# 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（2015年12月23日～2016年６月22日）　第22期（決算日2016年１月22日）　第23期（決算日2016年２月22日）　第24期（決算日2016年３月22日）
第25期（決算日2016年４月22日）　第26期（決算日2016年５月23日）　第27期（決算日2016年６月23日）

2020／2025／2030／2035／2040　作成対象期間（2015年12月23日～2016年６月22日）　第17期（決算日2016年６月22日）
2045　作成対象期間（2015年12月23日～2016年６月22日）　第12期（決算日2016年６月22日）
2050　作成対象期間（2015年12月23日～2016年６月22日）　第２期（決算日2016年６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。

| | | 野村資産設計ファンド | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 2015 | 2020 | 2025 | 2030 | 2035 | 2040 | 2045 | 2050 |
| 商品分類 | 追加型投信／内外／資産複合／インデックス型 | | | | | | | | |
| 信託期間 | 2007年６月11日以降、無期限とします。(2015／2020／2025／2030／2035／2040)<br>2010年９月10日以降、無期限とします。(2045)<br>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行います。<br>＜2015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（野村資産設計ファンド2050は設定日時点）＞ | | | | | | | | |
| | | 2015 | 2020 | 2025 | 2030 | 2035 | 2040 | 2045 | 2050 |
| | 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 60% | 45% | 35% | 25% | 20% | 15% | 12.5% | 10% |
| | 外国債券マザーファンド | 10% | 12.1% | 12.1% | 12.1% | 12.1% | 12.1% | 10.1% | 8.1% |
| | 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | | 2.9% | 2.9% | 2.9% | 2.9% | 2.9% | 2.4% | 1.9% |
| | 国内株式マザーファンド | 10% | 15% | 20% | 22.5% | 25% | 30% | 32.5% | 35% |
| | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 10% | 9.1% | 12.1% | 13.6% | 15.2% | 18.2% | 19.7% | 21.2% |
| | 新興国株式マザーファンド | | 5.9% | 7.9% | 8.9% | 9.8% | 11.8% | 12.8% | 13.8% |
| | J－REITインデックス マザーファンド | ５％ | ５％ | ５％ | 7.5% | 7.5% | ５％ | ５％ | ５％ |
| | 海外REITインデックス マザーファンド | ５％ | ５％ | ５％ | 7.5% | 7.5% | 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NOMURA-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。<br>※「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。 | | | | | | | | |

| | 主な投資対象 | 主な投資制限 |
|---|---|---|
| 野村資産設計ファンド | 「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NOMURA-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6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

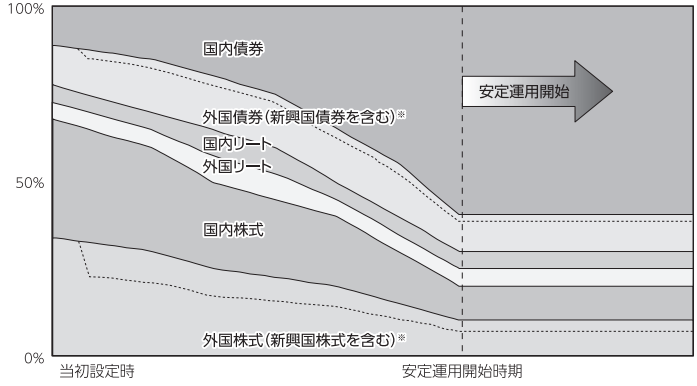

１．国内株式マザーファンド 運用報告書　245ページ
２．外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 運用報告書　279ページ
３．新興国株式マザーファンド 運用報告書　323ページ
４．国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド 運用報告書　354ページ
５．外国債券マザーファンド 運用報告書　384ページ
６．新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド 運用報告書　406ページ
７．J－REITインデックス マザーファンド 運用報告書　417ページ
８．海外REITインデックス マザーファンド 運用報告書　427ページ

## ◎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。

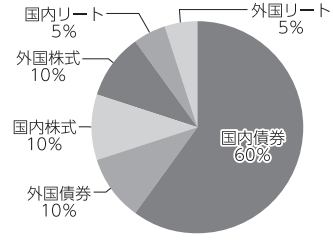
（２）各ファンドには、それぞれ安定運用開始時期（ターゲットイヤー）が定められており、当初設定以降、安定運用開始時期に近づくにしたがって、定期的に株式の実質組み入れの漸減と公社債の実質組み入れの漸増を行い、リスクの漸減を図ることを基本とします。なお、各資産への資産配分比率の最終決定は、家計や市場の構造変化等を考慮した上で行います。

■基本投資割合のイメージ図




※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。

■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。

| 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・マーケッツ・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・マーケッツ・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15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 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 13期(2014年6月23日) | 9,958 | 0 | 2.6 | 104.19 | 3.0 | 24.0 | 0.4 | 64.8 | － | 10.2 | 2,065 |
| 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22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24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 |

＊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。

| | ’13年７月～’14年６月末 | ’14年７月～’15年６月22日 | ’15年６月22日の翌日以降(注1) |
|---|---|---|---|
| ［国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド］<br>NOMURA-BPI総合 | 54% | 57% | 60% |
| ［外国債券マザーファンド］<br>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% | 8.8% | 10%(注2) |
| ［新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド］<br>JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 2.4% | 2.2% | |
| ［国内株式マザーファンド］<br>東証株価指数（TOPIX） | 12% | 11% | 10% |
| ［外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド］<br>MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 7.4% | 6.7% | 10%(注2) |
| ［新興国株式マザーファンド］<br>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） | 4.6% | 4.3% | |
| ［J－REITインデックス マザーファンド］<br>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］<br>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。
（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。

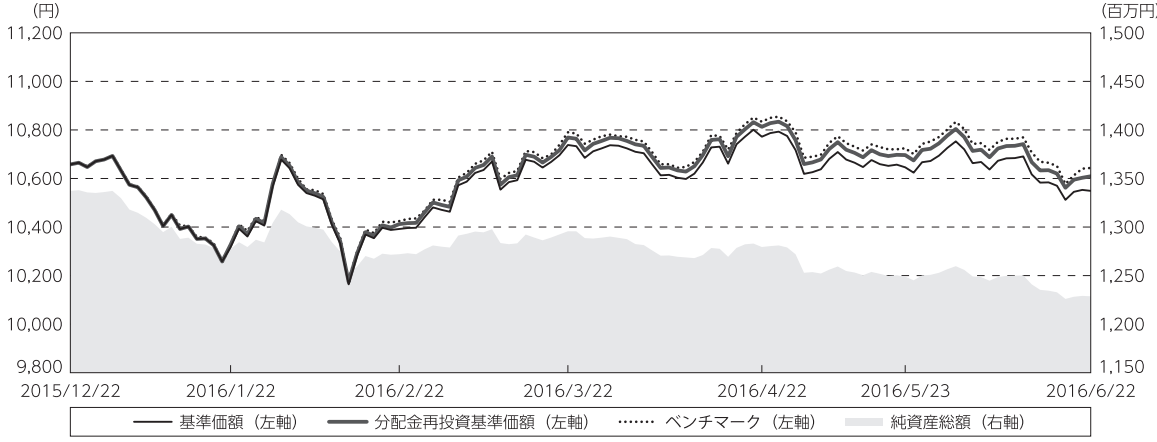
## ○当作成期中の基準価額と市況等の推移

| 決算期 | 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | ベンチマーク | 騰落率 | 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 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 第22期 | (期首)<br>2015年12月22日 | 10,658 | － | 113.35 | － | 18.7 | 0.4 | 70.0 | － | 10.0 |
| | 12月末 | 10,693 | 0.3 | 113.74 | 0.3 | 18.9 | 0.4 | 69.6 | － | 10.0 |
| | (期末)<br>2016年1月22日 | 10,327 | △3.1 | 109.83 | △3.1 | 17.6 | 0.3 | 71.4 | － | 9.5 |
| 第23期 | (期首)<br>2016年1月22日 | 10,317 | － | 109.83 | － | 17.6 | 0.3 | 71.4 | － | 9.5 |
| | 1月末 | 10,568 | 2.4 | 112.46 | 2.4 | 17.9 | 0.4 | 70.2 | － | 9.8 |
| | (期末)<br>2016年2月22日 | 10,402 | 0.8 | 110.87 | 0.9 | 18.3 | 0.4 | 70.6 | － | 10.0 |
| 第24期 | (期首)<br>2016年2月22日 | 10,392 | － | 110.87 | － | 18.3 | 0.4 | 70.6 | － | 10.0 |
| | 2月末 | 10,471 | 0.8 | 111.80 | 0.8 | 18.2 | 0.4 | 69.9 | － | 10.0 |
| | (期末)<br>2016年3月22日 | 10,748 | 3.4 | 114.76 | 3.5 | 20.1 | 0.4 | 68.6 | － | 10.2 |
| 第25期 | (期首)<br>2016年3月22日 | 10,738 | － | 114.76 | － | 20.1 | 0.4 | 68.6 | － | 10.2 |
| | 3月末 | 10,724 | △0.1 | 114.56 | △0.2 | 20.0 | 0.4 | 68.4 | － | 10.2 |
| | (期末)<br>2016年4月22日 | 10,782 | 0.4 | 115.22 | 0.4 | 19.7 | 0.4 | 69.5 | － | 9.8 |
| 第26期 | (期首)<br>2016年4月22日 | 10,772 | － | 115.22 | － | 19.7 | 0.4 | 69.5 | － | 9.8 |
| | 4月末 | 10,717 | △0.5 | 114.75 | △0.4 | 19.2 | 0.4 | 69.6 | － | 9.9 |
| | (期末)<br>2016年5月23日 | 10,656 | △1.1 | 114.06 | △1.0 | 19.0 | 0.5 | 69.8 | － | 9.9 |
| 第27期 | (期首)<br>2016年5月23日 | 10,646 | － | 114.06 | － | 19.0 | 0.5 | 69.8 | － | 9.9 |
| | 5月末 | 10,753 | 1.0 | 115.22 | 1.0 | 19.3 | 0.5 | 69.3 | － | 10.0 |
| | (期末)<br>2016年6月22日 | 10,559 | △0.8 | 113.20 | △0.8 | 18.4 | 0.5 | 70.5 | － | 9.9 |

＊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22期首：10,658円
第27期末：10,549円（既払分配金(税込み)：60円）
騰　落　率：△ 0.5%（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（2015年12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（2015年12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22期首10,658円から第27期末10,549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下がり額は49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（－15.3%）、外国株式（－10.6%）、新興国株式（－9.3%）、外国債券（－9.2%）、外国REIT（－4.7%）、新興国債券（－4.6%）が下落し、国内REIT（＋6.4%）、国内債券（＋5.5%）は上昇しました。

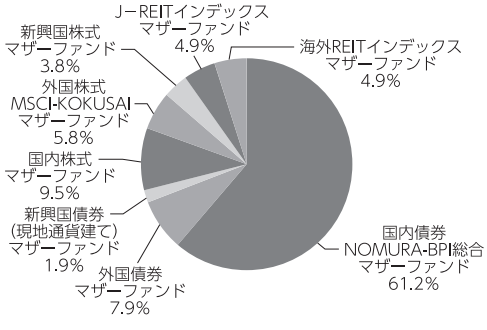
国内株式や外国債券などの下落が主な値下がり要因となりました。

## ○投資環境

| 資　　産 | 変動要因等 |
|---|---|
| 国内債券 | 国内株式市場の下落に伴い安全資産とされる国債への需要が高まったこと、日銀による国債買入れの平均残存年限の長期化やマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入などを背景に、国内債券利回りは長期債・超長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。 |
| 外国債券 | 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。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおける現大統領の弾劾手続き進展に伴う政治停滞からの脱却期待や、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、新興国債券利回りは南米を中心に低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）しました。 |
| 国内株式 | 円高基調に伴う国内輸出関連企業の業績改善期待の後退や、日銀による追加金融緩和への期待感の剥落などを背景に、下落しました。 |
| 外国株式 | 景気回復の弱さなどから欧州株式市場は下落しましたが、原油価格上昇に伴う資源関連企業の業績回復期待や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、外国株式市場は米国を中心に上昇しました。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおいて現大統領の弾劾手続き進展に伴い政権交代による経済改革への期待が高まったことや、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、中南米を中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）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、国内長期金利の低下などを背景に、上昇しました。 |
| 外国REIT | 海外長期金利の低下などを背景に、米国を中心に上昇しました。為替レートは、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

＜投資比率（2016年６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左記の通りとしました。また、当運用期間を通じて、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。

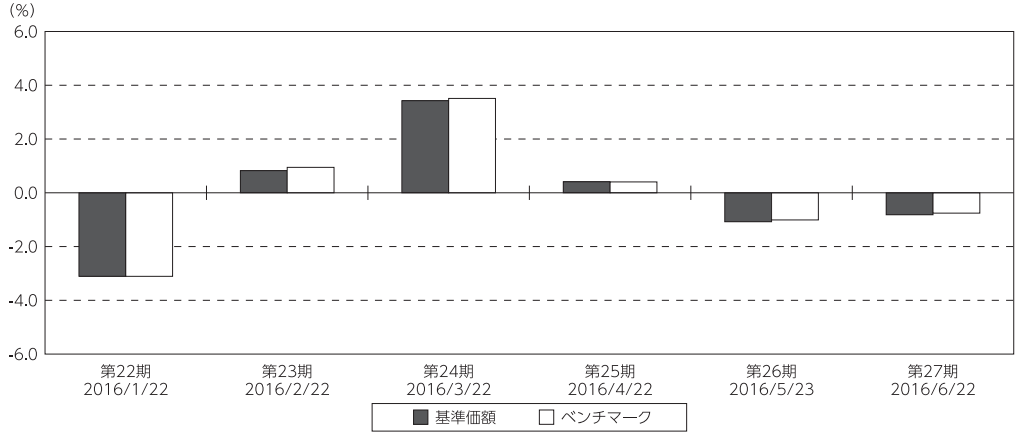
## ○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率※は－0.5%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－0.1%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。

※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22期 | 第23期 | 第24期 | 第25期 | 第26期 | 第27期 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 2015年12月23日～2016年１月22日 | 2016年１月23日～2016年２月22日 | 2016年２月23日～2016年３月22日 | 2016年３月23日～2016年４月22日 | 2016年４月23日～2016年５月23日 | 2016年５月24日～2016年６月22日 |
| 当期分配金 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 | 10 |
| （対基準価額比率） | 0.097% | 0.096% | 0.093% | 0.093% | 0.094% | 0.095% |
| 当期の収益 | 8 | 10 | 10 | 10 | 4 | 8 |
| 当期の収益以外 | 1 | － | － | － | 5 | 1 |
| 翌期繰越分配対象額 | 1,524 | 1,527 | 1,533 | 1,545 | 1,539 | 1,538 |

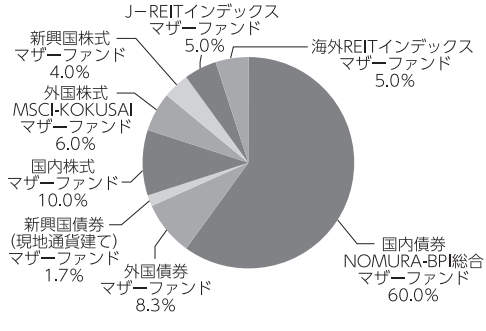
（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎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。

＜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 (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | ベンチマーク | 期中騰落率 | 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 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 13期(2014年6月23日) | 9,703 | 0 | 2.9 | 100.99 | 3.2 | 33.9 | 0.6 | 54.7 | － | 10.2 | 1,131 |
| 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 |

＊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。

| | ’13年７月～’14年６月末 | ’14年７月～’15年６月末 | ’15年７月以降 |
|---|---|---|---|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]<br>NOMURA-BPI総合 | 41% | 43% | 45% |
| [外国債券マザーファンド]<br>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% | 12.1% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]<br>JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | ３% | ３% | 2.9% |
| [国内株式マザーファンド]<br>東証株価指数（TOPIX） | 17% | 16% | 15% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]<br>MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 10.5% | 9.8% | 9.1% |
| [新興国株式マザーファンド]<br>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) | 6.5% | 6.2% | 5.9% |
| [J－REITインデックス マザーファンド]<br>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]<br>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。

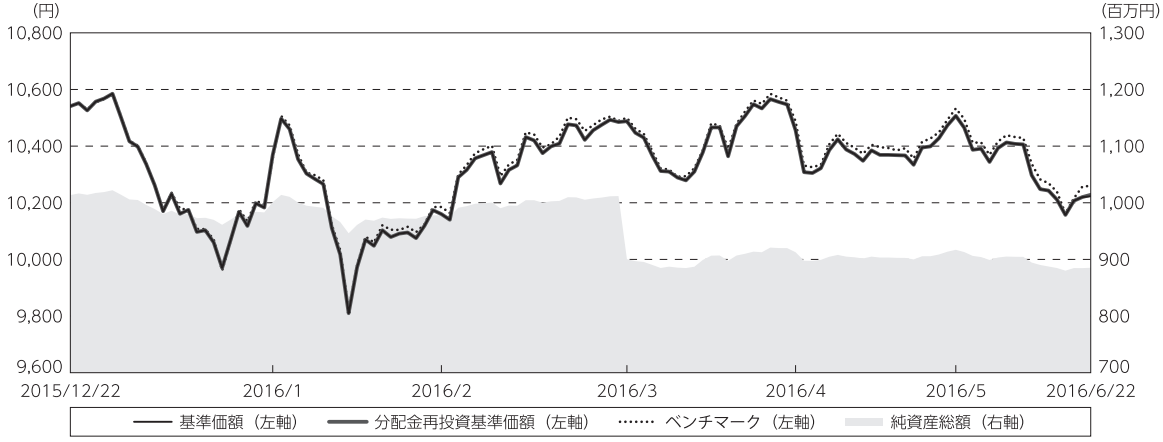
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 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 | 投資信託証券組入比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | | | | |
| (期　首) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2015年12月22日 | 10,541 | － | 110.97 | － | 28.3 | 0.6 | 60.2 | － | 10.1 |
| 12月末 | 10,585 | 0.4 | 111.44 | 0.4 | 28.5 | 0.6 | 59.9 | － | 10.2 |
| 2016年１月末 | 10,369 | △1.6 | 109.03 | △1.7 | 27.2 | 0.6 | 60.8 | － | 10.0 |
| ２月末 | 10,160 | △3.6 | 107.22 | △3.4 | 27.6 | 0.6 | 60.3 | － | 10.2 |
| ３月末 | 10,488 | △0.5 | 110.54 | △0.4 | 29.8 | 0.6 | 58.4 | － | 10.2 |
| ４月末 | 10,456 | △0.8 | 110.41 | △0.5 | 28.9 | 0.6 | 59.7 | － | 10.1 |
| ５月末 | 10,507 | △0.3 | 110.88 | △0.1 | 29.0 | 0.8 | 59.4 | － | 10.1 |
| (期　末) | | | | | | | | | |
| 2016年６月22日 | 10,228 | △3.0 | 108.01 | △2.7 | 27.9 | 0.7 | 60.6 | － | 10.0 |

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

# ◎運用経過

## ○期中の基準価額等の推移




期　首：10,541円
期　末：10,223円（既払分配金(税込み)：５円）
騰落率：△ 3.0%（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（2015年12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（2015年12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10,541円から期末10,228円（分配金込み）と313円の値下がりとなりました。

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（－15.3%）、外国株式（－10.6%）、新興国株式（－9.3%）、外国債券（－9.2%）、外国REIT（－4.7%）、新興国債券（－4.6%）が下落し、国内REIT（＋6.4%）、国内債券（＋5.5%）は上昇しました。

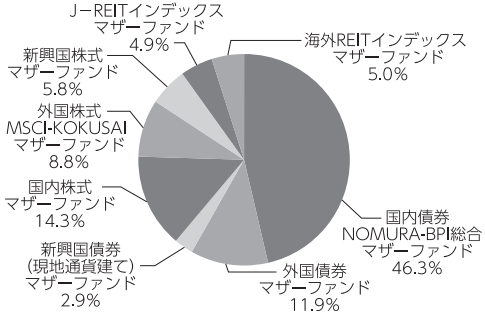
国内株式や外国債券などの下落が主な値下がり要因となりました。

## ○投資環境

| 資　　産 | 変動要因等 |
|---|---|
| 国内債券 | 国内株式市場の下落に伴い安全資産とされる国債への需要が高まったこと、日銀による国債買入れの平均残存年限の長期化やマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入などを背景に、国内債券利回りは長期債・超長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。 |
| 外国債券 | 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。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおける現大統領の弾劾手続き進展に伴う政治停滞からの脱却期待や、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、新興国債券利回りは南米を中心に低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）しました。 |
| 国内株式 | 円高基調に伴う国内輸出関連企業の業績改善期待の後退や、日銀による追加金融緩和への期待感の剥落などを背景に、下落しました。 |
| 外国株式 | 景気回復の弱さなどから欧州株式市場は下落しましたが、原油価格上昇に伴う資源関連企業の業績回復期待や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、外国株式市場は米国を中心に上昇しました。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおいて現大統領の弾劾手続き進展に伴い政権交代による経済改革への期待が高まったことや、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、中南米を中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）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、国内長期金利の低下などを背景に、上昇しました。 |
| 外国REIT | 海外長期金利の低下などを背景に、米国を中心に上昇しました。為替レートは、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

＜投資比率（2016年６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。

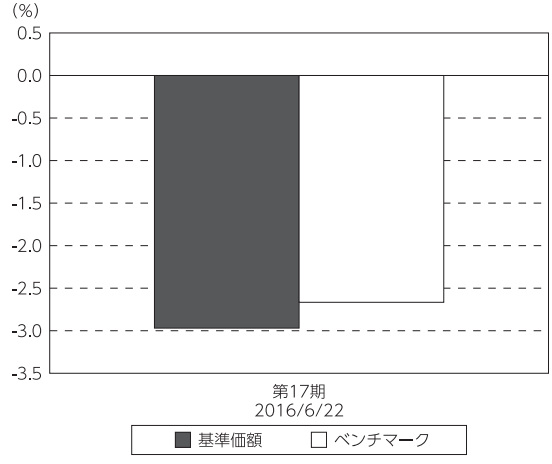
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○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－3.0%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－2.7%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17期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| 当期分配金 | 5 |
| (対基準価額比率) | 0.049% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | － |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,302 |

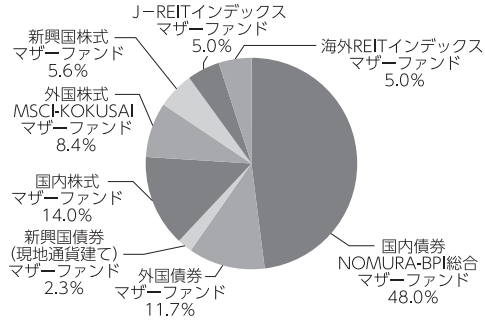
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎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。

＜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 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 13期(2014年6月23日) | 9,690 | 0 | 3.4 | 100.54 | 3.7 | 41.7 | 0.7 | 44.8 | － | 12.2 | 995 |
| 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 |

＊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。

| | ’13年７月～’14年６月末 | ’14年７月～’15年６月末 | ’15年７月以降 |
|---|---|---|---|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]<br>NOMURA-BPI総合 | 31% | 33% | 35% |
| [外国債券マザーファンド]<br>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% | 12.1% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]<br>JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | ３% | ３% | 2.9% |
| [国内株式マザーファンド]<br>東証株価指数（TOPIX） | 21% | 20.5% | 20% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]<br>MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 13% | 12.5% | 12.1% |
| [新興国株式マザーファンド]<br>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% | ８% | 7.9% |
| [J－REITインデックス マザーファンド]<br>東証REIT指数（配当込み） | ６% | 5.5% | ５% |
| [海外REITインデックス マザーファンド]<br>S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース) | ６% | 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。

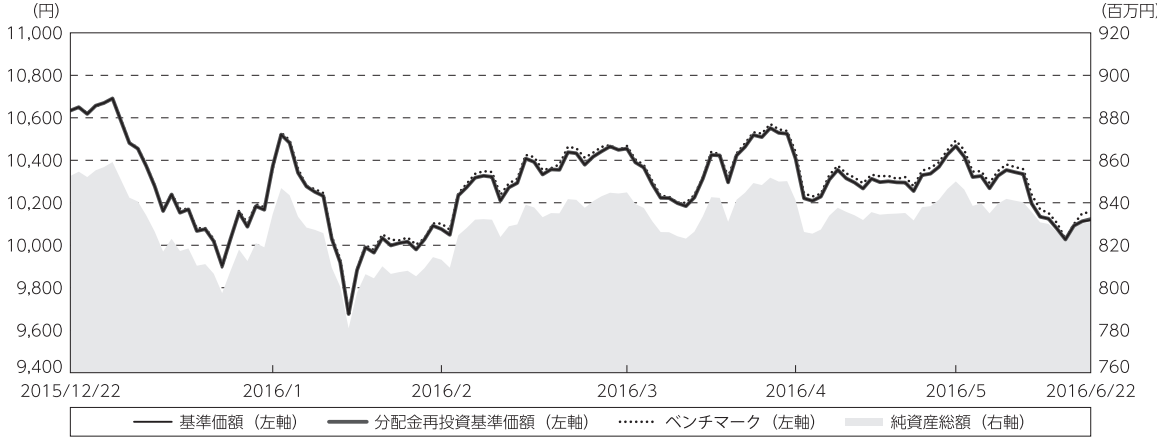
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 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 | 投資信託証券組入比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | | | | |
| (期　首) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2015年12月22日 | 10,634 | － | 111.45 | － | 37.9 | 0.8 | 50.4 | － | 10.2 |
| 12月末 | 10,691 | 0.5 | 112.07 | 0.6 | 38.2 | 0.8 | 50.0 | － | 10.3 |
| 2016年１月末 | 10,372 | △2.5 | 108.58 | △2.6 | 36.6 | 0.8 | 51.2 | － | 10.1 |
| ２月末 | 10,076 | △5.2 | 105.88 | △5.0 | 37.2 | 0.8 | 50.5 | － | 10.4 |
| ３月末 | 10,455 | △1.7 | 109.70 | △1.6 | 39.6 | 0.8 | 48.5 | － | 10.3 |
| ４月末 | 10,408 | △2.1 | 109.40 | △1.8 | 38.6 | 0.9 | 49.7 | － | 10.2 |
| ５月末 | 10,467 | △1.6 | 109.97 | △1.3 | 38.7 | 1.0 | 49.4 | － | 10.2 |
| (期　末) | | | | | | | | | |
| 2016年６月22日 | 10,123 | △4.8 | 106.43 | △4.5 | 37.4 | 1.0 | 50.7 | － | 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：10,634円
期　末：10,118円（既払分配金(税込み)：５円）
騰落率：△ 4.8%（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（2015年12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（2015年12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10,634円から期末10,123円（分配金込み）と511円の値下がりとなりました。

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（－15.3%）、外国株式（－10.6%）、新興国株式（－9.3%）、外国債券（－9.2%）、外国REIT（－4.7%）、新興国債券（－4.6%）が下落し、国内REIT（＋6.4%）、国内債券（＋5.5%）は上昇しました。

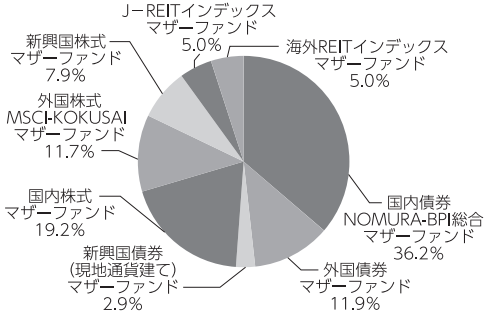
国内株式や外国株式などの下落が主な値下がり要因となりました。

## ○投資環境

| 資　　産 | 変動要因等 |
|---|---|
| 国内債券 | 国内株式市場の下落に伴い安全資産とされる国債への需要が高まったこと、日銀による国債買入れの平均残存年限の長期化やマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入などを背景に、国内債券利回りは長期債・超長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。 |
| 外国債券 | 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。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおける現大統領の弾劾手続き進展に伴う政治停滞からの脱却期待や、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、新興国債券利回りは南米を中心に低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）しました。 |
| 国内株式 | 円高基調に伴う国内輸出関連企業の業績改善期待の後退や、日銀による追加金融緩和への期待感の剥落などを背景に、下落しました。 |
| 外国株式 | 景気回復の弱さなどから欧州株式市場は下落しましたが、原油価格上昇に伴う資源関連企業の業績回復期待や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、外国株式市場は米国を中心に上昇しました。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおいて現大統領の弾劾手続き進展に伴い政権交代による経済改革への期待が高まったことや、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、中南米を中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）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、国内長期金利の低下などを背景に、上昇しました。 |
| 外国REIT | 海外長期金利の低下などを背景に、米国を中心に上昇しました。為替レートは、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

＜投資比率（2016年６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。

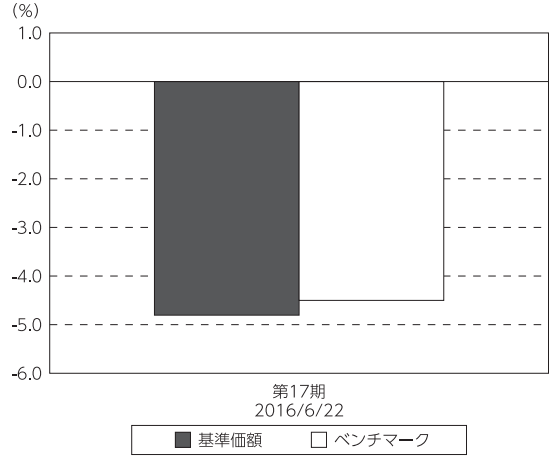
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○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－4.8%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－4.5%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17期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| 当期分配金 | 5 |
| （対基準価額比率） | 0.049% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | － |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,455 |

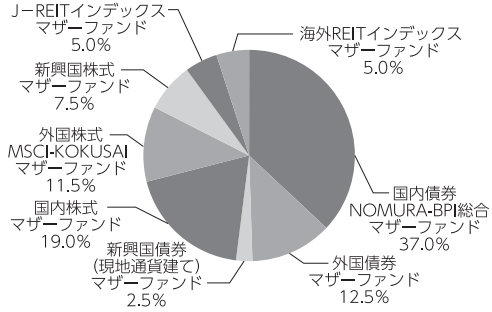
（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎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。

＜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 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 13期(2014年6月23日) | 9,696 | 0 | 3.9 | 100.21 | 4.1 | 46.5 | 0.8 | 36.9 | － | 15.2 | 801 |
| 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 |

＊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。

| | ’13年７月～’14年６月末 | ’14年７月～’15年６月末 | ’15年７月以降 |
|---|---|---|---|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]<br>NOMURA-BPI総合 | 23% | 24% | 25% |
| [外国債券マザーファンド]<br>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% | 12.1% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]<br>JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | ３% | ３% | 2.9% |
| [国内株式マザーファンド]<br>東証株価指数（TOPIX） | 23.5% | 23% | 22.5% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]<br>MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 14.6% | 14.1% | 13.6% |
| [新興国株式マザーファンド]<br>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% | 8.9% |
| [Ｊ－REITインデックス マザーファンド]<br>東証REIT指数（配当込み） | 7.5% | 7.5% | 7.5% |
| [海外REITインデックス マザーファンド]<br>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% | 7.5% |

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。

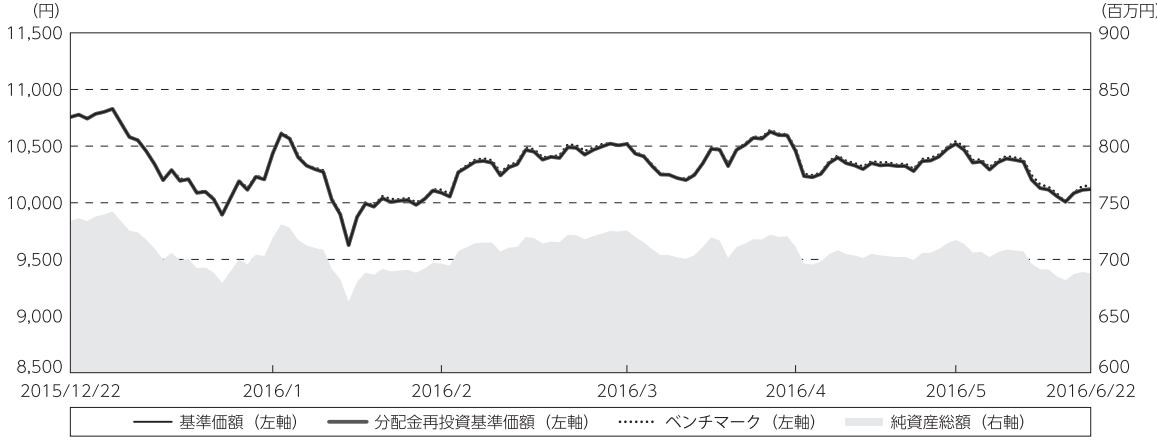
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 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 | 投資信託証券組入比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | | | | |
| (期　首) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2015年12月22日 | 10,756 | － | 112.24 | － | 42.7 | 0.9 | 40.4 | － | 15.3 |
| 12月末 | 10,829 | 0.7 | 113.01 | 0.7 | 43.0 | 0.9 | 40.0 | － | 15.3 |
| 2016年１月末 | 10,436 | △3.0 | 108.78 | △3.1 | 41.5 | 0.9 | 41.2 | － | 15.2 |
| ２月末 | 10,088 | △6.2 | 105.55 | △6.0 | 42.0 | 0.9 | 40.4 | － | 15.6 |
| ３月末 | 10,519 | △2.2 | 109.87 | △2.1 | 44.4 | 0.9 | 38.7 | － | 15.2 |
| ４月末 | 10,457 | △2.8 | 109.41 | △2.5 | 43.5 | 1.0 | 39.7 | － | 15.1 |
| ５月末 | 10,520 | △2.2 | 110.02 | △2.0 | 43.5 | 1.2 | 39.5 | － | 15.1 |
| (期　末) | | | | | | | | | |
| 2016年６月22日 | 10,121 | △5.9 | 105.93 | △5.6 | 42.3 | 1.1 | 40.6 | － | 15.3 |

＊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：10,756円
期　末：10,116円（既払分配金(税込み)：５円）
騰落率：△ 5.9%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2015年12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（2015年12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10,756円から期末10,121円（分配金込み）と635円の値下がりとなりました。

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（－15.3%）、外国株式（－10.6%）、新興国株式（－9.3%）、外国債券（－9.2%）、外国REIT（－4.7%）、新興国債券（－4.6%）が下落し、国内REIT（＋6.4%）、国内債券（＋5.5%）は上昇しました。

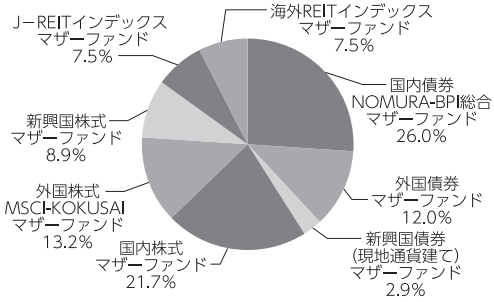
国内株式や外国株式などの下落が主な値下がり要因となりました。

## ○投資環境

| 資　　産 | 変動要因等 |
|---|---|
| 国内債券 | 国内株式市場の下落に伴い安全資産とされる国債への需要が高まったこと、日銀による国債買入れの平均残存年限の長期化やマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入などを背景に、国内債券利回りは長期債・超長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。 |
| 外国債券 | 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。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおける現大統領の弾劾手続き進展に伴う政治停滞からの脱却期待や、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、新興国債券利回りは南米を中心に低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）しました。 |
| 国内株式 | 円高基調に伴う国内輸出関連企業の業績改善期待の後退や、日銀による追加金融緩和への期待感の剥落などを背景に、下落しました。 |
| 外国株式 | 景気回復の弱さなどから欧州株式市場は下落しましたが、原油価格上昇に伴う資源関連企業の業績回復期待や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、外国株式市場は米国を中心に上昇しました。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおいて現大統領の弾劾手続き進展に伴い政権交代による経済改革への期待が高まったことや、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、中南米を中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）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、国内長期金利の低下などを背景に、上昇しました。 |
| 外国REIT | 海外長期金利の低下などを背景に、米国を中心に上昇しました。為替レートは、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

＜投資比率（2016年６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。

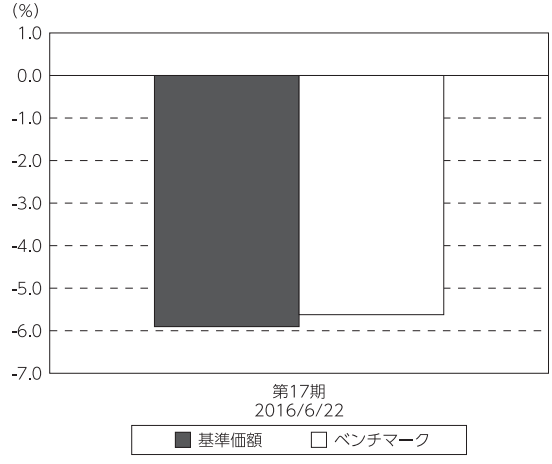
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○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－5.9%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－5.6%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17期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| 当期分配金 | 5 |
| （対基準価額比率） | 0.049% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | － |
| 翌期繰越分配対象額 | 3,045 |

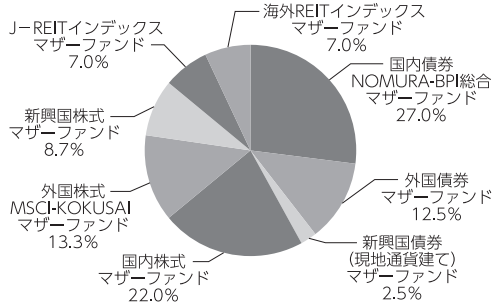
（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎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。

＜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 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 13期(2014年6月23日) | 9,457 | 0 | 3.9 | 97.09 | 4.1 | 53.4 | 0.9 | 31.9 | － | 13.2 | 530 |
| 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 |

＊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。

| | ’13年７月～’14年６月末 | ’14年７月～’15年６月末 | ’15年７月以降 |
|---|---|---|---|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]<br>NOMURA-BPI総合 | 18% | 19% | 20% |
| [外国債券マザーファンド]<br>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% | 12.1% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]<br>JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | ３% | ３% | 2.9% |
| [国内株式マザーファンド]<br>東証株価指数（TOPIX） | 27% | 26% | 25% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]<br>MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 16.7% | 15.9% | 15.2% |
| [新興国株式マザーファンド]<br>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) | 10.3% | 10.1% | 9.8% |
| [J－REITインデックス マザーファンド]<br>東証REIT指数（配当込み） | 6.5% | ７% | 7.5% |
| [海外REITインデックス マザーファンド]<br>S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース) | 6.5% | ７% | 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。

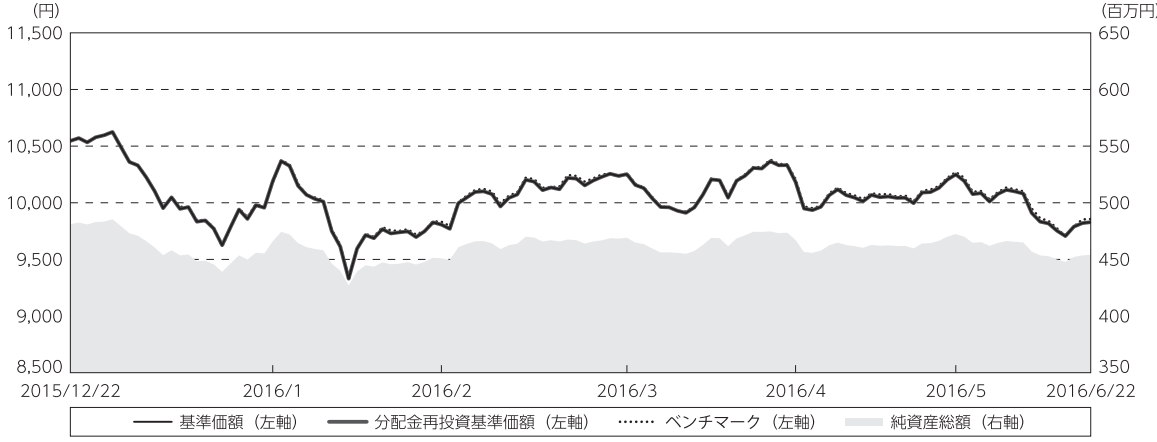
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 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 | 投資信託証券組入比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | | | | |
| (期　首) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2015年12月22日 | 10,546 | － | 109.23 | － | 47.6 | 1.0 | 35.3 | － | 15.3 |
| 12月末 | 10,625 | 0.7 | 110.05 | 0.8 | 47.9 | 1.0 | 35.0 | － | 15.4 |
| 2016年１月末 | 10,190 | △3.4 | 105.40 | △3.5 | 46.3 | 1.0 | 36.2 | － | 15.3 |
| ２月末 | 9,807 | △7.0 | 101.84 | △6.8 | 46.9 | 1.0 | 35.4 | － | 15.7 |
| ３月末 | 10,252 | △2.8 | 106.27 | △2.7 | 49.1 | 1.0 | 33.8 | － | 15.2 |
| ４月末 | 10,184 | △3.4 | 105.74 | △3.2 | 48.4 | 1.1 | 34.7 | － | 15.2 |
| ５月末 | 10,250 | △2.8 | 106.38 | △2.6 | 48.3 | 1.3 | 34.5 | － | 15.2 |
| (期　末) | | | | | | | | | |
| 2016年６月22日 | 9,829 | △6.8 | 102.09 | △6.5 | 47.2 | 1.3 | 35.6 | － | 15.4 |

＊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：10,546円
期　末： 9,829円（既払分配金(税込み)：0円）
騰落率：△ 6.8%（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（2015年12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（2015年12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10,546円から期末9,829円と717円の値下がりとなりました。

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（－15.3%）、外国株式（－10.6%）、新興国株式（－9.3%）、外国債券（－9.2%）、外国REIT（－4.7%）、新興国債券（－4.6%）が下落し、国内REIT（＋6.4%）、国内債券（＋5.5%）は上昇しました。

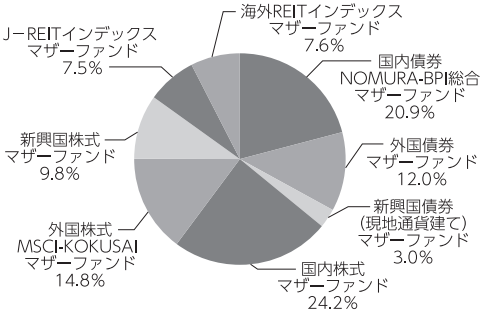
国内株式や外国株式などの下落が主な値下がり要因となりました。

## ○投資環境

| 資　　産 | 変動要因等 |
|---|---|
| 国内債券 | 国内株式市場の下落に伴い安全資産とされる国債への需要が高まったこと、日銀による国債買入れの平均残存年限の長期化やマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入などを背景に、国内債券利回りは長期債・超長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。 |
| 外国債券 | 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。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおける現大統領の弾劾手続き進展に伴う政治停滞からの脱却期待や、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、新興国債券利回りは南米を中心に低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）しました。 |
| 国内株式 | 円高基調に伴う国内輸出関連企業の業績改善期待の後退や、日銀による追加金融緩和への期待感の剥落などを背景に、下落しました。 |
| 外国株式 | 景気回復の弱さなどから欧州株式市場は下落しましたが、原油価格上昇に伴う資源関連企業の業績回復期待や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、外国株式市場は米国を中心に上昇しました。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおいて現大統領の弾劾手続き進展に伴い政権交代による経済改革への期待が高まったことや、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、中南米を中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）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、国内長期金利の低下などを背景に、上昇しました。 |
| 外国REIT | 海外長期金利の低下などを背景に、米国を中心に上昇しました。為替レートは、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

＜投資比率（2016年６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。

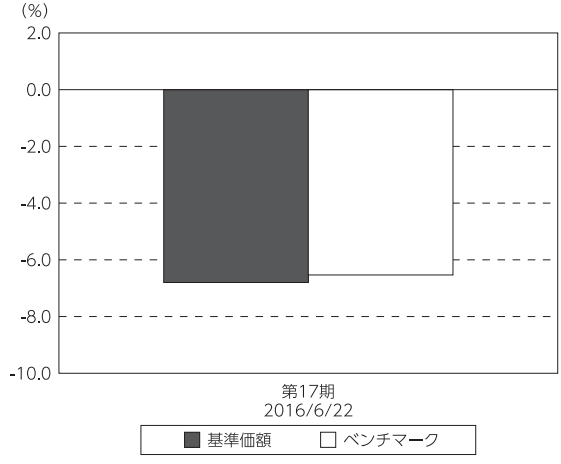
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○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－6.8%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－6.5%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17期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| 当期分配金 | － |
| （対基準価額比率） | －% |
| 当期の収益 | － |
| 当期の収益以外 | － |
| 翌期繰越分配対象額 | 3,177 |

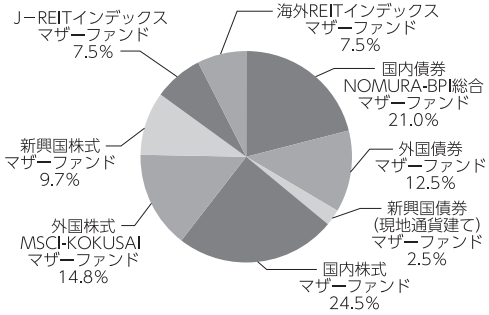
（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎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。

＜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 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 13期(2014年6月23日) | 9,321 | 0 | 3.7 | 95.32 | 3.9 | 61.1 | 1.1 | 27.0 | － | 10.3 | 1,825 |
| 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 |

＊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。

| | ’13年７月～’14年６月末 | ’14年７月～’15年６月末 | ’15年７月以降 |
|---|---|---|---|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]<br>NOMURA-BPI総合 | 14% | 14.5% | 15% |
| [外国債券マザーファンド]<br>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) | 11.2% | 11.6% | 12.1% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]<br>JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 2.8% | 2.9% | 2.9% |
| [国内株式マザーファンド]<br>東証株価指数（TOPIX） | 31% | 30.5% | 30% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]<br>MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 19.2% | 18.6% | 18.2% |
| [新興国株式マザーファンド]<br>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) | 11.8% | 11.9% | 11.8% |
| [J－REITインデックス マザーファンド]<br>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]<br>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。

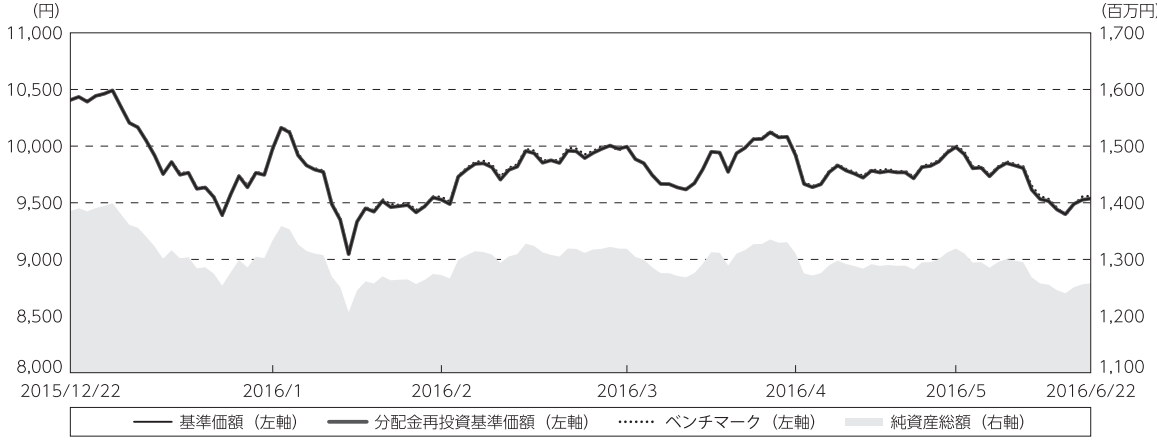
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 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 | 投資信託証券組入比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | | | | |
| (期　首) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2015年12月22日 | 10,407 | － | 107.23 | － | 57.3 | 1.2 | 30.4 | － | 10.5 |
| 12月末 | 10,492 | 0.8 | 108.10 | 0.8 | 57.7 | 1.2 | 30.0 | － | 10.5 |
| 2016年１月末 | 9,980 | △4.1 | 102.69 | △4.2 | 56.0 | 1.2 | 31.3 | － | 10.5 |
| ２月末 | 9,527 | △8.5 | 98.42 | △8.2 | 56.8 | 1.2 | 30.4 | － | 10.8 |
| ３月末 | 9,995 | △4.0 | 103.01 | △3.9 | 58.8 | 1.2 | 28.9 | － | 10.4 |
| ４月末 | 9,919 | △4.7 | 102.41 | △4.5 | 58.1 | 1.3 | 29.6 | － | 10.4 |
| ５月末 | 9,992 | △4.0 | 103.12 | △3.8 | 57.9 | 1.5 | 29.5 | － | 10.4 |
| (期　末) | | | | | | | | | |
| 2016年６月22日 | 9,537 | △8.4 | 98.50 | △8.1 | 56.9 | 1.5 | 30.5 | － | 10.5 |

＊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：10,407円
期　末： 9,537円（既払分配金(税込み)：0円）
騰落率：△ 8.4%（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（2015年12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（2015年12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10,407円から期末9,537円と870円の値下がりとなりました。

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（－15.3%）、外国株式（－10.6%）、新興国株式（－9.3%）、外国債券（－9.2%）、外国REIT（－4.7%）、新興国債券（－4.6%）が下落し、国内REIT（＋6.4%）、国内債券（＋5.5%）は上昇しました。

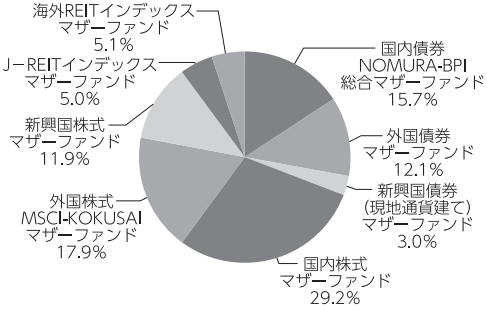
国内株式や外国株式などの下落が主な値下がり要因となりました。

## ○投資環境

| 資　　産 | 変動要因等 |
|---|---|
| 国内債券 | 国内株式市場の下落に伴い安全資産とされる国債への需要が高まったこと、日銀による国債買入れの平均残存年限の長期化やマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入などを背景に、国内債券利回りは長期債・超長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。 |
| 外国債券 | 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。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおける現大統領の弾劾手続き進展に伴う政治停滞からの脱却期待や、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、新興国債券利回りは南米を中心に低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）しました。 |
| 国内株式 | 円高基調に伴う国内輸出関連企業の業績改善期待の後退や、日銀による追加金融緩和への期待感の剥落などを背景に、下落しました。 |
| 外国株式 | 景気回復の弱さなどから欧州株式市場は下落しましたが、原油価格上昇に伴う資源関連企業の業績回復期待や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、外国株式市場は米国を中心に上昇しました。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおいて現大統領の弾劾手続き進展に伴い政権交代による経済改革への期待が高まったことや、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、中南米を中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）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、国内長期金利の低下などを背景に、上昇しました。 |
| 外国REIT | 海外長期金利の低下などを背景に、米国を中心に上昇しました。為替レートは、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

＜投資比率（2016年６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。

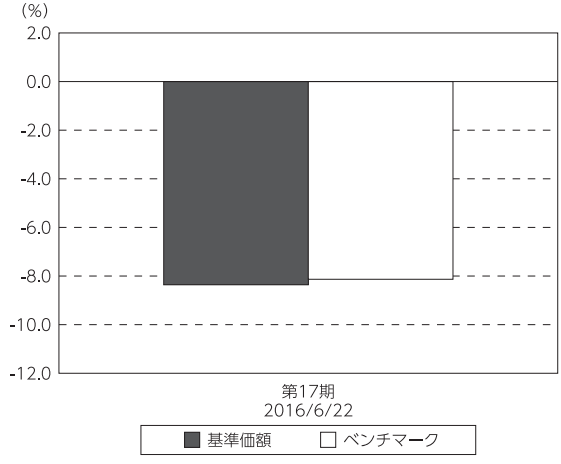
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○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－8.4%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－8.1%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17期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| 当期分配金 | － |
| （対基準価額比率） | －% |
| 当期の収益 | － |
| 当期の収益以外 | － |
| 翌期繰越分配対象額 | 2,761 |

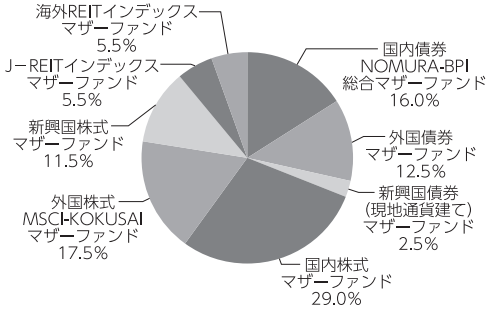
（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎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。

＜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 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | % | % | 百万円 |
| 8期(2014年6月23日) | 16,243 | 5 | 4.0 | 161.52 | 4.0 | 65.9 | 1.1 | 22.2 | － | 10.3 | 88 |
| 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 |

＊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。

| | ’13年７月～’14年６月末 | ’14年７月～’15年６月末 | ’15年７月以降 |
|---|---|---|---|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]<br>NOMURA-BPI総合 | 11.5% | 12% | 12.5% |
| [外国債券マザーファンド]<br>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) | 9.2% | 9.6% | 10.1% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]<br>JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 2.3% | 2.4% | 2.4% |
| [国内株式マザーファンド]<br>東証株価指数（TOPIX） | 33.5% | 33% | 32.5% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]<br>MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 20.8% | 20.2% | 19.7% |
| [新興国株式マザーファンド]<br>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) | 12.7% | 12.8% | 12.8% |
| [J－REITインデックス マザーファンド]<br>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]<br>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。

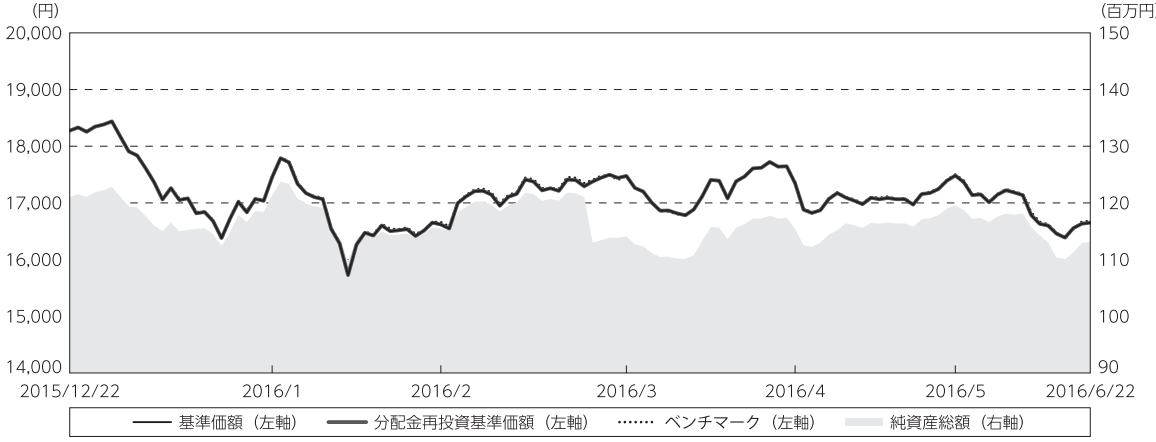
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 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 | 投資信託証券組入比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | | | | |
| (期　首) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2015年12月22日 | 18,275 | － | 182.28 | － | 62.2 | 1.3 | 25.3 | － | 10.6 |
| 12月末 | 18,439 | 0.9 | 183.94 | 0.9 | 62.5 | 1.3 | 25.0 | － | 10.6 |
| 2016年１月末 | 17,454 | △4.5 | 173.92 | △4.6 | 61.0 | 1.3 | 26.2 | － | 10.6 |
| ２月末 | 16,619 | △9.1 | 166.18 | △8.8 | 61.6 | 1.3 | 25.4 | － | 10.9 |
| ３月末 | 17,476 | △4.4 | 174.29 | △4.4 | 63.6 | 1.3 | 24.0 | － | 10.4 |
| ４月末 | 17,347 | △5.1 | 173.24 | △5.0 | 62.9 | 1.4 | 24.7 | － | 10.4 |
| ５月末 | 17,483 | △4.3 | 174.58 | △4.2 | 62.7 | 1.7 | 24.6 | － | 10.4 |
| (期　末) | | | | | | | | | |
| 2016年６月22日 | 16,652 | △8.9 | 166.40 | △8.7 | 61.8 | 1.6 | 25.5 | － | 10.6 |

＊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：18,275円
期　末：16,647円（既払分配金(税込み)：５円）
騰落率：△ 8.9%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2015年12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（2015年12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18,275円から期末16,652円（分配金込み）と1,623円の値下がりとなりました。

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（－15.3%）、外国株式（－10.6%）、新興国株式（－9.3%）、外国債券（－9.2%）、外国REIT（－4.7%）、新興国債券（－4.6%）が下落し、国内REIT（＋6.4%）、国内債券（＋5.5%）は上昇しました。

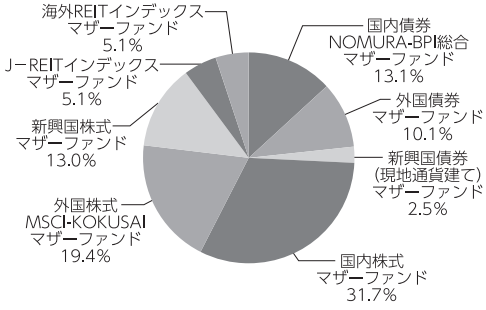
国内株式や外国株式などの下落が主な値下がり要因となりました。

## ○投資環境

| 資　　産 | 変動要因等 |
|---|---|
| 国内債券 | 国内株式市場の下落に伴い安全資産とされる国債への需要が高まったこと、日銀による国債買入れの平均残存年限の長期化やマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入などを背景に、国内債券利回りは長期債・超長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。 |
| 外国債券 | 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。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおける現大統領の弾劾手続き進展に伴う政治停滞からの脱却期待や、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、新興国債券利回りは南米を中心に低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）しました。 |
| 国内株式 | 円高基調に伴う国内輸出関連企業の業績改善期待の後退や、日銀による追加金融緩和への期待感の剥落などを背景に、下落しました。 |
| 外国株式 | 景気回復の弱さなどから欧州株式市場は下落しましたが、原油価格上昇に伴う資源関連企業の業績回復期待や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、外国株式市場は米国を中心に上昇しました。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおいて現大統領の弾劾手続き進展に伴い政権交代による経済改革への期待が高まったことや、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、中南米を中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）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、国内長期金利の低下などを背景に、上昇しました。 |
| 外国REIT | 海外長期金利の低下などを背景に、米国を中心に上昇しました。為替レートは、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

＜投資比率（2016年６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。

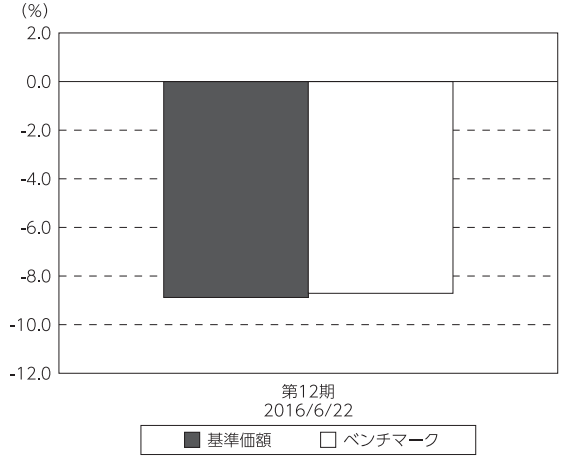
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○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－8.9%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－8.7%を0.2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12期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| 当期分配金 | 5 |
| （対基準価額比率） | 0.030% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | － |
| 翌期繰越分配対象額 | 6,723 |

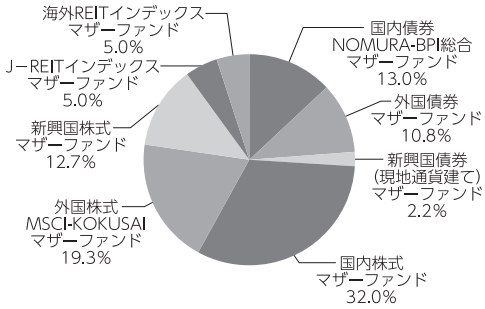
（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎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。

＜2016年７月以降の各資産への基本投資割合＞



## ○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 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | (分配落) | 税込み分配金 | 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 |

＊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。

| | 当初設定時以降 |
|---|---|
| [国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]<br>NOMURA-BPI総合 | 10% |
| [外国債券マザーファンド]<br>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% |
| [新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]<br>JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | 1.9% |
| [国内株式マザーファンド]<br>東証株価指数（TOPIX） | 35% |
| [外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]<br>MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 21.2% |
| [新興国株式マザーファンド]<br>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% |
| [J－REITインデックス マザーファンド]<br>東証REIT指数（配当込み） | 5％ |
| [海外REITインデックス マザーファンド]<br>S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース) | 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。

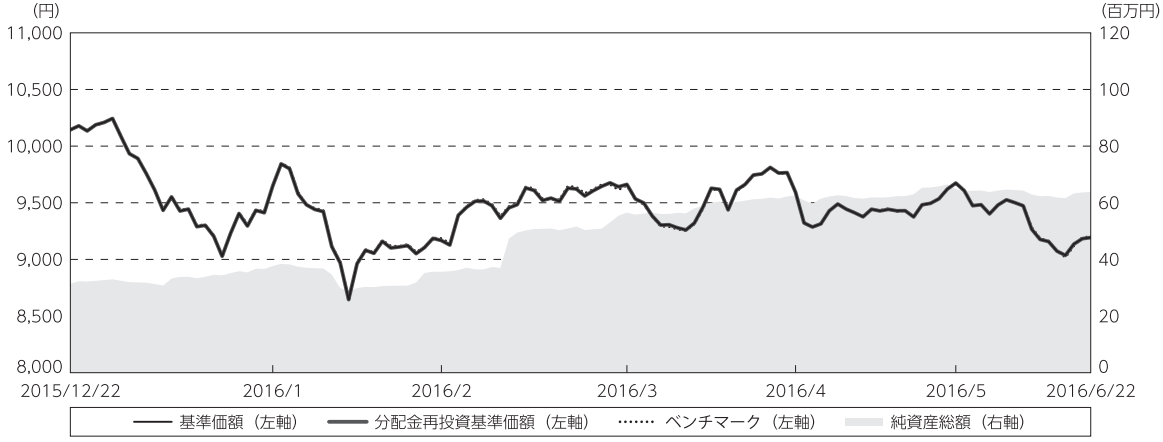
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 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 | 投資信託証券組入比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | | | | |
| (期　首) | 円 | % | | % | % | % | % | % | % |
| 2015年12月22日 | 10,144 | － | 101.41 | － | 67.1 | 1.5 | 20.3 | － | 10.6 |
| 12月末 | 10,244 | 1.0 | 102.43 | 1.0 | 67.4 | 1.4 | 20.0 | － | 10.6 |
| 2016年１月末 | 9,649 | △4.9 | 96.40 | △4.9 | 66.0 | 1.4 | 21.1 | － | 10.7 |
| ２月末 | 9,167 | △9.6 | 91.83 | △9.4 | 66.6 | 1.4 | 20.4 | － | 10.9 |
| ３月末 | 9,662 | △4.8 | 96.51 | △4.8 | 68.3 | 1.4 | 19.2 | － | 10.4 |
| ４月末 | 9,592 | △5.4 | 95.92 | △5.4 | 67.8 | 1.5 | 19.7 | － | 10.5 |
| ５月末 | 9,674 | △4.6 | 96.72 | △4.6 | 67.5 | 1.8 | 19.7 | － | 10.4 |
| (期　末) | | | | | | | | | |
| 2016年６月22日 | 9,193 | △9.4 | 91.99 | △9.3 | 66.7 | 1.8 | 20.4 | － | 10.7 |

＊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：10,144円
期　末： 9,193円（既払分配金(税込み)：0円）
騰落率：△ 9.4%（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（2015年12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（2015年12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10,144円から期末9,193円と951円の値下がりとなりました。

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（－15.3%）、外国株式（－10.6%）、新興国株式（－9.3%）、外国債券（－9.2%）、外国REIT（－4.7%）、新興国債券（－4.6%）が下落し、国内REIT（＋6.4%）、国内債券（＋5.5%）は上昇しました。

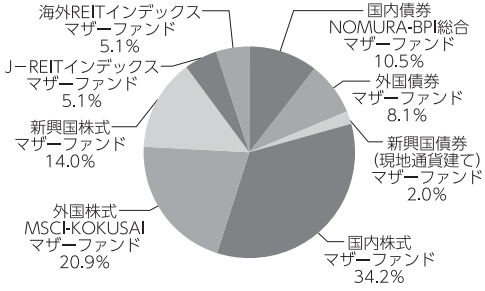
国内株式や外国株式などの下落が主な値下がり要因となりました。

## ○投資環境

| 資　　産 | 変動要因等 |
|---|---|
| 国内債券 | 国内株式市場の下落に伴い安全資産とされる国債への需要が高まったこと、日銀による国債買入れの平均残存年限の長期化やマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入などを背景に、国内債券利回りは長期債・超長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。 |
| 外国債券 | 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。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおける現大統領の弾劾手続き進展に伴う政治停滞からの脱却期待や、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、新興国債券利回りは南米を中心に低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）しました。 |
| 国内株式 | 円高基調に伴う国内輸出関連企業の業績改善期待の後退や、日銀による追加金融緩和への期待感の剥落などを背景に、下落しました。 |
| 外国株式 | 景気回復の弱さなどから欧州株式市場は下落しましたが、原油価格上昇に伴う資源関連企業の業績回復期待や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、外国株式市場は米国を中心に上昇しました。為替レートは、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。 |
| （新興国） | ブラジルにおいて現大統領の弾劾手続き進展に伴い政権交代による経済改革への期待が高まったことや、商品価格上昇に伴う新興国の経常収支改善期待などを背景に、中南米を中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で下落（円高）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、国内長期金利の低下などを背景に、上昇しました。 |
| 外国REIT | 海外長期金利の低下などを背景に、米国を中心に上昇しました。為替レートは、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

＜投資比率（2016年６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。

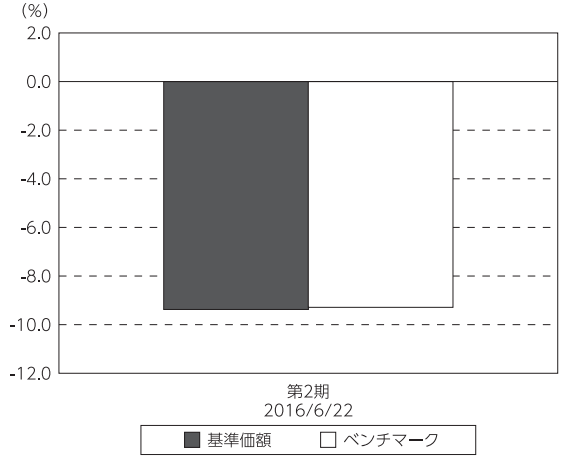
マザーファンドの運用経過については、51ページをご参照ください。

## ○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－9.4％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－9.3％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２期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| 当期分配金 | － |
| （対基準価額比率） | －％ |
| 当期の収益 | － |
| 当期の収益以外 | － |
| 翌期繰越分配対象額 | 90 |

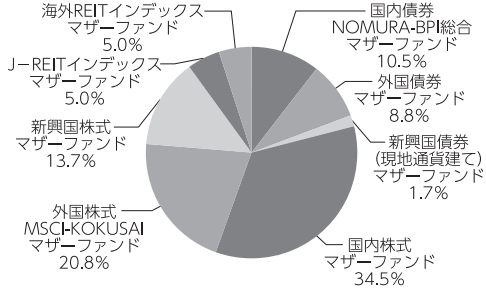
（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎今後の運用方針

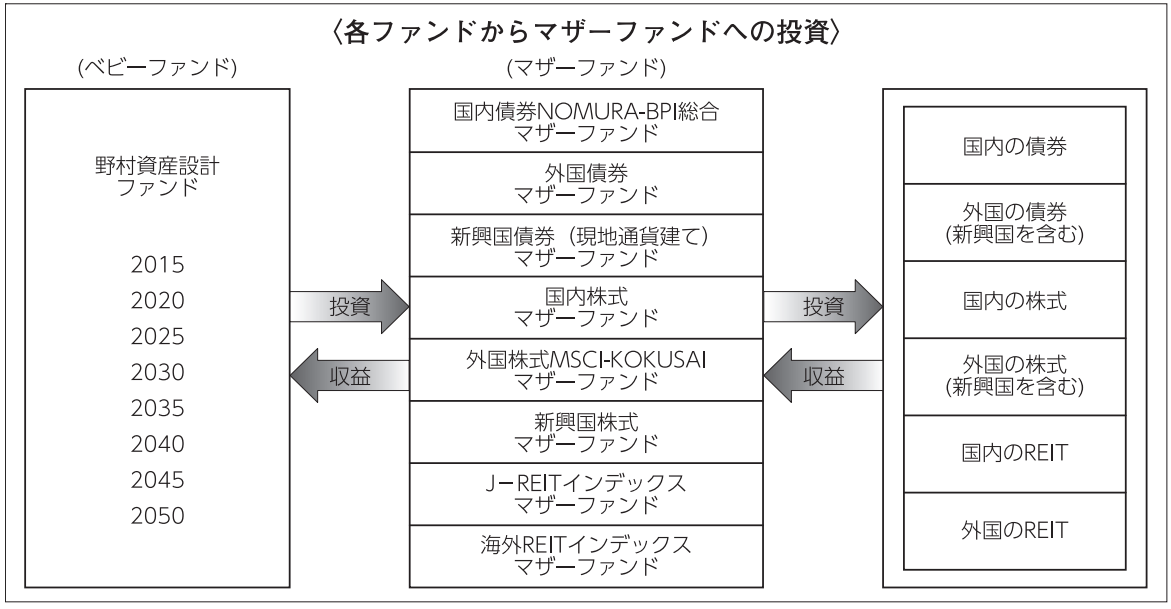
国内および外国（新興国を含む）の債券、株式、国内および外国のリートに分散投資を行い、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行います。これらの投資は、各資産のインデックスに連動する投資成果を目指して運用を行う８つのマザーファンドへの投資を通じて行います。なお、2016年７月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

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。

＜2016年７月以降の各資産への基本投資割合＞



## ◎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。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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、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。

**[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（預託証書）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

（2015年12月23日～2016年６月22日）

| 項目 | 第22期～第27期 金額 | 第22期～第27期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 信託報酬 | 44 | 0.416 | (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) | (0.151) | 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 | 0.002 | (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<br>※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) | |
| （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<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （株式） | ( 0) | (0.001) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 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） | ( 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) | (0.000) | 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、10,654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

(2015年12月23日～2016年６月22日)

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 第22期～第27期 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 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 | 17,151 | 21,711 | 12,338 | 15,580 |
| 外国債券マザーファンド | 3,836 | 8,491 | 4,652 | 10,446 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 5,253 | 10,471 | 4,399 | 8,700 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 8,759 | 11,530 | 86,450 | 112,273 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 742 | 1,510 | 6,415 | 12,552 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 3,419 | 6,869 | 4,547 | 9,384 |
| 新興国株式マザーファンド | 10,836 | 9,726 | 8,713 | 8,043 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 2,302 | 2,696 | 2,632 | 3,139 |

＊単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2015年12月23日～2016年６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22期～第27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 | 42,481,412千円 | 24,972,900千円 | 2,534,129千円 |
| (b) 当作成期中の平均組入株式時価総額 | 276,988,624千円 | 305,103,470千円 | 12,625,170千円 |
| (c) 売買高比率 (a) ／ (b) | 0.15 | 0.08 | 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12月23日～2016年６月22日)

### 利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2015＞

| 区分 | 第22期～第27期 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 預金 | 94 | 94 | 100.0 | 94 | 94 | 100.0 |

＜国内株式マザーファンド＞

| 区分 | 第22期～第27期 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 36,002 | 3 | 0.0 | 6,478 | － | － |
| 貸株 | 59,830 | 5,546 | 9.3 | 67,035 | 4,715 | 7.0 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

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。

＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

| 区分 | 第22期～第27期 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 25,605 | 2,828 | 11.0 | 10,345 | 319 | 3.1 |
| 預金 | 11,916 | 11,916 | 100.0 | 11,916 | 11,916 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国株式マザーファンド＞

| 区分 | 第22期～第27期 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 3,386 | 833 | 24.6 | 1,592 | 762 | 47.9 |
| 預金 | 825 | 825 | 100.0 | 825 | 825 | 100.0 |

平均保有割合　0.4%

＜国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド＞

| 区分 | 第22期～第27期 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 65,081 | 6,390 | 9.8 | 62,754 | 3,405 | 5.4 |
| 預金 | 73,491 | 73,491 | 100.0 | 73,491 | 73,491 | 100.0 |

平均保有割合　0.1%

＜外国債券マザーファンド＞

| 区分 | 第22期～第27期 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 64,939 | 3,150 | 4.9 | 27,267 | 2,157 | 7.9 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区分 | 第22期～第27期 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,875 | 355 | 12.3 | 1,775 | 355 | 20.0 |
| 預金 | 359 | 359 | 100.0 | 359 | 359 | 100.0 |

平均保有割合　1.2%

＜J－REITインデックス マザーファンド＞

| 区分 | 第22期～第27期 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 4,568 | 854 | 18.7 | 2,955 | 150 | 5.1 |
| 預金 | 9,337 | 9,337 | 100.0 | 9,337 | 9,337 | 100.0 |

平均保有割合　0.3%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区分 | 第22期～第27期 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,237 | 57 | 2.5 | 1,390 | 31 | 2.2 |
| 預金 | 1,421 | 1,421 | 100.0 | 1,421 | 1,421 | 100.0 |

平均保有割合　0.4%

## 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22期～第27期 | | |
|---|---|---|---|
| | 買　付　額 | 売　付　額 | 第27期末保有額 |
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 174 | 25 | 1,100 |

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６月22日現在）

## 親投資信託残高

| 銘　　柄 | 第21期末 | 第27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 | 92,278 | 97,091 | 116,257 |
| 外国債券マザーファンド | 46,744 | 45,928 | 96,702 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 36,715 | 37,569 | 71,412 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 640,886 | 563,195 | 751,640 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 36,359 | 30,686 | 60,200 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 31,009 | 29,881 | 60,353 |
| 新興国株式マザーファンド | 51,520 | 53,643 | 47,002 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 20,514 | 20,184 | 23,193 |

＊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６月22日現在）

| 項　　目 | 第27期末 | |
|---|---|---|
| | 評　価　額 | 比　率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 116,257 | 9.4 |
| 外国債券マザーファンド | 96,702 | 7.9 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 71,412 | 5.8 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 751,640 | 61.1 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 60,200 | 4.9 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 60,353 | 4.9 |
| 新興国株式マザーファンド | 47,002 | 3.8 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 23,193 | 1.9 |
| コール・ローン等、その他 | 3,932 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 1,230,691 | 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27期末における外貨建て純資産（629,041,155千円）の投資信託財産総額（631,826,179千円）に対する比率は99.6%です。
＊外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、第27期末における外貨建て純資産（304,673,934千円）の投資信託財産総額（305,160,053千円）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27期末における外貨建て純資産（17,647,324千円）の投資信託財産総額（17,697,416千円）に対する比率は99.7%です。
＊新興国株式マザーファンドにおいて、第27期末における外貨建て純資産（13,445,488千円）の投資信託財産総額（13,465,510千円）に対する比率は99.9%です。
＊新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、第27期末における外貨建て純資産（2,777,328千円）の投資信託財産総額（2,785,495千円）に対する比率は99.7%です。
＊外貨建て資産は、第27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＝28.78円、１米ドル＝104.58円、１カナダドル＝81.61円、１英ポンド＝153.40円、１スイスフラン＝108.67円、１スウェーデンクローナ＝12.62円、１ノルウェークローネ＝12.57円、１デンマーククローネ＝15.80円、１トルコリラ＝35.88円、１ユーロ＝117.51円、１チェココルナ＝4.34円、１フォリント＝0.3735円、１ズロチ＝26.74円、１ルーブル＝1.64円、１レイ＝25.89円、１香港ドル＝13.48円、１シンガポールドル＝77.85円、１リンギ＝25.91円、１バーツ＝2.97円、１フィリピンペソ＝2.26円、１ルピア＝0.0079円、１ウォン＝0.0905円、１新台湾ドル＝3.25円、１豪ドル＝77.86円、１ニュージーランドドル＝74.50円、１インドルピー＝1.56円、１新シェケル＝27.11円、１メキシコペソ＝5.61円、１レアル＝30.64円、１チリペソ＝0.1549円、１コロンビアペソ＝0.0352円、１ヌエボソル＝31.82円、１UAEディルハム＝28.53円、１エジプトポンド＝11.78円、１ランド＝7.08円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況

| 項　　目 | 第22期末 | 第23期末 | 第24期末 | 第25期末 | 第26期末 | 第27期末 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 2016年１月22日現在 | 2016年２月22日現在 | 2016年３月22日現在 | 2016年４月22日現在 | 2016年５月23日現在 | 2016年６月22日現在 |
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| **(A) 資産** | **1,279,634,046** | **1,274,149,555** | **1,299,565,940** | **1,284,321,376** | **1,250,998,948** | **1,230,691,842** |
| コール・ローン等 | 4,098,374 | 3,940,109 | 3,885,392 | 4,064,743 | 3,930,883 | 3,907,269 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 117,246,930 | 117,105,431 | 132,951,789 | 132,691,054 | 125,199,202 | 116,257,542 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 104,938,934 | 99,267,243 | 102,231,996 | 99,385,934 | 101,447,397 | 96,702,620 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 70,171,341 | 74,095,393 | 80,270,650 | 76,928,768 | 74,760,234 | 71,412,926 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額) | 795,132,963 | 780,920,404 | 766,798,125 | 769,875,312 | 753,457,442 | 751,640,744 |
| J-REITインデックス マザーファンド(評価額) | 61,935,273 | 66,573,477 | 64,796,945 | 64,602,715 | 61,499,638 | 60,200,557 |
| 海外REITインデックス マザーファンド(評価額) | 59,161,399 | 60,570,138 | 66,684,504 | 60,633,674 | 62,126,374 | 60,353,849 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 43,482,924 | 48,225,276 | 54,452,629 | 49,260,002 | 45,644,220 | 47,002,184 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド(評価額) | 23,465,901 | 23,452,084 | 25,409,946 | 24,033,711 | 22,933,558 | 23,193,989 |
| 未収入金 | － | － | 2,083,964 | 2,845,463 | － | 20,162 |
| 未収利息 | 7 | － | － | － | － | － |
| **(B) 負債** | **2,167,113** | **2,131,490** | **3,933,915** | **4,885,752** | **2,064,529** | **2,016,482** |
| 未払収益分配金 | 1,238,240 | 1,223,998 | 1,206,593 | 1,187,699 | 1,173,199 | 1,164,727 |
| 未払解約金 | － | － | 1,876,530 | 2,792,839 | － | － |
| 未払信託報酬 | 925,278 | 903,980 | 847,499 | 901,702 | 887,875 | 848,455 |
| 未払利息 | － | － | － | 8 | 5 | 5 |
| その他未払費用 | 3,595 | 3,512 | 3,293 | 3,504 | 3,450 | 3,295 |
| **(C) 純資産総額（Ａ－Ｂ）** | **1,277,466,933** | **1,272,018,065** | **1,295,632,025** | **1,279,435,624** | **1,248,934,419** | **1,228,675,360** |
| 元本 | 1,238,240,162 | 1,223,998,237 | 1,206,593,208 | 1,187,699,017 | 1,173,199,729 | 1,164,727,048 |
| 次期繰越損益金 | 39,226,771 | 48,019,828 | 89,038,817 | 91,736,607 | 75,734,690 | 63,948,312 |
| **(D) 受益権総口数** | **1,238,240,162口** | **1,223,998,237口** | **1,206,593,208口** | **1,187,699,017口** | **1,173,199,729口** | **1,164,727,048口** |
| **１万口当たり基準価額（Ｃ／Ｄ）** | **10,317円** | **10,392円** | **10,738円** | **10,772円** | **10,646円** | **10,549円** |

（注）第22期首元本額は1,254,666,712円、第22～27期中追加設定元本額は3,050,658円、第22～27期中一部解約元本額は92,990,322円、１口当たり純資産額は、第22期1.0317円、第23期1.0392円、第24期1.0738円、第25期1.0772円、第26期1.0646円、第27期1.0549円です。

## ○損益の状況

| 項　　目 | 第22期<br>2015年12月23日～<br>2016年１月22日 | 第23期<br>2016年１月23日～<br>2016年２月22日 | 第24期<br>2016年２月23日～<br>2016年３月22日 | 第25期<br>2016年３月23日～<br>2016年４月22日 | 第26期<br>2016年４月23日～<br>2016年５月23日 | 第27期<br>2016年５月24日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 | 円 |
| **(A) 配当等収益** | **182** | **135** | **－** | **△ 43** | **△ 276** | **△ 135** |
| 受取利息 | 182 | 135 | － | － | － | － |
| 支払利息 | － | － | － | △ 43 | △ 276 | △ 135 |
| **(B) 有価証券売買損益** | **△ 40,128,544** | **11,331,809** | **43,710,458** | **6,124,173** | **△ 12,864,202** | **△ 9,250,179** |
| 売買益 | 3,593,103 | 22,943,878 | 44,047,916 | 9,484,667 | 940,876 | 4,023,181 |
| 売買損 | △ 43,721,647 | △ 11,612,069 | △ 337,458 | △ 3,360,494 | △ 13,805,078 | △ 13,273,360 |
| **(C) 信託報酬等** | **△ 928,873** | **△ 907,492** | **△ 850,792** | **△ 905,206** | **△ 891,325** | **△ 851,750** |
| **(D) 当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）** | **△ 41,057,235** | **10,424,452** | **42,859,666** | **5,218,924** | **△ 13,755,803** | **△ 10,102,064** |
| **(E) 前期繰越損益金** | **129,464,352** | **86,174,719** | **94,028,165** | **133,561,502** | **135,903,303** | **120,076,891** |
| **(F) 追加信託差損益金** | **△ 47,942,106** | **△ 47,355,345** | **△ 46,642,421** | **△ 45,856,120** | **△ 45,239,611** | **△ 44,861,788** |
| （配当等相当額） | ( 28,036,935) | ( 27,780,273) | ( 27,451,684) | ( 27,087,321) | ( 26,822,428) | ( 26,694,583) |
| （売買損益相当額） | (△ 75,979,041) | (△ 75,135,618) | (△ 74,094,105) | (△ 72,943,441) | (△ 72,062,039) | (△ 71,556,371) |
| **(G) 計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）** | **40,465,011** | **49,243,826** | **90,245,410** | **92,924,306** | **76,907,889** | **65,113,039** |
| **(H) 収益分配金** | **△ 1,238,240** | **△ 1,223,998** | **△ 1,206,593** | **△ 1,187,699** | **△ 1,173,199** | **△ 1,164,727** |
| **次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）** | **39,226,771** | **48,019,828** | **89,038,817** | **91,736,607** | **75,734,690** | **63,948,312** |
| 追加信託差損益金 | △ 47,942,106 | △ 47,355,345 | △ 46,642,421 | △ 45,856,120 | △ 45,239,611 | △ 44,861,788 |
| （配当等相当額） | ( 28,037,633) | ( 27,780,801) | ( 27,452,301) | ( 27,088,436) | ( 26,822,893) | ( 26,695,212) |
| （売買損益相当額） | (△ 75,979,739) | (△ 75,136,146) | (△ 74,094,722) | (△ 72,944,556) | (△ 72,062,504) | (△ 71,557,000) |
| 分配準備積立金 | 160,784,738 | 159,130,918 | 157,586,081 | 156,419,938 | 153,816,385 | 152,482,547 |
| 繰越損益金 | △ 73,615,861 | △ 63,755,745 | △ 21,904,843 | △ 18,827,211 | △ 32,842,084 | △ 43,672,447 |

＊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（2015年12月23日～2016年６月22日）は以下の通りです。

| 項　　目 | 第22期<br>2015年12月23日～<br>2016年１月22日 | 第23期<br>2016年１月23日～<br>2016年２月22日 | 第24期<br>2016年２月23日～<br>2016年３月22日 | 第25期<br>2016年３月23日～<br>2016年４月22日 | 第26期<br>2016年４月23日～<br>2016年５月23日 | 第27期<br>2016年５月24日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| a. 配当等収益(経費控除後) | 1,015,866円 | 1,440,864円 | 1,941,769円 | 2,493,323円 | 496,695円 | 979,444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 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 28,037,633円 | 27,780,801円 | 27,452,301円 | 27,088,436円 | 26,822,893円 | 26,695,212円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 161,007,112円 | 158,914,052円 | 156,850,905円 | 155,114,314円 | 154,492,889円 | 152,667,830円 |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d) | 190,060,611円 | 188,135,717円 | 186,244,975円 | 184,696,073円 | 181,812,477円 | 180,342,486円 |
| f. 分配対象収益(１万口当たり) | 1,534円 | 1,537円 | 1,543円 | 1,555円 | 1,549円 | 1,548円 |
| g. 分配金 | 1,238,240円 | 1,223,998円 | 1,206,593円 | 1,187,699円 | 1,173,199円 | 1,164,727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22期 | 第23期 | 第24期 | 第25期 | 第26期 | 第27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

（2015年12月23日～2016年６月22日）

| 項目 | 当期 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 信託報酬 | 48 | 0.464 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （投信会社） | (19) | (0.178) | 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) | (0.259) | 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<br>※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) | |
| （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＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （株式） | ( 0) | (0.001) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 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) | (0.008) | 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) | (0.000) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合計 | 49 | 0.477 | |
| 期中の平均基準価額は、10,427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

(2015年12月23日～2016年６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 | 21,096 | 26,649 | 20,727 | 26,171 |
| 外国債券マザーファンド | 6,145 | 13,602 | 9,490 | 21,421 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 6,780 | 13,498 | 7,779 | 15,491 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 20,563 | 26,963 | 79,870 | 104,377 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 1,702 | 3,411 | 7,108 | 14,115 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 3,143 | 6,340 | 5,054 | 10,585 |
| 新興国株式マザーファンド | 13,880 | 12,525 | 14,338 | 13,330 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 3,202 | 3,765 | 4,710 | 5,672 |

＊単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2015年12月23日～2016年６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 | 42,481,412千円 | 25,121,548千円 | 2,549,870千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 276,988,624千円 | 305,103,470千円 | 12,625,170千円 |
| (c) 売買高比率 (a) ／ (b) | 0.15 | 0.08 | 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12月23日～2016年６月22日)

### 利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2020＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 預金 | 83 | 83 | 100.0 | 83 | 83 | 100.0 |

＜国内株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 36,002 | 3 | 0.0 | 6,478 | － | － |
| 貸株 | 59,830 | 5,546 | 9.3 | 67,035 | 4,715 | 7.0 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

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。

＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 25,605 | 2,828 | 11.0 | 10,345 | 319 | 3.1 |
| 預金 | 11,916 | 11,916 | 100.0 | 11,916 | 11,916 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 3,386 | 833 | 24.6 | 1,592 | 762 | 47.9 |
| 預金 | 825 | 825 | 100.0 | 825 | 825 | 100.0 |

平均保有割合　0.4%

＜国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 65,081 | 6,390 | 9.8 | 62,754 | 3,405 | 5.4 |
| 預金 | 73,491 | 73,491 | 100.0 | 73,491 | 73,491 | 100.0 |

平均保有割合　0.1%

＜外国債券マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 64,939 | 3,150 | 4.9 | 27,267 | 2,157 | 7.9 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,875 | 355 | 12.3 | 1,775 | 355 | 20.0 |
| 預金 | 359 | 359 | 100.0 | 359 | 359 | 100.0 |

平均保有割合　1.3%

＜J－REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 4,568 | 854 | 18.7 | 2,955 | 150 | 5.1 |
| 預金 | 9,337 | 9,337 | 100.0 | 9,337 | 9,337 | 100.0 |

平均保有割合　0.2%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,237 | 57 | 2.5 | 1,390 | 31 | 2.2 |
| 預金 | 1,421 | 1,421 | 100.0 | 1,421 | 1,421 | 100.0 |

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 | 買　　付　　額 | 売　　付　　額 | 当期末保有額 |
|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 174 | 25 | 1,100 |

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６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 | 105,533 | 105,902 | 126,807 |
| 外国債券マザーファンド | 53,240 | 49,895 | 105,054 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 41,761 | 40,762 | 77,481 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 366,452 | 307,145 | 409,916 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 27,722 | 22,316 | 43,779 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 23,642 | 21,731 | 43,892 |
| 新興国株式マザーファンド | 59,466 | 59,008 | 51,702 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 23,903 | 22,395 | 25,734 |

＊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６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 | 126,807 | 14.2 |
| 外国債券マザーファンド | 105,054 | 11.8 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 77,481 | 8.7 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 409,916 | 46.0 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 43,779 | 4.9 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 43,892 | 4.9 |
| 新興国株式マザーファンド | 51,702 | 5.8 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 25,734 | 2.9 |
| コール・ローン等、その他 | 6,972 | 0.8 |
| 投資信託財産総額 | 891,337 | 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（629,041,155千円）の投資信託財産総額（631,826,179千円）に対する比率は99.6％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（304,673,934千円）の投資信託財産総額（305,160,053千円）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（17,647,324千円）の投資信託財産総額（17,697,416千円）に対する比率は99.7％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（13,445,488千円）の投資信託財産総額（13,465,510千円）に対する比率は99.9％です。
＊新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（2,777,328千円）の投資信託財産総額（2,785,495千円）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＝28.78円、１米ドル＝104.58円、１カナダドル＝81.61円、１英ポンド＝153.40円、１スイスフラン＝108.67円、１スウェーデンクローナ＝12.62円、１ノルウェークローネ＝12.57円、１デンマーククローネ＝15.80円、１トルコリラ＝35.88円、１ユーロ＝117.51円、１チェココルナ＝4.34円、１フォリント＝0.3735円、１ズロチ＝26.74円、１ルーブル＝1.64円、１レイ＝25.89円、１香港ドル＝13.48円、１シンガポールドル＝77.85円、１リンギ＝25.91円、１バーツ＝2.97円、１フィリピンペソ＝2.26円、１ルピア＝0.0079円、１ウォン＝0.0905円、１新台湾ドル＝3.25円、１豪ドル＝77.86円、１ニュージーランドドル＝74.50円、１インドルピー＝1.56円、１新シェケル＝27.11円、１メキシコペソ＝5.61円、１レアル＝30.64円、１チリペソ＝0.1549円、１コロンビアペソ＝0.0352円、１ヌエボソル＝31.82円、１UAEディルハム＝28.53円、１エジプトポンド＝11.78円、１ランド＝7.08円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年６月22日現在)

| 項　　目 | 当 期 末 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 資産 | 891,337,628 |
| コール・ローン等 | 5,305,165 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 126,807,834 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 105,054,994 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 77,481,238 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額) | 409,916,168 |
| J-REITインデックス マザーファンド(評価額) | 43,779,603 |
| 海外REITインデックス マザーファンド(評価額) | 43,892,813 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 51,702,880 |
| 新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド(評価額) | 25,734,444 |
| 未収入金 | 1,662,489 |
| (B) 負債 | 6,063,140 |
| 未払収益分配金 | 432,975 |
| 未払解約金 | 1,199,999 |
| 未払信託報酬 | 4,414,812 |
| 未払利息 | 8 |
| その他未払費用 | 15,346 |
| (C) 純資産総額(Ａ－Ｂ) | 885,274,488 |
| 元本 | 865,951,162 |
| 次期繰越損益金 | 19,323,326 |
| (D) 受益権総口数 | 865,951,162口 |
| １万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ) | 10,223円 |

(注) 期首元本額は961,539,080円、期中追加設定元本額は45,408,342円、期中一部解約元本額は140,996,260円、１口当たり純資産額は1.0223円です。

## ○損益の状況 (2015年12月23日～2016年６月22日)

| 項　　目 | 当　　期 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 372 |
| 受取利息 | 153 |
| 支払利息 | △ 525 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 22,366,338 |
| 売買益 | 28,179,545 |
| 売買損 | △ 50,545,883 |
| (C) 信託報酬等 | △ 4,430,158 |
| (D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ) | △ 26,796,868 |
| (E) 前期繰越損益金 | 115,026,555 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 68,473,386 |
| (配当等相当額) | ( 47,566,222) |
| (売買損益相当額) | (△116,039,608) |
| (G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ) | 19,756,301 |
| (H) 収益分配金 | △ 432,975 |
| 次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ) | 19,323,326 |
| 追加信託差損益金 | △ 68,473,386 |
| (配当等相当額) | ( 47,639,087) |
| (売買損益相当額) | (△116,112,473) |
| 分配準備積立金 | 151,725,282 |
| 繰越損益金 | △ 63,928,570 |

＊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 (2015年12月23日～2016年６月22日) は以下の通りです。

| 項　　目 | 当　　期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| a. 配当等収益(経費控除後) | 4,858,833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 | 47,639,087円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 147,299,424円 |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d) | 199,797,344円 |
| f. 分配対象収益(１万口当たり) | 2,307円 |
| g. 分配金 | 432,975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

（2015年12月23日～2016年６月22日）

| 項目 | 当期 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 信託報酬 | 48 | 0.464 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （投信会社） | (19) | (0.178) | 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) | (0.259) | 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<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式） | ( 0) | (0.002) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.000) | |
| （先物・オプション） | ( 0) | (0.001) | |
| (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<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （株式） | ( 0) | (0.001) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 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) | (0.009) | 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) | (0.000) | 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、10,411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

（2015年12月23日～2016年６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 | 19,778 | 24,933 | 5,266 | 6,728 |
| 外国債券マザーファンド | 4,702 | 10,395 | 2,547 | 5,877 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 6,084 | 12,150 | 1,795 | 3,592 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 13,914 | 18,293 | 29,051 | 37,562 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 1,498 | 3,005 | 3,838 | 7,517 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 2,170 | 4,401 | 1,616 | 3,399 |
| 新興国株式マザーファンド | 13,925 | 12,615 | 6,549 | 6,170 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 2,453 | 2,890 | 1,485 | 1,788 |

＊単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

（2015年12月23日～2016年６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 | 42,481,412千円 | 25,121,548千円 | 2,549,870千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 276,988,624千円 | 305,103,470千円 | 12,625,170千円 |
| (c) 売買高比率 (a) ／ (b) | 0.15 | 0.08 | 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12月23日～2016年６月22日）

### 利害関係人との取引状況

＜野村資産設計ファンド2025＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 預金 | 71 | 71 | 100.0 | 71 | 71 | 100.0 |

＜国内株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 36,002 | 3 | 0.0 | 6,478 | － | － |
| 貸株 | 59,830 | 5,546 | 9.3 | 67,035 | 4,715 | 7.0 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

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。

＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 25,605 | 2,828 | 11.0 | 10,345 | 319 | 3.1 |
| 預金 | 11,916 | 11,916 | 100.0 | 11,916 | 11,916 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 3,386 | 833 | 24.6 | 1,592 | 762 | 47.9 |
| 預金 | 825 | 825 | 100.0 | 825 | 825 | 100.0 |

平均保有割合　0.5%

＜国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 65,081 | 6,390 | 9.8 | 62,754 | 3,405 | 5.4 |
| 預金 | 73,491 | 73,491 | 100.0 | 73,491 | 73,491 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜外国債券マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 64,939 | 3,150 | 4.9 | 27,267 | 2,157 | 7.9 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,875 | 355 | 12.3 | 1,775 | 355 | 20.0 |
| 預金 | 359 | 359 | 100.0 | 359 | 359 | 100.0 |

平均保有割合　1.2%

＜J－REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 4,568 | 854 | 18.7 | 2,955 | 150 | 5.1 |
| 預金 | 9,337 | 9,337 | 100.0 | 9,337 | 9,337 | 100.0 |

平均保有割合　0.2%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,237 | 57 | 2.5 | 1,390 | 31 | 2.2 |
| 預金 | 1,421 | 1,421 | 100.0 | 1,421 | 1,421 | 100.0 |

平均保有割合　0.2%

## 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 | 買　　付　　額 | 売　　付　　額 | 当期末保有額 |
|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 174 | 25 | 1,100 |

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６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 | 118,906 | 133,418 | 159,755 |
| 外国債券マザーファンド | 44,989 | 47,144 | 99,262 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 46,922 | 51,212 | 97,344 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 240,857 | 225,719 | 301,245 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 23,425 | 21,085 | 41,365 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 19,978 | 20,533 | 41,472 |
| 新興国株式マザーファンド | 67,278 | 74,654 | 65,412 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 20,192 | 21,160 | 24,315 |

＊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６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 | 159,755 | 19.1 |
| 外国債券マザーファンド | 99,262 | 11.9 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 97,344 | 11.7 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 301,245 | 36.1 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 41,365 | 5.0 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 41,472 | 5.0 |
| 新興国株式マザーファンド | 65,412 | 7.8 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 24,315 | 2.9 |
| コール・ローン等、その他 | 5,137 | 0.5 |
| 投資信託財産総額 | 835,307 | 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（629,041,155千円）の投資信託財産総額（631,826,179千円）に対する比率は99.6％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（304,673,934千円）の投資信託財産総額（305,160,053千円）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（17,647,324千円）の投資信託財産総額（17,697,416千円）に対する比率は99.7％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（13,445,488千円）の投資信託財産総額（13,465,510千円）に対する比率は99.9％です。
＊新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（2,777,328千円）の投資信託財産総額（2,785,495千円）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＝28.78円、１米ドル＝104.58円、１カナダドル＝81.61円、１英ポンド＝153.40円、１スイスフラン＝108.67円、１スウェーデンクローナ＝12.62円、１ノルウェークローネ＝12.57円、１デンマーククローネ＝15.80円、１トルコリラ＝35.88円、１ユーロ＝117.51円、１チェココルナ＝4.34円、１フォリント＝0.3735円、１ズロチ＝26.74円、１ルーブル＝1.64円、１レイ＝25.89円、１香港ドル＝13.48円、１シンガポールドル＝77.85円、１リンギ＝25.91円、１バーツ＝2.97円、１フィリピンペソ＝2.26円、１ルピア＝0.0079円、１ウォン＝0.0905円、１新台湾ドル＝3.25円、１豪ドル＝77.86円、１ニュージーランドドル＝74.50円、１インドルピー＝1.56円、１新シェケル＝27.11円、１メキシコペソ＝5.61円、１レアル＝30.64円、１チリペソ＝0.1549円、１コロンビアペソ＝0.0352円、１ヌエボソル＝31.82円、１UAEディルハム＝28.53円、１エジプトポンド＝11.78円、１ランド＝7.08円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年６月22日現在)

| 項　　目 | 当 期 末 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 資産 | 835,307,752 |
| コール・ローン等 | 4,685,167 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 159,755,310 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 99,262,953 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 97,344,410 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額) | 301,245,831 |
| J-REITインデックス マザーファンド(評価額) | 41,365,883 |
| 海外REITインデックス マザーファンド(評価額) | 41,472,854 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 65,412,434 |
| 新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド(評価額) | 24,315,616 |
| 未収入金 | 447,294 |
| (B) 負債 | 4,283,626 |
| 未払収益分配金 | 410,674 |
| 未払信託報酬 | 3,859,548 |
| 未払利息 | 7 |
| その他未払費用 | 13,397 |
| (C) 純資産総額(Ａ－Ｂ) | 831,024,126 |
| 元本 | 821,348,419 |
| 次期繰越損益金 | 9,675,707 |
| (D) 受益権総口数 | 821,348,419口 |
| １万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ) | 10,118円 |

(注) 期首元本額は801,792,979円、期中追加設定元本額は32,410,121円、期中一部解約元本額は12,854,681円、１口当たり純資産額は1.0118円です。

## ○損益の状況 (2015年12月23日～2016年６月22日)

| 項　　目 | 当　　期 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 307 |
| 受取利息 | 122 |
| 支払利息 | △ 429 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 37,107,876 |
| 売買益 | 19,023,522 |
| 売買損 | △ 56,131,398 |
| (C) 信託報酬等 | △ 3,872,945 |
| (D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ) | △ 40,981,128 |
| (E) 前期繰越損益金 | 112,537,691 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 61,470,182 |
| (配当等相当額) | ( 42,731,050) |
| (売買損益相当額) | (△104,201,232) |
| (G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ) | 10,086,381 |
| (H) 収益分配金 | △ 410,674 |
| 次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ) | 9,675,707 |
| 追加信託差損益金 | △ 61,470,182 |
| (配当等相当額) | ( 42,776,252) |
| (売買損益相当額) | (△104,246,434) |
| 分配準備積立金 | 158,897,838 |
| 繰越損益金 | △ 87,751,949 |

＊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 (2015年12月23日～2016年６月22日) は以下の通りです。

| 項　　目 | 当　　期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| a. 配当等収益(経費控除後) | 5,499,383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 | 42,776,252円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 153,809,129円 |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d) | 202,084,764円 |
| f. 分配対象収益(１万口当たり) | 2,460円 |
| g. 分配金 | 410,674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

（2015年12月23日～2016年６月22日）

| 項目 | 当期 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 信託報酬 | 49 | 0.464 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （投信会社） | (19) | (0.178) | 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) | (0.259) | 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<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式） | ( 0) | (0.002) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.001) | |
| （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<br>※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) | |
| （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) | (0.011) | 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) | (0.001) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合計 | 50 | 0.482 | |
| 期中の平均基準価額は、10,474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

（2015年12月23日～2016年６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 | 16,706 | 21,089 | 7,378 | 9,316 |
| 外国債券マザーファンド | 3,543 | 7,858 | 3,178 | 7,239 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 4,924 | 9,873 | 2,588 | 5,122 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 8,325 | 10,891 | 22,787 | 29,562 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 1,803 | 3,588 | 5,839 | 11,454 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 2,292 | 4,648 | 2,552 | 5,336 |
| 新興国株式マザーファンド | 12,055 | 10,954 | 7,516 | 7,040 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 1,794 | 2,110 | 1,625 | 1,951 |

＊単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

（2015年12月23日～2016年６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 | 42,481,412千円 | 25,121,548千円 | 2,549,870千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 276,988,624千円 | 305,103,470千円 | 12,625,170千円 |
| (c) 売買高比率 (a) ／ (b) | 0.15 | 0.08 | 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12月23日～2016年６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＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 預金 | 61 | 61 | 100.0 | 61 | 61 | 100.0 |

＜国内株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 36,002 | 3 | 0.0 | 6,478 | － | － |
| 貸株 | 59,830 | 5,546 | 9.3 | 67,035 | 4,715 | 7.0 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

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。

＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 25,605 | 2,828 | 11.0 | 10,345 | 319 | 3.1 |
| 預金 | 11,916 | 11,916 | 100.0 | 11,916 | 11,916 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 3,386 | 833 | 24.6 | 1,592 | 762 | 47.9 |
| 預金 | 825 | 825 | 100.0 | 825 | 825 | 100.0 |

平均保有割合　0.5%

＜国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 65,081 | 6,390 | 9.8 | 62,754 | 3,405 | 5.4 |
| 預金 | 73,491 | 73,491 | 100.0 | 73,491 | 73,491 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜外国債券マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 64,939 | 3,150 | 4.9 | 27,267 | 2,157 | 7.9 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,875 | 355 | 12.3 | 1,775 | 355 | 20.0 |
| 預金 | 359 | 359 | 100.0 | 359 | 359 | 100.0 |

平均保有割合　1.0%

＜J－REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 4,568 | 854 | 18.7 | 2,955 | 150 | 5.1 |
| 預金 | 9,337 | 9,337 | 100.0 | 9,337 | 9,337 | 100.0 |

平均保有割合　0.3%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,237 | 57 | 2.5 | 1,390 | 31 | 2.2 |
| 預金 | 1,421 | 1,421 | 100.0 | 1,421 | 1,421 | 100.0 |

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 | 買　　付　　額 | 売　　付　　額 | 当期末保有額 |
|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 174 | 25 | 1,100 |

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６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 | 115,533 | 124,861 | 149,509 |
| 外国債券マザーファンド | 38,854 | 39,218 | 82,574 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 45,547 | 47,883 | 91,017 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 148,585 | 134,122 | 179,000 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 30,346 | 26,311 | 51,617 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 25,881 | 25,621 | 51,750 |
| 新興国株式マザーファンド | 65,426 | 69,964 | 61,303 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 17,434 | 17,603 | 20,227 |

＊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６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 | 149,509 | 21.6 |
| 外国債券マザーファンド | 82,574 | 11.9 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 91,017 | 13.1 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 179,000 | 25.8 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 51,617 | 7.4 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 51,750 | 7.5 |
| 新興国株式マザーファンド | 61,303 | 8.8 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 20,227 | 2.9 |
| コール・ローン等、その他 | 6,147 | 1.0 |
| 投資信託財産総額 | 693,144 | 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（629,041,155千円）の投資信託財産総額（631,826,179千円）に対する比率は99.6％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（304,673,934千円）の投資信託財産総額（305,160,053千円）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（17,647,324千円）の投資信託財産総額（17,697,416千円）に対する比率は99.7％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（13,445,488千円）の投資信託財産総額（13,465,510千円）に対する比率は99.9％です。
＊新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（2,777,328千円）の投資信託財産総額（2,785,495千円）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＝28.78円、１米ドル＝104.58円、１カナダドル＝81.61円、１英ポンド＝153.40円、１スイスフラン＝108.67円、１スウェーデンクローナ＝12.62円、１ノルウェークローネ＝12.57円、１デンマーククローネ＝15.80円、１トルコリラ＝35.88円、１ユーロ＝117.51円、１チェココルナ＝4.34円、１フォリント＝0.3735円、１ズロチ＝26.74円、１ルーブル＝1.64円、１レイ＝25.89円、１香港ドル＝13.48円、１シンガポールドル＝77.85円、１リンギ＝25.91円、１バーツ＝2.97円、１フィリピンペソ＝2.26円、１ルピア＝0.0079円、１ウォン＝0.0905円、１新台湾ドル＝3.25円、１豪ドル＝77.86円、１ニュージーランドドル＝74.50円、１インドルピー＝1.56円、１新シェケル＝27.11円、１メキシコペソ＝5.61円、１レアル＝30.64円、１チリペソ＝0.1549円、１コロンビアペソ＝0.0352円、１ヌエボソル＝31.82円、１UAEディルハム＝28.53円、１エジプトポンド＝11.78円、１ランド＝7.08円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年６月22日現在)

| 項　　目 | 当 期 末 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 資産 | 693,144,418 |
| コール・ローン等 | 4,337,419 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 149,509,300 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 82,574,774 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 91,017,530 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額) | 179,000,336 |
| J-REITインデックス マザーファンド(評価額) | 51,617,143 |
| 海外REITインデックス マザーファンド(評価額) | 51,750,620 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 61,303,228 |
| 新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド(評価額) | 20,227,663 |
| 未収入金 | 1,806,405 |
| (B) 負債 | 5,427,910 |
| 未払収益分配金 | 339,904 |
| 未払解約金 | 1,790,683 |
| 未払信託報酬 | 3,285,914 |
| 未払利息 | 6 |
| その他未払費用 | 11,403 |
| (C) 純資産総額(Ａ－Ｂ) | 687,716,508 |
| 元本 | 679,809,120 |
| 次期繰越損益金 | 7,907,388 |
| (D) 受益権総口数 | 679,809,120口 |
| １万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ) | 10,116円 |

(注) 期首元本額は682,367,361円、期中追加設定元本額は24,738,872円、期中一部解約元本額は27,297,113円、１口当たり純資産額は1.0116円です。

## ○損益の状況 (2015年12月23日～2016年６月22日)

| 項　　目 | 当　　期 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 263 |
| 受取利息 | 100 |
| 支払利息 | △ 363 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 39,009,757 |
| 売買益 | 14,395,756 |
| 売買損 | △ 53,405,513 |
| (C) 信託報酬等 | △ 3,297,317 |
| (D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ) | △ 42,307,337 |
| (E) 前期繰越損益金 | 116,607,344 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 66,052,715 |
| (配当等相当額) | ( 44,878,232) |
| (売買損益相当額) | (△110,930,947) |
| (G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ) | 8,247,292 |
| (H) 収益分配金 | △ 339,904 |
| 次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ) | 7,907,388 |
| 追加信託差損益金 | △ 66,052,715 |
| (配当等相当額) | ( 44,922,971) |
| (売買損益相当額) | (△110,975,686) |
| 分配準備積立金 | 162,132,615 |
| 繰越損益金 | △ 88,172,512 |

＊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 (2015年12月23日～2016年６月22日) は以下の通りです。

| 項　　目 | 当　　期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| a. 配当等収益(経費控除後) | 5,397,609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 | 44,922,971円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 157,074,910円 |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d) | 207,395,490円 |
| f. 分配対象収益(１万口当たり) | 3,050円 |
| g. 分配金 | 339,904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

（2015年12月23日～2016年６月22日）

| 項目 | 当期 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 信託報酬 | 47 | 0.464 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （投信会社） | (18) | (0.178) | 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) | (0.259) | 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<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式） | ( 0) | (0.002) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.001) | |
| （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<br>※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) | |
| （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) | (0.011) | 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) | (0.001) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合計 | 48 | 0.483 | |
| 期中の平均基準価額は、10,218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

(2015年12月23日～2016年６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 | 12,234 | 15,307 | 4,654 | 5,967 |
| 外国債券マザーファンド | 2,534 | 5,608 | 2,078 | 4,769 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 3,496 | 6,968 | 1,485 | 2,977 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 5,036 | 6,607 | 12,039 | 15,581 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 1,370 | 2,751 | 3,876 | 7,592 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 1,461 | 2,962 | 1,490 | 3,132 |
| 新興国株式マザーファンド | 8,444 | 7,667 | 4,744 | 4,472 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 1,224 | 1,442 | 1,023 | 1,228 |

＊単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2015年12月23日～2016年６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 | 42,481,412千円 | 25,121,548千円 | 2,549,870千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 276,988,624千円 | 305,103,470千円 | 12,625,170千円 |
| (c) 売買高比率 (a) ／ (b) | 0.15 | 0.08 | 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12月23日～2016年６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＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 預金 | 38 | 38 | 100.0 | 38 | 38 | 100.0 |

＜国内株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 36,002 | 3 | 0.0 | 6,478 | － | － |
| 貸株 | 59,830 | 5,546 | 9.3 | 67,035 | 4,715 | 7.0 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

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。

＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 25,605 | 2,828 | 11.0 | 10,345 | 319 | 3.1 |
| 預金 | 11,916 | 11,916 | 100.0 | 11,916 | 11,916 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 3,386 | 833 | 24.6 | 1,592 | 762 | 47.9 |
| 預金 | 825 | 825 | 100.0 | 825 | 825 | 100.0 |

平均保有割合　0.3%

＜国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 65,081 | 6,390 | 9.8 | 62,754 | 3,405 | 5.4 |
| 預金 | 73,491 | 73,491 | 100.0 | 73,491 | 73,491 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜外国債券マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 64,939 | 3,150 | 4.9 | 27,267 | 2,157 | 7.9 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,875 | 355 | 12.3 | 1,775 | 355 | 20.0 |
| 預金 | 359 | 359 | 100.0 | 359 | 359 | 100.0 |

平均保有割合　0.7%

＜J－REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 4,568 | 854 | 18.7 | 2,955 | 150 | 5.1 |
| 預金 | 9,337 | 9,337 | 100.0 | 9,337 | 9,337 | 100.0 |

平均保有割合　0.2%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,237 | 57 | 2.5 | 1,390 | 31 | 2.2 |
| 預金 | 1,421 | 1,421 | 100.0 | 1,421 | 1,421 | 100.0 |

平均保有割合　0.2%

## 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 | 買　　付　　額 | 売　　付　　額 | 当期末保有額 |
|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 174 | 25 | 1,100 |

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６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 | 84,329 | 91,910 | 110,053 |
| 外国債券マザーファンド | 25,525 | 25,981 | 54,704 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 33,443 | 35,454 | 67,392 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 78,086 | 71,083 | 94,868 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 19,936 | 17,430 | 34,195 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 17,002 | 16,974 | 34,284 |
| 新興国株式マザーファンド | 47,337 | 51,038 | 44,719 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 11,460 | 11,661 | 13,400 |

＊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６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 | 110,053 | 24.1 |
| 外国債券マザーファンド | 54,704 | 12.0 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 67,392 | 14.8 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 94,868 | 20.8 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 34,195 | 7.5 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 34,284 | 7.5 |
| 新興国株式マザーファンド | 44,719 | 9.8 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 13,400 | 2.9 |
| コール・ローン等、その他 | 2,672 | 0.6 |
| 投資信託財産総額 | 456,287 | 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（629,041,155千円）の投資信託財産総額（631,826,179千円）に対する比率は99.6％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（304,673,934千円）の投資信託財産総額（305,160,053千円）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（17,647,324千円）の投資信託財産総額（17,697,416千円）に対する比率は99.7％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（13,445,488千円）の投資信託財産総額（13,465,510千円）に対する比率は99.9％です。
＊新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（2,777,328千円）の投資信託財産総額（2,785,495千円）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＝28.78円、１米ドル＝104.58円、１カナダドル＝81.61円、１英ポンド＝153.40円、１スイスフラン＝108.67円、１スウェーデンクローナ＝12.62円、１ノルウェークローネ＝12.57円、１デンマーククローネ＝15.80円、１トルコリラ＝35.88円、１ユーロ＝117.51円、１チェココルナ＝4.34円、１フォリント＝0.3735円、１ズロチ＝26.74円、１ルーブル＝1.64円、１レイ＝25.89円、１香港ドル＝13.48円、１シンガポールドル＝77.85円、１リンギ＝25.91円、１バーツ＝2.97円、１フィリピンペソ＝2.26円、１ルピア＝0.0079円、１ウォン＝0.0905円、１新台湾ドル＝3.25円、１豪ドル＝77.86円、１ニュージーランドドル＝74.50円、１インドルピー＝1.56円、１新シェケル＝27.11円、１メキシコペソ＝5.61円、１レアル＝30.64円、１チリペソ＝0.1549円、１コロンビアペソ＝0.0352円、１ヌエボソル＝31.82円、１UAEディルハム＝28.53円、１エジプトポンド＝11.78円、１ランド＝7.08円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年６月22日現在)

| 項　　目 | 当 期 末 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 資産 | 456,287,220 |
| コール・ローン等 | 2,637,084 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 110,053,645 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 54,704,909 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 67,392,002 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額) | 94,868,522 |
| J-REITインデックス マザーファンド(評価額) | 34,195,792 |
| 海外REITインデックス マザーファンド(評価額) | 34,284,222 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 44,719,651 |
| 新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド(評価額) | 13,400,606 |
| 未収入金 | 30,787 |
| (B) 負債 | 2,215,981 |
| 未払解約金 | 65,659 |
| 未払信託報酬 | 2,142,908 |
| 未払利息 | 4 |
| その他未払費用 | 7,410 |
| (C) 純資産総額(Ａ－Ｂ) | 454,071,239 |
| 元本 | 461,979,262 |
| 次期繰越損益金 | △ 7,908,023 |
| (D) 受益権総口数 | 461,979,262口 |
| １万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ) | 9,829円 |

(注) 期首元本額は456,159,645円、期中追加設定元本額は19,297,350円、期中一部解約元本額は13,477,733円、１口当たり純資産額は0.9829円です。

## ○損益の状況 (2015年12月23日～2016年６月22日)

| 項　　目 | 当　　期 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 159 |
| 受取利息 | 64 |
| 支払利息 | △ 223 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 30,149,312 |
| 売買益 | 7,758,863 |
| 売買損 | △ 37,908,175 |
| (C) 信託報酬等 | △ 2,150,318 |
| (D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ) | △ 32,299,789 |
| (E) 前期繰越損益金 | 78,815,897 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 54,424,131 |
| (配当等相当額) | ( 35,919,715) |
| (売買損益相当額) | (△ 90,343,846) |
| (G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ) | △ 7,908,023 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ) | △ 7,908,023 |
| 追加信託差損益金 | △ 54,424,131 |
| (配当等相当額) | ( 35,953,240) |
| (売買損益相当額) | (△ 90,377,371) |
| 分配準備積立金 | 110,862,929 |
| 繰越損益金 | △ 64,346,821 |

＊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 (2015年12月23日～2016年６月22日) は以下の通りです。

| 項　　目 | 当　　期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| a. 配当等収益(経費控除後) | 3,724,607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 | 35,953,240円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 107,138,322円 |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d) | 146,816,169円 |
| f. 分配対象収益(１万口当たり) | 3,177円 |
| g. 分配金 | 0円 |
| h. 分配金(１万口当たり) | 0円 |

## ○分配金のお知らせ

| | |
|---|---|
| １万口当たり分配金（税込み） | 0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

（2015年12月23日～2016年６月22日）

| 項目 | 当期 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 信託報酬 | 46 | 0.464 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （投信会社） | (18) | (0.178) | 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) | (0.259) | 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<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式） | ( 0) | (0.002) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.000) | |
| （先物・オプション） | ( 0) | (0.001) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.003 | (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<br>※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) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 1 | 0.015 | (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) | (0.012) | 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 | 47 | 0.486 | |
| 期中の平均基準価額は、9,984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

(2015年12月23日～2016年６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 | 32,289 | 40,490 | 17,828 | 22,520 |
| 外国債券マザーファンド | 5,511 | 12,249 | 6,976 | 16,031 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 8,290 | 16,635 | 5,879 | 11,600 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 9,295 | 12,186 | 30,199 | 39,083 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 2,311 | 4,628 | 8,384 | 16,388 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 1,719 | 3,514 | 2,987 | 6,252 |
| 新興国株式マザーファンド | 24,106 | 21,960 | 17,752 | 16,453 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 2,574 | 3,040 | 3,222 | 3,844 |

＊単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2015年12月23日～2016年６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 | 42,481,412千円 | 25,121,548千円 | 2,549,870千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 276,988,624千円 | 305,103,470千円 | 12,625,170千円 |
| (c) 売買高比率 (a) ／ (b) | 0.15 | 0.08 | 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12月23日～2016年６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＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 預金 | 110 | 110 | 100.0 | 110 | 110 | 100.0 |

＜国内株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 36,002 | 3 | 0.0 | 6,478 | － | － |
| 貸株 | 59,830 | 5,546 | 9.3 | 67,035 | 4,715 | 7.0 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

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。

＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 25,605 | 2,828 | 11.0 | 10,345 | 319 | 3.1 |
| 預金 | 11,916 | 11,916 | 100.0 | 11,916 | 11,916 | 100.0 |

平均保有割合　0.1%

＜新興国株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 3,386 | 833 | 24.6 | 1,592 | 762 | 47.9 |
| 預金 | 825 | 825 | 100.0 | 825 | 825 | 100.0 |

平均保有割合　1.2%

＜国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 65,081 | 6,390 | 9.8 | 62,754 | 3,405 | 5.4 |
| 預金 | 73,491 | 73,491 | 100.0 | 73,491 | 73,491 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜外国債券マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 64,939 | 3,150 | 4.9 | 27,267 | 2,157 | 7.9 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,875 | 355 | 12.3 | 1,775 | 355 | 20.0 |
| 預金 | 359 | 359 | 100.0 | 359 | 359 | 100.0 |

平均保有割合　1.9%

＜J－REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 4,568 | 854 | 18.7 | 2,955 | 150 | 5.1 |
| 預金 | 9,337 | 9,337 | 100.0 | 9,337 | 9,337 | 100.0 |

平均保有割合　0.3%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,237 | 57 | 2.5 | 1,390 | 31 | 2.2 |
| 預金 | 1,421 | 1,421 | 100.0 | 1,421 | 1,421 | 100.0 |

平均保有割合　0.4%

## 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 | 買　　付　　額 | 売　　付　　額 | 当期末保有額 |
|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 174 | 25 | 1,100 |

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６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 | 292,515 | 306,976 | 367,574 |
| 外国債券マザーファンド | 73,780 | 72,315 | 152,259 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 115,745 | 118,156 | 224,592 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 169,289 | 148,385 | 198,035 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 38,417 | 32,343 | 63,451 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 32,763 | 31,495 | 63,615 |
| 新興国株式マザーファンド | 164,691 | 171,045 | 149,869 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 33,106 | 32,458 | 37,297 |

＊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６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 | 367,574 | 29.1 |
| 外国債券マザーファンド | 152,259 | 12.0 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 224,592 | 17.8 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 198,035 | 15.7 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 63,451 | 5.0 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 63,615 | 5.0 |
| 新興国株式マザーファンド | 149,869 | 11.9 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 37,297 | 3.0 |
| コール・ローン等、その他 | 7,318 | 0.5 |
| 投資信託財産総額 | 1,264,010 | 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（629,041,155千円）の投資信託財産総額（631,826,179千円）に対する比率は99.6％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（304,673,934千円）の投資信託財産総額（305,160,053千円）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（17,647,324千円）の投資信託財産総額（17,697,416千円）に対する比率は99.7％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（13,445,488千円）の投資信託財産総額（13,465,510千円）に対する比率は99.9％です。
＊新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（2,777,328千円）の投資信託財産総額（2,785,495千円）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＝28.78円、１米ドル＝104.58円、１カナダドル＝81.61円、１英ポンド＝153.40円、１スイスフラン＝108.67円、１スウェーデンクローナ＝12.62円、１ノルウェークローネ＝12.57円、１デンマーククローネ＝15.80円、１トルコリラ＝35.88円、１ユーロ＝117.51円、１チェココルナ＝4.34円、１フォリント＝0.3735円、１ズロチ＝26.74円、１ルーブル＝1.64円、１レイ＝25.89円、１香港ドル＝13.48円、１シンガポールドル＝77.85円、１リンギ＝25.91円、１バーツ＝2.97円、１フィリピンペソ＝2.26円、１ルピア＝0.0079円、１ウォン＝0.0905円、１新台湾ドル＝3.25円、１豪ドル＝77.86円、１ニュージーランドドル＝74.50円、１インドルピー＝1.56円、１新シェケル＝27.11円、１メキシコペソ＝5.61円、１レアル＝30.64円、１チリペソ＝0.1549円、１コロンビアペソ＝0.0352円、１ヌエボソル＝31.82円、１UAEディルハム＝28.53円、１エジプトポンド＝11.78円、１ランド＝7.08円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年６月22日現在)

| 項　　目 | 当 期 末 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,264,010,139 |
| コール・ローン等 | 7,290,643 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 367,574,148 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 152,259,914 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 224,592,593 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額) | 198,035,310 |
| J-REITインデックス マザーファンド(評価額) | 63,451,327 |
| 海外REITインデックス マザーファンド(評価額) | 63,615,406 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 149,869,635 |
| 新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド(評価額) | 37,297,840 |
| 未収入金 | 23,323 |
| (B) 負債 | 6,066,618 |
| 未払信託報酬 | 6,045,576 |
| 未払利息 | 11 |
| その他未払費用 | 21,031 |
| (C) 純資産総額(Ａ－Ｂ) | 1,257,943,521 |
| 元本 | 1,318,949,655 |
| 次期繰越損益金 | △ 61,006,134 |
| (D) 受益権総口数 | 1,318,949,655口 |
| １万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ) | 9,537円 |

(注) 期首元本額は1,331,140,727円、期中追加設定元本額は34,669,502円、期中一部解約元本額は46,860,574円、１口当たり純資産額は0.9537円です。

## ○損益の状況 (2015年12月23日～2016年６月22日)

| 項　　目 | 当　　期 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 470 |
| 受取利息 | 224 |
| 支払利息 | △ 694 |
| (B) 有価証券売買損益 | △106,990,854 |
| 売買益 | 17,904,915 |
| 売買損 | △124,895,769 |
| (C) 信託報酬等 | △ 6,066,607 |
| (D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ) | △113,057,931 |
| (E) 前期繰越損益金 | 198,802,047 |
| (F) 追加信託差損益金 | △146,750,250 |
| (配当等相当額) | ( 56,773,228) |
| (売買損益相当額) | (△203,523,478) |
| (G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ) | △ 61,006,134 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ) | △ 61,006,134 |
| 追加信託差損益金 | △146,750,250 |
| (配当等相当額) | ( 56,830,518) |
| (売買損益相当額) | (△203,580,768) |
| 分配準備積立金 | 307,453,396 |
| 繰越損益金 | △221,709,280 |

＊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 (2015年12月23日～2016年６月22日) は以下の通りです。

| 項　　目 | 当　　期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| a. 配当等収益(経費控除後) | 10,369,394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 | 56,830,518円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 297,084,002円 |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d) | 364,283,914円 |
| f. 分配対象収益(１万口当たり) | 2,761円 |
| g. 分配金 | 0円 |
| h. 分配金(１万口当たり) | 0円 |

## ○分配金のお知らせ

| | |
|---|---|
| １万口当たり分配金（税込み） | 0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

（2015年12月23日～2016年６月22日）

| 項目 | 当期 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 信託報酬 | 81 | 0.464 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （投信会社） | (31) | (0.178) | 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) | (0.259) | 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 | 0.004 | (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<br>※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) | (0.003) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.000) | |
| （先物・オプション） | ( 0) | (0.001) | |
| (c) 有価証券取引税 | 0 | 0.003 | (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<br>※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) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.000) | |
| (d) その他費用 | 3 | 0.015 | (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) | (0.013) | 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 | 85 | 0.486 | |
| 期中の平均基準価額は、17,469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

(2015年12月23日～2016年６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 | 6,473 | 8,112 | 4,249 | 5,280 |
| 外国債券マザーファンド | 1,068 | 2,366 | 1,021 | 2,301 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 2,124 | 4,188 | 1,568 | 3,067 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 2,059 | 2,688 | 3,267 | 4,254 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 565 | 1,103 | 1,014 | 1,995 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 490 | 998 | 521 | 1,071 |
| 新興国株式マザーファンド | 4,307 | 3,866 | 3,235 | 2,970 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 471 | 552 | 450 | 534 |

＊単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2015年12月23日～2016年６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 | 42,481,412千円 | 25,121,548千円 | 2,549,870千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 276,988,624千円 | 305,103,470千円 | 12,625,170千円 |
| (c) 売買高比率 (a) ／ (b) | 0.15 | 0.08 | 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12月23日～2016年６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＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 預金 | 10 | 10 | 100.0 | 10 | 10 | 100.0 |

＜国内株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 36,002 | 3 | 0.0 | 6,478 | － | － |
| 貸株 | 59,830 | 5,546 | 9.3 | 67,035 | 4,715 | 7.0 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

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。

＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 25,605 | 2,828 | 11.0 | 10,345 | 319 | 3.1 |
| 預金 | 11,916 | 11,916 | 100.0 | 11,916 | 11,916 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 3,386 | 833 | 24.6 | 1,592 | 762 | 47.9 |
| 預金 | 825 | 825 | 100.0 | 825 | 825 | 100.0 |

平均保有割合　0.1%

＜国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 65,081 | 6,390 | 9.8 | 62,754 | 3,405 | 5.4 |
| 預金 | 73,491 | 73,491 | 100.0 | 73,491 | 73,491 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜外国債券マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 64,939 | 3,150 | 4.9 | 27,267 | 2,157 | 7.9 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,875 | 355 | 12.3 | 1,775 | 355 | 20.0 |
| 預金 | 359 | 359 | 100.0 | 359 | 359 | 100.0 |

平均保有割合　0.1%

＜J－REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 4,568 | 854 | 18.7 | 2,955 | 150 | 5.1 |
| 預金 | 9,337 | 9,337 | 100.0 | 9,337 | 9,337 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,237 | 57 | 2.5 | 1,390 | 31 | 2.2 |
| 預金 | 1,421 | 1,421 | 100.0 | 1,421 | 1,421 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

## 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 | 買　　付　　額 | 売　　付　　額 | 当期末保有額 |
|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 174 | 25 | 1,100 |

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６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 | 27,742 | 29,965 | 35,880 |
| 外国債券マザーファンド | 5,391 | 5,439 | 11,451 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 10,968 | 11,524 | 21,905 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 12,350 | 11,142 | 14,870 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 3,363 | 2,914 | 5,717 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 2,868 | 2,837 | 5,732 |
| 新興国株式マザーファンド | 15,646 | 16,718 | 14,648 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 2,398 | 2,420 | 2,781 |

＊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６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 | 35,880 | 31.6 |
| 外国債券マザーファンド | 11,451 | 10.1 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 21,905 | 19.3 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 14,870 | 13.1 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 5,717 | 5.0 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 5,732 | 5.0 |
| 新興国株式マザーファンド | 14,648 | 12.9 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 2,781 | 2.4 |
| コール・ローン等、その他 | 694 | 0.6 |
| 投資信託財産総額 | 113,678 | 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（629,041,155千円）の投資信託財産総額（631,826,179千円）に対する比率は99.6％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（304,673,934千円）の投資信託財産総額（305,160,053千円）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（17,647,324千円）の投資信託財産総額（17,697,416千円）に対する比率は99.7％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（13,445,488千円）の投資信託財産総額（13,465,510千円）に対する比率は99.9％です。
＊新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（2,777,328千円）の投資信託財産総額（2,785,495千円）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＝28.78円、１米ドル＝104.58円、１カナダドル＝81.61円、１英ポンド＝153.40円、１スイスフラン＝108.67円、１スウェーデンクローナ＝12.62円、１ノルウェークローネ＝12.57円、１デンマーククローネ＝15.80円、１トルコリラ＝35.88円、１ユーロ＝117.51円、１チェココルナ＝4.34円、１フォリント＝0.3735円、１ズロチ＝26.74円、１ルーブル＝1.64円、１レイ＝25.89円、１香港ドル＝13.48円、１シンガポールドル＝77.85円、１リンギ＝25.91円、１バーツ＝2.97円、１フィリピンペソ＝2.26円、１ルピア＝0.0079円、１ウォン＝0.0905円、１新台湾ドル＝3.25円、１豪ドル＝77.86円、１ニュージーランドドル＝74.50円、１インドルピー＝1.56円、１新シェケル＝27.11円、１メキシコペソ＝5.61円、１レアル＝30.64円、１チリペソ＝0.1549円、１コロンビアペソ＝0.0352円、１ヌエボソル＝31.82円、１UAEディルハム＝28.53円、１エジプトポンド＝11.78円、１ランド＝7.08円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年６月22日現在)

| 項　　目 | 当 期 末 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 資産 | 113,678,498 |
| コール・ローン等 | 691,052 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 35,880,805 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 11,451,879 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 21,905,108 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額) | 14,870,193 |
| J-REITインデックス マザーファンド(評価額) | 5,717,365 |
| 海外REITインデックス マザーファンド(評価額) | 5,732,149 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 14,648,620 |
| 新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド(評価額) | 2,781,327 |
| (B) 負債 | 576,687 |
| 未払収益分配金 | 33,971 |
| 未払信託報酬 | 540,882 |
| 未払利息 | 1 |
| その他未払費用 | 1,833 |
| (C) 純資産総額(Ａ－Ｂ) | 113,101,811 |
| 元本 | 67,943,245 |
| 次期繰越損益金 | 45,158,566 |
| (D) 受益権総口数 | 67,943,245口 |
| １万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ) | 16,647円 |

(注) 期首元本額は66,240,604円、期中追加設定元本額は10,464,010円、期中一部解約元本額は8,761,369円、１口当たり純資産額は1.6647円です。

## ○損益の状況 (2015年12月23日～2016年６月22日)

| 項　　目 | 当　　期 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 31 |
| 受取利息 | 3 |
| 支払利息 | △ 34 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 9,383,357 |
| 売買益 | 2,122,678 |
| 売買損 | △11,506,035 |
| (C) 信託報酬等 | △ 542,715 |
| (D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ) | △ 9,926,103 |
| (E) 前期繰越損益金 | 1,711,450 |
| (F) 追加信託差損益金 | 53,407,190 |
| (配当等相当額) | ( 35,781,725) |
| (売買損益相当額) | ( 17,625,465) |
| (G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ) | 45,192,537 |
| (H) 収益分配金 | △ 33,971 |
| 次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ) | 45,158,566 |
| 追加信託差損益金 | 53,407,190 |
| (配当等相当額) | ( 35,808,013) |
| (売買損益相当額) | ( 17,599,177) |
| 分配準備積立金 | 9,871,160 |
| 繰越損益金 | △18,119,784 |

＊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 (2015年12月23日～2016年６月22日) は以下の通りです。

| 項　　目 | 当　　期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| a. 配当等収益(経費控除後) | 917,441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 | 35,808,013円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 8,987,690円 |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d) | 45,713,144円 |
| f. 分配対象収益(１万口当たり) | 6,728円 |
| g. 分配金 | 33,971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

（2015年12月23日～2016年６月22日）

| 項目 | 当期 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 信託報酬 | 45 | 0.464 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （投信会社） | （17） | （0.178） | 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） | （0.259） | 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 | 0.005 | (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<br>※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） | （0.003） | |
| （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 | 0.003 | (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<br>※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） | （0.003） | |
| （投資信託証券） | （0） | （0.000） | |
| (d) その他費用 | 1 | 0.015 | (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） | （0.014） | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （監査費用） | （0） | （0.001） | 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 | 46 | 0.487 | |
| 期中の平均基準価額は、9,664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

(2015年12月23日～2016年６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 | 14,083 | 17,547 | 3,607 | 4,477 |
| 外国債券マザーファンド | 1,874 | 4,144 | 532 | 1,198 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 5,307 | 10,357 | 1,365 | 2,629 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 3,901 | 5,099 | 1,431 | 1,864 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 1,302 | 2,565 | 529 | 1,037 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 1,204 | 2,427 | 346 | 696 |
| 新興国株式マザーファンド | 8,176 | 7,306 | 2,373 | 2,123 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 835 | 979 | 246 | 289 |

＊単位未満は切り捨て。

## ○株式売買比率

(2015年12月23日～2016年６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 | 42,481,412千円 | 25,121,548千円 | 2,549,870千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 276,988,624千円 | 305,103,470千円 | 12,625,170千円 |
| (c) 売買高比率 (a) ／ (b) | 0.15 | 0.08 | 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12月23日～2016年６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＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 預金 | 4 | 4 | 100.0 | 4 | 4 | 100.0 |

＜国内株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 36,002 | 3 | 0.0 | 6,478 | － | － |
| 貸株 | 59,830 | 5,546 | 9.3 | 67,035 | 4,715 | 7.0 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

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。

＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 25,605 | 2,828 | 11.0 | 10,345 | 319 | 3.1 |
| 預金 | 11,916 | 11,916 | 100.0 | 11,916 | 11,916 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国株式マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 3,386 | 833 | 24.6 | 1,592 | 762 | 47.9 |
| 預金 | 825 | 825 | 100.0 | 825 | 825 | 100.0 |

平均保有割合　0.1%

＜国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド＞

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 65,081 | 6,390 | 9.8 | 62,754 | 3,405 | 5.4 |
| 預金 | 73,491 | 73,491 | 100.0 | 73,491 | 73,491 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜外国債券マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 64,939 | 3,150 | 4.9 | 27,267 | 2,157 | 7.9 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,875 | 355 | 12.3 | 1,775 | 355 | 20.0 |
| 預金 | 359 | 359 | 100.0 | 359 | 359 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜J－REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 投資信託証券 | 4,568 | 854 | 18.7 | 2,955 | 150 | 5.1 |
| 預金 | 9,337 | 9,337 | 100.0 | 9,337 | 9,337 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

| 区　　分 | 買付額等 A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 2,237 | 57 | 2.5 | 1,390 | 31 | 2.2 |
| 預金 | 1,421 | 1,421 | 100.0 | 1,421 | 1,421 | 100.0 |

平均保有割合　0.0%

## 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 | 買　　付　　額 | 売　　付　　額 | 当期末保有額 |
|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 174 | 25 | 1,100 |

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。

## ○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2015年12月23日～2016年６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 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | |
| 1 | － | － | 1 | 当初設定時における取得 |

## ○組入資産の明細

(2016年６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 | 7,772 | 18,248 | 21,850 |
| 外国債券マザーファンド | 1,124 | 2,466 | 5,193 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 3,070 | 7,012 | 13,329 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 2,570 | 5,040 | 6,726 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 874 | 1,647 | 3,233 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 746 | 1,604 | 3,241 |
| 新興国株式マザーファンド | 4,390 | 10,192 | 8,930 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 494 | 1,083 | 1,245 |

＊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６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 | 21,850 | 34.1 |
| 外国債券マザーファンド | 5,193 | 8.1 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 13,329 | 20.8 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド | 6,726 | 10.5 |
| J－REITインデックス マザーファンド | 3,233 | 5.0 |
| 海外REITインデックス マザーファンド | 3,241 | 5.1 |
| 新興国株式マザーファンド | 8,930 | 13.9 |
| 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド | 1,245 | 1.9 |
| コール・ローン等、その他 | 291 | 0.6 |
| 投資信託財産総額 | 64,038 | 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（629,041,155千円）の投資信託財産総額（631,826,179千円）に対する比率は99.6％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（304,673,934千円）の投資信託財産総額（305,160,053千円）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（17,647,324千円）の投資信託財産総額（17,697,416千円）に対する比率は99.7％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（13,445,488千円）の投資信託財産総額（13,465,510千円）に対する比率は99.9％です。
＊新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（2,777,328千円）の投資信託財産総額（2,785,495千円）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＝28.78円、１米ドル＝104.58円、１カナダドル＝81.61円、１英ポンド＝153.40円、１スイスフラン＝108.67円、１スウェーデンクローナ＝12.62円、１ノルウェークローネ＝12.57円、１デンマーククローネ＝15.80円、１トルコリラ＝35.88円、１ユーロ＝117.51円、１チェココルナ＝4.34円、１フォリント＝0.3735円、１ズロチ＝26.74円、１ルーブル＝1.64円、１レイ＝25.89円、１香港ドル＝13.48円、１シンガポールドル＝77.85円、１リンギ＝25.91円、１バーツ＝2.97円、１フィリピンペソ＝2.26円、１ルピア＝0.0079円、１ウォン＝0.0905円、１新台湾ドル＝3.25円、１豪ドル＝77.86円、１ニュージーランドドル＝74.50円、１インドルピー＝1.56円、１新シェケル＝27.11円、１メキシコペソ＝5.61円、１レアル＝30.64円、１チリペソ＝0.1549円、１コロンビアペソ＝0.0352円、１ヌエボソル＝31.82円、１UAEディルハム＝28.53円、１エジプトポンド＝11.78円、１ランド＝7.08円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年６月22日現在)

| 項　　目 | 当 期 末 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 資産 | 64,038,196 |
| コール・ローン等 | 287,144 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 21,850,498 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 5,193,438 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 13,329,981 |
| 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額) | 6,726,991 |
| J－REITインデックス マザーファンド(評価額) | 3,233,036 |
| 海外REITインデックス マザーファンド(評価額) | 3,241,397 |
| 新興国株式マザーファンド(評価額) | 8,930,596 |
| 新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド(評価額) | 1,245,115 |
| (B) 負債 | 224,778 |
| 未払信託報酬 | 224,058 |
| その他未払費用 | 720 |
| (C) 純資産総額(Ａ－Ｂ) | 63,813,418 |
| 元本 | 69,412,102 |
| 次期繰越損益金 | △ 5,598,684 |
| (D) 受益権総口数 | 69,412,102口 |
| １万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ) | 9,193円 |

(注) 期首元本額は30,991,771円、期中追加設定元本額は54,275,921円、期中一部解約元本額は15,855,590円、１口当たり純資産額は0.9193円です。

## ○損益の状況 (2015年12月23日～2016年６月22日)

| 項　　目 | 当　　期 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 15 |
| 支払利息 | △ 15 |
| (B) 有価証券売買損益 | △2,962,297 |
| 売買益 | 1,043,177 |
| 売買損 | △4,005,474 |
| (C) 信託報酬等 | △ 224,778 |
| (D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ) | △3,187,090 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 400,278 |
| (F) 追加信託差損益金 | △2,011,316 |
| (配当等相当額) | ( 69,484) |
| (売買損益相当額) | (△2,080,800) |
| (G) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ) | △5,598,684 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(Ｇ＋Ｈ) | △5,598,684 |
| 追加信託差損益金 | △2,011,316 |
| (配当等相当額) | ( 205,131) |
| (売買損益相当額) | (△2,216,447) |
| 分配準備積立金 | 422,285 |
| 繰越損益金 | △4,009,653 |

＊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 (2015年12月23日～2016年６月22日) は以下の通りです。

| 項　　目 | 当　　期<br>2015年12月23日～<br>2016年６月22日 |
|---|---|
| a. 配当等収益(経費控除後) | 417,023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 | 205,131円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 5,262円 |
| e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d) | 627,416円 |
| f. 分配対象収益(１万口当たり) | 90円 |
| g. 分配金 | 0円 |
| h. 分配金(１万口当たり) | 0円 |

## ○分配金のお知らせ

| | |
|---|---|
| １万口当たり分配金（税込み） | 0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６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(226,426,586千口)の内容です。

#### 国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| **水産・農林業（0.1%）** | | | |
| 極洋 | 59 | 66 | 17,358 |
| 日本水産 | 161.5 | 179.2 | 101,068 |
| マルハニチロ | 28.6 | 31.8 | 89,167 |
| サカタのタネ | 22.6 | 22.9 | 51,250 |
| ホクト | 14.2 | 15.8 | 31,094 |
| ホクリヨウ | － | 1.5 | 1,290 |
| **鉱業（0.3%）** | | | |
| 住石ホールディングス | 41.2 | 45.7 | 3,930 |
| 日鉄鉱業 | 39 | 43 | 14,749 |
| 三井松島産業 | 92 | 102 | 9,996 |
| 国際石油開発帝石 | 738.2 | 819.2 | 699,269 |
| 日本海洋掘削 | 4.2 | 4.7 | 10,720 |
| 石油資源開発 | 22.2 | 24.6 | 52,963 |
| Ｋ＆Ｏエナジーグループ | 9.4 | 10.5 | 13,608 |
| **建設業（3.2%）** | | | |
| ショーボンドホールディングス | 13.6 | 16.3 | 73,187 |
| ミライト・ホールディングス | 43.1 | 47.8 | 46,652 |
| タマホーム | 10.5 | 11.7 | 4,960 |
| サンヨーホームズ | 2.9 | 3.3 | 1,564 |
| ダイセキ環境ソリューション | 3.3 | 3.6 | 3,830 |
| 安藤・間 | 93.5 | 103.8 | 57,193 |
| 東急建設 | 45.6 | 50.6 | 46,450 |
| コムシスホールディングス | 62.4 | 66.8 | 110,086 |
| ミサワホーム | 16.5 | 18.4 | 13,340 |
| ビーアールホールディングス | － | 6.1 | 2,446 |
| 高松コンストラクショングループ | 10.6 | 11.7 | 27,799 |
| 東建コーポレーション | 5.2 | 6.4 | 51,648 |
| ソネック | － | 1.7 | 979 |
| ヤマウラ | 6.6 | 7.3 | 3,788 |
| 大成建設 | 728 | 808 | 657,712 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 大林組 | 420 | 466.4 | 489,720 |
| 清水建設 | 429 | 476 | 440,300 |
| 飛島建設 | 100.2 | 124.8 | 21,216 |
| 長谷工コーポレーション | 163.5 | 181.5 | 192,934 |
| 松井建設 | 15.4 | 17.1 | 18,006 |
| 錢高組 | 20 | 22 | 7,348 |
| 鹿島建設 | 657 | 729 | 500,823 |
| 不動テトラ | 99 | 109.8 | 16,360 |
| 大末建設 | 5.4 | 5.9 | 5,675 |
| 鉄建建設 | 85 | 95 | 26,980 |
| 西松建設 | 162 | 180 | 79,740 |
| 三井住友建設 | 537 | 595.9 | 54,226 |
| 大豊建設 | 54 | 60 | 27,660 |
| 前田建設工業 | 86 | 96 | 69,504 |
| 佐田建設 | 9.6 | 10.7 | 3,734 |
| ナカノフドー建設 | 10.7 | 11.9 | 5,105 |
| 奥村組 | 133 | 148 | 77,256 |
| 東鉄工業 | 16.8 | 18.7 | 49,779 |
| イチケン | 16 | 17 | 4,641 |
| 淺沼組 | 45 | 50 | 10,500 |
| 戸田建設 | 163 | 181 | 75,839 |
| 熊谷組 | 205 | 228 | 60,876 |
| 青木あすなろ建設 | 9.2 | 10.2 | 7,119 |
| 北野建設 | 29 | 32 | 7,840 |
| 植木組 | 17 | 19 | 3,743 |
| 三井ホーム | 18 | 20 | 8,920 |
| 矢作建設工業 | 19.1 | 21.1 | 16,584 |
| ピーエス三菱 | 16.6 | 18.4 | 6,642 |
| 日本ハウスホールディングス | 28.6 | 31.7 | 9,922 |
| 大東建託 | 52.4 | 57.2 | 932,646 |
| 新日本建設 | 16.7 | 18.5 | 11,285 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ＮＩＰＰＯ | 32 | 36 | 63,504 |
| 東亜道路工業 | 26 | 29 | 7,627 |
| 前田道路 | 44 | 49 | 86,093 |
| 日本道路 | 42 | 46 | 18,216 |
| 東亜建設工業 | 122 | 136 | 21,352 |
| 若築建設 | 81 | 89 | 12,549 |
| 東洋建設 | 44 | 48.8 | 21,374 |
| 五洋建設 | 155.5 | 172.6 | 91,650 |
| 大林道路 | 16 | 18.2 | 11,939 |
| 世紀東急工業 | 22 | 24.4 | 11,931 |
| 福田組 | 23 | 25 | 26,175 |
| 住友林業 | 96.5 | 107 | 159,751 |
| 日本基礎技術 | 15.6 | 17.3 | 5,847 |
| 日成ビルド工業 | 39 | 43 | 23,177 |
| ヤマダ・エスバイエルホーム | 71 | 79 | 5,609 |
| 巴コーポレーション | 17.4 | 19.3 | 6,330 |
| パナホーム | 52 | 58 | 47,212 |
| 大和ハウス工業 | 414 | 459.4 | 1,371,309 |
| ライト工業 | 26.9 | 29.9 | 31,424 |
| 積水ハウス | 468.5 | 519.9 | 931,920 |
| 日特建設 | 15.3 | 17 | 6,698 |
| 北陸電気工事 | 5.1 | 7.5 | 5,670 |
| ユアテック | 22 | 25 | 17,700 |
| 西部電気工業 | 12 | 13 | 5,278 |
| 四電工 | 11 | 12 | 4,692 |
| 中電工 | 20.2 | 22.5 | 45,990 |
| 関電工 | 56 | 62 | 51,522 |
| きんでん | 84.7 | 94 | 104,058 |
| 東京エネシス | 16 | 18 | 18,882 |
| トーエネック | 20 | 22 | 11,220 |
| 住友電設 | 11.1 | 12.3 | 13,751 |
| 日本電設工業 | 22.8 | 25.3 | 42,655 |
| 協和エクシオ | 54.9 | 60.9 | 75,150 |
| 新日本空調 | 11.8 | 13.1 | 13,008 |
| ＮＤＳ | 23 | 24 | 6,072 |
| 九電工 | 26 | 28.5 | 90,060 |
| 三機工業 | 31.1 | 34.5 | 29,152 |
| 日揮 | 141 | 156 | 226,668 |
| 中外炉工業 | 42 | 47 | 9,588 |
| ヤマト | 12.5 | 13.9 | 7,200 |
| 太平電業 | 21 | 23 | 24,725 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 高砂熱学工業 | 41.8 | 46.4 | 57,072 |
| 三晃金属工業 | 14 | 15 | 4,470 |
| 朝日工業社 | 16 | 18 | 8,766 |
| 明星工業 | 25.4 | 28.2 | 12,887 |
| 大氣社 | 17.1 | 19 | 48,051 |
| ダイダン | 19 | 21 | 16,044 |
| 日比谷総合設備 | 16.9 | 18.7 | 28,424 |
| 東芝プラントシステム | 22.8 | 25.3 | 39,721 |
| ＯＳＪＢホールディングス | 28.5 | 31.7 | 6,054 |
| 東洋エンジニアリング | 75 | 83 | 28,801 |
| 千代田化工建設 | 101 | 112 | 77,504 |
| 新興プランテック | 28.8 | 31.9 | 24,084 |
| **食料品（5.3%）** | | | |
| 日本製粉 | 93 | 100 | 78,400 |
| 日清製粉グループ本社 | 153.7 | 170.5 | 287,974 |
| 日東富士製粉 | 11 | 12 | 4,104 |
| 昭和産業 | 58 | 64 | 29,504 |
| 鳥越製粉 | 11.1 | 12.3 | 7,995 |
| 中部飼料 | 13 | 14.4 | 10,310 |
| フィード・ワン | 84.3 | 93.6 | 11,044 |
| 東洋精糖 | 21 | 24 | 2,496 |
| 日本甜菜製糖 | 71 | 79 | 14,141 |
| 三井製糖 | 55 | 61 | 30,317 |
| 塩水港精糖 | 15 | 16.6 | 3,668 |
| 日新製糖 | － | 6.6 | 9,055 |
| 森永製菓 | 126 | 140 | 89,600 |
| 中村屋 | 32 | 36 | 16,668 |
| 江崎グリコ | 32.4 | 35.9 | 214,682 |
| 名糖産業 | 6.2 | 6.9 | 8,873 |
| 不二家 | 80 | 89 | 17,444 |
| 山崎製パン | 103 | 114 | 317,034 |
| 第一屋製パン | 22 | 24 | 2,712 |
| モロゾフ | 21 | 24 | 10,224 |
| 亀田製菓 | 7.8 | 8.7 | 48,111 |
| 寿スピリッツ | 3.3 | 11.1 | 35,409 |
| カルビー | 51.9 | 57.6 | 244,512 |
| 森永乳業 | 126 | 139 | 96,744 |
| 六甲バター | 6.2 | 6.9 | 15,318 |
| ヤクルト本社 | 75.1 | 83.4 | 456,198 |
| 明治ホールディングス | 83 | 92.1 | 951,393 |
| 雪印メグミルク | 33 | 36.6 | 126,453 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| プリマハム | 88 | 98 | 31,066 |
| 日本ハム | 103 | 114 | 278,160 |
| 伊藤ハム | 67 | － | － |
| 林兼産業 | 45 | 50 | 4,250 |
| 丸大食品 | 72 | 80 | 38,240 |
| 米久 | 4.5 | － | － |
| Ｓ　Ｆｏｏｄｓ | 8.8 | 9.7 | 26,015 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | － | 92.9 | 93,085 |
| サッポロホールディングス | 214 | 238 | 134,708 |
| アサヒグループホールディングス | 262.9 | 291.8 | 995,329 |
| キリンホールディングス | 567.9 | 630.2 | 1,091,506 |
| 宝ホールディングス | 101.4 | 112.6 | 107,420 |
| オエノンホールディングス | 38 | 42 | 8,568 |
| 養命酒製造 | 4.3 | 4.8 | 8,572 |
| コカ・コーラウエスト | 47.5 | 52.7 | 152,830 |
| コカ・コーライーストジャパン | 49.6 | 55 | 108,790 |
| サントリー食品インターナショナル | 96 | 106.5 | 524,512 |
| ダイドードリンコ | 7.1 | 7.9 | 43,608 |
| 伊藤園 | 41.6 | 46.1 | 179,790 |
| キーコーヒー | 12.3 | 13.7 | 25,386 |
| ユニカフェ | 3.8 | 4.2 | 3,691 |
| ジャパンフーズ | 1.8 | 2 | 2,344 |
| 日清オイリオグループ | 74 | 82 | 40,426 |
| 不二製油グループ本社 | 37.4 | 41.5 | 78,642 |
| かどや製油 | 1.4 | 1.5 | 4,234 |
| Ｊ－オイルミルズ | 59 | 65 | 22,555 |
| キッコーマン | 106 | 118 | 451,940 |
| 味の素 | 300 | 327 | 834,994 |
| キユーピー | 71.3 | 79.1 | 256,679 |
| ハウス食品グループ本社 | 47.9 | 53.1 | 122,236 |
| カゴメ | 50.3 | 55.8 | 149,544 |
| 焼津水産化学工業 | 6.6 | 7.3 | 7,227 |
| アリアケジャパン | 11.5 | 12.7 | 82,423 |
| ピエトロ | － | 1.5 | 2,652 |
| エバラ食品工業 | 3.4 | 3.7 | 7,059 |
| ニチレイ | 149 | 166 | 154,878 |
| 東洋水産 | 68.9 | 76.5 | 322,830 |
| イートアンド | 1.5 | 1.7 | 3,437 |
| 日清食品ホールディングス | 59.3 | 65.8 | 360,584 |
| 永谷園ホールディングス | 13 | 15 | 18,270 |
| 一正蒲鉾 | 4.9 | 5.4 | 5,929 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フジッコ | 13.6 | 15.1 | 43,035 |
| ロック・フィールド | 7.3 | 16.2 | 24,802 |
| 日本たばこ産業 | 828.5 | 919.4 | 3,877,109 |
| ケンコーマヨネーズ | 4.6 | 5.1 | 14,433 |
| わらべや日洋 | 7.5 | 8.4 | 16,556 |
| なとり | 7 | 7.8 | 11,801 |
| 北の達人コーポレーション | － | 2.9 | 1,394 |
| ユーグレナ | 47.1 | 49.8 | 72,259 |
| ミヨシ油脂 | 48 | 53 | 6,307 |
| 理研ビタミン | 4.1 | 4.6 | 21,597 |
| **繊維製品（0.7%）** | | | |
| 片倉工業 | 16.4 | 18.2 | 20,766 |
| グンゼ | 106 | 118 | 33,866 |
| 東洋紡 | 519 | 576 | 113,472 |
| ユニチカ | 381 | 423 | 24,111 |
| 富士紡ホールディングス | 64 | 71 | 18,744 |
| 倉敷紡績 | 134 | 149 | 27,416 |
| シキボウ | 80 | 89 | 9,434 |
| 日本毛織 | 41 | 44.7 | 32,586 |
| 大東紡織 | 19 | 21 | 1,344 |
| トーア紡コーポレーション | 5.6 | 6.2 | 2,852 |
| ダイドーリミテッド | 14.6 | 16.2 | 7,290 |
| 帝国繊維 | 13.7 | 15.2 | 19,152 |
| 帝人 | 535 | 594 | 209,682 |
| 東レ | 950 | 1,055 | 966,380 |
| サカイオーベックス | 35 | 38 | 5,852 |
| 住江織物 | 33 | 36 | 8,280 |
| 日本フエルト | 6.9 | 7.7 | 3,742 |
| イチカワ | 9 | 10 | 2,560 |
| 日東製網 | 15 | 16 | 2,448 |
| 芦森工業 | 28 | 31 | 5,425 |
| アツギ | 101 | 112 | 12,208 |
| ダイニック | 25 | 27 | 4,158 |
| セーレン | 32.6 | 36.2 | 37,141 |
| 東海染工 | 18 | 20 | 2,400 |
| 小松精練 | 20.1 | 22.3 | 13,446 |
| ワコールホールディングス | 78 | 87 | 90,393 |
| ホギメディカル | 8.2 | 9.2 | 61,640 |
| レナウン | 35.4 | 39.3 | 4,244 |
| クラウディア | 3.4 | 3.3 | 1,593 |
| ＴＳＩホールディングス | 58.5 | 64.9 | 37,901 |

| 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 | 74 | 82 | 17,548 |
| ナイガイ | 48 | 53 | 2,279 |
| オンワードホールディングス | 87 | 94 | 62,980 |
| ルック | 24 | 26 | 3,536 |
| キムラタン | 552 | 613 | 4,291 |
| ゴールドウイン | 5.6 | 6.2 | 29,264 |
| デサント | 29.9 | 33.2 | 38,246 |
| キング | 6.5 | 7.2 | 2,527 |
| ヤマトインターナショナル | 8.1 | 9 | 3,420 |
| **パルプ・紙（0.3%）** | | | |
| 特種東海製紙 | 76 | 84 | 28,812 |
| 王子ホールディングス | 537 | 596 | 245,552 |
| 日本製紙 | 67.7 | 75.1 | 140,211 |
| 三菱製紙 | 200 | 221 | 15,912 |
| 北越紀州製紙 | 81.3 | 90.2 | 62,689 |
| 中越パルプ工業 | 52 | 58 | 12,122 |
| 巴川製紙所 | 20 | 22 | 3,894 |
| 大王製紙 | 58 | 64.4 | 72,385 |
| レンゴー | 116 | 128 | 81,792 |
| トーモク | 41 | 46 | 13,386 |
| ザ・パック | 9.3 | 10.3 | 27,346 |
| **化学（6.2%）** | | | |
| クラレ | 206.7 | 229.4 | 299,367 |
| 旭化成 | 817 | 907 | 629,276 |
| 共和レザー | 8.6 | 9.5 | 7,619 |
| 昭和電工 | 872 | 968 | 101,640 |
| 住友化学 | 964 | 1,070 | 493,270 |
| 日本化成 | 24 | 27 | 2,835 |
| 住友精化 | 27 | 30 | 18,450 |
| 日産化学工業 | 78.8 | 87.4 | 270,066 |
| ラサ工業 | 49 | 55 | 5,280 |
| クレハ | 99 | 110 | 41,800 |
| 多木化学 | 8 | 9 | 5,769 |
| テイカ | 22 | 24 | 12,000 |
| 石原産業 | 235 | 261 | 17,748 |
| 片倉コープアグリ | 16 | 18 | 3,618 |
| 日東エフシー | 7.7 | 8.5 | 7,012 |
| 日本曹達 | 85 | 94 | 42,300 |
| 東ソー | 353 | 392 | 210,112 |
| トクヤマ | 217 | 241 | 72,541 |
| セントラル硝子 | 142 | 157 | 75,831 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東亜合成 | 82 | 91 | 88,725 |
| 大阪ソーダ | 56 | 63 | 25,956 |
| 関東電化工業 | 31 | 35 | 31,150 |
| デンカ | 271 | 301 | 128,828 |
| 信越化学工業 | 234.9 | 260.7 | 1,572,542 |
| 日本カーバイド工業 | 45 | 49 | 7,252 |
| 堺化学工業 | 53 | 59 | 16,697 |
| エア・ウォーター | 108 | 120 | 183,600 |
| 大陽日酸 | 100.9 | 112 | 98,000 |
| 日本化学工業 | 49 | 54 | 11,070 |
| 日本パーカライジング | 66.9 | 74.3 | 79,723 |
| 高圧ガス工業 | 19 | 22 | 13,134 |
| チタン工業 | 15 | 17 | 2,907 |
| 四国化成工業 | 19 | 21 | 17,535 |
| 戸田工業 | 26 | 29 | 8,207 |
| ステラ　ケミファ | 6.7 | 7.4 | 21,985 |
| 保土谷化学工業 | 39 | 44 | 12,408 |
| 日本触媒 | 19 | 21.1 | 135,040 |
| 大日精化工業 | 51 | 56 | 23,912 |
| カネカ | 177 | 196 | 142,884 |
| 三菱瓦斯化学 | 225 | 250 | 140,250 |
| 三井化学 | 556 | 617 | 237,545 |
| ＪＳＲ | 129.4 | 136.4 | 194,506 |
| 東京応化工業 | 26.3 | 29.2 | 77,818 |
| 大阪有機化学工業 | 9.4 | 10.4 | 5,876 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 877.4 | 973.7 | 484,610 |
| 日本合成化学工業 | 31 | 34 | 19,686 |
| ダイセル | 184.2 | 204.5 | 234,561 |
| 住友ベークライト | 123 | 128 | 65,024 |
| 積水化学工業 | 303.2 | 330 | 438,240 |
| 日本ゼオン | 113 | 123 | 90,159 |
| アイカ工業 | 39.4 | 43.7 | 102,563 |
| 宇部興産 | 701 | 778 | 136,150 |
| 積水樹脂 | 20.2 | 22.4 | 31,763 |
| タキロン | 31 | 34 | 15,912 |
| 旭有機材 | 42 | 47 | 9,259 |
| 日立化成 | 64.7 | 71.8 | 141,446 |
| ニチバン | 13 | 14 | 11,172 |
| リケンテクノス | 21.2 | 31.3 | 13,552 |
| 大倉工業 | 31 | 35 | 9,975 |
| 積水化成品工業 | 34 | 37 | 11,988 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 群栄化学工業 | 35 | 39 | 10,959 |
| タイガースポリマー | 6.4 | 7.2 | 3,996 |
| ミライアル | 4.7 | 5.2 | 3,775 |
| ダイキアクシス | 2.4 | 2.7 | 2,365 |
| ダイキョーニシカワ | 4.2 | 18.7 | 26,123 |
| 日本化薬 | 85 | 94 | 98,324 |
| カーリットホールディングス | 12.1 | 13.5 | 6,250 |
| 日本精化 | 10.8 | 12 | 8,712 |
| 扶桑化学工業 | － | 9.2 | 13,165 |
| ＡＤＥＫＡ | 64.4 | 71.5 | 93,379 |
| 日油 | 100 | 109 | 93,522 |
| 新日本理化 | 20.7 | 22.9 | 3,389 |
| ハリマ化成グループ | 11.1 | 12.4 | 6,324 |
| 花王 | 352.3 | 391 | 2,362,422 |
| 第一工業製薬 | 29 | 32 | 10,592 |
| ニイタカ | 1.9 | 2.1 | 2,646 |
| 三洋化成工業 | 41 | 46 | 38,824 |
| 大日本塗料 | 75 | 83 | 16,019 |
| 日本ペイントホールディングス | 101.1 | 112.2 | 287,568 |
| 関西ペイント | 148.2 | 164.5 | 336,073 |
| 神東塗料 | 10 | 11 | 1,793 |
| 中国塗料 | 38 | 42 | 27,846 |
| 日本特殊塗料 | 9.2 | 10.2 | 11,658 |
| 藤倉化成 | 17.8 | 19.7 | 11,701 |
| 太陽ホールディングス | 9.6 | 10.7 | 34,668 |
| ＤＩＣ | 525 | 574 | 136,612 |
| サカタインクス | 26.7 | 29.7 | 38,016 |
| 東洋インキＳＣホールディングス | 129 | 144 | 63,504 |
| Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ | 4.7 | 10.5 | 7,990 |
| 富士フイルムホールディングス | 299.8 | 332.7 | 1,367,397 |
| 資生堂 | 248.5 | 275.8 | 746,039 |
| ライオン | 151 | 168 | 275,352 |
| 高砂香料工業 | 8.6 | 9.6 | 24,556 |
| マンダム | 12.2 | 13.5 | 66,217 |
| ミルボン | 7.7 | 8.6 | 40,162 |
| ファンケル | 30.4 | 33.7 | 48,022 |
| コーセー | 21.2 | 23.5 | 205,860 |
| コタ | 4.1 | 5 | 5,490 |
| シーズ・ホールディングス | 17.8 | 18.3 | 40,571 |
| シーボン | 1.5 | 1.7 | 3,592 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 13.3 | 14.8 | 134,976 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ノエビアホールディングス | 8.3 | 9.2 | 28,060 |
| アジュバンコスメジャパン | 2.4 | 2.7 | 2,435 |
| エステー | 8.9 | 9.9 | 10,949 |
| アグロ　カネショウ | 5.1 | 5.6 | 5,913 |
| コニシ | 10.3 | 22.8 | 30,369 |
| 長谷川香料 | 16.6 | 18.4 | 33,524 |
| 星光ＰＭＣ | 7.2 | 7.9 | 8,002 |
| 小林製薬 | 19.8 | 22 | 194,260 |
| 荒川化学工業 | 11.2 | 12.4 | 12,139 |
| メック | 10.1 | 11.2 | 10,595 |
| 日本高純度化学 | 3.7 | 4.1 | 8,216 |
| タカラバイオ | － | 31.1 | 40,927 |
| ＪＣＵ | 3.8 | 4.3 | 13,932 |
| 新田ゼラチン | 8.6 | 9.5 | 6,830 |
| ＯＡＴアグリオ | － | 1.7 | 2,284 |
| デクセリアルズ | 29.4 | 43.4 | 35,023 |
| アース製薬 | 9.4 | 10.4 | 52,104 |
| イハラケミカル工業 | 20.1 | 22.3 | 25,756 |
| 北興化学工業 | 14 | 16 | 4,656 |
| 大成ラミック | 3.7 | 4.1 | 11,660 |
| クミアイ化学工業 | 27 | 30 | 19,470 |
| 日本農薬 | 29.9 | 33.2 | 15,537 |
| アキレス | 111 | 119 | 15,232 |
| 有沢製作所 | 19.3 | 21.5 | 11,287 |
| 日東電工 | 101.2 | 112.3 | 725,345 |
| レック | 4.1 | 4.5 | 7,479 |
| きもと | 21.3 | 23.6 | 3,728 |
| 藤森工業 | 11.2 | 12.5 | 26,125 |
| 前澤化成工業 | 9.2 | 10.2 | 10,261 |
| ＪＳＰ | 8.5 | 9.5 | 18,012 |
| エフピコ | 11.6 | 12.9 | 61,597 |
| 天馬 | 10.1 | 11.2 | 17,427 |
| 信越ポリマー | 25.7 | 28.5 | 17,214 |
| 東リ | 34 | 37 | 10,767 |
| ニフコ | 25 | 27.8 | 151,788 |
| 日本バルカー工業 | 51 | 56 | 14,616 |
| ユニ・チャーム | 265.2 | 294.3 | 651,580 |
| **医薬品（5.9%）** | | | |
| 協和発酵キリン | 157 | 173.9 | 309,368 |
| 武田薬品工業 | 521.7 | 579 | 2,554,548 |
| アステラス製薬 | 1,466.8 | 1,627.7 | 2,647,454 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 大日本住友製薬 | 92.7 | 102.9 | 174,621 |
| 塩野義製薬 | 190.9 | 211.9 | 1,231,350 |
| 田辺三菱製薬 | 152.6 | 169.4 | 313,220 |
| わかもと製薬 | 15 | 17 | 4,063 |
| あすか製薬 | 16.6 | 18.4 | 31,592 |
| 日本新薬 | 30 | 33.3 | 179,820 |
| ビオフェルミン製薬 | 2.1 | 2.4 | 6,590 |
| 中外製薬 | 130.4 | 144.7 | 523,090 |
| 科研製薬 | 22.6 | 25.1 | 167,166 |
| エーザイ | 161.2 | 178.9 | 1,052,647 |
| ロート製薬 | 64.1 | 71.2 | 114,062 |
| 小野薬品工業 | 59.5 | 330.1 | 1,464,323 |
| 久光製薬 | 40.7 | 45.1 | 273,306 |
| 有機合成薬品工業 | 9 | 9 | 2,124 |
| 持田製薬 | 9 | 9.9 | 79,893 |
| 参天製薬 | 241.1 | 267.7 | 414,935 |
| 扶桑薬品工業 | 44 | 49 | 13,377 |
| 日本ケミファ | 18 | 20 | 9,700 |
| ツムラ | 41.2 | 45.7 | 121,013 |
| 日医工 | 30.6 | 34 | 72,590 |
| キッセイ薬品工業 | 23.2 | 25.7 | 53,918 |
| 生化学工業 | 25 | 27.8 | 44,090 |
| 栄研化学 | 11 | 12.2 | 28,316 |
| 日水製薬 | 5.3 | 5.8 | 6,617 |
| 鳥居薬品 | 8.9 | 9.9 | 22,789 |
| ＪＣＲファーマ | 10.1 | 11.2 | 32,748 |
| 東和薬品 | 6 | 6.7 | 37,319 |
| 富士製薬工業 | 3.6 | 4.7 | 10,669 |
| 沢井製薬 | 22.2 | 24.7 | 187,967 |
| ゼリア新薬工業 | 26.8 | 29.8 | 45,534 |
| 第一三共 | 440.5 | 488.9 | 1,248,895 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 34.9 | 38.8 | 77,832 |
| 大幸薬品 | 6.4 | 7.2 | 10,908 |
| ダイト | 5.8 | 8.1 | 21,529 |
| 大塚ホールディングス | 281.6 | 312.5 | 1,502,500 |
| 大正製薬ホールディングス | 31.5 | 35 | 362,250 |
| ペプチドリーム | － | 24.2 | 145,926 |
| **石油・石炭製品（0.5%）** | | | |
| 日本コークス工業 | 105.7 | 117.3 | 7,389 |
| 昭和シェル石油 | 131.7 | 146.2 | 167,837 |
| ニチレキ | 16 | 17.8 | 11,445 |
| 東燃ゼネラル石油 | 198 | 219 | 213,087 |
| ユシロ化学工業 | 7 | 7.8 | 10,670 |
| ビーピー・カストロール | 5.4 | 5.9 | 7,327 |
| 富士石油 | 30.4 | 33.7 | 12,165 |
| ＭＯＲＥＳＣＯ | 4.1 | 4.6 | 5,087 |
| 出光興産 | 68.3 | 75.8 | 179,191 |
| ＪＸホールディングス | 1,550.5 | 1,720.7 | 709,272 |
| コスモエネルギーホールディングス | 39.5 | 43.8 | 57,728 |
| **ゴム製品（0.9%）** | | | |
| 横浜ゴム | 79 | 87.7 | 118,131 |
| 東洋ゴム工業 | 59.3 | 65.8 | 75,077 |
| ブリヂストン | 442.1 | 490.6 | 1,691,588 |
| 住友ゴム工業 | 122.6 | 136 | 199,512 |
| 藤倉ゴム工業 | 10.9 | 12.1 | 4,888 |
| オカモト | 41 | 45 | 48,600 |
| フコク | 4.8 | 5.3 | 3,975 |
| ニッタ | 14.1 | 15.7 | 38,700 |
| 住友理工 | 28.3 | 31.4 | 25,591 |
| 三ツ星ベルト | 32 | 35 | 27,300 |
| バンドー化学 | 48 | 53 | 26,553 |
| **ガラス・土石製品（0.9%）** | | | |
| 日東紡績 | 87 | 96 | 32,544 |
| 旭硝子 | 691 | 767 | 461,734 |
| 日本板硝子 | 632 | 701 | 56,781 |
| 石塚硝子 | 18 | 20 | 3,220 |
| 日本山村硝子 | 52 | 58 | 9,106 |
| 日本電気硝子 | 271 | 300 | 138,300 |
| オハラ | 4.9 | 5.5 | 2,750 |
| 住友大阪セメント | 259 | 288 | 121,824 |
| 太平洋セメント | 817 | 907 | 223,122 |
| デイ・シイ | 12.1 | 13.4 | 4,529 |
| 日本ヒューム | 12.5 | 13.9 | 7,575 |
| 日本コンクリート工業 | 26.9 | 29.9 | 8,581 |
| 三谷セキサン | 6.5 | 7.3 | 14,979 |
| アジアパイルホールディングス | 16.1 | 17.9 | 6,694 |
| 東海カーボン | 114 | 126 | 34,776 |
| 日本カーボン | 64 | 71 | 14,910 |
| 東洋炭素 | 7.3 | 8 | 10,632 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 74 | 82 | 19,762 |
| ＴＯＴＯ | 96.2 | 106.8 | 452,298 |
| 日本碍子 | 165 | 184 | 412,344 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本特殊陶業 | 112.9 | 125.2 | 217,347 |
| ダントーホールディングス | 15 | 17 | 3,247 |
| ＭＡＲＵＷＡ | 4.8 | 5.3 | 16,854 |
| 品川リフラクトリーズ | 33 | 37 | 7,326 |
| 黒崎播磨 | 28 | 31 | 7,564 |
| ヨータイ | 7 | 8 | 2,264 |
| イソライト工業 | 6.4 | 7.1 | 1,462 |
| 東京窯業 | 16 | 17.6 | 2,798 |
| ニッカトー | 4.6 | 5.1 | 1,846 |
| フジミインコーポレーテッド | 11.5 | 12.8 | 19,980 |
| エーアンドエーマテリアル | 27 | 30 | 2,400 |
| ニチアス | 67 | 74 | 57,794 |
| ニチハ | 17.4 | 19.3 | 28,757 |
| **鉄鋼（1.2%）** | | | |
| 新日鐵住金 | 590.5 | 655.3 | 1,297,821 |
| 神戸製鋼所 | 2,405 | 2,669 | 232,203 |
| 中山製鋼所 | 147 | 163 | 8,802 |
| 合同製鐵 | 73 | 81 | 12,474 |
| ジェイ　エフ　イー　ホールディングス | 357.9 | 397.2 | 532,049 |
| 日新製鋼 | 59.7 | 66.3 | 89,438 |
| 東京製鐵 | 72.3 | 80.2 | 46,275 |
| 共英製鋼 | 13.9 | 15.5 | 23,296 |
| 大和工業 | 29.2 | 32.1 | 76,365 |
| 東京鐵鋼 | 27 | 30 | 11,910 |
| 大阪製鐵 | 8.2 | 9.1 | 15,151 |
| 淀川製鋼所 | 19.5 | 21.6 | 54,734 |
| 東洋鋼鈑 | 31.3 | 34.8 | 9,361 |
| 丸一鋼管 | 43.8 | 48.6 | 173,502 |
| モリ工業 | 21 | 23 | 6,762 |
| 大同特殊鋼 | 219 | 243 | 86,022 |
| 日本高周波鋼業 | 51 | 57 | 3,762 |
| 日本冶金工業 | 96.3 | 106.9 | 13,576 |
| 山陽特殊製鋼 | 78 | 86 | 40,506 |
| 愛知製鋼 | 77 | 86 | 38,958 |
| 日立金属 | 149.9 | 166.4 | 181,875 |
| 日本金属 | 34 | 38 | 3,648 |
| 大平洋金属 | 91 | 101 | 28,482 |
| 新日本電工 | 74.1 | 82.2 | 13,234 |
| 栗本鐵工所 | 62 | 69 | 11,868 |
| 虹技 | 18 | 20 | 2,980 |
| 日本鋳鉄管 | 14 | 16 | 2,128 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三菱製鋼 | 91 | 101 | 16,261 |
| 日亜鋼業 | 18.1 | 20.1 | 4,301 |
| 日本精線 | 9 | 10 | 4,310 |
| シンニッタン | 11.7 | 13 | 7,501 |
| 新家工業 | 26 | 29 | 3,799 |
| **非鉄金属（0.8%）** | | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 20 | 23 | 6,946 |
| 日本軽金属ホールディングス | 296.4 | 328.9 | 73,673 |
| 三井金属鉱業 | 334 | 370 | 71,040 |
| 東邦亜鉛 | 69 | 76 | 23,864 |
| 三菱マテリアル | 817 | 907 | 239,448 |
| 住友金属鉱山 | 361 | 401 | 417,842 |
| ＤＯＷＡホールディングス | 169 | 187 | 106,403 |
| 古河機械金属 | 204 | 227 | 33,596 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 12.9 | 14.3 | 17,960 |
| 東邦チタニウム | 22.1 | 24.6 | 16,949 |
| ＵＡＣＪ | 183 | 203 | 52,577 |
| 古河電気工業 | 412 | 457 | 112,422 |
| 住友電気工業 | 524.1 | 581.7 | 832,412 |
| フジクラ | 182 | 202 | 100,394 |
| 昭和電線ホールディングス | 156 | 173 | 10,207 |
| 東京特殊電線 | 1.9 | 2.1 | 1,570 |
| タツタ電線 | 27.2 | 30.2 | 9,150 |
| 沖電線 | 15 | 17 | 2,992 |
| カナレ電気 | 2 | 2.3 | 4,450 |
| 平河ヒューテック | 3.1 | 6.8 | 5,698 |
| リョービ | 80 | 89 | 42,987 |
| アーレスティ | 15.2 | 16.8 | 12,314 |
| アサヒホールディングス | 19.7 | 21.9 | 32,433 |
| **金属製品（0.6%）** | | | |
| 稲葉製作所 | 7 | 7.7 | 10,379 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 40 | 45 | 5,895 |
| トーカロ | 9.2 | 10.2 | 17,686 |
| アルファＣｏ | 4.4 | 4.8 | 4,584 |
| ＳＵＭＣＯ | 102.5 | 113.8 | 81,139 |
| 川田テクノロジーズ | 2.5 | 2.7 | 9,045 |
| 東洋製罐グループホールディングス | 93 | 103.2 | 212,488 |
| ホッカンホールディングス | 34 | 38 | 11,932 |
| コロナ | 6.8 | 7.6 | 7,835 |
| 横河ブリッジホールディングス | 24.8 | 27.5 | 27,637 |
| 駒井ハルテック | 23 | 26 | 4,992 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 高田機工 | 11 | 13 | 2,431 |
| 三和ホールディングス | 132.6 | 144.2 | 133,385 |
| 文化シヤッター | 36.4 | 40.4 | 33,693 |
| 三協立山 | 17.2 | 19 | 27,626 |
| アルインコ | 7.4 | 10.9 | 10,605 |
| 東洋シヤッター | 3.2 | 3.6 | 1,897 |
| ＬＩＸＩＬグループ | 182.4 | 202.4 | 382,333 |
| 日本フイルコン | 9.5 | 10.5 | 4,431 |
| ノーリツ | 25.6 | 28.5 | 54,178 |
| 長府製作所 | 14 | 15.5 | 38,750 |
| リンナイ | 24.3 | 27 | 239,220 |
| ダイニチ工業 | 6.7 | 7.4 | 4,491 |
| 日東精工 | 19 | 21 | 5,964 |
| 三洋工業 | 16 | 18 | 2,988 |
| 岡部 | 27.2 | 30.1 | 23,116 |
| ジーテクト | 13.6 | 15.1 | 19,207 |
| 中国工業 | 2 | 2.2 | 1,465 |
| 東プレ | 25.2 | 27.9 | 63,193 |
| 高周波熱錬 | 24.3 | 27 | 20,142 |
| 東京製綱 | 88 | 98 | 14,406 |
| サンコール | 6.9 | 7.7 | 3,557 |
| モリテック　スチール | 6.6 | 7.3 | 1,795 |
| パイオラックス | 6.6 | 7.3 | 36,865 |
| 日本発條 | 123.2 | 136.7 | 118,108 |
| 中央発條 | 17 | 19 | 5,206 |
| アドバネクス | 2.4 | 2.7 | 3,302 |
| 立川ブラインド工業 | 5.4 | 6 | 4,266 |
| 三益半導体工業 | 9.6 | 10.7 | 10,293 |
| **機械（4.8%）** | | | |
| 日本ドライケミカル | 1.7 | 1.9 | 3,931 |
| 日本製鋼所 | 216 | 240 | 117,600 |
| 三浦工業 | 58.4 | 64.8 | 148,262 |
| タクマ | 48 | 54 | 43,470 |
| ツガミ | 38 | 42 | 17,892 |
| オークマ | 85 | 95 | 69,825 |
| 東芝機械 | 71 | 79 | 28,203 |
| アマダホールディングス | 195.1 | 211.8 | 237,427 |
| アイダエンジニアリング | 34.3 | 38.1 | 33,756 |
| 滝澤鉄工所 | 41 | 45 | 5,490 |
| 富士機械製造 | 42.7 | 47.4 | 46,689 |
| 牧野フライス製作所 | 65 | 72 | 41,760 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| オーエスジー | 59.6 | 66.2 | 115,188 |
| ダイジェット工業 | 15 | 17 | 2,176 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 35.9 | 39.1 | 30,889 |
| ＤＭＧ森精機 | 72.3 | 80.2 | 93,673 |
| ソディック | 24.9 | 36.8 | 30,691 |
| ディスコ | 16.7 | 18.5 | 183,890 |
| 日東工器 | 7.6 | 8.5 | 18,929 |
| パンチ工業 | 5.2 | 5.7 | 4,554 |
| 豊和工業 | 7.3 | 8.1 | 4,179 |
| ＯＫＫ | 51 | 56 | 5,544 |
| 東洋機械金属 | 9.6 | 10.7 | 3,937 |
| 津田駒工業 | 32 | 35 | 3,815 |
| エンシュウ | 32 | 36 | 2,232 |
| 島精機製作所 | 18.5 | 20.5 | 40,590 |
| ＮＣホールディングス | － | 4.7 | 4,258 |
| フリュー | － | 2.8 | 7,383 |
| ヤマシンフィルタ | － | 2.8 | 1,248 |
| 日阪製作所 | 16.5 | 18.3 | 14,566 |
| やまびこ | 24 | 26.6 | 21,306 |
| ペガサスミシン製造 | 13.5 | 15 | 6,945 |
| ナブテスコ | 69.7 | 75.5 | 196,149 |
| 三井海洋開発 | 15.3 | 17 | 27,710 |
| レオン自動機 | 11 | 12.2 | 6,905 |
| ＳＭＣ | 39.2 | 43.5 | 1,134,480 |
| 新川 | 11.7 | 13 | 6,318 |
| ホソカワミクロン | 22 | 24 | 12,840 |
| ユニオンツール | 5.7 | 6.3 | 17,432 |
| オイレス工業 | 16.9 | 18.8 | 31,396 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 4.8 | 4.6 | 8,813 |
| サトーホールディングス | 17.6 | 19.6 | 37,651 |
| 日本エアーテック | 4.6 | 5.1 | 3,253 |
| 日精樹脂工業 | 9.5 | 10.6 | 6,837 |
| オカダアイヨン | － | 2.8 | 2,032 |
| ワイエイシイ | 5.3 | 5.8 | 5,863 |
| 小松製作所 | 641.7 | 712.1 | 1,336,255 |
| 住友重機械工業 | 382 | 424 | 201,824 |
| 日立建機 | 58.5 | 64.9 | 101,633 |
| 日工 | 20 | 22 | 6,446 |
| 巴工業 | 5.3 | 5.9 | 8,897 |
| 井関農機 | 134 | 149 | 34,866 |
| ＴＯＷＡ | 12.6 | 14 | 11,816 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 丸山製作所 | 27 | 30 | 5,100 |
| 北川鉄工所 | 60 | 67 | 11,658 |
| タカキタ | － | 4.8 | 2,529 |
| クボタ | 629 | 697.4 | 993,446 |
| 荏原実業 | 3.9 | 4.3 | 5,349 |
| 三菱化工機 | 43 | 48 | 9,072 |
| 月島機械 | 24.8 | 27.5 | 25,877 |
| 帝国電機製作所 | 9.5 | 10.5 | 8,515 |
| 東京機械製作所 | 49 | 54 | 1,998 |
| 新東工業 | 29.7 | 32.9 | 25,793 |
| 澁谷工業 | 10.9 | 12.1 | 21,538 |
| アイチ　コーポレーション | 18.5 | 20.5 | 15,067 |
| 小森コーポレーション | 31.8 | 35.3 | 40,347 |
| 鶴見製作所 | 9.7 | 10.8 | 13,986 |
| 住友精密工業 | 21 | 23 | 7,245 |
| 酒井重工業 | 25 | 28 | 4,760 |
| 荏原製作所 | 289 | 321 | 182,007 |
| 石井鐵工所 | 19 | 21 | 3,087 |
| 西島製作所 | 13.9 | 15.5 | 16,585 |
| 北越工業 | 14.1 | 15.6 | 9,016 |
| ダイキン工業 | 182.1 | 202.1 | 1,772,214 |
| オルガノ | 23 | 25 | 9,950 |
| トーヨーカネツ | 70 | 78 | 15,288 |
| 栗田工業 | 78.7 | 87.3 | 199,305 |
| 椿本チエイン | 74 | 82 | 55,678 |
| 大同工業 | 26 | 28 | 5,600 |
| 日本コンベヤ | 43 | － | － |
| 木村化工機 | 11.2 | 12.4 | 3,720 |
| アネスト岩田 | 21.1 | 23.4 | 19,960 |
| ダイフク | 61.8 | 74.6 | 137,040 |
| サムコ | 2.1 | 3.5 | 2,807 |
| 加藤製作所 | 30 | 33 | 14,124 |
| 油研工業 | 25 | 27 | 4,482 |
| タダノ | 60 | 67 | 61,506 |
| フジテック | 36.4 | 40.4 | 37,289 |
| ＣＫＤ | 34.8 | 38.6 | 32,385 |
| キトー | 15.8 | 17.5 | 14,280 |
| 平和 | 38.8 | 43 | 88,150 |
| 理想科学工業 | 13.8 | 15.3 | 22,414 |
| ＳＡＮＫＹＯ | 34.8 | 38.6 | 147,645 |
| 日本金銭機械 | 11.5 | 12.8 | 10,662 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| マースエンジニアリング | 7.1 | 7.8 | 16,286 |
| 福島工業 | 7.7 | 8.6 | 25,972 |
| オーイズミ | 5.2 | 5.8 | 2,320 |
| ダイコク電機 | 5.2 | 5.7 | 8,441 |
| 竹内製作所 | 18.6 | 27.5 | 48,015 |
| アマノ | 38.7 | 42.9 | 76,190 |
| ＪＵＫＩ | 18.6 | 20.6 | 20,682 |
| サンデンホールディングス | 76 | 85 | 26,860 |
| 蛇の目ミシン工業 | 12.1 | 13.5 | 8,154 |
| マックス | 19 | 21 | 24,003 |
| グローリー | 42.6 | 47.3 | 134,805 |
| 新晃工業 | 8.7 | 9.7 | 11,552 |
| 大和冷機工業 | 20.1 | 22.3 | 19,401 |
| セガサミーホールディングス | 134.4 | 149.2 | 180,382 |
| 日本ピストンリング | 5.2 | 5.8 | 8,282 |
| リケン | 58 | 64 | 21,184 |
| ＴＰＲ | 15.4 | 17.1 | 38,406 |
| ツバキ・ナカシマ | － | 17.1 | 21,973 |
| ホシザキ電機 | 27.4 | 30.4 | 312,816 |
| 大豊工業 | 10.1 | 11.2 | 12,622 |
| 日本精工 | 256.9 | 285.1 | 232,641 |
| ＮＴＮ | 310 | 344 | 106,984 |
| ジェイテクト | 133.3 | 147.9 | 183,691 |
| 不二越 | 116 | 129 | 43,473 |
| 日本トムソン | 43 | 47.5 | 16,767 |
| ＴＨＫ | 83.2 | 92.3 | 169,832 |
| ユーシン精機 | 4.8 | 5.4 | 9,844 |
| 前澤給装工業 | 5.1 | 5.7 | 7,558 |
| イーグル工業 | 15.5 | 17.2 | 22,669 |
| 前澤工業 | 9.2 | 10.2 | 2,601 |
| 日本ピラー工業 | 12.6 | 14 | 12,922 |
| キッツ | 60.8 | 61.8 | 32,383 |
| 日立工機 | 33.5 | 37.1 | 23,706 |
| マキタ | 81.6 | 90.5 | 611,780 |
| 日立造船 | 97.8 | 110 | 56,980 |
| 三菱重工業 | 2,227 | 2,472 | 1,043,925 |
| ＩＨＩ | 961 | 1,067 | 298,760 |
| **電気機器（11.9%）** | | | |
| 日清紡ホールディングス | 69.4 | 77.1 | 75,712 |
| イビデン | 82 | 85 | 107,950 |
| コニカミノルタ | 312.3 | 346.6 | 288,371 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ブラザー工業 | 161.7 | 179.4 | 215,100 |
| ミネベア | 202 | 223.6 | 170,830 |
| 日立製作所 | 3,191 | 3,541 | 1,653,292 |
| 東芝 | 2,633 | 2,922 | 843,873 |
| 三菱電機 | 1,334 | 1,481 | 1,904,566 |
| 富士電機 | 377 | 418 | 180,994 |
| 東洋電機製造 | 25 | 27 | 8,073 |
| 安川電機 | 155.3 | 172.4 | 236,705 |
| シンフォニアテクノロジー | 81 | 90 | 16,200 |
| 明電舎 | 115 | 128 | 45,824 |
| オリジン電気 | 18 | 20 | 5,280 |
| 山洋電気 | 33 | 36 | 17,244 |
| デンヨー | 11.5 | 12.8 | 14,259 |
| 東芝テック | 90 | 99 | 37,620 |
| 芝浦メカトロニクス | 20 | 22 | 4,576 |
| マブチモーター | 35.8 | 39.2 | 185,808 |
| 日本電産 | 150.5 | 167 | 1,316,795 |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | － | 1.6 | 3,545 |
| 東光高岳 | 7 | 7.7 | 13,167 |
| ダブル・スコープ | － | 6 | 30,960 |
| ダイヘン | 74 | 82 | 40,262 |
| 田淵電機 | 14.2 | 15.7 | 5,934 |
| ヤーマン | 1.6 | 1.8 | 3,315 |
| ＪＶＣケンウッド | 91.8 | 101.8 | 23,108 |
| ミマキエンジニアリング | 8.4 | 12.4 | 6,286 |
| 第一精工 | 5.2 | 5.8 | 6,049 |
| 日新電機 | 29.3 | 32.5 | 46,020 |
| 大崎電気工業 | 23 | 26 | 20,332 |
| オムロン | 143.5 | 156.7 | 566,470 |
| 日東工業 | 20 | 22.2 | 29,970 |
| ＩＤＥＣ | 16.3 | 18.1 | 16,308 |
| 不二電機工業 | 1.2 | 1.3 | 1,774 |
| ジーエス・ユアサ　コーポレーション | 241 | 267 | 107,601 |
| サクサホールディングス | 32 | 35 | 6,685 |
| メルコホールディングス | 6.9 | 7.7 | 16,370 |
| テクノメディカ | 2.8 | 3.1 | 5,394 |
| 日本電気 | 1,720 | 1,908 | 480,816 |
| 富士通 | 1,206 | 1,338 | 556,741 |
| 沖電気工業 | 542 | 601 | 87,746 |
| 岩崎通信機 | 59 | 65 | 4,160 |
| 電気興業 | 33 | 36 | 17,172 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| サンケン電気 | 68 | 76 | 26,068 |
| ナカヨ | 12 | 13 | 4,030 |
| アイホン | 7.1 | 7.9 | 12,592 |
| ルネサスエレクトロニクス | 64.7 | 71.8 | 46,095 |
| セイコーエプソン | 186.2 | 206.7 | 383,221 |
| ワコム | 98.5 | 109.3 | 44,375 |
| アルバック | 21.1 | 25.5 | 81,600 |
| アクセル | 6.3 | 6.3 | 4,548 |
| ＥＩＺＯ | 12.4 | 13.7 | 38,168 |
| ジャパンディスプレイ | 233.5 | 259.2 | 43,545 |
| 日本信号 | 34.5 | 38.3 | 31,559 |
| 京三製作所 | 29 | 32 | 10,816 |
| 能美防災 | 14.2 | 15.7 | 21,823 |
| ホーチキ | 9.1 | 10.1 | 11,746 |
| エレコム | 10.8 | 12 | 23,244 |
| 日本無線 | 32 | 41 | 10,906 |
| パナソニック | 1,428.9 | 1,585.7 | 1,471,529 |
| シャープ | 1,057 | 1,173 | 146,625 |
| アンリツ | 75.1 | 83.3 | 51,562 |
| 富士通ゼネラル | 38 | 42 | 88,494 |
| 日立国際電気 | 29 | 31.7 | 53,034 |
| ソニー | 882.3 | 979.3 | 2,941,817 |
| ＴＤＫ | 75.5 | 83.8 | 526,264 |
| 帝国通信工業 | 30 | 33 | 4,818 |
| ミツミ電機 | 47.6 | 52.8 | 23,918 |
| タムラ製作所 | 48 | 54 | 15,822 |
| アルプス電気 | 105.7 | 119.6 | 268,860 |
| 池上通信機 | 40 | 44 | 5,060 |
| パイオニア | 202.4 | 224.6 | 44,021 |
| 日本電波工業 | 11.3 | 12.5 | 10,237 |
| 鈴木 | 3.2 | 5.3 | 2,962 |
| 日本トリム | 3.4 | 3.7 | 26,973 |
| ローランド　ディー．ジー． | 6.1 | 6.8 | 14,341 |
| フォスター電機 | 15.7 | 17.4 | 31,511 |
| クラリオン | 66 | 73 | 19,491 |
| ＳＭＫ | 37 | 41 | 14,350 |
| ヨコオ | 8.9 | 9.9 | 4,831 |
| 東光 | 25 | － | － |
| ティアック | 90 | 100 | 3,400 |
| ホシデン | 37.9 | 42.1 | 26,817 |
| ヒロセ電機 | 20.2 | 22.4 | 295,680 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本航空電子工業 | 36 | 40 | 60,960 |
| ＴＯＡ | 14.8 | 16.4 | 15,580 |
| 日立マクセル | 20.7 | 23 | 34,086 |
| 古野電気 | 14.9 | 16.5 | 9,355 |
| ユニデンホールディングス | 39 | 44 | 5,412 |
| アルパイン | 29.8 | 33.1 | 35,714 |
| スミダコーポレーション | 10.2 | 11.4 | 8,344 |
| アイコム | 6.9 | 7.7 | 16,100 |
| リオン | 4.8 | 5.3 | 7,393 |
| 本多通信工業 | － | 3.6 | 2,826 |
| 船井電機 | 12.6 | 14 | 12,572 |
| 横河電機 | 125.2 | 138.9 | 159,179 |
| 新電元工業 | 44 | 49 | 16,758 |
| アズビル | 40.8 | 45.3 | 131,641 |
| 東亜ディーケーケー | 5.2 | 7.7 | 3,465 |
| 日本光電工業 | 52.3 | 58 | 166,054 |
| チノー | 4.5 | 4.9 | 4,826 |
| 共和電業 | 15.3 | 16.9 | 5,746 |
| 日本電子材料 | 4.9 | 5.5 | 2,277 |
| 堀場製作所 | 23.1 | 25.7 | 122,717 |
| アドバンテスト | 85.2 | 94.6 | 110,776 |
| 小野測器 | 6.1 | 6.7 | 5,788 |
| エスペック | 12.9 | 14.3 | 17,832 |
| パナソニック　デバイスＳＵＮＸ | 11 | 12.2 | 7,503 |
| キーエンス | 28.3 | 31.4 | 2,163,146 |
| 日置電機 | 6.5 | 7.3 | 16,162 |
| シスメックス | 97 | 107.7 | 776,517 |
| 日本マイクロニクス | － | 25.9 | 24,242 |
| メガチップス | 13.1 | 13.9 | 16,026 |
| ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ | 8.1 | 8.1 | 32,764 |
| 澤藤電機 | 7 | 7 | 1,183 |
| コーセル | 17.3 | 19.2 | 19,584 |
| 新日本無線 | 9.1 | 10.1 | 3,888 |
| オプテックス | 9.2 | 10.2 | 28,315 |
| 千代田インテグレ | 6.6 | 7.3 | 15,096 |
| アイ・オー・データ機器 | － | 4.3 | 2,786 |
| レーザーテック | 12.8 | 16.3 | 22,526 |
| スタンレー電気 | 89.8 | 99.2 | 236,592 |
| 岩崎電気 | 43 | 47 | 6,627 |
| ウシオ電機 | 75.9 | 84.2 | 103,734 |
| 岡谷電機産業 | 6.7 | 7.4 | 2,686 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ヘリオス　テクノ　ホールディング | 10.6 | 11.8 | 4,165 |
| 日本セラミック | 7.2 | 7.9 | 15,452 |
| 遠藤照明 | 6.3 | 7 | 6,776 |
| 日本デジタル研究所 | 10.5 | 11.7 | 16,052 |
| 古河電池 | 9 | 10 | 6,600 |
| 双信電機 | 6.1 | 6.7 | 1,775 |
| 山一電機 | 10.9 | 12 | 7,080 |
| 図研 | 9 | 10 | 9,180 |
| 日本電子 | 49 | 55 | 23,485 |
| カシオ計算機 | 125.4 | 139.1 | 226,454 |
| ファナック | 128 | 142 | 2,272,000 |
| 日本シイエムケイ | 26.9 | 29.9 | 12,498 |
| エンプラス | 6.4 | 7.1 | 20,135 |
| 大真空 | 23 | 25 | 6,950 |
| ローム | 61.7 | 68.4 | 297,540 |
| 浜松ホトニクス | 97.6 | 108.3 | 318,943 |
| 三井ハイテック | 18.1 | 20.1 | 13,708 |
| 新光電気工業 | 47.2 | 52.4 | 28,453 |
| 京セラ | 205.3 | 227.8 | 1,162,235 |
| 太陽誘電 | 60.8 | 67.5 | 69,862 |
| 村田製作所 | 131.2 | 146.4 | 1,793,400 |
| ユーシン | 16.3 | 18.3 | 12,059 |
| 双葉電子工業 | 21.4 | 22.7 | 44,832 |
| 北陸電気工業 | 50 | 56 | 6,272 |
| ニチコン | 39.4 | 43.7 | 30,371 |
| 日本ケミコン | 101 | 112 | 15,120 |
| ＫＯＡ | 17.3 | 19.2 | 14,515 |
| 市光工業 | 30 | 33 | 8,877 |
| 小糸製作所 | 74.9 | 83.2 | 407,264 |
| ミツバ | 21.2 | 23.6 | 31,057 |
| スター精密 | 23.7 | 26.3 | 30,876 |
| ＳＣＲＥＥＮホールディングス | 128 | 142 | 152,366 |
| キヤノン電子 | 11.5 | 12.7 | 19,138 |
| キヤノン | 673.3 | 747.2 | 2,315,572 |
| リコー | 405 | 449.4 | 421,986 |
| ＭＵＴＯＨホールディングス | 15 | 17 | 3,740 |
| 東京エレクトロン | 112.2 | 113.9 | 908,238 |
| **輸送用機器（9.5%）** | | | |
| トヨタ紡織 | 43.7 | 48.5 | 106,748 |
| 鬼怒川ゴム工業 | 29 | 32 | 24,704 |
| ユニプレス | 25.9 | 28.8 | 53,395 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 豊田自動織機 | 113.9 | 126.4 | 554,264 |
| モリタホールディングス | 21.9 | 24.3 | 33,436 |
| 三櫻工業 | 15.9 | 17.6 | 9,662 |
| デンソー | 309 | 342.9 | 1,261,872 |
| 東海理化電機製作所 | 36.6 | 40.6 | 66,218 |
| 三井造船 | 484 | 537 | 82,161 |
| 川崎重工業 | 973 | 1,080 | 341,280 |
| 名村造船所 | 37.5 | 41.6 | 25,625 |
| サノヤスホールディングス | 15.2 | 16.9 | 2,720 |
| 日本車輌製造 | 51 | 57 | 14,706 |
| ニチユ三菱フォークリフト | 14.4 | 16 | 8,560 |
| 近畿車輛 | 19 | 21 | 5,775 |
| 日産自動車 | 1,755.6 | 1,937 | 1,950,559 |
| いすゞ自動車 | 362.4 | 402.2 | 536,132 |
| トヨタ自動車 | 1,592.8 | 1,726.2 | 9,678,803 |
| 日野自動車 | 178.5 | 198.1 | 213,948 |
| 三菱自動車工業 | 496.6 | 551.1 | 298,696 |
| エフテック | 6.6 | 7.3 | 7,285 |
| レシップホールディングス | 4.1 | 4.6 | 3,615 |
| ＧＭＢ | 2 | 2.2 | 2,090 |
| ファルテック | 2.2 | 2.4 | 2,884 |
| 武蔵精密工業 | 13.3 | 14.8 | 32,367 |
| 日産車体 | 61.1 | 67.8 | 69,359 |
| 新明和工業 | 54 | 60 | 43,020 |
| 極東開発工業 | 24.9 | 27.6 | 26,772 |
| 日信工業 | 28 | 31 | 43,214 |
| トピー工業 | 103 | 114 | 24,852 |
| ティラド | 49 | 54 | 9,828 |
| 曙ブレーキ工業 | 63.4 | 70.3 | 15,676 |
| タチエス | 19.8 | 22 | 33,550 |
| ＮＯＫ | 60.5 | 67.2 | 124,588 |
| フタバ産業 | 38.1 | 42.3 | 21,403 |
| ＫＹＢ | 140 | 155 | 55,955 |
| シロキ工業 | 31 | － | － |
| 大同メタル工業 | 17.5 | 19.4 | 18,352 |
| プレス工業 | 66.4 | 73.7 | 25,721 |
| ミクニ | 11.9 | 17.6 | 5,139 |
| カルソニックカンセイ | 95 | 106 | 93,810 |
| 太平洋工業 | 27.6 | 30.8 | 31,785 |
| ケーヒン | 28.7 | 31.9 | 53,081 |
| 河西工業 | 15.3 | 17 | 17,153 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アイシン精機 | 125.9 | 142.3 | 596,237 |
| 富士機工 | 14.5 | 16 | 5,504 |
| マツダ | 396 | 439.5 | 746,490 |
| ダイハツ工業 | 149.3 | 165.7 | 242,750 |
| 今仙電機製作所 | 11.4 | 12.7 | 10,934 |
| 本田技研工業 | 1,125.5 | 1,249 | 3,369,177 |
| スズキ | 261.4 | 253.9 | 736,817 |
| 富士重工業 | 395.2 | 438.6 | 1,669,750 |
| 安永 | 4.1 | 4.6 | 2,157 |
| ヤマハ発動機 | 176.6 | 196 | 340,844 |
| ショーワ | 32.5 | 36 | 23,256 |
| ＴＢＫ | 14.9 | 16.5 | 5,824 |
| エクセディ | 17 | 18.8 | 43,221 |
| 豊田合成 | 45.4 | 50.4 | 96,667 |
| 愛三工業 | 21.9 | 24.3 | 18,783 |
| 盟和産業 | 1.5 | 2.3 | 2,306 |
| ヨロズ | 11.7 | 13 | 20,111 |
| エフ・シー・シー | 20.4 | 22.7 | 41,972 |
| シマノ | 50.4 | 55.9 | 884,897 |
| タカタ | 22.6 | 25.1 | 10,090 |
| テイ・エス　テック | 29 | 32.2 | 87,165 |
| ジャムコ | 5.5 | 8.1 | 15,624 |
| **精密機器（1.6%）** | | | |
| テルモ | 191.7 | 212.8 | 944,832 |
| クリエートメディック | 4.1 | 4.6 | 3,873 |
| 日機装 | 46.8 | 50 | 35,400 |
| 島津製作所 | 161 | 179 | 286,400 |
| ＪＭＳ | 23 | 26 | 7,124 |
| クボテック | 2.7 | 3 | 1,416 |
| モリテックス | 2.7 | － | － |
| 長野計器 | 8 | 8.4 | 4,947 |
| ブイ・テクノロジー | 3 | 3.3 | 30,855 |
| 東京計器 | 40 | 44 | 6,776 |
| 愛知時計電機 | 16 | 18 | 5,328 |
| オーバル | 12.2 | 13.5 | 2,997 |
| 東京精密 | 24.1 | 26.8 | 67,107 |
| マニー | 11.4 | 18.4 | 33,561 |
| ニコン | 233.5 | 259.1 | 368,958 |
| トプコン | 42 | 46.6 | 50,281 |
| オリンパス | 186.3 | 206.7 | 833,001 |
| 理研計器 | 10.1 | 11.2 | 12,252 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| タムロン | 10.1 | 11.2 | 16,340 |
| ＨＯＹＡ | 291 | 313.9 | 1,141,968 |
| ノーリツ鋼機 | 11.2 | 12.5 | 9,150 |
| エー・アンド・デイ | 11.3 | 12.6 | 4,750 |
| シチズンホールディングス | 153.9 | 170.8 | 94,110 |
| リズム時計工業 | 55 | 61 | 10,492 |
| 大研医器 | 9.9 | 11 | 9,020 |
| メニコン | 6.3 | 9.3 | 28,132 |
| 松風 | 6.1 | 6.8 | 8,901 |
| セイコーホールディングス | 80 | 89 | 30,082 |
| ニプロ | 93.2 | 103.4 | 127,802 |
| **その他製品（1.6%）** | | | |
| スノーピーク | － | 1.5 | 6,052 |
| パラマウントベッドホールディングス | 13.2 | 14.6 | 71,175 |
| トランザクション | 1.9 | 2.8 | 2,464 |
| ＳＨＯ－ＢＩ | 4.2 | 4.6 | 1,849 |
| ニホンフラッシュ | 3.6 | 5.4 | 6,118 |
| 前田工繊 | 13.8 | 13.9 | 13,691 |
| 永大産業 | 18 | 20 | 7,980 |
| アートネイチャー | 10 | 14.8 | 11,677 |
| ダンロップスポーツ | 7.9 | 8.7 | 8,987 |
| バンダイナムコホールディングス | 129.3 | 143.5 | 368,938 |
| アイフィスジャパン | 2.1 | 3.1 | 1,199 |
| 共立印刷 | 20.8 | 23.1 | 6,675 |
| ＳＨＯＥＩ | 6 | 6.2 | 9,839 |
| フランスベッドホールディングス | 17.4 | 19.3 | 17,601 |
| パイロットコーポレーション | 21.8 | 24.2 | 110,715 |
| 萩原工業 | 2.6 | 3.9 | 10,405 |
| トッパン・フォームズ | 22.3 | 24.8 | 27,602 |
| フジシールインターナショナル | 15.2 | 16.9 | 61,178 |
| タカラトミー | 41.1 | 45.6 | 36,708 |
| 廣済堂 | 11.6 | 12.9 | 3,973 |
| Ａｓ－ｍｅエステール | 3.3 | 3.7 | 2,097 |
| アーク | 52.6 | 58.4 | 4,380 |
| タカノ | 5.5 | 6.1 | 3,788 |
| プロネクサス | 11.7 | 13 | 13,208 |
| ホクシン | 9.9 | 11 | 1,287 |
| ウッドワン | 23 | 25 | 5,775 |
| 大建工業 | 49 | 54 | 17,010 |
| 凸版印刷 | 353 | 392 | 360,248 |
| 大日本印刷 | 370 | 411 | 448,812 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 図書印刷 | 23 | 26 | 12,740 |
| 共同印刷 | 42 | 47 | 14,852 |
| 日本写真印刷 | 21 | 23.3 | 48,953 |
| 光村印刷 | 12 | 14 | 2,646 |
| 宝印刷 | 6.5 | 6.7 | 8,951 |
| アシックス | 116.5 | 129.3 | 241,920 |
| ツツミ | 6.2 | 6.9 | 13,800 |
| 小松ウオール工業 | 4.2 | 4.7 | 7,482 |
| ヤマハ | 91.9 | 102 | 324,870 |
| 河合楽器製作所 | 4.7 | 5.2 | 9,718 |
| クリナップ | 14.7 | 16.3 | 11,980 |
| ピジョン | 70.9 | 78.6 | 252,699 |
| 兼松日産農林 | 13 | 14 | 1,932 |
| キングジム | 10.4 | 11.5 | 9,453 |
| リンテック | 29.7 | 33 | 65,769 |
| ＴＡＳＡＫＩ | 2.3 | 2.6 | 3,749 |
| イトーキ | 26.3 | 29.2 | 16,760 |
| 任天堂 | 77 | 85.5 | 1,271,812 |
| 三菱鉛筆 | 9.4 | 10.4 | 50,856 |
| タカラスタンダード | 52 | 57 | 53,466 |
| コクヨ | 65 | 72.1 | 106,275 |
| ナカバヤシ | 25 | 28 | 7,112 |
| グローブライド | 6.1 | 6.7 | 11,443 |
| 岡村製作所 | 43.6 | 48.4 | 48,980 |
| 美津濃 | 67 | 74 | 36,704 |
| アデランス | 21.7 | 24.1 | 13,014 |
| **電気・ガス業（1.9%）** | | | |
| 東京電力ホールディングス | 1,060.9 | 1,177.3 | 500,352 |
| 中部電力 | 382.7 | 424.7 | 619,424 |
| 関西電力 | 510.4 | 566.4 | 558,527 |
| 中国電力 | 172.9 | 191.9 | 244,480 |
| 北陸電力 | 122.5 | 136 | 175,304 |
| 東北電力 | 312.5 | 346.7 | 446,549 |
| 四国電力 | 112.6 | 125 | 147,500 |
| 九州電力 | 276.2 | 306.5 | 310,484 |
| 北海道電力 | 117 | 129.9 | 107,167 |
| 沖縄電力 | 13.3 | 22 | 46,640 |
| 電源開発 | 106.6 | 118.3 | 292,555 |
| ファーストエスコ | － | 5.6 | 3,819 |
| イーレックス | － | 4.2 | 8,610 |
| 東京瓦斯 | 1,396 | 1,549 | 638,962 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 大阪瓦斯 | 1,294 | 1,437 | 558,418 |
| 東邦瓦斯 | 315 | 350 | 274,050 |
| 北海道瓦斯 | 30 | 34 | 9,452 |
| 広島ガス | 21.8 | 24.2 | 7,647 |
| 西部瓦斯 | 141 | 156 | 38,688 |
| 静岡ガス | 35.5 | 39.4 | 29,156 |
| メタウォーター | 8.1 | 8.9 | 22,899 |
| **陸運業（4.6%）** | | | |
| ＳＢＳホールディングス | 12.3 | 13.7 | 10,165 |
| 東武鉄道 | 668 | 742 | 402,164 |
| 相鉄ホールディングス | 214 | 238 | 137,326 |
| 東京急行電鉄 | 728 | 808 | 707,000 |
| 京浜急行電鉄 | 343 | 380 | 378,100 |
| 小田急電鉄 | 401 | 445 | 513,085 |
| 京王電鉄 | 349 | 388 | 357,348 |
| 京成電鉄 | 187 | 208 | 279,344 |
| 富士急行 | 34 | 38 | 52,250 |
| 新京成電鉄 | 16 | 18 | 6,966 |
| 東日本旅客鉄道 | 228.6 | 253.7 | 2,376,915 |
| 西日本旅客鉄道 | 120.4 | 133.6 | 855,307 |
| 東海旅客鉄道 | 112 | 124.3 | 2,259,774 |
| 西武ホールディングス | 99.6 | 147.4 | 256,328 |
| 鴻池運輸 | 17.7 | 19.6 | 21,344 |
| 西日本鉄道 | 162 | 180 | 94,500 |
| ハマキョウレックス | 9.6 | 10.7 | 19,024 |
| サカイ引越センター | 2.5 | 5.5 | 15,383 |
| 近鉄グループホールディングス | 1,259 | 1,397 | 586,740 |
| 阪急阪神ホールディングス | 839 | 931 | 694,526 |
| 南海電気鉄道 | 281 | 312 | 175,032 |
| 京阪ホールディングス | 280 | 311 | 216,767 |
| 神戸電鉄 | 31 | 34 | 12,444 |
| 名古屋鉄道 | 455 | 505 | 273,205 |
| 山陽電気鉄道 | 46 | 51 | 24,990 |
| 日本通運 | 484 | 537 | 245,946 |
| ヤマトホールディングス | 231.1 | 248.2 | 551,004 |
| 山九 | 165 | 183 | 100,833 |
| 丸運 | 6.7 | 7.5 | 1,717 |
| 丸全昭和運輸 | 42 | 47 | 17,813 |
| センコー | 56 | 62.4 | 39,374 |
| トナミホールディングス | 26 | 28 | 7,364 |
| ニッコンホールディングス | 40.9 | 44.1 | 85,509 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本石油輸送 | 14 | 16 | 3,600 |
| 福山通運 | 76 | 84 | 45,192 |
| セイノーホールディングス | 88.7 | 98.4 | 93,381 |
| 神奈川中央交通 | 15 | 16 | 9,664 |
| 日立物流 | 26 | 28.9 | 47,887 |
| 丸和運輸機関 | 2.8 | 4.1 | 12,505 |
| Ｃ＆Ｆロジホールディングス | 12 | 13.3 | 12,834 |
| **海運業（0.2%）** | | | |
| 日本郵船 | 1,123 | 1,246 | 233,002 |
| 商船三井 | 609 | 676 | 155,480 |
| 川崎汽船 | 547 | 607 | 145,073 |
| ＮＳユナイテッド海運 | 56 | 62 | 8,556 |
| 明治海運 | 11.2 | 12.4 | 3,868 |
| 飯野海運 | 64.7 | 71.8 | 27,140 |
| 共栄タンカー | 10 | 12 | 2,100 |
| 乾汽船 | 9.9 | 11 | 9,548 |
| **空運業（0.6%）** | | | |
| 日本航空 | 239.4 | 265.7 | 903,645 |
| ＡＮＡホールディングス | 2,321 | 2,576 | 764,556 |
| パスコ | 11 | 13 | 4,004 |
| **倉庫・運輸関連業（0.2%）** | | | |
| トランコム | 3.6 | 4 | 25,280 |
| 日新 | 51 | 57 | 17,271 |
| 三菱倉庫 | 89 | 99 | 138,501 |
| 三井倉庫ホールディングス | 72 | 80 | 21,600 |
| 住友倉庫 | 91 | 101 | 51,712 |
| 澁澤倉庫 | 33 | 36 | 9,900 |
| 東陽倉庫 | 21 | 24 | 5,328 |
| 日本トランスシティ | 29 | 32 | 11,104 |
| ケイヒン | 23 | 25 | 3,250 |
| 中央倉庫 | 7.2 | 8 | 7,048 |
| 安田倉庫 | 9.7 | 10.8 | 6,922 |
| 東洋埠頭 | 36 | 40 | 5,680 |
| 宇徳 | 10.1 | 11.2 | 3,382 |
| 上組 | 149 | 166 | 156,704 |
| サンリツ | 3 | 3.4 | 1,686 |
| キムラユニティー | 3.2 | 3.5 | 3,570 |
| キユーソー流通システム | 3.4 | 3.8 | 9,469 |
| 郵船ロジスティクス | 11.5 | 12.7 | 13,487 |
| 近鉄エクスプレス | 22.4 | 24.8 | 31,694 |
| 東海運 | 6.7 | 7.5 | 1,927 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| エーアイテイー | 5.8 | 8.5 | 7,446 |
| 内外トランスライン | 3.1 | 4.6 | 4,388 |
| **情報・通信業（8.6%）** | | | |
| ＮＥＣネッツエスアイ | 15.5 | 17.2 | 32,026 |
| システナ | 12 | 13.4 | 18,559 |
| デジタルアーツ | 6 | 6.7 | 18,197 |
| 新日鉄住金ソリューションズ | 10.3 | 22.8 | 37,825 |
| キューブシステム | 5.3 | 5.9 | 4,106 |
| コア | 5.2 | 5.8 | 5,800 |
| ソフトクリエイトホールディングス | 4.4 | 6.5 | 6,207 |
| ＩＴホールディングス | 40.9 | 45.4 | 108,415 |
| ネオス | 3.7 | 4.1 | 2,382 |
| 電算システム | 4.3 | 4.8 | 7,161 |
| グリー | 74.9 | 83.1 | 48,862 |
| コーエーテクモホールディングス | 29.3 | 32.5 | 59,052 |
| 三菱総合研究所 | 4.8 | 5.3 | 16,668 |
| ボルテージ | 2.2 | 2.7 | 3,180 |
| 電算 | 1.4 | 1.5 | 2,707 |
| ＡＧＳ | 2.1 | 3.1 | 3,115 |
| ファインデックス | 8.1 | 9 | 12,006 |
| ヒト・コミュニケーションズ | 1.4 | 3.1 | 6,215 |
| ブレインパッド | 1.8 | 2 | 2,268 |
| ＫＬａｂ | 19.1 | 21.2 | 12,720 |
| ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ | 8.1 | 9 | 6,939 |
| イーブックイニシアティブジャパン | 2.7 | 3 | 2,490 |
| ネクソン | 117.8 | 131.3 | 206,403 |
| アイスタイル | 10.5 | 20.9 | 14,462 |
| エムアップ | 3.2 | 3.5 | 2,037 |
| エイチーム | 4.5 | 7.5 | 12,232 |
| テクノスジャパン | 1.3 | 4 | 8,920 |
| ｅｎｉｓｈ | 3.6 | 4 | 2,292 |
| コロプラ | 33.9 | 38.1 | 81,762 |
| モバイルクリエイト | 7.2 | 9 | 3,240 |
| オルトプラス | 4.5 | 5 | 1,785 |
| ブロードリーフ | 12.7 | 13.7 | 13,604 |
| ハーツユナイテッドグループ | 3.7 | 4.1 | 12,295 |
| メディアドゥ | － | 2.9 | 4,570 |
| ブイキューブ | 3 | 9 | 9,450 |
| サイバーリンクス | 1.4 | 2.1 | 2,184 |
| ディー・エル・イー | － | 3.8 | 3,496 |
| ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ | 2.8 | 4.6 | 5,092 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| オプティム | 0.8 | 1.1 | 5,093 |
| ベリサーブ | 1.4 | 1.6 | 5,168 |
| ティーガイア | 12.3 | 13.6 | 19,869 |
| 日本アジアグループ | 10.5 | 15.5 | 6,851 |
| 豆蔵ホールディングス | 9.7 | 10.8 | 10,238 |
| テクマトリックス | 5.3 | 5.9 | 12,431 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | 215.7 | 319.1 | 93,815 |
| ＧＭＯペイメントゲートウェイ | 10.7 | 11.2 | 64,960 |
| ザッパラス | 6.9 | 7.6 | 2,895 |
| インターネットイニシアティブ | 20 | 22.1 | 45,415 |
| さくらインターネット | － | 9 | 8,109 |
| ＧＭＯクラウド | 2.7 | 3 | 3,204 |
| ＳＲＡホールディングス | 7.1 | 7.9 | 15,294 |
| Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ | － | 2.7 | 2,268 |
| システムインテグレータ | 1.7 | 1.9 | 1,202 |
| 朝日ネット | 11.2 | 12.4 | 5,592 |
| コムチュア | 2.1 | 2.3 | 7,291 |
| サイバーコム | － | 1.6 | 1,289 |
| ｇｕｍｉ | 12.6 | 14.1 | 14,621 |
| パイプドＨＤ | 1.6 | 1.7 | 1,917 |
| フェイス | 3.3 | 3.6 | 3,916 |
| ハイマックス | 1.6 | 1.8 | 2,034 |
| 野村総合研究所 | 86.5 | 96 | 353,280 |
| サイバネットシステム | 10.1 | 11.2 | 8,142 |
| ＣＥホールディングス | 1.9 | 2.1 | 2,093 |
| インテージホールディングス | 6.4 | 7.2 | 11,613 |
| 東邦システムサイエンス | 3.6 | 4 | 2,296 |
| ソースネクスト | 6.2 | 6.8 | 3,012 |
| ティー・ワイ・オー | 17 | 26.9 | 4,411 |
| フォーカスシステムズ | － | 5.3 | 2,697 |
| クレスコ | 2.8 | 3.1 | 6,441 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 128.5 | 142.6 | 163,419 |
| オービック | 42.5 | 47.2 | 260,072 |
| ジャストシステム | 22.4 | 24.9 | 20,965 |
| ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング | 2.7 | 6 | 3,648 |
| ヤフー | 884.7 | 981.8 | 467,336 |
| トレンドマイクロ | 59.9 | 66.5 | 243,722 |
| インフォメーション・ディベロプメント | 2.3 | 2.6 | 2,639 |
| 日本オラクル | 19.8 | 22 | 127,380 |
| アルファシステムズ | 4 | 4.5 | 7,852 |
| フューチャー | 14.8 | 16.4 | 12,267 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ | 9.2 | 10.2 | 8,180 |
| ソフトバンク・テクノロジー | 3.3 | 3.7 | 7,414 |
| トーセ | 3.3 | 3.7 | 2,445 |
| オービックビジネスコンサルタント | 6.3 | 7 | 32,550 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 28 | 31 | 68,820 |
| アイティフォー | 16 | 17.8 | 9,273 |
| 東計電算 | 2.2 | 2.4 | 4,262 |
| エックスネット | 1.1 | 1.2 | 1,816 |
| 大塚商会 | 33.2 | 36.8 | 177,192 |
| サイボウズ | 16.4 | 18.2 | 7,189 |
| ソフトブレーン | 18 | 20 | 3,580 |
| 電通国際情報サービス | 7.6 | 8.4 | 13,675 |
| ＥＭシステムズ | 2.1 | 4.6 | 5,630 |
| ウェザーニューズ | 3.7 | 4.6 | 16,997 |
| ＣＩＪ | 11.2 | 12.4 | 5,815 |
| 東洋ビジネスエンジニアリング | 1.2 | 1.4 | 1,962 |
| 日本エンタープライズ | 10.9 | 14 | 4,242 |
| WOWOW | 5.9 | 6.5 | 15,632 |
| フュージョンパートナー | 7 | 8.5 | 4,411 |
| 日本コロムビア | 4.2 | 4.7 | 2,190 |
| イマジカ・ロボット　ホールディングス | 10.4 | 11.5 | 5,117 |
| ネットワンシステムズ | 53.4 | 59.3 | 36,766 |
| アルゴグラフィックス | 5.6 | 6.2 | 10,068 |
| マーベラス | 20.8 | 23.1 | 18,456 |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 22.7 | 25.2 | 30,744 |
| 日本ユニシス | 34.1 | 37.8 | 44,868 |
| 兼松エレクトロニクス | 7.8 | 8.6 | 15,806 |
| 東京放送ホールディングス | 74 | 82.1 | 114,036 |
| 日本テレビホールディングス | 112.7 | 125.1 | 205,664 |
| 朝日放送 | 12.2 | 13.5 | 8,235 |
| テレビ朝日ホールディングス | 33.7 | 37.4 | 59,279 |
| スカパーＪＳＡＴホールディングス | 93.7 | 104 | 48,880 |
| テレビ東京ホールディングス | 11.2 | 12.4 | 24,440 |
| 日本ＢＳ放送 | 2.1 | 3.1 | 3,041 |
| Ｕ－ＮＥＸＴ | － | 4.2 | 3,360 |
| ワイヤレスゲート | － | 4 | 6,964 |
| コネクシオ | 10.9 | 12 | 15,816 |
| 日本通信 | 65.5 | 97 | 22,795 |
| クロップス | 2.2 | 2.5 | 1,245 |
| 日本電信電話 | 954.1 | 1,058.8 | 4,817,540 |
| ＫＤＤＩ | 1,254 | 1,391.6 | 4,391,889 |
| 光通信 | 14.8 | 16.5 | 141,075 |
| ＮＴＴドコモ | 952 | 1,023.6 | 2,786,239 |
| エムティーアイ | 15.8 | 20.8 | 13,832 |
| ＧＭＯインターネット | 45.7 | 50 | 53,350 |
| カドカワ | 38.5 | 42.8 | 59,149 |
| 学研ホールディングス | 41 | 46 | 11,638 |
| ゼンリン | 16.3 | 18.1 | 36,634 |
| 昭文社 | 6.7 | 7.5 | 4,372 |
| インプレスホールディングス | 10.2 | 11.3 | 1,525 |
| アイネット | 6.9 | 7.6 | 7,881 |
| 松竹 | 81 | 90 | 92,790 |
| 東宝 | 88.1 | 97.7 | 272,973 |
| 東映 | 46 | 51 | 49,266 |
| ＡＯＩ　Ｐｒｏ． | 6.2 | 6.9 | 5,961 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 76.2 | 84.6 | 425,538 |
| ピー・シー・エー | 1.6 | 1.7 | 2,053 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | 1.9 | 2.1 | 1,894 |
| ＤＴＳ | 13.7 | 15.2 | 30,369 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 52.2 | 58 | 190,240 |
| シーイーシー | 8 | 8.9 | 12,228 |
| カプコン | 31.6 | 35 | 79,625 |
| アイ・エス・ビー | 1.5 | 2.2 | 1,826 |
| ジャステック | 7.8 | 8.7 | 8,064 |
| ＳＣＳＫ | 29.4 | 32.6 | 120,783 |
| 日本システムウエア | 4.6 | 5.1 | 5,105 |
| アイネス | 17.5 | 19.4 | 20,447 |
| ＴＫＣ | 11.4 | 12.7 | 33,147 |
| 富士ソフト | 18.3 | 20.3 | 47,319 |
| ＮＳＤ | 26.2 | 29.1 | 45,774 |
| コナミホールディングス | 55.7 | 61.8 | 243,801 |
| 福井コンピュータホールディングス | 2.7 | 4 | 7,440 |
| ＪＢＣＣホールディングス | 10.3 | 11.4 | 7,489 |
| ミロク情報サービス | 9.1 | 10.1 | 14,069 |
| ソフトバンクグループ | 699.4 | 776.1 | 4,651,943 |
| **卸売業（4.1%）** | | | |
| ホウスイ | 10 | 11 | 1,199 |
| 高千穂交易 | 4.7 | 5.3 | 4,743 |
| 伊藤忠食品 | 3 | 3.4 | 14,076 |
| エレマテック | 5.7 | 6.4 | 13,459 |
| ＪＡＬＵＸ | 4 | 4.4 | 7,524 |
| あらた | 5.5 | 6.2 | 13,695 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| トーメンデバイス | 1.8 | 2.1 | 3,937 |
| 東京エレクトロン　デバイス | 4.5 | 5 | 7,515 |
| フィールズ | 8.1 | 12 | 15,432 |
| 双日 | 777.6 | 862.9 | 211,410 |
| アルフレッサ　ホールディングス | 155.2 | 172.2 | 379,356 |
| 横浜冷凍 | 30.6 | 33.9 | 34,205 |
| 神栄 | 17 | 19 | 2,090 |
| 山下医科器械 | 1 | 1.1 | 1,786 |
| ラサ商事 | 5.8 | 6.4 | 2,995 |
| ラクーン | － | 5.9 | 3,103 |
| アルコニックス | 7 | 7.8 | 11,622 |
| 神戸物産 | 8 | 8.8 | 18,304 |
| あい　ホールディングス | 19.8 | 24.4 | 59,023 |
| ディーブイエックス | 3.3 | 4.9 | 5,483 |
| ダイワボウホールディングス | 112 | 125 | 27,375 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 22.2 | 24.7 | 27,441 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 21.4 | 23.7 | 24,055 |
| 八洲電機 | 9.5 | 10.6 | 5,501 |
| ＵＫＣホールディングス | 7.9 | 8.8 | 14,836 |
| ＯＣＨＩホールディングス | 3.6 | 4 | 4,048 |
| ＴＯＫＡＩホールディングス | 60.3 | 60.2 | 39,491 |
| 三洋貿易 | 6.8 | 7.5 | 9,075 |
| ウイン・パートナーズ | 4.4 | 4.9 | 6,967 |
| ミタチ産業 | 2.9 | 3.5 | 1,949 |
| シップヘルスケアホールディングス | 25.1 | 27.8 | 87,153 |
| 明治電機工業 | 3.9 | 4.3 | 4,360 |
| デリカフーズ | 2.6 | 2.9 | 2,749 |
| スターティア | 2.4 | 2.6 | 1,289 |
| 富士興産 | 4.8 | 5.3 | 2,082 |
| 協栄産業 | 16 | 18 | 2,358 |
| 小野建 | 10.7 | 11.9 | 13,839 |
| 佐鳥電機 | 9.8 | 10.8 | 7,149 |
| エコートレーディング | 2.8 | 3.1 | 1,798 |
| 伯東 | 9.4 | 10.4 | 8,975 |
| コンドーテック | 9.8 | 10.8 | 8,035 |
| 中山福 | 7.7 | 8.5 | 6,732 |
| ナガイレーベン | 17.8 | 19.8 | 46,015 |
| 三菱食品 | 13.5 | 15 | 41,835 |
| 松田産業 | 9 | 10 | 12,450 |
| 第一興商 | － | 24.2 | 102,729 |
| メディパルホールディングス | 123.4 | 137 | 235,366 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アドヴァン | 12.5 | 13.9 | 15,387 |
| ＳＰＫ | 2.8 | 3.2 | 6,102 |
| 萩原電気 | 3.1 | 4.7 | 9,028 |
| アズワン | 9.6 | 10.7 | 42,372 |
| スズデン | 4 | 4.4 | 3,889 |
| 尾家産業 | 4 | 4.4 | 3,836 |
| シモジマ | 8.5 | 9.4 | 9,738 |
| ドウシシャ | 14.5 | 16.1 | 32,554 |
| 小津産業 | 2.5 | 3 | 6,066 |
| 高速 | 7.3 | 8.1 | 6,666 |
| たけびし | 4.3 | 4.8 | 4,800 |
| 黒田電気 | 23 | 25.5 | 45,084 |
| 丸文 | 10.9 | 12.1 | 6,981 |
| ハピネット | 11.2 | 12.4 | 10,106 |
| 橋本総業ホールディングス | 2.5 | 2.8 | 4,222 |
| エクセル | 6 | 6.7 | 8,857 |
| マルカキカイ | 4 | 4.4 | 5,104 |
| ガリバーインターナショナル | 33.2 | 36.9 | 33,062 |
| 日本エム・ディ・エム | 10.3 | 11.4 | 8,025 |
| 進和 | 7.3 | 8.1 | 11,080 |
| エスケイジャパン | 2.9 | 3.3 | 709 |
| ダイトエレクトロン | 5.6 | 6.2 | 3,571 |
| シークス | 7.8 | 8.7 | 29,449 |
| 田中商事 | 3.8 | 4.2 | 2,725 |
| オーハシテクニカ | 6.9 | 7.7 | 9,532 |
| 白銅 | 3.5 | 3.9 | 4,145 |
| 伊藤忠商事 | 968.6 | 1,074.9 | 1,375,334 |
| 丸紅 | 1,214.8 | 1,348.1 | 629,427 |
| 高島 | 23 | 26 | 4,082 |
| 長瀬産業 | 74.2 | 82.4 | 95,007 |
| 蝶理 | 7.9 | 8.7 | 12,162 |
| 豊田通商 | 137.5 | 152.6 | 344,876 |
| 三共生興 | 18.6 | 20.7 | 6,582 |
| 兼松 | 263 | 291 | 48,597 |
| ツカモトコーポレーション | 22 | 25 | 2,650 |
| 三井物産 | 1,116.2 | 1,238.7 | 1,532,891 |
| 日本紙パルプ商事 | 64 | 71 | 23,430 |
| 日立ハイテクノロジーズ | 42.8 | 47.5 | 136,895 |
| カメイ | 16.1 | 17.8 | 15,325 |
| 東都水産 | 20 | 23 | 3,726 |
| ＯＵＧホールディングス | 18 | 20 | 4,680 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| スターゼン | 4.4 | 4.9 | 19,036 |
| 山善 | 47.4 | 52.6 | 42,816 |
| 椿本興業 | 14 | 15 | 4,035 |
| 住友商事 | 777 | 862.3 | 889,462 |
| 内田洋行 | 30 | 34 | 15,504 |
| 三菱商事 | 926.2 | 1,027.9 | 1,844,566 |
| 第一実業 | 28 | 31 | 13,826 |
| キヤノンマーケティングジャパン | 35.2 | 39.1 | 75,854 |
| 西華産業 | 41 | 44 | 11,748 |
| 佐藤商事 | 11 | 12.2 | 7,320 |
| 菱洋エレクトロ | 14.2 | 15.5 | 21,080 |
| 東京産業 | 12.3 | 13.6 | 4,814 |
| ユアサ商事 | 11.7 | 13 | 27,573 |
| 神鋼商事 | 28 | 31 | 5,208 |
| 小林産業 | 8.2 | 9.1 | 2,320 |
| 阪和興業 | 123 | 137 | 74,254 |
| カナデン | 11.8 | 13.1 | 11,606 |
| 菱電商事 | 20 | 22 | 14,036 |
| フルサト工業 | 6.8 | 7.5 | 9,517 |
| 岩谷産業 | 146 | 162 | 95,094 |
| すてきナイスグループ | 52 | 58 | 8,352 |
| 昭光通商 | 44 | 49 | 3,528 |
| ニチモウ | 19 | 21 | 3,360 |
| 極東貿易 | 18 | 20 | 3,700 |
| イワキ | 19 | 21 | 3,822 |
| 三愛石油 | 32 | 33.7 | 21,635 |
| 稲畑産業 | 29.6 | 32.8 | 31,947 |
| ＧＳＩクレオス | 33 | 36 | 3,528 |
| 明和産業 | 11.4 | 12.6 | 3,855 |
| ワキタ | 26.3 | 29.1 | 19,613 |
| 東邦ホールディングス | 39.5 | 43.8 | 110,157 |
| サンゲツ | 45 | 47.7 | 89,771 |
| ミツウロコグループホールディングス | 19.8 | 22 | 11,022 |
| シナネンホールディングス | 26 | 29 | 11,658 |
| 伊藤忠エネクス | 31.8 | 35.3 | 32,652 |
| サンリオ | 38 | 42.2 | 80,897 |
| サンワテクノス | 7.8 | 8.7 | 6,159 |
| リョーサン | 19.6 | 21.7 | 54,488 |
| 新光商事 | 14.5 | 16.1 | 16,003 |
| トーホー | 5.6 | 6.2 | 15,351 |
| 三信電気 | 17.1 | 18.9 | 15,649 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東陽テクニカ | 18.1 | 18.2 | 18,473 |
| モスフードサービス | 16.2 | 17.9 | 52,590 |
| 加賀電子 | 11.1 | 12.4 | 14,198 |
| ソーダニッカ | 12.7 | 14.1 | 6,528 |
| 立花エレテック | 9.1 | 10.1 | 10,625 |
| フォーバル | 4.8 | 7.2 | 5,241 |
| ＰＡＬＴＡＣ | 19.7 | 21.9 | 45,617 |
| 三谷産業 | 13.1 | 14.5 | 4,698 |
| 太平洋興発 | 51 | 57 | 3,990 |
| ヤマタネ | 57 | 64 | 9,408 |
| 丸紅建材リース | 11 | 12 | 2,076 |
| 日鉄住金物産 | 81 | 120 | 40,800 |
| トラスコ中山 | 14.1 | 15.6 | 78,312 |
| オートバックスセブン | 47.3 | 52.5 | 76,545 |
| 加藤産業 | 19.3 | 21.4 | 52,729 |
| イノテック | 11.3 | 12.6 | 5,380 |
| イエローハット | 11.6 | 12.9 | 30,985 |
| ＪＫホールディングス | 12.4 | 13.7 | 6,123 |
| 日伝 | 5.1 | 5.7 | 17,841 |
| 北沢産業 | 10.2 | 11.3 | 1,672 |
| 杉本商事 | 7.1 | 7.9 | 8,974 |
| 因幡電機産業 | 17.3 | 19.2 | 66,336 |
| バイテックホールディングス | 3.8 | 5.6 | 5,684 |
| ミスミグループ本社 | 138.5 | 153.8 | 273,610 |
| アルテック | 10.5 | 11.7 | 1,591 |
| タキヒヨー | 21 | 23 | 9,890 |
| 蔵王産業 | 2 | 2.2 | 2,835 |
| スズケン | 56.2 | 62.4 | 206,544 |
| ジェコス | 8.5 | 9.4 | 9,418 |
| ルネサスイーストン | 7.7 | 11.4 | 4,731 |
| **小売業（5.0%）** | | | |
| ローソン | 46.7 | 51.9 | 435,441 |
| サンエー | 8.4 | 9.3 | 46,221 |
| ダイユーエイト | 3.2 | 3.6 | 2,379 |
| カワチ薬品 | 9.5 | 10.6 | 27,337 |
| エービーシー・マート | 15.7 | 17.8 | 118,904 |
| ハードオフコーポレーション | 6 | 6.6 | 7,748 |
| アスクル | 12.9 | 16.7 | 58,784 |
| ゲオホールディングス | 23.4 | 22.9 | 32,243 |
| アダストリア | 11.4 | 25.2 | 93,996 |
| ジーフット | － | 8.2 | 6,215 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| シー・ヴイ・エス・ベイエリア | 18 | 20 | 1,580 |
| くらコーポレーション | 7.2 | 8 | 46,960 |
| キャンドゥ | 6.5 | 7.2 | 11,728 |
| パル | 7.2 | 8 | 18,792 |
| エディオン | 52.2 | 57.9 | 49,330 |
| サーラコーポレーション | 10.6 | 11.7 | 6,259 |
| ワッツ | 4.9 | 5.9 | 5,905 |
| ハローズ | 3.7 | 4.5 | 9,279 |
| あみやき亭 | 2.4 | 2.7 | 11,988 |
| ひらまつ | 17 | 18.9 | 12,058 |
| ゲンキー | 2.5 | 2.7 | 8,829 |
| サッポロドラッグストアー | 1.2 | 1.8 | 3,744 |
| 大黒天物産 | 2.9 | 3.3 | 15,724 |
| ハニーズ | 10.8 | 12 | 12,336 |
| ファーマライズホールディングス | 2.8 | 3.1 | 1,546 |
| アルペン | 11 | 12.2 | 20,801 |
| クオール | 12.5 | 13.9 | 18,222 |
| ジェイアイエヌ | 8.4 | 9.3 | 33,247 |
| ビックカメラ | 63.8 | 78.6 | 74,512 |
| ＤＣＭホールディングス | 60.7 | 67.3 | 51,821 |
| ＭｏｎｏｔａＲＯ | 43.4 | 48.4 | 163,350 |
| 東京一番フーズ | 2 | 3.4 | 1,870 |
| ダイヤモンドダイニング | 1.9 | 2.9 | 2,859 |
| きちり | 3.3 | 3.6 | 2,275 |
| アークランドサービス | 1.9 | 4.3 | 12,964 |
| Ｊ．フロント　リテイリング | 156.2 | 173.3 | 208,306 |
| ドトール・日レスホールディングス | 21.6 | 24 | 44,040 |
| マツモトキヨシホールディングス | 25.5 | 28.3 | 148,292 |
| ブロンコビリー | 4.8 | 7.1 | 23,110 |
| スタートトゥデイ | 38.4 | 41.7 | 221,427 |
| トレジャー・ファクトリー | 3.5 | 3.9 | 4,208 |
| 物語コーポレーション | 3.5 | 3.6 | 18,720 |
| ココカラファイン | 12.9 | 14.3 | 76,791 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 245.4 | 272.4 | 277,303 |
| ウエルシアホールディングス | 10.7 | 11.9 | 70,091 |
| クリエイトＳＤホールディングス | 18 | 20.2 | 59,509 |
| 丸善ＣＨＩホールディングス | 14.4 | 16 | 5,952 |
| ミサワ | 1.4 | 2.1 | 1,047 |
| エー・ピーカンパニー | 2 | 2.2 | 1,944 |
| チムニー | 3 | 3.3 | 9,655 |
| シュッピン | － | 5.2 | 6,136 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ネクステージ | 2 | 2.2 | 1,447 |
| ジョイフル本田 | 18 | 22.2 | 51,348 |
| 鳥貴族 | － | 3.4 | 6,755 |
| キリン堂ホールディングス | 4 | 4.4 | 4,144 |
| ホットランド | 3.2 | 4.7 | 4,544 |
| すかいらーく | 37.7 | 41.9 | 54,134 |
| 綿半ホールディングス | － | 5.1 | 7,553 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 40.9 | 45.4 | 46,943 |
| ブックオフコーポレーション | 7 | 7.8 | 6,567 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | 2.6 | 3.8 | 3,568 |
| あさひ | 9.2 | 10.2 | 15,034 |
| 日本調剤 | 3.1 | 3.5 | 16,677 |
| コスモス薬品 | 6.2 | 6.9 | 142,002 |
| トーエル | 6.5 | 6.6 | 5,306 |
| 一六堂 | 3 | 3.3 | 1,036 |
| セブン＆アイ・ホールディングス | 516.4 | 573 | 2,558,445 |
| 薬王堂 | 1.7 | 2.6 | 10,907 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 11 | 36.7 | 33,727 |
| ツルハホールディングス | 26.4 | 31.5 | 393,120 |
| サンマルクホールディングス | 9.7 | 10.8 | 33,102 |
| フェリシモ | 3.5 | 3.9 | 3,993 |
| トリドール | 15.1 | 16.8 | 45,208 |
| クスリのアオキ | 9.8 | 12.2 | 79,422 |
| メディカルシステムネットワーク | 13.9 | 15.5 | 7,672 |
| 総合メディカル | 6 | 6.6 | 26,004 |
| はるやま商事 | 5.1 | 5.7 | 4,086 |
| カッパ・クリエイト | 17.3 | 19.2 | 24,307 |
| ライトオン | 9.2 | 10.2 | 13,780 |
| ジーンズメイト | 3.9 | 4.4 | 787 |
| 良品計画 | 14.2 | 15.7 | 400,193 |
| 三城ホールディングス | 15.2 | 16.9 | 7,081 |
| アルビス | 3.2 | 3.6 | 7,509 |
| コナカ | 14.5 | 17.4 | 8,595 |
| ハウス　オブ　ローゼ | 1.5 | 1.7 | 2,378 |
| Ｇ－７ホールディングス | 3.6 | 4 | 4,684 |
| イオン北海道 | 8.2 | 9.2 | 4,673 |
| コジマ | 18.2 | 20.1 | 4,743 |
| ヒマラヤ | 3.8 | 4.2 | 3,906 |
| コーナン商事 | 17.5 | 19.4 | 36,879 |
| エコス | 4.5 | 5.3 | 6,519 |
| ワタミ | 14.6 | 16.2 | 16,831 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| マルシェ | 3 | 3.3 | 2,715 |
| ドンキホーテホールディングス | 79.8 | 88.6 | 347,312 |
| 西松屋チェーン | 24.3 | 27 | 39,717 |
| ゼンショーホールディングス | 63.5 | 70.4 | 102,432 |
| 幸楽苑ホールディングス | 7.8 | 8.6 | 13,261 |
| ハークスレイ | 3.4 | 3.8 | 3,644 |
| サイゼリヤ | 20.3 | 22.5 | 41,962 |
| ＶＴホールディングス | 41.7 | 46.3 | 23,335 |
| 魚力 | 3.8 | 4.3 | 6,157 |
| ポプラ | 3.1 | 3.4 | 1,676 |
| ユナイテッドアローズ | 17.6 | 19.5 | 58,792 |
| ハイデイ日高 | 9.4 | 12.5 | 31,275 |
| 京都きもの友禅 | 8.4 | 9.4 | 7,717 |
| コロワイド | 40.9 | 45.4 | 83,218 |
| ピーシーデポコーポレーション | － | 15.1 | 21,275 |
| 壱番屋 | 5.6 | 12.4 | 43,586 |
| トップカルチャー | 4.4 | 4.9 | 2,175 |
| ＰＬＡＮＴ | 2.8 | 3.1 | 3,574 |
| スギホールディングス | 22.1 | 24.6 | 142,680 |
| スクロール | 18.7 | 20.7 | 7,948 |
| ヨンドシーホールディングス | 9.4 | 10.4 | 22,287 |
| ファミリーマート | 37.9 | 42.1 | 258,915 |
| 木曽路 | 15.1 | 16.8 | 37,951 |
| サトレストランシステムズ | 14.5 | 16.1 | 13,024 |
| 千趣会 | 24.3 | 27 | 18,252 |
| タカキュー | 9.5 | 10.5 | 1,837 |
| ケーヨー | 20.8 | 23.1 | 11,781 |
| 上新電機 | 29 | 32 | 28,352 |
| 日本瓦斯 | 14.1 | 20.9 | 45,687 |
| ベスト電器 | 39.7 | 44.1 | 4,630 |
| ロイヤルホールディングス | 20.6 | 22.7 | 43,720 |
| 東天紅 | 9 | 10 | 1,310 |
| いなげや | 13.7 | 15.2 | 20,504 |
| 島忠 | 31.9 | 35.4 | 78,658 |
| チヨダ | 14.5 | 16.1 | 36,289 |
| ライフコーポレーション | 7.8 | 8.6 | 24,518 |
| リンガーハット | 11.1 | 12.4 | 28,792 |
| さが美 | 10 | 11 | 880 |
| ＭｒＭａｘ | 10.8 | 11.9 | 3,320 |
| テンアライド | 11.4 | 12.6 | 4,548 |
| ＡＯＫＩホールディングス | 28.2 | 31.3 | 34,743 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| オークワ | 19 | 21 | 24,171 |
| コメリ | 19 | 21.1 | 55,556 |
| 青山商事 | 23.7 | 26.3 | 95,600 |
| しまむら | 14.3 | 15.9 | 223,554 |
| はせがわ | 4.3 | 6.4 | 2,713 |
| 高島屋 | 179 | 199 | 145,071 |
| 松屋 | 24.8 | 27.6 | 20,368 |
| エイチ・ツー・オー　リテイリング | 63.2 | 70.1 | 108,444 |
| 近鉄百貨店 | 47 | 52 | 17,732 |
| 丸栄 | 25 | 28 | 2,352 |
| ニッセンホールディングス | 18.1 | 20.1 | 1,909 |
| パルコ | 11.8 | 13.1 | 11,907 |
| 丸井グループ | 151.5 | 168.1 | 239,710 |
| アクシアル　リテイリング | 9.5 | 10.6 | 36,994 |
| 井筒屋 | 67 | 74 | 3,478 |
| イオン | 507.9 | 563.6 | 869,916 |
| ユニーグループ・ホールディングス | 118.2 | 131.2 | 110,339 |
| イズミ | 24.5 | 27.2 | 109,616 |
| 東武ストア | 15 | 16 | 4,720 |
| 平和堂 | 25 | 27.8 | 65,830 |
| フジ | 13.7 | 15.2 | 37,908 |
| ヤオコー | 14 | 15.5 | 71,300 |
| ゼビオホールディングス | 16.7 | 18.6 | 27,379 |
| ケーズホールディングス | 26.1 | 57.9 | 108,504 |
| Ｏｌｙｍｐｉｃグループ | 7.3 | 8.1 | 3,960 |
| 日産東京販売ホールディングス | 20.7 | 23 | 5,060 |
| アインホールディングス | 14.9 | 16.5 | 118,800 |
| 元気寿司 | 3.4 | 3.8 | 8,170 |
| ヤマダ電機 | 375.3 | 416.5 | 219,912 |
| アークランドサカモト | 10.4 | 23.2 | 27,399 |
| ニトリホールディングス | 53.3 | 59.2 | 698,560 |
| グルメ杵屋 | 9 | 10 | 9,730 |
| 愛眼 | 9.8 | 10.9 | 2,169 |
| ケーユーホールディングス | 6.4 | 7.1 | 4,899 |
| 吉野家ホールディングス | 45.5 | 50.5 | 68,579 |
| 松屋フーズ | 5.9 | 6.6 | 18,044 |
| サガミチェーン | 16.5 | 18.3 | 22,655 |
| 関西スーパーマーケット | 10 | 11.1 | 10,866 |
| 王将フードサービス | 9 | 10 | 37,000 |
| プレナス | 13.8 | 15.3 | 26,208 |
| ミニストップ | 9.1 | 10.1 | 16,978 |

| 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 | 23.1 | 25.6 | 64,000 |
| バローホールディングス | 26.6 | 29.5 | 81,921 |
| 藤久 | 0.7 | 1.1 | 1,907 |
| ベルク | 6.1 | 6.7 | 28,173 |
| 大庄 | 5.8 | 7.3 | 11,088 |
| ファーストリテイリング | 24.7 | 22.9 | 646,467 |
| サンドラッグ | 26.1 | 28.9 | 273,394 |
| サックスバー　ホールディングス | 11.6 | 12.9 | 14,306 |
| ヤマザワ | 2.6 | 2.8 | 4,807 |
| やまや | 2.5 | 2.8 | 4,768 |
| ベルーナ | 30.8 | 34.1 | 20,187 |
| **銀行業（7.4%）** | | | |
| 島根銀行 | 2.6 | 2.9 | 3,398 |
| じもとホールディングス | 88.6 | 98.3 | 13,762 |
| 足利ホールディングス | 90.6 | 100.5 | 32,662 |
| 東京ＴＹフィナンシャルグループ | 17 | 18.9 | 43,243 |
| 九州フィナンシャルグループ | 188.9 | 209.7 | 108,414 |
| ゆうちょ銀行 | － | 351 | 434,889 |
| 富山第一銀行 | － | 34.8 | 16,669 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | － | 954.3 | 415,311 |
| 新生銀行 | 1,068 | 1,185 | 186,045 |
| あおぞら銀行 | 781 | 867 | 315,588 |
| 三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ | 9,904.1 | 10,990.9 | 5,502,044 |
| りそなホールディングス | 1,444.1 | 1,602.5 | 638,436 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 2,577 | 2,860 | 1,015,586 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 988.4 | 1,096.9 | 3,502,401 |
| 第四銀行 | 156 | 173 | 59,339 |
| 北越銀行 | 133 | 148 | 26,492 |
| 西日本シティ銀行 | 402 | 446 | 86,078 |
| 千葉銀行 | 476 | 528 | 271,392 |
| 横浜銀行 | 828 | － | － |
| 常陽銀行 | 446 | 495 | 188,595 |
| 群馬銀行 | 274 | 304 | 120,688 |
| 武蔵野銀行 | 19.7 | 21.9 | 53,414 |
| 千葉興業銀行 | 33.8 | 37.5 | 14,962 |
| 筑波銀行 | 51.3 | 56.9 | 16,102 |
| 七十七銀行 | 193 | 215 | 78,905 |
| 青森銀行 | 90 | 99 | 28,710 |
| 秋田銀行 | 82 | 89 | 27,234 |
| 山形銀行 | 69 | 77 | 30,954 |
| 岩手銀行 | 8.6 | 9.6 | 39,408 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東邦銀行 | 110 | 122 | 40,382 |
| 東北銀行 | 63 | 70 | 9,870 |
| みちのく銀行 | 62 | 68 | 12,444 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 534 | 593 | 215,259 |
| 静岡銀行 | 362 | 401 | 302,354 |
| 十六銀行 | 155 | 172 | 47,472 |
| スルガ銀行 | 130.3 | 130.1 | 289,862 |
| 八十二銀行 | 223 | 247.8 | 112,253 |
| 山梨中央銀行 | 76 | 85 | 31,450 |
| 大垣共立銀行 | 165 | 183 | 54,717 |
| 福井銀行 | 105 | 117 | 26,559 |
| 北國銀行 | 137 | 145 | 41,035 |
| 清水銀行 | 4.2 | 4.7 | 10,885 |
| 富山銀行 | 2.4 | 2.6 | 9,204 |
| 滋賀銀行 | 116 | 129 | 58,179 |
| 南都銀行 | 119 | 132 | 43,956 |
| 百五銀行 | 111 | 123 | 45,387 |
| 京都銀行 | 236 | 261 | 173,043 |
| 紀陽銀行 | 48.5 | 53.8 | 70,262 |
| 三重銀行 | 55 | 61 | 11,407 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 840 | 932 | 109,976 |
| 広島銀行 | 364 | 404 | 144,632 |
| 山陰合同銀行 | 74.8 | 82.3 | 58,021 |
| 中国銀行 | 87.5 | 97.1 | 104,868 |
| 鳥取銀行 | 39 | 44 | 7,568 |
| 伊予銀行 | 132 | 146.5 | 94,199 |
| 百十四銀行 | 135 | 150 | 45,750 |
| 四国銀行 | 95 | 106 | 21,518 |
| 阿波銀行 | 101 | 110 | 60,610 |
| 大分銀行 | 71 | 79 | 23,779 |
| 宮崎銀行 | 82 | 91 | 23,751 |
| 佐賀銀行 | 75 | 83 | 18,177 |
| 十八銀行 | 76 | 84 | 21,084 |
| 沖縄銀行 | 9.8 | 10.4 | 38,168 |
| 琉球銀行 | 25.4 | 28.2 | 30,202 |
| セブン銀行 | 462.5 | 513.3 | 176,575 |
| みずほフィナンシャルグループ | 17,385.5 | 19,420.1 | 3,111,100 |
| 高知銀行 | 48 | 53 | 5,353 |
| 山口フィナンシャルグループ | 115 | 128 | 125,952 |
| 長野銀行 | 40 | 45 | 8,640 |
| 名古屋銀行 | 104 | 115 | 37,720 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 北洋銀行 | 186 | 206.4 | 59,856 |
| 愛知銀行 | 4.1 | 4.6 | 21,045 |
| 第三銀行 | 70 | 77 | 11,781 |
| 中京銀行 | 51 | 56 | 13,048 |
| 東日本銀行 | 59 | － | － |
| 大光銀行 | 44 | 48 | 8,976 |
| 愛媛銀行 | 73 | 81 | 19,035 |
| トマト銀行 | 48 | 53 | 7,314 |
| みなと銀行 | 112 | 124 | 19,716 |
| 京葉銀行 | 102 | 113 | 45,087 |
| 関西アーバン銀行 | 17.2 | 19.1 | 17,839 |
| 栃木銀行 | 66 | 71 | 26,554 |
| 北日本銀行 | 3.8 | 4.3 | 10,797 |
| 東和銀行 | 173 | 256 | 20,480 |
| 福島銀行 | 152 | 169 | 14,196 |
| 大東銀行 | 74 | 82 | 14,514 |
| トモニホールディングス | 94.7 | 105.1 | 33,947 |
| フィデアホールディングス | 75.5 | 111.8 | 15,875 |
| 池田泉州ホールディングス | 131 | 145.3 | 56,812 |
| **証券、商品先物取引業（1.0%）** | | | |
| ＦＰＧ | 36.6 | 48.8 | 52,850 |
| ＳＢＩホールディングス | 148.2 | 164.5 | 173,054 |
| 日本アジア投資 | 8.4 | 9.3 | 2,827 |
| ジャフコ | 20.6 | 22.9 | 63,639 |
| 大和証券グループ本社 | 1,155 | 1,282 | 758,944 |
| 野村ホールディングス | 2,375.1 | 2,635.7 | 1,100,668 |
| 岡三証券グループ | 105 | 117 | 58,149 |
| 丸三証券 | 36.6 | 40.7 | 37,199 |
| 東洋証券 | 47 | 53 | 10,918 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 141.6 | 157.2 | 76,556 |
| 光世証券 | 29 | 33 | 3,960 |
| 水戸証券 | 38.2 | 42.4 | 10,388 |
| いちよし証券 | 27.6 | 30.6 | 23,562 |
| 松井証券 | 62.7 | 67 | 59,563 |
| だいこう証券ビジネス | 6 | 6.6 | 4,204 |
| マネックスグループ | 145.2 | 159.2 | 39,800 |
| カブドットコム証券 | 109.4 | 116.8 | 39,128 |
| 極東証券 | 16.5 | 18.4 | 20,534 |
| 岩井コスモホールディングス | 11.7 | 12.9 | 11,622 |
| 藍澤證券 | 17.3 | 25.6 | 14,233 |
| マネースクウェアＨＤ | 4.2 | 4.7 | 3,868 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| マネーパートナーズグループ | 11.4 | 12.7 | 6,629 |
| 小林洋行 | 3.5 | 3.9 | 982 |
| **保険業（2.2%）** | | | |
| かんぽ生命保険 | － | 55.7 | 118,919 |
| 損保ジャパン日本興亜ホールディングス | 274.2 | 304.3 | 855,539 |
| アニコム　ホールディングス | 8.3 | 9.3 | 24,561 |
| ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール | 368.9 | 409.4 | 1,171,702 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 118.2 | 131.2 | 159,276 |
| 第一生命保険 | 790.9 | 877.7 | 1,072,110 |
| 東京海上ホールディングス | 500.1 | 555 | 1,940,835 |
| Ｔ＆Ｄホールディングス | 449.9 | 499.3 | 467,544 |
| **その他金融業（1.3%）** | | | |
| 全国保証 | 32.1 | 35.6 | 133,678 |
| クレディセゾン | 93.6 | 103.9 | 192,111 |
| アクリーティブ | 10.1 | 11.2 | 4,244 |
| 芙蓉総合リース | 14.1 | 15.7 | 66,725 |
| 興銀リース | 23.2 | 25.7 | 46,696 |
| 東京センチュリーリース | 29 | 32.2 | 116,242 |
| 日本証券金融 | 54.4 | 60.3 | 24,240 |
| アイフル | 206.6 | 229.4 | 71,572 |
| ポケットカード | 12.3 | 13.7 | 7,507 |
| リコーリース | 9.7 | 10.8 | 29,937 |
| イオンフィナンシャルサービス | 81 | 89.9 | 201,735 |
| アコム | 248 | 275.2 | 140,352 |
| ジャックス | 68 | 76 | 36,024 |
| オリエントコーポレーション | 533.7 | 592.3 | 119,052 |
| 日立キャピタル | 29.1 | 32.3 | 78,392 |
| アプラスフィナンシャル | 59.2 | 65.7 | 6,372 |
| オリックス | 874.1 | 970 | 1,373,520 |
| 三菱ＵＦＪリース | 313.1 | 347.5 | 149,425 |
| 日本取引所グループ | 362.5 | 402.3 | 498,852 |
| イー・ギャランティ | 4 | 4.5 | 13,383 |
| アサックス | 2.1 | 2.4 | 3,189 |
| ＮＥＣキャピタルソリューション | 5 | 5.6 | 8,036 |
| **不動産業（2.7%）** | | | |
| いちごグループホールディングス | － | 151.6 | 61,246 |
| 日本駐車場開発 | 134.8 | 164.7 | 19,599 |
| ヒューリック | 257.3 | 285.6 | 299,308 |
| 三栄建築設計 | 4.9 | 5.5 | 6,220 |
| 野村不動産ホールディングス | 81.9 | 90.9 | 162,074 |
| 三重交通グループホールディングス | 21.9 | 24.3 | 9,015 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| サムティ | 6.5 | 9.9 | 9,593 |
| ディア・ライフ | 6.2 | 9.3 | 2,976 |
| エー・ディー・ワークス | 84.8 | 125.4 | 4,890 |
| 日本商業開発 | 4.1 | 6 | 8,886 |
| プレサンスコーポレーション | 4.2 | 4.6 | 17,411 |
| ユニゾホールディングス | 7.7 | 8.5 | 39,440 |
| 日本管理センター | 8 | 9 | 12,510 |
| サンセイランディック | 2.8 | 3.1 | 2,473 |
| エストラスト | 2.2 | 2.4 | 1,250 |
| フージャースホールディングス | 17.2 | 19 | 10,336 |
| オープンハウス | 17.8 | 19.8 | 55,459 |
| 東急不動産ホールディングス | 298.6 | 331.4 | 214,415 |
| 飯田グループホールディングス | 114.3 | 126.9 | 273,342 |
| ムゲンエステート | － | 2 | 3,982 |
| パーク２４ | 62.1 | 69.2 | 229,744 |
| パラカ | 4.3 | 3.9 | 6,006 |
| 三井不動産 | 655 | 726 | 1,781,604 |
| 三菱地所 | 918 | 1,019 | 1,936,609 |
| 平和不動産 | 23.3 | 25.9 | 34,188 |
| 東京建物 | 134.8 | 149.6 | 185,504 |
| ダイビル | 31.8 | 35.2 | 33,264 |
| 京阪神ビルディング | 20.4 | 22.7 | 12,053 |
| 住友不動産 | 296 | 328 | 897,736 |
| 大京 | 229 | 254 | 38,608 |
| テーオーシー | 47.8 | 53.1 | 46,887 |
| 東京楽天地 | 20 | 22 | 10,384 |
| レオパレス２１ | 145.4 | 161.4 | 110,559 |
| スターツコーポレーション | 14.2 | 15.7 | 32,781 |
| フジ住宅 | 15.7 | 17.5 | 11,637 |
| 空港施設 | 14.9 | 16.6 | 8,632 |
| 明和地所 | 6.8 | 7.5 | 4,132 |
| 住友不動産販売 | 8.9 | 9.9 | 20,225 |
| ゴールドクレスト | 9.7 | 10.8 | 18,100 |
| 日本エスリード | 4.8 | 5.3 | 5,374 |
| 日神不動産 | 16.4 | 18.2 | 6,406 |
| タカラレーベン | 54.7 | 59.7 | 45,431 |
| サンヨーハウジング名古屋 | 6.9 | 7.1 | 6,453 |
| イオンモール | 79.7 | 88.4 | 123,318 |
| ファースト住建 | 4.6 | 5.1 | 6,257 |
| トーセイ | 18.8 | 20.8 | 15,974 |
| 穴吹興産 | 11 | 15 | 3,750 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 76.7 | 85.1 | 92,333 |
| サンフロンティア不動産 | 14.9 | 16.6 | 17,679 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 10.8 | 11.9 | 5,712 |
| ランドビジネス | 8.3 | 8.1 | 2,041 |
| グランディハウス | 10.8 | 12 | 3,840 |
| 日本空港ビルデング | 39.4 | 43.7 | 155,572 |
| **サービス業（3.9%）** | | | |
| 日本工営 | 44 | 49 | 16,905 |
| ネクスト | 36.9 | 41 | 37,638 |
| ジェイエイシーリクルートメント | 6 | 8.9 | 14,355 |
| 日本M&Aセンター | 20.2 | 22.4 | 147,840 |
| ノバレーゼ | 3.3 | 3.7 | 3,122 |
| アコーディア・ゴルフ | 36.2 | 40.2 | 40,762 |
| 中広 | － | 1.4 | 827 |
| タケエイ | 11.2 | 12.7 | 11,887 |
| トラスト・テック | 2.2 | 5.8 | 8,096 |
| パソナグループ | 9.7 | 12.6 | 8,580 |
| ＣＤＳ | 3 | 3.3 | 2,679 |
| リンクアンドモチベーション | 26.3 | 29.2 | 5,402 |
| ＧＣＡサヴィアン | 11.7 | 12.8 | 12,544 |
| エス・エム・エス | 16.3 | 18.1 | 40,073 |
| テンプホールディングス | 91.5 | 101.6 | 174,244 |
| リニカル | 3.8 | 8.5 | 14,492 |
| クックパッド | 29.1 | 32.3 | 39,567 |
| エスクリ | 5.5 | 6.2 | 3,434 |
| アイ・ケイ・ケイ | 7 | 7.7 | 4,396 |
| 学情 | 4.8 | 5.4 | 6,895 |
| スタジオアリス | 6 | 6.7 | 18,378 |
| シミックホールディングス | 5.9 | 7.3 | 11,636 |
| ＮＪＳ | 2.6 | 2.9 | 3,329 |
| 綜合警備保障 | 43.6 | 48.4 | 237,644 |
| カカクコム | 94.7 | 104.1 | 203,307 |
| ルネサンス | 6.6 | 7.4 | 8,384 |
| ディップ | 14.4 | 16 | 41,712 |
| オプトホールディング | 8.1 | 9 | 6,705 |
| 新日本科学 | 12.4 | 13.7 | 8,480 |
| ツクイ | 15.5 | 17.2 | 29,240 |
| 綜合臨床ホールディングス | 6.7 | － | － |
| キャリアデザインセンター | 3.6 | 3 | 2,775 |
| エムスリー | 113.1 | 125.5 | 424,817 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 9.5 | 10.5 | 7,455 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アウトソーシング | 6.1 | 6.8 | 32,300 |
| ウェルネット | 4.5 | 5.4 | 21,276 |
| ディー・エヌ・エー | 58.6 | 65 | 144,690 |
| 博報堂ＤＹホールディングス | 181.1 | 200.9 | 245,499 |
| ぐるなび | 15.1 | 16.8 | 47,628 |
| エスアールジータカミヤ | 10.5 | 15.6 | 6,879 |
| 一休 | 9 | － | － |
| ジャパンベストレスキューシステム | 14.8 | 17.9 | 3,920 |
| ファンコミュニケーションズ | 30.1 | 33.4 | 25,150 |
| ジェイコムホールディングス | 3 | 3 | 6,294 |
| ＷＤＢホールディングス | 4.7 | 5.2 | 4,128 |
| ティア | 5.5 | 7 | 4,382 |
| バリューコマース | 12 | 13.4 | 4,569 |
| インフォマート | 18.9 | 28 | 26,740 |
| ＪＰホールディングス | 32.4 | 36 | 10,080 |
| ＥＰＳホールディングス | 11.9 | 18 | 24,552 |
| レッグス | 1.9 | 2.8 | 1,962 |
| プレステージ・インターナショナル | 11 | 12.2 | 18,251 |
| アミューズ | 3.6 | 8 | 15,376 |
| ドリームインキュベータ | 4.3 | 4.8 | 9,417 |
| クイック | 6.7 | 7.4 | 5,557 |
| ＴＡＣ | 7.2 | 8 | 1,528 |
| ケネディクス | 175.4 | 194.6 | 78,813 |
| 電通 | 145.6 | 161.6 | 854,864 |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 6.1 | 6.8 | 2,767 |
| ぴあ | 3.9 | 4.4 | 9,372 |
| イオンファンタジー | 4.6 | 5.1 | 13,331 |
| シーティーエス | 2.9 | 4.3 | 3,044 |
| ネクシィーズグループ | 4.7 | 5.2 | 8,465 |
| みらかホールディングス | 33.3 | 37 | 162,615 |
| アルプス技研 | 4.8 | 5.3 | 11,050 |
| ダイオーズ | 2.3 | 2.6 | 2,516 |
| 日本空調サービス | 6.4 | 12.7 | 6,464 |
| オリエンタルランド | 141.2 | 156.7 | 1,051,300 |
| ダスキン | 37 | 37.2 | 64,653 |
| 明光ネットワークジャパン | 15.1 | 18 | 22,014 |
| ファルコホールディングス | 5.7 | 6.3 | 8,605 |
| 秀英予備校 | 2.3 | 2.6 | 949 |
| 田谷 | 2.2 | 2.4 | 1,620 |
| ラウンドワン | 40.8 | 45.2 | 34,352 |
| リゾートトラスト | 54.8 | 60.8 | 134,368 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ビー・エム・エル | 7.7 | 8.5 | 41,267 |
| ワタベウェディング | 3.8 | 4.3 | 1,806 |
| りらいあコミュニケーションズ | 21.6 | 24 | 26,304 |
| リソー教育 | 24.3 | 26.9 | 10,195 |
| 早稲田アカデミー | 1.7 | 1.9 | 1,596 |
| ユー・エス・エス | 158.1 | 175.5 | 298,701 |
| 東京個別指導学院 | 6.3 | 7 | 4,592 |
| サイバーエージェント | 31.9 | 38.1 | 222,123 |
| 楽天 | 610.9 | 678.5 | 732,101 |
| テー・オー・ダブリュー | 7.8 | 11.6 | 7,284 |
| セントラルスポーツ | 4.5 | 4.9 | 11,475 |
| フルキャストホールディングス | 12 | 13.3 | 10,440 |
| リゾートソリューション | 13 | 14 | 4,172 |
| テクノプロ・ホールディングス | 18.5 | 23.5 | 76,492 |
| インターワークス | － | 2.5 | 3,045 |
| ＫｅｅＰｅｒ技研 | － | 1.6 | 2,571 |
| ファーストロジック | － | 0.8 | 1,605 |
| リブセンス | 8.7 | 9.7 | 4,268 |
| ジャパンマテリアル | 5.4 | 6 | 22,380 |
| ベクトル | 4 | 4.5 | 12,987 |
| ウチヤマホールディングス | 6.7 | 7.5 | 3,420 |
| サクセスホールディングス | 1.2 | 1.4 | 1,733 |
| キャリアリンク | 1.7 | 3.8 | 2,960 |
| ＩＢＪ | 2.5 | 11.3 | 6,271 |
| アサンテ | 4.8 | 5.3 | 7,494 |
| Ｎ・フィールド | 4.6 | 6.8 | 11,451 |
| Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ | 1 | 1.8 | 4,095 |
| ライドオン・エクスプレス | － | 3.1 | 4,023 |
| ＥＲＩホールディングス | 3.3 | 3.7 | 2,893 |
| アビスト | 1.4 | 2.2 | 4,617 |
| ウィルグループ | 3 | 3.3 | 3,465 |
| 日本ビューホテル | 1.4 | 2.1 | 2,860 |
| リクルートホールディングス | 263.4 | 292.3 | 1,107,817 |
| エラン | － | 1.6 | 2,080 |
| 日本郵政 | － | 426.3 | 548,221 |
| ベルシステム２４ホールディングス | － | 28.4 | 22,947 |
| リロ・ホールディング | 4.9 | 5.4 | 90,504 |
| 東祥 | 3.9 | 4.3 | 18,447 |
| エイチ・アイ・エス | 21.3 | 23.6 | 73,514 |
| ラックランド | 1.8 | 2 | 3,338 |
| 共立メンテナンス | 9.8 | 10.9 | 79,679 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | |
|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| イチネンホールディングス | 13.7 | 15.2 | 14,090 |
| 建設技術研究所 | 7.7 | 8.5 | 6,944 |
| スペース | 7 | 7.8 | 9,367 |
| 燦ホールディングス | 2.6 | 2.9 | 3,842 |
| スバル興業 | 9 | 10 | 3,930 |
| 東京テアトル | 50 | 55 | 6,380 |
| ナガワ | － | 2.6 | 9,139 |
| よみうりランド | 26 | 29 | 11,977 |
| 東京都競馬 | 89 | 99 | 20,790 |
| 常磐興産 | 48 | 53 | 7,791 |
| カナモト | 18.2 | 20.2 | 42,682 |
| 東京ドーム | 104 | 116 | 54,056 |
| 西尾レントオール | 10.5 | 11.7 | 26,395 |
| トランス・コスモス | 15.2 | 16.8 | 49,207 |
| 乃村工藝社 | 27.9 | 31 | 47,740 |
| 藤田観光 | 47 | 53 | 23,161 |
| 日本管財 | 11.2 | 12.4 | 19,728 |
| トーカイ | 5.8 | 6.4 | 20,608 |
| 白洋舎 | 14 | 15 | 3,795 |
| セコム | 135.9 | 150.8 | 1,178,200 |
| セントラル警備保障 | 5.8 | 6.4 | 12,556 |
| 丹青社 | 24.4 | 27.1 | 20,948 |
| メイテック | 16.3 | 17.5 | 61,512 |
| アサツー　ディ・ケイ | 22.9 | 25.4 | 62,026 |
| 応用地質 | 13.7 | 13.7 | 15,001 |
| 船井総研ホールディングス | 15.1 | 20.2 | 27,411 |
| 進学会 | 6.2 | 6.9 | 3,532 |
| オオバ | 7.1 | 10.5 | 4,053 |
| 学究社 | － | 2.1 | 2,385 |
| ベネッセホールディングス | 43.8 | 48.6 | 119,313 |
| イオンディライト | 12.6 | 14 | 40,866 |
| ナック | 8 | 8.9 | 7,769 |
| ニチイ学館 | 22.7 | 25.2 | 17,186 |
| ダイセキ | 24.5 | 27.2 | 55,732 |
| ステップ | 4.4 | 4.8 | 5,054 |
| 合計　株数・金額 | 206,190 | 230,874 | 263,994,721 |
| 合計　銘柄数＜比率＞ | 1,894 | 1,940 | ＜97.4%＞ |

＊各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいています。
＊銘柄欄の（　）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
＊評価額欄の＜　＞内は、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 |
| | | | 百万円 | 百万円 |
| 国内 | 株式先物取引 | ＴＯＰＩＸ | 7,121 | － |

＊単位未満は切り捨て。

## ＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

下記は、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド全体(160,429,457千口)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 | |
| ADT CORP/THE | 158 | — | — | — | 商業サービス・用品 |
| AFLAC INC | 390 | 408 | 2,878 | 301,027 | 保険 |
| AGCO CORP | 63 | 63 | 324 | 33,977 | 機械 |
| AGL RESOURCES INC | 107 | 115 | 757 | 79,219 | ガス |
| AES CORP | 602 | 650 | 780 | 81,640 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AT & T INC | 5,579 | 5,943 | 24,407 | 2,552,578 | 各種電気通信サービス |
| ABBOTT LABORATORIES | 1,347 | 1,426 | 5,380 | 562,671 | ヘルスケア機器・用品 |
| ABBVIE INC | 1,500 | 1,559 | 9,350 | 977,915 | バイオテクノロジー |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 463 | 566 | 2,188 | 228,837 | ソフトウェア |
| ACUITY BRANDS INC | 40 | 41 | 1,043 | 109,116 | 電気設備 |
| ADOBE SYSTEMS INC. | 452 | 479 | 4,776 | 499,535 | ソフトウェア |
| ADVANCE AUTO PARTS | 68 | 71 | 1,104 | 115,482 | 専門小売り |
| AETNA INC | 317 | 337 | 4,080 | 426,763 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AFFILIATED MANAGERS GROUP | 49 | 52 | 796 | 83,318 | 資本市場 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 299 | 318 | 1,467 | 153,511 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| AIR PRODUCTS | 186 | 198 | 2,840 | 297,017 | 化学 |
| AIRGAS INC | 60 | — | — | — | 化学 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 158 | 167 | 913 | 95,532 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ALBEMARLE CORP | 102 | 111 | 928 | 97,069 | 化学 |
| ALCOA INC | 1,210 | 1,250 | 1,232 | 128,894 | 金属・鉱業 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 205 | 218 | 2,708 | 283,279 | バイオテクノロジー |
| ALLEGHANY CORP | 14 | 15 | 803 | 84,022 | 保険 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 56 | 57 | 1,152 | 120,482 | 情報技術サービス |
| ALLIANT ENERGY CORP | 100 | 216 | 843 | 88,211 | 電力 |
| ALLSTATE CORP | 363 | 367 | 2,451 | 256,384 | 保険 |
| ALLY FINANCIAL INC | 393 | 421 | 688 | 72,030 | 消費者金融 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 67 | 72 | 401 | 42,001 | バイオテクノロジー |
| ALPHABET INC-CL C | 280 | 300 | 20,906 | 2,186,353 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ALPHABET INC-CL A | 262 | 282 | 20,054 | 2,097,269 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ALTERA CORP. | 279 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| ALTRIA GROUP INC | 1,777 | 1,889 | 12,501 | 1,307,396 | タバコ |
| AMAZON.COM INC | 360 | 387 | 27,702 | 2,897,099 | インターネット販売・カタログ販売 |
| AMERCO | 6 | 6 | 252 | 26,372 | 陸運・鉄道 |
| AMEREN CORPORATION | 220 | 231 | 1,186 | 124,099 | 総合公益事業 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 154 | 148 | 444 | 46,464 | 旅客航空輸送業 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 447 | 475 | 3,171 | 331,683 | 電力 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 817 | 793 | 4,939 | 516,583 | 消費者金融 |
| AMERICAN INTL GROUP | 1,173 | 1,113 | 5,986 | 626,102 | 保険 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 163 | 171 | 1,336 | 139,757 | 水道 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 186 | 188 | 1,439 | 150,544 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 162 | 164 | 1,618 | 169,264 | 資本市場 |
| AMETEK INC | 223 | 233 | 1,081 | 113,063 | 電気設備 |
| AMGEN INC | 687 | 726 | 10,861 | 1,135,878 | バイオテクノロジー |
| AMPHENOL CORP-CL A | 276 | 296 | 1,725 | 180,409 | 電子装置・機器・部品 |
| ANADARKO PETE | 458 | 495 | 2,747 | 287,359 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ANALOG DEVICES INC | 284 | 304 | 1,734 | 181,406 | 半導体・半導体製造装置 |
| ANSYS INC | 84 | 84 | 752 | 78,737 | ソフトウェア |
| ANTERO RESOURCES CORP | 74 | 147 | 421 | 44,090 | 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 | |
| ANTHEM INC | 237 | 252 | 3,319 | 347,112 | ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| APACHE CORPORATION | 348 | 369 | 2,089 | 218,535 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| APPLE INC | 5,169 | 5,362 | 51,426 | 5,378,229 | コンピュータ・周辺機器 |
| APPLIED MATERIALS | 1,088 | 1,096 | 2,611 | 273,138 | 半導体・半導体製造装置 |
| ARAMARK | 202 | 216 | 722 | 75,561 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ARCHER DANIELS MIDLAND | 552 | 577 | 2,419 | 253,077 | 食品 |
| ARROW ELECTRS INC | 83 | 89 | 594 | 62,193 | 電子装置・機器・部品 |
| ASHLAND INC | 59 | 59 | 679 | 71,056 | 化学 |
| ASSURANT INC | 62 | 62 | 532 | 55,671 | 保険 |
| ATMOS ENERGY CORP | — | 97 | 743 | 77,735 | ガス |
| AUTODESK INC. | 202 | 199 | 1,155 | 120,851 | ソフトウェア |
| AUTOLIV INC | 80 | 85 | 1,043 | 109,116 | 自動車部品 |
| AUTOMATIC DATA PROCESS | 422 | 444 | 3,966 | 414,837 | 情報技術サービス |
| AUTONATION INC | 71 | 71 | 340 | 35,559 | 専門小売り |
| AUTOZONE | 28 | 29 | 2,201 | 230,211 | 専門小売り |
| AVERY DENNISON CORP | 83 | 87 | 664 | 69,448 | 容器・包装 |
| AVNET | 122 | 122 | 525 | 54,926 | 電子装置・機器・部品 |
| BB&T CORPORATION | 711 | 786 | 2,828 | 295,837 | 銀行 |
| BAKER HUGHES | 397 | 404 | 1,882 | 196,886 | エネルギー設備・サービス |
| BALL CORP | 117 | 130 | 935 | 97,873 | 容器・包装 |
| BANK OF AMERICA CORP | 9,461 | 9,989 | 13,605 | 1,422,812 | 銀行 |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP | 1,003 | 1,042 | 4,213 | 440,684 | 資本市場 |
| BARD (C R) | 67 | 70 | 1,604 | 167,786 | ヘルスケア機器・用品 |
| BAXALTA INC | 497 | — | — | — | バイオテクノロジー |
| BAXTER INTERNATIONAL INC. | 498 | 478 | 2,151 | 225,001 | ヘルスケア機器・用品 |
| B/E AEROSPACE INC | 101 | 101 | 493 | 51,598 | 航空宇宙・防衛 |
| BECTON,DICKINSON | 189 | 204 | 3,470 | 362,903 | ヘルスケア機器・用品 |
| BED BATH & BEYOND | 156 | 156 | 675 | 70,690 | 専門小売り |
| WR BERKLEY CORP | 89 | 99 | 555 | 58,093 | 保険 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 1,073 | 1,152 | 16,534 | 1,729,194 | 各種金融サービス |
| BEST BUY COMPANY INC | 288 | 284 | 853 | 89,280 | 専門小売り |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 146 | 153 | 1,242 | 129,958 | バイオテクノロジー |
| BIOGEN INC | 212 | 211 | 4,932 | 515,852 | バイオテクノロジー |
| BLACKROCK INC | 111 | 119 | 4,141 | 433,086 | 資本市場 |
| H & R BLOCK INC | 209 | 224 | 506 | 52,919 | 各種消費者サービス |
| BOEING CO | 585 | 609 | 8,009 | 837,640 | 航空宇宙・防衛 |
| BORGWARNER INC | 201 | 213 | 710 | 74,288 | 自動車部品 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 1,218 | 1,306 | 2,972 | 310,859 | ヘルスケア機器・用品 |
| BRISTOL MYERS SQUIBB | 1,511 | 1,614 | 11,499 | 1,202,643 | 医薬品 |
| BROADCOM CORP-CL A | 508 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | — | 114 | 732 | 76,623 | 情報技術サービス |
| BROWN-FORMAN CORP-CL B | 105 | 108 | 1,056 | 110,461 | 飲料 |
| CBS CORP-CL B | 403 | 409 | 2,185 | 228,580 | メディア |
| CBRE GROUP INC | 276 | 296 | 861 | 90,081 | 不動産管理・開発 |
| CDK GLOBAL INC | 128 | 128 | 719 | 75,217 | ソフトウェア |
| CDW CORPORATION | 128 | 141 | 584 | 61,106 | 電子装置・機器・部品 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 214 | 229 | 625 | 65,404 | 化学 |
| C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC | 129 | 137 | 987 | 103,286 | 航空貨物・物流サービス |
| CIGNA CORP | 234 | 249 | 3,184 | 333,037 | ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| CIT GROUP INC | 155 | 194 | 607 | 63,523 | 銀行 |
| CME GROUP INC | 289 | 327 | 3,057 | 319,713 | 各種金融サービス |
| CMS ENERGY CORP | 246 | 273 | 1,193 | 124,793 | 総合公益事業 |
| CSX CORP | 889 | 932 | 2,481 | 259,558 | 陸運・鉄道 |
| CVS HEALTH CORP | 1,010 | 1,063 | 9,908 | 1,036,201 | 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 | |
| CA INC | 309 | 309 | 1,022 | 106,963 | ソフトウェア |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 177 | — | — | — | メディア |
| CABOT OIL & GAS CORP | 371 | 436 | 1,110 | 116,135 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | — | 291 | 711 | 74,377 | ソフトウェア |
| CALPINE CORP | 310 | 310 | 437 | 45,744 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CAMERON INTERNATIONAL CORP | 177 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| CAMPBELL SOUP CO | 166 | 195 | 1,225 | 128,170 | 食品 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 493 | 511 | 3,283 | 343,354 | 消費者金融 |
| CARDINAL HEALTH INC | 297 | 317 | 2,437 | 254,904 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARMAX INC | 193 | 193 | 929 | 97,165 | 専門小売り |
| CARNIVAL CORP | 380 | 403 | 1,960 | 205,039 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CATERPILLAR INC DEL | 518 | 563 | 4,306 | 450,361 | 機械 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 138 | 143 | 990 | 103,607 | 化学 |
| CELGENE CORP | 717 | 756 | 7,322 | 765,799 | バイオテクノロジー |
| CENTENE CORP | 106 | 161 | 1,112 | 116,363 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 363 | 389 | 914 | 95,601 | 総合公益事業 |
| CENTURYLINK INC | 518 | 530 | 1,488 | 155,640 | 各種電気通信サービス |
| CERNER CORP | 284 | 293 | 1,605 | 167,948 | ヘルスケア・テクノロジー |
| CHARTER COMMUNICATION-A | 76 | — | — | — | メディア |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | — | 208 | 4,640 | 485,276 | メディア |
| CHENIERE ENERGY INC | 206 | 195 | 690 | 72,252 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP | 516 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHEVRON CORP | 1,706 | 1,819 | 18,779 | 1,963,945 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR | 84 | — | — | — | 建設・土木 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 28 | 29 | 1,144 | 119,694 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CHUBB CORP | 206 | — | — | — | 保険 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 117 | 128 | 1,275 | 133,420 | 家庭用品 |
| CIMAREX ENERGY CO | 85 | 90 | 1,069 | 111,873 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 138 | 147 | 1,034 | 108,227 | 保険 |
| CISCO SYSTEMS | 4,613 | 4,868 | 14,005 | 1,464,667 | 通信機器 |
| CINTAS CORP | 85 | 84 | 793 | 83,015 | 商業サービス・用品 |
| CITIGROUP | 2,728 | 2,852 | 12,240 | 1,280,141 | 銀行 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 479 | 501 | 1,079 | 112,910 | 銀行 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 143 | 149 | 1,270 | 132,824 | ソフトウェア |
| CLOROX CO | 117 | 126 | 1,677 | 175,386 | 家庭用品 |
| COACH INC | 251 | 265 | 1,070 | 111,991 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| COCA COLA CO | 3,745 | 3,979 | 17,957 | 1,877,966 | 飲料 |
| COCA COLA ENTERPRISES | 196 | — | — | — | 飲料 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 552 | 588 | 3,622 | 378,797 | 情報技術サービス |
| COLGATE PALMOLIVE CO. | 777 | 821 | 5,894 | 616,476 | 家庭用品 |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP | 353 | 387 | 986 | 103,123 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COMCAST CORP-CL A | 2,251 | 2,354 | 14,721 | 1,539,617 | メディア |
| COMERICA INC | 159 | 173 | 734 | 76,838 | 銀行 |
| CONAGRA INC | 392 | 400 | 1,898 | 198,534 | 食品 |
| CONCHO RESOURCES INC | 118 | 123 | 1,544 | 161,499 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CONOCOPHILLIPS | 1,116 | 1,194 | 5,349 | 559,410 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 270 | 286 | 2,207 | 230,814 | 総合公益事業 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 157 | 168 | 2,601 | 272,045 | 飲料 |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 80 | 94 | 423 | 44,325 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| THE COOPER COMPANIES, INC. | 42 | 47 | 778 | 81,377 | ヘルスケア機器・用品 |
| CORNING INC | 1,111 | 1,079 | 2,197 | 229,858 | 電子装置・機器・部品 |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 398 | 423 | 6,658 | 696,397 | 食品・生活必需品小売り |
| CROWN HOLDINGS INC | 126 | 133 | 704 | 73,648 | 容器・包装 |
| CUMMINS INC | 154 | 161 | 1,857 | 194,236 | 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 | 千米ドル | 千円 | |
| DR HORTON INC | 299 | 340 | 1,054 | 110,262 | 家庭用耐久財 |
| DTE ENERGY COMPANY | 164 | 170 | 1,598 | 167,172 | 総合公益事業 |
| DANAHER CORP | 555 | 595 | 5,892 | 616,215 | コングロマリット |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 101 | 118 | 792 | 82,927 | ホテル・レストラン・レジャー |
| DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC | 153 | 160 | 1,210 | 126,583 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DEERE & COMPANY | 283 | 260 | 2,186 | 228,647 | 機械 |
| DELTA AIR LINES INC | 180 | 191 | 738 | 77,242 | 旅客航空輸送業 |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC | 124 | — | — | — | ヘルスケア機器・用品 |
| DENTSPLY SIRONA INC | — | 229 | 1,451 | 151,835 | ヘルスケア機器・用品 |
| DEVON ENERGY CORP | 354 | 444 | 1,695 | 177,329 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DICK S SPORTING GOODS INC | 83 | 83 | 339 | 35,475 | 専門小売り |
| DISNEY (WALT) CO | 1,453 | 1,499 | 14,813 | 1,549,155 | メディア |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 395 | 402 | 2,141 | 223,995 | 消費者金融 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC | 143 | 143 | 368 | 38,523 | メディア |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C | 246 | 235 | 579 | 60,605 | メディア |
| DISH NETWORK CORP-A | 200 | 220 | 1,167 | 122,147 | メディア |
| DOLLAR GENERAL CORP | 267 | 281 | 2,570 | 268,773 | 複合小売り |
| DOLLAR TREE INC | 199 | 227 | 2,102 | 219,900 | 複合小売り |
| DOMINION RESOURCES INC/VA | 539 | 572 | 4,252 | 444,759 | 総合公益事業 |
| DOMINOS PIZZA INC | — | 48 | 611 | 63,917 | ホテル・レストラン・レジャー |
| DOVER CORP | 145 | 153 | 1,083 | 113,317 | 機械 |
| DOW CHEM CO | 1,023 | 1,080 | 5,753 | 601,665 | 化学 |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC | 176 | 181 | 1,671 | 174,846 | 飲料 |
| DU PONT E I DE NEMOURS | 819 | 846 | 5,714 | 597,646 | 化学 |
| DUKE ENERGY CORP | 628 | 666 | 5,461 | 571,132 | 電力 |
| DUN & BRADSTREET CORP | 31 | 36 | 459 | 48,085 | 専門サービス |
| EMC CORP | 1,744 | 1,873 | 5,195 | 543,366 | コンピュータ・周辺機器 |
| EOG RESOURCES INC | 496 | 532 | 4,517 | 472,410 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| EQT CORP | 141 | 165 | 1,298 | 135,767 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | 271 | 275 | 689 | 72,100 | 資本市場 |
| EASTMAN CHEMICAL CO. | 134 | 142 | 1,023 | 107,026 | 化学 |
| EATON VANCE CORP | 100 | 117 | 424 | 44,354 | 資本市場 |
| EBAY INC | 997 | 1,083 | 2,675 | 279,752 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ECOLAB INC | 241 | 256 | 3,057 | 319,743 | 化学 |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO | 55 | 58 | 484 | 50,629 | パーソナル用品 |
| EDISON INTERNATIONAL | 295 | 318 | 2,357 | 246,496 | 電力 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 192 | 208 | 2,050 | 214,415 | ヘルスケア機器・用品 |
| ELECTRONIC ARTS | 283 | 296 | 2,235 | 233,746 | ソフトウェア |
| EMERSON ELEC | 596 | 623 | 3,311 | 346,290 | 電気設備 |
| ENERGEN CORP | 68 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ENTERGY CORP | 167 | 174 | 1,356 | 141,844 | 電力 |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS | 165 | 188 | 499 | 52,219 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EQUIFAX INC | 106 | 113 | 1,412 | 147,671 | 専門サービス |
| EVERSOURCE ENERGY | 290 | 309 | 1,762 | 184,293 | 電力 |
| EXELON CORPORATION | 774 | 894 | 3,107 | 324,986 | 電力 |
| EXPEDIA INC | 112 | 117 | 1,256 | 131,376 | インターネット販売・カタログ販売 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC | 173 | 177 | 859 | 89,906 | 航空貨物・物流サービス |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON | 612 | 647 | 4,836 | 505,782 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EXXON MOBIL CORP | 3,779 | 4,017 | 36,767 | 3,845,155 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FLIR SYSTEMS INC | 126 | 126 | 389 | 40,717 | 電子装置・機器・部品 |
| FMC CORP | 118 | 132 | 636 | 66,579 | 化学 |
| FMC TECHNOLOGIES INC | 205 | 225 | 620 | 64,920 | エネルギー設備・サービス |
| FACEBOOK INC-A | 1,944 | 2,219 | 25,380 | 2,654,336 | インターネットソフトウェア・サービス |
| FASTENAL CO | 250 | 279 | 1,254 | 131,183 | 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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| FEDEX CORPORATION | 243 | 253 | 4,157 | 434,819 | 航空貨物・物流サービス |
| F5 NETWORKS INC | 65 | 67 | 799 | 83,584 | 通信機器 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 255 | 298 | 2,184 | 228,407 | 情報技術サービス |
| FNF GROUP | 228 | 244 | 852 | 89,132 | 保険 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 737 | 767 | 1,412 | 147,671 | 銀行 |
| FIREEYE INC | 124 | — | — | — | ソフトウェア |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 129 | 137 | 956 | 100,005 | 銀行 |
| FISERV INC | 213 | 216 | 2,277 | 238,181 | 情報技術サービス |
| FIRSTENERGY CORP | 392 | 403 | 1,351 | 141,356 | 電力 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 70 | 89 | 1,308 | 136,872 | 情報技術サービス |
| FLUOR CORP | 131 | 139 | 713 | 74,616 | 建設・土木 |
| FLOWSERVE CORP | 123 | 123 | 612 | 64,020 | 機械 |
| FOOT LOCKER INC | 126 | 134 | 723 | 75,618 | 専門小売り |
| FORD MOTOR COMPANY | 3,354 | 3,580 | 4,732 | 494,952 | 自動車 |
| FORTINET INC | 128 | 139 | 469 | 49,075 | ソフトウェア |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | 148 | 153 | 880 | 92,116 | 建設関連製品 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 367 | 378 | 1,278 | 133,655 | 資本市場 |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 970 | 1,150 | 1,335 | 139,629 | 金属・鉱業 |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CO | 1,030 | 1,140 | 593 | 62,114 | 各種電気通信サービス |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 159 | 168 | 786 | 82,207 | 保険 |
| GAMESTOP CORP-CLASS A | 100 | — | — | — | 専門小売り |
| GAP INC | 229 | 229 | 470 | 49,214 | 専門小売り |
| GARTNER INC | 75 | 81 | 798 | 83,523 | 情報技術サービス |
| GENERAL DYNAMICS | 248 | 257 | 3,587 | 375,130 | 航空宇宙・防衛 |
| GENERAL ELEC CO | 8,563 | 9,025 | 27,923 | 2,920,223 | コングロマリット |
| GENERAL MILLS | 543 | 575 | 3,824 | 400,008 | 食品 |
| GENERAL MOTORS CO | 1,292 | 1,346 | 3,972 | 415,396 | 自動車 |
| GENUINE PARTS CO | 136 | 145 | 1,414 | 147,925 | 販売 |
| GILEAD SCIENCES INC | 1,330 | 1,322 | 10,812 | 1,130,785 | バイオテクノロジー |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 115 | 149 | 1,115 | 116,681 | 情報技術サービス |
| GOLDMAN SACHS GROUP | 354 | 367 | 5,457 | 570,776 | 資本市場 |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | 252 | 252 | 686 | 71,762 | 自動車部品 |
| WR GRACE & CO | — | 67 | 512 | 53,595 | 化学 |
| GRAINGER(W.W.) INC | 53 | 56 | 1,263 | 132,166 | 商社・流通業 |
| HCA HOLDINGS INC | 305 | 308 | 2,425 | 253,658 | ﾍﾙｽｹｱ･ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ･ｻｰﾋﾞｽ |
| HP INC | 1,637 | 1,670 | 2,226 | 232,806 | コンピュータ・周辺機器 |
| HALLIBURTON CO | 771 | 832 | 3,712 | 388,241 | エネルギー設備・サービス |
| HANESBRANDS INC | 359 | 377 | 1,003 | 104,993 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 190 | 179 | 826 | 86,410 | 自動車 |
| HARMAN INTERNATIONAL | 63 | 70 | 528 | 55,226 | 家庭用耐久財 |
| HARRIS CORP | 114 | 119 | 993 | 103,915 | 通信機器 |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES | 382 | 385 | 1,702 | 178,044 | 保険 |
| HASBRO INC | 101 | 108 | 926 | 96,930 | レジャー用品 |
| HELMERICH & PAYNE | 96 | 106 | 709 | 74,250 | エネルギー設備・サービス |
| HERSHEY CO/THE | 139 | 143 | 1,393 | 145,750 | 食品 |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC | 346 | — | — | — | 陸運・鉄道 |
| HESS CORP | 234 | 275 | 1,614 | 168,818 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 1,666 | 1,686 | 3,331 | 348,412 | コンピュータ・周辺機器 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 439 | 525 | 1,200 | 125,566 | ホテル・レストラン・レジャー |
| HOLLYFRONTIER CORP | 166 | 166 | 405 | 42,359 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HOLOGIC INC | 216 | 247 | 836 | 87,516 | ヘルスケア機器・用品 |
| HOME DEPOT | 1,164 | 1,225 | 15,648 | 1,636,483 | 専門小売り |
| HONEYWELL INTERNATIONAL | 673 | 706 | 8,281 | 866,066 | 航空宇宙・防衛 |
| HORMEL FOODS CORP | 131 | 276 | 963 | 100,793 | 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 | |
| HUMANA INC | 134 | 143 | 2,731 | 285,639 | 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 | 697 | 72,905 | 陸運・鉄道 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 750 | 750 | 694 | 72,630 | 銀行 |
| IMS HEALTH HOLDINGS INC | 144 | 163 | 404 | 42,292 | ヘルスケア・テクノロジー |
| IDEXX LABORATORIES INC | — | 86 | 771 | 80,639 | ヘルスケア機器・用品 |
| IHS INC-CLASS A | 61 | 66 | 767 | 80,294 | 専門サービス |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC | 299 | 317 | 3,362 | 351,641 | 機械 |
| ILLUMINA INC | 130 | 142 | 1,984 | 207,512 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| INCYTE CORP | 148 | 160 | 1,241 | 129,846 | バイオテクノロジー |
| INGREDION INC | — | 69 | 862 | 90,178 | 食品 |
| INTEL CORP | 4,304 | 4,561 | 14,741 | 1,541,629 | 半導体・半導体製造装置 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 100 | 114 | 2,873 | 300,509 | 各種金融サービス |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | 843 | 883 | 13,604 | 1,422,722 | 情報技術サービス |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE | 73 | 77 | 980 | 102,494 | 化学 |
| IP(INTERNATIONAL PAPER CO) | 360 | 376 | 1,596 | 166,922 | 容器・包装 |
| INTERPUBRIC GROUP | 369 | 392 | 947 | 99,126 | メディア |
| INTUIT INC | 238 | 236 | 2,546 | 266,306 | ソフトウェア |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 33 | 35 | 2,296 | 240,199 | ヘルスケア機器・用品 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | — | 121 | 271 | 28,358 | バイオテクノロジー |
| ISIS PHARMACEUTICALS INC | 109 | — | — | — | バイオテクノロジー |
| JPMORGAN CHASE & CO | 3,352 | 3,550 | 22,347 | 2,337,075 | 銀行 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 110 | 123 | 642 | 67,146 | 建設・土木 |
| JARDEN CORP | 184 | — | — | — | 家庭用耐久財 |
| JOHNSON & JOHNSON | 2,510 | 2,669 | 31,008 | 3,242,862 | 医薬品 |
| JOHNSON CONTROLS INC | 590 | 619 | 2,735 | 286,128 | 自動車部品 |
| JONES LANG LASALLE INC | 42 | 42 | 473 | 49,483 | 不動産管理・開発 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 314 | 335 | 777 | 81,349 | 通信機器 |
| KLA TENCOR CORP | 142 | 150 | 1,107 | 115,864 | 半導体・半導体製造装置 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 102 | 106 | 950 | 99,414 | 陸運・鉄道 |
| KELLOGG CO | 243 | 257 | 1,987 | 207,840 | 食品 |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC | 106 | — | — | — | 食品 |
| KEYCORP | 765 | 810 | 942 | 98,517 | 銀行 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 329 | 351 | 4,669 | 488,357 | 家庭用品 |
| KINDER MORGAN INC | 1,683 | 1,836 | 3,449 | 360,784 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KOHLS CORP | 181 | 185 | 681 | 71,275 | 複合小売り |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 548 | 586 | 5,021 | 525,141 | 食品 |
| KROGER CO | 844 | 890 | 3,067 | 320,833 | 食品・生活必需品小売り |
| L BRANDS, INC | 227 | 240 | 1,636 | 171,151 | 専門小売り |
| LKQ CORP | 281 | 300 | 983 | 102,812 | 販売 |
| L-3 COMMUNICATIONS HLDGS | 73 | 77 | 1,106 | 115,740 | 航空宇宙・防衛 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 94 | 99 | 1,269 | 132,761 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| LAM RESEARCH | 141 | 154 | 1,303 | 136,347 | 半導体・半導体製造装置 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 358 | 423 | 1,911 | 199,908 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 205 | 216 | 2,010 | 210,306 | パーソナル用品 |
| LEAR CORP | 69 | 74 | 844 | 88,293 | 自動車部品 |
| LEGGETT & PLATT INC | 123 | 134 | 675 | 70,643 | 家庭用耐久財 |
| LEGG MASON INC | 92 | — | — | — | 資本市場 |
| LENNAR CORP-A | 156 | 168 | 775 | 81,065 | 家庭用耐久財 |
| LEUCADIA NATIONAL CORP | 292 | 322 | 548 | 57,348 | 各種金融サービス |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC | 269 | 290 | 1,501 | 156,978 | 各種電気通信サービス |
| LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A | 414 | 423 | 1,052 | 110,106 | インターネット販売・カタログ販売 |
| LIBERTY MEDIA CORP-A | 81 | — | — | — | メディア |
| LIBERTY MEDIA CORP-C | 179 | — | — | — | メディア |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP | — | 81 | 247 | 25,837 | 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 | |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C | — | 193 | 570 | 59,704 | メディア |
| ELI LILLY & CO. | 904 | 965 | 7,003 | 732,374 | 医薬品 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 227 | 234 | 996 | 104,200 | 保険 |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP | 213 | 225 | 1,051 | 109,981 | 半導体・半導体製造装置 |
| LINKEDIN CORP - A | 103 | 113 | 2,155 | 225,466 | インターネットソフトウェア・サービス |
| LOCKHEED MARTIN | 252 | 266 | 6,347 | 663,854 | 航空宇宙・防衛 |
| LOEWS CORP | 269 | 279 | 1,125 | 117,703 | 保険 |
| LOWES COS INC | 839 | 881 | 6,900 | 721,693 | 専門小売り |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 106 | 106 | 761 | 79,682 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| M & T BANK CORP | 131 | 139 | 1,638 | 171,343 | 銀行 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 400 | 423 | 1,037 | 108,514 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MSCI INC | — | 93 | 696 | 72,818 | 各種金融サービス |
| MACYS INC | 307 | 304 | 1,004 | 105,041 | 複合小売り |
| MANPOWERGROUP INC | 70 | 70 | 529 | 55,424 | 専門サービス |
| MARATHON OIL CORP | 624 | 794 | 1,198 | 125,302 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 489 | 508 | 1,788 | 187,005 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MARKEL CORP | 12 | 13 | 1,270 | 132,824 | 保険 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 480 | 501 | 3,343 | 349,681 | 保険 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA | 193 | 199 | 1,347 | 140,914 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 51 | 59 | 1,086 | 113,613 | 建設資材 |
| MASCO CORP | 310 | 329 | 1,031 | 107,899 | 建設関連製品 |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 905 | 949 | 9,025 | 943,932 | 情報技術サービス |
| MATTEL INC | 301 | 334 | 1,073 | 112,229 | レジャー用品 |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 256 | 271 | 1,014 | 106,109 | 半導体・半導体製造装置 |
| MCCORMICK & CO INC. | 108 | 113 | 1,139 | 119,156 | 食品 |
| MCDONALD'S CORP | 854 | 872 | 10,693 | 1,118,309 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MCGRAW HILL FINANCIAL INC | 247 | — | — | — | 各種金融サービス |
| MCKESSON CORP | 211 | 221 | 3,969 | 415,081 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MEAD JOHNSON NUTRITION CO | 184 | 181 | 1,600 | 167,351 | 食品 |
| MEDIVATION INC | 142 | 154 | 908 | 94,973 | バイオテクノロジー |
| MEDNAX INC | 83 | 91 | 643 | 67,321 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR | 75 | 184 | 252 | 26,381 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MERCK & CO INC | 2,553 | 2,685 | 15,103 | 1,579,484 | 医薬品 |
| METLIFE INC | 857 | 903 | 3,858 | 403,523 | 保険 |
| METTLER-TOLEDO INTL | 25 | 26 | 981 | 102,678 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| MICROSOFT CORP | 6,886 | 7,267 | 37,199 | 3,890,352 | ソフトウェア |
| MICROCHIP TECHNOLOGY | 188 | 207 | 1,074 | 112,375 | 半導体・半導体製造装置 |
| MICRON TECHNOLOGY | 991 | 1,010 | 1,287 | 134,672 | 半導体・半導体製造装置 |
| MOHAWK INDUSTRIES | 57 | 60 | 1,181 | 123,540 | 家庭用耐久財 |
| MOLSON COORS BREWING CO-B | 138 | 180 | 1,837 | 192,140 | 飲料 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 1,460 | 1,518 | 6,752 | 706,130 | 食品 |
| MONSANTO CO | 424 | 427 | 4,597 | 480,852 | 化学 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 130 | 137 | 2,167 | 226,625 | 飲料 |
| MOODYS CORP | 163 | 169 | 1,664 | 174,036 | 各種金融サービス |
| MORGAN STANLEY | 1,335 | 1,421 | 3,723 | 389,353 | 資本市場 |
| MOSAIC CO/THE | 293 | 313 | 844 | 88,282 | 化学 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 144 | 151 | 1,023 | 107,082 | 通信機器 |
| MURPHY OIL CORP | 150 | 150 | 477 | 49,963 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NRG ENERGY INC | 294 | 294 | 421 | 44,059 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| NASDAQ INC | 111 | 111 | 698 | 73,097 | 各種金融サービス |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 350 | 366 | 1,304 | 136,454 | エネルギー設備・サービス |
| NAVIENT CORP | 339 | 339 | 414 | 43,394 | 消費者金融 |
| NETAPP INC | 279 | 279 | 706 | 73,878 | コンピュータ・周辺機器 |
| NETFLIX INC | 368 | 414 | 3,766 | 393,951 | インターネット販売・カタログ販売 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| NETSUITE INC | 33 | 39 | 305 | 31,915 | ソフトウェア |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | 500 | 1,140 | 686 | 71,771 | 不動産管理・開発 |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | — | 234 | 1,310 | 137,017 | コングロマリット |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 441 | 471 | 713 | 74,624 | 貯蓄・抵当・不動産金融 |
| NEWELL BRANDS INC | 241 | 427 | 2,073 | 216,827 | 家庭用耐久財 |
| NEWFIELD EXPLORATION CO | — | 190 | 776 | 81,209 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO | 470 | 517 | 1,800 | 188,318 | 金属・鉱業 |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I | 336 | 374 | 431 | 45,175 | メディア |
| NEXTERA ENERGY INC | 408 | 445 | 5,530 | 578,328 | 電力 |
| NIKE INC-B | 614 | 1,306 | 7,152 | 748,056 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NISOURCE INC | — | 308 | 779 | 81,492 | 総合公益事業 |
| NOBLE ENERGY INC | 395 | 411 | 1,515 | 158,476 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NORDSTROM INC | 128 | 127 | 479 | 50,138 | 複合小売り |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 273 | 287 | 2,439 | 255,152 | 陸運・鉄道 |
| NORTHERN TRUST CORP | 198 | 214 | 1,487 | 155,608 | 資本市場 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 161 | 166 | 3,566 | 372,985 | 航空宇宙・防衛 |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 225 | 250 | 405 | 42,354 | ソフトウェア |
| NUCOR CORP | 294 | 307 | 1,534 | 160,498 | 金属・鉱業 |
| NVIDIA CORP | 490 | 522 | 2,467 | 258,050 | 半導体・半導体製造装置 |
| OGE ENERGY CORP | 177 | 196 | 610 | 63,850 | 電力 |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC, | 90 | 94 | 2,456 | 256,895 | 専門小売り |
| OCCIDENTAL PETE CORP | 695 | 738 | 5,694 | 595,521 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| OCEANEERING INTL INC | 95 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| OMNICOM GROUP | 224 | 231 | 1,923 | 201,187 | メディア |
| ONEOK INC | 198 | 198 | 926 | 96,928 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ORACLE CORPORATION | 3,144 | 3,049 | 12,192 | 1,275,138 | ソフトウェア |
| PG&E CORP | 444 | 473 | 2,962 | 309,807 | 電力 |
| PNC FINANCIAL | 468 | 487 | 4,116 | 430,515 | 銀行 |
| PPG INDUSTRIES | 246 | 258 | 2,787 | 291,563 | 化学 |
| PPL CORPORATION | 615 | 654 | 2,594 | 271,324 | 電力 |
| PVH CORP | 76 | 80 | 811 | 84,902 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| PACCAR | 325 | 341 | 1,861 | 194,641 | 機械 |
| PACKAGING CORP OP AMERICA | 89 | 89 | 602 | 63,059 | 容器・包装 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 64 | 85 | 1,084 | 113,441 | 通信機器 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 127 | 132 | 1,496 | 156,529 | 機械 |
| PATTERSON COS INC | 75 | 87 | 416 | 43,590 | ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| PAYCHEX INC | 295 | 317 | 1,759 | 184,025 | 情報技術サービス |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 988 | 1,057 | 3,822 | 399,716 | 情報技術サービス |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL INC | 270 | 305 | 470 | 49,216 | 銀行 |
| PEPCO HOLDINGS INC | 227 | — | — | — | 電力 |
| PEPSICO INC | 1,331 | 1,398 | 14,550 | 1,521,679 | 飲料 |
| PFIZER INC | 5,589 | 5,965 | 20,728 | 2,167,773 | 医薬品 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 1,405 | 1,497 | 15,097 | 1,578,869 | タバコ |
| PHILLIPS 66 | 490 | 460 | 3,650 | 381,727 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP | 98 | 105 | 813 | 85,101 | 電力 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 135 | 156 | 2,449 | 256,186 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A | 190 | 240 | 248 | 25,977 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 56 | 62 | 516 | 53,991 | レジャー用品 |
| PRAXAIR INC | 261 | 276 | 3,087 | 322,844 | 化学 |
| PRECISION CASTPARTS CORP | 124 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 232 | 240 | 1,724 | 180,337 | 資本市場 |
| PRICELINE GROUP INC/THE | 45 | 48 | 6,446 | 674,189 | ｲﾝﾀｰﾈｯﾄ販売・ｶﾀﾛｸﾞ販売 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 267 | 280 | 1,211 | 126,646 | 保険 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 2,462 | 2,616 | 21,820 | 2,281,941 | 家庭用品 |

| 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 | |
| PROGRESSIVE CO | 538 | 569 | 1,823 | 190,657 | 保険 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 411 | 432 | 3,184 | 333,056 | 保険 |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE | 458 | 493 | 2,182 | 228,247 | 総合公益事業 |
| PULTEGROUP INC | 295 | 295 | 563 | 58,925 | 家庭用耐久財 |
| QORVO INC | 133 | 134 | 754 | 78,939 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUALCOMM INC | 1,424 | 1,450 | 7,812 | 817,041 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUANTA SERVICES INC | 186 | — | — | — | 建設・土木 |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 133 | 141 | 1,097 | 114,825 | ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD | 81 | 88 | 561 | 58,743 | ﾗｲﾌｻｲｴﾝｽ・ﾂｰﾙ/ｻｰﾋﾞｽ |
| RALPH LAUREN CORPORATION | 54 | 58 | 563 | 58,939 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| RANGE RESOURCES CORP | 150 | 167 | 775 | 81,124 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 120 | 120 | 629 | 65,785 | 資本市場 |
| RAYTHEON COMPANY | 277 | 291 | 3,916 | 409,594 | 航空宇宙・防衛 |
| REALOGY HOLDINGS CORP | 130 | 140 | 416 | 43,572 | 不動産管理・開発 |
| RED HAT INC | 163 | 178 | 1,430 | 149,647 | ソフトウェア |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 69 | 74 | 2,571 | 268,905 | バイオテクノロジー |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 1,200 | 1,260 | 1,155 | 120,833 | 銀行 |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A | 218 | 229 | 1,137 | 118,953 | 商業サービス・用品 |
| RESMED INC | 132 | 132 | 815 | 85,284 | ヘルスケア機器・用品 |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 779 | 825 | 4,205 | 439,761 | タバコ |
| RITE AID CORP | 930 | 1,000 | 774 | 80,944 | 食品・生活必需品小売り |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 121 | 133 | 521 | 54,523 | 専門サービス |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 124 | 129 | 1,512 | 158,139 | 電気設備 |
| ROCKWELL COLLINS INC | 122 | 128 | 1,100 | 115,041 | 航空宇宙・防衛 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 91 | 96 | 1,634 | 170,955 | コングロマリット |
| ROSS STORES INC | 375 | 394 | 2,161 | 226,006 | 専門小売り |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 116 | 121 | 1,242 | 129,907 | 各種電気通信サービス |
| S&P GLOBAL INC | — | 258 | 2,782 | 290,943 | 各種金融サービス |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 129 | 129 | 633 | 66,239 | 資本市場 |
| SABRE CORP | 157 | 200 | 531 | 55,615 | 情報技術サービス |
| ST JUDE MEDICAL INC | 251 | 270 | 2,074 | 216,998 | ヘルスケア機器・用品 |
| SALESFORCE.COM INC | 563 | 610 | 4,979 | 520,748 | ソフトウェア |
| SAN DISK CORPORATION | 188 | — | — | — | コンピュータ・周辺機器 |
| SCANA CORP | 124 | 131 | 936 | 97,982 | 総合公益事業 |
| HENRY SCHEIN INC | 74 | 80 | 1,408 | 147,265 | ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| SCHLUMBERGER LTD | 1,147 | 1,345 | 10,563 | 1,104,717 | エネルギー設備・サービス |
| SCHWAB(CHARLES)CORP | 1,072 | 1,148 | 3,258 | 340,724 | 資本市場 |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A | 71 | 78 | 493 | 51,561 | メディア |
| SEALED AIR CORP | 187 | 192 | 904 | 94,573 | 容器・包装 |
| SEMPRA ENERGY | 214 | 230 | 2,540 | 265,645 | 総合公益事業 |
| SERVICENOW INC | 135 | 155 | 1,127 | 117,894 | ソフトウェア |
| SHERWIN-WILLIAMS | 72 | 76 | 2,185 | 228,507 | 化学 |
| SIGNATURE BANK | 45 | 48 | 625 | 65,428 | 銀行 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 2,220 | 1,990 | 792 | 82,829 | メディア |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 176 | 182 | 1,191 | 124,593 | 半導体・半導体製造装置 |
| SMITH (A.O.) CORP | — | 72 | 610 | 63,852 | 建設関連製品 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW | 103 | 116 | 1,693 | 177,116 | 食品 |
| SNAP-ON INC | 51 | 54 | 843 | 88,231 | 機械 |
| SOUTHERN CO. | 825 | 883 | 4,494 | 470,031 | 電力 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 153 | 153 | 619 | 64,834 | 旅客航空輸送業 |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO | 336 | 380 | 536 | 56,153 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SPECTRA ENERGY CORP | 615 | 653 | 2,261 | 236,559 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SPLUNK INC | 116 | 128 | 762 | 79,728 | ソフトウェア |
| SPRINT CORP | 710 | 710 | 295 | 30,888 | 無線通信サービス |

| 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 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 141 | 145 | 1,654 | 172,976 | 機械 |
| STAPLES INC | 569 | 620 | 549 | 57,447 | 専門小売り |
| STARBUCKS CORP | 1,345 | 1,430 | 7,980 | 834,635 | ホテル・レストラン・レジャー |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS | 154 | 162 | 1,213 | 126,861 | ホテル・レストラン・レジャー |
| STATE STREET CORP | 373 | 388 | 2,280 | 238,511 | 資本市場 |
| STERICYCLE INC | 76 | 81 | 821 | 85,904 | 商業サービス・用品 |
| STRYKER CORP | 307 | 325 | 3,784 | 395,830 | ヘルスケア機器・用品 |
| SUNTRUST BKS INC. | 466 | 490 | 2,041 | 213,534 | 銀行 |
| SYMANTEC CORP | 627 | 634 | 1,326 | 138,707 | ソフトウェア |
| SYNOPSYS INC | 138 | 149 | 791 | 82,727 | ソフトウェア |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 747 | 805 | 2,080 | 217,623 | 消費者金融 |
| SYSCO CORP | 539 | 520 | 2,603 | 272,288 | 食品・生活必需品小売り |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 240 | 254 | 755 | 79,052 | 資本市場 |
| TECO ENERGY INC | — | 224 | 618 | 64,655 | 総合公益事業 |
| TJX COS INC | 611 | 643 | 4,967 | 519,534 | 専門小売り |
| T-MOBILE US INC | 258 | 271 | 1,163 | 121,640 | 無線通信サービス |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A | 44 | — | — | — | ソフトウェア |
| TARGET CORP | 541 | 554 | 3,783 | 395,711 | 複合小売り |
| TEGNA INC | 187 | 206 | 461 | 48,278 | メディア |
| TERADATA CORP | 132 | — | — | — | 情報技術サービス |
| TESORO CORP | 113 | 113 | 870 | 91,065 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TESLA MOTORS INC | 88 | 95 | 2,095 | 219,103 | 自動車 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 930 | 973 | 6,036 | 631,296 | 半導体・半導体製造装置 |
| TEXTRON INC | 249 | 264 | 1,017 | 106,377 | 航空宇宙・防衛 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 360 | 383 | 5,712 | 597,380 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| 3M CORP | 566 | 585 | 10,031 | 1,049,146 | コングロマリット |
| TIFFANY & CO | 119 | 127 | 782 | 81,868 | 専門小売り |
| TIME WARNER INC | 739 | 765 | 5,493 | 574,506 | メディア |
| TIME WARNER CABLE-A | 255 | — | — | — | メディア |
| TOLL BROTHERS INC | 147 | 164 | 449 | 47,028 | 家庭用耐久財 |
| TORCHMARK CORP | 112 | 112 | 682 | 71,367 | 保険 |
| TOWERS WATSON & CO-CL A | 62 | — | — | — | 専門サービス |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 152 | 163 | 859 | 89,869 | 情報技術サービス |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 126 | 130 | 1,198 | 125,335 | 専門小売り |
| TRANSDIGM GROUP INC | 47 | 52 | 1,374 | 143,706 | 航空宇宙・防衛 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 282 | 286 | 3,223 | 337,144 | 保険 |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD | 232 | 232 | 623 | 65,217 | 電子装置・機器・部品 |
| TRIPADVISOR INC | 107 | 115 | 741 | 77,584 | インターネット販売・カタログ販売 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC | 1,107 | 1,085 | 3,124 | 326,791 | メディア |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B | 391 | 428 | 1,223 | 127,969 | メディア |
| TWITTER INC | 516 | 540 | 881 | 92,164 | インターネットソフトウェア・サービス |
| TYSON FOODS INC-CL A | 279 | 285 | 1,772 | 185,329 | 食品 |
| UGI CORP | — | 165 | 725 | 75,890 | ガス |
| US BANCORP | 1,596 | 1,681 | 6,954 | 727,280 | 銀行 |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR | 56 | 59 | 1,428 | 149,381 | 専門小売り |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 165 | 171 | 655 | 68,599 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | — | 172 | 601 | 62,889 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| UNION PAC CORP | 786 | 819 | 7,178 | 750,731 | 陸運・鉄道 |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC | 83 | 88 | 394 | 41,284 | 旅客航空輸送業 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 635 | 668 | 7,125 | 745,190 | 航空貨物・物流サービス |
| UNITED RENTALS INC | 86 | 86 | 593 | 62,021 | 商社・流通業 |
| UNITED TECHNOLOGIES | 767 | 769 | 7,810 | 816,846 | 航空宇宙・防衛 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | 40 | 43 | 441 | 46,204 | バイオテクノロジー |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 863 | 918 | 12,685 | 1,326,685 | 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 | |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B | 83 | 87 | 1,154 | 120,700 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNUM GROUP | 227 | 227 | 780 | 81,664 | 保険 |
| V F CORP | 305 | 331 | 2,145 | 224,346 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VALERO ENERGY CORP | 451 | 456 | 2,392 | 250,221 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VALSPAR CORP | — | 72 | 779 | 81,569 | 化学 |
| VANTIV INC - CL A | 142 | 151 | 806 | 84,358 | 情報技術サービス |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 88 | 95 | 781 | 81,706 | ヘルスケア機器・用品 |
| VERISIGN INC | 93 | 96 | 829 | 86,782 | インターネットソフトウェア・サービス |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 3,685 | 3,940 | 21,315 | 2,229,164 | 各種電気通信サービス |
| VERISK ANALYTICS INC | 145 | 152 | 1,218 | 127,423 | 専門サービス |
| VERTEX PHARMACEUTICALS | 221 | 240 | 2,046 | 214,045 | バイオテクノロジー |
| VIACOM INC-CLASS B | 315 | 341 | 1,484 | 155,235 | メディア |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 1,769 | 1,857 | 14,360 | 1,501,787 | 情報技術サービス |
| VMWARE INC - CLASS A | 74 | 74 | 451 | 47,191 | ソフトウェア |
| VOYA FINANCIAL INC | 211 | 203 | 583 | 60,993 | 各種金融サービス |
| VULCAN MATERIALS CO | 122 | 128 | 1,487 | 155,534 | 建設資材 |
| WABCO HOLDINGS INC | 52 | 52 | 547 | 57,236 | 機械 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 292 | 302 | 1,899 | 198,658 | 総合公益事業 |
| WABTEC CORP | 86 | 90 | 655 | 68,567 | 機械 |
| WAL-MART STORES INC | 1,459 | 1,545 | 11,040 | 1,154,622 | 食品・生活必需品小売り |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 794 | 886 | 7,371 | 770,913 | 食品・生活必需品小売り |
| WASTE CONNECTIONS INC | — | 167 | 1,176 | 123,074 | 商業サービス・用品 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 410 | 428 | 2,684 | 280,780 | 商業サービス・用品 |
| WATERS CORP | 73 | 80 | 1,088 | 113,866 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| WELLS FARGO CO | 4,420 | 4,665 | 22,032 | 2,304,189 | 銀行 |
| WESTAR ENERGY INC | — | 136 | 758 | 79,335 | 電力 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 209 | 266 | 1,301 | 136,101 | コンピュータ・周辺機器 |
| WESTERN UNION CO | 463 | 491 | 929 | 97,254 | 情報技術サービス |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 41 | — | — | — | 化学 |
| WESTROCK CO | 243 | 243 | 993 | 103,938 | 容器・包装 |
| WHIRLPOOL CORP | 70 | 75 | 1,328 | 138,971 | 家庭用耐久財 |
| WHITEWAVE FOODS CO - CL A | 162 | 175 | 824 | 86,200 | 食品 |
| WHITING PETROLEUM CORP | 178 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WHOLE FOODS MARKET INC | 323 | 316 | 959 | 100,364 | 食品・生活必需品小売り |
| WILLIAMS COS | 640 | 695 | 1,506 | 157,504 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 101 | 107 | 849 | 88,860 | ソフトウェア |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP | 109 | 109 | 768 | 80,364 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WYNN RESORTS LTD | 77 | 77 | 783 | 81,984 | ホテル・レストラン・レジャー |
| XCEL ENERGY INC | 460 | 483 | 2,069 | 216,394 | 電力 |
| XILINX INC | 230 | 250 | 1,167 | 122,044 | 半導体・半導体製造装置 |
| XEROX CORP | 920 | 840 | 825 | 86,353 | 情報技術サービス |
| XYLEM INC | 170 | 170 | 781 | 81,763 | 機械 |
| YAHOO! INC | 808 | 869 | 3,250 | 339,891 | インターネットソフトウェア・サービス |
| YUM BRANDS INC | 392 | 396 | 3,337 | 349,075 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ZILLOW GROUP INC - C | 86 | 109 | 377 | 39,509 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 157 | 184 | 2,182 | 228,199 | ヘルスケア機器・用品 |
| ZOETIS INC | 432 | 460 | 2,175 | 227,497 | 医薬品 |
| ALKERMES PLC | 138 | 138 | 577 | 60,398 | バイオテクノロジー |
| ALLERGAN PLC | 357 | 381 | 8,838 | 924,305 | 医薬品 |
| AON PLC | 256 | 263 | 2,835 | 296,498 | 保険 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 114 | 121 | 845 | 88,389 | 保険 |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 90 | 95 | 507 | 53,083 | 保険 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | 125 | 173 | 485 | 50,785 | 化学 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 567 | 607 | 7,249 | 758,142 | 情報技術サービス |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| BUNGE LIMITED | 130 | 138 | 849 | 88,843 | 食品 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | — | 207 | 777 | 81,266 | 飲料 |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC | 258 | 269 | 1,860 | 194,589 | 自動車部品 |
| EATON CORP PLC | 426 | 445 | 2,752 | 287,838 | 電気設備 |
| ENDO INTERNATIONAL PLC | 196 | 205 | 315 | 33,015 | 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 | 704 | 73,714 | 保険 |
| INGERSOLL-RAND PLC | 241 | 251 | 1,641 | 171,672 | 機械 |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC | 684 | 850 | 526 | 55,024 | エネルギー設備・サービス |
| INVESCO LTD | 394 | 405 | 1,160 | 121,346 | 資本市場 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 54 | 58 | 823 | 86,083 | 医薬品 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 224 | 275 | 875 | 91,599 | メディア |
| LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C | 554 | 600 | 1,875 | 196,087 | メディア |
| LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - A | — | 34 | 119 | 12,490 | メディア |
| LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C | — | 74 | 265 | 27,714 | メディア |
| MALLINCKRODT PLC | 104 | 111 | 627 | 65,622 | 医薬品 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 353 | 410 | 413 | 43,263 | 半導体・半導体製造装置 |
| MEDTRONIC PLC | 1,284 | 1,362 | 11,521 | 1,204,882 | ヘルスケア機器・用品 |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD | 176 | 179 | 906 | 94,834 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NIELSEN HOLDINGS PLC | 313 | 350 | 1,873 | 195,935 | 専門サービス |
| NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN | 150 | 150 | 666 | 69,744 | ホテル・レストラン・レジャー |
| PARTNERRE LTD | 44 | — | — | — | 保険 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 40 | 42 | 479 | 50,169 | 保険 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 274 | 290 | 691 | 72,363 | コンピュータ・周辺機器 |
| PENTAIR PLC | 164 | 167 | 1,026 | 107,391 | 機械 |
| SIGNET JEWELERS LTD | 67 | 71 | 605 | 63,284 | 専門小売り |
| TYCO INTERNATIONAL PLC | 376 | 403 | 1,740 | 181,985 | 商業サービス・用品 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | — | 127 | 1,617 | 169,115 | 保険 |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC | 151 | — | — | — | 保険 |
| PERRIGO CO PLC | 133 | 139 | 1,345 | 140,710 | 医薬品 |
| XL GROUP PLC | 274 | 288 | 938 | 98,127 | 保険 |
| ACE LTD | 293 | — | — | — | 保険 |
| CHUBB LTD | — | 446 | 5,596 | 585,272 | 保険 |
| GARMIN LTD | 102 | 114 | 484 | 50,680 | 家庭用耐久財 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 365 | 358 | 2,211 | 231,264 | 電子装置・機器・部品 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. | 60 | 127 | 1,035 | 108,272 | ソフトウェア |
| TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD | 5 | 15 | 215 | 22,520 | 医薬品 |
| AERCAP HOLDINGS NV | 76 | 165 | 632 | 66,158 | 商社・流通業 |
| CORE LABORATORIES N.V. | 38 | 43 | 530 | 55,514 | エネルギー設備・サービス |
| MOBILEYE NV | 71 | 170 | 694 | 72,643 | ソフトウェア |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 359 | 356 | 2,809 | 293,785 | 化学 |
| MYLAN NV | 381 | 404 | 1,813 | 189,619 | 医薬品 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 125 | 284 | 2,445 | 255,704 | 半導体・半導体製造装置 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 154 | 169 | 617 | 64,545 | 電気設備 |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 162 | 169 | 1,292 | 135,135 | ホテル・レストラン・レジャー |
| AVAGO TECHNOLOGIES LTD | 236 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| BROADCOM LTD | — | 377 | 5,881 | 615,121 | 半導体・半導体製造装置 |
| FLEXTRONICS INTL LTD | 510 | 550 | 714 | 74,717 | 電子装置・機器・部品 |
| 小計 株数・金額 | 287,449 | 303,099 | 1,789,889 | 187,186,603 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 606 | 596 | — | <61.4%> | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | |
| ARC RESOURCES LTD | 300 | 335 | 720 | 58,779 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 188 | 206 | 1,308 | 106,804 | 金属・鉱業 |
| AGRIUM INC | 126 | 126 | 1,521 | 124,134 | 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 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダドル | 千円 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B | 377 | 401 | 2,100 | 171,384 | 食品・生活必需品小売り |
| ALTAGAS LTD | 141 | 141 | 439 | 35,867 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ATCO LTD CL1 | 68 | 68 | 302 | 24,695 | 総合公益事業 |
| BCE INC | 130 | 141 | 842 | 68,742 | 各種電気通信サービス |
| BANK OF MONTREAL | 587 | 618 | 5,107 | 416,845 | 銀行 |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX | 1,099 | 1,162 | 7,570 | 617,822 | 銀行 |
| BARRICK GOLD | 1,090 | 1,130 | 2,773 | 226,306 | 金属・鉱業 |
| BLACKBERRY LTD | 439 | 509 | 459 | 37,510 | コンピュータ・周辺機器 |
| BOMBARDIER B SHEARS | 1,670 | 1,890 | 372 | 30,385 | 航空宇宙・防衛 |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 778 | 861 | 3,800 | 310,155 | 不動産管理・開発 |
| CAE INC | 260 | 260 | 419 | 34,225 | 航空宇宙・防衛 |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 23 | 26 | 602 | 49,177 | 容器・包装 |
| CI FINANCIAL CORP | 226 | 242 | 653 | 53,323 | 資本市場 |
| CAMECO CORP | 346 | 386 | 552 | 45,110 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 360 | 383 | 3,953 | 322,630 | 銀行 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 726 | 769 | 5,752 | 469,430 | 陸運・鉄道 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 989 | 1,063 | 4,129 | 337,029 | 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 | 137 | 140 | 2,230 | 182,006 | 陸運・鉄道 |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A | 64 | 70 | 972 | 79,372 | 複合小売り |
| CANADIAN UTILITIES LTD A | 106 | 124 | 454 | 37,108 | 総合公益事業 |
| CENOVUS ENERGY INC | 753 | 790 | 1,482 | 121,013 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 17 | 17 | 908 | 74,108 | ソフトウェア |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 448 | 488 | 1,002 | 81,801 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DOLLARAMA INC | 115 | 115 | 1,040 | 84,888 | 複合小売り |
| ELDORADO GOLD CORPORATION | 628 | 708 | 371 | 30,334 | 金属・鉱業 |
| ELEMENT FINANCIAL CORP | 330 | 360 | 514 | 41,954 | 各種金融サービス |
| EMPIRE CO LTD A | 162 | 162 | 341 | 27,856 | 食品・生活必需品小売り |
| ENCANA CORP | 790 | 790 | 850 | 69,436 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ENBRIDGE INC | 777 | 883 | 4,787 | 390,718 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 19 | 21 | 1,416 | 115,638 | 保険 |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 149 | 149 | 336 | 27,457 | 商社・流通業 |
| FIRST CAPITAL REALTY INC | 113 | 113 | 245 | 20,066 | 不動産管理・開発 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 594 | 704 | 644 | 52,569 | 金属・鉱業 |
| FORTIS INC | 255 | 273 | 1,150 | 93,908 | 電力 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 147 | 173 | 1,522 | 124,271 | 金属・鉱業 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 212 | 231 | 852 | 69,582 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| GOLDCORP INC | 754 | 800 | 1,793 | 146,375 | 金属・鉱業 |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 280 | 280 | 988 | 80,709 | 保険 |
| CGI GROUP INC - CLASS A | 202 | 214 | 1,253 | 102,307 | 情報技術サービス |
| HUSKY ENERGY INC | 301 | 357 | 552 | 45,099 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HYDRO ONE LTD | — | 173 | 423 | 34,562 | 電力 |
| IGM FINANCIAL INC | 85 | 103 | 375 | 30,647 | 資本市場 |
| IMPERIAL OIL | 267 | 283 | 1,140 | 93,075 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 99 | 99 | 419 | 34,248 | 保険 |
| INTACT FINANCIAL CORP | 119 | 127 | 1,133 | 92,482 | 保険 |
| INTER PIPELINE LTD | 304 | 331 | 899 | 73,448 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A | 62 | 94 | 180 | 14,744 | 食品・生活必需品小売り |
| KEYERA CORP | 161 | 178 | 671 | 54,765 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KINROSS GOLD CORP | 1,046 | 1,186 | 724 | 59,138 | 金属・鉱業 |
| LINAMAR CORP | 40 | 48 | 243 | 19,841 | 自動車部品 |
| LOBLAW COMPANIES | 204 | 214 | 1,478 | 120,662 | 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 | 373 | 388 | 1,940 | 158,323 | 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 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダドル | 千円 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 1,796 | 1,918 | 3,529 | 288,011 | 保険 |
| METHANEX CORP | 82 | 82 | 323 | 26,440 | 化学 |
| METRO INC | 232 | 232 | 1,014 | 82,758 | 食品・生活必需品小売り |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 296 | 334 | 1,477 | 120,615 | 銀行 |
| ONEX CORP | 80 | 80 | 640 | 52,308 | 各種金融サービス |
| OPEN TEXT CORP | 111 | 121 | 949 | 77,517 | ソフトウェア |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 299 | 362 | 1,422 | 116,103 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 129 | 151 | 521 | 42,576 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC | 758 | 818 | 1,750 | 142,859 | 化学 |
| POWER CORPORATION OF CANADA | 328 | 350 | 1,009 | 82,405 | 保険 |
| POWER FINANCIAL CORP | 223 | 243 | 759 | 62,012 | 保険 |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 126 | 207 | 506 | 41,339 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 184 | 214 | 1,179 | 96,282 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B | 334 | 348 | 1,784 | 145,636 | 無線通信サービス |
| ROYAL BANK OF CANADA | 1,349 | 1,439 | 11,313 | 923,288 | 銀行 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 145 | 145 | 755 | 61,640 | 建設・土木 |
| SAPUTO INC | 239 | 239 | 896 | 73,142 | 食品 |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | 130 | 188 | 489 | 39,983 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 375 | 404 | 998 | 81,469 | メディア |
| SILVER WHEATON CORP | 352 | 420 | 1,120 | 91,414 | 金属・鉱業 |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 552 | 588 | 2,577 | 210,373 | 保険 |
| SUNCOR ENERGY INC | 1,305 | 1,524 | 5,290 | 431,746 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TECK RESOURCES LTD | 492 | 582 | 917 | 74,855 | 金属・鉱業 |
| TELUS CORP | 193 | 193 | 799 | 65,286 | 各種電気通信サービス |
| THOMSON REUTERS CORP | 316 | 330 | 1,752 | 143,032 | メディア |
| TORONTO DOMINION BANK | 1,684 | 1,789 | 10,081 | 822,711 | 銀行 |
| TOURMALINE OIL CORP | 173 | 194 | 616 | 50,299 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TRANSCANADA CORP | 640 | 688 | 3,936 | 321,220 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 870 | 980 | 434 | 35,430 | 金属・鉱業 |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL | 293 | 313 | 867 | 70,756 | 医薬品 |
| VERESEN INC | 248 | 290 | 318 | 25,986 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VERMILION ENERGY INC | 105 | 105 | 451 | 36,846 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WEST FRASER TIMBER | 68 | 68 | 267 | 21,815 | 紙製品・林産品 |
| WESTON(GEORGE)LTD | 48 | 48 | 534 | 43,599 | 食品・生活必需品小売り |
| YAMANA GOLD INC | 790 | 970 | 583 | 47,655 | 金属・鉱業 |
| BROOKFIELD BUSINESS PART | — | 17 | 46 | 3,807 | 建設・土木 |
| 小計 株数・金額 | 35,939 | 38,880 | 140,645 | 11,478,114 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 91 | 91 | — | <3.8%> | |
| (イギリス) | | | 千英ポンド | | |
| ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC | 830 | 940 | 274 | 42,105 | 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 | 177 | 27,233 | 金属・鉱業 |
| ASHTEAD GROUP PLC | 468 | 468 | 485 | 74,447 | 商社・流通業 |
| BHP BILLITON PLC | 1,923 | 2,043 | 1,731 | 265,665 | 金属・鉱業 |
| ARM HOLDINGS PLC | 1,267 | 1,365 | 1,382 | 212,113 | 半導体・半導体製造装置 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | 910 | 980 | 550 | 84,486 | 家庭用耐久財 |
| SKY PLC | 924 | 998 | 873 | 134,033 | メディア |
| AVIVA PLC | 3,640 | 3,890 | 1,687 | 258,800 | 保険 |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 127 | — | — | — | 化学 |
| DIAGEO PLC | 2,277 | 2,427 | 4,424 | 678,706 | 飲料 |
| SCHRODERS PLC | 118 | 133 | 345 | 53,004 | 資本市場 |
| DCC PLC | — | 86 | 554 | 85,025 | コングロマリット |
| BAE SYSTEMS PLC | 2,890 | 3,060 | 1,517 | 232,824 | 航空宇宙・防衛 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 1,690 | 1,804 | 7,662 | 1,175,425 | タバコ |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千英ポンド | 千円 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 2,944 | 3,164 | 1,755 | 269,348 | 銀行 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 870 | 926 | 3,395 | 520,820 | タバコ |
| SABMILLER PLC | 882 | 938 | 4,020 | 616,781 | 飲料 |
| HSBC HOLDINGS PLC | 17,760 | 19,050 | 8,378 | 1,285,214 | 銀行 |
| LEGAL & GENERAL | 5,430 | 5,760 | 1,323 | 203,047 | 保険 |
| MEGGITT PLC | 706 | 780 | 305 | 46,831 | 航空宇宙・防衛 |
| MORRISON SUPERMARKETS | 1,920 | 2,130 | 398 | 61,198 | 食品・生活必需品小売り |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 320 | 344 | 997 | 153,084 | 食品 |
| PEARSON | 750 | 790 | 682 | 104,765 | メディア |
| PERSIMMON PLC | 277 | 295 | 603 | 92,587 | 家庭用耐久財 |
| PRUDENTIAL PLC | 2,326 | 2,493 | 3,264 | 500,787 | 保険 |
| RIO TINTO PLC-REG | 1,132 | 1,201 | 2,439 | 374,270 | 金属・鉱業 |
| ST JAMES S PLACE PLC | 461 | 499 | 442 | 67,935 | 保険 |
| TRAVIS PERKINS PLC | 226 | 247 | 461 | 70,816 | 商社・流通業 |
| SSE PLC | 902 | 969 | 1,499 | 229,953 | 電力 |
| BP PLC | 16,550 | 17,890 | 6,839 | 1,049,155 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 51,700 | 62,100 | 4,367 | 669,973 | 銀行 |
| TATE & LYLE ORD. | 425 | 425 | 265 | 40,746 | 食品 |
| BG GROUP PLC | 3,105 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TAYLOR WIMPEY PLC | 3,000 | 3,190 | 592 | 90,822 | 家庭用耐久財 |
| TESCO PLC | 7,440 | 7,870 | 1,291 | 198,171 | 食品・生活必需品小売り |
| SMITH & NEPHEW PLC | 798 | 858 | 987 | 151,491 | ヘルスケア機器・用品 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 4,404 | 4,712 | 6,674 | 1,023,875 | 医薬品 |
| WEIR GROUP PLC | 182 | 220 | 296 | 45,526 | 機械 |
| BABCOCK INTL GROUP PLC | 219 | 259 | 259 | 39,810 | 商業サービス・用品 |
| ASTRAZENECA PLC | 1,143 | 1,219 | 4,720 | 724,136 | 医薬品 |
| GKN PLC | 1,560 | 1,690 | 480 | 73,703 | 自動車部品 |
| BT GROUP PLC | 7,570 | 8,170 | 3,482 | 534,209 | 各種電気通信サービス |
| CARNIVAL PLC | 167 | 187 | 647 | 99,281 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARKS & SPENCER PLC | 1,470 | 1,550 | 564 | 86,548 | 複合小売り |
| BARCLAYS PLC | 15,160 | 16,300 | 2,939 | 450,950 | 銀行 |
| INTERTEK GROUP PLC | 151 | 151 | 475 | 72,964 | 専門サービス |
| WILLIAM HILL PLC | 760 | 850 | 244 | 37,565 | ホテル・レストラン・レジャー |
| BURBERRY GROUP PLC | 392 | 423 | 475 | 72,934 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NEXT PLC | 130 | 140 | 765 | 117,366 | 複合小売り |
| KINGFISHER PLC | 2,060 | 2,170 | 793 | 121,666 | 専門小売り |
| ICAP PLC | 540 | 540 | 232 | 35,627 | 資本市場 |
| ITV PLC | 3,500 | 3,530 | 744 | 114,202 | メディア |
| SAINSBURY | 1,238 | 1,338 | 328 | 50,388 | 食品・生活必需品小売り |
| RANDGOLD RESOURCES LTD | 82 | 90 | 581 | 89,255 | 金属・鉱業 |
| G4S PLC | 1,368 | 1,520 | 267 | 41,107 | 商業サービス・用品 |
| ADMIRAL GROUP PLC | 198 | 198 | 390 | 59,835 | 保険 |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS | — | 124 | 397 | 60,907 | 家庭用耐久財 |
| CENTRICA PLC | 4,530 | 5,240 | 1,119 | 171,775 | 総合公益事業 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 3,549 | 4,071 | 7,362 | 1,129,392 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B | 2,208 | 3,625 | 6,651 | 1,020,397 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BUNZLE | 314 | 331 | 667 | 102,464 | 商社・流通業 |
| COBHAM PLC | 990 | 1,695 | 248 | 38,091 | 航空宇宙・防衛 |
| NATIONAL GRID PLC | 3,401 | 3,626 | 3,559 | 546,049 | 総合公益事業 |
| INMARSAT PLC | 425 | 425 | 313 | 48,048 | 各種電気通信サービス |
| PETROFAC LTD | 227 | 260 | 195 | 30,012 | エネルギー設備・サービス |
| HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | — | 139 | 306 | 47,016 | 医薬品 |
| LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC | 287 | 302 | 790 | 121,329 | 各種金融サービス |
| UNILEVER PLC | 1,167 | 1,244 | 3,924 | 602,067 | 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 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千英ポンド | 千円 | |
| TUI AG-DI | 466 | 466 | 473 | 72,637 | ホテル・レストラン・レジャー |
| INVESTEC PLC | 470 | 610 | 288 | 44,213 | 資本市場 |
| EXPERIAN PLC | 890 | 946 | 1,224 | 187,780 | 専門サービス |
| MONDI PLC | 342 | 342 | 456 | 69,985 | 紙製品・林産品 |
| SEVERN TRENT PLC | 221 | 221 | 494 | 75,803 | 水道 |
| WHITBREAD PLC | 166 | 175 | 718 | 110,279 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SPORTS DIRECT INTERNATIONAL | 253 | — | — | — | 専門小売り |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 250 | 250 | 331 | 50,890 | 資本市場 |
| SMITHS GROUP PLC | 375 | 375 | 424 | 65,175 | コングロマリット |
| ANGLO AMERICAN PLC | 1,290 | 1,370 | 901 | 138,347 | 金属・鉱業 |
| 3I GROUP PLC | 900 | 970 | 530 | 81,318 | 資本市場 |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC | 131 | 143 | 395 | 60,653 | 消費者金融 |
| CAPITA PLC | 609 | 640 | 682 | 104,753 | 専門サービス |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 578 | 617 | 4,208 | 645,592 | 家庭用品 |
| RELX PLC | 1,007 | 1,066 | 1,312 | 201,298 | メディア |
| SHIRE PLC | 538 | 866 | 3,443 | 528,250 | 医薬品 |
| FRESNILLO PLC | 209 | 209 | 254 | 39,049 | 金属・鉱業 |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 638 | 670 | 639 | 98,101 | 水道 |
| GLENCORE PLC | 11,250 | 11,880 | 1,735 | 266,251 | 金属・鉱業 |
| DIXONS CARPHONE PLC | 850 | 920 | 385 | 59,076 | 専門小売り |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 1,650 | 1,770 | 1,116 | 171,327 | 航空宇宙・防衛 |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 189 | — | — | — | 化学 |
| OLD MUTUAL PLC | 4,450 | 4,680 | 878 | 134,823 | 保険 |
| EASYJET PLC | 142 | 163 | 247 | 38,006 | 旅客航空輸送業 |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 3,120 | 3,410 | 824 | 126,484 | 銀行 |
| SAGE GROUP PLC (THE) | 950 | 1,050 | 647 | 99,299 | ソフトウェア |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | — | 375 | 346 | 53,095 | ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| WPP PLC | 1,168 | 1,243 | 1,937 | 297,264 | メディア |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | 174 | 198 | 281 | 43,221 | 飲料 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS C-ENTITLEMENT | — | 125,670 | 12 | 1,927 | 航空宇宙・防衛 |
| ROYAL MAIL PLC | 800 | 880 | 466 | 71,613 | 航空貨物・物流サービス |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI | 690 | 690 | 292 | 44,942 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WOLSELEY PLC | 232 | 242 | 914 | 140,324 | 商社・流通業 |
| IMI PLC | 259 | 259 | 251 | 38,518 | 機械 |
| VODAFONE GROUP PLC | 24,150 | 25,610 | 5,494 | 842,875 | 無線通信サービス |
| AGGREKO PLC | 230 | 262 | 306 | 46,961 | 商業サービス・用品 |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 907 | 987 | 468 | 71,833 | 保険 |
| COMPASS GROUP PLC | 1,493 | 1,585 | 2,070 | 317,539 | ホテル・レストラン・レジャー |
| REXAM PLC | 655 | 655 | 410 | 62,951 | 容器・包装 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 214 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー |
| STANDARD LIFE PLC | 1,760 | 1,860 | 616 | 94,556 | 保険 |
| AUTO TRADER GROUP PLC | 660 | 950 | 394 | 60,448 | ｲﾝﾀｰﾈｯﾄｿﾌﾄｳｪｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 1,280 | 1,360 | 495 | 75,943 | 保険 |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 864 | — | — | — | 機械 |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS C-ENTITLEMENT | 157,590 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | — | 181 | 481 | 73,915 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WORLDPAY GROUP PLC | — | 1,350 | 388 | 59,538 | 情報技術サービス |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | — | 122 | 354 | 54,417 | 化学 |
| JOHNSON MATTHEY PLC | — | 191 | 561 | 86,130 | 化学 |
| 小計 株数・金額 | 422,124 | 415,346 | 156,046 | 23,937,606 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 109 | 110 | — | <7.8%> | |
| (スイス) | | | 千スイスフラン | | |
| SYNGENTA AG-REG | 83 | 90 | 3,451 | 375,074 | 化学 |
| SIKA AG-BR | 1 | 2 | 854 | 92,824 | 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 | |
| (スイス) | 百株 | 百株 | 千スイスフラン | 千円 | |
| SGS SA-REG | 4 | 5 | 1,117 | 121,398 | 専門サービス |
| SULZER AG-REG | 13 | — | — | — | 機械 |
| BARRY CALLEBAUT AG | 1 | 1 | 221 | 24,095 | 食品 |
| SWISSCOM AG-REG | 23 | 24 | 1,119 | 121,634 | 各種電気通信サービス |
| LINDT & SPRUENGLI AG-PC | 0.87 | 0.95 | 546 | 59,412 | 食品 |
| LINDT&SPRUENGLI AG-REG | 0.09 | 0.1 | 690 | 74,982 | 食品 |
| GIVAUDAN-REG | 8 | 8 | 1,680 | 182,643 | 化学 |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 135 | 145 | 3,393 | 368,755 | 保険 |
| NOVARTIS-REG | 2,065 | 2,199 | 16,789 | 1,824,500 | 医薬品 |
| ABB LTD | 1,996 | 1,914 | 3,902 | 424,100 | 電気設備 |
| ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE) | 637 | 678 | 16,698 | 1,814,623 | 医薬品 |
| ADECCO GROUP AG-REG | 148 | 163 | 942 | 102,470 | 専門サービス |
| LAFARGEHOLCIM LTD | 381 | 443 | 1,871 | 203,346 | 建設資材 |
| NESTLE SA-REG | 2,888 | 3,080 | 22,129 | 2,404,845 | 食品 |
| BALOISE HOLDING AG | 46 | 50 | 564 | 61,289 | 保険 |
| SONOVA HOLDING AG-REG | 50 | 50 | 617 | 67,069 | ヘルスケア機器・用品 |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 1,628 | 1,802 | 2,259 | 245,562 | 資本市場 |
| THE SWATCH GROUP AG-B | 28 | 29 | 864 | 93,896 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| THE SWATCH GROUP AG-REG | 46 | 46 | 262 | 28,543 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| LONZA AG-REG | 47 | 50 | 807 | 87,720 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| SWISS LIFE HOLDING AG | 29 | 31 | 751 | 81,692 | 保険 |
| GALENICA AG-REG | 3 | 3 | 475 | 51,627 | 医薬品 |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 7 | 8 | 403 | 43,880 | 化学 |
| SWISS PRIME SITE-REG | 58 | 68 | 589 | 64,104 | 不動産管理・開発 |
| PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES | 24 | 32 | 206 | 22,429 | 各種金融サービス |
| DUFRY AG-REG | 35 | 45 | 566 | 61,566 | 専門小売り |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 15 | 16 | 723 | 78,649 | 資本市場 |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 39 | 43 | 758 | 82,432 | 機械 |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | 19 | 19 | 339 | 36,850 | 機械 |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 49 | 52 | 718 | 78,046 | 海運業 |
| GEBERIT AG-REG | 35 | 36 | 1,361 | 147,961 | 建設関連製品 |
| ACTELION LTD | 93 | 97 | 1,516 | 164,776 | バイオテクノロジー |
| ARYZTA AG | 85 | 85 | 324 | 35,275 | 食品 |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 207 | 220 | 948 | 103,112 | 資本市場 |
| SWISS RE LTD | 321 | 325 | 2,710 | 294,550 | 保険 |
| TRANSOCEAN LTD | 315 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A | 471 | 506 | 2,992 | 325,248 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| UBS GROUP AG | 3,325 | 3,540 | 5,242 | 569,728 | 資本市場 |
| 小計 株数・金額 | 15,370 | 15,916 | 101,414 | 11,020,725 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 40 | 38 | — | <3.6%> | |
| (スウェーデン) | | | 千スウェーデンクローナ | | |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB | 1,370 | 1,460 | 11,256 | 142,058 | 銀行 |
| SWEDBANK AB | 817 | 865 | 15,500 | 195,620 | 銀行 |
| SWEDISH MATCH AB | 174 | 189 | 5,269 | 66,498 | タバコ |
| NORDEA BANK AB | 2,770 | 2,930 | 22,883 | 288,787 | 銀行 |
| SECURITAS AB-B SHS | 294 | 294 | 3,672 | 46,341 | 商業サービス・用品 |
| INVESTOR AB-B SHS | 415 | 444 | 12,449 | 157,115 | 各種金融サービス |
| HENNES&MAURITZ AB-B | 861 | 923 | 23,130 | 291,905 | 専門小売り |
| ERICSSON LM-B | 2,760 | 2,920 | 19,155 | 241,738 | 通信機器 |
| TELIA CO AB | 2,320 | 2,510 | 9,292 | 117,265 | 各種電気通信サービス |
| SKANSKA AB-B SHS | 355 | 342 | 6,043 | 76,264 | 建設・土木 |
| LUNDIN PETROLEUM AB | 201 | 201 | 3,061 | 38,632 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ALFA LAVAL AB | 277 | 277 | 3,637 | 45,899 | 機械 |
| GETINGE AB-B SHS | 172 | 191 | 3,252 | 41,049 | 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 | |
| (スウェーデン) | | 百株 | 百株 | 千スウェーデンクローナ | 千円 | |
| KINNEVIK INVESTMENT AB-B | | 219 | — | — | — | 各種金融サービス |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR | | 61 | 61 | 2,964 | 37,413 | 無線通信サービス |
| ICA GRUPPEN AB | | 66 | 78 | 2,135 | 26,951 | 食品・生活必需品小売り |
| HUSQVARNA AB-B SHS | | 380 | 380 | 2,473 | 31,219 | 家庭用耐久財 |
| ELECTROLUX AB-B | | 210 | 233 | 5,342 | 67,424 | 家庭用耐久財 |
| SKF AB-B SHARES | | 360 | 388 | 5,754 | 72,615 | 機械 |
| VOLVO AB-B SHS | | 1,410 | 1,500 | 13,605 | 171,695 | 機械 |
| SANDVIK AB | | 977 | 1,030 | 8,832 | 111,462 | 機械 |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | | 140 | 168 | 2,264 | 28,579 | 各種金融サービス |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B | | 526 | 584 | 15,242 | 192,359 | 家庭用品 |
| BOLIDEN AB | | 260 | 260 | 4,011 | 50,628 | 金属・鉱業 |
| HEXAGON AB-B SHS | | 230 | 244 | 7,751 | 97,828 | 電子装置・機器・部品 |
| TELE 2 AB-B SHS | | 284 | 284 | 1,988 | 25,088 | 無線通信サービス |
| KINNEVIK AB - B | | — | 236 | 4,701 | 59,328 | 各種金融サービス |
| ATLAS COPCO AB-A | | 606 | 648 | 14,171 | 178,847 | 機械 |
| ATLAS COPCO AB-B | | 362 | 382 | 7,620 | 96,175 | 機械 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A | | 1,341 | 1,450 | 15,167 | 191,407 | 銀行 |
| ASSA ABLOY AB-B | | 912 | 970 | 16,383 | 206,757 | 建設関連製品 |
| 小計 | 株数・金額 | 21,130 | 22,442 | 269,014 | 3,394,961 | |
| | 銘柄数<比率> | 30 | 30 | — | <1.1%> | |
| (ノルウェー) | | | | 千ノルウェークローネ | | |
| DNB ASA | | 883 | 956 | 10,028 | 126,057 | 銀行 |
| TELENOR ASA | | 673 | 719 | 9,462 | 118,937 | 各種電気通信サービス |
| SCHIBSTED ASA | | 64 | 78 | 1,953 | 24,550 | メディア |
| STATOIL ASA | | 1,018 | 1,079 | 14,739 | 185,270 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| YARA INTERNATIONAL ASA | | 168 | 168 | 4,620 | 58,073 | 化学 |
| MARINE HARVEST ASA | | — | 365 | 5,292 | 66,526 | 食品 |
| NORSK HYDRO | | 1,300 | 1,300 | 4,121 | 51,800 | 金属・鉱業 |
| ORKLA ASA | | 748 | 800 | 5,808 | 73,006 | 食品 |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | | 172 | 197 | 2,750 | 34,569 | 保険 |
| SCHIBSTED ASA-B SHS | | 76 | 91 | 2,168 | 27,258 | メディア |
| 小計 | 株数・金額 | 5,102 | 5,753 | 60,942 | 766,052 | |
| | 銘柄数<比率> | 9 | 10 | — | <0.3%> | |
| (デンマーク) | | | | 千デンマーククローネ | | |
| CARLSBERG B | | 100 | 105 | 6,468 | 102,194 | 飲料 |
| A P MOLLER-MAERSK A/S | | 6 | 6 | 5,034 | 79,543 | 海運業 |
| A P MOLLER - MAERSK A/S-A | | 3 | 3 | 2,941 | 46,481 | 海運業 |
| DANSKE BANK AS | | 646 | 686 | 12,533 | 198,024 | 銀行 |
| GENMAB A/S | | — | 54 | 6,219 | 98,266 | バイオテクノロジー |
| TDC A/S | | 768 | 768 | 2,449 | 38,708 | 各種電気通信サービス |
| WILLIAM DEMANT HOLDING | | 21 | — | — | — | ヘルスケア機器・用品 |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | | 199 | 216 | 9,642 | 152,347 | 電気設備 |
| DSV A/S | | 171 | 182 | 5,088 | 80,401 | 陸運・鉄道 |
| PANDORA A/S | | 100 | 112 | 10,662 | 168,473 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CHR HANSEN HOLDING A/S | | 87 | 93 | 3,913 | 61,832 | 化学 |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES | | 212 | 225 | 6,835 | 108,000 | 化学 |
| COLOPLAST-B | | 99 | 117 | 5,701 | 90,082 | ヘルスケア機器・用品 |
| NOVO NORDISK A/S-B | | 1,776 | 1,795 | 61,819 | 976,752 | 医薬品 |
| ISS A/S | | 141 | 161 | 4,105 | 64,866 | 商業サービス・用品 |
| TRYG A/S | | 118 | 118 | 1,424 | 22,503 | 保険 |
| WILLIAM DEMANT HOLDING | | — | 130 | 1,700 | 26,866 | ヘルスケア機器・用品 |
| 小計 | 株数・金額 | 4,447 | 4,772 | 146,540 | 2,315,347 | |
| | 銘柄数<比率> | 15 | 16 | — | <0.8%> | |

| 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 | |
| ADIDAS AG | 187 | 184 | 2,263 | 265,948 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 347 | 398 | 2,571 | 302,221 | 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 | 116 | 448 | 52,725 | インターネットソフトウェア・サービス |
| FUCHS PETROLUB SE -PFD | 64 | 64 | 230 | 27,119 | 化学 |
| HANNOVER RUECK SE | 53 | 57 | 549 | 64,609 | 保険 |
| GEA GROUP AG | 163 | 175 | 753 | 88,508 | 機械 |
| CONTINENTAL AG | 100 | 106 | 2,019 | 237,272 | 自動車部品 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 872 | 940 | 2,439 | 286,642 | 航空貨物・物流サービス |
| AXEL SPRINGER SE | 44 | 44 | 218 | 25,666 | メディア |
| MERCK KGAA | 119 | 126 | 1,123 | 132,042 | 医薬品 |
| RWE AG | 432 | 462 | 607 | 71,417 | 総合公益事業 |
| SAP SE | 890 | 948 | 6,661 | 782,804 | ソフトウェア |
| E.ON SE | 1,790 | 1,940 | 1,752 | 205,993 | 総合公益事業 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 94 | 100 | 911 | 107,075 | 家庭用品 |
| METRO AG | 166 | 166 | 471 | 55,379 | 食品・生活必需品小売り |
| BAYER AG-REG | 750 | 801 | 7,348 | 863,507 | 医薬品 |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 164 | 174 | 1,792 | 210,601 | 家庭用品 |
| BASF SE | 836 | 887 | 6,192 | 727,639 | 化学 |
| BEIERSDORF AG | 94 | 100 | 805 | 94,630 | パーソナル用品 |
| HOCHTIEF AG | — | 20 | 228 | 26,862 | 建設・土木 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 131 | 137 | 1,009 | 118,648 | 建設資材 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE | 196 | 209 | 1,556 | 182,870 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| ALLIANZ SE-REG | 413 | 440 | 6,016 | 706,949 | 保険 |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 192 | 226 | 264 | 31,138 | 旅客航空輸送業 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 150 | 160 | 2,512 | 295,254 | 保険 |
| VOLKSWAGEN AG | 30 | 32 | 429 | 50,411 | 自動車 |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 166 | 178 | 2,203 | 258,967 | 自動車 |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 871 | 929 | 5,449 | 640,372 | 自動車 |
| MAN SE | 32 | 32 | 295 | 34,685 | 機械 |
| THYSSENKRUPP AG | 333 | 363 | 684 | 80,470 | 金属・鉱業 |
| SIEMENS AG | 717 | 742 | 7,105 | 834,954 | コングロマリット |
| QIAGEN NV | 201 | 223 | 417 | 49,107 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| LINDE AG | 167 | 179 | 2,290 | 269,178 | 化学 |
| DEUTSCHE BANK AG-REG | 1,252 | 1,331 | 1,969 | 231,480 | 資本市場 |
| BAYER MOTOREN WERK | 298 | 318 | 2,309 | 271,442 | 自動車 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 47 | 53 | 332 | 39,130 | 自動車 |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG | 2,915 | 3,114 | 4,499 | 528,763 | 各種電気通信サービス |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 1,050 | 1,090 | 1,426 | 167,600 | 半導体・半導体製造装置 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 176 | 189 | 1,498 | 176,031 | 各種金融サービス |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 142 | 152 | 716 | 84,145 | 自動車 |
| FRAPORT AG | 38 | 38 | 183 | 21,545 | 運送インフラ |
| LANXESS | 83 | 83 | 345 | 40,568 | 化学 |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR | 311 | 329 | 966 | 113,527 | 不動産管理・開発 |
| SYMRISE AG | 115 | 121 | 690 | 81,146 | 化学 |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG | 20 | — | — | — | メディア |
| BRENNTAG AG | 142 | 151 | 669 | 78,646 | 商社・流通業 |
| K+S AG | 173 | 188 | 394 | 46,392 | 化学 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 123 | 138 | 376 | 44,205 | 化学 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 566 | 746 | 274 | 32,251 | 各種電気通信サービス |
| HUGO BOSS AG | 63 | 63 | 349 | 41,013 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| COMMERZBANK AG | 960 | 1,020 | 693 | 81,528 | 銀行 |
| OSRAM LICHT AG | 77 | 88 | 419 | 49,289 | 電気設備 |
| VONOVIA SE | 421 | 452 | 1,417 | 166,593 | 不動産管理・開発 |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE | 199 | 209 | 900 | 105,864 | 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…ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| ZALANDO SE | 81 | 81 | 213 | 25,052 | インターネット販売・カタログ販売 |
| COVESTRO AG | — | 68 | 286 | 33,724 | 化学 |
| SCHAEFFLER AG | — | 160 | 228 | 26,829 | 自動車部品 |
| 小計 株数・金額 | 20,136 | 21,844 | 90,787 | 10,668,451 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 54 | 56 | — | <3.5%> | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 1,048 | 1,137 | 1,422 | 167,144 | 保険 |
| INTESA SANPAOLO | 11,510 | 12,160 | 2,619 | 307,789 | 銀行 |
| INTESA SANPAOLO-RSP | 920 | 920 | 185 | 21,838 | 銀行 |
| MEDIOBANCA S.P.A. | 530 | 530 | 338 | 39,765 | 資本市場 |
| SAIPEM SPA | 239 | 5,497 | 221 | 26,064 | エネルギー設備・サービス |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 157 | 165 | 761 | 89,442 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ENEL SPA | 6,350 | 7,387 | 2,929 | 344,295 | 電力 |
| ENI SPA | 2,310 | 2,448 | 3,510 | 412,510 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SNAM SPA | 1,900 | 2,370 | 1,219 | 143,287 | ガス |
| TENARIS SA | 417 | 460 | 585 | 68,811 | エネルギー設備・サービス |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA | 810 | 900 | 262 | 30,797 | 銀行 |
| UBI BANCA SPA - RIGHTS | 810 | — | — | — | 銀行 |
| TELECOM ITALIA SPA | 10,400 | 9,900 | 777 | 91,381 | 各種電気通信サービス |
| TELECOM ITALIA-RNC | 5,300 | 5,700 | 355 | 41,829 | 各種電気通信サービス |
| ATLANTIA SPA | 376 | 393 | 906 | 106,494 | 運送インフラ |
| TERNA SPA | 1,350 | 1,420 | 679 | 79,827 | 電力 |
| EXOR SPA | 86 | 112 | 373 | 43,892 | 各種金融サービス |
| LEONARDO-FINMECCANICA SPA | 370 | 410 | 407 | 47,914 | 航空宇宙・防衛 |
| PRYSMIAN SPA | 174 | 194 | 412 | 48,443 | 電気設備 |
| ENEL GREEN POWER SPA | 1,600 | — | — | — | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| UNICREDIT SPA | 4,330 | 4,841 | 1,219 | 143,262 | 銀行 |
| UNIPOLSAI SPA | 1,070 | 1,070 | 168 | 19,828 | 保険 |
| FERRARI NV | — | 127 | 482 | 56,739 | 自動車 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 860 | 990 | 652 | 76,722 | 機械 |
| BANCO POPOLARE SPA | 339 | — | — | — | 銀行 |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 824 | 890 | 556 | 65,364 | 自動車 |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA | 2,260 | — | — | — | 銀行 |
| POSTE ITALIANE SPA | — | 500 | 332 | 39,013 | 保険 |
| 小計 株数・金額 | 56,340 | 60,522 | 21,380 | 2,512,460 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 26 | 24 | — | <0.8%> | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | |
| BOUYGUES | 187 | 201 | 562 | 66,122 | 建設・土木 |
| AIRBUS GROUP SE | 536 | 574 | 3,120 | 366,662 | 航空宇宙・防衛 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 417 | 437 | 881 | 103,576 | 総合公益事業 |
| LOREAL-ORD | 228 | 245 | 4,106 | 482,533 | パーソナル用品 |
| CHRISTIAN DIOR SE | 51 | 53 | 797 | 93,755 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 253 | 268 | 3,846 | 451,984 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| THALES SA | 99 | 99 | 741 | 87,088 | 航空宇宙・防衛 |
| CAP GEMINI SA | 147 | 160 | 1,391 | 163,555 | 情報技術サービス |
| CASINO GUICHARD-PERRACHON SA | 49 | 59 | 299 | 35,171 | 食品・生活必需品小売り |
| INGENICO GROUP | 50 | 55 | 550 | 64,662 | 電子装置・機器・部品 |
| PUBLICIS GROUPE | 167 | 184 | 1,154 | 135,633 | メディア |
| LAGARDERE S.C.A | 116 | 116 | 240 | 28,318 | メディア |
| BOLLORE | 750 | 870 | 267 | 31,375 | 航空貨物・物流サービス |
| MICHELIN (CGDE) | 168 | 178 | 1,578 | 185,490 | 自動車部品 |
| PERNOD RICARD SA | 194 | 205 | 1,959 | 230,272 | 飲料 |
| RENAULT SA | 175 | 188 | 1,480 | 173,995 | 自動車 |
| REMY COINTREAU | 23 | 23 | 170 | 20,035 | 飲料 |

| 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 | |
| (ユーロ…フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 506 | 538 | 3,084 | 362,505 | 電気設備 |
| VIVENDI SA | 1,042 | 1,132 | 1,833 | 215,428 | メディア |
| TECHNIP SA | 98 | 105 | 520 | 61,131 | エネルギー設備・サービス |
| VALEO SA | 72 | — | — | — | 自動車部品 |
| ORANGE SA | 1,791 | 1,925 | 2,778 | 326,529 | 各種電気通信サービス |
| HERMES INTERNATIONAL | 24 | 24 | 832 | 97,799 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SOCIETE BIC SA | 25 | 28 | 347 | 40,813 | 商業サービス・用品 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 114 | 121 | 836 | 98,279 | ソフトウェア |
| KERING SA | 69 | 72 | 1,094 | 128,671 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| CNP ASSURANCES | 165 | 165 | 234 | 27,561 | 保険 |
| CARREFOUR SUPERMARCHE | 502 | 541 | 1,252 | 147,139 | 食品・生活必需品小売り |
| ATOS SE | 79 | 86 | 704 | 82,817 | 情報技術サービス |
| SANOFI | 1,067 | 1,137 | 7,962 | 935,662 | 医薬品 |
| ACCOR SA | 192 | 173 | 661 | 77,728 | ホテル・レストラン・レジャー |
| STMICROELECTRONICS NV | 577 | 577 | 300 | 35,257 | 半導体・半導体製造装置 |
| SOCIETE GENERALE | 654 | 742 | 2,535 | 297,892 | 銀行 |
| ALCATEL-LUCENT | 2,600 | — | — | — | 通信機器 |
| EURAZEO | 38 | 40 | 230 | 27,058 | 各種金融サービス |
| SODEXO | 85 | 90 | 849 | 99,815 | ホテル・レストラン・レジャー |
| AXA | 1,784 | 1,881 | 3,906 | 459,092 | 保険 |
| PEUGEOT CITROEN | 402 | 473 | 650 | 76,481 | 自動車 |
| JC DECAUX SA | 68 | 68 | 237 | 27,947 | メディア |
| ESSILOR INTERNATIONAL | 185 | 199 | 2,308 | 271,260 | ヘルスケア機器・用品 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 924 | 1,030 | 872 | 102,529 | 銀行 |
| ZODIAC AEROSPACE | 195 | 195 | 435 | 51,156 | 航空宇宙・防衛 |
| BNP PARIBAS | 958 | 1,023 | 4,712 | 553,820 | 銀行 |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD) | 441 | 455 | 1,770 | 208,013 | 建設関連製品 |
| WENDEL | 24 | 29 | 282 | 33,229 | 各種金融サービス |
| ILIAD SA | 24 | 24 | 451 | 53,044 | 各種電気通信サービス |
| SES FDR | 296 | 352 | 679 | 79,831 | メディア |
| IMERYS | 30 | 38 | 229 | 26,970 | 建設資材 |
| SAFRAN SA | 284 | 301 | 1,818 | 213,708 | 航空宇宙・防衛 |
| ENGIE | 1,334 | 1,411 | 2,048 | 240,668 | 総合公益事業 |
| ALSTOM | 203 | 155 | 332 | 39,087 | 機械 |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 163 | 163 | 268 | 31,527 | メディア |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 228 | 228 | 262 | 30,837 | 電力 |
| ARKEMA | 59 | 67 | 476 | 56,033 | 化学 |
| LEGRAND SA | 243 | 253 | 1,227 | 144,220 | 電気設備 |
| EIFFAGE SA | — | 55 | 354 | 41,686 | 建設・土木 |
| TOTAL SA | 1,965 | 2,137 | 9,193 | 1,080,313 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ADP | 28 | 28 | 284 | 33,396 | 運送インフラ |
| NATIXIS | 870 | 870 | 354 | 41,639 | 銀行 |
| SCOR SE | 140 | 154 | 434 | 51,023 | 保険 |
| REXEL SA | 252 | 286 | 361 | 42,429 | 商社・流通業 |
| VINCI | 430 | 485 | 3,139 | 368,911 | 建設・土木 |
| DANONE | 532 | 567 | 3,561 | 418,491 | 食品 |
| AIR LIQUIDE | 313 | 334 | 3,147 | 369,837 | 化学 |
| BUREAU VERITAS SA | 231 | 255 | 488 | 57,383 | 専門サービス |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR | 410 | 450 | 508 | 59,753 | 運送インフラ |
| SUEZ | 270 | 299 | 428 | 50,331 | 総合公益事業 |
| EDENRED | 187 | 187 | 318 | 37,400 | 商業サービス・用品 |
| VALEO SA | — | 228 | 1,048 | 123,166 | 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 | |
| (ユーロ…フランス) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| NUMERICABLE-SFR | | 96 | 110 | 278 | 32,735 | 各種電気通信サービス |
| 小計 | 株数・金額 | 26,883 | 26,205 | 96,079 | 11,290,287 | |
| | 銘柄数<比率> | 68 | 68 | — | <3.7%> | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| RELX NV | | 909 | 970 | 1,457 | 171,262 | メディア |
| RANDSTAD HOLDING NV | | 118 | 116 | 528 | 62,055 | 専門サービス |
| AKZO NOBEL | | 225 | 240 | 1,428 | 167,917 | 化学 |
| WOLTERS KLUWER | | 276 | 289 | 1,004 | 118,097 | メディア |
| VOPAK | | 61 | 71 | 312 | 36,705 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| AEGON NV | | 1,610 | 1,800 | 751 | 88,329 | 保険 |
| KONINKLIJKE KPN NV | | 2,840 | 3,300 | 1,079 | 126,843 | 各種電気通信サービス |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | | 854 | 903 | 2,089 | 245,595 | コングロマリット |
| ING GROEP NV | | 3,497 | 3,750 | 3,935 | 462,475 | 銀行 |
| HEINEKEN NV | | 208 | 220 | 1,777 | 208,885 | 飲料 |
| ARCELORMITTAL | | 960 | 1,792 | 817 | 96,023 | 金属・鉱業 |
| HEINEKEN HOLDING NV | | 91 | 97 | 693 | 81,544 | 飲料 |
| KONINKLIJKE DSM NV | | 167 | 175 | 943 | 110,820 | 化学 |
| UNILEVER NV-CVA | | 1,483 | 1,571 | 6,309 | 741,386 | パーソナル用品 |
| BOSKALIS WESTMINSTER-CVA | | 81 | 81 | 256 | 30,177 | 建設・土木 |
| TNT EXPRESS NV | | 430 | — | — | — | 航空貨物・物流サービス |
| ASML HOLDING NV | | 314 | 356 | 3,106 | 364,997 | 半導体・半導体製造装置 |
| GEMALTO | | 76 | 76 | 404 | 47,475 | ソフトウェア |
| OCI | | 80 | 80 | 105 | 12,394 | 化学 |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | | 764 | 812 | 1,592 | 187,114 | 食品・生活必需品小売り |
| NN GROUP NV | | 218 | 306 | 812 | 95,522 | 保険 |
| ABN AMRO GROUP NV-CVA | | — | 227 | 404 | 47,547 | 銀行 |
| ALTICE NV - B | | 100 | 100 | 141 | 16,667 | メディア |
| ALTICE NV - A | | 336 | 368 | 518 | 60,915 | メディア |
| 小計 | 株数・金額 | 15,698 | 17,700 | 30,471 | 3,580,758 | |
| | 銘柄数<比率> | 23 | 23 | — | <1.2%> | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA | | 472 | 502 | 675 | 79,371 | 運送インフラ |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS-RIGHTS | | — | 502 | 33 | 3,968 | 運送インフラ |
| ENDESA S.A. | | 294 | 317 | 558 | 65,617 | 電力 |
| BANKINTER S.A. | | 580 | 650 | 409 | 48,074 | 銀行 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A. | | 5,762 | 6,306 | 3,519 | 413,601 | 銀行 |
| GAS NATURAL SDG | | 328 | 328 | 576 | 67,778 | ガス |
| REPSOL SA | | 950 | 1,043 | 1,187 | 139,500 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| REPSOL SA-RTS | | 950 | 1,043 | 30 | 3,542 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BANCO SANTANDER SA | | 13,088 | 13,978 | 5,626 | 661,135 | 銀行 |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | | 96 | 102 | 804 | 94,533 | 電力 |
| TELEFONICA SA | | 4,086 | 4,356 | 3,878 | 455,738 | 各種電気通信サービス |
| ZARDOYA OTIS S.A | | 168 | 168 | 146 | 17,189 | 機械 |
| ENAGAS | | 197 | 213 | 572 | 67,254 | ガス |
| ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV | | 182 | 185 | 516 | 60,691 | 建設・土木 |
| GRIFOLS SA | | 132 | — | — | — | バイオテクノロジー |
| FERROVIAL SA | | 401 | 463 | 857 | 100,798 | 建設・土木 |
| FERROVIAL SA-RIGHTS | | — | 463 | 14 | 1,736 | 建設・土木 |
| MAPFRE SA | | 930 | 1,110 | 227 | 26,687 | 保険 |
| BANCO DE SABADELL SA | | 4,535 | 5,045 | 727 | 85,440 | 銀行 |
| CAIXABANK | | 2,444 | 2,482 | 553 | 65,092 | 銀行 |
| IBERDROLA SA | | 4,878 | 5,287 | 3,157 | 371,094 | 電力 |
| AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS | | 396 | 430 | 1,735 | 203,885 | 情報技術サービス |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP | | 740 | 800 | 523 | 61,500 | 旅客航空輸送業 |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…スペイン) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL | | 570 | 570 | 300 | 35,318 | 食品・生活必需品小売り |
| BANKIA SA | | 4,300 | 4,300 | 301 | 35,421 | 銀行 |
| BCO POPULAR ESPANOL | | 1,598 | 3,132 | 440 | 51,756 | 銀行 |
| INDITEX SA | | 990 | 1,056 | 3,207 | 376,863 | 専門小売り |
| AENA SA | | 61 | 65 | 773 | 90,932 | 運送インフラ |
| GRIFOLS SA | | — | 288 | 549 | 64,555 | バイオテクノロジー |
| 小計 | 株数・金額 | 49,131 | 55,189 | 31,904 | 3,749,079 | |
| | 銘柄数<比率> | 26 | 28 | — | <1.2%> | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | | |
| UMICORE | | 88 | 88 | 410 | 48,209 | 化学 |
| DELHAIZE GROUP | | 93 | 98 | 904 | 106,292 | 食品・生活必需品小売り |
| KBC GROEP NV | | 230 | 240 | 1,223 | 143,719 | 銀行 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV NV | | 729 | 777 | 8,853 | 1,040,423 | 飲料 |
| SOLVAY SA | | 68 | 73 | 639 | 75,102 | 化学 |
| UCB SA | | 117 | 123 | 801 | 94,223 | 医薬品 |
| COLRUYT SA | | 61 | 70 | 383 | 45,011 | 食品・生活必需品小売り |
| GROUPE BRUXELLES LAM | | 72 | 78 | 577 | 67,826 | 各種金融サービス |
| PROXIMUS | | 137 | 151 | 415 | 48,849 | 各種電気通信サービス |
| TELENET GROUP HOLDING NV | | 44 | 52 | 212 | 24,973 | メディア |
| AGEAS | | 179 | 200 | 683 | 80,353 | 保険 |
| 小計 | 株数・金額 | 1,818 | 1,950 | 15,104 | 1,774,985 | |
| | 銘柄数<比率> | 11 | 11 | — | <0.6%> | |
| (ユーロ…オーストリア) | | | | | | |
| OMV AG | | 125 | 140 | 352 | 41,441 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VOESTALPINE AG | | 110 | 110 | 352 | 41,363 | 金属・鉱業 |
| ERSTE GROUP BANK AG | | 251 | 268 | 591 | 69,457 | 銀行 |
| IMMOEAST AG-RIGHTS | | 500 | 500 | — | — | 不動産管理・開発 |
| RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | | 110 | 110 | 126 | 14,826 | 銀行 |
| ANDRITZ AG | | 73 | 72 | 313 | 36,804 | 機械 |
| 小計 | 株数・金額 | 1,169 | 1,200 | 1,735 | 203,892 | |
| | 銘柄数<比率> | 6 | 6 | — | <0.1%> | |
| (ユーロ…ルクセンブルグ) | | | | | | |
| RTL GROUP | | 33 | 39 | 311 | 36,548 | メディア |
| 小計 | 株数・金額 | 33 | 39 | 311 | 36,548 | |
| | 銘柄数<比率> | 1 | 1 | — | <0.0%> | |
| (ユーロ…フィンランド) | | | | | | |
| WARTSILA OYJ | | 136 | 147 | 561 | 65,969 | 機械 |
| UPM-KYMMENE OYJ | | 484 | 505 | 867 | 101,950 | 紙製品・林産品 |
| STORA ENSO OYJ-R | | 494 | 540 | 407 | 47,877 | 紙製品・林産品 |
| SAMPO OYJ-A SHS | | 401 | 432 | 1,656 | 194,681 | 保険 |
| FORTUM OYJ | | 405 | 440 | 635 | 74,712 | 電力 |
| ELISA OYJ | | 125 | 137 | 461 | 54,172 | 各種電気通信サービス |
| METSO OYJ | | 104 | 104 | 220 | 25,896 | 機械 |
| NOKIA OYJ | | 3,320 | 5,600 | 2,772 | 325,737 | 通信機器 |
| NESTE OYJ | | 125 | 125 | 381 | 44,815 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | | 102 | 113 | 371 | 43,686 | 自動車部品 |
| KONE OYJ | | 308 | 326 | 1,318 | 154,956 | 機械 |
| ORION OYJ | | 96 | 96 | 333 | 39,223 | 医薬品 |
| 小計 | 株数・金額 | 6,100 | 8,565 | 9,987 | 1,173,680 | |
| | 銘柄数<比率> | 12 | 12 | — | <0.4%> | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| BANK OF IRELAND | | 27,400 | 28,500 | 718 | 84,395 | 銀行 |
| CRH PLC | | 780 | 822 | 2,182 | 256,454 | 建設資材 |
| KERRY GROUP PLC-A | | 152 | 161 | 1,271 | 149,366 | 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 | |
| (ユーロ…アイルランド) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD | | 1,398 | 1,398 | － | － | 銀行 |
| PADDY POWER PLC | | － | 81 | 947 | 111,364 | ホテル・レストラン・レジャー |
| 小計 | 株数・金額 | 29,730 | 30,962 | 5,119 | 601,581 | |
| | 銘柄数＜比率＞ | 4 | 5 | － | ＜0.2%＞ | |
| (ユーロ…ポルトガル) | | | | | | |
| ENERGIAS DE PORTUGAL | | 2,100 | 2,200 | 645 | 75,824 | 電力 |
| BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REGD | | 34,000 | － | － | － | 銀行 |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | | 365 | 445 | 539 | 63,430 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| JERONIMO MARTINS | | 224 | 252 | 357 | 42,005 | 食品・生活必需品小売り |
| 小計 | 株数・金額 | 36,689 | 2,897 | 1,542 | 181,259 | |
| | 銘柄数＜比率＞ | 4 | 3 | － | ＜0.1%＞ | |
| ユーロ計 | 株数・金額 | 243,729 | 227,076 | 304,425 | 35,772,984 | |
| | 銘柄数＜比率＞ | 235 | 237 | － | ＜11.7%＞ | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | | 219 | 219 | 1,261 | 17,004 | 半導体・半導体製造装置 |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | | 2,130 | 2,130 | 3,216 | 43,355 | 不動産管理・開発 |
| BANK OF EAST ASIA | | 1,078 | 1,208 | 3,510 | 47,328 | 銀行 |
| CLP HLDGS | | 1,745 | 1,605 | 12,230 | 164,861 | 電力 |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS | | 1,070 | 1,070 | 1,273 | 17,164 | 旅客航空輸送業 |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE | | 550 | 650 | 4,777 | 64,400 | 電力 |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | | 1,026 | 1,102 | 20,144 | 271,548 | 各種金融サービス |
| LI & FUNG LTD | | 5,636 | 5,636 | 2,017 | 27,198 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| MTR CORP | | 1,305 | 1,395 | 5,224 | 70,423 | 陸運・鉄道 |
| FIRST PACIFIC CO | | 2,260 | 2,260 | 1,188 | 16,024 | 各種金融サービス |
| HANG SENG BANK | | 700 | 730 | 9,650 | 130,090 | 銀行 |
| HENDERSON LAND | | 1,030 | 1,078 | 4,452 | 60,024 | 不動産管理・開発 |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | | 1,240 | 1,350 | 9,895 | 133,391 | 電力 |
| WHARF(HOLDING) | | 1,230 | 1,330 | 6,098 | 82,201 | 不動産管理・開発 |
| HONG KONG & CHINA GAS | | 6,355 | 7,288 | 9,809 | 132,235 | ガス |
| HYSAN DEVELOPMENT | | 540 | 650 | 2,213 | 29,834 | 不動産管理・開発 |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | | 2,060 | 2,230 | 5,207 | 70,191 | ホテル・レストラン・レジャー |
| KERRY PROPERTIES | | 570 | 570 | 1,065 | 14,368 | 不動産管理・開発 |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | | 3,455 | 3,635 | 8,324 | 112,209 | 銀行 |
| NWS HOLDINGS LTD | | 1,355 | 1,355 | 1,623 | 21,881 | コングロマリット |
| PCCW LTD | | 3,860 | 3,860 | 1,914 | 25,808 | 各種電気通信サービス |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | | 620 | 750 | 2,212 | 29,824 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | | 5,166 | 5,166 | 3,854 | 51,956 | 不動産管理・開発 |
| SHANGRI-LA ASIA LTD | | 1,083 | 1,083 | 862 | 11,624 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SINO LAND CO.LTD | | 2,860 | 2,860 | 3,494 | 47,111 | 不動産管理・開発 |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | | 1,550 | 1,410 | 12,541 | 169,065 | 不動産管理・開発 |
| SWIRE PACIFIC-A | | 535 | 535 | 4,579 | 61,733 | 不動産管理・開発 |
| WHEELOCK & COMPANY LTD | | 870 | 870 | 3,071 | 41,398 | 不動産管理・開発 |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO | | 1,280 | 1,280 | 3,929 | 52,971 | 家庭用耐久財 |
| SJM HOLDINGS LIMITED | | 1,660 | 1,660 | 756 | 10,203 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WYNN MACAU LTD | | 1,324 | 1,684 | 1,933 | 26,059 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD | | 780 | 780 | 820 | 11,061 | ホテル・レストラン・レジャー |
| AIA GROUP LTD | | 10,964 | 11,624 | 52,308 | 705,111 | 保険 |
| HKT TRUST AND HKT LTD | | 2,596 | 2,596 | 2,845 | 38,353 | 各種電気通信サービス |
| SANDS CHINA LTD | | 2,216 | 2,348 | 6,081 | 81,976 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SWIRE PROPERTIES LTD | | 1,008 | 1,168 | 2,371 | 31,961 | 不動産管理・開発 |
| WH GROUP LIMITED | | 5,100 | 5,900 | 3,486 | 47,003 | 食品 |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | | 2,455 | 2,625 | 23,904 | 322,229 | 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 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | 2,475 | 2,635 | 12,728 | 171,586 | 不動産管理・開発 |
| 小計 株数・金額 | 83,959 | 88,327 | 256,882 | 3,462,778 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 39 | 39 | － | <1.1%> | |
| (シンガポール) | | | 千シンガポールドル | | |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING | 1,410 | 1,410 | 439 | 34,247 | 航空宇宙・防衛 |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 6,153 | 6,153 | 218 | 17,005 | 食品 |
| DBS GROUP HLDGS | 1,580 | 1,710 | 2,741 | 213,396 | 銀行 |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 370 | 370 | 323 | 25,203 | 不動産管理・開発 |
| SEMBCORP MARINE | 726 | 726 | 114 | 8,930 | 機械 |
| JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD | 98 | 100 | 329 | 25,612 | 販売 |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 770 | 770 | 575 | 44,838 | 各種金融サービス |
| CAPITALAND LIMITED | 2,290 | 2,460 | 740 | 57,644 | 不動産管理・開発 |
| GENTING SINGAPORE PLC | 5,246 | 6,146 | 445 | 34,688 | ホテル・レストラン・レジャー |
| COMFORTDELGRO CORP LTD | 2,070 | 2,070 | 565 | 43,993 | 陸運・鉄道 |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 490 | 550 | 580 | 45,162 | 旅客航空輸送業 |
| UNITED OVERSEAS BANK | 1,185 | 1,255 | 2,289 | 178,207 | 銀行 |
| UOL GROUP LIMITED | 377 | 487 | 265 | 20,662 | 不動産管理・開発 |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 1,510 | 1,510 | 570 | 44,435 | メディア |
| NOBLE GROUP LTD | 4,124 | 4,124 | 92 | 7,225 | 商社・流通業 |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 7,300 | 7,700 | 2,956 | 230,186 | 各種電気通信サービス |
| SEMBCORP INDUSTRIES | 990 | 990 | 281 | 21,897 | コングロマリット |
| OCBC-ORD | 2,725 | 2,975 | 2,543 | 198,021 | 銀行 |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | 1,840 | 1,840 | 607 | 47,270 | 食品 |
| STARHUB LTD | 530 | 530 | 191 | 14,936 | 無線通信サービス |
| KEPPEL CORP. | 1,317 | 1,427 | 776 | 60,434 | コングロマリット |
| YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 1,630 | 1,630 | 144 | 11,230 | 機械 |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 2,940 | 2,660 | 476 | 37,067 | 不動産管理・開発 |
| 小計 株数・金額 | 47,672 | 49,594 | 18,269 | 1,422,299 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 23 | 23 | － | <0.5%> | |
| (オーストラリア) | | | 千豪ドル | | |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 131 | 141 | 997 | 77,638 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK | 2,599 | 2,817 | 6,831 | 531,879 | 銀行 |
| AMCOR | 1,080 | 1,130 | 1,648 | 128,365 | 容器・包装 |
| WESTPAC BANKING CORP | 3,005 | 3,228 | 9,580 | 745,953 | 銀行 |
| BANK OF QUEENSLAND LTD | 351 | 351 | 384 | 29,937 | 銀行 |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 1,420 | 1,420 | 462 | 36,042 | 金属・鉱業 |
| TELSTRA CORP LTD | 3,930 | 4,170 | 2,230 | 173,701 | 各種電気通信サービス |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD | 393 | 443 | 421 | 32,836 | 銀行 |
| COCA-COLA AMATIL LTD | 520 | 520 | 443 | 34,495 | 飲料 |
| ASX LTD | 182 | 182 | 824 | 64,164 | 各種金融サービス |
| BHP BILLITON LIMITED | 2,904 | 3,084 | 5,763 | 448,784 | 金属・鉱業 |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 255 | 255 | 808 | 62,977 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 530 | 530 | 245 | 19,106 | 複合小売り |
| COMPUTERSHARE LTD | 410 | 470 | 484 | 37,728 | 情報技術サービス |
| CSL LIMITED | 421 | 451 | 4,910 | 382,365 | バイオテクノロジー |
| REA GROUP LTD | 41 | 54 | 311 | 24,217 | メディア |
| TRANSURBAN GROUP | 1,826 | 1,950 | 2,310 | 179,918 | 運送インフラ |
| COCHLEAR LTD | 52 | 52 | 632 | 49,232 | ヘルスケア機器・用品 |
| ORIGIN ENERGY LTD | 1,600 | 1,750 | 1,011 | 78,755 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 1,547 | 1,646 | 12,358 | 962,206 | 銀行 |
| BORAL LTD | 670 | 670 | 420 | 32,760 | 建設資材 |
| RIO TINTO LTD | 379 | 410 | 1,812 | 141,129 | 金属・鉱業 |
| APA GROUP | 990 | 1,070 | 950 | 73,979 | ガス |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | 460 | 520 | 686 | 53,483 | ホテル・レストラン・レジャー |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (オーストラリア) | | 百株 | 百株 | 千豪ドル | 千円 | |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD | | 2,200 | 2,320 | 1,338 | 104,226 | 保険 |
| TPG TELECOM LTD | | 270 | 330 | 386 | 30,087 | 各種電気通信サービス |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | | 52 | 52 | 168 | 13,134 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ORICA LTD | | 326 | 366 | 476 | 37,102 | 化学 |
| SUNCORP GROUP LTD | | 1,150 | 1,260 | 1,543 | 120,176 | 保険 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK | | 2,382 | 2,554 | 6,556 | 510,459 | 銀行 |
| NEWCREST MINING | | 720 | 750 | 1,625 | 126,541 | 金属・鉱業 |
| OIL SEARCH LTD | | 1,200 | 1,300 | 871 | 67,816 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INCITEC PIVOT LTD | | 1,610 | 1,610 | 534 | 41,617 | 化学 |
| AMP LIMITED | | 2,730 | 2,850 | 1,547 | 120,492 | 保険 |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | | 441 | 441 | 129 | 10,068 | 旅客航空輸送業 |
| QBE INSURANCE | | 1,270 | 1,330 | 1,558 | 121,365 | 保険 |
| CHALLENGER LIMITED | | 490 | 560 | 514 | 40,026 | 各種金融サービス |
| SANTOS LTD. | | 1,470 | 1,670 | 809 | 63,062 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SONIC HEALTHCARE LTD | | 339 | 373 | 792 | 61,742 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| TABCORP HOLDINGS | | 780 | 780 | 338 | 26,357 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WESFARMERS LIMITED | | 1,024 | 1,079 | 4,380 | 341,084 | 食品・生活必需品小売り |
| ALUMINA LTD | | 2,330 | 2,330 | 311 | 24,218 | 金属・鉱業 |
| ILUKA RESOURCES LTD | | 378 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| WOODSIDE PETROLEUM | | 662 | 711 | 1,884 | 146,699 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WOOLWORTHS LIMITED | | 1,145 | 1,229 | 2,604 | 202,766 | 食品・生活必需品小売り |
| DUET GROUP | | 2,000 | 2,290 | 574 | 44,753 | 総合公益事業 |
| SEEK LTD | | 288 | 328 | 527 | 41,090 | 専門サービス |
| DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L | | — | 59 | 406 | 31,660 | ホテル・レストラン・レジャー |
| TATTS GROUP LTD | | 1,310 | 1,470 | 577 | 44,980 | ホテル・レストラン・レジャー |
| BRAMBLES LTD | | 1,440 | 1,550 | 1,956 | 152,301 | 商業サービス・用品 |
| PLATINUM ASSET MANAGEMENT | | 170 | 250 | 158 | 12,321 | 資本市場 |
| ASCIANO LTD | | 610 | 610 | 541 | 42,127 | 陸運・鉄道 |
| MACQUARIE GROUP LIMITED | | 270 | 296 | 2,247 | 174,992 | 資本市場 |
| CROWN RESORTS LTD | | 360 | 360 | 469 | 36,578 | ホテル・レストラン・レジャー |
| VOCUS COMMUNICATIONS LTD | | — | 430 | 380 | 29,629 | 各種電気通信サービス |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | | 400 | 440 | 896 | 69,784 | 建設資材 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | | 640 | 720 | 717 | 55,891 | 飲料 |
| SYDNEY AIRPORT | | 979 | 1,079 | 780 | 60,739 | 運送インフラ |
| AURIZON HOLDINGS LTD | | 1,930 | 2,090 | 980 | 76,319 | 陸運・鉄道 |
| HEALTHSCOPE LTD | | 1,500 | 1,760 | 498 | 38,780 | 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 | 261 | 20,355 | 電力 |
| MEDIBANK PRIVATE LTD | | 2,610 | 2,610 | 777 | 60,557 | 保険 |
| AGL ENERGY LTD | | 606 | 645 | 1,208 | 94,111 | 総合公益事業 |
| SOUTH32 LTD | | 5,000 | 5,000 | 825 | 64,234 | 金属・鉱業 |
| CIMIC GROUP LTD | | 89 | 89 | 328 | 25,588 | 建設・土木 |
| 小計 | 株数・金額 | 70,502 | 74,919 | 100,019 | 7,787,508 | |
| | 銘柄数<比率> | 63 | 64 | — | <2.6%> | |
| (ニュージーランド) | | | | 千ニュージーランドドル | | |
| CONTACT ENERGY LTD | | 648 | 760 | 398 | 29,668 | 電力 |
| RYMAN HEALTHCARE LTD | | 350 | 350 | 311 | 23,206 | 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 | 565 | 42,100 | 建設資材 |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | | 1,700 | 1,700 | 574 | 42,807 | 各種電気通信サービス |
| MIGHTY RIVER POWER | | 600 | 600 | 178 | 13,275 | 電力 |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | | 881 | 971 | 626 | 46,663 | 運送インフラ |
| MERIDIAN ENERGY LTD | | 1,200 | 1,200 | 307 | 22,886 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小計 | 株数・金額 | 5,999 | 6,271 | 2,961 | 220,610 | |
| | 銘柄数<比率> | 7 | 7 | — | <0.1%> | |

| 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 | |
| (イスラエル) | | 百株 | 百株 | 千新シェケル | 千円 | |
| BANK HAPOALIM BM | | 930 | 1,020 | 2,017 | 54,696 | 銀行 |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL | | 1,270 | 1,380 | 1,959 | 53,124 | 銀行 |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP | | 1,860 | 2,010 | 1,425 | 38,634 | 各種電気通信サービス |
| DELEK GROUP LTD | | 4 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ISRAEL CHEMICALS LIMITED | | 440 | 440 | 685 | 18,596 | 化学 |
| NICE SYSTEMS LTD | | 53 | 59 | 1,437 | 38,963 | ソフトウェア |
| TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD | | 829 | 889 | 17,628 | 477,918 | 医薬品 |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | | 130 | 130 | 604 | 16,391 | 銀行 |
| AZRIELI GROUP | | 31 | 41 | 667 | 18,106 | 不動産管理・開発 |
| 小計 | 株数・金額 | 5,547 | 5,969 | 26,426 | 716,431 | |
| | 銘柄数<比率> | 9 | 8 | — | <0.2%> | |
| 合計 | 株数・金額 | 1,248,974 | 1,258,368 | — | 289,482,024 | |
| | 銘柄数<比率> | 1,276 | 1,269 | — | <94.9%> | |

＊邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
＊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 | % |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | — | 7,000 | 685 | 71,683 | 0.0 |
| AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP | 31,400 | 32,900 | 630 | 65,957 | 0.0 |
| AMERICAN TOWER CORP | 38,200 | 41,000 | 4,487 | 469,254 | 0.2 |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 86,000 | 91,000 | 969 | 101,353 | 0.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 12,090 | 13,330 | 2,333 | 244,056 | 0.1 |
| BOSTON PROPERTIES | 13,900 | 14,700 | 1,875 | 196,147 | 0.1 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 15,400 | 20,300 | 525 | 54,985 | 0.0 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 7,600 | 8,300 | 692 | 72,418 | 0.0 |
| CROWN CASTLE INTL CORP | 30,200 | 32,300 | 3,080 | 322,153 | 0.1 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 12,600 | 14,400 | 1,497 | 156,634 | 0.1 |
| DUKE REALTY CORP | 31,600 | 34,000 | 872 | 91,275 | 0.0 |
| EQUINIX INC | 5,412 | 6,680 | 2,535 | 265,123 | 0.1 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 32,900 | 35,100 | 2,316 | 242,270 | 0.1 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 6,060 | 6,300 | 1,385 | 144,868 | 0.0 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 10,400 | 12,000 | 1,047 | 109,583 | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 6,200 | 6,520 | 1,024 | 107,113 | 0.0 |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 52,200 | 54,400 | 1,563 | 163,506 | 0.1 |
| HCP INC | 42,400 | 45,600 | 1,596 | 166,957 | 0.1 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 67,400 | 73,900 | 1,230 | 128,678 | 0.0 |
| IRON MOUNTAIN INC | 19,000 | 24,400 | 932 | 97,553 | 0.0 |
| KIMCO REALTY CORP | 36,900 | 40,500 | 1,201 | 125,624 | 0.0 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 13,300 | 14,300 | 560 | 58,578 | 0.0 |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 口数 | 口数 | 評価額 | | 比率 |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| MACERICH CO /THE | | 12,100 | 12,300 | 1,002 | 104,861 | 0.0 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | | — | 7,200 | 732 | 76,622 | 0.0 |
| PLUM CREEK TIMBER CO | | 15,800 | — | — | — | — |
| PROLOGIS INC | | 48,000 | 50,700 | 2,533 | 264,951 | 0.1 |
| PUBLIC STORAGE | | 13,320 | 14,240 | 3,433 | 359,080 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | | 21,400 | 23,800 | 1,531 | 160,117 | 0.1 |
| REGENCY CENTERS CORP | | 8,800 | 9,400 | 743 | 77,788 | 0.0 |
| SL GREEN REALTY CORP | | 8,900 | 9,800 | 1,001 | 104,732 | 0.0 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | | 28,170 | 29,970 | 6,246 | 653,274 | 0.2 |
| UDR INC | | 24,100 | 25,700 | 904 | 94,580 | 0.0 |
| VENTAS INC | | 30,000 | 32,500 | 2,271 | 237,511 | 0.1 |
| VEREIT INC | | 81,000 | 84,000 | 825 | 86,353 | 0.0 |
| VORNADO REALTY TRUST | | 15,500 | 16,600 | 1,618 | 169,262 | 0.1 |
| WELLTOWER INC | | 32,100 | 34,500 | 2,533 | 264,936 | 0.1 |
| WEYERHAEUSER CO | | 46,600 | 76,000 | 2,172 | 227,156 | 0.1 |
| HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST | | 509,000 | 509,000 | 223 | 23,421 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 1,465,952 | 1,564,640 | 60,818 | 6,360,431 | |
| | 銘柄数<比率> | 36 | 37 | — | <2.1%> | |
| (カナダ) | | | | 千カナダドル | | |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | | 13,600 | 13,600 | 289 | 23,651 | 0.0 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | | 14,400 | 14,400 | 404 | 33,034 | 0.0 |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | 4,800 | 6,900 | 252 | 20,581 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 32,800 | 34,900 | 946 | 77,267 | |
| | 銘柄数<比率> | 3 | 3 | — | <0.0%> | |
| (イギリス) | | | | 千英ポンド | | |
| BRITISH LAND | | 89,000 | 94,000 | 703 | 107,858 | 0.0 |
| HAMMERSON PLC | | 73,000 | 73,000 | 423 | 64,893 | 0.0 |
| INTU PROPERTIES PLC | | 88,000 | 88,000 | 271 | 41,618 | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 70,600 | 77,500 | 918 | 140,878 | 0.0 |
| SEGRO PLC | | 70,000 | 70,000 | 315 | 48,439 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 390,600 | 402,500 | 2,631 | 403,688 | |
| | 銘柄数<比率> | 5 | 5 | — | <0.1%> | |
| (ユーロ…フランス) | | | | 千ユーロ | | |
| ICADE | | 3,000 | 3,700 | 238 | 28,039 | 0.0 |
| KLEPIERRE | | 20,000 | 21,200 | 851 | 100,109 | 0.0 |
| GECINA SA | | 2,970 | 4,000 | 506 | 59,530 | 0.0 |
| FONCIERE DES REGIONS | | 2,500 | 3,100 | 247 | 29,065 | 0.0 |
| UNIBAIL RODAMCO-NA | | 8,910 | 9,600 | 2,316 | 272,265 | 0.1 |
| ユーロ計 | 口数・金額 | 37,380 | 41,600 | 4,161 | 489,011 | |
| | 銘柄数<比率> | 5 | 5 | — | <0.2%> | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| LINK REIT | | 210,000 | 219,000 | 11,070 | 149,229 | 0.0 |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | | 210,000 | 260,000 | 1,801 | 24,288 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 420,000 | 479,000 | 12,872 | 173,517 | |
| | 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 | | 219,900 | 249,900 | 504 | 39,298 | 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 | % |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | | 187,000 | 213,000 | 494 | 38,470 | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | | 192,000 | 192,000 | 271 | 21,150 | 0.0 |
| SUNTEC REIT | | 203,000 | 243,000 | 408 | 31,781 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 801,900 | 897,900 | 1,678 | 130,700 | |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 4 | － | <0.0%> | |
| (オーストラリア) | | | | 千豪ドル | | |
| MIRVAC GROUP | | 350,000 | 350,000 | 714 | 55,592 | 0.0 |
| GPT GROUP | | 165,000 | 179,000 | 970 | 75,538 | 0.0 |
| LENDLEASE GROUP | | 48,000 | 53,000 | 709 | 55,213 | 0.0 |
| STOCKLAND TRUST GROUP | | 214,000 | 230,000 | 1,081 | 84,166 | 0.0 |
| DEXUS PROPERTY GROUP | | 83,000 | 92,000 | 825 | 64,253 | 0.0 |
| GOODMAN GROUP | | 163,000 | 174,000 | 1,261 | 98,220 | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | | 478,000 | 513,000 | 2,421 | 188,527 | 0.1 |
| WESTFIELD CORP | | 181,000 | 193,000 | 2,068 | 161,089 | 0.1 |
| VICINITY CENTRES | | 306,704 | 328,704 | 1,074 | 83,688 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 1,988,704 | 2,112,704 | 11,126 | 866,289 | |
| | 銘柄数<比率> | 9 | 9 | － | <0.3%> | |
| 合計 | 口数・金額 | 5,137,336 | 5,533,244 | － | 8,500,906 | |
| | 銘柄数<比率> | 64 | 65 | － | <2.8%> | |

＊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。
＊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 |
| | | | 百万円 | 百万円 |
| 外国 | 株式先物取引 | CAN60 | 277 | － |
| | | EURO50 | 878 | － |
| | | FT100 | 589 | － |
| | | SPEMINI | 4,656 | － |
| | | SWISSMKT | 266 | － |

＊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(15,351,086千口)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 | |
| (カタール) | 百株 | 百株 | 千カタールリヤル | 千円 | |
| QATAR INSURANCE CO | 28 | 37 | 271 | 7,809 | 保険 |
| QATAR NATIONAL BANK | 53 | 73 | 1,037 | 29,852 | 銀行 |
| COMMERCIAL BANK OF QATAR | 46 | 56 | 213 | 6,149 | 銀行 |
| OOREDOO QSC | 27 | 27 | 241 | 6,959 | 各種電気通信サービス |
| DOHA BANK LTD | 42 | 42 | 147 | 4,230 | 銀行 |
| QATAR ELECTRICITY & WATER CO | 8 | 8 | 169 | 4,873 | 総合公益事業 |
| INDUSTRIES QATAR | 41 | 50 | 500 | 14,404 | コングロマリット |
| QATAR ISLAMIC BANK | 17 | 21 | 206 | 5,940 | 銀行 |
| QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT | 70 | 96 | 225 | 6,477 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MASRAF AL RAYAN | 113 | 133 | 454 | 13,082 | 銀行 |
| BARWA REAL ESTATE CO | 32 | 32 | 106 | 3,076 | 不動産管理・開発 |
| EZDAN HOLDING GROUP | 253 | 253 | 456 | 13,142 | 不動産管理・開発 |
| VODAFONE QATAR | 99 | 99 | 105 | 3,027 | 無線通信サービス |
| 小計 株数・金額 | 832 | 933 | 4,135 | 119,026 | |
| 小計 銘柄数＜比率＞ | 13 | 13 | － | ＜0.9%＞ | |
| (アメリカ) | | | 千米ドル | | |
| ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR | 150 | 334 | 2,629 | 274,946 | インターネットソフトウェア・サービス |
| BAIDU INC - SPON ADR | 41 | 92 | 1,504 | 157,316 | インターネットソフトウェア・サービス |
| BANCO DE CHILE-ADR | 12 | 12 | 79 | 8,313 | 銀行 |
| BANCO SANTANDER CHILE-ADR | 52 | 52 | 100 | 10,467 | 銀行 |
| BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR | 36 | 36 | 123 | 12,939 | 銀行 |
| CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR | 25 | 25 | 56 | 5,864 | 飲料 |
| CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR | 46 | 66 | 69 | 7,302 | 金属・鉱業 |
| CORPBANCA SA-ADR | 31 | － | － | － | 銀行 |
| CTRIP.COM INTERNATIONAL -ADR | 44 | 112 | 443 | 46,430 | インターネット販売・カタログ販売 |
| ECOPETROL SA-SPONSORED ADR | 70 | 88 | 84 | 8,816 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| EMPRESA NACIONAL DE ELECTRIDAD SA-ADR | 32 | 37 | 99 | 10,362 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ENDESA AMERICAS SA - ADR | － | 37 | 48 | 5,068 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| ENERSIS AMERICAS S.A-ADR | 121 | 135 | 114 | 12,008 | 電力 |
| ENERSIS CHILE SA-ADR | － | 135 | 75 | 7,920 | 電力 |
| 58.COM INC-ADR | 11 | 25 | 113 | 11,869 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ITAU CORPBANCA-ADR | － | 31 | 37 | 3,913 | 銀行 |
| JD.COM INC-ADR | 51 | 228 | 481 | 50,382 | インターネット販売・カタログ販売 |
| STATE BANK OF INDIA-GDR | 47 | 52 | 163 | 17,092 | 銀行 |
| PJSC GAZPROM-ADR | 1,797 | 1,988 | 866 | 90,636 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR | 91 | 109 | 70 | 7,386 | 旅客航空輸送業 |
| TRANSNEFT PFD-CLS | 0.48 | 0.52 | 135 | 14,186 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR | 154 | 176 | 155 | 16,224 | 無線通信サービス |
| NETEASE INC-ADR | 12 | 26 | 431 | 45,074 | インターネットソフトウェア・サービス |
| NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR | 20 | 44 | 178 | 18,654 | 各種消費者サービス |
| SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B | 153 | 275 | 43 | 4,498 | 不動産管理・開発 |
| QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR | 14 | 30 | 220 | 23,069 | インターネットソフトウェア・サービス |
| QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR | 8 | 8 | 21 | 2,244 | インターネット販売・カタログ販売 |
| QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR | 29 | 35 | 84 | 8,814 | 化学 |
| SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR | 37 | 94 | 48 | 5,082 | インターネットソフトウェア・サービス |
| SOUTHERN COPPER CORP | 48 | 26 | 71 | 7,526 | 金属・鉱業 |
| TAL EDUCATION GROUP-ADR | 6 | 14 | 78 | 8,184 | 各種消費者サービス |
| VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS | 60 | 133 | 152 | 15,898 | インターネット販売・カタログ販売 |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| YY INC-ADR | | 4 | 10 | 37 | 3,918 | インターネットソフトウェア・サービス |
| YOUKU TUDOU INC | | 17 | — | — | — | インターネットソフトウェア・サービス |
| SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR | | 440 | 530 | 279 | 29,182 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| AFK SISTEMA-REG S SPONS GDR | | 56 | 56 | 43 | 4,589 | 無線通信サービス |
| NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S | | 27 | 31 | 332 | 34,795 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ROSTELECOM-SPONSORED ADR | | 38 | 38 | 33 | 3,502 | 各種電気通信サービス |
| ROSNEFT OJSC - GDR | | 351 | 392 | 205 | 21,477 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PJSC ALROSA | | 557 | 682 | 77 | 8,144 | 金属・鉱業 |
| SEVERSTAL-GDR REG S | | 65 | 65 | 67 | 7,044 | 金属・鉱業 |
| VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI | | 781 | 873 | 183 | 19,155 | 銀行 |
| DP WORLD LTD | | 45 | 57 | 98 | 10,342 | 運送インフラ |
| PJSC RUSHYDRO | | 38,910 | 38,910 | 37 | 3,869 | 電力 |
| MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS | | 75 | 99 | 308 | 32,250 | 食品・生活必需品小売り |
| PJSC SBERBANK OF RUSSIA | | 3,170 | 3,638 | 757 | 79,180 | 銀行 |
| PHOSAGRO OAO-GDR REG S | | — | 25 | 37 | 3,908 | 化学 |
| PJSC MOSCOW EXCHANGE | | 374 | 374 | 68 | 7,160 | 各種金融サービス |
| MEGAFON PJSC-GDR | | 31 | 31 | 35 | 3,684 | 無線通信サービス |
| PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR | | 175 | 195 | 253 | 26,536 | 金属・鉱業 |
| TATNEFT-SPONSORED ADR | | 73 | 80 | 242 | 25,348 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LUKOIL PJSC-SPON ADR | | 155 | 141 | 575 | 60,140 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CREDICORP LTD | | 21 | 22 | 333 | 34,895 | 銀行 |
| 小計 | 株数・金額 | 48,575 | 50,717 | 12,790 | 1,337,629 | |
| | 銘柄数<比率> | 49 | 51 | — | <9.9%> | |
| (トルコ) | | | | 千トルコリラ | | |
| AKBANK T.A.S | | 693 | 771 | 634 | 22,769 | 銀行 |
| ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYII | | 59 | 59 | 110 | 3,960 | 飲料 |
| ARCELIK A.S | | 63 | 84 | 166 | 5,989 | 家庭用耐久財 |
| ENKA INSAAT VE SANAYI | | 172 | — | — | — | コングロマリット |
| EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | | 464 | 464 | 188 | 6,767 | 金属・鉱業 |
| FORD OTOMOTIVE SANAYI AS | | 23 | 23 | 79 | 2,837 | 自動車 |
| KOC HLDGS | | 199 | 235 | 313 | 11,241 | コングロマリット |
| PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS | | 90 | 205 | 85 | 3,067 | 化学 |
| TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS | | 181 | 181 | 64 | 2,313 | コングロマリット |
| TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA | | 30 | 43 | 104 | 3,763 | 自動車 |
| TURK HAVA YOLLARI AO | | 183 | 183 | 108 | 3,890 | 旅客航空輸送業 |
| TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | | 258 | 305 | 318 | 11,424 | 無線通信サービス |
| TURKIYE GARANTI BANKASI | | 739 | 818 | 632 | 22,704 | 銀行 |
| TURKIYE IS BANKASI AS-C | | 454 | 545 | 246 | 8,851 | 銀行 |
| TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | | 40 | 40 | 254 | 9,148 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ULKER BISKUVI SANAYI AS | | 45 | 45 | 92 | 3,306 | 食品 |
| YAPI VE KREDI BANKASI A.S. | | 250 | 250 | 105 | 3,777 | 銀行 |
| HACI OMER SABANCI HOLDING | | 279 | 334 | 310 | 11,149 | 各種金融サービス |
| COCA-COLA ICECEK AS | | 20 | 20 | 73 | 2,623 | 飲料 |
| BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | | 58 | 71 | 404 | 14,512 | 食品・生活必需品小売り |
| TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D | | 240 | 240 | 111 | 3,988 | 銀行 |
| TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS | | 44 | 44 | 61 | 2,203 | 運送インフラ |
| TURKIYE HALK BANKASI | | 184 | 222 | 203 | 7,304 | 銀行 |
| TURK TELEKOMUNIKASYON AS | | 155 | 155 | 92 | 3,314 | 各種電気通信サービス |
| 小計 | 株数・金額 | 4,931 | 5,346 | 4,763 | 170,913 | |
| | 銘柄数<比率> | 24 | 23 | — | <1.3%> | |
| (ユーロ…ギリシャ) | | | | 千ユーロ | | |
| HELLENIC TELECOM | | 76 | 76 | 64 | 7,551 | 各種電気通信サービス |
| OPAP SA | | 59 | 75 | 51 | 6,085 | ホテル・レストラン・レジャー |
| JUMBO SA | | 31 | 31 | 35 | 4,146 | 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 | |
| (ユーロ…ギリシャ) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| PUBLIC POWER CORP | | 34 | — | — | — | 電力 |
| TITAN CEMENT CO | | 11 | 15 | 31 | 3,668 | 建設資材 |
| FF GROUP | | 8 | 8 | 16 | 1,913 | 専門小売り |
| PIRAEUS BANK S.A. | | 2,006 | 2,006 | 44 | 5,186 | 銀行 |
| EUROBANK ERGASIAS SA | | 555 | 676 | 57 | 6,720 | 銀行 |
| ALPHA BANK A.E. | | 413 | 474 | 103 | 12,200 | 銀行 |
| NATIONAL BANK OF GREECE | | 28 | 1,999 | 52 | 6,157 | 銀行 |
| ユーロ計 | 株数・金額 | 3,226 | 5,364 | 456 | 53,630 | |
| | 銘柄数<比率> | 10 | 9 | — | <0.4%> | |
| (チェコ) | | | | 千チェココルナ | | |
| KOMERCNI BANKA AS | | 4 | 24 | 2,262 | 9,819 | 銀行 |
| O2 CZECH REPUBLIC AS | | 18 | 18 | 401 | 1,742 | 各種電気通信サービス |
| CEZ AS | | 48 | 58 | 2,489 | 10,802 | 電力 |
| 小計 | 株数・金額 | 72 | 101 | 5,153 | 22,364 | |
| | 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 | 22,164 | 8,278 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| OTP BANK NYRT | | 66 | 76 | 52,136 | 19,472 | 銀行 |
| RICHTER GEDEON NYRT | | 46 | 46 | 25,419 | 9,494 | 医薬品 |
| 小計 | 株数・金額 | 124 | 136 | 99,720 | 37,245 | |
| | 銘柄数<比率> | 3 | 3 | — | <0.3%> | |
| (ポーランド) | | | | 千ズロチ | | |
| BANK MILLENNIUM SA | | 190 | 190 | 91 | 2,446 | 銀行 |
| MBANK | | 4 | 4 | 148 | 3,978 | 銀行 |
| BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA | | 8 | 8 | 59 | 1,592 | 銀行 |
| KGHM POLSKA MIEDZ S.A. | | 40 | 48 | 297 | 7,957 | 金属・鉱業 |
| BANK PEKAO SA | | 40 | 45 | 641 | 17,162 | 銀行 |
| ORANGE POLSKA SA | | 217 | 217 | 112 | 3,016 | 各種電気通信サービス |
| POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A. | | 89 | 112 | 776 | 20,762 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LPP SA | | 0.4 | 0.4 | 213 | 5,700 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| BANK ZACHODNI WBK SA | | 10 | 12 | 323 | 8,652 | 銀行 |
| PKO BANK POLSKI SA | | 246 | 306 | 766 | 20,486 | 銀行 |
| CCC SA | | 7 | 7 | 118 | 3,180 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| SYNTHOS SA | | 118 | 181 | 66 | 1,788 | 化学 |
| EUROCASH SA | | 25 | 25 | 116 | 3,118 | 食品・生活必需品小売り |
| GRUPA LOTOS SA | | 25 | 25 | 80 | 2,144 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I | | 587 | 587 | 307 | 8,230 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CYFROWY POLSAT SA | | 62 | 62 | 133 | 3,575 | メディア |
| GRUPA AZOTY SA | | 12 | 15 | 116 | 3,116 | 化学 |
| ENEA SA | | 56 | 56 | 59 | 1,593 | 電力 |
| POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA | | 257 | 299 | 401 | 10,731 | 電力 |
| TAURON POLSKA ENERGIA SA | | 286 | 286 | 76 | 2,037 | 電力 |
| POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE | | 178 | 204 | 632 | 16,918 | 保険 |
| ALIOR BANK SA | | 16 | 16 | 84 | 2,272 | 銀行 |
| ALIOR BANK SA-ALLOTMENT SHS | | — | 12 | 66 | 1,766 | 銀行 |
| ENERGA SA | | 62 | 62 | 61 | 1,638 | 電力 |
| 小計 | 株数・金額 | 2,545 | 2,788 | 5,754 | 153,871 | |
| | 銘柄数<比率> | 23 | 24 | — | <1.1%> | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H | | 450 | 450 | 387 | 5,228 | 金属・鉱業 |
| JIANGSU EXPRESS CO LTD-H | | 360 | 360 | 375 | 5,066 | 運送インフラ |
| CHINA SOUTHERN AIRLINES H | | 500 | 500 | 218 | 2,945 | 旅客航空輸送業 |
| CHINA MOBILE LTD | | 1,865 | 2,075 | 17,959 | 242,089 | 無線通信サービス |
| ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H | | 360 | 450 | 811 | 10,943 | 建設資材 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | |
| DATANG INTERNATIONAL POWER GEN-H | 760 | — | — | — | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD | 170 | 170 | 721 | 9,727 | コングロマリット |
| HUANENG POWER INTL INC-H | 1,260 | 1,460 | 765 | 10,312 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| YANZHOU COAL MINING-H | 460 | 460 | 215 | 2,901 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HENGAN INTL GROUP CO LTD | 230 | 250 | 1,747 | 23,556 | パーソナル用品 |
| HUADIAN POWER INTL CORP-H | 500 | 500 | 182 | 2,453 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CHONGQING CHANGAN AUTOMOBI-B | 268 | 268 | 280 | 3,778 | 自動車 |
| NEW WORLD CHINA LAND LTD | 820 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE | 880 | 1,040 | 818 | 11,033 | 自動車 |
| CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED | 1,280 | 1,520 | 1,010 | 13,625 | 医薬品 |
| CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT | 1,160 | 1,320 | 3,042 | 41,014 | 不動産管理・開発 |
| CHINA RESOURCES LAND LTD | 864 | 944 | 1,673 | 22,559 | 不動産管理・開発 |
| CITIC LTD | 1,370 | 1,520 | 1,693 | 22,825 | コングロマリット |
| BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H | 480 | 480 | 387 | 5,228 | 運送インフラ |
| LENOVO GROUP LTD | 2,040 | 2,460 | 1,163 | 15,685 | コンピュータ・周辺機器 |
| PETROCHINA CO LTD-H | 6,480 | 7,180 | 3,812 | 51,393 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHINA UNICOM HONGKONG LTD | 1,840 | 2,000 | 1,634 | 22,026 | 各種電気通信サービス |
| CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING | 448 | 536 | 766 | 10,331 | 保険 |
| CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H | 7,469 | 8,469 | 4,598 | 61,990 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H | 280 | 280 | 445 | 6,001 | 情報技術サービス |
| ENN ENERGY HOLDINGS LTD | 220 | 260 | 994 | 13,405 | ガス |
| KUNLUN ENERGY COMPANY LTD | 960 | 1,180 | 730 | 9,846 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COSCO PACIFIC LTD | 520 | 520 | 395 | 5,327 | 運送インフラ |
| YUEXIU PROPERTY CO LTD | 1,702 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| CHINA MERCHANTS HLDGS INTL | 380 | 480 | 974 | 13,134 | 運送インフラ |
| ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H | 1,320 | 1,320 | 319 | 4,306 | 金属・鉱業 |
| CHINA EVERBRIGHT LTD | 280 | 280 | 400 | 5,404 | 資本市場 |
| CHINA GAS HOLDINGS LTD | 520 | 520 | 592 | 7,990 | ガス |
| GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT | 1,550 | 1,900 | 790 | 10,654 | 自動車 |
| CHINA RESOURCES GAS GROUP LT | 260 | 320 | 720 | 9,705 | ガス |
| BYD CO LTD-H | 205 | 205 | 943 | 12,711 | 自動車 |
| CHINA TELECOM CORP LTD-H | 4,280 | 4,700 | 1,626 | 21,921 | 各種電気通信サービス |
| CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H | 520 | 520 | 316 | 4,261 | エネルギー設備・サービス |
| SINOTRANS LIMITED-H | 610 | 610 | 195 | 2,639 | 航空貨物・物流サービス |
| CHINA EVERBRIGHT INTL LTD | 810 | 810 | 682 | 9,193 | 商業サービス・用品 |
| GOLDIN PROPERTIES HOLDINGS | 400 | — | — | — | 不動産管理・開発 |
| PICC PROPERTY & CASUALTY -H | 1,162 | 1,562 | 2,166 | 29,198 | 保険 |
| AVICHINA INDUSTRY&TECH-H | 560 | 720 | 378 | 5,105 | 航空宇宙・防衛 |
| CHINA RESOURCES POWER HOLDING | 580 | 700 | 786 | 10,606 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| GREAT WALL MOTOR COMPANY-H | 915 | 1,130 | 731 | 9,855 | 自動車 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO-H | 2,280 | 2,470 | 4,134 | 55,736 | 保険 |
| ZIJIN MINING GROUP CO-H | 1,530 | 2,010 | 480 | 6,475 | 金属・鉱業 |
| SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H | 520 | 520 | 231 | 3,119 | ヘルスケア機器・用品 |
| SEMICONDUCTOR MANUFACTURING | 7,590 | 9,180 | 569 | 7,672 | 半導体・半導体製造装置 |
| WEICHAI POWER CO LTD-H | 264 | 264 | 220 | 2,967 | 機械 |
| SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H | 1,140 | 1,140 | 405 | 5,470 | 化学 |
| SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS | 130 | 130 | 223 | 3,017 | コングロマリット |
| TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO | 580 | 580 | 394 | 5,316 | 食品 |
| TSING TAO BREWERY CO-H | 100 | 100 | 266 | 3,585 | 飲料 |
| GUANGDONG INVESTMENT | 900 | 900 | 990 | 13,345 | 水道 |
| CHINA RESOURCES BEER (HOLDINGS) CO LTD | 380 | 380 | 649 | 8,759 | 飲料 |
| ZHEJIANG EXPRESSWAY-H | 460 | 460 | 322 | 4,340 | 運送インフラ |
| CNOOC LTD | 5,260 | 6,020 | 5,773 | 77,822 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SINO BIOPHARMACEUTICAL | 1,220 | 1,540 | 777 | 10,483 | 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 | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | |
| CHINA SHIPPING CONTAINER-H | 1,130 | 1,130 | 171 | 2,315 | 海運業 |
| CHINA MENGNIU DAIRY CO | 760 | 910 | 1,186 | 15,995 | 食品 |
| PING AN INSURANCE GROUP CO-H | 1,595 | 1,730 | 5,933 | 79,988 | 保険 |
| BEIJING ENTERPRISES WATER GR | 1,250 | 1,510 | 681 | 9,180 | 水道 |
| GOME ELECTRICAL APPLIANCES | 3,833 | 3,833 | 368 | 4,960 | 専門小売り |
| CHINA POWER INTERNATIONAL | 890 | 1,150 | 335 | 4,526 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AIR CHINA LIMITED-H | 540 | 540 | 287 | 3,879 | 旅客航空輸送業 |
| ZTE CORP-H | 234 | 234 | 230 | 3,101 | 通信機器 |
| SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H | 880 | 880 | 288 | 3,890 | 電気設備 |
| CHINA SHENHUA ENERGY CO - H | 1,065 | 1,185 | 1,533 | 20,670 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHINA COSCO HOLDINGS - H | 760 | 760 | 203 | 2,745 | 海運業 |
| BANK OF COMMUNICATIONS CO-H | 2,787 | 3,147 | 1,586 | 21,386 | 銀行 |
| CHINA STATE CONSTRUCTION INT | 560 | 560 | 571 | 7,699 | 建設・土木 |
| CHINA CONSTRUCTION BANK-H | 25,550 | 28,480 | 14,809 | 199,633 | 銀行 |
| SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP | 170 | 210 | 799 | 10,771 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H | 900 | 900 | 733 | 9,887 | 自動車 |
| NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS | 410 | 570 | 320 | 4,318 | 紙製品・林産品 |
| CHINA NATIONAL BUILDING MA-H | 770 | 1,070 | 364 | 4,918 | 建設資材 |
| BANK OF CHINA LTD-H | 24,220 | 26,600 | 8,059 | 108,646 | 銀行 |
| SHUI ON LAND LTD | 866 | 1,261 | 242 | 3,265 | 不動産管理・開発 |
| SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD | 420 | 420 | 401 | 5,418 | 不動産管理・開発 |
| GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H | 276 | 276 | 292 | 3,943 | 不動産管理・開発 |
| CHINA MERCHANTS BANK-H | 1,426 | 1,291 | 2,082 | 28,073 | 銀行 |
| IND & COMM BK OF CHINA-H | 22,450 | 25,040 | 10,742 | 144,804 | 銀行 |
| CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H | 604 | 864 | 340 | 4,588 | 各種電気通信サービス |
| CHINA COMMUNICATIONS CONST-H | 1,410 | 1,600 | 1,372 | 18,505 | 建設・土木 |
| CHINA COAL ENERGY CO-H | 880 | 880 | 328 | 4,424 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS | 160 | 230 | 310 | 4,179 | 機械 |
| ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H | 150 | 180 | 788 | 10,627 | 電気設備 |
| HAIER ELECTRONICS GROUP CO | 420 | 420 | 481 | 6,488 | 家庭用耐久財 |
| COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO | 1,543 | 1,933 | 603 | 8,133 | 不動産管理・開発 |
| CHINA CITIC BANK-H | 2,290 | 3,210 | 1,492 | 20,120 | 銀行 |
| BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS | 1,380 | 2,100 | 900 | 12,144 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | 320 | 320 | 463 | 6,246 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FOSUN INTERNATIONAL LIMITED | 639 | 784 | 800 | 10,785 | コングロマリット |
| CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD | 920 | 1,280 | 266 | 3,588 | 不動産管理・開発 |
| SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD | 1,015 | 1,015 | 323 | 4,364 | 不動産管理・開発 |
| SOHO CHINA LTD | 655 | 655 | 235 | 3,169 | 不動産管理・開発 |
| KINGSOFT CORP LTD | 270 | 270 | 394 | 5,313 | ソフトウェア |
| GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD | 3,410 | 4,092 | 417 | 5,626 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHINA RAILWAY GROUP LTD-H | 1,210 | 1,480 | 858 | 11,571 | 建設・土木 |
| CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H | 595 | 595 | 567 | 7,651 | 建設・土木 |
| WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | 1,640 | 1,960 | 1,029 | 13,870 | 食品 |
| CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H | 764 | 906 | 2,319 | 31,264 | 保険 |
| EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP | 1,180 | 1,470 | 712 | 9,610 | 不動産管理・開発 |
| CRRC CORP LTD-H | 1,353 | 1,533 | 1,056 | 14,242 | 機械 |
| SUN ART RETAIL GROUP LTD | 720 | 720 | 352 | 4,755 | 食品・生活必需品小売り |
| SINOPHARM GROUP CO-H | 380 | 428 | 1,521 | 20,510 | 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 | 709 | 9,566 | 自動車 |
| CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H | 680 | 680 | 267 | 3,611 | 銀行 |
| CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H | 1,000 | 1,000 | 605 | 8,155 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H | 185 | 241 | 410 | 5,529 | 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 | 1,120 | 285 | 3,849 | 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 |

| 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 | |
| SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | 520 | 520 | 241 | 3,259 | 不動産管理・開発 |
| LONGFOR PROPERTIES | 400 | 500 | 495 | 6,679 | 不動産管理・開発 |
| NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H | 257 | 257 | 690 | 9,301 | 保険 |
| CHINA MINSHENG BANKING-H | 1,810 | 2,030 | 1,502 | 20,249 | 銀行 |
| CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H | 960 | 960 | 324 | 4,373 | 銀行 |
| AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H | 6,950 | 8,110 | 2,376 | 32,031 | 銀行 |
| FAR EAST HORIZON LTD | 580 | 580 | 346 | 4,675 | 各種金融サービス |
| CITIC SECURITIES CO LTD-H | 605 | 715 | 1,199 | 16,172 | 資本市場 |
| CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING | 360 | 360 | 397 | 5,357 | 医薬品 |
| HAITONG SECURITIES CO LTD-H | 972 | 1,092 | 1,375 | 18,547 | 資本市場 |
| AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | 235 | 265 | 1,779 | 23,987 | 電子装置・機器・部品 |
| CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS -H | 136 | — | — | — | 機械 |
| PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H | 2,190 | 2,190 | 676 | 9,122 | 保険 |
| SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H | 130 | 130 | 244 | 3,291 | 医薬品 |
| SINOPEC ENGINEERING GROUP-H | 325 | 325 | 230 | 3,106 | 建設・土木 |
| CHINA GALAXY SECURITIES CO-H | 945 | 1,140 | 739 | 9,973 | 資本市場 |
| CHINA HUISHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD | 2,020 | 1,440 | 455 | 6,133 | 食品 |
| CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H | 2,930 | 2,930 | 761 | 10,269 | 資本市場 |
| CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS | 390 | 495 | 752 | 10,142 | 機械 |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 1,566 | 1,903 | 32,902 | 443,530 | インターネットソフトウェア・サービス |
| CHINA VANKE CO LTD-H | 441 | 441 | 749 | 10,105 | 不動産管理・開発 |
| LUYE PHARMA GROUP LTD | 370 | 370 | 174 | 2,349 | 医薬品 |
| ALIBABA PICTURES GROUP LTD | 3,400 | 3,400 | 608 | 8,203 | メディア |
| CAR INC | 250 | — | — | — | 陸運・鉄道 |
| HANERGY THIN FILM POWER GROUP LTD | 3,670 | 3,670 | 78 | 1,063 | 半導体・半導体製造装置 |
| ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT | 700 | 1,080 | 606 | 8,181 | 各種電気通信サービス |
| CGN POWER CO LTD-H | 2,590 | 3,920 | 842 | 11,360 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| DALIAN WANDA COMMERCIAL PROP | 194 | 194 | 965 | 13,010 | 不動産管理・開発 |
| GF SECURITIES CO LTD-H | 408 | 496 | 882 | 11,901 | 資本市場 |
| HUATAI SECURITIES CO LTD-H | 310 | 464 | 737 | 9,945 | 資本市場 |
| 3SBIO,INC | — | 335 | 252 | 3,409 | バイオテクノロジー |
| IMPERIAL PACIFIC INTERNATIONAL HOLDINGS | 16,800 | — | — | — | 食品 |
| 小計 株数・金額 | 248,557 | 254,834 | 199,729 | 2,692,354 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 144 | 137 | — | <20.0%> | |
| **(マレーシア)** | | | 千リンギ | | |
| AMMB HOLDING | 657 | 657 | 291 | 7,558 | 銀行 |
| GENTING PLANTATIONS BHD | 56 | 85 | 89 | 2,312 | 食品 |
| CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD | 1,637 | 880 | 378 | 9,804 | 銀行 |
| DIGI.COM BERHAD | 1,112 | 1,112 | 520 | 13,483 | 無線通信サービス |
| MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD | 243 | 243 | 160 | 4,159 | 運送インフラ |
| RHB CAPITAL BHD | 170 | 170 | 103 | 2,693 | 銀行 |
| HAP SENG CONSOLIDATED | 168 | 168 | 128 | 3,321 | コングロマリット |
| BERJAYA SPORTS TOTO BHD | 173 | 173 | 50 | 1,300 | ホテル・レストラン・レジャー |
| GAMUDA BERHAD | 523 | 523 | 253 | 6,572 | 建設・土木 |
| YTL CORPORATION | 1,242 | 1,573 | 261 | 6,766 | 総合公益事業 |
| HONG LEONG FINANCIAL GROUP | 63 | 63 | 89 | 2,306 | 銀行 |
| HONG LEONG BANK | 201 | 201 | 267 | 6,926 | 銀行 |
| IJM CORP | 1,017 | 1,017 | 347 | 9,011 | 建設・土木 |
| KUALA LUMPUR KEPONG | 134 | 134 | 309 | 8,013 | 食品 |
| MALAYAN BANKING | 1,376 | 1,211 | 995 | 25,791 | 銀行 |
| LAFARGE MALAYSIA BHD | 129 | 129 | 101 | 2,640 | 建設資材 |
| ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD | 295 | 395 | 162 | 4,206 | 銀行 |
| MISC BHD | 348 | 348 | 257 | 6,674 | 海運業 |
| PPB GROUP BERHAD | 149 | 149 | 244 | 6,339 | 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 | |
| (マレーシア) | 百株 | 百株 | 千リンギ | 千円 | |
| PETRONAS DAGANGAN BHD | 83 | 83 | 195 | 5,053 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PETRONAS GAS BERHAD | 214 | 251 | 545 | 14,138 | ガス |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD | 36 | 45 | 225 | 5,829 | タバコ |
| TELEKOM MALAYSIA | 324 | 401 | 271 | 7,044 | 各種電気通信サービス |
| TENAGA NASIONAL | 981 | 1,129 | 1,580 | 40,953 | 電力 |
| UMW HOLDINGS BHD | 152 | 213 | 120 | 3,118 | 自動車 |
| DIALOG GROUP BHD | 1,231 | 1,231 | 190 | 4,945 | 建設・土木 |
| PUBLIC BANK BHD | 786 | 940 | 1,809 | 46,889 | 銀行 |
| YTL POWER INTL | 431 | 720 | 105 | 2,726 | 総合公益事業 |
| AIRASIA BHD | 269 | 456 | 120 | 3,119 | 旅客航空輸送業 |
| GENTING BHD | 721 | 813 | 667 | 17,294 | ホテル・レストラン・レジャー |
| GENTING MALAYSIA BHD | 784 | 1,004 | 440 | 11,419 | ホテル・レストラン・レジャー |
| IOI CORP | 965 | 750 | 326 | 8,453 | 食品 |
| SIME DARBY BERHAD | 929 | 775 | 582 | 15,100 | コングロマリット |
| HARTALEGA HOLDINGS BHD | 197 | 197 | 81 | 2,113 | ヘルスケア機器・用品 |
| AXIATA GROUP BERHAD | 749 | 882 | 483 | 12,523 | 無線通信サービス |
| BUMI ARMADA BERHAD | 470 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| MAXIS BHD | 534 | 634 | 367 | 9,511 | 無線通信サービス |
| PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD | 841 | 796 | 512 | 13,282 | 化学 |
| SAPURAKENCANA PETROLEUM BHD | 932 | 1,173 | 166 | 4,315 | エネルギー設備・サービス |
| ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD | 500 | 500 | 145 | 3,756 | メディア |
| IHH HEALTHCARE BHD | 783 | 904 | 588 | 15,248 | 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 | 59 | 1,530 | 食品 |
| WESTPORTS HOLDINGS BHD | 332 | 332 | 142 | 3,681 | 運送インフラ |
| IOI PROPERTIES GROUP BHD | 401 | 564 | 132 | 3,436 | 不動産管理・開発 |
| 小計 株数・金額 | 23,728 | 24,414 | 14,873 | 385,366 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 44 | 43 | — | <2.9%> | |
| (タイ) | | | 千バーツ | | |
| BANGKOK BANK(F) | 75 | 75 | 1,188 | 3,530 | 銀行 |
| KRUNG THAI BANK-NVDR | 1,172 | 1,172 | 1,934 | 5,745 | 銀行 |
| ROBINSON DEPT STORE-NVDR | — | 166 | 1,112 | 3,303 | 複合小売り |
| SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR | 479 | 524 | 6,969 | 20,698 | 銀行 |
| TRUE CORP PCL-NVDR | 2,757 | 3,739 | 2,710 | 8,051 | 各種電気通信サービス |
| KASIKORNBANK PCL-NVDR | 149 | 195 | 3,198 | 9,498 | 銀行 |
| TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR | 4,404 | 4,404 | 960 | 2,851 | 銀行 |
| IRPC PCL - NVDR | 2,502 | 3,392 | 1,628 | 4,835 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR | 286 | 429 | 592 | 1,758 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR | — | 44 | 825 | 2,450 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR | 963 | 963 | 2,768 | 8,222 | 食品 |
| ADVANCED INFO SERVICE-NVDR | 310 | 350 | 5,512 | 16,372 | 無線通信サービス |
| HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR | 903 | 1,350 | 1,317 | 3,912 | 専門小売り |
| DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR | 151 | 151 | 1,030 | 3,060 | 電子装置・機器・部品 |
| PTT PCL-NVDR | 317 | 317 | 10,112 | 30,033 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| THAI UNION GROUP PCL-NVDR | 577 | 577 | 1,286 | 3,821 | 食品 |
| SIAM CEMENT PUBLIC (F) | 87 | 101 | 4,807 | 14,278 | 建設資材 |
| SIAM CEMENT PCL-NVDR | 31 | 40 | 1,904 | 5,654 | 建設資材 |
| BEC WORLD PCL NVDR | 276 | 276 | 673 | 2,000 | メディア |
| AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR | 127 | 144 | 5,558 | 16,508 | 運送インフラ |
| KASIKORNBANK PCL(F) | 365 | 401 | 6,716 | 19,948 | 銀行 |
| CENTRAL PATTANA PCL-NVDR | 420 | 420 | 2,509 | 7,453 | 不動産管理・開発 |
| BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR | 1,217 | 1,436 | 3,432 | 10,193 | 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 | 132 | 2,415 | 7,174 | 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 | 2,504 | 7,436 | ホテル・レストラン・レジャー |
| THAI OIL PCL-NVDR | 251 | 251 | 1,499 | 4,454 | 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 | |
| (タイ) | 百株 | 百株 | 千バーツ | 千円 | |
| GLOW ENERGY PCL - NVDR | 137 | 187 | 1,575 | 4,679 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CP ALL PCL-NVDR | 1,367 | 1,750 | 8,575 | 25,467 | 食品・生活必需品小売り |
| BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR | 1,808 | 1,808 | 1,654 | 4,913 | 陸運・鉄道 |
| PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR | 461 | 461 | 3,803 | 11,295 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INDORAMA VENTURES PCL-NVDR | 360 | 535 | 1,754 | 5,210 | 化学 |
| PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR | 621 | 731 | 4,300 | 12,771 | 化学 |
| ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR | 363 | 363 | 769 | 2,285 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR | — | 2,000 | 1,270 | 3,771 | 運送インフラ |
| 小計 株数・金額 | 23,543 | 29,513 | 98,869 | 293,643 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 31 | 34 | — | <2.2%> | |
| (フィリピン) | | | 千フィリピンペソ | | |
| AYALA LAND LTD | 2,354 | 2,639 | 10,450 | 23,617 | 不動産管理・開発 |
| ABOITIZ EQUITY VENTURES INC | 544 | 666 | 5,001 | 11,303 | コングロマリット |
| BANK OF PHILIPPINE ISLANDS | 210 | 272 | 2,648 | 5,985 | 銀行 |
| ALLIANCE GLOBAL GROUP INC | 546 | 546 | 862 | 1,949 | コングロマリット |
| DMCI HOLDINGS INC | 1,275 | 1,275 | 1,644 | 3,717 | コングロマリット |
| GLOBE TELECOM INC | 10 | 10 | 2,433 | 5,499 | 無線通信サービス |
| INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS | 130 | 130 | 793 | 1,792 | 運送インフラ |
| JG SUMMIT HOLDINGS INC | 747 | 869 | 7,456 | 16,850 | コングロマリット |
| JOLLIBEE FOODS CORPORATION | 127 | 156 | 3,588 | 8,108 | ホテル・レストラン・レジャー |
| METROPOLITAN BANK & TRUST | 85 | 215 | 1,917 | 4,333 | 銀行 |
| MEGAWORLD CORP | 3,740 | 3,740 | 1,686 | 3,812 | 不動産管理・開発 |
| PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO. | 29 | 33 | 7,080 | 16,002 | 無線通信サービス |
| ROBINSONS LAND CO | 491 | 491 | 1,495 | 3,378 | 不動産管理・開発 |
| SECURITY BANK CORP | — | 160 | 3,248 | 7,340 | 銀行 |
| SM PRIME HLDGS | 2,641 | 2,641 | 6,815 | 15,403 | 不動産管理・開発 |
| UNIVERSAL ROBINA CORP | 281 | 281 | 5,777 | 13,056 | 食品 |
| SM INVESTMENTS CORP | 53 | 53 | 5,368 | 12,132 | コングロマリット |
| AYALA CORPORATION | 58 | 89 | 7,600 | 17,177 | 各種金融サービス |
| ENERGY DEVELOPMENT CORPORATION | 2,635 | 3,415 | 1,833 | 4,144 | 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 | 2,997 | 6,774 | 各種金融サービス |
| ABOITIZ POWER CORP | 406 | 536 | 2,513 | 5,681 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| BDO UNIBANK INC | 481 | 571 | 6,287 | 14,209 | 銀行 |
| GT CAPITAL HOLDINGS INC | 24 | 24 | 3,690 | 8,339 | 各種金融サービス |
| 小計 株数・金額 | 21,209 | 23,154 | 93,191 | 210,613 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 22 | 23 | — | <1.6%> | |
| (インドネシア) | | | 千ルピア | | |
| AKR CORPORINDO TBK PT | 533 | 533 | 326,462 | 2,579 | 商社・流通業 |
| ASTRA AGRO LESTARI TBK PT | 105 | — | — | — | 食品 |
| UNITED TRACTORS TBK PT | 506 | 506 | 677,443 | 5,351 | 機械 |
| INDOFOOD SUKSES MAK TBK | 1,457 | 1,457 | 1,019,900 | 8,057 | 食品 |
| PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA | 2,010 | 2,557 | 984,445 | 7,777 | 食品 |
| GUDANG GARAM TBK | 160 | 160 | 1,060,000 | 8,374 | タバコ |
| HM SAMPOERNA TBK PT | 115 | 3,400 | 1,288,600 | 10,179 | タバコ |
| INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA | 456 | 456 | 736,440 | 5,817 | 建設資材 |
| SUMMARECON AGUNG TBK PT | 3,233 | 3,233 | 569,008 | 4,495 | 不動産管理・開発 |
| BANK DANAMON PT | 846 | 1,251 | 440,689 | 3,481 | 銀行 |
| BANK MANDIRI | 2,868 | 3,088 | 2,779,200 | 21,955 | 銀行 |
| MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK | 726 | 774 | 1,542,195 | 12,183 | 複合小売り |
| UNILEVER INDONESIA TBK PT | 467 | 517 | 2,264,460 | 17,889 | 家庭用品 |
| BANK RAKYAT INDONESIA | 3,375 | 3,819 | 3,971,760 | 31,376 | 銀行 |
| PERUSAHAAN GAS NEGARA PT | 3,658 | 3,658 | 866,946 | 6,848 | ガス |
| BANK NEGARA INDONESIA PT | 1,947 | 2,527 | 1,225,595 | 9,682 | 銀行 |
| SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT | 756 | 1,016 | 919,480 | 7,263 | 建設資材 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (インドネシア) | 百株 | 百株 | 千ルピア | 千円 | |
| BANK CENTRAL ASIA | 3,586 | 4,094 | 5,250,555 | 41,479 | 銀行 |
| XL AXIATA TBK PT | 862 | 1,382 | 525,160 | 4,148 | 無線通信サービス |
| LIPPO KARAWACI TBK PT | 5,925 | 5,925 | 607,312 | 4,797 | 不動産管理・開発 |
| GLOBAL MEDIACOM TBK PT | 1,525 | 2,587 | 247,058 | 1,951 | メディア |
| MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT | 1,465 | 1,465 | 326,695 | 2,580 | メディア |
| JASA MARGA (PERSERO) TBK PT | 692 | 692 | 359,840 | 2,842 | 運送インフラ |
| BUMI SERPONG DAMAI PT | 2,209 | 2,209 | 461,681 | 3,647 | 不動産管理・開発 |
| ADARO ENERGY PT | 3,595 | 5,337 | 450,976 | 3,562 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T | 353 | 353 | 601,865 | 4,754 | 食品 |
| TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE | 567 | 887 | 589,855 | 4,659 | 無線通信サービス |
| KALBE FARMA PT | 6,340 | 7,685 | 1,068,215 | 8,438 | 医薬品 |
| WASKITA KARYA PERSERO TBK PT | — | 1,575 | 389,025 | 3,073 | 建設・土木 |
| PT ASTRA INTERNATIONAL TBK | 6,202 | 6,711 | 4,529,925 | 35,786 | 自動車 |
| SURYA CITRA MEDIA PT TBK | 1,961 | 1,961 | 653,013 | 5,158 | メディア |
| TELEKOMUNIKASI | 15,692 | 17,389 | 6,729,543 | 53,163 | 各種電気通信サービス |
| 小計 株数・金額 | 74,193 | 89,205 | 43,463,344 | 343,360 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 31 | 31 | — | <2.6%> | |
| (韓国) | | | 千ウォン | | |
| CHEIL WORLDWIDE INC | 22 | 22 | 37,744 | 3,415 | メディア |
| HANMI SCIENCE CO LTD | 3 | 3 | 52,080 | 4,713 | 医薬品 |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD | 11 | 13 | 133,196 | 12,054 | 自動車 |
| SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE | 11 | 11 | 298,100 | 26,978 | 保険 |
| DONGBU INSURANCE CO LTD | 12 | 14 | 103,156 | 9,335 | 保険 |
| COWAY CO LTD | 17 | 19 | 207,675 | 18,794 | 家庭用耐久財 |
| KT & G CORP | 33 | 38 | 485,775 | 43,962 | タバコ |
| S-1 CORPORATION | 6 | 6 | 65,720 | 5,947 | 商業サービス・用品 |
| KOREA GAS CORPORATION | 6 | 6 | 27,785 | 2,514 | ガス |
| CJ CORP | 4 | 4 | 92,976 | 8,414 | コングロマリット |
| KAKAO CORP | 9 | 9 | 90,986 | 8,234 | インターネットソフトウェア・サービス |
| SK TELECOM CO LTD | 3 | 6 | 134,080 | 12,134 | 無線通信サービス |
| DAELIM INDUSTRIAL COMPANY | 9 | 9 | 75,200 | 6,805 | 建設・土木 |
| MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD | 55 | 55 | 43,813 | 3,965 | 資本市場 |
| NCSOFT CORPORATION | 4 | 6 | 135,000 | 12,217 | ソフトウェア |
| LG UPLUS CORP | 68 | 68 | 75,199 | 6,805 | 各種電気通信サービス |
| DOOSAN HEAVY INDUSTRIES | 17 | 17 | 37,170 | 3,363 | 電気設備 |
| DAEWOO ENGINEERING & CONSTR | 27 | 27 | 16,149 | 1,461 | 建設・土木 |
| POSCO DAEWOO CORP | 11 | 11 | 27,835 | 2,519 | 商社・流通業 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE | 2 | 3 | 335,265 | 30,341 | パーソナル用品 |
| LG CHEMICALS LTD | 13 | 15 | 398,095 | 36,027 | 化学 |
| LG CHEM LTD - PREFERRED | 2 | 2 | 50,690 | 4,587 | 化学 |
| LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF | — | 0.7 | 44,450 | 4,022 | パーソナル用品 |
| SHINHAN FINANCIAL GROUP | 125 | 141 | 542,976 | 49,139 | 銀行 |
| HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY | 18 | 18 | 73,848 | 6,683 | 建設・土木 |
| S-OIL CORPORATION | 13 | 16 | 123,391 | 11,166 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HANWHA CHEMICAL CORP | 33 | 33 | 81,260 | 7,354 | 化学 |
| SAMSUNG SECURITIES | 18 | 18 | 65,845 | 5,959 | 資本市場 |
| LOTTE CHEMICAL CORPORATION | 5 | 5 | 141,270 | 12,784 | 化学 |
| HOTEL SHILLA CO LTD | 9 | 12 | 78,370 | 7,092 | 専門小売り |
| HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES | 11 | 14 | 151,181 | 13,681 | 機械 |
| HYUNDAI MOBIS | 21 | 23 | 616,770 | 55,817 | 自動車部品 |
| SK HYNIX INC | 170 | 192 | 574,246 | 51,969 | 半導体・半導体製造装置 |
| HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR | 25 | 25 | 81,125 | 7,341 | 建設・土木 |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD | 8 | 8 | 79,218 | 7,169 | 自動車 |
| HYUNDAI MOTOR CO LTD | 47 | 47 | 655,500 | 59,322 | 自動車 |

| 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 | |
| HYUNDAI STEEL CO | 24 | 28 | 136,649 | 12,366 | 金属・鉱業 |
| INDUSTRIAL BK OF KOREA | 85 | 85 | 98,325 | 8,898 | 銀行 |
| KCC CORP | 1 | 1 | 67,287 | 6,089 | 建設関連製品 |
| KIA MOTORS CORP | 76 | 90 | 398,700 | 36,082 | 自動車 |
| KOREA ZINC CO LTD | 2 | 3 | 153,140 | 13,859 | 金属・鉱業 |
| KOREA ELECTRIC POWER | 77 | 87 | 511,578 | 46,297 | 電力 |
| HANWHA CORPORATION | 14 | 14 | 52,010 | 4,706 | コングロマリット |
| KOREAN AIR LINES CO LTD | 10 | 10 | 28,321 | 2,563 | 旅客航空輸送業 |
| OCI COMPANY LTD | 4 | 6 | 58,590 | 5,302 | 化学 |
| CJ KOREA EXPRESS CO LTD | 2 | 2 | 43,600 | 3,945 | 陸運・鉄道 |
| KUMHO PETRO CHEMICAL CO | 3 | 6 | 42,239 | 3,822 | 化学 |
| KT CORP | 8 | 8 | 26,268 | 2,377 | 各種電気通信サービス |
| LG ELECTRONICS INC | 29 | 34 | 194,114 | 17,567 | 家庭用耐久財 |
| LOTTE CONFECTIONERY CO LTD | 0.19 | 1 | 36,765 | 3,327 | 食品 |
| LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO | 0.2 | 0.2 | 35,860 | 3,245 | 飲料 |
| HANSSEM CO LTD | 3 | 3 | 50,700 | 4,588 | 家庭用耐久財 |
| LG CORP | 29 | 33 | 209,418 | 18,952 | コングロマリット |
| NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD | 43 | 43 | 40,572 | 3,671 | 資本市場 |
| GS ENGINEERING & CONSTRUCT | 14 | 14 | 39,635 | 3,586 | 建設・土木 |
| NAVER CORP | 8 | 9 | 648,210 | 58,663 | インターネットソフトウェア・サービス |
| PARADISE CO LTD | 12 | 12 | 19,155 | 1,733 | ホテル・レストラン・レジャー |
| HYUNDAI DEPT STORE CO | 4 | 4 | 58,725 | 5,314 | 複合小売り |
| DONGSUH COMPANIES INC | 10 | 10 | 33,481 | 3,030 | 食品・生活必需品小売り |
| KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO | 10 | 13 | 60,743 | 5,497 | 資本市場 |
| OTTOGI CORPORATION | 0.4 | 0.4 | 33,000 | 2,986 | 食品 |
| DOOSAN CORP | 2 | — | — | — | コングロマリット |
| AMOREPACIFIC GROUP | 8 | 10 | 166,260 | 15,046 | パーソナル用品 |
| KANGWON LAND INC | 37 | 42 | 180,194 | 16,307 | ホテル・レストラン・レジャー |
| POSCO | 20 | 23 | 489,405 | 44,291 | 金属・鉱業 |
| SAMSUNG SDI CO,LTD | 17 | 19 | 218,237 | 19,750 | 電子装置・機器・部品 |
| SAMSUNG ELECTRO MECHANICS | 18 | 20 | 104,949 | 9,497 | 電子装置・機器・部品 |
| SAMSUNG ELECTRONICS | 33 | 34 | 4,966,640 | 449,480 | コンピュータ・周辺機器 |
| SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES | 47 | 47 | 43,737 | 3,958 | 機械 |
| SAMSUNG ELECTRONICS PFD | 6 | 6 | 710,650 | 64,313 | コンピュータ・周辺機器 |
| SHINSEGAE CO LTD | 2 | 2 | 44,426 | 4,020 | 複合小売り |
| HYOSUNG CORPORATION | 7 | 7 | 93,555 | 8,466 | 化学 |
| ORION CORP | 1 | 1 | 120,651 | 10,918 | 食品 |
| YUHAN CORPORATION | 2 | 2 | 88,803 | 8,036 | 医薬品 |
| HANON SYSTEMS | 12 | 62 | 69,440 | 6,284 | 自動車部品 |
| HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO | 20 | 20 | 62,712 | 5,675 | 保険 |
| GS HOLDINGS CORP | 17 | 17 | 82,025 | 7,423 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LG.DISPLAY CO LTD | 73 | 84 | 211,763 | 19,164 | 電子装置・機器・部品 |
| SK NETWORKS CO LTD | 23 | 23 | 14,298 | 1,294 | 商社・流通業 |
| CELLTRION INC | 19 | 26 | 254,980 | 23,075 | バイオテクノロジー |
| HANA FINANCIAL HOLDINGS | 83 | 97 | 235,577 | 21,319 | 銀行 |
| HYUNDAI GLOVIS CO LTD | 5 | 6 | 114,400 | 10,353 | 航空貨物・物流サービス |
| MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD | 16 | 26 | 62,181 | 5,627 | 資本市場 |
| LOTTE SHOPPING CO | 3 | 3 | 81,315 | 7,359 | 複合小売り |
| SAMSUNG LIFE INSURANCE CO | 25 | 23 | 230,840 | 20,891 | 保険 |
| AMOREPACIFIC CORP | 10 | 10 | 452,520 | 40,953 | パーソナル用品 |
| AMOREPACIFIC CORP-PREF | 3 | 3 | 72,300 | 6,543 | パーソナル用品 |
| SAMSUNG CARD CO | 9 | 9 | 39,837 | 3,605 | 消費者金融 |
| SK INNOVATION CO LTD | 19 | 21 | 297,775 | 26,948 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CJ CHEILJEDANG CORP | 2 | 2 | 99,190 | 8,976 | 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 | |
| (韓国) | 百株 | 百株 | 千ウォン | 千円 | |
| KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD | 6 | 7 | 50,955 | 4,611 | 商業サービス・用品 |
| LG INNOTEK CO LTD | 4 | 4 | 37,260 | 3,372 | 電子装置・機器・部品 |
| SK HOLDINGS CO LTD | 10 | 15 | 325,080 | 29,419 | コングロマリット |
| KB FINANCIAL GROUP INC | 117 | 134 | 450,912 | 40,807 | 銀行 |
| HYUNDAI WIA CORP | 5 | 5 | 49,809 | 4,507 | 自動車部品 |
| KOREA AEROSPACE INDUSTRIES | 13 | 19 | 136,324 | 12,337 | 航空宇宙・防衛 |
| BNK FINANCIAL GROUP INC | 67 | 82 | 70,099 | 6,344 | 銀行 |
| BNK FINANCIAL GROUP INC-RIGHTS | 14 | — | — | — | 銀行 |
| HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD | 1 | 1 | 122,820 | 11,115 | 医薬品 |
| HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD | 61 | 61 | 37,637 | 3,406 | 保険 |
| CJ E&M CORP | 5 | 5 | 41,154 | 3,724 | メディア |
| E-MART CO | 6 | 5 | 101,352 | 9,172 | 食品・生活必需品小売り |
| DGB FINANCIAL GROUP INC | 45 | 62 | 56,859 | 5,145 | 銀行 |
| GS RETAIL CO LTD | 8 | 8 | 41,715 | 3,775 | 食品・生活必需品小売り |
| HANKOOK TIRE CO LTD/NEW | 22 | 27 | 140,285 | 12,695 | 自動車部品 |
| BGF RETAIL CO LTD | 2 | 3 | 78,440 | 7,098 | 食品・生活必需品小売り |
| SAMSUNG SDS CO LTD | 9 | 12 | 183,610 | 16,616 | 情報技術サービス |
| WOORI BANK | 111 | 111 | 113,578 | 10,278 | 銀行 |
| SAMSUNG C&T CORP | 23 | 26 | 324,162 | 29,336 | コングロマリット |
| 小計 株数・金額 | 2,426 | 2,711 | 21,280,948 | 1,925,925 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 108 | 107 | — | <14.3%> | |
| (台湾) | | | 千新台湾ドル | | |
| ACER INC | 917 | 917 | 1,417 | 4,607 | コンピュータ・周辺機器 |
| ASUSTEK COMPUTER INC | 218 | 238 | 6,701 | 21,778 | コンピュータ・周辺機器 |
| REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | 154 | 154 | 1,504 | 4,890 | 半導体・半導体製造装置 |
| ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC | 1,796 | 2,256 | 8,110 | 26,360 | 半導体・半導体製造装置 |
| ASIA CEMENT | 729 | 729 | 2,039 | 6,629 | 建設資材 |
| TAIWAN BUSINESS BANK | 1,118 | 1,118 | 924 | 3,005 | 銀行 |
| TAIWAN FERTILIZER CO LTD | 230 | 230 | 990 | 3,217 | 化学 |
| VANGUARD INTERNATIONAL SEMI | 250 | 250 | 1,320 | 4,290 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHICONY ELECTRONICS CO LTD | 142 | 142 | 1,106 | 3,596 | コンピュータ・周辺機器 |
| QUANTA COMPUTER INC | 876 | 876 | 5,182 | 16,841 | コンピュータ・周辺機器 |
| HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP | 191 | 281 | 1,475 | 4,796 | 不動産管理・開発 |
| EVA AIRWAYS CORP | 567 | 567 | 820 | 2,667 | 旅客航空輸送業 |
| CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | 208 | 208 | 5,084 | 16,526 | コンピュータ・周辺機器 |
| CHANG HWA COMMERCIAL BANK | 1,323 | 1,653 | 2,786 | 9,055 | 銀行 |
| CHINA AIRLINES | 795 | 795 | 799 | 2,598 | 旅客航空輸送業 |
| CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD | 530 | 630 | 4,280 | 13,910 | 自動車部品 |
| CHINA STEEL | 3,585 | 3,945 | 8,305 | 26,991 | 金属・鉱業 |
| CHINA LIFE INSURANCE CO LTD | 972 | 972 | 2,461 | 7,998 | 保険 |
| ADVANTECH CO.,LTD. | 102 | 102 | 2,572 | 8,359 | コンピュータ・周辺機器 |
| COMPAL ELECTRONICS | 1,285 | 1,575 | 3,175 | 10,320 | コンピュータ・周辺機器 |
| DELTA ELECTRONICS INC | 526 | 676 | 10,287 | 33,434 | 電子装置・機器・部品 |
| DELTA ELECTRONICS INC - RIGHTS | 30 | — | — | — | 電子装置・機器・部品 |
| NANYA TECHNOLOGY CO | — | 230 | 886 | 2,881 | 半導体・半導体製造装置 |
| CHUNGHWA TELECOM CO LTD | 1,180 | 1,310 | 14,810 | 48,133 | 各種電気通信サービス |
| AU OPTRONICS CORP | 2,620 | 2,620 | 2,441 | 7,936 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN MOBILE CO LTD | 522 | 592 | 6,748 | 21,933 | 無線通信サービス |
| EVERGREEN MARINE | 447 | 447 | 539 | 1,752 | 海運業 |
| FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION | 924 | 1,144 | 2,638 | 8,574 | コングロマリット |
| FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | 92 | 92 | 1,183 | 3,846 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| ECLAT TEXTILE COMPANY LTD | 51 | 62 | 1,921 | 6,243 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NOVATEK MICROELECTRONICS LTD | 160 | 200 | 2,326 | 7,561 | 半導体・半導体製造装置 |
| FORMOSA PLASTIC | 1,254 | 1,414 | 11,059 | 35,942 | 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 | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千新台湾ドル | 千円 | |
| FORMOSA TAFFETA CO. | 200 | 200 | 630 | 2,047 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO | 969 | 1,059 | 8,596 | 27,938 | 化学 |
| TRANSCEND INFORMATION INC | 43 | 43 | 419 | 1,362 | コンピュータ・周辺機器 |
| GIANT MANUFACTURING | 77 | 97 | 1,999 | 6,497 | レジャー用品 |
| MEDIATEK INC | 435 | 505 | 11,598 | 37,695 | 半導体・半導体製造装置 |
| FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD | 1,925 | 2,295 | 9,124 | 29,653 | 各種金融サービス |
| HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C | 1,862 | 2,292 | 3,885 | 12,626 | 銀行 |
| HOTAI MOTOR COMPANY LTD | 70 | 90 | 2,884 | 9,374 | 専門小売り |
| FAR EASTONE TELECOMM CO LTD | 480 | 580 | 4,367 | 14,194 | 無線通信サービス |
| SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD | 83 | 83 | 950 | 3,089 | 電子装置・機器・部品 |
| YUANTA FINANCIAL HOLDING CO | 2,803 | 3,493 | 3,633 | 11,808 | 資本市場 |
| CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD | 2,375 | 2,805 | 10,631 | 34,551 | 保険 |
| CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING | 4,097 | 4,847 | 3,791 | 12,320 | 銀行 |
| E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO | 1,968 | 2,428 | 4,626 | 15,035 | 銀行 |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY | 4,355 | 4,785 | 38,619 | 125,513 | 電子装置・機器・部品 |
| MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT | 3,073 | 3,773 | 9,264 | 30,110 | 銀行 |
| LARGAN PRECISION CO LTD | 30 | 30 | 9,226 | 29,985 | 電子装置・機器・部品 |
| TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS | 2,641 | 2,641 | 3,288 | 10,687 | 銀行 |
| SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS | 2,745 | 2,745 | 1,781 | 5,790 | 保険 |
| INVENTEC CO.,LTD | 779 | 779 | 1,776 | 5,773 | コンピュータ・周辺機器 |
| HTC CORPORATION | 177 | 237 | 2,224 | 7,229 | コンピュータ・周辺機器 |
| LITE-ON TECHNOLOGY CORP | 595 | 745 | 3,443 | 11,190 | コンピュータ・周辺機器 |
| RADIANT OPTO-ELECTRONICS COR | 146 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS | 2,999 | 2,999 | 2,885 | 9,377 | 銀行 |
| CTBC FINANCIAL HOLDING | 4,826 | 5,316 | 8,852 | 28,770 | 銀行 |
| FIRST FINANCIAL HOLDING CO | 2,634 | 3,084 | 5,243 | 17,040 | 銀行 |
| MERIDA INDUSTRY CO LTD | 52 | 52 | 740 | 2,405 | レジャー用品 |
| POWERTECH TECHNOLOGY INC | 211 | 211 | 1,505 | 4,893 | 半導体・半導体製造装置 |
| NAN YA PLASTICS CORP | 1,437 | 1,667 | 10,120 | 32,890 | 化学 |
| WISTRON CORP | 631 | 861 | 1,890 | 6,143 | コンピュータ・周辺機器 |
| POU CHEN CORP | 714 | 714 | 3,076 | 9,999 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO | 1,478 | 1,598 | 10,373 | 33,713 | 食品 |
| PRESIDENT CHAIN STORE CORP | 178 | 208 | 5,058 | 16,439 | 食品・生活必需品小売り |
| FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | 333 | 403 | 3,575 | 11,621 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PHISON ELECTRONICS CORP | 43 | 43 | 1,186 | 3,855 | 半導体・半導体製造装置 |
| RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD | 272 | 272 | 1,036 | 3,367 | 不動産管理・開発 |
| RUENTEX INDUSTRIES LTD | 147 | 147 | 709 | 2,306 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | 274 | 274 | 2,028 | 6,593 | コンピュータ・周辺機器 |
| SILICONWARE PRECISION INDUSTRIES | 702 | 702 | 3,616 | 11,753 | 半導体・半導体製造装置 |
| STANDARD FOODS CORP | 85 | 135 | 1,064 | 3,460 | 食品 |
| SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP | 424 | 424 | 1,436 | 4,669 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN CEMENT | 1,103 | 1,103 | 3,585 | 11,652 | 建設資材 |
| TECO ELECTRIC & MACHINERY | 510 | 680 | 1,856 | 6,033 | 電気設備 |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR | 7,460 | 8,310 | 137,530 | 446,974 | 半導体・半導体製造装置 |
| UNITED MICROELECTRONICS CORP | 3,955 | 3,955 | 4,844 | 15,745 | 半導体・半導体製造装置 |
| YULON MOTOR CO | 290 | 290 | 788 | 2,562 | 自動車 |
| INOTERA MEMORIES INC | 770 | 770 | 1,975 | 6,418 | 半導体・半導体製造装置 |
| INNOLUX CORP | 2,413 | 2,933 | 2,801 | 9,103 | 電子装置・機器・部品 |
| WPG HOLDINGS CO LTD | 490 | 490 | 1,814 | 5,895 | 電子装置・機器・部品 |
| HIWIN TECHNOLOGIES CORP | 67 | 67 | 985 | 3,202 | 機械 |
| TAIMED BIOLOGICS INC | — | 50 | 1,120 | 3,640 | バイオテクノロジー |
| HERMES MICROVISION INC | 10 | 20 | 2,690 | 8,742 | 半導体・半導体製造装置 |
| PEGATRON CORP | 536 | 646 | 4,528 | 14,717 | コンピュータ・周辺機器 |
| CHAILEASE HOLDING CO LTD | 346 | 346 | 1,752 | 5,695 | 各種金融サービス |

| 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 | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千新台湾ドル | 千円 | |
| ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD | 560 | 560 | 604 | 1,965 | 各種電気通信サービス |
| ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING | 134 | 134 | 776 | 2,523 | 電子装置・機器・部品 |
| TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL | 2,416 | 2,416 | 3,467 | 11,269 | 銀行 |
| OBI PHARMA INC | 30 | 40 | 2,188 | 7,111 | バイオテクノロジー |
| CASETEK HOLDINGS LTD | 30 | 50 | 582 | 1,893 | コンピュータ・周辺機器 |
| NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD | — | 50 | 1,415 | 4,598 | 家庭用耐久財 |
| 小計 株数・金額 | 94,316 | 105,031 | 492,371 | 1,600,207 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 89 | 90 | — | <11.9%> | |
| (インド) | | | 千インドルピー | | |
| RELIANCE INDUSTRIES LIMITED | 381 | 436 | 43,096 | 67,230 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BHARAT PETROLEUM CORP LTD | 52 | 30 | 3,116 | 4,861 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| EICHER MOTORS LTD | 4 | 4 | 7,672 | 11,968 | 機械 |
| MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED | 111 | 131 | 17,960 | 28,018 | 自動車 |
| SHREE CEMENT LIMITED | 2 | 2 | 3,883 | 6,058 | 建設資材 |
| ADITYA BIRLA NUVO LIMITED | 11 | — | — | — | コングロマリット |
| CONTAINER CORP OF INDIA LTD | 9 | 9 | 1,291 | 2,014 | 陸運・鉄道 |
| LIC HOUSING FINANCE | 84 | 84 | 4,103 | 6,401 | 貯蓄・抵当・不動産金融 |
| TATA STEEL LIMITED | 101 | 101 | 3,373 | 5,263 | 金属・鉱業 |
| JSW STEEL LTD | 23 | 30 | 4,216 | 6,577 | 金属・鉱業 |
| NESTLE INDIA LIMITED | 7 | 7 | 4,903 | 7,648 | 食品 |
| GAIL INDIA LTD | 118 | 118 | 4,525 | 7,059 | ガス |
| VEDANTA LTD | 229 | 316 | 3,972 | 6,196 | 金属・鉱業 |
| TITAN CO LTD | — | 113 | 4,253 | 6,636 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| OIL&NATURAL GAS CORP LTD | 264 | 264 | 5,758 | 8,983 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| GLAXOSMITHKLINE CONSUMER | 2 | 3 | 2,198 | 3,429 | 食品 |
| LUPIN LTD | 69 | 78 | 11,394 | 17,775 | 医薬品 |
| ACC LIMITED | 12 | 12 | 1,886 | 2,942 | 建設資材 |
| BAJAJ FINANCE LTD | — | 5 | 4,487 | 7,000 | 消費者金融 |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE | 457 | 503 | 62,340 | 97,251 | 貯蓄・抵当・不動産金融 |
| ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE | 155 | 193 | 8,651 | 13,495 | メディア |
| INFOSYS LTD | 561 | 615 | 74,187 | 115,732 | 情報技術サービス |
| WIPRO LTD | 196 | 190 | 10,669 | 16,643 | 情報技術サービス |
| HINDUSTAN UNILEVER LIMITED | 218 | 227 | 19,806 | 30,898 | 家庭用品 |
| APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE | 23 | 23 | 3,045 | 4,751 | ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| HCL TECHNOLOGIES LTD | 160 | 176 | 13,576 | 21,179 | 情報技術サービス |
| DABUR INDIA LTD | 176 | 176 | 5,476 | 8,542 | パーソナル用品 |
| HERO MOTOCORP LTD | 15 | 15 | 4,610 | 7,191 | 自動車 |
| DR.REDDYS LABORATORIES | 36 | 40 | 12,348 | 19,263 | 医薬品 |
| BHARTI AIRTEL LIMITED | 365 | 308 | 11,173 | 17,431 | 無線通信サービス |
| UNITED SPIRITS LIMITED | 18 | 24 | 5,894 | 9,194 | 飲料 |
| SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD | 291 | 328 | 24,196 | 37,746 | 医薬品 |
| DIVIS LABORATORIES LTD | 25 | 25 | 2,882 | 4,496 | ﾗｲﾌｻｲｴﾝｽ・ﾂｰﾙ/ｻｰﾋﾞｽ |
| MARUTI SUZUKI INDIA LTD | 31 | 34 | 14,509 | 22,634 | 自動車 |
| GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD | 39 | 50 | 3,841 | 5,993 | 医薬品 |
| AUROBINDO PHARMA LTD | 78 | 93 | 6,748 | 10,527 | 医薬品 |
| MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD | 96 | 96 | 2,915 | 4,548 | 自動車部品 |
| SHRIRAM TRANSPORT FINANCE | 44 | 54 | 6,323 | 9,864 | 消費者金融 |
| CIPLA LIMITED | 110 | 110 | 5,327 | 8,310 | 医薬品 |
| LARSEN&TOUBRO LIMITED | 89 | 103 | 15,396 | 24,018 | 建設・土木 |
| ULTRATECH CEMENT LTD | 9 | 12 | 4,163 | 6,494 | 建設資材 |
| ASHOK LEYLAND LIMITED | 341 | 341 | 3,490 | 5,445 | 機械 |
| BOSCH LTD | 2 | 2 | 5,275 | 8,229 | 自動車部品 |
| TATA CONSULTANCY SVS LTD | 138 | 162 | 42,975 | 67,042 | 情報技術サービス |
| NTPC LIMITED | 374 | 601 | 9,129 | 14,241 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |

| 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 | |
| PIRAMAL ENTERPRISES LTD | 21 | 21 | 2,877 | 4,488 | 医薬品 |
| YES BANK LTD | — | 38 | 4,103 | 6,401 | 銀行 |
| AMBUJA CEMENTS LTD | 196 | 236 | 5,683 | 8,865 | 建設資材 |
| BHARAT FORGE LIMITED | 28 | 36 | 2,745 | 4,282 | 自動車部品 |
| HINDALCO INDUSTRIES LIMITED | 314 | 406 | 5,017 | 7,827 | 金属・鉱業 |
| ITC LTD | 696 | 780 | 27,973 | 43,639 | タバコ |
| UPL LTD | 93 | 93 | 5,250 | 8,190 | 化学 |
| RELIANCE COMMUNICATION LTD | 227 | — | — | — | 無線通信サービス |
| SIEMENS INDIA LIMITED | 23 | 23 | 2,923 | 4,560 | コングロマリット |
| UNITED BREWERIES LTD | 16 | — | — | — | 飲料 |
| GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | 36 | 44 | 6,944 | 10,833 | パーソナル用品 |
| CAIRN INDIA LIMITED | 127 | 127 | 1,763 | 2,751 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| IDEA CELLULAR LIMITED | 336 | 336 | 3,443 | 5,371 | 無線通信サービス |
| MARICO LIMITED | 58 | 156 | 4,009 | 6,254 | パーソナル用品 |
| POWER FINANCE CORPORATION | 63 | 63 | 1,055 | 1,646 | 各種金融サービス |
| ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE | 239 | 287 | 5,835 | 9,102 | 運送インフラ |
| RURAL ELECTRIFICATION CORP | 74 | — | — | — | 各種金融サービス |
| BAJAJ AUTO LIMITED | 24 | 29 | 7,671 | 11,967 | 自動車 |
| COAL INDIA LTD | 217 | 217 | 6,820 | 10,639 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TATA MOTORS LTD-A-DVR | 114 | 114 | 3,711 | 5,789 | 自動車 |
| TATA MOTORS LTD | 256 | 544 | 26,416 | 41,210 | 自動車 |
| BHARAT HEAVY ELECTRICALS | 169 | 169 | 2,064 | 3,220 | 電気設備 |
| TATA POWER COMPANY LIMITED | 327 | 327 | 2,400 | 3,744 | 電力 |
| MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS | 84 | 84 | 2,715 | 4,236 | 消費者金融 |
| BHARTI INFRATEL LTD | 157 | 197 | 6,855 | 10,694 | 各種電気通信サービス |
| INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD | 96 | 96 | 6,723 | 10,489 | 貯蓄・抵当・不動産金融 |
| ASIAN PAINTS LTD | 89 | 104 | 10,252 | 15,994 | 化学 |
| AXIS BANK LIMITED | — | 216 | 11,222 | 17,506 | 銀行 |
| HAVELLS INDIA LTD | — | 91 | 3,352 | 5,229 | 電気設備 |
| ICICI BANK LTD | 333 | 392 | 9,345 | 14,578 | 銀行 |
| TECH MAHINDRA LTD | 67 | 67 | 3,616 | 5,641 | 情報技術サービス |
| CADILA HEALTHCARE LTD | 61 | 61 | 1,935 | 3,020 | 医薬品 |
| 小計 株数・金額 | 10,096 | 11,630 | 695,780 | 1,085,417 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 72 | 73 | — | <8.1%> | |
| (メキシコ) | | | 千メキシコペソ | | |
| ALFA S.A.B.-A | 882 | 992 | 3,124 | 17,530 | コングロマリット |
| COCA-COLA FEMSA SAB-SER L | 152 | 177 | 2,691 | 15,101 | 飲料 |
| CONTROLADORA COML MEXIC-UBC | 131 | — | — | — | 食品・生活必需品小売り |
| FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | 544 | 631 | 10,622 | 59,594 | 飲料 |
| EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1 | 60 | 60 | 1,186 | 6,653 | 複合小売り |
| GRUPO FIN SANTANDER-B | 500 | 626 | 2,074 | 11,638 | 銀行 |
| GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO | 717 | 831 | 7,981 | 44,777 | メディア |
| GRUPO BIMBO SAB-SERIES A | 524 | 524 | 2,883 | 16,176 | 食品 |
| GRUMA S.A.B.-B | 62 | 62 | 1,594 | 8,946 | 食品 |
| PROMOTORA Y OPERADORA DE INF | 77 | 77 | 1,692 | 9,492 | 運送インフラ |
| GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1 | 183 | 183 | 1,415 | 7,940 | コングロマリット |
| CEMEX SAB - CPO | 4,034 | 4,715 | 5,682 | 31,878 | 建設資材 |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE-O | 772 | 822 | 8,100 | 45,445 | 銀行 |
| MEXICHEM SAB DE CV-* | 285 | 380 | 1,496 | 8,394 | 化学 |
| INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | 40 | 40 | 1,381 | 7,749 | 金属・鉱業 |
| KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A | 431 | 525 | 2,172 | 12,187 | 家庭用品 |
| GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B | 62 | 76 | 2,234 | 12,537 | 運送インフラ |
| GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B | 1,192 | 1,311 | 5,572 | 31,262 | 金属・鉱業 |
| AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L | 9,373 | 10,765 | 12,153 | 68,182 | 無線通信サービス |

| 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 | |
| (メキシコ) | 百株 | 百株 | 千メキシコペソ | 千円 | |
| GRUPO FINANCIERO INBURSA-O | 672 | 800 | 2,434 | 13,656 | 銀行 |
| ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | 131 | 131 | 1,675 | 9,399 | 飲料 |
| GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH | 94 | 119 | 2,293 | 12,865 | 運送インフラ |
| OHL MEXICO SAB DE CV | 241 | 241 | 555 | 3,115 | 運送インフラ |
| GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA | 77 | 123 | 549 | 3,081 | 食品・生活必需品小売り |
| TELESITES SAB | 468 | — | — | — | 各種電気通信サービス |
| GRUPO LALA SAB DE CV | 198 | 198 | 836 | 4,690 | 食品 |
| GENTERA SAB DE CV | 362 | 362 | 1,183 | 6,638 | 消費者金融 |
| WALMART DE MEXICO-SER V | 1,619 | 1,807 | 7,817 | 43,853 | 食品・生活必需品小売り |
| 小計 株数・金額 | 23,885 | 26,580 | 91,406 | 512,792 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 28 | 26 | — | <3.8%> | |
| (ブラジル) | | | 千レアル | | |
| BRF SA | 189 | 202 | 925 | 28,346 | 食品 |
| VALE SA | 415 | 415 | 647 | 19,836 | 金属・鉱業 |
| CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB | 34 | 34 | 97 | 2,981 | 電力 |
| VALE SA-PREF A | 609 | 675 | 839 | 25,728 | 金属・鉱業 |
| TIM PARTICIPACOES SA | 238 | 301 | 209 | 6,420 | 無線通信サービス |
| CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B | 47 | 87 | 124 | 3,817 | 電力 |
| BANCO DO BRASIL SA | 275 | 275 | 435 | 13,355 | 銀行 |
| ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR | 1,007 | 1,290 | 927 | 28,420 | 銀行 |
| LOJAS AMERICANAS S.A.(PREF) | 141 | 202 | 314 | 9,630 | 複合小売り |
| LOJAS AMERICANAS SA | 38 | 46 | 50 | 1,554 | 複合小売り |
| GERDAU SA PFD NPV | 240 | 313 | 180 | 5,533 | 金属・鉱業 |
| PETROBRAS - PETROLEO BRAS | 850 | 990 | 1,182 | 36,218 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR | 1,200 | 1,354 | 1,290 | 39,536 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KROTON EDUCACIONAL SA | 439 | 498 | 687 | 21,065 | 各種消費者サービス |
| CCR SA | 281 | 281 | 462 | 14,163 | 運送インフラ |
| WEG SA | 173 | 173 | 250 | 7,684 | 機械 |
| BANCO BRADESCO SA - PREF | 738 | 952 | 2,371 | 72,662 | 銀行 |
| BANCO BRADESCO SA - PREF-RIGHTS | 24 | — | — | — | 銀行 |
| BANCO BRADESCO S.A. | 244 | 275 | 719 | 22,056 | 銀行 |
| BANCO BRADESCO S.A.-RIGHTS | 8 | — | — | — | 銀行 |
| NATURA COSMETICOS SA | 47 | 63 | 149 | 4,590 | パーソナル用品 |
| CIA SIDERURGICA NACIONAL SA | 215 | 215 | 160 | 4,927 | 金属・鉱業 |
| SUZANO PAPEL E CELULOSE SA-PREF | 119 | 119 | 143 | 4,386 | 紙製品・林産品 |
| CPFL ENERGIA SA | 65 | 66 | 138 | 4,249 | 電力 |
| ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF | 925 | 984 | 2,893 | 88,671 | 銀行 |
| PORTO SEGURO SA | 32 | 32 | 84 | 2,598 | 保険 |
| FIBRIA CELULOSE SA | 75 | 75 | 205 | 6,297 | 紙製品・林産品 |
| BRASKEM SA-PREF A | 44 | 44 | 86 | 2,649 | 化学 |
| TRACTEBEL ENERGIA SA | 54 | 54 | 197 | 6,040 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| LOCALIZA RENT A CAR | 45 | 45 | 167 | 5,147 | 陸運・鉄道 |
| LOJAS RENNER S.A. | 185 | 222 | 527 | 16,154 | 複合小売り |
| EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA | 73 | 112 | 144 | 4,423 | 電力 |
| ULTRAPAR PARTICIPACOES | 110 | 122 | 895 | 27,433 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO | 29 | 42 | 141 | 4,329 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TOTVS SA | 38 | 38 | 116 | 3,563 | ソフトウェア |
| EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | 52 | 65 | 307 | 9,416 | 電力 |
| EMBRAER SA | 199 | 224 | 411 | 12,594 | 航空宇宙・防衛 |
| CIA ENERGETICA DE SP-PREF B | 49 | 49 | 58 | 1,801 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| M DIAS BRANCO SA | 8 | 13 | 125 | 3,859 | 食品 |
| TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT | 20 | 20 | 37 | 1,145 | 電力 |
| ODONTOPREV S.A. | 68 | 68 | 78 | 2,406 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| B2W CIA DIGITAL | 30 | — | — | — | インターネット販売・カタログ販売 |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ブラジル) | | 百株 | 百株 | 千レアル | 千円 | |
| BR MALLS PARTICIPACOES SA | | 150 | 195 | 236 | 7,259 | 不動産管理・開発 |
| JBS SA | | 221 | 221 | 209 | 6,426 | 食品 |
| CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF | | 235 | 235 | 137 | 4,217 | 電力 |
| CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | | 101 | 125 | 351 | 10,777 | 水道 |
| MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS | | 20 | 29 | 170 | 5,231 | 不動産管理・開発 |
| ESTACIO PARTICIPACOES SA | | 76 | — | — | — | 各種消費者サービス |
| DURATEX SA | | 63 | 113 | 91 | 2,797 | 紙製品・林産品 |
| SUL AMERICA SA - UNITS | | 53 | 53 | 84 | 2,597 | 保険 |
| HYPERMARCAS S.A | | 117 | 117 | 335 | 10,292 | パーソナル用品 |
| BM&F BOVESPA SA | | 524 | 589 | 997 | 30,553 | 各種金融サービス |
| TELEFONICA BRASIL-PREF | | 125 | 158 | 660 | 20,237 | 各種電気通信サービス |
| QUALICORP SA | | 77 | 77 | 135 | 4,164 | 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 | 225 | 6,922 | 銀行 |
| CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO | | 76 | 76 | 325 | 9,974 | 資本市場 |
| CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF | | 47 | 57 | 260 | 7,978 | 食品・生活必需品小売り |
| CIELO SA | | 243 | 352 | 1,206 | 36,975 | 情報技術サービス |
| RAIA DROGASIL SA | | 73 | 73 | 454 | 13,937 | 食品・生活必需品小売り |
| BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | | 226 | 226 | 630 | 19,333 | 保険 |
| AMBEV SA | | 1,441 | 1,608 | 2,988 | 91,573 | 飲料 |
| KLABIN SA-UNIT | | 171 | 202 | 326 | 9,995 | 容器・包装 |
| RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL | | — | 266 | 126 | 3,863 | 陸運・鉄道 |
| AES TIETE ENERGIA SA-UNIT | | — | 68 | 98 | 3,004 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小計 | 株数・金額 | 13,846 | 16,009 | 28,845 | 883,812 | |
| | 銘柄数<比率> | 62 | 60 | — | <6.6%> | |
| (チリ) | | | | 千チリペソ | | |
| BANCO DE CREDITO E INVERSION | | 8 | 12 | 36,498 | 5,653 | 銀行 |
| EMPRESAS CMPC SA | | 324 | 414 | 57,898 | 8,968 | 紙製品・林産品 |
| EMPRESAS COPEC SA | | 124 | 149 | 86,810 | 13,446 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| EMPRESA NACIONAL DE TELECOM | | 32 | 42 | 25,562 | 3,959 | 無線通信サービス |
| EMPRESA NACIONAL DE TELEC-SD | | — | 11 | 789 | 122 | 無線通信サービス |
| COLBUN SA | | 2,430 | 2,920 | 48,410 | 7,498 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AGUAS ANDINAS SA-A | | 754 | 953 | 36,334 | 5,628 | 水道 |
| EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B | | 76 | 76 | 17,815 | 2,759 | 飲料 |
| S.A.C.I. FALABELLA | | 158 | 158 | 79,396 | 12,298 | 複合小売り |
| CENCOSUD SA | | 399 | 422 | 80,083 | 12,404 | 食品・生活必需品小売り |
| SONDA SA | | 130 | — | — | — | 情報技術サービス |
| AES GENER SA | | 780 | 780 | 24,894 | 3,856 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| 小計 | 株数・金額 | 5,217 | 5,939 | 494,494 | 76,597 | |
| | 銘柄数<比率> | 11 | 11 | — | <0.6%> | |
| (コロンビア) | | | | 千コロンビアペソ | | |
| INTERCONEXION ELECTRICA SA | | 107 | 107 | 94,802 | 3,337 | 電力 |
| CORP FINANCIERA COLOMBIANA | | — | 25 | 96,038 | 3,380 | 各種金融サービス |
| GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF | | 30 | 30 | 112,500 | 3,960 | 各種金融サービス |
| GRUPO AVAL ACCIONES-PFD | | 996 | 1,299 | 153,282 | 5,395 | 銀行 |
| CEMENTOS ARGOS SA | | 135 | 135 | 160,650 | 5,654 | 建設資材 |
| GRUPO ARGOS SA | | 81 | 102 | 190,536 | 6,706 | 建設資材 |
| GRUPO DE INV SURAMERICANA | | 78 | 78 | 296,400 | 10,433 | 各種金融サービス |
| CORP FIN COLOMBIANA-CD | | 25 | — | — | — | 各種金融サービス |
| 小計 | 株数・金額 | 1,452 | 1,776 | 1,104,208 | 38,868 | |
| | 銘柄数<比率> | 7 | 7 | — | <0.3%> | |
| (アラブ首長国連邦) | | | | 千UAEディルハム | | |
| FIRST GULF BANK | | 280 | 283 | 358 | 10,237 | 銀行 |
| DUBAI ISLAMIC BANK | | 264 | 450 | 230 | 6,587 | 銀行 |
| EMIRATES TELECOM CORPORATION | | 530 | 586 | 1,110 | 31,681 | 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 | |
| **(アラブ首長国連邦)** | 百株 | 百株 | 千UAEディルハム | 千円 | |
| ABU DHABI COMMERCIAL BANK | 618 | 618 | 381 | 10,896 | 銀行 |
| NATIONAL BANK OF ABU DHABI | 195 | 251 | 237 | 6,764 | 銀行 |
| EMAAR PROPERTIES PJSC | 985 | 1,151 | 719 | 20,525 | 不動産管理・開発 |
| ARABTEC HOLDING CO | 637 | 637 | 89 | 2,547 | 建設・土木 |
| ALDAR PROPERTIES PJSC | 1,092 | 1,092 | 302 | 8,634 | 不動産管理・開発 |
| DUBAI FINANCIAL MARKET | 608 | 608 | 77 | 2,222 | 各種金融サービス |
| EMAAR MALLS GROUP PJSC | 660 | 660 | 188 | 5,366 | 不動産管理・開発 |
| 小計 株数・金額 | 5,872 | 6,339 | 3,696 | 105,464 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 10 | 10 | — | <0.8%> | |
| **(エジプト)** | | | 千エジプトポンド | | |
| COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK | 292 | 368 | 1,530 | 18,030 | 銀行 |
| GLOBAL TELECOM HOLDING | 655 | 955 | 310 | 3,658 | 無線通信サービス |
| T M G HOLDING | 247 | 247 | 136 | 1,605 | 不動産管理・開発 |
| 小計 株数・金額 | 1,196 | 1,572 | 1,977 | 23,294 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 3 | 3 | — | <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 |
| BARLOWORLD LTD | 58 | — | — | — | 商社・流通業 |
| BIDVEST GROUP LTD | 100 | 110 | 1,488 | 10,539 | コングロマリット |
| TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD | 143 | 143 | 1,309 | 9,269 | 専門小売り |
| DISCOVERY LTD | 109 | 109 | 1,346 | 9,531 | 保険 |
| GOLD FIELDS LTD | 236 | 288 | 1,741 | 12,326 | 金属・鉱業 |
| REMGRO LTD | 138 | 169 | 4,249 | 30,085 | 各種金融サービス |
| THE FOSCHINI GROUP LTD | 64 | 64 | 952 | 6,746 | 専門小売り |
| EXXARO RESOURCES LTD | 37 | 37 | 249 | 1,766 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | 8 | 12 | 714 | 5,058 | 銀行 |
| LIBERTY HOLDINGS LTD | 28 | 42 | 519 | 3,676 | 保険 |
| MTN GROUP LTD | 487 | 550 | 8,133 | 57,584 | 無線通信サービス |
| ANGLOGOLD ASHANTI LTD | 123 | 139 | 3,234 | 22,897 | 金属・鉱業 |
| TELKOM SA SOC LTD | 62 | 62 | 408 | 2,889 | 各種電気通信サービス |
| FIRSTRAND LTD | 1,043 | 1,106 | 4,952 | 35,066 | 各種金融サービス |
| PSG GROUP LTD | 29 | 29 | 557 | 3,948 | 各種金融サービス |
| NASPERS LTD-N SHS | 121 | 148 | 32,345 | 229,003 | メディア |
| CORONATION FUND MANAGERS LTD | 68 | 68 | 453 | 3,212 | 資本市場 |
| NEDBANK GROUP LTD | 61 | 61 | 1,132 | 8,017 | 銀行 |
| NETCARE LTD | 307 | 307 | 978 | 6,929 | 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 | 79 | 561 | 3,977 | 食品・生活必需品小売り |
| RMB HOLDINGS LTD | 203 | 250 | 1,400 | 9,912 | 各種金融サービス |
| ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD | 14 | 14 | 536 | 3,797 | 金属・鉱業 |
| SAPPI LIMITED | 175 | 175 | 1,201 | 8,508 | 紙製品・林産品 |
| SASOL LTD | 171 | 187 | 7,668 | 54,294 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SHOPRITE HOLDINGS LTD | 143 | 131 | 2,180 | 15,437 | 食品・生活必需品小売り |
| BRAIT SE | 92 | 115 | 1,786 | 12,649 | 資本市場 |
| STANDARD BANK GROUP LTD | 352 | 450 | 5,641 | 39,939 | 銀行 |
| SPAR GROUP LIMITED/THE | 50 | 68 | 1,373 | 9,727 | 食品・生活必需品小売り |
| WOOLWORTHS HOLDINGS LTD | 289 | 326 | 2,672 | 18,923 | 複合小売り |
| IMPERIAL HOLDINGS LTD | 53 | 53 | 853 | 6,039 | 販売 |
| ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT | 103 | 114 | 4,182 | 29,611 | 医薬品 |
| TIGER BRANDS LTD | 52 | 52 | 1,914 | 13,557 | 食品 |
| SANLAM LIMITED | 495 | 503 | 3,136 | 22,209 | 保険 |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL LTD | 160 | — | — | — | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| INVESTEC LTD | 65 | 85 | 874 | 6,193 | 資本市場 |
| IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | 209 | 209 | 940 | 6,658 | 金属・鉱業 |
| PIONEER FOODS LTD | 36 | 36 | 610 | 4,322 | 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 | |
| (南アフリカ) | | 百株 | 百株 | 千ランド | 千円 | |
| NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENT P LC | | 67 | 59 | 1,053 | 7,456 | 不動産管理・開発 |
| MASSMART HOLDINGS LTD | | 25 | 25 | 320 | 2,271 | 食品・生活必需品小売り |
| MONDI LTD | | 37 | 37 | 1,078 | 7,639 | 紙製品・林産品 |
| LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN | | 270 | 335 | 1,228 | 8,701 | ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| MMI HOLDINGS LTD | | 306 | 400 | 914 | 6,471 | 保険 |
| RMI HOLDINGS | | 185 | — | — | — | 保険 |
| TSOGO SUN HOLDINGS LTD | | 126 | 126 | 341 | 2,418 | ホテル・レストラン・レジャー |
| VODACOM GROUP | | 112 | 130 | 2,128 | 15,071 | 無線通信サービス |
| BARCLAYS AFRICA GROUP LTD | | 97 | 155 | 2,262 | 16,016 | 銀行 |
| SIBANYE GOLD LTD | | — | 232 | 1,013 | 7,173 | 金属・鉱業 |
| RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD | | — | 237 | 957 | 6,779 | 保険 |
| MR PRICE GROUP LTD | | 80 | 80 | 1,617 | 11,452 | 専門小売り |
| STEINHOFF INTERNATIONAL H NV | | 710 | 997 | 8,766 | 62,063 | 家庭用耐久財 |
| BID CORP LTD | | — | 110 | 2,976 | 21,071 | 食品・生活必需品小売り |
| 小計 | 株数・金額 | 8,345 | 9,583 | 126,963 | 898,901 | |
| | 銘柄数<比率> | 49 | 49 | — | <6.7%> | |
| 合計 | 株数・金額 | 618,195 | 673,684 | — | 12,971,302 | |
| | 銘柄数<比率> | 836 | 830 | — | <96.4%> | |

＊邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
＊邦貨換算金額欄の<　>内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。
＊株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。
＊銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

## 外国新株予約権証券

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 証券数 | 証券数 | 評価額 | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| (タイ) | | 証券 | 証券 | 千バーツ | 千円 |
| BANPU PUBLIC CO-CW17 | | — | 14,300 | 119 | 354 |
| 合計 | 証券数・金額 | — | 14,300 | 119 | 354 |
| | 銘柄数<比率> | — | 1 | — | <0.0%> |

＊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。
＊<　>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。
＊金額の単位未満は切り捨て。

## 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 | 181 | 6,516 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 64,400 | 64,400 | 181 | 6,516 | |
| | 銘柄数<比率> | 1 | 1 | － | <0.0%> | |
| (メキシコ) | | | | 千メキシコペソ | | |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | | 69,200 | 80,400 | 3,173 | 17,802 | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 | 69,200 | 80,400 | 3,173 | 17,802 | |
| | 銘柄数<比率> | 1 | 1 | － | <0.1%> | |
| (南アフリカ) | | | | 千ランド | | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | | 75,380 | 75,380 | 1,857 | 13,150 | 0.1 |
| REDEFINE PROPERTIES LTD | | 132,440 | 161,710 | 1,798 | 12,731 | 0.1 |
| HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS | | 7,790 | 7,790 | 947 | 6,707 | 0.0 |
| FORTRESS INCOME FUND LTD-A | | 29,380 | 29,380 | 455 | 3,224 | 0.0 |
| FORTRESS INCOME FUND LTD | | 21,220 | 21,220 | 761 | 5,390 | 0.0 |
| RESILIENT REIT LTD | | 9,072 | 9,072 | 1,178 | 8,343 | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 | 275,282 | 304,552 | 6,998 | 49,547 | |
| | 銘柄数<比率> | 6 | 6 | － | <0.4%> | |
| 合計 | 口数・金額 | 408,882 | 449,352 | － | 73,866 | |
| | 銘柄数<比率> | 8 | 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 |
| | | MSCIN | 395 | － |

＊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(504,725,182千口)の内容です。

### 国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債　種類別開示

| 区分 | 当期末 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 額面金額 | 評価額 | 組入比率 | うちＢＢ格以下組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | ５年以上 | ２年以上 | ２年未満 |
| | 千円 | 千円 | % | % | % | % | % |
| 国債証券 | 463,515,000 | 530,237,202 | 78.7 | － | 52.1 | 20.4 | 6.2 |
| | (　2,860,000) | (　4,602,197) | ( 0.7) | (－) | ( 0.7) | ( 0.0) | ( 0.0) |
| 地方債証券 | 48,772,020 | 51,853,143 | 7.7 | － | 3.4 | 3.0 | 1.3 |
| | ( 48,772,020) | ( 51,853,143) | ( 7.7) | (－) | ( 3.4) | ( 3.0) | ( 1.3) |
| 特殊債券(除く金融債) | 49,276,017 | 52,690,393 | 7.8 | － | 4.6 | 1.5 | 1.7 |
| | ( 49,276,017) | ( 52,690,393) | ( 7.8) | (－) | ( 4.6) | ( 1.5) | ( 1.7) |
| 金融債券 | 5,500,000 | 5,536,411 | 0.8 | － | － | 0.3 | 0.5 |
| | (　5,500,000) | (　5,536,411) | ( 0.8) | (－) | (　－) | ( 0.3) | ( 0.5) |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | 28,607,000 | 29,808,487 | 4.4 | － | 1.8 | 1.7 | 0.9 |
| | ( 28,607,000) | ( 29,808,487) | ( 4.4) | (－) | ( 1.8) | ( 1.7) | ( 0.9) |
| 合計 | 595,670,037 | 670,125,638 | 99.5 | － | 62.0 | 26.9 | 10.6 |
| | (135,015,037) | (144,490,633) | (21.5) | (－) | (10.6) | ( 6.5) | ( 4.4) |

＊（　）内は非上場債で内書きです。
＊組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。
＊金額の単位未満は切り捨て。
＊評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。
＊残存期間が１年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債　銘柄別開示

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| **国債証券** | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券　利付（２年）第359回 | 0.1 | 300,000 | 301,599 | 2017/12/15 |
| 国庫債券　利付（２年）第360回 | 0.1 | 4,200,000 | 4,223,016 | 2018/１/15 |
| 国庫債券　利付（２年）第362回 | 0.1 | 1,400,000 | 1,408,470 | 2018/３/15 |
| 国庫債券　利付（５年）第106回 | 0.2 | 3,100,000 | 3,117,360 | 2017/９/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第107回 | 0.2 | 3,800,000 | 3,825,270 | 2017/12/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第108回 | 0.1 | 1,800,000 | 1,809,414 | 2017/12/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第109回 | 0.1 | 2,800,000 | 2,816,828 | 2018/３/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第110回 | 0.3 | 1,000,000 | 1,009,500 | 2018/３/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第111回 | 0.4 | 1,400,000 | 1,415,750 | 2018/３/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第112回 | 0.4 | 2,200,000 | 2,228,138 | 2018/６/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第113回 | 0.3 | 7,000,000 | 7,075,530 | 2018/６/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第114回 | 0.3 | 1,500,000 | 1,518,240 | 2018/９/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第115回 | 0.2 | 7,300,000 | 7,372,343 | 2018/９/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第116回 | 0.2 | 8,100,000 | 8,190,315 | 2018/12/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第117回 | 0.2 | 5,900,000 | 5,973,160 | 2019/３/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第118回 | 0.2 | 5,000,000 | 5,067,750 | 2019/６/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第119回 | 0.1 | 4,700,000 | 4,749,538 | 2019/６/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第120回 | 0.2 | 5,500,000 | 5,579,915 | 2019/９/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第121回 | 0.1 | 3,500,000 | 3,539,445 | 2019/９/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第122回 | 0.1 | 7,800,000 | 7,894,692 | 2019/12/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第123回 | 0.1 | 7,300,000 | 7,394,973 | 2020/３/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第124回 | 0.1 | 8,100,000 | 8,212,509 | 2020/６/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第125回 | 0.1 | 8,200,000 | 8,319,392 | 2020/９/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第126回 | 0.1 | 5,500,000 | 5,584,865 | 2020/12/20 |
| 国庫債券　利付（５年）第127回 | 0.1 | 6,000,000 | 6,097,740 | 2021/３/20 |
| 国庫債券　利付（40年）第１回 | 2.4 | 2,660,000 | 4,399,826 | 2048/３/20 |
| 国庫債券　利付（40年）第２回 | 2.2 | 900,000 | 1,448,604 | 2049/３/20 |
| 国庫債券　利付（40年）第３回 | 2.2 | 900,000 | 1,461,942 | 2050/３/20 |
| 国庫債券　利付（40年）第４回 | 2.2 | 1,300,000 | 2,134,093 | 2051/３/20 |
| 国庫債券　利付（40年）第５回 | 2.0 | 1,300,000 | 2,066,675 | 2052/３/20 |
| 国庫債券　利付（40年）第６回 | 1.9 | 1,300,000 | 2,038,868 | 2053/３/20 |
| 国庫債券　利付（40年）第７回 | 1.7 | 1,400,000 | 2,110,934 | 2054/３/20 |
| 国庫債券　利付（40年）第８回 | 1.4 | 1,500,000 | 2,112,945 | 2055/３/20 |
| 国庫債券　利付（40年）第９回 | 0.4 | 300,000 | 312,873 | 2056/３/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第288回 | 1.7 | 1,850,000 | 1,895,140 | 2017/９/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第289回 | 1.5 | 2,000,000 | 2,052,200 | 2017/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第290回 | 1.4 | 1,250,000 | 1,285,750 | 2018/３/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第291回 | 1.3 | 1,400,000 | 1,437,604 | 2018/３/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第292回 | 1.7 | 1,600,000 | 1,654,128 | 2018/３/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第293回 | 1.8 | 750,000 | 780,495 | 2018/６/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第294回 | 1.7 | 500,000 | 519,330 | 2018/６/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第295回 | 1.5 | 1,600,000 | 1,655,472 | 2018/６/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第297回 | 1.4 | 1,100,000 | 1,144,902 | 2018/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第298回 | 1.3 | 1,500,000 | 1,557,480 | 2018/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第299回 | 1.3 | 1,400,000 | 1,459,192 | 2019/３/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第300回 | 1.5 | 1,000,000 | 1,047,790 | 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 | 1,578,810 | 2019/6/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第302回 | 1.4 | 700,000 | 734,671 | 2019/6/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第303回 | 1.4 | 3,300,000 | 3,476,781 | 2019/9/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第304回 | 1.3 | 1,000,000 | 1,050,300 | 2019/9/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第305回 | 1.3 | 4,100,000 | 4,321,482 | 2019/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第306回 | 1.4 | 3,000,000 | 3,186,120 | 2020/3/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第307回 | 1.3 | 1,700,000 | 1,799,042 | 2020/3/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第308回 | 1.3 | 1,700,000 | 1,805,077 | 2020/6/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第309回 | 1.1 | 3,000,000 | 3,161,880 | 2020/6/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第310回 | 1.0 | 3,700,000 | 3,896,581 | 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 | 5,273,532 | 2020/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第313回 | 1.3 | 3,200,000 | 3,434,464 | 2021/3/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第314回 | 1.1 | 2,200,000 | 2,340,118 | 2021/3/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第315回 | 1.2 | 2,600,000 | 2,788,344 | 2021/6/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第316回 | 1.1 | 1,400,000 | 1,494,346 | 2021/6/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第317回 | 1.1 | 1,800,000 | 1,927,512 | 2021/9/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第318回 | 1.0 | 3,200,000 | 3,409,696 | 2021/9/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第319回 | 1.1 | 1,850,000 | 1,988,472 | 2021/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第320回 | 1.0 | 3,500,000 | 3,742,480 | 2021/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第321回 | 1.0 | 3,200,000 | 3,432,800 | 2022/3/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第322回 | 0.9 | 2,400,000 | 2,560,632 | 2022/3/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第323回 | 0.9 | 2,700,000 | 2,888,784 | 2022/6/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第324回 | 0.8 | 3,200,000 | 3,404,288 | 2022/6/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第325回 | 0.8 | 4,900,000 | 5,226,193 | 2022/9/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第326回 | 0.7 | 2,100,000 | 2,231,607 | 2022/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第327回 | 0.8 | 3,100,000 | 3,314,737 | 2022/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第328回 | 0.6 | 5,500,000 | 5,820,320 | 2023/3/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第329回 | 0.8 | 5,300,000 | 5,695,804 | 2023/6/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第330回 | 0.8 | 3,800,000 | 4,092,714 | 2023/9/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第331回 | 0.6 | 1,900,000 | 2,018,351 | 2023/9/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第332回 | 0.6 | 5,400,000 | 5,745,978 | 2023/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第333回 | 0.6 | 5,000,000 | 5,326,900 | 2024/3/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第334回 | 0.6 | 4,100,000 | 4,375,151 | 2024/6/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第335回 | 0.5 | 4,700,000 | 4,981,906 | 2024/9/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第336回 | 0.5 | 2,700,000 | 2,865,699 | 2024/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第337回 | 0.3 | 3,700,000 | 3,863,096 | 2024/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第338回 | 0.4 | 4,900,000 | 5,161,415 | 2025/3/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第339回 | 0.4 | 5,900,000 | 6,218,305 | 2025/6/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第340回 | 0.4 | 6,000,000 | 6,327,000 | 2025/9/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第341回 | 0.3 | 7,200,000 | 7,526,376 | 2025/12/20 |
| 国庫債券　利付（10年）第342回 | 0.1 | 7,500,000 | 7,692,825 | 2026/3/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第１回 | 2.8 | 100,000 | 137,804 | 2029/9/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第２回 | 2.4 | 200,000 | 266,844 | 2030/2/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第３回 | 2.3 | 160,000 | 211,902 | 2030/5/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第４回 | 2.9 | 900,000 | 1,276,974 | 2030/11/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第５回 | 2.2 | 150,000 | 198,738 | 2031/5/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第６回 | 2.4 | 700,000 | 954,443 | 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 | 814,938 | 2032/５/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第８回 | 1.8 | 100,000 | 128,281 | 2032/11/22 |
| 国庫債券　利付（30年）第９回 | 1.4 | 65,000 | 79,222 | 2032/12/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第10回 | 1.1 | 250,000 | 292,597 | 2033/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第11回 | 1.7 | 160,000 | 203,444 | 2033/６/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第12回 | 2.1 | 220,000 | 295,325 | 2033/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第13回 | 2.0 | 290,000 | 385,044 | 2033/12/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第14回 | 2.4 | 800,000 | 1,120,672 | 2034/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第15回 | 2.5 | 900,000 | 1,279,431 | 2034/６/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第16回 | 2.5 | 915,000 | 1,303,719 | 2034/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第17回 | 2.4 | 1,200,000 | 1,691,844 | 2034/12/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第18回 | 2.3 | 1,500,000 | 2,091,555 | 2035/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第19回 | 2.3 | 1,600,000 | 2,235,120 | 2035/６/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第20回 | 2.5 | 1,900,000 | 2,732,447 | 2035/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第21回 | 2.3 | 1,400,000 | 1,964,410 | 2035/12/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第22回 | 2.5 | 600,000 | 866,964 | 2036/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第23回 | 2.5 | 840,000 | 1,218,361 | 2036/６/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第24回 | 2.5 | 700,000 | 1,018,150 | 2036/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第25回 | 2.3 | 500,000 | 709,470 | 2036/12/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第26回 | 2.4 | 850,000 | 1,227,221 | 2037/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第27回 | 2.5 | 1,550,000 | 2,283,351 | 2037/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第28回 | 2.5 | 700,000 | 1,037,540 | 2038/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第29回 | 2.4 | 800,000 | 1,176,024 | 2038/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第30回 | 2.3 | 900,000 | 1,311,030 | 2039/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第31回 | 2.2 | 1,000,000 | 1,442,570 | 2039/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第32回 | 2.3 | 1,900,000 | 2,804,172 | 2040/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第33回 | 2.0 | 2,000,000 | 2,829,040 | 2040/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第34回 | 2.2 | 2,300,000 | 3,384,243 | 2041/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第35回 | 2.0 | 2,300,000 | 3,290,794 | 2041/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第36回 | 2.0 | 1,800,000 | 2,589,876 | 2042/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第37回 | 1.9 | 2,100,000 | 2,986,368 | 2042/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第38回 | 1.8 | 1,400,000 | 1,966,006 | 2043/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第39回 | 1.9 | 1,600,000 | 2,293,568 | 2043/６/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第40回 | 1.8 | 1,100,000 | 1,550,659 | 2043/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第41回 | 1.7 | 1,000,000 | 1,387,250 | 2043/12/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第42回 | 1.7 | 1,200,000 | 1,668,636 | 2044/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第43回 | 1.7 | 1,300,000 | 1,812,044 | 2044/６/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第44回 | 1.7 | 1,400,000 | 1,956,122 | 2044/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第45回 | 1.5 | 1,900,000 | 2,555,443 | 2044/12/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第46回 | 1.5 | 1,300,000 | 1,749,748 | 2045/３/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第47回 | 1.6 | 1,900,000 | 2,614,514 | 2045/６/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第48回 | 1.4 | 1,400,000 | 1,853,852 | 2045/９/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第49回 | 1.4 | 1,400,000 | 1,857,492 | 2045/12/20 |
| 国庫債券　利付（30年）第50回 | 0.8 | 1,900,000 | 2,198,357 | 2046/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第36回 | 3.0 | 380,000 | 395,397 | 2017/９/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第37回 | 3.1 | 320,000 | 333,366 | 2017/９/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第38回 | 2.7 | 170,000 | 178,717 | 2018/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第39回 | 2.6 | 511,000 | 536,309 | 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 | 554,919 | 2018/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第41回 | 1.5 | 255,000 | 267,296 | 2019/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第42回 | 2.6 | 683,000 | 736,642 | 2019/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第43回 | 2.9 | 400,000 | 441,024 | 2019/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第44回 | 2.5 | 150,000 | 165,466 | 2020/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第45回 | 2.4 | 242,000 | 266,040 | 2020/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第46回 | 2.2 | 90,000 | 98,836 | 2020/6/22 |
| 国庫債券　利付（20年）第47回 | 2.2 | 1,230,000 | 1,358,092 | 2020/9/21 |
| 国庫債券　利付（20年）第48回 | 2.5 | 200,000 | 224,788 | 2020/12/21 |
| 国庫債券　利付（20年）第49回 | 2.1 | 200,000 | 222,290 | 2021/3/22 |
| 国庫債券　利付（20年）第50回 | 1.9 | 183,000 | 201,687 | 2021/3/22 |
| 国庫債券　利付（20年）第51回 | 2.0 | 310,000 | 344,906 | 2021/6/21 |
| 国庫債券　利付（20年）第52回 | 2.1 | 100,000 | 112,397 | 2021/9/21 |
| 国庫債券　利付（20年）第53回 | 2.1 | 250,000 | 282,625 | 2021/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第54回 | 2.2 | 250,000 | 284,017 | 2021/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第55回 | 2.0 | 231,000 | 261,189 | 2022/3/21 |
| 国庫債券　利付（20年）第56回 | 2.0 | 120,000 | 136,416 | 2022/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第57回 | 1.9 | 210,000 | 237,451 | 2022/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第58回 | 1.9 | 180,000 | 204,600 | 2022/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第59回 | 1.7 | 230,000 | 259,502 | 2022/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第60回 | 1.4 | 780,000 | 864,903 | 2022/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第61回 | 1.0 | 300,000 | 325,695 | 2023/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第62回 | 0.8 | 440,000 | 472,859 | 2023/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第63回 | 1.8 | 300,000 | 343,623 | 2023/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第64回 | 1.9 | 400,000 | 463,080 | 2023/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第65回 | 1.9 | 455,000 | 528,864 | 2023/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第66回 | 1.8 | 300,000 | 346,416 | 2023/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第67回 | 1.9 | 310,000 | 361,726 | 2024/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第68回 | 2.2 | 290,000 | 345,236 | 2024/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第69回 | 2.1 | 560,000 | 662,256 | 2024/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第70回 | 2.4 | 540,000 | 654,517 | 2024/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第71回 | 2.2 | 200,000 | 239,164 | 2024/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第72回 | 2.1 | 670,000 | 799,457 | 2024/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第73回 | 2.0 | 1,600,000 | 1,904,016 | 2024/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第74回 | 2.1 | 1,300,000 | 1,558,245 | 2024/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第75回 | 2.1 | 600,000 | 722,070 | 2025/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第76回 | 1.9 | 910,000 | 1,078,968 | 2025/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第77回 | 2.0 | 700,000 | 836,192 | 2025/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第78回 | 1.9 | 800,000 | 952,032 | 2025/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第79回 | 2.0 | 860,000 | 1,031,294 | 2025/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第80回 | 2.1 | 900,000 | 1,087,488 | 2025/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第81回 | 2.0 | 360,000 | 433,342 | 2025/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第82回 | 2.1 | 820,000 | 994,758 | 2025/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第83回 | 2.1 | 1,370,000 | 1,667,564 | 2025/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第84回 | 2.0 | 1,200,000 | 1,449,084 | 2025/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第85回 | 2.1 | 400,000 | 488,688 | 2026/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第86回 | 2.3 | 1,400,000 | 1,738,058 | 2026/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第87回 | 2.2 | 500,000 | 615,800 | 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 | 1,371,205 | 2026/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第89回 | 2.2 | 470,000 | 581,122 | 2026/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第90回 | 2.2 | 1,500,000 | 1,861,785 | 2026/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第91回 | 2.3 | 250,000 | 312,890 | 2026/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第92回 | 2.1 | 1,550,000 | 1,914,560 | 2026/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第93回 | 2.0 | 300,000 | 368,577 | 2027/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第94回 | 2.1 | 200,000 | 247,890 | 2027/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第95回 | 2.3 | 700,000 | 886,662 | 2027/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第96回 | 2.1 | 400,000 | 497,776 | 2027/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第97回 | 2.2 | 1,300,000 | 1,638,988 | 2027/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第98回 | 2.1 | 300,000 | 374,820 | 2027/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第99回 | 2.1 | 2,100,000 | 2,632,434 | 2027/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第100回 | 2.2 | 1,520,000 | 1,929,457 | 2028/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第101回 | 2.4 | 250,000 | 323,457 | 2028/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第102回 | 2.4 | 500,000 | 649,315 | 2028/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第103回 | 2.3 | 600,000 | 771,924 | 2028/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第104回 | 2.1 | 400,000 | 504,944 | 2028/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第105回 | 2.1 | 1,900,000 | 2,406,084 | 2028/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第106回 | 2.2 | 400,000 | 511,476 | 2028/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第107回 | 2.1 | 300,000 | 381,309 | 2028/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第108回 | 1.9 | 1,600,000 | 1,993,392 | 2028/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第109回 | 1.9 | 900,000 | 1,124,964 | 2029/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第110回 | 2.1 | 1,100,000 | 1,403,160 | 2029/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第111回 | 2.2 | 800,000 | 1,034,648 | 2029/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第112回 | 2.1 | 1,800,000 | 2,304,450 | 2029/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第113回 | 2.1 | 1,800,000 | 2,311,218 | 2029/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第114回 | 2.1 | 2,500,000 | 3,221,275 | 2029/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第115回 | 2.2 | 500,000 | 651,025 | 2029/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第116回 | 2.2 | 1,100,000 | 1,437,370 | 2030/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第117回 | 2.1 | 1,900,000 | 2,456,529 | 2030/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第118回 | 2.0 | 500,000 | 641,685 | 2030/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第119回 | 1.8 | 800,000 | 1,004,248 | 2030/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第120回 | 1.6 | 800,000 | 981,800 | 2030/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第121回 | 1.9 | 2,000,000 | 2,544,780 | 2030/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第122回 | 1.8 | 1,100,000 | 1,383,943 | 2030/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第123回 | 2.1 | 2,000,000 | 2,610,480 | 2030/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第124回 | 2.0 | 1,000,000 | 1,290,740 | 2030/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第125回 | 2.2 | 900,000 | 1,190,907 | 2031/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第126回 | 2.0 | 1,000,000 | 1,293,780 | 2031/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第127回 | 1.9 | 800,000 | 1,023,248 | 2031/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第128回 | 1.9 | 1,500,000 | 1,922,850 | 2031/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第129回 | 1.8 | 500,000 | 633,475 | 2031/6/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第130回 | 1.8 | 1,600,000 | 2,031,200 | 2031/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第131回 | 1.7 | 800,000 | 1,003,448 | 2031/9/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第132回 | 1.7 | 1,300,000 | 1,634,737 | 2031/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第133回 | 1.8 | 1,400,000 | 1,782,074 | 2031/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第134回 | 1.8 | 900,000 | 1,148,607 | 2032/3/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第135回 | 1.7 | 400,000 | 504,232 | 2032/3/20 |

| 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136回 | 1.6 | 700,000 | 871,451 | 2032/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第137回 | 1.7 | 1,000,000 | 1,262,720 | 2032/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第138回 | 1.5 | 800,000 | 984,776 | 2032/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第139回 | 1.6 | 700,000 | 872,795 | 2032/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第140回 | 1.7 | 2,400,000 | 3,035,520 | 2032/９/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第141回 | 1.7 | 1,700,000 | 2,153,475 | 2032/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第142回 | 1.8 | 1,250,000 | 1,603,837 | 2032/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第143回 | 1.6 | 2,500,000 | 3,132,775 | 2033/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第144回 | 1.5 | 1,500,000 | 1,854,840 | 2033/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第145回 | 1.7 | 2,600,000 | 3,305,978 | 2033/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第146回 | 1.7 | 2,400,000 | 3,056,016 | 2033/９/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第147回 | 1.6 | 2,700,000 | 3,396,168 | 2033/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第148回 | 1.5 | 2,500,000 | 3,104,550 | 2034/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第149回 | 1.5 | 2,600,000 | 3,231,800 | 2034/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第150回 | 1.4 | 2,930,000 | 3,593,029 | 2034/９/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第151回 | 1.2 | 2,700,000 | 3,215,835 | 2034/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第152回 | 1.2 | 3,400,000 | 4,050,624 | 2035/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第153回 | 1.3 | 3,450,000 | 4,178,640 | 2035/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第154回 | 1.2 | 3,500,000 | 4,175,535 | 2035/９/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第155回 | 1.0 | 3,100,000 | 3,578,640 | 2035/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第156回 | 0.4 | 2,800,000 | 2,909,088 | 2036/３/20 |
| ポーランド共和国　第12回円貨債券（2012） | 1.05 | 100,000 | 100,938 | 2017/11/８ |
| ポーランド共和国　第15回円貨債券（2013） | 0.91 | 100,000 | 101,433 | 2020/11/13 |
| 小計 | | 463,515,000 | 530,237,202 | |
| **地方債証券** | | | | |
| 東京都　公募第655回 | 1.42 | 100,000 | 102,536 | 2018/３/20 |
| 東京都　公募第659回 | 1.62 | 300,000 | 309,843 | 2018/６/20 |
| 東京都　公募第660回 | 1.58 | 100,000 | 103,232 | 2018/６/20 |
| 東京都　公募第664回 | 1.4 | 100,000 | 103,507 | 2018/12/20 |
| 東京都　公募第668回 | 1.54 | 200,000 | 208,498 | 2019/３/20 |
| 東京都　公募第671回 | 1.42 | 100,000 | 104,298 | 2019/６/20 |
| 東京都　公募第685回 | 1.13 | 100,000 | 104,469 | 2020/６/19 |
| 東京都　公募第690回 | 1.29 | 200,000 | 211,348 | 2020/12/18 |
| 東京都　公募第703回 | 0.99 | 100,000 | 105,235 | 2021/12/20 |
| 東京都　公募第707回 | 0.87 | 100,000 | 104,780 | 2022/３/18 |
| 東京都　公募第708回 | 0.89 | 100,000 | 105,146 | 2022/６/20 |
| 東京都　公募第710回 | 0.81 | 100,000 | 104,667 | 2022/６/20 |
| 東京都　公募第712回 | 0.77 | 100,000 | 104,613 | 2022/９/20 |
| 東京都　公募第715回 | 0.76 | 100,000 | 104,664 | 2022/12/20 |
| 東京都　公募第716回 | 0.77 | 200,000 | 209,458 | 2022/12/20 |
| 東京都　公募（30年）第７回 | 2.51 | 100,000 | 143,842 | 2038/９/17 |
| 東京都　公募第10回 | 2.31 | 200,000 | 282,190 | 2039/９/20 |
| 東京都　公募（７年）第３回 | 0.58 | 100,000 | 101,339 | 2018/９/20 |
| 東京都　公募第１回 | 1.54 | 300,000 | 331,155 | 2023/６/20 |
| 東京都　公募第７回 | 2.16 | 100,000 | 119,305 | 2025/９/19 |
| 東京都　公募（20年）第16回 | 2.01 | 200,000 | 247,144 | 2028/12/20 |
| 東京都　公募（20年）第17回 | 2.09 | 200,000 | 249,120 | 2028/12/20 |
| 東京都　公募第23回 | 2.12 | 100,000 | 128,771 | 2030/12/20 |

| 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26回 | 1.74 | 300,000 | 374,187 | 2032/6/18 |
| 北海道　公募平成20年度第７回 | 1.72 | 300,000 | 311,388 | 2018/9/25 |
| 北海道　公募平成21年度第６回 | 1.6 | 100,000 | 104,922 | 2019/8/28 |
| 北海道　公募平成21年度第10回 | 1.5 | 100,000 | 104,951 | 2019/11/27 |
| 北海道　公募平成24年度第６回 | 0.84 | 100,000 | 104,714 | 2022/8/31 |
| 北海道　公募平成24年度第９回 | 0.79 | 100,000 | 104,492 | 2022/10/31 |
| 北海道　公募平成25年度第１回 | 0.58 | 300,000 | 310,314 | 2023/4/26 |
| 北海道　公募（５年）平成25年度第８回 | 0.31 | 100,000 | 100,600 | 2018/9/25 |
| 北海道　公募（５年）平成26年度第８回 | 0.178 | 200,000 | 200,800 | 2019/9/25 |
| 北海道　公募（５年）平成26年度第10回 | 0.147 | 100,000 | 100,298 | 2019/11/28 |
| 宮城県　公募（５年）第９回１号 | 0.35 | 500,000 | 503,850 | 2018/7/26 |
| 神奈川県　公募第155回 | 1.61 | 100,000 | 103,240 | 2018/6/20 |
| 神奈川県　公募第156回 | 1.66 | 101,000 | 104,791 | 2018/9/20 |
| 神奈川県　公募第184回 | 1.02 | 100,000 | 104,984 | 2021/6/18 |
| 神奈川県　公募第188回 | 1.05 | 200,000 | 211,804 | 2022/3/18 |
| 神奈川県　公募第196回 | 0.678 | 100,000 | 104,466 | 2023/3/20 |
| 神奈川県　公募第200回 | 0.825 | 100,000 | 105,786 | 2023/9/20 |
| 神奈川県　公募第205回 | 0.664 | 100,000 | 104,895 | 2024/3/19 |
| 神奈川県　公募第206回 | 0.654 | 100,000 | 104,976 | 2024/6/20 |
| 神奈川県　公募第210回 | 0.451 | 200,000 | 206,958 | 2024/12/20 |
| 神奈川県　公募（30年）第３回 | 2.62 | 100,000 | 143,623 | 2037/3/19 |
| 神奈川県　公募第７回 | 2.22 | 300,000 | 367,581 | 2027/3/19 |
| 神奈川県　公募（５年）第56回 | 0.29 | 100,000 | 100,513 | 2018/3/20 |
| 大阪府　公募第304回 | 1.98 | 150,000 | 153,213 | 2017/7/28 |
| 大阪府　公募第320回 | 1.84 | 400,000 | 417,452 | 2018/11/27 |
| 大阪府　公募第337回 | 1.44 | 200,000 | 210,640 | 2020/4/28 |
| 大阪府　公募第346回 | 1.25 | 100,000 | 105,317 | 2021/1/28 |
| 大阪府　公募第356回 | 1.06 | 100,000 | 105,407 | 2021/12/27 |
| 大阪府　公募第378回 | 0.7 | 104,000 | 109,007 | 2023/11/28 |
| 大阪府　公募第384回 | 0.67 | 100,000 | 104,899 | 2024/5/29 |
| 大阪府　公募第387回 | 0.521 | 300,000 | 311,514 | 2024/8/28 |
| 大阪府　公募第５回 | 2.16 | 100,000 | 127,082 | 2030/5/28 |
| 大阪府　公募第８回 | 1.83 | 100,000 | 124,413 | 2031/12/22 |
| 大阪府　公募第98回 | 0.295 | 200,000 | 201,134 | 2018/9/27 |
| 大阪府　公募（５年）第99回 | 0.24 | 240,000 | 241,104 | 2018/10/30 |
| 大阪府　公募（５年）第101回 | 0.23 | 148,000 | 148,648 | 2018/12/26 |
| 大阪府　公募第102回 | 0.223 | 100,000 | 100,436 | 2019/1/30 |
| 大阪府　公募（５年）第130回 | 0.001 | 600,000 | 600,174 | 2021/5/28 |
| 京都府　公募平成19年度第１回 | 1.81 | 100,000 | 102,323 | 2017/9/26 |
| 京都府　公募平成20年度第３回 | 1.57 | 140,000 | 145,479 | 2018/12/19 |
| 京都府　公募平成24年度第２回 | 0.91 | 100,000 | 105,328 | 2022/6/20 |
| 京都府　公募平成24年度第６回 | 0.8 | 100,000 | 104,899 | 2022/10/21 |
| 京都府　公募平成26年度第５回 | 1.455 | 100,000 | 121,114 | 2034/8/10 |
| 京都府　公募平成26年度第７回 | 0.564 | 200,000 | 208,782 | 2024/9/19 |
| 兵庫県　公募平成20年度第３回 | 1.76 | 100,000 | 103,328 | 2018/5/22 |
| 兵庫県　公募平成20年度第12回 | 1.82 | 100,000 | 104,352 | 2018/11/27 |
| 兵庫県　公募平成20年度第16回 | 1.6 | 100,000 | 104,048 | 2019/1/23 |
| 兵庫県　公募平成21年度第13回 | 1.48 | 100,000 | 104,434 | 2019/7/17 |

| 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21年度第25回 | 1.54 | 100,000 | 105,113 | 2019/11/20 |
| 兵庫県　公募平成22年度第１回 | 1.46 | 100,000 | 105,411 | 2020/４/16 |
| 兵庫県　公募（30年）第２回 | 2.36 | 100,000 | 141,417 | 2040/３/19 |
| 兵庫県　公募（15年）第１回 | 1.66 | 300,000 | 345,933 | 2026/７/29 |
| 兵庫県　公募（15年）第３回 | 1.35 | 100,000 | 113,247 | 2027/７/16 |
| 兵庫県　公募（12年）第３回 | 0.56 | 300,000 | 313,017 | 2025/４/16 |
| 兵庫県　公募第２回 | 2.37 | 100,000 | 125,019 | 2027/９/17 |
| 兵庫県　公募第９回 | 2.25 | 100,000 | 126,115 | 2029/11/19 |
| 兵庫県　公募（20年）第14回 | 1.72 | 100,000 | 123,452 | 2032/５/24 |
| 静岡県　公募平成19年度第４回 | 1.94 | 200,000 | 204,688 | 2017/８/28 |
| 静岡県　公募平成19年度第７回 | 1.81 | 100,000 | 102,621 | 2017/11/28 |
| 静岡県　公募平成21年度第２回 | 1.65 | 100,000 | 104,951 | 2019/６/25 |
| 静岡県　公募平成21年度第７回 | 1.54 | 100,000 | 105,278 | 2019/11/25 |
| 静岡県　公募（５年）平成24年度第８回 | 0.236 | 100,000 | 100,363 | 2017/10/18 |
| 静岡県　公募平成24年度第10回 | 0.678 | 100,000 | 104,469 | 2023/３/22 |
| 静岡県　公募平成25年度第５回 | 0.926 | 101,000 | 107,402 | 2023/７/25 |
| 静岡県　公募平成26年度第３回 | 0.679 | 165,000 | 173,469 | 2024/５/27 |
| 静岡県　公募平成26年度第８回 | 0.564 | 100,000 | 104,357 | 2024/９/25 |
| 静岡県　公募平成26年度第９回 | 0.554 | 100,000 | 104,359 | 2024/10/24 |
| 静岡県　公募（20年）第11回 | 1.841 | 100,000 | 123,885 | 2030/10/18 |
| 静岡県　公募（20年）第14回 | 1.736 | 100,000 | 124,667 | 2032/６/18 |
| 愛知県　公募平成19年度第３回 | 1.89 | 111,000 | 113,470 | 2017/８/17 |
| 愛知県　公募平成19年度第４回 | 1.87 | 100,000 | 102,526 | 2017/10/18 |
| 愛知県　公募平成20年度第７回 | 1.39 | 210,000 | 217,623 | 2019/１/30 |
| 愛知県　公募平成20年度第８回 | 2.04 | 100,000 | 123,485 | 2028/12/20 |
| 愛知県　公募平成20年度第10回 | 1.48 | 100,000 | 104,100 | 2019/３/27 |
| 愛知県　公募平成21年度第３回 | 1.66 | 114,000 | 119,682 | 2019/６/26 |
| 愛知県　公募平成21年度第17回 | 1.41 | 100,000 | 105,191 | 2020/２/26 |
| 愛知県　公募平成22年度第３回 | 1.364 | 100,000 | 105,343 | 2020/５/28 |
| 愛知県　公募平成22年度第９回 | 1.153 | 100,000 | 104,884 | 2020/９/30 |
| 愛知県　公募平成23年度第19回 | 1.006 | 100,000 | 105,601 | 2022/２/28 |
| 愛知県　公募平成24年度第２回 | 0.982 | 100,000 | 105,617 | 2022/４/27 |
| 愛知県　公募（20年）平成24年度第４回 | 1.687 | 100,000 | 123,682 | 2032/６/11 |
| 愛知県　公募（５年）平成24年度第６回 | 0.2 | 1,100,000 | 1,102,728 | 2017/７/13 |
| 愛知県　公募（15年）平成24年度第14回 | 1.314 | 400,000 | 454,840 | 2027/12/13 |
| 愛知県　公募平成24年度第17回 | 1.829 | 100,000 | 126,426 | 2033/２/８ |
| 愛知県　公募平成26年度第８回 | 1.814 | 100,000 | 135,617 | 2044/６/20 |
| 愛知県　公募平成26年度第13回 | 1.363 | 100,000 | 119,261 | 2034/11/14 |
| 広島県　公募平成20年度第３回 | 1.6 | 300,000 | 310,959 | 2018/９/25 |
| 広島県　公募平成22年度第６回 | 1.26 | 200,000 | 211,384 | 2021/１/25 |
| 広島県　公募平成24年度第４回 | 0.81 | 100,000 | 105,043 | 2022/11/28 |
| 広島県　公募平成25年度第３回 | 0.8 | 200,000 | 211,156 | 2023/９/25 |
| 広島県　公募（５年）平成25年度第６回 | 0.21 | 300,000 | 301,722 | 2019/２/25 |
| 広島県　公募平成26年度第５回 | 0.33 | 109,650 | 112,374 | 2025/１/27 |
| 埼玉県　公募平成19年度第７回 | 1.65 | 200,000 | 205,570 | 2018/２/27 |
| 埼玉県　公募平成20年度第１回 | 1.55 | 100,000 | 102,861 | 2018/４/24 |
| 埼玉県　公募平成21年度第５回 | 1.41 | 100,000 | 104,613 | 2019/９/25 |
| 埼玉県　公募平成22年度第２回 | 1.37 | 200,000 | 210,716 | 2020/５/26 |

| 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24年度第４回 | 0.84 | 100,000 | 104,988 | 2022/7/25 |
| 埼玉県　公募（５年）平成24年度第８回 | 0.21 | 200,000 | 200,652 | 2017/12/28 |
| 埼玉県　公募平成25年度第４回 | 0.921 | 100,000 | 106,301 | 2023/7/24 |
| 埼玉県　公募平成25年度第６回 | 0.806 | 148,000 | 156,382 | 2023/9/27 |
| 埼玉県　公募（５年）平成25年度第７回 | 0.261 | 100,000 | 100,609 | 2018/10/25 |
| 埼玉県　公募平成25年度第10回 | 0.67 | 100,000 | 104,986 | 2024/2/26 |
| 埼玉県　公募平成25年度第11回 | 0.655 | 100,000 | 104,838 | 2024/3/26 |
| 埼玉県　公募平成26年度第６回 | 0.554 | 200,000 | 208,552 | 2024/9/26 |
| 福岡県　公募平成19年度第６回 | 1.72 | 100,000 | 102,169 | 2017/9/20 |
| 福岡県　公募平成19年度第８回 | 1.62 | 100,000 | 102,445 | 2017/12/20 |
| 福岡県　公募平成20年度第３回 | 1.59 | 100,000 | 103,221 | 2018/6/20 |
| 福岡県　公募平成22年度第５回 | 0.94 | 100,000 | 104,089 | 2020/10/28 |
| 福岡県　公募平成23年度第５回 | 1.02 | 100,000 | 105,336 | 2021/10/25 |
| 福岡県　公募平成24年度第10回 | 0.18 | 100,000 | 100,321 | 2018/1/29 |
| 福岡県　公募平成26年度第４回 | 0.135 | 100,000 | 100,505 | 2019/9/26 |
| 福岡県　公募平成23年度第１回 | 1.491 | 100,000 | 114,309 | 2026/11/27 |
| 福岡県　公募（30年）平成19年度第１回 | 2.62 | 100,000 | 144,293 | 2037/9/18 |
| 福岡県　公募（30年）平成26年度第１回 | 1.827 | 100,000 | 135,944 | 2044/6/20 |
| 福岡県　公募（20年）平成20年度第２回 | 2.05 | 100,000 | 123,608 | 2028/12/20 |
| 福岡県　公募（20年）平成24年度第２回 | 1.635 | 100,000 | 122,835 | 2032/8/16 |
| 千葉県　公募平成20年度第１回 | 1.55 | 100,000 | 102,866 | 2018/4/25 |
| 千葉県　公募平成20年度第６回 | 1.64 | 200,000 | 207,662 | 2018/10/25 |
| 千葉県　公募平成21年度第１回 | 1.53 | 100,000 | 104,331 | 2019/4/25 |
| 千葉県　公募平成21年度第11回 | 1.42 | 180,000 | 189,180 | 2020/1/24 |
| 千葉県　公募平成24度第１回 | 1.05 | 100,000 | 106,009 | 2022/4/25 |
| 千葉県　公募平成24年度第２回 | 0.91 | 100,000 | 105,234 | 2022/5/25 |
| 千葉県　公募平成24年度第４回 | 0.22 | 100,000 | 100,305 | 2017/8/25 |
| 千葉県　公募平成24年度第８回 | 0.84 | 100,000 | 105,435 | 2023/1/25 |
| 千葉県　公募平成25年度第２回 | 0.26 | 900,000 | 904,635 | 2018/5/25 |
| 千葉県　公募平成25年度第３回 | 0.89 | 100,000 | 106,046 | 2023/6/23 |
| 千葉県　公募平成25年度第４回 | 0.92 | 100,000 | 106,297 | 2023/7/25 |
| 千葉県　公募（20年）第８回 | 2.18 | 100,000 | 128,014 | 2030/4/19 |
| 千葉県　公募（20年）第17回 | 1.403 | 100,000 | 120,186 | 2034/10/13 |
| 新潟県　公募平成20年度第２回 | 1.52 | 200,000 | 208,270 | 2019/2/27 |
| 新潟県　公募平成21年度第２回 | 1.55 | 150,000 | 158,004 | 2019/11/27 |
| 長野県　公募平成25年度第１回 | 0.24 | 1,100,000 | 1,106,754 | 2018/12/25 |
| 群馬県　公募第８回 | 1.03 | 100,000 | 105,502 | 2021/11/25 |
| 群馬県　公募（５年）第４回 | 0.235 | 600,000 | 603,480 | 2018/11/22 |
| 群馬県　公募（20年）第３回 | 1.687 | 100,000 | 123,352 | 2032/6/25 |
| 岐阜県　公募平成19年度第１回 | 1.87 | 190,000 | 194,824 | 2017/10/26 |
| 岐阜県　公募平成26年度第１回 | 0.554 | 186,670 | 194,420 | 2024/9/30 |
| 共同発行市場地方債　公募第56回 | 1.72 | 400,000 | 409,832 | 2017/11/24 |
| 共同発行市場地方債　公募第58回 | 1.59 | 270,500 | 277,400 | 2018/1/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第62回 | 1.74 | 100,000 | 103,372 | 2018/5/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第63回 | 1.88 | 200,000 | 207,630 | 2018/6/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第64回 | 1.78 | 262,000 | 271,848 | 2018/7/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第65回 | 1.62 | 700,000 | 724,815 | 2018/8/24 |
| 共同発行市場地方債　公募第66回 | 1.55 | 181,000 | 187,365 | 2018/9/25 |

| 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 | |
| 共同発行市場地方債　公募第68回 | 1.69 | 900,000 | 936,891 | 2018/11/22 |
| 共同発行市場地方債　公募第70回 | 1.42 | 110,000 | 114,054 | 2019/1/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第74回 | 1.57 | 500,000 | 522,925 | 2019/5/24 |
| 共同発行市場地方債　公募第75回 | 1.64 | 310,000 | 325,270 | 2019/6/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第82回 | 1.42 | 300,000 | 315,249 | 2020/1/24 |
| 共同発行市場地方債　公募第84回 | 1.38 | 500,000 | 525,815 | 2020/3/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第85回 | 1.44 | 100,000 | 105,545 | 2020/4/24 |
| 共同発行市場地方債　公募第88回 | 1.17 | 100,000 | 104,782 | 2020/7/24 |
| 共同発行市場地方債　公募第89回 | 1.04 | 100,000 | 104,342 | 2020/8/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第92回 | 1.03 | 110,000 | 114,965 | 2020/11/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第93回 | 1.25 | 300,000 | 316,767 | 2020/12/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第94回 | 1.24 | 300,000 | 316,875 | 2021/1/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第96回 | 1.29 | 100,000 | 106,060 | 2021/3/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第101回 | 1.05 | 300,000 | 316,056 | 2021/8/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第102回 | 1.03 | 150,000 | 157,998 | 2021/9/24 |
| 共同発行市場地方債　公募第103回 | 1.0 | 100,000 | 105,257 | 2021/10/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第108回 | 1.01 | 200,000 | 211,444 | 2022/3/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第110回 | 0.89 | 200,000 | 210,294 | 2022/5/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第111回 | 0.89 | 200,000 | 210,562 | 2022/6/24 |
| 共同発行市場地方債　公募第113回 | 0.77 | 200,000 | 209,316 | 2022/8/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第115回 | 0.8 | 100,000 | 104,974 | 2022/10/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第116回 | 0.8 | 200,000 | 210,082 | 2022/11/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第118回 | 0.84 | 100,000 | 105,400 | 2023/1/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第119回 | 0.8 | 200,000 | 210,472 | 2023/2/24 |
| 共同発行市場地方債　公募第120回 | 0.68 | 300,000 | 313,458 | 2023/3/24 |
| 共同発行市場地方債　公募第121回 | 0.57 | 100,000 | 103,757 | 2023/4/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第122回 | 0.62 | 400,000 | 416,736 | 2023/5/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第124回 | 0.91 | 100,000 | 106,264 | 2023/7/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第126回 | 0.81 | 100,000 | 105,727 | 2023/9/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第128回 | 0.66 | 300,000 | 314,349 | 2023/11/24 |
| 共同発行市場地方債　公募第130回 | 0.76 | 100,000 | 105,571 | 2024/1/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第132回 | 0.66 | 100,000 | 104,915 | 2024/3/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第136回 | 0.611 | 200,000 | 209,378 | 2024/7/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第137回 | 0.566 | 200,000 | 208,820 | 2024/8/23 |
| 共同発行市場地方債　公募第139回 | 0.544 | 155,000 | 161,696 | 2024/10/25 |
| 共同発行市場地方債　公募第143回 | 0.448 | 540,000 | 559,537 | 2025/2/25 |
| 堺市　公募平成22年度第１回 | 1.97 | 100,000 | 125,584 | 2030/11/19 |
| 堺市　公募平成26年度第１回 | 1.664 | 100,000 | 131,274 | 2044/9/20 |
| 島根県　公募平成22年度第１回 | 1.08 | 100,000 | 104,738 | 2020/11/26 |
| 島根県　公募平成25年度第３回 | 0.209 | 700,000 | 704,312 | 2019/3/25 |
| 福島県　公募平成24年度第２回 | 0.17 | 100,000 | 100,311 | 2018/2/26 |
| 福島県　公募平成26年度第１回 | 0.495 | 200,000 | 207,562 | 2024/11/28 |
| 滋賀県　公募平成25年度第１回 | 0.65 | 100,000 | 104,640 | 2023/11/29 |
| 滋賀県　公募平成26年度第１回 | 0.495 | 142,000 | 147,431 | 2024/11/28 |
| 栃木県　公募平成25年度第１回 | 0.65 | 100,000 | 104,640 | 2023/11/29 |
| 新潟市　公募平成25年度第１回 | 0.72 | 233,200 | 245,352 | 2023/12/26 |
| 大阪市　公募平成20年度第３回 | 1.82 | 110,000 | 114,193 | 2018/7/23 |
| 大阪市　公募平成21年度第６回 | 1.57 | 100,000 | 105,345 | 2019/11/25 |

| 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 | |
| 大阪市　公募平成25年度第１回 | 0.401 | 800,000 | 806,272 | 2018/５/23 |
| 大阪市　公募平成25年度第６回 | 0.694 | 100,000 | 104,760 | 2023/11/22 |
| 大阪市　公募（15年）第１回 | 1.753 | 100,000 | 116,243 | 2026/７/17 |
| 大阪市　公募（20年）第５回 | 2.47 | 100,000 | 127,905 | 2028/９/21 |
| 大阪市　公募（20年）第６回 | 2.21 | 100,000 | 125,191 | 2028/12/20 |
| 大阪市　公募（20年）第17回 | 1.721 | 100,000 | 123,995 | 2032/12/21 |
| 名古屋市　公募第460回 | 1.74 | 200,000 | 204,452 | 2017/９/20 |
| 名古屋市　公募第464回 | 1.61 | 300,000 | 310,890 | 2018/９/20 |
| 名古屋市　公募第469回 | 1.34 | 100,000 | 104,702 | 2019/12/20 |
| 名古屋市　公募第478回 | 1.063 | 100,000 | 105,946 | 2022/３/18 |
| 名古屋市　公募第488回 | 0.598 | 300,000 | 314,145 | 2024/９/20 |
| 名古屋市　公募（６年）第１回 | 0.283 | 200,000 | 201,186 | 2018/６/20 |
| 名古屋市　公募（12年）第１回 | 1.033 | 200,000 | 217,896 | 2025/６/20 |
| 名古屋市　公募（15年）第２回 | 0.905 | 100,000 | 109,847 | 2029/11/16 |
| 京都市　公募平成19年度第２回 | 1.74 | 300,000 | 307,920 | 2017/12/27 |
| 京都市　公募平成19年度第４回 | 1.62 | 190,000 | 195,192 | 2018/２/26 |
| 京都市　公募平成20年度第４回 | 1.54 | 200,000 | 208,232 | 2019/２/26 |
| 京都市　公募平成23年度第４回 | 1.067 | 100,000 | 105,692 | 2021/12/22 |
| 京都市　公募平成25年度第３回 | 0.312 | 100,000 | 100,707 | 2018/９/27 |
| 京都市　公募（20年）第２回 | 2.12 | 100,000 | 119,266 | 2025/９/19 |
| 京都市　公募（20年）第13回 | 1.359 | 100,000 | 118,697 | 2034/11/24 |
| 神戸市　公募平成21年度第７回 | 1.69 | 100,000 | 105,060 | 2019/６/20 |
| 横浜市　公募平成20年度第３回 | 1.56 | 100,000 | 103,474 | 2018/９/７ |
| 横浜市　公募公債平成20年度５回 | 1.58 | 200,000 | 207,862 | 2018/12/20 |
| 横浜市　公募平成21年度第４回 | 1.35 | 200,000 | 208,764 | 2019/９/20 |
| 横浜市　公募平成22年度第５回 | 1.265 | 100,000 | 105,609 | 2020/12/11 |
| 横浜市　公募公債平成24年度２回 | 0.815 | 200,000 | 209,904 | 2022/10/17 |
| 横浜市　公募公債平成25年度１回 | 0.664 | 200,000 | 208,596 | 2023/５/19 |
| 横浜市　公募公債平成25年度５回 | 0.655 | 200,000 | 209,158 | 2023/11/17 |
| 横浜市　公募公債平成26年度５回 | 0.471 | 200,000 | 207,368 | 2024/12/13 |
| 横浜市　公募（20年）第26回 | 1.776 | 100,000 | 125,325 | 2033/１/28 |
| 横浜市　公募（20年）第30回 | 1.376 | 100,000 | 119,315 | 2034/10/20 |
| 札幌市　公募平成19年度第３回 | 1.77 | 100,000 | 102,257 | 2017/９/20 |
| 札幌市　公募平成22年度第４回 | 1.05 | 100,000 | 104,171 | 2020/６/19 |
| 札幌市　公募（５年）平成24年度第８回 | 0.2 | 200,000 | 200,612 | 2017/12/20 |
| 札幌市　公募（20年）平成24年度第11回 | 1.794 | 100,000 | 125,944 | 2033/２/28 |
| 札幌市　公募平成26年度第４回 | 0.54 | 100,000 | 104,067 | 2024/６/20 |
| 札幌市　公募平成26年度第９回 | 0.43 | 200,000 | 206,604 | 2024/12/20 |
| 川崎市　公募第81回 | 1.57 | 100,000 | 104,332 | 2019/３/20 |
| 川崎市　公募第82回 | 1.52 | 100,000 | 104,950 | 2019/９/20 |
| 川崎市　公募第85回 | 0.72 | 100,000 | 104,541 | 2022/12/20 |
| 川崎市　公募（20年）第17回 | 1.527 | 100,000 | 121,667 | 2033/５/９ |
| 北九州市　公募（５年）平成25年度第２回 | 0.312 | 100,000 | 100,720 | 2018/９/27 |
| 北九州市　公募（20年）第14回 | 1.732 | 100,000 | 124,512 | 2032/11/12 |
| 福岡市　公募平成20年度第３回 | 1.52 | 100,000 | 103,082 | 2018/６/20 |
| 福岡市　公募平成24年度第５回 | 0.19 | 100,000 | 100,317 | 2017/12/26 |
| 福岡市　公募（５年）平成25年度第２回 | 0.35 | 300,000 | 302,340 | 2018/７/25 |
| 福岡市　公募平成26年度第２回 | 1.49 | 100,000 | 121,352 | 2034/６/20 |

| 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 | |
| 福岡市　公募平成26年度第５回 | 0.539 | 100,000 | 104,196 | 2024/10/28 |
| 福岡市　公募平成26年度第８回 | 0.465 | 160,000 | 165,932 | 2025/３/25 |
| 広島市　公募平成21年度第３回 | 1.34 | 100,000 | 104,720 | 2019/12/25 |
| 仙台市　公募平成25年度第１回 | 0.24 | 600,000 | 603,588 | 2019/１/29 |
| 千葉市　公募平成24度第１回 | 1.05 | 100,000 | 106,040 | 2022/４/25 |
| 鹿児島県　公募（５年）平成25年度第１回 | 0.24 | 100,000 | 100,564 | 2018/10/31 |
| 福井県　公募平成24年度第４回 | 0.46 | 100,000 | 103,042 | 2023/４/26 |
| 徳島県　公募平成22年度第１回 | 1.05 | 400,000 | 418,560 | 2020/11/30 |
| 山梨県　公募平成19年度第１回 | 1.86 | 200,000 | 205,120 | 2017/10/30 |
| 山梨県　公募平成21年度第１回 | 1.37 | 100,000 | 104,631 | 2019/10/30 |
| 岡山県　公募平成21年度第２回 | 1.39 | 100,000 | 105,302 | 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 | 126,784 | 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 | 383,718 | 2029/12/20 |
| 福岡北九州高速道路債券　第117回 | 2.26 | 100,000 | 125,266 | 2028/12/20 |
| 東京都住宅供給公社債券　第５回 | 2.02 | 200,000 | 204,666 | 2017/９/20 |
| 小計 | | 48,772,020 | 51,853,143 | |
| **特殊債券（除く金融債）** | | | | |
| 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 | 213,172 | 2020/７/15 |
| 公営企業債券　政府保証第880回 | 1.7 | 131,000 | 134,151 | 2017/11/17 |
| 公営企業債券　政府保証第881回 | 1.5 | 200,000 | 204,814 | 2018/１/23 |
| 公営企業債券　政府保証第886回 | 1.8 | 203,000 | 210,358 | 2018/６/19 |
| 公営企業債券　政府保証15年第１回 | 1.6 | 300,000 | 319,452 | 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 | 415,528 | 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 | 208,146 | 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 | 104,318 | 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 | 100,524 | 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 | 503,650 | 2018/３/26 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第38回 | 0.839 | 194,000 | 203,991 | 2022/７/15 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第39回 | 0.801 | 100,000 | 104,989 | 2022/８/15 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第40回 | 0.819 | 101,000 | 106,222 | 2022/９/16 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第41回 | 0.791 | 102,000 | 107,203 | 2022/10/18 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第42回 | 0.805 | 108,000 | 113,670 | 2022/11/14 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第43回 | 0.734 | 202,000 | 211,887 | 2022/12/16 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第44回 | 0.834 | 102,000 | 107,739 | 2023/１/20 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第45回 | 0.815 | 223,000 | 235,412 | 2023/２/17 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第50回 | 0.911 | 100,000 | 106,395 | 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 | 303,816 | 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 | 401,040 | 2017/８/29 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第59回 | 0.669 | 116,000 | 122,009 | 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 | 302,682 | 2020/６/18 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第64回 | 0.544 | 100,000 | 104,389 | 2024/９/13 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第65回 | 0.539 | 400,000 | 417,584 | 2024/10/16 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第69回 | 0.414 | 300,000 | 310,482 | 2025/２/17 |
| 政保　地方公共団体金融機構債券　第72回 | 0.509 | 189,000 | 197,402 | 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 | 2,012,120 | 2018/10/26 |
| 新関西国際空港債券　政府保証第１回 | 0.801 | 151,000 | 158,628 | 2022/８/29 |
| 新関西国際空港債券　政府保証第２回 | 0.882 | 191,000 | 203,099 | 2023/６/27 |
| 原子力損害賠償支援機構債券　政府保証第２回 | 0.151 | 200,000 | 200,456 | 2017/11/17 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| **特殊債券(除く金融債)** | % | 千円 | 千円 | |
| 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 | 2,105,439 | 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 | 3,593,482 | 2017/11/２ |
| 日本政策投資銀行債券　政府保証第18回 | 1.9 | 100,000 | 102,203 | 2017/８/16 |
| 日本政策投資銀行債券　政府保証第22回 | 2.2 | 100,000 | 115,462 | 2023/６/19 |
| 日本政策投資銀行社債　政府保証第５回 | 1.4 | 100,000 | 103,996 | 2019/４/15 |
| 日本政策投資銀行社債　政府保証第９回 | 1.0 | 141,000 | 147,088 | 2020/９/14 |
| 日本政策投資銀行社債　政府保証第16回 | 0.819 | 102,000 | 107,318 | 2022/９/20 |
| 日本政策投資銀行社債　政府保証第19回 | 0.668 | 140,000 | 146,489 | 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 | 108,997 | 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 | 109,144 | 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 | 102,462 | 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 | 210,307 | 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 | 140,527 | 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 | 293,397 | 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 | 103,620 | 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 | 353,995 | 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 | 103,935 | 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 | 103,565 | 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 | 252,066 | 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 | 252,676 | 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 | 314,364 | 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 | 256,570 | 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 | 421,036 | 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 | 254,662 | 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 | 249,730 | 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 | 140,756 | 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 | 466,980 | 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 | 147,814 | 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 | 105,106 | 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 | 147,289 | 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 | 136,337 | 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 | 105,215 | 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 | 123,238 | 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 | 229,022 | 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 | 122,096 | 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 | 416,430 | 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 | 210,474 | 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 | 210,192 | 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 | 209,840 | 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 | 422,608 | 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 | 125,035 | 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 | 203,540 | 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 | 417,372 | 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 | 212,684 | 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 | 288,232 | 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 | 315,513 | 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 | 143,897 | 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 | 152,205 | 2024/３/29 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| **特殊債券(除く金融債)** | % | 千円 | 千円 | |
| 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 | 121,691 | 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 | 121,606 | 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 | 105,121 | 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 | 198,569 | 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 | 103,879 | 2024/12/27 |
| 首都高速道路債券　政府保証第８回 | 1.3 | 100,000 | 104,748 | 2020/1/20 |
| 阪神高速道路債券　政府保証第５回 | 1.3 | 100,000 | 104,935 | 2020/3/18 |
| 民間都市開発推進機構　政府保証第16回 | 0.699 | 120,000 | 126,102 | 2023/10/20 |
| 中部国際空港債券　政府保証第18回 | 0.668 | 368,000 | 385,237 | 2023/3/22 |
| 預金保険機構債券　政府保証第194回 | 0.1 | 300,000 | 300,489 | 2017/12/15 |
| 新関西国際空港社債　財投機関債第10回 | 0.161 | 100,000 | 100,194 | 2017/9/20 |
| 新関西国際空港社債　財投機関債第12回 | 1.067 | 100,000 | 110,830 | 2029/9/20 |
| 日本政策投資銀行社債　財投機関債第26回 | 0.573 | 100,000 | 101,670 | 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 | 110,886 | 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 | 140,624 | 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 | 245,690 | 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 | 249,628 | 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 | 328,710 | 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 | 103,677 | 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 | 126,544 | 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 | 128,120 | 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80回 | 1.08 | 100,000 | 105,816 | 2021/12/20 |
| 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 | 422,812 | 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86回 | 0.934 | 200,000 | 210,534 | 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 | 122,368 | 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 | 104,385 | 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 | 428,214 | 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 | 125,048 | 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 | 301,515 | 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 | 208,286 | 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 | 207,792 | 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 | 378,075 | 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 | 128,256 | 2045/3/17 |
| 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 | 99,870 | 2056/3/17 |
| 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 | 144,314 | 2034/6/20 |
| 公営企業債券　30年第４回財投機関債 | 2.95 | 100,000 | 144,912 | 2034/3/24 |
| 地方公営企業等金融機構債券　第１回 | 1.77 | 200,000 | 207,818 | 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 | 123,173 | 2028/12/20 |
| 地方公共団体金融機構債券　第１回 | 1.648 | 100,000 | 104,910 | 2019/6/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　第２回 | 1.406 | 100,000 | 104,291 | 2019/7/26 |
| 地方公共団体金融機構債券　20年第４回 | 2.12 | 100,000 | 125,271 | 2029/12/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　20年第６回 | 2.242 | 300,000 | 382,059 | 2030/3/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　Ｆ24回 | 1.681 | 100,000 | 111,208 | 2023/3/17 |
| 地方公共団体金融機構債券　第13回 | 1.278 | 200,000 | 209,956 | 2020/6/26 |
| 地方公共団体金融機構債券　第16回 | 1.164 | 100,000 | 104,834 | 2020/9/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　第27回 | 1.034 | 300,000 | 315,660 | 2021/8/27 |
| 地方公共団体金融機構債券　第28回 | 1.048 | 100,000 | 105,382 | 2021/9/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　Ｆ104回 | 1.314 | 100,000 | 110,813 | 2025/3/7 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| **特殊債券(除く金融債)** | % | 千円 | 千円 | |
| 地方公共団体金融機構債券　Ｆ106回 | 1.259 | 100,000 | 109,447 | 2024/３/19 |
| 地方公共団体金融機構債券　第37回 | 0.852 | 300,000 | 315,093 | 2022/６/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　第41回 | 0.801 | 600,000 | 629,922 | 2022/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　Ｆ142回 | 1.016 | 100,000 | 108,069 | 2024/11/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　Ｆ144回 | 0.562 | 200,000 | 204,622 | 2020/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　Ｆ145回 | 1.059 | 200,000 | 217,276 | 2025/３/19 |
| 地方公共団体金融機構債券　第42回 | 0.801 | 100,000 | 105,053 | 2022/11/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　第44回 | 0.791 | 100,000 | 105,116 | 2023/１/27 |
| 地方公共団体金融機構債券　Ｆ160回 | 1.052 | 100,000 | 110,345 | 2028/５/26 |
| 地方公共団体金融機構債券　第51回 | 0.841 | 300,000 | 317,667 | 2023/８/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　第52回 | 0.801 | 300,000 | 317,268 | 2023/９/15 |
| 地方公共団体金融機構債券（15年）　第２回 | 1.161 | 200,000 | 224,018 | 2028/12/28 |
| 地方公共団体金融機構債券（20年）　第38回 | 1.487 | 100,000 | 119,862 | 2034/７/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　第64回 | 0.574 | 100,000 | 104,313 | 2024/９/27 |
| 地方公共団体金融機構債券（20年）　第39回 | 1.425 | 100,000 | 118,764 | 2034/９/28 |
| 公営企業債券（20年）　第２回財投機関債 | 1.45 | 100,000 | 109,313 | 2022/12/20 |
| 公営企業債券（20年）　第５回財投機関債 | 2.11 | 200,000 | 230,246 | 2023/９/20 |
| 公営企業債券（20年）　第25回財投機関債 | 2.5 | 100,000 | 127,593 | 2028/６/20 |
| 公営企業債券　第29回財投機関債 | 1.77 | 500,000 | 513,160 | 2017/12/20 |
| 首都高速道路社債　第12回 | 0.293 | 100,000 | 100,643 | 2018/12/20 |
| 阪神高速道路　第13回 | 0.18 | 100,000 | 100,535 | 2019/９/20 |
| 中小企業債券　第６回財投機関債 | 0.79 | 100,000 | 101,306 | 2018/３/20 |
| 都市再生債券　財投機関債第21回 | 1.72 | 300,000 | 311,319 | 2018/９/20 |
| 都市再生債券　財投機関債第55回 | 1.074 | 100,000 | 105,487 | 2021/９/17 |
| 都市再生債券　財投機関債第97回 | 1.017 | 100,000 | 110,757 | 2029/９/20 |
| 本州四国連絡橋債券　財投機関債第７回 | 2.26 | 100,000 | 119,574 | 2025/６/20 |
| 東京交通債券　第342回 | 2.4 | 200,000 | 228,170 | 2022/６/21 |
| 東京交通債券　第347回 | 2.05 | 157,000 | 181,115 | 2024/３/８ |
| 関西国際空港社債　財投機関債第26回 | 1.156 | 300,000 | 314,307 | 2020/９/18 |
| 関西国際空港社債　財投機関債第32回 | 1.164 | 100,000 | 105,958 | 2021/９/17 |
| 福祉医療機構債券　第31回財投機関債 | 0.93 | 100,000 | 105,480 | 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 | 244,734 | 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 | 206,410 | 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 | 115,413 | 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 | 312,231 | 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 | 105,152 | 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 | 116,345 | 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 | 123,868 | 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 | 106,107 | 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 | 126,671 | 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 | 349,851 | 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 | 126,657 | 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 | 105,461 | 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 | 210,682 | 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 | 230,696 | 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 | 142,798 | 2042/９/19 |
| 成田国際空港　第17回 | 0.489 | 200,000 | 207,306 | 2025/２/20 |
| 私学振興債券　財投機関債第７回 | 1.7 | 300,000 | 306,405 | 2017/９/25 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| **特殊債券(除く金融債)** | % | 千円 | 千円 | |
| 沖縄振興開発金融公庫債券　財投機関債第17回 | 1.208 | 100,000 | 105,868 | 2021/6/18 |
| 国際協力機構債券　第６回財投機関債 | 2.098 | 100,000 | 126,436 | 2030/12/13 |
| 東日本高速道路　第21回 | 0.58 | 100,000 | 101,095 | 2018/6/20 |
| 東日本高速道路　第26回 | 0.305 | 100,000 | 100,868 | 2019/6/20 |
| 東日本高速道路　第27回 | 0.248 | 100,000 | 100,697 | 2019/6/20 |
| 中日本高速道路債券　財投機関債第３回 | 1.92 | 100,000 | 102,418 | 2017/9/20 |
| 中日本高速道路社債　第32回 | 0.64 | 200,000 | 202,698 | 2018/9/20 |
| 中日本高速道路社債　第44回 | 0.536 | 100,000 | 101,690 | 2019/9/20 |
| 中日本高速道路社債　第46回 | 0.351 | 1,500,000 | 1,506,930 | 2017/9/20 |
| 中日本高速道路社債　第47回 | 0.277 | 100,000 | 100,447 | 2018/3/20 |
| 中日本高速道路　第62回 | 0.225 | 100,000 | 100,804 | 2020/9/18 |
| 西日本高速道路　第20回 | 0.759 | 200,000 | 210,694 | 2023/9/20 |
| 西日本高速道路　第23回 | 0.602 | 100,000 | 104,478 | 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 | 209,570 | 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 | 118,891 | 2034/8/4 |
| 貸付債権担保第６回住宅金融公庫債券 | 1.94 | 14,873 | 15,449 | 2037/6/10 |
| 貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券 | 1.69 | 51,894 | 53,865 | 2038/9/10 |
| 貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券 | 1.8 | 94,085 | 98,415 | 2039/6/10 |
| 貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券 | 1.43 | 93,822 | 96,516 | 2038/2/10 |
| 貸付債権担保第５回Ｓ種住宅金融公庫債券 | 1.76 | 59,112 | 62,414 | 2036/11/10 |
| 貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券 | 2.34 | 75,726 | 81,924 | 2041/5/10 |
| 貸付債権担保第７回Ｓ種住宅金融公庫債券 | 2.25 | 20,642 | 22,204 | 2037/5/10 |
| 貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券 | 1.84 | 50,830 | 53,874 | 2041/2/10 |
| 貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券 | 1.93 | 55,202 | 59,067 | 2041/3/10 |
| 貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券 | 1.69 | 56,658 | 59,157 | 2039/2/10 |
| 貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券 | 1.69 | 112,748 | 118,959 | 2040/7/10 |
| 貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券 | 2.12 | 99,670 | 105,474 | 2039/7/10 |
| 貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券 | 2.3 | 97,576 | 105,750 | 2041/7/10 |
| 貸付債権担保第８回住宅金融支援機構債券 | 1.99 | 55,480 | 59,376 | 2042/12/10 |
| 貸付債権担保第７回住宅金融支援機構債券 | 2.14 | 27,731 | 29,759 | 2042/11/10 |
| 貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券 | 2.28 | 38,499 | 42,120 | 2044/6/10 |
| 貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券 | 1.98 | 131,574 | 142,406 | 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 | 33,253 | 34,779 | 2032/11/10 |
| 貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券 | 1.43 | 139,900 | 148,417 | 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 | 68,026 | 71,352 | 2032/11/10 |
| 貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券 | 1.79 | 194,076 | 208,942 | 2046/2/10 |
| 貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券 | 1.51 | 140,682 | 150,109 | 2046/9/10 |
| 貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券 | 2.34 | 74,482 | 81,621 | 2044/5/10 |
| 貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券 | 1.89 | 187,041 | 202,443 | 2046/5/10 |
| 貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券 | 1.36 | 193,014 | 203,456 | 2045/9/10 |
| 貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券 | 1.21 | 232,869 | 245,963 | 2047/7/10 |
| 貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券 | 1.34 | 228,780 | 242,605 | 2047/5/10 |
| 貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券 | 1.26 | 151,224 | 160,094 | 2047/6/10 |
| 貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券 | 1.64 | 67,238 | 72,087 | 2046/8/10 |
| 貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券 | 1.6 | 140,832 | 150,647 | 2045/12/10 |
| 貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券 | 1.07 | 82,232 | 86,356 | 2048/12/10 |
| 貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券 | 1.07 | 168,658 | 177,467 | 2049/2/10 |
| 貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券 | 1.08 | 79,826 | 83,790 | 2048/5/10 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| **特殊債券(除く金融債)** | % | 千円 | 千円 | |
| 貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券 | 1.87 | 41,032 | 43,143 | 2039/9/10 |
| 貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券 | 1.25 | 238,992 | 253,039 | 2048/3/10 |
| 貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券 | 1.88 | 48,717 | 52,453 | 2045/2/10 |
| 貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券 | 1.86 | 50,399 | 54,219 | 2045/3/10 |
| 貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券 | 1.87 | 53,302 | 57,250 | 2045/4/10 |
| 貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券 | 1.85 | 65,231 | 70,424 | 2046/3/10 |
| 貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券 | 1.41 | 152,572 | 162,391 | 2046/12/10 |
| 貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券 | 1.42 | 224,412 | 238,897 | 2047/1/10 |
| 貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 75,190 | 80,111 | 2047/2/10 |
| 貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券 | 1.21 | 156,518 | 165,437 | 2048/9/10 |
| 貸付債権担保Ｓ種第３回住宅金融公庫債券 | 1.82 | 19,233 | 20,331 | 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 | 153,685 | 160,356 | 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 | 62,002 | 64,594 | 2032/5/10 |
| 貸付債権担保第１回住宅金融公庫債券 | 1.75 | 25,810 | 26,490 | 2036/3/10 |
| 貸付債権担保第７回住宅金融公庫債券 | 1.82 | 53,784 | 55,294 | 2037/8/10 |
| 貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券 | 1.52 | 303,020 | 321,364 | 2045/8/10 |
| 貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券 | 1.4 | 152,238 | 161,940 | 2047/3/10 |
| 貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券 | 1.16 | 240,567 | 253,552 | 2047/9/10 |
| 貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券 | 1.3 | 166,174 | 176,873 | 2048/6/10 |
| 貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券 | 1.26 | 155,340 | 164,655 | 2048/8/10 |
| 貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券 | 0.93 | 89,709 | 93,740 | 2049/9/10 |
| 貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券 | 0.95 | 90,853 | 95,085 | 2049/10/10 |
| 貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券 | 0.87 | 91,197 | 95,035 | 2049/11/10 |
| 貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券 | 0.74 | 186,096 | 192,352 | 2050/1/10 |
| 貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券 | 0.6 | 187,494 | 191,982 | 2050/2/10 |
| 貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券 | 0.8 | 94,407 | 98,012 | 2050/3/10 |
| 貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券 | 0.74 | 95,059 | 98,335 | 2050/5/10 |
| 貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券 | 0.83 | 285,513 | 297,190 | 2050/6/10 |
| 貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券 | 0.9 | 288,801 | 302,160 | 2050/7/10 |
| 貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券 | 0.88 | 192,974 | 201,652 | 2050/8/10 |
| 貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券 | 0.84 | 96,537 | 100,598 | 2050/9/10 |
| 貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券 | 0.89 | 96,904 | 101,337 | 2050/10/10 |
| フランス預金供託公庫　第４回円貨債券（2014） | 0.725 | 100,000 | 103,952 | 2024/7/30 |
| 韓国産業銀行　第45回円貨社債（2014） | 0.69 | 100,000 | 100,820 | 2019/1/29 |
| 小計 | | 49,276,017 | 52,690,393 | |
| **金融債券** | | | | |
| 商工債券　利付第753回い号 | 0.25 | 100,000 | 100,336 | 2018/2/27 |
| 農林債券　利付第751回い号 | 0.3 | 200,000 | 200,786 | 2017/12/27 |
| 農林債券　利付第752回い号 | 0.3 | 100,000 | 100,406 | 2018/1/26 |
| 農林債券　利付第756回い号 | 0.3 | 100,000 | 100,477 | 2018/5/25 |
| 農林債券　利付第759回い号 | 0.4 | 100,000 | 100,766 | 2018/8/27 |
| 農林債券　利付第760回い号 | 0.4 | 100,000 | 100,794 | 2018/9/27 |
| 農林債券　利付第761回い号 | 0.3 | 100,000 | 100,598 | 2018/10/26 |
| 農林債券　利付第764回い号 | 0.35 | 100,000 | 100,803 | 2019/1/25 |
| 農林債券　利付第765回い号 | 0.3 | 300,000 | 302,088 | 2019/2/27 |
| 農林債券　利付第767回い号 | 0.3 | 300,000 | 302,169 | 2019/4/26 |
| 農林債券　利付第773回い号 | 0.24 | 300,000 | 302,001 | 2019/10/25 |
| 農林債券　利付第777回い号 | 0.25 | 300,000 | 302,316 | 2020/2/27 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| **金融債券** | % | 千円 | 千円 | |
| しんきん中金債券　利付第277回 | 0.25 | 100,000 | 100,317 | 2017/12/27 |
| しんきん中金債券　利付第284回 | 0.4 | 100,000 | 100,750 | 2018/7/27 |
| しんきん中金債券　利付第286回 | 0.35 | 100,000 | 100,681 | 2018/9/27 |
| しんきん中金債券　利付第287回 | 0.3 | 100,000 | 100,598 | 2018/10/26 |
| しんきん中金債券　利付第290回 | 0.3 | 100,000 | 100,673 | 2019/1/25 |
| しんきん中金債券　利付第302回 | 0.2 | 100,000 | 100,557 | 2020/1/27 |
| 商工債券　利付（３年）第174回 | 0.15 | 200,000 | 200,284 | 2017/7/27 |
| 商工債券　利付（３年）第178回 | 0.15 | 1,000,000 | 1,001,590 | 2017/11/27 |
| 商工債券　利付（３年）第181回 | 0.15 | 500,000 | 500,840 | 2018/2/27 |
| 商工債券　利付（３年）第182回 | 0.14 | 100,000 | 100,159 | 2018/3/27 |
| 商工債券　利付（10年）第５回 | 1.8 | 600,000 | 615,786 | 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 | | 5,500,000 | 5,536,411 | |
| **普通社債券（含む投資法人債券）** | | | | |
| 東京電力　第455回 | 2.075 | 200,000 | 207,952 | 2018/10/23 |
| 東京電力　第459回 | 2.7 | 100,000 | 105,930 | 2019/1/29 |
| 東京電力　第542回 | 1.602 | 100,000 | 102,265 | 2018/4/25 |
| 東京電力　第544回 | 1.976 | 100,000 | 103,231 | 2018/6/25 |
| 東京電力　第547回 | 1.948 | 100,000 | 105,779 | 2020/7/24 |
| 東京電力　第548回 | 2.347 | 100,000 | 114,472 | 2028/9/29 |
| 東京電力　第559回 | 1.377 | 100,000 | 102,909 | 2019/10/29 |
| 東京電力　第560回 | 2.114 | 100,000 | 112,422 | 2029/12/10 |
| 東京電力　第565回 | 1.313 | 300,000 | 309,453 | 2020/6/24 |
| 中部電力　第482回 | 2.17 | 200,000 | 212,450 | 2019/6/25 |
| 中部電力　第500回 | 0.875 | 200,000 | 210,608 | 2024/5/24 |
| 関西電力　第448回 | 2.16 | 200,000 | 207,972 | 2018/6/20 |
| 関西電力　第469回 | 1.7 | 100,000 | 103,583 | 2018/10/25 |
| 関西電力　第482回 | 1.189 | 100,000 | 103,967 | 2020/7/24 |
| 関西電力　第484回 | 0.976 | 100,000 | 103,292 | 2020/10/23 |
| 関西電力　第496回 | 0.908 | 100,000 | 104,788 | 2025/2/25 |
| 関西電力　第497回 | 1.002 | 200,000 | 211,370 | 2025/6/20 |
| 関西電力　第498回 | 0.416 | 200,000 | 201,730 | 2020/9/18 |
| 中国電力　第314回 | 2.875 | 100,000 | 105,171 | 2018/4/25 |
| 中国電力　第330回 | 2.1 | 100,000 | 109,080 | 2021/3/25 |
| 中国電力　第377回 | 1.121 | 200,000 | 213,256 | 2023/8/25 |
| 中国電力　第378回 | 1.004 | 100,000 | 105,932 | 2023/10/25 |
| 北陸電力　第301回 | 1.158 | 100,000 | 106,525 | 2023/3/24 |
| 北陸電力　第304回 | 0.989 | 100,000 | 105,824 | 2023/10/25 |
| 北陸電力　第307回 | 1.055 | 100,000 | 107,231 | 2026/6/25 |
| 北陸電力　第308回 | 0.769 | 100,000 | 104,538 | 2024/9/25 |
| 東北電力　第431回 | 2.05 | 400,000 | 413,452 | 2018/3/23 |
| 東北電力　第473回 | 0.597 | 100,000 | 101,974 | 2021/4/23 |
| 東北電力　第475回 | 0.809 | 100,000 | 104,397 | 2024/9/25 |
| 東北電力　第481回 | 0.803 | 200,000 | 208,994 | 2025/7/25 |
| 四国電力　第281回 | 1.111 | 200,000 | 213,266 | 2023/9/25 |
| 九州電力　第400回 | 1.777 | 100,000 | 106,067 | 2020/4/24 |
| 九州電力　第409回 | 1.483 | 100,000 | 104,233 | 2019/8/23 |
| 九州電力　第420回 | 0.82 | 300,000 | 303,840 | 2018/4/25 |

| 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 | |
| 九州電力　第424回 | 1.233 | 200,000 | 213,630 | 2023/11/24 |
| 北海道電力　第296回 | 2.027 | 100,000 | 103,767 | 2018/6/25 |
| 北海道電力　第316回 | 1.164 | 207,000 | 214,975 | 2020/6/25 |
| 北海道電力　第323回 | 1.337 | 100,000 | 109,783 | 2030/3/25 |
| 新日本製鐵　第30回社債間限定同順位特約付 | 3.175 | 100,000 | 103,829 | 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 | 105,249 | 2021/3/19 |
| 成田国際空港　第13回一般担保付 | 0.802 | 200,000 | 210,428 | 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 | 102,393 | 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 | 101,849 | 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 | 104,351 | 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 | 0.237 | 100,000 | 100,626 | 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 | 0.348 | 100,000 | 101,671 | 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 | 207,828 | 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 | 104,352 | 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 | 103,704 | 2025/5/30 |
| 森ビル　第13回社債間限定同順位特約付 | 0.466 | 100,000 | 101,100 | 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 | 103,598 | 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 | 103,772 | 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 | 101,314 | 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 | 105,504 | 2020/4/23 |
| クレハ　第５回社債間限定同順位特約付 | 0.302 | 100,000 | 100,809 | 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 | 100,771 | 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 | 203,376 | 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 | 100,599 | 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 | 102,217 | 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 | 102,501 | 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 | 105,027 | 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 | 102,977 | 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 | 100,978 | 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 | 201,170 | 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 | 104,807 | 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 | 100,955 | 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 | 99,228 | 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 | 100,187 | 2025/5/21 |
| 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 | 101,992 | 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 | 100,612 | 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 | 100,537 | 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 | 223,078 | 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 | 101,660 | 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 | 105,055 | 2022/9/20 |
| 富士通　第34回社債間限定同順位特約付 | 0.644 | 100,000 | 101,944 | 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 | 105,288 | 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 | 201,966 | 2020/3/19 |
| ソニー　第26回 | 2.068 | 100,000 | 105,403 | 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 | 104,695 | 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 | 303,033 | 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 | 201,194 | 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 | 105,957 | 2023/3/20 |

| 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 | |
| アイシン精機　第15回社債間限定同順位特約付 | 0.562 | 100,000 | 103,693 | 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 | 103,288 | 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 | 105,758 | 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 | 211,694 | 2021/６/４ |
| 丸紅　第101回社債間限定同順位特約付 | 0.436 | 100,000 | 100,828 | 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 | 106,410 | 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 | 211,214 | 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 | 110,313 | 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 | 104,678 | 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 | 108,116 | 2029/１/29 |
| 三菱商事　第66回担保提供制限等財務上特約無 | 2.08 | 100,000 | 102,269 | 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 | 104,977 | 2019/７/29 |
| 高島屋　第11回社債間限定同順位特約付 | 0.451 | 200,000 | 203,814 | 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 | 100,554 | 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 | 203,254 | 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 | 103,142 | 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 | 103,008 | 2024/６/18 |
| イオン　第16回社債間限定同順位特約付 | 1.01 | 100,000 | 102,030 | 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 | 104,495 | 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 | 207,890 | 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 | 123,922 | 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 | 2,007,220 | 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 | 300,972 | 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 | 106,693 | 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 | 109,751 | 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 | 113,516 | 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 | 102,572 | 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 | 104,241 | 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 | 501,545 | 2018/１/23 |
| 三菱東京ＵＦＪ銀行　第12回（劣後特約付） | 2.16 | 300,000 | 306,747 | 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 | 310,173 | 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 | 103,760 | 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 | 108,964 | 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 | 107,574 | 2019/６/20 |
| りそな銀行　第６回劣後特約付 | 2.084 | 300,000 | 320,070 | 2020/３/４ |
| 三菱ＵＦＪ信託銀行　第９回劣後特約付 | 1.68 | 100,000 | 106,897 | 2021/４/28 |
| 三井住友信託銀行　第１回劣後特約付 | 1.389 | 300,000 | 320,922 | 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 | 100,606 | 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 | 104,608 | 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 | 103,134 | 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 | 207,580 | 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 | 100,318 | 2017/10/20 |
| 三井住友銀行　第24回劣後特約付 | 1.6 | 100,000 | 106,768 | 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 | 100,580 | 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 | 100,755 | 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 | 100,673 | 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 | 100,591 | 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 | 100,552 | 2019/６/20 |

| 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 | |
| ジャックス　第12回社債間限定同順位特約付 | 0.545 | 100,000 | 100,932 | 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 | 201,648 | 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 | 101,717 | 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 | 100,378 | 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 | 103,372 | 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 | 102,066 | 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 | 103,100 | 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 | 100,795 | 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 | 100,586 | 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 | 101,441 | 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 | 100,787 | 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 | 100,780 | 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 | 104,202 | 2025/8/12 |
| 野村ホールディングス　第21回 | 1.86 | 100,000 | 106,418 | 2020/3/17 |
| 野村ホールディングス　第41回 | 0.783 | 200,000 | 202,650 | 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 | 102,675 | 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 | 105,413 | 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 | 113,520 | 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 | 104,122 | 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 | 101,615 | 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 | 104,810 | 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 | 103,896 | 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 | 104,342 | 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 | 207,542 | 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 | 103,070 | 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 | 103,876 | 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 | 105,931 | 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 | 101,214 | 2018/2/8 |
| 積水ハウス・ＳＩ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 | 103,469 | 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 | 218,344 | 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 | 105,255 | 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 | 113,357 | 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 | 219,972 | 2030/6/12 |
| 東日本旅客鉄道　第15回 | 2.65 | 100,000 | 110,787 | 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 | 226,226 | 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 | 208,378 | 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 | 122,966 | 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 | 121,424 | 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 | 123,705 | 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 | 106,269 | 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 | 105,932 | 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 | 253,492 | 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 | 115,387 | 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 | 128,652 | 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 | 104,922 | 2027/4/30 |
| 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 | 100,733 | 2036/6/9 |
| 三菱倉庫　第14回 | 0.442 | 100,000 | 101,553 | 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 | 201,134 | 2019/3/14 |

| 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 | |
| 日本電信電話　第60回 | 1.31 | 100,000 | 105,597 | 2020/12/18 |
| ＫＤＤＩ　第20回社債間限定同順位特約付 | 0.803 | 100,000 | 105,009 | 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 | 103,832 | 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 | 104,403 | 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 | 104,586 | 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 | 105,241 | 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 | 105,069 | 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 | 104,235 | 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 | 105,045 | 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 | 135,234 | 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 | 104,554 | 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 | 111,434 | 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 | 202,070 | 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 | 102,226 | 2022/12/16 |
| 新韓銀行　第５回円貨社債（2014） | 0.39 | 200,000 | 199,416 | 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 | 103,495 | 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 | 200,960 | 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 | 194,382 | 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 | 99,590 | 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 | 98,888 | 2025/６/５ |
| エイチエスビーシー・ファイナンス・コーポレーション　第12回 | 2.54 | 100,000 | 108,395 | 2021/２/16 |
| バークレイズ・バンク・ピーエルシー　第７回円貨社債 | 0.478 | 100,000 | 100,328 | 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 | 201,404 | 2020/１/16 |
| 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 | 100,970 | 2017/11/２ |
| 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 | 101,105 | 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 | 100,925 | 2019/５/22 |
| ソシエテ　ジェネラル　第６回円貨社債（2014） | 0.552 | 200,000 | 202,418 | 2019/６/13 |
| 小計 | | 28,607,000 | 29,808,487 | |
| 合計 | | 595,670,037 | 670,125,638 | |

＊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(299,300,208千口)の内容です。

### 外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債　種類別開示

| 区分 | 当期末 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 額面金額 | 評価額 | | 組入比率 | うちBB格以下組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | ５年以上 | ２年以上 | ２年未満 |
| | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 2,335,700 | 2,543,141 | 265,961,690 | 42.2 | － | 18.3 | 15.7 | 8.3 |
| | 千カナダドル | 千カナダドル | | | | | | |
| カナダ | 138,780 | 161,147 | 13,151,224 | 2.1 | － | 1.0 | 0.7 | 0.4 |
| | 千英ポンド | 千英ポンド | | | | | | |
| イギリス | 271,210 | 337,074 | 51,707,168 | 8.2 | － | 5.9 | 2.3 | 0.1 |
| | 千スイスフラン | 千スイスフラン | | | | | | |
| スイス | 12,700 | 15,901 | 1,727,988 | 0.3 | － | 0.1 | 0.2 | － |
| | 千スウェーデンクローナ | 千スウェーデンクローナ | | | | | | |
| スウェーデン | 208,100 | 250,507 | 3,161,402 | 0.5 | － | 0.3 | 0.2 | 0.0 |
| | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | | | | | |
| ノルウェー | 112,300 | 127,116 | 1,597,857 | 0.3 | － | 0.1 | 0.1 | － |
| | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ | | | | | | |
| デンマーク | 200,600 | 268,958 | 4,249,546 | 0.7 | － | 0.6 | 0.1 | － |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 208,100 | 293,189 | 34,452,640 | 5.5 | － | 4.8 | 0.7 | － |
| イタリア | 475,900 | 591,012 | 69,449,901 | 11.0 | － | 6.3 | 3.3 | 1.5 |
| フランス | 367,800 | 485,991 | 57,108,817 | 9.1 | － | 6.5 | 2.2 | 0.4 |
| オランダ | 93,600 | 118,919 | 13,974,232 | 2.2 | － | 1.6 | 0.5 | 0.2 |
| スペイン | 309,400 | 372,234 | 43,741,322 | 6.9 | － | 3.2 | 2.6 | 1.2 |
| ベルギー | 100,400 | 135,906 | 15,970,395 | 2.5 | － | 2.0 | 0.4 | 0.1 |
| オーストリア | 57,700 | 74,897 | 8,801,162 | 1.4 | － | 1.0 | 0.3 | 0.1 |
| フィンランド | 26,200 | 30,444 | 3,577,496 | 0.6 | － | 0.4 | 0.1 | 0.0 |
| アイルランド | 42,600 | 50,527 | 5,937,506 | 0.9 | － | 0.3 | 0.5 | 0.2 |
| | 千ズロチ | 千ズロチ | | | | | | |
| ポーランド | 126,300 | 136,675 | 3,654,698 | 0.6 | － | 0.2 | 0.3 | 0.1 |
| | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | | | | | |
| シンガポール | 27,580 | 29,399 | 2,288,718 | 0.4 | － | 0.2 | 0.2 | － |
| | 千リンギ | 千リンギ | | | | | | |
| マレーシア | 111,900 | 113,292 | 2,935,406 | 0.5 | － | 0.3 | 0.1 | 0.1 |
| | 千豪ドル | 千豪ドル | | | | | | |
| オーストラリア | 134,700 | 151,394 | 11,787,592 | 1.9 | － | 1.1 | 0.6 | 0.2 |
| | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | | | | | |
| メキシコ | 936,900 | 1,028,421 | 5,769,445 | 0.9 | － | 0.5 | 0.3 | 0.2 |
| | 千ランド | 千ランド | | | | | | |
| 南アフリカ | 435,300 | 395,564 | 2,800,595 | 0.4 | － | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| 合計 | － | － | 623,806,811 | 99.0 | － | 54.9 | 31.2 | 12.9 |

＊邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
＊組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。
＊金額の単位未満は切り捨て。
＊評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

| 銘柄 | | | 当期末 利率 | 当期末 額面金額 | 当期末 評価額 外貨建金額 | 当期末 評価額 邦貨換算金額 | 当期末 償還年月日 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 12,730 | 1,331,391 | 2019/2/15 |
| | | US TREASURY BOND | 8.125 | 19,300 | 23,634 | 2,471,744 | 2019/8/15 |
| | | US TREASURY BOND | 8.75 | 12,700 | 16,647 | 1,741,038 | 2020/8/15 |
| | | US TREASURY BOND | 8.0 | 23,500 | 31,765 | 3,322,024 | 2021/11/15 |
| | | US TREASURY BOND | 6.25 | 19,400 | 25,715 | 2,689,338 | 2023/8/15 |
| | | US TREASURY BOND | 2.375 | 31,200 | 33,067 | 3,458,159 | 2024/8/15 |
| | | US TREASURY BOND | 6.0 | 43,200 | 59,914 | 6,265,877 | 2026/2/15 |
| | | US TREASURY BOND | 6.5 | 13,800 | 20,104 | 2,102,567 | 2026/11/15 |
| | | US TREASURY BOND | 6.125 | 23,700 | 34,348 | 3,592,148 | 2027/11/15 |
| | | US TREASURY BOND | 5.5 | 12,000 | 16,830 | 1,760,179 | 2028/8/15 |
| | | US TREASURY BOND | 5.25 | 5,000 | 6,900 | 721,602 | 2028/11/15 |
| | | US TREASURY BOND | 5.25 | 2,800 | 3,881 | 405,927 | 2029/2/15 |
| | | US TREASURY BOND | 4.375 | 2,200 | 3,045 | 318,475 | 2038/2/15 |
| | | US TREASURY BOND | 2.875 | 22,300 | 24,171 | 2,527,814 | 2043/5/15 |
| | | US TREASURY BOND | 3.75 | 16,000 | 20,387 | 2,132,124 | 2043/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.875 | 1,100 | 1,102 | 115,348 | 2017/6/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.5 | 9,000 | 9,172 | 959,235 | 2017/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 0.75 | 8,000 | 8,012 | 837,914 | 2017/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 0.875 | 16,900 | 16,946 | 1,772,303 | 2017/7/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.375 | 28,200 | 28,740 | 3,005,719 | 2017/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 0.5 | 3,400 | 3,395 | 355,099 | 2017/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 4.75 | 29,800 | 31,207 | 3,263,664 | 2017/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.875 | 9,000 | 9,024 | 943,793 | 2017/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.875 | 21,900 | 22,220 | 2,323,851 | 2017/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 0.625 | 10,000 | 9,998 | 1,045,595 | 2017/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.875 | 34,500 | 35,026 | 3,663,116 | 2017/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 0.625 | 8,000 | 7,995 | 836,215 | 2017/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 0.875 | 1,000 | 1,002 | 104,861 | 2017/10/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.875 | 18,500 | 18,794 | 1,965,564 | 2017/10/31 |
| | | US TREASURY N/B | 4.25 | 49,600 | 52,031 | 5,441,460 | 2017/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.25 | 18,600 | 19,009 | 1,987,966 | 2017/11/30 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 17,000 | 17,517 | 1,832,029 | 2017/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 0.75 | 6,000 | 6,002 | 627,700 | 2017/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.625 | 16,900 | 17,407 | 1,820,492 | 2018/1/31 |
| | | US TREASURY N/B | 0.875 | 4,000 | 4,009 | 419,267 | 2018/1/31 |
| | | US TREASURY N/B | 3.5 | 41,000 | 42,853 | 4,481,567 | 2018/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.0 | 12,000 | 12,051 | 1,260,303 | 2018/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 7,100 | 7,338 | 767,490 | 2018/2/28 |
| | | US TREASURY N/B | 1.0 | 500 | 502 | 52,512 | 2018/3/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.75 | 2,000 | 1,999 | 209,143 | 2018/3/31 |
| | | US TREASURY N/B | 0.75 | 34,000 | 33,996 | 3,555,303 | 2018/4/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.625 | 8,000 | 8,275 | 865,464 | 2018/4/30 |
| | | US TREASURY N/B | 0.625 | 1,200 | 1,197 | 125,211 | 2018/4/30 |
| | | US TREASURY N/B | 3.875 | 14,300 | 15,164 | 1,585,866 | 2018/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.375 | 5,000 | 5,157 | 539,322 | 2018/5/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.0 | 15,500 | 15,570 | 1,628,335 | 2018/5/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.375 | 31,200 | 32,212 | 3,368,812 | 2018/6/30 |

| 銘柄 | | | 当期末 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1.375 | 8,500 | 8,603 | 899,729 | 2018/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 2.25 | 8,800 | 9,075 | 949,099 | 2018/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.375 | 3,400 | 3,442 | 359,988 | 2018/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 4.0 | 4,800 | 5,137 | 537,318 | 2018/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.5 | 20,600 | 20,917 | 2,187,504 | 2018/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.375 | 27,400 | 27,757 | 2,902,877 | 2018/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.75 | 7,000 | 7,156 | 748,388 | 2018/10/31 |
| | | US TREASURY N/B | 3.75 | 35,400 | 37,887 | 3,962,293 | 2018/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.25 | 5,000 | 5,051 | 528,312 | 2018/11/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.375 | 6,500 | 6,587 | 688,930 | 2018/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.5 | 5,500 | 5,591 | 584,761 | 2018/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.25 | 5,100 | 5,153 | 538,920 | 2019/1/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.5 | 2,000 | 2,033 | 212,656 | 2019/1/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 27,500 | 28,879 | 3,020,196 | 2019/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.375 | 4,500 | 4,562 | 477,191 | 2019/2/28 |
| | | US TREASURY N/B | 1.5 | 4,000 | 4,068 | 425,444 | 2019/2/28 |
| | | US TREASURY N/B | 1.5 | 4,000 | 4,071 | 425,771 | 2019/3/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.625 | 25,500 | 26,025 | 2,721,792 | 2019/3/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.625 | 5,600 | 5,716 | 597,818 | 2019/4/30 |
| | | US TREASURY N/B | 3.125 | 29,500 | 31,399 | 3,283,713 | 2019/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.5 | 10,600 | 10,785 | 1,127,990 | 2019/5/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.0 | 2,000 | 2,006 | 209,838 | 2019/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.625 | 7,900 | 8,070 | 843,996 | 2019/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.625 | 14,500 | 14,813 | 1,549,226 | 2019/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 3.625 | 37,000 | 40,116 | 4,195,340 | 2019/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.0 | 3,000 | 3,007 | 314,487 | 2019/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.625 | 8,800 | 8,992 | 940,471 | 2019/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.0 | 3,000 | 3,005 | 314,352 | 2019/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.75 | 17,700 | 18,156 | 1,898,788 | 2019/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 3.375 | 49,300 | 53,303 | 5,574,500 | 2019/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.0 | 8,800 | 8,808 | 921,238 | 2019/11/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.5 | 1,800 | 1,831 | 191,582 | 2019/11/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.125 | 12,000 | 12,056 | 1,260,842 | 2019/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.625 | 3,800 | 3,882 | 406,066 | 2019/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.375 | 2,000 | 2,026 | 211,905 | 2020/1/31 |
| | | US TREASURY N/B | 3.625 | 51,800 | 56,684 | 5,928,072 | 2020/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.25 | 2,700 | 2,722 | 284,726 | 2020/2/29 |
| | | US TREASURY N/B | 1.125 | 4,000 | 4,014 | 419,806 | 2020/3/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.375 | 21,300 | 21,559 | 2,254,702 | 2020/3/31 |
| | | US TREASURY N/B | 3.5 | 47,700 | 52,129 | 5,451,652 | 2020/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.5 | 6,500 | 6,607 | 690,975 | 2020/5/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.875 | 14,500 | 14,955 | 1,564,034 | 2020/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.625 | 10,000 | 10,210 | 1,067,859 | 2020/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 2.0 | 11,000 | 11,400 | 1,192,260 | 2020/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.625 | 42,500 | 45,124 | 4,719,141 | 2020/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.125 | 7,000 | 7,288 | 762,257 | 2020/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.0 | 6,000 | 6,220 | 650,520 | 2020/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.75 | 1,600 | 1,640 | 171,602 | 2020/10/31 |

| 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 | |
| アメリカ | | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 国債証券 | US TREASURY N/B | 2.625 | 50,100 | 53,266 | 5,570,607 | 2020/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.375 | 6,800 | 7,164 | 749,256 | 2020/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.125 | 5,300 | 5,527 | 578,090 | 2021/1/31 |
| | | US TREASURY N/B | 3.625 | 45,800 | 50,873 | 5,320,379 | 2021/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.0 | 5,000 | 5,186 | 542,386 | 2021/2/28 |
| | | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,800 | 1,888 | 197,538 | 2021/3/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.25 | 2,900 | 3,043 | 318,256 | 2021/4/30 |
| | | US TREASURY N/B | 3.125 | 36,400 | 39,715 | 4,153,479 | 2021/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.0 | 12,500 | 12,974 | 1,356,833 | 2021/5/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.125 | 17,700 | 18,474 | 1,932,050 | 2021/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 2.25 | 9,700 | 10,185 | 1,065,226 | 2021/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.125 | 26,800 | 27,968 | 2,924,925 | 2021/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.0 | 7,300 | 7,574 | 792,122 | 2021/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.125 | 16,000 | 16,700 | 1,746,486 | 2021/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 2.0 | 11,000 | 11,414 | 1,193,698 | 2021/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.875 | 8,000 | 8,246 | 862,392 | 2021/11/30 |
| | | US TREASURY N/B | 2.125 | 12,400 | 12,941 | 1,353,425 | 2021/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.5 | 5,000 | 5,046 | 527,802 | 2022/1/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.0 | 33,700 | 34,940 | 3,654,030 | 2022/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.75 | 7,300 | 7,464 | 780,670 | 2022/2/28 |
| | | US TREASURY N/B | 1.75 | 5,900 | 6,030 | 630,712 | 2022/3/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.75 | 5,000 | 5,108 | 534,297 | 2022/4/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.75 | 11,900 | 12,158 | 1,271,530 | 2022/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.875 | 9,700 | 9,979 | 1,043,669 | 2022/5/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.125 | 27,000 | 28,158 | 2,944,768 | 2022/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.625 | 18,500 | 18,757 | 1,961,634 | 2022/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.625 | 12,800 | 12,946 | 1,353,997 | 2022/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.125 | 13,000 | 13,545 | 1,416,576 | 2022/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.75 | 22,000 | 22,400 | 2,342,640 | 2023/1/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.0 | 17,000 | 17,587 | 1,839,251 | 2023/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.5 | 11,000 | 11,018 | 1,152,267 | 2023/3/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.75 | 42,200 | 42,984 | 4,495,335 | 2023/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.5 | 14,400 | 15,404 | 1,611,015 | 2023/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 16,800 | 18,277 | 1,911,500 | 2023/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 27,300 | 29,727 | 3,108,864 | 2024/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.5 | 30,400 | 32,532 | 3,402,274 | 2024/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.25 | 25,100 | 26,347 | 2,755,385 | 2024/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.0 | 4,000 | 4,115 | 430,379 | 2025/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 6.25 | 2,600 | 4,005 | 418,844 | 2030/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 5.375 | 300 | 435 | 45,521 | 2031/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.5 | 2,000 | 2,804 | 293,248 | 2036/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 5.0 | 1,000 | 1,494 | 156,338 | 2037/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.5 | 500 | 703 | 73,594 | 2038/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.5 | 1,500 | 1,834 | 191,828 | 2039/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.25 | 5,000 | 6,784 | 709,509 | 2039/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.5 | 5,500 | 7,722 | 807,602 | 2039/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.375 | 7,700 | 10,613 | 1,109,945 | 2039/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.625 | 8,000 | 11,406 | 1,192,865 | 2040/2/15 |

| 銘柄 | | | 当期末 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 国債証券 | US TREASURY N/B | 4.375 | 8,000 | 11,029 | 1,153,419 | 2040/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.875 | 8,000 | 10,280 | 1,075,147 | 2040/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.25 | 7,800 | 10,582 | 1,106,708 | 2040/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.75 | 7,000 | 10,177 | 1,064,403 | 2041/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.375 | 7,000 | 9,676 | 1,011,958 | 2041/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.125 | 6,500 | 7,417 | 775,734 | 2041/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.125 | 3,200 | 3,651 | 381,821 | 2042/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.0 | 4,500 | 5,015 | 524,472 | 2042/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 9,300 | 9,882 | 1,033,533 | 2042/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 9,600 | 10,179 | 1,064,598 | 2042/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.125 | 18,200 | 20,702 | 2,165,067 | 2043/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.625 | 15,700 | 19,563 | 2,045,968 | 2043/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.625 | 23,200 | 28,860 | 3,018,224 | 2044/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.375 | 15,900 | 18,887 | 1,975,250 | 2044/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.125 | 29,100 | 32,989 | 3,450,078 | 2044/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.0 | 36,400 | 40,284 | 4,212,959 | 2044/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.5 | 13,200 | 13,207 | 1,381,210 | 2045/2/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.0 | 14,700 | 16,258 | 1,700,306 | 2045/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.0 | 5,000 | 5,530 | 578,335 | 2045/11/15 |
| | | US TREASURY NOTE | 2.875 | 33,600 | 34,858 | 3,645,521 | 2018/3/31 |
| 小計 | | | | | | 265,961,690 | |
| 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 | 5,112 | 417,263 | 2022/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 3,400 | 3,424 | 279,505 | 2017/8/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 13,800 | 13,949 | 1,138,414 | 2017/9/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 10,000 | 10,103 | 824,562 | 2018/2/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 3,200 | 3,235 | 264,066 | 2018/3/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 4.25 | 3,700 | 3,960 | 323,202 | 2018/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 9,500 | 9,637 | 786,552 | 2018/9/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75 | 3,800 | 3,918 | 319,765 | 2019/3/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 3.75 | 7,100 | 7,746 | 632,199 | 2019/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75 | 4,000 | 4,140 | 337,924 | 2019/9/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 3,600 | 3,712 | 302,938 | 2020/3/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5 | 7,500 | 8,323 | 679,317 | 2020/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 0.75 | 2,800 | 2,808 | 229,236 | 2020/9/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 3.25 | 10,000 | 11,228 | 916,357 | 2021/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 3,900 | 4,050 | 330,574 | 2023/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5 | 5,700 | 6,343 | 517,672 | 2024/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 6,900 | 7,554 | 616,542 | 2025/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 8.0 | 3,700 | 6,204 | 506,318 | 2027/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 5,180 | 7,726 | 630,554 | 2029/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 3,000 | 4,751 | 387,764 | 2033/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0 | 7,000 | 10,794 | 880,898 | 2037/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0 | 6,400 | 9,055 | 739,044 | 2041/6/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5 | 8,200 | 11,182 | 912,644 | 2045/12/1 |
| | | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,800 | 2,179 | 177,902 | 2048/12/1 |
| 小計 | | | | | | 13,151,224 | |

| 銘柄 | | | 当期末 利率 | 当期末 額面金額 | 当期末 評価額 外貨建金額 | 当期末 評価額 邦貨換算金額 | 償還年月日 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| イギリス | | | % | 千英ポンド | 千英ポンド | 千円 | |
| | 国債証券 | UK TREASURY | 5.0 | 2,300 | 2,480 | 380,551 | 2018/3/7 |
| | | UK TREASURY | 1.25 | 23,550 | 23,919 | 3,669,287 | 2018/7/22 |
| | | UK TREASURY | 4.5 | 3,600 | 3,994 | 612,710 | 2019/3/7 |
| | | UK TREASURY | 1.75 | 18,100 | 18,729 | 2,873,163 | 2019/7/22 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 3,000 | 3,306 | 507,278 | 2019/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.75 | 5,800 | 6,675 | 1,024,067 | 2020/3/7 |
| | | UK TREASURY | 2.0 | 15,140 | 15,906 | 2,439,993 | 2020/7/22 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 7,200 | 8,115 | 1,244,969 | 2020/9/7 |
| | | UK TREASURY | 8.0 | 9,340 | 12,621 | 1,936,083 | 2021/6/7 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 8,900 | 10,228 | 1,569,093 | 2021/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.0 | 4,650 | 5,470 | 839,209 | 2022/3/7 |
| | | UK TREASURY | 1.75 | 8,300 | 8,695 | 1,333,952 | 2022/9/7 |
| | | UK TREASURY | 2.25 | 7,200 | 7,783 | 1,194,053 | 2023/9/7 |
| | | UK TREASURY | 2.75 | 10,100 | 11,330 | 1,738,049 | 2024/9/7 |
| | | UK TREASURY | 5.0 | 13,450 | 17,697 | 2,714,798 | 2025/3/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 8,630 | 11,163 | 1,712,522 | 2027/12/7 |
| | | UK TREASURY | 6.0 | 3,850 | 5,822 | 893,208 | 2028/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.75 | 6,700 | 9,259 | 1,420,391 | 2030/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 7,250 | 9,637 | 1,478,380 | 2032/6/7 |
| | | UK TREASURY | 4.5 | 6,700 | 9,290 | 1,425,119 | 2034/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 6,900 | 9,388 | 1,440,246 | 2036/3/7 |
| | | UK TREASURY | 4.75 | 4,900 | 7,246 | 1,111,629 | 2038/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 4,200 | 5,857 | 898,577 | 2039/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 5,700 | 8,040 | 1,233,487 | 2040/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.5 | 6,100 | 9,059 | 1,389,667 | 2042/12/7 |
| | | UK TREASURY | 3.5 | 19,100 | 24,679 | 3,785,775 | 2045/1/22 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 5,950 | 8,807 | 1,351,114 | 2046/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 4,250 | 6,528 | 1,001,460 | 2049/12/7 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 7,250 | 10,531 | 1,615,509 | 2052/7/22 |
| | | UK TREASURY | 3.5 | 5,000 | 7,576 | 1,162,235 | 2068/7/22 |
| | | UK TSY 3 1/4% 2044 | 3.25 | 21,700 | 26,719 | 4,098,726 | 2044/1/22 |
| | | UNITED KINGDOM(GOVERNMEN | 4.25 | 6,400 | 10,507 | 1,611,853 | 2055/12/7 |
| 小計 | | | | | | 51,707,168 | |
| 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 | 10,405 | 1,130,803 | 2021/4/28 |
| | | SWITZERLAND GOVERNMENT | 4.0 | 3,600 | 5,495 | 597,185 | 2028/4/8 |
| 小計 | | | | | | 1,727,988 | |
| 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 | 7,354 | 92,807 | 2017/8/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 4.25 | 16,200 | 18,355 | 231,651 | 2019/3/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 5.0 | 49,400 | 61,241 | 772,863 | 2020/12/1 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 56,600 | 68,582 | 865,507 | 2022/6/1 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 1.5 | 22,400 | 24,629 | 310,819 | 2023/11/13 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 2.5 | 40,200 | 47,725 | 602,295 | 2025/5/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 16,300 | 22,619 | 285,457 | 2039/3/30 |
| 小計 | | | | | | 3,161,402 | |
| 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 | 23,300 | 25,963 | 326,357 | 2019/5/22 |

| 銘柄 | | | 当期末 利率 | 当期末 額面金額 | 当期末 評価額 外貨建金額 | 当期末 評価額 邦貨換算金額 | 当期末 償還年月日 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 千円 | |
| | 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.75 | 27,600 | 31,643 | 397,757 | 2021/5/25 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0 | 14,300 | 15,331 | 192,711 | 2023/5/24 |
| | | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.0 | 47,100 | 54,179 | 681,031 | 2024/3/14 |
| 小計 | | | | | | 1,597,857 | |
| 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 | 28,990 | 458,049 | 2019/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 3.0 | 52,100 | 61,402 | 970,158 | 2021/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 1.5 | 42,000 | 46,732 | 738,374 | 2023/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 7.0 | 14,500 | 23,050 | 364,200 | 2024/11/10 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 1.75 | 18,600 | 21,172 | 334,523 | 2025/11/15 |
| | | KINGDOM OF DENMARK | 4.5 | 48,300 | 87,610 | 1,384,239 | 2039/11/15 |
| 小計 | | | | | | 4,249,546 | |
| ユーロ | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESOBLIGATION | 0.25 | 1,700 | 1,746 | 205,260 | 2019/10/11 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.5 | 3,900 | 4,385 | 515,345 | 2019/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 8,700 | 9,888 | 1,161,988 | 2020/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.0 | 7,000 | 8,010 | 941,349 | 2020/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.25 | 3,100 | 3,469 | 407,739 | 2020/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 7,300 | 8,310 | 976,545 | 2021/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 7,000 | 8,328 | 978,693 | 2021/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.25 | 3,500 | 4,001 | 470,181 | 2021/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.0 | 20,000 | 22,709 | 2,668,534 | 2022/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 9,600 | 10,848 | 1,274,771 | 2022/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 5,000 | 5,586 | 656,440 | 2022/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 5,200 | 5,835 | 685,746 | 2023/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 5,200 | 5,853 | 687,824 | 2023/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.0 | 5,400 | 6,291 | 739,299 | 2023/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 14,100 | 21,078 | 2,476,969 | 2024/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.75 | 5,700 | 6,568 | 771,852 | 2024/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.5 | 1,500 | 1,701 | 199,923 | 2024/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0 | 2,300 | 2,516 | 295,705 | 2024/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5 | 26,900 | 46,073 | 5,414,130 | 2027/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.625 | 6,000 | 9,841 | 1,156,509 | 2028/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 3,400 | 5,299 | 622,773 | 2028/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 3,500 | 6,370 | 748,641 | 2030/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5 | 5,300 | 9,283 | 1,090,901 | 2031/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 6,600 | 11,665 | 1,370,801 | 2034/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0 | 9,400 | 15,915 | 1,870,254 | 2037/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.25 | 7,400 | 13,402 | 1,574,936 | 2039/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 5,200 | 10,127 | 1,190,065 | 2040/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 5,500 | 9,032 | 1,061,368 | 2042/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 4,700 | 6,977 | 819,974 | 2044/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 8,000 | 12,068 | 1,418,110 | 2046/8/15 |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25 | 3,300 | 3,493 | 410,541 | 2017/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 18,900 | 19,805 | 2,327,366 | 2017/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.75 | 10,500 | 10,629 | 1,249,019 | 2018/1/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 33,900 | 36,356 | 4,272,239 | 2018/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 10,400 | 11,107 | 1,305,207 | 2018/6/1 |

| 銘柄 | | | | 当期末 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| | イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 23,800 | 26,041 | 3,060,190 | 2018/8/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 8,000 | 8,674 | 1,019,328 | 2018/12/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 17,000 | 18,858 | 2,216,015 | 2019/2/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 3,800 | 4,252 | 499,720 | 2019/3/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5 | 4,100 | 4,379 | 514,649 | 2019/5/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5 | 500 | 521 | 61,240 | 2019/8/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 25,900 | 29,279 | 3,440,686 | 2019/9/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 10,300 | 11,907 | 1,399,289 | 2020/2/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 29,200 | 33,582 | 3,946,328 | 2020/3/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 13,800 | 15,952 | 1,874,613 | 2020/9/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 11,000 | 12,729 | 1,495,847 | 2021/3/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 7,000 | 8,117 | 953,934 | 2021/5/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 7,800 | 9,102 | 1,069,646 | 2021/8/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 10,400 | 12,681 | 1,490,233 | 2021/9/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 16,800 | 20,919 | 2,458,233 | 2022/3/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 9,600 | 12,383 | 1,455,131 | 2022/9/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 20,700 | 26,769 | 3,145,653 | 2022/11/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 5,000 | 6,216 | 730,536 | 2023/5/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 7,200 | 9,120 | 1,071,719 | 2023/8/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9.0 | 10,900 | 17,082 | 2,007,362 | 2023/11/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 11,900 | 14,896 | 1,750,478 | 2024/3/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 2,300 | 2,760 | 324,435 | 2024/9/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 14,900 | 19,482 | 2,289,444 | 2025/3/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 8,500 | 10,880 | 1,278,508 | 2026/3/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7.25 | 8,600 | 13,343 | 1,568,025 | 2026/11/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5 | 18,200 | 27,378 | 3,217,219 | 2027/11/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 7,300 | 9,768 | 1,147,938 | 2028/9/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25 | 12,100 | 17,120 | 2,011,805 | 2029/11/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0 | 18,100 | 27,863 | 3,274,197 | 2031/5/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.75 | 6,400 | 9,802 | 1,151,936 | 2033/2/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 8,400 | 12,076 | 1,419,130 | 2034/8/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 5,700 | 7,390 | 868,404 | 2037/2/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 8,000 | 11,812 | 1,388,028 | 2039/8/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 14,600 | 21,530 | 2,530,063 | 2040/9/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 7,000 | 10,188 | 1,197,250 | 2044/9/1 |
| | | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25 | 4,100 | 4,751 | 558,299 | 2046/9/1 |
| | フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | 1.0 | 8,000 | 8,331 | 979,076 | 2019/5/25 |
| | | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 8,500 | 8,754 | 1,028,744 | 2019/11/25 |
| | | | FRANCE (GOVT OF) | 2.5 | 3,500 | 4,348 | 511,038 | 2030/5/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 9,700 | 10,321 | 1,212,829 | 2017/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 6,000 | 6,496 | 763,398 | 2018/4/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.0 | 4,500 | 4,627 | 543,796 | 2018/5/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 10,800 | 11,997 | 1,409,826 | 2018/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.0 | 6,600 | 6,832 | 802,935 | 2018/11/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 11,500 | 13,035 | 1,531,823 | 2019/4/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8.5 | 4,000 | 5,196 | 610,631 | 2019/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.75 | 10,800 | 12,303 | 1,445,840 | 2019/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.5 | 14,800 | 17,003 | 1,998,051 | 2020/4/25 |

| 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 | 2.5 | 17,300 | 19,420 | 2,282,159 | 2020/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.75 | 11,800 | 14,106 | 1,657,701 | 2021/4/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.25 | 15,100 | 17,907 | 2,104,350 | 2021/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.0 | 14,800 | 17,542 | 2,061,363 | 2022/4/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.25 | 20,600 | 23,666 | 2,780,996 | 2022/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8.5 | 8,200 | 13,012 | 1,529,138 | 2023/4/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 29,500 | 38,695 | 4,547,067 | 2023/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.75 | 8,000 | 9,040 | 1,062,313 | 2024/11/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6.0 | 19,800 | 30,244 | 3,554,031 | 2025/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.5 | 26,500 | 34,558 | 4,060,986 | 2026/4/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.75 | 7,200 | 8,969 | 1,054,036 | 2027/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.5 | 23,100 | 37,212 | 4,372,830 | 2029/4/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.75 | 17,600 | 31,105 | 3,655,232 | 2032/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.75 | 8,500 | 14,165 | 1,664,538 | 2035/4/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 9,800 | 15,561 | 1,828,594 | 2038/10/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.5 | 11,400 | 19,796 | 2,326,263 | 2041/4/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.25 | 10,400 | 15,473 | 1,818,322 | 2045/5/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 4,700 | 8,349 | 981,173 | 2055/4/25 |
| | | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 3,800 | 6,895 | 810,310 | 2060/4/25 |
| | | | FRENCH TREASURY NOTE | 1.0 | 1,000 | 1,016 | 119,413 | 2017/7/25 |
| | オランダ | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.5 | 4,000 | 4,215 | 495,322 | 2017/7/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.25 | 4,500 | 4,627 | 543,802 | 2018/1/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 6,500 | 7,108 | 835,308 | 2018/7/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.25 | 2,500 | 2,615 | 307,357 | 2019/1/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 7,100 | 8,086 | 950,291 | 2019/7/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.25 | 2,000 | 2,054 | 241,440 | 2020/1/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.5 | 5,800 | 6,748 | 792,992 | 2020/7/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.25 | 5,900 | 6,991 | 821,601 | 2021/7/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.25 | 1,500 | 1,729 | 203,283 | 2022/7/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 5,900 | 7,439 | 874,262 | 2023/1/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 7.5 | 4,300 | 6,491 | 762,790 | 2023/1/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.75 | 1,400 | 1,587 | 186,586 | 2023/7/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.0 | 13,500 | 15,672 | 1,841,658 | 2024/7/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5 | 3,000 | 3,063 | 360,038 | 2026/7/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5.5 | 6,300 | 10,062 | 1,182,427 | 2028/1/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5 | 4,700 | 6,194 | 727,935 | 2033/1/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 5,000 | 8,331 | 979,082 | 2037/1/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 5,200 | 8,974 | 1,054,604 | 2042/1/15 |
| | | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.75 | 4,500 | 6,922 | 813,445 | 2047/1/15 |
| | スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5 | 28,700 | 28,900 | 3,396,144 | 2017/10/31 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.5 | 30,700 | 32,930 | 3,869,671 | 2018/1/31 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.25 | 1,300 | 1,306 | 153,480 | 2018/4/30 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.1 | 17,100 | 18,582 | 2,183,609 | 2018/7/30 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.75 | 17,100 | 18,612 | 2,187,196 | 2018/10/31 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.75 | 14,300 | 15,371 | 1,806,247 | 2019/4/30 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.6 | 9,100 | 10,353 | 1,216,638 | 2019/7/30 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.3 | 23,800 | 27,089 | 3,183,247 | 2019/10/31 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.0 | 22,800 | 26,057 | 3,061,982 | 2020/4/30 |

| 銘柄 | | | | 当期末 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| 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 | 4.85 | 11,600 | 13,854 | 1,628,096 | 2020/10/31 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.5 | 7,500 | 9,334 | 1,096,937 | 2021/4/30 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.85 | 9,200 | 11,885 | 1,396,631 | 2022/1/31 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.4 | 17,000 | 22,016 | 2,587,198 | 2023/1/31 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.4 | 6,300 | 7,813 | 918,171 | 2023/10/31 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.8 | 7,100 | 9,029 | 1,061,104 | 2024/1/31 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.8 | 8,300 | 9,925 | 1,166,303 | 2024/4/30 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.65 | 14,000 | 17,920 | 2,105,861 | 2025/7/30 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9 | 18,400 | 25,881 | 3,041,353 | 2026/7/30 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 4,800 | 6,605 | 776,186 | 2028/10/31 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9 | 4,900 | 7,067 | 830,538 | 2040/7/30 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7 | 4,400 | 6,217 | 730,658 | 2041/7/30 |
| | | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 7,300 | 11,049 | 1,298,417 | 2044/10/31 |
| | | | SPANISH GOVERNMENT | 6.0 | 9,800 | 14,490 | 1,702,789 | 2029/1/31 |
| | | | SPANISH GOVERNMENT | 5.75 | 8,300 | 12,605 | 1,481,238 | 2032/7/30 |
| | | | SPANISH GOVERNMENT | 4.2 | 5,600 | 7,332 | 861,616 | 2037/1/31 |
| | ベルギー | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM | 1.25 | 4,000 | 4,142 | 486,758 | 2018/6/22 |
| | | | BELGIUM KINGDOM | 3.0 | 3,100 | 3,448 | 405,226 | 2019/9/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 7,000 | 8,251 | 969,634 | 2020/9/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 7,200 | 8,928 | 1,049,129 | 2021/9/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 5,000 | 6,229 | 731,995 | 2022/3/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 6,400 | 8,180 | 961,288 | 2022/9/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM | 2.25 | 5,000 | 5,810 | 682,794 | 2023/6/22 |
| | | | BELGIUM KINGDOM | 2.6 | 10,400 | 12,449 | 1,462,980 | 2024/6/22 |
| | | | BELGIUM KINGDOM | 4.5 | 6,400 | 8,985 | 1,055,894 | 2026/3/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 3,500 | 5,174 | 608,008 | 2032/3/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 6,800 | 11,405 | 1,340,270 | 2041/3/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 5,800 | 9,359 | 1,099,776 | 2045/6/22 |
| | | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 2,000 | 2,152 | 252,986 | 2017/9/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4.0 | 2,500 | 2,699 | 317,247 | 2018/3/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4.0 | 5,200 | 5,851 | 687,585 | 2019/3/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 10,600 | 16,641 | 1,955,494 | 2028/3/28 |
| | | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.0 | 9,500 | 16,197 | 1,903,324 | 2035/3/28 |
| | オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.3 | 1,500 | 1,588 | 186,699 | 2017/9/15 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.65 | 3,000 | 3,242 | 381,081 | 2018/1/15 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.15 | 2,300 | 2,386 | 280,462 | 2018/10/19 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.35 | 2,500 | 2,827 | 332,215 | 2019/3/15 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.95 | 1,700 | 1,821 | 214,050 | 2019/6/18 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.25 | 2,400 | 2,453 | 288,313 | 2019/10/18 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.9 | 4,600 | 5,400 | 634,628 | 2020/7/15 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.5 | 4,400 | 5,272 | 619,573 | 2021/9/15 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.65 | 3,300 | 4,042 | 475,072 | 2022/4/20 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.4 | 5,000 | 6,146 | 722,275 | 2022/11/22 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.75 | 2,300 | 2,608 | 306,467 | 2023/10/20 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.65 | 3,000 | 3,387 | 398,112 | 2024/10/21 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.85 | 5,400 | 7,794 | 915,978 | 2026/3/15 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 6.25 | 4,600 | 7,547 | 886,880 | 2027/7/15 |
| | | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.15 | 5,900 | 9,581 | 1,125,954 | 2037/3/15 |

| 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 | |
| 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 | 3.15 | 5,800 | 8,794 | 1,033,396 | 2044/6/20 |
| | フィンランド | 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT | 3.875 | 2,000 | 2,109 | 247,925 | 2017/9/15 |
| | | | FINNISH GOVERNMENT | 1.125 | 1,500 | 1,554 | 182,715 | 2018/9/15 |
| | | | FINNISH GOVERNMENT | 4.375 | 1,300 | 1,492 | 175,385 | 2019/7/4 |
| | | | FINNISH GOVERNMENT | 3.375 | 2,000 | 2,289 | 269,050 | 2020/4/15 |
| | | | FINNISH GOVERNMENT | 3.5 | 2,000 | 2,368 | 278,320 | 2021/4/15 |
| | | | FINNISH GOVERNMENT | 1.625 | 3,200 | 3,556 | 417,906 | 2022/9/15 |
| | | | FINNISH GOVERNMENT | 1.5 | 4,200 | 4,653 | 546,852 | 2023/4/15 |
| | | | FINNISH GOVERNMENT | 4.0 | 2,400 | 3,223 | 378,814 | 2025/7/4 |
| | | | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 2,000 | 2,030 | 238,609 | 2026/4/15 |
| | | | FINNISH GOVERNMENT | 2.75 | 3,500 | 4,455 | 523,590 | 2028/7/4 |
| | | | FINNISH GOVERNMENT | 0.75 | 700 | 715 | 84,040 | 2031/4/15 |
| | | | FINNISH GOVERNMENT | 2.625 | 1,400 | 1,993 | 234,284 | 2042/7/4 |
| | アイルランド | 国債証券 | IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4 | 4.4 | 3,600 | 4,098 | 481,630 | 2019/6/18 |
| | | | IRISH GOVERNMENT | 5.5 | 7,500 | 8,082 | 949,795 | 2017/10/18 |
| | | | IRISH GOVERNMENT | 4.5 | 5,600 | 6,223 | 731,264 | 2018/10/18 |
| | | | IRISH GOVERNMENT | 5.9 | 3,400 | 4,084 | 479,924 | 2019/10/18 |
| | | | IRISH GOVERNMENT | 4.5 | 5,300 | 6,232 | 732,403 | 2020/4/18 |
| | | | IRISH GOVERNMENT | 5.0 | 3,500 | 4,264 | 501,080 | 2020/10/18 |
| | | | IRISH GOVERNMENT | 5.4 | 6,000 | 8,366 | 983,135 | 2025/3/13 |
| | | | IRISH TSY 2% 2045 | 2.0 | 1,500 | 1,639 | 192,645 | 2045/2/18 |
| | | | IRISH TSY 2.4% 2030 | 2.4 | 1,500 | 1,745 | 205,119 | 2030/5/15 |
| | | | IRISH TSY 3.4% 2024 | 3.4 | 1,300 | 1,580 | 185,723 | 2024/3/18 |
| | | | REPUBLIC OF IRELAND | 3.9 | 3,400 | 4,210 | 494,782 | 2023/3/20 |
| 小計 | | | | | | | 253,013,475 | |
| ポーランド | | | | | 千ズロチ | 千ズロチ | | |
| | | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.25 | 7,500 | 7,859 | 210,156 | 2017/10/25 |
| | | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.75 | 8,100 | 8,391 | 224,391 | 2018/4/25 |
| | | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 10,900 | 11,053 | 295,575 | 2018/7/25 |
| | | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 5,800 | 6,024 | 161,094 | 2019/7/25 |
| | | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.5 | 11,100 | 12,328 | 329,671 | 2019/10/25 |
| | | | POLAND GOVERNMENT BOND | 1.5 | 5,200 | 5,084 | 135,961 | 2020/4/25 |
| | | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.25 | 30,700 | 34,460 | 921,480 | 2020/10/25 |
| | | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 4,700 | 5,479 | 146,515 | 2021/10/25 |
| | | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 9,400 | 11,106 | 296,977 | 2022/9/23 |
| | | | POLAND GOVERNMENT BOND | 4.0 | 9,600 | 10,357 | 276,970 | 2023/10/25 |
| | | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 19,600 | 19,927 | 532,851 | 2025/7/25 |
| | | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 3,700 | 4,601 | 123,053 | 2029/4/25 |
| 小計 | | | | | | | 3,654,698 | |
| 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 | 1,702 | 132,531 | 2018/9/1 |
| | | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.5 | 4,600 | 4,770 | 371,360 | 2019/6/1 |
| | | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.25 | 4,000 | 4,301 | 334,879 | 2020/9/1 |
| | | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.25 | 2,580 | 2,662 | 207,282 | 2021/6/1 |
| | | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.125 | 1,200 | 1,297 | 101,033 | 2022/9/1 |
| | | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 3,000 | 3,177 | 247,329 | 2023/7/1 |
| | | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0 | 1,500 | 1,619 | 126,058 | 2024/9/1 |
| | | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.5 | 3,300 | 3,720 | 289,660 | 2027/3/1 |

| 銘柄 | | | 当期末 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| 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 | 2.875 | 2,400 | 2,545 | 198,177 | 2030/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.375 | 500 | 565 | 44,029 | 2033/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 2,900 | 3,036 | 236,375 | 2042/4/1 |
| 小計 | | | | | | 2,288,718 | |
| マレーシア | | | | 千リンギ | 千リンギ | | |
| | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.012 | 4,000 | 4,058 | 105,155 | 2017/9/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.24 | 8,200 | 8,384 | 217,250 | 2018/2/7 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.26 | 3,700 | 3,722 | 96,450 | 2018/3/1 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.58 | 4,300 | 4,354 | 112,825 | 2018/9/28 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.378 | 11,900 | 12,294 | 318,554 | 2019/11/29 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.492 | 10,000 | 10,018 | 259,568 | 2020/3/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.889 | 2,400 | 2,443 | 63,302 | 2020/7/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.16 | 6,000 | 6,172 | 159,925 | 2021/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.048 | 8,700 | 8,932 | 231,435 | 2021/9/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.418 | 4,600 | 4,520 | 117,135 | 2022/8/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.48 | 10,400 | 10,221 | 264,838 | 2023/3/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.181 | 5,800 | 5,920 | 153,397 | 2024/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.392 | 8,800 | 9,125 | 236,429 | 2026/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.502 | 4,000 | 3,795 | 98,336 | 2027/5/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.733 | 1,800 | 1,726 | 44,728 | 2028/6/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 5.248 | 2,700 | 2,958 | 76,663 | 2028/9/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.498 | 2,500 | 2,568 | 66,555 | 2030/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.232 | 4,400 | 4,417 | 114,466 | 2031/6/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.127 | 4,700 | 4,581 | 118,701 | 2032/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.844 | 400 | 377 | 9,786 | 2033/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.935 | 2,600 | 2,697 | 69,897 | 2043/9/30 |
| 小計 | | | | | | 2,935,406 | |
| オーストラリア | | | | 千豪ドル | 千豪ドル | | |
| | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 4,000 | 4,112 | 320,189 | 2017/7/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5 | 9,800 | 10,382 | 808,419 | 2018/1/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 4,700 | 4,865 | 378,859 | 2018/10/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.25 | 13,600 | 14,909 | 1,160,890 | 2019/3/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 2,900 | 3,004 | 233,951 | 2019/10/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 13,100 | 14,480 | 1,127,470 | 2020/4/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.75 | 900 | 902 | 70,239 | 2020/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 10,200 | 12,104 | 942,448 | 2021/5/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 7,900 | 9,637 | 750,353 | 2022/7/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5 | 7,500 | 9,190 | 715,579 | 2023/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 7,900 | 8,288 | 645,356 | 2024/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 16,000 | 17,454 | 1,358,973 | 2025/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 9,500 | 11,212 | 873,032 | 2026/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.75 | 5,800 | 7,210 | 561,440 | 2027/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 10,100 | 11,063 | 861,420 | 2029/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 3,600 | 4,543 | 353,769 | 2033/4/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,800 | 1,804 | 140,465 | 2035/6/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.75 | 5,400 | 6,225 | 484,730 | 2037/4/21 |
| 小計 | | | | | | 11,787,592 | |

| 銘柄 | | | 当期末 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| メキシコ | | | % | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 千円 | |
| | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.0 | 1,000 | 1,006 | 5,648 | 2017/6/15 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 60,800 | 63,866 | 358,289 | 2017/12/14 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 4.75 | 142,800 | 142,621 | 800,106 | 2018/6/14 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 104,500 | 113,133 | 634,679 | 2018/12/13 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.0 | 29,000 | 28,810 | 161,626 | 2019/12/11 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 60,700 | 66,529 | 373,232 | 2020/6/11 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 85,600 | 89,170 | 500,247 | 2021/6/10 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 38,400 | 39,782 | 223,182 | 2022/6/9 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 30,700 | 39,083 | 219,255 | 2024/12/5 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5 | 71,600 | 78,500 | 440,388 | 2027/6/3 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 47,100 | 55,412 | 310,864 | 2029/5/31 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 41,000 | 45,511 | 255,319 | 2031/5/29 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 10,000 | 11,114 | 62,353 | 2034/11/23 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 46,000 | 62,768 | 352,130 | 2036/11/20 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 30,500 | 36,670 | 205,720 | 2038/11/18 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 54,200 | 60,795 | 341,064 | 2042/11/13 |
| | | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0 | 83,000 | 93,642 | 525,333 | 2023/12/7 |
| 小計 | | | | | | 5,769,445 | |
| 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 | 10,367 | 73,403 | 2017/9/15 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 28,800 | 28,767 | 203,674 | 2018/12/21 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.25 | 25,300 | 24,473 | 173,273 | 2020/1/15 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.75 | 26,100 | 24,343 | 172,353 | 2021/3/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.75 | 25,200 | 23,955 | 169,607 | 2023/2/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10.5 | 61,900 | 68,207 | 482,909 | 2026/12/21 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 24,300 | 21,785 | 154,239 | 2030/1/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.0 | 30,000 | 24,282 | 171,916 | 2031/2/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.25 | 41,000 | 36,872 | 261,058 | 2032/3/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.25 | 47,100 | 33,436 | 236,730 | 2036/3/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.5 | 22,500 | 20,135 | 142,557 | 2037/1/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.5 | 24,600 | 17,325 | 122,664 | 2041/2/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 22,100 | 19,995 | 141,567 | 2044/1/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 46,100 | 41,615 | 294,640 | 2048/2/28 |
| 小計 | | | | | | 2,800,595 | |
| 合計 | | | | | | 623,806,811 | |

＊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(2,421,700千口)の内容です。

### 外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債　種類別開示

| 区分 | 当期末 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 額面金額 | 評価額 | | 組入比率 | うちBB格以下組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | ５年以上 | ２年以上 | ２年未満 |
| | 千トルコリラ | 千トルコリラ | 千円 | % | % | % | % | % |
| トルコ | 7,550 | 7,370 | 264,463 | 9.5 | － | 5.5 | 3.6 | 0.4 |
| | 千フォリント | 千フォリント | | | | | | |
| ハンガリー | 326,000 | 385,326 | 143,919 | 5.2 | 5.2 | 2.5 | 2.7 | － |
| | 千ズロチ | 千ズロチ | | | | | | |
| ポーランド | 9,420 | 9,893 | 264,561 | 9.5 | － | 4.2 | 3.5 | 1.8 |
| | 千ルーブル | 千ルーブル | | | | | | |
| ロシア | 85,000 | 83,236 | 136,507 | 4.9 | 4.9 | － | － | 4.9 |
| | 千レイ | 千レイ | | | | | | |
| ルーマニア | 2,640 | 2,948 | 76,342 | 2.7 | － | 1.3 | 0.8 | 0.6 |
| | 千リンギ | 千リンギ | | | | | | |
| マレーシア | 10,100 | 10,187 | 263,959 | 9.5 | － | 4.5 | 4.0 | 0.9 |
| | 千バーツ | 千バーツ | | | | | | |
| タイ | 65,100 | 71,967 | 213,743 | 7.7 | － | 4.7 | 2.6 | 0.4 |
| | 千フィリピンペソ | 千フィリピンペソ | | | | | | |
| フィリピン | 5,000 | 5,218 | 11,793 | 0.4 | － | － | 0.4 | － |
| | 千ルピア | 千ルピア | | | | | | |
| インドネシア | 32,280,000 | 34,437,062 | 272,052 | 9.8 | 9.8 | 8.0 | 1.6 | 0.2 |
| | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | | | | | |
| メキシコ | 41,150 | 45,645 | 256,073 | 9.2 | － | 5.6 | 2.5 | 1.1 |
| | 千レアル | 千レアル | | | | | | |
| ブラジル | 7,447 | 9,461 | 289,899 | 10.4 | 10.4 | 2.5 | 6.1 | 1.9 |
| | 千コロンビアペソ | 千コロンビアペソ | | | | | | |
| コロンビア | 5,130,000 | 5,439,841 | 191,482 | 6.9 | － | 2.6 | 4.3 | － |
| | 千ヌエボソル | 千ヌエボソル | | | | | | |
| ペルー | 1,580 | 1,650 | 52,511 | 1.9 | － | 1.3 | 0.6 | － |
| | 千ランド | 千ランド | | | | | | |
| 南アフリカ | 41,430 | 37,108 | 262,727 | 9.4 | － | 7.4 | 2.1 | － |
| 合計 | － | － | 2,700,037 | 97.0 | 30.3 | 50.0 | 34.7 | 12.2 |

＊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。
＊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。
＊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 | 当期末 額面金額 | 当期末 評価額 外貨建金額 | 当期末 評価額 邦貨換算金額 | 当期末 償還年月日 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| トルコ | | | % | 千トルコリラ | 千トルコリラ | 千円 | |
| | 国債証券 | TURKEY GOVERNMENT BOND | 8.3 | 300 | 297 | 10,688 | 2018/6/20 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 8.8 | 900 | 900 | 32,324 | 2018/11/14 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 10.5 | 860 | 902 | 32,384 | 2020/1/15 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 7.4 | 1,050 | 1,000 | 35,884 | 2020/2/5 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 9.5 | 730 | 741 | 26,598 | 2022/1/12 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 8.5 | 550 | 531 | 19,072 | 2022/9/14 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 7.1 | 570 | 509 | 18,293 | 2023/3/8 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 8.8 | 460 | 449 | 16,121 | 2023/9/27 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 10.4 | 220 | 233 | 8,386 | 2024/3/20 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 9.0 | 610 | 601 | 21,574 | 2024/7/24 |
| | | TURKEY GOVERNMENT BOND | 8.0 | 1,300 | 1,202 | 43,134 | 2025/3/12 |
| 小計 | | | | | | 264,463 | |
| ハンガリー | | | | 千フォリント | 千フォリント | | |
| | 国債証券 | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 6.5 | 77,000 | 87,741 | 32,771 | 2019/6/24 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 3.5 | 25,000 | 26,446 | 9,877 | 2020/6/24 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 7.5 | 70,000 | 85,697 | 32,008 | 2020/11/12 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 7.0 | 24,000 | 29,886 | 11,162 | 2022/6/24 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 6.0 | 77,000 | 92,977 | 34,727 | 2023/11/24 |
| | | HUNGARY GOVERNMENT BOND | 5.5 | 53,000 | 62,577 | 23,372 | 2025/6/24 |
| 小計 | | | | | | 143,919 | |
| ポーランド | | | | 千ズロチ | 千ズロチ | | |
| | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.25 | 580 | 607 | 16,252 | 2017/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.75 | 1,220 | 1,263 | 33,797 | 2018/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 600 | 623 | 16,664 | 2019/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.5 | 280 | 310 | 8,316 | 2019/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 1.5 | 1,030 | 1,007 | 26,930 | 2020/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.25 | 830 | 931 | 24,912 | 2020/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.0 | 800 | 788 | 21,071 | 2021/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 500 | 582 | 15,586 | 2021/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 780 | 921 | 24,642 | 2022/9/23 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 4.0 | 610 | 658 | 17,599 | 2023/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 1,800 | 1,830 | 48,935 | 2025/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 390 | 368 | 9,851 | 2026/7/25 |
| 小計 | | | | | | 264,561 | |
| ロシア | | | | 千ルーブル | 千ルーブル | | |
| | 国債証券 | RUSSIA FOREIGN BOND | 7.85 | 85,000 | 83,236 | 136,507 | 2018/3/10 |
| 小計 | | | | | | 136,507 | |
| ルーマニア | | | | 千レイ | 千レイ | | |
| | 国債証券 | ROMANIA | 5.9 | 620 | 656 | 17,000 | 2017/7/26 |
| | | ROMANIA | 5.6 | 200 | 219 | 5,687 | 2018/11/28 |
| | | ROMANIA | 4.75 | 270 | 293 | 7,594 | 2019/6/24 |
| | | ROMANIA | 5.95 | 300 | 345 | 8,937 | 2021/6/11 |
| | | ROMANIA | 5.85 | 950 | 1,107 | 28,663 | 2023/4/26 |
| | | ROMANIA | 4.75 | 300 | 326 | 8,459 | 2025/2/24 |
| 小計 | | | | | | 76,342 | |

| 銘柄 | | | 当期末 利率 | 当期末 額面金額 | 当期末 評価額 外貨建金額 | 当期末 評価額 邦貨換算金額 | 当期末 償還年月日 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| マレーシア | | | % | 千リンギ | 千リンギ | 千円 | |
| | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.314 | 200 | 201 | 5,217 | 2017/10/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.24 | 760 | 777 | 20,135 | 2018/2/7 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.58 | 1,200 | 1,215 | 31,486 | 2018/9/28 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.378 | 1,760 | 1,818 | 47,113 | 2019/11/29 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.659 | 1,300 | 1,311 | 33,993 | 2020/10/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.16 | 620 | 637 | 16,525 | 2021/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.418 | 750 | 737 | 19,098 | 2022/8/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.48 | 880 | 864 | 22,409 | 2023/3/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.181 | 600 | 612 | 15,868 | 2024/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.392 | 540 | 559 | 14,508 | 2026/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.733 | 740 | 709 | 18,388 | 2028/6/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.498 | 200 | 205 | 5,324 | 2030/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.127 | 550 | 536 | 13,890 | 2032/4/15 |
| 小計 | | | | | | 263,959 | |
| タイ | | | | 千バーツ | 千バーツ | | |
| | 国債証券 | THAILAND GOVERNMENT BOND | 5.125 | 3,600 | 3,817 | 11,339 | 2018/3/13 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.45 | 9,200 | 9,641 | 28,635 | 2019/3/8 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.875 | 8,700 | 9,268 | 27,527 | 2019/6/13 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 2.55 | 5,000 | 5,161 | 15,330 | 2020/6/26 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.65 | 15,000 | 16,409 | 48,737 | 2021/12/17 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.625 | 4,600 | 5,094 | 15,130 | 2023/6/16 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 4.75 | 1,200 | 1,446 | 4,295 | 2024/12/20 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.85 | 5,000 | 5,747 | 17,070 | 2025/12/12 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 3.58 | 6,700 | 7,585 | 22,528 | 2027/12/17 |
| | | THAILAND GOVERNMENT BOND | 4.875 | 6,100 | 7,793 | 23,147 | 2029/6/22 |
| 小計 | | | | | | 213,743 | |
| 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 | 5,218 | 11,793 | 2021/1/15 |
| 小計 | | | | | | 11,793 | |
| インドネシア | | | | 千ルピア | 千ルピア | | |
| | 国債証券 | INDONESIA GOVERNMENT | 10.0 | 650,000 | 673,452 | 5,320 | 2017/7/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 7.875 | 1,300,000 | 1,319,836 | 10,426 | 2019/4/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 11.0 | 1,900,000 | 2,157,906 | 17,047 | 2020/11/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 12.8 | 1,700,000 | 2,073,552 | 16,381 | 2021/6/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 7.0 | 1,880,000 | 1,820,422 | 14,381 | 2022/5/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 8.375 | 3,360,000 | 3,491,994 | 27,586 | 2024/3/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 11.0 | 6,120,000 | 7,382,494 | 58,321 | 2025/9/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 7.0 | 2,450,000 | 2,297,820 | 18,152 | 2027/5/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 9.0 | 1,330,000 | 1,434,959 | 11,336 | 2029/3/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 10.5 | 1,110,000 | 1,351,272 | 10,675 | 2030/8/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 9.5 | 1,400,000 | 1,599,500 | 12,636 | 2031/7/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 8.25 | 2,300,000 | 2,350,961 | 18,572 | 2032/6/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 6.625 | 3,300,000 | 2,881,140 | 22,761 | 2033/5/15 |
| | | INDONESIA GOVERNMENT | 8.375 | 3,480,000 | 3,601,747 | 28,453 | 2034/3/15 |
| 小計 | | | | | | 272,052 | |
| 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 | 5,650 | 5,642 | 31,656 | 2018/6/14 |

| 銘柄 | | | 当期末 利率 | 当期末 額面金額 | 当期末 評価額 外貨建金額 | 当期末 評価額 邦貨換算金額 | 償還年月日 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| メキシコ | | | % | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | 千円 | |
| | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 4,800 | 5,196 | 29,152 | 2018/12/13 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 4,950 | 5,425 | 30,436 | 2020/6/11 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 1,600 | 1,666 | 9,350 | 2021/6/10 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 4,800 | 4,972 | 27,897 | 2022/6/9 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 3,800 | 4,837 | 27,139 | 2024/12/5 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5 | 3,250 | 3,563 | 19,989 | 2027/6/3 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 3,200 | 3,552 | 19,927 | 2031/5/29 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 700 | 955 | 5,358 | 2036/11/20 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 5,000 | 6,011 | 33,724 | 2038/11/18 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 2,200 | 2,467 | 13,843 | 2042/11/13 |
| | | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0 | 1,200 | 1,353 | 7,595 | 2023/12/7 |
| 小計 | | | | | | 256,073 | |
| ブラジル | | | | 千レアル | 千レアル | | |
| | 国債証券 | LETRA TESOURO NACIONAL | — | 2,070 | 1,726 | 52,894 | 2018/1/1 |
| | | LETRA TESOURO NACIONAL | — | 2,020 | 1,593 | 48,809 | 2018/7/1 |
| | | LETRA TESOURO NACIONAL | — | 1,020 | 760 | 23,297 | 2019/1/1 |
| | | LETRA TESOURO NACIONAL | — | 1,910 | 1,343 | 41,152 | 2019/7/1 |
| | | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 10.0 | 186 | 1,810 | 55,486 | 2021/1/1 |
| | | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 10.0 | 50 | 471 | 14,436 | 2023/1/1 |
| | | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 10.0 | 191 | 1,756 | 53,822 | 2025/1/1 |
| 小計 | | | | | | 289,899 | |
| 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 | 3,350,000 | 3,399,231 | 119,652 | 2021/4/14 |
| | | REPUBLIC OF COLOMBIA | 9.85 | 1,780,000 | 2,040,609 | 71,829 | 2027/6/28 |
| 小計 | | | | | | 191,482 | |
| 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 | 599 | 19,084 | 2024/8/12 |
| | | PERU BONO SOBERANO | 7.84 | 480 | 525 | 16,715 | 2020/8/12 |
| | | PERU BONO SOBERANO | 6.9 | 500 | 525 | 16,711 | 2037/8/12 |
| 小計 | | | | | | 52,511 | |
| 南アフリカ | | | | 千ランド | 千ランド | | |
| | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 2,700 | 2,696 | 19,094 | 2018/12/21 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.25 | 2,380 | 2,302 | 16,300 | 2020/1/15 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.75 | 3,340 | 3,115 | 22,055 | 2021/3/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.75 | 2,300 | 2,186 | 15,480 | 2023/2/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10.5 | 4,900 | 5,399 | 38,227 | 2026/12/21 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 5,000 | 4,482 | 31,736 | 2030/1/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.0 | 4,360 | 3,528 | 24,985 | 2031/2/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.25 | 2,000 | 1,419 | 10,052 | 2036/3/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.5 | 3,300 | 2,953 | 20,908 | 2037/1/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.5 | 5,250 | 3,697 | 26,178 | 2041/2/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 5,900 | 5,326 | 37,708 | 2048/2/28 |
| 小計 | | | | | | 262,727 | |
| 合計 | | | | | | 2,700,037 | |

＊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。

## ＜J－REITインデックス マザーファンド＞

下記は、J－REITインデックス マザーファンド全体(10,696,508千口)の内容です。

### 国内投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | 比率 |
| | 口 | 口 | 千円 | % |
| 日本アコモデーションファンド投資法人　投資証券 | 836 | 868 | 374,108 | 1.8 |
| ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人　投資証券 | 459 | 477 | 170,527 | 0.8 |
| 森ヒルズリート投資法人　投資証券 | 2,709 | 3,137 | 492,509 | 2.3 |
| 産業ファンド投資法人　投資証券 | 608 | 632 | 341,280 | 1.6 |
| 大和ハウスリート投資法人　投資証券 | 605 | 628 | 365,496 | 1.7 |
| アドバンス・レジデンス投資法人　投資証券 | 2,243 | 2,330 | 629,100 | 3.0 |
| ケネディクス・レジデンシャル投資法人　投資証券 | 602 | 626 | 174,591 | 0.8 |
| アクティビア・プロパティーズ投資法人　投資証券 | 1,029 | 1,075 | 577,275 | 2.8 |
| ＧＬＰ投資法人　投資証券 | 4,476 | 4,648 | 581,000 | 2.8 |
| コンフォリア・レジデンシャル投資法人　投資証券 | 818 | 920 | 204,700 | 1.0 |
| 日本プロロジスリート投資法人　投資証券 | 2,986 | 3,301 | 800,492 | 3.8 |
| 星野リゾート・リート投資法人　投資証券 | 135 | 147 | 186,690 | 0.9 |
| ＳＩＡ不動産投資法人　投資証券 | 130 | 135 | 56,632 | 0.3 |
| イオンリート投資法人　投資証券 | 1,881 | 2,347 | 304,875 | 1.5 |
| ヒューリックリート投資法人　投資証券 | 1,348 | 1,715 | 314,016 | 1.5 |
| 日本リート投資法人　投資証券 | 676 | 702 | 193,330 | 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 | 936 | 1,440 | 135,216 | 0.6 |
| 日本ヘルスケア投資法人　投資証券 | 126 | 134 | 23,155 | 0.1 |
| 積水ハウス・リート投資法人　投資証券 | 1,370 | 1,594 | 213,277 | 1.0 |
| トーセイ・リート投資法人　投資証券 | 272 | 289 | 32,599 | 0.2 |
| ケネディクス商業リート投資法人　投資証券 | 613 | 757 | 203,935 | 1.0 |
| ヘルスケア＆メディカル投資法人　投資証券 | 208 | 216 | 21,837 | 0.1 |
| サムティ・レジデンシャル投資法人　投資証券 | 282 | 293 | 27,278 | 0.1 |
| ジャパン・シニアリビング投資法人　投資証券 | 146 | 152 | 22,648 | 0.1 |
| 野村不動産マスターファンド投資法人　投資証券 | 6,422 | 6,670 | 1,090,545 | 5.2 |
| いちごホテルリート投資法人　投資証券 | － | 248 | 45,384 | 0.2 |
| ラサールロジポート投資法人　投資証券 | － | 1,971 | 202,027 | 1.0 |
| スターアジア不動産投資法人　投資証券 | － | 618 | 57,103 | 0.3 |
| 日本ビルファンド投資法人　投資証券 | 2,436 | 2,530 | 1,601,490 | 7.6 |
| ジャパンリアルエステイト投資法人　投資証券 | 2,259 | 2,346 | 1,459,212 | 7.0 |
| 日本リテールファンド投資法人　投資証券 | 4,404 | 4,574 | 1,178,719 | 5.6 |
| オリックス不動産投資法人　投資証券 | 4,004 | 4,339 | 763,664 | 3.6 |
| 日本プライムリアルティ投資法人　投資証券 | 1,506 | 1,565 | 701,120 | 3.3 |
| プレミア投資法人　投資証券 | 2,272 | 2,360 | 310,576 | 1.5 |
| 東急リアル・エステート投資法人　投資証券 | 1,687 | 1,752 | 256,142 | 1.2 |
| グローバル・ワン不動産投資法人　投資証券 | 334 | 347 | 138,279 | 0.7 |
| ユナイテッド・アーバン投資法人　投資証券 | 4,748 | 5,271 | 948,780 | 4.5 |
| 森トラスト総合リート投資法人　投資証券 | 2,278 | 2,366 | 459,240 | 2.2 |
| インヴィンシブル投資法人　投資証券 | 5,511 | 6,588 | 492,123 | 2.3 |
| フロンティア不動産投資法人　投資証券 | 856 | 889 | 457,835 | 2.2 |
| 平和不動産リート投資法人　投資証券 | 1,741 | 1,819 | 147,157 | 0.7 |
| 日本ロジスティクスファンド投資法人　投資証券 | 1,518 | 1,577 | 364,602 | 1.7 |
| 福岡リート投資法人　投資証券 | 1,289 | 1,339 | 265,389 | 1.3 |
| ケネディクス・オフィス投資法人　投資証券 | 699 | 726 | 439,956 | 2.1 |

| 銘柄 | | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 口数 | 口数 | 評価額 | 比率 |
| | | 口 | 口 | 千円 | % |
| 積水ハウス・ＳＩレジデンシャル投資法人　投資証券 | | 1,757 | 1,825 | 208,962 | 1.0 |
| いちごオフィスリート投資法人　投資証券 | | 2,444 | 2,736 | 219,700 | 1.0 |
| 大和証券オフィス投資法人　投資証券 | | 835 | 867 | 542,742 | 2.6 |
| 阪急リート投資法人　投資証券 | | 1,031 | 1,071 | 135,695 | 0.6 |
| スターツプロシード投資法人　投資証券 | | 300 | 311 | 53,243 | 0.3 |
| トップリート投資法人　投資証券 | | 304 | 315 | 133,245 | 0.6 |
| 大和ハウス・レジデンシャル投資法人　投資証券 | | 1,290 | 1,340 | 360,862 | 1.7 |
| ジャパン・ホテル・リート投資法人　投資証券 | | 5,425 | 5,953 | 553,629 | 2.6 |
| 日本賃貸住宅投資法人　投資証券 | | 2,830 | 2,939 | 236,883 | 1.1 |
| ジャパンエクセレント投資法人　投資証券 | | 2,182 | 2,266 | 329,476 | 1.6 |
| 合計 | 口数・金額 | 87,856 | 98,081 | 20,600,359 | |
| | 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、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 | | | 当期末 | |
|---|---|---|---|---|
| | | | 買建額 | 売建額 |
| | | | 百万円 | 百万円 |
| 国内 | REIT先物取引 | 東証REIT指数 | 379 | － |

＊単位未満は切り捨て。

## ＜海外REITインデックス マザーファンド＞

下記は、海外REITインデックス マザーファンド全体(8,747,896千口)の内容です。

### 外国投資信託証券

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | 比率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| ACADIA REALTY TRUST | 9,900 | 10,900 | 373 | 39,019 | 0.2 |
| AGREE REALTY CORP | 2,900 | 3,700 | 167 | 17,517 | 0.1 |
| ALEXANDERS INC | 540 | 580 | 211 | 22,160 | 0.1 |
| ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT | 10,600 | 11,300 | 1,106 | 115,717 | 0.7 |
| AMERICAN ASSETS TRUST INC | 5,900 | 6,100 | 249 | 26,104 | 0.1 |
| AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES | 16,300 | 20,000 | 981 | 102,676 | 0.6 |
| AMERICAN HOMES 4 RENT-A | 22,500 | 27,300 | 513 | 53,674 | 0.3 |
| AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC | 4,700 | — | — | — | — |
| APARTMENT INVT&MGMT CO-A | 22,900 | 24,100 | 1,005 | 105,200 | 0.6 |
| APPLE HOSPITALITY REIT INC | 22,700 | 24,200 | 450 | 47,073 | 0.3 |
| ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC | 4,100 | 4,800 | 61 | 6,480 | 0.0 |
| ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC | 3,595 | 3,595 | 52 | 5,507 | 0.0 |
| ASHFORD HOSPITALITY TRUST | 12,100 | 12,100 | 67 | 7,023 | 0.0 |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 19,950 | 21,050 | 3,685 | 385,400 | 2.2 |
| BIOMED REALTY TRUST INC | 29,600 | — | — | — | — |
| BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH | 2,700 | 2,700 | 33 | 3,481 | 0.0 |
| BOSTON PROPERTIES | 22,350 | 23,600 | 3,011 | 314,903 | 1.8 |
| BRANDYWINE REALTY TRUST | 26,300 | 27,200 | 431 | 45,086 | 0.3 |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | 24,700 | 31,600 | 818 | 85,592 | 0.5 |
| CBL&ASSOCIATES PROPERTIES | 21,800 | 23,500 | 229 | 24,035 | 0.1 |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 12,600 | 13,400 | 1,117 | 116,916 | 0.7 |
| CAMPUS CREST COMMUNITIES INC | 8,900 | — | — | — | — |
| CARE CAPITAL PROPERTIES INC | 12,300 | 12,800 | 331 | 34,710 | 0.2 |
| CARETRUST REIT INC ACQUIRES | 7,200 | 8,500 | 114 | 12,009 | 0.1 |
| CEDAR REALTY TRUST INC | 10,900 | 12,000 | 85 | 8,935 | 0.1 |
| CHATHAM LODGING TRUST | 5,400 | 5,900 | 125 | 13,148 | 0.1 |
| CHESAPEAKE LODGING TRUST | 8,500 | 9,200 | 215 | 22,581 | 0.1 |
| CITY OFFICE REIT INC | 2,400 | 3,300 | 40 | 4,217 | 0.0 |
| COLONY STARWOOD HOMES | — | 5,900 | 176 | 18,418 | 0.1 |
| COLUMBIA PROPERTY TRUST INC | 18,200 | 19,300 | 415 | 43,456 | 0.2 |
| COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I | — | 2,000 | 40 | 4,262 | 0.0 |
| CORESITE REALTY CORP | 4,400 | 4,700 | 398 | 41,627 | 0.2 |
| CORPORATE OFFICE PROPERTIES | 13,900 | 14,600 | 410 | 42,981 | 0.2 |
| CORRECTIONS CORP OF AMERICA | 17,200 | 18,000 | 618 | 64,699 | 0.4 |
| COUSINS PROPERTIES INC | 29,500 | 30,400 | 317 | 33,254 | 0.2 |
| CUBESMART | 25,000 | 27,100 | 801 | 83,804 | 0.5 |
| CYRUSONE INC | 9,500 | 10,700 | 559 | 58,490 | 0.3 |
| DCT INDUSTRIAL TRUST INC | 13,000 | 13,600 | 621 | 65,027 | 0.4 |
| DDR CORP | 44,100 | 47,500 | 835 | 87,379 | 0.5 |
| DIAMONDROCK HOSPITALITY CO | 29,300 | 30,800 | 299 | 31,373 | 0.2 |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 21,300 | 22,600 | 2,350 | 245,828 | 1.4 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | 比率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| DOUGLAS EMMETT INC | 20,400 | 21,600 | 733 | 76,735 | 0.4 |
| DUKE REALTY CORP | 50,300 | 53,200 | 1,365 | 142,819 | 0.8 |
| DUPONT FABROS TECHNOLOGY | 9,400 | 11,400 | 526 | 55,044 | 0.3 |
| EPR PROPERTIES | 8,800 | 9,700 | 727 | 76,061 | 0.4 |
| EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC | 1,800 | 3,100 | 58 | 6,111 | 0.0 |
| EASTGROUP PROPERTIES | 4,700 | 4,900 | 332 | 34,758 | 0.2 |
| EDUCATION REALTY TRUST INC | 8,200 | 10,200 | 444 | 46,508 | 0.3 |
| EMPIRE STATE REALTY TRUST IN | 17,300 | 18,600 | 357 | 37,347 | 0.2 |
| EQUITY COMMONWEALTH | 18,900 | 19,400 | 562 | 58,836 | 0.3 |
| EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES | 11,600 | 12,300 | 908 | 95,034 | 0.5 |
| EQUITY ONE INC | 10,700 | 14,100 | 426 | 44,591 | 0.3 |
| EQUITY RESIDENTIAL | 53,100 | 56,100 | 3,702 | 387,217 | 2.2 |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 9,600 | 10,050 | 2,209 | 231,100 | 1.3 |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | 18,000 | 19,200 | 1,676 | 175,332 | 1.0 |
| FARMLAND PARTNERS INC | — | 1,800 | 20 | 2,095 | 0.0 |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 10,150 | 10,900 | 1,712 | 179,070 | 1.0 |
| FELCOR LODGING TRUST INC | 18,600 | 20,100 | 129 | 13,579 | 0.1 |
| FIRST INDUSTRIAL REALTY TR | 16,200 | 18,000 | 483 | 50,599 | 0.3 |
| FIRST POTOMAC REALTY TRUST | 8,400 | 8,400 | 78 | 8,204 | 0.0 |
| FOREST CITY REALTY TRUST- A | — | 33,500 | 748 | 78,231 | 0.4 |
| FOUR CORNERS PROPERTY TRUST | 5,400 | 8,526 | 170 | 17,859 | 0.1 |
| FRANKLIN STREET PROPERTIES C | 13,000 | 14,100 | 167 | 17,547 | 0.1 |
| GEO GROUP INC/THE | 10,800 | 11,400 | 380 | 39,760 | 0.2 |
| GAMING AND LEISURE PROPERTIE | 13,390 | 29,100 | 1,012 | 105,936 | 0.6 |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 85,000 | 89,400 | 2,569 | 268,703 | 1.5 |
| GETTY REALTY CORP | 3,900 | 3,921 | 82 | 8,652 | 0.0 |
| GLADSTONE COMMERCIAL CORP | 3,100 | 3,600 | 60 | 6,358 | 0.0 |
| GLOBAL NET LEASE INC | 24,300 | 26,500 | 213 | 22,337 | 0.1 |
| GOVERNMENT PROPERTIES INCOME | 10,500 | 11,000 | 227 | 23,766 | 0.1 |
| GRAMERCY PROPERTY TRUST | 60,794 | 64,900 | 578 | 60,474 | 0.3 |
| HCP INC | 67,800 | 71,900 | 2,517 | 263,250 | 1.5 |
| HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 14,700 | 16,000 | 538 | 56,305 | 0.3 |
| HEALTHCARE TRUST OF AMERICA | 18,500 | 21,000 | 660 | 69,091 | 0.4 |
| HERSHA HOSPITALITY TRUST | 6,900 | 6,900 | 124 | 13,024 | 0.1 |
| HIGHWOODS PROPERTIES INC | 14,000 | 14,900 | 735 | 76,945 | 0.4 |
| HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 22,000 | 23,300 | 632 | 66,156 | 0.4 |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 109,800 | 115,400 | 1,921 | 200,941 | 1.1 |
| HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 10,600 | 13,700 | 395 | 41,392 | 0.2 |
| INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | 4,285 | 4,285 | 32 | 3,414 | 0.0 |
| INLAND REAL ESTATE CORP | 12,700 | — | — | — | — |
| INVESTORS REAL ESTATE TRUST | 18,300 | 19,800 | 124 | 13,066 | 0.1 |
| IRON MOUNTAIN INC | 28,100 | 36,800 | 1,406 | 147,129 | 0.8 |
| KILROY REALTY CORP | 13,500 | 14,200 | 903 | 94,463 | 0.5 |
| KIMCO REALTY CORP | 60,400 | 64,300 | 1,907 | 199,448 | 1.1 |
| KITE REALTY GROUP TRUST | 12,000 | 12,700 | 343 | 35,926 | 0.2 |
| LTC PROPERTIES INC | 5,100 | 5,800 | 288 | 30,158 | 0.2 |
| LASALLE HOTEL PROPERTIES | 16,400 | 17,600 | 418 | 43,714 | 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 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| LEXINGTON REALTY TRUST | 30,500 | 32,700 | 322 | 33,684 | 0.2 |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 21,700 | 22,500 | 881 | 92,168 | 0.5 |
| MACERICH CO /THE | 19,600 | 19,400 | 1,581 | 165,392 | 0.9 |
| MACK-CALI REALTY CORP | 12,800 | 13,600 | 369 | 38,643 | 0.2 |
| MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 34,200 | 36,600 | 549 | 57,490 | 0.3 |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | 11,000 | 11,600 | 1,180 | 123,447 | 0.7 |
| MONMOUTH REIT-CLASS A | 9,100 | 10,100 | 131 | 13,794 | 0.1 |
| MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC | 24,600 | 25,600 | 259 | 27,120 | 0.2 |
| NATL HEALTH INVESTORS INC | 5,000 | 5,300 | 380 | 39,824 | 0.2 |
| NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC | 19,700 | 22,200 | 1,048 | 109,629 | 0.6 |
| NATIONAL STORAGE AFFILIATES | 3,500 | 3,500 | 71 | 7,518 | 0.0 |
| NEW SENIOR INVESTMENT GROUP | 12,700 | 13,200 | 138 | 14,522 | 0.1 |
| NEW YORK REIT INC | 24,000 | 25,000 | 231 | 24,184 | 0.1 |
| NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC | 3,000 | 3,000 | 50 | 5,302 | 0.0 |
| NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP | 27,700 | 28,110 | 339 | 35,453 | 0.2 |
| NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 8,798 | 9,500 | 97 | 10,153 | 0.1 |
| OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 24,100 | 25,500 | 825 | 86,297 | 0.5 |
| ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 2,100 | 2,100 | 50 | 5,251 | 0.0 |
| PS BUSINESS PARKS INC/CA | 2,800 | 3,000 | 309 | 32,324 | 0.2 |
| PARKWAY PROPERTIES INC | 11,700 | 12,800 | 215 | 22,529 | 0.1 |
| PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 10,300 | 11,000 | 294 | 30,772 | 0.2 |
| PENN REAL ESTATE INVEST TST | 10,000 | 10,500 | 221 | 23,114 | 0.1 |
| PHYSICIANS REALTY TRUST | 13,000 | 20,400 | 414 | 43,308 | 0.2 |
| PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 22,000 | 22,600 | 467 | 48,853 | 0.3 |
| POST PROPERTIES INC | 7,900 | 8,200 | 482 | 50,510 | 0.3 |
| PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 2,900 | 3,500 | 48 | 5,098 | 0.0 |
| PROLOGIS INC | 76,500 | 80,800 | 4,037 | 422,249 | 2.4 |
| PUBLIC STORAGE | 21,450 | 22,650 | 5,461 | 571,149 | 3.2 |
| QTS REALTY TRUST INC CL A | 5,600 | 7,200 | 400 | 41,865 | 0.2 |
| RLJ LODGING TRUST | 19,000 | 19,500 | 422 | 44,191 | 0.3 |
| RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES | 11,400 | 12,200 | 223 | 23,386 | 0.1 |
| REALTY INCOME CORP | 36,300 | 39,500 | 2,541 | 265,741 | 1.5 |
| REGENCY CENTERS CORP | 13,700 | 15,000 | 1,186 | 124,131 | 0.7 |
| RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 14,200 | 15,400 | 318 | 33,257 | 0.2 |
| RETAIL PROPERTIES OF AME-A | 34,700 | 36,400 | 586 | 61,364 | 0.3 |
| REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 8,100 | 10,200 | 213 | 22,379 | 0.1 |
| ROUSE PROPERTIES INC | 5,600 | 5,600 | 102 | 10,699 | 0.1 |
| RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 7,400 | 7,800 | 398 | 41,707 | 0.2 |
| SL GREEN REALTY CORP | 14,500 | 15,400 | 1,573 | 164,580 | 0.9 |
| SABRA HEALTH CARE REIT INC | 9,400 | 10,200 | 212 | 22,177 | 0.1 |
| SAUL CENTERS INC | 1,600 | 1,700 | 98 | 10,297 | 0.1 |
| SELECT INCOME REIT | 9,100 | 9,700 | 244 | 25,543 | 0.1 |
| SENIOR HOUSING PROP TRUST | 34,800 | 36,500 | 731 | 76,496 | 0.4 |
| SERITAGE GROWTH PROP-A REIT | 2,000 | 2,200 | 112 | 11,743 | 0.1 |
| SILVER BAY REALTY TRUST CORP | 5,100 | 5,800 | 95 | 9,947 | 0.1 |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 45,100 | 47,550 | 9,910 | 1,036,476 | 5.9 |
| SOVRAN SELF STORAGE INC | 5,300 | 7,100 | 720 | 75,365 | 0.4 |

| 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 | % |
| SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 64,000 | 73,300 | 883 | 92,448 | 0.5 |
| STAG INDUSTRIAL INC | 9,900 | 10,600 | 244 | 25,574 | 0.1 |
| STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL TRUST | 5,500 | — | — | — | — |
| STORE CAPITAL CORP | 9,900 | 23,400 | 635 | 66,465 | 0.4 |
| SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 12,400 | 13,500 | 171 | 17,944 | 0.1 |
| SUN COMMUNITIES INC | 8,400 | 9,900 | 712 | 74,523 | 0.4 |
| SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 30,500 | 33,500 | 410 | 42,881 | 0.2 |
| TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 14,000 | 14,700 | 551 | 57,711 | 0.3 |
| TAUBMAN CENTERS INC | 8,800 | 9,300 | 657 | 68,791 | 0.4 |
| TERRENO REALTY CORP | 6,300 | 6,700 | 168 | 17,636 | 0.1 |
| UDR INC | 38,200 | 41,100 | 1,446 | 151,254 | 0.9 |
| UMH PROPERTIES INC | 3,600 | 3,600 | 39 | 4,130 | 0.0 |
| UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME | 1,800 | 1,900 | 104 | 10,948 | 0.1 |
| URBAN EDGE PROPERTIES | 13,600 | 14,100 | 392 | 41,081 | 0.2 |
| URSTADT BIDDLE-CL A | 3,900 | 3,900 | 91 | 9,548 | 0.1 |
| VENTAS INC | 48,500 | 51,900 | 3,626 | 379,287 | 2.1 |
| VEREIT INC | 131,900 | 139,300 | 1,369 | 143,203 | 0.8 |
| VORNADO REALTY TRUST | 25,800 | 27,300 | 2,661 | 278,365 | 1.6 |
| WP CAREY INC | 14,100 | 15,000 | 1,024 | 107,142 | 0.6 |
| WP GLIMCHER INC | 26,500 | 28,400 | 316 | 33,116 | 0.2 |
| WASHINGTON REAL ESTATE INV | 9,800 | 11,400 | 343 | 35,873 | 0.2 |
| WEINGARTEN REALTY INVESTORS | 16,600 | 17,700 | 679 | 71,080 | 0.4 |
| WELLTOWER INC | 51,500 | 54,800 | 4,023 | 420,826 | 2.4 |
| WHITESTONE REIT | 4,200 | 4,200 | 63 | 6,610 | 0.0 |
| WINTHROP REALTY TRUST | 5,400 | 5,400 | 52 | 5,506 | 0.0 |
| XENIA HOTELS & RESORTS INC | 16,000 | 17,300 | 284 | 29,707 | 0.2 |
| 小計 口数・金額 | 2,877,802 | 3,110,317 | 120,459 | 12,597,693 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 157 | 156 | — | <71.3%> | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | |
| ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT | 5,700 | 5,700 | 216 | 17,644 | 0.1 |
| ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT | 10,000 | 11,100 | 146 | 11,948 | 0.1 |
| BOARDWALK REAL ESTATE INVEST | 3,500 | 3,500 | 189 | 15,430 | 0.1 |
| BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES | 2,000 | 2,000 | 57 | 4,710 | 0.0 |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | 4,900 | — | — | — | — |
| CT REAL ESTATE INVESTMENT TR | — | 4,900 | 72 | 5,930 | 0.0 |
| CAN APARTMENT PROP REAL ESTA | 9,000 | 10,000 | 317 | 25,911 | 0.1 |
| CAN REAL ESTATE INVEST TRUST | 5,100 | 5,600 | 261 | 21,379 | 0.1 |
| CHOICE PROPERTIES REIT | 6,000 | 7,000 | 96 | 7,866 | 0.0 |
| COMINAR REAL ESTATE INV-TR U | 12,200 | 12,000 | 205 | 16,746 | 0.1 |
| CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT | 6,000 | 6,000 | 91 | 7,442 | 0.0 |
| DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 7,500 | 8,400 | 159 | 12,990 | 0.1 |
| DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT | 3,400 | 4,400 | 38 | 3,131 | 0.0 |
| DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS | 8,400 | 8,400 | 77 | 6,306 | 0.0 |
| GRANITE REAL ESTATE INVESTME | 3,400 | 3,400 | 130 | 10,655 | 0.1 |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 19,600 | 21,300 | 453 | 37,043 | 0.2 |
| INNVEST REAL ESTATE INVESTME | 10,400 | 10,400 | 72 | 5,941 | 0.0 |
| INTERRENT REAL ESTATE INVEST | 5,200 | 5,200 | 39 | 3,254 | 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 | % |
| KILLAM APARTMENT REAL ESTATE | | － | 4,600 | 56 | 4,606 | 0.0 |
| MILESTONE APARTMENTS REAL ES | | 4,400 | 6,000 | 107 | 8,799 | 0.0 |
| MORGUARD NORTH AMERICAN RESI | | 1,700 | 1,700 | 21 | 1,737 | 0.0 |
| MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS | | 4,300 | 4,300 | 63 | 5,221 | 0.0 |
| NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST | | 3,100 | 3,100 | 67 | 5,507 | 0.0 |
| NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT | | 3,400 | 4,700 | 46 | 3,774 | 0.0 |
| ONEREIT | | 6,570 | 6,570 | 25 | 2,107 | 0.0 |
| PLAZA RETAIL REIT | | 7,500 | 7,500 | 36 | 2,937 | 0.0 |
| PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE | | 13,600 | 13,600 | 68 | 5,604 | 0.0 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | | 22,600 | 24,800 | 697 | 56,892 | 0.3 |
| SLATE RETAIL REIT | | 1,600 | 2,300 | 31 | 2,564 | 0.0 |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | 9,100 | 9,700 | 354 | 28,933 | 0.2 |
| 小計 | 口数・金額 | 200,170 | 218,170 | 4,203 | 343,019 | |
| | 銘柄数<比率> | 28 | 29 | － | <1.9%> | |
| (イギリス) | | | | 千英ポンド | | |
| BRITISH LAND | | 149,300 | 156,800 | 1,172 | 179,917 | 1.0 |
| DERWENT LONDON PLC | | 16,100 | 17,200 | 570 | 87,491 | 0.5 |
| BIG YELLOW GROUP PLC | | 21,200 | 23,400 | 198 | 30,511 | 0.2 |
| HAMMERSON PLC | | 114,200 | 120,200 | 696 | 106,852 | 0.6 |
| MCKAY SECURITIES PLC-ORD | | 14,200 | 14,200 | 29 | 4,579 | 0.0 |
| INTU PROPERTIES PLC | | 118,200 | 124,200 | 382 | 58,738 | 0.3 |
| SHAFTESBURY PLC | | 41,000 | 42,200 | 397 | 61,012 | 0.3 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | | 116,800 | 123,300 | 1,461 | 224,133 | 1.3 |
| GREAT PORTLAND ESTATES PLC | | 50,400 | 53,400 | 402 | 61,805 | 0.3 |
| SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST | | 78,700 | 78,700 | 42 | 6,549 | 0.0 |
| HANSTEEN HOLDINGS PLC | | 108,500 | 108,500 | 116 | 17,808 | 0.1 |
| SAFESTORE HOLDINGS PLC | | 29,040 | 32,540 | 126 | 19,372 | 0.1 |
| LONDONMETRIC PROPERTY PLC | | 92,000 | 99,500 | 159 | 24,497 | 0.1 |
| SEGRO PLC | | 109,100 | 114,800 | 517 | 79,440 | 0.4 |
| WORKSPACE GROUP PLC | | 16,800 | 17,800 | 147 | 22,608 | 0.1 |
| REDEFINE INTERNATIONAL PLC | | 150,000 | 193,000 | 88 | 13,618 | 0.1 |
| TRITAX BIG BOX REIT PLC | | 97,600 | 126,000 | 170 | 26,151 | 0.1 |
| EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC | | 48,700 | 67,200 | 73 | 11,262 | 0.1 |
| ASSURA PLC | | 230,710 | 254,700 | 146 | 22,426 | 0.1 |
| PRIMARY HEALTH PROPERTIES | | 66,800 | 91,000 | 95 | 14,587 | 0.1 |
| REGIONAL REIT LTD | | 26,000 | 26,000 | 28 | 4,347 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 1,695,350 | 1,884,640 | 7,025 | 1,077,713 | |
| | 銘柄数<比率> | 21 | 21 | － | <6.1%> | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | | 千ユーロ | | |
| HAMBORNER REIT AG | | 8,776 | 9,826 | 93 | 11,039 | 0.1 |
| ALSTRIA OFFICE REIT-AG | | 15,300 | 16,300 | 194 | 22,889 | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 | 24,076 | 26,126 | 288 | 33,928 | |
| | 銘柄数<比率> | 2 | 2 | － | <0.2%> | |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| BENI STABILI SPA | | 151,000 | 162,000 | 100 | 11,793 | 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…イタリア) | | 口 | 口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | | 43,604 | 53,604 | 39 | 4,598 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 194,604 | 215,604 | 139 | 16,391 | |
| | 銘柄数<比率> | 2 | 2 | — | <0.1%> | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| AFFINE | | 900 | 900 | 14 | 1,647 | 0.0 |
| ICADE | | 5,130 | 5,540 | 357 | 41,983 | 0.2 |
| ALTAREA | | 320 | 355 | 62 | 7,300 | 0.0 |
| KLEPIERRE | | 27,596 | 28,856 | 1,159 | 136,262 | 0.8 |
| GECINA SA | | 5,250 | 5,580 | 706 | 83,045 | 0.5 |
| FONCIERE DES REGIONS | | 6,260 | 6,800 | 542 | 63,757 | 0.4 |
| ANF IMMOBILIER | | 1,300 | 1,300 | 28 | 3,360 | 0.0 |
| MERCIALYS | | 2,580 | 2,580 | 50 | 5,887 | 0.0 |
| FONCIERE DES MURS | | 1,300 | — | — | — | — |
| UNIBAIL RODAMCO-NA | | 14,260 | 15,060 | 3,634 | 427,117 | 2.4 |
| FONCIERE DES MURS | | — | 1,300 | 32 | 3,857 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 64,896 | 68,271 | 6,588 | 774,219 | |
| | 銘柄数<比率> | 10 | 10 | — | <4.4%> | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA | | 7,080 | 7,530 | 295 | 34,694 | 0.2 |
| VASTNED RETAIL NV | | 2,850 | 2,820 | 106 | 12,559 | 0.1 |
| WERELDHAVE NV | | 5,810 | 6,160 | 266 | 31,310 | 0.2 |
| NSI NV | | 18,070 | 20,070 | 74 | 8,785 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 33,810 | 36,580 | 743 | 87,349 | |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 4 | — | <0.5%> | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM | | 8,630 | 9,530 | 78 | 9,238 | 0.1 |
| MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | | 44,205 | 47,055 | 443 | 52,164 | 0.3 |
| AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA | | 8,860 | 8,860 | 106 | 12,535 | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 | 61,695 | 65,445 | 629 | 73,938 | |
| | 銘柄数<比率> | 3 | 3 | — | <0.4%> | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | | |
| BEFIMMO S.C.A. | | 2,950 | 3,200 | 187 | 22,061 | 0.1 |
| COFINIMMO | | 2,950 | 3,110 | 333 | 39,158 | 0.2 |
| RETAIL ESTATES | | 770 | 870 | 68 | 8,076 | 0.0 |
| WERELDHAVE BELGIUM | | 290 | 290 | 32 | 3,816 | 0.0 |
| INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES | | 1,140 | 1,140 | 28 | 3,373 | 0.0 |
| WAREHOUSES DE PAUW SCA | | 1,940 | 2,070 | 173 | 20,396 | 0.1 |
| AEDIFICA | | 2,078 | 2,238 | 150 | 17,680 | 0.1 |
| XIOR STUDENT HOUSING NV | | — | 500 | 17 | 2,055 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 12,118 | 13,418 | 992 | 116,620 | |
| | 銘柄数<比率> | 7 | 8 | — | <0.7%> | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| GREEN REIT PLC | | 95,009 | 100,509 | 141 | 16,653 | 0.1 |
| HIBERNIA REIT PLC | | 99,000 | 108,000 | 133 | 15,736 | 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…アイルランド) | | 口 | 口 | 千ユーロ | 千円 | % |
| IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES | | 52,800 | 52,800 | 58 | 6,887 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 246,809 | 261,309 | 334 | 39,277 | |
| | 銘柄数<比率> | 3 | 3 | － | <0.2%> | |
| ユーロ計 | 口数・金額 | 638,008 | 686,753 | 9,715 | 1,141,725 | |
| | 銘柄数<比率> | 31 | 32 | － | <6.5%> | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| LINK REIT | | 333,000 | 344,500 | 17,414 | 234,747 | 1.3 |
| PROSPERITY REIT | | 180,000 | 180,000 | 556 | 7,497 | 0.0 |
| YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | | 160,000 | 160,000 | 688 | 9,274 | 0.1 |
| CHAMPION REIT | | 310,000 | 339,000 | 1,403 | 18,918 | 0.1 |
| SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT | | 150,000 | 150,000 | 642 | 8,654 | 0.0 |
| REGAL REAL ESTATE INVESTMENT | | 120,000 | 120,000 | 232 | 3,138 | 0.0 |
| FORTUNE REIT | | 199,000 | 210,000 | 1,894 | 25,533 | 0.1 |
| NEW CENTURY REIT | | 65,000 | 65,000 | 153 | 2,067 | 0.0 |
| SPRING REAL ESTATE INVESTMEN | | 105,000 | 124,000 | 414 | 5,582 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 1,622,000 | 1,692,500 | 23,398 | 315,414 | |
| | 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 | | 383,800 | 412,300 | 832 | 64,837 | 0.4 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | | 296,500 | 343,600 | 797 | 62,058 | 0.4 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | | 300,400 | 309,300 | 437 | 34,071 | 0.2 |
| SUNTEC REIT | | 365,400 | 381,300 | 640 | 49,869 | 0.3 |
| MAPLETREE LOGISTICS TRUST | | 210,900 | 230,900 | 223 | 17,436 | 0.1 |
| STARHILL GLOBAL REIT | | 209,900 | 209,900 | 162 | 12,664 | 0.1 |
| ASCOTT RESIDENCE TRUST | | 124,000 | 124,000 | 138 | 10,763 | 0.1 |
| FRASERS COMMERCIAL TRUST | | 85,000 | 85,000 | 105 | 8,205 | 0.0 |
| KEPPEL REIT | | 247,700 | 274,000 | 286 | 22,290 | 0.1 |
| FRASERS CENTREPOINT TRUST | | 79,600 | 90,100 | 176 | 13,712 | 0.1 |
| CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST | | 153,300 | 153,300 | 83 | 6,504 | 0.0 |
| CDL HOSPITALITY TRUSTS | | 99,000 | 110,400 | 154 | 12,032 | 0.1 |
| CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | | 100,800 | 110,000 | 161 | 12,588 | 0.1 |
| FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | | 72,400 | 83,500 | 103 | 8,028 | 0.0 |
| PARKWAY LIFE REAL ESTATE | | 59,000 | 59,000 | 142 | 11,069 | 0.1 |
| LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | | 282,800 | 282,800 | 96 | 7,485 | 0.0 |
| MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | | 174,300 | 177,000 | 291 | 22,667 | 0.1 |
| MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | | 193,200 | 212,500 | 306 | 23,822 | 0.1 |
| CACHE LOGISTICS TRUST | | 127,000 | 127,000 | 105 | 8,206 | 0.0 |
| AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT | | 77,700 | 89,400 | 119 | 9,326 | 0.1 |
| SABANA SHARIAH COMP IND REIT | | 94,200 | 94,200 | 54 | 4,216 | 0.0 |
| MAPLETREE GREATER CHINA COMM | | 251,900 | 271,900 | 263 | 20,532 | 0.1 |
| ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | | 129,000 | 129,000 | 85 | 6,628 | 0.0 |
| FAR EAST HOSPITALITY TRUST | | 118,000 | 140,000 | 84 | 6,539 | 0.0 |
| SPH REIT | | 105,000 | 120,500 | 110 | 8,630 | 0.0 |
| OUE HOSPITALITY TRUST | | 117,100 | 155,743 | 104 | 8,123 | 0.0 |
| SOILBUILD BUSINESS SPACE REI | | 97,000 | 97,000 | 65 | 5,134 | 0.0 |
| OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I | | 62,350 | 79,650 | 52 | 4,123 | 0.0 |
| FRASERS HOSPITALITY TRUST | | 88,000 | 88,000 | 68 | 5,309 | 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 | % |
| KEPPEL DC REIT | | 130,600 | 145,000 | 157 | 12,247 | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 | 4,835,850 | 5,186,293 | 6,411 | 499,125 | |
| | 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 | 269 | 20,973 | 0.1 |
| MIRVAC GROUP | | 533,000 | 555,000 | 1,132 | 88,153 | 0.5 |
| INVESTA OFFICE FUND | | 86,000 | 94,000 | 409 | 31,910 | 0.2 |
| CROMWELL PROPERTY GROUP | | 183,000 | 204,000 | 212 | 16,518 | 0.1 |
| CHARTER HALL RETAIL REIT | | 49,000 | 53,000 | 259 | 20,178 | 0.1 |
| ASPEN GROUP | | 13,000 | 13,000 | 15 | 1,234 | 0.0 |
| GPT GROUP | | 263,000 | 277,000 | 1,501 | 116,894 | 0.7 |
| ABACUS PROPERTY GROUP | | 39,000 | 45,000 | 144 | 11,246 | 0.1 |
| ALE PROPERTY GROUP | | 26,000 | 26,000 | 113 | 8,866 | 0.1 |
| STOCKLAND TRUST GROUP | | 345,000 | 364,000 | 1,710 | 133,202 | 0.8 |
| DEXUS PROPERTY GROUP | | 140,000 | 146,000 | 1,309 | 101,967 | 0.6 |
| GOODMAN GROUP | | 228,000 | 243,000 | 1,761 | 137,169 | 0.8 |
| ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP | | 7,000 | 7,000 | 47 | 3,733 | 0.0 |
| 360 CAPITAL GROUP LTD | | 42,450 | 42,450 | 40 | 3,139 | 0.0 |
| CHARTER HALL GROUP | | 46,000 | 53,000 | 275 | 21,416 | 0.1 |
| GALILEO JAPAN TRUST | | 18,170 | 18,170 | 46 | 3,621 | 0.0 |
| GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR | | 26,550 | 26,550 | 86 | 6,739 | 0.0 |
| INGENIA COMMUNITIES GROUP | | 22,285 | 22,285 | 64 | 5,014 | 0.0 |
| SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA | | 109,100 | 109,100 | 252 | 19,622 | 0.1 |
| ARENA REIT | | 35,220 | 35,220 | 70 | 5,511 | 0.0 |
| INDUSTRIA REIT | | 10,330 | 18,400 | 39 | 3,065 | 0.0 |
| NATIONAL STORAGE REIT | | 44,860 | 44,860 | 80 | 6,269 | 0.0 |
| HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L | | 22,680 | 22,680 | 68 | 5,332 | 0.0 |
| GDI PROPERTY GROUP | | 70,300 | 70,300 | 63 | 4,953 | 0.0 |
| 360 CAPITAL OFFICE FUND | | 11,100 | 11,100 | 24 | 1,944 | 0.0 |
| SCENTRE GROUP | | 772,000 | 819,000 | 3,865 | 300,981 | 1.7 |
| WESTFIELD CORP | | 278,800 | 294,800 | 3,160 | 246,057 | 1.4 |
| FOLKESTONE EDUCATION TRUST | | 33,250 | 33,250 | 87 | 6,808 | 0.0 |
| VICINITY CENTRES | | 479,000 | 499,000 | 1,631 | 127,046 | 0.7 |
| 小計 | 口数・金額 | 4,007,095 | 4,220,165 | 18,746 | 1,459,577 | |
| | 銘柄数<比率> | 29 | 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 | | 146,571 | 158,571 | 195 | 14,589 | 0.1 |
| VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST | | 39,300 | 39,300 | 83 | 6,236 | 0.0 |
| GOODMAN PROPERTY TRUST | | 150,000 | 170,000 | 219 | 16,337 | 0.1 |
| PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | | 67,525 | 67,525 | 106 | 7,948 | 0.0 |
| STRIDE PROPERTY LTD | | 51,000 | 58,000 | 132 | 9,873 | 0.1 |
| ARGOSY PROPERTY LTD | | 119,000 | 119,000 | 135 | 10,106 | 0.1 |
| KIWI PROPERTY GROUP LTD | | 180,000 | 190,000 | 277 | 20,666 | 0.1 |
| 小計 | 口数・金額 | 753,396 | 802,396 | 1,151 | 85,758 | |
| | 銘柄数<比率> | 7 | 7 | — | <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 | |
| (イスラエル) | | 口 | 口 | 千新シェケル | 千円 | % |
| REIT 1 LTD | | 22,490 | 22,490 | 263 | 7,133 | 0.0 |
| 小計 | 口数・金額 | 22,490 | 22,490 | 263 | 7,133 | |
| | 銘柄数<比率> | 1 | 1 | － | <0.0%> | |
| 合計 | 口数・金額 | 16,652,161 | 17,823,724 | － | 17,527,161 | |
| | 銘柄数<比率> | 313 | 314 | － | <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 | 117 | － |
| | | FTEPR | 15 | － |

＊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、野村證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證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、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（為替ヘッジを行な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みますが、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・エー、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 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 サービシーズ 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。<br>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<br>東証株価指数<br>（ＴＯＰＩＸ） | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 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。

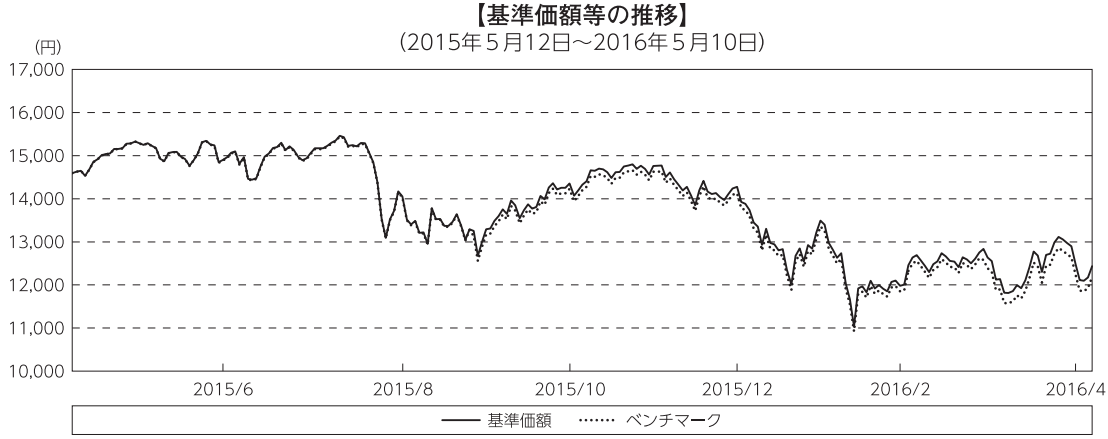
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク<br>東証株価指数<br>（ＴＯＰＩＸ） | | 株式組入比率 | 株式先物比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | |
| (期　首) | 円 | % | | % | % | % |
| 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)<br>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。

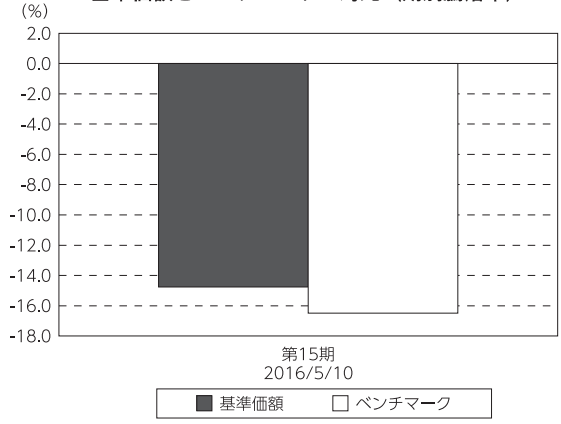
## ○当ファンドのベンチマークとの差異

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

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、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 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 売買委託手数料 | 0 | 0.002 | (a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式） | (0) | (0.000) | |
| （先物・オプション） | (0) | (0.002) | |
| 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 株数 | 買付 金額 | 売付 株数 | 売付 金額 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 国内 | 上場 | 63,159<br>(△ 4,994) | 81,654,860<br>( － ) | 10,748 | 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 新規買付額 | 買建 決済額 | 売建 新規売付額 | 売建 決済額 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 国内 | 株式先物取引 | 71,254 | 69,304 | － | － |

＊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 | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 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 |
|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 454 | 168 | 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。

# ○組入資産の明細

（2016年５月10日現在）

## 国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) 株数 | 当期末 株数 | 当期末 評価額 |
|---|---|---|---|
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| **水産・農林業（0.1%）** | | | |
| 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 |
| **鉱業（0.3%）** | | | |
| 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 |
| **建設業（3.2%）** | | | |
| 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 |
| 飛島建設 | 82.1 | 124.3 | 22,622 |
| 長谷工コーポレーション | 152.6 | 180.7 | 183,410 |
| 松井建設 | 13 | 17.1 | 13,423 |
| 錢高組 | 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 |
| ナカノフドー建設 | 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 |
| 淺沼組 | 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 |
| ピーエス三菱 | 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 |
| ＮＩＰＰＯ | 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 |
| 大氣社 | 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 |
| ダイダン | 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 |
| 新興プランテック | 25.1 | 31.8 | 27,538 |
| **食料品（5.2%）** | | | |
| 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 |
| キユーピー | 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 |
| **繊維製品（0.7%）** | | | |
| 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 |
| 日本フエルト | 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 |
| ＴＳＩ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 |
| **パルプ・紙（0.3%）** | | | |
| 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・パック | 8.1 | 10.2 | 26,662 |
| **化学（6.2%）** | | | |
| 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 |
| 高圧ガス工業 | 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 |
| ＪＳＲ | 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 |
| ＤＩＣ | 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 |
| ＪＣＵ | 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 |
| ＪＳＰ | 8.5 | 9.4 | 20,257 |
| エフピコ | 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 |
| **医薬品（5.9%）** | | | |
| 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 |
| ビオフェルミン製薬 | 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 |
| ペプチドリーム | － | 24.1 | 160,747 |
| **石油・石炭製品（0.5%）** | | | |
| 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 |
| ビーピー・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 |
| **ゴム製品（1.0%）** | | | |
| 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 |
| **ガラス・土石製品（0.9%）** | | | |
| 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 |
| アジアパ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 |
| ニッカトー | 4 | 5.1 | 1,902 |
| フジミインコーポレーテッド | 11 | 12.7 | 18,923 |
| エーアンドエーマテリアル | 24 | 30 | 2,430 |
| ニチアス | 51 | 74 | 58,756 |
| ニチハ | 15.1 | 19.2 | 31,795 |
| **鉄鋼（1.2%）** | | | |
| 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 |
| 東洋鋼鈑 | 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 |
| 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 |
| 日本鋳鉄管 | 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 |
| **非鉄金属（0.8%）** | | | |
| 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 |
| 沖電線 | 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 |
| アーレスティ | 13.2 | 16.8 | 13,876 |
| アサヒホールディングス | 17.2 | 21.8 | 32,198 |
| **金属製品（0.7%）** | | | |
| 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Ｃｏ | 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 |
| 東洋製罐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 |
| 文化シヤッター | 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 |
| 東洋シヤッター | 2.8 | 3.6 | 1,951 |
| ＬＩＸＩＬグループ | 169.4 | 201.5 | 434,434 |
| 日本フイルコン | 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 |
| パイオラックス | 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 |
| **機械（4.7%）** | | | |
| 日本ドライケミカル | 1.6 | 1.8 | 4,087 |
| 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 |
| ナブテスコ | 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 |
| 日本エアーテック | 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 |
| 酉島製作所 | 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 |
| ＣＫＤ | 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 |
| ＪＵＫＩ | 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 |
| ＴＰＲ | 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 |
| ＴＨＫ | 72.4 | 91.9 | 195,838 |
| ユーシン精機 | 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 |
| 日本ピラー工業 | 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 |
| ＩＨＩ | 785 | 1,062 | 251,694 |
| **電気機器（11.3%）** | | | |
| 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 |
| ＩＤＥＣ | 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 |
| 沖電気工業 | 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 |
| ＥＩＺＯ | 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 |
| ＴＤＫ | 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 |
| アドバンテスト | 74.2 | 94.2 | 100,699 |
| 小野測器 | 5.3 | 6.7 | 5,460 |
| エスペック | 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 |
| オプテックス | 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 |
| ＳＣＲＥＥＮホールディングス | 103 | 142 | 118,996 |
| キヤノン電子 | 10 | 12.7 | 20,167 |
| キヤノン | 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 |
| **輸送用機器（9.4%）** | | | |
| 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 |
| 日本車輌製造 | 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 |
| トピー工業 | 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 |
| ＴＢＫ | 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 |
| **精密機器（1.6%）** | | | |
| 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 |
| エー・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 |
| **その他製品（1.6%）** | | | |
| 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 |
| トランザクション | 0.8 | 2.8 | 2,032 |
| ＳＨＯ－ＢＩ | 3.6 | 4.6 | 1,830 |
| ニホンフラッシュ | － | 5.4 | 6,264 |
| 前田工繊 | 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 |
| ＳＨＯＥＩ | － | 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 |
| Ａｓ－ｍｅ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 |
| プロネクサス | 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 |
| ピジョン | 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 |
| ＴＡＳＡＫＩ | 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 |
| **電気・ガス業（2.0%）** | | | |
| 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 |
| **陸運業（4.6%）** | | | |
| 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 |
| **海運業（0.2%）** | | | |
| 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 |
| ＮＳ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 |
| **空運業（0.7%）** | | | |
| 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 |
| パスコ | 10 | 13 | 5,044 |
| **倉庫・運輸関連業（0.2%）** | | | |
| 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 |
| 澁澤倉庫 | 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 |
| キユ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 |
| エーアイテイー | 5 | 8.5 | 7,735 |
| 内外トランスライン | 1.2 | 4.6 | 4,439 |
| **情報・通信業（8.7%）** | | | |
| ＮＥＣネッツエスアイ | 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 |
| ＩＴ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 | 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 |
| ファインデックス | 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 |
| ＫＬａｂ | 11.4 | 21.1 | 12,343 |
| ポールトゥウィン・ピ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 |
| ｅｎｉｓｈ | 2.8 | 4 | 2,560 |
| コロプラ | 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 |
| Ｍｉｎｏｒｉ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 |
| パイプドビッツ | 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 |
| パイプドHD | － | 1.7 | 2,286 |
| パナソニック　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 |
| インテ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 |
| ウェザーニューズ | 3.2 | 4.6 | 18,032 |
| ＣＩＪ | 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ＪＳＡＴ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・ビー | 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 |
| ＪＢＣＣ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 |
| **卸売業（4.1%）** | | | |
| ホウスイ | 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 |
| トーメンデバイス | 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 |
| 佐鳥電機 | 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 |
| ハピネット | 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 |
| エアサ商事 | 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 |
| すてきナイスグループ | 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 |
| 三愛石油 | 28 | 33.5 | 25,091 |
| 稲畑産業 | 25.8 | 32.7 | 35,250 |
| ＧＳＩ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 |
| **小売業（5.0%）** | | | |
| 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・ヴイ・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 |
| キャンドゥ | 5.1 | 7.2 | 11,664 |
| パル | 6.3 | 7.9 | 21,053 |
| 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ー | 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 |
| クオール | 10.9 | 13.8 | 22,066 |
| ジェイアイエヌ | 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 |
| キリン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 |
| すかいらーく | 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 |
| ＶＴ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 |
| 壱番屋 | 4.9 | 6.2 | 44,764 |
| トップカルチャー | 4.3 | 4.9 | 2,263 |
| ＰＬＡＮＴ | 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 |
| ＭｒＭａｘ | 10.7 | 11.9 | 3,712 |
| テンアライド | 9 | 12.5 | 4,600 |
| ＡＯＫＩ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 |
| ＣＦＳコーポレーション | 7 | － | － |
| はせがわ | 3.8 | 6.4 | 2,675 |
| 髙島屋 | 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 |
| Ｏｌｙｍｐｉｃ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 |
| プレナス | 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 |
| バローホールディングス | 23.2 | 29.4 | 83,995 |
| 藤久 | 0.8 | 1.1 | 1,912 |
| ベルク | 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 |
| サックスバー　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 |
| ベルーナ | 26.8 | 34 | 19,380 |
| **銀行業（7.4%）** | | | |
| 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ＴＹ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ＵＦＪ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 |
| 山口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 |
| **証券、商品先物取引業（1.0%）** | | | |
| ＦＰＧ | 31.8 | 48.6 | 56,084 |
| ＳＢＩ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 |
| **保険業（2.3%）** | | | |
| 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 |
| **その他金融業（1.4%）** | | | |
| 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 |
| **不動産業（2.9%）** | | | |
| 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 |
| パラカ | 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 |
| **サービス業（3.9%）** | | | |
| 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 |
| テンプホールディングス | 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 |
| 綜合警備保障 | 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 |
| カカクコム | 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 |
| 綜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 |
| ウェルネット | 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 | － | － |
| ジャパンベストレスキューシステム | 12.9 | 17.9 | 4,099 |
| ファン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 |
| ＪＰホールディングス | 28.2 | 35.8 | 12,422 |
| ＥＰＳ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 |
| ぴあ | 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 |
| リソー教育 | 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 |
| ＩＢＪ | － | 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 |
| ＥＲＩ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 |
| ステップ | 3.8 | 4.8 | 5,083 |
| 合計 株数・金額 | 182,431 | 229,846 | 273,159,048 |
| 合計 銘柄数＜比率＞ | 1,866 | 1,937 | ＜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 |
| | | | 百万円 | 百万円 |
| 国内 | 株式先物取引 | ＴＯＰＩＸ | 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<br>元本額 |
|---|---|
| | 円 |
| 野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け） | 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 |
| のむラップ・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 |
| のむラップ・ファンド（保守型） | 1,688,102,560 |

| ファンド名 | 当期末<br>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 |
| のむラップ・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 |
| 野村ターゲットデートファンド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 |
| 野村ターゲットデートファンド2016　2029-2031年目標型 | 783,143 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 472,950 |
| 野村ターゲットデートファンド2016　2032-2034年目標型 | 433,737 |
| 野村ターゲットデートファンド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。<br>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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 期中騰落率 | MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 期中騰落率 | | | | |
| | 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。
（出所）MSCI

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

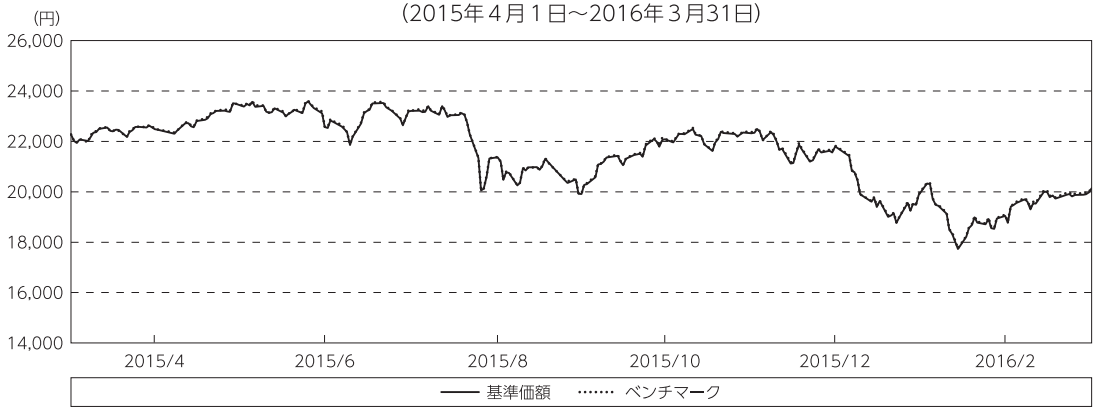
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 投資信託証券組入比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） | 騰落率 | | | |
| （期　首） | 円 | % | | % | % | % | % |
| 2015年３月31日 | 22,274 | － | 236.44 | － | 95.4 | 2.1 | 2.4 |
| ４月末 | 22,487 | 1.0 | 239.12 | 1.1 | 96.1 | 1.4 | 2.3 |
| 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

【基準価額等の推移】
(2015年４月１日～2016年３月31日)




（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などを受け、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－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）**

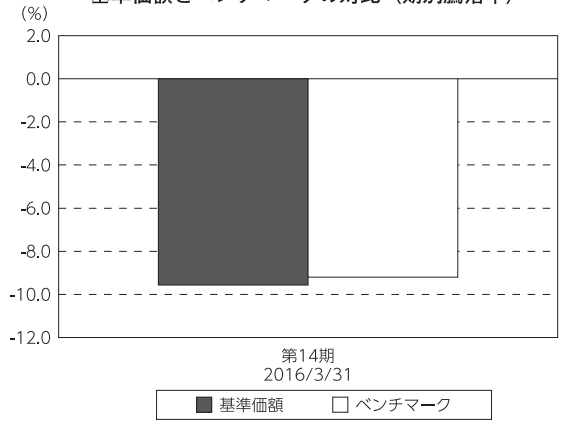
①コスト負担（売買コストや保管費用など）

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）

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、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを捉える投資成果を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。

## ○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 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 売買委託手数料 | 1 | 0.003 | (a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式） | (0) | (0.002) | |
| （投資信託証券） | (0) | (0.000) | |
| （先物・オプション） | (0) | (0.001) | |
| (b) 有価証券取引税 | 2 | 0.009 | (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<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （株式） | (2) | (0.008) | |
| （投資信託証券） | (0) | (0.000) | |
| (c) その他費用 | 3 | 0.015 | (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） | (3) | (0.012) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （その他） | (1) | (0.003) | 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 株数 | 買付 金額 | 売付 株数 | 売付 金額 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 百株 | 千米ドル | 百株 | 千米ドル |
| 外国 | アメリカ | 46,798<br>( 12,035) | 258,494<br>( 19,528) | 17,904<br>( 7,363) | 86,408<br>(40,011) |
| | | | 千カナダドル | | 千カナダドル |
| | カナダ | 6,615<br>( 147) | 21,160<br>( －) | 2,088<br>( 1,096) | 4,816<br>( 2,296) |
| | | | 千英ポンド | | 千英ポンド |
| | イギリス | 44,656<br>( 397,674) | 24,091<br>( 2,909) | 7,713<br>(399,897) | 4,875<br>( 4,171) |
| | | | 千スイスフラン | | 千スイスフラン |
| | スイス | 2,523<br>( 1,497) | 16,438<br>( 126) | 2,279<br>( 68) | 3,991<br>( 1,211) |
| | | | 千スウェーデンクローナ | | 千スウェーデンクローナ |
| | スウェーデン | 2,828<br>( 2,366) | 36,715<br>( －) | 1,893 | 11,250 |
| | | | 千ノルウェークローネ | | 千ノルウェークローネ |
| | ノルウェー | 840 | 11,872 | 717 | 5,366 |
| | | | 千デンマーククローネ | | 千デンマーククローネ |
| | デンマーク | 817<br>( 76) | 29,341<br>( －) | 175 | 7,217 |
| | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | ドイツ | 3,415<br>( 558) | 13,785<br>( 52) | 1,233<br>( －) | 3,393<br>( 318) |
| | イタリア | 11,654<br>( 6,214) | 4,294<br>( 733) | 4,548<br>( 4,249) | 1,338<br>( 557) |
| | フランス | 3,932<br>(△ 2,598) | 14,521<br>(△ 908) | 912<br>( －) | 3,939<br>( 121) |
| | オランダ | 2,505<br>( 1,585) | 4,281<br>( 982) | 900<br>( －) | 1,162<br>( 177) |
| | スペイン | 7,892<br>( 13,317) | 5,042<br>( 1,408) | 4,241<br>( 20,917) | 1,227<br>( 1,170) |
| | ベルギー | 260<br>( 55) | 1,961<br>( 41) | 126<br>( －) | 507<br>( 41) |
| | オーストリア | 61 | 194 | 851 | 306 |
| | ルクセンブルグ | 10 | 95 | 4<br>( 78) | 47<br>( 796) |
| | フィンランド | 1,538<br>( 1,430) | 1,577<br>( 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<br>11,943<br>(4,375) | 千香港ドル<br>34,945<br>(27,763) | 百株<br>1,738<br>(1,850) | 千香港ドル<br>10,943<br>(27,763) |
| | シンガポール | 4,653<br>(20) | 千シンガポールドル<br>2,546<br>(46) | 570<br>(10) | 千シンガポールドル<br>526<br>(20) |
| | オーストラリア | 15,420<br>(7,013) | 千豪ドル<br>17,893<br>(1,384) | 4,009<br>(785) | 千豪ドル<br>3,468<br>(1,086) |
| | ニュージーランド | 1,172<br>(－) | 千ニュージーランドドル<br>507<br>(50) | 100 | 千ニュージーランドドル<br>33 |
| | イスラエル | 850 | 千新シェケル<br>5,257 | 21 | 千新シェケル<br>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 |
| 外国 | 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 | — | — | —<br>( 81,000) | —<br>( 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 | —<br>( 7,375) | —<br>( —) | 7,375 | 238 |
| | | COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC | —<br>( 10,200) | —<br>( 288) | 10,200 | 192 |
| | | 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<br>( 142) | 546<br>( 42) | 220 | 56 |
| | | 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 | —<br>( 3,366) | —<br>( 77) | 3,366 | 66 |
| | | GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 9,000 | 244 | 1,200 | 30 |
| | | HCP INC | 5,800 | 203 | — | — |
| | | HEALTH CARE REIT INC | 1,800<br>(△ 32,100) | 114<br>(△ 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<br>( 17,000) | 45<br>( 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<br>( 81,000) | 53<br>( 798) | — | — |
| | | VORNADO REALTY TRUST | 1,700 | 151 | — | — |
| | | WELLTOWER INC | 2,400<br>( 32,100) | 154<br>( 2,499) | — | — |

| 銘柄 | | | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外国 | アメリカ | | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| | | WEYERHAEUSER CO | 4,300<br>( 27,200) | 111<br>( 738) | 1,400 | 45 |
| | 小計 | | 173,746<br>( 129,283) | 9,490<br>( 1,945) | 49,431<br>( 98,000) | 1,958<br>( 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 | —<br>( —) | —<br>( 3) |
| | | | UNIBAIL RODAMCO-NA | 1,580 | 367 | 460 | 112 |
| | | 小計 | | 11,110 | 852 | 1,760<br>( —) | 165<br>( 3) |
| | ユーロ計 | | | 11,110 | 852 | 1,760<br>( —) | 165<br>( 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<br>( —) | 61<br>( 0.47038) | —<br>( —) | —<br>(0.62559) |
| | | ASCENDAS REAL ESTATE INV-RTS | —<br>( 7,012) | —<br>( 0.47038) | —<br>( 7,012) | —<br>(0.47038) |
| | | SUNTEC REIT | 40,000 | 60 | —<br>( —) | —<br>( 1) |
| | 小計 | | 96,000<br>( 7,012) | 185<br>( 0.94076) | —<br>( 7,012) | —<br>( 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 | — | — |
| | | LENDLEASE 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<br>( 151,504) | 68<br>( 467) | —<br>(306,704) | —<br>( 943) |
| | | SCENTRE GROUP | 100,000 | 400 | 39,000 | 154 |
| | | WESTFIELD CORP | 21,600 | 212 | — | — |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外国 | オーストラリア | 口 | 千豪ドル | 口 | 千豪ドル |
| | NOVION PROPERTY GROUP | － | － | －<br>(184,200) | －<br>( 467) |
| | VICINITY CENTRES | 22,000<br>( 306,704) | 69<br>( 943) | － | － |
| | 小計 | 316,600<br>( 458,208) | 1,445<br>( 1,411) | 65,000<br>(490,904) | 206<br>( 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<br>61,434 | 百万円<br>59,941 | 百万円<br>－ | 百万円<br>－ |

＊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 | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 55,778 | 6,339 | 11.4 | 29,471 | 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 | 千米ドル | 千円 | |
| ANTHEM INC | 236 | 252 | 3,534 | 398,238 | ﾍﾙｽｹｱ・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| 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・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| 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 | |
| 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 | 89 | 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 | |
| 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 |
| INTERPUBRIC 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 | 3,556 | 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 |
| KOHLS 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・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| 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 |
| SYNOPSYS 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/ｻｰﾋﾞｽ |
| 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 |
| TRANSDIGM 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・金額 | 270,024 | 303,589 | 1,772,005 | 199,669,611 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 594 | 599 | — | <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 LIFECO 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 |
| ASHTEAD 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 | |
| 小計 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 | 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 | |
| DUFRY 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 | 14,380 | 16,053 | 100,859 | 11,774,300 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 38 | 39 | — | <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 | 19,174 | 22,475 | 276,354 | 3,827,514 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 31 | 30 | — | <1.2%> | |

| 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 | | 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 | 5,241 | 5,364 | 55,926 | 758,368 | |
| | 銘柄数<比率> | 9 | 9 | — | <0.2%> | |
| (デンマーク) | | | | 千デンマークローネ | | |
| 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 | 4,004 | 4,722 | 150,402 | 2,577,901 | |
| | 銘柄数<比率> | 14 | 16 | — | <0.8%> | |
| (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 |
| FRESENIUS 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 |
| DEUTSHCHE 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 |
| BRENNTAG 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 | |
| 小計 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・エネルギー販売業者 |
| 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・金額 | 52,881 | 61,952 | 22,322 | 2,850,570 | |
| 小計 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 | |
| 小計 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 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…オランダ) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| KONINKLIJKE 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 INFRAESTRUCTURAS 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 |
| MAPFRE 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 | | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…オーストリア) | | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | |
| VOESTALPINE AG | | 96 | 110 | 319 | 40,848 | 金属・鉱業 |
| 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 | 1,998 | 1,208 | 1,864 | 238,063 | |
| | 銘柄数<比率> | 8 | 6 | — | <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 | 111 | 39 | 291 | 37,187 | |
| | 銘柄数<比率> | 2 | 1 | — | <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 | 5,904 | 8,558 | 10,330 | 1,319,220 | |
| | 銘柄数<比率> | 12 | 12 | — | <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 | 26,782 | 30,962 | 5,121 | 654,047 | |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 5 | — | <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 | 32,959 | 36,897 | 1,701 | 217,309 | |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 4 | — | <0.1%> | |
| ユーロ計 | 株数・金額 | 236,527 | 258,101 | 309,569 | 39,532,030 | |
| | 銘柄数<比率> | 239 | 233 | — | <12.1%> | |
| (香港) | | | | 千香港ドル | | |
| 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 | 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 | |
| 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 |
| SWIRE PACIFIC-A | 545 | 585 | 4,829 | 70,167 | 不動産管理・開発 |
| WHEELOCK & 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 | |
| 小計 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 HLDGS | 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 | 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 | |
| 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 |
| YANGZIJIANG 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 | |
| 小計 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 | — | — | — | — |
| HOST HOTELS & 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 | |
| 小計 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) | | 口 | 口 | 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) | | 口 | 口 | 千豪ドル | 千円 | % |
| VICINITY CENTRES | | ― | 328,704 | 1,035 | 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 |
| | | | 百万円 | 百万円 |
| 外国 | 株式先物取引 | 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 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 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新シェケル＝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<br>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 |
| のむラップ・ファンド（保守型） | 909 |
| のむラップ・ファンド（普通型） | 5,321 |
| のむラップ・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（預託証書）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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 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なわれますので、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。
（出所）MSCI、為替レート（対顧客電信売買相場仲値）

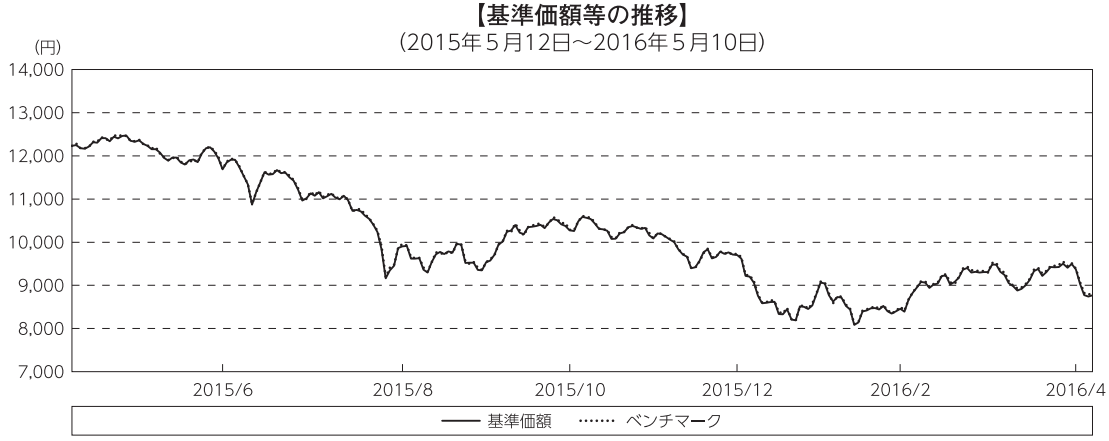
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | | |
| (期首) | 円 | % | | % | % | % | % |
| 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（預託証書）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。

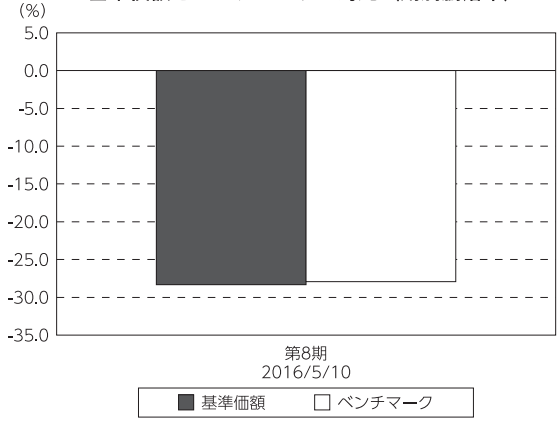
**（マイナス要因）**

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）

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、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 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 売買委託手数料 | 4 | 0.044 | (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<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式） | ( 4) | (0.037) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.001) | |
| （先物・オプション） | ( 1) | (0.006) | |
| (b) 有価証券取引税 | 2 | 0.025 | (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<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （株式） | ( 2) | (0.024) | |
| （投資信託証券） | ( 0) | (0.000) | |
| (c) その他費用 | 16 | 0.159 | (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） | (14) | (0.140) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （その他） | ( 2) | (0.019) | 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<br>516<br>( 26) | 千カタールリヤル<br>1,895<br>( 68) | 百株<br>20<br>( 6) | 千カタールリヤル<br>152<br>( 36) |
| | アメリカ | 10,491<br>( 194) | 千米ドル<br>4,639<br>( －) | 949<br>( 17) | 千米ドル<br>467<br>( 47) |
| | トルコ | 1,005<br>( 87) | 千トルコリラ<br>929<br>( －) | 197 | 千トルコリラ<br>224 |
| | ユーロ | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | ギリシャ | 5,142<br>(△ 4,372) | 336<br>( －) | 35<br>( －) | 17<br>( 0.44279) |
| | チェコ | 32 | 千チェココルナ<br>1,668 | 27 | 千チェココルナ<br>586 |
| | ハンガリー | 20 | 千フォリント<br>14,165 | － | 千フォリント<br>－ |
| | ポーランド | 501<br>( 160) | 千ズロチ<br>1,259<br>( －) | 326 | 千ズロチ<br>217 |
| | 香港 | 79,888<br>( 4,969) | 千香港ドル<br>56,165<br>( 1,102) | 31,677<br>( 1,331) | 千香港ドル<br>11,333<br>( 979) |
| | マレーシア | 6,093<br>( 627) | 千リンギ<br>3,359<br>( 79) | 1,110<br>( 61) | 千リンギ<br>715<br>( 31) |
| | タイ | 7,656<br>( 1,316) | 千バーツ<br>18,685<br>( 561) | 627<br>( 192) | 千バーツ<br>4,294<br>( 555) |
| | フィリピン | 5,055 | 千フィリピンペソ<br>19,047 | 311 | 千フィリピンペソ<br>2,111 |
| | インドネシア | 18,830 | 千ルピア<br>9,679,072 | 3,567 | 千ルピア<br>1,856,724 |
| | 韓国 | 472<br>( 111) | 千ウォン<br>4,734,421<br>( 340,995) | 166<br>( 61) | 千ウォン<br>966,842<br>( 318,282) |
| | 台湾 | 19,750<br>( 3,092) | 千新台湾ドル<br>94,352<br>( 1,883) | 5,916<br>( 684) | 千新台湾ドル<br>22,830<br>( 481) |
| | インド | 3,401<br>( 573) | 千インドルピー<br>215,457<br>( 2,390) | 974<br>( －) | 千インドルピー<br>34,850<br>( 2,390) |
| | メキシコ | 5,590<br>( 912) | 千メキシコペソ<br>17,297<br>( －) | 2,950<br>( 131) | 千メキシコペソ<br>6,695<br>( 88) |
| | ブラジル | 3,216<br>( 653) | 千レアル<br>5,406<br>( 19) | 1,490<br>( 2) | 千レアル<br>1,921<br>( 30) |

| | | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 |
| 外国 | チリ | 百株<br>558<br>( 2) | 千チリペソ<br>101,506<br>( 3,497) | 百株<br>327<br>( 1) | 千チリペソ<br>108,016<br>( 604) |
| | コロンビア | 150<br>( 25) | 千コロンビアペソ<br>155,045<br>( 94,250) | 448<br>( 25) | 千コロンビアペソ<br>318,835<br>( 94,250) |
| | アラブ首長国連邦 | 2,204 | 千UAEディルハム<br>1,731 | 129 | 千UAEディルハム<br>75 |
| | エジプト | 376<br>( 58) | 千エジプトポンド<br>388<br>( —) | 65 | 千エジプトポンド<br>56 |
| | 南アフリカ | 2,225<br>( 828) | 千ランド<br>28,422<br>( 7,301) | 672<br>( 871) | 千ランド<br>6,792<br>( 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 | —<br>( —) | —<br>( 95) |
| | 小計 | 11,200 | 393 | —<br>( —) | —<br>( 95) |
| | 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<br>( 622) | 207<br>( 55) | —<br>(9,072) | —<br>(883) |
| | RESILIENT PROPERTY INCOME-RIGHTS | —<br>( 622) | —<br>( 2) | —<br>( 622) | —<br>( 2) |
| | 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 | —<br>( 9,072) | —<br>( 880) | — | — |
| | 小計 | 136,330<br>( 10,316) | 3,617<br>( 939) | —<br>(9,694) | —<br>(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<br>4,419 | 百万円<br>4,215 | 百万円<br>－ | 百万円<br>－ |

＊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 | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 6,746 | 2,165 | 32.1 | 3,835 | 1,954 | 51.0 |
| 預金 | 825 | 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 | 期首(前期末) 株数 | 当期末 株数 | 当期末 評価額 外貨建金額 | 当期末 評価額 邦貨換算金額 | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|
| （カタール） | 百株 | 百株 | 千カタールリヤル | 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 | 412 | 928 | 4,056 | 121,079 | |
| 小計 銘柄数＜比率＞ | 11 | 13 | － | ＜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 | 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 | |
| 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 | |
| 小計 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 | | 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 | |
| (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 | 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 | |
| (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 | |
| 小計 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 AUTOMOBI-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・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| 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・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| 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 HUISHAN 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・ｻｰﾋﾞｽ |
| 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 | 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 | |
| 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 | 200,656 | 252,504 | 187,485 | 2,619,167 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 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 | 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 | |
| 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 | |
| 小計 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 |
| KASIKORNBANK 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 |
| KASIKORNBANK 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 DUSIT 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 | |
| 小計 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 | | 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 | |
| (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・金額 | 2,300 | 2,656 | 21,047,484 | 1,946,892 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 107 | 107 | — | <15.0%> | |
| (台湾) | | | 千新台湾ドル | | |
| 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 | 千新台湾ドル | 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 |
| EPISTAR 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 | 期首(前期末) | 当期末 | | | 業種等 |
|---|---|---|---|---|---|
| | 株数 | 株数 | 評価額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (台湾) | 百株 | 百株 | 千新台湾ドル | 千円 | |
| 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 | |
| 小計 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 | |
| 小計 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 | 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 | 22,569 | 25,989 | 88,495 | 527,431 | |
| 小計 銘柄数<比率> | 29 | 26 | — | <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 COSMETICOS 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 | 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 | |
| (ブラジル) | 百株 | 百株 | 千レアル | 千円 | |
| BRADESPAR 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 | |
| 小計 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 | | 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 | |
| (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 | 5,313 | 5,545 | 506,485 | 81,341 | |
| | 銘柄数<比率> | 11 | 11 | — | <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 | 1,771 | 1,473 | 1,022,947 | 37,542 | |
| | 銘柄数<比率> | 12 | 7 | — | <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 | 4,115 | 6,190 | 3,599 | 106,521 | |
| | 銘柄数<比率> | 8 | 10 | — | <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 | 1,202 | 1,572 | 2,062 | 25,472 | |
| | 銘柄数<比率> | 4 | 3 | — | <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・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| 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・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| 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・ﾌﾟﾛﾊﾞｲﾀﾞｰ/ﾍﾙｽｹｱ・ｻｰﾋﾞｽ |
| 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) | | 百株 | 百株 | 千ランド | 千円 | |
| STEINHOFF INTERNATIONAL H NV | | － | 956 | 8,438 | 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) | | 口 | 口 | 千トルコリラ | 千円 | % |
| EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI | | 52,400 | 64,400 | 180 | 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) | | | | 千メキシコペソ | | |
| FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | | 69,200 | 80,400 | 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) | | | | 千ランド | | |
| GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | | 65,380 | 75,380 | 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 |
| | | | 百万円 | 百万円 |
| 外国 | 株式先物取引 | MSCIN | 500 | － |

＊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 |
| | 千円 | % |
| 株式 | 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<br>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 |
| 野村ターゲットデートファンド2016　2026-2028年目標型 | 3,801,119 |
| 野村ターゲットデートファンド2016　2029-2031年目標型 | 410,628 |
| 野村ターゲットデートファンド2016　2032-2034年目標型 | 226,785 |
| 野村ターゲットデートファンド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 | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 期中騰落率 | NOMURA-BPI総合 | 期中騰落率 | | | |
| | 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、野村證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證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、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。

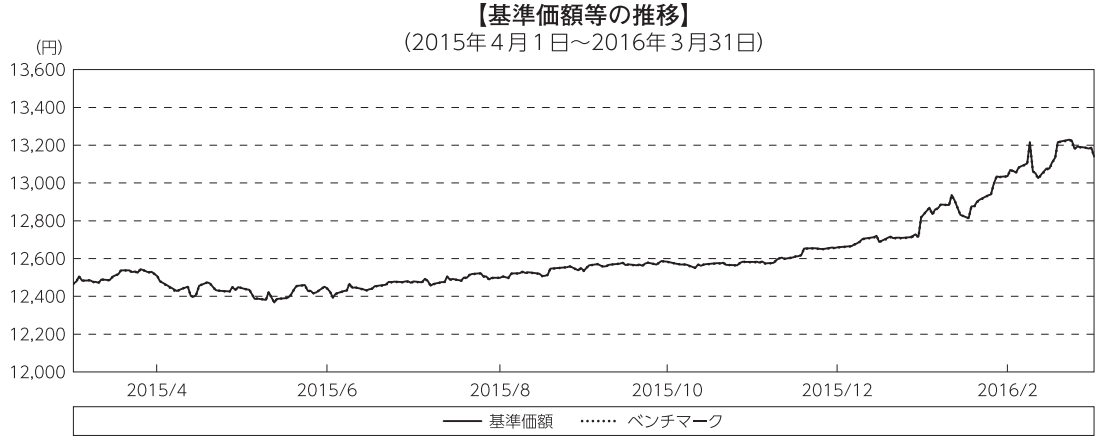
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債券組入比率 | 債券先物比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 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

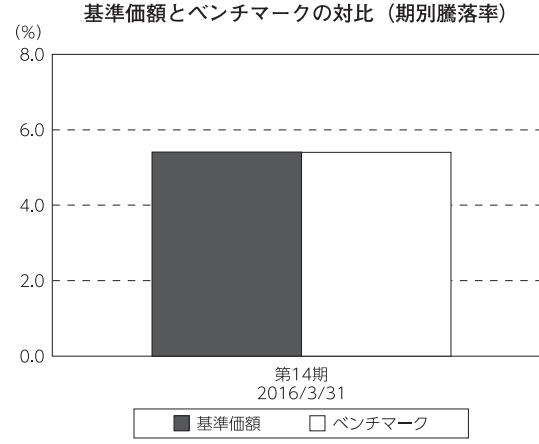
今期の基準価額の騰落率は＋5.4%となり、ベンチマークの＋5.4%とほぼ同程度となりました。主な差異要因は以下の通りです。

**（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 |
| | 特殊債券 | 25,130,353 | 12,498,312<br>(　776,726) |
| | 社債券（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 | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 211,793 | 20,247 | 9.6 | 93,784 | 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 | 513,500,283 | 78.3 | － | 51.5 | 21.2 | 5.6 |
| | (3,160,000) | (4,743,391) | (0.7) | (－) | (0.7) | (0.0) | (0.0) |
| 地方債証券 | 49,021,020 | 51,844,038 | 7.9 | － | 3.4 | 3.4 | 1.1 |
| | (49,021,020) | (51,844,038) | (7.9) | (－) | (3.4) | (3.4) | (1.1) |
| 特殊債券(除く金融債) | 48,158,183 | 51,196,816 | 7.8 | － | 4.4 | 1.9 | 1.5 |
| | (48,158,183) | (51,196,816) | (7.8) | (－) | (4.4) | (1.9) | (1.5) |
| 金融債券 | 6,150,000 | 6,191,268 | 0.9 | － | － | 0.3 | 0.6 |
| | (6,150,000) | (6,191,268) | (0.9) | (－) | (－) | (0.3) | (0.6) |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | 28,907,000 | 30,007,290 | 4.6 | － | 2.0 | 1.8 | 0.8 |
| | (28,907,000) | (30,007,290) | (4.6) | (－) | (2.0) | (1.8) | (0.8) |
| 合計 | 587,551,203 | 652,739,697 | 99.5 | － | 61.3 | 28.6 | 9.7 |
| | (135,396,203) | (143,982,805) | (21.9) | (－) | (10.4) | (7.4) | (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 | 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 | 償還年月日 |
| **国債証券** | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券　利付（20年）第136回 | 1.6 | 700,000 | 850,899 | 2032/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第137回 | 1.7 | 1,000,000 | 1,232,620 | 2032/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第138回 | 1.5 | 800,000 | 960,280 | 2032/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第139回 | 1.6 | 700,000 | 851,200 | 2032/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第140回 | 1.7 | 2,300,000 | 2,836,291 | 2032/９/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第141回 | 1.7 | 1,700,000 | 2,097,103 | 2032/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第142回 | 1.8 | 1,250,000 | 1,562,062 | 2032/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第143回 | 1.6 | 1,700,000 | 2,070,005 | 2033/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第144回 | 1.5 | 1,500,000 | 1,802,100 | 2033/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第145回 | 1.7 | 2,600,000 | 3,211,468 | 2033/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第146回 | 1.7 | 2,400,000 | 2,964,912 | 2033/９/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第147回 | 1.6 | 2,700,000 | 3,293,082 | 2033/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第148回 | 1.5 | 2,500,000 | 3,006,100 | 2034/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第149回 | 1.5 | 2,600,000 | 3,125,252 | 2034/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第150回 | 1.4 | 2,930,000 | 3,469,530 | 2034/９/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第151回 | 1.2 | 2,700,000 | 3,097,602 | 2034/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第152回 | 1.2 | 3,400,000 | 3,899,936 | 2035/３/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第153回 | 1.3 | 3,450,000 | 4,018,249 | 2035/６/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第154回 | 1.2 | 3,500,000 | 4,009,215 | 2035/９/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第155回 | 1.0 | 2,300,000 | 2,547,480 | 2035/12/20 |
| 国庫債券　利付（20年）第156回 | 0.4 | 1,000,000 | 992,660 | 2036/３/20 |
| ポーランド共和国　第12回円貨債券（2012） | 1.05 | 100,000 | 101,104 | 2017/11/８ |
| ポーランド共和国　第15回円貨債券（2013） | 0.91 | 100,000 | 101,292 | 2020/11/13 |
| 小計 | | 455,315,000 | 513,500,283 | |
| **地方債証券** | | | | |
| 東京都　公募第648回 | 1.84 | 300,000 | 306,537 | 2017/６/20 |
| 東京都　公募第655回 | 1.42 | 100,000 | 102,686 | 2018/３/20 |
| 東京都　公募第659回 | 1.62 | 300,000 | 310,521 | 2018/６/20 |
| 東京都　公募第660回 | 1.58 | 100,000 | 103,418 | 2018/６/20 |
| 東京都　公募第664回 | 1.4 | 100,000 | 103,699 | 2018/12/20 |
| 東京都　公募第668回 | 1.54 | 200,000 | 208,864 | 2019/３/20 |
| 東京都　公募第671回 | 1.42 | 100,000 | 104,421 | 2019/６/20 |
| 東京都　公募第685回 | 1.13 | 100,000 | 104,546 | 2020/６/19 |
| 東京都　公募第690回 | 1.29 | 200,000 | 211,622 | 2020/12/18 |
| 東京都　公募第703回 | 0.99 | 100,000 | 105,356 | 2021/12/20 |
| 東京都　公募第707回 | 0.87 | 100,000 | 104,867 | 2022/３/18 |
| 東京都　公募第708回 | 0.89 | 100,000 | 105,239 | 2022/６/20 |
| 東京都　公募第710回 | 0.81 | 100,000 | 104,742 | 2022/６/20 |
| 東京都　公募第712回 | 0.77 | 100,000 | 104,571 | 2022/９/20 |
| 東京都　公募第715回 | 0.76 | 100,000 | 104,644 | 2022/12/20 |
| 東京都　公募第716回 | 0.77 | 200,000 | 209,422 | 2022/12/20 |
| 東京都　公募（30年）第７回 | 2.51 | 100,000 | 137,100 | 2038/９/17 |
| 東京都　公募第10回 | 2.31 | 200,000 | 268,402 | 2039/９/20 |
| 東京都　公募（７年）第１回 | 0.7 | 300,000 | 302,343 | 2017/６/20 |
| 東京都　公募（７年）第３回 | 0.58 | 100,000 | 101,370 | 2018/９/20 |
| 東京都　公募第１回 | 1.54 | 300,000 | 331,335 | 2023/６/20 |
| 東京都　公募第７回 | 2.16 | 100,000 | 119,523 | 2025/９/19 |
| 東京都　公募（20年）第16回 | 2.01 | 200,000 | 245,972 | 2028/12/20 |

| 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 |
| **地方債証券** | % | 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 | 償還年月日 |
| **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 | 2018/7/23 |
| 大阪市　公募平成21年度第６回 | 1.57 | 100,000 | 105,486 | 2019/11/25 |
| 大阪市　公募平成25年度第１回 | 0.401 | 800,000 | 805,840 | 2018/5/23 |
| 大阪市　公募平成25年度第６回 | 0.694 | 100,000 | 104,585 | 2023/11/22 |
| 大阪市　公募（15年）第１回 | 1.753 | 100,000 | 116,353 | 2026/7/17 |
| 大阪市　公募（20年）第５回 | 2.47 | 100,000 | 127,473 | 2028/9/21 |
| 大阪市　公募（20年）第６回 | 2.21 | 100,000 | 124,626 | 2028/12/20 |
| 大阪市　公募（20年）第17回 | 1.721 | 100,000 | 120,692 | 2032/12/21 |
| 名古屋市　公募第460回 | 1.74 | 200,000 | 204,964 | 2017/9/20 |
| 名古屋市　公募第464回 | 1.61 | 300,000 | 311,712 | 2018/9/20 |
| 名古屋市　公募第469回 | 1.34 | 100,000 | 104,792 | 2019/12/20 |
| 名古屋市　公募第478回 | 1.063 | 100,000 | 106,021 | 2022/3/18 |
| 名古屋市　公募第488回 | 0.598 | 300,000 | 313,182 | 2024/9/20 |
| 名古屋市　公募（６年）第１回 | 0.283 | 200,000 | 201,010 | 2018/6/20 |
| 名古屋市　公募（12年）第１回 | 1.033 | 200,000 | 217,242 | 2025/6/20 |
| 名古屋市　公募（15年）第２回 | 0.905 | 100,000 | 108,724 | 2029/11/16 |
| 京都市　公募平成19年度第２回 | 1.74 | 300,000 | 308,661 | 2017/12/27 |
| 京都市　公募平成19年度第４回 | 1.62 | 190,000 | 195,614 | 2018/2/26 |
| 京都市　公募平成20年度第４回 | 1.54 | 200,000 | 208,600 | 2019/2/26 |
| 京都市　公募平成23年度第４回 | 1.067 | 100,000 | 105,776 | 2021/12/22 |
| 京都市　公募平成25年度第３回 | 0.312 | 100,000 | 100,675 | 2018/9/27 |
| 京都市　公募（20年）第２回 | 2.12 | 100,000 | 119,147 | 2025/9/19 |
| 京都市　公募（20年）第13回 | 1.359 | 100,000 | 114,482 | 2034/11/24 |
| 神戸市　公募平成21年度第７回 | 1.69 | 100,000 | 105,257 | 2019/6/20 |
| 横浜市　公募平成20年度第３回 | 1.56 | 100,000 | 103,713 | 2018/9/7 |
| 横浜市　公募公債平成20年度５回 | 1.58 | 200,000 | 208,320 | 2018/12/20 |
| 横浜市　公募平成21年度第４回 | 1.35 | 200,000 | 208,976 | 2019/9/20 |
| 横浜市　公募平成22年度第５回 | 1.265 | 100,000 | 105,645 | 2020/12/11 |
| 横浜市　公募公債平成24年度２回 | 0.815 | 200,000 | 209,628 | 2022/10/17 |
| 横浜市　公募公債平成25年度１回 | 0.664 | 200,000 | 208,200 | 2023/5/19 |
| 横浜市　公募公債平成25年度５回 | 0.655 | 200,000 | 208,720 | 2023/11/17 |
| 横浜市　公募公債平成26年度５回 | 0.471 | 200,000 | 206,646 | 2024/12/13 |
| 横浜市　公募（20年）第30回 | 1.376 | 100,000 | 115,421 | 2034/10/20 |
| 札幌市　公募平成19年度第３回 | 1.77 | 100,000 | 102,533 | 2017/9/20 |
| 札幌市　公募平成22年度第４回 | 1.05 | 100,000 | 104,187 | 2020/6/19 |
| 札幌市　公募（５年）平成24年度第８回 | 0.2 | 200,000 | 200,444 | 2017/12/20 |
| 札幌市　公募平成26年度第４回 | 0.54 | 100,000 | 103,704 | 2024/6/20 |
| 札幌市　公募平成26年度第９回 | 0.43 | 200,000 | 205,860 | 2024/12/20 |
| 川崎市　公募第81回 | 1.57 | 100,000 | 104,536 | 2019/3/20 |
| 川崎市　公募第82回 | 1.52 | 100,000 | 105,115 | 2019/9/20 |
| 川崎市　公募第85回 | 0.72 | 100,000 | 104,341 | 2022/12/20 |
| 川崎市　公募（20年）第17回 | 1.527 | 100,000 | 118,312 | 2033/5/9 |
| 川崎市　公募第32回 | 0.22 | 150,000 | 150,301 | 2017/6/20 |
| 北九州市　公募（５年）平成25年度第２回 | 0.312 | 100,000 | 100,707 | 2018/9/27 |
| 北九州市　公募（20年）第14回 | 1.732 | 100,000 | 121,210 | 2032/11/12 |
| 福岡市　公募平成20年度第３回 | 1.52 | 100,000 | 103,308 | 2018/6/20 |
| 福岡市　公募平成24年度第５回 | 0.19 | 100,000 | 100,241 | 2017/12/26 |
| 福岡市　公募（５年）平成25年度第２回 | 0.35 | 300,000 | 302,226 | 2018/7/25 |

| 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 | |
| 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 | |
| **特殊債券（除く金融債）** | | | | |
| 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 | 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 | |
| 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 |
| **特殊債券(除く金融債)** | % | 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 | 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 | |
| 地方公共団体金融機構債券　Ｆ144回 | 0.562 | 200,000 | 204,530 | 2020/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券　Ｆ145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　Ｆ160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 | 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 |
| **特殊債券(除く金融債)** | % | 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 | |
| **金融債券** | | | | |
| 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 |
| **金融債券** | % | 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 | |
| **普通社債券(含む投資法人債券)** | | | | |
| 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 | 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 | 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 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 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 | |
| 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 | 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・ＳＩ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 | |
| ＮＴＴ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 |
| エイチエスビーシー・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 |
| バークレイズ・バンク・ピーエルシー　第７回円貨社債 | 0.478 | 100,000 | 99,963 | 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 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 資産 | 661,381,770,545 |
| 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 |
|---|---|
| | 円 |
| (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<br>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<br>元本額 |
|---|---|
| | 百万円 |
| 野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け） | 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FOFs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 | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 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（為替ヘッジを行な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

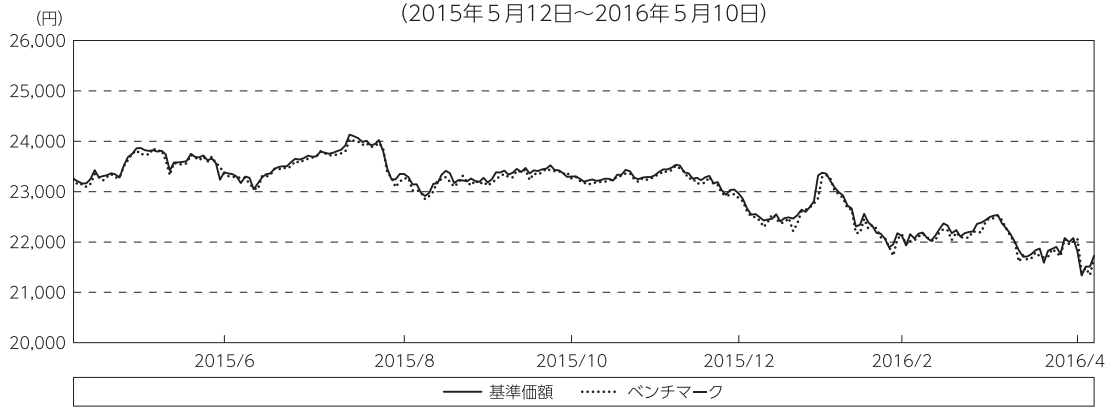
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債券組入比率 | 債券先物比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | |
| （期　首） | 円 | % | | % | % | % |
| 2015年５月11日 | 23,251 | － | 236.29 | － | 98.9 | － |
| ５月末 | 23,746 | 2.1 | 241.38 | 2.2 | 99.0 | － |
| ６月末 | 23,385 | 0.6 | 237.28 | 0.4 | 98.9 | － |
| ７月末 | 23,699 | 1.9 | 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

【基準価額等の推移】
（2015年５月12日～2016年５月10日）




（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。

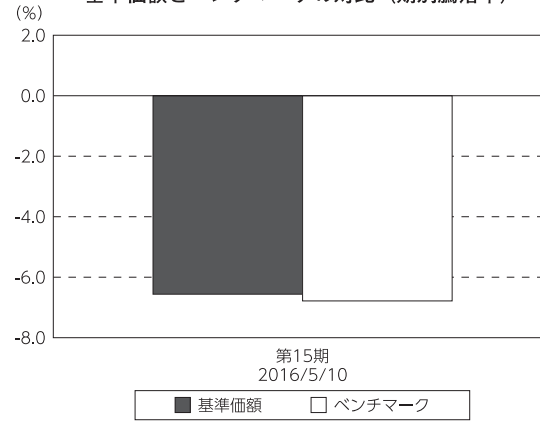
**（マイナス要因）**

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

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、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 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) その他費用 | 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<br>1,164,271 | 千米ドル<br>549,584 |
| | カナダ | 国債証券 | 千カナダドル<br>72,837 | 千カナダドル<br>42,081 |
| | イギリス | 国債証券 | 千英ポンド<br>110,916 | 千英ポンド<br>39,649 |
| | スイス | 国債証券 | 千スイスフラン<br>4,001 | 千スイスフラン<br>－ |
| | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデンクローナ<br>81,361 | 千スウェーデンクローナ<br>23,206 |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェークローネ<br>49,712 | 千ノルウェークローネ<br>732 |
| | デンマーク | 国債証券 | 千デンマーククローネ<br>79,204 | 千デンマーククローネ<br>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 |
|---|---|---|---|---|
| 外国 | 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<br>60,022 | 千ズロチ<br>20,105 |
| | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポールドル<br>11,142 | 千シンガポールドル<br>5,113 |
| | マレーシア | 国債証券 | 千リンギ<br>42,868 | 千リンギ<br>16,152 |
| | オーストラリア | 国債証券 | 千豪ドル<br>61,091 | 千豪ドル<br>18,091 |
| | メキシコ | 国債証券 | 千メキシコペソ<br>395,496 | 千メキシコペソ<br>118,842 |
| | 南アフリカ | 国債証券 | 千ランド<br>128,597 | 千ランド<br>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 | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 283,335 | 7,530 | 2.7 | 115,284 | 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。

# ○組入資産の明細

（2016年５月10日現在）

## 外国公社債

（A）外国（外貨建）公社債　種類別開示

| 区分 | 当期末 | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 額面金額 | 評価額 | | 組入比率 | うちBB格以下組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | ５年以上 | ２年以上 | ２年未満 |
| | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 2,264,900 | 2,457,940 | 266,588,179 | 42.1 | － | 18.5 | 15.3 | 8.3 |
| | 千カナダドル | 千カナダドル | | | | | | |
| カナダ | 135,080 | 155,553 | 13,002,750 | 2.1 | － | 1.1 | 0.6 | 0.4 |
| | 千英ポンド | 千英ポンド | | | | | | |
| イギリス | 260,000 | 318,585 | 49,782,224 | 7.9 | － | 5.8 | 1.9 | 0.2 |
| | 千スイスフラン | 千スイスフラン | | | | | | |
| スイス | 12,700 | 15,811 | 1,766,102 | 0.3 | － | 0.1 | 0.2 | － |
| | 千スウェーデンクローナ | 千スウェーデンクローナ | | | | | | |
| スウェーデン | 197,900 | 236,699 | 3,143,364 | 0.5 | － | 0.3 | 0.2 | 0.0 |
| | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | | | | | |
| ノルウェー | 132,000 | 146,577 | 1,933,359 | 0.3 | － | 0.2 | 0.1 | 0.0 |
| | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ | | | | | | |
| デンマーク | 194,400 | 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 |
| | 千ズロチ | 千ズロチ | | | | | | |
| ポーランド | 120,500 | 131,685 | 3,668,764 | 0.6 | － | 0.2 | 0.3 | 0.1 |
| | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | | | | | |
| シンガポール | 26,480 | 28,258 | 2,234,693 | 0.4 | － | 0.2 | 0.1 | － |
| | 千リンギ | 千リンギ | | | | | | |
| マレーシア | 107,000 | 108,117 | 2,895,398 | 0.5 | － | 0.3 | 0.1 | 0.1 |
| | 千豪ドル | 千豪ドル | | | | | | |
| オーストラリア | 127,400 | 142,035 | 11,249,226 | 1.8 | － | 1.1 | 0.4 | 0.2 |
| | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | | | | | |
| メキシコ | 887,300 | 990,729 | 5,904,747 | 0.9 | － | 0.6 | 0.3 | 0.1 |
| | 千ランド | 千ランド | | | | | | |
| 南アフリカ | 420,500 | 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 利率 | 当期末 額面金額 | 当期末 評価額 外貨建金額 | 当期末 評価額 邦貨換算金額 | 当期末 償還年月日 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| アメリカ | | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| | 国債証券 | US TREASURY N/B | 1.0 | 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 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 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 | 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(GOVERNMEN | 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 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 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 | 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 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.95 | 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 | 4.4 | 3,600 | 4,120 | 508,786 | 2019/6/18 |
| | | 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 | 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 | | | 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 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 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<br>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 |
| のむラップ・ファンド（普通型） | 6,049,210,521 |
| のむラップ・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 |
| のむラップ・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 |
| 野村外国債券パッシブファンド（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<br>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 |
| 野村ターゲットデートファンド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 |
| 野村ターゲットデートファンド2016　2029-2031年目標型 | 347,674 |
| 野村ターゲットデートファンド2016　2035-2037年目標型 | 266,217 |
| 野村ターゲットデートファンド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・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える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。<br>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・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | | |
| | 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・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース））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・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（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

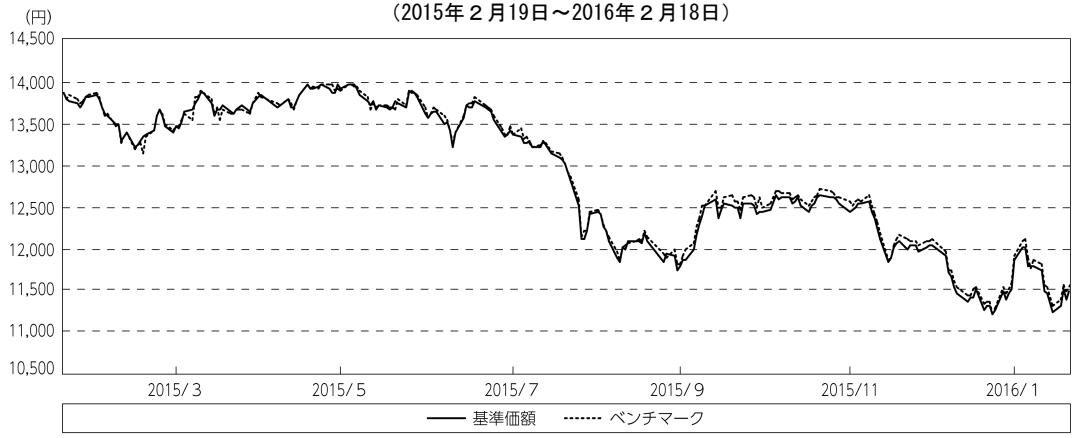
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース) | | 債券組入比率 | 債券先物比率 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | | |
| (期　首) | 円 | % | | % | % | % |
| 2015年2月18日 | 13,863 | － | 142.69 | － | 97.4 | － |
| 2月末 | 13,811 | △ 0.4 | 142.59 | △ 0.1 | 97.0 | － |
| 3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 | 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

【基準価額等の推移】
（2015年２月19日～2016年２月18日）




（注）ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）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相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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、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。

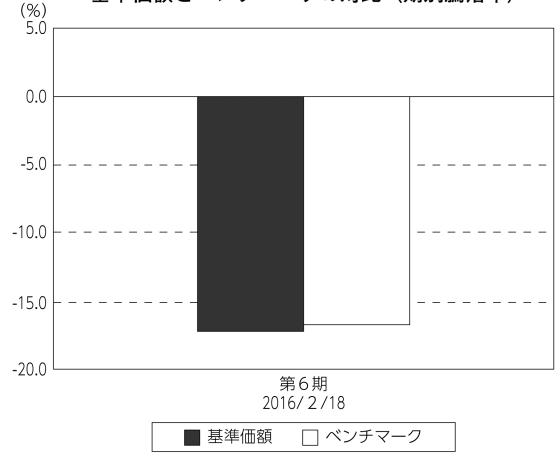
## ○当ファンドのベンチマークとの差異

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

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、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）です。

## ◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

＊本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含みますが、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・エー、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もご覧ください。
当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

## ○１万口当たりの費用明細

（2015年２月19日～2016年２月18日）

| 項目 | 当期 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) その他費用 | 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送金・資産の移転等に要する費用 |
| （その他） | ( 2) | (0.015) | 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 |
|---|---|---|---|---|
| 外国 | トルコ | 国債証券 | 千トルコリラ<br>2,349 | 千トルコリラ<br>1,931 |
| | ハンガリー | 国債証券 | 千フォリント<br>58,423 | 千フォリント<br>67,226 |
| | ポーランド | 国債証券 | 千ズロチ<br>2,671 | 千ズロチ<br>3,146 |
| | ロシア | 国債証券 | 千ルーブル<br>23,478 | 千ルーブル<br>27,453 |
| | ルーマニア | 国債証券 | 千レイ<br>616 | 千レイ<br>482 |
| | マレーシア | 国債証券 | 千リンギ<br>2,517 | 千リンギ<br>3,034 |
| | タイ | 国債証券 | 千バーツ<br>17,934 | 千バーツ<br>15,422 |
| | インドネシア | 国債証券 | 千ルピア<br>7,563,532 | 千ルピア<br>7,444,275 |
| | メキシコ | 国債証券 | 千メキシコペソ<br>13,983 | 千メキシコペソ<br>14,107 |
| | ブラジル | 国債証券 | 千レアル<br>4,594 | 千レアル<br>3,944 |
| | コロンビア | 国債証券 | 千コロンビアペソ<br>984,539 | 千コロンビアペソ<br>992,154 |
| | ペルー | 国債証券 | 千ヌエボソル<br>347 | 千ヌエボソル<br>442 |
| | 南アフリカ | 国債証券 | 千ランド<br>10,741 | 千ランド<br>8,412 |
| | ナイジェリア | 国債証券 | 千ナイラ<br>－ | 千ナイラ<br>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<br>A | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等<br>C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 876 | 11 | 1.3 | 886 | 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 |
| | 千トルコリラ | 千トルコリラ | 千円 | % | % | % | % | % |
| トルコ | 4,230 | 3,925 | 151,344 | 9.4 | － | 4.8 | 4.0 | 0.7 |
| | 千フォリント | 千フォリント | | | | | | |
| ハンガリー | 184,000 | 216,759 | 88,784 | 5.5 | 5.5 | 2.1 | 2.3 | 1.1 |
| | 千ズロチ | 千ズロチ | | | | | | |
| ポーランド | 5,230 | 5,596 | 161,564 | 10.0 | － | 4.0 | 4.9 | 1.1 |
| | 千ルーブル | 千ルーブル | | | | | | |
| ロシア | 50,000 | 48,091 | 73,098 | 4.5 | 4.5 | － | 4.5 | － |
| | 千レイ | 千レイ | | | | | | |
| ルーマニア | 1,490 | 1,703 | 48,486 | 3.0 | － | 1.8 | － | 1.2 |
| | 千リンギ | 千リンギ | | | | | | |
| マレーシア | 5,630 | 5,641 | 154,067 | 9.6 | － | 5.0 | 3.2 | 1.4 |
| | 千バーツ | 千バーツ | | | | | | |
| タイ | 41,700 | 46,267 | 148,517 | 9.2 | － | 5.0 | 4.1 | 0.2 |
| | 千フィリピンペソ | 千フィリピンペソ | | | | | | |
| フィリピン | 5,000 | 5,148 | 12,305 | 0.8 | － | － | 0.8 | － |
| | 千ルピア | 千ルピア | | | | | | |
| インドネシア | 17,650,000 | 18,550,679 | 157,680 | 9.8 | 9.8 | 8.3 | 1.1 | 0.4 |
| | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | | | | | |
| メキシコ | 22,500 | 24,761 | 154,017 | 9.6 | － | 6.0 | 3.1 | 0.4 |
| | 千レアル | 千レアル | | | | | | |
| ブラジル | 5,257 | 5,554 | 158,639 | 9.8 | 9.8 | 2.2 | 4.0 | 3.6 |
| | 千コロンビアペソ | 千コロンビアペソ | | | | | | |
| コロンビア | 2,530,000 | 2,564,334 | 86,930 | 5.4 | － | 5.4 | － | － |
| | 千ヌエボソル | 千ヌエボソル | | | | | | |
| ペルー | 830 | 770 | 25,062 | 1.6 | － | 1.3 | 0.3 | － |
| | 千ランド | 千ランド | | | | | | |
| 南アフリカ | 21,930 | 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 | 当期末 額面金額 | 当期末 評価額 外貨建金額 | 当期末 評価額 邦貨換算金額 | 当期末 償還年月日 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| トルコ | | | % | 千トルコリラ | 千トルコリラ | 千円 | |
| | 国債証券 | TURKEY GOVERNMENT BOND | 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 | | | | 千フォリント | 千フォリント | | |
| | 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 |

| 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 | |
| ブラジル | | | % | 千レアル | 千レアル | 千円 | |
| | 国債証券 | LETRA TESOURO NACIONAL | － | 2,100 | 1,628 | 46,503 | 2018/1/1 |
| | | LETRA TESOURO NACIONAL | － | 300 | 215 | 6,163 | 2018/7/1 |
| | | LETRA TESOURO NACIONAL | － | 820 | 545 | 15,582 | 2019/1/1 |
| | | LETRA TESOURO NACIONAL | － | 1,310 | 807 | 23,071 | 2019/7/1 |
| | | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 10.0 | 85 | 714 | 20,401 | 2021/1/1 |
| | | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 10.0 | 50 | 396 | 11,334 | 2023/1/1 |
| | | NOTA DO TESOURO NACIONAL | 10.0 | 112 | 846 | 24,172 | 2025/1/1 |
| 小計 | | | | | | 158,639 | |
| 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 | 1,720,000 | 1,691,964 | 57,357 | 2021/4/14 |
| | | REPUBLIC OF COLOMBIA | 9.85 | 810,000 | 872,370 | 29,573 | 2027/6/28 |
| 小計 | | | | | | 86,930 | |
| ペルー | | | | 千ヌエボソル | 千ヌエボソル | | |
| | 国債証券 | BONOS DE TESORERIA | 5.7 | 200 | 181 | 5,919 | 2024/8/12 |
| | | PERU BONO SOBERANO | 7.84 | 130 | 137 | 4,475 | 2020/8/12 |
| | | PERU BONO SOBERANO | 6.9 | 500 | 450 | 14,667 | 2037/8/12 |
| 小計 | | | | | | 25,062 | |
| 南アフリカ | | | | 千ランド | 千ランド | | |
| | 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 1,300 | 1,286 | 9,482 | 2018/12/21 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.25 | 2,380 | 2,273 | 16,754 | 2020/1/15 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.75 | 1,640 | 1,504 | 11,085 | 2021/3/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.75 | 1,400 | 1,309 | 9,650 | 2023/2/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10.5 | 3,800 | 4,152 | 30,601 | 2026/12/21 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.0 | 4,360 | 3,434 | 25,311 | 2031/2/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.25 | 2,000 | 1,396 | 10,295 | 2036/3/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.5 | 1,100 | 973 | 7,175 | 2037/1/31 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.5 | 2,250 | 1,562 | 11,514 | 2041/2/28 |
| | | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 1,700 | 1,511 | 11,139 | 2048/2/28 |
| 小計 | | | | | | 143,011 | |
| 合計 | | | | | | 1,563,511 | |

＊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２月18日現在）

| 項目 | 当期末 | |
|---|---|---|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 1,563,511 | 96.9 |
| コール・ローン等、その他 | 50,474 | 3.1 |
| 投資信託財産総額 | 1,613,985 | 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（1,600,843千円）の投資信託財産総額（1,613,985千円）に対する比率は99.2％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=113.97円、1トルコリラ=38.55円、1フォリント=0.4096円、1ズロチ=28.87円、1ルーブル=1.52円、1レイ=28.46円、1リンギ=27.31円、1バーツ=3.21円、1フィリピンペソ=2.39円、1ルピア=0.0085円、1メキシコペソ=6.22円、1レアル=28.56円、1コロンビアペソ=0.0339円、1ヌエボソル=32.53円、1ランド=7.37円。

## ○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。<br>外貨建て資産への直接投資は行いません。<br>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 | | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 期中騰落率 | 東証REIT指数（配当込み） | 期中騰落率 | | |
| | 円 | % | | % | % | 百万円 |
| ７期(2012年６月11日) | 8,319 | △ 7.4 | 1,401.77 | △ 7.5 | 97.7 | 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

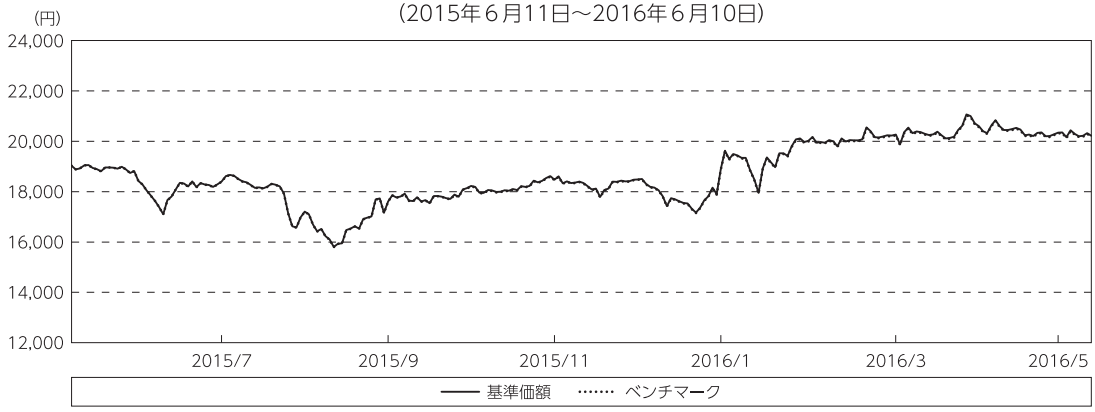
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 投資信託証券組入比率 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | 東証REIT指数（配当込み） | 騰落率 | |
| | 円 | % | | % | % |
| （期　首）<br>2015年６月10日 | 19,029 | － | 3,206.37 | － | 97.7 |
| ６月末 | 18,743 | △ 1.5 | 3,157.69 | △ 1.5 | 97.7 |
| ７月末 | 18,407 | △ 3.3 | 3,100.40 | △ 3.3 | 97.8 |
| ８月末 | 17,106 | △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）<br>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

【基準価額等の推移】
（2015年６月11日～2016年６月10日）




（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。

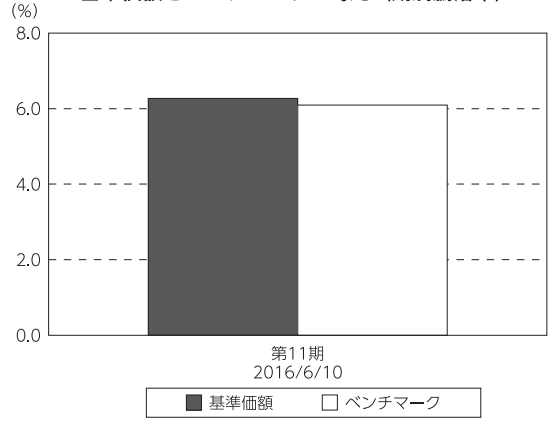
## ○当ファンドのベンチマークとの差異

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。

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、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 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 売買委託手数料 | 0 | 0.002 | (a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （投資信託証券） | (0) | (0.001) | |
| （先物・オプション） | (0) | (0.001) | |
| 合計 | 0 | 0.002 | |
| 期中の平均基準価額は、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 口数 | 買付 金額 | 売付 口数 | 売付 金額 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 口 | 千円 | 口 | 千円 |
| 国内 | 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 MidCity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<br>(△ 271) | 16,342<br>(△ 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 |
| | アクティビア・プロパティーズ投資法人　投資証券 | 398<br>( 467) | 237,407<br>( －) | 227 | 129,921 |
| | 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<br>(△ 2,804) | 42,488<br>(△ 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 |
| 国内 | 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 |
| | インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人　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<br>(6,266) | 268,489<br>(982,006) | 1,347 | 208,318 |
| | 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 |
| | 日本リテールファンド投資法人　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 |
| | プレミア投資法人　投資証券 | 629<br>(1,732) | 107,798<br>(－) | 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 |
| | 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<br>(△627) | 33,006<br>(△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・ＳＩ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<br>(4,763) | 8,230,281<br>(－) | 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 |
| | | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 国内 | REIT先物取引 | 1,470 | 1,485 | － | － |

＊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 | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 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證券株式会社、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 | 評価額 | 比率 |
| | 口 | 口 | 千円 | % |
| 日本アコモデーションファンド投資法人　投資証券 | 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 |
| アクティビア・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 |
| 日本リテー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 |
| インヴィンシブル投資法人　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・ＳＩ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 | |
| 合計　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 | | | 当期末 | |
|---|---|---|---|---|
| | | | 買建額 | 売建額 |
| | | | 百万円 | 百万円 |
| 国内 | REIT先物取引 | 東証REIT指数 | 391 | － |

＊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 | 当期末 | |
|---|---|---|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 投資証券 | 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 |
|---|---|
| | 円 |
| (A) 資産 | 21,482,277,618 |
| 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2.0222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 | 606,320,092 |
| 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<br>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。<br>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 | | 投資信託証券組入比率 | 純資産総額 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 期中騰落率 | | 期中騰落率 | | |
| | 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 | | 投資信託証券組入比率 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 騰落率 | | 騰落率 | |
| （期　首） | 円 | % | | % | % |
| 2015年６月10日 | 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 | 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

【基準価額等の推移】
(2015年６月11日～2016年６月10日)

（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）**

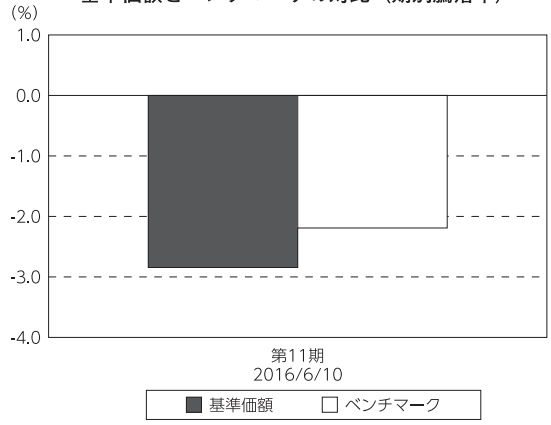
①コスト負担（売買コストや保管費用など）

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）

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。

## ◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

「S&P先進国REIT指数（除く日本）」はスタンダード&プアーズ ファイナンシャル サービシーズ 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。

## ○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 金額 | 当期 比率 | 項目の概要 |
|---|---|---|---|
| | 円 | % | |
| (a) 売買委託手数料 | 4 | 0.021 | (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<br>※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （株式） | ( 0) | (0.000) | |
| （投資信託証券） | ( 4) | (0.020) | |
| （先物・オプション） | ( 0) | (0.001) | |
| (b) 有価証券取引税 | 3 | 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<br>※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （株式） | ( 0) | (0.000) | |
| （投資信託証券） | ( 3) | (0.013) | |
| (c) その他費用 | 10 | 0.048 | (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） | ( 8) | (0.037) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （その他） | ( 2) | (0.011) | 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

| | | 買付 株数 | 買付 金額 | 売付 株数 | 売付 金額 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 百株 | 千米ドル | 百株 | 千米ドル |
| 外国 | アメリカ | －<br>(10) | －<br>(15) | 10 | 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 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| | 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<br>(5,334) | 110<br>(88) | 4,534 | 71 |
| | AMERICAN REALTY CAPITAL PROP | 3,700 | 30 | 9,000<br>(127,000) | 77<br>(1,092) |
| | AMERICAN RESIDENTIAL PROPERTIES INC | — | — | —<br>(4,700) | —<br>(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 | —<br>(495) | —<br>(—) | — | — |
| | ASHFORD HOSPITALITY TRUST | — | — | 1,000 | 8 |
| | ASSOCIATED ESTATES REALTY CP | — | — | 400<br>(8,000) | 11<br>(229) |
| | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 5,250 | 924 | 3,350 | 588 |
| | BIOMED REALTY TRUST INC | 4,400 | 92 | 4,000<br>(29,500) | 84<br>(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<br>(11,625) | 72<br>(—) | 1,300 | 36 |
| | CARETRUST REIT INC ACQUIRES | 4,700 | 56 | — | — |
| | CEDAR REALTY TRUST INC | 1,100 | 7 | — | — |
| | CHAMBERS STREET PROPERTIES | 2,800 | 19 | 2,800<br>(34,000) | 19<br>(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<br>(5,500) | 8<br>(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 | 千米ドル | 口 | 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 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| | | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | 3,400 | 89 | 1,800 | 45 |
| | | HEALTH CARE REIT INC | 3,000<br>(△ 50,000) | 197<br>(△ 3,384) | 3,600 | 244 |
| | | HEALTHCARE TRUST OF AMERICA | 5,000 | 135 | 2,000 | 53 |
| | | HERSHA HOSPITALITY TRUST | —<br>(△ 29,200) | —<br>(△ 185) | — | — |
| | | HERSHA HOSPITALITY TRUST | 500<br>( 7,300) | 10<br>( 185) | 900 | 21 |
| | | HIGHWOODS PROPERTIES INC | 3,400 | 144 | 2,000 | 84 |
| | | HOME PROPERTIES INC | 400 | 29 | 500<br>( 8,200) | 36<br>( 595) |
| | | HOSPITALITY PROPERTIES TRUST | 5,400 | 137 | 4,300<br>( —) | 111<br>( 5) |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 27,800 | 450 | 22,000 | 375 |
| | | HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN | 3,900 | 108 | 700 | 20 |
| | | INDEPENDENCE REALTY TRUST IN | —<br>( 985) | —<br>( 7) | — | — |
| | | INLAND REAL ESTATE CORP | 900 | 9 | —<br>( 13,600) | —<br>( 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<br>( 52,790) | 40<br>( 849) |
| | | NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP | 4,190<br>( 26,395) | 60<br>( 713) | 1,695 | 25 |
| | | NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP | 702<br>( 8,798) | 8<br>( 135) | — | — |

| 銘柄 | | | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外国 | アメリカ | | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| | | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS | 6,200 | 210 | 3,800 | 132 |
| | | ONE LIBERTY PROPERTIES INC | 300 | 7 | 400 | 8 |
| | | PS BUSINESS PARKS INC/CA | 400 | 35 | 200 | 16 |
| | | PARKWAY PROPERTIES INC | 1,900 | 29 | 1,500 | 24 |
| | | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST | 3,200 | 99 | 2,900 | 96 |
| | | PENN REAL ESTATE INVEST TST | 2,300 | 48 | 1,800 | 39 |
| | | PHYSICIANS REALTY TRUST | 12,000 | 208 | 2,000 | 33 |
| | | PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A | 5,500 | 102 | 5,000 | 93 |
| | | POST PROPERTIES INC | 2,200 | 127 | 2,000 | 115 |
| | | PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC | 600 | 7 | — | — |
| | | PROLOGIS INC | 21,400 | 877 | 15,100 | 623 |
| | | PUBLIC STORAGE | 5,400 | 1,270 | 3,850 | 880 |
| | | QTS REALTY TRUST INC CL A | 5,000 | 216 | 800 | 35 |
| | | RLJ LODGING TRUST | 4,800 | 112 | 4,600 | 114 |
| | | RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES | 1,900 | 31 | 1,200 | 19 |
| | | REALTY INCOME CORP | 12,000 | 625 | 6,000 | 320 |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 3,200 | 220 | 2,000 | 135 |
| | | RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN | 1,900 | 33 | — | — |
| | | RETAIL PROPERTIES OF AME-A | 7,300 | 106 | 5,200 | 75 |
| | | REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC | 2,100 | 38 | — | — |
| | | ROUSE PROPERTIES INC | 1,100 | 18 | 600 | 10 |
| | | RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES | 1,800 | 94 | 1,300 | 68 |
| | | SL GREEN REALTY CORP | 3,500 | 367 | 2,500 | 269 |
| | | SABRA HEALTH CARE REIT INC | 2,800 | 61 | 1,100 | 24 |
| | | SAUL CENTERS INC | 100 | 4 | — | — |
| | | SELECT INCOME REIT | 5,600 | 107 | 1,500<br>( — ) | 29<br>( 2) |
| | | SENIOR HOUSING PROP TRUST | 7,100 | 110 | 4,900<br>( — ) | 81<br>( 6) |
| | | SERITAGE GROWTH PROP-A REIT | 2,500 | 104 | 400 | 19 |
| | | SILVER BAY REALTY TRUST CORP | 700 | 10 | 600 | 9 |
| | | SIMON PROPERTY GROUP INC | 11,000 | 2,098 | 8,550 | 1,639 |
| | | SOVRAN SELF STORAGE INC | 2,700 | 286 | 900 | 89 |
| | | SPIRIT REALTY CAPITAL INC | 16,000 | 167 | 5,900 | 60 |
| | | STAG INDUSTRIAL INC | 3,100 | 57 | 2,100 | 41 |
| | | STARWOOD WAYPOINT RESIDENTIAL TRUST | —<br>(△ 5,500) | —<br>(△ 137) | — | — |
| | | STORE CAPITAL CORP | 20,500 | 501 | 1,300 | 33 |
| | | STRATEGIC HOTELS & RESORTS INC | 5,300 | 71 | 5,100<br>( 40,100) | 68<br>( 484) |
| | | SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC | 1,100 | 11 | 500 | 6 |
| | | SUN COMMUNITIES INC | 3,350 | 225 | 850 | 57 |
| | | SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC | 9,353<br>( 947) | 125<br>( 10) | 7,100 | 99 |
| | | TANGER FACTORY OUTLET CENTER | 4,200 | 140 | 3,300 | 111 |
| | | TAUBMAN CENTERS INC | 1,700 | 122 | 1,500 | 108 |

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外国 | アメリカ | 口 | 千米ドル | 口 | 千米ドル |
| | TERRENO REALTY CORP | 700 | 15 | — | — |
| | TRADE STREET RESIDENTIAL INC | — | — | —<br>( 2,400) | —<br>( 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<br>( 127,000) | 211<br>( 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<br>( 50,000) | 682<br>( 3,384) | 5,900 | 394 |
| | WHITESTONE REIT | 700 | 8 | — | — |
| | WINTHROP REALTY TRUST | 6,100 | 87 | 700<br>( —) | 10<br>( 10) |
| | XENIA HOTELS & RESORTS INC | 3,600 | 65 | 2,600 | 52 |
| | 小計 | 894,456<br>( 222,620) | 30,180<br>( 2,553) | 492,704<br>(338,190) | 18,462<br>( 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 | —<br>( 10,200) | —<br>( 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 INVSTMNT-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 | — | — | —<br>( 2,400) | —<br>( 56) |
| | NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST | 700<br>( 2,400) | 11<br>( 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 | — | — |
| | | | | (—) | (0.11739) |
| | SLATE RETAIL REIT-RIGHTS | — | — | 1,600 | 0.08787 |
| | | (1,600) | (0.11739) | | |
| | SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,000 | 90 | 3,500 | 101 |
| | | (10,200) | (290) | | |
| | 小計 | 58,890 | 1,138 | 41,590 | 822 |
| | | (20,770) | (370) | (19,170) | (370) |
| | イギリス | | 千英ポンド | | 千英ポンド |
| 外 | 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 | — | — |
| 国 | 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 | 9,000 | 12 |
| | | (—) | (0.53819) | (—) | (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 | 40,490 | 22 |
| | | (—) | (2) | (—) | (2) |
| | ASSURA PLC-RIGHTS | — | — | — | — |
| | | (28,142) | (2) | (28,142) | (2) |

| 銘柄 | | | 買付 | | 売付 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 外国 | イギリス | | 口 | 千英ポンド | 口 | 千英ポンド |
| | | PRIMARY HEALTH PROPERTIES | 24,200<br>( 66,800) | 25<br>( 65) | —<br>( —) | —<br>(0.56478) |
| | | PRIMARY HEALTH PROPERTIES-RIGHTS | —<br>( 6,680) | —<br>( 0.56478) | —<br>( 6,680) | —<br>(0.56478) |
| | | REGIONAL REIT LTD | 26,000 | 26 | — | — |
| | 小計 | | 719,140<br>( 118,379) | 1,860<br>( 73) | 291,810<br>( 68,279) | 1,274<br>( 73) |
| | ユーロ | | | 千ユーロ | | 千ユーロ |
| | | ドイツ | | | | |
| | | HAMBORNER REIT AG | 2,700<br>( 2,206) | 23<br>( 19) | 1,700<br>( —) | 14<br>( 1) |
| | | HAMBORNER REIT AG-RIGHTS | —<br>( 6,620) | —<br>( 1) | 2<br>( 6,618) | 0.00009<br>( 0.9927) |
| | | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | 5,400 | 66 | 1,400<br>( —) | 17<br>( 7) |
| | | 小計 | 8,100<br>( 8,826) | 90<br>( 20) | 3,102<br>( 6,618) | 32<br>( 9) |
| | | イタリア | | | | |
| | | BENI STABILI SPA | 22,000 | 15 | —<br>( —) | —<br>( 3) |
| | | IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ | 10,000 | 8 | 10,000 | 8 |
| | | 小計 | 32,000 | 23 | 10,000<br>( —) | 8<br>( 3) |
| | | フランス | | | | |
| | | AFFINE | 900 | 14 | — | — |
| | | ICADE | 1,500 | 94 | 710 | 47 |
| | | ALTAREA | — | — | —<br>( —) | —<br>( 7) |
| | | ALTAREA-RIGHTS | —<br>( 320) | —<br>( 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<br>( —) | 183<br>( 8) |
| | | MERCIALYS | — | — | 5,400 | 102 |
| | | FONCIERE DES MURS | 1,300 | 33 | —<br>( —) | —<br>( 1) |
| | | UNIBAIL RODAMCO-NA | 3,530 | 830 | 2,650 | 630 |
| | | 小計 | 18,100<br>( 320) | 1,607<br>( 0.84285) | 21,225<br>( —) | 1,459<br>( 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 | | 口 | 千ユーロ | 口 | 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<br>(—) | 230<br>(0.6924) | 50,400<br>(—) | 118<br>(1) |
| | ASCENDAS REAL ESTATE INV-RTS | —<br>(11,118) | —<br>(0.6924) | —<br>(11,118) | —<br>(0.6924) |
| | CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 66,200 | 90 | 58,000 | 80 |
| | SUNTEC REIT | 133,400 | 213 | 120,200<br>(—) | 194<br>(3) |
| | MAPLETREE LOGISTICS TRUST | 20,000 | 20 | —<br>(—) | —<br>(2) |
| | STARHILL GLOBAL REIT | 50,800 | 41 | 51,900<br>(—) | 45<br>(1) |
| | ASCOTT RESIDENCE TRUST | 35,100<br>(—) | 43<br>(0.03348) | 35,800<br>(—) | 45<br>(8) |
| | FRASERS COMMERCIAL TRUST | 15,000 | 20 | —<br>(—) | —<br>(0.11075) |
| | KEPPEL REIT | 52,600 | 47 | 26,300<br>(—) | 23<br>(1) |
| | FRASERS CENTREPOINT TRUST | 10,500 | 20 | — | — |
| | CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST | 28,300 | 17 | 45,000<br>(—) | 27<br>(0.1275) |
| | CDL HOSPITALITY TRUSTS | 11,400 | 14 | —<br>(—) | —<br>(0.1089) |
| | CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST | 67,300 | 99 | 44,800<br>(—) | 68<br>(8) |
| | FIRST REAL ESTATE INVT TRUST | 11,100 | 13 | 15,500<br>(—) | 21<br>(2) |
| | PARKWAY LIFE REAL ESTATE | 9,000 | 20 | —<br>(—) | —<br>(1) |
| | LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST | 48,300 | 17 | 64,300<br>(—) | 23<br>(3) |
| | MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST | 66,200 | 103 | 61,000<br>(—) | 97<br>(0.0871) |
| | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | 34,800 | 49 | 15,500 | 22 |
| | CACHE LOGISTICS TRUST | 37,000 | 35 | 20,000<br>(—) | 20<br>(1) |
| | AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT | 37,000 | 52 | 29,200<br>(—) | 42<br>(0.50243) |
| | SABANA SHARIAH COMP IND REIT | 21,200 | 15 | 27,000 | 20 |
| | MAPLETREE GREATER CHINA COMM | 44,300 | 41 | 22,100<br>(—) | 22<br>(3) |
| | ASCENDAS HOSPITALITY TRUST | — | — | —<br>(—) | —<br>(1) |
| | FAR EAST HOSPITALITY TRUST | 22,000 | 13 | — | — |
| | SPH REIT | 15,500 | 14 | — | — |
| | OUE HOSPITALITY TRUST | 26,800<br>(38,643) | 21<br>(28) | 24,700<br>(—) | 22<br>(7) |

| 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 |
| | 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 | 口 | 千ニュージーランドドル | 口 | 千ニュージーランドドル |
| | PROPERTY FOR INDUSTRY LTD | 9,000<br>( 5,425) | 14<br>( 8) | 12,000<br>( —) | 18<br>(0.43542) |
| | PROPERTY FOR INDUSTRY LTD-RIGHTS | —<br>( 5,425) | —<br>( 0.43542) | —<br>( 5,425) | —<br>(0.43542) |
| | STRIDE PROPERTY LTD | 17,000 | 35 | — | — |
| | KIWI PROPERTY GROUP LTD | 20,000 | 26 | — | — |
| | 小計 | 105,900<br>( 10,850) | 154<br>( 8) | 35,000<br>( 5,425) | 44<br>(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<br>764 | 百万円<br>703 | 百万円<br>— | 百万円<br>— |

＊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 | うち利害関係人との取引状況B | B/A | 売付額等 C | うち利害関係人との取引状況D | D/C |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 4,097 | 231 | 5.6 | 3,295 | 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 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 口数 | 口数 | 評価額 | | 比率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 口 | 口 | 千米ドル | 千円 | % |
| ACADIA REALTY TRUST | 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 | |
| 小計 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 | |
| 小計 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 PROPERTI-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) | | 口 | 口 | 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 | |
| 小計 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) | | | | 千新シェケル | | |
| 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 | 当期末 比率 |
|---|---|---|
| | 千円 | % |
| 投資証券 | 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<br>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＞