共同発行市場地方債	公募第121回	0.57	100,000	103,187	2023/4/25
共同発行市場地方債	公募第122回	0.62	400,000	414,060	2023/5/25
共同発行市場地方債	公募第124回	0.91	100,000	105,474	2023/7/25
共同発行市場地方債	公募第126回	0.81	100,000	104,906	2023/9/25
共同発行市場地方債	公募第128回	0.66	300,000	311,871	2023/11/24
共同発行市場地方債	公募第130回	0.76	100,000	104,687	2024/1/25
共同発行市場地方債	公募第132回	0.66	100,000	103,965	2024/3/25
共同発行市場地方債	公募第136回	0.611	200,000	207,384	2024/7/25
共同発行市場地方債	公募第137回	0.566	200,000	206,698	2024/8/23
共同発行市場地方債	公募第139回	0.544	155,000	159,980	2024/10/25
共同発行市場地方債	公募第143回	0.448	540,000	553,667	2025/2/25
共同発行市場地方債	公募第145回	0.406	500,000	510,960	2025/4/25
共同発行市場地方債	公募第156回	0.1	100,000	99,498	2026/3/25
共同発行市場地方債	公募第157回	0.08	100,000	99,310	2026/4/24
堺市	公募平成22年度第1回	1.97	100,000	121,086	2030/11/19
堺市	公募平成26年度第1回	1.664	100,000	119,862	2044/9/20
島根県	公募平成22年度第1回	1.08	100,000	104,240	2020/11/26
島根県	公募平成25年度第3回	0.209	700,000	703,220	2019/3/25
福島県	公募平成24年度第2回	0.17	100,000	100,194	2018/2/26
福島県	公募平成26年度第1回	0.495	200,000	205,732	2024/11/28
滋賀県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	103,895	2023/11/29
滋賀県	公募平成26年度第1回	0.495	142,000	146,069	2024/11/28
栃木県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	103,895	2023/11/29
新潟市	公募平成25年度第1回	0.72	233,200	243,519	2023/12/26

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
浜松市	公募平成26年度第1回	0.335	100,000	101,599	2025/1/23
大阪市	公募平成20年度第3回	1.82	110,000	113,161	2018/7/23
大阪市	公募平成21年度第6回	1.57	100,000	104,579	2019/11/25
大阪市	公募平成25年度第1回	0.401	800,000	804,488	2018/5/23
大阪市	公募平成25年度第6回	0.694	100,000	104,187	2023/11/22
大阪市	公募平成26年度第5回	0.593	100,000	103,598	2024/9/27
大阪市	公募(15年)第1回	1.753	100,000	115,116	2026/7/17
大阪市	公募(20年)第5回	2.47	100,000	124,980	2028/9/21
大阪市	公募(20年)第6回	2.21	100,000	122,319	2028/12/20
大阪市	公募(20年)第17回	1.721	100,000	118,265	2032/12/21
名古屋市	公募第464回	1.61	300,000	308,403	2018/9/20
名古屋市	公募第469回	1.34	100,000	103,997	2019/12/20
名古屋市	公募第478回	1.063	100,000	105,316	2022/3/18
名古屋市	公募第488回	0.598	300,000	310,881	2024/9/20
名古屋市	公募(6年)第1回	0.283	200,000	200,830	2018/6/20
名古屋市	公募(12年)第1回	1.033	200,000	214,988	2025/6/20
名古屋市	公募(15年)第2回	0.905	100,000	106,916	2029/11/16
京都市	公募平成19年度第4回	1.62	190,000	193,623	2018/2/26
京都市	公募平成20年度第4回	1.54	200,000	206,698	2019/2/26
京都市	公募平成23年度第4回	1.067	100,000	105,343	2021/12/22
京都市	公募平成25年度第3回	0.312	100,000	100,542	2018/9/27
京都市	公募(20年)第2回	2.12	100,000	117,148	2025/9/19
京都市	公募(20年)第13回	1.359	100,000	112,375	2034/11/24
神戸市	公募平成21年度第7回	1.69	100,000	104,202	2019/6/20
神戸市	公募平成26年度第17回	0.28	300,000	303,483	2025/1/27
神戸市	公募平成28年度第1回	0.08	200,000	198,622	2026/4/17
横浜市	公募平成20年度第3回	1.56	100,000	102,660	2018/9/7
横浜市	公募公債平成20年度5回	1.58	200,000	206,286	2018/12/20
横浜市	公募平成21年度第4回	1.35	200,000	207,382	2019/9/20
横浜市	公募平成22年度第5回	1.265	100,000	105,034	2020/12/11
横浜市	公募公債平成24年度2回	0.815	200,000	208,814	2022/10/17
横浜市	公募公債平成25年度1回	0.664	200,000	207,574	2023/5/19
横浜市	公募公債平成25年度5回	0.655	200,000	207,822	2023/11/17
横浜市	公募公債平成26年度5回	0.471	200,000	205,382	2024/12/13
横浜市	公募(20年)第26回	1.776	100,000	119,189	2033/1/28
横浜市	公募(20年)第30回	1.376	100,000	112,681	2034/10/20
札幌市	公募平成22年度第4回	1.05	100,000	103,685	2020/6/19
札幌市	公募(20年)平成24年度第11回	1.794	100,000	119,457	2033/2/28
札幌市	公募平成26年度第4回	0.54	100,000	103,118	2024/6/20
札幌市	公募平成26年度第9回	0.43	200,000	204,746	2024/12/20
川崎市	公募第81回	1.57	100,000	103,506	2019/3/20
川崎市	公募第82回	1.52	100,000	104,159	2019/9/20
川崎市	公募第85回	0.72	100,000	103,941	2022/12/20
川崎市	公募(20年)第17回	1.527	100,000	115,358	2033/5/9
北九州市	公募(5年)平成25年度第2回	0.312	100,000	100,542	2018/9/27
北九州市	公募(20年)第14回	1.732	100,000	118,394	2032/11/12
福岡市	公募平成20年度第3回	1.52	100,000	102,263	2018/6/20
福岡市	公募(5年)平成25年度第2回	0.35	300,000	301,644	2018/7/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
福岡市	公募平成26年度第2回	1.49	100,000	114,730	2034/6/20
福岡市	公募平成26年度第5回	0.539	100,000	103,177	2024/10/28
福岡市	公募平成26年度第8回	0.465	160,000	164,308	2025/3/25
広島市	公募平成21年度第3回	1.34	100,000	104,015	2019/12/25
広島市	公募平成26年度第2回	0.456	100,000	102,583	2024/12/25
仙台市	公募平成25年度第1回	0.24	600,000	602,964	2019/1/29
千葉市	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,352	2022/4/25
鹿児島県	公募(5年)平成25年度第1回	0.24	100,000	100,436	2018/10/31
福井県	公募平成24年度第4回	0.46	100,000	102,462	2023/4/26
福井県	公募平成27年度第4回	0.085	200,000	198,710	2026/4/27
徳島県	公募平成22年度第1回	1.05	400,000	416,544	2020/11/30
山梨県	公募平成21年度第1回	1.37	100,000	103,896	2019/10/30
岡山県	公募平成21年度第2回	1.39	100,000	104,534	2020/3/31
愛知県	名古屋半保証名古屋高速道路債券 第96回	2.34	100,000	121,988	2028/12/20
愛知県	名古屋半保証名古屋高速道路債券 第102回	2.298	300,000	368,061	2029/12/20
福岡北九州	高速道路債券 第117回	2.26	100,000	120,592	2028/12/20
小 計			47,636,420	50,150,954	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第344回	1.6	200,000	211,460	2020/7/15
公営企業債券	政府保証第881回	1.5	200,000	203,266	2018/1/23
公営企業債券	政府保証第886回	1.8	203,000	208,452	2018/6/19
公営企業債券	政府保証15年第1回	1.6	300,000	316,899	2020/6/22
政保	地方公営企業等金融機構債券 第2回	1.6	400,000	412,200	2018/11/16
地方公共団体金融機構債券	政府保証第5回	1.2	200,000	206,798	2019/10/18
地方公共団体金融機構債券	政府保証第16回	1.0	100,000	103,749	2020/9/14
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第4回	0.4	500,000	502,540	2018/3/26
政保	地方公共団体金融機構債券 第38回	0.839	194,000	203,162	2022/7/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第39回	0.801	100,000	104,580	2022/8/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第40回	0.819	101,000	105,802	2022/9/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第41回	0.791	102,000	106,757	2022/10/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第42回	0.805	108,000	113,190	2022/11/14
政保	地方公共団体金融機構債券 第43回	0.734	202,000	210,966	2022/12/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第44回	0.834	102,000	107,138	2023/1/20
政保	地方公共団体金融機構債券 第45回	0.815	223,000	234,116	2023/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第50回	0.911	100,000	105,870	2023/7/14
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第10回	0.385	300,000	303,024	2019/7/24
政保	地方公共団体金融機構債券 第59回	0.669	116,000	121,186	2024/4/12
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第14回	0.199	300,000	302,184	2020/6/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第64回	0.544	100,000	103,681	2024/9/13
政保	地方公共団体金融機構債券 第65回	0.539	400,000	414,580	2024/10/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第69回	0.414	300,000	308,241	2025/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第72回	0.509	189,000	195,775	2025/5/23
政保	地方公共団体金融機構債券 第78回	0.381	509,000	522,315	2025/11/18
日本政策金融公庫債券	政府保証第22回	0.243	2,000,000	2,009,120	2018/10/26
新関西国際空港債券	政府保証第1回	0.801	151,000	157,964	2022/8/29
新関西国際空港債券	政府保証第2回	0.882	191,000	201,837	2023/6/27
原子力損害賠償支援機構債券	政府保証第3回	0.117	2,100,000	2,103,612	2018/5/23
日本政策投資銀行債券	政府保証第22回	2.2	100,000	114,204	2023/6/19

銘柄	利	当 期		評 価 額	償 還 年 月 日
		率	額 面 金 額		
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		
日本政策投資銀行社債 政府保証第5回	1.4	100,000	103,249	2019/4/15	
日本政策投資銀行社債 政府保証第9回	1.0	141,000	146,286	2020/9/14	
日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	0.819	102,000	106,859	2022/9/20	
日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	0.668	140,000	145,776	2023/3/15	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6回	1.9	100,000	107,988	2021/2/26	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第9回	1.9	100,000	108,135	2021/3/26	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第56回	1.4	205,000	208,817	2018/4/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第58回	1.7	136,000	139,326	2018/5/30	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第60回	1.8	283,000	290,745	2018/6/29	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第62回	1.7	100,000	102,734	2018/7/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第67回	1.6	341,000	351,158	2018/10/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第69回	1.6	100,000	103,102	2018/11/28	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第71回	1.4	100,000	102,820	2018/12/25	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	2.1	200,000	245,328	2029/10/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	2.1	200,000	245,560	2029/12/28	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第98回	1.3	300,000	312,171	2020/1/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	2.2	200,000	247,774	2030/1/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第100回	1.4	400,000	417,908	2020/2/28	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	2.1	200,000	245,752	2030/4/30	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	1.9	200,000	240,734	2030/7/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	2.1	100,000	129,297	2040/11/30	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回	1.2	440,000	464,090	2021/6/30	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	1.0	140,000	146,987	2021/11/30	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	0.9	100,000	104,651	2022/1/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	0.9	140,000	146,608	2022/2/28	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	1.83	100,000	124,380	2042/5/30	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	0.839	100,000	104,755	2022/7/29	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	1.634	100,000	117,426	2032/7/30	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	0.801	218,000	228,062	2022/8/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	1.56	100,000	116,257	2032/8/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	1.919	300,000	379,980	2042/8/29	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	0.819	200,000	209,574	2022/9/30	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	0.791	200,000	209,386	2022/10/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	0.734	200,000	208,942	2022/12/28	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	0.834	400,000	420,252	2023/1/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	1.726	100,000	118,895	2033/1/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	0.541	196,000	202,601	2023/4/28	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	0.605	400,000	415,308	2023/5/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	0.882	200,000	211,362	2023/6/30	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	0.835	272,000	286,807	2023/8/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	0.693	300,000	313,926	2023/12/28	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	0.66	137,000	143,044	2024/2/29	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	0.645	145,000	151,253	2024/3/29	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回	1.483	100,000	114,952	2034/4/28	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	1.72	100,000	122,914	2044/5/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回	1.478	100,000	114,858	2034/5/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	0.644	100,000	104,368	2024/6/28	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	1.72	100,000	123,073	2044/8/31	

銘柄	柄	当 期 末		
		利 率	額 面 金 額	評 価 額
		%	千円	千円
<b>特殊債券(除く金融債)</b>				
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第225回	0.556	190,000	197,134
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第234回	0.466	100,000	103,155
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第239回	1.16	300,000	328,623
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第271回	0.02	151,000	149,958
首都高速道路債券	政府保証第8回	1.3	100,000	104,016
阪神高速道路債券	政府保証第5回	1.3	100,000	104,222
民間都市開発推進機構	政府保証第16回	0.699	120,000	125,468
中部国際空港債券	政府保証第18回	0.668	368,000	383,235
預金保険機構債券	政府保証第209回	0.1	2,000,000	2,008,680
新関西国際空港社債	財投機関債第12回	1.067	100,000	108,681
日本政策投資銀行社債	財投機関債第26回	0.573	100,000	101,416
日本政策投資銀行社債	財投機関債第31回	0.781	300,000	312,828
日本政策投資銀行社債	財投機関債第47回	1.027	100,000	108,194
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第4回	2.59	100,000	133,722
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第8回	2.45	200,000	241,906
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第17回	2.35	100,000	120,998
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第23回	2.39	200,000	244,224
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第33回	2.91	200,000	300,748
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第38回	1.87	100,000	102,786
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第39回	2.37	100,000	123,555
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第47回	2.41	100,000	124,860
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第80回	1.08	100,000	105,209
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第84回	1.01	400,000	420,380
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第86回	0.934	200,000	209,394
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第89回	1.711	100,000	117,744
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第102回	0.666	100,000	103,799
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第103回	1.69	350,000	411,264
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第105回	1.853	100,000	120,035
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第127回	0.184	300,000	301,338
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第130回	0.56	200,000	206,686
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第134回	0.529	200,000	206,226
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第136回	0.583	200,000	207,184
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第145回	1.523	300,000	343,293
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第149回	1.604	100,000	116,496
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第173回	0.652	100,000	86,828
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第33回	2.91	100,000	138,013
公営企業債券	30年第4回財投機関債	2.95	100,000	138,475
地方公営企業等金融機構債券	第1回	1.77	200,000	206,210
地方公営企業等金融機構債券	(20年) 第1回	2.07	100,000	120,416
地方公共団体金融機構債券	第1回	1.648	100,000	104,134
地方公共団体金融機構債券	第2回	1.406	100,000	103,630
地方公共団体金融機構債券	20年第4回	2.12	100,000	122,035
地方公共団体金融機構債券	20年第6回	2.242	300,000	371,706
地方公共団体金融機構債券	F24回	1.681	100,000	110,098
地方公共団体金融機構債券	第13回	1.278	200,000	208,930
地方公共団体金融機構債券	第16回	1.164	100,000	104,348
地方公共団体金融機構債券	第27回	1.034	300,000	314,304
地方公共団体金融機構債券	第28回	1.048	100,000	104,922

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
地方公共団体金融機構債券 F 104回	1.314	100,000	109,522	2025/3/7
地方公共団体金融機構債券 F 106回	1.259	100,000	108,335	2024/3/19
地方公共団体金融機構債券 第37回	0.852	400,000	417,984	2022/6/28
地方公共団体金融機構債券 第41回	0.801	600,000	626,820	2022/10/28
地方公共団体金融機構債券 F 142回	1.016	100,000	107,083	2024/11/28
地方公共団体金融機構債券 F 144回	0.562	200,000	204,264	2020/10/28
地方公共団体金融機構債券 F 145回	1.059	200,000	214,966	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券 第42回	0.801	100,000	104,535	2022/11/28
地方公共団体金融機構債券 第44回	0.791	100,000	104,473	2023/1/27
地方公共団体金融機構債券 F 160回	1.052	100,000	108,306	2028/5/26
地方公共団体金融機構債券 第51回	0.841	300,000	315,696	2023/8/28
地方公共団体金融機構債券 第52回	0.801	300,000	315,747	2023/9/15
地方公共団体金融機構債券 (15年) 第2回	1.161	200,000	219,452	2028/12/28
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第38回	1.487	100,000	114,486	2034/7/28
地方公共団体金融機構債券 第64回	0.574	100,000	103,531	2024/9/27
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第39回	1.425	100,000	113,339	2034/9/28
地方公共団体金融機構債券 第79回	0.484	100,000	102,923	2025/12/26
公営企業債券 (20年) 第2回財投機関債	1.45	100,000	108,333	2022/12/20
公営企業債券 (20年) 第5回財投機関債	2.11	200,000	227,616	2023/9/20
公営企業債券 (20年) 第25回財投機関債	2.5	100,000	124,650	2028/6/20
首都高速道路社債 第12回	0.293	100,000	100,574	2018/12/20
阪神高速道路 第13回	0.18	100,000	100,480	2019/9/20
中小企業債券 第6回財投機関債	0.79	100,000	100,974	2018/3/20
都市再生債券 財投機関債第21回	1.72	300,000	308,985	2018/9/20
都市再生債券 財投機関債第55回	1.074	100,000	105,015	2021/9/17
都市再生債券 財投機関債第97回	1.017	100,000	108,072	2029/9/20
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	2.26	100,000	117,790	2025/6/20
東京交通債券 第342回	2.4	200,000	224,038	2022/6/21
東京交通債券 第347回	2.05	157,000	176,954	2024/3/8
関西国際空港社債 財投機関債第26回	1.156	300,000	312,855	2020/9/18
関西国際空港社債 財投機関債第32回	1.164	100,000	105,441	2021/9/17
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	0.93	100,000	104,906	2022/6/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	2.26	200,000	241,228	2027/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回	1.86	200,000	204,608	2018/3/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	2.15	100,000	114,077	2023/9/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第25回	1.67	300,000	309,966	2018/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第41回	1.5	100,000	104,460	2019/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	1.94	100,000	114,657	2025/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	1.95	100,000	120,475	2030/10/22
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回	1.256	100,000	105,570	2021/6/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	2.066	100,000	122,457	2031/6/13
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	1.751	300,000	344,772	2026/6/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	2.056	100,000	122,350	2031/7/11
住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回	1.069	100,000	104,991	2021/9/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回	1.046	200,000	209,764	2021/9/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	1.595	200,000	227,988	2026/12/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	2.273	100,000	131,148	2042/9/19
成田国際空港 第13回一般担保付	0.802	200,000	208,490	2023/2/8

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円	
成田国際空港 第17回		0.489	200,000	204,724	2025/2/20
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第17回		1.208	100,000	105,354	2021/6/18
国際協力機構債券 第6回財投機関債		2.098	100,000	122,555	2030/12/13
東日本高速道路 第21回		0.58	100,000	100,858	2018/6/20
東日本高速道路 第26回		0.305	100,000	100,748	2019/6/20
東日本高速道路 第27回		0.248	100,000	100,605	2019/6/20
中日本高速道路社債 第32回		0.64	200,000	202,218	2018/9/20
中日本高速道路社債 第44回		0.536	100,000	101,457	2019/9/20
中日本高速道路社債 第47回		0.277	100,000	100,337	2018/3/20
中日本高速道路 第62回		0.225	100,000	100,804	2020/9/18
中日本高速道路 第63回		0.576	100,000	103,239	2025/11/13
西日本高速道路 第20回		0.759	200,000	208,758	2023/9/20
西日本高速道路 第23回		0.602	100,000	103,272	2024/6/20
西日本高速道路 第30回		0.17	300,000	298,755	2026/5/22
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第35回		1.165	200,000	208,636	2020/9/18
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第68回		0.586	200,000	207,112	2024/8/5
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回		1.441	100,000	113,674	2034/8/4
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券		1.94	13,872	14,341	2037/6/10
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券		1.69	47,511	49,108	2038/9/10
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券		1.8	85,090	88,515	2039/6/10
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券		1.43	86,502	88,631	2038/2/10
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券		1.76	53,982	56,527	2036/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券		2.34	64,995	69,550	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券		2.25	18,931	20,183	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券		1.84	43,822	46,034	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	48,480	51,399	2041/3/10
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券		1.69	52,692	54,801	2039/2/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券		1.69	96,004	100,393	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券		2.12	90,790	95,587	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券		2.3	84,124	90,159	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券		1.99	48,636	51,604	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券		2.14	24,023	25,550	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	34,629	37,593	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	117,795	126,523	2044/9/10
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券		1.64	29,899	31,079	2032/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券		1.43	124,686	131,153	2045/11/10
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券		1.71	61,180	63,754	2032/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券		1.79	163,125	174,135	2046/2/10
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券		1.51	117,438	124,108	2046/9/10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券		2.34	65,116	70,714	2044/5/10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券		1.89	156,132	167,450	2046/5/10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券		1.36	164,604	172,154	2045/9/10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券		1.21	207,588	216,717	2047/7/10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券		1.34	204,672	214,840	2047/5/10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券		1.26	134,308	140,594	2047/6/10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券		1.64	55,820	59,289	2046/8/10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券		1.6	123,594	131,081	2045/12/10
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券		1.07	70,250	72,996	2048/12/10

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券		1.07	147,376	153,207	2049/2/10
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券		1.08	70,199	72,940	2048/5/10
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券		1.87	36,830	38,510	2039/9/10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券		1.25	206,712	216,704	2048/3/10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券		1.88	43,342	46,332	2045/2/10
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券		1.86	44,948	48,023	2045/3/10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券		1.87	46,667	49,768	2045/4/10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券		1.85	54,957	58,823	2046/3/10
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券		1.41	134,710	141,939	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券		1.42	196,137	206,708	2047/1/10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券		1.44	65,954	69,566	2047/2/10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券		1.21	132,340	138,477	2048/9/10
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券		1.82	17,776	18,641	2036/5/10
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券		1.7	137,045	142,200	2032/5/10
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券		1.65	55,540	57,552	2032/5/10
貸付債権担保第1回住宅金融公庫債券		1.75	23,472	23,908	2036/3/10
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券		1.82	49,984	51,155	2037/8/10
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券		1.52	259,235	272,850	2045/8/10
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券		1.4	135,588	142,768	2047/3/10
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券		1.16	216,627	225,662	2047/9/10
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券		1.07	203,685	211,492	2048/4/10
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券		1.3	148,746	156,605	2048/6/10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券		1.26	132,426	138,947	2048/8/10
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券		1.04	306,692	318,291	2049/4/10
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券		1.01	536,368	555,784	2049/5/10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券		0.93	79,347	81,831	2049/9/10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券		0.95	81,118	83,769	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券		0.87	81,684	83,950	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券		0.74	168,228	171,858	2050/1/10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券		0.6	172,144	174,190	2050/2/10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券		0.8	88,048	90,316	2050/3/10
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券		0.74	90,373	92,353	2050/5/10
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券		0.83	268,845	276,386	2050/6/10
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券		0.9	273,366	282,343	2050/7/10
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券		0.88	182,704	188,418	2050/8/10
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券		0.84	91,568	94,159	2050/9/10
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券		0.89	92,423	95,370	2050/10/10
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券		0.41	300,000	299,349	2051/12/10
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券		0.48	200,000	200,792	2052/1/10
フランス預金供託公庫 第4回円貨債券 (2014)		0.725	100,000	102,196	2024/7/30
韓国産業銀行 第45回円貨社債 (2014)		0.69	100,000	100,609	2019/1/29
小	計		47,326,494	50,252,010	
<b>金融債券</b>					
商工債券	利付第753回い号	0.25	100,000	100,283	2018/2/27
農林債券	利付第752回い号	0.3	100,000	100,317	2018/1/26
農林債券	利付第756回い号	0.3	100,000	100,405	2018/5/25
農林債券	利付第759回い号	0.4	100,000	100,638	2018/8/27
農林債券	利付第760回い号	0.4	100,000	100,670	2018/9/27

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>金融債券</b>		%	千円	千円	
農林債券	利付第761回い号	0.3	100,000	100,516	2018/10/26
農林債券	利付第764回い号	0.35	100,000	100,679	2019/1/25
農林債券	利付第765回い号	0.3	300,000	301,800	2019/2/27
農林債券	利付第767回い号	0.3	300,000	301,929	2019/4/26
農林債券	利付第773回い号	0.24	300,000	301,830	2019/10/25
農林債券	利付第777回い号	0.25	300,000	302,001	2020/2/27
農林債券	利付第781回い号	0.28	100,000	100,822	2020/6/26
しんきん中金債券	利付第284回	0.4	100,000	100,613	2018/7/27
しんきん中金債券	利付第286回	0.35	100,000	100,591	2018/9/27
しんきん中金債券	利付第287回	0.3	100,000	100,525	2018/10/26
しんきん中金債券	利付第290回	0.3	100,000	100,585	2019/1/25
しんきん中金債券	利付第302回	0.2	100,000	100,510	2020/1/27
しんきん中金債券	利付第308回	0.25	100,000	100,728	2020/7/27
商工債券	利付(3年)第181回	0.15	500,000	500,825	2018/2/27
商工債券	利付(3年)第182回	0.14	100,000	100,163	2018/3/27
小	計		3,200,000	3,216,430	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
東京電力	第455回	2.075	200,000	206,556	2018/10/23
東京電力	第459回	2.7	100,000	105,007	2019/1/29
東京電力	第542回	1.602	100,000	101,839	2018/4/25
東京電力	第544回	1.976	100,000	102,598	2018/6/25
東京電力	第547回	1.948	100,000	105,522	2020/7/24
東京電力	第548回	2.347	100,000	114,004	2028/9/29
東京電力	第559回	1.377	100,000	102,914	2019/10/29
東京電力	第560回	2.114	100,000	111,888	2029/12/10
東京電力	第565回	1.313	300,000	309,567	2020/6/24
中部電力	第482回	2.17	200,000	210,194	2019/6/25
中部電力	第500回	0.875	200,000	207,972	2024/5/24
関西電力	第448回	2.16	200,000	206,096	2018/6/20
関西電力	第469回	1.7	100,000	102,845	2018/10/25
関西電力	第482回	1.189	100,000	103,404	2020/7/24
関西電力	第484回	0.976	100,000	102,804	2020/10/23
関西電力	第496回	0.908	100,000	103,776	2025/2/25
関西電力	第497回	1.002	200,000	209,286	2025/6/20
関西電力	第498回	0.416	200,000	201,304	2020/9/18
中国電力	第314回	2.875	100,000	103,775	2018/4/25
中国電力	第330回	2.1	100,000	107,949	2021/3/25
中国電力	第377回	1.121	200,000	211,018	2023/8/25
中国電力	第378回	1.004	100,000	104,824	2023/10/25
北陸電力	第301回	1.158	100,000	105,524	2023/3/24
北陸電力	第304回	0.989	100,000	104,688	2023/10/25
北陸電力	第307回	1.055	100,000	106,339	2026/6/25
北陸電力	第308回	0.769	100,000	103,281	2024/9/25
東北電力	第431回	2.05	400,000	409,908	2018/3/23
東北電力	第473回	0.597	100,000	101,490	2021/4/23
東北電力	第475回	0.809	100,000	103,311	2024/9/25
東北電力	第481回	0.803	200,000	206,950	2025/7/25
四国電力	第281回	1.111	200,000	211,232	2023/9/25

銘柄	利	当 期		末	
		率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		
九州電力 第400回	1.777	100,000	105,146	2020/4/24	
九州電力 第409回	1.483	100,000	103,446	2019/8/23	
九州電力 第420回	0.82	300,000	302,907	2018/4/25	
九州電力 第424回	1.233	200,000	211,864	2023/11/24	
北海道電力 第296回	2.027	100,000	102,907	2018/6/25	
北海道電力 第316回	1.164	207,000	213,795	2020/6/25	
北海道電力 第323回	1.337	100,000	109,520	2030/3/25	
北海道電力 第338回	0.84	100,000	98,237	2036/11/25	
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	1.293	100,000	104,476	2021/3/19	
清水建設 第18回社債間限定同順位特約付	0.947	100,000	101,792	2019/3/6	
大和ハウス工業 第5回特定社債間限定同順位特約付	0.443	100,000	100,715	2021/6/18	
森永乳業 第13回社債間限定同順位特約付	0.884	100,000	103,308	2024/5/8	
アサヒグループホールディングス 第7回特定社債間限定同順位特約付	0.237	100,000	100,257	2020/5/28	
アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特約付	0.348	100,000	100,519	2022/5/27	
キリンホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付	0.603	200,000	203,742	2025/2/28	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	0.714	100,000	102,662	2023/9/20	
野村不動産ホールディングス 第5回社債間限定同順位特約付	0.924	100,000	102,046	2025/5/30	
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付	0.34	200,000	197,418	2026/8/28	
森ビル 第13回社債間限定同順位特約付	0.466	100,000	100,656	2020/5/19	
東急不動産ホールディングス 第2回社債間限定同順位特約付	0.856	100,000	102,443	2024/7/29	
セブン&アイ・ホールディングス 第3回社債間限定同順位特約付	1.94	100,000	102,815	2018/6/20	
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	0.451	100,000	101,021	2021/9/3	
住友化学 第43回社債間限定同順位特約付	1.58	100,000	104,600	2020/4/23	
クレハ 第5回社債間限定同順位特約付	0.302	100,000	100,225	2020/3/6	
エア・ウォーター 第2回社債間限定同順位特約付	0.271	100,000	100,052	2020/9/3	
三菱ケミカルホールディングス 第14回社債間限定同順位特約付	0.482	200,000	202,402	2021/6/17	
宇部興産 第10回社債間限定同順位特約付	0.334	100,000	100,385	2019/6/4	
花王 第4回特定社債間限定同順位特約付	0.624	100,000	101,411	2020/6/19	
武田薬品工業 第15回社債間限定同順位特約付	0.704	100,000	101,653	2020/7/17	
第一三共 第4回社債間限定同順位特約付	0.846	100,000	103,904	2023/9/15	
JXホールディングス 第9回社債間限定同順位特約付	0.82	100,000	103,213	2024/6/4	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	0.355	100,000	100,691	2021/10/29	
ブリヂストン 第8回社債間限定同順位特約付	0.249	200,000	200,538	2019/9/26	
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	0.755	100,000	102,500	2024/6/25	
住友大阪セメント 第14回社債間限定同順位特約付	0.332	100,000	100,287	2020/3/3	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	0.579	100,000	98,926	2022/5/20	
神戸製鋼所 第63回社債間限定同順位特約付	0.924	100,000	99,582	2025/5/21	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回 (JFE保証)	0.703	100,000	101,461	2024/9/19	
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	0.234	100,000	100,298	2019/9/20	
小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付	0.275	100,000	100,385	2019/6/20	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	1.371	200,000	217,948	2028/12/13	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	0.428	100,000	100,865	2021/6/4	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	0.956	100,000	103,816	2022/9/20	
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	0.644	100,000	101,725	2020/10/16	
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	2.05	100,000	104,287	2019/3/20	
パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	0.387	200,000	201,324	2020/3/19	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	0.3	100,000	99,928	2023/9/20	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	0.47	100,000	100,050	2026/9/18	

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
ソニー 第26回	2.068	100,000	104,699	2019/6/20
ソニー 第32回	0.28	200,000	199,078	2023/9/20
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	0.877	100,000	103,824	2023/9/4
明治安田生命2014基金特定目的会社 第1回特定社債	0.51	300,000	301,044	2019/8/7
日産自動車 第55回特定社債間限定同順位特約付	0.415	200,000	200,932	2018/3/20
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	0.963	100,000	104,799	2023/3/20
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	0.562	100,000	101,949	2025/2/26
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	0.652	100,000	101,832	2022/3/14
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	1.358	100,000	104,409	2020/12/18
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	1.378	200,000	209,176	2021/6/4
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	0.436	100,000	99,841	2021/7/23
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	1.014	100,000	104,239	2025/12/5
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	0.954	200,000	207,060	2026/7/10
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	1.187	100,000	107,360	2029/7/13
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	1.117	100,000	103,303	2022/4/20
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	1.286	100,000	105,339	2029/1/29
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	1.657	100,000	103,927	2019/7/29
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	0.451	200,000	201,358	2021/7/30
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付	0.344	100,000	100,226	2019/6/4
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	0.543	200,000	201,406	2022/6/3
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	0.904	100,000	101,840	2024/4/24
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	0.884	100,000	101,696	2024/6/18
イオン 第16回社債間限定同順位特約付	1.01	100,000	101,436	2018/11/21
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	0.94	100,000	102,689	2024/6/26
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	0.915	200,000	204,444	2025/6/5
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	2.54	100,000	123,566	2027/7/27
みずほコーポレート銀行 第32回特定社債間限定同順位特約付	0.27	300,000	300,852	2018/1/24
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付	2.5	100,000	105,571	2019/6/3
三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間限定同順位特約付	2.69	100,000	108,460	2020/2/27
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	2.22	100,000	112,190	2022/10/27
三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付	1.035	100,000	103,774	2020/10/15
三菱東京UFJ銀行 第140回特定社債間限定同順位特約付	0.24	500,000	501,245	2018/1/23
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	0.849	300,000	305,697	2024/9/12
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	0.884	100,000	102,215	2025/5/29
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	1.328	100,000	106,360	2030/5/29
りそな銀行 第4回社債間限定同順位特約付	2.766	100,000	106,283	2019/6/20
りそな銀行 第6回劣後特約付	2.084	300,000	317,136	2020/3/4
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	1.68	100,000	106,029	2021/4/28
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	1.389	300,000	316,734	2022/9/20
三井住友信託銀行 第7回社債間限定同順位特約付	0.269	100,000	100,592	2019/4/26
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	103,934	2023/3/20
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	0.536	100,000	102,384	2024/12/20
みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	0.95	200,000	204,818	2024/7/16
三井住友銀行 第24回劣後特約付	1.6	100,000	105,829	2021/6/1
みずほ銀行 第35回特定社債間限定同順位特約付	0.285	100,000	100,562	2019/1/25
みずほ銀行 第38回特定社債間限定同順位特約付	0.24	1,000,000	1,006,390	2019/10/30
興銀リース 第4回社債間限定同順位特約付	0.36	100,000	100,418	2019/5/23
NTTファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,333	2019/6/20

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
ホンダファイナンス	第26回社債間限定同順位特約付	0.315	100,000	100,406	2018/9/20
ホンダファイナンス	第30回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	100,308	2019/6/20
ジャックス	第12回社債間限定同順位特約付	0.545	100,000	100,043	2021/12/3
オリエントコーポレーション	第2回社債間限定同順位特約付	0.45	200,000	200,236	2020/1/22
日立キャピタル	第52回社債間限定同順位特約付	0.508	100,000	100,825	2021/6/18
日立キャピタル	第56回社債間限定同順位特約付	0.197	100,000	99,958	2019/12/20
日立キャピタル	第57回社債間限定同順位特約付	0.616	100,000	101,341	2024/12/20
オリックス	第164回社債間限定同順位特約付	1.146	100,000	102,360	2019/8/7
三井住友ファイナンス&リース	第7回社債間限定同順位特約付	0.442	100,000	100,574	2018/8/6
三井住友ファイナンス&リース	第13回社債間限定同順位特約付	0.257	100,000	100,155	2020/5/28
三菱UFJリース	第30回社債間限定同順位特約付	0.426	100,000	100,575	2021/8/27
大和証券グループ本社	第17回社債間限定同順位特約付	0.398	100,000	100,539	2019/8/28
大和証券グループ本社	第22回社債間限定同順位特約付	0.397	100,000	100,506	2020/8/12
大和証券グループ本社	第23回社債間限定同順位特約付	0.909	100,000	102,385	2025/8/12
野村ホールディングス	第21回	1.86	100,000	105,446	2020/3/17
野村ホールディングス	第41回	0.783	200,000	202,026	2018/6/20
第1回財政融資マスタートラスト特定目的会社	第1回特定社債	1.83	100,000	101,914	2018/2/20
三井不動産	第34回社債間限定同順位特約付	2.085	100,000	104,261	2019/3/20
三菱地所	第56回担保提供制限等財務上特約無	2.42	100,000	111,300	2022/6/20
三菱地所	第98回担保提供制限等財務上特約無	1.165	100,000	103,196	2020/6/19
三菱地所	第110回担保提供制限等財務上特約無	0.571	100,000	100,975	2019/9/13
三菱地所	第111回担保提供制限等財務上特約無	0.929	100,000	103,304	2022/9/14
東京建物	第17回社債間限定同順位特約付	1.3	100,000	102,985	2020/3/18
住友不動産	第95回社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	103,188	2024/1/26
住友不動産	第97回社債間限定同順位特約付	0.904	200,000	205,120	2024/4/26
住友不動産	第100回社債間限定同順位特約付	0.809	100,000	101,902	2024/9/9
エヌ・ティ・ティ都市開発	第10回社債間限定同順位特約付	1.03	100,000	102,826	2020/9/18
日本ビルファンド投資法人	第13回特定投資法人債間限定同順位	1.168	100,000	104,106	2023/6/26
オリックス不動産投資法人	第5回特定投資法人債間限定同順位特	0.76	100,000	100,684	2018/2/8
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	第5回特定投資法人債	0.871	100,000	101,530	2024/8/30
東武鉄道	第102回社債間限定同順位特約付	1.36	200,000	215,954	2025/10/23
東京急行電鉄	第75回社債間限定同順位特約付	0.982	100,000	104,075	2022/6/7
東京急行電鉄	第82回社債間限定同順位特約付	1.307	100,000	109,739	2033/6/3
小田急電鉄	第68回社債間限定同順位特約付	1.098	200,000	214,058	2030/6/12
東日本旅客鉄道	第15回	2.65	100,000	109,319	2020/8/25
東日本旅客鉄道	第19回社債間限定同順位特約付	2.36	200,000	222,880	2022/2/25
東日本旅客鉄道	第58回社債間限定同順位特約付	1.58	200,000	206,826	2019/3/20
東日本旅客鉄道	第71回社債間限定同順位特約付	1.905	100,000	120,104	2030/9/27
東日本旅客鉄道	第107回社債間限定同順位特約付	1.415	100,000	112,290	2045/1/27
西日本旅客鉄道	第15回社債間限定同順位特約付	2.26	100,000	121,633	2027/12/20
西日本旅客鉄道	第31回社債間限定同順位特約付	1.408	100,000	105,381	2021/2/26
東海旅客鉄道	第16回社債間限定同順位特約付	1.875	100,000	104,931	2019/9/20
東海旅客鉄道	第51回社債間限定同順位特約付	2.212	200,000	247,762	2030/4/23
東海旅客鉄道	第70回社債間限定同順位特約付	1.309	100,000	111,978	2032/9/30
東海旅客鉄道	第74回社債間限定同順位特約付	1.685	100,000	118,991	2045/3/6
名古屋鉄道	第50回社債間限定同順位特約付	0.857	100,000	103,715	2027/4/30
日本通運	第11回社債間限定同順位特約付	0.2	100,000	98,391	2026/7/14
日本通運	第12回社債間限定同順位特約付	0.7	100,000	95,161	2036/7/14

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
ANAホールディングス	第32回社債間限定同順位特約付	0.99	100,000	96,909	2036/6/9
三菱倉庫	第14回	0.442	100,000	100,920	2021/3/12
住友倉庫	第1回社債間限定同順位特約付	0.279	200,000	200,612	2019/3/14
日本電信電話	第60回	1.31	100,000	104,516	2020/12/18
KDDI	第20回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	102,945	2023/12/20
NTTドコモ	第15回社債間限定同順位特約付	1.96	100,000	102,860	2018/6/20
電源開発	第31回社債間限定同順位特約付	1.155	100,000	103,557	2020/9/18
電源開発	第37回社債間限定同順位特約付	1.035	100,000	103,661	2021/7/20
電源開発	第39回社債間限定同順位特約付	0.929	100,000	104,256	2024/2/20
電源開発	第40回社債間限定同順位特約付	0.889	100,000	104,037	2024/6/20
電源開発	第41回社債間限定同順位特約付	0.782	100,000	103,285	2024/8/20
東京瓦斯	第17回社債間限定同順位特約付	2.625	100,000	103,824	2018/6/11
東京瓦斯	第38回社債間限定同順位特約付	1.984	100,000	124,623	2043/12/17
大阪瓦斯	第9回社債間限定同順位特約付	2.9	100,000	103,181	2018/1/30
東邦瓦斯	第31回社債間限定同順位特約付	2.06	100,000	109,551	2022/3/18
東京都競馬	第2回社債間限定同順位特約付	0.572	200,000	201,374	2018/7/11
ファーストリテイリング	第3回特定社債間限定同順位特約付	0.491	100,000	100,880	2022/12/16
クレディ・アグリコル・エス・エー	第6回円貨社債(2014)	0.865	100,000	101,316	2024/11/28
ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング	第2回円貨社債	0.345	200,000	199,802	2019/6/27
マラヤン・バンキング・ベルハッド	第2回円貨社債(2015)	0.509	200,000	193,806	2020/4/30
スタンダード・チャータード	第2回円貨社債(2015)	0.453	100,000	99,376	2020/6/5
スタンダード・チャータード	第3回円貨社債(2015)	1.043	100,000	96,883	2025/6/5
エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー	第2回円	0.842	100,000	99,827	2023/9/26
エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー	第3回円	1.207	100,000	101,239	2026/9/25
エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション	第12回	2.54	100,000	107,667	2021/2/16
パークレイズ・バンク・ピーエルシー	第7回円貨社債	0.478	100,000	99,550	2019/6/24
ナショナル・オーストラリア銀行	第11回円貨社債(2015)	0.284	200,000	200,016	2020/1/16
ラボバンク・ネダーランド	第23回円貨社債(2013)(コー)	0.557	100,000	100,438	2018/12/19
ラボバンク・ネダーランド	第25回円貨社債(2014)(コー)	0.434	100,000	100,197	2019/5/22
ソシエテ ジェネラル	第6回円貨社債(2014)	0.552	200,000	200,832	2019/6/13
小	計		27,407,000	28,291,393	
合	計		617,334,914	673,038,347	

\* 額面・評価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(302,125,962千口)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 2,420,800	千米ドル 2,499,779	千円 294,274,053	% 44.0	% —	% 18.0	% 17.5	% 8.5
カナダ	千カナダドル 145,180	千カナダドル 160,720	14,079,103	2.1	—	1.0	0.7	0.5
イギリス	千英ポンド 261,810	千英ポンド 330,799	48,167,695	7.2	—	5.2	1.8	0.2
スイス	千スイスフラン 10,700	千スイスフラン 13,185	1,512,391	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 201,100	千スウェーデンクローナ 237,694	3,035,365	0.5	—	0.3	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 121,000	千ノルウェークローネ 131,525	1,783,491	0.3	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 201,980	千デンマーククローネ 257,112	4,244,928	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	246,300	324,513	39,837,260	6.0	—	4.5	1.4	—
イタリア	451,680	553,366	67,931,226	10.1	—	6.0	2.8	1.4
フランス	415,700	528,081	64,827,300	9.7	—	6.4	2.4	1.0
オランダ	93,900	117,112	14,376,714	2.1	—	1.4	0.5	0.2
スペイン	273,700	338,080	41,502,785	6.2	—	3.4	1.6	1.1
ベルギー	105,200	139,414	17,114,467	2.6	—	1.9	0.5	0.2
オーストリア	57,100	73,700	9,047,442	1.4	—	1.0	0.3	0.0
フィンランド	25,400	29,268	3,593,035	0.5	—	0.4	0.1	0.0
アイルランド	37,800	45,397	5,572,990	0.8	—	0.4	0.3	0.1
ポーランド	千ズロチ 133,300	千ズロチ 140,789	3,916,775	0.6	—	0.2	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 30,380	千シンガポールドル 31,456	2,563,043	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千リンギ 111,400	千リンギ 110,054	2,893,336	0.4	—	0.2	0.2	0.0
オーストラリア	千豪ドル 146,550	千豪ドル 157,523	13,428,848	2.0	—	1.2	0.6	0.2
メキシコ	千メキシコペソ 974,200	千メキシコペソ 1,000,568	5,733,255	0.9	—	0.4	0.2	0.2
南アフリカ	千ランド 443,100	千ランド 404,158	3,407,058	0.5	—	0.4	0.1	0.0
合 計	—	—	662,842,569	99.0	—	53.2	31.9	14.0

\* 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	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 BOND	8.875	10,500	12,217	1,438,223	2019/2/15
	US TREASURY BOND	8.125	19,300	22,651	2,666,489	2019/8/15
	US TREASURY BOND	8.75	12,700	15,842	1,864,950	2020/8/15
	US TREASURY BOND	8.0	21,100	26,947	3,172,201	2021/11/15
	US TREASURY BOND	6.25	16,600	20,661	2,432,308	2023/8/15
	US TREASURY BOND	2.375	51,200	51,015	6,005,603	2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	43,200	55,463	6,529,111	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.5	13,800	18,556	2,184,493	2026/11/15
	US TREASURY BOND	6.125	23,700	31,539	3,712,831	2027/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	12,000	15,391	1,811,931	2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	5,000	6,307	742,486	2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	800	1,012	119,228	2029/2/15
	US TREASURY BOND	4.375	100	122	14,472	2038/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	25,300	24,123	2,839,870	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	16,000	17,926	2,110,278	2043/11/15
	US TREASURY N/B	0.75	3,400	3,393	399,497	2017/12/31
	US TREASURY N/B	2.625	16,300	16,593	1,953,390	2018/1/31
	US TREASURY N/B	0.875	4,000	3,995	470,383	2018/1/31
	US TREASURY N/B	0.75	300	299	35,234	2018/1/31
	US TREASURY N/B	3.5	41,000	42,162	4,963,396	2018/2/15
	US TREASURY N/B	1.0	12,000	12,001	1,412,805	2018/2/15
	US TREASURY N/B	2.75	6,200	6,325	744,632	2018/2/28
	US TREASURY N/B	0.75	7,100	7,078	833,297	2018/2/28
	US TREASURY N/B	1.0	4,000	3,999	470,824	2018/3/15
	US TREASURY N/B	0.75	2,000	1,993	234,621	2018/3/31
	US TREASURY N/B	0.75	34,000	33,873	3,987,626	2018/4/15
	US TREASURY N/B	2.625	8,500	8,674	1,021,218	2018/4/30
	US TREASURY N/B	0.625	1,200	1,192	140,436	2018/4/30
	US TREASURY N/B	3.875	15,200	15,794	1,859,310	2018/5/15
	US TREASURY N/B	1.0	600	599	70,568	2018/5/15
	US TREASURY N/B	2.375	7,500	7,633	898,661	2018/5/31
	US TREASURY N/B	1.0	15,500	15,474	1,821,666	2018/5/31
	US TREASURY N/B	1.125	21,400	21,404	2,519,700	2018/6/15
	US TREASURY N/B	2.375	31,200	31,780	3,741,156	2018/6/30
	US TREASURY N/B	1.375	8,500	8,533	1,004,606	2018/6/30
	US TREASURY N/B	2.25	8,800	8,956	1,054,348	2018/7/31
	US TREASURY N/B	1.375	18,400	18,469	2,174,170	2018/7/31
	US TREASURY N/B	0.75	17,700	17,588	2,070,539	2018/7/31
	US TREASURY N/B	4.0	4,800	5,026	591,763	2018/8/15
	US TREASURY N/B	1.0	19,600	19,553	2,301,813	2018/8/15
	US TREASURY N/B	1.5	20,800	20,921	2,462,922	2018/8/31
	US TREASURY N/B	1.0	800	797	93,870	2018/9/15
	US TREASURY N/B	1.375	27,400	27,483	3,235,355	2018/9/30
	US TREASURY N/B	0.75	10,000	9,921	1,167,957	2018/9/30
	US TREASURY N/B	0.875	2,400	2,386	280,905	2018/10/15
	US TREASURY N/B	1.75	9,900	10,000	1,177,264	2018/10/31
	US TREASURY N/B	1.25	21,400	21,420	2,521,569	2018/10/31

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	0.75	700	694	81,711	2018/10/31	
	US TREASURY N/B	3.75	35,700	37,422	4,405,346	2018/11/15	
	US TREASURY N/B	1.375	500	501	59,027	2018/11/30	
	US TREASURY N/B	1.25	6,000	6,002	706,623	2018/11/30	
	US TREASURY N/B	1.375	6,500	6,516	767,122	2018/12/31	
	US TREASURY N/B	1.5	5,500	5,528	650,798	2018/12/31	
	US TREASURY N/B	1.25	5,100	5,096	599,926	2019/1/31	
	US TREASURY N/B	1.5	2,000	2,008	236,470	2019/1/31	
	US TREASURY N/B	2.75	27,500	28,354	3,337,833	2019/2/15	
	US TREASURY N/B	1.375	4,500	4,506	530,505	2019/2/28	
	US TREASURY N/B	1.5	4,000	4,017	472,940	2019/2/28	
	US TREASURY N/B	1.0	8,300	8,245	970,625	2019/3/15	
	US TREASURY N/B	1.5	4,000	4,015	472,719	2019/3/31	
	US TREASURY N/B	1.625	25,500	25,675	3,022,497	2019/3/31	
	US TREASURY N/B	1.625	5,600	5,633	663,197	2019/4/30	
	US TREASURY N/B	3.125	27,600	28,741	3,383,476	2019/5/15	
	US TREASURY N/B	1.5	10,600	10,632	1,251,682	2019/5/31	
	US TREASURY N/B	1.0	1,400	1,385	163,127	2019/6/30	
	US TREASURY N/B	1.625	7,900	7,945	935,291	2019/6/30	
	US TREASURY N/B	1.625	14,500	14,573	1,715,608	2019/7/31	
	US TREASURY N/B	3.625	26,100	27,597	3,248,800	2019/8/15	
	US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,965	349,145	2019/8/31	
	US TREASURY N/B	1.625	8,800	8,841	1,040,872	2019/8/31	
	US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,962	348,717	2019/9/30	
	US TREASURY N/B	1.75	17,700	17,835	2,099,596	2019/9/30	
	US TREASURY N/B	3.375	49,300	51,901	6,109,871	2019/11/15	
	US TREASURY N/B	1.0	8,800	8,673	1,021,003	2019/11/30	
	US TREASURY N/B	1.5	1,800	1,799	211,804	2019/11/30	
	US TREASURY N/B	1.125	12,000	11,855	1,395,644	2019/12/31	
	US TREASURY N/B	1.625	3,800	3,810	448,524	2019/12/31	
	US TREASURY N/B	1.375	2,000	1,987	234,023	2020/1/31	
	US TREASURY N/B	3.625	51,800	55,025	6,477,585	2020/2/15	
	US TREASURY N/B	1.25	2,700	2,670	314,392	2020/2/29	
	US TREASURY N/B	1.125	4,000	3,936	463,412	2020/3/31	
	US TREASURY N/B	1.375	21,300	21,125	2,486,867	2020/3/31	
	US TREASURY N/B	1.375	3,200	3,170	373,231	2020/4/30	
	US TREASURY N/B	3.5	47,700	50,541	5,949,745	2020/5/15	
	US TREASURY N/B	1.5	6,500	6,455	759,979	2020/5/31	
	US TREASURY N/B	1.875	16,600	16,701	1,966,060	2020/6/30	
	US TREASURY N/B	1.625	13,200	13,156	1,548,805	2020/6/30	
	US TREASURY N/B	2.0	14,000	14,132	1,663,659	2020/7/31	
	US TREASURY N/B	2.625	42,500	43,775	5,153,193	2020/8/15	
	US TREASURY N/B	2.125	37,600	38,070	4,481,600	2020/8/31	
	US TREASURY N/B	2.0	6,000	6,045	711,617	2020/9/30	
	US TREASURY N/B	1.75	1,600	1,597	188,013	2020/10/31	
	US TREASURY N/B	2.625	52,600	54,157	6,375,414	2020/11/15	
	US TREASURY N/B	2.375	6,800	6,937	816,693	2020/12/31	
	US TREASURY N/B	2.125	5,300	5,348	629,570	2021/1/31	

銘柄	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3.625	45,800	48,977	5,765,616	2021/2/15
		US TREASURY N/B	2.0	5,000	5,017	590,715	2021/2/28
		US TREASURY N/B	1.125	10,000	9,681	1,139,676	2021/2/28
		US TREASURY N/B	2.25	1,800	1,824	214,759	2021/3/31
		US TREASURY N/B	2.25	2,900	2,936	345,708	2021/4/30
		US TREASURY N/B	3.125	38,400	40,284	4,742,232	2021/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	22,500	22,533	2,652,631	2021/5/31
		US TREASURY N/B	2.125	34,000	34,199	4,025,931	2021/6/30
		US TREASURY N/B	2.25	9,700	9,799	1,153,570	2021/7/31
		US TREASURY N/B	2.125	26,800	26,921	3,169,191	2021/8/15
		US TREASURY N/B	2.0	7,300	7,289	858,080	2021/8/31
		US TREASURY N/B	2.125	16,000	16,060	1,890,583	2021/9/30
		US TREASURY N/B	2.0	10,000	9,974	1,174,164	2021/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	26,000	25,926	3,052,111	2021/11/15
		US TREASURY N/B	1.875	8,000	7,930	933,519	2021/11/30
		US TREASURY N/B	2.125	12,400	12,435	1,463,947	2021/12/31
		US TREASURY N/B	1.5	5,000	4,856	571,723	2022/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	33,700	33,540	3,948,412	2022/2/15
		US TREASURY N/B	1.75	7,300	7,168	843,914	2022/2/28
		US TREASURY N/B	1.75	5,900	5,786	681,199	2022/3/31
		US TREASURY N/B	1.75	5,000	4,899	576,736	2022/4/30
		US TREASURY N/B	1.75	11,900	11,655	1,372,084	2022/5/15
		US TREASURY N/B	2.125	27,000	26,926	3,169,748	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	18,500	17,941	2,112,059	2022/8/15
		US TREASURY N/B	1.625	12,800	12,376	1,457,020	2022/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	13,000	12,911	1,519,958	2022/12/31
		US TREASURY N/B	1.75	22,000	21,355	2,513,965	2023/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	17,000	16,737	1,970,283	2023/2/15
		US TREASURY N/B	1.5	25,000	23,865	2,809,415	2023/2/28
		US TREASURY N/B	1.5	11,000	10,492	1,235,232	2023/3/31
		US TREASURY N/B	1.75	42,200	40,805	4,803,614	2023/5/15
		US TREASURY N/B	1.625	15,400	14,761	1,737,681	2023/5/31
		US TREASURY N/B	2.5	19,400	19,600	2,307,319	2023/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	16,800	17,226	2,027,910	2023/11/15
		US TREASURY N/B	2.75	26,800	27,467	3,233,521	2024/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	30,400	30,611	3,603,570	2024/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	25,100	24,731	2,911,373	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	9,700	9,358	1,101,650	2025/2/15
		US TREASURY N/B	2.125	26,500	25,748	3,031,110	2025/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	16,000	15,351	1,807,149	2025/8/15
		US TREASURY N/B	2.25	19,600	19,163	2,255,938	2025/11/15
		US TREASURY N/B	5.375	300	395	46,556	2031/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	500	625	73,602	2038/5/15
		US TREASURY N/B	3.5	500	540	63,660	2039/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	5,200	6,459	760,445	2039/8/15
		US TREASURY N/B	4.375	7,200	8,790	1,034,847	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4.625	8,000	10,115	1,190,811	2040/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	8,000	9,773	1,150,492	2040/5/15

銘柄	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	3.875	8,000	9,083	1,069,339	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.25	7,800	9,360	1,101,859	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4.75	7,000	9,022	1,062,110	2041/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	7,000	8,565	1,008,386	2041/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	6,500	6,518	767,391	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	3,200	3,209	377,851	2042/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	4,500	4,412	519,393	2042/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	9,300	8,679	1,021,795	2042/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	9,600	8,946	1,053,211	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	18,200	18,214	2,144,177	2043/2/15
		US TREASURY N/B	3.625	15,700	17,198	2,024,649	2043/8/15
		US TREASURY N/B	3.625	23,200	25,409	2,991,198	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.375	18,900	19,781	2,328,679	2044/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	30,600	30,578	3,599,698	2044/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	36,900	35,957	4,232,895	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	26,000	22,847	2,689,607	2045/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	21,700	21,126	2,487,068	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,000	1,898	223,484	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	15,500	15,081	1,775,337	2045/11/15
		US TREASURY NOTE	2.875	33,600	34,370	4,046,087	2018/3/31
小	計					294,274,053	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.75	4,600	4,935	432,380	2022/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	9,000	9,055	793,232	2018/2/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	3,200	3,220	282,094	2018/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.25	6,300	6,612	579,225	2018/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	9,500	9,568	838,191	2018/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	9,700	9,641	844,579	2018/11/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	3,800	3,873	339,294	2019/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.75	6,700	7,162	627,440	2019/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	4,300	4,394	384,929	2019/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	3,600	3,654	320,090	2020/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	7,800	8,441	739,438	2020/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,800	2,765	242,258	2020/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	8,200	8,061	706,194	2021/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.25	10,500	11,431	1,001,367	2021/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	800	768	67,299	2022/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,600	4,602	403,221	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	5,700	6,052	530,237	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	8,500	8,849	775,180	2025/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	3,700	5,820	509,905	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	5,680	7,944	695,963	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	3,000	4,417	387,007	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	5,000	7,094	621,478	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	6,400	8,242	722,081	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	9,500	11,620	1,017,930	2045/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	1,937	169,758	2048/12/1

銘柄	当期末						
	利率	額面金額	評価額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.75	500	551	48,319	2064/12/1
小	計					14,079,103	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド			
	国債証券	UK TREASURY	5.0	100	105	15,425	2018/3/7
		UK TREASURY	1.25	9,850	10,033	1,460,935	2018/7/22
		UK TREASURY	4.5	4,500	4,941	719,459	2019/3/7
		UK TREASURY	1.75	18,900	19,678	2,865,412	2019/7/22
		UK TREASURY	3.75	2,600	2,854	415,611	2019/9/7
		UK TREASURY	4.75	5,300	6,060	882,476	2020/3/7
		UK TREASURY	2.0	16,090	17,005	2,476,173	2020/7/22
		UK TREASURY	3.75	7,000	7,873	1,146,474	2020/9/7
		UK TREASURY	1.5	2,200	2,288	333,219	2021/1/22
		UK TREASURY	8.0	9,340	12,436	1,810,836	2021/6/7
		UK TREASURY	3.75	8,900	10,217	1,487,726	2021/9/7
		UK TREASURY	4.0	4,650	5,447	793,274	2022/3/7
		UK TREASURY	1.75	8,300	8,747	1,273,704	2022/9/7
		UK TREASURY	2.25	5,100	5,538	806,475	2023/9/7
		UK TREASURY	2.75	11,500	12,916	1,880,815	2024/9/7
		UK TREASURY	5.0	13,450	17,518	2,550,886	2025/3/7
		UK TREASURY	4.25	9,530	12,203	1,776,902	2027/12/7
		UK TREASURY	6.0	5,350	7,981	1,162,210	2028/12/7
		UK TREASURY	4.75	5,700	7,885	1,148,190	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	7,250	9,680	1,409,639	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	6,600	9,232	1,344,379	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	4,900	6,740	981,475	2036/3/7
		UK TREASURY	4.75	4,400	6,598	960,769	2038/12/7
		UK TREASURY	4.25	4,200	5,938	864,687	2039/9/7
		UK TREASURY	4.25	5,700	8,152	1,187,033	2040/12/7
		UK TREASURY	4.5	5,600	8,455	1,231,196	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	20,000	26,332	3,834,202	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	5,950	8,967	1,305,807	2046/12/7
		UK TREASURY	4.25	4,350	6,803	990,643	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	8,750	12,939	1,884,120	2052/7/22
		UK TREASURY	2.5	2,500	3,045	443,382	2065/7/22
		UK TREASURY	3.5	5,800	9,046	1,317,310	2068/7/22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	21,050	26,457	3,852,512	2044/1/22
		UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	6,400	10,674	1,554,322	2055/12/7
小	計					48,167,695	
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	7,100	7,955	912,501	2021/4/28
		SWITZERLAND GOVERNMENT	4.0	3,600	5,230	599,890	2028/4/8
小	計					1,512,391	
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	4.25	4,600	5,104	65,185	2019/3/12
		SWEDISH GOVERNMENT	5.0	49,400	59,927	765,269	2020/12/1
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	53,400	63,682	813,221	2022/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	26,600	28,943	369,610	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	41,700	48,755	622,609	2025/5/12

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		
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	千円		
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	1.0	9,100	9,398	120,012	2026/11/12	
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	16,300	21,883	279,456	2039/3/30	
小 計						3,035,365		
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	24,800	27,018	366,368	2019/5/22	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.75	27,600	30,746	416,921	2021/5/25	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	14,300	14,838	201,208	2023/5/24	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	44,900	49,529	671,615	2024/3/14	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	4,700	4,759	64,535	2025/3/13	
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	4,700	4,634	62,841	2026/2/19	
小 計						1,783,491		
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	16,500	16,767	276,828	2018/11/15	
		KINGDOM OF DENMARK	4.0	30,800	34,850	575,376	2019/11/15	
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	41,100	47,542	784,925	2021/11/15	
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	31,000	34,089	562,822	2023/11/15	
		KINGDOM OF DENMARK	7.0	5,280	8,138	134,359	2024/11/10	
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	29,000	32,453	535,813	2025/11/15	
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	48,300	83,270	1,374,803	2039/11/15	
小 計						4,244,928		
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ			
	ドイツ	国債証券	BUNDES OBLIGATION	0.5	600	618	75,876	2019/4/12
			BUNDES OBLIGATION	0.25	6,000	6,174	757,957	2019/10/11
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5	17,700	19,647	2,411,865	2019/7/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	3,700	4,155	510,148	2020/1/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	4,100	4,642	569,929	2020/7/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	13,300	14,769	1,813,122	2020/9/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	8,300	9,369	1,150,245	2021/1/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	7,000	8,237	1,011,247	2021/7/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	8,400	9,520	1,168,743	2021/9/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	14,400	16,202	1,988,959	2022/1/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	8,500	9,515	1,168,069	2022/7/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,000	5,534	679,445	2022/9/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,777	709,298	2023/2/15
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,792	711,047	2023/5/15
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	14,000	16,097	1,976,092	2023/8/15
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	14,100	20,483	2,514,605	2024/1/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	5,700	6,476	795,084	2024/2/15
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,500	1,678	206,085	2024/5/15
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	4,300	4,650	570,952	2024/8/15
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	8,000	8,325	1,022,070	2025/2/15
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	2,000	2,061	253,045	2026/2/15
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	20,600	33,863	4,157,034	2027/7/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	6,000	9,433	1,158,056	2028/1/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	3,400	5,072	622,749	2028/7/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	6,500	11,276	1,384,322	2030/1/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	5,300	8,880	1,090,114	2031/1/4
			BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	6,300	10,594	1,300,635	2034/7/4

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	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	5,400	8,677	1,065,303	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	8,400	14,368	1,763,877	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	8,200	15,085	1,851,885	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	5,500	8,457	1,038,303	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	4,700	6,504	798,505	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	9,000	12,565	1,542,577	2046/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.75	8,700	8,784	1,078,393	2018/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	15,900	16,723	2,052,972	2018/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	12,100	12,740	1,563,988	2018/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	29,600	31,820	3,906,223	2018/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	8,000	8,566	1,051,640	2018/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	15,300	16,699	2,050,085	2019/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,800	3,081	378,238	2019/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	5,800	6,144	754,301	2019/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	500	519	63,761	2019/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	11,080	12,337	1,514,561	2019/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	11,100	12,600	1,546,864	2020/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	29,200	33,007	4,052,022	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	16,200	18,442	2,263,949	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	2,000	2,031	249,350	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	11,400	13,000	1,595,901	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	7,000	7,987	980,484	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	7,800	8,948	1,098,571	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	12,800	15,288	1,876,794	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	20,442	2,509,489	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	9,600	12,077	1,482,665	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	20,700	26,117	3,206,146	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	6,700	8,113	995,966	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	6,200	7,661	940,506	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	11,700	17,734	2,177,131	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	15,900	19,409	2,382,664	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	2,300	2,690	330,290	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	14,900	18,923	2,323,097	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	8,500	10,491	1,287,942	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	8,600	12,914	1,585,398	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	18,200	26,390	3,239,636	2027/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	7,300	9,387	1,152,356	2028/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	18,500	25,080	3,078,876	2029/11/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	18,300	26,895	3,301,692	2031/5/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	6,400	9,343	1,146,990	2033/2/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,400	11,530	1,415,506	2034/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	6,700	8,277	1,016,106	2037/2/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,000	11,164	1,370,590	2039/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	15,600	21,698	2,663,651	2040/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	7,000	9,548	1,172,112	2044/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	8,100	8,751	1,074,302	2046/9/1		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0	8,000	8,319	1,021,356	2019/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	9,500	9,797	1,202,739	2019/11/25

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	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2.5	4,500	5,371	659,386	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	2,000	1,977	242,696	2036/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	5,400	5,743	705,052	2018/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	6,600	6,758	829,691	2018/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	10,800	11,787	1,446,986	2018/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	26,800	27,660	3,395,566	2018/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	11,500	12,824	1,574,396	2019/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	4,000	5,042	618,981	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	11,500	12,924	1,586,653	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	14,800	16,789	2,061,068	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.5	27,300	30,375	3,728,877	2020/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	0.25	2,000	2,050	251,682	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	11,800	13,898	1,706,195	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	15,100	17,674	2,169,727	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.0	14,800	17,310	2,125,021	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	20,600	23,391	2,871,556	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	8,200	12,635	1,551,085	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	32,000	41,120	5,047,891	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	8,000	8,917	1,094,670	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	19,800	29,458	3,616,318	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	4,000	4,159	510,583	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	33,100	41,878	5,140,958	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	7,200	8,673	1,064,712	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	24,500	37,873	4,649,326	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	19,600	32,978	4,048,497	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	7,400	11,741	1,441,396	2035/4/25
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	11,800	17,749	2,178,921	2038/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	11,400	18,547	2,276,843	2041/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	13,200	18,307	2,247,412	2045/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	4,700	7,837	962,129	2055/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	3,800	6,507	798,916	2060/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.25	5,200	5,309	651,823	2018/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	7,100	7,628	936,507	2018/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.25	2,500	2,602	319,505	2019/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	7,100	7,966	977,930	2019/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	2,000	2,058	252,668	2020/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	5,800	6,665	818,275	2020/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	5,900	6,923	849,958	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	1,500	1,715	210,564	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	5,900	7,344	901,588	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	4,300	6,339	778,183	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	1,400	1,573	193,190	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	13,500	15,489	1,901,540	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	4,000	4,042	496,195	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	7,300	11,265	1,382,935	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	5,700	7,249	889,929	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	5,000	7,964	977,684	2037/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	5,200	8,486	1,041,762	2042/1/15		

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	4,500	6,488	796,470	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.5	30,700	32,319	3,967,525	2018/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	3,000	3,021	370,857	2018/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.1	17,800	19,043	2,337,791	2018/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.75	7,100	7,632	937,011	2018/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	13,300	14,221	1,745,787	2019/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6	8,900	9,993	1,226,746	2019/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3	8,800	9,898	1,215,107	2019/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	27,500	31,177	3,827,315	2020/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	10,600	12,539	1,539,389	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	7,900	9,722	1,193,554	2021/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	900	921	113,139	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	9,200	11,753	1,442,849	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	17,000	21,891	2,687,408	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	6,000	7,451	914,803	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	7,100	9,041	1,109,942	2024/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	7,900	9,513	1,167,934	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	14,000	17,946	2,203,064	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	18,400	25,947	3,185,353	2026/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	4,800	6,657	817,286	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	5,400	7,889	968,456	2040/7/30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	6,400	9,151	1,123,395	2041/7/30		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	7,800	11,874	1,457,679	2044/10/31		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	1,000	1,116	137,051	2066/7/30		
SPANISH GOVERNMENT	6.0	18,500	27,478	3,373,307	2029/1/31		
SPANISH GOVERNMENT	5.75	8,500	12,964	1,591,485	2032/7/30		
SPANISH GOVERNMENT	4.2	5,200	6,912	848,540	2037/1/31		
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	1.25	6,400	6,587	808,661	2018/6/22
		BELGIUM KINGDOM	3.0	3,100	3,408	418,421	2019/9/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	7,000	8,139	999,258	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	7,200	8,797	1,079,959	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	5,000	6,145	754,465	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	8,053	988,601	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	5,000	5,762	707,350	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	10,000	11,775	1,445,499	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	8,400	11,520	1,414,288	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	5,007	614,731	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,800	10,995	1,349,865	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	5,800	8,938	1,097,234	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	1,300	1,429	175,429	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	4.0	2,500	2,649	325,221	2018/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	4.0	5,200	5,752	706,226	2019/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	10,600	16,214	1,990,531	2028/3/28
BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	11,000	18,236	2,238,721	2035/3/28		
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.15	2,300	2,378	291,947	2018/10/19
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.35	2,500	2,776	340,812	2019/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.95	2,500	2,661	326,695	2019/6/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	2,400	2,457	301,694	2019/10/18

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	
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	4,600	5,319	653,070	2020/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	4,400	5,210	639,638	2021/9/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,300	3,984	489,167	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	5,000	6,062	744,232	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	3,900	4,387	538,585	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	3,000	3,356	412,031	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,630	936,683	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	6,100	9,774	1,199,919	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	5,900	9,274	1,138,559	2037/3/15
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	5,800	8,426	1,034,402	2044/6/20		
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.125	1,500	1,547	189,965	2018/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.375	1,300	1,466	180,039	2019/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	3.375	2,000	2,261	277,634	2020/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	3.5	2,000	2,341	287,495	2021/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	3,200	3,544	435,080	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	4,200	4,626	567,930	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	2,400	3,172	389,434	2025/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	1,000	1,050	128,984	2025/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,019	247,970	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,500	4,366	536,087	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	700	697	85,633	2031/4/15
FINNISH GOVERNMENT	2.625	1,600	2,173	266,780	2042/7/4		
アイルランド	国債証券	IRELAND (REPUBLIC OF) 4.4	4.4	3,600	4,041	496,188	2019/6/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	5,600	6,112	750,378	2018/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.9	3,400	4,022	493,786	2019/10/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	5,300	6,176	758,209	2020/4/18
		IRISH GOVERNMENT	5.0	3,500	4,230	519,385	2020/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.4	7,000	9,698	1,190,587	2025/3/13
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	1,500	1,604	196,948	2045/2/18
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	2,600	3,002	368,552	2030/5/15
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	1,900	2,305	282,962	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	3,400	4,203	515,990	2023/3/20
小 計					263,803,223		
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3.75	3,000	3,079	85,671	2018/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	14,400	14,558	405,014	2018/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	—	1,200	1,158	32,228	2018/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	5,800	5,956	165,712	2019/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	11,100	12,070	335,791	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	6,300	6,124	170,376	2020/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	30,700	33,757	939,139	2020/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	6,700	7,622	212,051	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	9,400	10,786	300,080	2022/9/23
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	12,500	13,190	366,963	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	23,000	22,886	636,705	2025/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	5,500	5,097	141,802	2026/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	3,700	4,501	125,237	2029/4/25
小 計					3,916,775		

銘柄	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		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	4.0	1,600	1,670	136,115	2018/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.5	5,600	5,729	466,878	2019/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	4,000	4,213	343,306	2020/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	3,380	3,430	279,518	2021/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	1,400	1,473	120,075	2022/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	3,000	3,083	251,215	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	2,300	2,394	195,102	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	3,300	3,583	291,988	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	2,400	2,429	197,929	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	500	541	44,122	2033/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	2,900	2,906	236,788	2042/4/1
小	計					2,563,043	
マレーシア			千リンギ	千リンギ			
	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.24	2,700	2,716	71,404	2018/2/7
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.26	3,700	3,690	97,031	2018/3/1
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.58	5,000	4,990	131,189	2018/9/28
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.759	900	903	23,752	2019/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.654	3,400	3,400	89,400	2019/10/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	11,900	12,133	319,002	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.492	10,000	9,927	261,003	2020/3/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.889	2,400	2,413	63,443	2020/7/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	6,000	6,089	160,087	2021/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	8,700	8,715	229,140	2021/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	4,600	4,440	116,749	2022/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	10,400	9,929	261,037	2023/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	5,800	5,743	151,005	2024/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	8,800	8,805	231,489	2026/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	6,000	5,515	145,008	2027/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	1,800	1,674	44,011	2028/6/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	5.248	2,700	2,858	75,162	2028/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	2,500	2,465	64,830	2030/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	4,400	4,223	111,046	2031/6/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	4,700	4,377	115,078	2032/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	400	356	9,361	2033/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.935	4,600	4,682	123,099	2043/9/30
小	計					2,893,336	
オーストラリア			千豪ドル	千豪ドル			
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	3,700	3,847	328,011	2018/1/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	9,700	9,936	847,118	2018/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.25	11,600	12,429	1,059,578	2019/3/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	3,300	3,367	287,070	2019/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	13,100	14,112	1,203,058	2020/4/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	6,300	6,201	528,707	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	10,200	11,704	997,819	2021/5/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	8,100	9,507	810,503	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	7,500	8,820	751,977	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	7,900	7,952	677,987	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	16,300	16,935	1,443,755	2025/4/21

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千豪ドル	千豪ドル	千円	
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	12,300	13,760	1,173,040	2026/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	11,250	13,182	1,123,814	2027/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	789	67,308	2027/11/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	400	372	31,767	2028/5/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	10,100	10,321	879,871	2029/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	3,600	4,145	353,411	2033/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	1,619	138,071	2035/6/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	5,400	5,547	472,897	2037/4/21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	3,200	2,968	253,076	2039/6/21
小計					13,428,848	
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	4.75	146,200	142,658	817,434	2018/6/14
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	104,500	108,208	620,034	2018/12/13
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	33,000	31,480	180,382	2019/12/11
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	70,700	73,389	420,521	2020/6/11
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	124,300	122,389	701,289	2021/6/10
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	48,400	47,313	271,104	2022/6/9
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	30,700	35,837	205,347	2024/12/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	8,000	7,187	41,185	2026/3/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	83,100	83,727	479,761	2027/6/3
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	47,100	50,876	291,519	2029/5/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	44,500	45,120	258,537	2031/5/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	10,121	57,994	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	46,000	57,080	327,071	2036/11/20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	30,500	33,265	190,608	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	64,200	64,992	372,404	2042/11/13
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	83,000	86,920	498,056	2023/12/7
小計					5,733,255	
南アフリカ			千ランド	千ランド		
国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	26,100	26,108	220,096	2018/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	25,300	24,657	207,866	2020/1/15
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	26,100	24,621	207,563	2021/3/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	25,200	24,093	203,104	2023/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	70,000	76,963	648,805	2026/12/21
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	27,000	24,212	204,115	2030/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	30,000	24,426	205,911	2031/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	41,000	36,816	310,361	2032/3/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	47,100	33,486	282,289	2036/3/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	27,500	24,604	207,413	2037/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	24,600	17,462	147,208	2041/2/28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	27,100	24,697	208,197	2044/1/31
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	46,100	42,007	354,124	2048/2/28
小計					3,407,058	
合計					662,842,569	

\* 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（現地通貨建て）マザーファンド>

下記は、新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド全体(3,154,328千口)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
トルコ	千トルコリラ 11,130	千トルコリラ 10,301	千円 345,821	% 8.7	% 8.7	% 5.3	% 2.8	% 0.7
ハンガリー	千フォロント 414,000	千フォロント 488,966	193,435	4.9	—	2.6	2.2	—
ポーランド	千ズロチ 13,510	千ズロチ 13,708	381,380	9.6	—	4.2	4.8	0.7
ロシア	千ルーブル 130,000	千ルーブル 128,869	248,717	6.3	6.3	—	—	6.3
ルーマニア	千レイ 4,210	千レイ 4,645	126,370	3.2	—	1.8	1.3	—
マレーシア	千リング 13,510	千リング 13,328	350,416	8.8	—	4.1	3.1	1.6
タイ	千バーツ 83,300	千バーツ 88,745	290,198	7.3	—	3.3	3.9	0.1
フィリピン	千フィリピンペソ 5,000	千フィリピンペソ 5,000	11,800	0.3	—	—	0.3	—
インドネシア	千ルピア 43,360,000	千ルピア 45,159,636	397,404	10.0	10.0	8.5	1.5	—
メキシコ	千メキシコペソ 64,150	千メキシコペソ 65,690	376,405	9.5	—	6.1	1.7	1.7
ブラジル	千レアル 8,187	千レアル 11,737	414,442	10.4	10.4	2.6	5.3	2.6
コロンビア	千コロンビアペソ 6,570,000	千コロンビアペソ 7,198,340	282,894	7.1	—	3.2	3.9	—
ペルー	千ヌエボソル 2,200	千ヌエボソル 2,249	78,035	2.0	—	1.5	0.5	—
南アフリカ	千ランド 49,330	千ランド 43,710	368,482	9.3	—	8.0	1.3	—
合 計	—	—	3,865,805	97.3	35.4	51.2	32.6	13.5

\* 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、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、価格情報会社よりデータを入手しています。

\* スタンダード・アンド・プアーズ、ムーディーズ・インバスターズ・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	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		
トルコ		%	千トルコリラ	千トルコリラ	千円		
	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	8.8	800	780	26,211	2018/11/14
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.5	1,410	1,419	47,641	2020/1/15
		TURKEY GOVERNMENT BOND	7.4	1,050	966	32,437	2020/2/5
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.4	950	915	30,727	2020/7/8
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.5	1,050	994	33,380	2022/1/12
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.5	1,390	1,254	42,112	2022/9/14
		TURKEY GOVERNMENT BOND	7.1	570	473	15,901	2023/3/8
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.8	460	414	13,897	2023/9/27
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.4	220	213	7,152	2024/3/20
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.0	1,010	911	30,599	2024/7/24
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.0	1,620	1,368	45,953	2025/3/12
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.6	600	589	19,804	2026/2/11
小	計					345,821	
ハンガリー				千フォロント	千フォロント		
	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND	6.5	62,000	70,850	28,028	2019/6/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.5	48,000	51,864	20,517	2020/6/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	7.5	81,000	100,160	39,623	2020/11/12
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	7.0	24,000	30,358	12,009	2022/6/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	6.0	77,000	95,031	37,594	2023/11/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.0	30,000	30,664	12,130	2024/6/26
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	5.5	92,000	110,036	43,530	2025/6/24
小	計					193,435	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3.75	910	934	25,987	2018/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	990	1,016	28,285	2019/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	380	413	11,495	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	1,730	1,681	46,785	2020/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	830	912	25,390	2020/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	1,700	1,658	46,135	2021/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	600	576	16,049	2021/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	500	568	15,824	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	980	1,124	31,284	2022/9/23
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	1,140	1,202	33,467	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	2,100	2,089	58,133	2025/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,650	1,529	42,540	2026/7/25
小	計					381,380	
ロシア				千ルーブル	千ルーブル		
	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND	7.85	130,000	128,869	248,717	2018/3/10
小	計					248,717	
ルーマニア				千レイ	千レイ		
	国債証券	ROMANIA	4.75	790	851	23,164	2019/6/24
		ROMANIA	2.25	440	445	12,107	2020/2/26
		ROMANIA	3.25	300	309	8,416	2021/3/22
		ROMANIA	5.95	300	343	9,352	2021/6/11
		ROMANIA	5.85	950	1,095	29,788	2023/4/26

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		
ルーマニア		%	千レイ	千レイ	千円	
国債証券	ROMANIA	4.75	820	885	24,081	2025/2/24
	ROMANIA	5.8	610	715	19,459	2027/7/26
小計					126,370	
マレーシア			千リンギ	千リンギ		
国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.24	510	513	13,487	2018/2/7
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.58	1,960	1,956	51,426	2018/9/28
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	1,760	1,794	47,180	2019/11/29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.659	1,300	1,296	34,082	2020/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	1,020	1,035	27,214	2021/7/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	500	500	13,169	2021/9/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	750	724	19,035	2022/8/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	880	840	22,087	2023/3/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	1,200	1,188	31,242	2024/7/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	1,240	1,240	32,619	2026/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.9	500	485	12,764	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	740	688	18,093	2028/6/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	200	197	5,186	2030/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	550	512	13,466	2032/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	400	356	9,361	2033/4/15
小計					350,416	
タイ			千バーツ	千バーツ		
国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	5.125	600	625	2,044	2018/3/13
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.45	11,200	11,607	37,956	2019/3/8
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.875	9,700	10,188	33,315	2019/6/13
	THAILAND GOVERNMENT BOND	2.55	9,700	9,901	32,377	2020/6/26
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.65	15,000	15,972	52,230	2021/12/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	1.875	3,000	2,922	9,555	2022/6/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.625	8,700	9,250	30,249	2023/6/16
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4.75	1,500	1,724	5,638	2024/12/20
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.85	6,200	6,689	21,873	2025/12/12
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.58	6,700	7,041	23,024	2027/12/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4.875	10,000	11,816	38,640	2029/6/22
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.4	1,000	1,006	3,291	2036/6/17
小計					290,198	
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	5,000	5,000	11,800	2021/1/15
小計					11,800	
インドネシア			千ルピア	千ルピア		
国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	7.875	2,700,000	2,725,650	23,985	2019/4/15
	INDONESIA GOVERNMENT	11.0	1,900,000	2,118,500	18,642	2020/11/15
	INDONESIA GOVERNMENT	12.8	1,700,000	2,016,006	17,740	2021/6/15
	INDONESIA GOVERNMENT	7.0	1,880,000	1,829,166	16,096	2022/5/15
	INDONESIA GOVERNMENT	8.375	5,330,000	5,479,240	48,217	2024/3/15
	INDONESIA GOVERNMENT	11.0	6,880,000	8,199,439	72,155	2025/9/15
	INDONESIA GOVERNMENT	7.0	3,450,000	3,294,049	28,987	2027/5/15
	INDONESIA GOVERNMENT	9.0	1,330,000	1,417,780	12,476	2029/3/15
	INDONESIA GOVERNMENT	10.5	1,110,000	1,325,782	11,666	2030/8/15

銘柄	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		
インドネシア		%	千ルピア	千ルピア	千円		
	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9.5	1,400,000	1,558,163	13,711	2031/7/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.25	3,300,000	3,293,103	28,979	2032/6/15
		INDONESIA GOVERNMENT	6.625	4,500,000	3,887,235	34,207	2033/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.375	4,280,000	4,339,920	38,191	2034/3/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.25	3,600,000	3,675,600	32,345	2036/5/15
小	計					397,404	
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	4.75	6,850	6,684	38,299	2018/6/14
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	4,800	4,970	28,480	2018/12/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	2,200	2,098	12,025	2019/12/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	7,950	8,252	47,286	2020/6/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	1,600	1,575	9,027	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	8,200	8,015	45,930	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	4,600	5,369	30,768	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	4,000	3,593	20,592	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	4,350	4,382	25,113	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	4,300	4,359	24,982	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	2,000	2,024	11,598	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	1,700	2,109	12,087	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	5,000	5,453	31,247	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,200	3,239	18,562	2042/11/13
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	3,400	3,560	20,402	2023/12/7
小	計					376,405	
ブラジル			千レアル	千レアル			
	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	—	830	742	26,220	2018/1/1
		LETRA TESOURO NACIONAL	—	2,140	1,821	64,304	2018/7/1
		LETRA TESOURO NACIONAL	—	400	331	11,717	2018/10/1
		LETRA TESOURO NACIONAL	—	1,950	1,574	55,579	2019/1/1
		LETRA TESOURO NACIONAL	—	2,310	1,765	62,348	2019/7/1
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	10.0	256	2,576	90,966	2021/1/1
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	10.0	50	492	17,402	2023/1/1
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	10.0	251	2,432	85,901	2025/1/1
小	計					414,442	
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	3,820,000	3,973,965	156,176	2021/4/14
		REPUBLIC OF COLOMBIA	9.85	2,750,000	3,224,375	126,717	2027/6/28
小	計					282,894	
ペルー			千ヌエボソル	千ヌエボソル			
	国債証券	BONOS DE TESORERIA	5.7	600	593	20,590	2024/8/12
		PERU BONO SOBERANO	7.84	480	521	18,081	2020/8/12
		PERU BONO SOBERANO	6.95	500	513	17,803	2031/8/12
		PERU BONO SOBERANO	6.9	620	621	21,559	2037/8/12
小	計					78,035	
南アフリカ			千ランド	千ランド			
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	2,980	2,904	24,483	2020/1/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	3,340	3,150	26,561	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	3,300	3,155	26,596	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	5,800	6,377	53,758	2026/12/21	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	6,000	5,380	45,359	2030/1/31	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	6,160	5,015	42,280	2031/2/28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.875	1,000	937	7,899	2035/2/28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	3,700	2,630	22,175	2036/3/31	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	4,700	4,205	35,448	2037/1/31	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	6,450	4,578	38,597	2041/2/28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	5,900	5,376	45,321	2048/2/28	
小 計						368,482		
合 計						3,865,805		

\* 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(11,846,955千口)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
			千円	%
日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	868	945	449,820	1.9
MCUBS Mid City投資法人 投資証券	477	519	178,017	0.8
森ヒルズリート投資法人 投資証券	3,137	3,413	527,649	2.3
産業ファンド投資法人 投資証券	632	687	370,293	1.6
大和ハウスリート投資法人 投資証券	628	—	—	—
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	2,330	2,632	770,123	3.3
ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	626	680	201,960	0.9
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,075	1,288	678,776	2.9
GLP投資法人 投資証券	4,648	5,562	711,936	3.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	920	1,001	244,544	1.0
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	3,301	3,710	854,042	3.7
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	147	319	191,719	0.8
SIA不動産投資法人 投資証券	135	185	70,670	0.3
イオンリート投資法人 投資証券	2,347	2,553	320,401	1.4
ヒューリックリート投資法人 投資証券	1,715	2,037	376,641	1.6
日本リート投資法人 投資証券	702	764	215,066	0.9
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	1,440	1,590	149,778	0.6
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	134	145	25,447	0.1
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	1,594	1,743	253,257	1.1
トーセイ・リート投資法人 投資証券	289	357	38,841	0.2
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	757	824	210,202	0.9
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	216	235	24,416	0.1
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	293	552	46,809	0.2
ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	152	165	23,133	0.1
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	6,670	8,154	1,413,088	6.0
いちごホテルリート投資法人 投資証券	248	502	63,603	0.3
ラサールロジポート投資法人 投資証券	1,971	2,144	228,336	1.0
スターアジア不動産投資法人 投資証券	618	672	63,907	0.3
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	—	177	14,230	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	—	437	141,806	0.6
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	—	343	28,263	0.1
さくら総合リート投資法人 投資証券	—	649	50,297	0.2
投資法人みらい 投資証券	—	512	86,323	0.4
日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,530	2,752	1,753,024	7.5
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	2,346	2,552	1,625,624	6.9
日本リートファンド投資法人 投資証券	4,574	4,975	1,153,205	4.9
オリックス不動産投資法人 投資証券	4,339	4,921	892,177	3.8
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,565	1,702	787,175	3.4
プレミア投資法人 投資証券	2,360	2,567	341,154	1.5
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,752	1,906	271,033	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	347	378	159,705	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	5,271	5,932	1,028,608	4.4
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,366	2,573	462,625	2.0
インヴァンシブル投資法人 投資証券	6,588	7,165	393,358	1.7

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
フロンティア不動産投資法人 投資証券	889	967	479,632	2.0
平和不動産リート投資法人 投資証券	1,819	1,978	159,624	0.7
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,577	1,715	399,423	1.7
福岡リート投資法人 投資証券	1,339	1,456	255,964	1.1
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	726	789	512,850	2.2
積水ハウス・S1レジデンシャル投資法人 投資証券	1,825	2,155	261,832	1.1
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	2,736	2,987	222,232	0.9
大和証券オフィス投資法人 投資証券	867	971	557,354	2.4
阪急リート投資法人 投資証券	1,071	1,165	170,905	0.7
スターツプロシード投資法人 投資証券	311	501	75,350	0.3
トップリート投資法人 投資証券	315	—	—	—
大和ハウスリート投資法人 投資証券	1,340	2,962	837,061	3.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	5,953	7,333	589,573	2.5
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	2,939	3,197	247,767	1.1
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	2,266	2,545	360,881	1.5
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	98,081 54	113,640 57	23,021,545 < 98.4% >

\*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 375	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(8,550,103千口)の内容です。

## 外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率
	口 数	口 数	評 価 額		
			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	10,900	12,100	389	45,894	0.2
AGREE REALTY CORP	3,700	3,700	165	19,513	0.1
ALEXANDERS INC	580	530	228	26,953	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,300	11,740	1,280	150,683	0.8
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,100	6,100	260	30,669	0.2
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	20,000	19,360	930	109,577	0.6
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	27,300	32,100	649	76,483	0.4
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	24,100	23,300	1,024	120,604	0.7
APPLE HOSPITALITY REIT INC	24,200	22,700	446	52,536	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,800	4,800	68	8,102	0.0
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	3,595	3,200	45	5,349	0.0
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,100	12,100	92	10,896	0.1
AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,050	20,400	3,527	415,289	2.2
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2,700	2,700	35	4,233	0.0
BOSTON PROPERTIES	23,600	22,760	2,835	333,814	1.8
BRANDYWINE REALTY TRUST	27,200	26,600	421	49,631	0.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	31,600	38,500	942	110,994	0.6
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	23,500	25,900	304	35,825	0.2
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,400	12,990	1,057	124,460	0.7
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	12,800	12,800	306	36,027	0.2
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	8,500	9,000	136	16,019	0.1
CEDAR REALTY TRUST INC	12,000	12,000	75	8,942	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	5,900	5,900	123	14,502	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	9,200	9,200	241	28,429	0.2
CITY OFFICE REIT INC	3,300	3,300	41	4,937	0.0
COLONY STARWOOD HOMES	5,900	7,500	215	25,321	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,300	18,500	389	45,821	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,000	2,000	45	5,363	0.0
CORESITE REALTY CORP	4,700	5,060	394	46,437	0.3
CORECIVIC INC	—	17,900	422	49,708	0.3
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14,600	14,300	441	51,966	0.3
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	18,000	—	—	—	—
COUSINS PROPERTIES INC	30,400	51,400	427	50,282	0.3
CUBESMART	27,100	26,500	689	81,109	0.4
CYRUSONE INC	10,700	11,200	500	58,895	0.3
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	13,600	13,700	643	75,767	0.4
DDR CORP	47,500	45,300	676	79,617	0.4
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	30,800	28,900	330	38,920	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	22,600	23,470	2,237	263,358	1.4
DOUGLAS EMMETT INC	21,600	21,300	769	90,643	0.5
DUKE REALTY CORP	53,200	52,200	1,356	159,708	0.9

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	%
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	11,400	11,100	477	56,253	0.3
EPR PROPERTIES	9,700	9,340	658	77,504	0.4
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	3,100	3,100	60	7,090	0.0
EASTGROUP PROPERTIES	4,900	4,890	356	41,970	0.2
EDUCATION REALTY TRUST INC	10,200	10,600	431	50,811	0.3
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	18,600	18,000	360	42,421	0.2
EQUITY COMMONWEALTH	19,400	18,300	550	64,822	0.4
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,300	11,890	835	98,384	0.5
EQUITY ONE INC	14,100	13,500	402	47,406	0.3
EQUITY RESIDENTIAL	56,100	54,280	3,444	405,499	2.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,050	9,680	2,202	259,334	1.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	19,200	18,730	1,378	162,236	0.9
FARMLAND PARTNERS INC	1,800	1,800	19	2,320	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,900	10,620	1,484	174,776	0.9
FELCOR LODGING TRUST INC	20,100	20,100	161	18,953	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	18,000	17,600	486	57,328	0.3
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	8,400	8,400	88	10,442	0.1
FOREST CITY REALTY TRUST- A	33,500	31,700	640	75,418	0.4
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8,526	9,100	178	21,028	0.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	14,100	15,800	199	23,472	0.1
GEO GROUP INC/THE	11,400	11,000	380	44,778	0.2
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	29,100	28,600	858	101,104	0.5
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	89,400	86,400	2,192	258,140	1.4
GETTY REALTY CORP	3,921	3,921	97	11,530	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,600	3,600	69	8,132	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	26,500	25,200	194	22,842	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	11,000	11,000	206	24,331	0.1
GRAMERCY PROPERTY TRUST	64,900	61,600	550	64,828	0.4
HCP INC	71,900	69,000	2,026	238,563	1.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	16,000	17,500	514	60,546	0.3
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	21,000	20,900	591	69,627	0.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6,900	5,900	126	14,884	0.1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14,900	14,730	742	87,394	0.5
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	23,300	24,300	745	87,734	0.5
HOST HOTELS & RESORTS INC	115,400	109,600	2,101	247,333	1.3
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	13,700	18,200	621	73,187	0.4
ISTAR INC	—	11,400	141	16,654	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,285	9,000	78	9,270	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	19,800	18,300	126	14,907	0.1
IRON MOUNTAIN INC	36,800	36,400	1,173	138,148	0.7
KILROY REALTY CORP	14,200	13,690	1,026	120,869	0.7
KIMCO REALTY CORP	64,300	62,900	1,591	187,410	1.0
KITE REALTY GROUP TRUST	12,700	12,700	297	35,043	0.2
LTC PROPERTIES INC	5,800	5,600	257	30,278	0.2
LASALLE HOTEL PROPERTIES	17,600	17,100	519	61,135	0.3
LEXINGTON REALTY TRUST	32,700	31,100	333	39,246	0.2
LIBERTY PROPERTY TRUST	22,500	21,800	853	100,470	0.5

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	%
LIFE STORAGE INC	—	6,770	557	65,637	0.4
MACERICH CO /THE	19,400	17,950	1,231	144,914	0.8
MACK-CALI REALTY CORP	13,600	13,600	385	45,324	0.2
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	—	3,100	34	4,039	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	36,600	47,200	569	67,065	0.4
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,600	16,810	1,585	186,667	1.0
MONMOUTH REIT-CLASS A	10,100	10,100	148	17,525	0.1
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	25,600	25,600	270	31,793	0.2
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,300	5,900	428	50,445	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,200	21,700	931	109,640	0.6
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,500	5,300	113	13,345	0.1
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,200	12,500	124	14,611	0.1
NEW YORK REIT INC	25,000	25,000	249	29,341	0.2
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3,000	3,000	64	7,610	0.0
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	28,110	27,200	418	49,278	0.3
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	9,500	7,600	93	10,968	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	25,500	28,700	867	102,133	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,100	2,100	51	6,093	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,000	2,900	327	38,607	0.2
PARKWAY INC	—	6,473	132	15,598	0.1
PARKWAY PROPERTIES INC	12,800	—	—	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	11,000	11,000	331	39,015	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10,500	10,500	202	23,868	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	20,400	20,100	371	43,750	0.2
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,600	21,100	426	50,224	0.3
POST PROPERTIES INC	8,200	—	—	—	—
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	3,500	3,500	48	5,702	0.0
PROLOGIS INC	80,800	78,330	4,065	478,570	2.6
PUBLIC STORAGE	22,650	22,050	4,743	558,418	3.0
QTS REALTY TRUST INC CL A	7,200	6,940	336	39,566	0.2
QUALITY CARE PROPERTIES	—	13,400	206	24,355	0.1
RLJ LODGING TRUST	19,500	18,700	457	53,823	0.3
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	12,200	12,200	199	23,481	0.1
REALTY INCOME CORP	39,500	38,190	2,147	252,839	1.4
REGENCY CENTERS CORP	15,000	15,530	1,040	122,525	0.7
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	15,400	15,900	328	38,726	0.2
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	36,400	34,700	523	61,640	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	10,200	10,200	235	27,725	0.1
ROUSE PROPERTIES INC	5,600	—	—	—	—
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,800	7,430	468	55,191	0.3
SL GREEN REALTY CORP	15,400	14,950	1,608	189,384	1.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	10,200	9,300	216	25,432	0.1
SAUL CENTERS INC	1,700	1,700	111	13,146	0.1
SELECT INCOME REIT	9,700	9,000	217	25,660	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	36,500	34,700	617	72,670	0.4
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	2,200	3,500	161	18,973	0.1
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	5,800	5,600	95	11,187	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	%	
SIMON PROPERTY GROUP INC	47,550	46,500	8,284	975,299	5.3	
SOVRAN SELF STORAGE INC	7,100	—	—	—	—	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	73,300	72,700	769	90,546	0.5	
STAG INDUSTRIAL INC	10,600	11,700	272	32,077	0.2	
STORE CAPITAL CORP	23,400	23,200	560	65,928	0.4	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,500	13,500	211	24,934	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	9,900	9,930	738	86,970	0.5	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	33,500	32,700	511	60,205	0.3	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14,700	14,100	494	58,177	0.3	
TAUBMAN CENTERS INC	9,300	8,920	656	77,295	0.4	
TERRENO REALTY CORP	6,700	6,600	186	21,995	0.1	
TIER REIT INC	—	7,200	117	13,824	0.1	
UDR INC	41,100	39,800	1,402	165,108	0.9	
UMH PROPERTIES INC	3,600	3,600	51	6,094	0.0	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,900	1,900	120	14,231	0.1	
URBAN EDGE PROPERTIES	14,100	13,300	359	42,304	0.2	
URSTADT BIDDLE-CL A	3,900	3,900	93	10,986	0.1	
VENTAS INC	51,900	52,530	3,212	378,141	2.0	
VEREIT INC	139,300	143,600	1,203	141,660	0.8	
VORNADO REALTY TRUST	27,300	25,450	2,622	308,735	1.7	
WP CAREY INC	15,000	15,700	929	109,469	0.6	
WP GLIMCHER INC	28,400	—	—	—	—	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	—	28,400	292	34,435	0.2	
WASHINGTON REAL ESTATE INV	11,400	11,300	360	42,381	0.2	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17,700	17,400	606	71,384	0.4	
WELLTOWER INC	54,800	53,850	3,516	414,014	2.2	
WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	10,000	16	1,942	0.0	
WHITESTONE REIT	4,200	4,200	58	6,832	0.0	
WINTHROP REALTY TRUST	5,400	—	—	—	—	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,300	15,500	300	35,343	0.2	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	87,000	72	8,500	0.0	
小 計	口 数・金 額	3,110,317	3,225,484	113,782	13,394,509	
	銘柄 数 < 比 率 >	156	159	—	< 72.4% >	
(カナダ)			千カナダドル			
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN	—	1,500	15	1,371	0.0	
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	5,700	5,900	208	18,223	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	11,100	11,100	137	12,057	0.1	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,500	3,500	165	14,517	0.1	
BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	2,000	2,000	52	4,579	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,900	4,900	73	6,451	0.0	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,000	9,700	301	26,443	0.1	
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	5,600	5,000	228	19,994	0.1	
CHOICE PROPERTIES REIT	7,000	7,000	93	8,223	0.0	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	12,000	13,500	195	17,147	0.1	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	6,000	6,700	90	7,935	0.0	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	8,400	8,400	160	14,061	0.1	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	4,400	4,400	37	3,256	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 GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	8,400	7,800	73	6,415	0.0	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,400	3,300	146	12,869	0.1	
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	21,300	20,900	459	40,260	0.2	
INNVEST REAL ESTATE INVESTME	10,400	—	—	—	—	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,200	5,200	38	3,352	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,600	4,600	55	4,823	0.0	
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	6,000	5,600	105	9,237	0.0	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,700	1,700	23	2,017	0.0	
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4,300	4,300	62	5,439	0.0	
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	3,100	4,200	82	7,244	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4,700	4,700	47	4,195	0.0	
ONEREIT	6,570	6,570	23	2,054	0.0	
PLAZA RETAIL REIT	7,500	7,500	36	3,225	0.0	
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,600	17,000	93	8,190	0.0	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	24,800	23,400	614	53,787	0.3	
SLATE OFFICE REIT	—	2,100	16	1,427	0.0	
SLATE RETAIL REIT	2,300	2,300	34	2,987	0.0	
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,700	9,700	308	26,995	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	218,170	214,470	3,981	348,790	
	銘 柄 数 < 比 率 >	29	30	—	< 1.9% >	
(イギリス)			千英ポンド			
BRITISH LAND	156,800	152,200	967	140,949	0.8	
CAPITAL & REGIONAL PLC	—	64,000	34	5,032	0.0	
DERWENT LONDON PLC	17,200	16,300	443	64,557	0.3	
BIG YELLOW GROUP PLC	23,400	22,500	149	21,819	0.1	
HAMMERSON PLC	120,200	116,200	653	95,089	0.5	
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	14,200	14,200	24	3,618	0.0	
MUCKLOW < A & J > GROUP PLC	—	7,200	32	4,780	0.0	
INTU PROPERTIES PLC	124,200	135,000	371	54,116	0.3	
SHAFTESBURY PLC	42,200	40,500	361	52,603	0.3	
LAND SECURITIES GROUP PLC	123,300	119,300	1,250	182,050	1.0	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	53,400	49,900	326	47,482	0.3	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	78,700	78,700	44	6,474	0.0	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	108,500	105,000	115	16,787	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,540	32,540	112	16,384	0.1	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	99,500	89,000	133	19,438	0.1	
SEGRO PLC	114,800	122,400	542	79,025	0.4	
WORKSPACE GROUP PLC	17,800	17,800	133	19,425	0.1	
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	193,000	193,000	73	10,645	0.1	
NEWRIVER REIT PLC	—	35,000	118	17,220	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	126,000	164,000	220	32,094	0.2	
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	67,200	67,200	71	10,469	0.1	
ASSURA PLC	254,700	254,700	143	20,842	0.1	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	91,000	91,000	98	14,376	0.1	
REGIONAL REIT LTD	26,000	26,000	27	4,069	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,884,640	2,013,640	6,451	939,358	
	銘 柄 数 < 比 率 >	21	24	—	< 5.1% >	

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…ドイツ)		口	口	千ユーロ	千円	%
HAMBORNER REIT AG		9,826	12,100	107	13,205	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		16,300	15,100	175	21,586	0.1
小 計		口 数 ・ 金 額	26,126	27,200	283	34,791
		銘柄 数 < 比 率 >	2	2	-	< 0.2% >
(ユーロ…イタリア)						
BENI STABILI SPA		162,000	135,000	71	8,808	0.0
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		53,604	53,604	38	4,718	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	215,604	188,604	110	13,526
		銘柄 数 < 比 率 >	2	2	-	< 0.1% >
(ユーロ…フランス)						
AFFINE		900	-	-	-	-
ICADE		5,540	6,580	437	53,716	0.3
ALTAREA		355	355	65	8,062	0.0
KLEPIERRE		28,856	30,900	1,140	139,991	0.8
GECINA SA		5,580	5,980	766	94,075	0.5
FONCIERE DES REGIONS		6,800	7,410	604	74,209	0.4
ANF IMMOBILIER		1,300	-	-	-	-
MERCIALYS		2,580	8,380	157	19,278	0.1
UNIBAIL RODAMCO-NA		15,060	14,750	3,274	401,977	2.2
FONCIERE DES MURS		1,300	-	-	-	-
小 計		口 数 ・ 金 額	68,271	74,355	6,445	791,310
		銘柄 数 < 比 率 >	10	7	-	< 4.3% >
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPRTI-CVA		7,530	7,000	252	31,012	0.2
VASTNED RETAIL NV		2,820	2,820	100	12,327	0.1
WERELDHAVE NV		6,160	6,000	250	30,744	0.2
NSI NV		20,070	19,000	68	8,455	0.0
小 計		口 数 ・ 金 額	36,580	34,820	672	82,539
		銘柄 数 < 比 率 >	4	4	-	< 0.4% >
(ユーロ…スペイン)						
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		9,530	14,210	100	12,305	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		-	15,300	174	21,411	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		47,055	69,500	717	88,048	0.5
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		8,860	8,300	111	13,673	0.1
小 計		口 数 ・ 金 額	65,445	107,310	1,103	135,439
		銘柄 数 < 比 率 >	3	4	-	< 0.7% >
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO S. C. A.		3,200	3,455	179	22,084	0.1
COFINIMMO		3,110	3,050	322	39,613	0.2
RETAIL ESTATES		870	870	63	7,796	0.0
WERELDHAVE BELGIUM		290	290	29	3,599	0.0
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES		1,140	1,900	44	5,461	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA		2,070	2,300	191	23,465	0.1
MONTEA SCA		-	940	41	5,077	0.0
AEDIFICA		2,238	1,980	137	16,900	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)						
XIOR STUDENT HOUSING NV		500	500	千ユーロ 17	千円 2,089	% 0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	13,418	15,285	1,027	126,087	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	9	—	< 0.7% >	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		100,509	100,509	134	16,545	0.1
HIBERNIA REIT PLC		108,000	99,000	118	14,583	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		52,800	52,800	61	7,583	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	261,309	252,309	315	38,713	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.2% >	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	686,753	699,883	9,957	1,222,408	
	銘 柄 数 < 比 率 >	32	31	—	< 6.6% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		344,500	331,000	16,550	251,063	1.4
PROSPERITY REIT		180,000	180,000	545	8,273	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		160,000	160,000	652	9,902	0.1
CHAMPION REIT		339,000	301,000	1,261	19,132	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT		150,000	140,000	617	9,365	0.1
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT		120,000	120,000	241	3,659	0.0
FORTUNE REIT		210,000	211,000	1,818	27,591	0.1
NEW CENTURY REIT		65,000	—	—	—	—
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN		124,000	124,000	390	5,925	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,692,500	1,567,000	22,077	334,914	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	8	—	< 1.8% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		412,300	405,000	765	62,368	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		343,600	345,000	786	64,092	0.3
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		309,300	310,000	460	37,509	0.2
SUNTEC REIT		381,300	370,000	612	49,894	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		230,900	230,900	232	18,907	0.1
STARHILL GLOBAL REIT		209,900	209,900	155	12,655	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST		124,000	130,000	148	12,075	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		85,000	85,000	106	8,657	0.0
KEPPEL REIT		274,000	252,000	254	20,738	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		90,100	79,000	149	12,197	0.1
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST		153,300	153,300	81	6,620	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		110,400	91,000	120	9,787	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST		110,000	110,000	148	12,099	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		83,500	83,500	104	8,538	0.0
PARKWAY LIFE REAL ESTATE		59,000	59,000	139	11,393	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST		282,800	282,800	103	8,410	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		177,000	180,000	291	23,759	0.1
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		212,500	273,025	380	31,033	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST		127,000	127,000	104	8,485	0.0
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT		89,400	89,400	115	9,396	0.1
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		94,200	94,200	41	3,377	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM		271,900	271,900	254	20,714	0.1
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		129,000	129,000	89	7,252	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	
(シンガポール)		口	口	千シンガポールドル	千円	%
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	140,000	140,000	82	6,730	0.0	
SPH REIT	120,500	120,500	113	9,278	0.1	
QUE HOSPITALITY TRUST	155,743	160,043	104	8,476	0.0	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	97,000	106,700	68	5,564	0.0	
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	79,650	79,650	54	4,445	0.0	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	88,000	—	—	—	—	
KEPPEL DC REIT	145,000	119,756	144	11,758	0.1	
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	—	158,000	146	11,908	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	5,186,293	5,245,574	6,358	518,126	
	銘柄 数 < 比 率 >	30	30	—	<2.8%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
BWP TRUST	73,000	73,000	217	18,545	0.1	
MIRVAC GROUP	555,000	546,000	1,157	98,678	0.5	
INVESTA OFFICE FUND	94,000	94,000	438	37,342	0.2	
CROMWELL PROPERTY GROUP	204,000	204,000	198	16,956	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT	53,000	48,000	204	17,431	0.1	
ASPEN GROUP	13,000	13,000	13	1,163	0.0	
GPT GROUP	277,000	266,000	1,330	113,382	0.6	
ABACUS PROPERTY GROUP	45,000	45,000	134	11,470	0.1	
ALE PROPERTY GROUP	26,000	26,000	110	9,442	0.1	
STOCKLAND TRUST GROUP	364,000	355,000	1,608	137,094	0.7	
DEXUS PROPERTY GROUP	146,000	142,600	1,368	116,703	0.6	
GOODMAN GROUP	243,000	234,300	1,651	140,817	0.8	
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	7,000	7,000	46	3,932	0.0	
360 CAPITAL GROUP LTD	42,450	42,450	35	3,057	0.0	
CHARTER HALL GROUP	53,000	63,000	296	25,242	0.1	
GALILEO JAPAN TRUST	18,170	—	—	—	—	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26,550	26,550	87	7,446	0.0	
GENERATION HEALTHCARE REIT	—	22,000	37	3,235	0.0	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	22,285	22,000	60	5,157	0.0	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	109,100	109,100	241	20,554	0.1	
ARENA REIT	35,220	35,220	64	5,494	0.0	
CHARTER HALL LONG WALE REIT	—	25,000	99	8,482	0.0	
INDUSTRIA REIT	18,400	23,000	48	4,137	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	44,860	71,018	106	9,081	0.0	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	22,680	22,680	62	5,297	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	70,300	70,300	69	5,933	0.0	
360 CAPITAL OFFICE FUND	11,100	11,100	23	2,034	0.0	
SCENTRE GROUP	819,000	788,000	3,490	297,594	1.6	
WESTFIELD CORP	294,800	281,700	2,597	221,417	1.2	
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	33,250	33,250	82	7,001	0.0	
VICINITY CENTRES	499,000	485,000	1,440	122,798	0.7	
VIVA ENERGY REIT	—	56,000	133	11,362	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	4,220,165	4,241,268	17,457	1,488,291	
	銘柄 数 < 比 率 >	29	31	—	<8.0%>	
(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	158,571	187	15,216	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	
(ニュージーランド)	口	口	千ニュージーランドドル	千円	%
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	39,300	48,033	97	7,929	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST	170,000	153,000	180	14,681	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	67,525	67,525	103	8,456	0.0
STRIDE PROPERTY LTD	58,000	—	—	—	—
ARGOSY PROPERTY LTD	119,000	110,000	109	8,900	0.0
INVESTORE PROPERTY LTD	—	32,000	43	3,539	0.0
STRIDE STAPLED GROUP	—	58,000	99	8,065	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD	190,000	188,000	253	20,639	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	802,396	815,129	1,075	87,427
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	8	—	<0.5%>
(イスラエル)			千新シェケル		
REIT 1 LTD	22,490	22,490	243	7,487	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	22,490	22,490	243	7,487
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>
合 計	口 数 ・ 金 額	17,823,724	18,044,938	—	18,341,313
	銘 柄 数 < 比 率 >	314	322	—	<99.2%>

\*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 130	百万円 —
		FTEPR	7	—

\*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。

## 〈マザーファンドの対象指数について〉

\* NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

\* 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）は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（為替ヘッジを行わない円ベースの指数）です。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）は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

\* 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・メイカーとして行為し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・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・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で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](http://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。

- \* 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。
- \* 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ものではなく、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。  
請求目論見書には、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。
- \* 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。
- \* 「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 サービスーズ 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明等を行なうものではありません。

# 国内株式マザーファンド

## 運用報告書

第15期（決算日2016年5月10日）

作成対象期間（2015年5月12日～2016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		ベンチマーク指数		株組入比率	株先物比率	純資産額
	円	騰落率	(TOPIX)	(騰落率)			
11期(2012年5月10日)	6,581	△ 8.5	765.42	△10.6	96.7	3.2	137,638
12期(2013年5月10日)	10,640	61.7	1,210.60	58.2	98.1	1.8	190,083
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

\*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

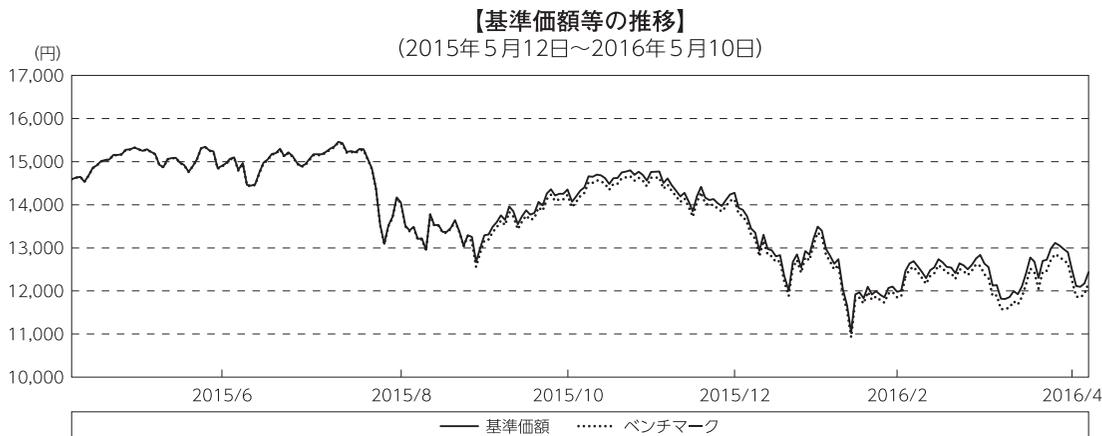
年月日	基準価額		ベンチマーク指数		株組入比率	株先物比率
	円	騰落率	(TOPIX)	(騰落率)		
(期首) 2015年5月11日	14,594	—	1,598.33	—	98.1	1.9
5月末	15,285	4.7	1,673.65	4.7	97.3	2.0
6月末	14,903	2.1	1,630.40	2.0	97.8	2.1
7月末	15,171	4.0	1,659.52	3.8	98.8	1.2
8月末	14,054	△ 3.7	1,537.05	△ 3.8	98.3	1.7
9月末	13,001	△10.9	1,411.16	△11.7	97.5	2.5
10月末	14,357	△ 1.6	1,558.20	△ 2.5	97.6	1.5
11月末	14,563	△ 0.2	1,580.25	△ 1.1	97.8	1.8
12月末	14,276	△ 2.2	1,547.30	△ 3.2	98.6	1.4
2016年1月末	13,215	△ 9.4	1,432.07	△10.4	98.0	2.0
2月末	11,978	△17.9	1,297.85	△18.8	98.2	1.8
3月末	12,553	△14.0	1,347.20	△15.7	98.1	1.7
4月末	12,489	△14.4	1,340.55	△16.1	98.1	1.8
(期末) 2016年5月10日	12,439	△14.8	1,334.90	△16.5	97.7	2.3

\*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、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14,594円から期末12,439円に2,155円の値下がりとなりました。

中国や新興国への景気減速懸念が高まったことや、原油価格下落などを背景とした世界的な株安が進行したこと、為替が円高に進行したことなどから下落しました。

### ○投資環境

期首から2015年8月中旬までは、米国の利上げに対する見方や、ギリシャの債務問題の進展状況、中国株式市場の急落などを巡り、株式市場は一進一退の展開となりました。

8月中旬以降は、中国や新興国への景気減速懸念が高まったことや、為替が円高に進行したことが企業収益への不安につながり下落しましたが、10月以降は、中国経済への懸念が後退したことや、ECB（欧州中央銀行）総裁の追加金融緩和を示唆する発言など世界的な金融緩和継続の流れ、国内企業の決算への期待などが相場を押し上げました。

12月以降は、日銀金融政策決定会合の内容が金融緩和への手詰まり感の表れと受け取られたことや、中国経済への懸念が再び高まったこと、原油価格下落などを背景とした世界的な株安が進行したこと、為替が円高に進行したことなどをを受けて、株式市場は下落しました。

2016年1月下旬には、日欧の中央銀行における金融緩和姿勢から反発に転じましたが、2月上旬には、米国経済の先行き懸念の高まりや、日銀によるマイナス金利導入の影響により金融機関の利益減少懸念が高まったことなどから再び下落しました。

## ○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。

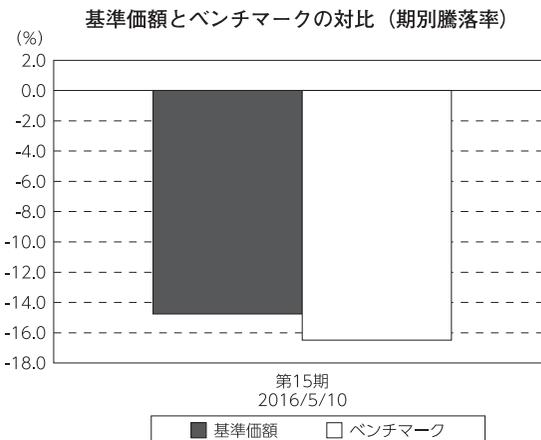
なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

## ○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-14.8%となり、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）の-16.5%を1.7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）

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

(2015年5月12日～2016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	%	(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	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	(0)	(0.002)	
期中の平均基準価額は、13,820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

(2015年5月12日～2016年5月10日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 63,159 (△ 4,994)	千円 81,654,860 ( )	千株 10,748	千円 14,893,941

\*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。

## 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 71,254	百万円 69,304	百万円 -	百万円 -

\*単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2015年5月12日～2016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	96,548,801千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	273,880,605千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.35

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2015年5月12日～2016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		
	百万円	うち利害関係人 との取引状況B 百万円	$\frac{B}{A}$ %	百万円	うち利害関係人 との取引状況D 百万円	$\frac{D}{C}$ %
株式	81,654	652	0.8	14,893	62	0.4
貸株	83,949	13,049	15.5	97,775	11,630	11.9
預金	586,031	586,031	100.0	586,031	586,031	100.0

## 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 454	百万円 168	百万円 1,208

## 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)	4,596千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	0.0%

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。

(2016年5月10日現在)

## ○組入資産の明細

## 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.1%)</b>				
極洋	52	66	17,292	
日本水産	150	178.4	112,035	
マルハニチロ	24.9	31.6	80,896	
サカタのタネ	19.6	22.9	62,906	
ホクト	13.5	15.7	33,095	
ホクリヨウ	—	1.4	1,523	
<b>鉱業 (0.3%)</b>				
住石ホールディングス	33.9	45.5	4,277	
日鉄鉱業	34	43	18,232	
三井松島産業	80	101	11,413	
国際石油開発帝石	643	815.8	673,606	
日本海洋掘削	3.7	4.6	11,251	
石油資源開発	17.4	24.5	58,800	
K&Oエナジーグループ	8.2	10.4	13,561	
<b>建設業 (3.2%)</b>				
ショーボンドホールディングス	11.8	16.2	77,841	
ミライト・ホールディングス	37.5	47.6	48,837	
タマホーム	9.1	11.6	5,150	
サンヨーホームズ	1.7	3.2	1,600	
ダイセキ環境ソリューション	1.4	3.6	4,172	
安藤・間	81.4	103.3	56,608	
東急建設	43.3	50.4	45,712	
コムシスホールディングス	54.3	66.6	118,481	
ミサワホーム	14.4	18.3	13,834	
ビーアールホールディングス	—	6.1	2,690	
高松コンストラクショングループ	9.2	11.7	28,442	
東建コーポレーション	4.6	6.4	56,832	
ソネック	—	1.7	952	
ヤマウラ	5.7	7.2	3,772	
大成建設	634	804	599,784	
大林組	366	464.4	499,230	
清水建設	373	474	465,468	
飛鳥建設	82.1	124.3	22,622	
長谷工コーポレーション	152.6	180.7	183,410	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
松井建設	13	17.1	13,423	
銭高組	17	22	10,098	
鹿島建設	536	726	506,022	
不動テトラ	92.3	109.4	14,878	
大末建設	4.7	5.9	5,068	
鉄建建設	74	94	26,038	
日鉄住金テックスエンジ	23	—	—	
西松建設	132	179	81,982	
三井住友建設	495.2	593.4	57,559	
大豊建設	33	60	28,560	
前田建設工業	81	95	79,610	
佐田建設	42	10.7	4,472	
ナカノフード建設	9.3	11.8	6,112	
奥村組	116	147	87,612	
大和小田急建設	6.6	—	—	
東鉄工業	14.7	18.6	59,613	
イチケン	13	17	4,573	
浅沼組	39	50	12,500	
戸田建設	153	180	92,520	
熊谷組	153	227	67,192	
青木あすなろ建設	8	10.1	6,797	
北野建設	25	32	8,480	
植木組	15	19	4,237	
三井ホーム	16	20	9,700	
矢作建設工業	15.1	21.1	18,757	
ビーエス三菱	12.8	18.3	7,631	
日本ハウスホールディングス	20.2	31.6	11,439	
大東建託	45.6	57	945,345	
新日本建設	14.5	18.4	9,384	
N I P P O	28	36	66,024	
東亜道路工業	23	29	10,672	
前田道路	38	48	97,248	
日本道路	36	46	22,632	
東亜建設工業	91	135	23,085	
若築建設	70	89	13,350	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東洋建設	36.6	48.6	23,473
五洋建設	135.4	171.8	86,243
大林道路	14	18.1	13,719
世紀東急工業	17.8	24.3	11,542
福田組	18	25	32,750
住友林業	90	106.6	134,849
日本基礎技術	14.6	17.2	7,206
日成ビルド工業	34	43	18,662
ヤマダ・エスバイエルホーム	55	79	7,189
巴コーポレーション	15.2	19.2	6,720
パナホーム	46	58	50,518
大和ハウス工業	357.4	457.5	1,387,597
ライト工業	19.6	29.8	34,657
積水ハウス	379.7	517.7	997,090
日特建設	16.3	17	7,106
北陸電気工事	6	7.5	6,390
ユアテック	19	24	19,008
西部電気工業	10	13	5,681
四電工	10	12	4,884
中電工	17.6	22.4	49,750
関電工	56	62	54,560
きんでん	81	93.6	123,084
東京エネシス	14	18	19,476
トーエネック	17	22	13,090
住友電設	9.6	12.2	17,385
日本電設工業	19.9	25.2	50,349
協和エクシオ	51.8	60.7	88,015
新日本空調	10.3	13	13,338
NDS	20	24	7,008
九電工	22	28.3	91,975
三機工業	24.8	34.3	30,595
日揮	123	156	288,912
中外炉工業	37	47	9,306
ヤマト	11	13.9	6,588
太平電業	17	23	21,574
高砂熱学工業	33.6	46.2	63,432
三晃金属工業	12	15	4,560
朝日工業社	14	18	7,956
明星工業	20.1	28	14,028
大気社	17.4	18.9	46,853

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ダイダシ	16	21	16,191
日比谷総合設備	15.7	18.6	29,536
東芝プラントシステム	19.8	25.1	34,512
OSJBホールディングス	16.6	31.5	8,158
東洋エンジニアリング	59	83	24,402
千代田化工建設	88	112	92,624
新興ブランテック	25.1	31.8	27,538
<b>食料品 (5.2%)</b>			
日本製粉	75	99	84,645
日清製粉グループ本社	133.8	169.8	314,809
日東富士製粉	10	12	4,008
昭和産業	50	64	32,000
鳥越製粉	9.7	12.3	7,810
中部飼料	11.7	14.3	12,169
フィード・ワン	73.4	93.2	11,556
東洋精糖	18	23	2,438
日本甜菜製糖	62	79	14,931
三井製糖	48	61	31,415
塩水港精糖	13	16.5	4,339
日新製糖	—	6.6	9,154
森永製菓	110	140	76,580
中村屋	28	36	16,452
江崎グリコ	28.2	35.8	202,270
名糖産業	5.4	6.8	9,078
不二家	70	89	17,088
山崎製パン	89	113	308,264
第一屋製パン	16	24	2,616
モロゾフ	19	24	10,272
亀田製菓	6.8	8.6	38,313
寿スピリッツ	2.9	11	25,410
カルビー	45.2	57.4	245,098
森永乳業	109	139	85,346
六甲バター	5.4	6.9	13,427
ヤクルト本社	65.4	83	432,430
明治ホールディングス	36.1	91.7	810,628
雪印メグミルク	28.7	36.4	102,320
プリマハム	68	98	29,792
日本ハム	90	114	299,706
伊藤ハム	67	—	—
林兼産業	39	50	4,850

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丸大食品	63	80	36,800
米久	3.9	—	—
S Foods	7.6	9.7	28,071
伊藤ハム米久ホールディングス	—	92.5	78,347
サッポロホールディングス	200	237	144,333
アサヒグループホールディングス	245.3	290.5	1,039,118
キリンホールディングス	494.6	627.6	1,119,638
宝ホールディングス	95.7	112.1	108,064
オエノンホールディングス	31	42	9,240
養命酒製造	8	4.8	9,254
コカ・コーラウエスト	41.3	52.5	168,000
コカ・コーライーストジャパン	37.1	54.8	117,436
サントリー食品インターナショナル	73.2	106.1	564,452
ダイドードリンコ	6.2	7.8	43,680
伊藤園	36.2	45.9	162,256
キーコーヒー	10.7	13.6	25,486
ユニカフェ	3.3	4.2	3,767
ジャパンフーズ	1.6	2	2,410
日清オイリオグループ	59	82	38,950
不二製油グループ本社	32.6	41.3	85,408
かどや製油	1.2	1.5	4,182
J-オイルミルズ	51	65	22,945
キッコーマン	100	117	425,295
味の素	281	325.7	848,774
キュービー	62.1	78.8	234,036
ハウス食品グループ本社	45.2	52.9	113,311
カゴメ	47.2	55.6	137,220
焼津水産化学工業	5.7	7.3	7,278
アリアケジャパン	11.1	12.7	80,899
ピエトロ	—	1.4	2,716
エバラ食品工業	2	3.7	7,263
ニチレイ	130	165	163,020
東洋水産	63.8	76.1	308,205
イートアンド	1.3	1.7	3,626
日清食品ホールディングス	51.6	65.5	347,150
永谷園ホールディングス	12	15	16,575
一正蒲鉾	4.2	5.4	5,470
フジッコ	12	15	36,105
ロック・フィールド	6.3	16.1	27,241
日本たばこ産業	676.5	915.5	4,204,891

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ケンコーマヨネーズ	4	5	11,650
わらべや日洋	7.2	8.3	17,413
なとり	5.6	7.7	13,151
北の達人コーポレーション	—	2.8	1,422
ユーグレナ	40.8	49.6	77,326
ミヨシ油脂	42	53	6,890
理研ビタミン	3.6	4.6	19,527
<b>繊維製品 (0.7%)</b>			
片倉工業	14.3	18.1	21,792
グンゼ	92	117	36,036
東洋紡	452	573	106,578
ユニチカ	332	421	22,734
富士紡ホールディングス	55	70	15,750
日清紡ホールディングス	73	—	—
倉敷紡績	117	148	28,860
シキボウ	66	88	9,504
日本毛織	36	44.5	33,953
大東紡織	17	21	1,323
トーア紡コーポレーション	51	6.1	2,958
ダイドーリミテッド	12.8	16.2	7,549
帝国繊維	11.9	15.1	22,755
帝人	466	592	217,264
東レ	883	1,050	962,640
サカイオーベックス	30	38	6,460
住江織物	29	36	9,612
日本フェルト	6	7.7	3,418
イチカワ	8	10	2,750
日本バイリーン	16	—	—
日東製網	13	16	2,208
芦森工業	25	31	4,898
アツギ	95	111	12,543
ダイニック	22	27	4,050
セーレン	28.4	36.1	39,710
東海染工	16	20	2,660
小松精練	19	22.2	13,786
ワコールホールディングス	68	86	102,770
ホギメディカル	7.2	9.1	56,784
レナウン	27.4	39.1	4,692
クラウディア	2.9	3.3	1,716
T S I ホールディングス	50.9	64.6	44,832

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三陽商会	60	81	20,331
ナイガイ	42	53	2,544
オンワードホールディングス	82	94	71,440
ルック	19	26	4,108
キムラタン	508	610	4,270
ゴールドウイン	26	6.1	26,474
デサント	26	33	47,586
キング	5.7	7.2	2,671
ヤマトインターナショナル	7.4	8.9	3,488
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>			
特種東海製紙	66	84	29,988
王子ホールディングス	468	594	258,984
日本製紙	55	74.8	157,678
三菱製紙	174	221	17,901
北越紀州製紙	70.8	89.8	60,525
中越パルプ工業	43	57	11,742
巴川製紙所	18	22	4,268
大王製紙	51	64.1	72,368
レンゴー	101	128	73,984
トーモク	36	46	13,570
ザ・バック	8.1	10.2	26,662
<b>化学 (6.2%)</b>			
クラレ	194.2	228.4	324,784
旭化成	712	903	681,223
共和レザー	7.5	9.5	7,809
コープケミカル	17	—	—
昭和電工	760	964	106,040
住友化学	840	1,066	524,472
日本化成	21	27	2,997
住友精化	24	30	15,900
日産化学工業	74.8	87	256,824
ラサ工業	43	55	5,885
クレハ	80	109	40,875
多木化学	7	9	5,688
テイカ	19	24	11,880
石原産業	191	260	19,240
片倉コープアグリ	7	17	3,672
日東エフシー	—	8.5	7,718
日本曹達	73	94	54,520
東ソー	285	391	199,410

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トクヤマ	177	240	42,000
セントラル硝子	116	157	99,852
東亜合成	143	90.6	91,777
大阪ソーダ	45	62	25,606
関東電化工業	27	35	27,090
デンカ	236	300	137,400
信越化学工業	204.6	259.6	1,613,414
日本カーバイド工業	39	49	7,987
堺化学工業	46	59	18,408
エア・ウォーター	101	119	193,851
大陽日酸	146.5	111.5	112,615
日本化学工業	42	54	11,772
日本パーカライジング	53.8	74	72,372
高压ガス工業	17	21	13,356
チタン工業	13	17	3,213
四国化成工業	16	21	17,850
戸田工業	23	29	8,903
ステラ ケミファ	5.8	7.4	21,837
保土谷化学工業	34	43	9,933
日本触媒	90	21	110,040
大日精化工業	47	56	25,760
カネカ	154	195	177,840
三菱瓦斯化学	196	249	144,420
三井化学	519	614	227,794
J S R	112.7	135.8	210,354
東京応化工業	23.6	29	89,320
大阪有機化学工業	8.1	10.3	6,695
三菱ケミカルホールディングス	713.3	969.6	554,611
日本合成化学工業	27	34	22,712
ダイセル	160.5	203.6	270,788
住友ベークライト	107	135	59,535
積水化学工業	264	328.6	452,153
日本ゼオン	98	122	96,868
アイカ工業	34.3	43.5	106,879
宇部興産	575	775	168,175
積水樹脂	17.6	22.3	34,386
タキロン	24	34	18,768
旭有機材	40	47	9,494
日立化成	56.4	71.5	140,855
ニチバン	11	14	8,988

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リケンテクノス	18.4	31.2	13,572
大倉工業	27	35	9,905
積水化成成品工業	32	37	13,172
群栄化学工業	30	39	11,622
タイガースポリマー	5.6	7.1	4,331
ミライアル	4.1	5.2	3,858
ダイキアクシス	1.7	2.7	2,370
ダイキョーニシカワ	3.7	18.6	27,602
日本化薬	74	94	110,356
カーリットホールディングス	9.1	13.4	6,525
日本精化	9.4	12	9,156
扶桑化学工業	—	9.1	15,451
ADEKA	52.6	71.2	109,078
日油	93	109	98,754
新日本理化	18	22.8	4,218
ハリマ化成グループ	9.7	12.3	6,605
花王	306.8	389.3	2,375,508
第一工業製薬	25	32	10,752
ニイタカ	—	2.1	2,944
三洋化成工業	36	45	37,665
大日本塗料	65	83	16,268
日本ペイントホールディングス	98.7	111.7	304,605
関西ペイント	138	163.8	324,651
神東塗料	8	11	1,837
中国塗料	33	41	28,618
日本特殊塗料	8.8	10.1	8,746
藤倉化成	15.5	19.7	9,712
太陽ホールディングス	9.3	10.6	36,411
D I C	457	572	144,144
サカタインクス	23.3	29.6	36,733
東洋インキＳＣホールディングス	113	143	62,348
T&K TOKA	3.8	10.5	9,250
富士フイルムホールディングス	261.1	331.3	1,520,335
資生堂	202.9	274.7	671,778
ライオン	132	167	258,516
高砂香料工業	37	9.5	24,795
マンダム	11.4	13.5	68,310
ミルボン	6.7	8.5	41,012
ファンケル	26.5	33.6	51,508
コーセー	18.4	23.4	210,600

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コタ	3.9	4.9	5,355
シーズ・ホールディングス	7.7	18.2	39,730
シーボン	1.3	1.6	3,734
ポーラ・オルビスホールディングス	13.6	14.7	137,004
ノエビアホールディングス	7.2	9.1	28,255
アジュバンコスメジャパン	2.1	2.7	2,624
エステー	7.8	9.9	11,563
アグロ カネショウ	3.1	5.6	5,717
コニシ	8.9	22.7	32,143
長谷川香料	14.4	18.3	33,525
星光PMC	6.2	7.9	9,456
小林製薬	18.7	21.9	193,158
荒川化学工業	9.6	12.3	11,783
メック	8.8	11.2	8,668
日本高純度化学	3.2	4.1	8,355
タカラバイオ	—	31	44,175
J C U	3.1	4.2	14,637
新田ゼラチン	6.8	9.5	6,982
OATアグリオ	—	1.7	2,548
デクセリアルズ	—	43.3	38,147
アース製薬	8.2	10.4	50,752
イハラケミカル工業	17.5	22.3	31,286
北興化学工業	12	15	4,830
大成ラミック	3.2	4.1	11,164
クミアイ化学工業	23.5	29.9	28,345
日本農薬	26.1	33.1	18,933
アキレス	97	118	16,402
有沢製作所	19.2	21.4	11,812
日東電工	88.2	111.9	765,396
レック	3.9	4.5	6,012
きもと	20.4	23.5	3,830
藤森工業	9.8	12.4	31,954
前澤化成工業	8	10.1	10,211
J S P	8.5	9.4	20,257
エフビコ	10.1	12.8	62,080
天馬	8.8	11.1	18,858
信越ポリマー	22.4	28.4	19,226
東リ	29	37	12,506
ニフコ	25.5	27.7	147,918
日本バルカー工業	47	56	16,072

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ユニ・チャーム	231	293.1	675,155
<b>医薬品 (5.9%)</b>			
協和発酵キリン	136	173.2	350,903
武田薬品工業	427.5	576.5	3,049,108
アステラス製薬	1,299.4	1,620.9	2,396,500
大日本住友製薬	80.7	102.5	145,345
塩野義製薬	178.1	211	1,178,224
田辺三菱製薬	132.9	168.7	335,713
わかもと製薬	13	16	4,064
あすか製薬	13.4	18.4	26,404
日本新薬	26	33.2	168,324
ピオフェルミン製薬	1.8	2.3	7,969
中外製薬	113.6	144.1	530,288
科研製薬	39	24.9	149,898
エーザイ	150.5	178.2	1,183,248
ロート製薬	51.9	70.9	133,575
小野薬品工業	51.8	328.7	1,712,527
久光製薬	32.2	44.9	245,603
有機合成薬品工業	7	9	2,268
持田製薬	7.9	9.9	80,685
参天製薬	209.7	266.6	431,892
扶桑薬品工業	38	49	12,985
日本ケミファ	14	20	9,440
ツムラ	35.9	45.6	131,601
日医工	26.7	33.8	89,603
キッセイ薬品工業	21.2	25.6	65,971
生化学工業	21.8	27.7	48,281
栄研化学	9.6	12.1	23,800
日水製薬	4.6	5.8	6,699
鳥居薬品	7.8	9.9	25,967
JCRファーマ	8.8	11.1	30,536
東和薬品	5.8	6.6	32,901
富士製薬工業	3.2	4.7	9,207
沢井製薬	18.1	24.6	178,104
ゼリア新薬工業	23.4	29.6	41,262
第一三共	383.7	486.8	1,333,345
キョーリン製薬ホールディングス	30.4	38.6	83,800
大幸薬品	5.1	7.1	10,543
ダイト	5.1	8.1	23,571
大塚ホールディングス	226.4	311.2	1,345,940

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大正製薬ホールディングス	27.4	34.8	320,856
バブチドリーム	—	24.1	160,747
<b>石油・石炭製品 (0.5%)</b>			
日本コークス工業	102.3	116.8	8,760
昭和シェル石油	102	145.6	161,616
コスモ石油	315	—	—
ニチレキ	14	17.7	13,151
東燃ゼネラル石油	172	218	217,128
ユシロ化学工業	6.1	7.8	9,695
ビービー・カストロール	4.7	5.9	7,605
富士石油	26.4	33.6	11,491
MORESCO	2.9	4.6	5,179
出光興産	54.1	75.5	170,856
JXホールディングス	1,266.1	1,713.5	767,133
コスモエネルギーホールディングス	—	43.7	59,082
<b>ゴム製品 (1.0%)</b>			
横浜ゴム	126	87.3	165,870
東洋ゴム工業	51.6	65.5	106,830
ブリヂストン	357.5	488.5	2,021,413
住友ゴム工業	89	135.5	232,653
藤倉ゴム工業	9.5	12.1	5,360
オカモト	39	45	40,995
フコク	4.8	5.3	4,626
ニッタ	11.3	15.6	42,666
住友理工	21.1	31.3	29,234
三ツ星ベルト	28	35	30,135
バンドー化学	42	53	27,613
<b>ガラス・土石製品 (0.9%)</b>			
日東紡績	84	96	32,352
旭硝子	562	764	514,936
日本板硝子	550	698	60,726
石塚硝子	15	20	3,600
日本山村硝子	45	57	9,291
日本電気硝子	219	299	154,284
オハラ	4.3	5.5	2,805
住友大阪セメント	212	287	133,168
太平洋セメント	712	903	258,258
デイ・シイ	11.7	13.4	4,743
日本ヒューム	11.9	13.9	8,214
日本コンクリート工業	19.5	29.8	8,791

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三谷セキサン	5.7	7.2	12,160
アジアバイルホールディングス	15.2	17.8	7,458
東海カーボン	99	125	36,000
日本カーボン	60	71	15,975
東洋炭素	6.3	8	11,072
ノリタケカンパニーリミテド	64	82	20,172
TOTO	168	106.3	408,192
日本碍子	144	183	438,285
日本特殊陶業	98.3	124.7	243,414
ダントーホールディングス	15	17	3,094
MARUWA	3.3	5.3	16,562
品川リフラクトリーズ	29	36	6,804
黒崎播磨	25	31	7,812
ヨータイ	6	8	2,288
イソライト工業	5.6	7.1	1,576
東京窯業	14	17.6	2,956
ニッカー	4	5.1	1,902
フジミインコーポレーテッド	11	12.7	18,923
ユーアンドユーマテリアル	24	30	2,430
ニチアス	51	74	58,756
ニチハ	15.1	19.2	31,795
<b>鉄鋼 (1.2%)</b>			
新日鐵住金	4,821	652.5	1,431,258
神戸製鋼所	1,972	2,658	271,116
中山製鋼所	85	162	10,206
合同製鐵	58	81	15,309
ジェイ エフ イー ホールディングス	290.9	395.5	579,012
日新製鋼	48.3	66	97,284
東京製鐵	57.7	79.9	50,496
共英製鋼	12.1	15.4	24,609
大和工業	26	31.9	79,431
東京鐵鋼	22	30	10,200
大阪製鐵	7.2	9.1	16,589
淀川製鋼所	79	21.5	52,954
東洋鋼板	27.3	34.6	12,213
丸一鋼管	35	48.4	158,026
モリ工業	18	23	6,877
大同特殊鋼	191	242	87,846
日本高周波鋼業	45	57	4,446
日本冶金工業	89.1	106.4	16,704

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
山陽特殊製鋼	68	86	39,388
愛知製鋼	67	85	36,465
日立金属	116	165.7	193,703
日本金属	29	37	3,626
大太平洋金属	73	101	33,532
新日本電工	69.5	81.9	13,841
栗本鐵工所	59	69	11,661
虹技	16	20	3,260
日本鑄鉄管	11	16	2,464
三菱製鋼	74	101	17,978
日亜鋼業	15.8	20	4,540
日本精線	9	10	4,530
シンニッタン	11.8	13	8,047
新家工業	22	29	3,683
<b>非鉄金属 (0.8%)</b>			
大紀アルミニウム工業所	19	22	6,006
日本軽金属ホールディングス	276.6	327.5	62,552
三井金属鉱業	310	369	70,479
東邦亜鉛	64	76	21,660
三菱マテリアル	712	903	301,602
住友金属鉱山	315	399	453,663
DOWAホールディングス	136	186	125,922
古河機械金属	178	226	36,386
大阪チタニウムテクノロジーズ	11.2	14.2	19,397
東邦チタニウム	19.3	24.5	18,007
UACJ	130	202	43,430
古河電気工業	335	455	119,210
住友電気工業	429.7	579.2	756,145
フジクラ	159	201	105,324
昭和電線ホールディングス	125	172	11,180
東京特殊電線	1.6	2	1,732
タツタ電線	21.4	30.1	10,203
神電線	12	17	3,281
カナレ電気	1.8	2.3	4,471
平河ヒューテック	2.7	6.8	5,950
リョービ	64	88	36,080
アールスティ	13.2	16.8	13,876
アサヒホールディングス	17.2	21.8	32,198
<b>金属製品 (0.7%)</b>			
稲葉製作所	6.1	7.7	10,248

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
宮地エンジニアリンググループ	33	45	7,065
トーカロ	7.5	10.2	18,727
アルファC o	3.8	4.8	4,824
SUMCO	88.8	113.3	81,122
川田テクノロジーズ	2.2	2.7	9,531
東洋製織グループホールディングス	81	102.8	221,945
ホッカンホールディングス	27	38	12,084
コロナ	6	7.6	8,360
横河ブリッジホールディングス	21.6	27.4	27,564
駒井ハルテック	20	26	6,422
高田機工	10	12	2,352
三和ホールディングス	107.3	143.6	125,650
文化シャッター	31.7	40.3	37,358
三協立山	14.9	19	28,918
アルインコ	4.8	10.8	10,681
東洋シャッター	2.8	3.6	1,951
L I X I Lグループ	169.4	201.5	434,434
日本フィルコン	8.2	10.5	4,557
ノーリツ	22.3	28.3	52,553
長府製作所	12.2	15.4	39,809
リンナイ	21.2	26.9	267,117
ダイニチ工業	5.8	7.4	4,536
日東精工	16	21	5,901
三洋工業	14	18	3,006
岡部	22.4	30	22,260
ジーテクト	10.4	15.1	20,143
中国工業	1.7	2.2	1,689
東プレ	21.9	27.8	61,076
高周波熱錬	19.7	26.9	19,583
東京製綱	77	98	14,406
サンコール	7	7.7	3,672
モリテック スチール	5.7	7.3	1,810
バイオラックス	5.8	7.3	42,340
日本発條	99.1	136.2	133,067
中央発條	15	18	5,400
アドバネクス	21	2.7	3,337
立川ブラインド工業	—	6	4,218
三益半導体工業	8.4	10.7	11,042
<b>機械 (4.7%)</b>			
日本ドライケミカル	1.6	1.8	4,087

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本製鋼所	163	239	99,663
三浦工業	50.9	64.5	129,645
タクマ	36	53	48,813
ツガミ	33	42	17,850
オークマ	74	94	76,140
東芝機械	62	79	27,334
アマダホールディングス	169.9	210.9	228,193
アイダエンジニアリング	24.9	37.9	38,013
滝澤鉄工所	36	45	5,580
富士機械製造	37.2	47.2	52,864
牧野フライス製作所	57	72	47,952
オーエスジー	51.9	65.9	127,846
ダイジェット工業	13	17	2,346
旭ダイヤモンド工業	31.2	38.9	40,806
DMG森精機	71.9	79.9	96,758
ソディック	21.7	36.7	31,488
ディスコ	13.3	18.4	176,456
日東工器	6.6	8.4	18,085
パンチ工業	4	5.7	4,138
豊和工業	6.4	8.1	4,284
OKK	44	56	6,160
東洋機械金属	7.7	10.7	4,237
津田駒工業	28	35	4,305
エンシュウ	28	35	2,520
島精機製作所	16.1	20.4	45,838
NCホールディングス	—	4.7	5,785
フリュー	—	2.8	7,596
ヤマシンフィルタ	—	2.8	1,265
日阪製作所	14.4	18.3	14,365
やまびこ	4.5	26.5	20,458
ペガサスミシン製造	10	14.9	7,941
ナプテスコ	69.4	75.2	192,662
三井海洋開発	11.4	16.9	31,146
レオン自動機	8.6	12.2	7,246
SMC	34.2	43.4	1,173,753
新川	9.5	12.9	5,650
ホソカワミクロン	19	24	13,488
ユニオンツール	5.6	6.2	17,825
オイレス工業	13.5	18.7	32,799
日精エー・エス・ビー機械	4.2	4.6	9,834

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サトーホールディングス	14.2	19.5	44,206
日本エアータック	3.4	5.1	3,182
日精樹脂工業	8.3	10.5	6,426
オカダアイヨン	—	2.8	2,321
ワイエイシイ	4.6	5.8	6,478
小松製作所	558.9	709.1	1,280,634
住友重機械工業	312	422	198,762
日立建機	50.9	64.6	111,887
日工	16	22	7,128
巴工業	4.3	5.9	8,743
井関農機	117	148	35,372
TOWA	9.3	14	10,248
丸山製作所	24	30	4,920
北川鉄工所	52	66	12,870
タカキタ	—	4.8	2,654
クボタ	548	694.5	1,143,841
荏原実業	3.4	4.3	5,486
三菱化工機	37	48	10,608
月島機械	20.1	27.4	25,893
帝国電機製作所	7.6	10.5	8,043
東京機械製作所	43	54	2,268
新東工業	26.8	32.8	30,110
澁谷工業	9.5	12.1	16,201
アイチ コーポレーション	16.1	20.5	16,666
小森コーポレーション	27.7	35.2	44,387
鶴見製作所	8.5	10.7	15,825
住友精密工業	18	23	7,544
酒井重工業	22	27	4,995
荏原製作所	236	320	156,800
石井鐵工所	17	21	3,150
西島製作所	11.1	15.4	16,170
北越工業	11.2	15.5	10,276
ダイキン工業	158.6	201.3	1,775,868
オルガノ	22	25	10,375
トーヨーカネツ	66	77	17,171
栗田工業	64.5	86.9	225,418
椿本チエイン	58	82	59,450
大同工業	22	28	5,348
日本コンベヤ	35	—	—
木村化工機	10.5	12.4	4,600

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アネスト岩田	17	23.3	24,767
ダイフク	53.8	74.3	146,742
サムコ	1.6	3.5	3,262
加藤製作所	24	33	13,596
油研工業	21	27	4,860
タダノ	53	66.7	67,700
フジテック	31.7	40.2	44,300
C K D	30.5	38.4	33,369
キトー	11.9	17.4	13,572
平和	23.6	42.8	97,840
理想科学工業	13.2	15.3	23,256
SANKYO	30.3	38.5	157,657
日本金銭機械	10	12.7	11,010
マースエンジニアリング	6.1	7.8	15,319
福島工業	6	8.5	21,666
オーイズミ	3.8	5.8	2,697
ダイコク電機	4.5	5.7	7,791
竹内製作所	4.6	27.3	46,082
アマノ	36.3	42.8	78,538
J U K I	81	20.5	21,422
サンデンホールディングス	66	84	26,964
蛇の目ミシン工業	106	13.4	7,946
マックス	17	21	26,670
グローリー	34.8	47.1	172,150
新晃工業	7.6	9.6	14,323
大和冷機工業	15.7	22.2	20,845
セガサミーホールディングス	117.1	148.5	178,051
日本ピストンリング	42	5.7	8,327
リケン	47	64	23,232
T P R	12.2	17	47,583
ツバキ・ナカシマ	—	17.1	25,051
ホシザキ電機	23.9	30.3	303,000
大豊工業	8.8	11.1	13,153
日本精工	223.7	283.9	272,260
NTN	252	343	116,963
ジェイテクト	116.1	147.3	208,282
不二越	101	128	44,672
日本トムソン	37	47.3	18,872
T H K	72.4	91.9	195,838
ユーション精機	4.8	5.4	9,925

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
前澤給装工業	4.1	5.6	7,991
イーグル工業	15.1	17.1	24,555
前澤工業	8	10.1	2,979
日本ビラー工業	11.9	14	13,160
キッツ	48.9	61.6	30,676
日立工機	29.1	37	27,232
マキタ	71	90.1	624,393
日立造船	85.2	109.6	61,266
三菱重工業	1,826	2,461	992,275
I H I	785	1,062	251,694
<b>電気機器 (11.3%)</b>			
日清紡ホールディングス	—	76.7	90,966
イビデン	71.4	84.6	111,756
コニカミノルタ	259.6	345.1	326,464
ブラザー工業	140.8	178.7	223,911
ミネベア	162	222.7	194,639
日立製作所	2,616	3,526	1,693,185
東芝	2,293	2,910	641,946
三菱電機	1,089	1,474	1,825,549
富士電機	303	416	195,936
東洋電機製造	21	27	8,532
安川電機	132.9	171.7	216,170
シンフォニアテクノロジー	76	89	13,261
明電舎	100	127	57,023
オリジン電気	16	20	5,480
山洋電気	24	36	19,980
デンヨー	9.3	12.8	15,283
東芝テック	78	99	39,699
芝浦メカトロニクス	18	22	4,774
マブチモーター	33.3	39.6	222,156
日本電産	119.4	166.3	1,360,334
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	—	1.6	3,040
東光高岳	5.5	7.7	13,552
ダブル・スコープ	—	5.5	32,725
ダイヘン	60	81	44,307
田淵電機	12.3	15.6	7,332
ヤーマン	1.4	1.8	3,756
JVCケンウッド	79.9	101.4	27,479
ミマキエンジニアリング	6.5	12.4	6,634
第一精工	4	5.7	6,663

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日新電機	25.5	32.4	38,167
大崎電気工業	20	25	19,000
オムロン	117.6	156.1	518,252
日東工業	17.5	22.1	36,907
I D E C	12.9	18	18,288
不二電機工業	1	1.3	1,856
ジーエス・ユアサ コーポレーション	210	266	119,434
サクサホールディングス	27	35	7,350
メルコホールディングス	6	7.6	16,400
テクノメディカ	2.4	3.1	6,429
日本電気	1,410	1,900	488,300
富士通	1,050	1,333	517,737
神電気工業	383	599	92,845
岩崎通信機	48	65	4,680
電気興業	31	36	17,316
サンケン電気	55	75	23,550
ナカヨ	11	13	4,095
アイホン	6.3	7.8	12,979
ルネサスエレクトロニクス	56.4	71.5	46,189
セイコーエプソン	148.7	205.8	377,437
ワコム	85.8	108.8	48,633
アルバック	18.4	25.4	85,217
アクセル	5	6.2	5,245
E I Z O	10	13.7	41,100
ジャパンディスプレイ	223.7	258.1	54,717
日本信号	30	38.1	34,937
京三製作所	26	32	11,328
能美防災	14.4	15.7	22,199
ホーチキ	7.9	10	12,660
エレコム	4.5	12	24,468
日本無線	23	40	10,600
パナソニック	1,327.5	1,579.1	1,503,934
シャープ	921	1,168	155,344
アンリツ	65.4	83	49,966
富士通ゼネラル	33	42	83,370
日立国際電気	28	31.6	37,730
ソニー	712.2	975.2	2,614,998
T D K	65.7	83.4	495,396
帝国通信工業	26	33	5,577
ミツミ電機	38.5	52.6	27,246

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タムラ製作所	42	53	16,112
アルプス電気	86	119.1	217,357
池上通信機	37	44	5,280
パイオニア	163.7	223.6	65,514
日本電波工業	9.8	12.5	9,037
鈴木	1.4	5.3	3,042
日本トリム	2.6	3.7	27,713
ローランド ディー. ジー.	4.4	6.8	14,171
フォスター電機	12.8	17.3	33,492
クラリオン	57	73	22,046
SMK	32	41	18,532
ヨコオ	8.5	9.8	4,900
東光	26	—	—
ティアック	59	99	3,960
ホシデン	33	41.9	28,324
ヒロセ電機	18.5	22.3	284,325
日本航空電子工業	31	40	53,240
TOA	11.7	16.3	15,925
日立マクセル	21.6	22.9	36,823
古野電気	12.9	16.4	9,659
ユニデンホールディングス	30	43	5,375
アルパイン	26	32.9	40,105
スミダコーポレーション	9.7	11.3	7,616
アイコム	6	7.6	15,792
リオン	4.1	5.3	8,983
本多通信工業	—	3.6	3,351
船井電機	11	14	12,684
横河電機	109	138.3	159,598
新電元工業	42	49	19,453
アズビル	35.6	45.1	124,881
東亜ディーケーケー	4.5	7.7	3,780
日本光電工業	46.4	57.8	166,521
チノー	3.9	4.9	4,968
共和電業	13.3	16.9	6,253
日本電子材料	4.7	5.5	2,387
堀場製作所	20.1	25.6	103,424
アドバンテス	74.2	94.2	100,699
小野測器	5.3	6.7	5,460
エスベック	12.1	14.3	21,450
パナソニック デバイスSUNX	9.5	12.1	6,909

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キーエンス	24.7	31.3	2,070,495
日置電機	5.7	7.2	16,999
シスメックス	84.4	107.3	773,633
日本マイクロニクス	—	25.8	24,871
メガチップス	11.4	13.8	16,297
OBARA GROUP	7.1	8.1	30,010
澤藤電機	7	7	1,211
コーセル	15.8	19.2	20,678
新日本無線	8	10.1	4,353
オブテックス	7.5	10.2	31,416
千代田インテグレ	5.7	7.3	16,315
アイ・オー・データ機器	—	4.3	2,704
レーザーテック	11.2	16.2	20,493
スタンレー電気	78.2	98.8	225,362
岩崎電気	37	47	8,930
ウシオ電機	66.1	83.9	123,333
岡谷電機産業	5.8	7.4	2,775
ヘリオス テクノ ホールディング	10	11.7	4,200
日本セラミック	6.2	7.9	15,278
遠藤照明	5	7	7,504
日本デジタル研究所	9.2	11.7	17,620
古河電池	8	10	6,750
双信電機	5.3	6.7	1,949
山一電機	12.6	12	6,480
図研	7.9	10	10,640
日本電子	46	55	25,905
カシオ計算機	109.2	138.5	270,629
ファナック	113.4	141.4	2,290,680
日本シイエムケイ	27.7	29.8	12,545
エンプラス	4.9	7	21,420
大真空	20	25	6,000
ローム	53.7	68.1	286,360
浜松ホトニクス	85	107.8	301,301
三井ハイテック	14.4	20	13,740
新光電気工業	41.1	52.2	30,693
京セラ	178.8	226.9	1,197,351
太陽誘電	57.1	67.2	70,022
村田製作所	114.3	145.756	1,877,337
ユーション	15.2	18.3	12,736
双葉電子工業	18.6	22.6	37,267

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
北陸電気工業	47	56	7,392
ニチコン	34.3	43.5	31,668
日本ケミコン	88	112	16,128
KOA	15.1	19.1	14,687
市光工業	26	33	8,151
小糸製作所	65.3	82.8	404,064
ミツバ	20	23.5	37,224
スター精密	20.7	26.2	31,806
S C R E E Nホールディングス	103	142	118,996
キャノン電子	10	12.7	20,167
キャノン	631.6	744.1	2,288,107
リコー	327.5	447.5	433,627
MUTOHホールディングス	15	16	3,712
東京エレクトロン	91.6	113.4	810,810
<b>輸送用機器 (9.4%)</b>			
トヨタ紡織	38.1	48.3	108,240
鬼怒川ゴム工業	25	32	24,672
ユニプレス	20.9	28.7	56,826
豊田自動織機	99.2	125.8	589,373
モリタホールディングス	19	24.2	33,976
三櫻工業	13.8	17.5	10,045
デンソー	269.1	341.5	1,407,663
東海理化電機製作所	28.7	40.4	77,810
三井造船	422	535	89,880
川崎重工業	791	1,076	337,864
名村造船所	30.3	41.5	32,868
サノヤスホールディングス	13.2	16.8	3,645
日本車輛製造	40	57	14,820
ニチユ三菱フォークリフト	12.5	15.9	8,299
近畿車輛	16	21	6,447
日産自動車	1,529	1,928.9	1,936,615
いすゞ自動車	344.4	400.5	465,381
トヨタ自動車	1,502.9	1,719	9,758,763
日野自動車	155.5	197.3	207,165
三菱自動車工業	399.2	548.8	265,619
エフテック	6.2	7.3	7,489
レシップホールディングス	3.6	4.5	3,217
GMB	1.6	2.2	1,647
ファルテック	1.6	2.4	3,007
武蔵精密工業	11.6	14.7	30,752

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日産車体	47.9	67.5	73,440
新明和工業	44	60	44,220
極東開発工業	20.2	27.5	28,297
日信工業	19.9	30.9	46,720
トビー工業	90	114	22,230
ティラド	42	54	9,504
曙ブレーキ工業	46	70	18,760
タチエス	17.3	21.9	32,740
NOK	52.7	66.9	122,828
フタバ産業	33.2	42.1	22,734
KYB	122	155	57,350
シロキ工業	24	—	—
大同メタル工業	15.2	19.3	15,748
プレス工業	54	73.4	28,479
ミクニ	10.4	17.5	6,177
カルソニックカンセイ	83	106	82,998
太平洋工業	22.2	30.7	33,708
ケーヒン	25	31.8	50,975
河西工業	13.4	17	19,516
アイシン精機	99.7	141.7	610,018
富士機工	12.6	16	6,464
マツダ	324.6	437.6	766,018
ダイハツ工業	130	165	244,695
今仙電機製作所	9.3	12.6	12,448
本田技研工業	980.3	1,243.8	3,787,371
スズキ	227.7	252.9	740,617
富士重工業	370.7	436.8	1,634,942
安永	3.6	4.6	2,203
ヤマハ発動機	165.7	195.2	356,044
ショーワ	25.7	35.9	28,289
T B K	13.9	16.4	6,215
エクセディ	14.8	18.8	48,616
豊田合成	35.2	50.2	102,508
愛三工業	16.9	24.2	21,247
盟和産業	9	2.3	2,362
ヨロズ	10.2	12.9	28,870
エフ・シー・シー	16	22.6	42,872
シマノ	47	55.7	927,405
タカタ	19.7	25	7,875
テイ・エス テック	23	32.1	92,319

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジャムコ	4.1	8.1	21,829
<b>精密機器 (1.6%)</b>			
テルモ	167	211.9	900,575
クリエートメディック	3.6	4.6	3,942
日機装	35.3	49.8	42,529
島津製作所	130	178	299,040
JMS	20	25	7,350
クボテック	2.3	3	1,479
モリテックス	2.4	—	—
長野計器	7	8.3	5,170
ブイ・テクノロジー	2.1	3.3	15,460
東京計器	38	44	6,908
愛知時計電機	14	18	5,598
オーバル	10.6	13.5	3,159
東京精密	19.6	26.7	62,745
マニー	3.3	18.4	31,776
ニコン	203.4	258.1	403,410
トプコン	32.9	46.4	49,091
オリンパス	162.3	205.9	859,632
理研計器	9.6	11.2	11,737
タムロン	8.4	11.1	17,449
HOYA	259.2	312.5	1,262,812
ノーリツ鋼機	9.8	12.4	7,675
ユエ・アンド・デイ	9.9	12.5	4,800
シチズンホールディングス	134.1	170.1	107,503
リズム時計工業	48	60	8,940
大研医器	7.5	10.9	9,570
メニコン	—	9.3	35,340
松風	5.3	6.7	9,132
セイコーホールディングス	77	89	36,223
ニプロ	69.6	103	112,270
<b>その他製品 (1.6%)</b>			
スノーピーク	—	1.5	5,467
パラマウントベッドホールディングス	11.5	14.6	59,568
トランザクシオン	0.8	2.8	2,032
SHO-B I	3.6	4.6	1,830
ニホンフラッシュ	—	5.4	6,264
前田工織	12	13.8	14,986
永大産業	15	20	8,480
アートネイチャー	7.8	14.8	13,660

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ダンロップスポーツ	6.9	8.7	8,830
バンダイナムコホールディングス	120.1	142.9	327,526
アイフィスジャパン	—	3.1	1,491
共立印刷	19.7	23	6,371
SHOE I	—	6.2	9,982
フランスベッドホールディングス	76	19.3	19,049
パイロットコーポレーション	9.5	24.1	118,572
萩原工業	2.3	3.8	9,906
トッパン・フォームズ	19.4	24.7	28,553
フジシールインターナショナル	13.2	16.8	62,076
タカラトミー	39.1	45.5	34,807
廣済堂	10.1	12.8	4,390
A s - m e エステール	2.9	3.7	2,305
アーク	34.4	58.1	4,938
タカノ	4.8	6.1	3,928
ブロネクス	11.1	12.9	12,345
ホクシン	8.6	11	1,463
ウッドワン	18	25	6,300
大建工業	44	54	16,740
凸版印刷	308	390	367,770
大日本印刷	332	409	420,043
図書印刷	18	26	14,066
共同印刷	34	46	14,628
日本写真印刷	18.3	23.2	38,999
光村印刷	10	14	2,814
宝印刷	5.7	6.7	9,313
アシックス	108.2	128.7	303,989
ツツミ	5.4	6.9	16,021
小松ウオール工業	3.3	4.7	7,957
ヤマハ	80.1	101.6	314,452
河合楽器製作所	3.8	5.1	9,878
クリナップ	9.9	16.2	12,619
ビジョン	61.7	78.3	227,148
兼松日産農林	14	14	2,044
キングジム	9.1	11.5	9,855
リンテック	25.9	32.9	72,281
T A S A K I	2	2.6	4,100
イトーキ	22.9	29.1	18,245
任天堂	67.1	85.1	1,290,967
三菱鉛筆	9	10.3	55,208

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
タカラスタンダード	45	57	54,777
コクヨ	56.6	71.8	105,976
ナカバヤシ	23	28	7,784
グローブライド	53	6.7	8,984
岡村製作所	41.8	48.2	48,730
美津濃	58	74	41,884
アデランス	12.6	24	13,344
<b>電気・ガス業 (2.0%)</b>			
東京電力ホールディングス	924	1,172.4	630,751
中部電力	333.3	422.9	631,601
関西電力	444.5	564	573,306
中国電力	150.6	191.1	271,553
北陸電力	106.7	135.4	191,184
東北電力	272.1	345.3	485,491
四国電力	98.1	124.5	167,079
九州電力	240.6	305.2	342,129
北海道電力	101.9	129.3	124,774
沖縄電力	7.1	14.7	44,011
電源開発	79	117.8	365,769
ファーストエスコ	—	5.6	2,973
イーレックス	—	4.1	7,703
東京瓦斯	1,324	1,543	680,771
大阪瓦斯	1,127	1,431	584,849
東邦瓦斯	277	348	270,396
北海道瓦斯	23	34	9,554
広島ガス	17.2	24.1	8,386
西部瓦斯	123	156	42,744
静岡ガス	30.9	39.2	29,635
メタウォーター	6.8	8.9	26,557
<b>陸運業 (4.6%)</b>			
SBSホールディングス	10.7	13.6	9,452
東武鉄道	582	739	416,057
相鉄ホールディングス	187	237	160,449
東京急行電鉄	592	804	781,488
京浜急行電鉄	298	379	379,000
小田急電鉄	349	443	519,639
京王電鉄	304	386	360,524
京成電鉄	163	207	301,392
富士急行	30	38	54,910
新京成電鉄	14	18	7,560

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東日本旅客鉄道	199.6	252.7	2,488,084
西日本旅客鉄道	104.8	133	886,844
東海旅客鉄道	97.5	123.8	2,407,910
西武ホールディングス	86.8	146.8	323,253
鴻池運輸	13.5	19.5	24,160
西日本鉄道	141	179	103,104
ハマキョウレックス	3.4	10.6	23,404
サカイ引越センター	1.9	5.4	15,930
近鉄グループホールディングス	1,096	1,391	627,341
阪急阪神ホールディングス	731	928	633,824
南海電気鉄道	244	310	174,530
京阪ホールディングス	244	310	233,740
神戸電鉄	27	34	12,308
名糖運輸	4.5	—	—
名古屋鉄道	397	503	274,135
山陽電気鉄道	40	50	25,400
日本通運	421	535	252,520
ヤマトホールディングス	191.5	247.1	537,689
山九	132	182	98,462
丸運	5.9	7.5	1,830
丸全昭和運輸	37	46	18,768
センコー	48	62.2	42,669
トナミホールディングス	22	28	7,672
ニッコンホールディングス	35.6	43.9	100,970
日本石油輸送	12	16	3,728
福山通運	66	84	46,284
セイノーホールディングス	84.3	98	110,250
神奈川中央交通	13	16	9,312
日立物流	22.7	28.8	52,732
丸和運輸機関	—	4.1	11,463
C&Fロジホールディングス	—	13.2	10,969
<b>海運業 (0.2%)</b>			
日本郵船	920	1,241	251,923
商船三井	571	673	154,117
川崎汽船	477	605	128,260
N Sユナイテッド海運	47	62	9,238
明治海運	9.7	12.4	4,699
飯野海運	56.4	71.5	27,885
共栄タンカー	9	11	1,617
第一中央汽船	126	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
乾汽船	—	10.9	9,929
<b>空運業 (0.7%)</b>			
日本航空	208.6	264.6	1,070,042
ANAホールディングス	2,141	2,565	854,658
バスコ	10	13	5,044
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
トランコム	3.1	4	25,360
日新	41	57	18,867
三菱倉庫	71	98	145,040
三井倉庫ホールディングス	63	80	23,280
住友倉庫	80	101	54,439
滋澤倉庫	28	36	9,900
東陽倉庫	19	24	5,400
乾汽船	7.3	—	—
日本トランスシティ	25	32	11,040
ケイヒン	20	25	3,575
中央倉庫	6.3	8	7,208
安田倉庫	8.5	10.7	7,500
東洋埠頭	34	40	5,920
宇徳	8.8	11.2	3,505
上組	130	165	162,195
サンリツ	2.6	3.4	1,655
キムラユニティー	2.8	3.5	3,776
キューソー流通システム	3	3.8	9,861
郵船ロジスティクス	10	12.7	13,944
近鉄エクスプレス	9.7	24.7	33,937
東海運	5.9	7.4	1,983
エーアイティー	5	8.5	7,735
内外トランスライン	1.2	4.6	4,439
<b>情報・通信業 (8.7%)</b>			
NECネットエスアイ	13.5	17.1	31,635
システナ	10.5	13.3	23,966
デジタルアーツ	5.7	6.7	15,101
新日鉄住金ソリューションズ	9	22.7	39,611
キューブシステム	4.7	5.9	3,610
コア	4.5	5.7	7,404
ソフトクリエイトホールディングス	3.5	6.5	5,980
I Tホールディングス	35.6	45.2	117,565
ネオス	2.9	4	2,240
電算システム	3.7	4.7	7,242

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
グリーン	65.1	82.8	54,068
コーエーテクモホールディングス	24.3	32.4	60,264
三菱総合研究所	4.2	5.3	17,993
ボルテージ	1.9	2.7	3,177
電算	1.2	1.5	3,601
AGS	1.7	3.1	3,087
ファイナデックス	6.2	8.9	16,215
ヒト・コミュニケーションズ	1.2	3.1	6,373
ブレインパッド	1.6	2	1,560
KL a b	11.4	21.1	12,343
ポールトゥウィン・ビットクルーホールディ	7.1	9	8,271
イーブックイニシアティブジャパン	2.4	3	2,250
ネクソン	102.3	130.7	201,931
アイスタイル	4.6	20.8	18,512
エムアップ	3	3.5	1,890
エイチーム	3.9	7.5	12,330
テクノスジャパン	—	3.9	11,992
e n i s h	2.8	4	2,560
コロブラ	29.5	37.9	80,461
モバイルクリエイト	6.3	8.9	4,005
オルトプラス	3.9	5	2,100
ブロードリーフ	8.9	13.7	14,768
ハーツユナイテッドグループ	3.2	4.1	10,561
メディアドゥ	—	2.9	5,889
ブイキューブ	—	8.9	11,988
サイバーリンクス	—	2.1	2,284
VOYAGE GROUP	—	4.6	5,754
オプティム	—	1.1	6,083
ベリサーブ	1.2	1.6	8,080
ティーガイア	10.7	13.6	18,632
日本アジアグループ	—	15.4	7,746
豆蔵ホールディングス	8.4	10.8	7,948
テクマトリックス	4.6	5.8	11,866
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	317.8	88,348
GMOペイメントゲートウェイ	9.3	11.2	79,408
ザッパラス	6	7.6	3,078
インターネットイニシアティブ	17.4	22.1	49,813
さくらインターネット	—	8.9	11,614
GMOクラウド	2.4	3	3,753
ビットアイル	12.2	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
SRAホールディングス	5.7	7.8	19,858
Minorityソリューションズ	—	2.6	2,376
システムインテグレータ	1.5	1.9	1,356
パイブドビッツ	1.4	—	—
朝日ネット	11	12.4	5,914
コムチュア	1.8	2.3	6,239
gumi	10.8	14	12,600
パイブドHD	—	1.7	2,286
バナソニック インフォメーションシステム	2.5	—	—
フェイス	3.2	3.6	4,845
ハイマックス	1.4	1.8	2,070
野村総合研究所	60.9	95.6	382,878
サイバネットシステム	8.8	11.1	8,924
CEホールディングス	1.6	2.1	1,902
インターージホールディングス	6.1	7.1	10,011
東邦システムサイエンス	3.2	4	2,428
ソースネクスト	5.4	6.8	3,556
ティー・ワイ・オー	14.8	26.8	4,582
フォーカスシステムズ	—	5.2	3,062
クレスコ	2.4	3.1	5,877
フジ・メディア・ホールディングス	112	142	178,920
オービック	37.1	47	280,590
ジャストシステム	19.6	24.8	23,386
TDCソフトウェアエンジニアリング	2.3	5.9	3,722
ヤフー	770.5	977.6	493,688
トレンドマイクロ	56.9	66.2	276,054
インフォメーション・ディベロップメント	2	2.6	2,568
日本オラクル	17.2	21.9	134,247
アルファシステムズ	3.5	4.5	7,924
フューチャー	11.3	16.4	12,021
CAC Holdings	7.3	10.2	8,262
ソフトバンク・テクノロジー	2.9	3.7	6,563
トーセ	2.9	3.7	2,504
オービックビジネスコンサルタント	6.8	6.9	32,395
伊藤忠テクノソリューションズ	24.4	30.9	77,960
アイティフォー	12.9	17.7	9,062
東計電算	1.9	2.4	4,646
エックスネット	1	1.2	1,860
大塚商会	28.9	36.7	201,850
サイボウズ	14.3	18.1	6,280

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソフトブレーン	14.7	19.9	3,383
電通国際情報サービス	6.6	8.4	16,917
EMシステムズ	1.7	4.6	5,639
ウエザーニューズ	3.2	4.6	18,032
C I J	9.7	12.3	6,199
東洋ビジネスエンジニアリング	1.1	1.4	1,916
日本エンタープライズ	9.5	13.9	3,586
WOWOW	5.1	6.5	15,951
フュージョンパートナー	6.1	8.5	4,658
日本コロムビア	3.7	4.6	1,987
イマジカ・ロボット ホールディングス	7.5	11.5	4,577
ネットワンシステムズ	43.6	59.1	36,346
アルゴグラフィックス	4.4	6.2	10,707
マーベラス	18.1	23	19,619
エイベックス・グループ・ホールディングス	21.3	25.1	35,867
日本ユニシス	29.7	37.6	49,932
兼松エレクトロニクス	6.8	8.6	16,804
東京放送ホールディングス	64.4	81.7	125,327
日本テレビホールディングス	98.2	124.5	226,714
朝日放送	10.6	13.5	8,640
テレビ朝日ホールディングス	29.4	37.3	69,825
スカパーJ SATホールディングス	81.6	103.5	63,963
テレビ東京ホールディングス	8.8	12.4	24,589
日本BS放送	1.8	3.1	3,121
U-NEXT	—	4.2	4,363
ワイヤレスゲート	—	4	9,232
コネクシオ	7.6	12	16,776
日本通信	—	96.6	21,252
クロップス	1.3	2.5	1,287
日本電信電話	420.7	1,054.4	5,306,795
KDDI	1,092.2	1,385.7	4,536,781
光通信	9.7	16.4	138,088
NTTドコモ	829.2	1,019.3	2,854,040
エムティーアイ	13.6	20.7	17,408
GMOインターネット	35.9	49.8	67,977
カドカワ	26.4	42.6	68,032
学研ホールディングス	36	45	11,340
ゼンリン	14.2	18	46,692
昭文社	6.4	7.4	4,610
インプレスホールディングス	7.6	11.2	1,657

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アイネット	5.5	7.6	8,572
松竹	71	90	95,040
東宝	76.7	97.3	281,683
東映	40	51	43,401
AOI Pro.	5	6.9	6,182
エヌ・ティ・ティ・データ	66.4	84.3	484,725
ピー・シー・エー	1.4	1.7	2,213
ビジネスブレイン太田昭和	—	2.1	1,965
DTS	11.1	15.2	33,440
スクウェア・エニックス・ホールディングス	41.3	57.7	161,617
シーイーシー	7	8.9	14,275
カプコン	27.5	34.9	84,702
アイ・エス・ピー	1.1	2.2	1,973
ジャステック	6.2	8.6	8,376
SCSK	25.6	32.4	130,248
日本システムウエア	4	5.1	5,395
アイネス	14.6	19.3	22,156
TKC	9.9	12.6	38,430
富士ソフト	14.8	20.2	50,257
NSD	25.1	28.9	49,881
コナミホールディングス	43.7	61.6	214,368
福井コンピュータホールディングス	2.9	3.9	6,360
JBCホールディングス	9	11.4	7,843
ミロク情報サービス	7.1	10.1	11,847
ソフトバンクグループ	568.5	772.9	4,631,216
<b>卸売業 (4.1%)</b>			
ハウスイ	9	11	1,320
高千穂交易	4.1	5.2	4,711
伊藤忠食品	2.6	3.4	13,379
エレマテック	5	6.4	12,563
JALUX	3	4.4	8,720
あらた	24	6.1	15,079
トーマンデバイス	1.6	2	3,534
東京エレクトロン デバイス	2.8	4.9	7,394
フィールズ	—	11.9	18,921
双日	719.6	859.3	201,076
アルフレッサ ホールディングス	127.2	171.5	363,065
横浜冷凍	26.6	33.8	36,673
神栄	16	19	2,071
山下医科器械	0.9	1.1	2,075

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ラサ商事	5	6.4	3,296
ラクーン	—	5.8	3,126
アルコニックス	6.1	7.7	12,035
神戸物産	3.5	8.8	21,700
あい ホールディングス	17.2	24.3	79,947
ディーブイエックス	3.1	4.8	5,433
ダイワボウホールディングス	98	124	26,660
マクニカ・富士エレホールディングス	19.3	24.6	28,609
バイタルケーエスケー・ホールディングス	20.2	23.6	22,750
八洲電機	8.3	10.5	5,817
UKCホールディングス	6.9	8.8	16,676
OCHIホールディングス	2.8	3.9	4,067
TOKAIホールディングス	52.5	59.9	36,658
三洋貿易	5.9	7.5	10,747
ウイン・パートナーズ	3.5	4.9	7,389
ミタチ産業	2.5	3.5	2,268
シップヘルスケアホールディングス	19.7	27.7	77,920
明治電機工業	3.1	4.3	4,523
デリカフーズ	1.8	2.9	2,728
スターティア	1.2	2.6	2,020
富士興産	4.1	5.3	2,210
協栄産業	13	18	2,268
小野建	9.3	11.9	13,447
佐島電機	8.5	10.8	8,100
エコートレーディング	2.5	3.1	1,760
伯東	7.3	10.4	9,630
コンドレーテック	7.8	10.8	9,525
中山福	6.2	8.5	6,315
ナガイレーベン	15.5	19.7	44,068
三菱食品	11.8	15	40,365
松田産業	7.8	9.9	11,731
第一興商	—	24.1	115,198
メディパルホールディングス	107.5	136.4	238,563
アドヴァン	5.5	13.9	14,692
SPK	2.3	3.1	6,147
萩原電気	3	4.6	8,956
アズワン	7.7	10.7	43,014
スズデン	3.5	4.4	4,496
尾家産業	3.4	4.4	3,779
シモジマ	6.6	9.4	9,268

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ドウシシャ	13.9	16	35,120
小津産業	2.1	3	6,483
高速	6.4	8.1	7,119
たけびし	3.8	4.8	4,780
黒田電気	18.7	25.4	42,113
丸文	9.5	12	7,824
ハビネット	6.5	12.4	11,135
橋本総業ホールディングス	2	2.8	4,172
エクセル	4.9	6.6	9,028
マルカキカイ	3.5	4.4	5,592
ガリバーインターナショナル	32.5	36.7	40,810
日本エム・ディ・エム	9	11.4	8,504
進和	6.3	8	11,664
エスケイジャパン	2.5	3.3	996
ダイトエレクトロン	4.9	6.2	4,048
シークス	6.8	8.7	29,797
田中商事	3.3	4.2	2,637
オーハシテクニカ	6.6	7.7	9,147
白銅	3.5	3.9	3,962
伊藤忠商事	899.9	1,070.4	1,479,292
丸紅	940.5	1,342.5	712,330
高島	20	25	4,275
長瀬産業	60.3	82	96,924
蝶理	6.8	8.7	13,685
豊田通商	119.8	151.9	364,104
三共生興	18.3	20.6	7,642
兼松	214	290	51,330
ツカモトコーポレーション	19	24	2,616
三井物産	911.4	1,233.5	1,584,430
日本紙パルプ商事	56	71	22,933
日立ハイテクノロジーズ	37.3	47.3	140,906
カメイ	14	17.7	16,691
東都水産	18	22	3,850
OUGホールディングス	17	20	4,600
スターゼン	42	4.9	16,292
山善	41.3	52.4	45,326
椿本興業	12	15	4,365
住友商事	634.5	858.7	933,836
内田洋行	26	34	15,776
三菱商事	823.9	1,023.6	1,840,432

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第一実業	26	31	15,345
キヤノンマーケティングジャパン	30.7	38.9	79,122
西華産業	35	44	9,504
佐藤商事	9.6	12.2	7,856
菱洋エレクトロ	12.4	15.4	20,097
東京産業	10.7	13.5	5,035
ユアサ商事	9.4	12.9	31,734
神鋼商事	27	30	5,610
小林産業	7.8	9	1,674
阪和興業	107	136	65,416
カナデン	9.2	13	10,868
菱電商事	17	22	14,014
フルサト工業	5.9	7.5	11,122
岩谷産業	119	162	102,708
すてきなイスグループ	46	58	7,714
昭光通商	38	48	3,600
ニチモウ	17	21	3,759
極東貿易	12	20	4,320
イワキ	16	21	4,284
三菱石油	28	33.5	25,091
稲畑産業	25.8	32.7	35,250
G S I クレオス	28	36	4,140
明和産業	8.5	12.6	4,636
ワキタ	22.9	29	22,069
東邦ホールディングス	37.1	43.7	109,555
サンゲツ	37.6	47.5	94,002
ミツウロコグループホールディングス	17.3	21.9	11,475
シナネンホールディングス	23	29	12,180
伊藤忠エネクス	23.7	35.1	33,309
サンリオ	30.1	42	91,224
サンワテクノス	6.8	8.7	6,394
リョーサン	18.1	21.6	57,456
新光商事	12.6	16	17,440
トーホー	24	6.1	14,658
三信電気	14.9	18.8	16,788
東陽テクニカ	15.7	18.1	19,511
モスフードサービス	14.1	17.9	54,058
加賀電子	9.7	12.3	16,334
ソーダニッカ	11.1	14	6,538
立花エレテック	7.9	10.1	11,887

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フォーバル	2.1	7.1	5,523
PALTAC	17.2	21.8	41,223
三谷産業	11.4	14.5	5,278
太平洋興発	42	57	4,218
ヤマタネ	54	63	9,450
丸紅建材リース	9	12	2,256
日鉄住金物産	71	120	45,960
トラスコ中山	13.4	15.6	74,334
オートバックスセブン	39.6	52.2	103,251
加藤産業	16.8	21.3	58,788
イノテック	9.9	12.5	5,375
イエローハット	10.1	12.9	29,786
JKホールディングス	10.8	13.7	6,247
日伝	4.4	5.6	16,772
北沢産業	8.9	11.2	1,803
杉本商事	5.8	7.8	9,180
因幡電機産業	16	19.1	67,136
バイテックホールディングス	3.6	5.6	5,476
ミスミグループ本社	40.2	153.2	240,064
アルテック	7.9	11.6	1,705
タキヒヨー	18	23	9,821
蔵王産業	1.4	2.2	2,895
スズケン	48.9	62.1	232,254
ジェコス	7.4	9.4	11,129
ルネサスイーストン	5.3	11.3	4,734
<b>小売業 (5.0%)</b>			
ローソン	40.7	51.7	450,307
サンエー	8.1	9.3	48,267
ダイユーエイト	2.5	3.6	2,466
カワチ薬品	8.3	10.5	26,617
エービーシー・マート	15.3	17.7	130,449
ハードオフコーポレーション	5.2	6.6	9,768
アスクル	11.2	16.6	70,965
ゲオホールディングス	20.2	22.8	41,176
アダストリア	9.1	25.1	90,862
ジーフット	—	8.2	6,379
シー・ヴィ・エス・ベイエリア	14	20	1,820
くらコーポレーション	6.3	8	38,520
キャンドウ	5.1	7.2	11,664
バル	6.3	7.9	21,053

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エディオン	49.2	57.7	51,468
サーラコーポレーション	9.2	11.7	6,563
ワッツ	4.2	5.8	5,347
ハローズ	—	4.4	10,282
あみやき亭	1.9	2.6	11,349
ひらまつ	14.8	18.8	13,235
ゲンキー	1.1	2.7	9,342
サッポロドラッグストア	0.9	1.8	3,853
大黒天物産	2.6	3.2	15,456
ハニーズ	9.4	12	13,968
ファーマライズホールディングス	2.4	3.1	1,717
アルペン	9.6	12.2	22,008
クオーラ	10.9	13.8	22,066
ジェイアイエス	7.3	9.3	36,735
ビックカメラ	52.8	78.3	84,955
DCMホールディングス	52	67.1	53,210
Monotaro	21	48.2	166,531
東京一番フーズ	—	3.4	1,662
ダイヤモンドダイニング	—	2.8	2,842
きちり	2.9	3.6	2,343
アークランドサービス	1.3	4.3	13,889
J. フロント リテイリング	136	172.6	221,445
ドトール・日レスホールディングス	18.8	23.9	45,242
マツモトキヨシホールディングス	24	28.1	156,236
ブロンコビリー	1.9	7.1	22,116
スタートトゥデイ	33.5	41.5	216,630
トレジャー・ファクトリー	1.3	3.8	4,335
物語コーポレーション	3	3.6	18,900
ココカラファイン	11.2	14.2	72,704
三越伊勢丹ホールディングス	213.7	271.3	306,297
ウエルシアホールディングス	9.2	11.8	69,620
クリエイトSDホールディングス	5.3	20.1	53,667
丸善CHIホールディングス	12.5	15.9	5,883
ミサワ	—	2.1	1,081
エー・ピーカンパニー	1.5	2.2	2,428
チムニー	2.6	3.3	9,873
シュッピン	—	5.1	6,828
ネクステージ	1.4	2.2	1,419
ジョイフル本田	7.9	22.1	53,437
麒麟堂ホールディングス	3.4	4.4	4,721

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ホットランド	—	4.7	4,714
すかいらく	52.5	41.7	56,545
綿半ホールディングス	—	5.1	7,502
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	35.3	45.2	47,369
ブックオフコーポレーション	6.1	7.7	6,475
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	3.8	3,765
あさひ	7.1	10.1	16,887
日本調剤	1.4	3.4	13,311
コスモス薬品	5.4	6.9	131,583
トーエル	5.7	6.6	5,115
一六堂	2.6	3.3	1,102
セブン&アイ・ホールディングス	449.7	570.6	2,717,767
薬王堂	1.5	2.5	9,750
クリエイト・レストランツ・ホールディング	7.5	36.6	37,112
ツルハホールディングス	23	31.3	344,613
サンマルクホールディングス	7.7	10.8	30,996
フェリシモ	2.7	3.9	3,966
トリドール	11.5	16.7	34,134
クスリのアオキ	4.2	12.1	73,689
メディカルシステムネットワーク	9.7	15.4	9,809
総合メディカル	5.2	6.6	21,417
はるやま商事	4.5	5.7	4,326
カッパ・クリエイト	16.8	19.1	23,645
ライトオン	8	10.2	14,994
ジーンズメイト	3.4	4.3	786
良品計画	13.3	15.7	406,316
三城ホールディングス	13.3	16.8	7,442
アルビス	2.4	3.6	7,502
コナカ	12.6	17.4	8,926
ハウス オブ ローゼ	1.2	1.7	2,429
G-7ホールディングス	2.3	4	4,940
イオン北海道	6.8	9.1	4,713
コジマ	15.8	20.1	4,964
ヒマラヤ	3.3	4.2	4,263
コーナン商事	16.4	19.3	37,615
エコス	3.7	5.2	7,311
ワタミ	12.7	16.1	15,939
マルシェ	2.6	3.3	2,745
ドンキホーテホールディングス	34.7	88.2	343,539
西松屋チェーン	21.2	26.9	34,109

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゼンショーホールディングス	55.3	70.2	99,543
幸楽苑ホールディングス	6.7	8.6	12,882
ハークスレイ	3	3.8	3,944
サイゼリヤ	17.7	22.4	45,248
V Tホールディングス	—	46.1	26,784
魚力	3	4.2	5,422
ポプラ	2.7	3.4	1,570
ユナイテッドアローズ	14.1	19.5	72,735
ハイデイ日高	8.1	12.4	32,574
京都きもの友禅	6.3	9.3	8,388
コロワイド	35.6	45.2	85,156
ピーシーデポコーポレーション	—	15.1	18,271
巷番屋	4.9	6.2	44,764
トップカルチャー	4.3	4.9	2,263
P L A N T	2.4	3.1	3,782
スギホールディングス	19.3	24.5	137,935
スクロール	13.9	20.6	9,620
ヨンドシーホールディングス	8.2	10.4	28,184
ファミリーマート	36.3	41.9	249,305
木曽路	13.1	16.7	37,508
サトレストランシステムズ	10	16	12,944
千趣会	19.3	26.9	20,417
タカキュー	7.4	10.5	1,974
ケーヨー	20.1	23	12,075
上新電機	23	32	28,384
日本瓦斯	17.2	20.8	52,748
ベスト電器	34.6	43.9	5,092
ロイヤルホールディングス	17.9	22.6	47,505
東天紅	8	10	1,300
いなげや	12	15.2	22,496
島忠	27.8	35.3	88,567
チヨダ	12.7	16.1	45,997
ライフコーポレーション	6.8	8.6	26,015
リンガーハット	10.4	12.3	28,400
さが美	8	11	979
M r M a x	10.7	11.9	3,712
テナアライド	9	12.5	4,600
A O K Iホールディングス	24.7	31.1	38,626
オークワ	17	21	24,822
コメリ	18.4	21	58,926

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
青山商事	27	26.1	109,098
しまむら	12.5	15.8	238,896
C F S コーポレーション	7	—	—
はせがわ	3.8	6.4	2,675
高島屋	156	198	156,024
松屋	21.6	27.4	23,646
エイチ・ツー・オー リテイリング	50.8	69.8	124,662
近鉄百貨店	41	52	16,120
丸栄	18	28	2,744
ニッセンホールディングス	22.5	20	2,360
パルコ	10.3	13.1	12,209
丸井グループ	113.1	167.4	286,923
アクシアル リテイリング	8.3	10.5	37,695
井筒屋	58	74	3,922
イオン	443.4	561.3	939,896
ユニーグループ・ホールディングス	102.9	130.6	107,222
イズミ	24	27.1	117,343
東武ストア	14	16	4,944
平和堂	21.8	27.6	64,777
フジ	11.9	15.1	36,723
ヤオコー	12.2	15.5	76,415
ゼビオホールディングス	14.6	18.5	31,542
ケーズホールディングス	24.8	28.8	108,432
O l y m p i c グループ	6.3	8	4,584
日産東京販売ホールディングス	18	22.9	5,976
アインホールディングス	12.9	16.4	92,332
元気寿司	3.3	3.8	8,097
ヤマダ電機	425	414.8	230,628
アークランドサカモト	7.7	23.1	26,726
ニトリホールディングス	46.4	58.9	628,463
グルメ杵屋	8	10	9,990
愛眼	8.6	10.9	2,343
ケーユーホールディングス	5.6	7.1	5,246
吉野家ホールディングス	30.3	50.3	72,532
松屋フーズ	5.2	6.5	18,317
サガミチェーン	14	18.2	22,386
関西スーパーマーケット	8	11.1	10,245
王将フードサービス	7.9	10	35,850
ブレナス	12	15.2	30,217
ミニストップ	7.9	10.1	18,079

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アークス	18.7	25.5	65,050
パローホールディングス	23.2	29.4	83,995
藤久	0.8	1.1	1,912
ペルク	4.8	6.7	29,212
大庄	5	7.3	10,650
ファーストリテイリング	21.5	22.8	658,806
サンドラッグ	22.7	28.8	228,672
サックスパー ホールディングス	8.1	12.8	17,088
ヤマザワ	2.2	2.8	4,628
やまや	1.8	2.8	5,549
ペルーナ	26.8	34	19,380
<b>銀行業 (7.4%)</b>			
島根銀行	2.3	2.9	3,320
じもとホールディングス	77.1	97.9	13,803
足利ホールディングス	67.6	100.1	31,931
東京T Y フィナンシャルグループ	13.8	18.8	52,602
九州フィナンシャルグループ	—	208.8	116,510
ゆうちょ銀行	—	349.5	463,087
富山第一銀行	—	34.7	18,391
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	950.3	462,796
新生銀行	1,023	1,180	186,440
あおぞら銀行	726	863	335,707
三菱UF J フィナンシャル・グループ	8,626.2	10,944.9	5,568,765
りそなホールディングス	1,257.7	1,595.8	616,617
三井住友トラスト・ホールディングス	2,376	2,848	954,080
三井住友フィナンシャルグループ	813.1	1,092.3	3,667,943
第四銀行	136	173	65,048
北越銀行	116	147	27,783
西日本シティ銀行	377	444	86,136
千葉銀行	415	526	285,092
横浜銀行	721	—	—
常陽銀行	389	493	187,340
群馬銀行	255	303	131,199
武蔵野銀行	17.2	21.8	60,233
千葉興業銀行	22.3	37.4	17,615
筑波銀行	44.7	56.7	15,762
七十七銀行	181	214	81,320
青森銀行	84	99	32,274
秋田銀行	71	89	25,810
山形銀行	65	77	30,954

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
岩手銀行	7.5	9.5	39,235
東邦銀行	96	122	45,140
東北銀行	58	69	9,867
みちのく銀行	54	68	12,036
ふくおかフィナンシャルグループ	436	590	211,220
静岡銀行	315	400	318,000
十六銀行	135	171	54,891
スルガ銀行	113.5	129.5	284,900
八十二銀行	194	246.8	116,242
山梨中央銀行	67	84	34,104
大垣共立銀行	134	182	60,606
福井銀行	92	117	25,272
北國銀行	120	145	45,095
清水銀行	3.7	4.6	10,465
富山銀行	—	2.6	9,139
滋賀銀行	108	128	60,928
南都銀行	104	132	41,580
百五銀行	103	123	49,323
京都銀行	205	260	187,200
紀陽銀行	42.2	53.5	70,299
三重銀行	48	61	12,078
ほくほくフィナンシャルグループ	731	928	128,064
広島銀行	317	402	157,986
山陰合同銀行	65	82	57,072
中国銀行	76.2	96.7	106,950
鳥取銀行	34	43	7,181
伊予銀行	115	145.9	105,485
百十四銀行	118	150	48,000
四国銀行	83	105	22,050
阿波銀行	88	109	60,931
鹿児島銀行	75	—	—
大分銀行	66	78	25,038
宮崎銀行	72	91	26,299
肥後銀行	88	—	—
佐賀銀行	65	83	17,845
十八銀行	66	84	21,252
沖縄銀行	8.5	10.4	38,428
琉球銀行	22.1	28.1	35,883
セブン銀行	362.5	511.1	241,239
みずほフィナンシャルグループ	14,990.1	19,335.1	3,205,759

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高知銀行	42	53	5,830
山ロフィナンシャルグループ	107	128	135,936
長野銀行	35	45	8,460
名古屋銀行	97	114	41,382
北洋銀行	162	205.5	57,334
愛知銀行	3.9	4.6	22,862
第三銀行	61	77	11,704
中京銀行	44	56	11,984
東日本銀行	47	—	—
大光銀行	38	48	9,504
愛媛銀行	63	80	18,400
トマト銀行	41	53	7,685
みなと銀行	97	123	19,434
京葉銀行	89	112	45,248
関西アーバン銀行	15	19	19,703
栃木銀行	54	71	30,104
北日本銀行	3.3	4.2	11,155
東和銀行	151	255	22,950
福島銀行	132	168	14,448
大東銀行	69	82	14,432
トモニホールディングス	82.5	104.7	32,980
フィデアホールディングス	63.8	111.3	19,032
池田泉州ホールディングス	102.5	144.7	60,195
<b>証券・商品先物取引業 (1.0%)</b>			
F P G	31.8	48.6	56,084
S B I ホールディングス	129.1	163.8	200,982
日本アジア投資	78	9.2	2,465
ジャフコ	14.7	22.8	71,364
大和証券グループ本社	1,006	1,276	800,945
野村ホールディングス	2,197.9	2,624.7	1,208,149
岡三証券グループ	92	116	66,004
丸三証券	34.2	40.5	40,257
東洋証券	41	52	12,740
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	123.4	156.5	86,388
光世証券	26	33	4,290
水戸証券	33.3	42.2	12,027
いちよし証券	22.5	30.5	27,999
松井証券	54.6	66.8	64,595
だいこう証券ビジネス	5.2	6.6	4,870
マネックスグループ	126.5	158.5	45,965

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カブドットコム証券	47.7	116.3	40,821
極東証券	14.4	18.3	24,046
岩井コスモホールディングス	11	12.9	13,119
藍澤證券	15.1	25.5	15,121
マネースクウェアHD	4.4	4.7	4,939
マネーパートナーズグループ	11	12.7	8,496
小林洋行	3.1	3.9	943
<b>保険業 (2.3%)</b>			
かんぽ生命保険	—	55.5	135,253
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	238.8	303	871,428
アニコム ホールディングス	6	9.2	26,394
MS&ADインシュアランスグループホール	342.7	407.7	1,206,588
ソニーフィナンシャルホールディングス	103	130.7	176,445
第一生命保険	688.8	874	1,173,782
東京海上ホールディングス	435.6	552.7	2,052,175
T&Dホールディングス	391.8	497.2	516,839
<b>その他金融業 (1.4%)</b>			
全国保証	27.9	35.5	133,302
クレディセゾン	87.8	103.5	214,452
アクリーティブ	7.3	11.2	5,902
芙蓉総合リース	11.3	15.6	75,582
興銀リース	20.2	25.6	48,512
東京センチュリーリース	25.2	32	119,680
日本証券金融	47.4	60.1	25,963
アイフル	179.9	228.4	90,446
ポケットカード	8	13.6	7,629
リコーリース	8.5	10.7	33,812
イオンフィナンシャルサービス	70.5	89.5	226,614
アコム	216	274	173,168
ジャックス	59	75	34,125
オリエントコーポレーション	248.5	589.8	134,474
日立キャピタル	21.1	32.1	74,664
アプラスフィナンシャル	51.6	65.4	6,801
オリックス	761.1	966	1,546,083
三菱UFJ F リース	272.7	346	161,928
日本取引所グループ	157.9	400.6	659,387
イー・ギャランティ	3.1	4.4	10,696
アサックス	1.9	2.4	3,290
NECキャピタルソリューション	4.4	5.5	8,481

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>不動産業 (2.9%)</b>			
いちごグループホールディングス	—	151	73,537
日本駐車場開発	116.8	164	20,336
ヒューリック	199.6	284.4	316,821
東京建物不動産販売	5.6	—	—
三栄建築設計	4.3	5.5	7,111
野村不動産ホールディングス	64.6	90.5	180,547
三重交通グループホールディングス	19.1	24.2	14,253
サムティ	—	9.8	11,162
ディア・ライフ	—	9.2	3,744
エー・ディー・ワークス	—	124.9	5,620
日本商業開発	3.4	6	13,944
プレサンスコーポレーション	3.6	4.6	18,561
ユニゾホールディングス	5.9	8.5	47,515
日本管理センター	6.9	8.9	15,833
サンセイランディック	1.6	3.1	3,007
エストラスト	1.5	2.4	1,315
フージャースホールディングス	16	19	9,462
オープンハウス	7.8	19.7	52,165
東急不動産ホールディングス	281.8	330	246,840
飯田グループホールディングス	69.7	126.4	271,128
ムゲンエステート	—	2	4,510
パーク24	54.1	68.9	216,001
バラカ	3.7	3.9	5,775
三井不動産	570	723	1,972,705
三菱地所	799	1,014	2,180,100
平和不動産	20.3	25.8	35,423
東京建物	234	149	212,176
ダイビル	27.7	35.1	36,153
京阪神ビルディング	17.8	22.6	13,379
住友不動産	258	327	1,048,689
大京	171	253	44,528
テーオーシー	37	52.9	46,869
東京楽天地	18	22	10,604
レオパレス21	117.6	160.7	113,936
スターツコーポレーション	12.3	15.6	34,039
フジ住宅	13.7	17.4	11,832
空港施設	13	16.5	7,953
明和地所	6.2	7.5	4,725
住友不動産販売	7.7	9.8	21,471

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゴールドクレスト	9.7	10.7	16,884
日本エスリード	4.2	5.3	5,331
日神不動産	14.3	18.1	6,606
タカラレーベン	47.6	59.5	44,863
サンヨーハウジング名古屋	6	7	6,825
イオンモール	69.4	88	129,272
ファースト住建	4	5.1	6,609
トーセイ	14.7	20.7	16,435
穴吹興産	10	15	3,840
エヌ・ティ・ティ都市開発	66.8	84.7	89,697
サンフロンティア不動産	11.6	16.5	17,985
エフ・ジェー・ネクスト	8.2	11.9	6,045
ランドビジネス	7.2	8	2,072
グランディハウス	9.4	11.9	4,188
日本空港ビルデング	37.1	43.5	158,340
<b>サービス業 (3.9%)</b>			
日本工営	38	48	16,944
ネクスト	13.4	40.8	51,163
ジェイエイシーリクルートメント	—	8.9	12,549
日本M&Aセンター	17.6	22.3	147,403
ノバレーゼ	2.9	3.7	3,074
アコーディア・ゴルフ	42.8	40	42,160
中広	—	1.4	882
タケエイ	11.1	12.6	12,511
トラスト・テック	2	5.8	7,934
パソナグループ	8.5	12.5	8,912
CDS	2.6	3.3	2,890
リンクアンドモチベーション	15.3	29.1	4,103
GCAサヴィアン	9	12.8	13,017
エス・エム・エス	12.8	18	40,752
テンブホールディングス	22.4	101.2	164,854
リニカル	2.9	8.5	19,133
クックパッド	7.2	32.2	54,385
エスクリ	4	6.1	3,800
アイ・ケイ・ケイ	6.1	7.7	4,835
学情	4.2	5.3	5,830
スタジオアリス	5.2	6.6	18,585
シミックホールディングス	5.1	7.3	11,986
NJS	2.5	2.9	3,497
総合警備保障	38	48.2	288,718

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カカココム	75	103.6	212,690
ルネサンス	5.8	7.3	8,927
ディップ	2.5	16	45,168
オプトホールディング	5.1	9	6,669
新日本科学	10.8	13.7	7,630
ツクイ	13.5	17.1	23,341
総合臨床ホールディングス	5.8	—	—
キャリアデザインセンター	3.1	3	2,949
エムスリー	98.5	125	400,625
ツカダ・グローバルホールディング	8.3	10.5	7,486
アウトソーシング	4.3	6.7	25,493
ウエルネット	4	5.4	21,384
ディー・エヌ・エー	56.1	64.7	118,789
博報堂DYホールディングス	157.7	200.1	255,327
ぐるなび	13.2	16.7	45,874
エスアールジータカミヤ	9.2	15.6	8,018
一休	8.9	—	—
ジャパンバストレスキューシステム	12.9	17.9	4,099
ファンコムコミュニケーションズ	26.2	33.3	26,540
ジェイコムホールディングス	2.7	2.9	7,693
PGMホールディングス	16	—	—
WDBホールディングス	4.1	5.2	4,815
ティア	4.8	6.9	4,629
バリューコマース	9.3	13.3	4,788
インフォマート	—	27.8	27,327
J Pホールディングス	28.2	35.8	12,422
E P Sホールディングス	10.4	17.9	25,006
レッグス	—	2.8	1,968
プレステージ・インターナショナル	8.7	12.1	15,379
アミューズ	3.5	8	19,984
ドリームインキュベータ	3.7	4.8	11,433
クイック	5.2	7.4	5,727
TAC	5.6	7.9	1,532
ケネディクス	161.7	193.8	93,217
電通	126.8	160.9	921,957
テイクアンドギヴ・ニーズ	4.4	6.7	3,122
びあ	3.3	4.4	9,152
イオンファンタジー	3.7	5.1	13,132
シーティーエス	—	4.3	3,237
ネクシィーズグループ	4.1	5.2	14,034

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
みらかホールディングス	29	36.9	170,478
アルプス技研	4.6	5.3	11,559
ダイオーズ	2.4	2.6	2,805
日本空調サービス	5.6	12.7	6,781
オリエンタルランド	123	156.1	1,150,613
ダスキン	32.2	37	74,185
明光ネットワークジャパン	13.2	17.9	21,873
ファルコホールディングス	5.4	6.3	8,864
秀英予備校	2.3	2.6	1,089
田谷	1.9	2.4	1,672
ラウンドワン	32.3	45.1	31,028
リゾートトラスト	43	60.5	142,659
ビー・エム・エル	6.7	8.5	39,737
ワタベウェディング	3.7	4.3	2,029
りらいあコミュニケーションズ	21.2	23.9	26,624
リゾー教育	17.6	26.8	11,068
早稲田アカデミー	1.7	1.9	1,630
ユー・エス・エス	137.7	174.8	288,944
東京個別指導学院	5.5	7	4,900
サイバーエージェント	27.8	38	196,840
楽天	494.8	675.5	846,739
テー・オー・ダブリュー	3.4	11.6	8,212
セントラルスポーツ	3.9	4.9	11,191
フルキャストホールディングス	11.7	13.2	9,662
リゾートソリューション	11	14	4,298
テクノプロ・ホールディングス	16.1	23.4	74,295
インターワークス	—	2.5	2,350
Keeper 技研	—	1.6	3,116
ファーストロジック	—	0.7	1,808
リブセンス	6.6	9.6	4,771
ジャパンマテリアル	4.7	6	16,812
ベクトル	2.5	4.5	14,062
ウチヤマホールディングス	6.6	7.4	4,269
サクセスホールディングス	1.2	1.3	1,991
キャリアリンク	1.5	1.9	3,484
I B J	—	11.2	6,574
アサンテ	3.8	5.3	7,250
N・フィールド	—	6.8	12,981
M&Aキャピタルパートナーズ	0.4	1.8	3,477
ライドオン・エクスプレス	—	3.1	4,854

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
E R I ホールディングス	2.9	3.7	3,259
アビスト	1.2	2.2	4,738
ウィルグループ	1.3	3.3	3,329
日本ビューホテル	—	2.1	3,444
リクルートホールディングス	172.1	291.1	1,014,483
エラン	—	1.6	2,217
日本郵政	—	424.5	609,582
ベルシステム24ホールディングス	—	28.2	27,269
リロ・ホールディング	3.9	5.4	79,704
東祥	2.4	4.3	17,522
エイチ・アイ・エス	18.5	23.5	66,246
ラックランド	—	2	3,414
共立メンテナンス	6.8	10.9	95,157
イチネンホールディングス	11.9	15.1	15,432
建設技術研究所	6.7	8.5	7,607
スペース	6.1	7.8	10,241
燦ホールディングス	2.3	2.9	3,987
スバル興業	8	10	3,800
東京テアトル	43	55	6,545
ナガワ	—	2.6	8,073
よみうりランド	23	29	14,442
東京都競馬	78	99	21,978
常磐興産	42	53	8,056
カナモト	15.9	20.1	53,144
東京ドーム	78	115	51,980
西尾レントオール	9.2	11.6	32,294
トランス・コスモス	14.9	16.8	51,912
乃村工藝社	22.3	30.9	55,496
藤田観光	41	52	26,780
日本管財	5.6	12.4	19,046
トーカイ	5	6.4	20,768
白洋舎	12	15	3,825
セコム	110.5	150.2	1,274,296
セントラル警備保障	5	6.4	13,600
丹青社	13.1	27	23,949
メイテック	15.2	17.5	66,937
アサツー ディ・ケイ	21.4	25.3	69,524
応用地質	11.9	13.6	15,544
船井総研ホールディングス	12.3	20.1	33,245
進学会	4.7	6.9	3,836

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オオバ	—	10.5	4,987
学究社	—	2.1	2,499
ベネッセホールディングス	41.6	48.4	118,628
イオンディライト	11	13.9	42,464
ナック	7.6	8.8	8,078
ニチイ学館	22.2	25.1	17,795
ダイセキ	18.3	27.1	56,042

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ステップ	3.8	4.8	5,083
合 計	株 数 ・ 金 額	182,431	229,846
	銘柄数<比率>	1,866	1,937
			273,159,048
			<97.7%>

\*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	百万円
		6,324	—

\*単位未満は切り捨て。

### ○有価証券の貸付及び借入の状況

2016年5月10日現在における貸付株式の総株数は20,484,900株（うち野村證券株式会社への貸付は2,867,700株）です。

### ○投資信託財産の構成

(2016年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	273,159,048	89.6
コール・ローン等、その他	31,767,343	10.4
投資信託財産総額	304,926,391	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 (2016年5月10日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	304,877,753,055	
コール・ローン等	25,676,445,531	
株式(評価額)	273,159,048,910	
未収入金	2,902,546,302	
未収配当金	2,755,194,960	
未収利息	698,546	
その他未収収益	2,242,816	
差入委託証拠金	381,575,990	
(B) 負債	25,385,543,691	
未払金	154,972	
未払解約金	3,275,021,197	
未払利息	45,549	
受入担保金	22,110,321,973	
(C) 純資産総額(A-B)	279,492,209,364	
元本	224,682,172,660	
次期繰越損益金	54,810,036,704	
(D) 受益権総口数	224,682,172,660口	
1万口当たり基準価額(C/D)	12,439円	

(注) 期首元本額は178,095,641,491円、期中追加設定元本額は75,955,719,903円、期中一部解約元本額は29,369,188,734円、1口当たり純資産額は1.2439円です。

## ○損益の状況 (2015年5月12日～2016年5月10日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	5,624,735,002	
受取配当金	5,554,570,420	
受取利息	9,926,919	
その他収益金	65,058,265	
支払利息	△ 4,820,602	
(B) 有価証券売買損益	△48,465,869,243	
売買益	10,531,425,228	
売買損	△58,997,294,471	
(C) 先物取引等取引損益	△ 669,146,971	
取引益	1,098,586,801	
取引損	△ 1,767,733,772	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△43,510,281,212	
(E) 前期繰越損益金	81,819,660,427	
(F) 追加信託差損益金	28,007,913,062	
(G) 解約差損益金	△11,507,255,573	
(H) 計(D+E+F+G)	54,810,036,704	
次期繰越損益金(H)	54,810,036,704	

\*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	円
	元本額	
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)	77,277,849,552	
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)	31,998,627,541	
マイバランス70(確定拠出年金向け)	17,327,003,764	
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,778,491,507	
野村世界6資産分散投信(成長コース)	9,260,029,578	
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	8,533,816,104	
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	7,641,562,531	
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)	6,463,310,792	
野村世界6資産分散投信(分配コース)	5,311,571,751	
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)	4,855,577,506	
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,313,238,920	
のむらップ・ファンド(普通型)	3,844,336,574	
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)	3,330,219,910	
マイバランスDC50	3,022,781,736	
マイ・ロード	2,939,611,705	
マイバランスDC70	2,740,408,083	
マイバランスDC30	2,320,362,707	
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)	2,320,011,299	
のむらップ・ファンド(保守型)	1,688,102,560	

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,580,532,805
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,523,794,516
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）	1,281,554,849
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）	1,260,205,192
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,248,594,557
のむらっぴ・ファンド（積極型）	1,228,404,374
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	972,383,375
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）	913,559,958
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）	710,209,195
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）	558,570,457
ノムラFOfs用インデックスファンド・TOPIX（適格機関投資家専用）	533,273,405
バランスセレクト70	530,861,503
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）	504,787,804
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	490,441,659
バランスセレクト50	469,388,376
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	468,696,415
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）	419,192,654
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	329,004,882
野村資産設計ファンド2040	314,083,726
バランスセレクト30	202,918,016
野村資産設計ファンド2025	134,620,850
野村資産設計ファンド2030	128,079,526
野村資産設計ファンド2020	109,239,024
野村資産設計ファンド2015	100,629,740
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	97,794,485
野村資産設計ファンド2035	93,518,788
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	91,136,796
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）	79,240,330
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）	48,290,202
野村DC運用戦略ファンド	45,415,062
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	39,785,596
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	39,678,696
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）	33,561,471
野村資産設計ファンド2045	30,204,723
ネクストコア	28,959,499
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）	19,426,085
野村資産設計ファンド2050	17,717,072
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）	15,307,770
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	10,136,612
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	7,217,593
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	1,503,377
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	988,801
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	783,143
野村DC運用戦略ファンドA	472,950
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	433,737
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	343,932
野村DC運用戦略ファンドM	314,962

## ○お知らせ

信託金限度額を、1兆円から2兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2016年4月15日＞

# 外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド

## 運用報告書

第14期（決算日2016年3月31日）

作成対象期間（2015年4月1日～2016年3月31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	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率	純資 産額
	騰落率	騰落率	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし)	騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
10期(2012年4月2日)	10,652	0.7	112.00	1.1	95.9	2.1	2.0	223,329
11期(2013年4月1日)	13,577	27.5	143.46	28.1	95.4	2.2	2.3	248,694
12期(2014年3月31日)	17,747	30.7	187.86	30.9	96.6	1.2	2.1	270,114
13期(2015年3月31日)	22,274	25.5	236.44	25.9	95.4	2.1	2.4	331,520
14期(2016年3月31日)	20,145	△9.6	214.69	△9.2	94.8	2.5	2.7	326,431

\*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	株式 先物比率	投資信託 証券 組入比率
	騰落率	騰落率	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし)	騰落率			
(期首)	円	%		%	%	%	%
2015年3月31日	22,274	—	236.44	—	95.4	2.1	2.4
4月末	22,487	1.0	239.12	1.1	96.1	1.4	2.3
5月末	23,500	5.5	249.44	5.5	95.8	1.7	2.3
6月末	22,572	1.3	239.69	1.4	95.9	1.8	2.3
7月末	23,208	4.2	246.51	4.3	95.2	2.4	2.3
8月末	21,367	△4.1	227.01	△4.0	95.6	1.9	2.4
9月末	19,912	△10.6	211.50	△10.6	95.7	1.6	2.5
10月末	22,085	△0.8	234.56	△0.8	95.1	1.4	2.5
11月末	22,329	0.2	237.53	0.5	96.0	1.4	2.5
12月末	21,802	△2.1	231.74	△2.0	95.4	1.9	2.5
2016年1月末	19,870	△10.8	211.35	△10.6	95.1	2.2	2.6
2月末	19,044	△14.5	202.69	△14.3	95.4	1.8	2.6
(期末)							
2016年3月31日	20,145	△9.6	214.69	△9.2	94.8	2.5	2.7

\*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22,274円から期末20,145円に2,129円の値下がりとなりました。

中国人民元の通貨切り下げをきっかけとした世界的な景気減速懸念や、原油価格の下落、米ドルが対円で下落（円高）したことを受けて、基準価額は下落しました。

## ○投資環境

期首より、米国の経済指標が改善し景気に対する不安感が後退したことや、ECB（欧州中央銀行）の金融緩和姿勢が維持されるとの見方が強まり、欧米の株式市場は上昇しました。

2015年6月以降は、米国の利上げに対する見方や、ギリシャの債務問題の進展状況などを巡り、一進一退の展開となり、8月に中国人民元の通貨切り下げをきっかけに世界的な景気減速懸念が高まり大幅な下落となりました。

10月になると、米企業業績が総じて市場予想を上回ったことや中国の追加金融緩和などを背景に上昇に転じましたが、12月には、ECBによる追加金融緩和が市場予想を下回る内容になったことや、原油など商品価格が一段と低下したことを受け、再び下落しました。さらに、2016年1月には、原油価格の下落が続いたことからリスク回避姿勢が強まり、世界の株式市場は大幅に下落しました。

2月中旬になると、原油価格が持ち直したことや市場予想を上回る米国経済指標の発表などを背景に上昇に転じました。その後も原油など商品価格の上昇やFOMC（米連邦公開市場委員会）声明で年内利上げペースの減速が示唆されたことなどを背景に世界の株式市場は上昇しました。

為替市場は、2015年5月中旬に米住宅着工件数が大幅に増加したことや、FRB（米連邦準備制度理事会）議長が年内の利上げ見通しを示したことから、米ドルは対円で上昇（円安）しました。その後、8月には、世界的な景気減速懸念からリスク回避姿勢が強まり、ドルが対円で下落（円高）しました。11月に入り、堅調な10月の米雇用統計などを受け米国の年内利上げ観測が高まり、米ドルは対円で上昇（円安）しましたが、12月以降は、原油価格や世界的な株式市場の下落を背景に、米ドルは対円で大幅に下落（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-9.6%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-9.2%を0.4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）

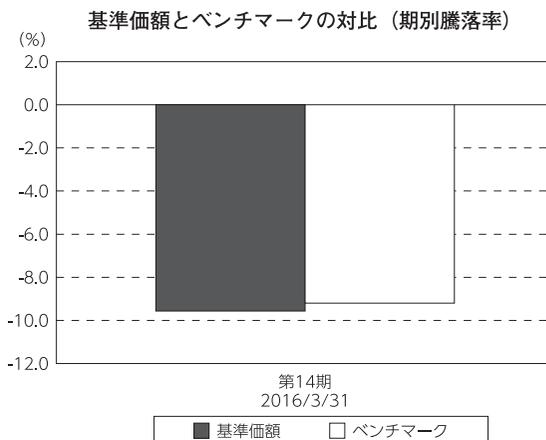
### （その他、差異を生じた要因）

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）

## ◎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めざ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。



（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。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年4月1日～2016年3月31日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 株 式 ) ( 投 資 信 託 証 券 ) ( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	円 1 (0) (0) (0)	% 0.003 (0.002) (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 ( 株 式 ) ( 投 資 信 託 証 券 )	2 (2) (0)	0.009 (0.008) (0.000)	(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
(c) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( そ の 他 )	3 (3) (1)	0.015 (0.012) (0.003)	(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
合 計	6	0.027	
期中の平均基準価額は、21,704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

(2015年4月1日～2016年3月31日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 46,798 ( 12,035)	千米ドル 258,494 ( 19,528)	百株 17,904 ( 7,363)	千米ドル 86,408 (40,011)
	カナダ	6,615 ( 147)	千カナダドル 21,160 ( -)	2,088 ( 1,096)	千カナダドル 4,816 ( 2,296)
	イギリス	44,656 ( 397,674)	千英ポンド 24,091 ( 2,909)	7,713 (399,897)	千英ポンド 4,875 ( 4,171)
	スイス	2,523 ( 1,497)	千スイスフラン 16,438 ( 126)	2,279 ( 68)	千スイスフラン 3,991 ( 1,211)
	スウェーデン	2,828 ( 2,366)	千スウェーデンクローナ 36,715 ( -)	1,893	千スウェーデンクローナ 11,250
	ノルウェー	840	千ノルウェークローネ 11,872	717	千ノルウェークローネ 5,366
	デンマーク	817 ( 76)	千デンマーククローネ 29,341 ( -)	175	千デンマーククローネ 7,217
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	3,415 ( 558)	13,785 ( 52)	1,233 ( -)	3,393 ( 318)
	イタリア	11,654 ( 6,214)	4,294 ( 733)	4,548 ( 4,249)	1,338 ( 557)
	フランス	3,932 (△ 2,598)	14,521 (△ 908)	912 ( -)	3,939 ( 121)
	オランダ	2,505 ( 1,585)	4,281 ( 982)	900 ( -)	1,162 ( 177)
	スペイン	7,892 ( 13,317)	5,042 ( 1,408)	4,241 ( 20,917)	1,227 ( 1,170)
	ベルギー	260 ( 55)	1,961 ( 41)	126 ( -)	507 ( 41)
オーストリア	61	194	851	306	
ルクセンブルグ	10	95	4 ( 78)	47 ( 796)	
フィンランド	1,538 ( 1,430)	1,577 ( 908)	314	285	
アイルランド	4,194	1,631	14	55	
ポルトガル	3,978	266	40	39	

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	香港	百株 11,943 ( 4,375)	千香港ドル 34,945 ( 27,763)	百株 1,738 ( 1,850)	千香港ドル 10,943 (27,763)
	シンガポール	4,653 ( 20)	千シンガポールドル 2,546 ( 46)	570 ( 10)	千シンガポールドル 526 ( 20)
	オーストラリア	15,420 ( 7,013)	千豪ドル 17,893 ( 1,384)	4,009 ( 785)	千豪ドル 3,468 ( 1,086)
	ニュージーランド	1,172 ( -)	千ニュージーランドドル 507 ( 50)	100	千ニュージーランドドル 33
	イスラエル	850	千新シエケル 5,257	21	千新シエケル 627

\*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。

## 投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	4,600	84	—	—
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	—	—	—	—
			( 81,000)	( 798)
AMERICAN TOWER CORP	6,200	580	1,400	135
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	11,000	104	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2,400	410	360	58
BOSTON PROPERTIES	1,720	201	300	37
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	17,300	429	—	—
CAMDEN PROPERTY TRUST	700	53	—	—
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	—	—	7,375	238
	( 7,375)	( —)		
COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC	—	—	10,200	192
	( 10,200)	( 288)		
CROWN CASTLE INTL CORP	5,100	428	1,600	134
DIGITAL REALTY TRUST INC	2,200	164	—	—
DUKE REALTY CORP	5,400	107	—	—
EQUINIX INC	1,916	546	220	56
	( 142)	( 42)		
EQUITY RESIDENTIAL	7,200	539	1,800	135
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1,140	250	240	52
EXTRA SPACE STORAGE INC	11,000	790	—	—
FEDERAL REALTY INVS TRUST	720	99	—	—
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	—	—	3,366	66
	( 3,366)	( 77)		
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	9,000	244	1,200	30
HCP INC	5,800	203	—	—
HEALTH CARE REIT INC	1,800	114	—	—
	(△ 32,100)	(△ 2,499)		
HOST HOTELS & RESORTS INC	11,600	186	3,600	62
IRON MOUNTAIN INC	4,200	142	—	—
KIMCO REALTY CORP	5,700	151	—	—
LIBERTY PROPERTY TRUST	2,500	76	—	—
MACERICH CO /THE	1,900	147	800	65
MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,200	664	—	—
PLUM CREEK TIMBER CO	2,500	102	900	45
			( 17,000)	( 738)
PROLOGIS INC	6,900	265	—	—
PUBLIC STORAGE	2,200	487	640	132
RAYONIER INC	—	—	11,800	304
REALTY INCOME CORP	5,800	301	1,300	64
REGENCY CENTERS CORP	800	47	—	—
SL GREEN REALTY CORP	1,600	175	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	3,150	585	330	67
UDR INC	3,100	102	—	—
VENTAS INC	4,000	230	600	31
VEREIT INC	7,000	53	—	—
	( 81,000)	( 798)		
VORNADO REALTY TRUST	1,700	151	—	—
WELLTOWER INC	2,400	154	—	—
	( 32,100)	( 2,499)		

銘	柄	買 付 額		売 付 額	
		口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ		口	千米ドル	口	千米ドル
	WEYERHAEUSER CO	4,300 ( 27,200)	111 ( 738)	1,400	45
小	計	173,746 ( 129,283)	9,490 ( 1,945)	49,431 ( 98,000)	1,958 ( 1,536)
カナダ			千カナダドル		千カナダドル
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	3,100	63	—	—
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,000	59	—	—
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,900	219	—	—
小	計	12,000	341	—	—
イギリス			千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND	10,000	77	—	—
	HAMMERSON PLC	6,000	37	—	—
	INTU PROPERTIES PLC	11,000	35	—	—
	LAND SECURITIES GROUP PLC	12,800	151	3,300	44
	SEGro PLC	17,000	72	7,000	29
小	計	56,800	373	10,300	74
ユーロ			千ユーロ		千ユーロ
フランス					
	KLEPIERRE	8,000	328	1,300	52
	GECINA SA	930	109	—	—
	FONCIERE DES REGIONS	600	46	( —)	( 3)
	UNIBAIL RODAMCO-NA	1,580	367	460	112
小	計	11,110	852	1,760 ( —)	165 ( 3)
ユ ー ロ 計		11,110	852	1,760 ( —)	165 ( 3)
香港			千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	19,000	808	—	—
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	260,000	1,584	—	—
小	計	279,000	2,392	—	—
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	30,000	63	—	—
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	26,000 ( —)	61 ( 0.47038)	( —)	(0.62559)
	ASCENDAS REAL ESTATE INV-RTS	— ( 7,012)	— ( 0.47038)	( —) ( 7,012)	— (0.47038)
	SUNTEC REIT	40,000	60	— ( —)	— ( 1)
小	計	96,000 ( 7,012)	185 ( 0.94076)	( —) ( 7,012)	— ( 2)
オーストラリア			千豪ドル		千豪ドル
	MIRVAC GROUP	40,000	69	26,000	52
	GPT GROUP	31,000	145	—	—
	LENLEASE GROUP	5,000	65	—	—
	STOCKLAND TRUST GROUP	33,000	135	—	—
	DEXUS PROPERTY GROUP	17,000	130	—	—
	GOODMAN GROUP	24,000	147	—	—
	FEDERATION CENTRES	23,000 ( 151,504)	68 ( 467)	— (306,704)	— ( 943)
	SCENTRE GROUP	100,000	400	39,000	154
	WESTFIELD CORP	21,600	212	—	—

銘柄	買付額		売付額		
	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
	NOVION PROPERTY GROUP	—	—	(184,200)	( 467)
	VICINITY CENTRES	22,000 ( 306,704)	69 ( 943)	—	—
小計	316,600 ( 458,208)	1,445 ( 1,411)	65,000 (490,904)	206 ( 1,411)	

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。ただし、数値が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 株式先物取引	百万円 61,434	百万円 59,941	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

(2015年4月1日～2016年3月31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	63,845,739千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	313,772,382千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

### ○利害関係人との取引状況等

(2015年4月1日～2016年3月31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 55,778	百万円 6,339	% 11.4	百万円 29,471	百万円 3,978	% 13.5
預金	9,673	9,673	100.0	8,694	8,694	100.0

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

(2016年3月31日現在)

## 外国株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ADT CORP/THE	158	158	652	73,528	商業サービス・用品
AFLAC INC	392	408	2,600	292,988	保険
AGCO CORP	78	63	323	36,480	機械
AGL RESOURCES INC	—	115	746	84,124	ガス
AES CORP	582	650	755	85,107	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AT & T INC	4,518	5,943	23,397	2,636,440	各種電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	1,314	1,440	5,997	675,809	ヘルスケア機器・用品
ABBVIE INC	1,390	1,576	8,983	1,012,226	バイオテクノロジー
ACTIVISION BLIZZARD INC	436	487	1,659	186,959	ソフトウェア
ACUITY BRANDS INC	—	41	902	101,657	電気設備
ADOBE SYSTEMS INC.	410	479	4,492	506,165	ソフトウェア
ADVANCE AUTO PARTS	63	71	1,171	131,959	専門小売り
AETNA INC	308	337	3,848	433,615	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP	48	52	847	95,536	資本市場
AGILENT TECHNOLOGIES INC	290	324	1,299	146,471	ライフサイエンス・ツール/サービス
AIR PRODUCTS	186	198	2,881	324,716	化学
AIRGAS INC	59	63	896	101,016	化学
AKAMAI TECHNOLOGIES	154	167	920	103,684	インターネットソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	96	111	710	80,035	化学
ALCOA INC	1,021	1,250	1,210	136,342	金属・鉱業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	171	218	2,941	331,478	バイオテクノロジー
ALLEGHANY CORP	14	15	742	83,673	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	55	58	1,267	142,842	情報技術サービス
ALLIANT ENERGY CORP	95	108	798	89,919	総合公益事業
ALLSTATE CORP	368	372	2,519	283,861	保険
ALLY FINANCIAL INC	381	421	767	86,479	消費者金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	—	72	425	47,931	バイオテクノロジー
ALPHABET INC-CL C	—	300	22,545	2,540,474	インターネットソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A	—	281	21,621	2,436,264	インターネットソフトウェア・サービス
ALTERA CORP.	257	—	—	—	半導体・半導体製造装置
ALTRIA GROUP INC	1,723	1,889	11,821	1,332,031	タバコ
AMAZON.COM INC	342	384	23,043	2,596,550	インターネット販売・カタログ販売
AMERCO	—	6	234	26,438	陸運・鉄道
AMEREN CORPORATION	206	231	1,149	129,494	総合公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	160	154	637	71,805	旅客航空輸送業
AMERICAN ELECTRIC POWER	424	475	3,135	353,358	電力
AMERICAN EXPRESS CO	813	811	4,889	550,951	消費者金融
AMERICAN INTL GROUP	1,221	1,194	6,509	733,511	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	154	171	1,173	132,199	水道
AMERISOURCEBERGEN CORP	192	188	1,637	184,490	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	162	168	1,605	180,916	資本市場
AMETEK INC	213	233	1,172	132,112	電気設備
AMGEN INC	663	726	10,865	1,224,347	バイオテクノロジー
AMPHENOL CORP-CL A	263	296	1,708	192,481	電子装置・機器・部品
ANADARKO PETE	438	495	2,296	258,747	石油・ガス・消耗燃料
ANALOG DEVICES INC	270	304	1,796	202,479	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC	78	84	743	83,832	ソフトウェア
ANTERO RESOURCES CORP	41	74	184	20,754	石油・ガス・消耗燃料

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	
ANTHEM INC	236	252	3,534	398,238	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
APACHE CORPORATION	321	369	1,794	202,239	石油・ガス・消耗燃料
APPLE INC	5,102	5,382	58,965	6,644,197	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS	1,058	1,145	2,409	271,455	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	—	216	712	80,269	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND	565	582	2,131	240,153	食品
ARROW ELECTRS INC	83	93	592	66,815	電子装置・機器・部品
ASHLAND INC	55	59	652	73,568	化学
ASSURANT INC	62	62	485	54,743	保険
ATMOS ENERGY CORP	—	97	718	80,936	ガス
AUTODESK INC.	196	220	1,273	143,531	ソフトウェア
AUTOLIV INC	81	85	1,007	113,573	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS	422	444	3,958	446,016	情報技術サービス
AUTONATION INC	62	71	340	38,377	専門小売り
AUTOZONE	27	29	2,359	265,858	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	83	91	658	74,238	容器・包装
AVNET	118	122	539	60,816	電子装置・機器・部品
AVON PRODUCTS INC	378	—	—	—	パーソナル用品
BB&T CORPORATION	622	759	2,544	286,762	銀行
BAKER HUGHES	380	424	1,838	207,205	エネルギー設備・サービス
BALL CORP	109	124	879	99,063	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP	9,160	10,030	13,520	1,523,483	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	984	1,060	3,936	443,603	資本市場
BARD (C R)	65	70	1,426	160,709	ヘルスケア機器・用品
BAXALTA INC	—	657	2,637	297,233	バイオテクノロジー
BAXTER INTERNATIONAL INC.	472	529	2,182	245,941	ヘルスケア機器・用品
B/E AEROSPACE INC	90	101	470	52,999	航空宇宙・防衛
BECTON, DICKINSON	179	204	3,113	350,811	ヘルスケア機器・用品
BED BATH & BEYOND	157	156	773	87,169	専門小売り
WR BERKLEY CORP	98	99	555	62,637	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,006	1,146	16,325	1,839,604	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	264	305	962	108,497	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	136	153	1,194	134,644	バイオテクノロジー
BIOGEN INC	205	215	5,469	616,354	バイオテクノロジー
BLACKROCK INC	114	119	4,062	457,740	資本市場
H & R BLOCK INC	234	224	591	66,659	各種消費者サービス
BOEING CO	590	614	7,894	889,587	航空宇宙・防衛
BORGWARNER INC	195	213	807	91,011	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,147	1,306	2,457	276,955	ヘルスケア機器・用品
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,446	1,608	10,201	1,149,465	医薬品
BROADCOM CORP-CL A	469	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP-CL B	107	110	1,083	122,125	飲料
CBS CORP-CL B	421	414	2,260	254,753	メディア
CBRE GROUP INC	260	296	849	95,690	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC	—	128	597	67,370	ソフトウェア
CDW CORPORATION	—	141	585	65,950	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	43	229	732	82,520	化学
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	128	137	1,021	115,084	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP	229	249	3,425	385,985	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CIT GROUP INC	164	166	531	59,911	銀行
CME GROUP INC	276	312	2,981	335,987	各種金融サービス
CMS ENERGY CORP	237	273	1,152	129,875	総合公益事業
CSX CORP	872	932	2,451	276,196	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	999	1,067	11,102	1,250,988	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額		外貨建金額	邦貨換算金額	
			千株	千株			
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円			
CA INC	289	309	954	107,553			ソフトウェア
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	167	193	636	71,765			メディア
CABOT OIL & GAS CORP	349	436	990	111,570			石油・ガス・消耗燃料
CALPINE CORP	275	310	457	51,592			独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CAMERON INTERNATIONAL CORP	178	182	1,231	138,796			エネルギー設備・サービス
CAMPBELL SOUP CO	181	175	1,122	126,517			食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	486	517	3,575	402,837			消費者金融
CARDINAL HEALTH INC	290	317	2,592	292,114			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARMAX INC	182	193	980	110,497			専門小売り
CARNIVAL CORP	329	403	2,110	237,812			ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC DEL	503	563	4,307	485,370			機械
CELANESE CORP-SERIES A	129	143	944	106,395			化学
CELGENE CORP	696	760	7,508	846,091			バイオテクノロジー
CENTENE CORP	—	161	1,005	113,311			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	345	389	811	91,390			総合公益事業
CENTURYLINK INC	500	530	1,689	190,328			各種電気通信サービス
CERNER CORP	266	293	1,544	174,056			ヘルスケア・テクノロジー
CHARTER COMMUNICATION-A	66	82	1,677	188,964			メディア
CHENIERE ENERGY INC	197	220	741	83,565			石油・ガス・消耗燃料
CHESAPEAKE ENERGY CORP	463	—	—	—			石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP	1,646	1,819	17,325	1,952,290			石油・ガス・消耗燃料
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	84	84	312	35,210			建設・土木
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	26	30	1,421	160,203			ホテル・レストラン・レジャー
CHUBB CORP	207	—	—	—			保険
CHURCH & DWIGHT CO INC	117	128	1,179	132,865			家庭用品
CIMAREX ENERGY CO	75	90	869	97,923			石油・ガス・消耗燃料
CINCINNATI FINANCIAL CORP	137	147	968	109,106			保険
CISCO SYSTEMS	4,455	4,890	13,916	1,568,160			通信機器
CINTAS CORP	89	91	816	92,008			商業サービス・用品
CITIGROUP	2,639	2,870	12,019	1,354,364			銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	—	501	1,064	119,961			銀行
CITRIX SYSTEMS INC	143	149	1,159	130,604			ソフトウェア
CLOROX CO	112	126	1,612	181,687			家庭用品
COACH INC	243	265	1,068	120,396			繊維・アパレル・贅沢品
COBALT INTERNATIONAL ENERGY	236	—	—	—			石油・ガス・消耗燃料
COCA COLA CO	3,434	3,992	18,594	2,095,254			飲料
COCA COLA ENTERPRISES	193	207	1,057	119,166			飲料
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	527	588	3,672	413,767			情報技術サービス
COLGATE PALMOLIVE CO.	796	825	5,834	657,420			家庭用品
COLUMBIA PIPELINE GROUP	—	370	929	104,770			石油・ガス・消耗燃料
COMCAST CORP-CL A	1,874	2,392	14,543	1,638,745			メディア
COMCAST CORP SPECIAL CL-A	366	—	—	—			メディア
COMERICA INC	159	173	661	74,524			銀行
COMPUTER SCIENCE	118	—	—	—			情報技術サービス
CONAGRA INC	367	412	1,851	208,676			食品
CONCHO RESOURCES INC	102	123	1,253	141,299			石油・ガス・消耗燃料
CONOCOPHILLIPS	1,074	1,194	4,785	539,235			石油・ガス・消耗燃料
CONSOL ENERGY INC	198	—	—	—			石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC	251	286	2,187	246,468			総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	147	168	2,546	286,982			飲料
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	80	80	238	26,817			石油・ガス・消耗燃料
THE COOPER COMPANIES, INC.	41	47	733	82,643			ヘルスケア機器・用品
CORNING INC	1,120	1,138	2,371	267,230			電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	382	423	6,675	752,244			食品・生活必需品小売り

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	
CREE INC	107	—	—	—	半導体・半導体製造装置
CROWN HOLDINGS INC	121	133	659	74,332	容器・包装
CUMMINS INC	148	161	1,759	198,304	機械
DR HORTON INC	281	317	956	107,765	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	151	170	1,542	173,779	総合公益事業
DANAHER CORP	549	595	5,654	637,124	コングロマリット
DARDEN RESTAURANTS INC	113	109	725	81,774	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	149	160	1,168	131,664	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY	297	303	2,427	273,546	機械
DELTA AIR LINES INC	179	191	942	106,167	旅客航空輸送業
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	124	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
DENTSPLY SIRONA INC	—	229	1,421	160,137	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	337	434	1,137	128,126	石油・ガス・消耗燃料
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	65	—	—	—	エネルギー設備・サービス
DICK S SPORTING GOODS INC	88	83	390	43,947	専門小売り
DISNEY (WALT) CO	1,403	1,513	14,965	1,686,265	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	398	417	2,095	236,159	消費者金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	125	143	401	45,262	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	228	265	705	79,547	メディア
DISH NETWORK CORP-A	189	220	1,042	117,428	メディア
DIRECTV	413	—	—	—	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	266	281	2,420	272,745	複合小売り
DOLLAR TREE INC	179	213	1,772	199,686	複合小売り
DOMINION RESOURCES INC/VA	504	572	4,275	481,785	総合公益事業
DOVER CORP	145	153	984	110,905	機械
DOW CHEM CO	1,029	1,080	5,559	626,482	化学
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	166	181	1,627	183,433	飲料
DU PONT E I DE NEMOURS	791	846	5,428	611,715	化学
DUKE ENERGY CORP	618	661	5,311	598,458	電力
DUN & BRADSTREET CORP	31	36	372	41,992	専門サービス
EMC CORP	1,777	1,873	5,000	563,502	コンピュータ・周辺機器
EOG RESOURCES INC	474	532	3,918	441,560	石油・ガス・消耗燃料
EQT CORP	134	150	994	112,110	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	—	291	717	80,859	資本市場
EASTMAN CHEMICAL CO.	125	142	1,040	117,236	化学
EATON VANCE CORP	100	117	389	43,914	資本市場
EBAY INC	976	1,041	2,502	281,988	インターネットソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	236	256	2,877	324,287	化学
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	—	61	493	55,592	パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	269	318	2,276	256,558	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	92	211	1,875	211,340	ヘルスケア機器・用品
ELECTRONIC ARTS	264	296	1,965	221,499	ソフトウェア
EMERSON ELEC	607	634	3,459	389,771	電気設備
ENERGEN CORP	60	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ENERGIZER HOLDINGS INC	55	—	—	—	家庭用品
ENTERGY CORP	159	174	1,378	155,340	電力
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	—	188	384	43,363	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EQUIFAX INC	106	113	1,287	145,027	専門サービス
EVERSOURCE ENERGY	278	309	1,804	203,303	電力
EXELON CORPORATION	745	894	3,167	356,907	電力
EXPEDIA INC	899	117	1,261	142,118	インターネット販売・カタログ販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	173	183	891	100,442	航空貨物・物流サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	641	650	4,488	505,736	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EXXON MOBIL CORP	3,685	4,020	33,977	3,828,532	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	期首(前期末)		当期		期末		業種等
	株数	株数	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
(アメリカ)	百株	百株	千円ドル	千円			
FLIR SYSTEMS INC	126	126	425	47,959			電子装置・機器・部品
FMC CORP	118	132	544	61,398			化学
FMC TECHNOLOGIES INC	210	225	609	68,681			エネルギー設備・サービス
FACEBOOK INC-A	1,743	2,193	25,153	2,834,320			インターネットソフトウェア・サービス
FAMILY DOLLAR STORES	90	—	—	—			複合小売り
FASTENAL CO	247	262	1,281	144,451			商社・流通業
FEDEX CORPORATION	233	259	4,192	472,438			航空貨物・物流サービス
F5 NETWORKS INC	65	70	738	83,190			通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	241	269	1,699	191,504			情報技術サービス
FNF GROUP	211	244	829	93,424			保険
FIFTH THIRD BANCORP	699	767	1,293	145,799			銀行
FIREEYE INC	70	—	—	—			ソフトウェア
FIRST REPUBLIC BANK/CA	114	137	918	103,459			銀行
FISERV INC	214	219	2,235	251,901			情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	366	403	1,442	162,522			電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	66	74	1,093	123,207			情報技術サービス
FLUOR CORP	138	139	755	85,141			建設・土木
FLOWSERVE CORP	123	123	541	61,037			機械
FOOT LOCKER INC	123	134	880	99,261			専門小売り
FORD MOTOR COMPANY	3,135	3,580	4,779	538,531			自動車
FORTINET INC	—	139	408	46,047			ソフトウェア
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	—	158	881	99,343			建設関連製品
FOSSIL GROUP INC	41	—	—	—			繊維・アパレル・贅沢品
FRANKLIN RESOURCES INC	352	378	1,479	166,709			資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC	885	1,100	1,131	127,542			金属・鉱業
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	830	1,140	641	72,320			各種電気通信サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	168	745	83,993			保険
GAMESTOP CORP-CLASS A	100	100	317	35,787			専門小売り
GAP INC	212	229	679	76,533			専門小売り
GARTNER INC	—	81	715	80,592			情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS	246	257	3,389	381,919			航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	8,742	9,115	29,013	3,269,189			コングロマリット
GENERAL MILLS	529	578	3,659	412,331			食品
GENERAL MOTORS CO	1,111	1,367	4,236	477,350			自動車
GENUINE PARTS CO	129	148	1,466	165,298			販売
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	413	—	—	—			保険
GILEAD SCIENCES INC	1,314	1,388	12,765	1,438,409			バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	—	124	778	87,718			情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	342	370	5,799	653,531			資本市場
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	—	252	825	93,051			自動車部品
GOOGLE INC-CL A	248	—	—	—			インターネットソフトウェア・サービス
GOOGLE INC-CL C	251	—	—	—			インターネットソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO	—	67	479	54,039			化学
GRAINGER(W.W.) INC	53	54	1,279	144,183			商社・流通業
HCA HOLDINGS INC	262	313	2,444	275,449			ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HP INC	—	1,740	2,140	241,157			コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	734	832	2,996	337,686			エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC	340	377	1,073	120,984			繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC	181	188	930	104,817			自動車
HARMAN INTERNATIONAL	—	70	609	68,630			家庭用耐久財
HARRIS CORP	92	119	936	105,541			通信機器
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	367	394	1,824	205,597			保険
HASBRO INC	94	108	848	95,590			レジャー用品
HELMERICH & PAYNE	91	106	618	69,645			エネルギー設備・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	
HERSHEY CO/THE	133	143	1,313	148,000	食品
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	387	346	354	39,922	陸運・鉄道
HESS CORP	229	275	1,401	157,940	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD CO	1,630	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	—	1,752	3,134	353,176	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	343	486	1,104	124,475	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	166	166	570	64,326	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	199	231	796	89,800	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT	1,148	1,225	16,343	1,841,636	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL	649	706	7,919	892,335	航空宇宙・防衛
HORMEL FOODS CORP	121	276	1,213	136,683	食品
HOSPIRA INC	148	—	—	—	医薬品
HUDSON CITY BANCORP INC	390	—	—	—	貯蓄・抵当・不動産金融
HUMANA INC	134	143	2,656	299,376	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	80	87	732	82,483	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	700	750	719	81,045	銀行
IMS HEALTH HOLDINGS INC	—	163	424	47,808	ヘルスケア・テクノロジー
IHS INC-CLASS A	57	66	815	91,867	専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	325	317	3,253	366,589	機械
ILLUMINA INC	122	142	2,246	253,138	ライフサイエンス・ツール/サービス
INCYTE CORP	130	160	1,093	123,226	バイオテクノロジー
INTEL CORP	4,212	4,561	14,919	1,681,076	半導体・半導体製造装置
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	70	—	—	—	総合公益事業
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	98	114	2,670	300,884	各種金融サービス
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	819	888	13,178	1,484,988	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	68	77	882	99,413	化学
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	343	376	1,541	173,707	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP	369	392	896	101,062	メディア
INTUIT INC	233	241	2,486	280,194	ソフトウェア
INTUITIVE SURGICAL INC	31	35	2,129	239,994	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	121	467	52,669	バイオテクノロジー
ISIS PHARMACEUTICALS INC	99	—	—	—	バイオテクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	3,255	3,566	21,232	2,392,520	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	120	123	538	60,663	建設・土木
JARDEN CORP	156	200	1,177	132,646	家庭用耐久財
JOHNSON & JOHNSON	2,437	2,672	29,119	3,281,180	医薬品
JOHNSON CONTROLS INC	584	619	2,406	271,183	自動車部品
JONES LANG LASALLE INC	—	42	487	54,881	不動産管理・開発
JOY GLOBAL INC	91	—	—	—	機械
JUNIPER NETWORKS INC	327	335	854	96,294	通信機器
KLA TENCOR CORP	142	150	1,088	122,640	半導体・半導体製造装置
KANSAS CITY SOUTHERN	97	108	926	104,413	陸運・鉄道
KELLOGG CO	235	257	1,974	222,490	食品
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	106	—	—	—	食品
KEYCORP	765	810	903	101,766	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	324	351	4,763	536,742	家庭用品
KINDER MORGAN INC	1,571	1,836	3,279	369,488	石油・ガス・消耗燃料
KOHL'S CORP	173	191	879	99,108	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE	—	586	4,623	520,980	食品
KRAFT FOODS GROUP INC	516	—	—	—	食品
KROGER CO	403	890	3,390	381,986	食品・生活必需品小売り
L BRANDS, INC	212	240	2,120	238,980	専門小売り
LKQ CORP	263	300	933	105,198	販売
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	75	77	924	104,124	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	87	99	1,166	131,465	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH	140	154	1,265	142,622	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	342	379	1,979	223,051	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	204	216	2,039	229,807	パーソナル用品
LEAR CORP	—	74	826	93,097	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	123	134	642	72,400	家庭用耐久財
LEGG MASON INC	92	92	318	35,899	資本市場
LENNAR CORP-A	156	168	803	90,505	家庭用耐久財
LEUCADIA NATIONAL CORP	272	322	512	57,798	各種金融サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	248	290	1,532	172,666	各種電気通信サービス
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	378	436	1,099	123,852	インターネット販売・カタログ販売
LIBERTY MEDIA CORP-A	81	81	315	35,562	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-C	179	193	729	82,226	メディア
ELI LILLY & CO.	875	965	6,926	780,508	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	223	239	955	107,641	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP	213	225	1,007	113,530	半導体・半導体製造装置
LINKEDIN CORP - A	95	113	1,286	144,937	インターネットソフトウェア・サービス
LOCKHEED MARTIN	234	267	5,973	673,048	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	295	269	1,036	116,848	保険
LORILLARD INC	315	—	—	—	タバコ
LOWES COS INC	861	885	6,727	758,085	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	98	106	718	80,980	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP	102	141	1,578	177,896	銀行
MDU RESOURCES GROUP INC	151	—	—	—	総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	336	423	900	101,475	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	—	93	680	76,655	各種金融サービス
MACYS INC	295	304	1,340	151,063	複合小売り
MANPOWERGROUP INC	70	70	566	63,858	専門サービス
MARATHON OIL CORP	593	794	836	94,209	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	246	508	1,858	209,389	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	—	13	1,209	136,306	保険
MARSH & MCLENNAN COS	472	501	3,043	342,893	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	193	199	1,423	160,438	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	51	55	851	95,954	建設資材
MASCO CORP	310	329	1,039	117,146	建設関連製品
MASTERCARD INC-CLASS A	873	955	8,958	1,009,483	情報技術サービス
MATTEL INC	301	334	1,121	126,416	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	239	271	990	111,579	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	101	113	1,127	127,010	食品
MCDONALD'S CORP	849	885	11,135	1,254,799	ホテル・レストラン・レジャー
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	237	258	2,552	287,632	各種金融サービス
MCKESSON CORP	202	221	3,492	393,494	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	173	192	1,631	183,872	食品
MEADWESTVACO CORP	140	—	—	—	容器・包装
MEDIVATION INC	66	154	575	64,881	バイオテクノロジー
MEDNAX INC	—	91	594	66,998	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	—	104	176	19,863	ホテル・レストラン・レジャー
MERCK & CO INC	2,483	2,691	14,321	1,613,746	医薬品
METLIFE INC	838	914	4,088	460,672	保険
METTLER-TOLEDO INTL	25	27	926	104,425	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP	6,816	7,327	40,335	4,544,963	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	178	198	967	108,965	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	924	1,031	1,080	121,749	半導体・半導体製造装置
MOHAWK INDUSTRIES	54	60	1,150	129,643	家庭用耐久財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MOLSON COORS BREWING CO-B	135	180	1,729	194,853	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,467	1,533	6,202	698,899	食品
MONSANTO CO	423	427	3,889	438,273	化学
MONSTER BEVERAGE CORP	122	—	—	—	飲料
MONSTER BEVERAGE CORP	—	137	1,852	208,703	飲料
MOODYS CORP	165	169	1,620	182,545	各種金融サービス
MORGAN STANLEY	1,283	1,397	3,502	394,636	資本市場
MOSAIC CO/THE	281	313	880	99,175	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	197	151	1,130	127,422	通信機器
MURPHY OIL CORP	150	150	366	41,274	石油・ガス・消耗燃料
NRG ENERGY INC	294	294	380	42,867	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NASDAQ INC	101	111	723	81,511	各種金融サービス
NATIONAL OILWELL VARCO INC	367	366	1,138	128,259	エネルギー設備・サービス
NAVIENT CORP	371	339	405	45,723	消費者金融
NETAPP INC	263	279	743	83,812	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	49	391	3,995	450,227	インターネット販売・カタログ販売
NETSUITE INC	28	39	262	29,619	ソフトウェア
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	560	341	38,428	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON	—	234	1,315	148,235	コングロマリット
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	399	471	751	84,703	貯蓄・抵当・不動産金融
NEWELL RUBBERMAID INC	241	255	1,131	127,490	家庭用耐久財
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	424	517	1,382	155,833	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	336	374	476	53,731	メディア
NEXTERA ENERGY INC	378	445	5,273	594,189	電力
NIKE INC-B	597	1,312	8,139	917,175	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	273	—	—	—	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC	333	411	1,265	142,546	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	120	137	787	88,763	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	270	287	2,432	274,074	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	197	214	1,401	157,895	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	168	166	3,298	371,722	航空宇宙・防衛
NUANCE COMMUNICATIONS INC	209	250	461	51,945	ソフトウェア
NUCOR CORP	281	307	1,483	167,117	金属・鉱業
NVIDIA CORP	480	526	1,880	211,948	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	166	196	560	63,141	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	86	96	2,655	299,249	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	681	738	5,062	570,462	石油・ガス・消耗燃料
OCEANEERING INTL INC	94	95	310	35,025	エネルギー設備・サービス
OMNICARE INC	86	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
OMNICOM GROUP	211	231	1,924	216,874	メディア
ONEOK INC	183	198	574	64,790	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,088	3,082	12,626	1,422,805	ソフトウェア
OWENS-ILLINOIS INC	140	—	—	—	容器・包装
PG&E CORP	407	473	2,811	316,801	総合公益事業
PNC FINANCIAL	460	487	4,156	468,359	銀行
PPG INDUSTRIES	119	258	2,887	325,309	化学
PPL CORPORATION	567	654	2,465	277,821	電力
PVH CORP	71	82	811	91,399	繊維・アパレル・贅沢品
PACCAR	306	345	1,882	212,138	機械
PACKAGING CORP OP AMERICA	—	89	529	59,609	容器・包装
PALL CORP	90	—	—	—	機械
PALO ALTO NETWORKS INC	58	77	1,248	140,730	通信機器
PARKER HANNIFIN CORP	127	132	1,465	165,083	機械
PATTERSON COS INC	75	87	402	45,398	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・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	
PAYCHEX INC	288	317	1,689	190,349	情報技術サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	—	1,057	4,126	464,977	情報技術サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	270	305	490	55,297	銀行
PEPCO HOLDINGS INC	227	—	—	—	電力
PEPSICO INC	1,304	1,408	14,458	1,629,212	飲料
PHARMACYCLICS INC	56	—	—	—	バイオテクノロジー
PFIZER INC	5,486	5,965	17,936	2,021,113	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,354	1,497	14,773	1,664,722	タバコ
PHILLIPS 66	484	517	4,529	510,435	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	98	105	784	88,368	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	128	156	2,190	246,813	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	—	190	156	17,641	石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INDUSTRIES INC	56	62	602	67,940	レジャー用品
PRAXAIR INC	253	276	3,174	357,646	化学
PRECISION CASTPARTS CORP	123	—	—	—	航空宇宙・防衛
T ROWE PRICE GROUP INC	221	240	1,773	199,849	資本市場
PRICELINE GROUP INC/THE	45	48	6,321	712,334	インターネット販売・カタログ販売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	256	280	1,113	125,475	保険
PROCTER & GAMBLE CO	2,353	2,628	21,728	2,448,345	家庭用品
PROGRESSIVE CO	477	569	1,993	224,594	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	397	435	3,173	357,570	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE	431	493	2,294	258,535	総合公益事業
PULTEGROUP INC	295	295	543	61,195	家庭用耐久財
QEP RESOURCES INC	147	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
QORVO INC	125	139	712	80,239	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,449	1,450	7,393	833,105	通信機器
QUANTA SERVICES INC	186	163	368	41,545	建設・土木
QUEST DIAGNOSTICS INC	126	141	1,018	114,805	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	58	88	569	64,155	ライフサイエンス・ツール/サービス
RACKSPACE HOSTING INC	110	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス
RALPH LAUREN CORPORATION	52	58	562	63,341	繊維・アパレル・贅沢品
RANGE RESOURCES CORP	143	167	540	60,893	石油・ガス・消耗燃料
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	111	120	573	64,565	資本市場
RAYTHEON COMPANY	270	291	3,601	405,807	航空宇宙・防衛
REALOGY HOLDINGS CORP	130	140	495	55,796	不動産管理・開発
RED HAT INC	167	178	1,317	148,502	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS	69	74	2,679	301,939	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1,200	1,260	995	112,161	銀行
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	252	229	1,107	124,760	商業サービス・用品
RESMED INC	122	132	750	84,616	ヘルスケア機器・用品
REYNOLDS AMERICAN INC	276	825	4,164	469,267	タバコ
RITE AID CORP	—	1,000	811	91,383	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	121	133	609	68,712	専門サービス
ROCK-TENN COMPANY CL-A	118	—	—	—	容器・包装
ROCKWELL AUTOMATION INC	119	129	1,475	166,215	電気設備
ROCKWELL COLLINS INC	105	128	1,184	133,427	航空宇宙・防衛
ROPER TECHNOLOGIES INC	86	96	1,747	196,885	コングロマリット
ROSS STORES INC	184	394	2,298	259,005	専門小売り
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	114	121	1,209	136,288	各種電気通信サービス
SEI INVESTMENTS COMPANY	129	129	552	62,227	資本市場
SPX CORP	33	—	—	—	機械
SABRE CORP	—	200	571	64,407	情報技術サービス
ST JUDE MEDICAL INC	250	270	1,486	167,481	ヘルスケア機器・用品
SALESFORCE.COM INC	517	610	4,532	510,699	ソフトウェア

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	
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	55	—	—	—	医薬品
SAN DISK CORPORATION	187	194	1,473	166,026	コンピュータ・周辺機器
SCANA CORP	113	131	910	102,589	総合公益事業
HENRY SCHEIN INC	74	80	1,393	157,000	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,122	1,220	9,078	1,022,911	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,024	1,148	3,233	364,397	資本市場
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	71	71	460	51,865	メディア
SEALED AIR CORP	179	192	922	103,910	容器・包装
SEMPRA ENERGY	202	230	2,379	268,156	総合公益事業
SERVICENOW INC	113	143	873	98,403	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS	69	76	2,187	246,461	化学
SIGMA-ALDRICH	103	—	—	—	化学
SIGNATURE BANK	—	48	676	76,181	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,070	2,040	807	91,027	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	162	182	1,416	159,652	半導体・半導体製造装置
JM SMUCKER CO/THE-NEW	87	112	1,458	164,289	食品
SNAP-ON INC	49	54	865	97,539	機械
SOUTHERN CO.	780	874	4,475	504,327	電力
SOUTHWEST AIRLINES	153	153	688	77,545	旅客航空輸送業
SOUTHWESTERN ENERGY CO	336	400	308	34,705	石油・ガス・消耗燃料
SPECTRA ENERGY CORP	581	653	1,994	224,787	石油・ガス・消耗燃料
SPLUNK INC	—	128	622	70,095	ソフトウェア
SPRINT CORP	650	710	244	27,600	無線通信サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	127	145	1,524	171,833	機械
STAPLES INC	550	620	682	76,917	専門小売り
STARBUCKS CORP	653	1,437	8,623	971,688	ホテル・レストラン・レジャー
STARWOOD HOTELS & RESORTS	151	162	1,355	152,714	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	366	393	2,299	259,145	資本市場
STERICYCLE INC	75	81	1,018	114,709	商業サービス・用品
STRYKER CORP	297	329	3,521	396,852	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.	444	496	1,809	203,939	銀行
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	132	—	—	—	エネルギー設備・サービス
SYMANTEC CORP	601	652	1,198	135,033	ソフトウェア
SYNOPSIS INC	131	149	717	80,806	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	143	805	2,284	257,427	消費者金融
SYSCO CORP	506	542	2,527	284,781	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	240	254	803	90,498	資本市場
TECO ENERGY INC	—	224	616	69,486	総合公益事業
TJX COS INC	600	643	5,059	570,062	専門小売り
T-MOBILE US INC	205	271	1,041	117,381	無線通信サービス
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	98	—	—	—	自動車部品
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	49	222	25,044	ソフトウェア
TARGET CORP	528	567	4,740	534,116	複合小売り
TEGNA INC	—	206	488	55,012	メディア
TERADATA CORP	139	132	344	38,835	情報技術サービス
TESORO CORP	106	113	977	110,100	石油・ガス・消耗燃料
TESLA MOTORS INC	77	93	2,121	239,041	自動車
TEXAS INSTRUMENTS INC	922	980	5,720	644,558	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	233	264	958	108,042	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	350	386	5,444	613,469	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	530	593	9,896	1,115,150	コングロマリット
TIFFANY & CO	112	127	921	103,878	専門小売り
TIME WARNER INC	732	772	5,570	627,712	メディア
TIME WARNER CABLE-A	242	273	5,628	634,203	メディア

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	
TOLL BROTHERS INC	147	164	476	53,664	家庭用耐久財
TORCHMARK CORP	112	122	668	75,333	保険
TOWERS WATSON & CO-CL A	63	—	—	—	専門サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	138	163	762	85,864	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	118	132	1,197	134,905	専門小売り
TRANSIDGM GROUP INC	43	52	1,156	130,356	航空宇宙・防衛
TRAVELERS COS INC/THE	290	295	3,464	390,344	保険
TRIMBLE NAVIGATION LTD	232	232	574	64,779	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	103	115	765	86,275	インターネット販売・カタログ販売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,187	1,122	3,131	352,857	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	379	428	1,206	136,000	メディア
TWITTER INC	328	567	927	104,523	インターネットソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	266	285	1,925	216,960	食品
US BANCORP	1,561	1,688	6,919	779,645	銀行
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	53	59	1,153	129,921	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	144	171	1,464	165,013	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP	775	824	6,638	747,986	陸運・鉄道
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	83	93	556	62,686	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	613	674	7,126	802,980	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC	86	86	539	60,846	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES	755	815	8,170	920,637	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	43	477	53,764	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC	837	918	11,904	1,341,413	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	79	87	1,090	122,863	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP	227	227	710	80,034	保険
URBAN OUTFITTERS INC	96	—	—	—	専門小売り
V F CORP	298	331	2,159	243,326	繊維・アパレル・贅沢品
VALERO ENERGY CORP	457	462	2,955	333,068	石油・ガス・消耗燃料
VANTIV INC - CL A	127	151	813	91,658	情報技術サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	88	95	758	85,422	ヘルスケア機器・用品
VERISIGN INC	96	99	886	99,940	インターネットソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	3,614	3,931	21,243	2,393,675	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	130	152	1,196	134,843	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	211	240	1,881	212,018	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B	307	341	1,367	154,118	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	1,718	1,875	14,396	1,622,169	情報技術サービス
VMWARE INC - CLASS A	74	74	385	43,434	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	198	211	644	72,586	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	117	128	1,350	152,148	建設資材
WABCO HOLDINGS INC	—	52	552	62,249	機械
WEC ENERGY GROUP INC	—	302	1,800	202,849	総合公益事業
WABTEC CORP	82	94	744	83,898	機械
WAL-MART STORES INC	1,404	1,545	10,629	1,197,743	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	761	843	7,050	794,395	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	—	117	755	85,113	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC	381	428	2,552	287,577	商業サービス・用品
WATERS CORP	73	80	1,057	119,134	ライフサイエンス・ツール/サービス
WELLS FARGO CO	4,290	4,687	22,802	2,569,358	銀行
WESTERN DIGITAL CORP	192	220	1,015	114,379	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	463	491	949	106,944	情報技術サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	41	41	192	21,676	化学
WESTROCK CO	—	243	929	104,733	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	68	76	1,358	153,075	家庭用耐久財
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	—	175	706	79,585	食品

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
WHITING PETROLEUM CORP	178	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
WHOLE FOODS MARKET INC	306	332	1,058	119,224	食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS	622	695	1,088	122,637	石油・ガス・消耗燃料
WINDSTREAM HOLDINGS INC	510	—	—	—	各種電気通信サービス
WISCONSIN ENERGY CORP	196	—	—	—	総合公益事業
WORKDAY INC-CLASS A	83	107	814	91,800	ソフトウェア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	110	109	832	93,847	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN RESORTS LTD	69	77	723	81,549	ホテル・レストラン・レジャー
XCEL ENERGY INC	437	483	2,007	226,187	電力
XILINX INC	229	250	1,196	134,849	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	956	890	963	108,608	情報技術サービス
XYLEM INC	154	170	697	78,614	機械
YAHOO! INC	788	869	3,177	357,991	インターネットソフトウェア・サービス
YUM BRANDS INC	383	415	3,413	384,619	ホテル・レストラン・レジャー
ZILLOW GROUP INC - A	43	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	—	86	198	22,336	インターネットソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	147	184	1,963	221,222	ヘルスケア機器・用品
ZOETIS INC	439	460	2,024	228,167	医薬品
ACTAVIS PLC	327	—	—	—	医薬品
ALKERMES PLC	123	138	444	50,086	バイオテクノロジー
ALLERGAN PLC	—	379	10,442	1,176,629	医薬品
AON PLC	238	263	2,734	308,083	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	114	121	864	97,444	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	80	95	522	58,864	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	145	419	47,234	化学
ACCENTURE PLC-CL A	548	603	6,956	783,893	情報技術サービス
BUNGE LIMITED	128	138	779	87,856	食品
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	260	273	2,045	230,435	自動車部品
EATON CORP PLC	411	445	2,792	314,644	電気設備
ENDO INTERNATIONAL PLC	153	205	583	65,717	医薬品
ENSCO PLC-CL A	199	—	—	—	エネルギー設備・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	40	40	791	89,145	保険
INGERSOLL-RAND PLC	233	251	1,557	175,550	機械
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	664	850	651	73,461	エネルギー設備・サービス
INVESCO LTD	376	412	1,287	145,121	資本市場
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	51	58	719	81,059	医薬品
LIBERTY GLOBAL PLC-A	212	237	916	103,322	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	557	574	2,163	243,772	メディア
MALLINCKRODT PLC	100	111	665	74,932	医薬品
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	319	410	423	47,677	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,236	1,362	10,272	1,157,471	ヘルスケア機器・用品
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	176	179	1,017	114,705	繊維・アパレル・贅沢品
NABORS INDUSTRIES INC	229	—	—	—	エネルギー設備・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	—	334	1,763	198,713	専門サービス
NOBLE CORP PLC	211	—	—	—	エネルギー設備・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	99	150	812	91,575	ホテル・レストラン・レジャー
PARTNERRE LTD	41	—	—	—	保険
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	40	44	527	59,490	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	282	290	990	111,657	コンピュータ・周辺機器
PENTAIR PLC	158	174	940	106,011	機械
SIGNET JEWELERS LTD	65	71	849	95,747	専門小売り
TYCO INTERNATIONAL PLC	356	403	1,475	166,291	商業サービス・用品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	—	124	1,472	165,907	保険
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	140	—	—	—	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	
PERRIGO CO PLC	123	139	1,808	203,747	医薬品
XL GROUP PLC	216	288	1,062	119,714	保険
ACE LTD	290	—	—	—	保険
CHUBB LTD	—	446	5,340	601,756	保険
GARMIN LTD	102	114	454	51,202	家庭用耐久財
TE CONNECTIVITY LTD	354	371	2,269	255,758	電子装置・機器・部品
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	—	67	578	65,182	ソフトウェア
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	—	8	113	12,795	医薬品
AERCAP HOLDINGS NV	—	87	340	38,340	商社・流通業
CORE LABORATORIES N. V.	38	43	491	55,395	エネルギー設備・サービス
MOBILEYE NV	—	84	311	35,049	ソフトウェア
LYONDELLBASELL INDU-CL A	373	366	3,143	354,259	化学
MYLAN NV	319	404	1,874	211,225	医薬品
NIELSEN NV	299	—	—	—	専門サービス
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	132	1,085	122,274	半導体・半導体製造装置
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	139	169	657	74,096	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	145	169	1,357	153,009	ホテル・レストラン・レジャー
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	220	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BROADCOM LTD	—	375	5,886	663,284	半導体・半導体製造装置
FLEXTRONICS INTL LTD	510	550	656	73,996	電子装置・機器・部品
小 計	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	594	599	1,772,005	199,669,611	
	銘柄 数 < 比 率 >		—	< 61.2% >	
(カナダ)			千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD	263	335	621	53,904	石油・ガス・消耗燃料
AGNICO EAGLE MINES LTD	186	206	981	85,210	金属・鉱業
AGRIUM INC	124	126	1,476	128,109	化学
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	364	401	2,321	201,473	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	121	141	455	39,563	石油・ガス・消耗燃料
ATCO LTD CL1	68	68	267	23,252	総合公益事業
BCE INC	118	141	837	72,726	各種電気通信サービス
BANK OF MONTREAL	565	618	4,883	423,833	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	1,062	1,162	7,384	640,901	銀行
BARRICK GOLD	1,015	1,130	2,013	174,765	金属・鉱業
BAYTEX ENERGY CORP	144	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
BLACKBERRY LTD	439	509	528	45,854	コンピュータ・周辺機器
BOMBARDIER B SHEARS	1,160	1,670	220	19,131	航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	496	847	3,832	332,637	不動産管理・開発
CAE INC	212	260	390	33,870	航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	26	646	56,133	容器・包装
CI FINANCIAL CORP	205	226	652	56,646	資本市場
CAMECO CORP	346	386	654	56,784	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	345	383	3,745	325,092	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	712	769	6,249	542,408	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	956	1,063	3,684	319,765	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN OIL SANDS LTD	420	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	149	140	2,432	211,116	陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A	64	70	938	81,445	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	106	124	449	39,055	総合公益事業
CATAMARAN CORP	177	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENOVUS ENERGY INC	711	790	1,345	116,764	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE	15	17	966	83,891	ソフトウェア
CRESCENT POINT ENERGY CORP	355	488	876	76,109	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	108	115	1,022	88,739	複合小売り
ELDORADO GOLD CORPORATION	628	628	254	22,128	金属・鉱業

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
ELEMENT FINANCIAL CORP	—	360	496	43,117	各種金融サービス
EMPIRE CO LTD A	46	162	364	31,663	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	720	790	605	52,588	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	738	883	4,422	383,867	石油・ガス・消耗燃料
ENERPLUS CORP	187	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	17	21	1,556	135,080	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	149	149	283	24,634	商社・流通業
FIRST CAPITAL REALTY INC	77	113	233	20,281	不動産管理・開発
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	510	704	475	41,242	金属・鉱業
FORTIS INC	235	273	1,104	95,888	電力
FRANCO-NEVADA CORP	135	165	1,341	116,424	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	208	231	902	78,309	繊維・アパレル・贅沢品
GOLDCORP INC	707	800	1,700	147,612	金属・鉱業
GREAT-WEST LIFE CO INC	261	280	992	86,099	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	189	214	1,322	114,762	情報技術サービス
HUSKY ENERGY INC	301	357	575	49,947	石油・ガス・消耗燃料
IGM FINANCIAL INC	85	103	395	34,318	資本市場
IMPERIAL OIL	264	283	1,223	106,204	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	83	99	386	33,518	保険
INTACT FINANCIAL CORP	118	127	1,148	99,652	保険
INTER PIPELINE LTD	280	331	858	74,490	石油・ガス・消耗燃料
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	62	94	208	18,111	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP	72	161	618	53,671	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP	1,046	1,186	528	45,908	金属・鉱業
LINAMAR CORP	—	48	297	25,828	自動車部品
LOBLAW COMPANIES	202	214	1,579	137,087	食品・生活必需品小売り
MEG ENERGY CORP	136	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
MAGNA INTERNATIONAL INC	364	388	2,171	188,476	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,726	1,918	3,538	307,124	保険
METHANEX CORP	82	82	345	30,004	化学
METRO INC	210	232	1,038	90,105	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	278	334	1,429	124,097	銀行
NEW GOLD INC	431	—	—	—	金属・鉱業
ONEX CORP	80	80	637	55,337	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP	102	121	819	71,106	ソフトウェア
PARAMOUNT RESOURCES LTD.	49	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
PEMBINA PIPELINE CORP	287	362	1,259	109,303	石油・ガス・消耗燃料
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	129	151	434	37,690	石油・ガス・消耗燃料
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	720	818	1,847	160,304	化学
POWER CORPORATION OF CANADA	330	350	1,042	90,461	保険
POWER FINANCIAL CORP	223	243	782	67,909	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	111	186	452	39,259	石油・ガス・消耗燃料
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	—	104	415	36,041	商業サービス・用品
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	169	198	1,009	87,640	ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	320	348	1,816	157,629	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,258	1,433	10,810	938,247	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	128	145	687	59,650	建設・土木
SAPUTO INC	216	239	1,010	87,679	食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	—	170	330	28,652	石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS-B	351	404	1,020	88,534	メディア
SILVER WHEATON CORP	351	392	896	77,841	金属・鉱業
SUN LIFE FINANCIAL INC	531	588	2,449	212,550	保険
SUNCOR ENERGY INC	1,270	1,524	5,435	471,720	石油・ガス・消耗燃料
TALISMAN ENERGY	910	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料

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		
TECK RESOURCES LTD	492	582	590	51,218	金属・鉱業	
TELUS CORP	193	193	820	71,172	各種電気通信サービス	
THOMSON REUTERS CORP	316	330	1,732	150,335	メディア	
TORONTO DOMINION BANK	1,607	1,789	10,066	873,689	銀行	
TOURMALINE OIL CORP	153	173	473	41,095	石油・ガス・消耗燃料	
TRANSALTA CORP	243	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
TRANSCANADA CORP	614	688	3,489	302,856	石油・ガス・消耗燃料	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	630	870	288	25,068	金属・鉱業	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	278	313	1,098	95,350	医薬品	
VERESEN INC	—	248	215	18,725	石油・ガス・消耗燃料	
VERMILION ENERGY INC	93	105	396	34,428	石油・ガス・消耗燃料	
WEST FRASER TIMBER	56	68	366	31,816	紙製品・林産品	
WESTON(GEORGE)LTD	42	48	561	48,757	食品・生活必需品小売り	
YAMANA GOLD INC	790	970	385	33,421	金属・鉱業	
小 計	株 数 ・ 金 額	34,598	38,177	135,925	11,796,937	
	銘柄 数 < 比 率 >	93	90	—	< 3.6% >	
(イギリス)			千英ポンド			
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	830	940	262	42,495	資本市場	
AMEC FOSTER WHEELER PLC PLC	332	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
ANTOFAGASTA PLC	349	410	192	31,182	金属・鉱業	
ASHTED GROUP PLC	431	468	407	65,927	商社・流通業	
BHP BILLITON PLC	1,837	2,043	1,621	262,524	金属・鉱業	
ARM HOLDINGS PLC	1,230	1,340	1,372	222,180	半導体・半導体製造装置	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	980	559	90,527	家庭用耐久財	
SKY PLC	892	998	1,031	167,090	メディア	
TULLOW OIL PLC	782	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
AVIVA PLC	2,550	3,890	1,789	289,739	保険	
CRODA INTERNATIONAL PLC	115	127	386	62,637	化学	
DIAGEO PLC	2,194	2,427	4,601	745,089	飲料	
SCHRODERS PLC	101	118	319	51,778	資本市場	
BAE SYSTEMS PLC	2,690	3,060	1,566	253,683	航空宇宙・防衛	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,625	1,797	7,322	1,185,703	タバコ	
STANDARD CHARTERED PLC	2,132	3,164	1,493	241,885	銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	829	926	3,569	577,935	タバコ	
SABMILLER PLC	846	938	3,994	646,861	飲料	
HSBC HOLDINGS PLC	16,720	18,870	8,247	1,335,375	銀行	
LEGAL & GENERAL	5,150	5,760	1,355	219,547	保険	
MEGGITT PLC	706	780	318	51,491	航空宇宙・防衛	
MORRISON SUPERMARKETS	1,740	2,130	430	69,702	食品・生活必需品小売り	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	313	344	1,158	187,654	食品	
PEARSON	720	790	715	115,828	メディア	
PERSIMMON PLC	254	295	620	100,404	家庭用耐久財	
PRUDENTIAL PLC	2,241	2,493	3,245	525,573	保険	
RIO TINTO PLC-REG	1,112	1,201	2,369	383,681	金属・鉱業	
ST JAMES S PLACE PLC	—	499	462	74,819	保険	
TRAVIS PERKINS PLC	209	247	452	73,229	商社・流通業	
SSE PLC	859	969	1,461	236,605	電力	
BP PLC	15,900	17,660	6,279	1,016,697	石油・ガス・消耗燃料	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	49,800	55,300	3,749	607,093	銀行	
TATE & LYLE ORD.	425	425	245	39,706	食品	
BG GROUP PLC	2,984	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
TAYLOR WIMPEY PLC	—	3,190	608	98,501	家庭用耐久財	
TESCO PLC	7,050	7,870	1,524	246,897	食品・生活必需品小売り	
SMITH & NEPHEW PLC	764	858	985	159,627	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	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,237	4,691	6,623	1,072,508	医薬品
WEIR GROUP PLC	182	220	243	39,398	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC	219	259	244	39,651	商業サービス・用品
ASTRAZENECA PLC	1,102	1,219	4,772	772,843	医薬品
GKN PLC	1,430	1,690	496	80,369	自動車部品
BT GROUP PLC	7,110	8,170	3,644	590,139	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC	165	187	690	111,790	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC	1,410	1,550	628	101,745	複合小売り
BARCLAYS PLC	14,360	16,300	2,471	400,249	銀行
INTERTEK GROUP PLC	137	151	480	77,775	専門サービス
WILLIAM HILL PLC	760	850	280	45,473	ホテル・レストラン・レジャー
BURBERRY GROUP PLC	393	423	579	93,834	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	133	140	778	126,038	複合小売り
KINGFISHER PLC	2,060	2,170	818	132,605	専門小売り
ICAP PLC	460	540	255	41,392	資本市場
ITV PLC	3,340	3,650	888	143,792	メディア
SAINSBURY	1,118	1,238	347	56,308	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	74	90	565	91,517	金属・鉱業
G4S PLC	1,368	1,520	293	47,525	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	175	198	389	63,126	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	—	124	403	65,334	家庭用耐久財
CENTRICA PLC	4,230	4,900	1,129	182,880	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,408	3,800	6,484	1,050,002	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	2,129	3,820	6,547	1,060,167	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE	295	331	672	108,959	商社・流通業
COBHAM PLC	990	1,130	248	40,253	航空宇宙・防衛
NATIONAL GRID PLC	3,290	3,596	3,572	578,479	総合公益事業
INMARSAT PLC	350	425	410	66,407	各種電気通信サービス
PETROFAC LTD	227	260	238	38,583	エネルギー設備・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC	272	302	851	137,897	各種金融サービス
UNILEVER PLC	1,121	1,244	3,968	642,556	パーソナル用品
TUI AG-DI	398	466	479	77,654	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	470	550	276	44,839	資本市場
EXPERIAN PLC	860	946	1,178	190,857	専門サービス
MONDI PLC	—	342	461	74,758	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	203	221	484	78,510	水道
WHITBREAD PLC	158	175	696	112,720	ホテル・レストラン・レジャー
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	213	253	95	15,485	専門小売り
HARGREAVES LANSDOWN PLC	191	250	333	53,919	資本市場
SMITHS GROUP PLC	339	375	407	66,002	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,224	1,370	733	118,834	金属・鉱業
3I GROUP PLC	870	970	447	72,500	資本市場
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	143	423	68,514	消費者金融
CAPITA PLC	581	640	670	108,602	専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	565	617	4,177	676,454	家庭用品
RELX PLC	967	1,066	1,392	225,424	メディア
SHIRE PLC	511	568	2,224	360,248	医薬品
FRESNILLO PLC	209	209	196	31,760	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	601	670	622	100,838	水道
GLENCORE PLC	9,670	11,880	1,800	291,523	金属・鉱業
DIXONS CARPHONE PLC	850	920	393	63,757	専門小売り
FRIENDS LIFE GROUP LTD	1,260	—	—	—	保険
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,633	1,770	1,221	197,752	航空宇宙・防衛
JOHNSON MATTHEY PLC	177	—	—	—	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		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
OLD MUTUAL PLC	4,270	4,680	920	149,056	保険	
EASYJET PLC	142	163	247	40,117	旅客航空輸送業	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,210	3,410	762	123,515	銀行	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,310	—	—	—	保険	
SAGE GROUP PLC (THE)	950	1,050	658	106,685	ソフトウェア	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	375	338	54,830	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
WPP PLC	1,151	1,243	2,032	329,070	メディア	
COCA-COLA HBC AG-CDI	174	198	297	48,250	飲料	
ROYAL MAIL PLC	550	880	426	69,078	航空貨物・物流サービス	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	650	690	316	51,304	ホテル・レストラン・レジャー	
WOLSELEY PLC	221	242	966	156,542	商社・流通業	
IMI PLC	226	259	247	40,133	機械	
VODAFONE GROUP PLC	23,120	25,610	5,698	922,656	無線通信サービス	
AGGREKO PLC	230	262	284	46,086	商業サービス・用品	
RSA INSURANCE GROUP PLC	907	987	471	76,334	保険	
COMPASS GROUP PLC	1,451	1,585	1,949	315,671	ホテル・レストラン・レジャー	
REXAM PLC	595	655	414	67,137	容器・包装	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	201	229	646	104,675	ホテル・レストラン・レジャー	
MELROSE INDUSTRIES PLC	864	—	—	—	機械	
STANDARD LIFE PLC	1,677	1,860	664	107,548	保険	
AUTO TRADER GROUP PLC	—	950	372	60,360	インターネットソフトウェア・サービス	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	—	1,360	507	82,188	保険	
WORLDPAY GROUP PLC	—	1,050	285	46,244	情報技術サービス	
JOHNSON MATTHEY PLC	—	191	523	84,712	化学	
小 計	株 数	金 額	246,108	280,828	152,497	24,692,453
	銘柄 数 < 比 率 >		104	108	—	< 7.6% >
(スイス)			千スイスフラン			
SYNGENTA AG	81	89	3,560	415,698	化学	
SIKA AG-BR	1	2	805	94,008	化学	
SGS SA-REG	4	5	1,061	123,880	専門サービス	
SULZER AG-REG	20	13	123	14,470	機械	
BARRY CALLEBAUT AG	1	1	198	23,156	食品	
SWISSCOM AG-REG	20	24	1,287	150,338	各種電気通信サービス	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.87	0.95	558	65,155	食品	
LINDT&SPRUENGLI AG-REG	0.09	0.1	708	82,692	食品	
GIVAUDAN-REG	7	8	1,709	199,546	化学	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	129	144	3,205	374,217	保険	
NOVARTIS-REG	2,003	2,199	15,403	1,798,262	医薬品	
ABB LTD	1,923	2,134	4,031	470,593	電気設備	
ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	611	678	16,080	1,877,269	医薬品	
ADECCO SA-REG	148	163	1,027	119,975	専門サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD	201	443	1,989	232,307	建設資材	
NESTLE SA-REG	2,807	3,080	22,253	2,597,815	食品	
BALOISE HOLDING AG	40	50	614	71,736	保険	
SONOVA HOLDING AG-REG	45	50	618	72,167	ヘルスケア機器・用品	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,337	1,743	2,394	279,578	資本市場	
THE SWATCH GROUP AG-B	26	29	997	116,401	繊維・アパレル・贅沢品	
THE SWATCH GROUP AG-REG	46	46	306	35,791	繊維・アパレル・贅沢品	
LONZA AG-REG	46	50	813	94,937	ライフサイエンス・ツール/サービス	
SWISS LIFE HOLDING AG	26	31	818	95,518	保険	
GALENICA AG-REG	—	3	524	61,218	医薬品	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	7	8	415	48,543	化学	
SWISS PRIME SITE-REG	47	63	531	62,072	不動産管理・開発	
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	24	32	198	23,179	各種金融サービス	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			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		
DUFREY AG-REG	—	40	474	55,334	専門小売り	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	15	15	595	69,569	資本市場	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	39	43	765	89,309	機械	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	19	19	340	39,789	機械	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	45	52	719	84,026	海運業	
GEBERIT AG-REG	33	36	1,326	154,836	建設関連製品	
ACTELION LTD	89	97	1,389	162,186	バイオテクノロジー	
ARYZTA AG	72	85	336	39,245	食品	
JULIUS BAER GROUP LTD	198	220	912	106,480	資本市場	
SWISS RE LTD	304	337	3,002	350,531	保険	
TRANSOCEAN LTD	315	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	452	500	3,207	374,443	繊維・アパレル・贅沢品	
UBS GROUP AG	3,188	3,511	5,550	648,011	資本市場	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	14,380 38	16,053 39	100,859 —	11,774,300 <3.6%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	1,320	1,460	11,577	160,352	銀行	
SWEDBANK AB	787	865	15,146	209,774	銀行	
SWEDISH MATCH AB	174	189	5,239	72,561	タバコ	
NORDEA BANK AB	2,660	2,930	23,073	319,571	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	290	294	4,045	56,029	商業サービス・用品	
INVESTOR AB-B SHS	397	444	12,911	178,824	各種金融サービス	
HENNES&MAURITZ AB-B	831	923	25,197	348,990	専門小売り	
ASSA ABLOY AB-B	294	—	—	—	建設関連製品	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	433	—	—	—	銀行	
ERICSSON LM-B	2,660	2,920	23,871	330,613	通信機器	
TELIA AB	2,290	2,510	10,647	147,466	各種電気通信サービス	
SKANSKA AB-B SHS	329	375	7,016	97,175	建設・土木	
LUNDIN PETROLEUM AB	201	201	2,761	38,250	石油・ガス・消耗燃料	
ALFA LAVAL AB	270	277	3,792	52,521	機械	
GETINGE AB-B SHS	171	191	3,646	50,499	ヘルスケア機器・用品	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	203	236	5,482	75,929	各種金融サービス	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	55	61	2,765	38,297	無線通信サービス	
ELEKTA AB-B SHS	317	—	—	—	ヘルスケア機器・用品	
ICA GRUPPEN AB	66	78	2,112	29,254	食品・生活必需品小売り	
HUSQVARNA AB-B SHS	320	380	2,251	31,183	家庭用耐久財	
ELECTROLUX AB-B	208	233	4,979	68,962	家庭用耐久財	
SKF AB-B SHARES	336	388	5,738	79,478	機械	
ATLAS COPCO AB-A	584	—	—	—	機械	
ATLAS COPCO AB-B	344	—	—	—	機械	
VOLVO AB-B SHS	1,326	1,500	13,335	184,689	機械	
SANDVIK AB	927	1,030	8,765	121,399	機械	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	140	168	2,325	32,202	各種金融サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB-B	504	584	15,131	209,570	家庭用品	
BOLIDEN AB	225	260	3,377	46,776	金属・鉱業	
HEXAGON AB-B SHS	228	244	7,703	106,687	電子装置・機器・部品	
TELE 2 AB-B SHS	284	284	2,161	29,933	無線通信サービス	
ATLAS COPCO AB-A	—	648	13,238	183,355	機械	
ATLAS COPCO AB-B	—	382	7,326	101,475	機械	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	—	1,450	15,138	209,661	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	—	970	15,597	216,026	建設関連製品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	19,174 31	22,475 30	276,354 —	3,827,514 <1.2%>	

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ノルウェー)	百株	百株	千ノルウェークローネ	千円		
DNB ASA	829	956	9,397	127,429		銀行
TELENOR ASA	656	719	10,037	136,104		各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	—	78	1,835	24,887		メディア
SUBSEA 7 SA	259	—	—	—		エネルギー設備・サービス
STATOIL ASA	982	1,055	13,915	188,693		石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	157	168	5,409	73,354		化学
SEADRILL LTD	338	—	—	—		エネルギー設備・サービス
NORSK HYDRO	1,160	1,300	4,457	60,446		金属・鉱業
ORKLA ASA	688	800	6,056	82,119		食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	172	197	2,791	37,852		保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	—	91	2,026	27,480		メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,241	5,364	55,926	758,368	
(デンマーク)			千デンマーククローネ			
CARLSBERG B	93	105	6,604	113,201		飲料
A P MOLLER-MAERSK A/S	6	6	5,844	100,171		海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A	3	3	3,230	55,372		海運業
DANSKE BANK AS	564	686	12,745	218,464		銀行
GENMAB A/S	—	51	4,378	75,044		バイオテクノロジー
TDC A/S	688	768	2,474	42,412		各種電気通信サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING	21	26	1,701	29,167		ヘルスケア機器・用品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	189	216	10,156	174,079		電気設備
TRYG A/S	19	—	—	—		保険
DSV A/S	160	182	5,012	85,910		陸運・鉄道
PANDORA A/S	96	108	9,380	160,789		繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S	—	93	4,076	69,865		化学
NOVOZYMES A/S-B SHARES	212	225	6,747	115,656		化学
COLOPLAST-B	99	105	5,255	90,074		ヘルスケア機器・用品
NOVO NORDISK A/S-B	1,750	1,888	67,590	1,158,499		医薬品
ISS A/S	104	141	3,688	63,221		商業サービス・用品
TRYG A/S	—	118	1,515	25,969		保険
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,004	4,722	150,402	2,577,901	
(ユーロ…ドイツ)			千ユーロ			
ADIDAS AG	177	202	2,112	269,819		繊維・アパレル・贅沢品
PRESENIUS SE & CO KGAA	323	371	2,372	302,973		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	105	116	512	65,437		インターネットソフトウェア・サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD	64	64	255	32,605		化学
HANNOVER RUECK SE	53	57	586	74,936		保険
GEA GROUP AG	163	175	756	96,541		機械
CONTINENTAL AG	95	106	2,132	272,304		自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	828	940	2,349	300,034		航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE	35	44	210	26,925		メディア
MERCK KGAA	113	126	933	119,180		医薬品
RWE AG	432	462	525	67,168		総合公益事業
SAP SE	804	948	6,745	861,460		ソフトウェア
E.ON SE	1,742	1,940	1,682	214,813		総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	101	100	880	112,376		家庭用品
METRO AG	134	166	454	58,083		食品・生活必需品小売り
BAYER AG	720	797	8,240	1,052,373		医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	154	174	1,721	219,820		家庭用品
BASF SE	801	887	5,953	760,267		化学
CELESIO AG	52	—	—	—		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BEIERSDORF AG	87	100	805	102,862		パーソナル用品

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…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HEIDELBERGCEMENT AG	123	137	1,040	132,873	建設資材	
FRESENIUS MEDICAL CARE	188	209	1,628	207,936	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
ALLIANZ SE	398	440	6,373	813,858	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG (REGD)	192	226	317	40,591	旅客航空輸送業	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG (REG)	151	160	2,885	368,437	保険	
VOLKSWAGEN AG	25	34	444	56,788	自動車	
VOLKSWAGEN AG-PREF	141	178	2,024	258,540	自動車	
DAIMLER AG	840	929	6,310	805,876	自動車	
MAN SE	32	32	306	39,102	機械	
THYSSENKRUPP AG	386	363	660	84,343	金属・鉱業	
SIEMENS AG	692	765	7,139	911,745	コングロマリット	
QIAGEN NV	201	223	435	55,630	ライフサイエンス・ツール/サービス	
LINDE AG	161	179	2,344	299,382	化学	
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,206	1,331	2,017	257,587	資本市場	
BAYER MOTOREN WERK	287	318	2,611	333,437	自動車	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	47	53	373	47,688	自動車	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	2,773	3,114	4,965	634,065	各種電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,000	1,090	1,379	176,148	半導体・半導体製造装置	
DEUTSCHE BOERSE AG	168	189	1,412	180,387	各種金融サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	134	152	708	90,413	自動車	
FRAPORT AG	29	38	203	25,946	運送インフラ	
LANXESS	83	83	348	44,452	化学	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	257	329	902	115,221	不動産管理・開発	
SYMRISE AG	106	115	688	87,907	化学	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	20	—	—	—	メディア	
BRENTAG AG	132	151	760	97,143	商社・流通業	
K+S AG	157	173	361	46,194	化学	
EVONIK INDUSTRIES AG	—	138	368	47,096	化学	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	476	746	358	45,717	各種電気通信サービス	
HUGO BOSS AG	58	63	359	45,857	繊維・アパレル・贅沢品	
COMMERZBANK AG	831	1,020	782	99,917	銀行	
OSRAM LICHT AG	77	88	400	51,150	電気設備	
VONOVIA SE	301	452	1,435	183,319	不動産管理・開発	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	187	209	959	122,490	メディア	
ZALANDO SE	—	81	233	29,841	インターネット販売・カタログ販売	
小 計	株 数	金 額	18,847	21,587	92,772	11,847,076
	銘柄 数 < 比 率 >		53	53	—	< 3.6% >
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	996	1,137	1,496	191,076	保険	
INTESA SANPAOLO	11,090	12,160	2,940	375,474	銀行	
INTESA SANPAOLO-RSP	760	920	209	26,739	銀行	
MEDIOBANCA SPA-ORD	550	530	335	42,842	資本市場	
PIRELLI&CO	211	—	—	—	自動車部品	
SAIPEM	239	5,497	195	24,990	エネルギー設備・サービス	
LUXOTTICA GROUP SPA	148	165	826	105,563	繊維・アパレル・贅沢品	
ENEL SPA	5,720	6,770	2,708	345,811	電力	
ENI SPA	2,224	2,448	3,309	422,648	石油・ガス・消耗燃料	
SNAM SPA	1,750	2,050	1,133	144,767	ガス	
TENARIS SA	417	460	503	64,322	エネルギー設備・サービス	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	750	900	304	38,892	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	8,600	11,100	1,058	135,226	各種電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RNC	5,200	5,700	442	56,484	各種電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	352	393	968	123,708	運送インフラ	
TERNA SPA	1,350	1,420	721	92,117	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	
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円	
EXOR SPA	86	112	364	46,497	各種金融サービス
FINMECCANICA SPA	370	410	463	59,215	航空宇宙・防衛
PRYSMIAN SPA	174	194	389	49,795	電気設備
ENEL GREEN POWER SPA	1,600	1,600	310	39,678	独立系発電事業者・エネルギー販売者
UNICREDIT SPA	3,860	4,640	1,517	193,756	銀行
UNIPOLSAI SPA	800	1,070	218	27,847	保険
FERRARI NV	—	127	474	60,553	自動車
CNH INDUSTRIAL NV	801	920	566	72,311	機械
BANCO POPOLARE SPA	303	339	218	27,965	銀行
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	3,750	—	—	—	銀行
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	780	890	644	82,284	自動車
小 計	株 数 銘 柄 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	52,881	61,952	22,322	2,850,570	
	銘 柄 数 < 比 率 >	26	25	—	<0.9%>
(ユーロ…フランス)					
BOUYGUES	139	201	747	95,496	建設・土木
AIRBUS GROUP SE	515	574	3,441	439,505	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT	372	437	930	118,836	総合公益事業
LOREAL-ORD	217	242	3,890	496,822	パーソナル用品
CHRISTIAN DIOR SE	47	53	881	112,569	繊維・アパレル・贅沢品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	244	268	4,149	529,938	繊維・アパレル・贅沢品
THALES (EX THOMSON-CSF)	83	99	766	97,914	航空宇宙・防衛
CAP GEMINI SA	125	160	1,344	171,730	情報技術サービス
CASINO GUICHARD	49	59	299	38,183	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	—	55	564	72,131	電子装置・機器・部品
PUBLICIS GROUPE	159	184	1,152	147,230	メディア
LAFARGE SA	160	—	—	—	建設資材
LAGARDERE S. C. A	97	116	274	35,107	メディア
BOLLORE	750	870	303	38,762	航空貨物・物流サービス
MICHELIN B	162	178	1,625	207,598	自動車部品
PERNOD-RICARD	187	205	2,055	262,439	飲料
RENAULT	168	188	1,651	210,882	自動車
REMY COINTREAU	23	23	155	19,804	飲料
SCHNEIDER ELECTRIC SE	460	538	3,019	385,558	電気設備
VIVENDI SA	1,054	1,132	2,142	273,645	メディア
TECHNIP SA	88	98	485	62,047	エネルギー設備・サービス
VALEO	66	76	1,041	132,998	自動車部品
ORANGE	1,608	1,903	2,966	378,857	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	23	24	781	99,751	繊維・アパレル・贅沢品
BIC	25	28	379	48,425	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	114	121	855	109,243	ソフトウェア
KERING	66	72	1,165	148,877	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	135	165	226	28,929	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE	483	541	1,320	168,569	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	71	86	617	78,918	情報技術サービス
SANOFI	1,041	1,133	8,074	1,031,163	医薬品
ACCOR SA	182	207	776	99,140	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV	577	577	282	36,104	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE	626	697	2,285	291,898	銀行
ALCATEL-LUCENT	2,460	—	—	—	通信機器
EURAZEO	30	38	230	29,445	各種金融サービス
SODEXO	80	90	862	110,102	ホテル・レストラン・レジャー
AXA	1,589	1,912	3,948	504,195	保険
PEUGEOT CITROEN	342	437	671	85,688	自動車
JC DECAUX SA	53	68	262	33,488	メディア

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		
ESSILOR INTERNATIONAL	180	199	2,165	276,485	ヘルスケア機器・用品	
CREDIT AGRICOLE SA	879	1,030	986	125,940	銀行	
ZODIAC AEROSPACE	154	195	350	44,735	航空宇宙・防衛	
BNP PARIBAS	925	1,023	4,547	580,681	銀行	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	391	455	1,762	225,063	建設関連製品	
WENDEL	28	29	277	35,377	各種金融サービス	
ILIAD SA	21	24	567	72,413	各種電気通信サービス	
SES FDR	261	316	817	104,333	メディア	
IMERYS	30	38	232	29,678	建設資材	
SAFRAN SA	257	301	1,869	238,774	航空宇宙・防衛	
ENGIE	1,270	1,411	1,952	249,285	総合公益事業	
ALSTOM	187	155	354	45,297	機械	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	130	163	467	59,645	メディア	
ELECTRICITE DE FRANCE	203	228	231	29,537	電力	
ARKEMA	59	67	445	56,853	化学	
LEGRAND SA	232	253	1,260	160,942	電気設備	
TOTAL SA	1,866	2,115	8,667	1,106,810	石油・ガス・消耗燃料	
ADP	24	28	307	39,224	運送インフラ	
VALLOUREC	93	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
NATIXIS	780	870	379	48,494	銀行	
SCOR SE	140	154	484	61,927	保険	
REXEL SA	252	286	360	46,036	商社・流通業	
VINCI	414	460	3,049	389,400	建設・土木	
DANONE	502	567	3,603	460,139	食品	
AIR LIQUIDE	301	330	3,331	425,413	化学	
BUREAU VERITAS SA	231	255	499	63,726	専門サービス	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	410	450	444	56,781	運送インフラ	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	270	299	483	61,702	総合公益事業	
EDENRED	187	187	321	41,097	商業サービス・用品	
NUMERICABLE-SFR	85	110	414	52,922	メディア	
小 計	株 数	金 額	25,435	25,857	97,264	12,420,731
銘 柄 数 < 比 率 >	69	67	—	< 3.8% >		
(ユーロ…オランダ)						
RELX NV	595	970	1,520	194,164	メディア	
RANDSTAD HOLDING NV	110	127	624	79,751	専門サービス	
AKZO NOBEL	209	240	1,448	185,021	化学	
WOLTERS KLUWER	259	289	1,035	132,176	メディア	
VOPAK	61	71	314	40,138	石油・ガス・消耗燃料	
AEGON NV	1,590	1,800	882	112,723	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	2,860	3,110	1,146	146,428	各種電気通信サービス	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	798	915	2,298	293,574	コングロマリット	
ING GROEP NV	3,371	3,750	4,074	520,297	銀行	
HEINEKEN NV	200	220	1,776	226,915	飲料	
ARCELORMITTAL	871	960	369	47,185	金属・鉱業	
ARCELORMITTAL-RIGHTS	—	960	110	14,150	金属・鉱業	
HEINEKEN HOLDING NV	91	97	675	86,287	飲料	
KONINKLIJKE DSM NV	149	175	856	109,323	化学	
UNILEVER NV-CVA	1,422	1,571	6,335	808,986	パーソナル用品	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	71	81	283	36,239	建設・土木	
TNT EXPRESS NV	360	430	339	43,297	航空貨物・物流サービス	
DELTA LLOYD NV	183	—	—	—	保険	
ASML HOLDING NV	306	332	2,964	378,557	半導体・半導体製造装置	
GEMALTO	68	76	497	63,520	ソフトウェア	
OCI	80	80	140	17,959	化学	

銘柄	株数	期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…オランダ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
KONINKLIJKE AHOLD NV	786	812	1,622	207,229	食品・生活必需品小売り	
NN GROUP NV	136	232	677	86,568	保険	
ALTICE NV - B	—	100	161	20,631	メディア	
ALTICE NV - A	—	368	588	75,109	メディア	
小計	株数・金額	14,576	17,766	30,745	3,926,239	
	銘柄数<比率>	22	24	—	<1.2%>	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA	350	502	727	92,952	運送インフラ	
ENDESA S. A.	263	317	546	69,789	電力	
BANKINTER S. A.	580	650	407	52,069	銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA	5,440	6,172	3,671	468,910	銀行	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA - RIGHTS	5,440	—	—	—	銀行	
GAS NATURAL SDG	305	328	588	75,100	ガス	
REPSOL SA	915	1,043	1,050	134,146	石油・ガス・消耗燃料	
BANCO SANTANDER SA	12,280	13,978	5,557	709,719	銀行	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	96	102	787	100,582	電力	
TELEFONICA SA	3,679	4,356	4,388	560,455	各種電気通信サービス	
TELEFONICA S. A. -RIGHTS	3,679	—	—	—	各種電気通信サービス	
ZARDOYA OTIS S. A	162	168	172	21,976	機械	
ENAGAS	175	213	571	73,018	ガス	
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV	150	185	494	63,150	建設・土木	
GRIFOLS SA	132	—	—	—	バイオテクノロジー	
FERROVIAL SA	363	463	877	112,086	建設・土木	
MAPPRE SA	790	1,110	215	27,456	保険	
BANCO DE SABADELL SA	2,986	4,845	787	100,540	銀行	
BANCO DE SABADELL SA-RIGHTS	2,986	—	—	—	銀行	
CAIXABANK	1,979	2,482	656	83,831	銀行	
IBERDROLA SA	4,470	5,287	3,146	401,788	電力	
AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS	395	419	1,581	201,959	情報技術サービス	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	680	800	564	72,135	旅客航空輸送業	
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL	570	570	270	34,589	食品・生活必需品小売り	
BANKIA SA	3,850	4,300	371	47,498	銀行	
BCO POPULAR ESPANOL	1,563	1,624	383	48,911	銀行	
INDITEX SA	946	1,056	3,179	406,036	専門小売り	
AENA SA	49	65	742	94,833	運送インフラ	
GRIFOLS SA	—	288	569	72,690	バイオテクノロジー	
小計	株数・金額	55,276	51,327	32,311	4,126,231	
	銘柄数<比率>	28	25	—	<1.3%>	
(ユーロ…ベルギー)						
UMICORE	88	88	390	49,855	化学	
DELHAIZE GROUP	87	98	908	116,047	食品・生活必需品小売り	
KBC GROUPE NV	214	240	1,111	141,930	銀行	
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV	701	774	8,614	1,100,086	飲料	
SOLVAY SA	51	73	654	83,581	化学	
U. C. B. SA	110	123	833	106,415	医薬品	
COLRUYT SA	61	70	358	45,830	食品・生活必需品小売り	
GROUPE BRUXELLES LAM	72	78	569	72,732	各種金融サービス	
PROXIMUS	137	151	460	58,754	各種電気通信サービス	
TELENET GROUP HOLDING NV	43	52	235	30,051	メディア	
AGEAS	194	200	705	90,066	保険	
小計	株数・金額	1,758	1,947	14,842	1,895,353	
	銘柄数<比率>	11	11	—	<0.6%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG	125	140	354	45,267	石油・ガス・消耗燃料	

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株		千ユーロ	千円	
VOESTALPINE AG	96	110	319	40,848	金属・鋳業	
ERSTE GROUP BANK AG	251	268	658	84,070	銀行	
IMMOFINANZ AG	820	—	—	—	不動産管理・開発	
IMMOEAST AG-RIGHTS	500	500	—	—	不動産管理・開発	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	110	110	144	18,492	銀行	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIEN	31	—	—	—	保険	
ANDRITZ AG	65	80	386	49,384	機械	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,998 8	1,208 6	1,864 —	238,063 <0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルグ)						
RTL GROUP	33	39	291	37,187	メディア	
ALTICE SA	78	—	—	—	メディア	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	111 2	39 1	291 —	37,187 <0.0%>	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA OYJ	123	147	592	75,613	機械	
UPM-KYMMENE OYJ	475	505	823	105,180	紙製品・林産品	
STORA ENSO OYJ-R	494	540	435	55,649	紙製品・林産品	
SAMPO OYJ-A	388	432	1,817	232,140	保険	
FORTUM OYJ	396	440	590	75,404	電力	
ELISA CORPORATION	125	137	470	60,042	各種電気通信サービス	
METSO OYJ	104	104	220	28,155	機械	
NOKIA OYJ	3,230	5,600	2,987	381,516	通信機器	
NESTE OYJ	107	125	379	48,494	石油・ガス・消耗燃料	
NOKIAN RENKAAT OYJ	102	113	353	45,137	自動車部品	
KONE OYJ	273	319	1,380	176,347	機械	
ORION OYJ	87	96	278	35,539	医薬品	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,904 12	8,558 12	10,330 —	1,319,220 <0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
BANK OF IRELAND	24,500	28,500	741	94,625	銀行	
CRH PLC	737	822	2,073	264,837	建設資材	
KERRY GROUP PLC-A	147	161	1,323	168,959	食品	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	1,398	1,398	—	—	銀行	
PADDY POWER PLC	—	81	983	125,624	ホテル・レストラン・レジャー	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	26,782 4	30,962 5	5,121 —	654,047 <0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL	2,000	2,200	698	89,226	電力	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REGD	30,400	34,000	131	16,759	銀行	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	335	445	507	64,839	石油・ガス・消耗燃料	
JERONIMO MARTINS	224	252	364	46,484	食品・生活必需品小売り	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	32,959 4	36,897 4	1,701 —	217,309 <0.1%>	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	236,527 239	258,101 233	309,569 —	39,532,030 <12.1%>	
(香港)						
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	219	219	1,346	19,569	半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,920	2,130	3,135	45,556	不動産管理・開発	
BANK OF EAST ASIA	1,108	1,208	3,504	50,926	銀行	
CLP HLDGS	1,675	1,855	12,985	188,672	電力	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	1,070	1,070	1,427	20,739	旅客航空輸送業	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	500	600	4,548	66,082	電力	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	975	1,102	20,530	298,304	各種金融サービス	

銘柄	株数	期首(前期末)		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		
LI & FUNG LTD	4,936	5,636	2,570	37,342	繊維・アパレル・贅沢品	
MTR CORP	1,305	1,395	5,335	77,530	陸運・鉄道	
FIRST PACIFIC CO	2,260	2,260	1,285	18,684	各種金融サービス	
HANG SENG BANK	670	730	9,928	144,253	銀行	
HENDERSON LAND	936	1,110	5,389	78,314	不動産管理・開発	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,170	1,350	10,692	155,354	電力	
WHARF(HOLDING)	1,330	1,330	5,685	82,613	不動産管理・開発	
HONG KONG & CHINA GAS	5,514	6,625	9,567	139,012	ガス	
HUTCHISON WHAMPOA	1,850	—	—	—	コングロマリット	
HYSAN DEVELOPMENT	540	650	2,135	31,025	不動産管理・開発	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	2,060	2,230	6,611	96,071	ホテル・レストラン・レジャー	
KERRY PROPERTIES	570	570	1,199	17,433	不動産管理・開発	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,145	3,635	8,305	120,685	銀行	
NWS HOLDINGS LTD	1,355	1,355	1,658	24,098	コングロマリット	
PCCW LTD	3,860	3,860	1,937	28,155	各種電気通信サービス	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	620	750	2,010	29,205	繊維・アパレル・贅沢品	
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,666	5,166	3,864	56,153	不動産管理・開発	
SHANGRI-LA ASIA LTD	743	1,083	971	14,119	ホテル・レストラン・レジャー	
SINO LAND CO. LTD	2,560	2,860	3,540	51,446	不動産管理・開発	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,490	1,680	16,077	233,607	不動産管理・開発	
WIRES PACIFIC-A	545	585	4,829	70,167	不動産管理・開発	
WHEELLOCK & COMPANY LTD	770	870	2,966	43,106	不動産管理・開発	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,260	1,280	3,904	56,725	家庭用耐久財	
SJM HOLDINGS LIMITED	1,660	1,660	914	13,290	ホテル・レストラン・レジャー	
WYNN MACAU LTD	1,324	1,684	2,037	29,606	ホテル・レストラン・レジャー	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	780	780	912	13,260	ホテル・レストラン・レジャー	
AIA GROUP LTD	10,514	11,624	51,029	741,456	保険	
HKT TRUST AND HKT LTD	2,196	2,596	2,777	40,360	各種電気通信サービス	
SANDS CHINA LTD	2,080	2,348	7,454	108,319	ホテル・レストラン・レジャー	
SWIRE PROPERTIES LTD	1,008	1,168	2,470	35,893	不動産管理・開発	
WH GROUP LIMITED	3,100	5,900	3,315	48,178	食品	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,200	2,625	26,857	390,244	コングロマリット	
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	—	2,635	13,256	192,610	不動産管理・開発	
小計	株数・金額	75,486	88,217	268,973	3,908,181	
	銘柄数<比率>	39	39	—	<1.2%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,410	1,410	454	37,824	航空宇宙・防衛	
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,153	6,153	261	21,786	食品	
DBS GROUP HLDS	1,490	1,710	2,648	220,670	銀行	
CITY DEVELOPMENTS LTD	370	370	304	25,337	不動産管理・開発	
SEMBCORP MARINE	726	726	121	10,161	機械	
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	90	118	482	40,207	販売	
SINGAPORE EXCHANGE LTD	680	770	608	50,677	各種金融サービス	
CAPITALAND LIMITED	2,290	2,460	765	63,737	不動産管理・開発	
GENTING SINGAPORE PLC	5,246	6,146	519	43,265	ホテル・レストラン・レジャー	
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,670	2,070	610	50,873	陸運・鉄道	
SINGAPORE AIRLINES LTD	490	550	631	52,594	旅客航空輸送業	
UNITED OVERSEAS BANK	1,100	1,255	2,390	199,175	銀行	
UOL GROUP LIMITED	387	487	294	24,546	不動産管理・開発	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	1,460	1,510	614	51,199	メディア	
NOBLE GROUP LTD	4,124	4,124	191	15,979	商社・流通業	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	7,010	7,700	2,964	246,972	各種電気通信サービス	
SEMBCORP INDUSTRIES	830	990	305	25,413	コングロマリット	
OCBC-ORD	2,635	2,975	2,662	221,823	銀行	

銘柄	株数	期首(前期末)		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)	百株	百株		千円		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,600	1,840	625	52,118	食品	
STARHUB LTD	530	530	175	14,615	無線通信サービス	
KEPPEL CORP.	1,237	1,427	851	70,973	コングロマリット	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,630	1,630	160	13,375	機械	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	2,640	2,940	574	47,884	不動産管理・開発	
小計	株数・金額	45,799	49,892	19,219	1,601,212	
	銘柄数<比率>	23	23	—	<0.5%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD	119	141	854	73,660	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	2,405	2,817	6,510	561,495	銀行	
AMCOR	1,020	1,130	1,607	138,689	容器・包装	
WESTPAC BANKING CORP	2,711	3,206	9,582	826,510	銀行	
BANK OF QUEENSLAND LTD	301	351	411	35,526	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,420	1,420	364	31,476	金属・鉱業	
TELSTRA CORP LTD	3,770	4,170	2,176	187,743	各種電気通信サービス	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	393	443	388	33,509	銀行	
COCA-COLA AMATIL LTD	520	520	446	38,481	飲料	
ASX LTD	175	182	750	64,752	各種金融サービス	
BHP BILLITON LIMITED	2,802	3,084	5,125	442,083	金属・鉱業	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	124	255	835	72,095	石油・ガス・消耗燃料	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	397	530	249	21,530	複合小売り	
COMPUTERSHARE LTD	410	470	456	39,402	情報技術サービス	
CSL LIMITED	412	451	4,526	390,387	バイオテクノロジー	
REA GROUP LTD	41	54	287	24,782	メディア	
TRANSURBAN GROUP	1,566	1,950	2,191	189,046	運送インフラ	
COCHLEAR LTD	52	52	525	45,361	ヘルスケア機器・用品	
ORIGIN ENERGY LTD	980	1,750	864	74,563	石油・ガス・消耗燃料	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,413	1,646	12,066	1,040,763	銀行	
BORAL LTD	670	670	408	35,250	建設資材	
RIO TINTO LTD	380	410	1,721	148,487	金属・鉱業	
APA GROUP	990	1,070	930	80,290	ガス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	520	522	45,074	ホテル・レストラン・レジャー	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	2,040	2,320	1,266	109,254	保険	
TPG TELECOM LTD	190	270	303	26,175	各種電気通信サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	52	52	221	19,092	ホテル・レストラン・レジャー	
ORICA LTD	326	366	571	49,276	化学	
LEIGHTON HOLDINGS	89	—	—	—	建設・土木	
WORLEYPARSONS LTD	180	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
SUNCORP GROUP LTD	1,090	1,260	1,460	125,954	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,065	2,524	6,471	558,169	銀行	
NEWCREST MINING	640	750	1,259	108,610	金属・鉱業	
OIL SEARCH LTD	—	1,300	873	75,348	石油・ガス・消耗燃料	
INCITEC PIVOT LTD	1,430	1,610	515	44,436	化学	
TOLL HLDGS	550	—	—	—	航空貨物・物流サービス	
AMP LIMITED	2,600	2,850	1,621	139,867	保険	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	470	441	175	15,111	旅客航空輸送業	
QBE INSURANCE	1,170	1,330	1,428	123,201	保険	
CHALLENGER LIMITED	—	560	459	39,606	各種金融サービス	
SANTOS LTD.	846	1,670	673	58,047	石油・ガス・消耗燃料	
SONIC HEALTHCARE LTD	339	373	690	59,548	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
TABCORP HOLDINGS	780	780	321	27,717	ホテル・レストラン・レジャー	
WESFARMERS LIMITED	984	1,079	4,453	384,074	食品・生活必需品小売り	
ALUMINA LTD	2,330	2,330	302	26,125	金属・鉱業	
ILUKA RESOURCES LTD	378	378	247	21,387	金属・鉱業	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円		
WOODSIDE PETROLEUM	646	711	1,845	159,196	石油・ガス・消耗燃料	
WOOLWORTHS LIMITED	1,088	1,229	2,687	231,824	食品・生活必需品小売り	
DUET GROUP	—	2,290	522	45,032	総合公益事業	
SEEK LTD	288	328	519	44,811	専門サービス	
TATTS GROUP LTD	1,310	1,470	530	45,770	ホテル・レストラン・レジャー	
BRAMBLES LTD	1,360	1,550	1,873	161,628	商業サービス・用品	
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	170	250	156	13,498	資本市場	
ASCIANO LTD	850	610	547	47,246	陸運・鉄道	
MACQUARIE GROUP LIMITED	248	296	1,911	164,872	資本市場	
CROWN RESORTS LTD	297	360	440	37,974	ホテル・レストラン・レジャー	
VOCUS COMMUNICATIONS LTD	—	430	352	30,411	各種電気通信サービス	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	369	440	773	66,678	建設資材	
TREASURY WINE ESTATES LTD	540	720	684	58,995	飲料	
SYDNEY AIRPORT	979	1,079	717	61,887	運送インフラ	
ALS LTD	352	—	—	—	専門サービス	
AURIZON HOLDINGS LTD	1,910	2,090	825	71,203	陸運・鉄道	
HEALTHSCOPE LTD	960	1,760	459	39,619	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AUSNET SERVICES	1,634	1,634	245	21,139	電力	
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,300	2,610	751	64,832	保険	
AGL ENERGY LTD	566	645	1,170	100,970	総合公益事業	
SOUTH32 LTD	—	5,000	717	61,884	金属・鉱業	
CIMIC GROUP LTD	—	89	309	26,657	建設・土木	
小 計	株 数 ・ 金 額	57,488	75,126	95,166	8,208,103	
	銘柄 数 < 比 率 >	61	64	—	< 2.5% >	
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル			
CONTACT ENERGY LTD	318	760	377	29,416	電力	
RYMAN HEALTHCARE LTD	300	350	295	23,033	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
FLETCHER BUILDING LTD	620	690	535	41,700	建設資材	
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,480	1,700	613	47,794	各種電気通信サービス	
MIGHTY RIVER POWER	600	600	173	13,481	電力	
MERIDIAN ENER-PARTLY PAID SH	1,000	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	881	971	621	48,402	運送インフラ	
MERIDIAN ENERGY LTD	—	1,200	308	24,018	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,199	6,271	2,925	227,846	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 0.1% >	
(イスラエル)			千新シェケル			
BANK HAPOALIM BM	930	1,020	2,008	59,809	銀行	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,150	1,380	1,871	55,726	銀行	
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	1,650	1,860	1,608	47,913	各種電気通信サービス	
DELEK GROUP LTD	4	4	291	8,691	石油・ガス・消耗燃料	
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	340	440	726	21,620	化学	
NICE SYSTEMS LTD	53	53	1,306	38,906	ソフトウェア	
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD	751	881	18,130	539,940	医薬品	
ISRAEL CORP LIMITED/THE	2	—	—	—	化学	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	90	130	569	16,952	銀行	
AZRIELI GROUP	—	31	460	13,699	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,970	5,799	26,973	803,261	
	銘柄 数 < 比 率 >	9	9	—	< 0.2% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	1,019,003	1,154,618	—	309,377,723	
	銘柄 数 < 比 率 >	1,261	1,266	—	< 94.8% >	

\* 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。

\* 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、数値が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	%	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	29,500	34,100	630	71,007	0.0	
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	81,000	—	—	—	—	
AMERICAN TOWER CORP	36,200	41,000	4,194	472,659	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,000	91,000	926	104,384	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,290	13,330	2,517	283,627	0.1	
BOSTON PROPERTIES	13,280	14,700	1,862	209,898	0.1	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	17,300	440	49,669	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	7,600	8,300	693	78,111	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	28,800	32,300	2,807	316,387	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	11,800	14,000	1,236	139,342	0.0	
DUKE REALTY CORP	28,600	34,000	760	85,702	0.0	
EQUINIX INC	4,652	6,490	2,129	239,944	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	29,700	35,100	2,627	296,036	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,400	6,300	1,463	164,941	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	11,000	1,017	114,664	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,800	6,520	1,016	114,565	0.0	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,600	54,400	1,605	180,890	0.1	
HCP INC	39,800	45,600	1,479	166,683	0.1	
HEALTH CARE REIT INC	30,300	—	—	—	—	
HOTEL & RESORTS INC	65,900	73,900	1,216	137,063	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	14,800	19,000	638	71,956	0.0	
KIMCO REALTY CORP	34,800	40,500	1,160	130,791	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	12,500	15,000	500	56,368	0.0	
MACERICH CO /THE	12,200	13,300	1,051	118,452	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	7,200	730	82,330	0.0	
PLUM CREEK TIMBER CO	15,400	—	—	—	—	
PROLOGIS INC	43,800	50,700	2,214	249,481	0.1	
PUBLIC STORAGE	12,680	14,240	3,890	438,382	0.1	
RAYONIER INC	11,800	—	—	—	—	
REALTY INCOME CORP	19,300	23,800	1,480	166,833	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	8,000	8,800	660	74,438	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	8,200	9,800	939	105,854	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	27,150	29,970	6,165	694,754	0.2	
UDR INC	22,600	25,700	983	110,767	0.0	
VENTAS INC	28,300	31,700	1,995	224,890	0.1	
VEREIT INC	—	88,000	777	87,656	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	14,900	16,600	1,559	175,769	0.1	
WELLTOWER INC	—	34,500	2,376	267,768	0.1	
WEYERHAEUSER CO	45,900	76,000	2,359	265,902	0.1	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	509,000	262	29,537	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,397,552	1,553,150	58,373	6,577,514	
	銘柄 数 < 比 率 >	35	36	—	< 2.0% >	
(カナダ)				千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		10,500	13,600	282	24,515	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)			千カナダドル	千円	%	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	12,400	14,400	383	33,244	0.0	
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	6,900	235	20,402	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	22,900	34,900	900	78,162	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	3	—	< 0.0% >	
(イギリス)			千英ポンド			
BRITISH LAND	84,000	94,000	666	107,913	0.0	
HAMMERSON PLC	67,000	73,000	420	68,143	0.0	
INTU PROPERTIES PLC	77,000	88,000	277	44,983	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	68,000	77,500	843	136,656	0.0	
SEGRO PLC	60,000	70,000	288	46,686	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	356,000	402,500	2,497	404,383	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.1% >	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
ICADE	3,000	3,000	203	25,993	0.0	
KLEPIERRE	14,500	21,200	891	113,852	0.0	
GECINA SA	2,470	3,400	407	52,014	0.0	
FONCIERE DES REGIONS	2,500	3,100	259	33,082	0.0	
UNIBAIL RODAMCO-NA	8,480	9,600	2,352	300,350	0.1	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	30,950	40,300	4,113	525,294	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.2% >	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	200,000	219,000	10,161	147,648	0.0	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	260,000	1,827	26,557	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	200,000	479,000	11,989	174,205	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	2	—	< 0.1% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND MALL TRUST	219,900	249,900	529	44,136	0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	187,000	213,000	513	42,765	0.0	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	192,000	192,000	288	23,993	0.0	
SUNTEC REIT	203,000	243,000	413	34,415	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	801,900	897,900	1,744	145,310	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.0% >	
(オーストラリア)			千豪ドル			
MIRVAC GROUP	336,000	350,000	663	57,205	0.0	
GPT GROUP	148,000	179,000	887	76,576	0.0	
LENDLEASE GROUP	48,000	53,000	723	62,397	0.0	
STOCKLAND TRUST GROUP	197,000	230,000	959	82,722	0.0	
DEXUS PROPERTY GROUP	75,000	92,000	723	62,369	0.0	
GOODMAN GROUP	150,000	174,000	1,160	100,100	0.0	
FEDERATION CENTRES	132,200	—	—	—	—	
SCENTRE GROUP	452,000	513,000	2,252	194,241	0.1	
WESTFIELD CORP	171,400	193,000	1,935	166,961	0.1	
NOVION PROPERTY GROUP	184,200	—	—	—	—	

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) VICINITY CENTRES	口 —	口 328,704	千豪ドル 1,035	千円 89,304	% 0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 1,893,800	2,112,704	10,340	891,878		
銘 柄 数 < 比 率 >	10	9	—	< 0.3% >		
合 計	口 数 ・ 金 額 4,703,102	5,520,454	—	8,796,750		
銘 柄 数 < 比 率 >	62	64	—	< 2.7% >		

\*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。

\*比率は、純資産総額に対する投資信託証券評価額の比率。

\*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	百万円	百万円
	CAN60	328	—
	EURO50	1,087	—
	FT100	676	—
	SPEMINI	5,592	—
	SWISSMKT	324	—

\*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

(2016年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 309,377,723	% 94.7
投資信託受益証券	29,537	0.0
投資証券	8,767,212	2.7
コール・ローン等、その他	8,535,586	2.6
投資信託財産総額	326,710,058	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（324,747,687千円）の投資信託財産総額（326,710,058千円）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=112.68円、1カナダドル=86.79円、1英ポンド=161.92円、1スイスフラン=116.74円、1スウェーデンクローナ=13.85円、1ノルウェークローネ=13.56円、1デンマーククローネ=17.14円、1ユーロ=127.70円、1香港ドル=14.53円、1シンガポールドル=83.31円、1豪ドル=86.25円、1ニュージーランドドル=77.88円、1新シエケル=29.78円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月31日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	328,623,889,302	
コール・ローン等	6,303,064,788	
株式(評価額)	309,377,723,661	
投資信託受益証券(評価額)	29,537,371	
投資証券(評価額)	8,767,212,705	
未収入金	2,065,461,383	
未収配当金	661,634,499	
未収利息	11	
差入委託証拠金	1,419,254,884	
(B) 負債	2,192,455,412	
未払金	1,982,175,335	
未払解約金	206,616,677	
その他未払費用	3,663,400	
(C) 純資産総額(A-B)	326,431,433,890	
元本	162,042,393,593	
次期繰越損益金	164,389,040,297	
(D) 受益権総口数	162,042,393,593口	
1万口当たり基準価額(C/D)	20,145円	

(注) 期首元本額148,838百万円、期中追加設定元本額39,073百万円、期中一部解約元本額25,868百万円、計算口数当たり純資産額20,145円。

## ○損益の状況 (2015年4月1日～2016年3月31日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	7,070,564,590	
受取配当金	7,020,077,020	
受取利息	1,118,843	
その他収益金	50,733,844	
支払利息	△ 1,365,117	
(B) 有価証券売買損益	△ 38,396,334,939	
売買益	17,774,213,949	
売買損	△ 56,170,548,888	
(C) 先物取引等取引損益	△ 61,877,253	
取引益	1,000,351,308	
取引損	△ 1,062,228,561	
(D) 保管費用等	△ 48,940,378	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 31,436,587,980	
(F) 前期繰越損益金	182,682,883,846	
(G) 追加信託差損益金	43,758,396,155	
(H) 解約差損益金	△ 30,615,651,724	
(I) 計(E+F+G+H)	164,389,040,297	
次期繰越損益金(I)	164,389,040,297	

\*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
	百万円
バランスセレクト30	63
バランスセレクト50	200
バランスセレクト70	187
野村外国株式インデックスファンド	562
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,928
野村世界6資産分散投信(分配コース)	10,449
野村世界6資産分散投信(成長コース)	5,914
野村資産設計ファンド2015	40
野村資産設計ファンド2020	41
野村資産設計ファンド2025	51
野村資産設計ファンド2030	49
野村資産設計ファンド2035	35
野村資産設計ファンド2040	120
野村外国株インデックス(野村投資一任口座向け)	16,151
のむらっぴ・ファンド(保守型)	909
のむらっぴ・ファンド(普通型)	5,321
のむらっぴ・ファンド(積極型)	4,348
野村資産設計ファンド2045	11
野村インデックスファンド・外国株式	2,399
マイ・ロード	1,605
ネクストコア	91
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	90
野村外国株インデックス(野村SMA・EW向け)	419
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	255
野村資産設計ファンド2050	5
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)	621
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)	458
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)	9,968
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)	4,059
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)	9
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)	38
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)	28
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)	131
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)	1,438
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)	571
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	238
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)	34
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)	267
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)	4,738
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	638
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	896
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)	183
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)	638
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	16
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	14
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)	55,942
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,377
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,418
マイバランス70(確定拠出年金向け)	5,967
マイバランスDC30	741
マイバランスDC50	1,288
マイバランスDC70	969
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	12,907
野村DC運用戦略ファンド	143
野村DC運用戦略ファンドM	0
野村DC運用戦略ファンドA	1
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	31
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	0
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	0

\* 単位未満は切り捨て。

○お知らせ

---

有価証券の指図範囲に新投資口予約権証券を加える所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2015年8月3日>

# 新興国株式マザーファンド

## 運用報告書

第8期（決算日2016年5月10日）

作成対象期間（2015年5月12日～2016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	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・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。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	新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）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	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	円	騰落率	円	騰落率				
4期(2012年5月10日)	7,147	△15.0	70.89	△14.1	97.0	2.8	0.0	6,593
5期(2013年5月10日)	10,056	40.7	100.34	41.5	98.2	1.7	0.0	9,301
6期(2014年5月12日)	9,924	△1.3	98.98	△1.4	96.1	3.5	0.4	9,568
7期(2015年5月11日)	12,236	23.3	122.66	23.9	96.6	2.9	0.4	14,431
8期(2016年5月10日)	8,770	△28.3	88.42	△27.9	95.5	3.9	0.6	12,986

\*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。

\*ベンチマーク (=「MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース)」) は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・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。

\*MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行われますので、変動することがあります。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の作成または編集に関す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。

請求目論見書には、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、為替レート (対顧客電信売買相場仲値)

## ○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	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	円	騰落率			
(期首) 2015年5月11日	12,236	—	122.66	—	96.6	2.9	0.4
5月末	12,350	0.9	123.82	0.9	96.6	2.8	0.5
6月末	11,688	△4.5	117.21	△4.4	96.5	2.7	0.5
7月末	11,079	△9.5	111.14	△9.4	95.9	3.6	0.5
8月末	9,905	△19.1	99.83	△18.6	97.5	1.9	0.6
9月末	9,350	△23.6	93.81	△23.5	96.5	2.9	0.6
10月末	10,279	△16.0	103.14	△15.9	96.3	3.1	0.5
11月末	10,157	△17.0	102.39	△16.5	95.1	4.1	0.6
12月末	9,703	△20.7	97.61	△20.4	95.9	3.4	0.6
2016年1月末	8,800	△28.1	88.38	△27.9	97.1	2.2	0.6
2月末	8,460	△30.9	85.23	△30.5	96.4	2.9	0.6
3月末	9,483	△22.5	95.44	△22.2	96.9	2.3	0.6
4月末	9,370	△23.4	94.12	△23.3	95.9	3.5	0.6
(期末) 2016年5月10日	8,770	△28.3	88.42	△27.9	95.5	3.9	0.6

\*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エマージング・マーケット・インデックス（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12,236円から期末8,770円に3,466円の値下がりとなりました。

中国人民元の通貨切り下げをきっかけとした世界的な景気減速懸念や、原油価格の下落、各国通貨が対円で下落（円高）したことなどを受けて、基準価額は下落しました。

### ○投資環境

期首から2015年9月にかけては、FRB（米連邦準備制度理事会）による早期利上げ観測が高まったことや、中国の景気減速を示唆する経済指標の発表が相次いだこと、中国人民元の通貨切り下げなどから景気減速懸念が高まったことなどを受けて、新興国株式市場は下落しました。

2015年10月初旬には、中国人民銀行が追加金融緩和に踏み切ったことなどを背景にアジアを中心に上昇する場面もありましたが、11月以降は中国における景気減速懸念の再燃や原油など商品価格が低下したことなどを受けて、新興国株式市場は再び下落しました。

2016年1月以降は、中国株式市場におけるIPO（新規株式公開）による株式需給の悪化懸念や、原油価格の下落が続きリスク回避姿勢が強まったことなどを受け下落する一方、2月中旬

以降には原油価格が持ち直したことや中国人民銀行による預金準備率の引き下げが発表されたことなどを背景に上昇するなど、新興国株式市場は一進一退の展開となりました。

為替市場は、中国人民元の通貨切り下げをきっかけに世界的な景気減速懸念が高まったことを受けリスク回避姿勢が強まったことや、米国の利上げペースが緩やかなものに留まるとの観測が強まったこと、日銀が追加金融緩和を見送ったことなどを背景に、各国通貨が対円で下落（円高）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・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すため、新興国の株式（DR（預託証券）を含む）に幅広く分散投資し、株式先物への投資も一部行いました。期中の資金流出入や「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」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、実質株式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-28.3%となり、ベンチマークの-27.9%を0.4ポイント下回りました。

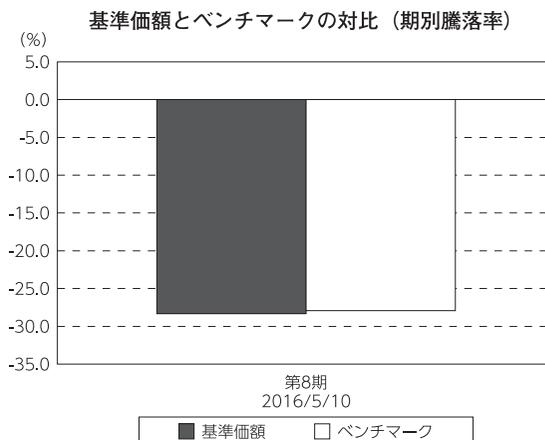
主な差異要因は以下の通りです。

### （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、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・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。

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

(2015年5月12日～2016年5月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
	円	%	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	4 (4) (0) (1)	0.044 (0.037) (0.001) (0.006)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	2 (2) (0)	0.025 (0.024) (0.000)	(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
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	16 (14) (2)	0.159 (0.140) (0.019)	(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
合 計	22	0.228	
期中の平均基準価額は、10,052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

(2015年5月12日～2016年5月10日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	カタール	百株 516 ( 26)	千カタールリヤル 1,895 ( 68)	百株 20 ( 6)	千カタールリヤル 152 ( 36)
	アメリカ	10,491 ( 194)	千米ドル 4,639 ( -)	949 ( 17)	千米ドル 467 ( 47)
	トルコ	1,005 ( 87)	千トルコリラ 929 ( -)	197	千トルコリラ 224
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ギリシャ	5,142 (△ 4,372)	336 ( -)	35 ( -)	17 ( 0.44279)
	チェコ	32	千チェココルナ 1,668	27	千チェココルナ 586
	ハンガリー	20	千フォリント 14,165	-	千フォリント -
	ポーランド	501 ( 160)	千ズロチ 1,259 ( -)	326	千ズロチ 217
	香港	79,888 ( 4,969)	千香港ドル 56,165 ( 1,102)	31,677 ( 1,331)	千香港ドル 11,333 ( 979)
	マレーシア	6,093 ( 627)	千リンギ 3,359 ( 79)	1,110 ( 61)	千リンギ 715 ( 31)
	タイ	7,656 ( 1,316)	千バーツ 18,685 ( 561)	627 ( 192)	千バーツ 4,294 ( 555)
	フィリピン	5,055	千フィリピンペソ 19,047	311	千フィリピンペソ 2,111
	インドネシア	18,830	千ルピア 9,679,072	3,567	千ルピア 1,856,724
	韓国	472 ( 111)	千ウォン 4,734,421 ( 340,995)	166 ( 61)	千ウォン 966,842 ( 318,282)
	台湾	19,750 ( 3,092)	千新台幣ドル 94,352 ( 1,883)	5,916 ( 684)	千新台幣ドル 22,830 ( 481)
	インド	3,401 ( 573)	千インドルピー 215,457 ( 2,390)	974 ( -)	千インドルピー 34,850 ( 2,390)
	メキシコ	5,590 ( 912)	千メキシコペソ 17,297 ( -)	2,950 ( 131)	千メキシコペソ 6,695 ( 88)
	ブラジル	3,216 ( 653)	千レアル 5,406 ( 19)	1,490 ( 2)	千レアル 1,921 ( 30)

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	チリ	百株 558 ( 2)	千チリペソ 101,506 ( 3,497)	百株 327 ( 1)	千チリペソ 108,016 ( 604)
	コロンビア	150 ( 25)	千コロンビアペソ 155,045 ( 94,250)	448 ( 25)	千コロンビアペソ 318,835 ( 94,250)
	アラブ首長国連邦	2,204	千UAEディルハム 1,731	129	千UAEディルハム 75
	エジプト	376 ( 58)	千エジプトポンド 388 ( -)	65	千エジプトポンド 56
	南アフリカ	2,225 ( 828)	千ランド 28,422 ( 7,301)	672 ( 871)	千ランド 6,792 ( 7,324)

\*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	トルコ	口	千トルコリラ	口	千トルコリラ
	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	12,000	33	-	-
	小 計	12,000	33	-	-
	メキシコ		千メキシコペソ		千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	11,200	393	( -)	( 95)
小 計	11,200	393	( -)	( 95)	
外 国	南アフリカ		千ランド		千ランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	10,000	254	-	-
	REDEFINE PROPERTIES LTD	66,040	772	-	-
	RESILIENT PROPERTY INCOME	1,900 ( 622)	207 ( 55)	-	-
	RESILIENT PROPERTY INCOME-RIGHTS	- ( 622)	- ( 2)	(9,072)	(883)
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	7,790	954	-	-
	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	29,380	518	-	-
	FORTRESS INCOME FUND LTD	21,220	910	-	-
	RESILIENT REIT LTD	- ( 9,072)	- ( 880)	-	-
	小 計	136,330 ( 10,316)	3,617 ( 939)	- (9,694)	- (886)

\*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 4,419	百万円 4,215	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

(2015年5月12日～2016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	4,558,108千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,707,868千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.35

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2015年5月12日～2016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 2,165	% 32.1	百万円 3,835	百万円 1,954	% 51.0	
預金	825	100.0	825	825	100.0	

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

(2016年5月10日現在)

## 外国株式

銘柄	株数	株数	期 末		業 種 等	
			評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カタル)	百株	百株	千カタルリヤル	千円		
QATAR INSURANCE CO	—	37	288	8,614	保険	
QATAR NATIONAL BANK	49	68	956	28,558	銀行	
COMMERCIAL BANK OF QATAR	21	56	207	6,182	銀行	
OOREDOO QSC	21	27	244	7,307	各種電気通信サービス	
DOHA BANK LTD	17	42	152	4,550	銀行	
QATAR ELECTRICITY & WATER CO	8	8	172	5,153	総合公益事業	
INDUSTRIES QATAR	44	50	499	14,910	コングロマリット	
QATAR ISLAMIC BANK	17	21	207	6,205	銀行	
QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	—	96	217	6,502	石油・ガス・消耗燃料	
MASRAF AL RAYAN	97	133	445	13,309	銀行	
BARWA REAL ESTATE CO	22	32	104	3,133	不動産管理・開発	
EZDAN HOLDING GROUP	—	253	444	13,260	不動産管理・開発	
GULF INTERNATIONAL SERVICES	12	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
VODAFONE QATAR	99	99	113	3,390	無線通信サービス	
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	412 11	928 13	4,056 —	121,079 <0.9%>	
(アメリカ)			千米ドル			
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	—	166	1,318	142,972	インターネットソフトウェア・サービス	
BAIDU INC - SPON ADR	—	45	762	82,722	インターネットソフトウェア・サービス	
BANCO DE CHILE-ADR	10	12	80	8,677	銀行	
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	45	52	99	10,741	銀行	
BANCOLOMBIA S. A. -SPONS ADR	30	36	124	13,521	銀行	
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	20	25	54	5,897	飲料	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	46	66	60	6,592	金属・鉱業	
CORPBANCA SA-ADR	23	—	—	—	銀行	
CTRIP.COM INTERNATIONAL -ADR	—	45	194	21,128	インターネット販売・カタログ販売	
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	70	88	79	8,675	石油・ガス・消耗燃料	
EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIDAD SA-ADR	32	37	103	11,184	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
ENDESA AMERICAS SA - ADR	—	37	50	5,453	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
ENERSIS AMERICAS S. A-ADR	109	135	112	12,234	電力	
ENERSIS CHILE SA-ADR	—	135	79	8,654	電力	
58.COM INC-ADR	—	11	55	6,022	インターネットソフトウェア・サービス	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	143	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
ITAU CORPBANCA-ADR	—	31	40	4,429	銀行	
JD.COM INC-ADR	—	58	135	14,739	インターネット販売・カタログ販売	
STATE BANK OF INDIA-GDR	43	52	145	15,826	銀行	
PJSC GAZPROM-ADR	1,643	1,988	942	102,246	石油・ガス・消耗燃料	
LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR	91	109	70	7,625	旅客航空輸送業	
TRANSNEFT PFD-CLS	0.44	0.48	151	16,378	石油・ガス・消耗燃料	
INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	289	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	154	176	157	17,056	無線通信サービス	
NETEASE INC-ADR	—	13	180	19,593	インターネットソフトウェア・サービス	
NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	—	20	78	8,542	各種消費者サービス	
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	—	153	51	5,535	不動産管理・開発	
QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR	—	17	110	12,005	インターネットソフトウェア・サービス	
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR	—	8	29	3,236	インターネット販売・カタログ販売	

銘柄	株数	株数	期 末		業 種 等	
			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		
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	29	35	70	7,607	化学	
SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR	—	37	21	2,355	インターネットソフトウェア・サービス	
SOUTHERN COPPER CORP	48	54	149	16,243	金属・鉱業	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	—	6	32	3,521	各種消費者サービス	
VINA CONCHA Y TORO SA-ADR	6	—	—	—	飲料	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	—	60	75	8,219	インターネット販売・カタログ販売	
YY INC-ADR	—	4	19	2,117	インターネットソフトウェア・サービス	
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	415	490	235	25,509	石油・ガス・消耗燃料	
AFK SISTEMA-REG S SPONS GDR	45	56	39	4,267	無線通信サービス	
NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	25	30	282	30,667	石油・ガス・消耗燃料	
JSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	162	—	—	—	金属・鉱業	
ROSTELECOM-SPONSORED ADR	38	38	31	3,469	各種電気通信サービス	
ROSNEFT OJSC - GDR	314	377	185	20,154	石油・ガス・消耗燃料	
URALKALI-SPON GDR	78	—	—	—	化学	
PJSC ALROSA	557	557	61	6,664	金属・鉱業	
SEVERSTAL-GDR REG S	52	65	69	7,554	金属・鉱業	
TATNEFT-SPONSORED ADR	68	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	718	838	167	18,197	銀行	
DP WORLD LTD	45	57	105	11,462	運送インフラ	
PJSC RUSHYDRO	30,910	38,910	39	4,321	電力	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	72	87	294	31,956	食品・生活必需品小売り	
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	3,180	3,575	654	71,023	銀行	
PJSC MOSCOW EXCHANGE	374	374	59	6,416	各種金融サービス	
MEGAFON PJSC-GDR	25	31	34	3,752	無線通信サービス	
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	—	180	240	26,068	金属・鉱業	
TATNEFT-SPONSORED ADR	—	80	233	25,302	石油・ガス・消耗燃料	
LUKOIL PJSC-SPON ADR	—	168	666	72,269	石油・ガス・消耗燃料	
CREDICORP LTD	19	22	302	32,837	銀行	
小 計	株 数 ・ 金 額	39,938	49,657	9,345	1,013,655	
	銘柄 数 < 比 率 >	37	50	—	< 7.8% >	
(トルコ)			千トルコリラ			
AKBANK T. A. S	618	771	597	22,021	銀行	
ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYII	59	59	113	4,186	飲料	
ARCELIK A. S	63	84	157	5,816	家庭用耐久財	
ENKA INSAAT VE SANAYI	127	172	81	2,988	コングロマリット	
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	387	464	211	7,806	金属・鉱業	
FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	16	23	84	3,104	自動車	
KOC HLDGS	158	199	261	9,630	コングロマリット	
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	90	205	85	3,135	化学	
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	162	181	65	2,403	コングロマリット	
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	30	43	98	3,645	自動車	
TURK HAVA YOLLARI AO	147	183	123	4,535	旅客航空輸送業	
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	258	305	335	12,351	無線通信サービス	
TURKIYE GARANTI BANKASI	677	739	558	20,590	銀行	
TURKIYE IS BANKASI AS-C	454	545	240	8,849	銀行	
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	34	40	274	10,121	石油・ガス・消耗燃料	
ULKER BISKUVI SANAYI AS	45	45	97	3,596	食品	
YAPI VE KREDI BANKASI A. S.	250	250	98	3,639	銀行	
HACI OMER SABANCI HOLDING	279	334	308	11,352	各種金融サービス	
COCA-COLA ICECEK AS	20	20	72	2,670	飲料	
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	62	71	426	15,720	食品・生活必需品小売り	
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	178	240	106	3,910	銀行	

銘柄	株数	期 末			業 種 等	
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(トルコ)	百株	百株	千トルコリラ	千円		
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	44	44	71	2,630	運送インフラ	
TURKIYE HALK BANKASI	184	222	212	7,813	銀行	
TURK TELEKOMUNIKASYON AS	155	155	96	3,564	各種電気通信サービス	
小 計	株 数 ・ 金 額	4,507	5,403	4,778	176,087	
	銘柄 数 < 比 率 >	24	24	—	<1.4%>	
(ユーロ…ギリシャ)			千ユーロ			
ALPHA BANK A. E.	1,104	—	—	—	銀行	
HELLENIC TELECOM	65	76	66	8,237	各種電気通信サービス	
OPAP SA	59	75	51	6,311	ホテル・レストラン・レジャー	
JUMBO SA	31	31	34	4,319	専門小売り	
PUBLIC POWER CORP	35	34	10	1,357	電力	
TITAN CEMENT CO	11	15	31	3,882	建設資材	
FF GROUP	8	8	16	2,043	専門小売り	
NATIONAL BANK OF GREECE	433	—	—	—	銀行	
PIRAEUS BANK S. A.	636	—	—	—	銀行	
EUROBANK ERGASIAS SA	2,278	—	—	—	銀行	
PIRAEUS BANK S. A.	—	2,006	55	6,813	銀行	
EUROBANK ERGASIAS SA	—	676	59	7,312	銀行	
ALPHA BANK A. E.	—	474	102	12,704	銀行	
NATIONAL BANK OF GREECE	—	1,999	58	7,260	銀行	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	4,664	5,399	487	60,243	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	10	—	<0.5%>	
(チェコ)			千チェココルナ			
KOMERCNI BANKA AS	3	4	2,254	10,300	銀行	
O2 CZECH REPUBLIC AS	24	18	416	1,902	各種電気通信サービス	
CEZ AS	48	58	2,511	11,479	電力	
小 計	株 数 ・ 金 額	77	82	5,182	23,682	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.2%>	
(ハンガリー)			千フォリント			
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	10	13	21,958	8,590	石油・ガス・消耗燃料	
OTP BANK NYRT	66	76	53,656	20,990	銀行	
RICHTER GEDEON NYRT	38	46	25,654	10,035	医薬品	
小 計	株 数 ・ 金 額	115	136	101,268	39,616	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.3%>	
(ポーランド)			千ズロチ			
BANK MILLENNIUM SA	110	190	90	2,527	銀行	
MBANK	3	4	150	4,190	銀行	
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	8	8	61	1,706	銀行	
KGHM POLSKA MIEDZ S. A.	40	48	321	8,953	金属・鉱業	
BANK PEKAO SA	36	45	704	19,632	銀行	
ORANGE POLSKA SA	167	217	127	3,543	各種電気通信サービス	
POLSKI KONCERN NAFTOWY S. A.	94	112	749	20,889	石油・ガス・消耗燃料	
LPP SA	0.26	0.4	217	6,062	繊維・アパレル・贅沢品	
BANK ZACHODNI WBK SA	10	12	311	8,668	銀行	
PKO BANK POLSKI SA	238	306	744	20,754	銀行	
CCC SA	7	7	116	3,237	繊維・アパレル・贅沢品	
SYNTHOS SA	118	181	72	2,025	化学	
EUROCASH SA	25	25	124	3,455	食品・生活必需品小売り	
GRUPA LOTOS SA	25	25	75	2,098	石油・ガス・消耗燃料	
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	498	587	298	8,329	石油・ガス・消耗燃料	
CYFROWY POLSAT SA	46	62	144	4,030	メディア	
GRUPA AZOTY SA	12	15	130	3,629	化学	

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ポーランド)	百株	百株	千ズロチ	千円		
ENEA SA	56	56	63	1,777	電力	
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	257	299	386	10,780	電力	
TAURON POLSKA ENERGIA SA	286	286	81	2,274	電力	
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	16	178	612	17,061	保険	
GETIN NOBLE BANK SA	279	—	—	—	銀行	
ALIOR BANK SA	12	16	110	3,081	銀行	
ENERGA SA	62	62	70	1,972	電力	
小 計	株 数 ・ 金 額	2,414	2,750	5,767	160,682	
	銘柄 数 < 比 率 >	24	23	—	< 1.2% >	
(香港)			千香港ドル			
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	350	450	399	5,576	金属・鉱業	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	360	360	379	5,300	運送インフラ	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	—	500	255	3,562	旅客航空輸送業	
CHINA MOBILE LTD	1,715	2,045	17,505	244,547	無線通信サービス	
ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	360	450	815	11,391	建設資材	
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN-H	760	760	158	2,218	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	140	170	640	8,941	コングロマリット	
HUANENG POWER INTL INC-H	1,080	1,460	798	11,156	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
YANZHOU COAL MINING-H	460	460	192	2,686	石油・ガス・消耗燃料	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	210	250	1,677	23,434	パーソナル用品	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	500	500	195	2,731	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	199	268	297	4,152	自動車	
NEW WORLD CHINA LAND LTD	660	—	—	—	不動産管理・開発	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	880	1,040	769	10,751	自動車	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	1,280	1,280	844	11,801	医薬品	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	1,180	1,320	2,989	41,767	不動産管理・開発	
CHINA RESOURCES LAND LTD	644	944	1,699	23,748	不動産管理・開発	
CITIC LTD	630	1,520	1,684	23,527	コングロマリット	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	480	480	390	5,458	運送インフラ	
LENOVO GROUP LTD	1,860	2,460	1,402	19,588	コンピュータ・周辺機器	
PETROCHINA CO LTD-H	5,980	7,180	3,841	53,662	石油・ガス・消耗燃料	
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	1,700	2,000	1,762	24,615	各種電気通信サービス	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	280	536	804	11,231	保険	
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	7,209	8,449	4,385	61,258	石油・ガス・消耗燃料	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	—	280	386	5,405	情報技術サービス	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	200	260	981	13,711	ガス	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	960	1,180	732	10,236	石油・ガス・消耗燃料	
COSCO PACIFIC LTD	520	520	424	5,927	運送インフラ	
YUEXIU PROPERTY CO LTD	1,702	2,382	257	3,594	不動産管理・開発	
CHINA MERCHANTS HLDGS INTL	320	380	826	11,546	運送インフラ	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	980	1,320	320	4,481	金属・鉱業	
CHINA EVERBRIGHT LTD	220	280	413	5,781	資本市場	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	520	520	548	7,656	ガス	
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	150	—	—	—	電子装置・機器・部品	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	1,550	1,900	693	9,688	自動車	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	260	320	678	9,477	ガス	
BYD CO LTD-H	165	205	857	11,985	自動車	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	3,960	4,700	1,739	24,293	各種電気通信サービス	
CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	520	520	315	4,402	エネルギー設備・サービス	
SINOTRANS LIMITED-H	400	610	190	2,658	航空貨物・物流サービス	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	680	810	673	9,403	商業サービス・用品	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	410	—	—	—	紙製品・林産品	

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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	982	1,262	1,697	23,709	保険
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	560	720	372	5,210	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	580	700	907	12,673	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	305	1,130	632	8,840	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2,120	2,460	4,167	58,216	保険
ZIJIN MINING GROUP CO-H	1,530	2,010	516	7,216	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	520	520	228	3,196	ヘルスケア機器・用品
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	7,590	9,180	550	7,694	半導体・半導体製造装置
WEICHAI POWER CO LTD-H	132	264	228	3,186	機械
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	840	1,140	408	5,701	化学
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	130	130	222	3,109	コングロマリット
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	580	580	484	6,773	食品
TSING TAO BREWERY CO-H	100	100	290	4,051	飲料
GUANGDONG INVESTMENT	760	900	990	13,830	水道
CHINA RESOURCES BEER (HOLDINGS) CO LTD	380	380	644	9,003	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	340	460	356	4,986	運送インフラ
CNOOC LTD	5,030	6,020	5,381	75,184	石油・ガス・消耗燃料
SINO BIOPHARMACEUTICAL	840	1,540	839	11,725	医薬品
CHINA SHIPPING CONTAINER-H	1,130	1,130	186	2,604	海運業
CHINA MENGNIU DAIRY CO	400	910	1,142	15,967	食品
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	730	1,710	5,890	82,296	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,250	1,510	723	10,104	水道
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	2,863	3,833	356	4,980	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	—	1,150	385	5,381	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA LIMITED-H	540	540	315	4,405	旅客航空輸送業
ZTE CORP-H	195	234	239	3,341	通信機器
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	880	880	280	3,921	電気設備
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	955	1,185	1,440	20,130	石油・ガス・消耗燃料
CHINA COSCO HOLDINGS - H	760	760	208	2,909	海運業
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	2,497	2,787	1,304	18,227	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	460	560	623	8,715	建設・土木
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	20,420	28,060	13,300	185,807	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	170	170	661	9,238	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	760	900	713	9,970	自動車
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	410	570	293	4,100	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	770	770	274	3,840	建設資材
BANK OF CHINA LTD-H	22,370	26,600	8,033	112,223	銀行
SHUI ON LAND LTD	866	1,261	253	3,542	不動産管理・開発
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	420	420	445	6,219	不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	276	276	278	3,894	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK-H	1,261	1,541	2,538	35,455	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	20,890	24,650	9,761	136,366	銀行
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	604	864	297	4,152	各種電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1,250	1,410	1,243	17,373	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO-H	1,210	880	280	3,921	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	160	230	280	3,919	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	150	180	747	10,448	電気設備
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	270	420	519	7,263	家庭用耐久財
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	653	—	—	—	食品
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,543	1,933	595	8,320	不動産管理・開発
CHINA CITIC BANK-H	2,310	2,680	1,238	17,297	銀行
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	1,380	1,650	719	10,050	繊維・アパレル・贅沢品

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	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	270	320	615	8,601	繊維・アパレル・贅沢品
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	465	784	793	11,089	コングロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	920	1,280	253	3,540	不動産管理・開発
SINO-OCEAN LAND HOLDINGS	1,015	1,015	337	4,721	不動産管理・開発
SOHO CHINA LTD	430	655	243	3,394	不動産管理・開発
KINGSOFT CORP LTD	200	270	458	6,404	ソフトウェア
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	2,590	4,092	470	6,574	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,210	1,210	693	9,685	建設・土木
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	312	—	—	—	食品
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	595	595	545	7,613	建設・土木
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	1,730	1,960	1,154	16,127	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	728	906	2,283	31,895	保険
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP	1,540	1,470	827	11,561	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD-H	550	1,553	1,120	15,647	機械
SUN ART RETAIL GROUP LTD	720	720	376	5,260	食品・生活必需品小売り
BBMG CORPORATION - H	360	—	—	—	建設資材
SINOPHARM GROUP CO-H	332	380	1,250	17,465	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CHINA RESOURCES CEMENT	440	—	—	—	建設資材
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	599	739	619	8,653	自動車
CHINA SOUTH CITY HOLDINGS	520	—	—	—	不動産管理・開発
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	680	680	266	3,723	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	830	1,000	508	7,096	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	185	241	391	5,467	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	—	1,120	246	3,442	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	1,060	—	—	—	医薬品
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	—	520	257	3,603	不動産管理・開発
LONGFOR PROPERTIES	400	500	513	7,166	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	213	257	625	8,742	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	1,825	2,030	1,433	20,021	銀行
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	640	960	320	4,479	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	6,030	7,450	2,004	27,996	銀行
FAR EAST HORIZON LTD	420	580	353	4,934	各種金融サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H	300	715	1,133	15,841	資本市場
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	260	360	374	5,230	医薬品
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	404	1,092	1,323	18,489	資本市場
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	205	235	1,284	17,941	電子装置・機器・部品
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS -H	136	136	144	2,013	機械
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	1,810	2,190	648	9,055	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	95	130	256	3,577	医薬品
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	325	325	209	2,923	建設・土木
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	485	1,140	714	9,985	資本市場
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	1,350	1,440	413	5,773	食品
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	1,450	2,930	720	10,069	資本市場
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	—	495	716	10,013	機械
TENCENT HOLDINGS LTD	1,446	1,718	26,646	372,247	インターネットソフトウェア・サービス
CHINA CNR CORP LTD	585	—	—	—	機械
CHINA VANKE CO LTD-H	364	441	829	11,582	不動産管理・開発
LUYE PHARMA GROUP LTD	—	370	187	2,620	医薬品
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	1,300	3,400	595	8,312	メディア
CAR INC	—	250	206	2,881	陸運・鉄道
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LTD	3,430	3,670	78	1,102	半導体・半導体製造装置
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	700	700	354	4,948	各種電気通信サービス

銘柄	株数	期末			業種等	
		株数	評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円		
CGN POWER CO LTD-H	1,640	3,100	740	10,350	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
DALIAN WANDA COMMERCIAL PROP	—	194	994	13,889	不動産管理・開発	
GF SECURITIES CO LTD-H	—	496	820	11,460	資本市場	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	—	464	707	9,878	資本市場	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	200,656	252,504	187,485	2,619,167	
		139	140	—	<20.2%>	
(マレーシア)			千リンギ			
AMMB HOLDING	542	657	292	7,829	銀行	
GENTING PLANTATIONS BHD	56	85	90	2,431	食品	
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	1,465	1,793	840	22,519	銀行	
DIGI.COM BERHAD	982	1,112	489	13,102	無線通信サービス	
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	243	243	158	4,233	運送インフラ	
RHB CAPITAL BHD	142	170	98	2,646	銀行	
HAP SENG CONSOLIDATED	—	168	129	3,455	コングロマリット	
BERJAYA SPORTS TOTO BHD	171	173	53	1,422	ホテル・レストラン・レジャー	
GAMUDA BERHAD	523	523	247	6,638	建設・土木	
YTL CORPORATION	1,242	1,573	245	6,572	総合公益事業	
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	58	63	93	2,502	銀行	
HONG LEONG BANK	173	201	267	7,169	銀行	
IJM CORP	416	1,017	354	9,505	建設・土木	
KUALA LUMPUR KEPONG	142	134	307	8,224	食品	
MALAYAN BANKING	1,324	1,631	1,428	38,262	銀行	
LAFARGE MALAYSIA BHD	129	129	109	2,936	建設資材	
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD	295	395	161	4,337	銀行	
MISC BHD	284	348	252	6,768	海運業	
PPB GROUP BERHAD	118	149	233	6,264	食品	
PETRONAS DAGANGAN BHD	63	83	190	5,112	石油・ガス・消耗燃料	
PETRONAS GAS BERHAD	214	251	524	14,048	ガス	
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	36	45	212	5,690	タバコ	
TELEKOM MALAYSIA	324	401	264	7,087	各種電気通信サービス	
TENAGA NASIONAL	948	1,129	1,594	42,691	電力	
UMW HOLDINGS BHD	152	213	132	3,559	自動車	
DIALOG GROUP BHD	937	1,231	197	5,276	建設・土木	
PUBLIC BANK BHD	786	825	1,573	42,140	銀行	
YTL POWER INTL	431	720	108	2,895	総合公益事業	
AIRASIA BHD	269	456	95	2,564	旅客航空輸送業	
GENTING BHD	624	721	606	16,238	ホテル・レストラン・レジャー	
GENTING MALAYSIA BHD	842	1,004	431	11,561	ホテル・レストラン・レジャー	
IOI CORP	810	965	401	10,750	食品	
SIME DARBY BERHAD	832	1,035	778	20,843	コングロマリット	
HARTALEGA HOLDINGS BHD	—	197	76	2,036	ヘルスケア機器・用品	
AXIATA GROUP BERHAD	749	882	476	12,754	無線通信サービス	
UEM SUNRISE BHD	404	—	—	—	不動産管理・開発	
BUMI ARMADA BERHAD	470	820	63	1,701	エネルギー設備・サービス	
MAXIS BHD	534	634	340	9,117	無線通信サービス	
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	841	943	576	15,429	化学	
SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD	932	1,173	187	5,026	エネルギー設備・サービス	
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	358	500	133	3,561	メディア	
IHH HEALTHCARE BHD	660	783	509	13,650	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
FELDA GLOBAL VENTURES	386	386	55	1,488	食品	
WESTPORTS HOLDINGS BHD	—	332	138	3,716	運送インフラ	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(マレーシア)	百株	百株	千リンギ	千円		
IOI PROPERTIES GROUP BHD	401	564	136	3,642	不動産管理・開発	
小計	株数・金額	21,313	26,861	15,661	419,409	
	銘柄数<比率>	42	44	—	<3.2%>	
(タイ)			千バーツ			
BANGKOK BANK (F)	75	75	1,260	3,880	銀行	
KRUNG THAI BANK-NVDR	915	1,172	2,040	6,283	銀行	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	438	524	6,812	20,980	銀行	
TRUE CORP PCL-NVDR	2,648	2,798	2,085	6,421	各種電気通信サービス	
TRUE CORP PCL (NVDR)-RTS	—	940	28	86	各種電気通信サービス	
KASIKORN BANK PCL-NVDR	179	195	3,178	9,789	銀行	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	3,033	4,404	977	3,011	銀行	
IRPC PCL - NVDR	2,502	3,392	1,641	5,056	石油・ガス・消耗燃料	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	286	286	363	1,118	石油・ガス・消耗燃料	
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR-RIGHTS	—	143	220	678	石油・ガス・消耗燃料	
BANGKOK BANK PUBLIC CO-NVDR	92	—	—	—	銀行	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	714	963	2,407	7,415	食品	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	298	350	5,285	16,277	無線通信サービス	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	903	1,350	1,101	3,391	専門小売り	
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	151	151	1,064	3,278	電子装置・機器・部品	
PTT PCL-NVDR	277	346	10,345	31,863	石油・ガス・消耗燃料	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	577	577	1,240	3,820	食品	
SIAM CEMENT PUBLIC (F)	87	101	4,989	15,367	建設資材	
SIAM CEMENT PCL-NVDR	31	31	1,519	4,678	建設資材	
BEC WORLD PCL NVDR	276	276	687	2,116	メディア	
AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	127	144	5,702	17,563	運送インフラ	
KASIKORN BANK PCL (F)	330	401	6,576	20,255	銀行	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	318	420	2,310	7,114	不動産管理・開発	
BANGKOK DUST MED SERVI-NVDR	750	1,217	2,908	8,958	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	109	109	2,223	6,848	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	495	626	2,363	7,278	ホテル・レストラン・レジャー	
THAI OIL PCL-NVDR	251	251	1,556	4,793	石油・ガス・消耗燃料	
GLOW ENERGY PCL - NVDR	137	187	1,598	4,924	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
CP ALL PCL-NVDR	1,230	1,507	7,082	21,815	食品・生活必需品小売り	
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	1,808	1,808	1,645	5,067	陸運・鉄道	
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	386	461	3,399	10,471	石油・ガス・消耗燃料	
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	360	360	1,036	3,193	化学	
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	503	731	4,355	13,413	化学	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	220	363	784	2,414	石油・ガス・消耗燃料	
BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	—	2,000	1,190	3,665	運送インフラ	
小計	株数・金額	20,509	28,663	91,979	283,297	
	銘柄数<比率>	32	34	—	<2.2%>	
(フィリピン)			千フィリピンペソ			
AYALA LAND LTD	2,113	2,354	7,968	18,327	不動産管理・開発	
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	544	666	4,282	9,849	コングロマリット	
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	210	272	2,478	5,700	銀行	
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	546	546	784	1,803	コングロマリット	
DMCI HOLDINGS INC	940	1,275	1,491	3,431	コングロマリット	
GLOBE TELECOM INC	8	10	2,265	5,209	無線通信サービス	
INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	130	130	819	1,883	運送インフラ	
JG SUMMIT HOLDINGS INC	747	869	6,812	15,669	コングロマリット	
JOLLIBEE FOODS CORPORATION	127	156	3,538	8,137	ホテル・レストラン・レジャー	
METROPOLITAN BANK & TRUST	85	85	666	1,532	銀行	

銘柄	株数	株数	期末		業種等	
			評価額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(フィリピン)	百株	百株	千フィリピンペソ	千円		
MEGAWORLD CORP	2,770	3,740	1,383	3,182	不動産管理・開発	
PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO.	26	33	5,544	12,752	無線通信サービス	
ROBINSONS LAND CO	—	491	1,310	3,015	不動産管理・開発	
SM PRIME HLDGS	2,240	2,641	5,983	13,762	不動産管理・開発	
UNIVERSAL ROBINA CORP	242	281	5,743	13,210	食品	
SM INVESTMENTS CORP	45	53	4,921	11,318	コングロマリット	
AYALA CORPORATION	62	73	5,396	12,411	各種金融サービス	
ENERGY DEVELOPMENT CORPORATION	2,635	3,415	1,929	4,437	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	3,458	4,338	2,450	5,637	各種金融サービス	
ABOITIZ POWER CORP	406	536	2,361	5,430	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
BDO UNIBANK INC	481	571	5,687	13,080	銀行	
GT CAPITAL HOLDINGS INC	—	24	3,352	7,711	各種金融サービス	
小計	株数・金額	17,819	22,563	77,171	177,495	
	銘柄数<比率>	20	22	—	<1.4%>	
(インドネシア)			千ルピア			
AKR CORPORINDO TBK PT	—	533	322,465	2,644	商社・流通業	
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT	105	105	161,437	1,323	食品	
UNITED TRACTORS TBK PT	506	506	696,437	5,710	機械	
INDOFOOD SUKSES MAK TBK	1,175	1,457	1,012,615	8,303	食品	
PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	2,010	2,557	897,507	7,359	食品	
GUDANG GARAM TBK	125	160	1,084,400	8,892	タバコ	
HM SAMPOERNA TBK PT	—	136	1,319,540	10,820	タバコ	
INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	456	456	858,420	7,039	建設資材	
SUMMARECON AGUNG TBK PT	—	3,233	444,537	3,645	不動産管理・開発	
TAMBANG BATUBARA BUKIT ASAM	195	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
BANK DANAMON PT	846	1,251	366,824	3,007	銀行	
BANK MANDIRI	2,573	3,088	2,871,840	23,549	銀行	
MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	575	726	1,341,285	10,998	複合小売り	
UNILEVER INDONESIA TBK PT	467	517	2,300,650	18,865	家庭用品	
BANK RAKYAT INDONESIA	3,118	3,819	3,828,547	31,394	銀行	
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	3,010	3,658	855,972	7,018	ガス	
BANK NEGARA INDONESIA PT	2,000	2,527	1,134,623	9,303	銀行	
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	835	1,016	942,340	7,727	建設資材	
BANK CENTRAL ASIA	3,547	4,094	5,373,375	44,061	銀行	
XL AXIATA TBK PT	862	862	299,976	2,459	無線通信サービス	
LIPPO KARAWACI TBK PT	5,925	5,925	577,687	4,737	不動産管理・開発	
GLOBAL MEDIACOM TBK PT	1,525	2,587	275,515	2,259	メディア	
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT	1,465	1,465	314,975	2,582	メディア	
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	485	692	366,760	3,007	運送インフラ	
INDO TAMBANGRAYA MEGAH PT	94	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
BUMI SERPONG DAMAI PT	2,209	2,209	382,157	3,133	不動産管理・開発	
ADARO ENERGY PT	3,595	3,595	249,852	2,048	石油・ガス・消耗燃料	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	353	353	543,620	4,457	食品	
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	567	567	338,782	2,778	無線通信サービス	
KALBE FARMA PT	6,340	7,685	1,002,892	8,223	医薬品	
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	5,779	6,597	4,222,080	34,621	自動車	
SURYA CITRA MEDIA PT TBK	1,515	1,961	635,364	5,209	メディア	
TELEKOMUNIKASI	13,984	17,167	6,197,287	50,817	各種電気通信サービス	
小計	株数・金額	66,242	81,505	41,219,765	338,002	
	銘柄数<比率>	30	31	—	<2.6%>	
(韓国)			千ウォン			
CHEIL WORLDWIDE INC	22	22	37,968	3,512	メディア	

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	
(韓国)	百株	百株	千ウォン	千円	
HANMI SCIENCE CO LTD	—	3	45,864	4,242	医薬品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	11	13	127,568	11,800	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	9	11	352,835	32,637	保険
DONGBU INSURANCE CO LTD	12	14	100,492	9,295	保険
COWAY CO LTD	14	17	177,650	16,432	家庭用耐久財
KT & G CORP	31	35	472,560	43,711	タバコ
S-1 CORPORATION	4	6	62,930	5,821	商業サービス・用品
KOREA GAS CORPORATION	6	6	29,043	2,686	ガス
CJ CORP	4	4	99,681	9,220	コングロマリット
KAKAO CORP	7	9	98,649	9,125	インターネットソフトウェア・サービス
DOOSAN INFRACORE CO LTD	36	—	—	—	機械
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	29	—	—	—	機械
SK TELECOM CO LTD	2	6	134,400	12,432	無線通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	7	9	75,952	7,025	建設・土木
DAEWOO SECURITIES	55	55	42,487	3,930	資本市場
NCSOFT CORPORATION	3	6	139,800	12,931	ソフトウェア
LG UPLUS CORP	54	68	77,268	7,147	各種電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	17	17	41,772	3,863	電気設備
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	27	27	16,066	1,486	建設・土木
POSCO DAEWOO CORP	11	11	24,841	2,297	商社・流通業
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	2	3	323,523	29,925	パーソナル用品
LG CHEMICALS LTD	13	15	429,788	39,755	化学
LG CHEM LTD - PREFERRED	2	2	53,293	4,929	化学
LS CORP	4	—	—	—	電気設備
LS INDUSTRIAL SYSTEMS	4	—	—	—	電気設備
SHINHAN FINANCIAL GROUP	120	141	559,237	51,729	銀行
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	14	18	82,536	7,634	建設・土木
HYUNDAI MERCHANT MARINE	15	—	—	—	海運業
S-OIL CORPORATION	13	16	133,171	12,318	石油・ガス・消耗燃料
HANWHA CHEMICAL CORP	24	33	78,778	7,286	化学
SAMSUNG SECURITIES	18	18	67,784	6,270	資本市場
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	4	5	144,330	13,350	化学
HOTEL SHILLA CO LTD	9	9	67,340	6,228	専門小売り
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	11	14	145,449	13,454	機械
HYUNDAI MOBIS	18	23	587,895	54,380	自動車部品
SK HYNIX INC	166	192	496,202	45,898	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	19	25	88,375	8,174	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	6	8	75,978	7,027	自動車
HYUNDAI MOTOR CO LTD	43	52	704,600	65,175	自動車
HYUNDAI MIPO DOCKYARD	3	—	—	—	機械
HYUNDAI STEEL CO	20	28	159,761	14,777	金属・鉱業
INDUSTRIAL BK OF KOREA	85	85	97,897	9,055	銀行
KCC CORP	1	1	71,400	6,604	建設関連製品
KIA MOTORS CORP	75	90	415,800	38,461	自動車
KOREA ZINC CO LTD	2	3	156,550	14,480	金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER	71	87	548,244	50,712	電力
HANWHA CORPORATION	10	14	51,100	4,726	コングロマリット
KOREAN AIR LINES CO LTD	10	10	29,944	2,769	旅客航空輸送業
OCI COMPANY LTD	4	4	51,520	4,765	化学
CJ KOREA EXPRESS CO LTD	2	2	41,600	3,848	陸運・鉄道
KUMHO PETRO CHEMICAL CO	3	3	20,352	1,882	化学
KT CORP	8	8	28,028	2,592	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	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千ウォン	千円	
LG ELECTRONICS INC	29	34	195,508	18,084	家庭用耐久財
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.19	0.19	47,462	4,390	食品
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	—	0.2	40,400	3,737	飲料
HANSSEM CO LTD	3	3	53,850	4,981	家庭用耐久財
LG CORP	25	33	219,772	20,328	コングロマリット
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	43	43	40,572	3,752	資本市場
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	14	14	41,395	3,829	建設・土木
NAVER CORP	8	9	651,000	60,217	インターネットソフトウェア・サービス
PARADISE CO LTD	12	12	22,786	2,107	ホテル・レストラン・レジャー
HYUNDAI DEPT STORE CO	4	4	63,000	5,827	複合小売り
DONGSUH COMPANIES INC	—	10	33,178	3,069	食品・生活必需品小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	10	13	58,032	5,368	資本市場
OTTOGI CORPORATION	—	0.4	35,960	3,326	食品
DOOSAN CORP	2	2	21,890	2,024	コングロマリット
AMOREPACIFIC GROUP	8	10	177,990	16,464	パーソナル用品
KANGWON LAND INC	31	37	165,912	15,346	ホテル・レストラン・レジャー
POSCO	18	23	494,145	45,708	金属・鉱業
SAMSUNG C&T CORP	35	—	—	—	商社・流通業
SAMSUNG SDI CO,LTD	14	17	204,457	18,912	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	18	21	108,346	10,022	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRONICS	31	36	4,767,330	440,978	コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	47	47	44,884	4,151	機械
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	5	6	733,725	67,869	コンピュータ・周辺機器
SHINSEGAE CO LTD	1	2	47,403	4,384	複合小売り
HYOSUNG CORPORATION	6	7	90,860	8,404	化学
ORION CORP	1	1	127,070	11,753	食品
YUHAN CORPORATION	2	2	65,201	6,031	医薬品
SK HOLDINGS CO LTD	7	—	—	—	コングロマリット
HANON SYSTEMS	8	62	61,876	5,723	自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	15	20	66,976	6,195	保険
GS HOLDINGS CORP	12	17	89,930	8,318	石油・ガス・消耗燃料
LG DISPLAY CO LTD	65	73	176,143	16,293	電子装置・機器・部品
SK NETWORKS CO LTD	23	23	13,536	1,252	商社・流通業
HITE JINRO CO LTD	6	—	—	—	飲料
CELLTRION INC	19	22	221,342	20,474	バイオテクノロジー
HANA FINANCIAL HOLDINGS	78	97	235,577	21,790	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	5	6	119,925	11,093	航空貨物・物流サービス
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	6	26	58,741	5,433	資本市場
LOTTE SHOPPING CO	3	3	91,845	8,495	複合小売り
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	17	27	296,390	27,416	保険
AMOREPACIFIC CORP	8	10	465,480	43,056	パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	—	3	72,450	6,701	パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	9	9	37,828	3,499	消費者金融
SK INNOVATION CO LTD	17	21	314,975	29,135	石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	2	2	98,800	9,139	食品
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	6	7	56,643	5,239	商業サービス・用品
LG INNOTEK CO LTD	2	4	32,660	3,021	電子装置・機器・部品
SK HOLDINGS CO LTD	5	11	248,464	22,982	コングロマリット
KB FINANCIAL GROUP INC	110	125	420,466	38,893	銀行
HYUNDAI WIA CORP	4	5	51,056	4,722	自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	10	19	129,035	11,935	航空宇宙・防衛
BNK FINANCIAL GROUP INC	53	82	71,089	6,575	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		
(韓国)	百株	百株	千ウォン	千円		
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	—	1	102,172	9,450	医薬品	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	61	61	39,531	3,656	保険	
CJ E&M CORP	—	5	41,553	3,843	メディア	
E-MART CO	6	7	137,455	12,714	食品・生活必需品小売り	
DGB FINANCIAL GROUP INC	45	45	40,024	3,702	銀行	
GS RETAIL CO LTD	—	8	44,874	4,150	食品・生活必需品小売り	
HANKOOK TIRE CO LTD/NEW	22	27	140,015	12,951	自動車部品	
BGF RETAIL CO LTD	—	2	48,625	4,497	食品・生活必需品小売り	
SAMSUNG SDS CO LTD	7	10	176,460	16,322	情報技術サービス	
WOORI BANK	91	111	114,138	10,557	銀行	
SAMSUNG C&T CORP	4	24	310,968	28,764	コングロマリット	
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	2,300 107	2,656 107	21,047,484 —	1,946,892 <15.0%>	
(台湾)			千新台幣ドル			
ACER INC	657	917	995	3,335	コンピュータ・周辺機器	
ASUSTEK COMPUTER INC	198	238	6,296	21,093	コンピュータ・周辺機器	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	104	154	1,365	4,575	半導体・半導体製造装置	
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	1,726	2,036	5,996	20,088	半導体・半導体製造装置	
ASIA CEMENT	569	729	1,955	6,552	建設資材	
TAIWAN BUSINESS BANK	1,042	1,118	895	3,001	銀行	
FORMOSA INTERNATIONAL HOTELS	14	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	230	230	959	3,212	化学	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	250	250	1,332	4,463	半導体・半導体製造装置	
UNIMICRON TECHNOLOGY CORP	270	—	—	—	電子装置・機器・部品	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	142	142	1,043	3,496	コンピュータ・周辺機器	
QUANTA COMPUTER INC	766	876	4,436	14,863	コンピュータ・周辺機器	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	147	281	1,273	4,265	不動産管理・開発	
EVA AIRWAYS CORP	567	567	849	2,844	旅客航空輸送業	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	188	208	4,438	14,870	コンピュータ・周辺機器	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	1,237	1,653	2,637	8,835	銀行	
CHINA AIRLINES	795	795	815	2,731	旅客航空輸送業	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	430	530	3,420	11,459	自動車部品	
CHINA STEEL	3,295	3,945	8,206	27,491	金属・鉱業	
CHINA MOTOR CO LTD	90	—	—	—	自動車	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	884	972	2,266	7,593	保険	
ADVANTECH CO.,LTD.	82	102	2,253	7,550	コンピュータ・周辺機器	
FARGLORY LAND DEVELOPMENT CO	60	—	—	—	不動産管理・開発	
CLEVO COMPANY	138	—	—	—	コンピュータ・周辺機器	
COMPAL ELECTRONICS	1,285	1,285	2,327	7,797	コンピュータ・周辺機器	
CTCI CORP	130	—	—	—	建設・土木	
DELTA ELECTRONICS INC	506	676	9,543	31,969	電子装置・機器・部品	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,100	1,240	13,709	45,925	各種電気通信サービス	
AU OPTRONICS CORP	2,620	2,620	2,308	7,732	電子装置・機器・部品	
TAIWAN MOBILE CO LTD	462	592	6,393	21,418	無線通信サービス	
EVERGREEN MARINE	442	447	525	1,761	海運業	
FAR EAST DEPARTMENT STORE	303	—	—	—	複合小売り	
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	906	1,144	2,643	8,857	コングロマリット	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	—	92	1,165	3,902	繊維・アパレル・贅沢品	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	51	62	1,949	6,530	繊維・アパレル・贅沢品	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	160	200	2,206	7,391	半導体・半導体製造装置	
FORMOSA PLASTIC	1,154	1,414	10,974	36,764	化学	
FORMOSA TAFFETA CO.	200	200	572	1,916	繊維・アパレル・贅沢品	

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	
(台湾)	百株	百株	千新台幣ドル	千円	
FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	959	1,059	8,511	28,513	化学
TRANSCEND INFORMATION INC	43	43	377	1,265	コンピュータ・周辺機器
EPSTAR CORP	250	—	—	—	半導体・半導体製造装置
GIANT MANUFACTURING	77	97	1,804	6,043	レジャー用品
MEDIATEK INC	395	505	9,905	33,183	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	1,885	2,295	8,470	28,374	各種金融サービス
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	1,753	2,292	3,541	11,863	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	70	90	2,691	9,014	専門小売り
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	480	580	4,286	14,358	無線通信サービス
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	63	83	892	2,988	電子装置・機器・部品
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	2,292	3,493	3,563	11,938	資本市場
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,285	2,805	9,958	33,359	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	4,097	4,847	3,766	12,618	銀行
E. SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	1,903	2,428	4,104	13,748	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	3,520	4,705	34,162	114,444	電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	2,742	3,773	8,642	28,950	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	30	30	7,600	25,460	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	2,201	2,641	3,116	10,441	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	2,118	2,745	1,718	5,757	保険
INVENTEC CO., LTD	579	779	1,581	5,298	コンピュータ・周辺機器
HTC CORPORATION	177	237	1,577	5,284	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	592	745	2,798	9,374	コンピュータ・周辺機器
RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR	106	146	699	2,341	半導体・半導体製造装置
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	2,343	2,999	2,744	9,193	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING	3,850	5,316	8,560	28,676	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	2,205	3,084	4,903	16,428	銀行
MERIDA INDUSTRY CO LTD	52	52	632	2,119	レジャー用品
POWERTECH TECHNOLOGY INC	211	211	1,380	4,626	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	1,337	1,537	9,454	31,671	化学
WISTRON CORP	612	861	1,571	5,264	コンピュータ・周辺機器
KINSUS INTERCONNECT TECH	70	—	—	—	半導体・半導体製造装置
POU CHEN CORP	594	714	2,765	9,265	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	1,306	1,598	9,030	30,252	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	178	178	3,999	13,398	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	333	403	3,656	12,249	石油・ガス・消耗燃料
PHISON ELECTRONICS CORP	33	43	1,104	3,700	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	160	272	936	3,138	不動産管理・開発
RUENTEX INDUSTRIES LTD	147	147	625	2,095	繊維・アパレル・贅沢品
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	272	274	1,767	5,921	コンピュータ・周辺機器
SILICONWARE PRECISION INDUSTRIES	872	702	3,184	10,667	半導体・半導体製造装置
STANDARD FOODS CORP	77	85	666	2,233	食品
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	324	424	1,298	4,350	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT	923	1,103	3,309	11,087	建設資材
TAIWAN GLASS IND CORP	224	—	—	—	建設関連製品
TECO ELECTRIC & MACHINERY	510	680	1,706	5,717	電気設備
TAIWAN SEMICONDUCTOR	6,960	8,180	120,655	404,194	半導体・半導体製造装置
U-MING MARINE TRANSPORT CORP	110	—	—	—	海運業
UNITED MICROELECTRONICS CORP	3,415	3,955	4,449	14,905	半導体・半導体製造装置
WAN HAI LINES LIMITED	160	—	—	—	海運業
WALSIN LIHWA CORP	810	—	—	—	電気設備
YANG MING MARINE TRANSPORT	428	—	—	—	海運業
YULON MOTOR CO	200	290	779	2,611	自動車

銘柄	株数	当期		期末		業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千新台幣ドル	千円		
INOTERA MEMORIES INC	610	770	2,259	7,570	半導体・半導体製造装置	
INNOLUX CORP	2,413	2,933	2,801	9,384	電子装置・機器・部品	
WPG HOLDINGS CO LTD	380	490	1,649	5,527	電子装置・機器・部品	
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	45	67	931	3,120	機械	
HERMES MICROVISION INC	10	10	953	3,192	半導体・半導体製造装置	
PEGATRON CORP	456	646	4,302	14,411	コンピュータ・周辺機器	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	265	346	1,741	5,835	各種金融サービス	
SCINOPHARM TAIWAN LTD	64	—	—	—	医薬品	
TPK HOLDING CO LTD	90	—	—	—	電子装置・機器・部品	
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	560	560	571	1,913	各種電気通信サービス	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	74	134	858	2,875	電子装置・機器・部品	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	1,948	2,416	3,346	11,211	銀行	
OBI PHARMA INC	—	30	1,054	3,532	バイオテクノロジー	
CASETEK HOLDINGS LTD	—	50	590	1,976	コンピュータ・周辺機器	
小計	株数・金額	87,485	103,727	439,772	1,473,238	
	銘柄数<比率>	101	88	—	<11.3%>	
(インド)				千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	369	436	42,922	70,392	石油・ガス・消耗燃料	
BHARAT PETROLEUM CORP LTD	52	30	2,895	4,748	石油・ガス・消耗燃料	
EICHER MOTORS LTD	—	4	8,398	13,772	機械	
RELIANCE INFRASTRUCTURE LTD	26	—	—	—	電力	
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	102	121	16,424	26,936	自動車	
SHREE CEMENT LIMITED	—	2	3,593	5,892	建設資材	
ADITYA BIRLA NUVO LIMITED	11	—	—	—	コングロマリット	
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	—	9	1,285	2,108	陸運・鉄道	
LIC HOUSING FINANCE	84	84	3,914	6,419	貯蓄・抵当・不動産金融	
TATA STEEL LIMITED	72	101	3,319	5,444	金属・鉱業	
JSW STEEL LTD	23	30	3,991	6,546	金属・鉱業	
NESTLE INDIA LIMITED	6	7	4,132	6,776	食品	
GAIL INDIA LTD	86	118	4,565	7,487	ガス	
VEDANTA LTD	334	316	3,283	5,385	金属・鉱業	
OIL&NATURAL GAS CORP LTD	205	264	5,601	9,185	石油・ガス・消耗燃料	
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER	2	3	2,232	3,660	食品	
LUPIN LTD	—	78	12,618	20,694	医薬品	
ACC LIMITED	12	12	1,742	2,857	建設資材	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	422	503	60,601	99,386	貯蓄・抵当・不動産金融	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	161	193	8,132	13,336	メディア	
INFOSYS LTD	260	615	73,753	120,955	情報技術サービス	
WIPRO LTD	177	196	10,590	17,368	情報技術サービス	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	209	259	21,974	36,038	家庭用品	
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	23	23	3,114	5,107	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
HCL TECHNOLOGIES LTD	138	181	13,071	21,437	情報技術サービス	
DABUR INDIA LTD	142	176	5,086	8,341	パーソナル用品	
HERO MOTOCORP LTD	15	15	4,444	7,289	自動車	
DR. REDDYS LABORATORIES	33	40	11,502	18,863	医薬品	
BHARTI AIRTEL LIMITED	166	399	14,660	24,044	無線通信サービス	
UNITED SPIRITS LIMITED	12	18	4,662	7,646	飲料	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	234	328	26,463	43,400	医薬品	
DIVIS LABORATORIES LTD	9	25	2,709	4,442	ライフサイエンス・ツール/サービス	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	—	34	13,424	22,015	自動車	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	—	50	4,208	6,901	医薬品	
AUROBINDO PHARMA LTD	39	93	7,638	12,526	医薬品	

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		
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円		
JINDAL STEEL&POWER LTD	85	—	—	—	金属・鉱業	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	64	96	2,475	4,059	自動車部品	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	44	44	4,678	7,673	消費者金融	
CIPLA LIMITED	92	110	5,912	9,696	医薬品	
LARSEN&TOUBRO LIMITED	86	103	13,333	21,867	建設・土木	
ULTRATECH CEMENT LTD	9	12	3,925	6,437	建設資材	
ASHOK LEYLAND LIMITED	—	341	3,575	5,864	機械	
BOSCH LTD	2	2	4,793	7,860	自動車部品	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	134	156	39,271	64,404	情報技術サービス	
ADANI ENTERPRISES LTD	45	—	—	—	商社・流通業	
NTPC LIMITED	450	374	5,362	8,795	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	21	21	2,546	4,177	医薬品	
AMBUJA CEMENTS LTD	196	236	5,212	8,548	建設資材	
BHARAT FORGE LIMITED	—	36	2,870	4,706	自動車部品	
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	314	406	3,725	6,110	金属・鉱業	
ITC LTD	621	735	23,885	39,172	タバコ	
UPL LTD	—	93	5,490	9,004	化学	
RELIANCE COMMUNICATION LTD	227	227	1,264	2,073	無線通信サービス	
SIEMENS INDIA LIMITED	17	23	2,718	4,458	コングロマリット	
UNITED BREWERIES LTD	16	22	1,806	2,962	飲料	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	36	36	4,868	7,985	パーソナル用品	
CAIRN INDIA LIMITED	127	127	1,766	2,896	石油・ガス・消耗燃料	
IDEA CELLULAR LIMITED	278	336	3,822	6,268	無線通信サービス	
MARICO LIMITED	—	156	3,870	6,347	パーソナル用品	
POWER FINANCE CORPORATION	63	63	1,083	1,777	各種金融サービス	
DLF LIMITED	96	—	—	—	不動産管理・開発	
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	153	287	5,648	9,263	運送インフラ	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	74	74	1,256	2,060	各種金融サービス	
BAJAJ AUTO LIMITED	24	29	7,354	12,060	自動車	
OIL INDIA LTD	27	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
COAL INDIA LTD	186	217	6,223	10,206	石油・ガス・消耗燃料	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	—	114	3,306	5,422	自動車	
TATA MOTORS LTD	222	256	10,365	16,999	自動車	
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	169	169	2,155	3,535	電気設備	
TATA POWER COMPANY LIMITED	327	327	2,405	3,944	電力	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	84	84	2,561	4,201	消費者金融	
BHARTI INFRATEL LTD	—	197	7,424	12,176	各種電気通信サービス	
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	—	96	6,693	10,976	貯蓄・抵当・不動産金融	
ASIAN PAINTS LTD	75	104	9,464	15,522	化学	
AXIS BANK LIMITED	—	188	8,998	14,756	銀行	
ICICI BANK LTD	333	392	8,852	14,517	銀行	
TECH MAHINDRA LTD	67	67	3,235	5,305	情報技術サービス	
CADILA HEALTHCARE LTD	—	61	1,966	3,225	医薬品	
小 計	株 数	金 額	8,212	11,212	643,131	1,054,735
	銘柄	数<比率>	63	72	—	<8.1%>
(メキシコ)			千メキシコペソ			
ALFA S. A. B. -A	790	992	3,189	19,008	コングロマリット	
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	112	152	2,277	13,574	飲料	
CONTROLADORA COML MEXIC-UBC	131	—	—	—	食品・生活必需品小売り	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	556	602	9,704	57,837	飲料	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	47	60	1,111	6,623	複合小売り	
GRUPO FIN SANTANDER-B	499	626	2,007	11,965	銀行	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)	百株	百株	千メキシコペソ	千円	
GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	723	831	8,047	47,962	メディア
GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	449	524	2,847	16,970	食品
GRUMA S. A. B. -B	52	62	1,649	9,832	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	77	77	1,675	9,986	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	144	183	1,415	8,438	コングロマリット
CEMEX SAB - CPO	3,532	4,715	5,753	34,288	建設資材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	706	822	7,955	47,413	銀行
MEXICHEM SAB DE CV-*	285	380	1,595	9,511	化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	40	40	1,104	6,580	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	431	525	2,186	13,032	家庭用品
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	62	76	2,075	12,372	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	1,093	1,311	5,319	31,704	金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	9,398	10,353	12,030	71,699	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	672	800	2,586	15,414	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	104	131	1,574	9,385	飲料
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	94	94	1,623	9,673	運送インフラ
GENOMMA LAB INTERNACIONAL-B	238	-	-	-	医薬品
OHL MEXICO SAB DE CV	241	241	612	3,649	運送インフラ
MINERA FRISCO SAB DE CV-A1	138	-	-	-	金属・鉱業
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA	77	123	580	3,460	食品・生活必需品小売り
GRUPO LALA SAB DE CV	145	198	920	5,486	食品
GENTERA SAB DE CV	273	362	1,242	7,404	消費者金融
WALMART DE MEXICO-SER V	1,458	1,707	7,408	44,153	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	22,569 29	25,989 26	88,495 -<4.1%>	527,431 -<4.1%>
(ブラジル)			千レアル		
BRF SA	185	225	1,033	31,863	食品
CYRELA BRAZIL REALTY	65	-	-	-	家庭用耐久財
VALE SA	375	415	632	19,492	金属・鉱業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB	24	34	91	2,806	電力
VALE SA-PREF A	527	675	833	25,708	金属・鉱業
TIM PARTICIPACOES SA	238	301	214	6,602	無線通信サービス
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	47	87	114	3,541	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	62	-	-	-	電力
BANCO DO BRASIL SA	240	275	556	17,174	銀行
USINAS SIDER MINAS GER-PF A	104	-	-	-	金属・鉱業
AES TIETE SA-PREF	24	-	-	-	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	1,019	1,264	941	29,043	銀行
LOJAS AMERICANAS S. A. (PREF)	141	202	274	8,454	複合小売り
LOJAS AMERICANAS SA	38	46	45	1,395	複合小売り
GERDAU SA PFD NPV	240	313	215	6,660	金属・鉱業
METALURGICA GERDAU SA-PREF	69	-	-	-	金属・鉱業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	862	990	1,194	36,851	石油・ガス・消耗燃料
PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	1,192	1,354	1,283	39,585	石油・ガス・消耗燃料
SOUZA CRUZ SA	113	-	-	-	タバコ
KROTON EDUCACIONAL SA	375	439	525	16,199	各種消費者サービス
CCR SA	239	281	445	13,753	運送インフラ
WEG SA	173	173	262	8,109	機械
BANCO BRADESCO SA - PREF	721	920	2,349	72,468	銀行
BANCO BRADESCO S. A.	214	269	746	23,020	銀行
NATURA COSMETTICOS SA	47	63	150	4,647	パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	215	215	215	6,643	金属・鉱業

銘柄	株数	当 期 末			業 種 等	
		株数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ブラジル)	百株	百株	千レアル	千円		
BRADSPAR SA -PREF	64	—	—	—	金属・鉱業	
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA-PREF	92	119	169	5,237	紙製品・林産品	
CPFL ENERGIA SA	65	66	128	3,954	電力	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	781	999	3,058	94,309	銀行	
PORTO SEGURO SA	32	32	81	2,516	保険	
FIBRIA CELULOSE SA	75	75	227	7,020	紙製品・林産品	
BRASKEM SA-PREF A	44	44	94	2,928	化学	
TRACTEBEL ENERGIA SA	42	54	199	6,161	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
LOCALIZA RENT A CAR	45	45	158	4,897	陸運・鉄道	
LOJAS RENNER S.A.	37	222	455	14,042	複合小売り	
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	73	73	89	2,773	電力	
EDP-ENERGIAS DO BRASIL RIGHTS	—	20	2	61	電力	
ULTRAPAR PARTICIPACOES	101	122	874	26,976	石油・ガス・消耗燃料	
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	29	42	130	4,025	石油・ガス・消耗燃料	
TOTVS SA	29	38	111	3,430	ソフトウェア	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	—	65	286	8,820	電力	
EMBRAER SA	199	224	435	13,422	航空宇宙・防衛	
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B	49	49	69	2,138	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
M DIAS BRANCO SA	8	8	69	2,150	食品	
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	20	20	38	1,184	電力	
ODONTOPREV S.A.	68	68	72	2,222	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
B2W CIA DIGITAL	30	30	33	1,017	インターネット販売・カタログ販売	
BR MALLS PARTICIPACOES SA	114	195	236	7,294	不動産管理・開発	
JBS SA	221	221	187	5,772	食品	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	198	235	141	4,361	電力	
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	101	125	325	10,023	水道	
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	20	29	164	5,075	不動産管理・開発	
BANCO ESTADO RIO GRANDE SUL	54	—	—	—	銀行	
ESTACIO PARTICIPACOES SA	76	76	85	2,648	各種消費者サービス	
DURATEX SA	63	113	81	2,528	紙製品・林産品	
SUL AMERICA SA - UNITS	53	53	82	2,557	保険	
HYPERMARCAS S.A	90	117	352	10,882	パーソナル用品	
BM&F BOVESPA SA	537	589	973	30,008	各種金融サービス	
TELEFONICA BRASIL-PREF	101	125	525	16,197	各種電気通信サービス	
QUALICORP SA	52	77	109	3,383	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	126	126	232	7,157	銀行	
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO	62	76	319	9,840	資本市場	
ECORODOVIAS INFRA E LOG SA	61	—	—	—	運送インフラ	
CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF	39	57	272	8,414	食品・生活必需品小売り	
CIELO SA	234	352	1,189	36,695	情報技術サービス	
RAIA DROGASIL SA	60	73	397	12,251	食品・生活必需品小売り	
OI SA PREFERENCE	82	—	—	—	各種電気通信サービス	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	199	226	624	19,271	保険	
AMBEV SA	1,335	1,549	2,927	90,272	飲料	
VIA VAREJO SA	30	—	—	—	専門小売り	
KLABIN SA-UNIT	120	202	349	10,783	容器・包装	
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL	—	266	117	3,609	陸運・鉄道	
小 計	株数・金額	13,469	15,846	28,610	882,344	
	銘柄数<比率>	70	62	—	<6.8%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION	8	12	36,104	5,798	銀行	
EMPRESAS CMPC SA	346	414	60,738	9,754	紙製品・林産品	

銘柄	株数	株数	期末		業種等
			評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(チリ)	百株	百株	千チリペソ	千円	
EMPRESAS COPEC SA	131	149	96,730	15,534	石油・ガス・消耗燃料
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	32	42	24,661	3,960	無線通信サービス
COLBUN SA	2,430	2,430	42,362	6,803	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AGUAS ANDINAS SA-A	754	953	37,474	6,018	水道
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	76	76	17,170	2,757	飲料
S. A. C. I. FALABELLA	282	158	78,129	12,547	複合小売り
CENCOSUD SA	342	399	70,155	11,266	食品・生活必需品小売り
SONDA SA	130	130	16,962	2,724	情報技術サービス
AES GENER SA	780	780	25,995	4,174	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>	5,313 11	5,545 11	506,485 -	81,341 <0.6%>
(コロンビア)			千コロンビアペソ		
ALMACENES EXITO SA	61	-	-	-	食品・生活必需品小売り
INTERCONEXION ELECTRICA SA	107	107	90,950	3,337	電力
CORP FINANCIERA COLOMBIANA	25	25	95,075	3,489	各種金融サービス
ISAGEN S. A. E. S. P	193	-	-	-	電力
BANCO DAVIVIENDA SA	29	-	-	-	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF	24	30	108,900	3,996	各種金融サービス
GRUPO AVAL ACCIONES-PFD	996	996	116,532	4,276	銀行
CEMEX LATAM HOLDINGS SA	52	-	-	-	建設資材
CEMENTOS ARGOS SA	105	135	148,230	5,440	建設資材
GRUPO ARGOS SA-PRF	31	-	-	-	建設資材
GRUPO ARGOS SA	81	102	175,440	6,438	建設資材
GRUPO DE INV SURAMERICANA	66	78	287,820	10,562	各種金融サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,771 12	1,473 7	1,022,947 -	37,542 <0.3%>
(アラブ首長国連邦)			千UAEディルハム		
FIRST GULF BANK	240	280	354	10,475	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK	264	360	203	6,020	銀行
EMIRATES TELECOM CORPORATION	-	586	1,113	32,945	各種電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK	315	618	394	11,666	銀行
NATIONAL BANK OF ABU DHABI	195	195	169	5,029	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC	1,011	1,151	717	21,220	不動産管理・開発
ARABTEC HOLDING CO	637	637	93	2,755	建設・土木
ALDAR PROPERTIES PJSC	842	1,092	290	8,599	不動産管理・開発
DUBAI FINANCIAL MARKET	608	608	79	2,341	各種金融サービス
EMAAR MALLS GROUP PJSC	-	660	184	5,468	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	4,115 8	6,190 10	3,599 -	106,521 <0.8%>
(エジプト)			千エジプトポンド		
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	234	368	1,639	20,250	銀行
TELECOM EGYPT	65	-	-	-	各種電気通信サービス
GLOBAL TELECOM HOLDING	655	955	264	3,269	無線通信サービス
T M G HOLDING	247	247	158	1,952	不動産管理・開発
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,202 4	1,572 3	2,062 -	25,472 <0.2%>
(南アフリカ)			千ランド		
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD	344	344	-	-	各種金融サービス
AFRICAN RAINBOW MINERALS LTD	24	-	-	-	金属・鉱業
BARLOWORLD LTD	58	58	409	2,929	商社・流通業
BIDVEST GROUP LTD	91	110	3,938	28,197	コングロマリット
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	115	143	1,484	10,631	専門小売り

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	
(南アフリカ)	百株	百株	千ランド	千円	
STEINHOFF INTL HOLDINGS LTD	586	—	—	—	家庭用耐久財
ASSORE LIMITED	8	—	—	—	金属・鉱業
DISCOVERY LTD	109	109	1,293	9,264	保険
GOLD FIELDS LTD	236	236	1,549	11,095	金属・鉱業
REMGRO LTD	131	154	3,790	27,142	各種金融サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD	49	64	933	6,685	専門小売り
EXXARO RESOURCES LTD	37	37	264	1,896	石油・ガス・消耗燃料
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	—	12	665	4,764	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD	28	28	378	2,707	保険
MTN GROUP LTD	471	550	7,205	51,587	無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD	123	139	3,049	21,837	金属・鉱業
TELKOM SA SOC LTD	62	62	353	2,527	各種電気通信サービス
FIRSTRAND LTD	932	1,106	4,676	33,482	各種金融サービス
PSG GROUP LTD	—	29	541	3,880	各種金融サービス
NASPERS LTD-N SHS	112	132	25,645	183,622	メディア
CORONATION FUND MANAGERS LTD	68	68	469	3,359	資本市場
NEDBANK GROUP LTD	61	61	1,042	7,462	銀行
NETCARE LTD	251	307	1,064	7,625	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PICKN PAY STORES LTD	54	79	573	4,108	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD	203	250	1,317	9,432	各種金融サービス
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	14	14	550	3,939	金属・鉱業
SAPPI LIMITED	134	175	1,150	8,239	紙製品・林産品
SASOL LTD	158	187	8,179	58,566	石油・ガス・消耗燃料
SHOPRITE HOLDINGS LTD	127	162	2,664	19,080	食品・生活必需品小売り
MR PRICE GROUP LTD	66	—	—	—	専門小売り
BRAIT SE	94	115	1,735	12,422	資本市場
STANDARD BANK GROUP LTD	337	416	4,900	35,089	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE	50	50	1,054	7,548	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	254	326	2,844	20,367	複合小売り
IMPERIAL HOLDINGS LTD	53	53	699	5,008	販売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	94	114	3,608	25,833	医薬品
TIGER BRANDS LTD	44	52	1,759	12,595	食品
NAMPAK LTD	175	—	—	—	容器・包装
SANLAM LIMITED	512	569	3,647	26,112	保険
MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD	104	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
INVESTEC LTD	65	85	882	6,318	資本市場
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	146	209	991	7,098	金属・鉱業
KUMBA IRON ORE LTD	16	—	—	—	金属・鉱業
PIONEER FOODS LTD	—	36	605	4,335	食品
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENT P LC	—	67	1,214	8,696	不動産管理・開発
MASSMART HOLDINGS LTD	25	25	301	2,158	食品・生活必需品小売り
MONDI LTD	—	37	1,063	7,613	紙製品・林産品
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	270	335	1,215	8,703	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MMI HOLDINGS LTD	306	400	895	6,412	保険
RMI HOLDINGS	185	—	—	—	保険
TSOGO SUN HOLDINGS LTD	126	126	329	2,358	ホテル・レストラン・レジャー
VODACOM GROUP	112	130	2,184	15,640	無線通信サービス
PPC LTD	157	—	—	—	建設資材
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	97	117	1,615	11,567	銀行
SIBANYE GOLD LTD	—	232	1,204	8,626	金属・鉱業
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	—	237	955	6,840	保険
MR PRICE GROUP LTD	—	80	1,405	10,061	専門小売り

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
(南アフリカ) STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	百株 —	百株 956	千ランド 8,438	千円 60,419	家庭用耐久財	
小 計	株 数 ・ 金 額 7,896	9,407	116,745	835,897		
	銘 柄 数 < 比 率 > 49	49	—	<6.4%>		
合 計	株 数 ・ 金 額 533,009	660,078	—	12,403,837		
	銘 柄 数 < 比 率 > 829	832	—	<95.5%>		

\* 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。

\* 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	
(トルコ) EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	口 52,400	口 64,400	千トルコリラ 180	千円 6,644	% 0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額 52,400	64,400	180	6,644		
	銘 柄 数 < 比 率 > 1	1	—	<0.1%>		
(メキシコ) FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	69,200	80,400	千メキシコペソ 3,224	19,220	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額 69,200	80,400	3,224	19,220		
	銘 柄 数 < 比 率 > 1	1	—	<0.1%>		
(南アフリカ) GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	65,380	75,380	千ランド 1,808	12,947	0.1	
REDEFINE PROPERTIES LTD	95,670	161,710	1,854	13,280	0.1	
RESILIENT PROPERTY INCOME	6,550	—	—	—	—	
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	—	7,790	915	6,553	0.1	
FORTRESS INCOME FUND LTD-A	—	29,380	458	3,283	0.0	
FORTRESS INCOME FUND LTD	—	21,220	778	5,576	0.0	
RESILIENT REIT LTD	—	9,072	1,212	8,682	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額 167,600	304,552	7,028	50,324		
	銘 柄 数 < 比 率 > 3	6	—	<0.4%>		
合 計	口 数 ・ 金 額 289,200	449,352	—	76,189		
	銘 柄 数 < 比 率 > 5	8	—	<0.6%>		

\* 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、純資産総額に対する投資信託証券評価額の比率。

\* 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	MSCIN	百万円 500	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。

## ○投資信託財産の構成

(2016年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 12,403,837	% 95.3
投資証券	76,189	0.6
コール・ローン等、その他	529,605	4.1
投資信託財産総額	13,009,631	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（12,945,165千円）の投資信託財産総額（13,009,631千円）に対する比率は99.5%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=29.85円、1米ドル=108.46円、1トルコリラ=36.85円、1ユーロ=123.49円、1チェココルナ=4.57円、1フォリント=0.3912円、1ズロチ=27.86円、1香港ドル=13.97円、1リンギ=26.78円、1バーツ=3.08円、1フィリピンペソ=2.30円、1ルピア=0.0082円、1ウォン=0.0925円、1新台湾ドル=3.35円、1インドルピー=1.64円、1メキシコペソ=5.96円、1レアル=30.84円、1チリペソ=0.1606円、1コロンビアペソ=0.0367円、1UAEディルハム=29.59円、1エジプトポンド=12.35円、1ランド=7.16円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月10日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	13,136,959,121
コール・ローン等	441,799,354
株式(評価額)	12,403,837,793
投資証券(評価額)	76,189,315
未収入金	128,213,511
未収配当金	12,325,093
差入委託証拠金	74,594,055
(B) 負債	150,211,940
未払金	148,258,294
未払解約金	581,170
未払利息	76
その他未払費用	1,372,400
(C) 純資産総額(A-B)	12,986,747,181
元本	14,807,501,610
次期繰越損益金	△ 1,820,754,429
(D) 受益権総口数	14,807,501,610口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,770円

(注) 期首元本額は11,794,194,890円、期中追加設定元本額は4,184,101,266円、期中一部解約元本額は1,170,794,546円、1口当たり純資産額は0.8770円です。

## ○損益の状況 (2015年5月12日～2016年5月10日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	292,499,717
受取配当金	291,708,939
受取利息	29,879
その他収益金	764,226
支払利息	△ 3,327
(B) 有価証券売買損益	△ 4,555,530,065
売買益	432,659,751
売買損	△ 4,988,189,816
(C) 先物取引等取引損益	△ 88,163,235
取引益	74,547,812
取引損	△ 162,711,047
(D) 保管費用等	△ 20,878,382
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 4,372,071,965
(F) 前期繰越損益金	2,637,366,199
(G) 追加信託差損益金	△ 33,565,053
(H) 解約差損益金	△ 52,483,610
(I) 計(E+F+G+H)	△ 1,820,754,429
次期繰越損益金(I)	△ 1,820,754,429

\* 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
野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け)	11,364,339,361
野村インデックスファンド・新興国株式	2,333,798,099
ノムラFOfs用インデックスファンド・新興国株式(適格機関投資家専用)	259,064,669
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	195,619,089
野村資産設計ファンド2040	164,723,115
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	163,070,904
野村資産設計ファンド2025	70,923,354
野村資産設計ファンド2030	67,591,613
野村資産設計ファンド2020	57,291,779
野村資産設計ファンド2015	52,360,185
野村資産設計ファンド2035	48,908,747
野村資産設計ファンド2045	15,871,273
野村資産設計ファンド2050	9,319,944
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	3,801,119
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	410,628
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	226,785
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	180,946

○お知らせ

---

有価証券の指図範囲に新投資口予約権証券を加える所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年8月3日＞

# 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

## 運用報告書

第14期（決算日2016年3月31日）

作成対象期間（2015年4月1日～2016年3月31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	わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）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	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		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	期騰落	期中率	NOMURA-BPI総合	期騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
10期(2012年4月2日)	11,591	2.8	337.688	2.8	98.9	—	233,348
11期(2013年4月1日)	12,027	3.8	350.376	3.8	99.3	—	260,210
12期(2014年3月31日)	12,109	0.7	352.801	0.7	99.0	—	290,791
13期(2015年3月31日)	12,467	3.0	363.279	3.0	99.6	—	510,034
14期(2016年3月31日)	13,141	5.4	382.913	5.4	99.5	—	656,174

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切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

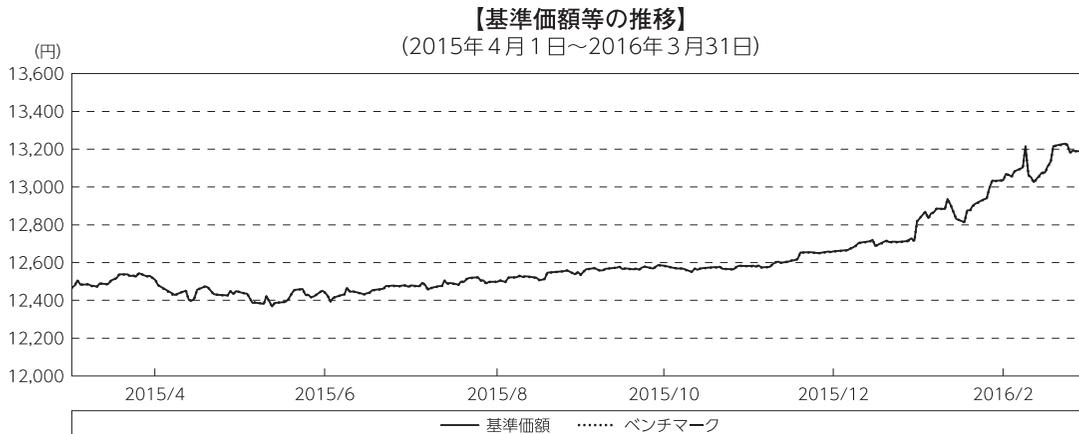
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	騰落	騰落率	NOMURA-BPI総合	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2015年3月31日	12,467	—	363.279	—	99.6	—
4月末	12,507	0.3	364.501	0.3	99.6	—
5月末	12,449	△0.1	362.770	△0.1	99.4	—
6月末	12,443	△0.2	362.542	△0.2	99.2	—
7月末	12,479	0.1	363.584	0.1	99.6	—
8月末	12,499	0.3	364.201	0.3	98.1	—
9月末	12,535	0.5	365.235	0.5	99.3	—
10月末	12,583	0.9	366.655	0.9	99.4	—
11月末	12,582	0.9	366.578	0.9	99.2	—
12月末	12,660	1.5	368.877	1.5	99.2	—
2016年1月末	12,818	2.8	373.520	2.8	98.3	—
2月末	13,036	4.6	379.830	4.6	98.5	—
(期末)						
2016年3月31日	13,141	5.4	382.913	5.4	99.5	—

\*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、NOMURA-BPI総合です。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12,467円から期末13,141円に674円の値上がりとなりました。

世界的な株価下落に伴い世界経済の先行きに不透明感が高まりました。また日銀による国債買い入れの平均残存年限長期化やマイナス金利政策の導入などを背景に、国内債券利回りが低下（価格は上昇）したため、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

期首から2015年6月中旬にかけては、円安の進行や2015年1-3月期実質GDP（国内総生産）成長率が景気の拡大を示したことを受けて国内株式市場が上昇したことなどから、国内債券市場は軟調となりました。その後は8月中旬から9月下旬や2016年1月から2月中旬にかけては、世界的な株価下落に伴い世界経済の先行きに不透明感が高まりました。日銀が国債買い入れの平均残存年限長期化を発表したことや、マイナス金利政策の導入を決定したことなどを背景に、国内債券市場は堅調となり国内債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

NOMURA-BPI総合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、種別構成、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利付債券銘柄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

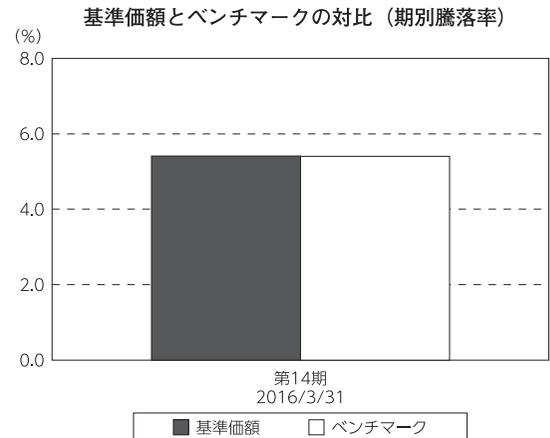
今期の基準価額の騰落率は+5.4%となり、ベンチマークの+5.4%とほぼ同程度となりました。主な差異要因は以下の通りです。

### （マイナス要因）

資金流出入に伴う取引で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時価に違いがあること。



（注）ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

## ◎今後の運用方針

当ファンドでは引き続き、債券組入比率を高位に保ち、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）を指数に合わせることで、NOMURA-BPI総合との連動をできる限り高めるように運用を行ってまいります。

## ○1万口当たりの費用明細

(2015年4月1日～2016年3月31日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2015年4月1日～2016年3月31日)

### 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	153,978,592	69,665,521
	地方債証券	23,888,366	5,558,234
	特殊債証券	25,130,353	12,498,312 ( 776,726)
	社債証券(投資法人債券を含む)	8,796,402	6,062,809

\*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。

\*社債証券(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。

## ○利害関係人との取引状況等

(2015年4月1日～2016年3月31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	$\frac{D}{C}$	
公社債	百万円 211,793	百万円 20,247	% 9.6	百万円 93,784	百万円 3,273	% 3.5
預金	38,982	38,982	100.0	37,298	37,298	100.0

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。

## ○組入資産の明細

(2016年3月31日現在)

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期		末				
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	455,315,000 ( 3,160,000)	513,500,283 ( 4,743,391)	78.3 ( 0.7)	— (—)	51.5 ( 0.7)	21.2 ( 0.0)	5.6 (0.0)
地方債証券	49,021,020 ( 49,021,020)	51,844,038 ( 51,844,038)	7.9 ( 7.9)	— (—)	3.4 ( 3.4)	3.4 ( 3.4)	1.1 (1.1)
特殊債券 (除く金融債)	48,158,183 ( 48,158,183)	51,196,816 ( 51,196,816)	7.8 ( 7.8)	— (—)	4.4 ( 4.4)	1.9 ( 1.9)	1.5 (1.5)
金融債券	6,150,000 ( 6,150,000)	6,191,268 ( 6,191,268)	0.9 ( 0.9)	— (—)	— ( —)	0.3 ( 0.3)	0.6 (0.6)
普通社債券 (含む投資法人債券)	28,907,000 ( 28,907,000)	30,007,290 ( 30,007,290)	4.6 ( 4.6)	— (—)	2.0 ( 2.0)	1.8 ( 1.8)	0.8 (0.8)
合 計	587,551,203 (135,396,203)	652,739,697 (143,982,805)	99.5 (21.9)	— (—)	61.3 (10.4)	28.6 ( 7.4)	9.7 (4.1)

\* ( )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
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
国庫債券	利付(2年)第359回	0.1	300,000	301,557	2017/12/15
国庫債券	利付(2年)第360回	0.1	4,200,000	4,223,268	2018/1/15
国庫債券	利付(2年)第362回	0.1	1,200,000	1,207,380	2018/3/15
国庫債券	利付(5年)第105回	0.2	4,500,000	4,521,285	2017/6/20
国庫債券	利付(5年)第106回	0.2	5,600,000	5,632,424	2017/9/20
国庫債券	利付(5年)第107回	0.2	3,800,000	3,826,106	2017/12/20
国庫債券	利付(5年)第108回	0.1	1,800,000	1,809,270	2017/12/20
国庫債券	利付(5年)第109回	0.1	2,800,000	2,817,332	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第110回	0.3	1,000,000	1,010,130	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第111回	0.4	1,400,000	1,416,926	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第112回	0.4	2,200,000	2,230,536	2018/6/20
国庫債券	利付(5年)第113回	0.3	7,000,000	7,081,620	2018/6/20
国庫債券	利付(5年)第114回	0.3	1,500,000	1,519,500	2018/9/20
国庫債券	利付(5年)第115回	0.2	7,300,000	7,376,796	2018/9/20
国庫債券	利付(5年)第116回	0.2	8,100,000	8,195,013	2018/12/20
国庫債券	利付(5年)第117回	0.2	5,900,000	5,975,579	2019/3/20
国庫債券	利付(5年)第118回	0.2	5,000,000	5,068,700	2019/6/20
国庫債券	利付(5年)第119回	0.1	4,000,000	4,042,040	2019/6/20
国庫債券	利付(5年)第120回	0.2	5,500,000	5,579,585	2019/9/20
国庫債券	利付(5年)第121回	0.1	3,500,000	3,538,465	2019/9/20
国庫債券	利付(5年)第122回	0.1	7,800,000	7,890,402	2019/12/20
国庫債券	利付(5年)第123回	0.1	7,300,000	7,388,841	2020/3/20
国庫債券	利付(5年)第124回	0.1	8,100,000	8,203,194	2020/6/20
国庫債券	利付(5年)第125回	0.1	8,200,000	8,308,896	2020/9/20
国庫債券	利付(5年)第126回	0.1	4,500,000	4,562,010	2020/12/20
国庫債券	利付(5年)第127回	0.1	1,000,000	1,014,510	2021/3/20
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	2,960,000	4,540,995	2048/3/20
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	900,000	1,338,606	2049/3/20
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	900,000	1,348,065	2050/3/20
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	1,100,000	1,658,932	2051/3/20
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	1,200,000	1,743,300	2052/3/20
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	1,300,000	1,856,153	2053/3/20
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	1,400,000	1,914,598	2054/3/20
国庫債券	利付(40年)第8回	1.4	1,600,000	2,029,824	2055/3/20
国庫債券	利付(10年)第288回	1.7	1,850,000	1,901,430	2017/9/20
国庫債券	利付(10年)第289回	1.5	2,000,000	2,058,580	2017/12/20
国庫債券	利付(10年)第290回	1.4	1,250,000	1,289,450	2018/3/20
国庫債券	利付(10年)第291回	1.3	1,400,000	1,441,440	2018/3/20
国庫債券	利付(10年)第292回	1.7	1,600,000	1,659,936	2018/3/20
国庫債券	利付(10年)第293回	1.8	750,000	783,652	2018/6/20
国庫債券	利付(10年)第294回	1.7	500,000	521,325	2018/6/20
国庫債券	利付(10年)第295回	1.5	1,600,000	1,661,136	2018/6/20
国庫債券	利付(10年)第297回	1.4	1,100,000	1,148,774	2018/12/20
国庫債券	利付(10年)第298回	1.3	1,500,000	1,562,415	2018/12/20
国庫債券	利付(10年)第299回	1.3	1,400,000	1,463,588	2019/3/20
国庫債券	利付(10年)第300回	1.5	1,000,000	1,051,380	2019/3/20

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 (10年) 第301回	1.5	1,500,000	1,583,430	2019/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第302回	1.4	700,000	736,666	2019/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第303回	1.4	3,300,000	3,485,328	2019/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第304回	1.3	1,000,000	1,052,670	2019/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第305回	1.3	4,100,000	4,331,609	2019/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第306回	1.4	3,000,000	3,192,180	2020/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第307回	1.3	1,700,000	1,802,102	2020/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第308回	1.3	1,700,000	1,808,290	2020/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第309回	1.1	3,000,000	3,165,600	2020/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第310回	1.0	3,700,000	3,898,172	2020/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第311回	0.8	1,800,000	1,880,208	2020/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第312回	1.2	4,950,000	5,277,145	2020/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第313回	1.3	3,200,000	3,437,824	2021/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第314回	1.1	2,200,000	2,341,482	2021/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第315回	1.2	2,600,000	2,790,918	2021/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第316回	1.1	1,400,000	1,495,438	2021/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第317回	1.1	1,800,000	1,928,700	2021/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第318回	1.0	3,200,000	3,411,136	2021/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第319回	1.1	1,850,000	1,988,380	2021/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第320回	1.0	3,500,000	3,741,605	2021/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第321回	1.0	3,200,000	3,430,528	2022/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第322回	0.9	2,400,000	2,558,424	2022/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第323回	0.9	2,700,000	2,885,868	2022/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第324回	0.8	3,200,000	3,400,160	2022/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第325回	0.8	4,900,000	5,217,373	2022/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第326回	0.7	2,100,000	2,226,315	2022/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第327回	0.8	3,800,000	4,054,372	2022/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第328回	0.6	5,500,000	5,802,280	2023/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第329回	0.8	5,300,000	5,675,293	2023/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第330回	0.8	4,800,000	5,149,968	2023/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第331回	0.6	1,900,000	2,009,820	2023/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第332回	0.6	6,400,000	6,777,152	2023/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第333回	0.6	5,500,000	5,829,890	2024/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第334回	0.6	4,100,000	4,350,182	2024/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第335回	0.5	4,700,000	4,951,215	2024/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第336回	0.5	2,700,000	2,846,124	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第337回	0.3	3,700,000	3,835,124	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第338回	0.4	4,900,000	5,123,783	2025/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第339回	0.4	5,900,000	6,168,509	2025/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第340回	0.4	6,000,000	6,274,560	2025/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第341回	0.3	5,900,000	6,110,453	2025/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第342回	0.1	1,300,000	1,319,513	2026/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第1回	2.8	100,000	136,047	2029/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第2回	2.4	200,000	262,624	2030/2/20
国庫債券 利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	208,449	2030/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第4回	2.9	900,000	1,256,112	2030/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	195,046	2031/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第6回	2.4	700,000	935,529	2031/11/20

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7回	2.3	600,000	796,212	2032/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	124,955	2032/11/22
国庫債券 利付 (30年) 第9回	1.4	65,000	76,991	2032/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	283,877	2033/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第11回	1.7	160,000	197,467	2033/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第12回	2.1	220,000	286,662	2033/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	373,227	2033/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	1,086,280	2034/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第15回	2.5	900,000	1,239,750	2034/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第16回	2.5	915,000	1,262,736	2034/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第17回	2.4	1,200,000	1,636,332	2034/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第18回	2.3	1,500,000	2,021,835	2035/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第19回	2.3	1,600,000	2,159,664	2035/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第20回	2.5	1,900,000	2,637,143	2035/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第21回	2.3	1,400,000	1,892,940	2035/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	835,200	2036/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	1,170,943	2036/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	978,047	2036/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	680,410	2036/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,175,329	2037/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第27回	2.5	1,550,000	2,184,740	2037/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第28回	2.5	700,000	990,731	2038/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第29回	2.4	800,000	1,121,680	2038/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第30回	2.3	900,000	1,249,065	2039/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第31回	2.2	1,000,000	1,372,840	2039/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第32回	2.3	1,900,000	2,663,059	2040/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第33回	2.0	2,000,000	2,680,180	2040/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第34回	2.2	2,300,000	3,199,553	2041/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	3,107,323	2041/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第36回	2.0	1,800,000	2,442,816	2042/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第37回	1.9	2,100,000	2,810,073	2042/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第38回	1.8	1,400,000	1,845,522	2043/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第39回	1.9	1,600,000	2,154,576	2043/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第40回	1.8	1,100,000	1,455,850	2043/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第41回	1.7	1,000,000	1,299,980	2043/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第42回	1.7	1,200,000	1,560,876	2044/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,694,056	2044/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,827,700	2044/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第45回	1.5	1,900,000	2,383,018	2044/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第46回	1.5	1,300,000	1,632,969	2045/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第47回	1.6	1,900,000	2,438,916	2045/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第48回	1.4	1,400,000	1,723,554	2045/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第49回	1.4	1,400,000	1,725,948	2045/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第50回	0.8	300,000	320,940	2046/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第36回	3.0	380,000	397,841	2017/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第37回	3.1	320,000	335,494	2017/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第38回	2.7	170,000	179,712	2018/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第39回	2.6	511,000	539,186	2018/3/20

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40回	2.3	525,000	557,555	2018/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第41回	1.5	255,000	267,982	2019/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第42回	2.6	683,000	740,030	2019/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第43回	2.9	400,000	443,240	2019/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第44回	2.5	150,000	166,095	2020/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第45回	2.4	242,000	267,001	2020/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第46回	2.2	90,000	99,079	2020/6/22
国庫債券 利付 (20年) 第47回	2.2	1,230,000	1,362,089	2020/9/21
国庫債券 利付 (20年) 第48回	2.5	200,000	225,488	2020/12/21
国庫債券 利付 (20年) 第49回	2.1	200,000	222,840	2021/3/22
国庫債券 利付 (20年) 第50回	1.9	183,000	202,066	2021/3/22
国庫債券 利付 (20年) 第51回	2.0	310,000	345,656	2021/6/21
国庫債券 利付 (20年) 第52回	2.1	100,000	112,616	2021/9/21
国庫債券 利付 (20年) 第53回	2.1	250,000	282,980	2021/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第54回	2.2	250,000	284,422	2021/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第55回	2.0	231,000	261,425	2022/3/21
国庫債券 利付 (20年) 第56回	2.0	120,000	136,430	2022/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第57回	1.9	210,000	237,434	2022/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第58回	1.9	180,000	204,415	2022/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第59回	1.7	230,000	259,377	2022/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第60回	1.4	780,000	863,733	2022/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第61回	1.0	300,000	324,831	2023/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	471,156	2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	343,020	2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	462,236	2023/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	527,777	2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	345,645	2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	360,898	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	344,615	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	660,956	2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	653,383	2024/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	238,674	2024/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第72回	2.1	670,000	797,166	2024/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第73回	2.0	1,600,000	1,896,960	2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第74回	2.1	1,300,000	1,552,044	2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	718,998	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	1,074,036	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	832,510	2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	947,424	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	1,026,461	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第80回	2.1	900,000	1,082,556	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	430,988	2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	989,502	2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,659,083	2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,441,488	2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	485,832	2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第86回	2.3	1,400,000	1,728,412	2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	612,290	2026/3/20

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88回	2.3	1,100,000	1,363,208	2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	577,644	2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,850,115	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	310,975	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第92回	2.1	1,550,000	1,901,741	2026/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	366,153	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第94回	2.1	200,000	246,296	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第95回	2.3	700,000	880,495	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	494,172	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第97回	2.2	1,300,000	1,625,975	2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	371,790	2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第99回	2.1	2,100,000	2,610,384	2027/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第100回	2.2	1,520,000	1,913,041	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	320,602	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第102回	2.4	500,000	643,385	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	764,772	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	500,128	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,382,410	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	506,516	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第107回	2.1	300,000	377,208	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,972,656	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	1,111,509	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第110回	2.1	1,100,000	1,386,770	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第111回	2.2	800,000	1,021,712	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,275,326	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第113回	2.1	1,800,000	2,281,248	2029/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第114回	2.1	2,500,000	3,176,325	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第115回	2.2	500,000	642,030	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,416,052	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第117回	2.1	1,900,000	2,419,802	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	630,900	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	987,096	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	964,760	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第121回	1.9	2,000,000	2,500,760	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第122回	1.8	1,100,000	1,359,809	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第123回	2.1	2,300,000	2,947,703	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第124回	2.0	1,000,000	1,266,300	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第125回	2.2	1,700,000	2,208,249	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第126回	2.0	1,000,000	1,269,730	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第127回	1.9	800,000	1,004,088	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第128回	1.9	1,500,000	1,886,160	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第129回	1.8	500,000	621,305	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第130回	1.8	1,800,000	2,240,370	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	983,672	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,599,481	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,743,882	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第134回	1.8	900,000	1,122,696	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第135回	1.7	400,000	492,788	2032/3/20

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
	%	千円	千円
<b>国債証券</b>			
国庫債券 利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	850,899
国庫債券 利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,232,620
国庫債券 利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	960,280
国庫債券 利付 (20年) 第139回	1.6	700,000	851,200
国庫債券 利付 (20年) 第140回	1.7	2,300,000	2,836,291
国庫債券 利付 (20年) 第141回	1.7	1,700,000	2,097,103
国庫債券 利付 (20年) 第142回	1.8	1,250,000	1,562,062
国庫債券 利付 (20年) 第143回	1.6	1,700,000	2,070,005
国庫債券 利付 (20年) 第144回	1.5	1,500,000	1,802,100
国庫債券 利付 (20年) 第145回	1.7	2,600,000	3,211,468
国庫債券 利付 (20年) 第146回	1.7	2,400,000	2,964,912
国庫債券 利付 (20年) 第147回	1.6	2,700,000	3,293,082
国庫債券 利付 (20年) 第148回	1.5	2,500,000	3,006,100
国庫債券 利付 (20年) 第149回	1.5	2,600,000	3,125,252
国庫債券 利付 (20年) 第150回	1.4	2,930,000	3,469,530
国庫債券 利付 (20年) 第151回	1.2	2,700,000	3,097,602
国庫債券 利付 (20年) 第152回	1.2	3,400,000	3,899,936
国庫債券 利付 (20年) 第153回	1.3	3,450,000	4,018,249
国庫債券 利付 (20年) 第154回	1.2	3,500,000	4,009,215
国庫債券 利付 (20年) 第155回	1.0	2,300,000	2,547,480
国庫債券 利付 (20年) 第156回	0.4	1,000,000	992,660
ポーランド共和国 第12回円貨債券 (2012)	1.05	100,000	101,104
ポーランド共和国 第15回円貨債券 (2013)	0.91	100,000	101,292
小計		455,315,000	513,500,283
<b>地方債証券</b>			
東京都 公募第648回	1.84	300,000	306,537
東京都 公募第655回	1.42	100,000	102,686
東京都 公募第659回	1.62	300,000	310,521
東京都 公募第660回	1.58	100,000	103,418
東京都 公募第664回	1.4	100,000	103,699
東京都 公募第668回	1.54	200,000	208,864
東京都 公募第671回	1.42	100,000	104,421
東京都 公募第685回	1.13	100,000	104,546
東京都 公募第690回	1.29	200,000	211,622
東京都 公募第703回	0.99	100,000	105,356
東京都 公募第707回	0.87	100,000	104,867
東京都 公募第708回	0.89	100,000	105,239
東京都 公募第710回	0.81	100,000	104,742
東京都 公募第712回	0.77	100,000	104,571
東京都 公募第715回	0.76	100,000	104,644
東京都 公募第716回	0.77	200,000	209,422
東京都 公募 (30年) 第7回	2.51	100,000	137,100
東京都 公募第10回	2.31	200,000	268,402
東京都 公募 (7年) 第1回	0.7	300,000	302,343
東京都 公募 (7年) 第3回	0.58	100,000	101,370
東京都 公募第1回	1.54	300,000	331,335
東京都 公募第7回	2.16	100,000	119,523
東京都 公募 (20年) 第16回	2.01	200,000	245,972

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	
東京都	公募(20年)第17回	2.09	200,000	247,970	2028/12/20
東京都	公募第23回	2.12	100,000	126,553	2030/12/20
東京都	公募(20年)第26回	1.74	300,000	365,193	2032/6/18
北海道	公募平成19年度第2回	1.84	500,000	509,910	2017/5/31
北海道	公募平成19年度第4回	1.98	100,000	102,308	2017/6/29
北海道	公募平成20年度第7回	1.72	300,000	312,324	2018/9/25
北海道	公募平成21年度第6回	1.6	100,000	105,137	2019/8/28
北海道	公募平成21年度第10回	1.5	100,000	105,142	2019/11/27
北海道	公募平成24年度第6回	0.84	100,000	104,619	2022/8/31
北海道	公募平成24年度第9回	0.79	100,000	104,370	2022/10/31
北海道	公募平成25年度第1回	0.58	300,000	309,657	2023/4/26
北海道	公募(5年)平成25年度第8回	0.31	100,000	100,606	2018/9/25
北海道	公募(5年)平成26年度第8回	0.178	200,000	200,604	2019/9/25
北海道	公募(5年)平成26年度第10回	0.147	100,000	100,204	2019/11/28
宮城県	公募(5年)第9回1号	0.35	500,000	503,715	2018/7/26
神奈川県	公募第155回	1.61	100,000	103,462	2018/6/20
神奈川県	公募第156回	1.66	101,000	105,083	2018/9/20
神奈川県	公募第184回	1.02	100,000	105,070	2021/6/18
神奈川県	公募第188回	1.05	200,000	211,950	2022/3/18
神奈川県	公募第196回	0.678	100,000	104,216	2023/3/20
神奈川県	公募第200回	0.825	100,000	105,571	2023/9/20
神奈川県	公募第205回	0.664	100,000	104,573	2024/3/19
神奈川県	公募第206回	0.654	100,000	104,637	2024/6/20
神奈川県	公募第210回	0.451	200,000	206,224	2024/12/20
神奈川県	公募(30年)第3回	2.62	100,000	137,479	2037/3/19
神奈川県	公募第7回	2.22	300,000	368,364	2027/3/19
神奈川県	公募(5年)第56回	0.29	100,000	100,452	2018/3/20
大阪府	公募第303回	1.93	300,000	306,666	2017/6/28
大阪府	公募第304回	1.98	150,000	153,673	2017/7/28
大阪府	公募第320回	1.84	400,000	418,516	2018/11/27
大阪府	公募第337回	1.44	200,000	210,732	2020/4/28
大阪府	公募第346回	1.25	100,000	105,298	2021/1/28
大阪府	公募第356回	1.06	100,000	105,507	2021/12/27
大阪府	公募第378回	0.7	104,000	108,743	2023/11/28
大阪府	公募第384回	0.67	100,000	104,605	2024/5/29
大阪府	公募第387回	0.521	300,000	310,500	2024/8/28
大阪府	公募第5回	2.16	100,000	125,430	2030/5/28
大阪府	公募第8回	1.83	100,000	121,789	2031/12/22
大阪府	公募第98回	0.295	200,000	201,040	2018/9/27
大阪府	公募(5年)第99回	0.24	240,000	240,921	2018/10/30
大阪府	公募(5年)第101回	0.23	148,000	148,520	2018/12/26
大阪府	公募第102回	0.223	100,000	100,339	2019/1/30
京都府	公募平成19年度第1回	1.81	100,000	102,598	2017/9/26
京都府	公募平成20年度第3回	1.57	140,000	145,800	2018/12/19
京都府	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	105,297	2022/6/20
京都府	公募平成24年度第6回	0.8	100,000	104,758	2022/10/21
京都府	公募平成26年度第5回	1.455	100,000	117,034	2034/8/10
京都府	公募平成26年度第7回	0.564	200,000	208,124	2024/9/19

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	
兵庫県	公募平成19年度第2回	1.8	100,000	101,898	2017/5/24
兵庫県	公募平成20年度第3回	1.76	100,000	103,571	2018/5/22
兵庫県	公募平成20年度第12回	1.82	100,000	104,618	2018/11/27
兵庫県	公募平成20年度第16回	1.6	100,000	104,250	2019/1/23
兵庫県	公募平成21年度第13回	1.48	100,000	104,560	2019/7/17
兵庫県	公募平成21年度第25回	1.54	100,000	105,241	2019/11/20
兵庫県	公募平成22年度第1回	1.46	100,000	105,448	2020/4/16
兵庫県	公募(30年)第2回	2.36	100,000	134,323	2040/3/19
兵庫県	公募(15年)第1回	1.66	300,000	346,365	2026/7/29
兵庫県	公募(15年)第3回	1.35	100,000	113,054	2027/7/16
兵庫県	公募(12年)第3回	0.56	300,000	311,931	2025/4/16
兵庫県	公募第2回	2.37	100,000	124,747	2027/9/17
兵庫県	公募第9回	2.25	100,000	125,701	2029/11/19
静岡県	公募平成19年度第1回	1.77	100,000	101,979	2017/5/30
静岡県	公募平成19年度第4回	1.94	200,000	205,330	2017/8/28
静岡県	公募平成19年度第7回	1.81	100,000	102,906	2017/11/28
静岡県	公募平成21年度第2回	1.65	100,000	105,166	2019/6/25
静岡県	公募平成21年度第7回	1.54	100,000	105,453	2019/11/25
静岡県	公募(5年)平成24年度第8回	0.236	100,000	100,295	2017/10/18
静岡県	公募平成24年度第10回	0.678	100,000	104,219	2023/3/22
静岡県	公募平成26年度第3回	0.679	165,000	172,924	2024/5/27
静岡県	公募平成26年度第8回	0.564	100,000	104,026	2024/9/25
静岡県	公募平成26年度第9回	0.554	100,000	103,978	2024/10/24
静岡県	公募(20年)第11回	1.841	100,000	122,066	2030/10/18
静岡県	公募(20年)第14回	1.736	100,000	121,669	2032/6/18
愛知県	公募平成19年度第3回	1.89	111,000	113,818	2017/8/17
愛知県	公募平成19年度第4回	1.87	100,000	102,828	2017/10/18
愛知県	公募平成20年度第7回	1.39	210,000	217,982	2019/1/30
愛知県	公募平成20年度第8回	2.04	100,000	122,899	2028/12/20
愛知県	公募平成20年度第10回	1.48	100,000	104,297	2019/3/27
愛知県	公募平成21年度第3回	1.66	114,000	119,930	2019/6/26
愛知県	公募平成21年度第17回	1.41	100,000	105,284	2020/2/26
愛知県	公募平成22年度第3回	1.364	100,000	105,436	2020/5/28
愛知県	公募平成22年度第9回	1.153	100,000	104,906	2020/9/30
愛知県	公募平成23年度第19回	1.006	100,000	105,666	2022/2/28
愛知県	公募平成24年度第2回	0.982	100,000	105,672	2022/4/27
愛知県	公募(5年)平成24年度第6回	0.2	1,100,000	1,102,046	2017/7/13
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	1.314	400,000	453,476	2027/12/13
愛知県	公募平成24年度第17回	1.829	100,000	123,107	2033/2/8
愛知県	公募平成26年度第8回	1.814	100,000	126,975	2044/6/20
愛知県	公募平成26年度第13回	1.363	100,000	115,130	2034/11/14
広島県	公募平成20年度第3回	1.6	300,000	311,742	2018/9/25
広島県	公募平成22年度第6回	1.26	200,000	211,536	2021/1/25
広島県	公募平成24年度第4回	0.81	100,000	104,900	2022/11/28
広島県	公募平成25年度第3回	0.8	200,000	210,792	2023/9/25
広島県	公募(5年)平成25年度第6回	0.21	300,000	301,572	2019/2/25
広島県	公募平成26年度第5回	0.33	109,650	112,012	2025/1/27
埼玉県	公募平成19年度第7回	1.65	200,000	206,074	2018/2/27

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	
埼玉県	公募平成20年度第1回	1.55	100,000	103,085	2018/4/24
埼玉県	公募平成21年度第5回	1.41	100,000	104,751	2019/9/25
埼玉県	公募平成22年度第2回	1.37	200,000	210,908	2020/5/26
埼玉県	公募平成24年度第4回	0.84	100,000	104,924	2022/7/25
埼玉県	公募(5年)平成24年度第8回	0.21	200,000	200,484	2017/12/28
埼玉県	公募平成25年度第4回	0.921	100,000	106,112	2023/7/24
埼玉県	公募平成25年度第6回	0.806	148,000	156,057	2023/9/27
埼玉県	公募(5年)平成25年度第7回	0.261	100,000	100,578	2018/10/25
埼玉県	公募平成25年度第10回	0.67	100,000	104,672	2024/2/26
埼玉県	公募平成25年度第11回	0.655	100,000	104,513	2024/3/26
埼玉県	公募平成26年度第6回	0.554	200,000	207,886	2024/9/26
福岡県	公募平成19年度第6回	1.72	100,000	102,452	2017/9/20
福岡県	公募平成19年度第8回	1.62	100,000	102,702	2017/12/20
福岡県	公募平成20年度第3回	1.59	100,000	103,463	2018/6/20
福岡県	公募平成22年度第5回	0.94	100,000	104,008	2020/10/28
福岡県	公募平成23年度第5回	1.02	100,000	105,414	2021/10/25
福岡県	公募平成24年度第10回	0.18	100,000	100,246	2018/1/29
福岡県	公募平成26年度第4回	0.135	100,000	100,313	2019/9/26
福岡県	公募平成23年度第1回	1.491	100,000	114,534	2026/11/27
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	2.62	100,000	137,985	2037/9/18
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	1.827	100,000	127,284	2044/6/20
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	2.05	100,000	123,177	2028/12/20
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	1.635	100,000	119,990	2032/8/16
千葉県	公募平成20年度第1回	1.55	100,000	103,089	2018/4/25
千葉県	公募平成20年度第6回	1.64	200,000	208,238	2018/10/25
千葉県	公募平成21年度第1回	1.53	100,000	104,532	2019/4/25
千葉県	公募平成21年度第11回	1.42	180,000	189,397	2020/1/24
千葉県	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	106,079	2022/4/25
千葉県	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	105,269	2022/5/25
千葉県	公募平成24年度第4回	0.22	100,000	100,238	2017/8/25
千葉県	公募平成24年度第8回	0.84	100,000	105,245	2023/1/25
千葉県	公募平成25年度第2回	0.26	900,000	904,050	2018/5/25
千葉県	公募平成25年度第3回	0.89	100,000	105,817	2023/6/23
千葉県	公募(20年)第8回	2.18	100,000	126,367	2030/4/19
千葉県	公募(20年)第17回	1.403	100,000	116,073	2034/10/13
新潟県	公募平成20年度第2回	1.52	200,000	208,670	2019/2/27
新潟県	公募平成21年度第2回	1.55	150,000	158,283	2019/11/27
長野県	公募平成25年度第1回	0.24	1,100,000	1,106,435	2018/12/25
群馬県	公募第8回	1.03	100,000	105,466	2021/11/25
群馬県	公募(5年)第4回	0.235	600,000	603,162	2018/11/22
岐阜県	公募平成19年度第1回	1.87	190,000	195,432	2017/10/26
岐阜県	公募平成26年度第1回	0.554	186,670	193,875	2024/9/30
共同発行市場地方債	公募第51回	1.9	100,000	102,281	2017/6/23
共同発行市場地方債	公募第56回	1.72	400,000	410,884	2017/11/24
共同発行市場地方債	公募第58回	1.59	270,500	278,003	2018/1/25
共同発行市場地方債	公募第62回	1.74	100,000	103,642	2018/5/25
共同発行市場地方債	公募第63回	1.88	100,000	104,110	2018/6/25
共同発行市場地方債	公募第64回	1.78	262,000	272,584	2018/7/25

銘柄		当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
共同発行市場地方債	公募第65回	1.62	700,000	726,768	2018/8/24
共同発行市場地方債	公募第66回	1.55	181,000	187,858	2018/9/25
共同発行市場地方債	公募第68回	1.69	900,000	939,375	2018/11/22
共同発行市場地方債	公募第70回	1.42	110,000	114,271	2019/1/25
共同発行市場地方債	公募第74回	1.57	500,000	523,960	2019/5/24
共同発行市場地方債	公募第75回	1.64	310,000	325,965	2019/6/25
共同発行市場地方債	公募第82回	1.42	300,000	315,600	2020/1/24
共同発行市場地方債	公募第84回	1.38	500,000	526,215	2020/3/25
共同発行市場地方債	公募第85回	1.44	100,000	105,630	2020/4/24
共同発行市場地方債	公募第88回	1.17	100,000	104,813	2020/7/24
共同発行市場地方債	公募第89回	1.04	100,000	104,331	2020/8/25
共同発行市場地方債	公募第92回	1.03	110,000	114,977	2020/11/25
共同発行市場地方債	公募第93回	1.25	300,000	316,935	2020/12/25
共同発行市場地方債	公募第94回	1.24	300,000	317,091	2021/1/25
共同発行市場地方債	公募第96回	1.29	100,000	106,135	2021/3/25
共同発行市場地方債	公募第101回	1.05	300,000	315,990	2021/8/25
共同発行市場地方債	公募第102回	1.03	150,000	157,962	2021/9/24
共同発行市場地方債	公募第103回	1.0	100,000	105,223	2021/10/25
共同発行市場地方債	公募第108回	1.01	200,000	211,302	2022/3/25
共同発行市場地方債	公募第110回	0.89	200,000	210,358	2022/5/25
共同発行市場地方債	公募第111回	0.89	200,000	210,492	2022/6/24
共同発行市場地方債	公募第113回	0.77	200,000	209,128	2022/8/25
共同発行市場地方債	公募第115回	0.8	100,000	104,835	2022/10/25
共同発行市場地方債	公募第116回	0.8	200,000	209,726	2022/11/25
共同発行市場地方債	公募第118回	0.84	100,000	105,209	2023/1/25
共同発行市場地方債	公募第119回	0.8	200,000	210,046	2023/2/24
共同発行市場地方債	公募第120回	0.68	300,000	312,708	2023/3/24
共同発行市場地方債	公募第121回	0.57	100,000	103,475	2023/4/25
共同発行市場地方債	公募第122回	0.62	100,000	103,907	2023/5/25
共同発行市場地方債	公募第124回	0.91	100,000	106,073	2023/7/25
共同発行市場地方債	公募第126回	0.81	100,000	105,510	2023/9/25
共同発行市場地方債	公募第128回	0.66	300,000	313,467	2023/11/24
共同発行市場地方債	公募第130回	0.76	100,000	105,324	2024/1/25
共同発行市場地方債	公募第132回	0.66	100,000	104,592	2024/3/25
共同発行市場地方債	公募第136回	0.611	200,000	208,670	2024/7/25
共同発行市場地方債	公募第137回	0.566	200,000	208,088	2024/8/23
共同発行市場地方債	公募第139回	0.544	155,000	161,105	2024/10/25
共同発行市場地方債	公募第143回	0.448	540,000	557,479	2025/2/25
堺市	公募平成22年度第1回	1.97	100,000	123,754	2030/11/19
堺市	公募平成26年度第1回	1.664	100,000	122,553	2044/9/20
島根県	公募平成22年度第1回	1.08	100,000	104,785	2020/11/26
島根県	公募平成25年度第3回	0.209	700,000	703,710	2019/3/25
福島県	公募平成24年度第2回	0.17	100,000	100,238	2018/2/26
福島県	公募平成26年度第1回	0.495	200,000	206,940	2024/11/28
滋賀県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	104,341	2023/11/29
滋賀県	公募平成26年度第1回	0.495	142,000	146,927	2024/11/28
栃木県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	104,341	2023/11/29
新潟市	公募平成25年度第1回	0.72	233,200	244,773	2023/12/26

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額
地方債証券	%	千円	千円
大阪市 公募平成20年度第3回	1.82	110,000	114,495
大阪市 公募平成21年度第6回	1.57	100,000	105,486
大阪市 公募平成25年度第1回	0.401	800,000	805,840
大阪市 公募平成25年度第6回	0.694	100,000	104,585
大阪市 公募(15年)第1回	1.753	100,000	116,353
大阪市 公募(20年)第5回	2.47	100,000	127,473
大阪市 公募(20年)第6回	2.21	100,000	124,626
大阪市 公募(20年)第17回	1.721	100,000	120,692
名古屋市 公募第460回	1.74	200,000	204,964
名古屋市 公募第464回	1.61	300,000	311,712
名古屋市 公募第469回	1.34	100,000	104,792
名古屋市 公募第478回	1.063	100,000	106,021
名古屋市 公募第488回	0.598	300,000	313,182
名古屋市 公募(6年)第1回	0.283	200,000	201,010
名古屋市 公募(12年)第1回	1.033	200,000	217,242
名古屋市 公募(15年)第2回	0.905	100,000	108,724
京都市 公募平成19年度第2回	1.74	300,000	308,661
京都市 公募平成19年度第4回	1.62	190,000	195,614
京都市 公募平成20年度第4回	1.54	200,000	208,600
京都市 公募平成23年度第4回	1.067	100,000	105,776
京都市 公募平成25年度第3回	0.312	100,000	100,675
京都市 公募(20年)第2回	2.12	100,000	119,147
京都市 公募(20年)第13回	1.359	100,000	114,482
神戸市 公募平成21年度第7回	1.69	100,000	105,257
横浜市 公募平成20年度第3回	1.56	100,000	103,713
横浜市 公募公債平成20年度5回	1.58	200,000	208,320
横浜市 公募平成21年度第4回	1.35	200,000	208,976
横浜市 公募平成22年度第5回	1.265	100,000	105,645
横浜市 公募公債平成24年度2回	0.815	200,000	209,628
横浜市 公募公債平成25年度1回	0.664	200,000	208,200
横浜市 公募公債平成25年度5回	0.655	200,000	208,720
横浜市 公募公債平成26年度5回	0.471	200,000	206,646
横浜市 公募(20年)第30回	1.376	100,000	115,421
札幌市 公募平成19年度第3回	1.77	100,000	102,533
札幌市 公募平成22年度第4回	1.05	100,000	104,187
札幌市 公募(5年)平成24年度第8回	0.2	200,000	200,444
札幌市 公募平成26年度第4回	0.54	100,000	103,704
札幌市 公募平成26年度第9回	0.43	200,000	205,860
川崎市 公募第81回	1.57	100,000	104,536
川崎市 公募第82回	1.52	100,000	105,115
川崎市 公募第85回	0.72	100,000	104,341
川崎市 公募(20年)第17回	1.527	100,000	118,312
川崎市 公募第32回	0.22	150,000	150,301
北九州市 公募(5年)平成25年度第2回	0.312	100,000	100,707
北九州市 公募(20年)第14回	1.732	100,000	121,210
福岡市 公募平成20年度第3回	1.52	100,000	103,308
福岡市 公募平成24年度第5回	0.19	100,000	100,241
福岡市 公募(5年)平成25年度第2回	0.35	300,000	302,226

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
福岡市	公募平成26年度第2回	1.49	100,000	117,306	2034/6/20
福岡市	公募平成26年度第5回	0.539	100,000	103,855	2024/10/28
福岡市	公募平成26年度第8回	0.465	160,000	165,414	2025/3/25
広島市	公募平成21年度第3回	1.34	100,000	104,838	2019/12/25
仙台市	公募平成25年度第1回	0.24	600,000	603,174	2019/1/29
千葉市	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,967	2022/4/25
鹿児島県	公募(5年)平成25年度第1回	0.24	100,000	100,546	2018/10/31
福井県	公募平成24年度第4回	0.46	100,000	102,738	2023/4/26
徳島県	公募平成22年度第1回	1.05	400,000	418,724	2020/11/30
山梨県	公募平成19年度第1回	1.86	200,000	205,742	2017/10/30
山梨県	公募平成21年度第1回	1.37	100,000	104,755	2019/10/30
岡山県	公募平成21年度第2回	1.39	100,000	105,408	2020/3/31
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	第96回	2.34	100,000	126,003	2028/12/20
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	第102回	2.298	300,000	379,977	2029/12/20
福岡北九州高速道路債券	第117回	2.26	100,000	124,395	2028/12/20
東京都住宅供給公社債券	第5回	2.02	200,000	205,484	2017/9/20
小 計			49,021,020	51,844,038	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第344回	1.6	200,000	213,258	2020/7/15
公営企業債券	政府保証第875回	1.7	100,000	101,904	2017/5/22
公営企業債券	政府保証第880回	1.7	131,000	134,557	2017/11/17
公営企業債券	政府保証第881回	1.5	200,000	205,316	2018/1/23
公営企業債券	政府保証第886回	1.8	203,000	210,967	2018/6/19
公営企業債券	政府保証15年第1回	1.6	300,000	319,611	2020/6/22
政保	地方公営企業等金融機構債券 第2回	1.6	400,000	416,552	2018/11/16
地方公共団体金融機構債券	政府保証第5回	1.2	200,000	208,184	2019/10/18
地方公共団体金融機構債券	政府保証第16回	1.0	100,000	104,202	2020/9/14
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第1回	0.4	100,000	100,544	2017/9/27
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第4回	0.4	500,000	503,620	2018/3/26
政保	地方公共団体金融機構債券 第39回	0.801	100,000	104,713	2022/8/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第45回	0.815	100,000	105,151	2023/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第50回	0.911	100,000	106,132	2023/7/14
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第10回	0.385	300,000	303,399	2019/7/24
政保	地方公共団体金融機構債券(4年) 第6回	0.205	400,000	400,960	2017/8/29
政保	地方公共団体金融機構債券 第59回	0.669	116,000	121,590	2024/4/12
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第14回	0.199	300,000	301,869	2020/6/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第64回	0.544	100,000	104,062	2024/9/13
政保	地方公共団体金融機構債券 第65回	0.539	400,000	416,248	2024/10/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第69回	0.414	300,000	309,456	2025/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第72回	0.509	189,000	196,792	2025/5/23
日本政策金融公庫債券	政府保証第22回	0.243	2,000,000	2,011,160	2018/10/26
新関西国際空港債券	政府保証第1回	0.801	151,000	158,151	2022/8/29
原子力損害賠償支援機構債券	政府保証第2回	0.151	200,000	200,376	2017/11/17
原子力損害賠償支援機構債券	政府保証第3回	0.117	2,100,000	2,103,675	2018/5/23
原子力損害賠償支援機構債券	政府保証第5回	0.059	3,590,000	3,591,328	2017/11/2
日本政策投資銀行債券	政府保証第18回	1.9	100,000	102,569	2017/8/16
日本政策投資銀行債券	政府保証第22回	2.2	100,000	115,351	2023/6/19
日本政策投資銀行社債	政府保証第5回	1.4	100,000	104,129	2019/4/15

銘柄	利 率	当 期 末		償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
日本政策投資銀行社債 政府保証第9回	1.0	141,000	146,924	2020/9/14
日本政策投資銀行社債 政府保証第10回	0.5	100,000	100,571	2017/6/23
日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	0.819	102,000	106,984	2022/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6回	1.9	100,000	109,007	2021/2/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第9回	1.9	100,000	109,175	2021/3/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第42回	1.8	100,000	102,798	2017/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第56回	1.4	205,000	210,746	2018/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第58回	1.7	136,000	140,897	2018/5/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第60回	1.8	283,000	294,243	2018/6/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第62回	1.7	100,000	103,895	2018/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第67回	1.6	341,000	354,875	2018/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第69回	1.6	100,000	104,190	2018/11/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第71回	1.4	100,000	103,745	2018/12/25
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	2.1	200,000	250,242	2029/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	2.1	200,000	250,478	2029/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第98回	1.3	300,000	314,421	2020/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	2.2	200,000	253,508	2030/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第100回	1.4	400,000	421,176	2020/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	2.1	200,000	251,352	2030/4/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	1.9	200,000	246,338	2030/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	2.1	100,000	133,216	2040/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回	1.2	440,000	466,479	2021/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	1.0	140,000	147,512	2021/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	0.9	100,000	104,944	2022/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	0.9	140,000	147,012	2022/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	1.83	100,000	128,360	2042/5/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	0.839	100,000	104,925	2022/7/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	1.634	100,000	120,116	2032/7/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	0.801	218,000	228,331	2022/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	1.56	100,000	118,861	2032/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	1.919	300,000	391,917	2042/8/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	0.819	200,000	209,816	2022/9/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	0.791	200,000	209,576	2022/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	0.734	200,000	209,034	2022/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	0.834	400,000	421,004	2023/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	1.726	100,000	121,626	2033/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	0.541	196,000	202,562	2023/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	0.605	400,000	415,380	2023/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	0.882	200,000	211,780	2023/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	0.835	272,000	287,455	2023/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	0.693	300,000	314,517	2023/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	0.66	137,000	143,412	2024/2/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	0.645	145,000	151,675	2024/3/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回	1.483	100,000	117,753	2034/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回	1.478	100,000	117,651	2034/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	0.644	100,000	104,782	2024/6/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	0.556	190,000	197,873	2024/8/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	0.466	100,000	103,524	2024/12/27

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
首都高速道路債券 政府保証第8回	1.3	100,000	104,769	2020/1/20
阪神高速道路債券 政府保証第5回	1.3	100,000	104,965	2020/3/18
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	0.699	120,000	125,718	2023/10/20
中部国際空港債券 政府保証第18回	0.668	264,000	275,051	2023/3/22
預金保険機構債券 政府保証第194回	0.1	300,000	300,327	2017/12/15
中日本高速道路債券 政府保証第13回	1.7	138,000	140,608	2017/5/19
中日本高速道路債券 政府保証第14回	1.9	100,000	102,258	2017/6/16
西日本高速道路債券 政府保証第8回	1.7	100,000	101,890	2017/5/19
銀行等保有株式取得機構債券 政府保証第28回	0.1	400,000	400,304	2017/5/19
新関西国際空港社債 財投機関債第10回	0.161	100,000	100,156	2017/9/20
新関西国際空港社債 財投機関債第12回	1.067	100,000	109,100	2029/9/20
日本政策投資銀行社債 財投機関債第25回	0.425	100,000	100,470	2017/6/20
日本政策投資銀行社債 財投機関債第26回	0.573	100,000	101,696	2019/6/20
日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	1.027	100,000	109,149	2029/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第4回	2.59	100,000	135,746	2035/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第8回	2.45	200,000	244,300	2026/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回	2.39	200,000	247,872	2027/7/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第33回	2.91	200,000	306,542	2048/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第38回	1.87	100,000	104,062	2018/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第39回	2.37	100,000	125,406	2028/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回	2.41	100,000	126,739	2029/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第86回	0.934	200,000	210,506	2022/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第89回	1.711	100,000	119,343	2032/6/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第102回	0.666	100,000	104,024	2023/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第103回	1.69	350,000	416,703	2033/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回	1.853	100,000	121,719	2033/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第127回	0.184	300,000	301,332	2019/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第130回	0.56	200,000	206,972	2024/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第134回	0.529	200,000	206,468	2024/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第145回	1.523	300,000	351,783	2044/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第149回	1.604	100,000	119,436	2045/3/17
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回	2.91	100,000	140,059	2034/6/20
公営企業債券 30年第4回財投機関債	2.95	100,000	141,050	2034/3/24
地方公営企業等金融機構債券 第1回	1.77	200,000	208,674	2018/9/25
地方公営企業等金融機構債券(20年) 第1回	2.07	100,000	122,054	2028/12/20
地方公共団体金融機構債券 第1回	1.648	100,000	105,189	2019/6/28
地方公共団体金融機構債券 第2回	1.406	100,000	104,504	2019/7/26
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	2.12	100,000	123,680	2029/12/28
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	2.242	300,000	376,671	2030/3/28
地方公共団体金融機構債券 F24回	1.681	100,000	111,056	2023/3/17
地方公共団体金融機構債券 第13回	1.278	200,000	210,292	2020/6/26
地方公共団体金融機構債券 第16回	1.164	100,000	104,925	2020/9/28
地方公共団体金融機構債券 第27回	1.034	300,000	315,912	2021/8/27
地方公共団体金融機構債券 F104回	1.314	100,000	110,262	2025/3/7
地方公共団体金融機構債券 F106回	1.259	100,000	108,987	2024/3/19
地方公共団体金融機構債券 第37回	0.852	300,000	314,856	2022/6/28
地方公共団体金融機構債券 第41回	0.801	600,000	628,674	2022/10/28
地方公共団体金融機構債券 F142回	1.016	100,000	107,447	2024/11/28

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円	
地方公共団体金融機構債券	F 144回	0.562	200,000	204,530	2020/10/28
地方公共団体金融機構債券	F 145回	1.059	200,000	215,996	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券	第42回	0.801	100,000	104,806	2022/11/28
地方公共団体金融機構債券	第44回	0.791	100,000	104,844	2023/1/27
地方公共団体金融機構債券	F 160回	1.052	100,000	109,232	2028/5/26
地方公共団体金融機構債券	第51回	0.841	300,000	316,341	2023/8/28
地方公共団体金融機構債券	第52回	0.801	300,000	316,383	2023/9/15
地方公共団体金融機構債券	(15年) 第2回	1.161	200,000	221,468	2028/12/28
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第38回	1.487	100,000	115,870	2034/7/28
地方公共団体金融機構債券	第64回	0.574	100,000	103,631	2024/9/27
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第39回	1.425	100,000	114,757	2034/9/28
公営企業債券(20年) 第2回財投機関債		1.45	100,000	109,196	2022/12/20
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債		2.5	100,000	126,615	2028/6/20
公営企業債券 第29回財投機関債		1.77	500,000	514,845	2017/12/20
首都高速道路社債 第12回		0.293	100,000	100,686	2018/12/20
阪神高速道路 第13回		0.18	100,000	100,447	2019/9/20
中小企業債券 第6回財投機関債		0.79	100,000	101,446	2018/3/20
都市再生債券 財投機関債第21回		1.72	300,000	312,567	2018/9/20
都市再生債券 財投機関債第55回		1.074	100,000	105,578	2021/9/17
都市再生債券 財投機関債第97回		1.017	100,000	109,019	2029/9/20
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回		2.26	100,000	119,044	2025/6/20
東京交通債券 第342回		2.4	200,000	228,750	2022/6/21
東京交通債券 第347回		2.05	157,000	180,625	2024/3/8
関西国際空港社債 財投機関債第26回		1.156	300,000	314,580	2020/9/18
福祉医療機構債券 第31回財投機関債		0.93	100,000	105,422	2022/6/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回		2.26	200,000	243,792	2027/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回		1.86	200,000	207,186	2018/3/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回		2.15	100,000	115,221	2023/9/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第25回		1.67	300,000	313,299	2018/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第41回		1.5	100,000	105,387	2019/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回		1.94	100,000	115,855	2025/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回		1.95	100,000	121,896	2030/10/22
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回		1.256	100,000	106,272	2021/6/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回		2.066	100,000	124,305	2031/6/13
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回		1.751	300,000	346,365	2026/6/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回		2.056	100,000	124,189	2031/7/11
住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回		1.069	100,000	105,551	2021/9/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回		1.046	200,000	210,850	2021/9/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回		1.595	200,000	228,880	2026/12/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回		2.273	100,000	133,305	2042/9/19
成田国際空港 第17回		0.489	200,000	205,906	2025/2/20
私学振興債券 財投機関債第7回		1.7	300,000	307,335	2017/9/25
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第17回		1.208	100,000	106,022	2021/6/18
国際協力機構債券 第6回財投機関債		2.098	100,000	124,607	2030/12/13
東日本高速道路 第21回		0.58	100,000	101,187	2018/6/20
東日本高速道路 第26回		0.305	100,000	100,833	2019/6/20
東日本高速道路 第27回		0.248	100,000	100,650	2019/6/20
中日本高速道路債券 財投機関債第3回		1.92	100,000	102,777	2017/9/20

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
中日本高速道路社債 第32回		0.64	200,000	203,036	2018/9/20
中日本高速道路社債 第44回		0.536	100,000	101,682	2019/9/20
中日本高速道路社債 第46回		0.351	1,500,000	1,506,975	2017/9/20
中日本高速道路社債 第47回		0.277	100,000	100,476	2018/3/20
中日本高速道路社債 第53回		0.222	100,000	100,222	2017/6/20
西日本高速道路 第20回		0.759	200,000	209,770	2023/9/20
西日本高速道路 第23回		0.602	100,000	103,829	2024/6/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第35回		1.165	200,000	209,800	2020/9/18
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回		1.441	100,000	114,922	2034/8/4
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券		1.94	15,355	15,963	2037/6/10
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券		1.69	54,378	56,541	2038/9/10
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券		1.8	100,360	105,135	2039/6/10
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券		1.43	98,118	101,019	2038/2/10
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券		1.76	61,605	65,027	2036/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券		2.34	82,758	89,743	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券		2.25	21,586	23,230	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券		1.84	54,444	57,753	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	59,696	63,872	2041/3/10
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券		1.69	58,590	61,214	2039/2/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券		1.69	120,880	127,600	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券		2.12	104,645	110,881	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券		2.3	104,128	112,995	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券		1.99	59,582	63,696	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券		2.14	29,714	31,885	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	40,277	44,039	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	137,841	149,150	2044/9/10
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券		1.64	34,882	36,419	2032/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券		1.43	144,444	153,611	2045/11/10
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券		1.71	71,678	75,042	2032/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券		1.79	205,452	221,795	2046/2/10
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券		1.51	147,586	157,614	2046/9/10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券		2.34	79,442	86,968	2044/5/10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券		1.89	200,343	217,031	2046/5/10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券		1.36	202,719	214,093	2045/9/10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券		1.21	241,647	254,618	2047/7/10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券		1.34	237,912	252,450	2047/5/10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券		1.26	157,888	166,773	2047/6/10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券		1.64	71,226	76,438	2046/8/10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券		1.6	145,356	155,895	2045/12/10
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券		1.07	86,121	90,260	2048/12/10
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券		1.07	175,622	184,194	2049/2/10
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券		1.08	83,400	87,398	2048/5/10
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券		1.87	42,962	45,233	2039/9/10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券		1.25	249,375	263,716	2048/3/10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券		1.88	51,197	55,027	2045/2/10
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券		1.86	52,833	56,767	2045/3/10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券		1.87	56,282	60,360	2045/4/10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券		1.85	68,858	74,543	2046/3/10

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	1.41	157,790	168,041	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	1.42	232,569	247,751	2047/1/10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	1.44	78,089	83,259	2047/2/10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	1.21	164,612	173,769	2048/9/10
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	1.82	20,001	21,141	2036/5/10
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	1.7	162,515	169,373	2032/5/10
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	1.65	65,500	68,137	2032/5/10
貸付債権担保第1回住宅金融公庫債券	1.75	26,764	27,495	2036/3/10
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	1.82	56,040	57,728	2037/8/10
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	1.52	319,935	338,891	2045/8/10
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	1.4	157,388	167,548	2047/3/10
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	1.16	248,352	261,089	2047/9/10
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	1.3	171,884	182,692	2048/6/10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	1.26	163,626	173,232	2048/8/10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	0.93	92,847	96,612	2049/9/10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	0.95	93,619	97,569	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	0.87	93,649	97,107	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	0.74	189,946	195,243	2050/1/10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	0.6	190,318	193,730	2050/2/10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	0.8	95,846	98,973	2050/3/10
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	0.74	96,232	98,992	2050/5/10
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	0.83	289,587	299,763	2050/6/10
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	0.9	292,029	303,832	2050/7/10
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	0.88	195,246	202,839	2050/8/10
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	0.84	97,617	101,113	2050/9/10
フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	0.725	100,000	103,095	2024/7/30
韓国産業銀行 第45回円貨社債(2014)	0.69	100,000	100,521	2019/1/29
小 計		48,158,183	51,196,816	
<b>金融債券</b>				
商工債券 利付第753回い号	0.25	100,000	100,391	2018/2/27
農林債券 利付第745回い号	0.35	100,000	100,347	2017/6/27
農林債券 利付第751回い号	0.3	200,000	200,848	2017/12/27
農林債券 利付第752回い号	0.3	100,000	100,454	2018/1/26
農林債券 利付第756回い号	0.3	100,000	100,547	2018/5/25
農林債券 利付第759回い号	0.4	100,000	100,864	2018/8/27
農林債券 利付第760回い号	0.4	100,000	100,906	2018/9/27
農林債券 利付第761回い号	0.3	100,000	100,666	2018/10/26
農林債券 利付第764回い号	0.35	100,000	100,837	2019/1/25
農林債券 利付第765回い号	0.3	300,000	302,139	2019/2/27
農林債券 利付第767回い号	0.3	300,000	302,151	2019/4/26
農林債券 利付第773回い号	0.24	300,000	301,803	2019/10/25
農林債券 利付第777回い号	0.25	300,000	301,977	2020/2/27
しんきん中金債券 利付第271回	0.35	350,000	351,256	2017/6/27
しんきん中金債券 利付第277回	0.25	100,000	100,355	2017/12/27
しんきん中金債券 利付第284回	0.4	100,000	100,846	2018/7/27
しんきん中金債券 利付第286回	0.35	100,000	100,807	2018/9/27
しんきん中金債券 利付第287回	0.3	100,000	100,692	2018/10/26
しんきん中金債券 利付第290回	0.3	100,000	100,725	2019/1/25

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>金融債券</b>	%	千円	千円	
しんきん中金債券 利付第302回	0.2	100,000	100,511	2020/1/27
商工債券 利付(3年)第172回	0.2	200,000	200,326	2017/5/26
商工債券 利付(3年)第174回	0.15	200,000	200,236	2017/7/27
商工債券 利付(3年)第178回	0.15	1,000,000	1,001,640	2017/11/27
商工債券 利付(3年)第181回	0.15	500,000	501,000	2018/2/27
商工債券 利付(3年)第182回	0.14	100,000	100,188	2018/3/27
商工債券 利付(10年)第5回	1.8	600,000	618,120	2017/12/20
あおぞら債券 利付(3年)第71回	0.19	400,000	400,636	2017/12/8
小 計		6,150,000	6,191,268	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>				
東京電力 第455回	2.075	200,000	208,500	2018/10/23
東京電力 第459回	2.7	100,000	106,256	2019/1/29
東京電力 第542回	1.602	100,000	102,413	2018/4/25
東京電力 第544回	1.976	100,000	103,457	2018/6/25
東京電力 第547回	1.948	100,000	105,972	2020/7/24
東京電力 第548回	2.347	100,000	111,369	2028/9/29
東京電力 第559回	1.377	100,000	102,991	2019/10/29
東京電力 第560回	2.114	100,000	108,684	2029/12/10
東京電力 第565回	1.313	300,000	309,645	2020/6/24
中部電力 第482回	2.17	200,000	213,176	2019/6/25
中部電力 第500回	0.875	200,000	209,038	2024/5/24
関西電力 第448回	2.16	200,000	208,808	2018/6/20
関西電力 第469回	1.7	100,000	103,926	2018/10/25
関西電力 第482回	1.189	100,000	103,931	2020/7/24
関西電力 第484回	0.976	100,000	103,157	2020/10/23
関西電力 第496回	0.908	100,000	103,499	2025/2/25
関西電力 第497回	1.002	200,000	208,538	2025/6/20
関西電力 第498回	0.416	200,000	201,236	2020/9/18
中国電力 第314回	2.875	100,000	105,772	2018/4/25
中国電力 第330回	2.1	100,000	109,375	2021/3/25
中国電力 第377回	1.121	200,000	212,110	2023/8/25
中国電力 第378回	1.004	100,000	105,284	2023/10/25
北陸電力 第301回	1.158	100,000	106,084	2023/3/24
北陸電力 第304回	0.989	100,000	105,173	2023/10/25
北陸電力 第307回	1.055	100,000	105,825	2026/6/25
北陸電力 第308回	0.769	100,000	103,695	2024/9/25
東北電力 第431回	2.05	400,000	415,072	2018/3/23
東北電力 第473回	0.597	100,000	101,753	2021/4/23
東北電力 第475回	0.809	100,000	103,554	2024/9/25
東北電力 第481回	0.803	200,000	206,930	2025/7/25
四国電力 第281回	1.111	200,000	212,102	2023/9/25
九州電力 第400回	1.777	100,000	106,115	2020/4/24
九州電力 第409回	1.483	100,000	104,350	2019/8/23
九州電力 第420回	0.82	300,000	304,206	2018/4/25
九州電力 第424回	1.233	200,000	211,890	2023/11/24
北海道電力 第296回	2.027	100,000	104,158	2018/6/25
北海道電力 第316回	1.164	207,000	214,965	2020/6/25
北海道電力 第323回	1.337	100,000	107,836	2030/3/25

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額 償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円
新日本製鐵 第30回社債間限定同順位特約付	3.175	100,000	104,503 2017/9/11
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	1.293	100,000	105,472 2021/3/19
成田国際空港 第13回一般担保付	0.802	200,000	209,806 2023/2/8
清水建設 第18回社債間限定同順位特約付	0.947	100,000	102,597 2019/3/6
大和ハウス工業 第5回特定社債間限定同順位特約付	0.443	100,000	101,976 2021/6/18
森永乳業 第13回社債間限定同順位特約付	0.884	100,000	103,828 2024/5/8
アサヒグループホールディングス 第7回特定社債間限定同順位特約付	0.237	100,000	100,643 2020/5/28
アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特約付	0.348	100,000	101,591 2022/5/27
キリンホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付	0.603	200,000	206,444 2025/2/28
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	0.714	100,000	103,984 2023/9/20
野村不動産ホールディングス 第5回社債間限定同順位特約付	0.924	100,000	102,944 2025/5/30
森ビル 第13回社債間限定同順位特約付	0.466	100,000	101,125 2020/5/19
東急不動産ホールディングス 第2回社債間限定同順位特約付	0.856	100,000	103,032 2024/7/29
セブン&アイ・ホールディングス 第3回社債間限定同順位特約付	1.94	100,000	104,222 2018/6/20
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	0.451	100,000	101,324 2021/9/3
住友化学 第43回社債間限定同順位特約付	1.58	100,000	105,899 2020/4/23
クレハ 第5回社債間限定同順位特約付	0.302	100,000	100,769 2020/3/6
エア・ウォーター 第2回社債間限定同順位特約付	0.271	100,000	100,782 2020/9/3
三菱ケミカルホールディングス 第14回社債間限定同順位特約付	0.482	200,000	203,508 2021/6/17
宇部興産 第10回社債間限定同順位特約付	0.334	100,000	100,610 2019/6/4
花王 第4回特定社債間限定同順位特約付	0.624	100,000	102,321 2020/6/19
武田薬品工業 第15回社債間限定同順位特約付	0.704	100,000	102,616 2020/7/17
第一三共 第4回社債間限定同順位特約付	0.846	100,000	104,680 2023/9/15
JXホールディングス 第9回社債間限定同順位特約付	0.82	100,000	102,417 2024/6/4
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	0.355	100,000	101,218 2021/10/29
ブリヂストン 第8回社債間限定同順位特約付	0.249	200,000	201,156 2019/9/26
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	0.755	100,000	104,272 2024/6/25
住友大阪セメント 第14回社債間限定同順位特約付	0.332	100,000	100,924 2020/3/3
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	0.579	100,000	99,032 2022/5/20
神戸製鋼所 第63回社債間限定同順位特約付	0.924	100,000	99,391 2025/5/21
ジェイ エフ イー ホールディングス 第16回(JFEス保証)	0.858	100,000	100,844 2017/5/26
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回(JFEス保証)	0.703	100,000	101,334 2024/9/19
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	0.234	100,000	100,530 2019/9/20
小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付	0.275	100,000	100,478 2019/6/20
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	1.371	200,000	220,318 2028/12/13
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	0.428	100,000	101,727 2021/6/4
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	0.956	100,000	104,969 2022/9/20
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	0.644	100,000	101,881 2020/10/16
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	2.05	100,000	105,712 2019/3/20
パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	0.387	200,000	201,902 2020/3/19
ソニー 第26回	2.068	100,000	105,572 2019/6/20
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	0.877	100,000	104,605 2023/9/4
川崎重工業 第32回社債間限定同順位特約付	1.062	100,000	101,189 2017/6/21
明治安田生命2014基金特定目的会社 第1回特定社債	0.51	300,000	303,024 2019/8/7
日産自動車 第55回特定社債間限定同順位特約付	0.415	200,000	201,372 2018/3/20
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	0.963	100,000	105,499 2023/3/20
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	0.562	100,000	103,042 2025/2/26
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	0.652	100,000	103,286 2022/3/14

銘柄	当 期 末			償還年月日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	1.358	100,000	105,983	2020/12/18
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	1.378	200,000	212,212	2021/6/4
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	0.436	100,000	100,533	2021/7/23
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	1.014	100,000	105,512	2025/12/5
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	0.954	200,000	209,118	2026/7/10
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	1.187	100,000	108,707	2029/7/13
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	1.117	100,000	104,719	2022/4/20
三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無	2.08	100,000	102,676	2017/7/28
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	1.657	100,000	105,299	2019/7/29
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	0.451	200,000	203,900	2021/7/30
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付	0.344	100,000	100,546	2019/6/4
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	0.543	200,000	202,412	2022/6/3
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	0.904	100,000	102,601	2024/4/24
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	0.884	100,000	102,446	2024/6/18
イオン 第16回社債間限定同順位特約付	1.01	100,000	102,273	2018/11/21
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	0.94	100,000	103,959	2024/6/26
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	0.915	200,000	206,372	2025/6/5
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	2.54	100,000	123,239	2027/7/27
みずほコーポレート銀行 第31回特定社債間限定同順位特約付	0.33	2,000,000	2,008,440	2017/10/25
みずほコーポレート銀行 第32回特定社債間限定同順位特約付	0.27	300,000	301,194	2018/1/24
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付	2.5	100,000	107,271	2019/6/3
三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間限定同順位特約付	2.69	100,000	110,245	2020/2/27
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	2.22	100,000	113,666	2022/10/27
三菱東京UFJ銀行 第93回特定社債間限定同順位特約付	1.985	100,000	102,977	2017/10/17
三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付	1.035	100,000	104,344	2020/10/15
三菱東京UFJ銀行 第140回特定社債間限定同順位特約付	0.24	500,000	501,715	2018/1/23
三菱東京UFJ銀行 第12回(劣後特約付)	2.16	300,000	307,980	2017/7/28
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	0.849	300,000	308,415	2024/9/12
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	0.884	100,000	102,999	2025/5/29
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	1.328	100,000	106,895	2030/5/29
りそな銀行 第4回社債間限定同順位特約付	2.766	100,000	108,194	2019/6/20
りそな銀行 第6回劣後特約付	2.084	300,000	321,513	2020/3/4
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	1.68	100,000	107,428	2021/4/28
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	1.389	300,000	321,579	2022/9/20
三井住友信託銀行 第7回社債間限定同順位特約付	0.269	100,000	100,670	2019/4/26
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	104,380	2023/3/20
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	0.536	100,000	102,498	2024/12/20
みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	0.95	200,000	206,470	2024/7/16
三井住友銀行 第57回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	100,372	2017/10/20
三井住友銀行 第24回劣後特約付	1.6	100,000	107,288	2021/6/1
みずほ銀行 第35回特定社債間限定同順位特約付	0.285	100,000	100,638	2019/1/25
興銀リース 第4回社債間限定同順位特約付	0.36	100,000	100,781	2019/5/23
NTTファイナンス 第45回社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	100,110	2017/6/20
NTTファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,671	2019/6/20
ホンダファイナンス 第26回社債間限定同順位特約付	0.315	100,000	100,728	2018/9/20
ホンダファイナンス 第30回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	100,541	2019/6/20
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	0.545	100,000	100,912	2021/12/3
オリエントコーポレーション 第2回社債間限定同順位特約付	0.45	200,000	201,170	2020/1/22

銘柄	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円
日立キャピタル	第52回社債間限定同順位特約付	0.508	100,000	101,784 2021/6/18
日立キャピタル	第56回社債間限定同順位特約付	0.197	100,000	100,381 2019/12/20
日立キャピタル	第57回社債間限定同順位特約付	0.616	100,000	102,480 2024/12/20
オリックス	第144回社債間限定同順位特約付	1.51	100,000	102,352 2017/12/22
オリックス	第164回社債間限定同順位特約付	1.146	100,000	103,282 2019/8/7
三井住友ファイナンス&リース	第7回社債間限定同順位特約付	0.442	100,000	100,922 2018/8/6
三井住友ファイナンス&リース	第13回社債間限定同順位特約付	0.257	100,000	100,600 2020/5/28
三菱UFJリース	第19回社債間限定同順位特約付	0.487	100,000	100,461 2017/5/29
三菱UFJリース	第30回社債間限定同順位特約付	0.426	100,000	101,458 2021/8/27
大和証券グループ本社	第17回社債間限定同順位特約付	0.398	100,000	100,799 2019/8/28
大和証券グループ本社	第22回社債間限定同順位特約付	0.397	100,000	100,795 2020/8/12
大和証券グループ本社	第23回社債間限定同順位特約付	0.909	100,000	103,373 2025/8/12
野村ホールディングス	第21回	1.86	100,000	106,733 2020/3/17
野村ホールディングス	第41回	0.783	200,000	202,992 2018/6/20
第1回財政融資マスタートラスト特定目的会社	第1回特定社債	1.83	100,000	103,040 2018/2/20
三井不動産	第34回社債間限定同順位特約付	2.085	100,000	105,847 2019/3/20
三菱地所	第56回担保提供制限等財務上特約無	2.42	100,000	113,838 2022/6/20
三菱地所	第98回担保提供制限等財務上特約無	1.165	100,000	104,334 2020/6/19
三菱地所	第110回担保提供制限等財務上特約無	0.571	100,000	101,682 2019/9/13
三菱地所	第111回担保提供制限等財務上特約無	0.929	100,000	104,718 2022/9/14
東京建物	第17回社債間限定同順位特約付	1.3	100,000	103,997 2020/3/18
住友不動産	第95回社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	103,467 2024/1/26
住友不動産	第97回社債間限定同順位特約付	0.904	200,000	205,524 2024/4/26
住友不動産	第100回社債間限定同順位特約付	0.809	100,000	101,982 2024/9/9
エヌ・ティ・ティ都市開発	第10回社債間限定同順位特約付	1.03	100,000	104,028 2020/9/18
日本ビルファンド投資法人	第13回特定投資法人債間限定同順位	1.168	100,000	105,639 2023/6/26
オリックス不動産投資法人	第5回特定投資法人債間限定同順位特	0.76	100,000	101,384 2018/2/8
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	第5回特定投資法人債	0.871	100,000	102,890 2024/8/30
東武鉄道	第102回社債間限定同順位特約付	1.36	200,000	216,776 2025/10/23
東京急行電鉄	第75回社債間限定同順位特約付	0.982	100,000	105,307 2022/6/7
東京急行電鉄	第82回社債間限定同順位特約付	1.307	100,000	109,692 2033/6/3
小田急電鉄	第68回社債間限定同順位特約付	1.098	200,000	215,830 2030/6/12
東日本旅客鉄道	第15回	2.65	100,000	111,212 2020/8/25
東日本旅客鉄道	第19回社債間限定同順位特約付	2.36	200,000	226,884 2022/2/25
東日本旅客鉄道	第58回社債間限定同順位特約付	1.58	200,000	208,946 2019/3/20
東日本旅客鉄道	第71回社債間限定同順位特約付	1.905	100,000	120,925 2030/9/27
東日本旅客鉄道	第107回社債間限定同順位特約付	1.415	100,000	113,159 2045/1/27
西日本旅客鉄道	第15回社債間限定同順位特約付	2.26	100,000	122,680 2027/12/20
西日本旅客鉄道	第31回社債間限定同順位特約付	1.408	100,000	106,414 2021/2/26
東海旅客鉄道	第16回社債間限定同順位特約付	1.875	100,000	106,217 2019/9/20
東海旅客鉄道	第51回社債間限定同順位特約付	2.212	200,000	249,552 2030/4/23
東海旅客鉄道	第70回社債間限定同順位特約付	1.309	100,000	112,194 2032/9/30
東海旅客鉄道	第74回社債間限定同順位特約付	1.685	100,000	120,055 2045/3/6
名古屋鉄道	第50回社債間限定同順位特約付	0.857	100,000	103,924 2027/4/30
三菱倉庫	第14回	0.442	100,000	101,601 2021/3/12
住友倉庫	第1回社債間限定同順位特約付	0.279	200,000	201,234 2019/3/14
日本電信電話	第60回	1.31	100,000	105,706 2020/12/18
KDDI	第20回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	104,548 2023/12/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
N T T ドコモ 第15回社債間限定同順位特約付	1.96	100,000	104,290	2018/6/20
電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	1.155	100,000	104,491	2020/9/18
電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	1.035	100,000	104,612	2021/7/20
電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	0.929	100,000	104,563	2024/2/20
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	0.889	100,000	104,293	2024/6/20
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	0.782	100,000	103,416	2024/8/20
東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	2.625	100,000	105,594	2018/6/11
東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	1.984	100,000	126,797	2043/12/17
大阪瓦斯 第9回社債間限定同順位特約付	2.9	100,000	105,149	2018/1/30
東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	2.06	100,000	111,656	2022/3/18
東京都競馬 第2回社債間限定同順位特約付	0.572	200,000	202,360	2018/7/11
ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付	0.491	100,000	101,987	2022/12/16
ノルデア・バンク 第6回円貨社債(2014)	0.288	100,000	100,108	2017/5/26
新韓銀行 第5回円貨社債(2014)	0.39	200,000	199,336	2017/11/13
クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債(2014)	0.865	100,000	102,281	2024/11/28
ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング 第2回円貨社債	0.345	200,000	200,708	2019/6/27
マラヤン・バンキング・ベルハッド 第2回円貨社債(2015)	0.509	200,000	193,356	2020/4/30
スタンダード・チャータード 第2回円貨社債(2015)	0.453	100,000	97,283	2020/6/5
スタンダード・チャータード 第3回円貨社債(2015)	1.043	100,000	91,853	2025/6/5
エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第12回	2.54	100,000	108,046	2021/2/16
パークレイズ・バンク・ビーエルシー 第7回円貨社債	0.478	100,000	99,963	2019/6/24
ナショナル・オーストラリア銀行 第11回円貨社債(2015)	0.284	200,000	200,656	2020/1/16
ラボバンク・ネダーランド 第16回円貨社債(2012)(コー	1.142	100,000	101,177	2017/5/25
ラボバンク・ネダーランド 第18回円貨社債(2012)(コー	0.778	100,000	101,014	2017/11/2
ラボバンク・ネダーランド 第25回円貨社債(2014)(コー	0.434	100,000	100,695	2019/5/22
ソシエテ ジェネラル 第6回円貨社債(2014)	0.552	200,000	202,162	2019/6/13
小 計		28,907,000	30,007,290	
合 計		587,551,203	652,739,697	

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2016年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	652,739,697	98.7
コール・ローン等、その他	8,642,073	1.3
投資信託財産総額	661,381,770	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 (2016年3月31日現在)

項目	当期末
(A) 資産	661,381,770,545 円
コール・ローン等	3,278,047,781
公社債(評価額)	652,739,697,217
未収入金	4,413,142,000
未収利息	933,136,963
前払費用	17,746,584
(B) 負債	5,207,549,499
未払金	4,860,451,000
未払解約金	347,098,499
(C) 純資産総額(A-B)	656,174,221,046
元本	499,328,368,105
次期繰越損益金	156,845,852,941
(D) 受益権総口数	499,328,368,105口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,141円

(注) 期首元本額409,123百万円、期中追加設定元本額151,219百万円、期中一部解約元本額61,014百万円、計算口数当たり純資産額13,141円。

## ○損益の状況 (2015年4月1日～2016年3月31日)

項目	当期
(A) 配当等収益	6,249,401,619
受取利息	6,249,401,619
(B) 有価証券売買損益	27,558,166,933
売買益	28,422,612,543
売買損	△ 864,445,610
(C) 当期損益金(A+B)	33,807,568,552
(D) 前期繰越損益金	100,910,475,855
(E) 追加信託差損益金	38,498,203,654
(F) 解約差損益金	△ 16,370,395,120
(G) 計(C+D+E+F)	156,845,852,941
次期繰越損益金(G)	156,845,852,941

\*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
	百万円
野村国内債券インデックスファンド	377
野村世界6資産分散投信(安定コース)	17,103
野村世界6資産分散投信(分配コース)	20,341
野村世界6資産分散投信(成長コース)	2,467
野村資産設計ファンド2015	576
野村資産設計ファンド2020	300
野村資産設計ファンド2025	218
野村資産設計ファンド2030	133
野村資産設計ファンド2035	68
野村資産設計ファンド2040	144
野村日本債券インデックスファンド	1,533
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	257,355
のむラップ・ファンド(保守型)	8,061
のむラップ・ファンド(普通型)	3,815
のむラップ・ファンド(積極型)	652
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	19,402
野村資産設計ファンド2045	10
野村円債投資インデックスファンド	2,165
野村インデックスファンド・国内債券	1,029
マイ・ロード	31,707
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	199
野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)	69
野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)	57

ファンド名	当期末
	元本額
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	百万円 5,160
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,213
野村資産設計ファンド2050	4
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）	1,088
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）	267
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）	12,002
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）	1,759
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）	50
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）	40
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）	7
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,122
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）	385
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）	2,100
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	930
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）	200
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）	390
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）	864
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,865
ノムラ日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	703
ノムラPOFs用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）	591
マイバランス30（確定拠出年金向け）	11,247
マイバランス50（確定拠出年金向け）	16,227
マイバランス70（確定拠出年金向け）	7,198
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合（確定拠出年金向け）	40,965
マイバランスDC30	6,155
マイバランスDC50	3,888
マイバランスDC70	1,171
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	7,890
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	36
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	0
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	0

\*単位未満は切り捨て。

## ○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15期（決算日2016年5月10日）

作成対象期間（2015年5月12日～2016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	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）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		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	円	騰落率		騰落率			
11期(2012年5月10日)	14,713	2.4	148.79	1.8	98.2	—	278,390
12期(2013年5月10日)	19,680	33.8	196.85	32.3	98.1	—	309,517
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

\*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 (=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)) 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。  
 \*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) は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス (為替ヘッジを行わない円ベースの指数) です。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) は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。  
 (出所) Citigroup Index LLC

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

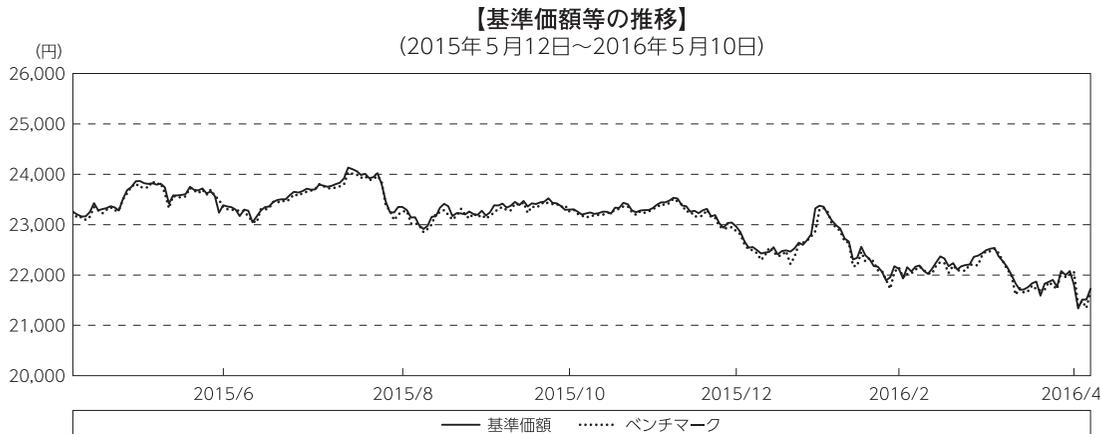
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率		騰落率		
(期首) 2015年5月11日	23,251	—	236.29	—	98.9	—
5月末	23,746	2.1	241.38	2.2	99.0	—
6月末	23,385	0.6	237.28	0.4	98.9	—
7月末	23,699	1.9	240.84	1.9	98.9	—
8月末	23,351	0.4	236.40	0.0	98.9	—
9月末	23,275	0.1	235.74	△0.2	98.8	—
10月末	23,300	0.2	236.47	0.1	98.9	—
11月末	23,289	0.2	236.36	0.0	99.1	—
12月末	22,960	△1.3	232.42	△1.6	98.9	—
2016年1月末	23,322	0.3	232.41	△1.6	98.5	—
2月末	22,124	△4.8	225.09	△4.7	99.0	—
3月末	22,522	△3.1	228.36	△3.4	99.0	—
4月末	21,808	△6.2	224.19	△5.1	98.9	—
(期末) 2016年5月10日	21,725	△6.6	220.26	△6.8	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、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）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23,251円から期末21,725円へと下落し、値下がり額は1,526円となりました。

外国債券利回りが長期債を中心に低下（価格は上昇）したことはプラスに寄与しましたが、ECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和や米国の利上げペースの鈍化観測などを背景に主要通貨が対円で下落（円高）したことがマイナスに影響したため、基準価額は下落しました。

### ○投資環境

当運用期間では、米国の政策金利引上げに伴い米国の短期債券利回りは上昇（価格は下落）しましたが、商品価格下落に伴う低インフレの長期化観測やECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和、米国の利上げペースが緩やかなものにとどまるとの観測などを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。

為替市場は、ECBによる追加金融緩和や米国の利上げペースの鈍化観測などを背景に、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

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）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

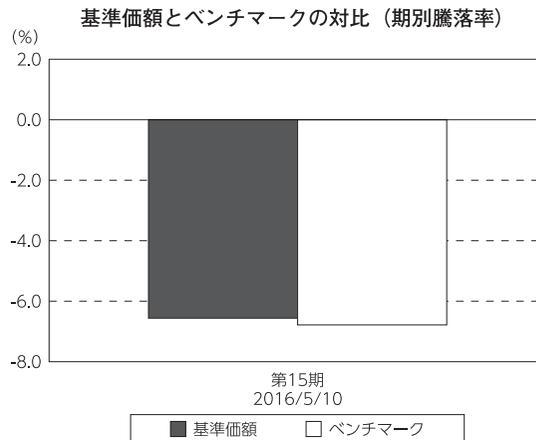
今期の基準価額の騰落率は-6.6%となり、ベンチマークの-6.8%を0.2ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### （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、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）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、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）の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

(2015年5月12日～2016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、23,065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

(2015年5月12日～2016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 1,164,271	千米ドル 549,584
	カナダ	国債証券	千カナダドル 72,837	千カナダドル 42,081
	イギリス	国債証券	千英ポンド 110,916	千英ポンド 39,649
	スイス	国債証券	千スイスフラン 4,001	千スイスフラン -
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 81,361	千スウェーデンクローナ 23,206
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 49,712	千ノルウェークローネ 732
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 79,204	千デンマーククローネ 26,206
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	102,024	14,451
	イタリア	国債証券	266,332	128,788
フランス	国債証券	135,861	36,498	

		買付額		売付額	
外	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	オランダ	国債証券	24,619		7,810
	スペイン	国債証券	169,524		74,703
	ベルギー	国債証券	35,540		3,974
	オーストリア	国債証券	18,442		5,988
	フィンランド	国債証券	2,391		—
	アイルランド	国債証券	7,426		—
	ポーランド	国債証券	千ズロチ 60,022		千ズロチ 20,105
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 11,142		千シンガポールドル 5,113
	国	マレーシア	国債証券	千リンギ 42,868	
オーストラリア		国債証券	千豪ドル 61,091		千豪ドル 18,091
メキシコ		国債証券	千メキシコペソ 395,496		千メキシコペソ 118,842
南アフリカ		国債証券	千ランド 128,597		千ランド 7,431

\*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

(2015年5月12日～2016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 283,335	百万円 7,530	% 2.7	百万円 115,284	百万円 1,324	% 1.1
為替直物取引	195,271	19,369	9.9	44,170	2,035	4.6
預金	20,359	20,359	100.0	20,359	20,359	100.0

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。

(2016年5月10日現在)

## ○組入資産の明細

## 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	2,264,900	2,457,940	266,588,179	42.1	—	18.5	15.3	8.3
カナダ	千カナダドル 135,080	千カナダドル 155,553	13,002,750	2.1	—	1.1	0.6	0.4
イギリス	千英ポンド 260,000	千英ポンド 318,585	49,782,224	7.9	—	5.8	1.9	0.2
スイス	千スイスフラン 12,700	千スイスフラン 15,811	1,766,102	0.3	—	0.1	0.2	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 197,900	千スウェーデンクローナ 236,699	3,143,364	0.5	—	0.3	0.2	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 132,000	千ノルウェークローネ 146,577	1,933,359	0.3	—	0.2	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 194,400	千デンマーククローネ 258,674	4,293,992	0.7	—	0.6	0.1	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	209,750	290,409	35,862,618	5.7	—	4.9	0.7	—
イタリア	468,000	576,919	71,243,836	11.3	—	6.2	3.6	1.4
フランス	356,800	467,118	57,684,422	9.1	—	6.4	2.4	0.3
オランダ	89,600	113,391	14,002,739	2.2	—	1.5	0.5	0.2
スペイン	298,700	357,246	44,116,372	7.0	—	3.1	2.7	1.2
ベルギー	96,900	128,719	15,895,550	2.5	—	2.0	0.4	0.1
オーストリア	56,400	72,337	8,932,926	1.4	—	1.0	0.3	0.1
フィンランド	22,200	26,026	3,214,047	0.5	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	42,600	50,566	6,244,400	1.0	—	0.3	0.5	0.2
ポーランド	千ズロチ 120,500	千ズロチ 131,685	3,668,764	0.6	—	0.2	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 26,480	千シンガポールドル 28,258	2,234,693	0.4	—	0.2	0.1	—
マレーシア	千リンギ 107,000	千リンギ 108,117	2,895,398	0.5	—	0.3	0.1	0.1
オーストラリア	千豪ドル 127,400	千豪ドル 142,035	11,249,226	1.8	—	1.1	0.4	0.2
メキシコ	千メキシコペソ 887,300	千メキシコペソ 990,729	5,904,747	0.9	—	0.6	0.3	0.1
南アフリカ	千ランド 420,500	千ランド 377,269	2,701,252	0.4	—	0.3	0.1	0.0
合 計	—	—	626,360,972	99.0	—	55.2	30.8	13.0

\* 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			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 BOND	8.875	10,500	12,829	1,391,507	2019/2/15
	US TREASURY BOND	8.125	19,300	23,778	2,578,983	2019/8/15
	US TREASURY BOND	8.75	12,700	16,743	1,815,963	2020/8/15
	US TREASURY BOND	8.0	18,500	25,119	2,724,464	2021/11/15
	US TREASURY BOND	6.25	19,400	25,744	2,792,238	2023/8/15
	US TREASURY BOND	2.375	31,200	32,955	3,574,299	2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	42,000	58,189	6,311,253	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.5	13,800	20,045	2,174,143	2026/11/15
	US TREASURY BOND	6.125	17,700	25,532	2,769,227	2027/11/15
	US TREASURY BOND	5.5	12,000	16,697	1,811,044	2028/8/15
	US TREASURY BOND	5.25	5,000	6,850	742,951	2028/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	2,800	3,850	417,571	2029/2/15
	US TREASURY BOND	4.375	2,200	2,984	323,710	2038/2/15
	US TREASURY BOND	2.875	22,300	23,599	2,559,620	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	16,600	20,674	2,242,386	2043/11/15
	US TREASURY N/B	0.875	7,200	7,223	783,443	2017/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	24,600	25,160	2,728,878	2017/5/31
	US TREASURY N/B	0.625	8,500	8,504	922,378	2017/5/31
	US TREASURY N/B	0.875	5,000	5,016	544,058	2017/6/15
	US TREASURY N/B	2.5	9,000	9,193	997,149	2017/6/30
	US TREASURY N/B	0.75	8,000	8,014	869,205	2017/6/30
	US TREASURY N/B	0.875	16,900	16,954	1,838,845	2017/7/15
	US TREASURY N/B	2.375	28,200	28,801	3,123,805	2017/7/31
	US TREASURY N/B	0.5	3,400	3,395	368,288	2017/7/31
	US TREASURY N/B	4.75	29,800	31,354	3,400,657	2017/8/15
	US TREASURY N/B	1.875	21,900	22,251	2,413,408	2017/8/31
	US TREASURY N/B	0.625	10,000	9,997	1,084,303	2017/8/31
	US TREASURY N/B	1.875	34,500	35,080	3,804,867	2017/9/30
	US TREASURY N/B	0.625	8,000	7,997	867,374	2017/9/30
	US TREASURY N/B	0.875	1,000	1,003	108,794	2017/10/15
	US TREASURY N/B	1.875	18,500	18,827	2,042,015	2017/10/31
	US TREASURY N/B	4.25	49,600	52,291	5,671,502	2017/11/15
	US TREASURY N/B	2.25	18,600	19,052	2,066,450	2017/11/30
	US TREASURY N/B	2.75	17,000	17,574	1,906,120	2017/12/31
	US TREASURY N/B	0.75	6,000	6,005	651,395	2017/12/31
	US TREASURY N/B	2.625	16,900	17,463	1,894,049	2018/1/31
	US TREASURY N/B	0.875	4,000	4,012	435,229	2018/1/31
	US TREASURY N/B	3.5	41,000	43,006	4,664,512	2018/2/15
	US TREASURY N/B	2.75	7,100	7,361	798,432	2018/2/28
	US TREASURY N/B	0.75	2,000	2,001	217,114	2018/3/31
	US TREASURY N/B	0.75	34,000	34,022	3,690,088	2018/4/15
	US TREASURY N/B	2.625	8,000	8,303	900,590	2018/4/30
	US TREASURY N/B	0.625	1,200	1,197	129,928	2018/4/30
	US TREASURY N/B	3.875	11,300	12,026	1,304,447	2018/5/15
	US TREASURY N/B	2.375	5,000	5,169	560,687	2018/5/31

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	US TREASURY N/B	1.0	13,500	13,574	1,472,331	2018/5/31
	US TREASURY N/B	2.375	29,300	30,323	3,288,855	2018/6/30
	US TREASURY N/B	1.375	8,500	8,616	934,550	2018/6/30
	US TREASURY N/B	2.25	8,600	8,885	963,689	2018/7/31
	US TREASURY N/B	1.375	3,400	3,446	373,834	2018/7/31
	US TREASURY N/B	4.0	4,800	5,161	559,856	2018/8/15
	US TREASURY N/B	1.5	20,600	20,954	2,272,677	2018/8/31
	US TREASURY N/B	1.375	25,500	25,862	2,805,055	2018/9/30
	US TREASURY N/B	1.75	7,000	7,166	777,281	2018/10/31
	US TREASURY N/B	3.75	30,600	32,879	3,566,106	2018/11/15
	US TREASURY N/B	1.25	5,000	5,056	548,400	2018/11/30
	US TREASURY N/B	1.375	6,500	6,596	715,427	2018/12/31
	US TREASURY N/B	1.5	5,500	5,598	607,248	2018/12/31
	US TREASURY N/B	1.25	5,100	5,158	559,498	2019/1/31
	US TREASURY N/B	1.5	2,000	2,036	220,851	2019/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	27,500	28,964	3,141,452	2019/2/15
	US TREASURY N/B	1.375	4,500	4,567	495,410	2019/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	4,000	4,074	441,872	2019/2/28
	US TREASURY N/B	1.5	4,000	4,075	442,025	2019/3/31
	US TREASURY N/B	1.625	25,500	26,065	2,827,094	2019/3/31
	US TREASURY N/B	1.625	5,600	5,725	620,947	2019/4/30
	US TREASURY N/B	3.125	26,400	28,177	3,056,172	2019/5/15
	US TREASURY N/B	1.5	10,600	10,799	1,171,277	2019/5/31
	US TREASURY N/B	1.0	2,000	2,006	217,665	2019/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	7,900	8,080	876,447	2019/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	14,500	14,830	1,608,546	2019/7/31
	US TREASURY N/B	3.625	37,000	40,237	4,364,159	2019/8/15
	US TREASURY N/B	1.0	3,000	3,007	326,142	2019/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	8,800	9,000	976,184	2019/8/31
	US TREASURY N/B	1.0	3,000	3,005	326,015	2019/9/30
	US TREASURY N/B	1.75	8,700	8,932	968,813	2019/9/30
	US TREASURY N/B	3.375	49,300	53,382	5,789,882	2019/11/15
	US TREASURY N/B	1.0	8,800	8,810	955,566	2019/11/30
	US TREASURY N/B	1.5	1,800	1,832	198,797	2019/11/30
	US TREASURY N/B	1.125	12,000	12,055	1,307,569	2019/12/31
	US TREASURY N/B	1.625	3,800	3,885	421,453	2019/12/31
	US TREASURY N/B	1.375	2,000	2,026	219,758	2020/1/31
	US TREASURY N/B	3.625	51,800	56,810	6,161,615	2020/2/15
	US TREASURY N/B	1.25	2,700	2,722	295,301	2020/2/29
	US TREASURY N/B	1.125	4,000	4,013	435,331	2020/3/31
	US TREASURY N/B	1.375	20,500	20,757	2,251,396	2020/3/31
	US TREASURY N/B	3.5	46,600	51,023	5,533,993	2020/5/15
	US TREASURY N/B	1.875	14,500	14,959	1,622,553	2020/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	10,000	10,212	1,107,647	2020/6/30
	US TREASURY N/B	2.0	11,000	11,402	1,236,681	2020/7/31
	US TREASURY N/B	2.625	42,500	45,162	4,898,366	2020/8/15
	US TREASURY N/B	2.125	7,000	7,292	790,952	2020/8/31

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	US TREASURY N/B	2.0	6,000	6,222	674,909	2020/9/30
	US TREASURY N/B	1.75	1,600	1,641	178,009	2020/10/31
	US TREASURY N/B	2.625	50,100	53,313	5,782,376	2020/11/15
	US TREASURY N/B	2.375	6,800	7,167	777,400	2020/12/31
	US TREASURY N/B	2.125	5,300	5,527	599,538	2021/1/31
	US TREASURY N/B	3.625	44,200	49,169	5,332,874	2021/2/15
	US TREASURY N/B	2.0	5,000	5,185	562,466	2021/2/28
	US TREASURY N/B	2.25	1,800	1,889	204,882	2021/3/31
	US TREASURY N/B	2.25	2,900	3,043	330,137	2021/4/30
	US TREASURY N/B	3.125	36,400	39,755	4,311,895	2021/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	14,000	14,528	1,575,737	2021/5/31
	US TREASURY N/B	2.125	8,700	9,081	985,031	2021/6/30
	US TREASURY N/B	2.25	9,700	10,185	1,104,665	2021/7/31
	US TREASURY N/B	2.125	26,800	27,968	3,033,443	2021/8/15
	US TREASURY N/B	2.0	7,300	7,570	821,046	2021/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	16,000	16,695	1,810,739	2021/9/30
	US TREASURY N/B	2.0	11,000	11,402	1,236,681	2021/11/15
	US TREASURY N/B	1.875	8,000	8,240	893,812	2021/11/30
	US TREASURY N/B	2.125	12,400	12,931	1,402,587	2021/12/31
	US TREASURY N/B	1.5	5,000	5,040	546,663	2022/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	33,700	34,937	3,789,312	2022/2/15
	US TREASURY N/B	1.75	7,300	7,456	808,706	2022/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	5,900	6,022	653,162	2022/3/31
	US TREASURY N/B	1.75	5,000	5,102	553,400	2022/4/30
	US TREASURY N/B	1.75	11,900	12,141	1,316,890	2022/5/15
	US TREASURY N/B	1.875	9,700	9,967	1,081,075	2022/5/31
	US TREASURY N/B	2.125	27,000	28,122	3,050,132	2022/6/30
	US TREASURY N/B	1.625	18,500	18,732	2,031,748	2022/8/15
	US TREASURY N/B	1.625	12,800	12,929	1,402,333	2022/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	13,000	13,528	1,467,260	2022/12/31
	US TREASURY N/B	1.75	15,000	15,241	1,653,082	2023/1/31
	US TREASURY N/B	2.0	17,000	17,563	1,904,896	2023/2/15
	US TREASURY N/B	1.75	40,600	41,247	4,473,656	2023/5/15
	US TREASURY N/B	2.5	16,300	17,396	1,886,816	2023/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	16,800	18,233	1,977,578	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	27,300	29,637	3,214,490	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	30,400	32,430	3,517,425	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	24,300	25,412	2,756,237	2024/11/15
	US TREASURY N/B	6.25	2,600	3,967	430,308	2030/5/15
	US TREASURY N/B	5.375	300	429	46,631	2031/2/15
	US TREASURY N/B	4.5	2,000	2,755	298,807	2036/2/15
	US TREASURY N/B	5.0	1,000	1,467	159,181	2037/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	500	689	74,799	2038/5/15
	US TREASURY N/B	3.5	1,500	1,792	194,414	2039/2/15
	US TREASURY N/B	4.25	5,000	6,642	720,411	2039/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	5,500	7,565	820,508	2039/8/15
	US TREASURY N/B	4.375	7,700	10,404	1,128,420	2039/11/15

銘柄	当期末					
	利率	額面金額	評価額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY N/B	4.625	8,000	11,187	1,213,430	2040/2/15
	US TREASURY N/B	4.375	8,000	10,811	1,172,655	2040/5/15
	US TREASURY N/B	3.875	8,000	10,071	1,092,327	2040/8/15
	US TREASURY N/B	4.25	7,800	10,369	1,124,635	2040/11/15
	US TREASURY N/B	4.75	7,000	9,980	1,082,481	2041/2/15
	US TREASURY N/B	4.375	7,000	9,480	1,028,209	2041/5/15
	US TREASURY N/B	3.125	6,500	7,255	786,889	2041/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	3,200	3,569	387,175	2042/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	4,500	4,899	531,348	2042/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	9,300	9,650	1,046,739	2042/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	9,600	9,944	1,078,553	2042/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	18,200	20,231	2,194,347	2043/2/15
	US TREASURY N/B	3.625	15,700	19,120	2,073,850	2043/8/15
	US TREASURY N/B	3.625	23,200	28,195	3,058,056	2044/2/15
	US TREASURY N/B	3.375	15,900	18,460	2,002,187	2044/5/15
	US TREASURY N/B	3.125	18,600	20,611	2,235,482	2044/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	33,500	36,216	3,928,056	2044/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	13,200	12,880	1,396,998	2045/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	14,700	15,878	1,722,159	2045/5/15
	US TREASURY N/B	3.0	5,000	5,398	585,556	2045/11/15
	US TREASURY NOTE	2.875	31,000	32,272	3,500,296	2018/3/31
小計					266,588,179	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.75	4,600	5,109	427,133	2022/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.25	5,400	5,447	455,349	2017/8/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	13,800	13,974	1,168,122	2017/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.25	9,700	9,819	820,820	2018/2/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.25	3,200	3,242	271,005	2018/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	4.25	3,700	3,981	332,841	2018/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.25	7,500	7,625	637,451	2018/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	3,800	3,930	328,514	2019/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	3.75	7,100	7,784	650,719	2019/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	4,000	4,155	347,349	2019/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	3,600	3,721	311,041	2020/3/1
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5	7,500	8,361	698,946	2020/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,500	2,511	209,959	2020/9/1
	CANADIAN GOVERNMENT	3.25	9,200	10,356	865,671	2021/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	3,900	4,034	337,244	2023/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.5	5,700	6,306	527,120	2024/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.25	7,200	7,834	654,870	2025/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	8.0	2,200	3,678	307,492	2027/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	5,180	7,694	643,155	2029/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.75	3,000	4,710	393,774	2033/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	5.0	7,000	10,671	891,989	2037/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	4.0	6,400	8,940	747,340	2041/6/1
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5	7,100	9,533	796,907	2045/12/1

銘柄	当期末						
	利率	額面金額	評価額		償還年月日		
			外貨建金額	邦貨換算金額			
カナダ		%	千カナダドル	千カナダドル	千円		
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	2,128	177,930	2048/12/1
小	計					13,002,750	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド			
	国債証券	UK TREASURY	1.0	2,100	2,117	330,836	2017/9/7
		UK TREASURY	5.0	5,700	6,193	967,725	2018/3/7
		UK TREASURY	1.25	23,400	23,839	3,725,225	2018/7/22
		UK TREASURY	4.5	4,000	4,462	697,357	2019/3/7
		UK TREASURY	1.75	14,200	14,736	2,302,766	2019/7/22
		UK TREASURY	3.75	3,000	3,323	519,314	2019/9/7
		UK TREASURY	4.75	5,800	6,714	1,049,142	2020/3/7
		UK TREASURY	2.0	13,500	14,212	2,220,892	2020/7/22
		UK TREASURY	3.75	7,200	8,151	1,273,806	2020/9/7
		UK TREASURY	8.0	5,300	7,200	1,125,079	2021/6/7
		UK TREASURY	3.75	8,900	10,250	1,601,685	2021/9/7
		UK TREASURY	4.0	4,650	5,480	856,381	2022/3/7
		UK TREASURY	1.75	8,300	8,678	1,356,099	2022/9/7
		UK TREASURY	2.25	7,200	7,745	1,210,239	2023/9/7
		UK TREASURY	2.75	8,600	9,575	1,496,227	2024/9/7
		UK TREASURY	5.0	12,800	16,741	2,615,967	2025/3/7
		UK TREASURY	4.25	8,300	10,626	1,660,495	2027/12/7
		UK TREASURY	6.0	3,750	5,625	878,962	2028/12/7
		UK TREASURY	4.75	6,700	9,166	1,432,321	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	7,250	9,522	1,488,044	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	6,700	9,162	1,431,797	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	6,900	9,236	1,443,270	2036/3/7
		UK TREASURY	4.75	4,900	7,114	1,111,682	2038/12/7
		UK TREASURY	4.25	4,200	5,743	897,479	2039/9/7
		UK TREASURY	4.25	5,700	7,875	1,230,566	2040/12/7
		UK TREASURY	4.5	6,100	8,848	1,382,691	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	14,300	17,956	2,805,884	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	5,950	8,573	1,339,672	2046/12/7
		UK TREASURY	4.25	4,250	6,319	987,457	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	7,250	10,134	1,583,659	2052/7/22
		UK TREASURY	3.5	5,000	7,185	1,122,806	2068/7/22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	21,700	26,005	4,063,585	2044/1/22
		UNITED KINGDOM(GOVEMEN	4.25	6,400	10,067	1,573,100	2055/12/7
小	計					49,782,224	
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	9,100	10,377	1,159,182	2021/4/28
		SWITZERLAND GOVERNMENT	4.0	3,600	5,433	606,919	2028/4/8
小	計					1,766,102	
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	3.75	7,000	7,384	98,071	2017/8/12
		SWEDISH GOVERNMENT	4.25	16,200	18,373	244,001	2019/3/12
		SWEDISH GOVERNMENT	5.0	49,400	61,241	813,282	2020/12/1
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	50,900	61,118	811,649	2022/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	17,900	19,407	257,734	2023/11/13

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	
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	千円	
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	2.5	40,200	47,202	626,853	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	16,300	21,970	291,771	2039/3/30
小 計						3,143,364	
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	4.25	21,900	22,728	299,787	2017/5/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	4.5	24,100	26,949	355,458	2019/5/22
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.75	27,600	31,505	415,556	2021/5/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	14,300	15,200	200,490	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	44,100	50,194	662,067	2024/3/14
小 計						1,933,359	
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	25,100	28,952	480,617	2019/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	52,100	61,134	1,014,826	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	35,800	39,516	655,966	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	7.0	14,500	22,976	381,413	2024/11/10
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	18,600	20,913	347,169	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	48,300	85,180	1,413,999	2039/11/15
小 計						4,293,992	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESobligation	0.25	1,700	1,744	215,380	2019/10/11
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5	5,150	5,805	716,932	2019/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	8,700	9,900	1,222,571	2020/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	7,000	8,013	989,642	2020/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	3,100	3,466	428,106	2020/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	7,300	8,300	1,025,069	2021/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	7,000	8,319	1,027,375	2021/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	3,500	3,991	492,876	2021/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	20,000	22,672	2,799,765	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	9,600	10,824	1,336,774	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,000	5,574	688,333	2022/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,820	718,788	2023/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	4,200	4,713	582,089	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	5,400	6,275	774,941	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	14,100	21,087	2,604,152	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	5,700	6,543	808,069	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,500	1,695	209,361	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	5,700	6,209	766,821	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	26,900	45,814	5,657,661	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	6,000	9,755	1,204,731	2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	3,400	5,244	647,601	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	3,500	6,291	776,949	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	5,300	9,142	1,128,974	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	6,600	11,391	1,406,676	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	9,400	15,490	1,912,956	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	5,400	9,477	1,170,370	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	5,200	9,823	1,213,087	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	5,500	8,723	1,077,301	2042/7/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ユーロ							
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	4,700	6,715	829,341	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	8,000	11,579	1,429,915	2046/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	10,300	10,973	1,355,119	2017/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	18,900	19,894	2,456,820	2017/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.75	10,500	10,644	1,314,512	2018/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	26,900	29,009	3,582,382	2018/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	9,900	10,623	1,311,947	2018/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	23,800	26,184	3,233,556	2018/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	8,000	8,716	1,076,338	2018/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	17,000	18,958	2,341,172	2019/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	3,800	4,276	528,107	2019/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	14,100	15,115	1,866,576	2019/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	500	522	64,505	2019/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	25,900	29,417	3,632,732	2019/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	10,300	11,950	1,475,712	2020/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	21,800	25,155	3,106,393	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	12,600	14,592	1,801,973	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	11,000	12,741	1,573,425	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	7,000	8,124	1,003,343	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	7,800	9,100	1,123,791	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	10,400	12,692	1,567,354	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	20,924	2,583,954	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	9,600	12,378	1,528,588	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	17,100	22,105	2,729,767	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	4,600	5,702	704,165	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	7,200	9,087	1,122,168	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	10,700	16,769	2,070,808	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	11,700	14,599	1,802,862	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	2,300	2,744	338,901	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	14,900	19,370	2,392,056	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	8,500	10,817	1,335,803	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	8,600	13,274	1,639,324	2026/11/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	18,200	27,139	3,351,498	2027/11/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	7,300	9,644	1,190,941	2028/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	12,100	16,897	2,086,690	2029/11/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	14,700	22,214	2,743,285	2031/5/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	6,400	9,625	1,188,665	2033/2/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,400	11,855	1,464,067	2034/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	5,700	7,191	888,031	2037/2/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,000	11,508	1,421,122	2039/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	14,600	20,972	2,589,943	2040/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	7,000	9,927	1,225,934	2044/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	3,100	3,477	429,484	2046/9/1		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0	8,000	8,341	1,030,093	2019/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	8,500	8,756	1,081,364	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	3,500	4,253	525,227	2030/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	9,700	10,373	1,280,993	2017/10/25

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	6,000	6,525	805,892	2018/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	4,500	4,632	572,089	2018/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	10,800	12,050	1,488,157	2018/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	6,600	6,839	844,606	2018/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	11,500	13,096	1,617,235	2019/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	4,000	5,231	646,050	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	10,800	12,349	1,525,070	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	14,800	17,049	2,105,400	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.5	17,300	19,442	2,400,967	2020/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	11,800	14,128	1,744,756	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	15,100	17,919	2,212,931	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.0	14,800	17,545	2,166,681	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	17,600	20,207	2,495,449	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	8,200	13,066	1,613,627	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	28,500	37,369	4,614,722	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	8,000	9,007	1,112,304	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	19,800	30,253	3,736,018	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	20,500	26,600	3,284,932	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	7,200	8,875	1,096,028	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	23,100	36,530	4,511,131	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	16,600	28,664	3,539,826	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	8,500	13,768	1,700,234	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	9,800	14,978	1,849,733	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	11,400	19,040	2,351,348	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	10,400	14,791	1,826,592	2045/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	4,700	7,911	977,034	2055/4/25
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	3,800	6,496	802,256	2060/4/25		
FRENCH TREASURY NOTE	1.0	1,000	1,017	125,663	2017/7/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.5	4,000	4,236	523,183	2017/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.25	4,500	4,632	572,083	2018/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	6,500	7,140	881,812	2018/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.25	2,500	2,616	323,165	2019/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	7,100	8,112	1,001,807	2019/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	2,000	2,051	253,350	2020/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	5,800	6,752	833,884	2020/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	5,900	6,989	863,072	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	1,500	1,724	212,983	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	5,900	7,430	917,645	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	4,300	6,493	801,926	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	1,400	1,579	194,998	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	13,500	15,580	1,924,017	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	6,300	9,948	1,228,597	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	3,700	4,752	586,856	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	5,000	8,079	997,725	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	5,200	8,648	1,068,048	2042/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	4,500	6,620	817,582	2047/1/15		
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	28,700	28,941	3,573,933	2017/10/31

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.5	20,700	22,335	2,758,175	2018/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	1,300	1,307	161,484	2018/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.1	17,100	18,682	2,307,155	2018/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.75	17,100	18,706	2,310,075	2018/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	13,800	14,903	1,840,375	2019/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6	9,100	10,411	1,285,718	2019/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3	23,800	27,201	3,359,053	2019/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	19,900	22,808	2,816,602	2020/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	11,600	13,880	1,714,131	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	7,500	9,348	1,154,417	2021/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	9,200	11,903	1,470,001	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	14,600	18,897	2,333,664	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	4,700	5,813	717,906	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	7,100	9,006	1,112,194	2024/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	8,300	9,897	1,222,273	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	13,700	17,427	2,152,138	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	18,400	25,753	3,180,284	2026/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	4,800	6,523	805,609	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	4,900	6,852	846,216	2040/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	4,400	6,015	742,839	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	4,900	7,199	889,121	2044/10/31
SPANISH GOVERNMENT	5.5	10,400	11,114	1,372,507	2017/7/30		
SPANISH GOVERNMENT	6.0	9,800	14,312	1,767,403	2029/1/31		
SPANISH GOVERNMENT	5.75	7,300	10,877	1,343,290	2032/7/30		
SPANISH GOVERNMENT	4.2	5,600	7,124	879,796	2037/1/31		
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.5	1,700	1,777	219,450	2017/6/28
		BELGIUM KINGDOM	1.25	4,000	4,150	512,488	2018/6/22
		BELGIUM KINGDOM	3.0	3,100	3,455	426,690	2019/9/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	7,000	8,255	1,019,513	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	7,200	8,925	1,102,163	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	5,000	6,222	768,428	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	8,167	1,008,547	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	5,000	5,781	713,930	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	7,300	8,687	1,072,757	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	6,400	8,918	1,101,358	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	5,030	621,261	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,800	10,920	1,348,629	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	3,700	5,671	700,401	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	2,000	2,165	267,405	2017/9/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	4.0	2,500	2,711	334,812	2018/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	4.0	5,200	5,867	724,599	2019/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	10,600	16,324	2,015,850	2028/3/28
BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	9,500	15,687	1,937,260	2035/3/28		
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.3	1,500	1,597	197,219	2017/9/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.65	3,000	3,260	402,623	2018/1/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.15	2,300	2,390	295,160	2018/10/19
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.35	2,500	2,839	350,649	2019/3/15

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	
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.95	1,700	1,824	225,363	2019/6/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	2,400	2,452	302,896	2019/10/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	4,600	5,422	669,622	2020/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	4,400	5,281	652,244	2021/9/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,300	4,046	499,738	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	5,000	6,147	759,093	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	2,300	2,598	320,939	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	3,000	3,369	416,074	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,729	954,456	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	4,600	7,503	926,611	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	5,900	9,304	1,148,961	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	4,500	6,569	811,270	2044/6/20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	3.875	2,000	2,118	261,649	2017/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	1,500	1,556	192,161	2018/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.375	1,300	1,498	184,997	2019/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	3.375	2,000	2,293	283,162	2020/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	3.5	2,000	2,370	292,786	2021/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	3,200	3,545	437,891	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	2,200	2,429	299,975	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	2,400	3,210	396,521	2025/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,500	4,387	541,777	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	700	695	85,869	2031/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	1,400	1,921	237,253	2042/7/4
		アイルランド	国債証券	IRELAND (REPUBLIC OF)	4.4	3,600	4,120
IRISH GOVERNMENT	5.5			7,500	8,136	1,004,809	2017/10/18
IRISH GOVERNMENT	4.5			5,600	6,260	773,091	2018/10/18
IRISH GOVERNMENT	5.9			3,400	4,109	507,507	2019/10/18
IRISH GOVERNMENT	4.5			5,300	6,258	772,849	2020/4/18
IRISH GOVERNMENT	5.0			3,500	4,278	528,402	2020/10/18
IRISH GOVERNMENT	5.4			6,000	8,360	1,032,482	2025/3/13
IRISH TSY 2% 2045	2.0			1,500	1,556	192,230	2045/2/18
IRISH TSY 2.4% 2030	2.4			1,500	1,713	211,564	2030/5/15
IRISH TSY 3.4% 2024	3.4			1,300	1,574	194,494	2024/3/18
REPUBLIC OF IRELAND	3.9			3,400	4,196	518,183	2023/3/20
小 計							257,196,914
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	7,500	7,906	220,272	2017/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.75	8,100	8,428	234,805	2018/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	9,500	9,666	269,301	2018/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	5,800	6,067	169,039	2019/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	11,100	12,420	346,046	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	5,200	5,111	142,411	2020/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	29,900	33,906	944,637	2020/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	4,000	4,696	130,830	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	9,400	11,209	312,296	2022/9/23
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	9,600	10,438	290,818	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	16,700	17,166	478,267	2025/7/25

銘柄	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	3,700	4,667	130,037	2029/4/25
小	計					3,668,764	
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	4.0	1,600	1,707	135,043	2018/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.5	4,100	4,260	336,937	2019/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	4,000	4,304	340,360	2020/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	2,580	2,660	210,400	2021/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	1,200	1,294	102,392	2022/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	2,400	2,532	200,230	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	1,500	1,613	127,575	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	3,300	3,724	294,497	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	2,400	2,548	201,504	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	500	565	44,722	2033/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	2,900	3,047	241,027	2042/4/1
小	計					2,234,693	
マレーシア			千リンギ	千リンギ			
	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.012	4,000	4,056	108,630	2017/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.24	8,200	8,363	223,985	2018/2/7
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.26	3,700	3,712	99,413	2018/3/1
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.58	3,000	3,018	80,834	2018/9/28
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	11,900	12,263	328,406	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.492	10,000	9,996	267,714	2020/3/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.889	2,400	2,436	65,261	2020/7/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	6,000	6,144	164,541	2021/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	8,700	8,856	237,178	2021/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	4,600	4,506	120,683	2022/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	7,800	7,683	205,764	2023/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	5,800	5,907	158,192	2024/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	8,800	9,082	243,241	2026/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	4,000	3,765	100,849	2027/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	1,800	1,722	46,116	2028/6/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	5.248	2,700	2,959	79,254	2028/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	2,500	2,563	68,657	2030/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	4,400	4,417	118,301	2031/6/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	4,700	4,620	123,740	2032/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	400	378	10,129	2033/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.935	1,600	1,661	44,500	2043/9/30
小	計					2,895,398	
オーストラリア			千豪ドル	千豪ドル			
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	5,000	5,154	408,224	2017/7/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	9,400	10,014	793,122	2018/1/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	4,700	4,888	387,181	2018/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.25	11,400	12,566	995,274	2019/3/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	2,900	3,012	238,560	2019/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	13,100	14,527	1,150,593	2020/4/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	900	901	71,359	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	9,400	11,177	885,274	2021/5/15

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	
オーストラリア			%	千豪ドル	千豪ドル	千円	
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	7,900	9,639	763,423	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	7,300	8,918	706,349	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	8,200	8,529	675,547	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	16,000	17,269	1,367,709	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	9,500	10,720	849,083	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	4,800	5,892	466,675	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	6,100	6,569	520,339	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	3,600	4,449	352,368	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	1,753	138,838	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	5,400	6,051	479,300	2037/4/21
小	計					11,249,226	
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	5.0	6,400	6,467	38,548	2017/6/15
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	60,800	64,276	383,090	2017/12/14
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4.75	108,800	109,372	651,857	2018/6/14
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	94,500	103,307	615,712	2018/12/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	29,000	28,955	172,575	2019/12/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	60,700	67,014	399,408	2020/6/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	85,600	89,956	536,141	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	27,400	28,748	171,339	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	30,700	39,482	235,316	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	71,600	80,001	476,807	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	47,100	56,799	338,523	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	41,000	46,552	277,455	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	11,373	67,786	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	46,000	64,233	382,830	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	30,500	37,504	223,523	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	54,200	62,140	370,356	2042/11/13
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	83,000	94,542	563,472	2023/12/7
小	計					5,904,747	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	10,300	10,349	74,105	2017/9/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	23,800	23,668	169,466	2018/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	25,300	24,316	174,106	2020/1/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	26,100	24,158	172,976	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	25,200	23,740	169,982	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	61,900	67,588	483,934	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	24,300	21,482	153,813	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	30,000	23,853	170,787	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	41,000	36,329	260,119	2032/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	47,100	32,950	235,927	2036/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	22,500	19,831	141,993	2037/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	24,600	17,062	122,168	2041/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	12,300	10,966	78,523	2044/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	46,100	40,970	293,346	2048/2/28
小	計					2,701,252	
合	計					626,360,972	

\* 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

(2016年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 626,360,972	% 98.3
コール・ローン等、その他	11,133,784	1.7
投資信託財産総額	637,494,756	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(631,449,795千円)の投資信託財産総額(637,494,756千円)に対する比率は99.1%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=108.46円、1カナダドル=83.59円、1英ポンド=156.26円、1スイスフラン=111.70円、1スウェーデンクローナ=13.28円、1ノルウェークローネ=13.19円、1デンマーククローネ=16.60円、1ユーロ=123.49円、1ズロチ=27.86円、1シンガポールドル=79.08円、1リンギ=26.78円、1豪ドル=79.20円、1メキシコペソ=5.96円、1ランド=7.16円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	639,133,070,846
コール・ローン等	4,545,792,238
公社債(評価額)	626,360,972,586
未収入金	1,823,000,886
未収利息	5,918,367,356
前払費用	484,937,780
(B) 負債	6,235,070,181
前受収益	10,513
未払金	5,707,149,631
未払解約金	520,172,349
未払利息	3,488
その他未払費用	7,734,200
(C) 純資産総額(A-B)	632,898,000,665
元本	291,325,475,847
次期繰越損益金	341,572,524,818
(D) 受益権総口数	291,325,475,847口
1万口当たり基準価額(C/D)	21,725円

(注) 期首元本額は226,250,611,838円、期中追加設定元本額は93,884,664,448円、期中一部解約元本額は28,809,800,439円、1口当たり純資産額は2.1725円です。

## ○損益の状況 (2015年5月12日～2016年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	17,097,914,261
受取利息	17,098,505,784
支払利息	△ 591,523
(B) 有価証券売買損益	△ 61,369,438,009
売買益	9,743,040,445
売買損	△ 71,112,478,454
(C) 保管費用等	△ 66,787,725
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 44,338,311,473
(E) 前期繰越損益金	299,807,870,946
(F) 追加信託差損益金	123,857,945,032
(G) 解約差損益金	△ 37,754,979,687
(H) 計(D+E+F+G)	341,572,524,818
次期繰越損益金(H)	341,572,524,818

\*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（野村投資一任口座向け）	176,457,397,990
野村世界6資産分散投信（分配コース）	30,422,937,991
野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	12,220,623,842
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）	9,732,837,067
マイ・ロード	8,243,352,955
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,294,994,580
のむらップ・ファンド（普通型）	6,049,210,521
のむらップ・ファンド（保守型）	4,203,459,238
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）	2,511,358,868
野村DC外国債券インデックスファンド	2,493,189,250
マイバランス50（確定拠出年金向け）	2,400,306,707
マイバランス70（確定拠出年金向け）	2,163,660,740
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）	2,115,180,803
野村外国債券インデックス（野村SMA・EW向け）	2,018,404,437
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）	1,907,486,569
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,820,986,375
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）	1,804,312,476
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,745,367,331
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	1,689,490,286
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,515,216,664
のむらップ・ファンド（積極型）	1,486,329,678
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,421,173,277
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）	1,251,940,876
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,112,958,024
マイバランスDC30	1,012,111,671
野村DC運用戦略ファンド	754,737,592
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）	650,873,984
マイバランスDC50	586,652,515
野村インデックスファンド・外国債券	571,229,988
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）	520,369,883
野村外国債券バッシブファンド（確定拠出年金向け）	518,466,464
ネクストコア	483,317,021
マイバランスDC70	354,395,352
野村外国債券インデックスファンド	286,101,969
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）	240,094,682
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	210,656,574
ノムラFOfs用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用）	197,213,360
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）	105,881,930
バランスセレクト50	89,600,390
バランスセレクト30	86,883,757
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	83,971,392
野村資産設計ファンド2040	72,555,388
バランスセレクト70	67,555,802
野村資産設計ファンド2020	50,467,803
野村資産設計ファンド2015	46,681,186
野村資産設計ファンド2025	46,648,867
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）	43,530,310
野村資産設計ファンド2030	39,447,006
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）	36,879,283
野村資産設計ファンド2035	25,922,484
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	11,597,920
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）	8,766,188
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	7,574,123
野村資産設計ファンド2045	5,375,804

ファンド名	当期末
	元本額
	円
バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)	5,063,000
野村DC運用戦略ファンドM	5,055,226
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)	4,450,812
バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)	4,353,670
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	2,628,781
野村DC運用戦略ファンドA	2,591,399
野村資産設計ファンド2050	2,348,224
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	347,674
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	266,217
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	244,786
マイターゲット2040 (確定拠出年金向け)	218,042
マイターゲット2030 (確定拠出年金向け)	170,783

## ○お知らせ

信託金限度額を、1兆円から3兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2016年4月15日>

# 新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日2016年2月18日）

作成対象期間（2015年2月19日～2016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・ディバースファイド (円換算ベース)		債組入比率	債先物比率	純資産額
	騰落	中率	騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
2期(2012年2月20日)	10,373	3.0	104.43	3.1	96.3	—	1,649
3期(2013年2月18日)	12,996	25.3	133.07	27.4	96.5	—	2,337
4期(2014年2月18日)	12,499	△3.8	128.72	△3.3	97.3	—	2,101
5期(2015年2月18日)	13,863	10.9	142.69	10.9	97.4	—	2,077
6期(2016年2月18日)	11,485	△17.2	118.83	△16.7	97.0	—	1,612

\*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・ディバースファイド（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。  
\*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（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

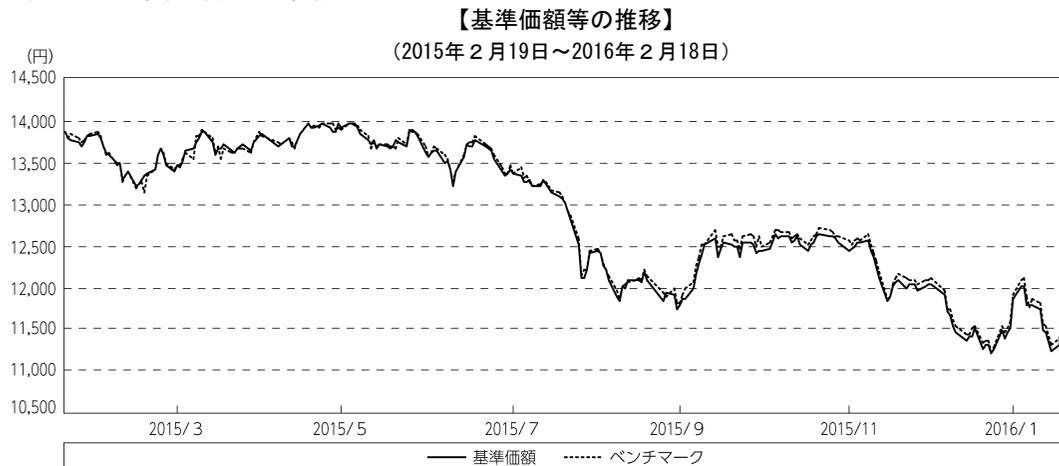
年月日	基準価額		ベンチマーク JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ エマージング・マーケット・グローバル・ ディバースファイド(円換算ベース)		債組入比率	債先物比率
	騰落	騰落率	騰落	騰落率		
(期首) 2015年2月18日	円	%		%	%	%
	13,863	—	142.69	—	97.4	—
2月末	13,811	△0.4	142.59	△0.1	97.0	—
3月末	13,477	△2.8	138.58	△2.9	97.1	—
4月末	13,826	△0.3	142.67	△0.0	97.3	—
5月末	13,929	0.5	143.09	0.3	97.6	—
6月末	13,563	△2.2	139.61	△2.2	97.0	—
7月末	13,369	△3.6	137.58	△3.6	97.6	—
8月末	12,443	△10.2	128.42	△10.0	96.4	—
9月末	11,775	△15.1	121.48	△14.9	95.6	—
10月末	12,443	△10.2	128.55	△9.9	95.8	—
11月末	12,450	△10.2	129.44	△9.3	97.0	—
12月末	12,032	△13.2	124.57	△12.7	97.0	—
2016年1月末	11,854	△14.5	122.65	△14.0	97.1	—
(期末) 2016年2月18日	円	%		%	%	%
	11,485	△17.2	118.83	△16.7	97.0	—

\*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、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13,863円から期末11,485円に2,378円の値下がりとなりました。

商品価格下落に伴う新興国の経常収支悪化懸念や、米国の利上げに伴う資金流出懸念などにより、新興国通貨が対円で下落（円高）したことから、基準価額は下落しました。

### ○投資環境

期首から2015年9月にかけて、トルコの政治体制や金融政策に対する不透明感が高まったこと、ブラジルにおける政治環境の不安定化や財政規律の弱体化、インフレ懸念の高まり、および大手格付会社によるブラジル国債の格付け引き下げなどから、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。10月には、インドネシアで景気刺激策としてエネルギー価格の引き下げなどが発表されたことが好感されたことなどから、新興国債券利回りは低下（価格は上昇）する局面もありましたが、2015年12月には南アフリカで財務交代に伴う財政規律や政治に対する不透明感が高まったことなどを背景に、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しました。その後期末にかけては、ブラジルで金融引き締め期待が後退したことや、南アフリカ準備銀行（中央銀行）による政策金利引き上げがインフレへの断固とした対応として好感されたことなどを背景に、新興国債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

当運用期間では、新興国債券利回りは上昇（価格は下落）しましたが、利子収入から債券リターンはプラスとなりました。

また為替市場は、商品価格下落に伴う新興国の経常収支悪化懸念や、米国の利上げに伴う資金流出懸念などにより、新興国通貨は対円で下落（円高）しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

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

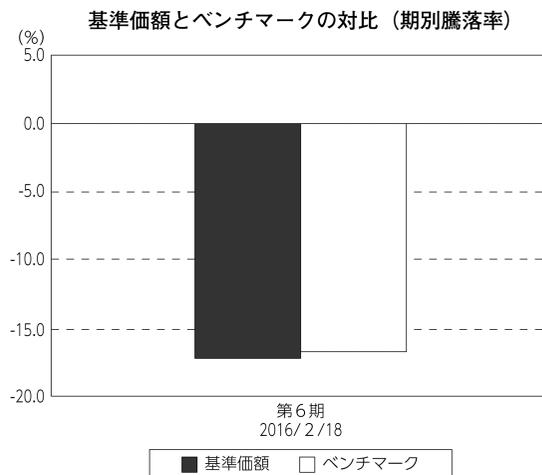
今期の基準価額の騰落率は－17.2%となり、ベンチマークの－16.7%と0.5ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです

### （マイナス要因）

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・エマーシング・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）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・メイカーとして行為し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・イー、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に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をご覧ください。

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

(2015年2月19日～2016年2月18日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 20	% 0.157	(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 ）	(18)	(0.143)	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
（ そ の 他 ）	( 2 )	(0.015)	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
合 計	20	0.157	
期中の平均基準価額は、12,914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

(2015年2月19日～2016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 2,349	千トルコリラ 1,931
	ハンガリー	国債証券	千フォリント 58,423	千フォリント 67,226
	ポーランド	国債証券	千ズロチ 2,671	千ズロチ 3,146
	ロシア	国債証券	千ルーブル 23,478	千ルーブル 27,453
	ルーマニア	国債証券	千レイ 616	千レイ 482
	マレーシア	国債証券	千リンギ 2,517	千リンギ 3,034
	タイ	国債証券	千バーツ 17,934	千バーツ 15,422
	インドネシア	国債証券	千ルピア 7,563,532	千ルピア 7,444,275
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 13,983	千メキシコペソ 14,107
	ブラジル	国債証券	千レアル 4,594	千レアル 3,944
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ 984,539	千コロンビアペソ 992,154
	ペルー	国債証券	千ヌエボソル 347	千ヌエボソル 442
	南アフリカ	国債証券	千ランド 10,741	千ランド 8,412
	ナイジェリア	国債証券	千ナイラ -	千ナイラ 59,899

\*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

(2015年2月19日～2016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	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 876	百万円 11	% 1.3	百万円 886	百万円 9	% 1.0
為替直物取引	2,295	354	15.4	2,404	350	14.6
預金	11	11	100.0	4	4	100.0

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。

## ○組入資産の明細

(2016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 4,230	千トルコリラ 3,925	千円 151,344	% 9.4	% —	% 4.8	% 4.0	% 0.7
ハンガリー	千フォロント 184,000	千フォロント 216,759	88,784	5.5	5.5	2.1	2.3	1.1
ポーランド	千ズロチ 5,230	千ズロチ 5,596	161,564	10.0	—	4.0	4.9	1.1
ロシア	千ルーブル 50,000	千ルーブル 48,091	73,098	4.5	4.5	—	4.5	—
ルーマニア	千レイ 1,490	千レイ 1,703	48,486	3.0	—	1.8	—	1.2
マレーシア	千リンギ 5,630	千リンギ 5,641	154,067	9.6	—	5.0	3.2	1.4
タイ	千バーツ 41,700	千バーツ 46,267	148,517	9.2	—	5.0	4.1	0.2
フィリピン	千フィリピンペソ 5,000	千フィリピンペソ 5,148	12,305	0.8	—	—	0.8	—
インドネシア	千ルピア 17,650,000	千ルピア 18,550,679	157,680	9.8	9.8	8.3	1.1	0.4
メキシコ	千メキシコペソ 22,500	千メキシコペソ 24,761	154,017	9.6	—	6.0	3.1	0.4
ブラジル	千リアル 5,257	千リアル 5,554	158,639	9.8	9.8	2.2	4.0	3.6
コロンビア	千コロンビアペソ 2,530,000	千コロンビアペソ 2,564,334	86,930	5.4	—	5.4	—	—
ペルー	千ヌエボソル 830	千ヌエボソル 770	25,062	1.6	—	1.3	0.3	—
南アフリカ	千ランド 21,930	千ランド 19,404	143,011	8.9	—	7.2	1.6	—
合 計	—	—	1,563,511	97.0	29.7	53.1	33.9	10.0

\* 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。

\* スタンダード・アンド・プアーズ、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	
トルコ			%	千トルコリラ	千トルコリラ	千円	
国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND		6.3	300	277	10,683	2018/2/14
	TURKEY GOVERNMENT BOND		8.3	300	285	11,015	2018/6/20
	TURKEY GOVERNMENT BOND		8.8	800	766	29,544	2018/11/14
	TURKEY GOVERNMENT BOND		10.5	610	609	23,497	2020/1/15
	TURKEY GOVERNMENT BOND		9.5	330	314	12,117	2022/1/12
	TURKEY GOVERNMENT BOND		8.5	550	497	19,188	2022/9/14
	TURKEY GOVERNMENT BOND		7.1	570	473	18,270	2023/3/8
	TURKEY GOVERNMENT BOND		10.4	220	217	8,396	2024/3/20
	TURKEY GOVERNMENT BOND		9.0	210	193	7,443	2024/7/24
	TURKEY GOVERNMENT BOND		8.0	340	290	11,186	2025/3/12
小 計						151,344	
ハンガリー				千フォロント	千フォロント		
国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND		6.75	38,000	41,456	16,980	2017/11/24
	HUNGARY GOVERNMENT BOND		6.5	44,000	50,497	20,683	2019/6/24
	HUNGARY GOVERNMENT BOND		7.5	33,000	40,610	16,633	2020/11/12
	HUNGARY GOVERNMENT BOND		7.0	24,000	30,082	12,321	2022/6/24
	HUNGARY GOVERNMENT BOND		6.0	18,000	21,882	8,963	2023/11/24
	HUNGARY GOVERNMENT BOND		5.5	27,000	32,231	13,201	2025/6/24
小 計						88,784	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND		5.25	580	617	17,820	2017/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		3.75	620	651	18,801	2018/4/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		5.5	280	316	9,130	2019/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		1.5	1,030	1,009	29,142	2020/4/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		5.25	670	767	22,147	2020/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		5.75	500	590	17,060	2021/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		5.75	280	335	9,693	2022/9/23
	POLAND GOVERNMENT BOND		4.0	310	338	9,766	2023/10/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		3.25	700	721	20,825	2025/7/25
	POLAND GOVERNMENT BOND		2.5	260	248	7,175	2026/7/25
小 計						161,564	
ロシア				千ルーブル	千ルーブル		
国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND		7.85	50,000	48,091	73,098	2018/3/10
小 計						73,098	
ルーマニア				千レイ	千レイ		
国債証券	ROMANIA		5.9	620	665	18,945	2017/7/26
	ROMANIA		5.85	870	1,037	29,540	2023/4/26
小 計						48,486	
マレーシア				千リンギ	千リンギ		
国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.314	200	202	5,516	2017/10/31
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4.24	600	612	16,721	2018/2/7
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.58	750	756	20,669	2018/9/28
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4.378	1,080	1,115	30,459	2019/11/29
	MALAYSIAN GOVERNMENT		4.16	620	636	17,385	2021/7/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.418	750	735	20,072	2022/8/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT		3.48	550	536	14,660	2023/3/15

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	
マレーシア			%	千リンギ	千リンギ	千円	
国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	160	163	4,465	2026/4/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	570	543	14,850	2028/6/15	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	350	339	9,265	2032/4/15	
小 計					154,067		
タイ				千バーツ	千バーツ		
国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	2.8	1,000	1,020	3,277	2017/10/10	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5.125	5,100	5,480	17,593	2018/3/13	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.45	5,200	5,499	17,652	2019/3/8	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.875	8,700	9,362	30,053	2019/6/13	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.65	10,800	11,940	38,330	2021/12/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4.75	1,200	1,467	4,711	2024/12/20	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.58	6,700	7,600	24,398	2027/12/17	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4.875	3,000	3,894	12,500	2029/6/22	
小 計					148,517		
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	5,000	5,148	12,305	2021/1/15	
小 計					12,305		
インドネシア				千ルピア	千ルピア		
国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	10.0	650,000	671,451	5,707	2017/7/15	
	INDONESIA GOVERNMENT	11.0	1,900,000	2,127,107	18,080	2020/11/15	
	INDONESIA GOVERNMENT	12.8	1,000,000	1,199,288	10,193	2021/6/15	
	INDONESIA GOVERNMENT	7.0	1,050,000	992,995	8,440	2022/5/15	
	INDONESIA GOVERNMENT	8.375	2,800,000	2,854,908	24,266	2024/3/15	
	INDONESIA GOVERNMENT	11.0	2,390,000	2,819,005	23,961	2025/9/15	
	INDONESIA GOVERNMENT	7.0	1,450,000	1,320,149	11,221	2027/5/15	
	INDONESIA GOVERNMENT	9.0	830,000	867,051	7,369	2029/3/15	
	INDONESIA GOVERNMENT	10.5	780,000	914,963	7,777	2030/8/15	
	INDONESIA GOVERNMENT	9.5	500,000	543,330	4,618	2031/7/15	
	INDONESIA GOVERNMENT	8.25	2,300,000	2,259,784	19,208	2032/6/15	
	INDONESIA GOVERNMENT	8.375	2,000,000	1,980,646	16,835	2034/3/15	
	小 計					157,680	
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	7.75	1,050	1,119	6,966	2017/12/14	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4.75	5,350	5,378	33,454	2018/6/14	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	2,350	2,601	16,183	2020/6/11	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	1,600	1,679	10,444	2021/6/10	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	1,400	1,464	9,106	2022/6/9	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	1,700	2,179	13,556	2024/12/5	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	2,250	2,483	15,449	2027/6/3	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	1,700	1,898	11,806	2031/5/29	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	200	272	1,693	2036/11/20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	2,500	2,992	18,613	2038/11/18	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	1,200	1,333	8,295	2042/11/13	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	1,200	1,357	8,446	2023/12/7	
	小 計					154,017	
ブラジル				千レアル	千レアル		
国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	—	480	399	11,409	2017/7/1	



## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年2月18日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,623,652,500
コール・ローン等	20,558,724
公社債(評価額)	1,563,511,352
未収入金	9,686,600
未収利息	25,384,026
前払費用	4,511,798
(B) 負債	11,372,644
未払金	9,667,381
未払解約金	1,360,363
その他未払費用	344,900
(C) 純資産総額(A-B)	1,612,279,856
元本	1,403,841,235
次期繰越損益金	208,438,621
(D) 受益権総口数	1,403,841,235口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,485円

(注) 期首元本額1,498百万円、期中追加設定元本額1,020百万円、期中一部解約元本額1,115百万円、計算口数当たり純資産額11,485円。

(注) 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

- ・野村資産設計ファンド2015 20百万円
- ・野村資産設計ファンド2020 24百万円
- ・野村資産設計ファンド2025 20百万円
- ・野村資産設計ファンド2030 17百万円
- ・野村資産設計ファンド2035 11百万円
- ・野村資産設計ファンド2040 32百万円
- ・野村資産設計ファンド2045 2百万円
- ・野村インデックスファンド・新興国債券 396百万円
- ・ネクストコア 28百万円
- ・野村インデックスファンド・海外5資産バランス 149百万円
- ・野村資産設計ファンド2050 0百万円
- ・ノムラFOFs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) 452百万円
- ・野村DC新興国債券(現地通貨建て)インデックスファンド 211百万円
- ・野村DC運用戦略ファンド 33百万円
- ・野村DC運用戦略ファンドM 0百万円
- ・野村DC運用戦略ファンドA 2百万円

## ○損益の状況（2015年2月19日～2016年2月18日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	112,760,385
受取利息	112,760,385
(B) 有価証券売買損益	△468,912,488
売買益	27,820,892
売買損	△496,733,380
(C) 保管費用等	△ 3,828,614
(D) 当期損益金(A+B+C)	△359,980,717
(E) 前期繰越損益金	578,984,323
(F) 追加信託差損益金	275,273,265
(G) 解約差損益金	△285,838,250
(H) 計(D+E+F+G)	208,438,621
次期繰越損益金(H)	208,438,621

\* 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。

## ○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11期（決算日2016年6月10日）

作成対象期間（2015年6月11日～2016年6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	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。 同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超えるJ-REITがある場合には、当該J-REITへ東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

**野村アセットマネジメント**

東京都中央区日本橋 1-12-1

<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 組入比率	純資産 総額
	円	騰落率	東証REIT指数 (配当込み)	騰落率		
7期(2012年6月11日)	8,319	△ 7.4	1,401.77	△ 7.5	97.7	百万円 15,069
8期(2013年6月10日)	12,408	49.2	2,092.40	49.3	98.0	15,237
9期(2014年6月10日)	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

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 組入比率
	円	騰落率	東証REIT指数 (配当込み)	騰落率	
(期首) 2015年6月10日	19,029	—	3,206.37	—	97.7
6月末	18,743	△ 1.5	3,157.69	△ 1.5	97.7
7月末	18,407	△ 3.3	3,100.40	△ 3.3	97.8
8月末	17,106	△ 10.1	2,881.06	△ 10.1	97.8
9月末	17,604	△ 7.5	2,964.58	△ 7.5	94.7
10月末	18,185	△ 4.4	3,061.58	△ 4.5	97.9
11月末	18,479	△ 2.9	3,110.54	△ 3.0	96.9
12月末	18,506	△ 2.7	3,115.04	△ 2.8	97.6
2016年1月末	18,906	△ 0.6	3,182.12	△ 0.8	95.8
2月末	19,976	5.0	3,361.11	4.8	95.6
3月末	20,267	6.5	3,409.88	6.3	98.0
4月末	20,600	8.3	3,465.54	8.1	97.2
5月末	20,345	6.9	3,422.69	6.7	98.1
(期末) 2016年6月10日	20,222	6.3	3,401.82	6.1	98.2

\*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19,029円から期末20,222円に1,193円の値上がりとなりました。

東京都心におけるオフィスビル市況の改善、日本銀行によるマイナス金利導入が好感されたことなどを受けて、基準価額は上昇しました。

### ○投資環境

期首より2015年8月にかけては、国内REITの公募増資および新規上場の発表が相次いだことによる需給悪化などが懸念される一方、日本銀行による国内REITの買い入れなどを背景に国内REIT市場は一進一退の展開となりました。

8月以降、中国や新興国の景気減速への懸念が高まったことを受け世界的に株式市場が下落したことなどを背景に、国内REIT市場は大きく下落しました。

9月以降は、東京都心におけるオフィスビル市況の改善が好感されたことなどを受け、国内REIT市場は上昇しました。

2016年1月には、原油価格下落などを背景とした世界的な株安が進行したことなどを受け下落する場面もありましたが、1月下旬以降、日本銀行によるマイナス金利導入の発表を好感したことや、長期金利低下を背景とした金利コスト低下に伴い収益拡大が期待されたことなどから国内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

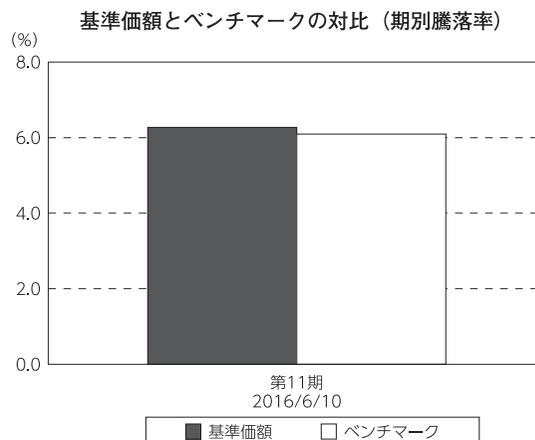
東証REIT指数（配当込み）の動きに連動した投資成果を目指すため、指数構成銘柄の時価総額比と等しくなるように銘柄間の投資比率の調整を行ってまいりました。なお、組入比率を高位に維持する為、東証REIT指数先物を利用しました。

## ○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+6.3%となり、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の+6.1%を0.2ポイント上回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

- ・設定解約等に起因するREIT売買等により発生する差異。
- ・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

(2015年6月11日～2016年6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	%	(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	0.002	
( 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、18,927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

(2015年6月11日～2016年6月10日)

## 投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	口	千円	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	318	136,525	205	87,036
MCUBS Mid City投資法人 投資証券	286	94,552	110	37,530
森ヒルズリート投資法人 投資証券	1,359	207,401	673	105,102
野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券	26 (△ 271)	16,342 (△ 188,587)	4	2,553
産業ファンド投資法人 投資証券	231	124,061	149	79,920
大和ハウスリート投資法人 投資証券	226	111,250	144	68,227
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	842	227,069	541	144,589
ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	224	67,929	143	42,623
アクティブピア・プロパティーズ投資法人 投資証券	398 ( 467)	237,407 ( -)	227	129,921
内 GLP投資法人 投資証券	1,978	236,531	1,062	127,432
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	379	86,294	199	45,134
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	1,323	308,629	724	165,313
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	300 (△ 2,804)	42,488 (△ 438,913)	72	10,419
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	95	117,371	27	33,943
SIA不動産投資法人 投資証券	53	23,388	35	15,387
イオンリート投資法人 投資証券	1,101	149,063	458	61,044

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		口	千円	口	千円
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	819	142,792	325	55,820
	日本リート投資法人 投資証券	391	109,954	164	45,320
	インバスコ・オフィス・ジュリート投資法人 投資証券	820	79,498	221	22,118
	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	72	13,808	33	6,189
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	689	88,957	323	41,021
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	195	22,323	57	6,624
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	498	124,723	150	38,412
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	72	7,951	44	4,648
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	350	32,829	59	5,138
	ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	183	32,015	32	4,748
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	1,702 ( 6,266)	268,489 ( 982,006)	1,347	208,318
国	いちごホテルリート投資法人 投資証券	285	39,511	39	5,732
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	2,020	218,812	63	6,544
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	613	61,233	—	—
	日本ビルファンド投資法人 投資証券	914	547,360	586	361,490
	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	851	509,488	547	337,540
	日本リートファンド投資法人 投資証券	1,830	439,495	1,049	260,065
	オリックス不動産投資法人 投資証券	1,805	298,746	956	160,032
	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	603	254,645	356	152,658
	プレミアム投資法人 投資証券	629 ( 1,732)	107,798 ( —)	425	68,934
	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	632	95,138	405	61,447
内	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	129	54,353	84	35,478
	野村不動産オフィスファンド投資法人 投資証券	65 (△ 627)	33,006 (△ 354,505)	14	7,178
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	2,080	352,150	1,121	190,203
	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	855	179,001	549	112,145
	インヴィンシブル投資法人 投資証券	3,704	264,092	1,294	93,783
	フロンティア不動産投資法人 投資証券	316	160,834	201	100,139
	平和不動産リート投資法人 投資証券	739	64,008	405	35,394
	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	636	145,870	355	83,268
	福岡リート投資法人 投資証券	488	96,791	314	60,818
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	258	151,814	164	98,956
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 投資証券	658	74,298	422	46,309	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	1,111	92,980	587	49,747	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	319	202,936	204	133,147	
阪急リート投資法人 投資証券	388	50,873	249	32,630	
スターツプロシード投資法人 投資証券	105	18,105	65	11,063	
トップリート投資法人 投資証券	117	53,380	76	33,881	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	481	118,863	308	75,285	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	2,576	224,833	1,308	117,734	
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	1,059	87,400	679	56,270	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	880	122,798	507	71,353	
合 計		42,076 ( 4,763)	8,230,281 ( —)	20,860	4,453,778

\*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 1,470	百万円 1,485	百万円 -	百万円 -

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2015年6月11日～2016年6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	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	8,230	1,302	15.8	4,453	227	5.1
預金	9,337	9,337	100.0	9,337	9,337	100.0

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証券株式会社、野村信託銀行です。

## ○組入資産の明細

(2016年6月10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	口 数	評 価 額
日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	749	862	390,055	1.8
MCUBS Midcity投資法人 投資証券	297	473	175,719	0.8
森ヒルズリート投資法人 投資証券	2,428	3,114	513,187	2.4
野村不動産レジデンシャル投資法人 投資証券	249	-	-	-
産業ファンド投資法人 投資証券	545	627	357,390	1.7
大和ハウスリート投資法人 投資証券	542	624	377,520	1.8
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	2,011	2,312	663,081	3.1
ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	540	621	185,927	0.9
アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	429	1,067	609,257	2.8
GLP投資法人 投資証券	3,698	4,614	588,746	2.7
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	733	913	216,746	1.0
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	2,677	3,276	776,412	3.6
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	2,576	-	-	-
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	77	145	191,980	0.9
SIA不動産投資法人 投資証券	116	134	58,156	0.3
イオンリート投資法人 投資証券	1,686	2,329	323,731	1.5
ヒューリックリート投資法人 投資証券	1,208	1,702	314,870	1.5
日本リート投資法人 投資証券	470	697	199,411	0.9
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	831	1,430	137,280	0.6

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率	
	口	口	千円	%	
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	94	133	23,873	0.1	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	1,216	1,582	216,734	1.0	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	148	286	32,975	0.2	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	403	751	221,169	1.0	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	186	214	22,898	0.1	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	—	291	27,383	0.1	
ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	—	151	23,480	0.1	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	—	6,621	1,112,328	5.2	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	—	246	45,214	0.2	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	—	1,957	198,635	0.9	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	—	613	58,418	0.3	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,184	2,512	1,582,560	7.4	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	2,025	2,329	1,448,638	6.8	
日本リートリアルファンド投資法人 投資証券	3,759	4,540	1,159,516	5.4	
オリックス不動産投資法人 投資証券	3,458	4,307	790,334	3.7	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,306	1,553	713,603	3.3	
プレミア投資法人 投資証券	407	2,343	333,408	1.6	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,512	1,739	269,545	1.3	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	300	345	141,622	0.7	
野村不動産オフィスファンド投資法人 投資証券	576	—	—	—	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	4,090	5,049	926,996	4.3	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,042	2,348	486,270	2.3	
インヴェンシブル投資法人 投資証券	4,128	6,538	506,695	2.4	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	767	882	462,168	2.2	
平和不動産リート投資法人 投資証券	1,471	1,805	154,327	0.7	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,284	1,565	386,398	1.8	
福岡リート投資法人 投資証券	1,155	1,329	273,906	1.3	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	626	720	461,520	2.2	
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人 投資証券	1,575	1,811	214,784	1.0	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	2,191	2,715	224,802	1.0	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	746	861	571,704	2.7	
阪急リート投資法人 投資証券	924	1,063	142,548	0.7	
スターツプロシード投資法人 投資証券	269	309	53,982	0.3	
トップリート投資法人 投資証券	272	313	135,998	0.6	
大和ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,157	1,330	368,410	1.7	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	4,641	5,909	579,082	2.7	
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	2,537	2,917	247,945	1.2	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	1,876	2,249	344,321	1.6	
合 計	口 数 ・ 金 額	71,187	97,166	21,043,672	
	銘 柄 数 < 比 率 >	51	54	< 98.2% >	

\* 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投資信託証券評価額の比率。

\* 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	
			買建額	売建額
国内	REIT先物取引	東証REIT指数	百万円 391	百万円 -

\*単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2016年6月10日現在)

項目	当期	
	評価額	比率
投資証券	千円 21,043,672	% 98.0
コール・ローン等、その他	438,605	2.0
投資信託財産総額	21,482,277	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 (2016年6月10日現在)

項目	当期末
(A) 資産	21,482,277,618 円
コール・ローン等	303,372,684
投資証券(評価額)	21,043,672,700
未収入金	4,437,745
未収配当金	113,994,489
差入委託証拠金	16,800,000
(B) 負債	45,812,409
未払金	34,566,086
未払解約金	11,245,890
未払利息	433
(C) 純資産総額(A-B)	21,436,465,209
元本	10,600,385,360
次期繰越損益金	10,836,079,849
(D) 受益権総口数	10,600,385,360口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,222円

(注) 期首元本額は8,916,491,271円、期中追加設定元本額は4,693,521,308円、期中一部解約元本額は3,009,627,219円、1口当たり純資産額は2,022円です。

## ○損益の状況

(2015年6月11日~2016年6月10日)

項目	当期
(A) 配当等収益	606,320,092 円
受取配当金	597,440,546
受取利息	140,567
その他収益金	8,774,829
支払利息	△ 35,850
(B) 有価証券売買損益	684,103,116
売買益	1,171,420,502
売買損	△ 487,317,386
(C) 先物取引等取引損益	22,966,220
取引益	83,112,104
取引損	△ 60,145,884
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,313,389,428
(E) 前期繰越損益金	8,050,898,446
(F) 追加信託差損益金	4,165,743,956
(G) 解約差損益金	△ 2,693,951,981
(H) 計(D+E+F+G)	10,836,079,849
次期繰越損益金(H)	10,836,079,849

\*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）	3,264,905,690
野村インデックスファンド・J-REIT	2,506,021,390
野村世界6資産分散投信（安定コース）	946,765,401
野村世界6資産分散投信（成長コース）	822,566,916
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	683,687,078
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	535,472,437
ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT（適格機関投資家専用）	532,706,323
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）	437,529,690
野村DC運用戦略ファンド	300,133,960
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	211,848,887
ネクストコア	199,731,545
野村資産設計ファンド2040	32,392,538
野村資産設計ファンド2015	30,818,727
野村資産設計ファンド2030	26,431,812
野村資産設計ファンド2020	22,418,811
野村資産設計ファンド2025	20,890,943
野村資産設計ファンド2035	17,405,367
野村DC運用戦略ファンドA	3,011,807
野村資産設計ファンド2045	2,958,591
野村資産設計ファンド2050	1,612,373
野村DC運用戦略ファンドM	1,075,074

## ○お知らせ

有価証券の指図範囲に新投資口予約権証券を加える所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年8月3日＞

# 海外REITインデックス マザーファンド

## 運用報告書

第11期（決算日2016年6月10日）

作成対象期間（2015年6月11日～2016年6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	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 組入比率	純資産 総額
	騰落	率	騰落	率		
	円	%		%	%	百万円
7期(2012年6月11日)	9,921	2.4	102.09	2.5	99.7	18,044
8期(2013年6月10日)	14,355	44.7	148.91	45.9	99.6	17,921
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

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 組入比率
	騰落	率	騰落	率	
(期首) 2015年6月10日	円	%		%	%
	21,126	—	220.55	—	99.5
6月末	20,554	△2.7	214.83	△2.6	99.3
7月末	21,605	2.3	225.92	2.4	96.9
8月末	20,352	△3.7	212.96	△3.4	99.3
9月末	20,003	△5.3	209.30	△5.1	99.3
10月末	21,713	2.8	227.14	3.0	97.0
11月末	21,664	2.5	227.11	3.0	99.2
12月末	21,690	2.7	227.35	3.1	98.9
2016年1月末	20,327	△3.8	213.22	△3.3	98.6
2月末	19,412	△8.1	203.87	△7.6	99.1
3月末	21,074	△0.2	221.52	0.4	97.8
4月末	20,539	△2.8	215.56	△2.3	99.2
5月末	20,899	△1.1	219.39	△0.5	99.2
(期末) 2016年6月10日	円	%		%	%
	20,525	△2.8	215.72	△2.2	99.2

\*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21,126円から期末20,525円に601円の値下がりとなりました。

中国経済への懸念が高まったことや、原油価格下落などを背景とした世界的な株安が進行したことなどを受けて、下落しました。

## ○投資環境

期首より、米国の利上げに対する見方やギリシャの債務問題の進展状況などをめぐり一進一退の展開となりましたが、2015年7月中旬にギリシャがEU（欧州連合）と金融支援の再開で基本合意に達したことなどから主要国のREIT市場は堅調な推移となりました。

8月下旬には、中国の景気減速への懸念から世界的な株式市場下落の流れを受けて下落しましたが、9月以降は、米国の経済指標が市場予想を上回ったことや、主要国が緩和的な金融政策を維持するとの見方が広がったことなどを背景に上昇しました。

2016年1月以降は、中国経済への懸念が高まったことや、原油価格下落などを背景とした世界的な株安が進行したことなどをを受けて、再び下落しました。

2月中旬以降は、原油価格が持ち直したことや、市場予想を上回る米国経済指標の発表などを背景に上昇しました。

為替市場は、2015年8月下旬以降、世界的な景気減速懸念からリスク回避姿勢が強まり、ドルは対円で下落（円高）しました。11月に入り、堅調な10月の米雇用統計などを受け米国の年内利上げ観測が高まり、米ドルは対円で上昇（円安）しましたが、12月以降は、原油価格や世界的な株式市場の下落を背景に、米ドルは対円で下落（円高）しました。その後も米国の利上げが穏やかなペースになるとの観測や、日本銀行による追加金融緩和が見送られたことから、米ドルは対円でさらに下落（円高）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-2.8%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-2.2%を0.6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）

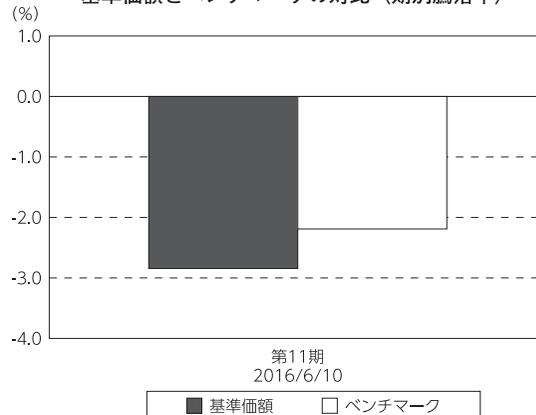
為替の評価時価による差異（ファンド評価に使用される為替レートとベンチマークの為替レートに時間差があり異なるため）

## ◎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。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（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。

「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 サービスーズ 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

(2015年6月11日～2016年6月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投資信託証券) (先物・オプション)	円 4 (0) (4) (0)	% 0.021 (0.000) (0.020) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投資信託証券)	3 (0) (3)	0.013 (0.000) (0.013)	(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
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	10 (8) (2)	0.048 (0.037) (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
合 計	17	0.082	
期中の平均基準価額は、20,819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

(2015年6月11日～2016年6月10日)

## 株式

外 国	買 付	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
アメリカ	百株 — (10)	千米ドル — (15)	百株 10	千米ドル 16	

\*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 数	口 数	金 額
			口 数	口 数	金 額
			口 数	口 数	金 額
	ACADIA REALTY TRUST	2,600	83	1,700	53
	AGREE REALTY CORP	1,500	55	700	22
	ALEXANDERS INC	180	68	80	30
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2,400	211	1,600	145
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	1,600	64	900	37
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	6,100	253	2,600	105
	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	6,900	110	4,534	71
		( 5,334)	( 88)		
	AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	3,700	30	9,000	77
				(127,000)	( 1,092)
	AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	—	—	—	—
				( 4,700)	( 88)
	APARTMENT INVT&MGMT CO-A	5,400	207	3,800	146
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	28,000	542	3,800	72
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	1,500	16	800	8
	ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	—	—	—	—
		( 495)	( —)		
	ASHFORD HOSPITALITY TRUST	—	—	1,000	8
	ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	—	—	400	11
				( 8,000)	( 229)
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,250	924	3,350	588
	BIOMED REALTY TRUST INC	4,400	92	4,000	84
				( 29,500)	( 590)
	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2,700	30	—	—
	BOSTON PROPERTIES	5,650	689	4,250	522
	BRANDYWINE REALTY TRUST	7,700	102	7,500	102
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	10,700	271	4,100	101
	CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	5,300	75	6,800	104
	CAMDEN PROPERTY TRUST	3,000	230	2,300	178
	CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	1,200	8	10,100	70
	CARE CAPITAL PROPERTIES INC	2,475	72	1,300	36
	( 11,625)	( —)			
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	4,700	56	—	—	
CEDAR REALTY TRUST INC	1,100	7	—	—	
CHAMBERS STREET PROPERTIES	2,800	19	2,800	19	
			( 34,000)	( 258)	
CHATHAM LODGING TRUST	500	9	—	—	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	1,400	38	700	20	
CITY OFFICE REIT INC	4,000	44	700	8	
COLONY STARWOOD HOMES	400	8	—	—	
	( 5,500)	( 137)			
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,000	92	2,900	70	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,000	37	—	—	
CORESITE REALTY CORP	1,700	99	700	40	

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ		口		口
			千米ドル		千米ドル
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	3,400	77	2,300	52
	CORRECTIONS CORP OF AMERICA	3,400	98	2,400	76
	COUSINS PROPERTIES INC	5,100	49	4,400	45
	CUBESMART	6,400	180	3,300	90
	CYRUSONE INC	6,500	224	2,700	95
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	3,200	115	2,400	85
	DDR CORP	10,400	170	7,300	120
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	7,100	75	5,600	65
	DIGITAL REALTY TRUST INC	6,500	493	3,700	277
	DOUGLAS EMMETT INC	4,900	145	2,900	86
	DUKE REALTY CORP	12,300	251	8,900	182
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY	3,600	127	1,900	60
	EPR PROPERTIES	2,700	159	1,200	72
	EASTGROUP PROPERTIES	800	45	600	35
	EDUCATION REALTY TRUST INC	3,300	121	600	19
	EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	6,000	103	4,000	68
	EQUITY COMMONWEALTH	4,200	113	3,400	92
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,900	119	1,100	67
	EQUITY ONE INC	7,300	194	4,600	118
	EQUITY RESIDENTIAL	13,500	1,010	10,100	754
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,450	545	1,800	401
	EXCEL TRUST INC	700	11	—	—
				( 9,500)	( 151)
	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,300	518	3,100	253
	FARMLAND PARTNERS INC	1,800	20	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,650	384	1,900	273
	FELCOR LODGING TRUST INC	2,700	21	1,200	11
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	4,700	102	2,500	53
	FOREST CITY REALTY TRUST- A	34,200	619	1,100	23
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8,400	168	2,000	34
		( 2,126)	( 34)		
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	5,000	52	3,800	39
GEO GROUP INC/THE	1,700	49	1,000	33	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	17,490	556	2,420	71	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	23,300	634	24,800	668	
GETTY REALTY CORP	400	6	600	10	
	( 21)	( 0.37332)			
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	500	8	—	—	
GLOBAL NET LEASE INC	29,300	255	2,800	24	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	1,000	15	—	—	
			( —)	( 1)	
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	850	19	765	18	
			( 8,400)	( 211)	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	7,406	57	4,200	33	
	( 60,794)	( 470)			
HCP INC	18,600	655	13,700	490	

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	アメリカ		口		口
			千米ドル		千米ドル
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	3,400	89	1,800	45
	HEALTH CARE REIT INC	3,000	197	3,600	244
		(△ 50,000)	(△ 3,384)		
	HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	5,000	135	2,000	53
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	—	—	—	—
		(△ 29,200)	(△ 185)		
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	500	10	900	21
		( 7,300)	( 185)		
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,400	144	2,000	84
	HOME PROPERTIES INC	400	29	500	36
				( 8,200)	( 595)
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	5,400	137	4,300	111
				( —)	( 5)
	HOST HOTELS & RESORTS INC	27,800	450	22,000	375
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	3,900	108	700	20
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	—	—	—	—
		( 985)	( 7)		
	INLAND REAL ESTATE CORP	900	9	—	—
				( 13,600)	( 133)
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	4,900	34	3,300	23
	IRON MOUNTAIN INC	14,900	502	4,800	147
	KILROY REALTY CORP	3,700	235	2,000	129
	KIMCO REALTY CORP	15,300	403	11,400	299
	KITE REALTY GROUP TRUST	2,000	51	1,600	42
	LTC PROPERTIES INC	1,300	56	700	30
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	4,300	116	3,700	106
	LEXINGTON REALTY TRUST	6,100	51	4,500	39
	LIBERTY PROPERTY TRUST	4,100	131	3,500	115
	MACERICH CO /THE	4,300	337	5,300	415
	MACK-CALI REALTY CORP	4,300	90	3,000	65
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	12,800	153	7,300	91
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2,600	230	1,900	163	
MONMOUTH REIT-CLASS A	1,700	17	—	—	
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	4,100	38	1,400	13	
NATL HEALTH INVESTORS INC	1,500	92	1,100	69	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	5,700	232	3,300	131	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,500	46	—	—	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	5,500	63	1,900	19	
NEW YORK REIT INC	5,000	51	4,000	40	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3,000	44	—	—	
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	15,960	223	2,660	40	
			( 52,790)	( 849)	
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	4,190	60	1,695	25	
	( 26,395)	( 713)			
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	702	8	—	—	
	( 8,798)	( 135)			



銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
TERRENO REALTY CORP	700	15	—	—
TRADE STREET RESIDENTIAL INC	—	—	( 2,400)	( 17)
UDR INC	10,700	379	7,000	244
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	500	26	500	25
URBAN EDGE PROPERTIES	2,700	63	2,000	47
VENTAS INC	13,800	798	10,100	605
VEREIT INC	25,700 ( 127,000)	211 ( 1,092)	13,400	109
VORNADO REALTY TRUST	6,600	616	4,700	446
WP CAREY INC	2,900	172	2,200	133
WP GLIMCHER INC	2,600	25	1,000	13
WASHINGTON REAL ESTATE INV	2,600	70	1,200	32
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3,800	131	2,700	94
WELLTOWER INC	10,400 ( 50,000)	682 ( 3,384)	5,900	394
WHITESTONE REIT	700	8	—	—
WINTHROP REALTY TRUST	6,100	87	700 ( —)	10 ( 10)
XENIA HOTELS & RESORTS INC	3,600	65	2,600	52
小 計	894,456 ( 222,620)	30,180 ( 2,553)	492,704 (338,190)	18,462 ( 4,726)
カナダ		千カナダドル		千カナダドル
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	3,000	103	3,000	107
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	2,500	32	1,500	19
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	300	14	500	27
CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	800	23	— ( 10,200)	— ( 290)
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,800	107	1,700	48
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1,100	44	600	23
CHOICE PROPERTIES REIT	1,000	11	—	—
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	5,100	83	5,300	89
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	1,000	12	4,500	57
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	900	14	—	—
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	1,000	8	2,500	20
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,590	15	1,890	18
H&R REAL ESTATE INVSTMT-UTS	8,200	161	6,600	131
INNVEST REAL ESTATE INVESTME	2,600	13	—	—
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,600	46	—	—
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	6,900	113	1,500	23
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	—	—	1,600	16
NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT	—	—	— ( 2,400)	— ( 56)
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	700 ( 2,400)	11 ( 56)	—	—
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	1,300	12	—	—

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
カナダ		口	千カナダドル	口	千カナダドル
	ONEREIT	— ( 6,570)	— ( 23)	—	—
	RETROCOM REAL ESTATE INVESTMENT	—	—	( 6,570)	( 23)
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,200	184	5,300	138
	SLATE RETAIL REIT	2,300	31	—	—
	SLATE RETAIL REIT-RIGHTS	— ( 1,600)	— ( 0.11739)	1,600	0.08787
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	3,000 ( 10,200)	90 ( 290)	3,500	101
小計		58,890 ( 20,770)	1,138 ( 370)	41,590 ( 19,170)	822 ( 370)
イギリス			千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND	35,000	272	25,700	203
	DERWENT LONDON PLC	4,600	160	3,500	122
	BIG YELLOW GROUP PLC	6,500	50	4,300	33
	HAMMERSON PLC	24,600	146	17,200	105
	MCKAY SECURITIES PLC-ORD	7,170	18	8,720	22
	MUCKLOW < A & J > GROUP PLC	—	—	8,620	39
	INTU PROPERTIES PLC	32,800	102	44,900	141
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	—	—	( 16,700)	( 65)
	SHAFTESBURY PLC	10,900	100	8,900	82
	LAND SECURITIES GROUP PLC	24,900	289	17,300	207
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	15,700	123	13,000	102
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	78,700	48	—	—
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	10,500	12	—	—
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	6,880	24	3,380	11
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	29,400	48	13,800	23
	SEGRO PLC	31,200	134	25,400	110
	WORKSPACE GROUP PLC	1,800	16	1,000	8
	REDEFINE INTERNATIONAL PLC	81,300	39	46,600	24
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	47,400 ( —)	60 ( 0.53819)	9,000 ( —)	12 (0.53819)
	TRITAX BIG BOX REIT PLC-RTS	— ( 8,872)	— ( 0.53819)	— ( 8,872)	— (0.53819)
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	67,200 ( —)	74 ( 0.22558)	— ( —)	— (0.22558)
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC-RIGHTS	— ( 7,885)	— ( 0.22558)	— ( 7,885)	— (0.22558)
	ASSURA PLC	152,390 ( —)	84 ( 2)	40,490 ( —)	22 ( 2)
	ASSURA PLC-RIGHTS	— ( 28,142)	— ( 2)	— ( 28,142)	— ( 2)

銘	柄	買 付 額		売 付 額	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	24,200 ( 66,800)	25 ( 65)	— ( —)	— (0.56478)
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES-RIGHTS	— ( 6,680)	— ( 0.56478)	— ( 6,680)	— (0.56478)
	REGIONAL REIT LTD	26,000	26	—	—
	小 計	719,140 ( 118,379)	1,860 ( 73)	291,810 ( 68,279)	1,274 ( 73)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ				
	HAMBORNER REIT AG	2,700 ( 2,206)	23 ( 19)	1,700 ( —)	14 ( 1)
	HAMBORNER REIT AG-RIGHTS	— ( 6,620)	— ( 1)	2 ( 6,618)	0.00009 ( 0.9927)
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	5,400	66	1,400 ( —)	17 ( 7)
	小 計	8,100 ( 8,826)	90 ( 20)	3,102 ( 6,618)	32 ( 9)
	イタリア				
	BENI STABILI SPA	22,000	15	— ( —)	— ( 3)
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,000	8	10,000	8
	小 計	32,000	23	10,000 ( —)	8 ( 3)
	フランス				
	AFFINE	900	14	—	—
	ICADE	1,500	94	710	47
	ALTAREA	—	—	— ( —)	— ( 7)
	ALTAREA-RIGHTS	— ( 320)	— ( 0.84285)	5	0.01414
	KLEPIERRE	7,210	290	8,870	350
GECINA SA	1,410	164	1,250	144	
FONCIERE DES REGIONS	2,250	179	2,340 ( —)	183 ( 8)	
MERCIALYS	—	—	5,400	102	
FONCIERE DES MURS	1,300	33	— ( —)	— ( 1)	
UNIBAIL RODAMCO-NA	3,530	830	2,650	630	
小 計	18,100 ( 320)	1,607 ( 0.84285)	21,225 ( —)	1,459 ( 16)	
オランダ					
EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	1,250	49	600	23	
VASTNED RETAIL NV	880	35	940	36	
WERELDHAVE NV	1,860	97	780	41	
NSI NV	9,080	33	—	—	
小 計	13,070	216	2,320	101	

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	ユーロ				
			千ユーロ		千ユーロ
	スペイン				
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	4,330	38	—	—
				( —)	( 7)
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM-RIG	—	—	6,130	6
		( 6,130)	( 6)		
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	9,350	101	9,220	98
		( 18,770)	( 189)	( —)	( 44)
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA-RIGH	—	—	—	—
		( 28,155)	( 39)	( 28,155)	( 39)
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	1,710	21	2,850	32
		( 5,000)	( 56)		
	AXIA REAL ESTATE SOCIMI SA-RIGHT	—	—	—	—
				( 5,000)	( 1)
	小 計	15,390	161	18,200	136
		( 58,055)	( 292)	( 33,155)	( 93)
	ベルギー				
	BEFIMMO S. C. A.	730	39	300	15
	COFINIMMO	520	51	420	41
	RETAIL ESTATES	870	65	—	—
	WERELDHAVE BELGIUM	290	28	—	—
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,140	24	—	—
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	550	38	200	14
	AEDIFICA	1,170	69	680	41
		( 388)	( 20)	( —)	( 1)
	AEDIFICA RIGHTS	—	—	2	0.00051
		( 1,360)	( 1)	( 1,358)	( 1)
	XIOR STUDENT HOUSING NV	800	23	300	9
	小 計	6,070	339	1,902	122
		( 1,748)	( 21)	( 1,358)	( 2)
	アイルランド				
	GREEN REIT PLC	25,000	37	27,200	40
HIBERNIA REIT PLC	20,000	26	6,000	7	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	11,800	12	8,190	9	
小 計	56,800	77	41,390	57	
ユ ー ロ 計	149,530	2,515	98,139	1,917	
	( 68,949)	( 335)	( 41,131)	( 126)	
香港		千香港ドル		千香港ドル	
LINK REIT	77,000	3,475	61,500	2,796	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	40,000	166	20,000	81	
CHAMPION REIT	29,000	112	60,000	232	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	30,000	112	30,000	116	
FORTUNE REIT	105,000	819	97,000	755	
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	19,000	62	—	—	
小 計	300,000	4,748	268,500	3,983	
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	139,900	281	103,700	211	

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	99,500 ( - )	230 ( 0.6924)	50,400 ( - )	118 ( 1)	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV-RTS	- ( 11,118)	- ( 0.6924)	- ( 11,118)	- ( 0.6924)	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	66,200	90	58,000	80	
	SUNTEC REIT	133,400	213	120,200 ( - )	194 ( 3)	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	20,000	20	- ( - )	- ( 2)	
	STARHILL GLOBAL REIT	50,800	41	51,900 ( - )	45 ( 1)	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	35,100 ( - )	43 ( 0.03348)	35,800 ( - )	45 ( 8)	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	15,000	20	- ( - )	- (0.11075)	
	KEPPEL REIT	52,600	47	26,300 ( - )	23 ( 1)	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	10,500	20	-	-	
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	28,300	17	45,000 ( - )	27 ( 0.1275)	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	11,400	14	- ( - )	- ( 0.1089)	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	67,300	99	44,800 ( - )	68 ( 8)	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	11,100	13	15,500 ( - )	21 ( 2)	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	9,000	20	- ( - )	- ( 1)	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	48,300	17	64,300 ( - )	23 ( 3)	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	66,200	103	61,000 ( - )	97 ( 0.0871)	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	34,800	49	15,500	22	
	CACHE LOGISTICS TRUST	37,000	35	20,000 ( - )	20 ( 1)	
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	37,000	52	29,200 ( - )	42 (0.50243)	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	21,200	15	27,000	20	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	44,300	41	22,100 ( - )	22 ( 3)	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	-	-	- ( - )	- ( 1)	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	22,000	13	-	-		
SPH REIT	15,500	14	-	-		
QUE HOSPITALITY TRUST	26,800 ( 38,643)	21 ( 28)	24,700 ( - )	22 ( 7)		

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外 国	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	OUE HOSPITALITY TRUST-RIGHTS	—	—	—	—
		( 38,643)	( 7)	( 38,643)	( 7)
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	20,000	16	—	—
	BHG RETAIL REIT	31,600	25	31,600	25
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	17,300	11	—	—
		( 19,350)	( 14)	( —)	( 4)
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I-RIGHTS	—	—	—	—
		( 19,350)	( 3)	( 19,350)	( 3)
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	17,000	12	—	—
				( —)	( 3)
	KEPPEL DC REIT	31,500	34	20,300	22
	小計	1,220,600	1,643	867,300	1,153
		( 127,104)	( 54)	( 69,111)	( 68)
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	BWP TRUST	7,000	22	8,000	25
	MIRVAC GROUP	147,000	273	123,000	230
	INVESTA OFFICE FUND	11,000	43	8,000	31
	CROMWELL PROPERTY GROUP	21,000	21	—	—
	CHARTER HALL RETAIL REIT	16,000	71	6,000	27
	GPT GROUP	94,000	444	73,000	341
	ABACUS PROPERTY GROUP	11,934	35	—	—
	ALE PROPERTY GROUP	4,800	16	5,400	19
	STOCKLAND TRUST GROUP	88,000	357	67,000	277
	DEXUS PROPERTY GROUP	37,000	287	29,000	228
	GOODMAN GROUP	61,000	383	42,000	265
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	—	—	3,000	15
	CHARTER HALL GROUP	17,000	75	10,000	44
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	—	—	—	—
		(△ 111,429)	( —)		
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	30,180	62	10,000	20	
FEDERATION CENTRES	43,000	121	63,697	183	
	( 288,697)	( 856)	(458,000)	( 1,341)	
AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	—	—	13,470	30	
INDUSTRIA REIT	8,070	16	—	—	
SCENTRE GROUP	188,000	784	138,000	573	
WESTFIELD CORP	66,900	651	50,900	502	
NOVION PROPERTY GROUP	—	—	—	—	
			(351,000)	( 856)	
VICINITY CENTRES	73,000	215	32,000	97	
	( 458,000)	( 1,341)			
小計	924,884	3,886	682,467	2,915	
	( 635,268)	( 2,198)	(809,000)	( 2,198)	
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	33,000	39	23,000	26	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	6,900	12	—	—	
GOODMAN PROPERTY TRUST	20,000	25	—	—	

	銘 柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	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
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	9,000 ( 5,425)	14 ( 8)	12,000 ( -)	18 (0.43542)
	PROPERTY FOR INDUSTRY LTD-RIGHTS	- ( 5,425)	- ( 0.43542)	- ( 5,425)	- (0.43542)
	STRIDE PROPERTY LTD	17,000	35	-	-
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	20,000	26	-	-
	小 計	105,900 ( 10,850)	154 ( 8)	35,000 ( 5,425)	44 (0.87084)

\*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 764	百万円 703	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

(2015年6月11日～2016年6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	1,989千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	-千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	-

\* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

### ○利害関係人との取引状況等

(2015年6月11日～2016年6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 4,097	百万円 231	5.6	百万円 3,295	百万円 835	25.3
預金	1,421	1,421	100.0	1,421	1,421	100.0

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

(2016年6月10日現在)

## 外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		比 率
	口 数	口 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
ACADIA REALTY TRUST	10,000	10,900	372	39,936	0.2
AGREE REALTY CORP	2,700	3,500	155	16,699	0.1
ALEXANDERS INC	480	580	212	22,789	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	10,500	11,300	1,109	118,796	0.7
AMERICAN ASSETS TRUST INC	5,400	6,100	252	26,994	0.2
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	16,400	19,900	946	101,385	0.6
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	20,300	28,000	506	54,218	0.3
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	132,300	—	—	—	—
AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC	4,700	—	—	—	—
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	22,500	24,100	986	105,619	0.6
APPLE HOSPITALITY REIT INC	—	24,200	446	47,819	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,100	4,800	62	6,729	0.0
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	3,100	3,595	46	4,936	0.0
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	13,100	12,100	64	6,946	0.0
ASSOCIATED ESTATES REALTY CP	8,400	—	—	—	—
AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,100	21,000	3,575	382,909	2.1
BIOMED REALTY TRUST INC	29,100	—	—	—	—
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	—	2,700	33	3,559	0.0
BOSTON PROPERTIES	22,200	23,600	3,043	326,004	1.8
BRANDYWINE REALTY TRUST	26,300	26,500	433	46,375	0.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	24,800	31,400	818	87,705	0.5
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	25,000	23,500	243	26,099	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	12,600	13,300	1,074	115,108	0.6
CAMPUS CREST COMMUNITIES INC	8,900	—	—	—	—
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	—	12,800	342	36,629	0.2
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	3,800	8,500	117	12,590	0.1
CEDAR REALTY TRUST INC	10,900	12,000	84	9,099	0.1
CHAMBERS STREET PROPERTIES	34,000	—	—	—	—
CHATHAM LODGING TRUST	5,400	5,900	125	13,452	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	8,500	9,200	219	23,460	0.1
CITY OFFICE REIT INC	—	3,300	39	4,184	0.0
COLONY STARWOOD HOMES	—	5,900	166	17,844	0.1
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	18,200	19,300	433	46,404	0.3
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	—	2,000	39	4,232	0.0
CORESITE REALTY CORP	3,700	4,700	390	41,870	0.2
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	13,500	14,600	404	43,329	0.2
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	17,000	18,000	620	66,412	0.4
COUSINS PROPERTIES INC	29,700	30,400	336	36,042	0.2
CUBESMART	23,400	26,500	790	84,633	0.5
CYRUSONE INC	6,700	10,500	555	59,544	0.3
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	12,800	13,600	620	66,433	0.4
DDR CORP	43,200	46,300	810	86,827	0.5

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	%
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	29,300	30,800	280	30,017	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	19,600	22,400	2,303	246,717	1.4
DOUGLAS EMMETT INC	19,600	21,600	741	79,417	0.4
DUKE REALTY CORP	49,800	53,200	1,317	141,075	0.8
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	9,700	11,400	530	56,846	0.3
EPR PROPERTIES	8,200	9,700	723	77,468	0.4
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	1,800	1,800	34	3,653	0.0
EASTGROUP PROPERTIES	4,700	4,900	334	35,774	0.2
EDUCATION REALTY TRUST INC	7,100	9,800	417	44,712	0.2
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	15,900	17,900	349	37,479	0.2
EQUITY COMMONWEALTH	18,600	19,400	569	60,981	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,500	12,300	896	96,033	0.5
EQUITY ONE INC	11,400	14,100	425	45,620	0.3
EQUITY RESIDENTIAL	52,700	56,100	3,616	387,295	2.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,400	10,050	2,103	225,238	1.3
EXCEL TRUST INC	8,800	—	—	—	—
EXTRA SPACE STORAGE INC	16,000	19,200	1,721	184,390	1.0
FARMLAND PARTNERS INC	—	1,800	19	2,141	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,900	10,650	1,673	179,213	1.0
FELCOR LODGING TRUST INC	18,600	20,100	131	14,121	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	15,800	18,000	475	50,971	0.3
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	8,400	8,400	80	8,591	0.0
FOREST CITY REALTY TRUST- A	—	33,100	750	80,400	0.4
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	—	8,526	172	18,445	0.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	12,900	14,100	172	18,468	0.1
GEO GROUP INC/THE	10,700	11,400	386	41,426	0.2
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	12,930	28,000	951	101,869	0.6
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	90,900	89,400	2,466	264,167	1.5
GETTY REALTY CORP	4,100	3,921	83	8,919	0.0
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,100	3,600	60	6,519	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	—	26,500	226	24,294	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	10,000	11,000	227	24,339	0.1
GRAMERCY PROPERTY TRUST INC	8,315	—	—	—	—
GRAMERCY PROPERTY TRUST	—	64,000	589	63,129	0.4
HCP INC	66,700	71,600	2,468	264,405	1.5
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	14,200	15,800	529	56,738	0.3
HEALTH CARE REIT INC	50,600	—	—	—	—
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	18,000	21,000	655	70,194	0.4
HERSHA HOSPITALITY TRUST	29,200	—	—	—	—
HERSHA HOSPITALITY TRUST	—	6,900	127	13,663	0.1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	13,400	14,800	734	78,683	0.4
HOME PROPERTIES INC	8,300	—	—	—	—
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	21,900	23,000	612	65,573	0.4
HOST HOTELS & RESORTS INC	109,600	115,400	1,799	192,682	1.1
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	10,500	13,700	390	41,787	0.2
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	3,300	4,285	33	3,575	0.0
INLAND REAL ESTATE CORP	12,700	—	—	—	—

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	18,200	19,800	128	13,741	0.1
IRON MOUNTAIN INC	27,000	37,100	1,376	147,453	0.8
KILROY REALTY CORP	12,500	14,200	887	95,096	0.5
KIMCO REALTY CORP	59,600	63,500	1,859	199,128	1.1
KITE REALTY GROUP TRUST	12,300	12,700	332	35,582	0.2
LTC PROPERTIES INC	5,200	5,800	284	30,468	0.2
LASALLE HOTEL PROPERTIES	16,500	17,100	394	42,250	0.2
LEXINGTON REALTY TRUST	31,100	32,700	322	34,531	0.2
LIBERTY PROPERTY TRUST	21,700	22,300	860	92,189	0.5
MACERICH CO /THE	20,400	19,400	1,518	162,583	0.9
MACK-CALI REALTY CORP	12,300	13,600	365	39,181	0.2
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	30,600	36,100	545	58,381	0.3
MID-AMERICA APARTMENT COMM	10,900	11,600	1,142	122,347	0.7
MONMOUTH REIT-CLASS A	8,400	10,100	129	13,910	0.1
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	22,900	25,600	251	26,951	0.2
NATL HEALTH INVESTORS INC	4,900	5,300	378	40,511	0.2
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	19,300	21,700	1,039	111,369	0.6
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	—	3,500	74	7,943	0.0
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	9,600	13,200	138	14,787	0.1
NEW YORK REIT INC	24,000	25,000	236	25,275	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	—	3,000	45	4,861	0.0
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	39,490	—	—	—	—
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	—	28,890	401	43,008	0.2
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	—	9,500	105	11,334	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	22,800	25,200	834	89,415	0.5
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,200	2,100	49	5,346	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,800	3,000	310	33,283	0.2
PARKWAY PROPERTIES INC	12,400	12,800	230	24,648	0.1
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	10,500	10,800	283	30,339	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10,000	10,500	233	25,021	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	10,400	20,400	403	43,216	0.2
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,100	22,600	472	50,611	0.3
POST PROPERTIES INC	8,000	8,200	476	51,086	0.3
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	2,900	3,500	50	5,390	0.0
PROLOGIS INC	74,200	80,500	4,014	429,956	2.4
PUBLIC STORAGE	21,050	22,600	5,546	594,053	3.3
QTS REALTY TRUST INC CL A	3,000	7,200	391	41,979	0.2
RLJ LODGING TRUST	19,300	19,500	409	43,899	0.2
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	11,500	12,200	227	24,381	0.1
REALTY INCOME CORP	32,500	38,500	2,463	263,811	1.5
REGENCY CENTERS CORP	13,700	14,900	1,185	127,008	0.7
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	13,500	15,400	321	34,388	0.2
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	34,300	36,400	594	63,700	0.4
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	8,100	10,200	211	22,634	0.1
ROUSE PROPERTIES INC	5,100	5,600	102	11,023	0.1
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,300	7,800	397	42,612	0.2
SL GREEN REALTY CORP	14,300	15,300	1,552	166,288	0.9

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	%	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	8,500	10,200	225	24,197	0.1	
SAUL CENTERS INC	1,600	1,700	99	10,687	0.1	
SELECT INCOME REIT	5,600	9,700	247	26,460	0.1	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	34,300	36,500	695	74,469	0.4	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	—	2,100	103	11,072	0.1	
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	5,700	5,800	93	10,063	0.1	
SIMON PROPERTY GROUP INC	45,050	47,500	9,578	1,025,843	5.7	
SOVRAN SELF STORAGE INC	5,200	7,000	722	77,414	0.4	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	63,200	73,300	873	93,498	0.5	
STAG INDUSTRIAL INC	9,600	10,600	240	25,793	0.1	
STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL TRUST	5,500	—	—	—	—	
STORE CAPITAL CORP	4,200	23,400	626	67,114	0.4	
STRATEGIC HOTELS & RESORTS INC	39,900	—	—	—	—	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	12,900	13,500	165	17,769	0.1	
SUN COMMUNITIES INC	7,300	9,800	679	72,767	0.4	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	30,300	33,500	396	42,480	0.2	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	13,800	14,700	545	58,424	0.3	
TAUBMAN CENTERS INC	9,100	9,300	657	70,389	0.4	
TERRENO REALTY CORP	6,000	6,700	165	17,745	0.1	
TRADE STREET RESIDENTIAL INC	2,400	—	—	—	—	
UDR INC	37,400	41,100	1,385	148,385	0.8	
UMH PROPERTIES INC	3,600	3,600	37	4,048	0.0	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,900	1,900	107	11,464	0.1	
URBAN EDGE PROPERTIES	13,400	14,100	400	42,917	0.2	
URSTADT BIDDLE-CL A	3,900	3,900	90	9,661	0.1	
VENTAS INC	47,900	51,600	3,530	378,113	2.1	
VEREIT INC	—	139,300	1,376	147,400	0.8	
VORNADO REALTY TRUST	25,300	27,200	2,643	283,097	1.6	
WP CAREY INC	14,100	14,800	1,000	107,167	0.6	
WP GLIMCHER INC	26,800	28,400	324	34,705	0.2	
WASHINGTON REAL ESTATE INV	9,600	11,000	338	36,250	0.2	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	16,400	17,500	683	73,189	0.4	
WELLTOWER INC	—	54,500	3,932	421,135	2.4	
WHITESTONE REIT	3,500	4,200	61	6,558	0.0	
WINTHROP REALTY TRUST	—	5,400	52	5,592	0.0	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	16,300	17,300	285	30,590	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	2,810,015	3,096,197	118,619	12,704,126	
	銘柄 数 < 比 率 >	152	156	—	< 70.9% >	
(カナダ)				千カナダドル		
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	5,700	5,700	212	17,853	0.1	
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	10,100	11,100	145	12,221	0.1	
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,700	3,500	191	16,117	0.1	
BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	2,000	2,000	57	4,875	0.0	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,900	—	—	—	—	
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	—	4,900	72	6,136	0.0	
CALLOWAY REAL ESTATE INVESTM	9,400	—	—	—	—	
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	7,900	10,000	308	25,931	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	%	
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	5,100	5,600	261	22,019	0.1	
CHOICE PROPERTIES REIT	6,000	7,000	97	8,178	0.0	
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	12,200	12,000	206	17,360	0.1	
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	9,500	6,000	91	7,655	0.0	
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	7,500	8,400	159	13,402	0.1	
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	5,900	4,400	35	2,997	0.0	
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	8,700	8,400	77	6,485	0.0	
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,400	3,400	133	11,235	0.1	
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	19,700	21,300	470	39,557	0.2	
INNVEST REAL ESTATE INVESTME	7,800	10,400	70	5,939	0.0	
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,200	5,200	40	3,442	0.0	
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	—	4,600	56	4,735	0.0	
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	4,900	10,300	189	15,949	0.1	
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	1,700	21	1,778	0.0	
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4,300	4,300	65	5,475	0.0	
NORTHERN PROPERTY REAL ESTAT	2,400	—	—	—	—	
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	—	3,100	66	5,590	0.0	
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	3,400	4,700	46	3,878	0.0	
ONEREIT	—	6,570	24	2,066	0.0	
PLAZA RETAIL REIT	7,500	7,500	36	3,027	0.0	
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,600	13,600	68	5,776	0.0	
RETROCOM REAL ESTATE INVESTMENT	6,570	—	—	—	—	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,100	24,000	667	56,158	0.3	
SLATE RETAIL REIT	—	2,300	31	2,617	0.0	
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	9,700	348	29,305	0.2	
小 計	口 数 ・ 金 額	202,770	221,670	4,253	357,771	
	銘柄 数 < 比 率 >	27	29	—	< 2.0% >	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND	147,500	156,800	1,161	179,860	1.0	
DERWENT LONDON PLC	15,700	16,800	554	85,899	0.5	
BIG YELLOW GROUP PLC	21,200	23,400	205	31,785	0.2	
HAMMERSON PLC	112,800	120,200	698	108,199	0.6	
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	15,750	14,200	30	4,775	0.0	
MUCKLOW < A & J > GROUP PLC	8,620	—	—	—	—	
INTU PROPERTIES PLC	136,300	124,200	378	58,620	0.3	
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	16,700	—	—	—	—	
SHAFTESBURY PLC	40,200	42,200	390	60,458	0.3	
LAND SECURITIES GROUP PLC	115,700	123,300	1,436	222,361	1.2	
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	50,700	53,400	396	61,336	0.3	
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	—	78,700	45	7,066	0.0	
HANSTEEN HOLDINGS PLC	98,000	108,500	113	17,534	0.1	
SAFESTORE HOLDINGS PLC	29,040	32,540	117	18,133	0.1	
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	83,900	99,500	160	24,875	0.1	
SEGRO PLC	109,000	114,800	509	78,938	0.4	
WORKSPACE GROUP PLC	17,000	17,800	154	23,958	0.1	
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	158,300	193,000	90	13,967	0.1	
TRITAX BIG BOX REIT PLC	87,600	126,000	174	27,072	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	
(イギリス)		口	口	千英ポンド	千円	%
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	—	—	67,200	74	11,468	0.1
ASSURA PLC	142,800	—	254,700	146	22,651	0.1
PRIMARY HEALTH PROPERTIES	—	—	91,000	98	15,213	0.1
REGIONAL REIT LTD	—	—	26,000	27	4,266	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,406,810	1,884,240	6,966	1,078,444	
	銘柄 数 < 比 率 >	19	21	—	< 6.0% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG	6,620	—	9,826	96	11,652	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG	12,300	—	16,300	196	23,738	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	18,920	26,126	292	35,391	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.2% >	
(ユーロ…イタリア)						
BENI STABILI SPA	140,000	—	162,000	105	12,810	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	53,604	—	53,604	43	5,228	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	193,604	215,604	149	18,039	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	2	—	< 0.1% >	
(ユーロ…フランス)						
AFFINE	—	—	900	14	1,771	0.0
ICADE	4,750	—	5,540	370	44,842	0.3
ALTAREA	320	—	320	57	6,921	0.0
ALTAREA-RIGHTS	—	—	315	1	164	0.0
KLEPIERRE	30,516	—	28,856	1,215	147,147	0.8
GECINA SA	5,310	—	5,470	712	86,248	0.5
FONCIERE DES REGIONS	6,890	—	6,800	555	67,269	0.4
ANF IMMOBILIER	1,300	—	1,300	30	3,649	0.0
MERCIALYS	7,980	—	2,580	52	6,301	0.0
FONCIERE DES MURS	—	—	1,300	35	4,286	0.0
UNIBAIL RODAMCO-NA	14,180	—	15,060	3,636	440,021	2.5
小 計	口 数 ・ 金 額	71,246	68,441	6,682	808,625	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	11	—	< 4.5% >	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPRTI-CVA	6,880	—	7,530	315	38,184	0.2
VASTNED RETAIL NV	2,880	—	2,820	110	13,378	0.1
WERELDHAVE NV	5,080	—	6,160	282	34,177	0.2
NSI NV	10,990	—	20,070	79	9,641	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	25,830	36,580	788	95,382	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.5% >	
(ユーロ…スペイン)						
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	5,200	—	9,530	81	9,813	0.1
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	28,155	—	47,055	453	54,834	0.3
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	5,000	—	8,860	112	13,562	0.1
AXIA REAL ESTATE SOCIMI SA-RIGHTS	5,000	—	—	—	—	—
小 計	口 数 ・ 金 額	43,355	65,445	646	78,211	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	3	—	< 0.4% >	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO S. C. A.	2,770	—	3,200	194	23,547	0.1
COFINIMMO	3,010	—	3,110	345	41,849	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…ベルギー)			千ユーロ	千円	%	
RETAIL ESTATES	—	870	69	8,411	0.0	
WERELDHAVE BELGIUM	—	290	34	4,190	0.0	
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	—	1,140	29	3,535	0.0	
WAREHOUSES DE PAUW SCA	1,720	2,070	180	21,870	0.1	
AEDIFICA	1,360	2,238	151	18,334	0.1	
XIOR STUDENT HOUSING NV	—	500	17	2,160	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	8,860	13,418	1,023	123,898	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	8	—	<0.7%>	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC	102,709	100,509	147	17,879	0.1	
HIBERNIA REIT PLC	94,000	108,000	139	16,832	0.1	
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	49,190	52,800	60	7,379	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	245,899	261,309	347	42,091	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.2%>	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	607,714	686,923	9,930	1,201,639	
	銘 柄 数 < 比 率 >	27	33	—	<6.7%>	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	331,000	346,500	17,203	237,411	1.3	
PROSPERITY REIT	180,000	180,000	552	7,625	0.0	
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	140,000	160,000	707	9,759	0.1	
CHAMPION REIT	370,000	339,000	1,383	19,087	0.1	
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	150,000	150,000	634	8,756	0.0	
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	120,000	120,000	232	3,212	0.0	
FORTUNE REIT	202,000	210,000	1,837	25,357	0.1	
NEW CENTURY REIT	65,000	65,000	154	2,125	0.0	
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	105,000	124,000	415	5,732	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,663,000	1,694,500	23,120	319,068	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<1.8%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND MALL TRUST	376,100	412,300	841	66,538	0.4	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	294,500	343,600	804	63,606	0.4	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	301,100	309,300	436	34,500	0.2	
SUNTEC REIT	368,100	381,300	631	49,922	0.3	
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	210,900	230,900	228	18,083	0.1	
STARHILL GLOBAL REIT	211,000	209,900	162	12,869	0.1	
ASCOTT RESIDENCE TRUST	124,700	124,000	141	11,182	0.1	
FRASERS COMMERCIAL TRUST	70,000	85,000	110	8,708	0.0	
KEPPEL REIT	247,700	274,000	290	22,976	0.1	
FRASERS CENTREPOINT TRUST	79,600	90,100	180	14,255	0.1	
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	170,000	153,300	84	6,670	0.0	
CDL HOSPITALITY TRUSTS	99,000	110,400	157	12,445	0.1	
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	87,500	110,000	169	13,401	0.1	
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	87,900	83,500	105	8,323	0.0	
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	50,000	59,000	145	11,482	0.1	
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	298,800	282,800	96	7,606	0.0	
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	171,800	177,000	284	22,543	0.1	
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	193,200	212,500	307	24,291	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	%	
CACHE LOGISTICS TRUST	110,000	127,000	109	8,690	0.0	
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	81,600	89,400	122	9,724	0.1	
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	100,000	94,200	56	4,471	0.0	
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	249,700	271,900	270	21,402	0.1	
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	129,000	129,000	85	6,786	0.0	
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	118,000	140,000	85	6,755	0.0	
SPH REIT	105,000	120,500	112	8,865	0.0	
OUE HOSPITALITY TRUST	115,000	155,743	105	8,316	0.0	
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	77,000	97,000	67	5,333	0.0	
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	43,000	79,650	52	4,190	0.0	
FRASERS HOSPITALITY TRUST	71,000	88,000	69	5,464	0.0	
KEPPEL DC REIT	133,800	145,000	155	12,331	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	4,775,000	5,186,293	6,468	511,742	
	銘柄 数 < 比 率 >	30	30	—	< 2.9% >	
(オーストラリア)			千豪ドル			
BWP TRUST	74,000	73,000	269	21,382	0.1	
MIRVAC GROUP	531,000	555,000	1,121	88,992	0.5	
INVESTA OFFICE FUND	91,000	94,000	407	32,309	0.2	
CROMWELL PROPERTY GROUP	183,000	204,000	217	17,246	0.1	
CHARTER HALL RETAIL REIT	43,000	53,000	260	20,699	0.1	
ASPEN GROUP	13,000	13,000	15	1,253	0.0	
GPT GROUP	256,000	277,000	1,509	119,836	0.7	
ABACUS PROPERTY GROUP	33,066	45,000	147	11,716	0.1	
ALE PROPERTY GROUP	26,600	26,000	114	9,081	0.1	
STOCKLAND TRUST GROUP	343,000	364,000	1,732	137,536	0.8	
DEXUS PROPERTY GROUP	138,000	146,000	1,305	103,609	0.6	
GOODMAN GROUP	224,000	243,000	1,771	140,619	0.8	
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	10,000	7,000	48	3,822	0.0	
360 CAPITAL GROUP LTD	42,450	42,450	38	3,032	0.0	
CHARTER HALL GROUP	46,000	53,000	278	22,129	0.1	
GALILEO JAPAN TRUST	18,170	18,170	46	3,692	0.0	
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26,550	26,550	89	7,123	0.0	
INGENIA COMMUNITIES GROUP	133,714	22,285	66	5,253	0.0	
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	88,920	109,100	259	20,611	0.1	
FEDERATION CENTRES	190,000	—	—	—	—	
ARENA REIT	35,220	35,220	71	5,675	0.0	
AUSTRALIAN INDUSTRIAL REIT	13,470	—	—	—	—	
INDUSTRIA REIT	10,330	18,400	39	3,111	0.0	
NATIONAL STORAGE REIT	44,860	44,860	84	6,694	0.0	
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	22,680	22,680	72	5,743	0.0	
GDI PROPERTY GROUP	70,300	70,300	63	5,078	0.0	
360 CAPITAL OFFICE FUND	11,100	11,100	25	2,008	0.0	
SCENTRE GROUP	769,000	819,000	3,849	305,557	1.7	
WESTFIELD CORP	276,000	292,000	3,139	249,173	1.4	
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	33,250	33,250	87	6,941	0.0	
NOVION PROPERTY GROUP	351,000	—	—	—	—	

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	—	—	499,000	1,651	131,111	0.7
小 計	口 数 ・ 金 額	4,148,680	4,217,365	18,783	1,491,045	
	銘柄 数 < 比 率 >	31	29	—	< 8.3% >	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	148,571	158,571	204	15,581	0.1	
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	32,400	39,300	89	6,825	0.0	
GOODMAN PROPERTY TRUST	150,000	170,000	226	17,286	0.1	
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD	65,100	67,525	112	8,589	0.0	
STRIDE PROPERTY LTD	41,000	58,000	129	9,829	0.1	
ARGOSY PROPERTY LTD	119,000	119,000	141	10,786	0.1	
KIWI PROPERTY GROUP LTD	170,000	190,000	285	21,708	0.1	
小 計	口 数 ・ 金 額	726,071	802,396	1,189	90,607	
	銘柄 数 < 比 率 >	7	7	—	< 0.5% >	
(イスラエル)				千新シケル		
REIT 1 LTD	22,490	22,490	263	7,365	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	22,490	22,490	263	7,365	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	16,362,550	17,812,074	—	17,761,810	
	銘柄 数 < 比 率 >	303	315	—	< 99.2% >	

\* 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投資信託証券評価額の比率。

\* 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	百万円	百万円
	DJREA	120	—
	FTEPR	16	—

\* 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

(2016年6月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 17,761,810	% 99.0
コール・ローン等、その他	173,940	1.0
投資信託財産総額	17,935,750	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（17,887,906千円）の投資信託財産総額（17,935,750千円）に対する比率は99.7%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=107.10円、1カナダドル=84.11円、1英ポンド=154.80円、1ユーロ=121.01円、1香港ドル=13.80円、1シンガポールドル=79.11円、1豪ドル=79.38円、1ニュージーランドドル=76.17円、1新シェケル=27.92円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年6月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	17,953,613,418
コール・ローン等	108,380,698
投資証券(評価額)	17,761,810,092
未収入金	23,919,900
未収配当金	20,975,704
差入委託証拠金	38,527,024
(B) 負債	41,790,137
未払金	30,696,836
未払解約金	10,564,552
未払利息	49
その他未払費用	528,700
(C) 純資産総額(A-B)	17,911,823,281
元本	8,726,852,013
次期繰越損益金	9,184,971,268
(D) 受益権総口数	8,726,852,013口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,525円

(注) 期首元本額は8,313,561,755円、期中追加設定元本額は2,612,081,279円、期中一部解約元本額は2,198,791,021円、1口当たり純資産額は2.0525円です。

## ○損益の状況 (2015年6月11日～2016年6月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	656,403,294
受取配当金	656,369,937
受取利息	41,430
その他収益金	64
支払利息	△ 8,137
(B) 有価証券売買損益	△1,125,061,425
売買益	2,018,703,456
売買損	△3,143,764,881
(C) 先物取引等取引損益	13,533,653
取引益	21,367,651
取引損	△ 7,833,998
(D) 保管費用等	△ 8,117,788
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 463,242,266
(F) 前期繰越損益金	9,249,724,282
(G) 追加信託差損益金	2,791,007,755
(H) 解約差損益金	△2,392,518,503
(I) 計(E+F+G+H)	9,184,971,268
次期繰越損益金(I)	9,184,971,268

\*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）	3,178,764,925
野村インデックスファンド・外国REIT	1,616,063,695
野村世界6資産分散投信（安定コース）	921,783,364
野村世界6資産分散投信（成長コース）	800,864,438
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	669,414,123
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）	644,045,803
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT（適格機関投資家専用）	374,130,662
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	177,705,878
野村DC運用戦略ファンド	115,624,936
ネクストコア	76,027,778
野村資産設計ファンド2040	31,534,742
野村資産設計ファンド2015	30,005,573
野村資産設計ファンド2030	25,734,439
野村資産設計ファンド2020	21,824,621
野村資産設計ファンド2025	20,337,873
野村資産設計ファンド2035	16,946,146
野村資産設計ファンド2045	2,880,531
野村資産設計ファンド2050	1,569,713
野村DC運用戦略ファンドA	1,165,688
野村DC運用戦略ファンドM	427,085

## ○お知らせ

有価証券の指図範囲に新投資口予約権証券を加える所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年8月3日＞