

野村資産設計ファンド＜愛称:未来時計＞

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

運用報告書(全体版)

2015 作成対象期間 (2016年12月23日～2017年6月22日) 第34期 (決算日2017年1月23日) 第35期 (決算日2017年2月22日) 第36期 (決算日2017年3月22日)
第37期 (決算日2017年4月24日) 第38期 (決算日2017年5月22日) 第39期 (決算日2017年6月22日)

2020／2025／2030／2035／2040 作成対象期間 (2016年12月23日～2017年6月22日) 第19期 (決算日2017年6月22日)
2045 作成対象期間 (2016年12月23日～2017年6月22日) 第14期 (決算日2017年6月22日)
2050 作成対象期間 (2016年12月23日～2017年6月22日) 第4期 (決算日2017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。

商品分類		野村資産設計ファンド								
		2015	2020	2025	2030	2035	2040	2045	2050	
追加型投信／内外／資産複合／インデックス型										
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) 2010年9月10日以降、無期限とします。(2045) 2015年9月17日以降、無期限とします。(2050)								
運用方針		各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内及び外国の各債券、各株式、各不動産投資信託証券(REIT)に実質的に投資し、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行うことを基本とします。各ファンドには、それぞれ安定運用開始時期(ターゲットイヤー)が定められており、当初設定以降、安定運用開始時期に近づくにつれて、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。 ＜2016年7月1日時点の各マザーファンド受益証券への基本投資割合＞								
		2015	2020	2025	2030	2035	2040	2045	2050	
		国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	60%	48%	37%	27%	21%	16%	13%	10.5%
		外国債券マザーファンド	10%	11.7%	12.5%	12.5%	12.5%	12.5%	10.8%	8.8%
		新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド		2.3%	2.5%	2.5%	2.5%	2.5%	2.2%	1.7%
		国内株式マザーファンド	10%	14%	19%	22%	24.5%	29%	32%	34.5%
		外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	10%	8.4%	11.5%	13.3%	14.8%	17.5%	19.3%	20.8%
		新興国株式マザーファンド		5.6%	7.5%	8.7%	9.7%	11.5%	12.7%	13.7%
		J-REITインデックス マザーファンド	5%	5%	5%	7%	7.5%	5.5%	5%	5%
		海外REITインデックス マザーファンド	5%	5%	5%	7%	7.5%	5.5%	5%	5%
		※安定運用開始時期の到来以降の各マザーファンド受益証券への基本投資割合は、国内債券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。 ※「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。								
野村資産設計ファンド		主な投資対象			主な投資制限					
		「国内債券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			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			外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。					
		新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド			外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。					
		国内株式マザーファンド			株式への投資割合には制限を設けません。					
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド			株式への投資割合には制限を設けません。					
		新興国株式マザーファンド			株式への投資割合には制限を設けません。					
		J-REITインデックス マザーファンド			投資信託証券への投資割合には制限を設けません。					
		海外REITインデックス マザーファンド			投資信託証券への投資割合には制限を設けません。					
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	10 ページ	16 ページ	22 ページ	28 ページ	34 ページ	40 ページ	46 ページ
マザーファンドの運用経過	52 ページ							
各ファンドの信託財産の状況	55 ページ	64 ページ	72 ページ	80 ページ	88 ページ	96 ページ	104 ページ	112 ページ
マザーファンドの組入資産の明細 (2017年6月22日現在)	120 ページ							

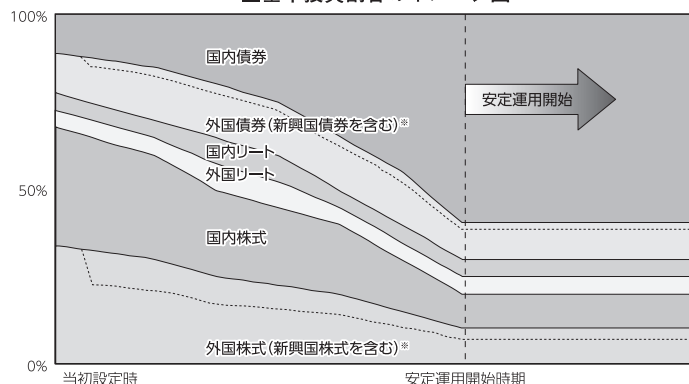
■各マザーファンドの運用状況のご報告

- | | |
|-----------------------------------|---------|
| 1. 国内株式マザーファンド 運用報告書 | 250 ページ |
| 2. 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 運用報告書 | 286 ページ |
| 3. 新興国株式マザーファンド 運用報告書 | 330 ページ |
| 4. 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド 運用報告書 | 361 ページ |
| 5. 外国債券マザーファンド 運用報告書 | 392 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 | 415 ページ |
| 7. J-REITインデックス マザーファンド 運用報告書 | 427 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 | 438 ページ |

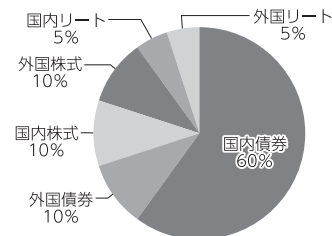
◎運用の概要

- (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



■安定運用開始時期の到来以降の基本投資割合



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

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

資産	実質的な投資をするマザーファンド	各マザーファンドの対象指数
国内債券	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	NOMURA-BPI総合
外国債券	外国債券マザーファンド	シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)
(新興国)	新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド	JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円換算ベース)
国内株式	国内株式マザーファンド	東証株価指数 (TOPIX)
外国株式	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・為替ヘッジなし)
(新興国)	新興国株式マザーファンド	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース)
国内REIT	J-REITインデックス マザーファンド	東証REIT指数 (配当込み)
外国REIT	海外REITインデックス マザーファンド	S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース)

- * 「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックスーエマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円換算ベース)」は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。
- * 「MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・為替ヘッジなし)」は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。
- * 「MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース)」は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・ドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。
- * 「S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、ドルベース) をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

○最近25期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	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
		税 込 分 配	み 金 期 騰 落 率		期 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
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
28期(2016年7月22日)	10,710	10	1.6	115.15	1.7	20.5	0.3	68.0	—	10.3	1,235
29期(2016年8月22日)	10,505	10	△1.8	113.07	△1.8	19.5	0.3	69.8	—	9.7	1,197
30期(2016年9月23日)	10,515	10	0.2	113.36	0.3	19.6	0.3	69.5	—	9.9	1,183
31期(2016年10月24日)	10,517	10	0.1	113.46	0.1	20.0	0.3	69.3	—	9.8	1,155
32期(2016年11月22日)	10,548	10	0.4	114.01	0.5	20.1	0.4	68.7	—	10.0	1,138
33期(2016年12月22日)	10,814	10	2.6	117.09	2.7	20.3	0.3	68.4	—	10.2	1,119
34期(2017年1月23日)	10,741	10	△0.6	116.51	△0.5	19.6	0.3	68.8	—	10.0	1,088
35期(2017年2月22日)	10,776	10	0.4	116.99	0.4	19.8	0.4	68.9	—	10.0	1,067
36期(2017年3月22日)	10,732	10	△0.3	116.76	△0.2	19.5	0.4	69.7	—	9.8	1,048
37期(2017年4月24日)	10,715	10	△0.1	116.44	△0.3	19.1	0.4	69.8	—	10.0	1,039
38期(2017年5月22日)	10,808	10	1.0	117.81	1.2	19.8	0.3	69.0	—	10.0	1,025
39期(2017年6月22日)	10,849	10	0.5	118.47	0.6	19.7	0.3	69.1	—	10.0	1,011

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

	’14年7月～’15年6月22日	’15年6月22日の翌日以降 ^(注1)
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合	57%	60%
[外国債券マザーファンド] シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)	8.8%	10% ^(注2)
[新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド] JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・ マーケット・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)	2.2%	
[国内株式マザーファンド] 東証株価指数(TOPIX)	11%	10%
[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)	6.7%	10% ^(注2)
[新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み・円換算ベース)	4.3%	
[J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数(配当込み)	5%	5%
[海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)	5%	5%

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

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

(注2) 各々、2本のマザーファンドの合計の投資割合とします。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組入比率	株 式 先物比率	債 券 組入比率	債 券 先物比率	投資信託 証 券 組入比率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率					
第34期	(期 首) 2016年12月22日	円 10,814	% —	117.09	% —	% 20.3	% 0.3	% 68.4	% —	% 10.2
	12月末	10,801	△0.1	116.90	△0.2	20.0	0.4	68.3	—	10.3
	(期 末) 2017年1月23日	10,751	△0.6	116.51	△0.5	19.6	0.3	68.8	—	10.0
第35期	(期 首) 2017年1月23日	10,741	—	116.51	—	19.6	0.3	68.8	—	10.0
	1月末	10,728	△0.1	116.35	△0.1	19.6	0.4	69.0	—	9.9
	(期 末) 2017年2月22日	10,786	0.4	116.99	0.4	19.8	0.4	68.9	—	10.0
第36期	(期 首) 2017年2月22日	10,776	—	116.99	—	19.8	0.4	68.9	—	10.0
	2月末	10,776	0.0	117.03	0.0	19.5	0.4	69.1	—	10.0
	(期 末) 2017年3月22日	10,742	△0.3	116.76	△0.2	19.5	0.4	69.7	—	9.8
第37期	(期 首) 2017年3月22日	10,732	—	116.76	—	19.5	0.4	69.7	—	9.8
	3月末	10,738	0.1	116.72	△0.0	19.4	0.5	69.5	—	9.8
	(期 末) 2017年4月24日	10,725	△0.1	116.44	△0.3	19.1	0.4	69.8	—	10.0
第38期	(期 首) 2017年4月24日	10,715	—	116.44	—	19.1	0.4	69.8	—	10.0
	4月末	10,778	0.6	117.32	0.8	19.4	0.5	69.3	—	9.9
	(期 末) 2017年5月22日	10,818	1.0	117.81	1.2	19.8	0.3	69.0	—	10.0
第39期	(期 首) 2017年5月22日	10,808	—	117.81	—	19.8	0.3	69.0	—	10.0
	5月末	10,812	0.0	117.89	0.1	19.7	0.4	68.8	—	10.0
	(期 末) 2017年6月22日	10,859	0.5	118.47	0.6	19.7	0.3	69.1	—	10.0

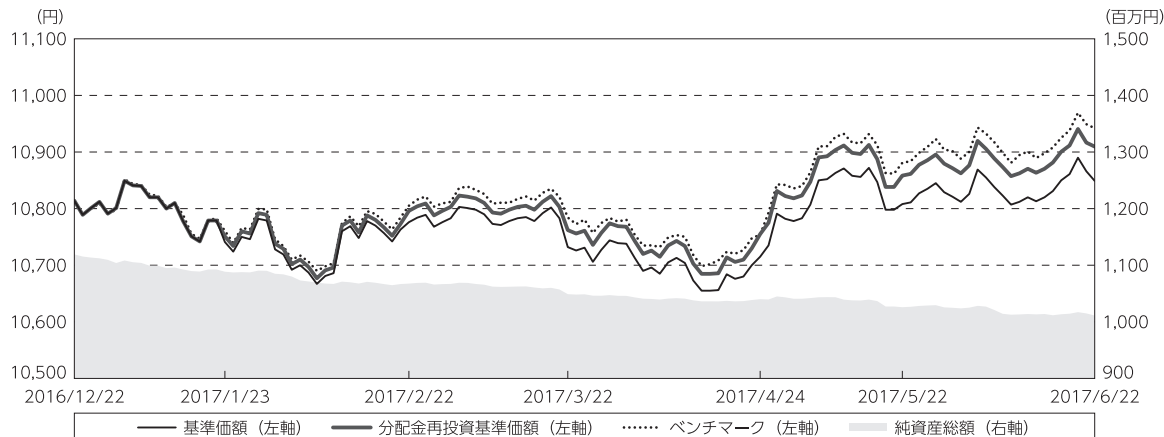
* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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34期首：10,814円

第39期末：10,849円 (既払分配金(税込み)：60円)

騰落率：0.9% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2016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(2016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34期首10,814円から第39期末10,849円(分配落ち後)となりました。この間、分配金として1万口当たり合計60円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値上がり額は95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、新興国株式(+12.7%)、国内株式(+5.5%)、外国株式(+4.4%)、新興国債券(+4.2%)、外国REIT(+0.9%)、国内債券(+0.0%)が上昇し、国内REIT(-2.6%)、外国債券(-0.3%)は下落しました。

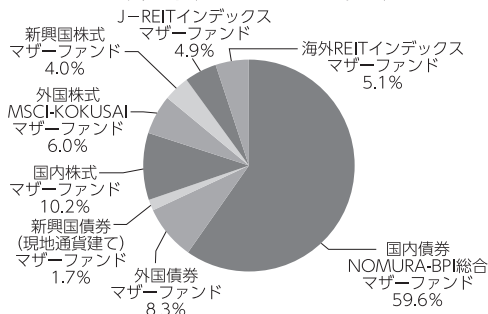
国内株式や新興国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

資 産	変動要因等
国 内 債 券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことなどを背景に、国内債券利回りはやや上昇（価格は下落）しました。利金収入からリターンはほぼ横ばいとなりました。
外 国 債 券	ユーロ圏の景況感回復やECB（欧州中央銀行）による金融緩和姿勢の後退懸念から、ユーロ圏の債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、米国では、政策金利引き上げに伴い短期債券利回りは上昇しましたが、インフレ率の鈍化や将来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長期債券利回りが低下（価格は上昇）し、米国債券利回りは低下しました。外国債券全体の利回りは米国を中心に低下しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	ブラジルやロシアにおける政策金利の引き下げや、大手格付機関によるインドネシアの格付け引き上げなどを背景に、新興国債券利回りは低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 株 式	国内企業の2017年1～3月期決算が概ね良好な結果となったことや、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 株 式	ユーロ圏の景況感回復やフランス大統領選においてEU（欧州連合）離脱に消極的なマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したこと、米国・欧州における堅調な企業業績などを背景に、欧州を中心に上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	中国における堅調な不動産販売や政府によるインフラ投資計画の公表、韓国における新大統領の景気刺激策への期待、外国株式市場の上昇などを背景に、アジアを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 R E I T	東京都心オフィスビルの平均賃料上昇は継続しましたが、空室率低下に一服感がみられることや、公募増資に伴う需給悪化懸念などを背景に、下落しました。
外 国 R E I T	米国の長期金利低下や外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2017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、当作成期間を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、52ページをご参照ください。

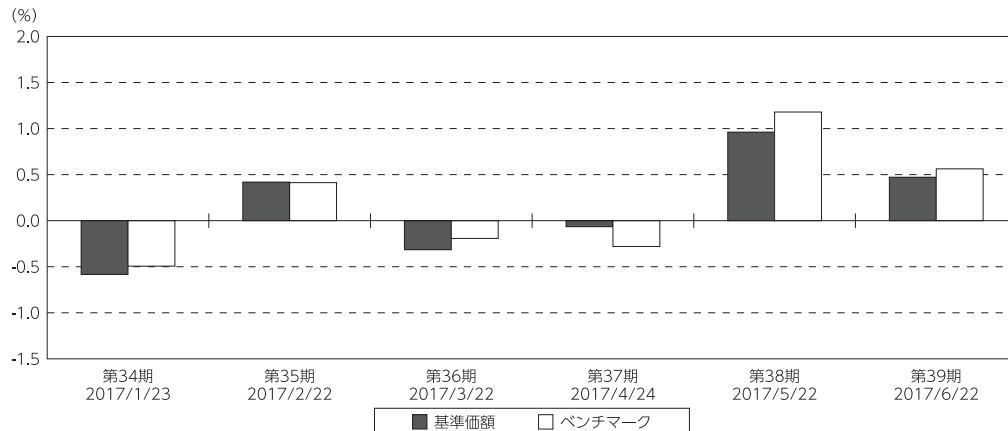
○当ファンドのベンチマークとの差異

基準価額の騰落率※は+0.9%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+1.2%を0.3ポイント下回りました。

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

※基準価額の騰落率は、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34期	第35期	第36期	第37期	第38期	第39期
	2016年12月23日～ 2017年1月23日	2017年1月24日～ 2017年2月22日	2017年2月23日～ 2017年3月22日	2017年3月23日～ 2017年4月24日	2017年4月25日～ 2017年5月22日	2017年5月23日～ 2017年6月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.093%	10 0.093%	10 0.093%	10 0.093%	10 0.092%	10 0.092%
当期の収益	7	10	6	10	10	10
当期の収益以外	2	—	3	—	—	—
翌期繰越分配対象額	1,547	1,549	1,546	1,552	1,554	1,558

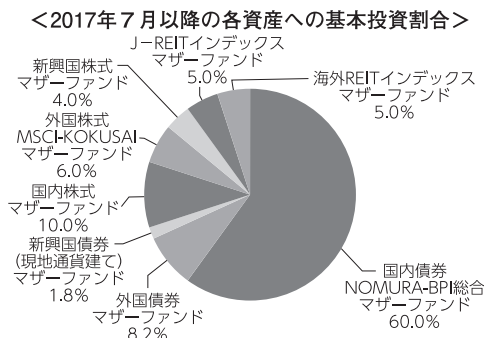
(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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、2017年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			ベンチマーク		株 式 組入比率	株 式 先物比率	債 券 組入比率	債 券 先物比率	投資信託 組入比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
15期(2015年6月22日)	10,890	5	3.3	114.20	3.5	30.8	0.5	58.0	—	10.0	1,085
16期(2015年12月22日)	10,541	5	△3.2	110.97	△2.8	28.3	0.6	60.2	—	10.1	1,013
17期(2016年6月22日)	10,223	5	△3.0	108.01	△2.7	27.9	0.7	60.6	—	10.0	885
18期(2016年12月22日)	10,732	5	5.0	113.83	5.4	28.3	0.4	60.4	—	10.2	903
19期(2017年6月22日)	10,873	5	1.4	115.76	1.7	27.6	0.4	61.2	—	10.1	898

- * 基準価額の騰落率は分配金込み。
- * 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。
- * 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- * 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
- * ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

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

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

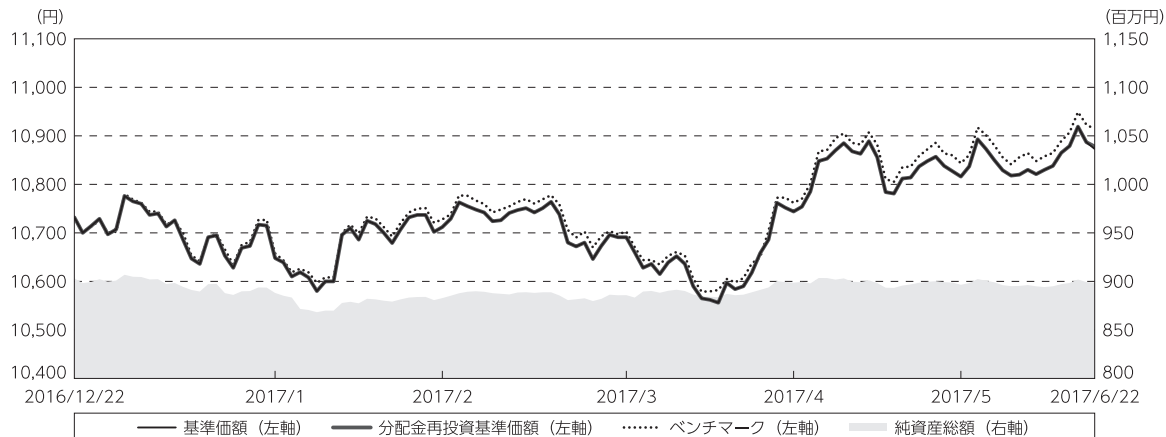
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%
2016年12月22日	10,732	—	113.83	—	28.3	0.4	60.4	—	10.2
12月末	10,707	△0.2	113.52	△0.3	27.8	0.5	60.5	—	10.3
2017年1月末	10,648	△0.8	113.05	△0.7	27.5	0.5	61.1	—	10.0
2月末	10,712	△0.2	113.79	△0.0	27.3	0.6	61.2	—	10.1
3月末	10,691	△0.4	113.52	△0.3	27.1	0.7	61.6	—	9.9
4月末	10,744	0.1	114.15	0.3	27.2	0.6	61.4	—	10.0
5月末	10,816	0.8	115.02	1.0	27.5	0.6	61.0	—	10.0
(期 末)									
2017年6月22日	10,878	1.4	115.76	1.7	27.6	0.4	61.2	—	10.1

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
* 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



- （注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成年首（2016年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、作成年首（2016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10,732円から期末10,878円（分配金込み）と146円の値上がりとなりました。

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、新興国株式（+12.7%）、国内株式（+5.5%）、外国株式（+4.4%）、新興国債券（+4.2%）、外国REIT（+0.9%）、国内債券（+0.0%）が上昇し、国内REIT（-2.6%）、外国債券（-0.3%）は下落しました。

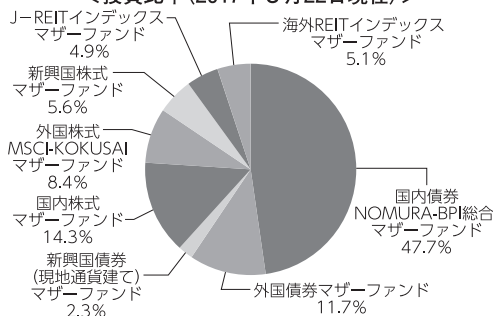
国内株式や新興国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

資 産	変動要因等
国 内 債 券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことなどを背景に、国内債券利回りはやや上昇（価格は下落）しました。利金収入からリターンはほぼ横ばいとなりました。
外 国 債 券	ユーロ圏の景況感回復やECB（欧州中央銀行）による金融緩和姿勢の後退懸念から、ユーロ圏の債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、米国では、政策金利引き上げに伴い短期債券利回りは上昇しましたが、インフレ率の鈍化や将来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長期債券利回りが低下（価格は上昇）し、米国債券利回りは低下しました。外国債券全体の利回りは米国を中心に低下しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	ブラジルやロシアにおける政策金利の引き下げや、大手格付機関によるインドネシアの格付け引き上げなどを背景に、新興国債券利回りは低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 株 式	国内企業の2017年1～3月期決算が概ね良好な結果となったことや、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 株 式	ユーロ圏の景況感回復やフランス大統領選においてEU（欧州連合）離脱に消極的なマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したこと、米国・欧州における堅調な企業業績などを背景に、欧州を中心に上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	中国における堅調な不動産販売や政府によるインフラ投資計画の公表、韓国における新大統領の景気刺激策への期待、外国株式市場の上昇などを背景に、アジアを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 R E I T	東京都心オフィスビルの平均賃料上昇は継続しましたが、空室率低下に一服感がみられることや、公募増資に伴う需給悪化懸念などを背景に、下落しました。
外 国 R E I T	米国の長期金利低下や外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2017年6月22日現在)>



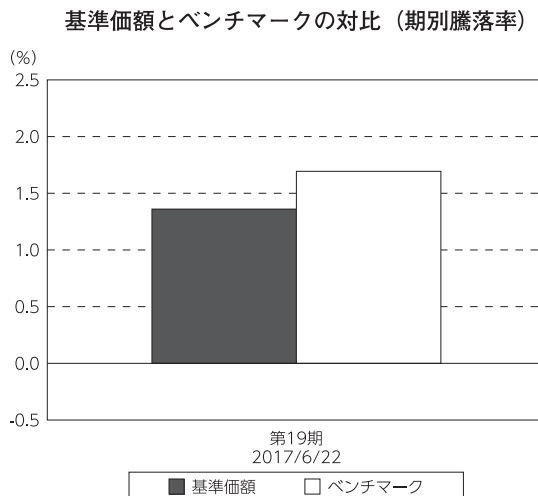
期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、期を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、52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+1.4%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+1.7%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。



(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19期
	2016年12月23日～ 2017年6月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.046%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,463

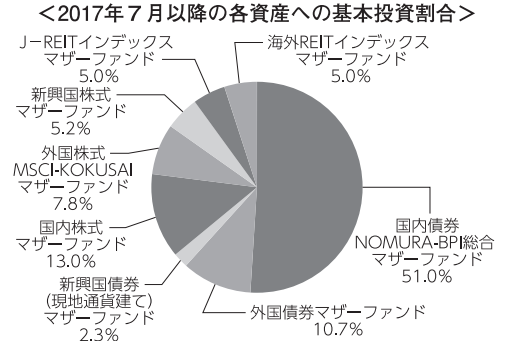
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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、2017年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			ベンチマーク		株 式 組入比率	株 式 先物比率	債 券 組入比率	債 券 先物比率	投資信託 組入比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
15期(2015年6月22日)	11,110	5	4.4	116.03	4.6	39.6	0.7	48.0	—	11.0	917
16期(2015年12月22日)	10,634	5	△4.2	111.45	△3.9	37.9	0.8	50.4	—	10.2	852
17期(2016年6月22日)	10,118	5	△4.8	106.43	△4.5	37.4	1.0	50.7	—	10.2	831
18期(2016年12月22日)	10,857	5	7.4	114.61	7.7	38.1	0.5	50.5	—	10.3	878
19期(2017年6月22日)	11,070	5	2.0	117.24	2.3	37.4	0.5	51.3	—	10.2	877

- * 基準価額の騰落率は分配金込み。
- * 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。
- * 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- * 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
- * ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

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

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

○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	%		%	%	%	%	%	%
2016年12月22日	10,857	—	114.61	—	38.1	0.5	50.5	—	10.3
12月末	10,818	△0.4	114.14	△0.4	37.6	0.7	50.6	—	10.3
2017年1月末	10,771	△0.8	113.81	△0.7	37.3	0.7	51.1	—	10.1
2月末	10,848	△0.1	114.68	0.1	37.0	0.8	51.2	—	10.2
3月末	10,833	△0.2	114.44	△0.1	36.8	0.9	51.7	—	10.0
4月末	10,893	0.3	115.13	0.5	36.9	0.9	51.4	—	10.1
5月末	10,995	1.3	116.31	1.5	37.3	0.8	51.0	—	10.1
(期 末)									
2017年6月22日	11,075	2.0	117.24	2.3	37.4	0.5	51.3	—	10.2

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

* 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



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作定期首（2016年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、作定期首（2016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10,857円から期末11,075円（分配金込み）と218円の値上がりとなりました。

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、新興国株式（+12.7%）、国内株式（+5.5%）、外国株式（+4.4%）、新興国債券（+4.2%）、外国REIT（+0.9%）、国内債券（+0.0%）が上昇し、国内REIT（-2.6%）、外国債券（-0.3%）は下落しました。

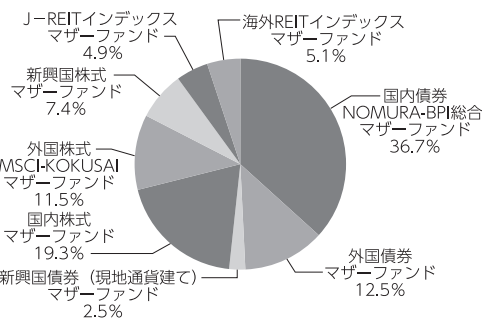
国内株式や新興国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

資 産	変動要因等
国 内 債 券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことなどを背景に、国内債券利回りはやや上昇（価格は下落）しました。利金収入からリターンはほぼ横ばいとなりました。
外 国 債 券	ユーロ圏の景況感回復やECB（欧州中央銀行）による金融緩和姿勢の後退懸念から、ユーロ圏の債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、米国では、政策金利引き上げに伴い短期債券利回りは上昇しましたが、インフレ率の鈍化や将来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長期債券利回りが低下（価格は上昇）し、米国債券利回りは低下しました。外国債券全体の利回りは米国を中心に低下しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	ブラジルやロシアにおける政策金利の引き下げや、大手格付機関によるインドネシアの格付け引き上げなどを背景に、新興国債券利回りは低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 株 式	国内企業の2017年1－3月期決算が概ね良好な結果となったことや、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 株 式	ユーロ圏の景況感回復やフランス大統領選においてEU（欧州連合）離脱に消極的なマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したこと、米国・欧州における堅調な企業業績などを背景に、欧州を中心に上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	中国における堅調な不動産販売や政府によるインフラ投資計画の公表、韓国における新大統領の景気刺激策への期待、外国株式市場の上昇などを背景に、アジアを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 R E I T	東京都心オフィスビルの平均賃料上昇は継続しましたが、空室率低下に一服感がみられることや、公募増資に伴う需給悪化懸念などを背景に、下落しました。
外 国 R E I T	米国の長期金利低下や外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2017年6月22日現在)>



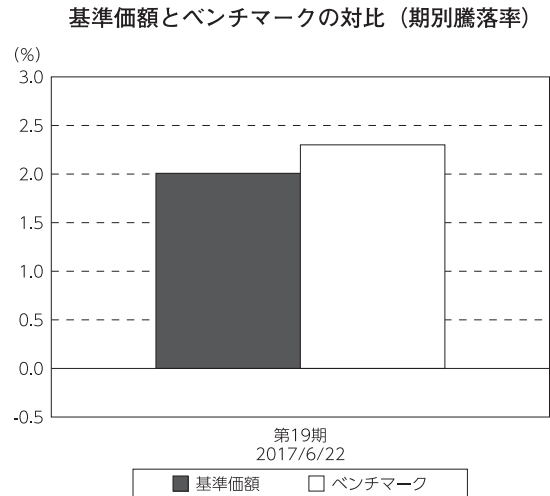
期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、期を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、52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+2.0%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+2.3%を0.3ポイント下回りました。

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



(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19期
	2016年12月23日～ 2017年6月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.045%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,641

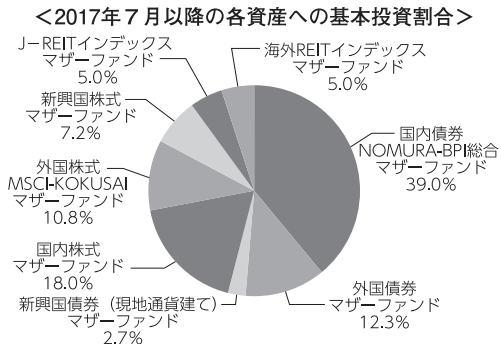
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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、2017年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			ベンチマーク		株 式 組入比率	株 式 先物比率	債 券 組入比率	債 券 先物比率	投資信託 組入比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
15期(2015年6月22日)	11,318	5	5.1	117.71	5.3	44.5	0.8	39.0	—	15.0	800
16期(2015年12月22日)	10,756	5	△4.9	112.24	△4.6	42.7	0.9	40.4	—	15.3	733
17期(2016年6月22日)	10,116	5	△5.9	105.93	△5.6	42.3	1.1	40.6	—	15.3	687
18期(2016年12月22日)	11,020	5	9.0	115.78	9.3	43.9	0.6	40.7	—	14.2	733
19期(2017年6月22日)	11,277	5	2.4	118.83	2.6	43.2	0.6	41.3	—	14.2	725

- * 基準価額の騰落率は分配金込み。
- * 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。
- * 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- * 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
- * ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

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

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

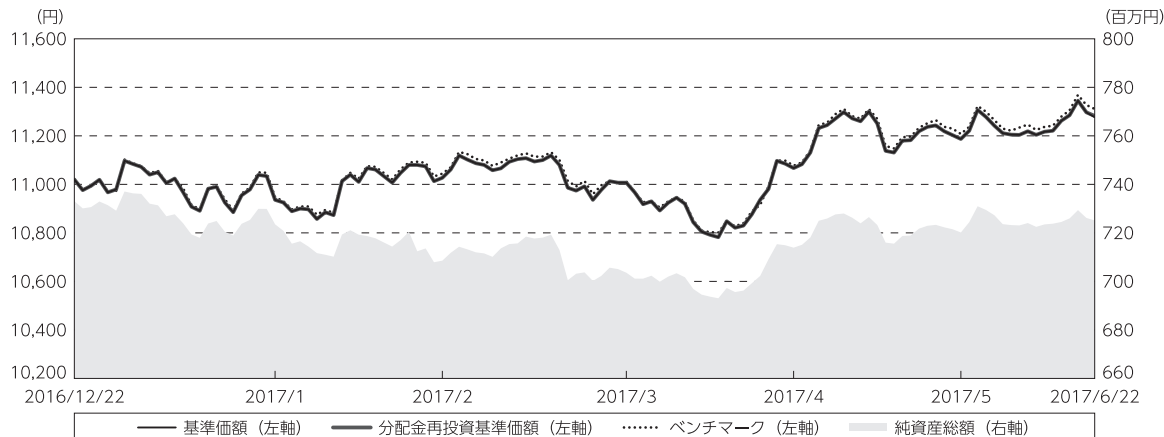
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式	株 式	債 券	債 券	投資信託 証券 組入比率
		騰 落 率		騰 落 率	組入比率	先物比率	組入比率	先物比率	
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%
2016年12月22日	11,020	—	115.78	—	43.9	0.6	40.7	—	14.2
12月末	10,979	△0.4	115.29	△0.4	43.3	0.8	40.7	—	14.3
2017年1月末	10,936	△0.8	115.02	△0.7	43.2	0.8	41.2	—	14.0
2月末	11,027	0.1	116.03	0.2	42.8	0.9	41.3	—	14.1
3月末	11,007	△0.1	115.70	△0.1	42.7	1.1	41.7	—	13.9
4月末	11,067	0.4	116.38	0.5	42.7	1.0	41.5	—	14.0
5月末	11,187	1.5	117.75	1.7	43.1	0.9	41.2	—	14.0
(期 末)									
2017年6月22日	11,282	2.4	118.83	2.6	43.2	0.6	41.3	—	14.2

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
* 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



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作定期首(2016年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、作定期首(2016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11,020円から期末11,282円(分配金込み)と262円の値上がりとなりました。

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、新興国株式(+12.7%)、国内株式(+5.5%)、外国株式(+4.4%)、新興国債券(+4.2%)、外国REIT(+0.9%)、国内債券(+0.0%)が上昇し、国内REIT(-2.6%)、外国債券(-0.3%)は下落しました。

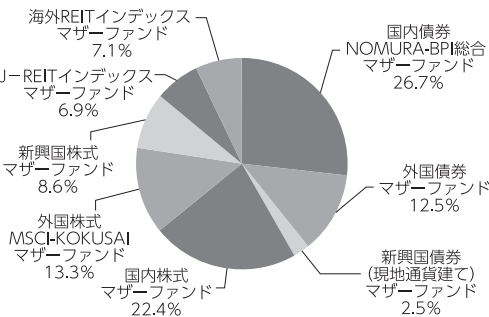
国内株式や新興国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

資 産	変動要因等
国 内 債 券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことなどを背景に、国内債券利回りはやや上昇（価格は下落）しました。利金収入からリターンはほぼ横ばいとなりました。
外 国 債 券	ユーロ圏の景況感回復やECB（欧州中央銀行）による金融緩和姿勢の後退懸念から、ユーロ圏の債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、米国では、政策金利引き上げに伴い短期債券利回りは上昇しましたが、インフレ率の鈍化や将来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長期債券利回りが低下（価格は上昇）し、米国債券利回りは低下しました。外国債券全体の利回りは米国を中心に低下しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	ブラジルやロシアにおける政策金利の引き下げや、大手格付機関によるインドネシアの格付け引き上げなどを背景に、新興国債券利回りは低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 株 式	国内企業の2017年1～3月期決算が概ね良好な結果となったことや、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 株 式	ユーロ圏の景況感回復やフランス大統領選においてEU（欧州連合）離脱に消極的なマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したこと、米国・欧州における堅調な企業業績などを背景に、欧州を中心に上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	中国における堅調な不動産販売や政府によるインフラ投資計画の公表、韓国における新大統領の景気刺激策への期待、外国株式市場の上昇などを背景に、アジアを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 R E I T	東京都心オフィスビルの平均賃料上昇は継続しましたが、空室率低下に一服感がみられることや、公募増資に伴う需給悪化懸念などを背景に、下落しました。
外 国 R E I T	米国の長期金利低下や外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2017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。

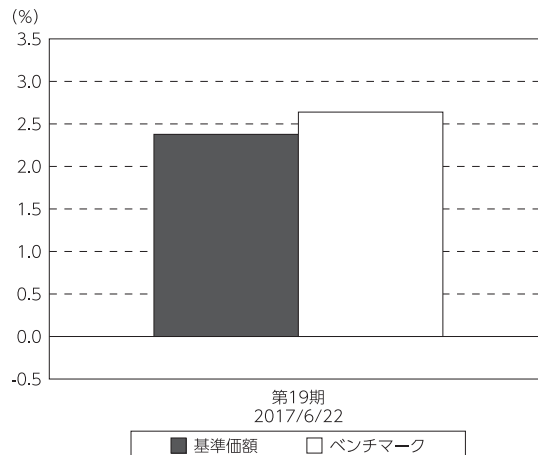
マザーファンドの運用経過については、52ページをご参照ください。

○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+2.4%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+2.6%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19期
	2016年12月23日～ 2017年6月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.044%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,255

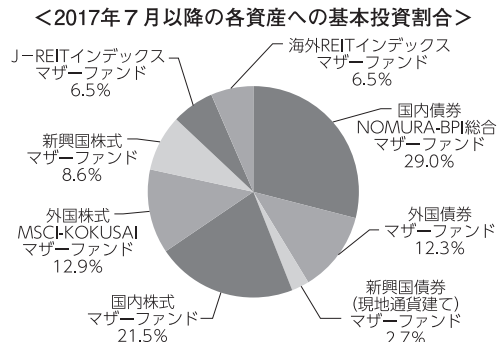
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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、2017年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			ベンチマーク		株 式 組入比率	株 式 先物比率	債 券 組入比率	債 券 先物比率	投資信託 組入比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
15期(2015年6月22日)	11,158	5	5.9	115.21	6.0	50.3	0.9	34.0	—	14.1	528
16期(2015年12月22日)	10,546	5	△ 5.4	109.23	△ 5.2	47.6	1.0	35.3	—	15.3	481
17期(2016年6月22日)	9,829	0	△ 6.8	102.09	△ 6.5	47.2	1.3	35.6	—	15.4	454
18期(2016年12月22日)	10,824	5	10.2	112.78	10.5	48.7	0.7	34.8	—	15.2	495
19期(2017年6月22日)	11,110	5	2.7	116.09	2.9	48.1	0.7	35.4	—	15.2	496

- * 基準価額の騰落率は分配金込み。
- * 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。
- * 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- * 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
- * ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

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

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

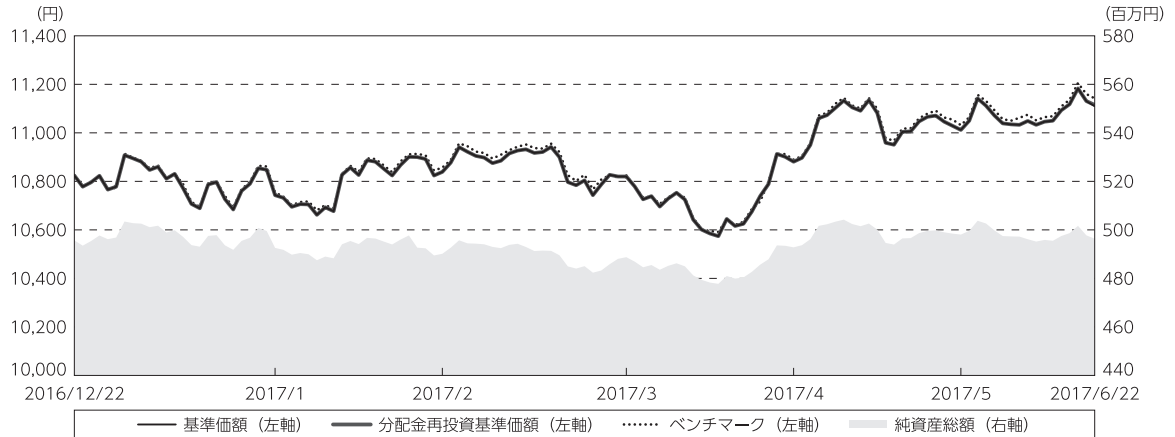
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額	ベンチ マ ー ク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率					
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%
2016年12月22日	10,824	—	112.78	—	48.7	0.7	34.8	—	15.2
12月末	10,778	△0.4	112.25	△0.5	48.1	0.9	34.9	—	15.3
2017年1月末	10,743	△0.7	112.06	△0.6	48.1	0.9	35.2	—	15.0
2月末	10,839	0.1	113.12	0.3	47.7	1.0	35.3	—	15.2
3月末	10,820	△0.0	112.79	0.0	47.5	1.2	35.8	—	14.9
4月末	10,881	0.5	113.46	0.6	47.6	1.1	35.6	—	15.0
5月末	11,012	1.7	114.95	1.9	47.9	1.0	35.3	—	15.0
(期 末)									
2017年6月22日	11,115	2.7	116.09	2.9	48.1	0.7	35.4	—	15.2

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
* 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：10,824円

期 末：11,110円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率： 2.7% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作定期首(2016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、作定期首(2016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10,824円から期末11,115円(分配金込み)と291円の値上がりとなりました。

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、新興国株式(+12.7%)、国内株式(+5.5%)、外国株式(+4.4%)、新興国債券(+4.2%)、外国REIT(+0.9%)、国内債券(+0.0%)が上昇し、国内REIT(-2.6%)、外国債券(-0.3%)は下落しました。

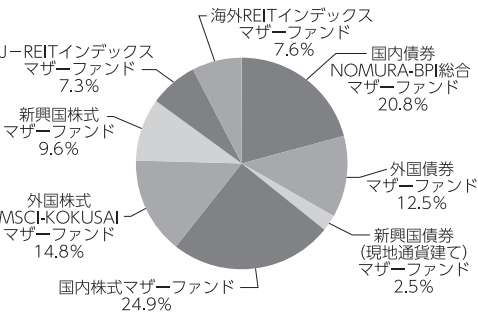
国内株式や新興国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

資 産	変動要因等
国 内 債 券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことなどを背景に、国内債券利回りはやや上昇（価格は下落）しました。利金収入からリターンはほぼ横ばいとなりました。
外 国 債 券	ユーロ圏の景況感回復やECB（欧州中央銀行）による金融緩和姿勢の後退懸念から、ユーロ圏の債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、米国では、政策金利引き上げに伴い短期債券利回りは上昇しましたが、インフレ率の鈍化や将来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長期債券利回りが低下（価格は上昇）し、米国債券利回りは低下しました。外国債券全体の利回りは米国を中心に低下しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	ブラジルやロシアにおける政策金利の引き下げや、大手格付機関によるインドネシアの格付け引き上げなどを背景に、新興国債券利回りは低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 株 式	国内企業の2017年1－3月期決算が概ね良好な結果となったことや、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 株 式	ユーロ圏の景況感回復やフランス大統領選においてEU（欧州連合）離脱に消極的なマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したこと、米国・欧州における堅調な企業業績などを背景に、欧州を中心に上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	中国における堅調な不動産販売や政府によるインフラ投資計画の公表、韓国における新大統領の景気刺激策への期待、外国株式市場の上昇などを背景に、アジアを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 R E I T	東京都心オフィスビルの平均賃料上昇は継続しましたが、空室率低下に一服感がみられることや、公募増資に伴う需給悪化懸念などを背景に、下落しました。
外 国 R E I T	米国の長期金利低下や外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2017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。

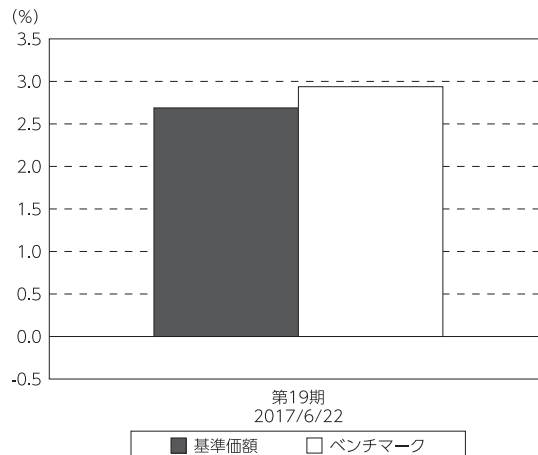
マザーファンドの運用経過については、52ページをご参照ください。

○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+2.7%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+2.9%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19期
	2016年12月23日～ 2017年6月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.045%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	3,392

(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。

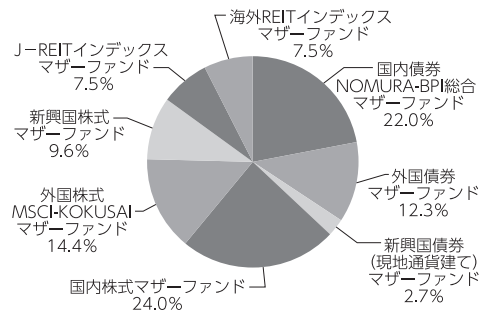
(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎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、2017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。

<2017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 組入比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
15期(2015年6月22日)	11,121	5	6.9	114.27	7.0	59.1	1.0	29.0	—	10.3	1,554
16期(2015年12月22日)	10,407	5	△ 6.4	107.23	△ 6.2	57.3	1.2	30.4	—	10.5	1,385
17期(2016年6月22日)	9,537	0	△ 8.4	98.50	△ 8.1	56.9	1.5	30.5	—	10.5	1,257
18期(2016年12月22日)	10,669	5	11.9	110.49	12.2	57.5	0.8	29.9	—	11.3	1,342
19期(2017年6月22日)	11,021	5	3.3	114.37	3.5	56.9	0.8	30.5	—	11.3	1,227

- * 基準価額の騰落率は分配金込み。
- * 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。
- * 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- * 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
- * ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

	’14年7月～’15年6月末	’15年7月～’16年6月末	’16年7月以降
〔国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド〕 NOMURA-BPI総合	14.5%	15%	16%
〔外国債券マザーファンド〕 シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	11.6%	12.1%	12.5%
〔新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド〕 JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・ マーケット・グローバル・ディバシファイド（円換算ベース）	2.9%	2.9%	2.5%
〔国内株式マザーファンド〕 東証株価指数（TOPIX）	30.5%	30%	29%
〔外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド〕 MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）	18.6%	18.2%	17.5%
〔新興国株式マザーファンド〕 MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）	11.9%	11.8%	11.5%
〔J-REITインデックス マザーファンド〕 東証REIT指数（配当込み）	5%	5%	5.5%
〔海外REITインデックス マザーファンド〕 S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）	5%	5%	5.5%

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

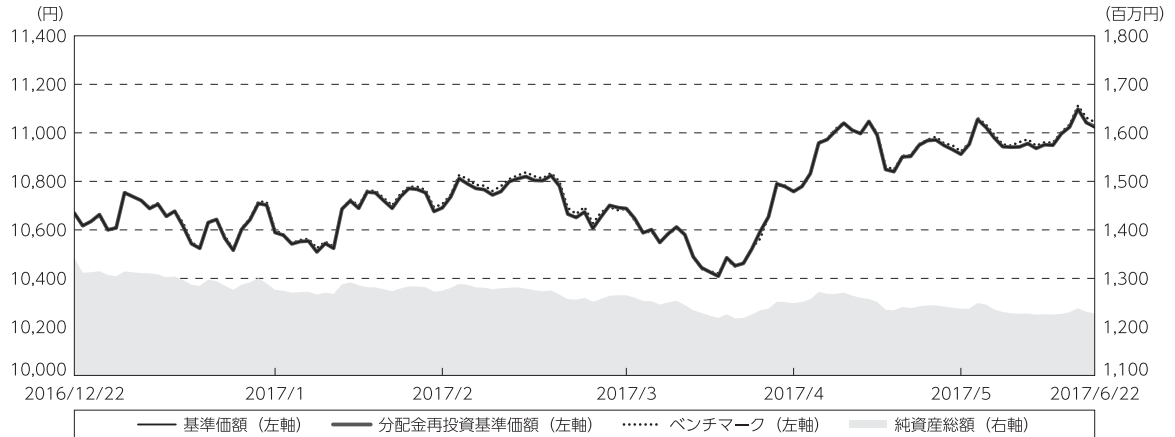
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率		騰 落 率						
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%
2016年12月22日	10,669	—	110.49	—	57.5	0.8	29.9	—	11.3
12月末	10,608	△0.6	109.79	△0.6	56.8	1.0	30.0	—	11.4
2017年1月末	10,589	△0.7	109.76	△0.7	56.8	1.0	30.3	—	11.2
2月末	10,691	0.2	110.88	0.4	56.4	1.2	30.4	—	11.3
3月末	10,688	0.2	110.68	0.2	56.2	1.4	30.8	—	11.1
4月末	10,758	0.8	111.42	0.8	56.3	1.3	30.6	—	11.2
5月末	10,912	2.3	113.12	2.4	56.6	1.2	30.3	—	11.2
(期 末)									
2017年6月22日	11,026	3.3	114.37	3.5	56.9	0.8	30.5	—	11.3

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
* 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



- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成年首（2016年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、作成年首（2016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10,669円から期末11,026円（分配金込み）と357円の値上がりとなりました。

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、新興国株式（+12.7%）、国内株式（+5.5%）、外国株式（+4.4%）、新興国債券（+4.2%）、外国REIT（+0.9%）、国内債券（+0.0%）が上昇し、国内REIT（-2.6%）、外国債券（-0.3%）は下落しました。

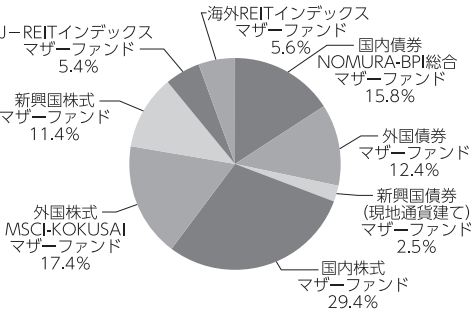
国内株式や新興国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

資 産	変動要因等
国 内 債 券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことなどを背景に、国内債券利回りはやや上昇（価格は下落）しました。利金収入からリターンはほぼ横ばいとなりました。
外 国 債 券	ユーロ圏の景況感回復やECB（欧州中央銀行）による金融緩和姿勢の後退懸念から、ユーロ圏の債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、米国では、政策金利引き上げに伴い短期債券利回りは上昇しましたが、インフレ率の鈍化や将来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長期債券利回りが低下（価格は上昇）し、米国債券利回りは低下しました。外国債券全体の利回りは米国を中心に低下しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	ブラジルやロシアにおける政策金利の引き下げや、大手格付機関によるインドネシアの格付け引き上げなどを背景に、新興国債券利回りは低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 株 式	国内企業の2017年1－3月期決算が概ね良好な結果となったことや、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 株 式	ユーロ圏の景況感回復やフランス大統領選においてEU（欧州連合）離脱に消極的なマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したこと、米国・欧州における堅調な企業業績などを背景に、欧州を中心に上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	中国における堅調な不動産販売や政府によるインフラ投資計画の公表、韓国における新大統領の景気刺激策への期待、外国株式市場の上昇などを背景に、アジアを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 R E I T	東京都心オフィスビルの平均賃料上昇は継続しましたが、空室率低下に一服感がみられることや、公募増資に伴う需給悪化懸念などを背景に、下落しました。
外 国 R E I T	米国の長期金利低下や外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2017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。

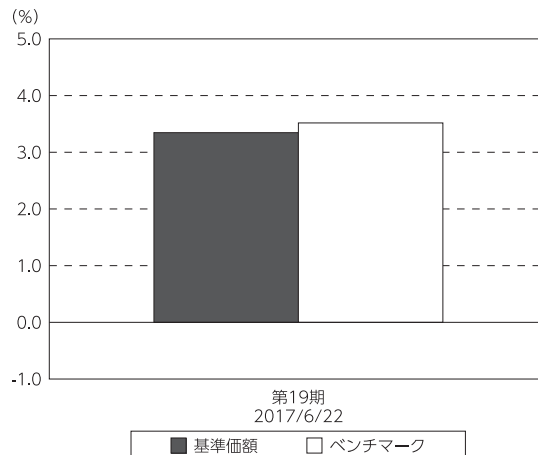
マザーファンドの運用経過については、52ページをご参照ください。

○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+3.3%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+3.5%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19期
	2016年12月23日～ 2017年6月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.045%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,978

(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。

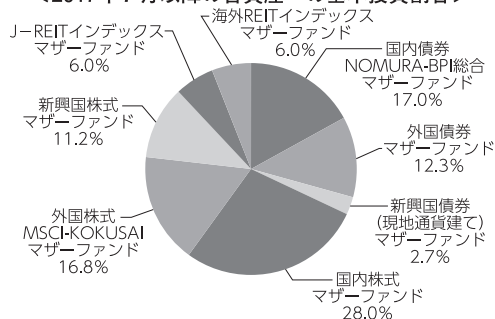
(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎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、2017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。

＜2017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 組入比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率						
	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
10期(2015年6月22日)	19,595	5	7.7	195.16	7.7	64.0	1.1	24.1	—	10.3	135
11期(2015年12月22日)	18,275	5	△ 6.7	182.28	△ 6.6	62.2	1.3	25.3	—	10.6	121
12期(2016年6月22日)	16,647	5	△ 8.9	166.40	△ 8.7	61.8	1.6	25.5	—	10.6	113
13期(2016年12月22日)	18,834	5	13.2	188.56	13.3	63.2	0.9	25.1	—	10.3	123
14期(2017年6月22日)	19,535	5	3.7	195.87	3.9	62.7	0.9	25.5	—	10.4	120

- * 基準価額の騰落率は分配金込み。
- * 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。
- * 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- * 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
- * ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

	’14年7月～’15年6月末	’15年7月～’16年6月末	’16年7月以降
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド] NOMURA-BPI総合	12%	12.5%	13%
[外国債券マザーファンド] シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	9.6%	10.1%	10.8%
[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド] JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・ マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）	2.4%	2.4%	2.2%
[国内株式マザーファンド] 東証株価指数（TOPIX）	33%	32.5%	32%
[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド] MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）	20.2%	19.7%	19.3%
[新興国株式マザーファンド] MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）	12.8%	12.8%	12.7%
[J-REITインデックス マザーファンド] 東証REIT指数（配当込み）	5%	5%	5%
[海外REITインデックス マザーファンド] S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）	5%	5%	5%

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

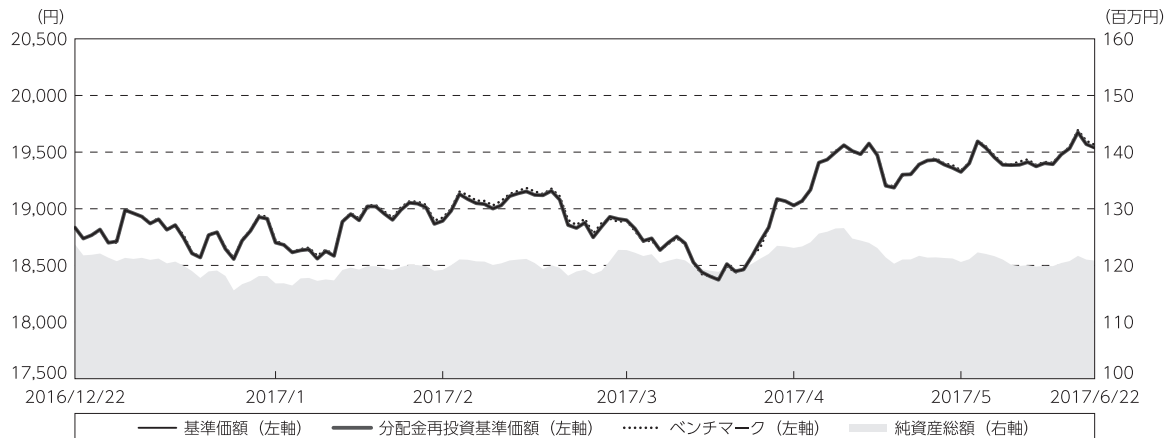
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチ マ ー ク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
		騰 落 率		騰 落 率					
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%
2016年12月22日	18,834	—	188.56	—	63.2	0.9	25.1	—	10.3
12月末	18,712	△0.6	187.22	△0.7	62.5	1.1	25.2	—	10.4
2017年1月末	18,701	△0.7	187.40	△0.6	62.6	1.1	25.3	—	10.3
2月末	18,893	0.3	189.43	0.5	62.2	1.3	25.5	—	10.4
3月末	18,899	0.3	189.16	0.3	62.0	1.5	25.8	—	10.2
4月末	19,029	1.0	190.47	1.0	62.1	1.4	25.6	—	10.3
5月末	19,325	2.6	193.61	2.7	62.4	1.3	25.4	—	10.2
(期 末)									
2017年6月22日	19,540	3.7	195.87	3.9	62.7	0.9	25.5	—	10.4

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
* 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：18,834円

期 末：19,535円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率： 3.7% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作定期首(2016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、作定期首(2016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18,834円から期末19,540円(分配金込み)と706円の値上がりとなりました。

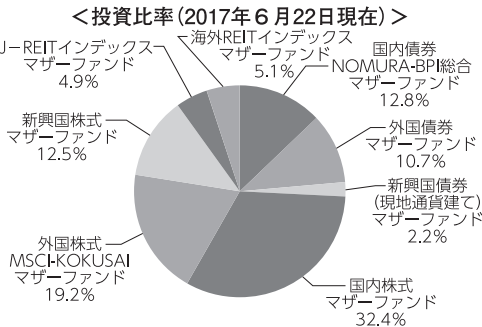
投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、新興国株式(+12.7%)、国内株式(+5.5%)、外国株式(+4.4%)、新興国債券(+4.2%)、外国REIT(+0.9%)、国内債券(+0.0%)が上昇し、国内REIT(-2.6%)、外国債券(-0.3%)は下落しました。

国内株式や新興国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

資 産	変動要因等
国 内 債 券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことなどを背景に、国内債券利回りはやや上昇（価格は下落）しました。利金収入からリターンはほぼ横ばいとなりました。
外 国 債 券	ユーロ圏の景況感回復やECB（欧州中央銀行）による金融緩和姿勢の後退懸念から、ユーロ圏の債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、米国では、政策金利引き上げに伴い短期債券利回りは上昇しましたが、インフレ率の鈍化や将来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長期債券利回りが低下（価格は上昇）し、米国債券利回りは低下しました。外国債券全体の利回りは米国を中心に低下しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	ブラジルやロシアにおける政策金利の引き下げや、大手格付機関によるインドネシアの格付け引き上げなどを背景に、新興国債券利回りは低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 株 式	国内企業の2017年1－3月期決算が概ね良好な結果となったことや、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 株 式	ユーロ圏の景況感回復やフランス大統領選においてEU（欧州連合）離脱に消極的なマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したこと、米国・欧州における堅調な企業業績などを背景に、欧州を中心に上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	中国における堅調な不動産販売や政府によるインフラ投資計画の公表、韓国における新大統領の景気刺激策への期待、外国株式市場の上昇などを背景に、アジアを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 R E I T	東京都心オフィスビルの平均賃料上昇は継続しましたが、空室率低下に一服感がみられることや、公募増資に伴う需給悪化懸念などを背景に、下落しました。
外 国 R E I T	米国の長期金利低下や外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ



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。

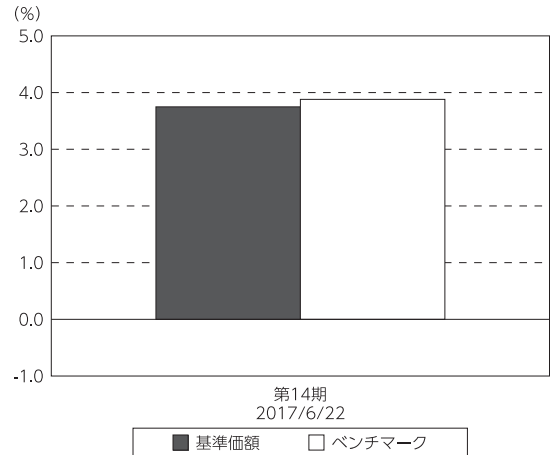
マザーファンドの運用経過については、52ページをご参照ください。

○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+3.7%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+3.9%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14期
	2016年12月23日～ 2017年6月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.026%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	9,535

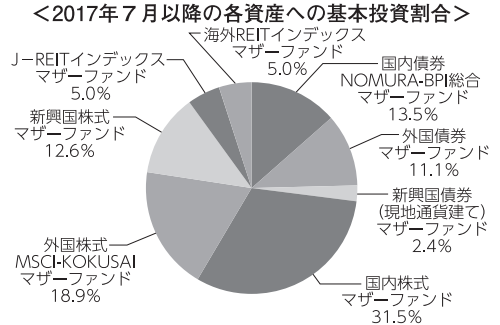
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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、2017年7月以降の各資産への基本投資割合は家計や市場の構造変化等を考慮し、右記の通りとしております。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			ベンチマーク		株 式	株 式	債 券	債 券	投資信託	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率		期 中 騰 落 率	組 入 比 率	先 物 比 率	組 入 比 率	先 物 比 率	組 入 比 率	
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	%	%	百万円
2015年9月17日	10,000	—	—	100.00	—	—	—	—	—	—	1
1期(2015年12月22日)	10,144	5	1.5	101.41	1.4	67.1	1.5	20.3	—	10.6	31
2期(2016年6月22日)	9,193	0	△ 9.4	91.99	△ 9.3	66.7	1.8	20.4	—	10.7	63
3期(2016年12月22日)	10,500	5	14.3	105.07	14.2	68.0	0.9	20.2	—	10.4	91
4期(2017年6月22日)	10,935	5	4.2	109.45	4.2	67.6	1.0	20.6	—	10.4	133

- * 基準価額の騰落率は分配金込み。
- * 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。
- * 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
- * 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
- * ベンチマークは、当ファンドが投資対象とする各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合（下記ご参照）を掛け合わせた合成指数を当社で算出し、設定時を100としています。

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

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

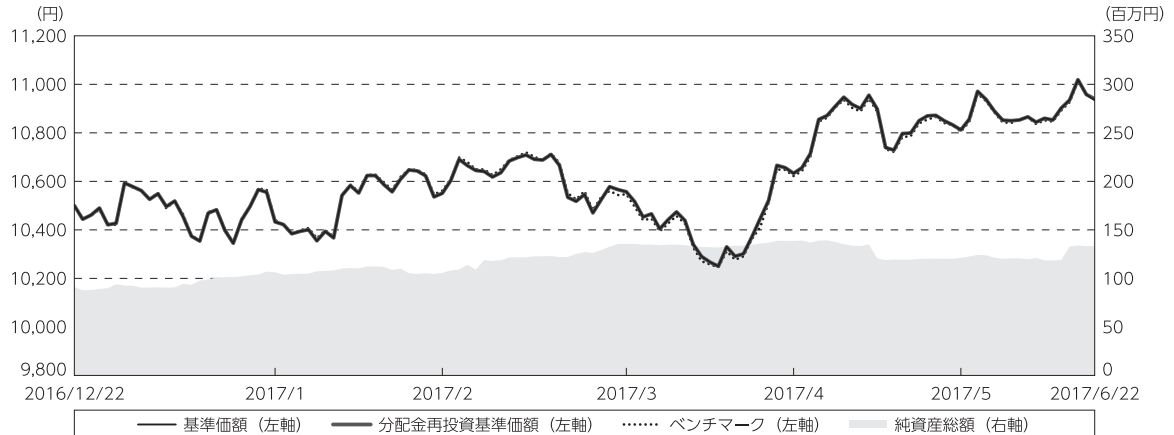
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
	騰 落 率		騰 落 率						
(期 首)	円	%		%	%	%	%	%	%
2016年12月22日	10,500	—	105.07	—	68.0	0.9	20.2	—	10.4
12月末	10,427	△0.7	104.28	△0.8	67.3	1.2	20.3	—	10.5
2017年1月末	10,433	△0.6	104.48	△0.6	67.4	1.2	20.4	—	10.3
2月末	10,551	0.5	105.69	0.6	67.0	1.5	20.5	—	10.4
3月末	10,557	0.5	105.54	0.4	66.8	1.6	20.8	—	10.2
4月末	10,633	1.3	106.29	1.2	66.9	1.6	20.7	—	10.3
5月末	10,812	3.0	108.12	2.9	67.2	1.4	20.5	—	10.3
(期 末)									
2017年6月22日	10,940	4.2	109.45	4.2	67.6	1.0	20.6	—	10.4

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
* 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：10,500円

期 末：10,935円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率： 4.2% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2016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(2016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10,500円から期末10,940円(分配金込み)と440円の値上がりとなりました。

投資対象とする8本のマザーファンドの当期間の値動きは、新興国株式(+12.7%)、国内株式(+5.5%)、外国株式(+4.4%)、新興国債券(+4.2%)、外国REIT(+0.9%)、国内債券(+0.0%)が上昇し、国内REIT(-2.6%)、外国債券(-0.3%)は下落しました。

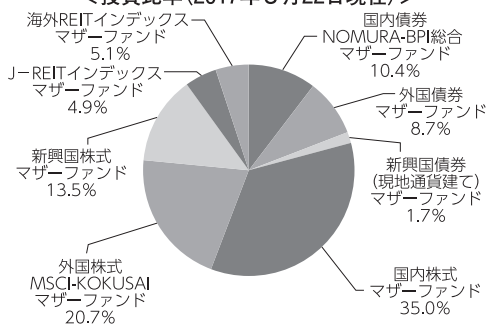
国内株式や新興国株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

○投資環境

資 産	変動要因等
国 内 債 券	国内株式市場の上昇に伴い安全資産としての国債需要が減少したことなどを背景に、国内債券利回りはやや上昇（価格は下落）しました。利金収入からリターンはほぼ横ばいとなりました。
外 国 債 券	ユーロ圏の景況感回復やECB（欧州中央銀行）による金融緩和姿勢の後退懸念から、ユーロ圏の債券利回りは上昇（価格は下落）しました。一方、米国では、政策金利引き上げに伴い短期債券利回りは上昇しましたが、インフレ率の鈍化や将来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長期債券利回りが低下（価格は上昇）し、米国債券利回りは低下しました。外国債券全体の利回りは米国を中心に低下しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	ブラジルやロシアにおける政策金利の引き下げや、大手格付機関によるインドネシアの格付け引き上げなどを背景に、新興国債券利回りは低下（価格は上昇）しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 株 式	国内企業の2017年1～3月期決算が概ね良好な結果となったことや、外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。
外 国 株 式	ユーロ圏の景況感回復やフランス大統領選においてEU（欧州連合）離脱に消極的なマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したこと、米国・欧州における堅調な企業業績などを背景に、欧州を中心に上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。
(新 興 国)	中国における堅調な不動産販売や政府によるインフラ投資計画の公表、韓国における新大統領の景気刺激策への期待、外国株式市場の上昇などを背景に、アジアを中心に上昇しました。主要新興国通貨は対円で上昇・下落まちまちの展開となりました。
国 内 R E I T	東京都心オフィスビルの平均賃料上昇は継続しましたが、空室率低下に一服感がみられることや、公募増資に伴う需給悪化懸念などを背景に、下落しました。
外 国 R E I T	米国の長期金利低下や外国株式市場の上昇などを背景に、上昇しました。為替レートは、日米長期金利差の縮小などを背景に米ドルは対円で下落（円高）しましたが、フランス大統領選でマクロン氏が勝利し欧州政治の不透明感が後退したことなどを背景にユーロは対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

<投資比率(2017年6月22日現在)>



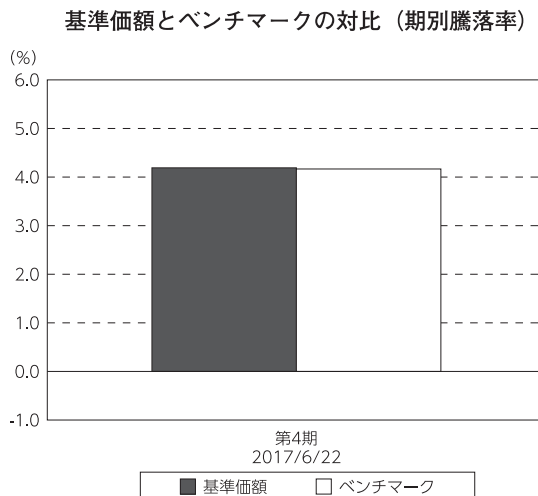
期末の各マザーファンドへの投資比率は左記の通りとしました。また、期を通じて、8本のマザーファンドへの投資比率の合計は概ね99%以上の高位に保ちました。

マザーファンドの運用経過については、52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+4.2%となり、ベンチマーク（各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数）の+4.2%とほぼ同水準となりました。

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



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

◎分配金

収益分配金は、利子・配当等収益等の水準および基準価額水準等を勘案し決定しました。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第 4 期
	2016年12月23日～ 2017年6月22日
当期分配金 (対基準価額比率)	5 0.046%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	1,071

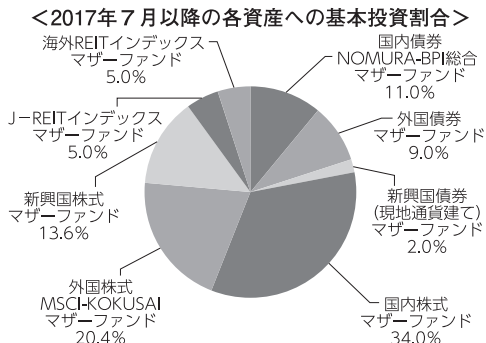
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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。

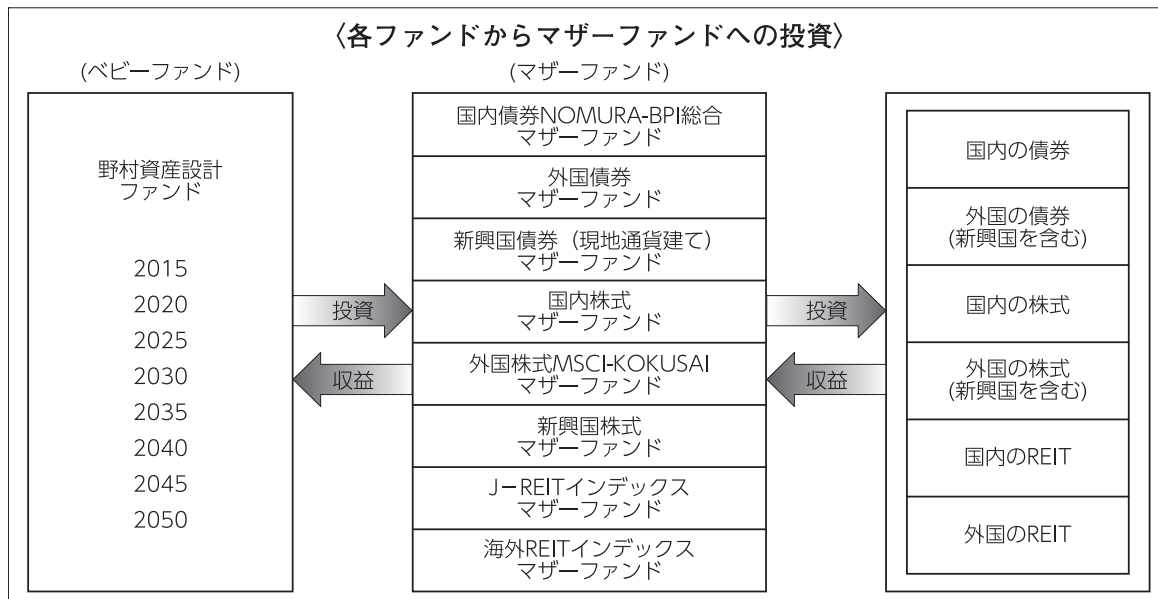
◎今後の運用方針

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、2017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。



◎マザーファンドの運用経過



[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]

NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、種別構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した債券に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。組入比率は当運用期間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。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債などに分散投資しました。毎月の指数構成銘柄の変更に対応し、ポートフォリオの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は当運用期間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）組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。現物株式への投資にあたっては、各銘柄への投資比率を各銘柄がMSCI-KOKUSAI指数の中で占める比率にほぼ一致させ、MSCI-KOKUSAI指数の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しおよび修正を行い、また資金流入出に対しても速やかに対応しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

[新興国株式マザーファンド]

MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指すため、新興国の株式（DR（預託証券）を含む）に幅広く分散投資し、株式先物への投資も一部行いました。当運用期間中の資金流入出や「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行いました。実質株式組入比率（投資信託証券や株式先物を含む）は当運用期間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）は当運用期間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）は当運用期間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（為替の売り予約）は行いませんでした。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	第34期～第39期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 45	% 0.415	(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)	(26)	(0.237)	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 ※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)	(0.001)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.007	(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)	(0.005)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	46	0.425	
作成期間の平均基準価額は、10,772円です。			

* 作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2016年12月23日～2017年6月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第34期～第39期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内株式マザーファンド	千口 848	千円 1,222	千口 13,157	千円 19,263
外国債券マザーファンド	1,202	2,592	5,815	12,671
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	8	18	5,673	12,993
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	13,084	17,053	54,223	70,514
J-REITインデックス マザーファンド	1,545	3,026	3,792	7,535
海外REITインデックス マザーファンド	1,505	3,193	4,876	10,511
新興国株式マザーファンド	7	7	9,790	10,703
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	60	78	2,808	3,584

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年12月23日～2017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34期～第39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	18,843,247千円	27,117,117千円	3,201,180千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	316,699,661千円	344,270,300千円	19,086,551千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.05	0.07	0.16

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年12月23日～2017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>

該当事項はございません。

<国内株式マザーファンド>

区 分	第34期～第39期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 7,534	百万円 6	% 0.1	百万円 11,308	百万円 —	% —
貸株	63,988	5,795	9.1	70,366	4,855	6.9

平均保有割合 0.0%

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

*貸株の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド>

区 分	第34期～第39期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 21,472	百万円 3,347	% 15.6	百万円 17,462	百万円 142	% 0.8

平均保有割合 0.0%

<新興国株式マザーファンド>

区 分	第34期～第39期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 5,235	百万円 1,343	% 25.7	百万円 2,776	百万円 1,152	% 41.5

平均保有割合 0.2%

<国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド>

区 分	第34期～第39期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 65,244	百万円 2,697	% 4.1	百万円 49,932	百万円 —	% —

平均保有割合 0.1%

<外国債券マザーファンド>

区 分	第34期～第39期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 31,631	百万円 1,512	% 4.8	百万円 33,588	百万円 1,765	% 5.3

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34期～第39期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,564	百万円 410	% 11.5	百万円 2,787	百万円 408	% 14.6

平均保有割合 0.4%

<J-REITインデックス マザーファンド>

区 分	第34期～第39期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 10,829	百万円 248	% 2.3	百万円 4,743	百万円 247	% 5.2

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	第34期～第39期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,173	百万円 438	% 13.8	百万円 1,432	百万円 113	% 7.9

平均保有割合 0.3%

利害関係人の発行する有価証券等

<国内株式マザーファンド>

種 類	第34期～第39期		
	買 付 額	売 付 額	第39期末保有額
株式	百万円 40	百万円 63	百万円 1,921

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

種 類	第34期～第39期
	買 付 額
株式	百万円 51

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	第34期～第39期
売買委託手数料総額 (A)	17千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.088千円
(B) / (A)	0.5%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017年6月22日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第33期末	第39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	79,444	67,134	103,051
外国債券マザーファンド	42,599	37,987	83,921
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	31,184	25,519	60,692
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	503,265	462,126	602,520
J-REITインデックス マザーファンド	28,027	25,781	49,610
海外REITインデックス マザーファンド	26,967	23,596	51,474
新興国株式マザーファンド	44,383	34,599	40,115
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	15,762	13,014	17,082

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017年6月22日現在)

項 目	第39期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内株式マザーファンド	103,051	10.2
外国債券マザーファンド	83,921	8.3
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	60,692	6.0
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	602,520	59.4
J-REITインデックス マザーファンド	49,610	4.9
海外REITインデックス マザーファンド	51,474	5.1
新興国株式マザーファンド	40,115	4.0
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	17,082	1.7
コール・ローン等、その他	6,463	0.4
投資信託財産総額	1,014,928	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39期末における外貨建て純資産（665,651,281千円）の投資信託財産総額（666,879,542千円）に対する比率は99.8%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、第39期末における外貨建て純資産（378,580,609千円）の投資信託財産総額（380,941,266千円）に対する比率は99.4%です。

*海外REITインデックス マザーファンドにおいて、第39期末における外貨建て純資産（20,450,448千円）の投資信託財産総額（20,487,659千円）に対する比率は99.8%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、第39期末における外貨建て純資産（22,409,847千円）の投資信託財産総額（22,706,950千円）に対する比率は98.7%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、第39期末における外貨建て純資産（4,925,826千円）の投資信託財産総額（4,981,419千円）に対する比率は98.9%です。

*外貨建て資産は、第39期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1 カタールリヤル＝30.32円、1 米ドル＝111.14円、1 カナダドル＝83.45円、1 英ポンド＝140.87円、1 スイスフラン＝114.21円、1 スウェーデンクローナ＝12.69円、1 ノルウェークローネ＝13.02円、1 デンマーククローネ＝16.67円、1 トルコリラ＝31.49円、1 ユーロ＝124.02円、1 チェココルナ＝4.72円、1 フォリント＝0.401円、1 ズロチ＝29.16円、1 ルーブル＝1.85円、1 レイ＝26.99円、1 香港ドル＝14.25円、1 シンガポールドル＝80.07円、1 リンギ＝25.94円、1 パーツ＝3.27円、1 フィリピンペソ＝2.21円、1 ルピア＝0.0084円、1 ウォン＝0.0977円、1 新台湾ドル＝3.65円、1 豪ドル＝84.00円、1 ニュージーランドドル＝80.59円、1 インドルピー＝1.74円、1 新シェケル＝31.39円、1 パキスタンルピー＝1.07円、1 アルゼンチンペソ＝6.85円、1 メキシコペソ＝6.10円、1 レアル＝33.32円、1 チリペソ＝0.167円、1 コロンビアペソ＝0.0363円、1 ソル＝33.97円、1 UAEディルハム＝30.34円、1 エジプトポンド＝6.12円、1 ランド＝8.50円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第34期末	第35期末	第36期末	第37期末	第38期末	第39期末
	2017年1月23日現在	2017年2月22日現在	2017年3月22日現在	2017年4月24日現在	2017年5月22日現在	2017年6月22日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	1,090,340,266	1,069,771,740	1,054,899,730	1,041,753,069	1,029,601,846	1,014,928,291
コール・ローン等	3,447,583	3,382,645	3,192,710	3,301,687	3,170,239	3,241,506
国内株式マザーファンド(評価額)	108,861,482	108,430,396	104,633,646	103,286,952	104,390,231	103,051,987
外国債券マザーファンド(評価額)	88,776,372	87,699,801	86,692,104	85,879,880	86,225,681	83,921,185
外国株式USCT-HOUCSALマザーファンド(評価額)	65,176,550	65,578,501	62,753,261	60,845,957	61,970,237	60,692,379
国内債券XOMURA-DPI総合マザーファンド(評価額)	653,088,588	634,891,201	629,854,926	626,304,177	610,440,419	602,520,341
J-REITインデックスマザーファンド(評価額)	54,056,709	51,881,362	51,726,680	51,073,758	51,436,674	49,610,701
海外REITインデックスマザーファンド(評価額)	54,129,291	54,984,556	50,277,778	52,750,123	50,439,571	51,474,983
新興国株式マザーファンド(評価額)	44,448,103	44,049,353	43,149,413	40,758,471	41,731,675	40,115,158
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額)	18,355,588	18,334,658	18,068,561	17,552,064	17,563,174	17,082,629
未収入金	—	539,267	4,550,651	—	2,233,945	3,217,422
(B) 負債	1,820,786	2,239,846	6,060,714	1,766,656	3,775,359	3,867,848
未払収益分配金	1,013,464	990,684	977,270	970,557	949,121	931,931
未払解約金	—	510,937	4,401,813	9,787	2,160,960	2,212,413
未払信託報酬	804,195	735,368	678,993	783,267	662,699	720,704
未払利息	4	4	3	5	4	4
その他未払費用	3,123	2,853	2,635	3,040	2,575	2,796
(C) 純資産総額(A-B)	1,088,519,480	1,067,531,894	1,048,839,016	1,039,986,413	1,025,826,487	1,011,060,443
元本	1,013,464,529	990,684,448	977,270,928	970,557,140	949,121,895	931,931,992
次期繰越損益金	75,054,951	76,847,446	71,568,088	69,429,273	76,704,592	79,128,451
(D) 受益権総口数	1,013,464,529口	990,684,448口	977,270,928口	970,557,140口	949,121,895口	931,931,992口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,741円	10,776円	10,732円	10,715円	10,808円	10,849円

(注) 第34期首元本額は1,034,839,512円、第34～39期中追加設定元本額は2,571,376円、第34～39期中一部解約元本額は105,478,896円、1口当たり純資産額は、第34期1.0741円、第35期1.0776円、第36期1.0732円、第37期1.0715円、第38期1.0808円、第39期1.0849円です。

○損益の状況

項 目	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期	第39期
	2016年12月23日～ 2017年1月23日	2017年1月24日～ 2017年2月22日	2017年2月23日～ 2017年3月22日	2017年3月23日～ 2017年4月24日	2017年4月25日～ 2017年5月22日	2017年5月23日～ 2017年6月22日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 123	△ 96	△ 81	△ 116	△ 117	△ 115
支払利息	△ 123	△ 96	△ 81	△ 116	△ 117	△ 115
(B) 有価証券売買損益	△ 5,714,300	5,135,381	△ 2,623,361	87,403	10,358,805	5,414,075
売買益	1,986,339	9,401,215	3,283,886	3,803,595	12,356,846	5,918,438
売買損	△ 7,700,639	△ 4,265,834	△ 5,907,247	△ 3,716,192	△ 1,998,041	△ 504,363
(C) 信託報酬等	△ 807,318	△ 738,221	△ 681,628	△ 786,307	△ 665,274	△ 723,500
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 6,521,741	4,397,064	△ 3,305,070	△ 699,020	9,693,414	4,690,460
(E) 前期繰越損益金	121,332,852	111,259,453	113,110,624	108,055,625	104,058,320	110,764,318
(F) 追加信託差損益金	△ 38,742,696	△ 37,818,387	△ 37,260,196	△ 36,956,775	△ 36,098,021	△ 35,394,396
(配当等相当額)	(23,624,788)	(23,157,186)	(22,896,527)	(22,795,809)	(22,344,198)	(21,995,014)
(売買損益相当額)	(△ 62,367,484)	(△ 60,975,573)	(△ 60,156,723)	(△ 59,752,584)	(△ 58,442,219)	(△ 57,389,410)
(G) 計 (D + E + F)	76,068,415	77,838,130	72,545,358	70,399,830	77,653,713	80,060,382
(H) 収益分配金	△ 1,013,464	△ 990,684	△ 977,270	△ 970,557	△ 949,121	△ 931,931
次期繰越損益金 (G + H)	75,054,951	76,847,446	71,568,088	69,429,273	76,704,592	79,128,451
追加信託差損益金	△ 38,742,696	△ 37,818,387	△ 37,260,196	△ 36,956,775	△ 36,098,021	△ 35,394,396
(配当等相当額)	(23,625,378)	(23,157,656)	(22,897,019)	(22,796,658)	(22,344,578)	(21,995,533)
(売買損益相当額)	(△ 62,368,074)	(△ 60,976,043)	(△ 60,157,215)	(△ 59,753,433)	(△ 58,442,599)	(△ 57,389,929)
分配準備積立金	133,207,914	130,324,414	128,240,043	127,847,422	125,178,148	123,238,015
繰越損益金	△ 19,410,267	△ 15,658,581	△ 19,411,759	△ 21,461,374	△ 12,375,535	△ 8,715,168

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

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

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

(注) 分配金の計算過程 (2016年12月23日～2017年6月22日) は以下の通りです。

項 目	第34期	第35期	第36期	第37期	第38期	第39期
	2016年12月23日～ 2017年1月23日	2017年1月24日～ 2017年2月22日	2017年2月23日～ 2017年3月22日	2017年3月23日～ 2017年4月24日	2017年4月25日～ 2017年5月22日	2017年5月23日～ 2017年6月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	796,248円	1,090,830円	666,416円	1,492,442円	1,090,125円	1,259,680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	23,625,378円	23,157,656円	22,897,019円	22,796,658円	22,344,578円	21,995,533円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	133,425,130円	130,224,268円	128,550,897円	127,325,537円	125,037,144円	122,910,266円
e. 分配対象収益 (a+b+c+d)	157,846,756円	154,472,754円	152,114,332円	151,614,637円	148,471,847円	146,165,479円
f. 分配対象収益 (1万口当たり)	1,557円	1,559円	1,556円	1,562円	1,564円	1,568円
g. 分配金	1,013,464円	990,684円	977,270円	970,557円	949,121円	931,931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34期	第35期	第36期	第37期	第38期	第39期
1 万口当たり分配金（税込み）	10円	10円	10円	10円	10円	10円

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。
※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。
※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 50	% 0.463	(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)	(28)	(0.258)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.009	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(1)	(0.006)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	51	0.475	
期中の平均基準価額は、10,719円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2016年12月23日～2017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	4,179	6,073	9,967	14,561
外国債券マザーファンド	3,244	6,989	3,878	8,460
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,283	2,941	4,592	10,484
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	24,865	32,363	19,628	25,508
J-REITインデックス マザーファンド	2,155	4,238	1,751	3,502
海外REITインデックス マザーファンド	2,118	4,505	2,804	6,049
新興国株式マザーファンド	1,803	1,974	8,653	9,442
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	678	868	2,155	2,741

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年12月23日～2017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	18,843,247千円	27,100,796千円	3,198,136千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	316,699,661千円	344,270,300千円	19,086,551千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.05	0.07	0.16

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年12月23日～2017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＞
該当事項はございません。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 7,534	百万円 6	% 0.1	百万円 11,308	百万円 —	% —
貸株	63,988	5,795	9.1	70,366	4,855	6.9

平均保有割合 0.0%

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

*貸株の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 21,472	百万円 3,347	% 15.6	百万円 17,462	百万円 142	% 0.8

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 5,235	百万円 1,343	% 25.7	百万円 2,776	百万円 1,152	% 41.5

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 65,244	百万円 2,697	% 4.1	百万円 49,932	百万円 —	% —

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	$\frac{B}{A}$	売付額等		
				C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 31,631	百万円 1,512	% 4.8	百万円 33,588	百万円 1,765	% 5.3
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	$\frac{B}{A}$	売付額等		
				C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,564	百万円 410	% 11.5	百万円 2,787	百万円 408	% 14.6
平均保有割合 0.5%						

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等		
				C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 10,829	百万円 248	% 2.3	百万円 4,743	百万円 247	% 5.2
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	$\frac{B}{A}$	売付額等		
				C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,173	百万円 438	% 13.8	百万円 1,432	百万円 113	% 7.9
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
株式	百万円 40	百万円 63	百万円 1,921

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 51

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	18千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.074千円
(B) / (A)	0.4%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017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	89,313	83,525	128,211
外国債券マザーファンド	48,221	47,586	105,128
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	35,058	31,749	75,509
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	323,306	328,543	428,354
J-REITインデックス マザーファンド	22,506	22,911	44,087
海外REITインデックス マザーファンド	21,655	20,969	45,744
新興国株式マザーファンド	49,897	43,047	49,909
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	17,124	15,647	20,538

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017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	128,211	14.2
外国債券マザーファンド	105,128	11.6
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	75,509	8.4
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	428,354	47.4
J-REITインデックス マザーファンド	44,087	4.9
海外REITインデックス マザーファンド	45,744	5.1
新興国株式マザーファンド	49,909	5.5
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	20,538	2.3
コール・ローン等、その他	5,482	0.6
投資信託財産総額	902,962	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（665,651,281千円）の投資信託財産総額（666,879,542千円）に対する比率は99.8%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（378,580,609千円）の投資信託財産総額（380,941,266千円）に対する比率は99.4%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（20,450,448千円）の投資信託財産総額（20,487,659千円）に対する比率は99.8%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（22,409,847千円）の投資信託財産総額（22,706,950千円）に対する比率は98.7%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（4,925,826千円）の投資信託財産総額（4,981,419千円）に対する比率は98.9%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1 カタールリヤル=30.32円、1 米ドル=111.14円、1 カナダドル=83.45円、1 英ポンド=140.87円、1 スイスフラン=114.21円、1 スウェーデンクローナ=12.69円、1 ノルウェークローネ=13.02円、1 デンマーククローネ=16.67円、1 トルコリラ=31.49円、1 ユーロ=124.02円、1 チェココルナ=4.72円、1 フォリント=0.401円、1 ズロチ=29.16円、1 ルーブル=1.85円、1 レイ=26.99円、1 香港ドル=14.25円、1 シンガポールドル=80.07円、1 リンギ=25.94円、1 パーツ=3.27円、1 フィリピンペソ=2.21円、1 ルピア=0.0084円、1 ウォン=0.0977円、1 新台湾ドル=3.65円、1 豪ドル=84.00円、1 ニュージーランドドル=80.59円、1 インドルピー=1.74円、1 新シェケル=31.39円、1 パキスタンルピー=1.07円、1 アルゼンチンペソ=6.85円、1 メキシコペソ=6.10円、1 レアル=33.32円、1 チリペソ=0.167円、1 コロンビアペソ=0.0363円、1 ソル=33.97円、1 UAEディルハム=30.34円、1 エジプトポンド=6.12円、1 ランド=8.50円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年6月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	902,962,983
コール・ローン等	5,098,008
国内株式マザーファンド(評価額)	128,211,352
外国債券マザーファンド(評価額)	105,128,732
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	75,509,961
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額)	428,354,873
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	44,087,700
海外REITインデックス マザーファンド(評価額)	45,744,445
新興国株式マザーファンド(評価額)	49,909,009
新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド(評価額)	20,538,831
未収入金	380,072
(B) 負債	4,557,379
未払収益分配金	413,140
未払信託報酬	4,129,888
未払利息	7
その他未払費用	14,344
(C) 純資産総額(A-B)	898,405,604
元本	826,280,231
次期繰越損益金	72,125,373
(D) 受益権総口数	826,280,231口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,873円

(注) 期首元本額は841,574,878円、期中追加設定元本額は45,921,028円、期中一部解約元本額は61,215,675円、1口当たり純資産額は1.0873円です。

○損益の状況 (2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 721
支払利息	△ 721
(B) 有価証券売買損益	16,101,910
売買益	18,576,574
売買損	△ 2,474,664
(C) 信託報酬等	△ 4,144,232
(D) 当期損益金(A+B+C)	11,956,957
(E) 前期繰越損益金	116,203,336
(F) 追加信託差損益金	△ 55,621,780
(配当等相当額)	(58,460,188)
(売買損益相当額)	(△114,081,968)
(G) 計(D+E+F)	72,538,513
(H) 収益分配金	△ 413,140
次期繰越損益金(G+H)	72,125,373
追加信託差損益金	△ 55,621,780
(配当等相当額)	(58,530,248)
(売買損益相当額)	(△114,152,028)
分配準備積立金	145,062,514
繰越損益金	△ 17,315,361

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2016年12月23日～2017年6月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年12月23日～ 2017年6月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	6,414,155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	58,530,248円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	139,061,499円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	204,005,902円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,468円
g. 分配金	413,140円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

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

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

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

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

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 50	% 0.463	(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)	(28)	(0.258)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.003	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.001)	
(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)	(0.007)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	51	0.477	
期中の平均基準価額は、10,859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まず。

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

○売買及び取引の状況

(2016年12月23日～2017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	5,183	7,571	11,679	17,129
外国債券マザーファンド	3,623	7,839	3,788	8,246
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,752	4,024	5,708	13,053
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	22,244	28,966	15,906	20,671
J-REITインデックス マザーファンド	2,323	4,571	1,712	3,397
海外REITインデックス マザーファンド	2,265	4,823	2,725	5,873
新興国株式マザーファンド	2,432	2,665	10,738	11,770
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	759	974	2,146	2,737

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年12月23日～2017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	18,843,247千円	27,100,796千円	3,198,136千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	316,699,661千円	344,270,300千円	19,086,551千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.05	0.07	0.16

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年12月23日～2017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>
該当事項はございません。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 7,534	百万円 6	% 0.1	百万円 11,308	百万円 —	% —
貸株	63,988	5,795	9.1	70,366	4,855	6.9

平均保有割合 0.1%

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

*貸株の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 21,472	百万円 3,347	% 15.6	百万円 17,462	百万円 142	% 0.8

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 5,235	百万円 1,343	% 25.7	百万円 2,776	百万円 1,152	% 41.5

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 65,244	百万円 2,697	% 4.1	百万円 49,932	百万円 —	% —

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			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 31,631	百万円 1,512	% 4.8	百万円 33,588	百万円 1,765	% 5.3
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			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,564	百万円 410	% 11.5	百万円 2,787	百万円 408	% 14.6
平均保有割合 0.5%						

<J-REITインデックス マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 10,829	百万円 248	% 2.3	百万円 4,743	百万円 247	% 5.2
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			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,173	百万円 438	% 13.8	百万円 1,432	百万円 113	% 7.9
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
株式	百万円 40	百万円 63	百万円 1,921

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 51

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)	22千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.072千円
(B) / (A)	0.3%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017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	117,075	110,579	169,739
外国債券マザーファンド	49,760	49,595	109,566
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	46,358	42,402	100,844
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	240,712	247,049	322,103
J-REITインデックス マザーファンド	21,738	22,349	43,007
海外REITインデックス マザーファンド	20,916	20,455	44,624
新興国株式マザーファンド	64,546	56,240	65,205
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	17,979	16,591	21,778

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017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	169,739	19.1
外国債券マザーファンド	109,566	12.3
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	100,844	11.4
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	322,103	36.3
J-REITインデックス マザーファンド	43,007	4.8
海外REITインデックス マザーファンド	44,624	5.0
新興国株式マザーファンド	65,205	7.3
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	21,778	2.5
コール・ローン等、その他	11,554	1.3
投資信託財産総額	888,420	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（665,651,281千円）の投資信託財産総額（666,879,542千円）に対する比率は99.8%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（378,580,609千円）の投資信託財産総額（380,941,266千円）に対する比率は99.4%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（20,450,448千円）の投資信託財産総額（20,487,659千円）に対する比率は99.8%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（22,409,847千円）の投資信託財産総額（22,706,950千円）に対する比率は98.7%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（4,925,826千円）の投資信託財産総額（4,981,419千円）に対する比率は98.9%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1 カタールリヤル=30.32円、1 米ドル=111.14円、1 カナダドル=83.45円、1 英ポンド=140.87円、1 スイスフラン=114.21円、1 スウェーデンクローナ=12.69円、1 ノルウェークローネ=13.02円、1 デンマーククローネ=16.67円、1 トルコリラ=31.49円、1 ユーロ=124.02円、1 チェココルナ=4.72円、1 フォリント=0.401円、1 ズロチ=29.16円、1 ルーブル=1.85円、1 レイ=26.99円、1 香港ドル=14.25円、1 シンガポールドル=80.07円、1 リンギ=25.94円、1 パーツ=3.27円、1 フィリピンペソ=2.21円、1 ルピア=0.0084円、1 ウォン=0.0977円、1 新台湾ドル=3.65円、1 豪ドル=84.00円、1 ニュージーランドドル=80.59円、1 インドルピー=1.74円、1 新シェケル=31.39円、1 パキスタンルピー=1.07円、1 アルゼンチンペソ=6.85円、1 メキシコペソ=6.10円、1 レアル=33.32円、1 チリペソ=0.167円、1 コロンビアペソ=0.0363円、1 ソル=33.97円、1 UAEディルハム=30.34円、1 エジプトポンド=6.12円、1 ランド=8.50円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年6月22日現在)

項 目	当 期 末 円
(A) 資産	888,420,834
コール・ローン等	5,255,393
国内株式マザーファンド(評価額)	169,739,572
外国債券マザーファンド(評価額)	109,566,223
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	100,844,900
国内債券NOMURA-BPT総合 マザーファンド(評価額)	322,103,470
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	43,007,926
海外REITインデックス マザーファンド(評価額)	44,624,076
新興国株式マザーファンド(評価額)	65,205,227
新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド(評価額)	21,778,044
未収入金	6,296,003
(B) 負債	10,635,113
未払収益分配金	396,459
未払解約金	6,179,126
未払信託報酬	4,045,468
未払利息	7
その他未払費用	14,053
(C) 純資産総額(A-B)	877,785,721
元本	792,919,753
次期繰越損益金	84,865,968
(D) 受益権総口数	792,919,753口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,070円

(注) 期首元本額は808,730,428円、期中追加設定元本額は43,479,561円、期中一部解約元本額は59,290,236円、1口当たり純資産額は1.1070円です。

○損益の状況 (2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期 円
(A) 配当等収益	△ 666
支払利息	△ 666
(B) 有価証券売買損益	21,080,299
売買益	23,614,235
売買損	△ 2,533,936
(C) 信託報酬等	△ 4,059,521
(D) 当期損益金(A+B+C)	17,020,112
(E) 前期繰越損益金	115,921,477
(F) 追加信託差損益金	△ 47,679,162
(配当等相当額)	(59,101,298)
(売買損益相当額)	(△106,780,460)
(G) 計(D+E+F)	85,262,427
(H) 収益分配金	△ 396,459
次期繰越損益金(G+H)	84,865,968
追加信託差損益金	△ 47,679,162
(配当等相当額)	(59,175,838)
(売買損益相当額)	(△106,855,000)
分配準備積立金	150,306,627
繰越損益金	△ 17,761,497

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2016年12月23日～2017年6月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期 2016年12月23日～ 2017年6月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	7,346,551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	59,175,838円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	143,356,535円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	209,878,924円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,646円
g. 分配金	396,459円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

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

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

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

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

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 51	% 0.463	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(20)	(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)	(29)	(0.258)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.003	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.002)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(d) そ の 他 費 用	1	0.011	(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)	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	52	0.479	
期中の平均基準価額は、11,033円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2016年12月23日～2017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	5,900	8,581	12,861	18,831
外国債券マザーファンド	3,130	6,748	3,543	7,668
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,915	4,390	5,989	13,688
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	15,170	19,751	12,330	16,015
J-REITインデックス マザーファンド	2,802	5,505	2,265	4,512
海外REITインデックス マザーファンド	2,726	5,805	3,421	7,390
新興国株式マザーファンド	2,489	2,729	10,855	11,891
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	727	933	1,961	2,499

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年12月23日～2017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	18,843,247千円	27,100,796千円	3,198,136千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	316,699,661千円	344,270,300千円	19,086,551千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.05	0.07	0.16

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年12月23日～2017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>
該当事項はございません。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 7,534	百万円 6	% 0.1	百万円 11,308	百万円 —	% —
貸株	63,988	5,795	9.1	70,366	4,855	6.9

平均保有割合 0.0%

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

*貸株の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 21,472	百万円 3,347	% 15.6	百万円 17,462	百万円 142	% 0.8

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 5,235	百万円 1,343	% 25.7	百万円 2,776	百万円 1,152	% 41.5

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 65,244	百万円 2,697	% 4.1	百万円 49,932	百万円 —	% —

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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 31,631	百万円 1,512	% 4.8	百万円 33,588	百万円 1,765	% 5.3
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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,564	百万円 410	% 11.5	百万円 2,787	百万円 408	% 14.6
平均保有割合 0.4%						

<J-REITインデックス マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 10,829	百万円 248	% 2.3	百万円 4,743	百万円 247	% 5.2
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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,173	百万円 438	% 13.8	百万円 1,432	百万円 113	% 7.9
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
株式	百万円 40	百万円 63	百万円 1,921

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 51

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)	22千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.082千円
(B) / (A)	0.4%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017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	112,610	105,650	162,173
外国債券マザーファンド	41,335	40,923	90,407
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	44,537	40,463	96,235
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	145,915	148,755	193,947
J-REITインデックス マザーファンド	25,281	25,818	49,682
海外REITインデックス マザーファンド	24,325	23,630	51,549
新興国株式マザーファンド	62,198	53,831	62,411
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	14,924	13,690	17,969

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017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	162,173	22.2
外国債券マザーファンド	90,407	12.4
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	96,235	13.2
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	193,947	26.6
J-REITインデックス マザーファンド	49,682	6.8
海外REITインデックス マザーファンド	51,549	7.1
新興国株式マザーファンド	62,411	8.6
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	17,969	2.5
コール・ローン等、その他	4,619	0.6
投資信託財産総額	728,992	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（665,651,281千円）の投資信託財産総額（666,879,542千円）に対する比率は99.8%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（378,580,609千円）の投資信託財産総額（380,941,266千円）に対する比率は99.4%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（20,450,448千円）の投資信託財産総額（20,487,659千円）に対する比率は99.8%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（22,409,847千円）の投資信託財産総額（22,706,950千円）に対する比率は98.7%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（4,925,826千円）の投資信託財産総額（4,981,419千円）に対する比率は98.9%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1 カタールリヤル=30.32円、1 米ドル=111.14円、1 カナダドル=83.45円、1 英ポンド=140.87円、1 スイスフラン=114.21円、1 スウェーデンクローナ=12.69円、1 ノルウェークローネ=13.02円、1 デンマーククローネ=16.67円、1 トルコリラ=31.49円、1 ユーロ=124.02円、1 チェココルナ=4.72円、1 フォリント=0.401円、1 ズロチ=29.16円、1 ルーブル=1.85円、1 レイ=26.99円、1 香港ドル=14.25円、1 シンガポールドル=80.07円、1 リンギ=25.94円、1 パーツ=3.27円、1 フィリピンペソ=2.21円、1 ルピア=0.0084円、1 ウォン=0.0977円、1 新台湾ドル=3.65円、1 豪ドル=84.00円、1 ニュージーランドドル=80.59円、1 インドルピー=1.74円、1 新シェケル=31.39円、1 パキスタンルピー=1.07円、1 アルゼンチンペソ=6.85円、1 メキシコペソ=6.10円、1 レアル=33.32円、1 チリペソ=0.167円、1 コロンビアペソ=0.0363円、1 ソル=33.97円、1 UAEディルハム=30.34円、1 エジプトポンド=6.12円、1 ランド=8.50円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年6月22日現在)

項 目	当 期 末 円
(A) 資産	728,992,708
コール・ローン等	4,142,974
国内株式マザーファンド(評価額)	162,173,101
外国債券マザーファンド(評価額)	90,407,252
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	96,235,281
国内債券NOMURA-BPT総合 マザーファンド(評価額)	193,947,387
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	49,682,468
海外REITインデックス マザーファンド(評価額)	51,549,458
新興国株式マザーファンド(評価額)	62,411,968
新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド(評価額)	17,969,898
未収入金	472,921
(B) 負債	3,872,719
未払収益分配金	321,505
未払解約金	215,614
未払信託報酬	3,324,059
未払利息	5
その他未払費用	11,536
(C) 純資産総額(A-B)	725,119,989
元本	643,010,569
次期繰越損益金	82,109,420
(D) 受益権総口数	643,010,569口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,277円

(注) 期首元本額は665,255,620円、期中追加設定元本額は43,336,987円、期中一部解約元本額は65,582,038円、1口当たり純資産額は1.1277円です。

○損益の状況 (2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期 円
(A) 配当等収益	△ 574
支払利息	△ 574
(B) 有価証券売買損益	19,932,429
売買益	22,394,674
売買損	△ 2,462,245
(C) 信託報酬等	△ 3,335,595
(D) 当期損益金(A+B+C)	16,596,260
(E) 前期繰越損益金	116,552,935
(F) 追加信託差損益金	△ 50,718,270
(配当等相当額)	(59,493,354)
(売買損益相当額)	(△110,211,624)
(G) 計(D+E+F)	82,430,925
(H) 収益分配金	△ 321,505
次期繰越損益金(G+H)	82,109,420
追加信託差損益金	△ 50,718,270
(配当等相当額)	(59,580,699)
(売買損益相当額)	(△110,298,969)
分配準備積立金	149,778,251
繰越損益金	△ 16,950,561

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2016年12月23日～2017年6月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期 2016年12月23日～ 2017年6月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	6,794,675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	59,580,699円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	143,305,081円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	209,680,455円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,260円
g. 分配金	321,505円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

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

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

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

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

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 50	% 0.463	(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)	(28)	(0.258)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.003	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.002)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.001)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(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)	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	51	0.480	
期中の平均基準価額は、10,845円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2016年12月23日～2017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	3,101	4,507	7,140	10,543
外国債券マザーファンド	2,008	4,338	1,875	4,070
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,061	2,426	3,663	8,418
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	7,735	10,075	5,081	6,600
J-REITインデックス マザーファンド	1,868	3,676	1,202	2,381
海外REITインデックス マザーファンド	1,816	3,862	2,063	4,458
新興国株式マザーファンド	1,552	1,686	7,234	7,981
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	424	542	1,125	1,439

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年12月23日～2017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	18,843,247千円	27,100,796千円	3,198,136千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	316,699,661千円	344,270,300千円	19,086,551千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.05	0.07	0.16

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年12月23日～2017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＞
該当事項はございません。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 7,534	百万円 6	% 0.1	百万円 11,308	百万円 —	% —
貸株	63,988	5,795	9.1	70,366	4,855	6.9

平均保有割合 0.0%

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

*貸株の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 21,472	百万円 3,347	% 15.6	百万円 17,462	百万円 142	% 0.8

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 5,235	百万円 1,343	% 25.7	百万円 2,776	百万円 1,152	% 41.5

平均保有割合 0.2%

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 65,244	百万円 2,697	% 4.1	百万円 49,932	百万円 —	% —

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			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 31,631	百万円 1,512	% 4.8	百万円 33,588	百万円 1,765	% 5.3
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			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,564	百万円 410	% 11.5	百万円 2,787	百万円 408	% 14.6
平均保有割合 0.3%						

<J-REITインデックス マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 10,829	百万円 248	% 2.3	百万円 4,743	百万円 247	% 5.2
平均保有割合 0.1%						

<海外REITインデックス マザーファンド>

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,173	百万円 438	% 13.8	百万円 1,432	百万円 113	% 7.9
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
株式	百万円 40	百万円 63	百万円 1,921

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 51

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)	17千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.061千円
(B) / (A)	0.4%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017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	84,509	80,470	123,522
外国債券マザーファンド	27,855	27,989	61,833
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	33,397	30,796	73,243
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	76,478	79,131	103,172
J-REITインデックス マザーファンド	18,253	18,919	36,407
海外REITインデックス マザーファンド	17,563	17,316	37,775
新興国株式マザーファンド	46,731	41,049	47,593
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	10,064	9,363	12,290

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017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	123,522	24.7
外国債券マザーファンド	61,833	12.3
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	73,243	14.6
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	103,172	20.6
J-REITインデックス マザーファンド	36,407	7.3
海外REITインデックス マザーファンド	37,775	7.5
新興国株式マザーファンド	47,593	9.5
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	12,290	2.5
コール・ローン等、その他	5,224	1.0
投資信託財産総額	501,059	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（665,651,281千円）の投資信託財産総額（666,879,542千円）に対する比率は99.8%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（378,580,609千円）の投資信託財産総額（380,941,266千円）に対する比率は99.4%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（20,450,448千円）の投資信託財産総額（20,487,659千円）に対する比率は99.8%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（22,409,847千円）の投資信託財産総額（22,706,950千円）に対する比率は98.7%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（4,925,826千円）の投資信託財産総額（4,981,419千円）に対する比率は98.9%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1 カタールリヤル=30.32円、1 米ドル=111.14円、1 カナダドル=83.45円、1 英ポンド=140.87円、1 スイスフラン=114.21円、1 スウェーデンクローナ=12.69円、1 ノルウェークローネ=13.02円、1 デンマーククローネ=16.67円、1 トルコリラ=31.49円、1 ユーロ=124.02円、1 チェココルナ=4.72円、1 フォリント=0.401円、1 ズロチ=29.16円、1 ルーブル=1.85円、1 レイ=26.99円、1 香港ドル=14.25円、1 シンガポールドル=80.07円、1 リンギ=25.94円、1 パーツ=3.27円、1 フィリピンペソ=2.21円、1 ルピア=0.0084円、1 ウォン=0.0977円、1 新台湾ドル=3.65円、1 豪ドル=84.00円、1 ニュージーランドドル=80.59円、1 インドルピー=1.74円、1 新シェケル=31.39円、1 パキスタンルピー=1.07円、1 アルゼンチンペソ=6.85円、1 メキシコペソ=6.10円、1 レアル=33.32円、1 チリペソ=0.167円、1 コロンビアペソ=0.0363円、1 ソル=33.97円、1 UAEディルハム=30.34円、1 エジプトポンド=6.12円、1 ランド=8.50円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年6月22日現在)

項 目	当 期 末 円
(A) 資産	501,059,827
コール・ローン等	2,927,962
国内株式マザーファンド(評価額)	123,522,321
外国債券マザーファンド(評価額)	61,833,879
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	73,243,249
国内債券NOMURA-BPT総合 マザーファンド(評価額)	103,172,205
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	36,407,396
海外REITインデックス マザーファンド(評価額)	37,775,523
新興国株式マザーファンド(評価額)	47,593,037
新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド(評価額)	12,290,477
未収入金	2,293,778
(B) 負債	4,711,103
未払収益分配金	223,377
未払解約金	2,192,507
未払信託報酬	2,287,294
未払利息	4
その他未払費用	7,921
(C) 純資産総額(A-B)	496,348,724
元本	446,755,163
次期繰越損益金	49,593,561
(D) 受益権総口数	446,755,163口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,110円

(注) 期首元本額は457,959,045円、期中追加設定元本額は20,326,833円、期中一部解約元本額は31,530,715円、1口当たり純資産額は1.1110円です。

○損益の状況 (2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期 円
(A) 配当等収益	△ 345
支払利息	△ 345
(B) 有価証券売買損益	15,157,937
売買益	17,015,697
売買損	△ 1,857,760
(C) 信託報酬等	△ 2,295,215
(D) 当期損益金(A+B+C)	12,862,377
(E) 前期繰越損益金	83,427,662
(F) 追加信託差損益金	△ 46,473,101
(配当等相当額)	(44,096,948)
(売買損益相当額)	(△ 90,570,049)
(G) 計(D+E+F)	49,816,938
(H) 収益分配金	△ 223,377
次期繰越損益金(G+H)	49,593,561
追加信託差損益金	△ 46,473,101
(配当等相当額)	(44,139,028)
(売買損益相当額)	(△ 90,612,129)
分配準備積立金	107,426,241
繰越損益金	△ 11,359,579

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2016年12月23日～2017年6月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期 2016年12月23日～ 2017年6月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	4,934,536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	44,139,028円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	102,715,082円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	151,788,646円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	3,397円
g. 分配金	223,377円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

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

- ※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合
分配金は全額普通分配金となります。
- ※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合
分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金（特別分配金）となります。
- ※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合
分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 50	% 0.463	(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)	(28)	(0.258)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.004	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.002)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.002	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.002)	
(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)	(0.010)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	51	0.481	
期中の平均基準価額は、10,707円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2016年12月23日～2017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	6,412	9,313	40,850	59,919
外国債券マザーファンド	3,965	8,539	9,934	21,621
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,863	4,249	18,396	42,237
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	12,024	15,660	20,207	26,289
J-REITインデックス マザーファンド	3,011	5,927	4,832	9,547
海外REITインデックス マザーファンド	2,943	6,251	6,304	13,608
新興国株式マザーファンド	2,417	2,652	31,594	34,606
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	749	957	4,734	6,047

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年12月23日～2017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	18,843,247千円	27,100,796千円	3,198,136千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	316,699,661千円	344,270,300千円	19,086,551千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.05	0.07	0.16

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年12月23日～2017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>
該当事項はございません。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 7,534	百万円 6	% 0.1	百万円 11,308	百万円 —	% —
貸株	63,988	5,795	9.1	70,366	4,855	6.9

平均保有割合 0.1%

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

*貸株の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 21,472	百万円 3,347	% 15.6	百万円 17,462	百万円 142	% 0.8

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 5,235	百万円 1,343	% 25.7	百万円 2,776	百万円 1,152	% 41.5

平均保有割合 0.7%

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 65,244	百万円 2,697	% 4.1	百万円 49,932	百万円 —	% —

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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 31,631	百万円 1,512	% 4.8	百万円 33,588	百万円 1,765	% 5.3
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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,564	百万円 410	% 11.5	百万円 2,787	百万円 408	% 14.6
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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 10,829	百万円 248	% 2.3	百万円 4,743	百万円 247	% 5.2
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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,173	百万円 438	% 13.8	百万円 1,432	百万円 113	% 7.9
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
株式	百万円 40	百万円 63	百万円 1,921

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 51

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)	45千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.116千円
(B) / (A)	0.3%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017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	269,804	235,366	361,287
外国債券マザーファンド	75,130	69,161	152,792
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	106,515	89,981	214,002
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	157,163	148,979	194,240
J-REITインデックス マザーファンド	36,104	34,284	65,973
海外REITインデックス マザーファンド	34,739	31,378	68,452
新興国株式マザーファンド	149,434	120,257	139,426
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	27,122	23,137	30,369

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017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	361,287	29.2
外国債券マザーファンド	152,792	12.4
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	214,002	17.3
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	194,240	15.7
J-REITインデックス マザーファンド	65,973	5.3
海外REITインデックス マザーファンド	68,452	5.5
新興国株式マザーファンド	139,426	11.3
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	30,369	2.5
コール・ローン等、その他	10,156	0.8
投資信託財産総額	1,236,697	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（665,651,281千円）の投資信託財産総額（666,879,542千円）に対する比率は99.8%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（378,580,609千円）の投資信託財産総額（380,941,266千円）に対する比率は99.4%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（20,450,448千円）の投資信託財産総額（20,487,659千円）に対する比率は99.8%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（22,409,847千円）の投資信託財産総額（22,706,950千円）に対する比率は98.7%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（4,925,826千円）の投資信託財産総額（4,981,419千円）に対する比率は98.9%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1 カタールリヤル=30.32円、1 米ドル=111.14円、1 カナダドル=83.45円、1 英ポンド=140.87円、1 スイスフラン=114.21円、1 スウェーデンクローナ=12.69円、1 ノルウェークローネ=13.02円、1 デンマーククローネ=16.67円、1 トルコリラ=31.49円、1 ユーロ=124.02円、1 チェココルナ=4.72円、1 フォリント=0.401円、1 ズロチ=29.16円、1 ルーブル=1.85円、1 レイ=26.99円、1 香港ドル=14.25円、1 シンガポールドル=80.07円、1 リンギ=25.94円、1 パーツ=3.27円、1 フィリピンペソ=2.21円、1 ルピア=0.0084円、1 ウォン=0.0977円、1 新台湾ドル=3.65円、1 豪ドル=84.00円、1 ニュージーランドドル=80.59円、1 インドルピー=1.74円、1 新シェケル=31.39円、1 パキスタンルピー=1.07円、1 アルゼンチンペソ=6.85円、1 メキシコペソ=6.10円、1 レアル=33.32円、1 チリペソ=0.167円、1 コロンビアペソ=0.0363円、1 ソル=33.97円、1 UAEディルハム=30.34円、1 エジプトポンド=6.12円、1 ランド=8.50円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年6月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,236,697,593
コール・ローン等	7,495,841
国内株式マザーファンド(評価額)	361,287,299
外国債券マザーファンド(評価額)	152,792,429
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	214,002,716
国内債券NOMURA-BPT総合 マザーファンド(評価額)	194,240,026
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	65,973,020
海外REITインデックス マザーファンド(評価額)	68,452,175
新興国株式マザーファンド(評価額)	139,426,356
新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド(評価額)	30,369,951
未収入金	2,657,780
(B) 負債	8,888,623
未払収益分配金	557,030
未払解約金	2,442,460
未払信託報酬	5,868,712
未払利息	10
その他未払費用	20,411
(C) 純資産総額(A－B)	1,227,808,970
元本	1,114,060,864
次期繰越損益金	113,748,106
(D) 受益権総口数	1,114,060,864口
1万口当たり基準価額(C／D)	11,021円

(注) 期首元本額は1,257,832,564円、期中追加設定元本額は41,534,117円、期中一部解約元本額は185,305,817円、1口当たり純資産額は1.1021円です。

○損益の状況 (2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,053
支払利息	△ 1,053
(B) 有価証券売買損益	44,901,394
売買益	50,130,317
売買損	△ 5,228,923
(C) 信託報酬等	△ 5,889,123
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	39,011,218
(E) 前期繰越損益金	189,970,267
(F) 追加信託差損益金	△114,676,349
(配当等相当額)	(63,090,112)
(売買損益相当額)	(△177,766,461)
(G) 計(D＋E＋F)	114,305,136
(H) 収益分配金	△ 557,030
次期繰越損益金(G＋H)	113,748,106
追加信託差損益金	△114,676,349
(配当等相当額)	(63,185,031)
(売買損益相当額)	(△177,861,380)
分配準備積立金	268,649,264
繰越損益金	△ 40,224,809

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

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

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

(注) 分配金の計算過程 (2016年12月23日～2017年6月22日) は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年12月23日～ 2017年6月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	12,482,350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	63,185,031円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	256,723,944円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	332,391,325円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,983円
g. 分配金	557,030円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

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

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

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

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

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	88	0.463	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(34)	(0.178)	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)	(49)	(0.258)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口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 ※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 ※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	2	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)	(2)	(0.010)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	91	0.481	
期中の平均基準価額は、18,926円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2016年12月23日～2017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	2,275	3,312	4,114	6,045
外国債券マザーファンド	740	1,593	834	1,819
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	848	1,934	1,892	4,351
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	1,750	2,277	1,589	2,068
J-REITインデックス マザーファンド	482	951	435	862
海外REITインデックス マザーファンド	446	947	546	1,174
新興国株式マザーファンド	1,095	1,206	3,212	3,528
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	194	248	388	497

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年12月23日～2017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	18,843,247千円	27,100,796千円	3,198,136千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	316,699,661千円	344,270,300千円	19,086,551千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.05	0.07	0.16

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年12月23日～2017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>
該当事項はございません。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 7,534	百万円 6	% 0.1	百万円 11,308	百万円 —	% —
貸株	63,988	5,795	9.1	70,366	4,855	6.9

平均保有割合 0.0%

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

*貸株の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

<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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 21,472	百万円 3,347	% 15.6	百万円 17,462	百万円 142	% 0.8

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 5,235	百万円 1,343	% 25.7	百万円 2,776	百万円 1,152	% 41.5

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 65,244	百万円 2,697	% 4.1	百万円 49,932	百万円 —	% —

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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 31,631	百万円 1,512	% 4.8	百万円 33,588	百万円 1,765	% 5.3
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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,564	百万円 410	% 11.5	百万円 2,787	百万円 408	% 14.6
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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 10,829	百万円 248	% 2.3	百万円 4,743	百万円 247	% 5.2
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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,173	百万円 438	% 13.8	百万円 1,432	百万円 113	% 7.9
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
株式	百万円 40	百万円 63	百万円 1,921

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 51

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)	4千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.01千円
(B) / (A)	0.2%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017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	27,384	25,545	39,212
外国債券マザーファンド	5,970	5,877	12,984
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	10,805	9,760	23,214
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	11,745	11,906	15,523
J-REITインデックス マザーファンド	3,019	3,065	5,899
海外REITインデックス マザーファンド	2,904	2,805	6,120
新興国株式マザーファンド	15,179	13,062	15,145
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	2,197	2,002	2,628

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017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	39,212	32.3
外国債券マザーファンド	12,984	10.7
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	23,214	19.1
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	15,523	12.8
J-REITインデックス マザーファンド	5,899	4.9
海外REITインデックス マザーファンド	6,120	5.0
新興国株式マザーファンド	15,145	12.5
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	2,628	2.2
コール・ローン等、その他	730	0.5
投資信託財産総額	121,455	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（665,651,281千円）の投資信託財産総額（666,879,542千円）に対する比率は99.8%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（378,580,609千円）の投資信託財産総額（380,941,266千円）に対する比率は99.4%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（20,450,448千円）の投資信託財産総額（20,487,659千円）に対する比率は99.8%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（22,409,847千円）の投資信託財産総額（22,706,950千円）に対する比率は98.7%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（4,925,826千円）の投資信託財産総額（4,981,419千円）に対する比率は98.9%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1 カタールリヤル=30.32円、1 米ドル=111.14円、1 カナダドル=83.45円、1 英ポンド=140.87円、1 スイスフラン=114.21円、1 スウェーデンクローナ=12.69円、1 ノルウェークローネ=13.02円、1 デンマーククローネ=16.67円、1 トルコリラ=31.49円、1 ユーロ=124.02円、1 チェココルナ=4.72円、1 フォリント=0.401円、1 ズロチ=29.16円、1 ルーブル=1.85円、1 レイ=26.99円、1 香港ドル=14.25円、1 シンガポールドル=80.07円、1 リンギ=25.94円、1 パーツ=3.27円、1 フィリピンペソ=2.21円、1 ルピア=0.0084円、1 ウォン=0.0977円、1 新台湾ドル=3.65円、1 豪ドル=84.00円、1 ニュージーランドドル=80.59円、1 インドルピー=1.74円、1 新シェケル=31.39円、1 パキスタンルピー=1.07円、1 アルゼンチンペソ=6.85円、1 メキシコペソ=6.10円、1 レアル=33.32円、1 チリペソ=0.167円、1 コロンビアペソ=0.0363円、1 ソル=33.97円、1 UAEディルハム=30.34円、1 エジプトポンド=6.12円、1 ランド=8.50円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年6月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	121,455,274
コール・ローン等	677,576
国内株式マザーファンド(評価額)	39,212,617
外国債券マザーファンド(評価額)	12,984,844
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	23,214,517
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド(評価額)	15,523,269
J-REITインデックスマザーファンド(評価額)	5,899,224
海外REITインデックスマザーファンド(評価額)	6,120,907
新興国株式マザーファンド(評価額)	15,145,096
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額)	2,628,742
未収入金	48,482
(B) 負債	603,323
未払収益分配金	30,931
未払解約金	11,661
未払信託報酬	558,854
その他未払費用	1,877
(C) 純資産総額(A-B)	120,851,951
元本	61,863,984
次期繰越損益金	58,987,967
(D) 受益権総口数	61,863,984口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,535円

(注) 期首元本額は65,691,056円、期中追加設定元本額は7,436,339円、期中一部解約元本額は11,263,411円、1口当たり純資産額は1.9535円です。

○損益の状況 (2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 41
支払利息	△ 41
(B) 有価証券売買損益	4,818,523
売買益	5,374,137
売買損	△ 555,614
(C) 信託報酬等	△ 560,731
(D) 当期損益金(A+B+C)	4,257,751
(E) 前期繰越損益金	5,503,032
(F) 追加信託差損益金	49,258,115
(配当等相当額)	(35,587,380)
(売買損益相当額)	(13,670,735)
(G) 計(D+E+F)	59,018,898
(H) 収益分配金	△ 30,931
次期繰越損益金(G+H)	58,987,967
追加信託差損益金	49,258,115
(配当等相当額)	(35,632,040)
(売買損益相当額)	(13,626,075)
分配準備積立金	9,729,852

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2016年12月23日～2017年6月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年12月23日～ 2017年6月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,254,945円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	1,260,688円
c. 信託約款に定める収益調整金	49,258,115円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	7,245,150円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	59,018,898円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	9,540円
g. 分配金	30,931円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

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

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

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

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

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 49	% 0.463	(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)	(0.258)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口内でのファンドの管理および事務手続き等
(受 託 会 社)	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.004	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.003)	
(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	0.002	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(0)	(0.002)	
(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)	(0.000)	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、10,568円です。			

* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

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

○売買及び取引の状況

(2016年12月23日～2017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	21,609	31,663	13,008	19,308
外国債券マザーファンド	3,783	8,200	2,090	4,573
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	8,209	18,877	5,194	12,139
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	7,681	9,988	4,073	5,295
J-REITインデックス マザーファンド	2,510	4,974	1,357	2,671
海外REITインデックス マザーファンド	2,246	4,828	1,294	2,802
新興国株式マザーファンド	11,226	12,296	7,758	8,692
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	1,217	1,556	763	989

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年12月23日～2017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	18,843,247千円	27,100,796千円	3,198,136千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	316,699,661千円	344,270,300千円	19,086,551千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.05	0.07	0.16

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年12月23日～2017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>
該当事項はございません。

＜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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 7,534	百万円 6	% 0.1	百万円 11,308	百万円 －	% －
貸株	63,988	5,795	9.1	70,366	4,855	6.9

平均保有割合 0.0%

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

*貸株の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

＜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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 21,472	百万円 3,347	% 15.6	百万円 17,462	百万円 142	% 0.8

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 5,235	百万円 1,343	% 25.7	百万円 2,776	百万円 1,152	% 41.5

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 65,244	百万円 2,697	% 4.1	百万円 49,932	百万円 －	% －

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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 31,631	百万円 1,512	% 4.8	百万円 33,588	百万円 1,765	% 5.3
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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,564	百万円 410	% 11.5	百万円 2,787	百万円 408	% 14.6
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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 10,829	百万円 248	% 2.3	百万円 4,743	百万円 247	% 5.2
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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 3,173	百万円 438	% 13.8	百万円 1,432	百万円 113	% 7.9
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
株式	百万円 40	百万円 63	百万円 1,921

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<国内株式マザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 51

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)	5千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.011千円
(B) / (A)	0.2%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○ 自社による当ファンドの設定、解約状況

(2016年12月23日～2017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 1	百万円 －	百万円 0	百万円 0	当初設定時における取得とその処分

○ 組入資産の明細

(2017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	21,712	30,314	46,532
外国債券マザーファンド	3,578	5,271	11,645
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	8,564	11,578	27,537
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	6,977	10,584	13,800
J-REITインデックス マザーファンド	2,220	3,374	6,493
海外REITインデックス マザーファンド	2,136	3,088	6,737
新興国株式マザーファンド	12,042	15,510	17,982
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	1,248	1,703	2,235

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017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	46,532	34.8
外国債券マザーファンド	11,645	8.7
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	27,537	20.6
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	13,800	10.3
J-REITインデックス マザーファンド	6,493	4.9
海外REITインデックス マザーファンド	6,737	5.0
新興国株式マザーファンド	17,982	13.4
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	2,235	1.7
コール・ローン等、その他	750	0.6
投資信託財産総額	133,711	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（665,651,281千円）の投資信託財産総額（666,879,542千円）に対する比率は99.8%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（378,580,609千円）の投資信託財産総額（380,941,266千円）に対する比率は99.4%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（20,450,448千円）の投資信託財産総額（20,487,659千円）に対する比率は99.8%です。

*新興国株式マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（22,409,847千円）の投資信託財産総額（22,706,950千円）に対する比率は98.7%です。

*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（4,925,826千円）の投資信託財産総額（4,981,419千円）に対する比率は98.9%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1 カタールリヤル=30.32円、1 米ドル=111.14円、1 カナダドル=83.45円、1 英ポンド=140.87円、1 スイスフラン=114.21円、1 スウェーデンクローナ=12.69円、1 ノルウェークローネ=13.02円、1 デンマーククローネ=16.67円、1 トルコリラ=31.49円、1 ユーロ=124.02円、1 チェココルナ=4.72円、1 フォリント=0.401円、1 ズロチ=29.16円、1 ルーブル=1.85円、1 レイ=26.99円、1 香港ドル=14.25円、1 シンガポールドル=80.07円、1 リンギ=25.94円、1 パーツ=3.27円、1 フィリピンペソ=2.21円、1 ルピア=0.0084円、1 ウォン=0.0977円、1 新台湾ドル=3.65円、1 豪ドル=84.00円、1 ニュージーランドドル=80.59円、1 インドルピー=1.74円、1 新シェケル=31.39円、1 パキスタンルピー=1.07円、1 アルゼンチンペソ=6.85円、1 メキシコペソ=6.10円、1 レアル=33.32円、1 チリペソ=0.167円、1 コロンビアペソ=0.0363円、1 ソル=33.97円、1 UAEディルハム=30.34円、1 エジプトポンド=6.12円、1 ランド=8.50円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年6月22日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	133,711,740
コール・ローン等	746,576
国内株式マザーファンド(評価額)	46,532,674
外国債券マザーファンド(評価額)	11,645,517
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	27,537,769
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド(評価額)	13,800,419
J-REITインデックスマザーファンド(評価額)	6,493,188
海外REITインデックスマザーファンド(評価額)	6,737,194
新興国株式マザーファンド(評価額)	17,982,580
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド(評価額)	2,235,823
(B) 負債	609,792
未払収益分配金	60,858
未払解約金	5,048
未払信託報酬	542,064
未払利息	1
その他未払費用	1,821
(C) 純資産総額(A-B)	133,101,948
元本	121,716,559
次期繰越損益金	11,385,389
(D) 受益権総口数	121,716,559口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,935円

(注) 期首元本額は86,864,327円、期中追加設定元本額は96,938,200円、期中一部解約元本額は62,085,968円、1口当たり純資産額は1.0935円です。

○損益の状況 (2016年12月23日～2017年6月22日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 54
支払利息	△ 54
(B) 有価証券売買損益	4,784,969
売買益	6,318,965
売買損	△ 1,533,996
(C) 信託報酬等	△ 543,885
(D) 当期損益金(A+B+C)	4,241,030
(E) 前期繰越損益金	3,096,464
(F) 追加信託差損益金	4,108,753
(配当等相当額)	(5,514,989)
(売買損益相当額)	(△ 1,406,236)
(G) 計(D+E+F)	11,446,247
(H) 収益分配金	△ 60,858
次期繰越損益金(G+H)	11,385,389
追加信託差損益金	4,108,753
(配当等相当額)	(5,766,698)
(売買損益相当額)	(△ 1,657,945)
分配準備積立金	7,276,636

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

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

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

(注) 分配金の計算過程(2016年12月23日～2017年6月22日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年12月23日～ 2017年6月22日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,297,572円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	2,943,458円
c. 信託約款に定める収益調整金	5,766,698円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	3,096,464円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	13,104,192円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,076円
g. 分配金	60,858円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

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

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

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

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

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2017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(218,817,797千円)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	6.3	6.2	19,747
日本水産	207.7	205.4	139,261
マルハニチロ	30.3	30	91,050
カネコ種苗	5.5	5.4	7,965
サカタのタネ	23.6	23.3	82,016
ホクト	16.3	16.1	31,491
ホクリヨウ	1.7	2.2	2,208
鉱業 (0.3%)			
住石ホールディングス	44.4	43.9	4,390
日鉄鉱業	4.4	4.4	26,092
三井松島産業	9.8	9.7	13,201
国際石油開発帝石	842.7	833.3	851,632
日本海洋掘削	5.6	5.5	12,111
石油資源開発	25.3	25.1	55,872
K&Oエナジーグループ	10.8	10.6	19,048
建設業 (3.2%)			
ショーボンドホールディングス	16.8	15.3	88,893
ミライト・ホールディングス	49.2	48.7	62,092
タマホーム	12	11.9	7,556
サンヨーホームズ	3.4	3.3	2,145
ファーストコーポレーション	—	3.5	3,857
インベスターズクラウド	—	2	10,300
ダイセキ環境ソリューション	3.7	4.4	5,803
安藤・間	114.9	113.7	76,520
東急建設	56.8	56.2	53,614
コムシスホールディングス	62.5	61.8	148,196
ミサワホーム	18.9	18.7	19,335
ピーアールホールディングス	15.8	15.7	5,981

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
高松コンストラクショングループ	12.1	11.9	33,284
東建コーポレーション	6.6	5.9	81,420
ソネック	2	2	1,588
ヤマウラ	7.5	7.4	7,096
大成建設	813	804	861,888
大林組	479.8	474.4	642,337
清水建設	489	484	594,352
飛鳥建設	154.1	152.4	25,908
長谷工コーポレーション	186.7	184.6	255,486
松井建設	17.6	17.4	15,486
銭高組	23	23	10,212
鹿島建設	703	695	675,540
不動テトラ	129.1	127.7	23,496
大末建設	5.6	5.6	5,600
鉄建建設	97	96	33,216
西松建設	185	183	114,009
三井住友建設	613	606.1	73,944
大豊建設	58	57	31,179
前田建設工業	99	104	136,136
佐田建設	11	10.9	4,785
ナカノフドー建設	12.2	12.1	7,986
奥村組	132	130	102,700
東鉄工業	19.2	19	66,880
イチケン	14	14	5,628
浅沼組	51	55	18,150
戸田建設	186	184	132,480
熊谷組	251	248	89,280
青木あすなろ建設	10.5	10.4	9,037
北野建設	33	33	10,791

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
植木組	20	20	5,260
三井ホーム	21	20	15,040
矢作建設工業	21.8	21.5	19,866
ピーエス三菱	16.8	16.7	8,350
日本ハウスホールディングス	32.6	32.2	17,130
大東建託	58.9	57.3	1,031,686
新日本建設	19	18.8	18,198
N I P P O	37	37	83,509
東亜道路工業	30	30	14,160
前田道路	50	50	110,900
日本道路	48	47	27,777
東亜建設工業	13	12.8	23,283
若築建設	92	91	15,288
東洋建設	46	45.5	19,610
五洋建設	177.5	175.5	116,883
大林道路	16.6	16.4	15,366
世紀東急工業	23.3	23	13,317
福田組	26	26	28,080
住友林業	110.1	108.9	196,455
日本基礎技術	17.8	17.6	6,582
日成ビルド工業	47	47	29,281
ヤマダ・エスバイエルホーム	81	80	6,560
巴コーポレーション	19.9	19.7	7,170
パナホーム	60	59	70,564
大和ハウス工業	472.5	467.3	1,794,432
ライト工業	30.7	30.4	37,300
積水ハウス	503.4	484.4	955,479
日特建設	13.6	13.5	7,924
北陸電気工事	7.7	7.7	7,322
ユアテック	25	25	19,525
西部電気工業	2.7	2.6	6,000
四電工	12	12	5,976
中電工	20.2	17.8	52,314
関電工	64	63	75,285
きんでん	106.4	105.2	189,360
東京エネシス	17	16.3	16,153
トーエネック	22	22	15,290
住友電設	11.1	10.9	17,549
日本電設工業	26.1	25.8	60,475
協和エクシオ	62.7	62	120,466

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
新日本空調	12.3	12.2	19,507
N D S	2.5	2.5	7,525
九電工	31.1	30.7	127,712
三機工業	35.5	35.1	43,488
日揮	149.3	147.6	253,872
中外炉工業	48	48	10,512
ヤマト	14.3	14.2	9,002
太平電業	22	21	27,405
高砂熱学工業	44	43.5	79,909
三晃金属工業	1.4	1.4	4,620
朝日工業社	3.6	3.6	11,142
明星工業	29	28.6	19,076
大気社	21.2	21	62,853
ダイダゲン	21	21	27,867
日比谷総合設備	17.9	17.7	33,665
東芝プラントシステム	26	25.7	46,414
O S J Bホールディングス	48.9	48.3	14,151
東洋エンジニアリング	94	93	25,482
千代田化工建設	115	114	71,478
新興プランテック	32.8	32.5	27,950
食料品 (4.7%)			
日本製粉	47.6	47	86,621
日清製粉グループ本社	175.4	173.4	331,540
日東富士製粉	1	1	3,940
昭和産業	66	65	40,625
鳥越製粉	12.7	12.6	10,130
中部飼料	17.5	17.3	25,984
フィード・ワン	96.3	95.2	22,276
東洋精糖	24	24	2,808
日本甜菜製糖	8.2	8.1	17,617
三井製糖	11.3	11.2	36,512
塩水港精糖	17.1	16.9	4,157
日新製糖	6.8	6.7	12,482
森永製菓	31.2	30.9	208,266
中村屋	3.7	3.7	18,944
江崎グリコ	40	39.6	251,460
名糖産業	6.9	6.8	9,860
不二家	91	90	22,950
山崎製パン	117.2	115.9	271,669
第一屋製パン	25	24	2,952

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
モロゾフ	24	24	15,384
亀田製菓	8.9	8.8	50,072
寿スビリッツ	11.4	15	59,175
カルビー	65.2	64.5	290,572
森永乳業	143	142	129,078
六甲バター	7.1	7.1	19,326
ヤクルト本社	85.8	84.8	686,880
明治ホールディングス	94.8	93.7	881,717
雪印メグミルク	34.5	34.1	111,166
ブリマハム	101	100	68,400
日本ハム	109	111	392,385
林兼産業	5.1	5.1	4,299
丸大食品	76	76	40,432
S F o o d s	8.6	8.5	34,510
伊藤ハム米久ホールディングス	92.3	91.2	94,483
サッポロホールディングス	52.4	51.8	167,055
アサヒグループホールディングス	300.1	296.8	1,281,582
キリンホールディングス	688.8	681.1	1,617,953
宝ホールディングス	115.8	114.5	138,201
オエノンホールディングス	41	40	11,360
養命酒製造	4.9	4.9	10,255
コカ・コーラボトラーズジャパン	54.2	99.8	328,342
コカ・コーライーストジャパン	62.3	—	—
サントリー食品インターナショナル	109.6	108.4	590,780
ダイドーグループホールディングス	7.3	7.3	41,902
伊藤園	47.5	46.9	200,497
キーコーヒー	14.1	13.9	30,538
ユニカフェ	4.3	4.3	4,261
ジャパンフーズ	2	2	2,756
日清オイリオグループ	92	91	63,245
不二製油グループ本社	42.7	42.2	115,037
かどや製油	1.6	1.5	7,920
Jーオイルミルズ	7.4	7.3	29,893
キッコーマン	112	110.7	417,892
味の素	329.6	325.9	819,475
キュービー	81.4	80.5	237,636
ハウス食品グループ本社	59.2	58.6	176,386
カゴメ	57.4	56.8	206,468
焼津水産化学工業	7.5	7.4	8,961
アリアケジャパン	13.1	12.9	105,909

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ビエトロ	1.9	1.9	3,100
エバラ食品工業	3.8	3.8	8,014
ニチレイ	78.7	77.8	257,907
東洋水産	78.6	77.8	345,043
イートアンド	1.8	1.7	3,891
大冷	—	1.6	2,924
ヨシムラ・フード・ホールディングス	—	0.3	842
日清食品ホールディングス	62.5	61.8	446,814
永谷園ホールディングス	15	15	21,525
一正蒲鉾	5.6	5.5	7,694
フジッコ	15.5	15.3	40,529
ロック・フィールド	16.6	15.3	29,942
日本たばこ産業	886.6	876.7	3,515,567
ケンコーマヨネーズ	5.7	8.5	28,135
わらべや日洋ホールディングス	9.4	9.3	29,481
なとり	8	7.9	17,174
イフジ産業	—	2.5	1,880
北の達人コーポレーション	3.4	6.8	5,576
ユーグレナ	51.4	54.6	64,537
ミヨシ油脂	55	54	7,830
理研ビタミン	4.7	4.7	20,844
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	18.7	18.5	24,882
グンゼ	112	110	44,440
東洋紡	592	586	121,302
ユニチカ	410	405	32,805
富士紡ホールディングス	7.3	7.2	23,904
倉敷紡績	151	149	38,293
シキボウ	81	80	11,760
日本毛織	42.2	41.7	39,198
ダイトウボウ	20	20	1,440
トーア紡コーポレーション	6.3	6.3	3,465
ダイドーリミテッド	16.7	16.5	7,260
帝国繊維	15.6	15.5	29,264
帝人	122.2	120.9	262,715
東レ	1,085	1,072.8	998,884
サカイオーベックス	3.6	3.5	6,020
住江織物	37	40	10,440
日本フエルト	8.6	8.5	4,352
イチカワ	10	10	3,130

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日東製綱	1.6	1.6	2,945
アツギ	123	121	14,762
ダイニツク	28	28	5,236
セーレン	37.2	36.8	64,252
ソトー	5.6	5.5	6,292
東海染工	21	21	2,814
小松精練	21	20.8	15,433
ワコールホールディングス	89	88	135,168
ホギメディカル	9.4	9.3	72,168
レナウン	40.4	40	6,120
クラウドシア	3.4	3.4	2,142
T S I ホールディングス	61.6	60.9	49,085
三陽商会	78	77	13,552
ナイガイ	55	54	3,510
オンワードホールディングス	97	96	79,584
ルック	27	27	6,993
キムラタン	631	624	4,368
ゴールドウイン	6.3	6.3	43,407
デサント	34.1	33.7	51,055
キング	7.4	7.3	3,007
ヤマトインターナショナル	9.2	9.8	4,204
パルプ・紙 (0.3%)			
特種東海製紙	8.7	8.6	35,303
王子ホールディングス	585	578	331,772
日本製紙	67	66.3	148,313
三菱製紙	21.3	21	16,065
北越紀州製紙	83.5	82.6	74,009
中越パルプ工業	59	59	14,219
巴川製紙所	23	23	5,497
大王製紙	59.6	58.9	90,529
阿波製紙	2.7	3.6	2,217
レンゴー	144.2	142.6	90,123
トーモク	47	47	17,813
ザ・バック	10.6	10.5	38,535
化学 (7.0%)			
クラレ	251.7	248.9	526,672
旭化成	933	922	1,099,946
共和レザー	8.7	8.6	7,929
昭和電工	99.5	98.4	245,901
住友化学	1,101	1,089	665,379

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本化成	28	—	—
住友精化	6.2	6.1	33,550
日産化学工業	81.9	81	303,345
ラサ工業	56	56	7,784
クレハ	11.3	11.2	62,608
多木化学	10	10	9,080
テイカ	23	23	22,172
石原産業	26.9	26.6	28,754
片倉コープアグリ	20	20	5,380
日東エフシー	8.7	8.6	8,152
日本曹達	90	89	53,489
東ソー	432	428	481,928
トクヤマ	233	230	117,070
セントラル硝子	152	151	70,970
東亜合成	93.6	92.6	131,862
大阪ソーダ	64	64	34,304
関東電化工業	31	30.3	26,997
デンカ	310	306	167,382
信越化学工業	268.2	265.2	2,667,912
日本カーバイド工業	51	50	8,900
堺化学工業	56	55	24,090
エア・ウォーター	123.3	121.9	245,750
大陽日酸	115.2	113.9	140,438
日本化学工業	55	55	12,155
日本パーカライジニング	76.4	75.6	128,973
高圧ガス工業	22.2	21.9	17,804
チタン工業	17	17	3,281
四国化成工業	22	21	28,308
戸田工業	30	29	7,975
ステラ ケミファ	7.1	7.2	20,880
保土谷化学工業	5.2	5.2	22,698
日本触媒	23.5	23.3	164,964
大日精化工業	62	61	53,802
カネカ	202	199	167,359
三菱瓦斯化学	139.3	137.8	316,526
三井化学	680	672	379,680
J S R	150.3	148.7	275,689
東京応化工業	28	27.7	106,229
大阪有機化学工業	9.7	9.6	13,756
三菱ケミカルホールディングス	1,001.6	996.3	887,504

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
KHネオケム	18.3	24.2	49,948
ダイセル	201.7	199.4	255,630
住友ベークライト	132	130	102,830
積水化学工業	339.5	335.7	673,078
日本ゼオン	126	125	144,125
アイカ工業	47.9	47.4	157,131
宇部興産	753	745	207,855
積水樹脂	23.1	22.8	47,104
タキロンシーアイ	31	31	19,127
旭有機材	48	48	11,856
日立化成	83.1	82.2	274,548
ニチバン	15	15	14,325
リケンテクノス	32.2	31.9	18,629
大倉工業	36	35	21,770
積水化成品工業	21.3	20.6	18,601
群栄化学工業	3.6	3.6	13,212
タイガースポリマー	7.4	7.3	5,555
ミライアル	5.4	5.3	5,898
ダイキアクシス	2.5	2.4	5,628
ダイキョーニシカワ	26.2	25.9	38,332
日本化薬	97	96	156,096
カーリットホールディングス	13.9	13.7	8,055
日本精化	12.4	12.2	11,931
扶桑化学工業	10.6	10.5	39,952
ADEKA	64.3	63.6	106,148
日油	120	114	161,994
新日本理化	23.6	23.3	3,704
ハリマ化成グループ	12.7	12.6	10,546
花王	379.8	368.9	2,508,151
第一工業製薬	33	33	16,203
日華化学	—	4.7	5,682
ニイタカ	2.2	2.1	3,723
三洋化成工業	9.4	9.3	49,104
有機合成薬品工業	9.7	9.6	2,736
大日本塗料	86	85	24,990
日本ペイントホールディングス	115.4	114.1	473,515
関西ペイント	157.1	155.4	393,628
神東塗料	11	11	2,233
中国塗料	42.9	42.4	35,361
日本特殊塗料	10.5	10.4	17,004

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
藤倉化成	20.3	20.1	12,663
太陽ホールディングス	12.2	12	61,920
D I C	59.1	58.4	227,468
サカタインクス	30.5	30.2	53,937
東洋インキＳＣホールディングス	148	146	85,410
T&K TOKA	10.8	10.7	12,861
富士フィルムホールディングス	296.6	293.3	1,186,398
資生堂	283.7	280.6	1,139,236
ライオン	186	183.6	448,534
高砂香料工業	9.8	9.7	41,128
マンダム	15	14.8	91,612
ミルボン	8.1	8	49,520
ファンケル	31.8	31.4	66,536
コーセー	24.2	23.9	306,876
コタ	5.6	6.1	7,759
シーズ・ホールディングス	19.4	19.2	79,776
シーボン	1.7	1.7	4,210
ポーラ・オルビスホールディングス	15.2	60.3	182,106
ノエビアホールディングス	9.4	9.3	53,289
アジュバンコスメジヤパン	2.8	2.8	2,646
エステー	10.2	10.1	25,613
アグロ カネショウ	5.8	5.7	8,755
コニシ	23.5	23.2	37,468
長谷川香料	18.9	18.7	43,234
星光PMC	8.2	8.1	10,189
小林製薬	41.5	39.6	271,260
荒川化学工業	12.8	12.7	25,908
メック	11.6	11.4	15,093
日本高純度化学	4.2	4.2	10,172
タカラバイオ	32	42.2	65,747
J C U	4.7	9.3	37,200
新田ゼラチン	9	8.9	6,621
OATアグリオ	1.7	1.7	2,721
デクセリアルズ	39.1	38.8	42,020
アース製薬	10.7	10.6	62,328
イハラケミカル工業	20.7	—	—
北興化学工業	15	14.5	6,989
大成ラミック	4.2	4.6	13,386
クミアイ化学工業	30.8	62.6	40,377
日本農薬	34.1	36.8	23,552

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アキレス	12.2	12.1	23,449
有沢製作所	25.3	25	21,375
日東電工	107.8	106.6	945,222
レック	4.7	9.2	25,907
きもと	26.7	26.4	6,600
藤森工業	11.1	11	37,675
前澤化成工業	9.8	9.7	12,134
J S P	7	6.9	21,321
エフピコ	13.3	13.1	82,399
天馬	9.9	9.8	20,580
信越ポリマー	29.3	29	24,737
東リ	35.6	35.2	13,446
ニフコ	26.2	25.9	156,954
日本バルカー工業	11.6	11.5	25,369
ユニ・チャーム	302.7	299.4	870,056
医薬品 (4.7%)			
協和発酵キリン	178.9	176.9	365,298
武田薬品工業	560.6	554.5	3,196,138
アステラス製薬	1,527.6	1,510.7	2,095,340
大日本住友製薬	105.8	104.7	177,675
塩野義製薬	202.4	187.6	1,180,942
田辺三菱製薬	174.2	172.3	443,500
わかもと製薬	17	17	4,913
あすか製薬	16.3	16.1	27,643
日本新薬	34.3	33.9	245,097
バイオフェルミン製薬	2.4	2.4	7,284
中外製薬	148.9	147.2	612,352
科研製薬	27.9	27.6	164,496
エーザイ	184.1	182	1,140,230
ロート製薬	73.2	72.4	174,918
小野薬品工業	339.6	335.8	839,835
久光製薬	42.2	41.7	231,852
持田製薬	10.2	9.9	80,091
参天製薬	275.5	267.1	407,594
扶桑薬品工業	5	5	13,960
日本ケミファ	2.1	2.1	11,235
ツムラ	50.2	49.6	228,656
日医工	35	34.6	58,612
キッセイ薬品工業	26.5	26.2	79,910
生化学工業	27.7	27.4	51,046

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
栄研化学	12.5	12.4	41,478
日水製薬	6	5.9	8,372
鳥居薬品	10.2	10.1	28,098
J C R ファーマ	11.5	11.4	33,037
東和薬品	6.9	6.8	36,312
富士製薬工業	4.8	4.8	18,816
沢井製薬	25.4	25.1	157,377
ゼリア新薬工業	30.6	30.3	60,266
第一三共	440	435.1	1,094,929
キョーリン製薬ホールディングス	36.5	36.1	90,069
大幸薬品	7.4	7.4	14,652
ダイト	8.3	8.8	21,357
大塚ホールディングス	321.5	317.9	1,551,987
大正製薬ホールディングス	32	31.6	276,500
ペプチドリーム	25.4	27.6	198,444
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	120.6	119.3	11,572
昭和シェル石油	133.6	132.2	137,620
ニチレキ	18.3	18.1	24,036
東燃ゼネラル石油	243	—	—
ユシロ化学工業	8	7.9	11,802
ビービー・カストロール	6.1	6	11,808
富士石油	34.7	34.3	11,078
MORESCO	5.1	5.1	10,439
出光興産	70.9	70.1	219,413
J X T G ホールディングス	1,659.4	2,254.6	1,072,287
コスモエネルギーホールディングス	45.1	44.6	73,367
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	90.2	89.2	198,559
東洋ゴム工業	78.9	78.1	175,803
ブリヂストン	504.6	499	2,448,094
住友ゴム工業	139.9	138.4	262,268
藤倉ゴム工業	12.5	12.3	8,081
オカモト	45	45	61,380
フコク	6.2	6.2	6,125
ニッタ	13.4	13.3	46,151
住友理工	27.7	27.4	31,181
三ツ星ベルト	36	34	42,160
バンドー化学	27.2	26.9	29,536

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ガラス・土石製品 (1.0%)			
日東紡績	121	119	65,331
旭硝子	736	728	680,680
日本板硝子	68.1	67.4	57,222
石塚硝子	21	21	4,557
日本山村硝子	59	59	11,033
日本電気硝子	309	305	251,930
オハラ	5.6	5.6	7,716
住友大阪セメント	278	274	144,672
太平洋セメント	902	892	338,068
日本ヒューム	14.3	14.2	9,826
日本コンクリート工業	33.3	32.9	12,831
三谷セキサン	7.5	7.4	21,075
アジアパイルホールディングス	18.4	18.2	13,340
東海カーボン	140	138.1	86,174
日本カーボン	73	73	25,842
東洋炭素	8.3	8.2	16,063
ノリタケカンパニーリミテド	8.4	8.3	32,453
TOTO	109.8	108.6	471,867
日本碍子	188.8	186.7	404,578
日本特殊陶業	128.8	127.4	292,128
ダントーホールディングス	12	12	1,812
MARUWA	5.5	5.4	24,894
品川リフラクトリーズ	38	37	10,064
黒崎播磨	32	32	13,952
ヨータイ	9	8	3,016
イソライト工業	7.3	7.2	2,728
東京窯業	18.1	17.9	3,741
ニッカトー	4.8	4.8	2,616
フジミインコーポレーテッド	12.7	12.6	28,778
エーアンドエーマテリアル	31	31	3,782
ニチアス	78	77	103,488
ニチハ	19.9	19.6	82,712
鉄鋼 (1.1%)			
新日鐵住金	674	666.5	1,586,270
神戸製鋼所	258.4	255.6	264,801
中山製鋼所	16.8	16.6	10,424
合同製鐵	8.4	8.3	14,608
ジェイ エフ イー ホールディングス	408.6	404	727,806
日新製鋼	68.2	48.2	55,912

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京製鐵	75.6	74.8	67,170
共英製鋼	15.9	15.7	27,490
大和工業	30	29.7	80,576
東京鐵鋼	31	31	11,935
大阪製鐵	9.4	9.3	19,269
淀川製鋼所	20.7	20.4	59,466
東洋鋼板	35.7	35.3	13,625
丸一鋼管	50	49.4	159,068
モリ工業	4.8	4.6	10,170
大同特殊鋼	250	248	151,776
日本高周波鋼業	52	52	4,264
日本冶金工業	123.7	122.3	26,539
山陽特殊製鋼	89	88	52,272
愛知製鋼	8.8	8.7	36,714
日立金属	152.1	150.4	214,470
日本金属	3.6	3.5	5,390
大平洋金属	95	94	26,038
新日本電工	84.6	83.6	30,764
栗本鐵工所	7.1	7	13,790
虹技	21	21	4,893
日本鑄鉄管	15	14	2,394
三菱製鋼	104	103	26,471
日亜鋼業	20.6	20.4	5,712
日本精線	10	10	6,910
シンニッタン	12.2	12.1	8,566
新家工業	32	32	5,984
非鉄金属 (0.9%)			
大紀アルミニウム工業所	25	25	14,125
日本軽金属ホールディングス	338.3	380.5	96,266
三井金属鉱業	406	402	170,046
東邦亜鉛	84	83	35,192
三菱マテリアル	93.3	92.2	286,281
住友金属鉱山	387	382	536,328
DOWAホールディングス	165	163	129,748
古河機械金属	233	230	42,780
大阪チタニウムテクノロジーズ	16.3	16.1	27,064
東邦チタニウム	25.3	25	19,350
UACJ	190	209	59,983
古河電気工業	50.1	49.6	252,464
住友電気工業	563.1	556.9	951,463

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
フジクラ	196.7	194.5	185,553
昭和電線ホールディングス	178	176	14,432
東京特殊電線	2.1	2.1	4,370
タツタ電線	28	27.7	15,539
沖電線	16	15	3,870
カナレ電気	2.1	2.1	5,239
平河ヒューテック	7	7	10,360
リョービ	91	90	40,590
アーレスティ	17.3	17.1	18,433
アサヒホールディングス	22.5	22.2	40,648
金属製品 (0.7%)			
稲葉製作所	7.9	7.9	11,328
宮地エンジニアリンググループ	43	42	10,668
トーカロ	9.8	9.7	35,405
アルファC o	5	4.9	12,083
SUMCO	156	154.3	259,224
川田テクノロジーズ	2.8	2.8	19,824
R S T e c h n o l o g i e s	0.5	0.7	6,062
東洋製綱グループホールディングス	106.2	105	195,825
ホッカンホールディングス	39	38	16,606
コロナ	7.8	7.7	8,893
横河ブリッジホールディングス	26.3	26	41,574
駒井ハルテック	2.9	2.8	6,179
高田機工	13	13	3,575
三和ホールディングス	148.3	146.7	179,854
文化シャッター	41.6	41.1	36,044
三協立山	19.6	19.4	34,454
アルインコ	10.3	10.1	11,301
東洋シャッター	3.7	3.6	2,322
L I X I L グループ	208.2	205.8	572,947
日本フィルコン	10.8	10.7	6,505
ノーリツ	29.3	28.9	65,053
長府製作所	15.9	15.8	43,102
リンナイ	25.5	25.2	267,120
ダイニチ工業	7.6	7.5	5,872
日東精工	21	21	9,849
三洋工業	19	19	4,180
岡部	31	30.7	31,344
ジーテクト	15.6	15.4	31,939
中国工業	2.1	2.1	1,537

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東ブレ	28.7	28.4	84,177
高周波熱錬	27.8	26.9	27,787
東京製綱	10.1	10	16,800
サンコール	7.9	7.8	4,765
モリテック スチール	7.5	7.4	2,146
パイオラックス	7.5	22.4	68,992
エイチワン	—	11.2	13,496
日本発條	140.7	139.1	161,912
中央発條	17	17	5,933
アドバネクス	2.6	2.5	4,532
立川ブラインド工業	6.2	6.1	7,320
三益半導体工業	11	12.4	21,315
機械 (5.0%)			
日本ドライケミカル	1.9	1.9	4,518
日本製鋼所	49.4	48.9	83,814
三浦工業	61.1	60.4	133,484
タクマ	48	47.3	54,300
ツガミ	40	40	33,680
オークマ	97	96	99,456
東芝機械	89	88	44,440
アマダホールディングス	201.1	198.9	261,553
アイダエンジニアリング	42.4	42	44,940
滝澤鉄工所	44	43	7,482
富士機械製造	45.5	45	73,710
牧野フライス製作所	74	74	66,822
オーエスジー	68.1	67.3	150,482
ダイジェット工業	17	17	2,958
旭ダイヤモンド工業	42.7	41.5	33,905
DMG 森精機	88.4	85.1	149,095
ソディック	37.9	37.5	48,600
ディスコ	17.5	17.3	319,877
日東工器	8.7	8.6	21,568
パンチ工業	5.4	5.3	6,105
富士ダイス	—	5.3	3,953
豊和工業	8.3	8.3	6,498
OKK	54	54	6,966
東洋機械金属	10.1	10	7,450
津田駒工業	33	33	5,973
エンシュウ	37	36	4,212
島精機製作所	19.5	19.3	100,360

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
N Cホールディングス	4.8	4.8	4,190
フリー	2.9	8.7	11,710
ヤマシンフィルタ	2.9	3.8	8,531
日阪製作所	20.3	20.1	19,135
やまびこ	27.4	27.1	34,146
ベガスミシン製造	14.3	14.1	10,166
ナブテスコ	77.7	76.8	254,592
三井海洋開発	15	14.8	34,898
レオン自動機	12.6	12.4	15,785
SMC	44.8	44.3	1,531,894
新川	12.4	12.3	9,151
ホソカワミクロン	25	5.3	26,606
ユニオンツール	6.5	6.4	21,504
オイレス工業	19.3	18	35,064
日精エー・エス・ビー機械	4.8	4.7	18,659
サトーホールディングス	18.6	18.4	50,066
日本エアータック	4.8	4.8	4,036
日精樹脂工業	11.8	11.7	12,378
オカダアイヨン	3.1	4.1	5,580
ワイエイシイホールディングス	5.6	5.5	7,518
小松製作所	689.4	681.7	1,877,401
住友重機械工業	436	431	314,199
日立建機	66.8	66	177,936
日工	4.5	4.4	9,548
巴工業	6.1	6	10,884
井関農機	153	151	33,975
TOWA	12.2	12.1	20,485
丸山製作所	31	3.1	5,508
北川鉄工所	6.8	6.8	16,075
ローツェ	5.3	7	19,005
タカキタ	5	4.9	2,567
クボタ	717.4	707.3	1,317,699
荏原実業	4.2	4.1	6,092
三菱化工機	49	49	12,446
月島機械	28.3	28	35,728
帝国電機製作所	10.9	10.7	12,337
東京機械製作所	56	55	4,070
新東工業	33.9	33.5	38,391
澁谷工業	12.5	12.3	41,881
アイチ コーポレーション	21.1	20.9	16,302

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
小森コーポレーション	35.9	35.5	50,339
鶴見製作所	11.1	11	19,723
住友精密工業	24	23	8,119
酒井重工業	28	28	9,044
荏原製作所	62	66.9	202,707
石井鐵工所	2.2	2.2	3,592
西島製作所	14.6	14.4	16,372
北越工業	16	15.9	15,486
ダイキン工業	194.9	192.7	2,177,510
オルガノ	28	28	15,596
トーヨーカネツ	69	68	20,604
栗田工業	84.5	81.5	253,057
椿本チエイン	85	84	80,136
大同工業	29	29	8,642
木村化工機	12.8	12.6	4,636
アネスト岩田	25.9	25.6	25,344
ダイフク	71.2	70.4	236,192
サムコ	3.6	3.9	3,545
加藤製作所	7.8	7.7	23,254
油研工業	28	28	6,440
タダノ	74.6	73.8	91,881
フジテック	41.6	41.1	57,087
CKD	42.8	42.3	72,248
キトー	18	17.8	20,398
平和	44.2	43.8	108,142
理想科学工業	14.2	14	30,226
SANKYO	39.7	39.3	150,126
日本金銭機械	13.1	13	15,262
マースエンジニアリング	8.1	8	20,240
福島工業	8.8	8.7	36,801
オーイズミ	6	5.9	3,392
ダイコク電機	5.9	5.8	10,167
竹内製作所	26.1	25.8	48,942
アマノ	44.2	43.7	105,972
JUK I	22.5	22.3	34,141
サンデンホールディングス	87	86	25,026
蛇の目ミシン工業	13.8	13.7	12,110
マックス	22	22	35,992
グローリー	45.6	45.1	169,125
新晃工業	10	13.1	24,104

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大和冷機工業	22.9	22.7	27,625
セガサミーホールディングス	141.6	140	205,660
日本ビストンリング	5.6	5.5	12,111
リケン	6.6	6.5	31,395
T P R	16	15.8	55,379
ツバキ・ナカシマ	15.9	15.8	34,080
ホシザキ	31.3	41.3	424,151
大豊工業	11.5	11.5	16,353
日本精工	293.2	290	405,710
N T N	330	327	162,846
ジェイテクト	152.2	150.5	234,629
不二越	144	142	87,330
日本トムソン	45.6	45.1	26,473
T H K	100.9	99.8	320,358
ユースン精機	6.3	6.2	17,539
前澤給装工業	5.4	5.3	8,177
イーグル工業	15.4	15.3	27,723
前澤工業	10.4	9.4	3,026
日本ビラー工業	14.4	14.3	23,194
キッツ	68.5	67.8	71,732
日立工機	38.2	10.8	9,363
マキタ	93.1	184.1	756,651
日立造船	113.2	111.9	60,090
三菱重工業	2,393	2,366	1,031,812
I H I	1,097	1,085	413,385
スター精密	25	24.7	41,372
電気機器 (13.3%)			
日清紡ホールディングス	79.3	78.4	84,044
イビデン	99.9	98.8	195,327
コニカミノルタ	334.2	330.5	294,145
ブラザー工業	184.5	182.5	471,762
ミネベアミツミ	230	256.9	478,604
日立製作所	3,428	3,390	2,272,317
東芝	3,193	3,158	1,017,191
三菱電機	1,522.9	1,506	2,379,480
富士電機	430	425	252,025
東洋電機製造	5.6	6	9,894
安川電機	165.5	163.7	398,445
シンフォニアテクノロジー	92	91	38,129
明電舎	131	130	48,100

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オリジン電気	21	21	6,342
山洋電気	37	37	41,699
デンヨー	13.2	13	26,546
東芝テック	89	88	52,448
芝浦メカトロニクス	23	23	8,004
マブチモーター	40.3	39.4	228,914
日本電産	185	183	2,156,655
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1.7	4.4	7,436
東光高岳	7.2	7.1	11,608
ダブル・スコープ	13.7	13.7	26,536
ダイヘン	78	77	69,916
田淵電機	21.5	21.3	8,072
ヤーマン	1.8	1.8	16,650
J V C ケンウッド	104.8	103.6	33,152
ミマキエンジニアリング	12.8	12.6	8,757
第一精工	6.7	6.6	13,450
日新電機	28.7	28.4	33,710
大崎電気工業	28	28	23,604
オムロン	151.8	150.1	727,985
日東工業	21	20.7	36,680
I D E C	18.6	18.4	28,428
不二電機工業	1.6	1.5	2,059
ジーエス・ユアサ コーポレーション	275	272	132,736
サクサホールディングス	36	36	7,272
メルコホールディングス	7.9	7.8	25,623
テクノメディカ	3.2	3.2	6,412
日本電気	1,963	1,941	564,831
富士通	1,376	1,361	1,122,280
沖電気工業	61.9	61.2	99,939
岩崎通信機	63	62	5,146
電気興業	41	40	22,960
サンケン電気	83	83	38,927
ナカヨ	15	15	5,940
アイホン	8.1	8	15,248
ルネサスエレクトロニクス	73.9	73.1	72,807
セイコーエプソン	212.6	210.2	513,308
ワコム	110.7	109.5	38,106
アルバック	26.3	23.8	140,182
アクセル	6	5.9	4,702
E I Z O	14.1	14	61,880

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジャパンディスプレイ	266.6	263.6	52,456
日本信号	39.4	38.9	40,883
京三製作所	33	33	18,414
能美防災	16.2	16	26,032
ホーチキ	10.3	10.2	19,706
エレコム	12.4	12.2	29,036
日本無線	8.7	8.6	11,618
パナソニック	1,631.1	1,621.4	2,457,231
アンリツ	104.1	102.9	107,736
富士通ゼネラル	48	47.9	121,378
日立国際電気	37.3	36.9	97,563
ソニー	1,007.9	997.2	4,264,027
TDK	80.4	79.5	589,890
帝国通信工業	31	31	6,541
ミツミ電機	50.4	—	—
タムラ製作所	55	54	28,188
アルプス電気	131.8	130.3	411,748
池上通信機	45	45	7,020
パイオニア	214.5	212.1	44,753
日本電波工業	13.8	13.6	12,036
鈴木	5.5	5.4	4,163
日本トリム	3.5	3.4	15,113
ローランド ディー・ジー・	7.3	7.2	19,260
フォスター電機	16.7	16.5	31,696
クラリオン	75	74	31,080
SMK	37	36	15,120
ヨコオ	10.2	10.1	14,665
ティアック	103	101	5,151
ホシデン	43.3	42.8	54,869
ヒロセ電機	23.1	22.8	371,640
日本航空電子工業	45	40	60,760
TOA	16.8	16.7	17,985
日立マクセル	21.3	21	45,234
古野電気	18.4	18.2	12,103
ユニデンホールディングス	42	42	10,878
アルパイン	34	33.7	53,583
スミダコーポレーション	11.7	12.8	22,297
アイコム	7.9	7.8	19,632
リオン	5.5	5.4	9,007
本多通信工業	4.6	6	9,204

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
船井電機	16	15.8	13,904
横河電機	154.8	153.1	283,081
新電元工業	55	54	30,402
アズビル	43.3	42.8	185,966
東亜ディーケーケー	7.1	7	5,138
日本光電工業	59.7	59	154,462
チノー	5.1	5	6,150
共和電業	16.2	16	7,120
日本電子材料	5.6	5.6	4,088
堀場製作所	28.3	28	203,840
アドバンテスト	97.3	96.2	194,516
小野測器	6.9	6.8	5,161
エスベック	12.7	12.5	21,612
パナソニック デバイスSUNX	12.5	—	—
キーエンス	32.3	64	3,219,200
日置電機	7.5	7.4	16,827
シスメックス	110.9	109.8	738,954
日本マイクロニクス	26.6	24.6	29,372
メガチップス	13.3	13.1	37,046
OBARA GROUP	8.3	8.2	49,036
澤藤電機	9	9	5,355
コーセル	19.8	19.6	27,342
イリソ電子工業	4.5	5.9	54,280
新日本無線	12.1	12	8,724
オブテックスグループ	10.5	10.7	41,944
千代田インテグレ	7.5	7.4	16,169
アイ・オー・データ機器	4.4	5.9	7,386
レーザーテック	16.7	31	54,498
スタンレー電気	102.1	100.7	340,869
岩崎電気	52	51	9,231
ウシオ電機	86.7	85.7	122,551
岡谷電機産業	7.6	7.5	3,037
ヘリオス テクノ ホールディング	13.1	13	11,245
日本セラミック	11.7	11.7	31,145
遠藤照明	7.2	7.1	8,101
日本デジタル研究所	13.5	—	—
古河電池	10	10	7,720
双信電機	6.9	6.8	2,148
山一電機	13.4	13.3	24,378
図研	9.3	9.2	14,407

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本電子	52	51	29,937
カシオ計算機	119.3	113.5	192,836
ファナック	144.7	143.1	3,098,115
日本シイエムケイ	30.7	30.4	29,275
エンプラス	6.5	6.4	22,208
大真空	5.2	5.2	8,964
ローム	69	68.2	590,612
浜松ホトニクス	111.4	102.8	353,118
三井ハイテック	18.8	18.6	32,475
新光電気工業	53.9	53.3	52,820
京セラ	234.4	231.7	1,534,549
太陽誘電	69.4	68.7	124,072
村田製作所	149.8	148.1	2,547,320
ユーシン	18.9	19.6	14,954
双葉電子工業	23.3	23.1	45,437
北陸電気工業	57	57	8,037
ニチコン	45	44.5	52,999
日本ケミコン	123	122	48,312
KO A	19.7	19.5	40,033
市光工業	30	30	27,330
小糸製作所	85.5	84.6	483,912
ミツバ	26.3	26	51,870
S C R E E Nホールディングス	29.3	28.9	228,599
キャノン電子	13.1	13	30,173
キャノン	768.6	760.1	2,945,387
リコー	429.3	424.5	399,030
M U T O Hホールディングス	19	19	4,864
東京エレクトロン	95.2	94.1	1,517,362
輸送用機器 (8.3%)			
トヨタ紡織	49.9	49.4	102,702
芦森工業	32	32	8,096
ユニプレス	27.5	27.2	66,150
豊田自動織機	130	128.6	735,592
モリタホールディングス	25	24.7	42,607
三機工業	18.1	17.9	14,194
デンソー	352	348.1	1,621,797
東海理化電機製作所	37.6	37.2	74,437
三井造船	516	510	77,520
川崎重工業	1,111	1,099	347,284
名村造船所	42.8	42.4	27,305

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サノヤスホールディングス	17.3	17.1	4,309
日本車輛製造	52	51	14,382
ニチユ三菱フォークリフト	16.4	16.8	12,784
近畿車輻	2.1	2.1	5,380
日産自動車	1,708.7	1,665.2	1,781,764
いすゞ自動車	413.7	409.1	547,580
トヨタ自動車	1,775.7	1,716.5	10,087,870
日野自動車	203.8	201.5	248,449
三菱自動車工業	523.2	517.4	370,975
エフテック	7.5	8.1	11,696
レシップホールディングス	4.7	4.6	4,255
GMB	2.3	2.3	2,741
ファルテック	2.5	2.5	3,217
武蔵精密工業	16.6	16.4	50,430
日産車体	62.7	62	69,936
新明和工業	58	57	51,186
極東開発工業	28.4	28.1	50,411
日信工業	31.9	31.6	54,225
トビー工業	11.7	11.6	38,512
ティラド	55	55	19,800
曙ブレーキ工業	66.3	65.6	22,566
タチエス	24.2	24	47,208
NOK	69.1	68.3	160,573
フタバ産業	43.5	43	37,840
K Y B	160	158	85,320
大同メタル工業	17.9	17.7	17,115
プレス工業	75.8	75	38,550
ミクニ	18.1	17.9	8,144
カルソニックカンセイ	97	—	—
太平洋工業	29.3	31.7	44,823
ケーヒン	32.8	32.4	48,988
河西工業	19.3	19.1	26,854
アイシン精機	130.6	129.2	720,936
富士機工	14.1	14	10,318
マツダ	452.1	447	670,276
今仙電機製作所	13.1	12.9	16,499
本田技研工業	1,284.8	1,270.5	3,868,672
スズキ	283	279.8	1,486,017
S U B A R U	443.3	438.3	1,609,437
安永	5.2	6.8	8,064

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤマハ発動機	201.6	199.4	586,036
ショーワ	37.1	36.7	39,195
T B K	18.3	18.1	9,086
エクセディ	19.4	19.2	59,040
豊田合成	46.1	45.6	121,250
愛三工業	25	24.7	21,612
盟和産業	2.2	2.1	2,513
ヨロズ	13.3	13.2	23,192
エフ・シー・シー	23.3	23.1	50,589
シマノ	57.5	56.9	992,905
タカタ	25.8	—	—
テイ・エス テック	33.2	32.8	108,404
ジャムコ	8.3	8.2	20,803
精密機器 (1.6%)			
テルモ	218.8	216.4	975,964
クリエートメディック	4.7	4.7	4,671
日機装	49.4	48.8	53,338
島津製作所	184	181.7	397,014
J M S	26	26	8,502
クボテック	3.1	3	1,881
長野計器	11.2	11.1	8,469
ブイ・テクノロジー	2.9	2.9	61,741
東京計器	49	49	13,965
愛知時計電機	1.9	1.9	7,210
インターアクション	—	5.3	4,054
オーバル	13.9	13.8	3,739
東京精密	27.6	27.3	103,876
マニー	19	17.2	51,944
ニコン	248.8	246	456,576
トプコン	71.9	71.1	136,227
オリンパス	227.9	225.3	912,465
理研計器	12.6	12.4	27,304
タムロン	12.7	12.5	24,200
HOYA	293.7	290.5	1,636,967
シード	—	1.8	4,807
ノーリツ鋼機	14.4	14.3	14,014
エー・アンド・デイ	13	12.9	5,895
シチズン時計	161.1	154.5	116,647
リズム時計工業	57	57	13,281
大研医器	12.7	12.6	10,029

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メニコン	9.8	9.7	34,920
松風	7.5	7.4	9,960
セイコーホールディングス	101	100	44,200
ニプロ	98.8	97.7	146,061
その他製品 (2.1%)			
スノーピーク	2.2	2.2	7,095
パラマウントベッドホールディングス	13.7	13.5	66,555
トランザクション	3.1	6.3	7,112
S H O - B I	4.8	4.7	2,180
ニホンフラッシュ	6.7	6.6	10,065
前田工織	14.3	14.1	23,138
永大産業	19	18	9,252
アートネイチャー	15.2	15.1	10,947
ダンロップスポーツ	9	8.9	10,146
バンダイナムコホールディングス	157.5	155.7	611,122
アイフィスジャパン	3.2	3.1	2,402
共立印刷	23.7	23.4	7,932
S H O E I	6.4	6.3	18,994
フランスベッドホールディングス	17.9	17.7	17,770
パイロットコーポレーション	24.9	24.6	113,652
萩原工業	4	3.9	11,438
トッパン・フォームズ	25.5	25.2	29,383
フジシールインターナショナル	16	31.6	98,276
タカラトミー	55.5	54.9	77,079
廣済堂	14.4	14.2	5,154
A s - m e エステール	3.8	3.8	2,660
アーク	60.1	59.4	6,831
タカノ	6.3	6.2	7,378
プロネクス	13.3	13.2	16,724
ホクシン	10.1	10	1,900
ウッドワン	24	24	6,864
大建工業	10	9.9	24,255
凸版印刷	403	399	499,947
大日本印刷	412	407	514,855
図書印刷	19	19	9,633
共同印刷	44	43	16,770
日本写真印刷	24	24.6	78,720
光村印刷	13	12	3,096
宝印刷	6.9	7.4	12,150
アシックス	141.8	140.3	280,038

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ツツミ	5.3	5.3	11,426
小松ウオール工業	4.8	4.8	10,051
ヤマハ	96.2	95.1	365,659
河合楽器製作所	5.6	5.5	13,090
クリナップ	16.7	16.5	14,239
ビジョン	86.3	85.3	356,554
兼松サステック	15	15	3,180
キングジム	11.9	11.7	11,629
リンテック	33.9	33.6	89,342
T A S A K I	3.9	2.3	5,066
イトーキ	30	29.7	25,512
任天堂	87.9	86.9	3,250,060
三菱鉛筆	11.8	11.6	72,964
タカスタンダード	29.5	29.2	53,961
コクヨ	74.2	73.4	109,512
ナカバヤシ	26	25	8,075
グローブライド	6.9	6.8	13,396
岡村製作所	49.8	49.3	50,138
美津濃	77	76	50,008
アデランス	26.4	—	—
電気・ガス業 (1.8%)			
東京電力ホールディングス	1,211	1,197.6	547,303
中部電力	470.4	465.2	701,056
関西電力	582.6	576.1	898,139
中国電力	197.4	195.2	240,486
北陸電力	139.9	138.3	138,853
東北電力	356.7	352.7	550,212
四国電力	128.6	127.1	173,110
九州電力	315.3	311.8	431,219
北海道電力	133.6	132.1	111,228
沖縄電力	21	22.7	57,249
電源開発	113.6	112.3	313,653
エフオン	5.8	7	7,133
イーレックス	5.9	17.7	17,788
東京瓦斯	1,531	1,514	887,204
大阪瓦斯	1,385	1,370	619,925
東邦瓦斯	360	352	293,920
北海道瓦斯	35	36	9,864
広島ガス	29.4	29.1	10,330
西部瓦斯	161	159	42,771

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
静岡ガス	43.9	43.4	32,159
メタウォーター	8	8	25,320
陸運業 (4.3%)			
S B S ホールディングス	14.1	13.9	12,162
東武鉄道	763	754	468,988
相鉄ホールディングス	228	226	124,752
東京急行電鉄	776	767	648,882
京浜急行電鉄	391	387	541,413
小田急電鉄	228.7	226.2	524,105
京王電鉄	399	394	379,028
京成電鉄	107	105.8	327,980
富士急行	39	38	45,296
新京成電鉄	18	18	7,542
東日本旅客鉄道	276.2	273.1	3,030,044
西日本旅客鉄道	137.4	135.9	1,111,118
東海旅客鉄道	118.7	117.4	2,160,747
西武ホールディングス	197.2	195	423,540
鴻池運輸	20.2	20	30,700
西日本鉄道	172	170	84,150
ハマキョウレックス	9.3	9.2	25,668
サカイ引越センター	4.9	6.5	27,917
近鉄グループホールディングス	1,437	1,421	625,240
阪急阪神ホールディングス	180.4	178.3	725,681
南海電気鉄道	302	298	176,714
京阪ホールディングス	320	316	226,256
神戸電鉄	35	34	13,770
名古屋鉄道	520	514	271,392
山陽電気鉄道	52	51	29,427
日本通運	552	525	373,800
ヤマトホールディングス	255.3	252.4	586,325
山九	188	186	136,152
丸運	7.7	7.6	2,074
丸全昭和運輸	48	47	22,137
センコーグループホールディングス	64.2	67	46,900
トナミホールディングス	29	29	12,557
ニッコンホールディングス	48.4	47.9	124,683
日本石油輸送	1.6	1.6	4,244
福山通運	87	86	62,608
セイノーホールディングス	101.3	100.1	153,853
神奈川中央交通	17	17	12,427

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立物流	29.7	29.4	78,645
丸和運輸機関	3.6	3.5	14,840
C&F ロジホールディングス	14.8	14.6	19,826
九州旅客鉄道	106.4	140.3	519,811
海運業 (0.2%)			
日本郵船	1,206	1,193	240,986
商船三井	749	740	244,200
川崎汽船	541	535	153,545
N S ユナイテッド海運	64	63	13,545
明治海運	12.8	12.6	5,430
飯野海運	73.9	73	35,040
共栄タンカー	12	12	2,532
乾汽船	10.4	10.3	8,909
空運業 (0.6%)			
日本航空	257.3	248.1	858,177
A N A ホールディングス	2,650	2,621	1,028,742
バスコ	13	13	4,758
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	4.1	4.1	22,714
日新	58	58	29,522
三菱倉庫	94	93	137,733
三井倉庫ホールディングス	83	82	25,092
住友倉庫	104	103	73,954
滋澤倉庫	37	37	13,542
東陽倉庫	24.4	24.1	7,230
日本トランスシティ	33	32	14,624
ケイヒン	26	26	4,160
中央倉庫	8.2	8.1	8,804
安田倉庫	11.1	11	8,063
東洋埠頭	41	41	7,585
宇徳	11.6	11.4	5,266
上組	170	168	200,256
サンリツ	3.5	3.4	2,278
キムラユニティ	3.6	3.6	4,132
キユーソー流通システム	4.5	4.4	11,145
郵船ロジスティクス	13.1	13	13,143
近鉄エクスプレス	25.5	25.2	50,551
東海運	7.7	7.6	3,245
ユーアイティー	8.8	8.7	9,021
内外トランスライン	4.3	4.2	5,502

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
情報・通信業 (8.2%)			
N E C ネットエスアイ	15.4	15.3	38,663
システナ	11.2	11.1	27,261
デジタルアーツ	6.3	6.2	24,645
新日鉄住金ソリューションズ	23.5	21.8	59,928
キューブシステム	6.1	8	7,488
コア	5.9	5.9	8,897
ソフトクリエイトホールディングス	6.7	6.6	9,543
T I S	46.7	46.2	149,457
ネオス	4.2	4.1	1,972
電算システム	4.9	4.8	8,371
グリー	85.6	84.8	89,718
コーエーテクモホールディングス	33.4	33.1	76,229
三菱総合研究所	5.5	5.9	19,647
ボルテージ	2.8	2.5	3,800
電算	1.6	1.5	3,331
A G S	3.5	3.5	5,663
ファインデックス	10.4	10.3	9,527
ヒト・コミュニケーションズ	3.2	3.1	5,499
ブレインパッド	2.1	3	3,930
K L a b	26.9	26.6	48,305
ポールトゥウィン・ビットクルーホールディ	10.1	10	17,180
イーブックイニシアティブジャパン	2.2	2.2	2,589
ネクソン	155	153.2	350,828
アイスタイル	21.5	31.4	29,107
エムアップ	4	3.9	7,421
エイチーム	7.8	9.4	28,999
テクノスジャパン	10.8	10.7	12,658
e n i s h	4.1	4.1	6,478
コロブラ	39.2	44.7	51,181
モバイルクリエイト	9.2	10.2	4,345
オルトプラス	5.8	5.7	9,205
ブロードリーフ	34.8	34.3	24,318
ハーツユナイテッドグループ	7.4	7.3	12,658
メディアドゥ	3	4	10,948
ブイキューブ	7.7	7.6	4,636
サイバーリンクス	2.1	2.1	2,704
ディー・エル・イー	4.1	6.2	3,081
フィックスターズ	—	2.4	7,920
VOYAGE GROUP	4.8	6.9	15,918

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
オブティム	1.5	2.9	8,961
セレス	—	3.3	5,273
ベリサーブ	1.6	1.6	5,712
ティーガイア	14	13.9	29,704
日本アジアグループ	15.9	15.8	6,683
豆蔵ホールディングス	10.3	10.2	10,424
テクマトリックス	4.4	8.7	16,216
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	295.4	292.2	83,277
GMOペイメントゲートウェイ	11.5	9.8	69,090
ザッパラス	7.9	7.2	3,772
システムリサーチ	—	1.4	3,243
インターネットイニシアティブ	20.7	20.5	41,820
さくらインターネット	10.8	11.3	10,429
GMOクラウド	3.1	3.1	12,400
SRAホールディングス	7.4	7.3	22,119
Minor i ソリューションズ	3.1	3.1	4,039
システムインテグレータ	2	1.9	1,415
朝日ネット	12.8	12.6	6,211
アドソル日進	2.8	3.7	4,639
フリービット	7.8	10.3	9,414
コムチュア	2.4	2.3	11,822
サイバーコム	1.9	2.5	2,850
メディカル・データ・ビジョン	—	6.1	16,043
gumi	14.6	15.8	22,214
ショーケース・ティービー	—	2.1	2,341
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	—	2	4,102
PCIホールディングス	1.6	2.3	5,980
パイブドHD	2.5	2.5	2,587
アイビーシー	—	1.4	1,598
オーブンドア	—	1.8	6,336
LINE	23.5	31.2	125,268
オークネット	—	4.3	5,740
AOI TYO Holdings	—	11.4	12,141
マクロミル	—	17.9	46,468
ソルクシーズ	4	5.3	4,552
フェイス	3.7	3.7	4,765
ハイマックス	1.9	1.8	2,995
野村総合研究所	95.8	104.2	467,337
サイバネットシステム	11.5	11.4	8,310
CEホールディングス	2.1	1.9	2,091

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
インテージホールディングス	8	7.9	17,293
東邦システムサイエンス	4.6	4.6	3,109
ソースネクスト	8.4	8.3	5,270
ティー・ワイ・オー	27.7	—	—
フォーカスシステムズ	5.4	7.1	7,313
クレスコ	3.2	3.2	11,648
フジ・メディア・ホールディングス	146.7	145.1	215,183
オービック	48.6	48	332,160
ジャストシステム	22.8	22.5	38,925
TDCソフトウェアエンジニアリング	6.1	6.1	7,814
ヤフー	1,009.9	998.7	474,382
トレンドマイクロ	74.6	73.8	433,206
インフォメーション・ディベロプメント	2.7	4	5,956
日本オラクル	22.6	22.4	152,544
アルファシステムズ	4.6	4.6	9,991
フューチャー	19	18.8	16,619
CAC Holdings	10.5	10.4	11,346
ソフトバンク・テクノロジー	3.3	6.7	14,070
トーセ	3.8	3.7	8,121
オービックビジネスコンサルタント	7.2	7.1	42,600
伊藤忠テクノソリューションズ	31.9	31.6	125,452
アイティフォー	18.3	18.1	11,511
東計電算	2.5	2.5	7,072
エクスネット	1.3	2.5	2,230
大塚商会	37.9	37.5	267,750
サイボウズ	18.7	18.5	10,045
ソフトブレーン	19.2	19	10,127
電通国際情報サービス	8.7	8.6	24,424
デジタルガレージ	22	27	55,701
EMシステムズ	4.8	4.8	11,529
ウェザーニューズ	4.7	4.7	17,789
C I J	12.8	11.7	6,704
東洋ビジネスエンジニアリング	1.4	1.4	2,524
日本エンタープライズ	14.4	14.2	3,961
WOWOW	6.7	6.6	21,120
スカラ	8.8	9.6	8,361
日本コロムビア	4.2	4.1	3,079
イマジカ・ロボット ホールディングス	11.8	11.7	8,798
ネットワンシステムズ	61	60.3	64,822
システムソフト	24.8	32.8	5,116

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アルゴグラフィックス	6.4	6.4	17,523
マーベラス	23.8	23.5	26,249
エイベックス・グループ・ホールディングス	25.9	25.6	37,811
日本ユニシス	38.9	38.5	69,954
兼松エレクトロニクス	8.9	8.8	30,800
東京放送ホールディングス	92.9	91.8	179,010
日本テレビホールディングス	128.6	127.2	236,464
朝日放送	13.9	13.8	11,122
テレビ朝日ホールディングス	38.5	38.1	76,314
スカパー J S A Tホールディングス	91.7	90.6	43,125
テレビ東京ホールディングス	11.5	11.4	25,513
日本BS放送	3.2	4.7	5,743
ビジョン	—	2.1	12,138
U-NEXT	3.6	3.6	4,172
ワイヤレスゲート	4.9	6.4	9,913
コネクシオ	12.4	12.3	24,021
日本通信	117.8	116.6	19,355
クロップス	3	2.9	1,687
日本電信電話	1,131.1	1,118.6	6,082,946
KDDI	1,394	1,378.5	4,176,855
光通信	16.9	16.7	188,710
NTTドコモ	1,052.9	1,025.7	2,824,264
エムティーアイ	21.5	18.7	13,725
GMOインターネット	51.4	50.8	74,472
アイドママーケティングコミュニケーション	—	1.8	1,333
カドカワ	40.9	40.4	57,327
学研ホールディングス	47	4.6	14,881
ゼンリン	18.6	18.4	56,304
昭文社	7.7	8	5,824
インプレスホールディングス	11.6	11.5	1,621
アイネット	7.9	7.8	10,491
松竹	93	92	132,756
東宝	92.2	91.1	317,939
東映	52	52	56,108
AOI Pro.	6.5	—	—
エス・ティ・ティ・データ	87	86.1	547,596
ビー・シー・エー	2	2	3,038
ビジネスブレイン太田昭和	2.4	2.4	2,474
DTS	14.5	14.4	49,536
スクウェア・エニックス・ホールディングス	54.2	53.6	208,236

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
シーイーシー	8.3	8.2	17,572
カブコン	33	32.7	90,611
アイ・エス・ビー	2.7	2.7	4,106
ジャステック	8.9	8.8	10,797
S C S K	38.3	37.9	204,660
日本システムウエア	4.6	4.6	8,818
アイネス	17.7	17.6	19,377
T K C	13	12.9	42,441
富士ソフト	20.9	20.7	67,068
NSD	29.9	29.6	60,976
コナミホールディングス	63.6	62.9	411,366
福井コンピュータホールディングス	4.1	4	16,340
J B C Cホールディングス	11.8	11.6	9,813
ミロク情報サービス	10.4	13.7	32,975
ソフトバンクグループ	634.3	627.2	5,801,600
卸売業 (4.3%)			
ハウスイ	11	11	1,353
高千穂交易	5.4	5.4	5,907
伊藤忠食品	3.5	3.4	16,065
エレマテック	5.6	5.6	10,029
J A L U X	4.5	4.5	12,105
あらた	6.3	6.3	24,601
トーマンデバイス	2.1	2.1	4,643
東京エレクトロン デバイス	5.1	5	8,485
フィールズ	10.8	10.6	12,529
双日	832.2	822.9	219,714
アルフレッサ ホールディングス	166.7	164.8	358,110
横浜冷凍	34.9	32.8	34,505
神栄	19	19	3,135
山下医科器械	1.1	1.1	1,907
ラサ商事	6	6	5,970
ラクーン	6.1	8.9	5,518
アルコニックス	8	7.9	15,610
神戸物産	7.6	7.5	42,450
あい ホールディングス	25.1	19.8	60,687
ディーブイエックス	5	4.9	6,443
ダイワボウホールディングス	120	118	47,554
マクニカ・富士エレホールディングス	26.1	25.8	42,905
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26.5	26.2	24,339
八洲電機	10.9	10.7	8,239

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
メディアスホールディングス	—	2.1	6,594
UKCホールディングス	9	8.9	17,105
OCH I ホールディングス	4.1	4	5,468
TOKAI ホールディングス	61.9	61.2	50,796
大阪工機	1.6	2.1	1,650
三洋貿易	7.7	7.6	18,506
ビューティガレージ	1.2	1.8	3,074
ウイン・パートナーズ	5.1	10	14,010
ミタチ産業	3.6	3.2	2,076
シップヘルスケアホールディングス	27	26.7	91,180
明治電機工業	4.8	4.8	6,508
デリカフーズ	3	2.9	4,379
スターティア	3.2	3.1	2,232
コメダホールディングス	19	25.2	46,292
富士興産	5	5	2,500
協栄産業	17	17	3,094
小野建	12.2	12.1	21,102
佐島電機	11.1	10.2	8,659
エコートレーディング	3.2	3.2	2,278
伯東	9.6	9.5	13,338
コンドータック	11.2	11	10,417
中山福	8.1	8	6,408
ナガイレーベン	20.3	18.4	47,950
三菱食品	15.5	15.3	50,184
松田産業	10.3	10.1	14,836
第一興商	22.9	22.7	123,034
メディバルホールディングス	140.9	139.3	290,161
S P K	3	3	7,920
萩原電気	4.8	4.7	10,293
アズワン	11	10.9	58,206
スズデン	5	5	6,375
尾家産業	4.5	4.5	5,607
シモジマ	8.6	8.5	9,775
ドウシシャ	16.6	16.4	34,407
小津産業	3.1	3.1	6,758
高速	8.4	8.3	8,756
たけびし	4.9	4.9	6,835
黒田電気	19.2	19	42,579
リックス	3.2	3.1	5,725
丸文	12.4	12.3	9,717

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ハビネット	11.7	11.6	24,800
橋本総業ホールディングス	2.9	2.9	5,063
日本ライフライン	12	15.9	75,684
エクセル	6	6	8,766
マルカキカイ	4.5	4.5	8,545
I D O M	37.9	37.5	27,187
日本エム・ディ・エム	10.6	10.4	9,786
進和	8.3	8.2	17,515
エスケイジャパン	2.6	2.6	754
ダイترون	6.4	6.4	8,563
シークス	10.1	9.9	42,966
田中商事	4.3	4.3	3,147
オーハシテクニカ	7.9	7.8	10,943
白銅	3.5	3.5	5,841
伊藤忠商事	1,032	1,020.5	1,646,576
丸紅	1,386.8	1,371.3	948,939
高島	24	24	5,088
長瀬産業	84.7	83.8	138,856
蝶理	9	8.9	18,618
豊田通商	157	155.2	519,920
三共生興	21.3	21	8,190
兼松	300	296	67,784
ツカモトコーポレーション	25	25	3,175
三井物産	1,274.2	1,260	1,934,730
日本紙パルプ商事	73	72	30,168
日立ハイテクノロジーズ	48.8	48.3	213,727
カメイ	18.3	18.1	26,950
東都水産	2.1	2.1	3,975
OUGホールディングス	22	22	5,764
スターゼン	5.9	5.8	29,522
山善	54.1	53.5	59,331
椿本興業	16	16	7,024
住友商事	887	877.2	1,256,589
内田洋行	35	6.4	17,433
三菱商事	1,057.3	1,045.6	2,357,305
第一実業	32	32	18,912
キヤノンマーケティングジャパン	40.2	39.7	101,115
西華産業	45	43	16,684
佐藤商事	12.6	12.4	11,036
菱洋エレクトロ	13.5	12.9	23,052

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京産業	14	13.8	6,099
ユアサ商事	13.3	13.2	44,814
神鋼商事	3.5	3.5	9,289
小林産業	10.2	10.1	2,999
阪和興業	141	139	106,891
カナデン	13.4	13.3	15,002
菱電商事	22	22	16,962
フルサト工業	7.8	7.7	13,390
岩谷産業	156	154	107,184
すてきナイスグループ	60	59	8,968
昭光通商	50	49	4,704
ニチモウ	20	20	3,560
極東貿易	22	21	5,670
イワキ	21	21	9,093
三菱石油	37.8	37.3	39,873
稲畑産業	33.8	33.4	47,929
G S I クレオス	34	34	4,862
明和産業	13	12.8	5,542
ワキタ	30	29.6	36,911
東邦ホールディングス	45.1	44.6	98,610
サンゲツ	48.3	47.7	91,917
ミツウロコグループホールディングス	22.7	22.4	16,083
シナネンホールディングス	6	6	13,590
伊藤忠エネクス	31.1	30.7	28,827
サンリオ	43.4	42.9	90,604
サンワテクノス	8.3	8.2	12,931
リョーサン	20.9	20.7	87,664
新光商事	15.4	15.3	21,465
トーホー	6.3	6.3	19,057
三信電気	15.6	15.4	22,160
東陽テクニカ	18.7	16	17,296
モスフードサービス	18.4	18.2	63,518
加賀電子	12.7	12.6	28,791
ソーダニッカ	14.5	14.3	7,536
立花エレテック	9.5	9.4	14,447
フォーバル	6.1	6.1	4,355
P A L T A C	22.5	22.3	86,189
三谷産業	14.9	14.8	6,068
太平洋興発	59	58	5,568
ヤマタネ	7	7	11,207

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丸紅建材リース	14	14	3,080
日鉄住金物産	12.4	12.2	62,952
トラスコ中山	16.1	31.8	80,708
オートバックスセブン	52.2	51.6	94,015
モリト	—	11.1	10,356
加藤産業	22	21.7	65,425
イノテック	12.1	12	7,956
イエローハット	13.3	13.1	35,212
J Kホールディングス	14.1	14	9,366
日伝	5.8	5.8	22,069
北沢産業	11.6	11.5	2,323
杉本商事	8.1	8	12,344
因幡電機産業	19.8	19.5	81,510
パイテックホールディングス	5.7	5.7	7,997
ミスミグループ本社	158.4	157.1	392,435
アルテック	12	11.9	2,629
タキヒヨー	21	21	9,765
蔵王産業	2.3	2.3	3,355
スズケン	64.1	63.4	235,214
ジェコス	9.7	9.6	12,192
ルネサスイーストン	12.9	12.7	7,429
小売業 (4.8%)			
ローソン	48.9	44	339,240
サンエー	10.6	10.5	52,447
カワチ薬品	10.9	10.8	28,587
エービーシー・マート	25.6	25.3	166,221
ハードオフコーポレーション	6.2	6.1	6,990
アスクル	17.1	14.5	49,372
ゲオホールディングス	23.5	23.3	27,680
アダストリア	21.6	21.4	66,126
ジーフット	8.5	8.4	6,753
シー・ヴィ・エス・ペリエリア	1.8	1.8	1,299
くらコーポレーション	9.2	9.1	46,865
キャンドゥ	7.4	7.4	12,476
パルグループホールディングス	7.2	7.1	20,845
エディオン	54.6	54	54,756
サーラコーポレーション	17.6	17.4	12,545
ワッツ	6	5.5	6,913
ハローズ	4.6	4.6	11,003
あみやき亭	2.7	2.7	11,043

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ひらまつ	19.4	19.2	12,864
ゲンキー	2.8	5.6	17,864
大黒天物産	3.4	3.3	18,150
ハニーズホールディングス	12.4	13.5	16,659
ファーマライズホールディングス	3.2	3.2	1,683
アルペン	12.6	10.6	21,390
クオール	15.9	15.7	27,270
ジンズ	9.6	9.5	59,850
ビックカメラ	80.9	80	93,440
D C Mホールディングス	85.5	84.6	82,146
M o n o t a R O	49.8	49.4	183,768
東京一番フーズ	3.5	3.5	2,026
ダイヤモンドダイニング	3.1	3.1	7,167
きちり	3.7	3.7	2,475
アークランドサービスホールディングス	4.4	5.8	23,693
J . フロント リテイリング	178.3	176.3	287,897
ドトール・日レスホールディングス	24.7	24.4	57,998
マツモトキヨシホールディングス	26.6	26.3	176,736
ブロンコビリー	7.3	7.3	19,710
スタートトゥデイ	128.6	127.2	370,279
トレジャー・ファクトリー	4	3.9	3,120
物語コーポレーション	3.7	4	23,560
ココカラファイン	14.7	14.5	82,505
三越伊勢丹ホールディングス	280.3	277.2	313,790
H a m e e	2.1	4.2	7,014
ウエルシアホールディングス	13.9	36.8	156,584
クリエイトSDホールディングス	20.7	20.5	53,853
丸善CH1ホールディングス	16.4	16.2	5,832
ミサワ	2.5	2.5	1,135
ティーライフ	1.3	1.9	3,296
エー・ピーカンパニー	2.3	2.3	2,058
チムニー	4.3	4.2	11,823
シュッピン	5.3	5.2	9,724
ネクステージ	2.7	5.4	7,916
ジョイフル本田	22.9	22.6	77,405
鳥貴族	3.5	5.1	13,132
キリン堂ホールディングス	4.5	4.5	4,189
ホットランド	6.5	6.4	9,811
すかいらく	60.4	59.8	99,686
綿半ホールディングス	5.7	5.6	12,936

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヨシックス	1.4	1.8	2,869
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	46.7	46.2	55,209
ブックオフコーポレーション	8	7.9	6,201
ゴルフダイジェスト・オンライン	5.6	5.6	4,760
BEENOS	1.6	2.2	3,181
あさひ	10.5	10.4	14,185
日本調剤	5	4.9	17,885
コスモス薬品	7.1	7	161,770
トーエル	6.8	6.7	5,949
一六堂	3	2.9	1,139
オンリー	1.6	2.1	1,738
セブン&アイ・ホールディングス	589.7	583.2	2,762,618
薬王堂	7	6.9	24,184
クリエイト・レストランツ・ホールディング	37.8	37.4	37,437
ツルハホールディングス	32.5	27.9	347,076
サンマルクホールディングス	9.1	9	31,050
フェリシモ	4	4	4,384
トリドールホールディングス	17.3	17.1	47,880
TOKYO BASE	—	1.8	7,974
サツドラホールディングス	1.9	1.8	3,843
ダイユー・リックホールディングス	4.5	4.5	3,537
パロックジャパンリミテッド	—	11	12,034
クスリのアオキホールディングス	12.5	11	57,750
スシローグローバルホールディングス	—	12.6	41,580
L I X I L ビバ	—	13.2	26,835
メディカルシステムネットワーク	15.9	15.7	8,054
総合メディカル	6.8	6.7	33,466
はるやまホールディングス	6.6	6.5	6,747
ノジマ	16.3	21.7	40,513
カッパ・クリエイト	19.7	19.5	25,213
ライトオン	10.5	11.7	12,051
ジーンズメイト	4.5	4.4	1,786
良品計画	18.7	18.5	543,345
三城ホールディングス	17.4	17.2	8,049
アドヴァン	14.3	14.2	16,528
アルビス	3.7	3.6	18,540
コナカ	17.9	17.7	10,743
ハウス オブ ローゼ	1.7	1.7	2,660
G－7ホールディングス	4.1	4.1	8,925
イオン北海道	14.1	14	8,428

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コジマ	20.7	23.9	7,361
ヒマラヤ	4.4	3.8	3,173
コーナン商事	20	19.8	42,213
エコス	5.4	5.4	6,690
ワタミ	16.6	16.4	22,402
マルシェ	3.1	3.1	2,566
ドンキホーテホールディングス	91.1	90.1	384,276
西松屋チェーン	24.7	24.4	29,158
ゼンショーホールディングス	73	72.2	152,775
幸楽苑ホールディングス	8.9	8.8	15,778
ハークスレイ	3.4	3.4	3,767
サイゼリヤ	23.2	20.6	69,216
V Tホールディングス	47.6	47.1	26,187
魚力	4.4	4.3	5,362
ボブラ	3.5	3.5	1,991
フジ・コーポレーション	2.1	2.1	4,029
ユナイテッドアローズ	18.8	18.5	67,525
ハイデイ日高	12.8	15.2	37,726
京都きもの友禅	8.9	8.8	8,219
コロワイド	46.7	46.2	87,040
ピーシーデポコーポレーション	18.7	18.5	10,859
老番屋	12.7	9.8	37,632
トップカルチャー	5.1	5	2,480
P L A N T	3.2	3.2	3,913
スギホールディングス	30.9	30.5	186,660
ヴィア・ホールディングス	—	10.5	10,132
スクロール	21.3	21.1	8,102
ヨンドシーホールディングス	10.7	14.1	39,719
ユニー・ファミリーマートホールディングス	61.8	61.1	403,260
木曽路	17.2	17	46,835
サトレストランシシステムズ	16.6	16.4	14,956
千趣会	25.5	25.2	21,344
タカキュー	10.8	10.7	2,107
ケーヨー	23.7	23.5	18,800
上新電機	33	33	50,589
日本瓦斯	25.8	25.5	93,330
ベスト電器	45.4	44.9	7,139
ロイヤルホールディングス	23.3	22.9	58,440
東天紅	11	11	2,222
いなげや	15.7	15.5	29,295

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
島忠	36.4	36	96,408
チヨダ	16.6	16.4	48,445
ライフコーポレーション	10.7	10.5	34,177
リンガーハット	15.9	15.7	38,056
さが美	13	13	1,638
M r M a x	17.6	17.4	10,057
テンアライド	13	12.8	5,068
A O K I ホールディングス	28.1	27.8	39,837
オークワ	20	20	26,220
コメリ	21.7	21.5	60,350
青山商事	29.5	29.1	117,855
しまむら	16.4	16.2	228,258
はせがわ	7.4	7.3	3,452
高島屋	236	234	266,058
松屋	30.7	30.4	32,528
エイチ・ツー・オー リテイリング	72.2	71.3	144,952
近鉄百貨店	54	53	18,762
丸栄	29	—	—
バルコ	13.5	13.3	16,571
丸井グループ	148.2	146.6	248,780
アクシアル リテイリング	10.9	10.8	46,494
井筒屋	7.6	7.5	3,255
イオン	579.8	573.3	980,916
イズミ	28	25.1	163,652
東武ストア	1.7	1.7	5,261
平和堂	28.5	28.2	68,328
フジ	15.6	15.5	44,686
ヤオコー	16	15.8	78,605
ゼビオホールディングス	19.1	18.9	35,078
ケーズホールディングス	64.9	58.9	131,111
O l y m p i c グループ	8.3	8.2	5,034
日産東京販売ホールディングス	20.7	20.4	8,547
アインホールディングス	17	18.2	145,236
元気寿司	3.5	3.5	7,899
ヤマダ電機	471.3	466	266,552
アークランドサカモト	23.8	23.6	35,636
ニトリホールディングス	60.9	60.2	1,006,544
グルメ軒屋	10	10	11,000
愛眼	10.3	10.2	2,223
ケーユーホールディングス	7.3	7.3	7,117

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
吉野家ホールディングス	49.1	48.5	92,004
松屋フーズ	6.8	6.7	28,877
サガミチェーン	17.6	17.4	24,499
関西スーパーマーケット	11.5	11.3	17,628
王将フードサービス	10.3	10.2	43,962
プレナス	15.7	15.6	36,660
ミニストップ	10.4	10.3	24,256
アークス	26.4	26.1	63,240
パローホールディングス	30.3	30	75,870
藤久	1.1	1.1	1,925
ベルク	6.2	6.2	34,348
大庄	7.5	7.4	13,445
ファーストリテイリング	23.5	23.2	851,672
サンドラッグ	26.8	53	228,165
サックスパー ホールディングス	13.2	13.1	15,982
ヤマザワ	2.9	2.9	5,199
やまや	2.9	2.9	4,616
ペルーナ	35.1	29.8	39,276
銀行業 (7.8%)			
島根銀行	3	2.9	3,787
じもとホールディングス	101.1	100	20,000
めぶきフィナンシャルグループ	679.5	671.9	285,557
東京ＴＹフィナンシャルグループ	20.4	20.2	59,408
九州フィナンシャルグループ	231.1	228.5	159,036
ゆうちょ銀行	399	394.5	556,245
富山第一銀行	35.8	35.4	18,301
コンコルディア・フィナンシャルグループ	922.5	903.1	495,440
西日本フィナンシャルホールディングス	95.5	94.5	105,462
新生銀行	1,341	1,326	249,288
あおぞら銀行	891	882	378,378
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	10,677.7	10,558.9	7,636,196
りそなホールディングス	1,648.4	1,630.1	952,304
三井住友トラスト・ホールディングス	294.2	290.9	1,110,074
三井住友フィナンシャルグループ	1,128.3	1,115.8	4,756,655
第四銀行	173	171	88,920
北越銀行	15.2	15	40,500
千葉銀行	543	537	432,285
群馬銀行	313.1	309.6	197,834
武蔵野銀行	22.5	22.2	74,592
千葉興業銀行	38.6	38.2	22,041

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
筑波銀行	58.6	57.9	19,512
七十七銀行	221	218	113,142
青森銀行	109	108	42,120
秋田銀行	92	89	29,192
山形銀行	79	78	38,298
岩手銀行	9.2	9.1	40,131
東邦銀行	126	125	48,875
東北銀行	72	71	10,721
みちのく銀行	70	83	15,272
ふくおかフィナンシャルグループ	572	565	303,405
静岡銀行	383	368	362,112
十六銀行	189	187	64,515
スルガ銀行	144.1	142.5	386,745
八十二銀行	271.9	268.9	184,734
山梨中央銀行	87	86	39,818
大垣共立銀行	188	215	69,230
福井銀行	120	119	33,558
北國銀行	150	148	63,640
清水銀行	4.8	4.7	17,131
富山銀行	2.7	2.7	11,515
滋賀銀行	132	131	76,635
南都銀行	13.6	15.9	50,323
百五銀行	127	125	56,375
京都銀行	252	249	265,434
紀陽銀行	55.3	52.4	101,551
三重銀行	6.3	6.2	15,351
ほくほくフィナンシャルグループ	93.7	92.7	157,311
広島銀行	416	411	198,924
山陰合同銀行	84.7	82.6	75,248
中国銀行	99.9	98.8	160,648
鳥取銀行	4.5	4.4	7,436
伊予銀行	150.7	198.7	175,253
百十四銀行	155	153	55,080
四国銀行	109	107	33,063
阿波銀行	120	119	91,630
大分銀行	81	80	34,960
宮崎銀行	94	93	33,201
佐賀銀行	85	85	22,270
十八銀行	87	86	27,606
沖縄銀行	13.7	13.5	60,142

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
琉球銀行	29	28.7	45,747
セブン銀行	528.2	522.3	220,932
みずほフィナンシャルグループ	19,131.1	18,918.4	3,747,735
高知銀行	51	51	6,528
山口フィナンシャルグループ	132	130	173,940
長野銀行	4.6	4.6	9,117
名古屋銀行	11.8	11.3	47,177
北洋銀行	230	227.4	88,913
愛知銀行	4.7	4.7	29,798
第三銀行	8	7.9	13,453
中京銀行	5.8	5.7	13,081
大光銀行	50	48	11,568
愛媛銀行	16.6	17.7	24,744
トマト銀行	5.4	5.4	8,488
みなと銀行	12.8	12.6	26,094
京葉銀行	115	114	54,720
関西アーバン銀行	19.6	19.4	25,899
栃木銀行	77.7	76.9	36,835
北日本銀行	4.4	4.3	13,674
東和銀行	264	261	33,669
福島銀行	153	151	13,288
大東銀行	73	72	11,880
トモニホールディングス	116.1	114.8	63,025
フィデアホールディングス	136.7	135.2	25,417
池田泉州ホールディングス	149.5	147.8	67,988
証券・商品先物取引業 (1.1%)			
F P G	50.2	49.7	50,197
S B I ホールディングス	159.3	157.5	229,005
日本アジア投資	13.4	13.3	5,732
ジャフコ	23.5	23.3	103,219
大和証券グループ本社	1,318	1,266	837,838
野村ホールディングス	2,880.7	2,848.7	1,921,448
岡三証券グループ	120	119	86,275
丸三証券	44.8	44.3	39,958
東洋証券	50	50	12,500
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	161.7	159.9	95,140
光世証券	34	33	5,313
水戸証券	43.6	43.1	13,662
いちよし証券	31.5	31.2	29,390
松井証券	80.5	79.6	72,595

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
だいこう証券ビジネス	6.8	6.7	4,194
マネックスグループ	151.1	147.6	42,656
カブドットコム証券	105.1	103.9	38,754
極東証券	18.9	18.7	30,780
岩井コスモホールディングス	13.3	13.2	16,341
藍澤証券	26.3	26.1	18,087
マネースクウェアHD	1	—	—
マネーパートナーズグループ	18	17.8	9,202
小林洋行	4	4	1,088
保険業 (2.5%)			
かんぽ生命保険	53.2	52.6	126,923
S O M P O ホールディングス	294.6	291.3	1,240,646
アニコム ホールディングス	9.5	9.4	22,165
MS&ADインシュアランスグループホール	421.1	416.4	1,580,238
ソニーフィナンシャルホールディングス	135	133.5	240,300
第一生命ホールディングス	849.7	840.3	1,634,803
東京海上ホールディングス	570.9	561.2	2,644,374
T & D ホールディングス	513.6	507.9	834,225
アドバンスクリエイト	3.3	3.3	6,336
その他金融業 (1.3%)			
全国保証	39.7	39.2	189,140
クレディセゾン	106.9	105.7	233,702
アクリーティブ	11.6	11.4	4,617
芙蓉総合リース	16.1	15.9	98,739
興銀リース	26.5	26.2	70,216
東京センチュリー	28.4	28	123,620
日本証券金融	62.1	61.4	34,813
アイフル	236.3	233.7	90,909
ポケットカード	10.5	10.4	7,592
リコーリース	11.1	11	41,250
イオンフィナンシャルサービス	90	89	210,574
アコム	283	279.9	139,390
ジャックス	78	77	40,425
オリエントコーポレーション	304.7	301.3	58,150
日立キャピタル	33.2	32.8	84,886
アプラスフィナンシャル	67.6	66.8	7,147
オリックス	997.8	986.8	1,741,208
三菱UFJリース	357.4	353.4	206,385
日本取引所グループ	438.1	433.2	862,501
イー・ギャランティ	4.1	4.2	11,482

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アサックス	2.4	2.4	4,010
N E Cキャピタルソリューション	5.7	5.7	10,191
不動産業 (2.4%)			
いちご	133.8	132.5	44,122
日本駐車場開発	169.8	168	27,048
ヒューリック	293.8	290.7	319,770
三栄建築設計	5.6	5.6	9,788
野村不動産ホールディングス	93.5	92.5	200,447
三重交通グループホールディングス	25	24.7	9,633
サムティ	11.3	11.2	13,585
ディア・ライフ	9.5	12.5	5,237
エー・ディー・ワークス	129	127.8	5,751
日本商業開発	7.8	7.8	12,597
プレサンスコーポレーション	21.9	21.6	31,082
ユニゾホールディングス	11.6	11.5	33,752
T H E グローバル社	4.9	6.5	3,880
日本管理センター	10.1	10	13,660
サンセイランディック	2.9	2.9	2,262
エストラスト	2.5	2.4	1,651
フージャースホールディングス	18.2	18	17,442
オープンハウス	20.4	22.7	75,364
東急不動産ホールディングス	340.9	337.1	227,542
飯田グループホールディングス	117.5	116.2	213,575
ムゲンエステート	4.9	6.4	5,952
ファーストブラザーズ	1.4	1.9	2,838
ハウスドゥ	—	2.2	3,977
シーアールイー	2	2.2	3,456
ケイアイスター不動産	—	3.7	7,943
パーク 2 4	71.4	70.7	202,484
バラカ	4	4.4	9,130
三井不動産	747	738.8	1,936,025
三菱地所	1,048	1,036.4	2,176,958
平和不動産	26.6	26.3	48,365
東京建物	163.5	161.7	244,490
ダイビル	36.3	35.9	41,141
京阪神ビルディング	23.3	23.1	16,054
住友不動産	338	334	1,160,316
大京	262	259	60,347
テオーシー	54.6	54	58,374
東京楽天地	23	23	13,225

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
レオパレス 2 1	177.8	175.9	118,732
スターツコーポレーション	14.4	18.9	51,767
フジ住宅	18	17.8	13,332
空港施設	17	16.8	10,096
明和地所	7.7	7.6	6,118
住友不動産販売	12.7	—	—
ゴールドクレスト	12.7	12.5	29,462
日本エスリード	5.5	5.4	10,432
日神不動産	16.7	16.5	9,735
日本エスコ	18.8	24.2	12,124
タカラレーベン	61.4	59.8	30,378
サンヨーハウジング名古屋	7.3	7.2	7,840
イオンモール	90.7	89.7	200,748
ファースト住建	5.2	5.2	8,075
トーセイ	19.3	19	15,124
穴吹興産	15	1.5	4,590
エス・ティ・ティ都市開発	87.5	86.6	94,567
サンフロンティア不動産	15.2	15	17,040
エフ・ジェー・ネクスト	12.3	12.2	10,065
インテリックス	2.9	4.3	3,551
ランドビジネス	8.3	8.2	2,402
グランディハウス	12.3	12.2	5,270
日本空港ビルデング	44.9	44.4	194,916
サービス業 (4.0%)			
日本工営	50	9.9	32,274
L i f u l l	36.9	36.5	31,645
ジェイエイシーリクルートメント	9.2	9.1	16,207
日本M&Aセンター	43	42.6	186,375
メンバーズ	—	3.7	2,634
アコーディア・ゴルフ	45.1	—	—
中広	1.4	1.4	1,043
タケエイ	13.1	12.9	14,409
トラスト・テック	6	6	13,824
コシダカホールディングス	—	7.1	20,142
パソナグループ	12.9	11	12,276
C D S	3.4	3.3	4,554
リンクアンドモチベーション	35.1	34.7	29,946
G C A	13.2	13.1	13,060
エス・エム・エス	20.4	20.9	71,269
テンブホールディングス	115.3	114.1	259,463

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リニカル	8.8	8.7	16,251
クックパッド	33.3	32.9	29,741
エスクリ	5.3	5.2	3,754
アイ・ケイ・ケイ	6.6	6.6	5,339
学情	6.2	6.1	7,625
スタジオアリス	6.1	6	14,292
シミックホールディングス	7.5	7.5	11,527
N J S	3.3	3.3	4,573
総合警備保障	54.3	53.7	292,665
カカココム	106.4	105.2	166,531
セントケア・ホールディング	—	1.9	3,119
サイネックス	—	1.4	1,407
ルネサンス	7.6	7.5	14,662
ディップ	19.2	19	43,890
オプトホールディング	10.7	10.7	15,985
新日本科学	16.6	16.4	11,480
ツクイ	35.3	34.9	23,627
キャリアデザインセンター	3.1	3.1	4,519
エムスリー	129.2	127.8	415,989
ツカダ・グローバルホールディング	10.9	10.7	6,280
プラス	—	0.8	909
アウトソーシング	8.5	9.5	53,485
ウェルネット	11.2	11.1	16,594
ワールドホールディングス	3.4	4.4	10,956
ディー・エヌ・エー	66.9	66.1	167,563
博報堂D Yホールディングス	206.7	204.4	301,081
ぐるなび	21.6	21.3	38,105
エスアールジータカミヤ	16.1	15.9	9,078
ジャパンベストレスキューシステム	18.5	16.7	4,642
ファンコミュニケーションズ	37.9	37.5	36,787
ライク	3.1	2.6	8,918
ビジネス・ブレークスルー	—	6.2	2,480
WDBホールディングス	5.3	5.3	12,884
ティア	7.2	7.1	5,594
C D G	—	1	1,805
バリユーコマース	13.8	13.6	9,669
インフォマート	31.6	62.5	59,187
J Pホールディングス	42.8	42.4	13,016
E P Sホールディングス	18.5	20.3	34,510
レッグス	3.4	3.3	2,567

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
プレステージ・インターナショナル	21.1	27.9	34,596
アミューズ	8.3	8.2	26,855
ドリームインキュベータ	4.5	4.5	9,729
クイック	7.6	7.5	11,677
T A C	8.2	8.1	2,049
ケネディクス	200.2	187	100,419
電通	166.2	164.4	876,252
テイクアンドギヴ・ニーズ	6.9	6.9	5,368
びあ	4.5	4.5	17,640
イオンファンタジー	4.4	4.3	13,975
シーティーエス	4	7.9	9,219
ネクシィーズグループ	5.4	5.3	9,646
みらかホールディングス	38.1	37.7	190,008
アルプス技研	6	5.9	22,538
ダイオーズ	2.7	2.7	3,366
日本空調サービス	14.3	14.1	9,743
オリエンタルランド	161.2	159.4	1,242,841
ダスキン	38.2	36.3	107,230
明光ネットワークジャパン	18.5	17.1	25,154
ファルコホールディングス	7	6.9	10,681
秀英予備校	3	2.9	1,307
田谷	2.5	2.5	1,670
ラウンドワン	46.5	46	50,002
リゾートトラスト	57.7	57.1	122,707
ビー・エム・エル	19.5	19.3	42,440
ワタバウエディング	2.2	2.2	1,168
りらいあコミュニケーションズ	24.6	24.4	30,280
リソー教育	25.4	25.1	23,443
早稲田アカデミー	1.9	1.9	2,789
ユー・エス・エス	180.5	178.5	407,872
東京個別指導学院	4.8	4.8	7,348
サイバーエージェント	78.5	88.7	327,303
楽天	761.8	753.8	1,030,444
クリーク・アンド・リバー社	5.3	6.9	7,169
テー・オー・ダブリュー	11.9	11.8	10,443
セントラルスポーツ	5.1	5	23,175
フルキャストホールディングス	15.4	15.2	20,185
リソルホールディングス	15	15	5,520
テクノプロ・ホールディングス	24.2	24	111,120
アトラ	1.7	2.3	1,621

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
インターワークス	3	3	3,552
K e e P e r 技研	1.6	2.2	6,215
ファーストロジック	0.8	1	2,631
三機サービス	—	1.5	1,998
デザインワン・ジャパン	1	2.6	3,910
イー・ガーディアン	4.8	6.8	13,953
リブセンス	10	9.9	6,652
ジャパンマテリアル	5.4	10.8	22,561
ベクトル	12	12	23,172
ウチヤマホールディングス	6.7	6.6	3,016
サクセスホールディングス	1.2	1.4	2,255
キャリアリンク	3.3	3.3	2,125
I B J	11.6	11.5	8,452
アサンテ	5.5	5.4	10,200
N・フィールド	7	6.9	9,660
バリューHR	—	1.5	4,537
M&Aキャピタルパートナーズ	1.9	2.6	15,366
ライドオン・エクスプレス	3.7	3.7	3,274
E R I ホールディングス	3.8	3.8	3,123
アビスト	2.3	1.9	7,761
ウィルグループ	5.9	5.9	6,124
エスクロー・エージェント・ジャパン	2.5	3.3	7,273
日本ビューホテル	2.1	3	4,110
リクルートホールディングス	325.8	322.2	1,994,418
エラン	2	2	5,122
土木管理総合試験所	1.5	2	1,438
日本郵政	389.2	384.8	528,715
ベルシステム24ホールディングス	22.7	22.5	25,470
一蔵	—	1.4	1,540
L I T A L I C O	—	1.7	2,748
エボラブルアジア	—	2.8	8,540
ソラスト	6.8	9.3	13,782
リログループ	5.6	73.8	168,116
東祥	3.2	4.2	22,680
エイチ・アイ・エス	24.3	24	82,560
ラックランド	2.6	2.6	5,707
共立メンテナンス	12.1	23.9	84,247
イチネンホールディングス	15.6	15.1	18,301
建設技術研究所	9.4	9.3	10,806
スペース	8	8	12,328

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
燦ホールディングス	3	2.9	6,391
スバル興業	11	11	6,666
東京テアトル	57	56	8,008
タナベ経営	2.9	2.9	4,045
ナガワ	2.7	2.7	10,705
よみうりランド	30	29	14,993
東京都競馬	102	101	27,876
常磐興産	5.5	5.4	9,698
カナモト	20.8	20.6	78,177
東京ドーム	59.5	58.8	60,740
西尾レントオール	12	11.9	42,066
トランス・コスモス	17.3	17.1	41,125
乃村工藝社	31.9	31.5	82,341
藤田観光	49	48	18,048
K N T - C T ホールディングス	84	84	13,524
日本管財	12.8	12.6	23,814
トーカイ	6.6	6.5	28,665
白洋舎	1.4	1.4	4,291
セコム	155.1	153.4	1,329,978
セントラル警備保障	6.6	6.5	13,448
丹青社	25.8	25.5	29,605
メイテック	18	17.1	83,191
アサツマ ディ・ケイ	24.3	23.8	67,639
応用地質	14.1	13.9	21,962
船井総研ホールディングス	19.2	18.7	54,248
進学会	6.2	6.1	3,544
オオバ	10.8	11.5	5,980
いであ	—	2.7	2,986
学究社	3.9	3.9	6,232
ベネッセホールディングス	50	49.4	207,480
イオンデイライト	16.8	16.6	62,167
ナック	9.1	9	8,730
ニチイ学館	25.9	25.6	29,337
ダイセキ	26	25.7	64,070
ステップ	5	4.9	7,114
合 計	株 数 ・ 金 額	215,677	213,902
	銘柄数<比率>	1,974	2,003
			<98.8%>

*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいています。

*銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
*評価額欄の< >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		期末
			買建額	売建額	
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 4,115		百万円 —

*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(159, 156, 984千口)の内容です。

外国株式

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
AFLAC INC		400	400	3, 118	346, 623	保険
AGCO CORP		63	63	423	47, 024	機械
AES CORP		650	650	758	84, 305	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AT & T INC		5, 985	6, 154	23, 477	2, 609, 290	各種電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES		1, 440	1, 736	8, 431	937, 104	ヘルスケア機器・用品
ABBVIE INC		1, 582	1, 592	11, 357	1, 262, 253	バイオテクノロジー
ACTIVISION BLIZZARD INC		577	712	4, 320	480, 171	ソフトウェア
ACUITY BRANDS INC		43	43	765	85, 067	電気設備
ADOBE SYSTEMS INC.		488	497	7, 168	796, 732	ソフトウェア
ADVANCE AUTO PARTS		71	71	853	94, 911	専門小売り
ADVANCED MICRO DEVICES		—	860	1, 202	133, 621	半導体・半導体製造装置
AETNA INC		343	350	5, 323	591, 653	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP		52	59	954	106, 135	資本市場
AGILENT TECHNOLOGIES INC		312	327	1, 955	217, 293	ライフサイエンス・ツール/サービス
AIR PRODUCTS		199	215	3, 084	342, 846	化学
AKAMAI TECHNOLOGIES		166	166	818	90, 917	インターネットソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP		111	111	1, 178	131, 001	化学
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		216	222	2, 743	304, 909	バイオテクノロジー
ALIGN TECHNOLOGY INC		71	78	1, 165	129, 531	ヘルスケア機器・用品
ALLEGHANY CORP		15	15	886	98, 543	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP		57	52	1, 351	150, 224	情報技術サービス
ALLIANT ENERGY CORP		229	229	957	106, 385	電力
ALLSTATE CORP		362	361	3, 221	358, 044	保険
ALLY FINANCIAL INC		421	481	964	107, 183	消費者金融
ALPHABET INC-CL C		300	312	30, 011	3, 335, 488	インターネットソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A		286	297	29, 132	3, 237, 799	インターネットソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC		1, 899	1, 935	14, 905	1, 656, 575	タバコ
AMAZON.COM INC		392	406	40, 710	4, 524, 574	インターネット販売・通信販売
AMERCO		6	6	232	25, 871	陸運・鉄道
AMEREN CORPORATION		242	243	1, 372	152, 508	総合公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		125	125	605	67, 281	旅客航空輸送業
AMERICAN ELECTRIC POWER		480	494	3, 576	397, 498	電力
AMERICAN EXPRESS CO		769	766	6, 297	699, 880	消費者金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC		—	74	742	82, 498	保険
AMERICAN INTL GROUP		1, 039	980	6, 195	688, 574	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC		178	178	1, 436	159, 667	水道
AMERISOURCEBERGEN CORP		182	166	1, 587	176, 411	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC		157	157	2, 013	223, 765	資本市場
AMETEK INC		233	233	1, 409	156, 694	電気設備
AMGEN INC		727	735	12, 594	1, 399, 722	バイオテクノロジー
AMPHENOL CORP-CL A		305	304	2, 271	252, 486	電子装置・機器・部品
ANADARKO PETE		536	553	2, 507	278, 723	石油・ガス・消耗燃料
ANALOG DEVICES INC		304	368	2, 943	327, 114	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC		83	83	1, 016	112, 918	ソフトウェア
ANTERO RESOURCES CORP		147	218	439	48, 868	石油・ガス・消耗燃料
ANTHEM INC		257	262	5, 043	560, 563	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
APACHE CORPORATION		366	382	1, 744	193, 851	石油・ガス・消耗燃料
APPLE INC		5, 245	5, 252	76, 610	8, 514, 538	コンピュータ・周辺機器

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
				外貨建金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
APPLIED MATERIALS	1,056	1,078	4,702	522,606	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	232	254	1,043	115,995	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND	567	571	2,355	261,776	食品
ARCONIC INC	436	391	990	110,029	航空宇宙・防衛
ARISTA NETWORKS INC	—	46	727	80,858	通信機器
ARROW ELECTRS INC	89	89	685	76,174	電子装置・機器・部品
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	58	—	—	—	化学
ASSURANT INC	62	60	613	68,184	保険
ATMOS ENERGY CORP	105	105	880	97,885	ガス
AUTODESK INC.	199	199	2,103	233,753	ソフトウェア
AUTOLIV INC	84	84	912	101,433	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS	446	445	4,561	506,937	情報技術サービス
AUTONATION INC	71	71	279	31,082	専門小売り
AUTOZONE	28	28	1,647	183,093	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	87	87	763	84,827	容器・包装
AVNET	122	122	464	51,660	電子装置・機器・部品
BB&T CORPORATION	796	817	3,566	396,348	銀行
BAKER HUGHES	396	399	2,188	243,231	エネルギー設備・サービス
BALL CORP	158	338	1,412	156,947	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP	9,927	10,046	23,236	2,582,493	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,045	1,042	5,167	574,291	資本市場
BARD (C R)	72	73	2,305	256,266	ヘルスケア機器・用品
BAXTER INTERNATIONAL INC.	471	485	2,912	323,686	ヘルスケア機器・用品
B/E AEROSPACE INC	101	—	—	—	航空宇宙・防衛
BECTON, DICKINSON	205	228	4,411	490,302	ヘルスケア機器・用品
BED BATH & BEYOND	156	156	525	58,359	専門小売り
WR BERKLEY CORP	99	99	683	75,985	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,185	1,242	21,070	2,341,741	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	284	284	1,566	174,137	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	168	168	1,660	184,511	バイオテクノロジー
BIOGEN INC	212	216	6,034	670,671	バイオテクノロジー
BLACKROCK INC	119	121	5,099	566,743	資本市場
H & R BLOCK INC	224	224	691	76,901	各種消費者サービス
BOEING CO	576	581	11,571	1,286,087	航空宇宙・防衛
BORGWARNER INC	213	213	873	97,129	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,314	1,376	3,840	426,823	ヘルスケア機器・用品
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,623	1,680	9,419	1,046,912	医薬品
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	114	114	865	96,190	情報技術サービス
BROWN-FORMAN CORP-CL B	200	200	976	108,539	飲料
CBS CORP-CL B	396	368	2,301	255,744	メディア
CBOE HOLDINGS INC	—	100	888	98,714	資本市場
CBRE GROUP INC	296	296	1,040	115,601	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC	128	128	803	89,324	ソフトウェア
CDW CORPORATION	140	165	1,035	115,108	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	229	229	611	67,954	化学
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	136	136	913	101,527	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP	251	256	4,356	484,193	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CIT GROUP INC	194	136	650	72,265	銀行
CME GROUP INC	331	341	4,259	473,355	資本市場
CMS ENERGY CORP	273	273	1,302	144,757	総合公益事業
CSX CORP	924	924	4,822	535,956	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	1,035	1,025	8,011	890,386	食品・生活必需品小売り
CA INC	309	309	1,106	122,945	ソフトウェア
CABOT OIL & GAS CORP	457	457	1,021	113,517	石油・ガス・消耗燃料

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CADENCE DESIGN SYS INC	291	291	997	110,835	ソフトウェア
CALPINE CORP	347	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CAMPBELL SOUP CO	191	191	1,033	114,842	食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	495	483	3,906	434,168	消費者金融
CARDINAL HEALTH INC	310	321	2,487	276,417	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARMAX INC	183	183	1,093	121,502	専門小売り
CARNIVAL CORP	348	348	2,311	256,929	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC DEL	572	590	6,104	678,479	機械
CELANESE CORP-SERIES A	143	144	1,360	151,223	化学
CELGENE CORP	753	777	10,320	1,147,063	バイオテクノロジー
CENTENE CORP	168	168	1,346	149,596	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	412	412	1,152	128,119	総合公益事業
CENTURYLINK INC	522	554	1,353	150,480	各種電気通信サービス
CERNER CORP	303	301	2,021	224,637	ヘルスケア・テクノロジー
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	210	216	7,221	802,633	メディア
CHENIERE ENERGY INC	195	195	909	101,101	石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP	1,835	1,898	19,832	2,204,150	石油・ガス・消耗燃料
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	29	25	1,069	118,814	ホテル・レストラン・レジャー
CHURCH & DWIGHT CO INC	256	257	1,362	151,440	家庭用品
CIMAREX ENERGY CO	95	97	895	99,526	石油・ガス・消耗燃料
CINCINNATI FINANCIAL CORP	155	155	1,110	123,377	保険
CISCO SYSTEMS	4,890	5,022	15,990	1,777,133	通信機器
CINTAS CORP	84	92	1,192	132,524	商業サービス・用品
CITIGROUP	2,825	2,778	17,731	1,970,731	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	504	504	1,774	197,171	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	149	158	1,274	141,675	ソフトウェア
CLOROX CO	124	130	1,811	201,321	家庭用品
COACH INC	279	279	1,298	144,342	繊維・アパレル・贅沢品
COCA COLA CO	3,987	4,089	18,490	2,055,029	飲料
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	587	600	4,074	452,851	情報技術サービス
COLGATE PALMOLIVE CO.	829	840	6,357	706,530	家庭用品
COMCAST CORP-CL A	2,336	4,744	19,108	2,123,755	メディア
COMERICA INC	173	173	1,251	139,051	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	—	193	733	81,531	通信機器
COMPUTER SCIENCES CORP	138	—	—	—	情報技術サービス
CONAGRA BRANDS INC	400	430	1,620	180,073	食品
CONCHO RESOURCES INC	139	150	1,721	191,366	石油・ガス・消耗燃料
CONOCOPHILLIPS	1,213	1,233	5,542	615,975	石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC	293	302	2,556	284,121	総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	171	170	3,151	350,231	飲料
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	94	94	285	31,748	石油・ガス・消耗燃料
THE COOPER COMPANIES, INC.	47	47	1,146	127,382	ヘルスケア機器・用品
CORNING INC	1,010	943	2,806	311,899	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	425	442	7,211	801,456	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	32	32	830	92,290	インターネットソフトウェア・サービス
COTY INC-CL A	476	476	904	100,483	パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	131	145	840	93,436	容器・包装
CUMMINS INC	156	162	2,578	286,616	機械
DR HORTON INC	336	361	1,226	136,292	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	177	179	1,971	219,093	総合公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	—	289	2,208	245,456	情報技術サービス
DANAHER CORP	608	620	5,361	595,906	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC	118	127	1,121	124,605	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA INC	157	157	1,009	112,179	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
DEERE & COMPANY		258	267	3,331	370,276	機械
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V		217	217	1,374	152,718	ソフトウェア
DELTA AIR LINES INC		177	177	925	102,824	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC		232	234	1,492	165,845	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP		458	493	1,486	165,197	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC		83	83	650	72,256	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC		77	85	737	81,951	石油・ガス・消耗燃料
DICK S SPORTING GOODS INC		82	82	312	34,676	専門小売り
DISNEY (WALT) CO	1,484	1,586		16,621	1,847,289	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	394	385		2,323	258,273	消費者金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	143	143		365	40,654	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	212	212		525	58,432	メディア
DISH NETWORK CORP-A	218	231		1,460	162,358	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	271	283		2,029	225,609	複合小売り
DOLLAR TREE INC	227	237		1,612	179,244	複合小売り
DOMINION ENERGY INC	615	625		4,947	549,865	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC	46	46		996	110,714	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP	153	153		1,188	132,039	機械
DOW CHEM CO	1,093	1,219		7,762	862,734	化学
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	178	187		1,791	199,061	飲料
DU PONT E I DE NEMOURS	848	865		6,999	777,933	化学
DUKE ENERGY CORP	674	700		6,059	673,497	電力
DUN & BRADSTREET CORP	36	—		—	—	専門サービス
EOG RESOURCES INC	559	574		5,000	555,776	石油・ガス・消耗燃料
EQT CORP	165	165		838	93,212	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	275	280		1,030	114,580	資本市場
EAST WEST BANCORP INC	—	143		809	89,922	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO.	141	141		1,173	130,427	化学
EATON VANCE CORP	117	117		557	61,909	資本市場
EBAY INC	1,047	1,021		3,569	396,704	インターネットソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	256	264		3,488	387,711	化学
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	58	—		—	—	パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	317	328		2,671	296,917	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	210	211		2,508	278,803	ヘルスケア機器・用品
ELECTRONIC ARTS	290	310		3,508	389,909	ソフトウェア
EMERSON ELEC	629	648		3,799	422,317	電気設備
ENTERGY CORP	171	182		1,444	160,545	電力
ENVISION HEALTHCARE CORP	116	116		675	75,084	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EQUIFAX INC	117	117		1,626	180,785	専門サービス
EVERSOURCE ENERGY	307	321		2,013	223,759	電力
EXELON CORPORATION	900	932		3,417	379,836	電力
EXPEDIA INC	123	123		1,838	204,315	インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	177	177		975	108,450	航空貨物・物流サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	617	604		3,863	429,421	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EXXON MOBIL CORP	4,036	4,153		33,822	3,758,980	石油・ガス・消耗燃料
FLIR SYSTEMS INC	127	127		448	49,839	電子装置・機器・部品
FMC CORP	132	132		997	110,894	化学
FMC TECHNOLOGIES INC	225	—		—	—	エネルギー設備・サービス
FACEBOOK INC-A	2,260	2,359		36,307	4,035,200	インターネットソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	276	293		1,251	139,080	商社・流通業
FEDEX CORPORATION	246	251		5,341	593,650	航空貨物・物流サービス
F5 NETWORKS INC	67	62		799	88,882	通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	303	331		2,813	312,655	情報技術サービス
FNF GROUP	244	265		1,163	129,265	保険

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FIFTH THIRD BANCORP	737	737	1,871	207,969	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	302	370	677	75,335	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	145	155	1,547	171,991	銀行
FISERV INC	214	215	2,695	299,596	情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	418	452	1,330	147,842	電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	88	94	1,315	146,239	情報技術サービス
FLUOR CORP	139	139	608	67,617	建設・土木
FLOWSERVE CORP	122	122	537	59,714	機械
FOOT LOCKER INC	134	134	640	71,217	専門小売り
FORD MOTOR COMPANY	3,630	3,720	4,106	456,438	自動車
FORTINET INC	139	139	524	58,287	ソフトウェア
FORTIVE CORP	307	310	1,995	221,776	機械
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	153	153	994	110,579	建設関連製品
FRANKLIN RESOURCES INC	359	335	1,482	164,788	資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC	1,241	1,400	1,569	174,423	金属・鉱業
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	1,140	—	—	—	各種電気通信サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	179	180	1,042	115,830	保険
GAP INC	229	229	501	55,737	専門小売り
GARTNER INC	81	91	1,121	124,621	情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS	253	257	5,258	584,410	航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	8,719	8,742	24,285	2,699,065	コングロマリット
GENERAL MILLS	580	580	3,260	362,336	食品
GENERAL MOTORS CO	1,368	1,359	4,638	515,496	自動車
GENUINE PARTS CO	144	144	1,294	143,861	販売
GILEAD SCIENCES INC	1,282	1,306	8,815	979,754	バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	146	156	1,397	155,364	情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	354	360	8,016	890,933	資本市場
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	248	248	834	92,693	自動車部品
WR GRACE & CO	67	67	465	51,707	化学
GRAINGER(W.W.) INC	55	55	962	106,937	商社・流通業
HCA HEALTHCARE INC	295	297	2,496	277,437	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HD SUPPLY HOLDINGS INC	—	199	640	71,194	商社・流通業
HP INC	1,670	1,670	2,957	328,704	コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	842	870	3,674	408,329	エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC	377	377	830	92,347	繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC	179	168	940	104,485	自動車
HARMAN INTERNATIONAL	70	—	—	—	家庭用耐久財
HARRIS CORP	119	127	1,418	157,676	通信機器
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	375	377	1,950	216,831	保険
HASBRO INC	107	115	1,279	142,151	レジャー用品
HELMERICH & PAYNE	106	106	550	61,166	エネルギー設備・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	—	77	808	89,805	情報技術サービス
HERSHEY CO/THE	144	144	1,606	178,558	食品
HESS CORP	274	274	1,104	122,753	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,624	1,680	2,783	309,387	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	569	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	—	203	1,331	148,002	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	166	166	429	47,728	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	247	276	1,263	140,459	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT	1,201	1,221	19,119	2,124,956	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	702	726	9,746	1,083,231	コングロマリット
HORMEL FOODS CORP	292	294	999	111,095	食品
HUMANA INC	145	150	3,545	394,048	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	753	83,725	陸運・鉄道

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	
HUNTINGTON BANCSHARES INC		1,070	1,070	1,397	155,309	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE		46	46	858	95,387	航空宇宙・防衛
IDEX CORP		—	75	833	92,607	機械
IDEXX LABORATORIES INC		86	86	1,432	159,246	ヘルスケア機器・用品
ILLINOIS TOOL WORKS INC		312	312	4,574	508,380	機械
ILLUMINA INC		142	147	2,611	290,190	ライフサイエンス・ツール/サービス
INCYTE CORP		167	167	2,237	248,690	バイオテクノロジー
INGREDION INC		73	68	800	88,952	食品
INTEL CORP		4,592	4,741	16,394	1,822,071	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC		582	598	3,844	427,282	資本市場
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES		882	906	13,933	1,548,555	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE		76	76	1,034	114,941	化学
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)		376	393	2,209	245,514	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP		392	392	948	105,431	メディア
INTUIT INC		235	241	3,380	375,655	ソフトウェア
INTUITIVE SURGICAL INC		37	38	3,651	405,774	ヘルスケア機器・用品
JPMORGAN CHASE & CO		3,515	3,585	31,232	3,471,182	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC		123	123	645	71,754	建設・土木
JOHNSON & JOHNSON		2,662	2,718	36,668	4,075,341	医薬品
JONES LANG LASALLE INC		47	47	559	62,160	不動産管理・開発
JUNIPER NETWORKS INC		335	378	1,090	121,243	通信機器
KLA TENCOR CORP		150	159	1,558	173,196	半導体・半導体製造装置
KANSAS CITY SOUTHERN		106	106	1,062	118,067	陸運・鉄道
KELLOGG CO		255	267	1,881	209,145	食品
KEYCORP		1,070	1,077	1,980	220,124	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP		352	357	4,706	523,061	家庭用品
KINDER MORGAN INC		1,856	1,987	3,677	408,765	石油・ガス・消耗燃料
KOHL'S CORP		185	172	611	67,976	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE		596	606	5,417	602,116	食品
KROGER CO		880	945	2,113	234,946	食品・生活必需品小売り
L BRANDS, INC		240	240	1,235	137,315	専門小売り
LKQ CORP		300	300	963	107,027	販売
L3 TECHNOLOGIES INC		—	77	1,315	146,176	航空宇宙・防衛
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS		77	—	—	—	航空宇宙・防衛
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS		98	103	1,505	167,372	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH		154	160	2,414	268,371	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP		421	401	2,589	287,770	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A		214	224	2,180	242,306	パーソナル用品
LEAR CORP		69	69	955	106,210	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC		134	134	707	78,663	家庭用耐久財
LEIDOS HOLDINGS INC		—	141	757	84,230	情報技術サービス
LENNAR CORP-A		180	201	1,070	118,955	家庭用耐久財
LENNOX INTERNATIONAL INC		—	38	734	81,672	建設関連製品
LEUCADIA NATIONAL CORP		322	322	804	89,431	各種金融サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC		301	301	1,808	201,019	各種電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND CORP-C		101	110	948	105,468	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A		423	423	1,006	111,889	インターネット販売・通信販売
LIBERTY SIRIUSXM GROUP		98	98	397	44,141	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C		193	193	771	85,757	メディア
ELI LILLY & CO.		964	998	8,247	916,624	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP		223	223	1,471	163,575	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP		238	—	—	—	半導体・半導体製造装置
LOCKHEED MARTIN		256	262	7,434	826,231	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP		277	277	1,296	144,139	保険

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
LOWES COS INC		863	865	6,845	760,821	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC		106	106	564	62,780	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP		137	137	2,206	245,187	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL		449	449	1,479	164,476	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC		85	93	947	105,251	資本市場
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION		76	76	580	64,506	運送インフラ
MACYS INC		304	304	656	72,978	複合小売り
MANPOWERGROUP INC		70	71	764	84,922	専門サービス
MARATHON OIL CORP		812	812	942	104,775	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP		510	529	2,736	304,136	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP		13	14	1,367	151,956	保険
MARSH & MCLENNAN COS		507	520	4,128	458,874	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA		322	322	3,352	372,650	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS		59	64	1,460	162,285	建設資材
MASCO CORP		329	329	1,275	141,726	建設関連製品
MASTERCARD INC		942	951	11,706	1,301,094	情報技術サービス
MATTEL INC		334	334	667	74,204	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS		270	288	1,325	147,270	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.		113	113	1,130	125,613	食品
MCDONALD'S CORP		829	833	12,805	1,423,226	ホテル・レストラン・レジャー
MCKESSON CORP		218	210	3,420	380,128	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO		178	—	—	—	食品
MEDNAX INC		91	91	526	58,477	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR		184	244	580	64,514	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC		39	43	1,191	132,374	インターネットソフトウェア・サービス
MERCK & CO INC		2,689	2,764	18,093	2,010,872	医薬品
METLIFE INC		914	931	4,890	543,534	保険
METTLER-TOLEDO INTL		26	26	1,568	174,286	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP		7,205	7,351	51,655	5,740,989	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY		206	216	1,745	194,042	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY		1,009	1,043	3,338	371,056	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP		57	57	688	76,507	機械
MOHAWK INDUSTRIES		63	63	1,532	170,358	家庭用耐久財
MOLSON COORS BREWING CO-B		186	188	1,612	179,210	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC		1,509	1,535	6,904	767,358	食品
MONSANTO CO		428	437	5,124	569,559	化学
MONSTER BEVERAGE CORP		384	402	2,057	228,708	飲料
MOODYS CORP		168	168	1,998	222,079	資本市場
MORGAN STANLEY		1,405	1,398	6,278	697,783	資本市場
MOSAIC CO/THE		334	312	682	75,835	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC		145	163	1,405	156,230	通信機器
MURPHY OIL CORP		167	167	411	45,751	石油・ガス・消耗燃料
NVR INC		—	3	871	96,803	家庭用耐久財
NASDAQ INC		111	111	774	86,059	資本市場
NATIONAL OILWELL VARCO INC		365	365	1,172	130,338	エネルギー設備・サービス
NAVIENT CORP		299	299	477	53,102	消費者金融
NETAPP INC		267	267	1,030	114,572	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC		420	433	6,712	746,060	インターネット販売・通信販売
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD		1,140	1,140	843	93,757	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD		241	220	1,381	153,526	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD		—	220	909	101,055	コングロマリット
NEW YORK COMMUNITY BANCORP		471	471	601	66,847	貯蓄・抵当・不動産金融
NEWELL BRANDS INC		422	477	2,507	278,693	家庭用耐久財
NEWFIELD EXPLORATION CO		188	188	523	58,148	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO		510	535	1,773	197,109	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I		374	374	506	56,239	メディア
NEXTERA ENERGY INC		452	468	6,601	733,702	電力
NIKE INC-B	1,309	1,333	7,010	779,118	繊維・アパレル・贅沢品	
NISOURCE INC	303	337	876	97,455	総合公益事業	
NOBLE ENERGY INC	426	473	1,330	147,824	石油・ガス・消耗燃料	
NORDSTROM INC	127	127	585	65,040	複合小売り	
NORFOLK SOUTHERN CORP	286	289	3,394	377,307	陸運・鉄道	
NORTHERN TRUST CORP	207	217	2,048	227,643	資本市場	
NORTHROP GRUMMAN CORP	165	165	4,302	478,190	航空宇宙・防衛	
NUANCE COMMUNICATIONS INC	250	308	574	63,806	ソフトウェア	
NUCOR CORP	306	321	1,796	199,678	金属・鉱業	
NVIDIA CORP	524	539	8,595	955,296	半導体・半導体製造装置	
OGE ENERGY CORP	196	196	692	76,939	電力	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	92	92	2,042	226,961	専門小売り	
OCCIDENTAL PETE CORP	748	762	4,562	507,115	石油・ガス・消耗燃料	
OMNICOM GROUP	230	230	1,900	211,220	メディア	
ONEOK INC	210	212	1,005	111,705	石油・ガス・消耗燃料	
ORACLE CORPORATION	3,005	3,086	14,297	1,589,017	ソフトウェア	
PG&E CORP	496	510	3,528	392,121	電力	
PNC FINANCIAL	481	488	5,969	663,472	銀行	
PPG INDUSTRIES	257	254	2,811	312,444	化学	
PPL CORPORATION	669	690	2,717	302,068	電力	
PVH CORP	80	80	840	93,419	繊維・アパレル・贅沢品	
PACCAR	341	355	2,227	247,578	機械	
PACKAGING CORP OP AMERICA	96	97	1,044	116,117	容器・包装	
PALO ALTO NETWORKS INC	85	90	1,196	132,974	通信機器	
PARKER HANNIFIN CORP	133	133	2,102	233,712	機械	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	150	217	566	62,970	石油・ガス・消耗燃料	
PATTERSON COS INC	87	87	415	46,141	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
PAYCHEX INC	315	329	1,971	219,134	情報技術サービス	
PAYPAL HOLDINGS INC	1,063	1,154	6,178	686,680	情報技術サービス	
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	305	354	613	68,143	銀行	
PEPSICO INC	1,399	1,431	16,802	1,867,463	飲料	
PFIZER INC	5,900	5,966	20,212	2,246,451	医薬品	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,508	1,555	18,689	2,077,156	タバコ	
PHILLIPS 66	460	435	3,431	381,400	石油・ガス・消耗燃料	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	111	111	983	109,301	電力	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	166	172	2,666	296,356	石油・ガス・消耗燃料	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	90	140	327	36,393	石油・ガス・消耗燃料	
POLARIS INDUSTRIES INC	62	62	543	60,376	レジャー用品	
PRAXAIR INC	279	287	3,813	423,785	化学	
T ROWE PRICE GROUP INC	239	239	1,745	194,012	資本市場	
PRICELINE GROUP INC/THE	47	49	9,153	1,017,374	インターネット販売・通信販売	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	279	293	1,871	207,953	保険	
PROCTER & GAMBLE CO	2,487	2,562	22,904	2,545,581	家庭用品	
PROGRESSIVE CO	565	586	2,605	289,624	保険	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	427	429	4,499	500,105	保険	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	487	508	2,233	248,194	総合公益事業	
PULTEGROUP INC	289	289	701	77,986	家庭用耐久財	
QORVO INC	127	127	903	100,469	半導体・半導体製造装置	
QUALCOMM INC	1,432	1,484	8,359	929,060	半導体・半導体製造装置	
QUEST DIAGNOSTICS INC	133	141	1,537	170,858	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
QUINTILES IMS HOLDINGS INC	142	142	1,274	141,689	ライフサイエンス・ツール/サービス	

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
RALPH LAUREN CORPORATION		58	58	411	45,709	繊維・アパレル・贅沢品
RANGE RESOURCES CORP		190	245	519	57,780	石油・ガス・消耗燃料
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		121	133	1,033	114,823	資本市場
RAYTHEON COMPANY		289	293	4,790	532,389	航空宇宙・防衛
RED HAT INC		178	178	1,754	195,020	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS		75	78	4,097	455,435	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1,210	1,210	1,689	187,733	銀行	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		63	63	802	89,203	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A		229	243	1,557	173,060	商業サービス・用品
RESMED INC		141	141	1,105	122,842	ヘルスケア機器・用品
REYNOLDS AMERICAN INC		838	852	5,623	624,962	タバコ
RITE AID CORP		990	—	—	—	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC		133	133	633	70,404	専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC		124	129	2,065	229,565	電気設備
ROCKWELL COLLINS INC		128	159	1,673	186,045	航空宇宙・防衛
ROLLINS INC		—	97	414	46,022	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC		99	103	2,405	267,381	コングロマリット
ROSS STORES INC		390	390	2,219	246,630	専門小売り
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A		120	—	—	—	各種電気通信サービス
S&P GLOBAL INC		255	261	3,790	421,247	資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY		141	127	676	75,203	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS		—	171	658	73,131	ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP		—	51	900	100,086	銀行
SABRE CORP		200	200	450	50,057	情報技術サービス
ST JUDE MEDICAL INC		277	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
SALESFORCE.COM INC		630	666	5,831	648,112	ソフトウェア
SCANA CORP		129	141	989	109,977	総合公益事業
HENRY SCHEIN INC		80	80	1,478	164,374	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,352	1,400	9,165	1,018,687	エネルギー設備・サービス	
SCHWAB(CHARLES)CORP	1,165	1,210	5,051	561,451	資本市場	
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A		78	91	604	67,145	メディア
SEALED AIR CORP		192	192	869	96,601	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC		97	97	615	68,424	バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY		229	238	2,710	301,227	総合公益事業
SERVICENOW INC		157	166	1,753	194,860	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS		75	83	2,949	327,842	化学
SIGNATURE BANK		50	57	780	86,725	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,630	1,630	854	94,926	メディア	
SKYWORKS SOLUTIONS INC		181	181	1,869	207,801	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP		144	144	812	90,343	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW		113	113	1,373	152,677	食品
SNAP-ON INC		58	59	910	101,164	機械
SOUTHERN CO.		948	993	5,084	565,053	電力
SOUTHWEST AIRLINES		153	153	933	103,777	旅客航空輸送業
SOUTHWESTERN ENERGY CO		468	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SPECTRA ENERGY CORP		677	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC		26	26	332	36,938	家庭用品
SPLUNK INC		128	128	731	81,272	ソフトウェア
SPRINT CORP		750	750	615	68,434	無線通信サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC		144	150	2,143	238,228	機械
STAPLES INC		620	620	536	59,673	専門小売り
STARBUCKS CORP	1,424	1,464	8,778	975,602	ホテル・レストラン・レジャー	
STATE STREET CORP		381	382	3,414	379,467	資本市場
STEEL DYNAMICS		—	240	798	88,689	金属・鉱業

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
STERICYCLE INC	79	89	679	75,511	商業サービス・用品
STRYKER CORP	329	336	4,730	525,790	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.	483	486	2,687	298,643	銀行
SYMANTEC CORP	608	608	1,760	195,624	ソフトウェア
SYNOPSYS INC	149	149	1,112	123,619	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	805	805	2,390	265,719	消費者金融
SYSCO CORP	514	515	2,747	305,359	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	253	253	1,027	114,217	資本市場
TJX COS INC	643	657	4,559	506,751	専門小売り
T-MOBILE US INC	283	283	1,799	199,944	無線通信サービス
TARGET CORP	534	528	2,667	296,461	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP	164	222	903	100,370	石油・ガス・消耗燃料
TEGNA INC	206	—	—	—	メディア
TELEFLEX INC	43	43	880	97,907	ヘルスケア機器・用品
TESARO INC	—	37	525	58,446	バイオテクノロジー
TESORO CORP	113	150	1,367	151,956	石油・ガス・消耗燃料
TESLA INC	124	129	4,881	542,575	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	883	914	2,837	315,411	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC	974	1,004	7,998	888,994	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	264	264	1,219	135,525	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	386	395	6,939	771,279	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	587	595	12,669	1,408,080	コングロマリット
TIFFANY & CO	119	128	1,168	129,896	専門小売り
TIME WARNER INC	755	778	7,721	858,184	メディア
TOLL BROTHERS INC	164	163	636	70,724	家庭用耐久財
TORCHMARK CORP	112	112	852	94,776	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	163	163	958	106,502	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	130	130	686	76,315	専門小売り
TRANSDIGM GROUP INC	52	52	1,401	155,749	航空宇宙・防衛
TRAVELERS COS INC/THE	281	277	3,561	395,843	保険
TRIMBLE INC	255	256	930	103,365	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	123	123	440	48,966	インターネット販売・通信販売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,038	1,045	2,847	316,485	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	428	428	1,149	127,767	メディア
TWITTER INC	539	634	1,127	125,282	インターネットソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	289	289	1,773	197,149	食品
UGI CORP	163	180	895	99,505	ガス
US BANCORP	1,662	1,689	8,782	976,120	銀行
ULTA BEAUTY INC	56	59	1,727	191,968	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	184	184	373	41,533	繊維・アパレル・贅沢品
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	187	187	350	38,968	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP	809	813	8,749	972,420	陸運・鉄道
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	76	76	589	65,537	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	671	693	7,566	840,981	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC	86	85	863	95,999	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES	772	765	9,313	1,035,144	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP	43	43	572	63,636	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC	926	965	17,848	1,983,679	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	86	86	973	108,216	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP	225	225	1,031	114,604	保険
VCA INC	—	80	739	82,225	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
V F CORP	319	356	1,965	218,482	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC	—	39	831	92,375	ホテル・レストラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP	450	453	2,930	325,640	石油・ガス・消耗燃料

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
VALSPAR CORP	73	—	—	—	化学
VANTIV INC - CL A	148	161	964	107,146	情報技術サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	95	96	1,001	111,335	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	—	105	655	72,818	ヘルスケア・テクノロジー
VERISIGN INC	96	97	904	100,507	インターネットソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	3,965	4,087	18,559	2,062,654	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	159	160	1,344	149,478	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	238	246	3,316	368,631	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B	341	341	1,178	131,015	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	1,834	1,863	17,612	1,957,486	情報技術サービス
VMWARE INC - CLASS A	74	74	666	74,027	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	203	187	663	73,738	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	128	135	1,730	192,304	建設資材
WABCO HOLDINGS INC	52	52	627	69,703	機械
WEC ENERGY GROUP INC	306	320	2,043	227,152	総合公益事業
WABTEC CORP	90	90	793	88,232	機械
WAL-MART STORES INC	1,503	1,534	11,695	1,299,806	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	893	915	7,147	794,426	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	175	262	1,710	190,099	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC	432	445	3,266	363,016	商業サービス・用品
WATERS CORP	80	80	1,483	164,869	ライフサイエンス・ツール/サービス
WELLS FARGO CO	4,664	4,775	25,297	2,811,614	銀行
WESTAR ENERGY INC	134	134	715	79,557	電力
WESTERN DIGITAL CORP	278	291	2,648	294,406	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	491	458	862	95,899	情報技術サービス
WESTROCK CO	243	243	1,384	153,885	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	75	76	1,474	163,919	家庭用耐久財
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	175	—	—	—	食品
WHOLE FOODS MARKET INC	316	316	1,367	151,930	食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS	694	810	2,255	250,715	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A	120	128	1,308	145,445	ソフトウェア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	109	109	1,124	125,019	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN RESORTS LTD	77	84	1,154	128,329	ホテル・レストラン・レジャー
XCEL ENERGY INC	494	512	2,434	270,576	電力
XILINX INC	250	250	1,653	183,714	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	840	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
XEROX CORP	—	210	585	65,070	コンピュータ・周辺機器
XYLEM INC	170	186	995	110,678	機械
YAHOO! INC	884	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス
YUM BRANDS INC	361	332	2,470	274,524	ホテル・レストラン・レジャー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	155	192	610	67,878	各種電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	109	109	528	58,729	インターネットソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	198	197	2,531	281,389	ヘルスケア機器・用品
ZIONS BANCORPORATION	—	200	846	94,091	銀行
ZOETIS INC	458	486	3,061	340,288	医薬品
ALKERMES PLC	152	152	876	97,406	バイオテクノロジー
ALLEGION PLC	—	94	766	85,154	建設関連製品
ALLERGAN PLC	384	335	8,191	910,453	医薬品
AON PLC	257	264	3,571	396,983	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	121	134	1,263	140,468	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	—	114	568	63,185	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	85	85	550	61,197	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	212	212	687	76,363	化学
ACCENTURE PLC-CL A	604	626	7,957	884,350	情報技術サービス

銘柄		柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
			株 数	株 数	評 価 額		
					外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)			百株	百株	千米ドル	千円	
BUNGE LIMITED			138	138	1,045	116,149	食品
DELPHI AUTOMOTIVE PLC			269	269	2,308	256,543	自動車部品
EATON CORP PLC			444	447	3,393	377,167	電気設備
ENDO INTERNATIONAL PLC			205	—	—	—	医薬品
EVEREST RE GROUP LTD			40	40	1,028	114,350	保険
IHS MARKIT LTD			353	375	1,753	194,925	専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC			251	262	2,370	263,465	機械
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC			850	850	330	36,748	エネルギー設備・サービス
INVESCO LTD			396	396	1,378	153,159	資本市場
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC			62	61	940	104,581	医薬品
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC			914	943	3,908	434,416	建設関連製品
LIBERTY GLOBAL PLC-A			240	240	691	76,899	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C			595	595	1,657	184,167	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C			112	—	—	—	メディア
MALLINCKRODT PLC			111	97	440	48,911	医薬品
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD			410	410	719	79,925	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC			1,354	1,371	12,173	1,352,919	ヘルスケア機器・用品
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD			161	161	555	61,768	繊維・アパレル・贅沢品
NIELSEN HOLDINGS PLC			342	362	1,347	149,786	専門サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN			161	161	883	98,235	ホテル・レストラン・レジャー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD			42	42	590	65,621	保険
SEAGATE TECHNOLOGY			286	286	1,191	132,420	コンピュータ・周辺機器
PENTAIR PLC			167	167	1,084	120,493	機械
SIGNET JEWELERS LTD			71	68	382	42,473	専門小売り
TECHNIPFMC PLC			—	433	1,147	127,479	エネルギー設備・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC			126	132	1,961	218,003	保険
PERRIGO CO PLC			138	138	1,011	112,468	医薬品
XL GROUP LTD			264	264	1,161	129,129	保険
CHUBB LTD			451	469	6,876	764,251	保険
GARMIN LTD			114	133	680	75,637	家庭用耐久財
TE CONNECTIVITY LTD			343	356	2,811	312,451	電子装置・機器・部品
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.			127	132	1,485	165,145	ソフトウェア
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD			15	15	171	19,024	医薬品
AERCAP HOLDINGS NV			150	150	674	74,986	商社・流通業
CORE LABORATORIES N.V.			43	43	434	48,282	エネルギー設備・サービス
MOBILEYE NV			170	203	1,272	141,392	ソフトウェア
LYONDELLBASELL INDU-CL A			345	347	2,761	306,866	化学
MYLAN NV			449	454	1,737	193,101	医薬品
NXP SEMICONDUCTORS NV			287	280	3,056	339,728	半導体・半導体製造装置
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING			169	169	719	80,014	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD			169	169	1,925	213,953	ホテル・レストラン・レジャー
BROADCOM LTD			383	399	9,797	1,088,888	半導体・半導体製造装置
FLEX LTD			550	560	948	105,369	電子装置・機器・部品
小 計		株 数 ・ 金 額	302,711	308,588	2,140,366	237,880,350	
銘 柄 数 < 比 率 >			602	606	—	< 62.8% >	
(カナダ)					千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD			329	329	552	46,124	石油・ガス・消耗燃料
AGNICO EAGLE MINES LTD			216	233	1,441	120,318	金属・鉱業
AGRIUM INC			131	141	1,725	143,974	化学
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B			404	423	2,642	220,479	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD			166	166	497	41,488	石油・ガス・消耗燃料
ATCO LTD CL1			68	68	343	28,645	総合公益事業
BCE INC			138	154	908	75,848	各種電気通信サービス
BANK OF MONTREAL			631	644	5,955	497,004	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	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	1,167	1,215	9,597	800,893	銀行
BARRICK GOLD	1,120	1,158	2,427	202,547	金属・鉱業
BLACKBERRY LTD	509	509	721	60,188	コンピュータ・周辺機器
BOMBARDIER B SHEARS	1,890	1,890	468	39,114	航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	833	897	4,559	380,486	資本市場
CAE INC	260	260	579	48,362	航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B	26	133	880	73,485	容器・包装
CI FINANCIAL CORP	242	282	761	63,515	資本市場
CAMECO CORP	386	386	465	38,847	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	382	400	4,217	351,958	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	758	764	8,097	675,747	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	1,076	1,118	4,186	349,397	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	136	145	2,995	249,942	陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A	70	70	1,030	85,975	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	124	124	513	42,850	総合公益事業
CENOVUS ENERGY INC	830	1,030	941	78,561	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE INC	19	20	1,448	120,881	ソフトウェア
CRESCENT POINT ENERGY CORP	537	537	552	46,112	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	107	107	1,326	110,712	複合小売り
ELDORADO GOLD CORPORATION	708	—	—	—	金属・鉱業
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	360	360	324	27,097	各種金融サービス
EMERA INC	49	49	238	19,901	電力
EMPIRE CO LTD A	162	162	308	25,780	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP	950	950	1,018	84,985	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC	913	1,639	8,294	692,215	石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	21	23	1,311	109,478	保険
FINNING INTERNATIONAL INC	152	152	386	32,218	商社・流通業
FIRST CAPITAL REALTY INC	113	180	375	31,303	不動産管理・開発
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	650	650	651	54,350	金属・鉱業
FORTIS INC	384	410	1,874	156,462	電力
FRANCO-NEVADA CORP	169	179	1,733	144,655	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	208	241	996	83,180	繊維・アパレル・贅沢品
GOLDCORP INC	829	829	1,479	123,486	金属・鉱業
GREAT-WEST LIFE CO INC	300	300	1,021	85,269	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	214	214	1,437	119,989	情報技術サービス
HUSKY ENERGY INC	357	357	553	46,205	石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD	173	294	684	57,091	電力
IGM FINANCIAL INC	103	103	415	34,699	資本市場
IMPERIAL OIL	285	308	1,187	99,057	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	99	99	521	43,497	保険
INTACT FINANCIAL CORP	126	136	1,293	107,908	保険
INTER PIPELINE LTD	331	362	900	75,159	石油・ガス・消耗燃料
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	94	94	205	17,186	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP	178	178	720	60,159	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP	1,186	1,186	636	53,147	金属・鉱業
LINAMAR CORP	48	48	298	24,942	自動車部品
LOBLAW COMPANIES	223	223	1,624	135,550	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	377	377	2,235	186,593	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,927	1,986	4,718	393,778	保険
METHANEX CORP	82	82	438	36,561	化学
METRO INC	232	232	1,003	83,733	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	334	334	1,791	149,507	銀行
ONEX CORPORATION	80	80	794	66,292	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP	121	262	1,121	93,577	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
(カナダ)		百株	百株	千カナダドル	千円	
PEMBINA PIPELINE CORP		374	396	1,673	139,686	石油・ガス・消耗燃料
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP		172	172	402	33,586	石油・ガス・消耗燃料
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC		812	860	1,879	156,810	化学
POWER CORPORATION OF CANADA		376	379	1,101	91,941	保険
POWER FINANCIAL CORP		243	243	795	66,411	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD		207	207	578	48,272	石油・ガス・消耗燃料
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC		213	226	1,861	155,328	ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B		347	361	2,237	186,747	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA		1,443	1,475	13,758	1,148,171	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC		145	145	776	64,796	建設・土木
SAPUTO INC		258	211	888	74,147	食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A		226	226	501	41,830	石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS INC-B		404	404	1,221	101,916	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A		—	79	961	80,264	インターネットソフトウェア・サービス
SILVER WHEATON CORP		416	—	—	—	金属・鉱業
SUN LIFE FINANCIAL INC		591	616	2,765	230,757	保険
SUNCOR ENERGY INC		1,630	1,659	6,345	529,546	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD		549	549	1,118	93,323	金属・鉱業
TELUS CORP		193	193	866	72,331	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP		324	288	1,766	147,398	資本市場
TORONTO DOMINION BANK		1,801	1,868	12,142	1,013,249	銀行
TOURMALINE OIL CORP		216	216	550	45,946	石油・ガス・消耗燃料
TRANSCANADA CORP		836	862	5,391	449,946	石油・ガス・消耗燃料
TRISURA GROUP LTD		—	5	11	944	保険
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		980	980	327	27,314	金属・鉱業
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL		313	313	570	47,590	医薬品
VERESEN INC		290	290	525	43,827	石油・ガス・消耗燃料
VERMILION ENERGY INC		120	120	510	42,599	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER		68	68	402	33,599	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE)LTD		48	48	566	47,270	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		—	454	1,184	98,883	金属・鉱業
YAMANA GOLD INC		970	970	312	26,064	金属・鉱業
小 計		株 数 ・ 金 額	39,660	41,167	166,434	13,889,000
銘 柄 数 < 比 率 >			91	92	—	< 3.7% >
(イギリス)				千英ポンド		
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC		940	940	276	38,917	資本市場
ANTOFAGASTA PLC		410	410	313	44,212	金属・鉱業
ASHTREAD GROUP PLC		476	516	820	115,575	商社・流通業
BHP BILLITON PLC		2,063	2,130	2,429	342,210	金属・鉱業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		980	980	554	78,137	家庭用耐久財
SKY PLC		990	1,050	1,012	142,662	メディア
AVIVA PLC		3,950	4,060	2,170	305,697	保険
DIAGEO PLC		2,443	2,530	6,007	846,274	飲料
SCHRODERS PLC		133	133	415	58,586	資本市場
DCC PLC		86	86	625	88,135	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC		3,060	3,150	2,130	300,190	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,811	1,870	10,384	1,462,809	タバコ
STANDARD CHARTERED PLC		3,200	3,300	2,454	345,724	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		938	956	3,390	477,680	タバコ
HSBC HOLDINGS PLC		19,340	19,910	13,686	1,927,965	銀行
LEGAL & GENERAL		5,770	6,030	1,568	220,940	保険
MEGGITT PLC		780	780	397	55,983	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS		2,130	2,130	527	74,323	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		340	362	1,069	150,639	食品

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
PEARSON	780	780	554	78,178	メディア
PERSIMMON PLC	295	295	666	93,834	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC	2,525	2,567	4,618	650,542	保険
RIO TINTO PLC-REG	1,211	1,233	3,723	524,551	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC	490	540	650	91,664	保険
TRAVIS PERKINS PLC	247	247	362	51,113	商社・流通業
SSE PLC	996	990	1,472	207,378	電力
BP PLC	18,250	19,530	8,919	1,256,468	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC	62,900	71,900	4,829	680,334	銀行
TATE & LYLE ORD.	480	480	347	48,955	食品
TAYLOR WIMPEY PLC	3,190	3,190	571	80,572	家庭用耐久財
TESCO PLC	7,870	8,230	1,381	194,656	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC	890	891	1,231	173,461	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,735	4,904	8,253	1,162,660	医薬品
WEIR GROUP PLC	220	220	379	53,522	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC	259	259	233	32,928	商業サービス・用品
ASTRAZENECA PLC	1,227	1,271	6,863	966,847	医薬品
GKN PLC	1,690	1,690	589	82,991	自動車部品
BT GROUP PLC	8,160	8,370	2,370	333,915	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC	187	187	980	138,167	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC	1,530	1,530	520	73,323	複合小売り
BARCLAYS PLC	16,550	17,010	3,404	479,599	銀行
INTERTEK GROUP PLC	163	163	723	101,973	専門サービス
WILLIAM HILL PLC	850	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
BURBERRY GROUP PLC	419	454	799	112,624	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	140	140	557	78,492	複合小売り
KINGFISHER PLC	2,140	2,140	643	90,589	専門小売り
ITV PLC	3,530	3,530	630	88,762	メディア
SAINSBURY	1,700	1,700	430	60,683	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	88	97	678	95,582	金属・鉱業
G4S PLC	1,520	1,520	507	71,516	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	219	219	446	62,873	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	124	124	408	57,539	家庭用耐久財
CENTRICA PLC	5,240	5,490	1,133	159,624	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,204	4,422	9,129	1,286,033	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	3,639	3,760	7,884	1,110,720	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE	331	331	781	110,042	商社・流通業
COBHAM PLC	1,695	2,540	343	48,447	航空宇宙・防衛
NATIONAL GRID PLC	3,680	—	—	—	総合公益事業
INMARSAT PLC	425	425	341	48,135	各種電気通信サービス
PETROFAC LTD	260	260	106	15,016	エネルギー設備・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	139	139	224	31,681	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	300	317	1,191	167,905	資本市場
UNILEVER PLC	1,256	1,277	5,498	774,610	パーソナル用品
TUI AG-DI	490	490	563	79,449	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	610	610	354	49,882	資本市場
EXPERIAN PLC	946	946	1,543	217,485	専門サービス
MONDI PLC	370	372	783	110,309	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	237	237	551	77,656	水道
WHITBREAD PLC	173	188	748	105,510	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	250	250	332	46,804	資本市場
SMITHS GROUP PLC	371	410	664	93,565	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,364	1,364	1,330	187,477	金属・鉱業
3I GROUP PLC	970	970	869	122,501	資本市場

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(イギリス)		百株	百株	千英ポンド	千円	
PROVIDENT FINANCIAL PLC		143	143	337	47,560	消費者金融
CAPITA PLC		640	640	445	62,794	専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC		619	669	5,270	742,438	家庭用品
RELX PLC		1,058	1,097	1,875	264,253	専門サービス
SHIRE PLC		881	906	4,040	569,221	バイオテクノロジー
FRESNILLO PLC		209	209	323	45,575	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC		670	670	628	88,531	水道
GLENCORE PLC		11,970	12,200	3,433	483,703	金属・鉱業
DIXONS CARPHONE PLC		920	920	276	38,906	専門小売り
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC		1,830	1,670	1,557	219,373	航空宇宙・防衛
OLD MUTUAL PLC		4,880	4,880	958	135,014	保険
EASYJET PLC		163	163	217	30,585	旅客航空輸送業
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP		3,410	3,660	903	127,246	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)		1,050	1,050	747	105,314	ソフトウェア
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC		375	375	293	41,362	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WPP PLC		1,251	1,267	2,112	297,529	メディア
COCA-COLA HBC AG-CDI		167	193	461	65,060	飲料
CONVATEC GROUP PLC-WI		—	1,160	380	53,549	ヘルスケア機器・用品
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC		—	174	766	108,003	ホテル・レストラン・レジャー
NEX GROUP PLC		540	—	—	—	資本市場
NATIONAL GRID PLC		—	3,437	3,464	488,113	総合公益事業
ROYAL MAIL PLC		880	880	386	54,383	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI		690	690	339	47,832	ホテル・レストラン・レジャー
WOLSELEY PLC		242	255	1,253	176,591	商社・流通業
IMI PLC		259	259	316	44,585	機械
VODAFONE GROUP PLC		25,820	26,760	5,962	839,884	無線通信サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC		987	987	620	87,430	保険
COMPASS GROUP PLC		1,602	1,653	2,755	388,174	ホテル・レストラン・レジャー
STANDARD LIFE PLC		1,870	2,040	800	112,708	保険
AUTO TRADER GROUP PLC		950	950	369	52,004	インターネットソフトウェア・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP		1,360	1,360	495	69,740	保険
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC		181	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC -C		—	129,930	12	1,830	航空宇宙・防衛
WORLDPAY GROUP PLC		1,850	2,080	665	93,763	情報技術サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		136	136	541	76,211	化学
JOHNSON MATTHEY PLC		191	191	574	80,983	化学
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC C-ENTITLEMENT		84,180	—	—	—	航空宇宙・防衛
小 計	株 数 ・ 金 額	374,341	436,178	186,953	26,336,103	
	銘柄 数 < 比 率 >	106	105	—	< 7.0 % >	
(スイス)				千スイスフラン		
SYNGENTA AG-REG		91	—	—	—	化学
SIKA AG-BR		2	2	1,409	160,964	化学
SGS SA-REG		5	5	1,310	149,646	専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG		2	2	316	36,171	食品
SWISSCOM AG-REG		25	25	1,198	136,891	各種電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG-PC		1	1	608	69,544	食品
LINDT&SPRUENGLI AG-REG		0.1	0.1	708	80,963	食品
GIVAUDAN-REG		8	9	1,858	212,233	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG		147	151	4,369	499,076	保険
NOVARTIS-REG		2,171	2,239	17,878	2,041,893	医薬品
ABB LTD		1,840	2,008	4,941	564,390	電気設備
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)		683	704	17,776	2,030,257	医薬品
ADECCO GROUP AG-REG		163	164	1,220	139,354	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD		439	457	2,547	290,981	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
(スイス)		百株	百株	千スイスフラン	千円	
NESTLE SA-REG		3,027	3,118	25,817	2,948,564	食品
BALOISE HOLDING AG		50	50	748	85,429	保険
SONOVA HOLDING AG-REG		50	50	820	93,652	ヘルスケア機器・用品
STRAUMANN HOLDING AG-REG		—	9	527	60,281	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		1,940	2,320	3,132	357,705	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B		29	31	1,162	132,812	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG		46	60	434	49,612	繊維・アパレル・贅沢品
LONZA AG-REG		53	75	1,555	177,653	ライフサイエンス・ツール/サービス
SWISS LIFE HOLDING AG		31	31	1,047	119,670	保険
GALENICA AG-REG		3	—	—	—	医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		8	8	578	66,024	化学
SWISS PRIME SITE-REG		68	68	592	67,683	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES		32	32	237	27,099	各種金融サービス
DUFREY AG-REG		45	36	595	68,009	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG		16	16	1,013	115,712	資本市場
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		38	38	815	93,083	機械
SCHINDLER HOLDING AG-REG		19	19	397	45,451	機械
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		52	52	826	94,437	海運業
GEBERIT AG-REG		35	37	1,744	199,235	建設関連製品
ACTELION LTD		93	—	—	—	バイオテクノロジー
ARYZTA AG		85	—	—	—	食品
JULIUS BAER GROUP LTD		220	220	1,120	128,017	資本市場
SWISS RE LTD		316	321	2,874	328,302	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A		510	524	4,199	479,666	繊維・アパレル・贅沢品
UBS GROUP AG		3,548	3,640	5,729	654,350	資本市場
VIFOR PHARMA AG		—	48	526	60,083	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額	15,900	16,578	112,642	12,864,910	
	銘 柄 数 < 比 率 >	38	36	—	<3.4%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS		34	34	2,340	29,706	各種金融サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB		1,510	1,500	15,660	198,725	銀行
SWEDBANK AB		881	910	18,782	238,348	銀行
SWEDISH MATCH AB		189	189	5,836	74,062	タバコ
NORDEA BANK AB		2,970	3,070	33,616	426,593	銀行
SECURITAS AB-B SHS		325	333	4,948	62,794	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS		441	458	19,181	243,407	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B		917	943	18,954	240,530	専門小売り
ERICSSON LM-B		2,970	3,090	19,405	246,251	通信機器
TELIA CO AB		2,470	2,620	10,204	129,500	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS		342	341	7,184	91,176	建設・土木
LUNDIN PETROLEUM AB		171	171	2,806	35,609	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB		277	277	4,855	61,620	機械
GETINGE AB-B SHS		191	191	3,268	41,471	ヘルスケア機器・用品
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR		68	68	3,367	42,731	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB		78	78	2,470	31,347	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS		380	450	3,888	49,338	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B		233	233	6,780	86,042	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES		388	388	7,081	89,857	機械
VOLVO AB-B SHS		1,490	1,580	23,226	294,737	機械
SANDVIK AB		1,030	1,150	15,755	199,930	機械
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS		168	168	3,521	44,685	各種金融サービス
SVENSKA CELLULOZA AB-B		600	—	—	—	家庭用品
BOLIDEN AB		274	263	6,049	76,761	金属・鉱業
HEXAGON AB-B SHS		258	258	10,621	134,791	電子装置・機器・部品

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(スウェーデン)		百株	百株	千スウェーデンクローナ	千円	
TELE 2 AB-B SHS		340	340	3,078	39,068	無線通信サービス
KINNEVIK AB - B		236	236	6,185	78,494	各種金融サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B		—	600	14,676	186,238	家庭用品
ATLAS COPCO AB-A		646	681	22,983	291,663	機械
ATLAS COPCO AB-B		382	382	11,662	147,996	機械
SVENSKA HANDELSBANKEN-A		1,480	1,530	18,497	234,735	銀行
ASSA ABLOY AB-B		963	997	19,092	242,284	建設関連製品
小 計	株 数 ・ 金 額	22,702	23,529	345,981	4,390,505	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	31	—	< 1.2% >	
(ノルウェー)				千ノルウェークローネ		
DNB ASA		940	980	13,680	178,124	銀行
TELENOR ASA		749	760	10,594	137,939	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA		78	78	1,556	20,270	メディア
STATOIL ASA		1,105	1,113	15,637	203,602	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA		168	186	5,860	76,308	化学
MARINE HARVEST ASA		359	372	5,565	72,457	食品
NORSK HYDRO		1,300	1,300	5,872	76,454	金属・鉱業
ORKLA ASA		800	800	6,836	89,004	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		197	197	2,765	36,011	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS		91	91	1,674	21,800	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額	5,787	5,877	70,044	911,974	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	10	—	< 0.2% >	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG B		105	105	7,612	126,900	飲料
A P MOLLER-MAERSK A/S		6	6	8,503	141,755	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A		3	3	4,548	75,827	海運業
DANSKE BANK AS		669	738	18,560	309,406	銀行
GENMAB A/S		54	58	8,444	140,765	バイオテクノロジー
TDC A/S		768	768	2,980	49,686	各種電気通信サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		212	221	13,160	219,386	電気設備
H LUNDBECK A/S		—	75	2,811	46,859	医薬品
DSV A/S		193	190	7,727	128,814	陸運・鉄道
PANDORA A/S		110	108	6,890	114,862	繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S		100	102	5,016	83,622	化学
NOVOZYMES A/S-B SHARES		225	225	6,621	110,384	化学
COLOPLAST-B		117	117	6,850	114,195	ヘルスケア機器・用品
NOVO NORDISK A/S-B		1,855	1,820	52,852	881,056	医薬品
ISS A/S		161	161	4,375	72,947	商業サービス・用品
TRYG A/S		118	118	1,681	28,030	保険
DONG ENERGY A/S		76	141	4,332	72,229	電力
WILLIAM DEMANT HOLDING		130	130	2,280	38,010	ヘルスケア機器・用品
小 計	株 数 ・ 金 額	4,903	5,088	165,251	2,754,743	
	銘 柄 数 < 比 率 >	17	18	—	< 0.7% >	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		184	189	3,232	400,892	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA		396	417	3,266	405,094	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		129	129	637	79,096	インターネットソフトウェア・サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD		64	64	325	40,321	化学
HANNOVER RUECK SE		62	62	663	82,274	保険
GEA GROUP AG		186	186	692	85,834	機械
CONTINENTAL AG		108	109	2,158	267,744	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG		947	997	3,240	401,917	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE		44	44	239	29,718	メディア
MERCK KGAA		125	131	1,427	177,088	医薬品

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
RWE AG	496	496	976	121,120	総合公益事業
SAP SE	954	987	9,396	1,165,321	ソフトウェア
E.ON SE	1,990	2,240	2,026	251,385	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	99	106	1,191	147,762	家庭用品
METRO AG	182	182	524	65,074	食品・生活必需品小売り
BAYER AG-REG	803	830	10,109	1,253,767	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	173	179	2,291	284,154	家庭用品
BASF SE	892	923	7,927	983,186	化学
BEIERSDORF AG	100	100	964	119,580	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	20	20	339	42,154	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	143	152	1,319	163,683	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE	208	216	1,885	233,835	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG	443	459	8,034	996,475	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	226	226	418	51,866	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	155	159	2,837	351,960	保険
VOLKSWAGEN AG	32	32	441	54,776	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF	181	184	2,433	301,790	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	934	957	6,263	776,807	自動車
MAN SE	37	37	351	43,652	機械
THYSSENKRUPP AG	363	363	878	108,924	金属・鉱業
SIEMENS AG	743	768	9,557	1,185,353	コングロマリット
QIAGEN NV	223	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
LINDE AG	181	186	3,284	407,301	化学
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,330	2,079	3,159	391,784	資本市場
BAYER MOTOREN WERK	323	328	2,742	340,072	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	53	53	389	48,292	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG	3,174	3,258	5,466	678,007	各種電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,089	1,125	2,212	274,370	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG	—	189	1,812	224,810	資本市場
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	152	152	760	94,274	自動車
FRAPORT AG	38	38	297	36,853	運送インフラ
LANXESS	85	89	594	73,743	化学
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	329	361	1,241	154,012	不動産管理・開発
SYMRISE AG	121	121	791	98,187	化学
BRENTAG AG	151	151	787	97,697	商社・流通業
K+S AG	188	188	438	54,325	化学
EVONIK INDUSTRIES AG	169	169	492	61,023	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	746	746	324	40,254	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG	63	63	414	51,364	繊維・アパレル・贅沢品
COMMERZBANK AG	1,020	1,020	954	118,379	銀行
OSRAM LICHT AG	88	88	646	80,177	電気設備
VONOVIA SE	446	465	1,650	204,726	不動産管理・開発
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	223	223	829	102,882	メディア
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER	189	—	—	—	資本市場
INNogy SE	145	146	534	66,298	総合公益事業
ZALANDO SE	81	117	498	61,806	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG	68	116	771	95,625	化学
QIAGEN NV	—	214	663	82,266	ライフサイエンス・ツール/サービス
SCHAEFFLER AG	160	160	240	29,764	自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額	22,258	23,792	118,052	14,640,921
	銘 柄 数 < 比 率 >	57	57	—	< 3.9% >
(ユーロ…イタリア)					
ASSICURAZIONI GENERALI	1,120	1,260	1,850	229,553	保険
INTESA SANPAOLO	12,370	12,660	3,286	407,596	銀行

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…イタリア)		百株	百株	千ユーロ	千円	
INTESA SANPAOLO-RSP		920	920	222	27,543	銀行
MEDIOBANCA S. P. A.		530	530	449	55,706	銀行
SAIPEM SPA		5,897	—	—	—	エネルギー設備・サービス
LUXOTTICA GROUP SPA		165	165	891	110,501	繊維・アパレル・贅沢品
ENEL SPA		7,440	8,100	4,033	500,271	電力
ENI SPA		2,480	2,540	3,479	431,564	石油・ガス・消耗燃料
SNAM SPA		2,330	2,330	966	119,805	石油・ガス・消耗燃料
TENARIS SA		460	460	616	76,445	エネルギー設備・サービス
TELECOM ITALIA SPA		9,900	11,300	940	116,598	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC		5,700	5,700	378	46,939	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA		416	466	1,192	147,950	運送インフラ
TERNA SPA		1,520	1,520	769	95,480	電力
RECORDATI SPA		—	112	417	51,824	医薬品
LEONARDO SPA		410	410	637	79,119	航空宇宙・防衛
PRYSMIAN SPA		194	194	505	62,724	電気設備
UNICREDIT SPA		5,031	—	—	—	銀行
UNIPOLSAI SPA		1,070	1,070	212	26,381	保険
FERRARI NV		116	125	998	123,787	自動車
CNH INDUSTRIAL NV		990	1,050	1,086	134,778	機械
SAIPEM SPA		—	589	191	23,695	エネルギー設備・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		890	1,090	1,044	129,571	自動車
UNICREDIT SPA		—	1,997	3,229	400,479	銀行
EXOR NV		112	104	528	65,522	各種金融サービス
POSTE ITALIANE SPA		500	500	304	37,702	保険
小 計	株 数 ・ 金 額	60,561	55,192	28,233	3,501,545	
	銘 柄 数 < 比 率 >	23	24	—	<0.9%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES		201	221	871	108,071	建設・土木
AIRBUS SE		566	578	4,349	539,418	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT		461	461	879	109,057	総合公益事業
LOREAL-ORD		246	250	4,767	591,215	パーソナル用品
CHRISTIAN DIOR SE		53	53	1,380	171,177	繊維・アパレル・贅沢品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		273	277	6,430	797,521	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT AVIATION SA		2	2	357	44,284	航空宇宙・防衛
THALES SA		105	105	1,040	129,022	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA		158	158	1,459	181,039	情報技術サービス
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA		59	59	304	37,720	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP		55	55	444	55,155	電子装置・機器・部品
PUBLICIS GROUPE		191	207	1,400	173,723	メディア
LAGARDERE S. C. A		116	116	327	40,605	メディア
BOLLORE		870	870	356	44,227	航空貨物・物流サービス
MICHELIN (CGDE)		175	172	2,058	255,337	自動車部品
PERNOD RICARD SA		207	213	2,624	325,448	飲料
RENAULT SA		186	186	1,490	184,887	自動車
REMY COINTREAU		23	23	240	29,779	飲料
SEB SA		20	24	390	48,479	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE		544	568	3,918	485,918	電気設備
VIVENDI SA		1,000	1,040	2,139	265,313	メディア
TECHNIP SA		104	—	—	—	エネルギー設備・サービス
ORANGE SA		1,950	1,990	2,887	358,106	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL		26	21	956	118,685	繊維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA		28	28	303	37,585	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA		128	128	1,071	132,901	ソフトウェア
KERING SA		75	74	2,294	284,552	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	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
CNP ASSURANCES		165	165	327	40,558	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE		563	552	1,206	149,651	食品・生活必需品小売り
ATOS SE		86	96	1,236	153,288	情報技術サービス
SANOFI		1,127	1,161	10,049	1,246,353	医薬品
ACCOR SA		173	191	792	98,304	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV		600	650	894	110,883	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE		742	774	3,596	446,072	銀行
EURAZEO SE		40	42	282	34,978	各種金融サービス
SODEXO		89	89	1,055	130,852	ホテル・レストラン・レジャー
AXA		1,898	1,932	4,645	576,134	保険
PEUGEOT CITROEN		473	473	859	106,587	自動車
JC DECAUX SA		68	68	200	24,920	メディア
ESSILOR INTERNATIONAL		204	210	2,490	308,884	ヘルスケア機器・用品
CREDIT AGRICOLE SA		1,080	1,130	1,573	195,148	銀行
ZODIAC AEROSPACE		195	195	466	57,811	航空宇宙・防衛
BNP PARIBAS		1,032	1,128	7,009	869,304	銀行
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)		481	496	2,398	297,512	建設関連製品
WENDEL		29	29	393	48,751	各種金融サービス
ILIAD SA		27	27	588	72,949	各種電気通信サービス
SES FDR		344	376	839	104,081	メディア
IMERYS		38	38	295	36,627	建設資材
SAFRAN SA		304	313	2,550	316,291	航空宇宙・防衛
ENGIE		1,452	1,710	2,363	293,086	総合公益事業
ALSTOM		155	155	490	60,793	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS		163	163	392	48,617	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE		228	570	571	70,903	電力
IPSEN		—	40	498	61,861	医薬品
ARKEMA		67	67	640	79,487	化学
LEGRAND SA		264	264	1,642	203,650	電気設備
EIFFAGE SA		61	77	655	81,247	建設・土木
TOTAL SA		2,189	2,339	10,385	1,287,967	石油・ガス・消耗燃料
ADP		28	28	405	50,282	運送インフラ
NATIXIS		870	980	574	71,295	銀行
SCOR SE		154	180	646	80,152	保険
REXEL SA		286	286	411	51,040	商社・流通業
VINCI		489	501	3,982	493,965	建設・土木
DANONE		577	589	4,023	498,989	食品
AIR LIQUIDE		376	392	4,413	547,414	化学
BUREAU VERITAS SA		255	255	526	65,321	専門サービス
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR		450	450	438	54,391	運送インフラ
SUEZ		333	385	633	78,568	総合公益事業
EDENRED		214	214	499	61,905	商業サービス・用品
VALEO SA		228	239	1,474	182,913	自動車部品
SFR GROUP SA		77	—	—	—	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	26,499 70	27,903 69	124,165 —	15,399,041 <4.1%>	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		219	219	801	99,406	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	219 1	219 1	801 —	99,406 <0.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
RELX NV		954	978	1,836	227,724	専門サービス
RANDSTAD HOLDING NV		116	116	615	76,376	専門サービス
AKZO NOBEL		237	248	1,945	241,257	化学

銘柄		株数	期首(前期末)	当期		業種等
			株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…オランダ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
WOLTERS KLUWER		299	299	1,177	146,065	専門サービス
VOPAK		71	71	304	37,713	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV		1,800	1,700	754	93,568	保険
KONINKLIJKE KPN NV		3,430	3,410	1,019	126,491	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV		916	935	3,100	384,577	コングロマリット
HEINEKEN NV		223	232	2,038	252,853	飲料
ARCELORMITTAL		1,780	—	—	—	金属・鉱業
HEINEKEN HOLDING NV		97	97	808	100,233	飲料
KONINKLIJKE DSM NV		182	180	1,209	149,947	化学
UNILEVER NV-CVA		1,580	1,636	8,196	1,016,512	パーソナル用品
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA		93	96	282	35,058	建設・土木
ASML HOLDING NV		360	374	4,368	541,759	半導体・半導体製造装置
GEMALTO		76	85	465	57,736	ソフトウェア
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		1,249	1,270	2,101	260,671	食品・生活必需品小売り
NN GROUP NV		300	311	996	123,636	保険
ARCELORMITTAL		—	672	1,223	151,723	金属・鉱業
ABN AMRO GROUP NV-CVA		279	279	644	79,946	銀行
ALTICE NV - B		100	100	225	27,913	メディア
ALTICE NV - A		368	401	903	111,996	メディア
ING GROEP NV		3,780	3,901	5,876	728,847	銀行
小計	株数・金額	18,290	17,391	40,095	4,972,614	
	銘柄数<比率>	22	22	—	<1.3%>	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA		630	708	1,164	144,441	運送インフラ
ENDESA S. A.		317	317	715	88,752	電力
BANKINTER S. A.		650	650	527	65,385	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S. A.		6,433	6,708	4,923	610,630	銀行
GAS NATURAL SDG		328	358	780	96,856	ガス
REPSOL SA		1,059	1,183	1,622	201,220	石油・ガス・消耗燃料
REPSOL SA-RTS		1,059	1,182	48	5,955	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA		14,173	14,640	8,564	1,062,156	銀行
TELEFONICA SA		4,644	4,520	4,307	534,223	各種電気通信サービス
ZARDOYA OTIS S. A		175	—	—	—	機械
ENAGAS		228	228	604	75,003	石油・ガス・消耗燃料
GAMESA CORP TECNOLOGICA SA		—	236	448	55,654	電気設備
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV		190	240	865	107,287	建設・土木
FERROVIAL SA		464	472	949	117,786	建設・土木
MAPFRE SA		980	980	305	37,908	保険
BANCO DE SABADELL SA		4,995	5,300	931	115,554	銀行
CAIXABANK		3,358	3,590	1,484	184,103	銀行
IBERDROLA SA		5,284	5,860	4,219	523,265	電力
AMADEUS IT GROUP SA		426	440	2,362	293,034	情報技術サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP		800	630	432	53,653	旅客航空輸送業
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		560	660	361	44,781	食品・生活必需品小売り
BANKIA SA		4,300	—	—	—	銀行
BCO POPULAR ESPANOL		3,002	—	—	—	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA		432	432	878	108,974	電力
INDITEX SA		1,066	1,094	3,831	475,143	専門小売り
AENA SA		65	65	1,158	143,732	運送インフラ
GRIFOLS SA		288	288	756	93,794	バイオテクノロジー
BANKIA SA		—	1,075	435	54,061	銀行
小計	株数・金額	55,913	51,858	42,681	5,293,363	
	銘柄数<比率>	26	25	—	<1.4%>	

銘柄		株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
			株数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)		百株	百株	千ユーロ	千円	
UMICORE		94	94	598	74,167	化学
KBC GROEP NV		240	254	1,653	205,103	銀行
SOLVAY SA		73	73	883	109,546	化学
UCB SA		121	121	755	93,655	医薬品
COLRUYT SA		70	73	324	40,224	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAM		78	78	669	82,979	各種金融サービス
PROXIMUS		151	151	468	58,044	各種電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		52	52	292	36,243	メディア
AGEAS		190	190	679	84,311	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		740	765	7,825	970,574	飲料
小計	株数・金額	1,809	1,851	14,149	1,754,850	
	銘柄数<比率>	10	10	—	<0.5%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG		138	150	708	87,834	石油・ガス・消耗燃料
VOESTALPINE AG		110	110	429	53,204	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		307	307	988	122,560	銀行
IMMOEAST AG-RIGHTS		500	—	—	—	不動産管理・開発
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		110	162	357	44,331	銀行
ANDRITZ AG		72	72	392	48,727	機械
小計	株数・金額	1,237	801	2,875	356,658	
	銘柄数<比率>	6	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…ルクセンブルグ)						
EUROFINS SCIENTIFIC SE		10	10	515	63,940	ライフサイエンス・ツール/サービス
RTL GROUP		39	39	261	32,411	メディア
小計	株数・金額	49	49	776	96,351	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA OYJ		147	147	804	99,814	機械
UPM-KYMMENE OYJ		531	529	1,354	167,952	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R		540	540	643	79,762	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS		430	444	2,037	252,747	保険
FORTUM OYJ		440	440	629	78,087	電力
ELISA OYJ		149	145	503	62,418	各種電気通信サービス
METSO OYJ		103	122	378	46,949	機械
NOKIA OYJ		5,680	5,830	3,349	415,384	通信機器
NESTE OYJ		125	125	444	55,080	石油・ガス・消耗燃料
NOKIAN RENKAAT OYJ		113	113	414	51,432	自動車部品
KONE OYJ		323	341	1,589	197,117	機械
ORION OYJ		95	108	613	76,078	医薬品
小計	株数・金額	8,676	8,884	12,762	1,582,827	
	銘柄数<比率>	12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
BANK OF IRELAND		28,500	28,500	655	81,295	銀行
CRH PLC		823	861	2,815	349,121	建設資材
KERRY GROUP PLC-A		166	168	1,314	162,995	食品
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD		1,398	1,398	—	—	銀行
PADDY POWER PLC		84	87	863	107,088	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額	30,971	31,014	5,648	700,499	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL		2,350	2,350	712	88,308	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		480	500	659	81,760	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…ポルトガル)		百株	百株	千ユーロ	千円	
JERONIMO MARTINS		230	267	474	58,825	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	3,060	3,117	1,845	228,894	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	229,544	222,073	392,089	48,626,975	
	銘柄 数 < 比 率 >	237	235	—	<12.8%>	
(香港)				千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		219	290	3,291	46,903	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		2,130	2,130	4,132	58,883	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA		1,208	1,208	4,024	57,351	銀行
CLP HLDGS		1,590	1,660	13,944	198,702	電力
CATHAY PACIFIC AIRWAYS		1,070	—	—	—	旅客航空輸送業
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		650	650	4,286	61,086	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD		1,129	1,152	23,063	328,648	資本市場
LI & FUNG LTD		5,636	5,636	1,600	22,808	繊維・アパレル・贅沢品
MTR CORP		1,485	1,480	6,475	92,268	陸運・鉄道
FIRST PACIFIC CO		2,260	2,260	1,299	18,517	各種金融サービス
HANG LUNG GROUP LTD		810	810	2,563	36,532	不動産管理・開発
HANG SENG BANK		762	756	12,179	173,553	銀行
HENDERSON LAND		1,078	1,185	5,289	75,375	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,320	1,390	9,750	138,949	電力
WHARF(HOLDING)		1,330	1,250	8,225	117,206	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS		7,588	8,302	12,205	173,924	ガス
HYSAN DEVELOPMENT		650	650	2,444	34,827	不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		2,230	2,360	11,351	161,760	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES		570	570	1,504	21,443	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		3,635	3,635	12,558	178,964	銀行
NWS HOLDINGS LTD		1,595	1,595	2,433	34,684	コングロマリット
PCCW LTD		3,860	3,860	1,706	24,312	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		750	750	2,347	33,451	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT		5,696	6,096	6,242	88,962	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD		1,083	1,083	1,449	20,655	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO.LTD		3,140	3,140	4,094	58,347	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,390	1,440	16,790	239,263	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A		535	535	4,060	57,864	不動産管理・開発
WHEELOCK & COMPANY LTD		750	840	4,960	70,682	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		1,400	1,400	5,047	71,919	家庭用耐久財
SJM HOLDINGS LIMITED		1,660	1,660	1,402	19,988	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD		1,684	1,484	2,775	39,544	ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD		940	940	1,663	23,709	ホテル・レストラン・レジャー
ATA GROUP LTD		11,690	12,110	68,542	976,732	保険
HKT TRUST AND HKT LTD		2,596	3,796	3,879	55,283	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD		2,336	2,336	8,573	122,166	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD		1,168	1,168	2,966	42,275	不動産管理・開発
WH GROUP LIMITED		8,100	8,100	5,994	85,414	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		2,635	2,710	26,697	380,438	コングロマリット
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING		2,610	2,710	16,736	238,498	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額	92,970	95,131	328,554	4,681,902	
	銘柄 数 < 比 率 >	40	39	—	<1.2%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		1,610	1,610	592	47,439	航空宇宙・防衛
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		6,203	6,203	229	18,377	食品
DBS GROUP HLDGS		1,730	1,770	3,610	289,116	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD		410	410	436	34,962	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD		100	100	447	35,815	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
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
SATS LTD		590	770	395	31,690	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD		770	770	569	45,623	資本市場
CAPITALAND LIMITED		2,460	2,460	868	69,531	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE PLC		6,146	6,146	703	56,346	ホテル・レストラン・レジャー
COMFORTDELGRO CORP LTD		2,070	2,070	498	39,944	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD		550	520	518	41,501	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK		1,250	1,300	2,969	237,743	銀行
UOL GROUP LIMITED		487	487	374	29,947	不動産管理・開発
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		1,480	1,480	476	38,158	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED		7,750	8,210	3,078	246,515	各種電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES		990	990	301	24,107	コンピュータリット
OCBC-ORD		3,030	3,160	3,308	264,913	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,840	1,840	642	51,417	食品
STARHUB LTD		690	690	186	14,972	無線通信サービス
KEPPEL CORP.		1,427	1,427	883	70,726	コンピュータリット
YANGZIJANG SHIPBUILDING		1,630	2,700	322	25,834	機械
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L		2,660	2,660	795	63,682	不動産管理・開発
小 計		株 数 ・ 金 額	45,874	47,774	22,210	1,778,370
銘 柄 数 < 比 率 >			22	22	—	<0.5%>
(オーストラリア)				千豪ドル		
RAMSAY HEALTH CARE LTD		141	141	1,016	85,395	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK		2,840	2,954	8,123	682,374	銀行
AMCOR		1,120	1,180	1,949	163,746	容器・包装
WESTPAC BANKING CORP		3,249	3,357	9,993	839,478	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD		351	351	379	31,915	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,480	1,480	668	56,192	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD		4,140	4,140	1,792	150,580	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD		443	443	466	39,184	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD		600	600	539	45,309	飲料
ASX LTD		196	196	1,014	85,201	資本市場
BHP BILLITON LIMITED		3,115	3,198	7,067	593,676	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		255	255	788	66,273	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		530	530	197	16,605	複合小売り
COMPUTERSHARE LTD		470	470	660	55,469	情報技術サービス
CSL LIMITED		446	455	6,347	533,169	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD		54	54	354	29,801	メディア
TRANSURBAN GROUP		1,980	2,060	2,595	218,030	運送インフラ
COCHLEAR LTD		58	58	924	77,679	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD		1,750	1,750	1,184	99,519	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		1,666	1,730	13,978	1,174,185	銀行
BORAL LTD		1,150	1,150	790	66,364	建設資材
RIO TINTO LTD		408	423	2,453	206,085	金属・鉱業
APA GROUP		1,110	1,110	1,064	89,417	ガス
ARISTOCRAT LEISURE LTD		520	562	1,303	109,522	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		2,450	2,430	1,543	129,616	保険
TPG TELECOM LTD		330	359	199	16,766	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		52	52	195	16,401	ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD		366	366	724	60,873	化学
BLUESCOPE STEEL LTD		—	600	728	61,185	金属・鉱業
SUNCORP GROUP LTD		1,260	1,320	1,888	158,669	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK		2,602	2,679	7,785	653,954	銀行
NEWCREST MINING		750	750	1,554	130,599	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD		1,290	1,430	923	77,597	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD		1,610	1,610	531	44,629	化学

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円	
AMP LIMITED	2,810	2,980	1,504	126,411	各種金融サービス
QANTAS AIRWAYS LIMITED	441	441	242	20,389	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE	1,320	1,400	1,661	139,591	保険
CHALLENGER LIMITED	560	560	730	61,340	各種金融サービス
SANTOS LTD.	1,480	1,760	513	43,169	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE LTD	405	380	908	76,320	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TABCORP HOLDINGS	780	780	358	30,073	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LIMITED	1,100	1,130	4,544	381,768	食品・生活必需品小売り
ALUMINA LTD	2,330	2,330	434	36,501	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM	735	764	2,237	187,971	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS LIMITED	1,266	1,277	3,205	269,242	食品・生活必需品小売り
DUET GROUP	2,290	—	—	—	総合公益事業
SEEK LTD	328	328	551	46,287	専門サービス
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	59	59	322	27,049	ホテル・レストラン・レジャー
TATTS GROUP LTD	1,470	1,470	630	52,972	ホテル・レストラン・レジャー
BRAMBLES LTD	1,530	1,620	1,642	137,985	商業サービス・用品
MACQUARIE GROUP LIMITED	295	325	2,899	243,597	資本市場
CROWN RESORTS LTD	360	430	546	45,872	ホテル・レストラン・レジャー
VOCUS GROUP LTD	540	—	—	—	各種電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	440	440	880	73,920	建設資材
TREASURY WINE ESTATES LTD	720	720	961	80,740	飲料
SYDNEY AIRPORT	1,079	1,079	801	67,342	運送インフラ
AURIZON HOLDINGS LTD	2,090	2,090	1,139	95,680	陸運・鉄道
HEALTHSCOPE LTD	1,760	1,760	383	32,229	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	280	23,539	電力
MEDIBANK PRIVATE LTD	2,610	2,610	715	60,071	保険
AGL ENERGY LTD	657	657	1,716	144,151	総合公益事業
SOUTH32 LTD	5,070	5,370	1,347	113,221	金属・鉱業
CIMIC GROUP LTD	89	89	343	28,890	建設・土木
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	75,030 62	74,727 61	113,235 — <2.5%>	9,511,801
(ニュージーランド)			千ニュージーランドドル		
CONTACT ENERGY LTD	760	760	392	31,665	電力
RYMAN HEALTHCARE LTD	350	450	373	30,136	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
FLETCHER BUILDING LTD	690	690	534	43,095	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD	1,680	1,890	706	56,965	各種電気通信サービス
MERCURY NZ LTD	600	600	199	16,053	電力
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	971	911	636	51,324	運送インフラ
MERIDIAN ENERGY LTD	1,200	1,200	358	28,867	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,251 7	6,501 7	3,202 — <0.1%>	258,108
(イスラエル)			千新シェケル		
BANK HAPOLIM BM	1,050	1,020	2,477	77,771	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL	1,420	1,420	2,425	76,132	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	2,040	2,040	1,255	39,413	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD	23	23	1,022	32,091	航空宇宙・防衛
FRUTAROM	38	38	899	28,234	化学
ISRAEL CHEMICALS LIMITED	500	500	794	24,939	化学
NICE LTD	59	59	1,653	51,911	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	130	130	833	26,169	銀行

銘柄		株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
			株数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)		百株	百株	千新シェケル	千円	
AZRIELI GROUP		41	41	803	25,225	不動産管理・開発
小 計	株数・金額	5,301	5,271	12,165	381,888	
	銘柄数<比率>	9	9	—	<0.1%>	
合 計	株数・金額	1,220,978	1,288,484	—	364,266,635	
	銘柄数<比率>	1,272	1,271	—	<96.2%>	

* 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。

* 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORP	32,900	36,800	807	89,774	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,600	8,800	1,047	116,434	0.0
AMERICAN TOWER CORP	41,600	42,400	5,537	615,478	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	95,000	102,000	1,263	140,456	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,230	13,620	2,649	294,510	0.1
BOSTON PROPERTIES	14,900	15,700	1,964	218,321	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	30,000	30,000	527	58,615	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	8,200	9,100	797	88,657	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	51,000	730	81,224	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	32,900	36,000	3,582	398,103	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	15,300	16,000	1,905	211,752	0.1
DUKE REALTY CORP	34,000	34,000	969	107,694	0.0
EQUINIX INC	7,010	7,660	3,343	371,598	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	36,100	36,300	2,468	274,378	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,540	6,550	1,745	193,995	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC	12,700	12,700	991	110,222	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	6,910	6,910	852	94,714	0.0
GGP INC	—	63,200	1,492	165,837	0.0
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	56,500	—	—	—	—
HCP INC	44,700	47,400	1,566	174,108	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	73,900	74,100	1,378	153,179	0.0
IRON MOUNTAIN INC	24,400	24,400	830	92,337	0.0
KIMCO REALTY CORP	40,000	40,000	700	77,886	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	14,300	14,300	596	66,242	0.0
MACERICH CO /THE	12,300	12,300	699	77,687	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,200	11,200	1,234	137,160	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	14,500	14,500	553	61,479	0.0
PROLOGIS INC	51,400	52,900	3,070	341,293	0.1
PUBLIC STORAGE	14,380	15,420	3,273	363,835	0.1
REALTY INCOME CORP	24,700	26,200	1,452	161,375	0.0
REGENCY CENTERS CORP	10,300	15,100	905	100,642	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	12,000	1,572	174,818	0.0
SL GREEN REALTY CORP	9,800	9,800	1,043	116,018	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	30,470	32,100	5,096	566,462	0.1
UDR INC	25,300	27,500	1,102	122,559	0.0
VENTAS INC	34,600	34,800	2,461	273,599	0.1
VEREIT INC	95,000	95,000	763	84,888	0.0
VORNADO REALTY TRUST	16,500	17,400	1,612	179,208	0.0
WELLTOWER INC	35,300	36,600	2,823	313,824	0.1
WEYERHAEUSER CO	72,200	75,000	2,532	281,406	0.1
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	509,000	218	24,325	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,615,640	1,725,760	68,167	7,576,114
	銘 柄 数 < 比 率 >	38	40	—	<2.0%>
(カナダ)			千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	13,600	304	25,388	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,900	16,900	418	34,905	0.0

銘柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)		口	口	千カナダドル	千円	%
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		6,900	6,900	224	18,730	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	37,400	37,400	946	79,024	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.0%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		92,000	102,000	632	89,158	0.0
HAMMERSON PLC		74,000	74,000	432	60,878	0.0
INTU PROPERTIES PLC		88,000	88,000	234	33,012	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		77,500	77,500	802	112,995	0.0
SEGRO PLC		86,000	103,000	512	72,170	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	417,500	444,500	2,613	368,214	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)				千ユーロ		
ICADE		3,700	3,700	275	34,126	0.0
KLEPIERRE		22,400	22,300	828	102,716	0.0
GECINA SA		4,000	4,000	548	67,962	0.0
FONCIERE DES REGIONS		3,100	3,100	257	31,994	0.0
UNIBAIL RODAMCO-NA		9,570	9,960	2,308	286,328	0.1
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	42,770	43,060	4,218	523,128	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		215,000	225,000	13,815	196,863	0.1
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		260,000	260,000	1,853	26,416	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	475,000	485,000	15,668	223,280	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		249,900	249,900	486	38,918	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		239,000	239,000	635	50,903	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		192,000	192,000	314	25,212	0.0
SUNTEC REIT		243,000	243,000	447	35,800	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	923,900	923,900	1,883	150,835	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.0%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		381,000	381,000	868	72,969	0.0
GPT GROUP		179,000	179,000	921	77,435	0.0
LENLEASE GROUP		53,000	53,000	867	72,834	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP		227,000	244,000	1,163	97,765	0.0
DEXUS		91,000	100,000	1,056	88,704	0.0
GOODMAN GROUP		174,000	184,000	1,536	129,057	0.0
SCENTRE GROUP		527,000	540,000	2,262	190,058	0.1
WESTFIELD CORP		191,000	203,000	1,719	144,430	0.0
VICINITY CENTRES		328,704	328,704	920	77,311	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	2,151,704	2,212,704	11,316	950,566	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.3%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	5,663,914	5,872,324	—	9,871,164	
	銘 柄 数 < 比 率 >	66	68	—	<2.6%>	

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

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

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期		期末
			買建額	売建額	額
外国	株式先物取引		百万円		百万円
		CAN60	162		—
		EUR050	576		—
		FT100	312		—
		SPI200	129		—
		SPEMINI	2,893		—
		SWISSMKT	153		—

* 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(19,347,089千口)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
(カタル)		百株	百株	千カタルリヤル	千円	
QATAR INSURANCE CO		46	53	350	10,623	保険
QATAR NATIONAL BANK		78	102	1,268	38,453	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR		56	89	262	7,959	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR-RIGHTS		10	—	—	—	銀行
OOREDOO QSC		33	33	294	8,931	各種電気通信サービス
DOHA BANK LTD		42	67	198	6,019	銀行
QATAR ELECTRICITY & WATER CO		10	10	199	6,041	総合公益事業
INDUSTRIES QATAR		58	66	609	18,493	コングロマリット
QATAR ISLAMIC BANK		21	27	245	7,438	銀行
QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT		96	96	162	4,920	石油・ガス・消耗燃料
MASRAF AL RAYAN		133	152	585	17,755	銀行
BARWA REAL ESTATE CO		32	32	101	3,065	不動産管理・開発
EZDAN HOLDING GROUP		301	351	430	13,048	不動産管理・開発
小 計		株 数 ・ 金 額	922	1,084	4,708	142,752
銘 柄 数 < 比 率 >		13	12	—	<0.6%>	
(アメリカ)				千米ドル		
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR		423	480	6,883	765,049	インターネットソフトウェア・サービス
AUTOHOME INC-ADR		—	21	94	10,512	インターネットソフトウェア・サービス
BAIDU INC - SPON ADR		102	115	2,079	231,078	インターネットソフトウェア・サービス
BANCO DE CHILE-ADR		16	16	123	13,779	銀行
BANCO SANTANDER CHILE-ADR		58	68	173	19,229	銀行
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR		42	48	205	22,859	銀行
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR		25	32	84	9,421	飲料
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR		66	86	98	10,963	金属・鉱業
CTRIIP.COM INTERNATIONAL -ADR		141	161	886	98,503	インターネット販売・通信販売
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR		88	99	86	9,572	石油・ガス・消耗燃料
ENEL GENERACION CHILE-SP ADR		44	44	100	11,198	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ENEL AMERICAS S.A-ADR		217	247	229	25,462	電力
ENEL CHILE SA-ADR		135	167	93	10,372	電力
58.COM INC-ADR		30	37	156	17,386	インターネットソフトウェア・サービス
ITAU CORPBANCA-ADR		39	39	53	5,941	銀行
JD.COM INC-ADR		255	276	1,134	126,042	インターネット販売・通信販売
STATE BANK OF INDIA-GDR		56	77	346	38,510	銀行
PJSC GAZPROM-ADR		2,228	2,268	884	98,305	石油・ガス・消耗燃料
LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR		109	129	141	15,727	旅客航空輸送業
TRANSNEFT PJSC		0.58	0.17	44	4,995	石油・ガス・消耗燃料
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR		202	202	174	19,422	無線通信サービス
MOMO INC-SPON ADR		—	36	139	15,484	インターネットソフトウェア・サービス
NETEASE INC-ADR		30	34	1,100	122,329	インターネットソフトウェア・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR		50	56	407	45,334	各種消費者サービス
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B		275	408	63	7,098	不動産管理・開発
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR		13	—	—	—	インターネット販売・通信販売
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR		35	42	136	15,179	化学
SOUTHERN COPPER CORP		33	33	113	12,632	金属・鉱業
TAL EDUCATION GROUP-ADR		17	20	238	26,451	各種消費者サービス
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS		152	175	205	22,814	インターネット販売・通信販売
WEIBO CORP-SPON ADR		12	14	111	12,402	インターネットソフトウェア・サービス
YY INC-ADR		10	15	88	9,832	インターネットソフトウェア・サービス

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
YUM CHINA HOLDINGS INC		151	164	665	73,965	ホテル・レストラン・レジャー
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR		530	606	257	28,624	石油・ガス・消耗燃料
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR		56	73	30	3,416	無線通信サービス
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S		33	38	396	44,091	石油・ガス・消耗燃料
NOVOLIPET STEEL - GDR REG S		—	50	88	9,863	金属・鉱業
ROSTELECOM-SPONSORED ADR		56	56	39	4,404	各種電気通信サービス
ROSNEFT OJSC - GDR		415	476	251	27,926	石油・ガス・消耗燃料
PJSC ALROSA		1,002	1,176	159	17,689	金属・鉱業
SEVERSTAL-GDR REG S		81	76	90	10,112	金属・鉱業
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI		924	1,048	216	24,072	銀行
DP WORLD LTD		67	67	141	15,748	運送インフラ
PJSC RUSHYDRO		38,910	46,910	58	6,490	電力
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS		118	135	462	51,411	食品・生活必需品小売り
INTER RAO UES PJSC		11,000	13,580	84	9,390	電力
PJSC SBERBANK OF RUSSIA		4,050	4,510	1,072	119,232	銀行
PJSC PHOSAGRO-GDR REG S		37	37	50	5,592	化学
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC		516	675	116	12,943	資本市場
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR		214	233	322	35,886	金属・鉱業
TATNEFT-SPONSORED ADR		88	109	409	45,554	石油・ガス・消耗燃料
LUKOIL PJSC-SPON ADR		160	183	837	93,088	石油・ガス・消耗燃料
CREDICORP LTD		25	28	512	56,935	銀行
SINA CORP		21	25	229	25,542	インターネットソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	63,369	75,710	23,176	2,575,879	
	銘 柄 数 < 比 率 >	51	53	—	<11.5%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T. A. S		856	976	974	30,691	銀行
ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYII		78	78	172	5,417	飲料
ARCELIK A. S		84	107	277	8,741	家庭用耐久財
ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI		—	80	175	5,537	航空宇宙・防衛
EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK		560	560	365	11,523	金属・鉱業
FORD OTOMOTIVE SANAYI AS		23	23	100	3,176	自動車
KOC HLDGS		235	347	576	18,140	コングロマリット
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS		205	286	171	5,412	化学
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS		273	273	127	3,999	コングロマリット
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA		43	43	129	4,081	自動車
TURK HAVA YOLLARI AO		183	183	136	4,296	旅客航空輸送業
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		355	355	406	12,811	無線通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI		898	996	971	30,583	銀行
TURKIYE IS BANKASI AS-C		651	651	470	14,803	銀行
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		48	58	574	18,101	石油・ガス・消耗燃料
ULKER BISKUVI SANAYI AS		60	60	129	4,077	食品
YAPI VE KREDI BANKASI A. S.		331	331	148	4,669	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING		334	398	437	13,773	各種金融サービス
COCA-COLA ICECEK AS		28	28	113	3,573	飲料
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		81	93	600	18,896	食品・生活必需品小売り
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D		240	317	207	6,522	銀行
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS		67	67	128	4,033	運送インフラ
TURKIYE HALK BANKASI		222	270	350	11,038	銀行
TURK TELEKOMUNIKASYON AS		155	222	138	4,376	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	6,019	6,810	7,884	248,281	
	銘 柄 数 < 比 率 >	23	24	—	<1.1%>	
(ユーロ…ギリシャ)				千ユーロ		
HELLENIC TELECOM		92	108	112	14,007	各種電気通信サービス
OPAP SA		75	91	91	11,337	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
(ユーロ…ギリシャ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
JUMBO SA		40	40	63	7,891	専門小売り
TITAN CEMENT CO		15	20	50	6,275	建設資材
FF GROUP		13	13	27	3,464	専門小売り
PIRAEUS BANK S.A.		2,616	2,616	58	7,235	銀行
EUROBANK ERGASIAS SA		676	856	84	10,530	銀行
ALPHA BANK A.E.		554	554	120	14,911	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		1,999	2,479	84	10,456	銀行
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	6,084	6,780	694	86,111	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	9	—	<0.4%>	
(チェコ)				千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS		28	33	3,084	14,559	銀行
O2 CZECH REPUBLIC AS		18	27	765	3,614	各種電気通信サービス
CEZ AS		58	68	3,044	14,369	電力
MONETA MONEY BANK AS		160	205	1,578	7,450	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	266	334	8,473	39,994	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.2%>	
(ハンガリー)				千フォリント		
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC		13	20	45,551	18,266	石油・ガス・消耗燃料
OTP BANK NYRT		89	105	98,070	39,326	銀行
RICHTER GEDEON NYRT		52	52	37,834	15,171	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額	156	178	181,455	72,763	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.3%>	
(ポーランド)				千ズロチ		
BANK MILLENNIUM SA		190	263	191	5,575	銀行
MBANK		5	5	267	7,805	銀行
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA		12	12	88	2,567	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ S.A.		57	57	626	18,275	金属・鉱業
BANK PEKAO SA		61	67	801	23,357	銀行
ORANGE POLSKA SA		217	284	141	4,114	各種電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.		124	131	1,581	46,122	石油・ガス・消耗燃料
LPP SA		0.5	0.5	327	9,548	繊維・アパレル・贅沢品
BANK ZACHODNI WBK SA		12	14	484	14,117	銀行
PKO BANK POLSKI SA		339	407	1,406	41,012	銀行
CCC SA		10	12	280	8,172	繊維・アパレル・贅沢品
SYNTHOS SA		181	181	80	2,352	化学
EUROCASH SA		25	25	76	2,243	食品・生活必需品小売り
GRUPA LOTOS SA		35	35	202	5,897	石油・ガス・消耗燃料
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I		688	800	534	15,577	石油・ガス・消耗燃料
CYFROWY POLSAT SA		75	91	231	6,754	メディア
GRUPA AZOTY SA		15	15	104	3,038	化学
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA		299	364	451	13,179	電力
TAURON POLSKA ENERGIA SA		401	401	147	4,304	電力
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		204	270	1,197	34,926	保険
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S		19	19	136	3,978	金属・鉱業
ALIOR BANK SA		29	38	233	6,816	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	3,006	3,499	9,593	279,739	
	銘 柄 数 < 比 率 >	22	22	—	<1.2%>	
(香港)				千香港ドル		
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H		450	450	535	7,630	金属・鉱業
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H		480	480	524	7,469	運送インフラ
CHINA SOUTHERN AIRLINES H		500	760	494	7,050	旅客航空輸送業
CHINA MOBILE LTD		2,320	2,615	21,874	311,711	無線通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H		450	530	1,330	18,956	建設資材
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD		170	215	808	11,519	コングロマリット

銘 柄	期首(前期末)	当 期		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価		
			外貨建金額		邦貨換算金額
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
HUANENG POWER INTL INC-H	1,460	1,840	1,056	15,050	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
YANZHOU COAL MINING-H	700	700	450	6,423	石油・ガス・消耗燃料
HENGAN INTL GROUP CO LTD	270	305	1,776	25,316	パーソナル用品
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B	268	268	269	3,838	自動車
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	1,240	1,240	1,810	25,798	自動車
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	1,520	1,740	2,018	28,762	医薬品
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	1,460	1,680	3,813	54,343	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES LAND LTD	1,044	1,144	2,494	35,552	不動産管理・開発
CITIC LTD	1,710	2,370	2,900	41,337	コングロマリット
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	480	660	735	10,477	運送インフラ
LENOVO GROUP LTD	2,880	2,880	1,448	20,643	コンピュータ・周辺機器
PETROCHINA CO LTD-H	7,860	8,720	4,237	60,390	石油・ガス・消耗燃料
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	2,240	2,480	2,827	40,287	各種電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	660	660	1,281	18,265	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	9,649	11,009	6,814	97,107	石油・ガス・消耗燃料
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	370	370	821	11,704	情報技術サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	320	320	1,361	19,402	ガス
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	1,180	1,440	921	13,132	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING PORTS LTD	520	680	610	8,701	運送インフラ
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	480	580	1,258	17,935	運送インフラ
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	1,320	1,700	685	9,762	金属・鉱業
CHINA EVERBRIGHT LTD	360	360	637	9,090	資本市場
CHINA GAS HOLDINGS LTD	660	660	858	12,226	ガス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	1,900	2,100	3,112	44,348	自動車
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	320	400	956	13,623	ガス
BYD CO LTD-H	245	300	1,470	20,947	自動車
CHINA TELECOM CORP LTD-H	5,180	5,800	2,163	30,828	各種電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	720	720	448	6,391	エネルギー設備・サービス
SINOTRANS LIMITED-H	610	—	—	—	航空貨物・物流サービス
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	980	980	929	13,238	商業サービス・用品
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	1,722	1,902	2,477	35,303	保険
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	720	720	337	4,811	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	700	860	1,252	17,843	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	1,130	1,375	1,386	19,750	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	2,760	3,210	7,639	108,867	保険
ZIJIN MINING GROUP CO-H	2,010	2,010	526	7,504	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	720	720	429	6,114	ヘルスケア機器・用品
WEICHAI POWER CO LTD-H	384	384	480	6,850	機械
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	1,140	1,480	597	8,520	化学
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	190	190	432	6,159	コングロマリット
TINGYI (CAYMAN ISLN)HLDG CO	740	740	675	9,627	食品
TSING TAO BREWERY CO-H	140	140	474	6,763	飲料
GUANGDONG INVESTMENT	1,060	1,260	1,378	19,642	水道
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	613	753	1,506	21,469	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	460	640	618	8,809	運送インフラ
CNOOC LTD	6,730	7,620	6,522	92,948	石油・ガス・消耗燃料
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,540	1,860	1,313	18,712	医薬品
CHINA MENGNIU DAIRY CO	1,050	1,200	1,833	26,128	食品
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,985	2,190	11,388	162,279	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,510	1,850	1,143	16,292	水道
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	3,833	5,233	512	7,308	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	1,150	1,150	322	4,588	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA LIMITED-H	540	760	588	8,382	旅客航空輸送業
ZTE CORP-H	234	338	626	8,924	通信機器

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 邦貨換算金額		
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	880	1,260	462	6,589	電気設備
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	1,330	1,470	2,869	40,889	石油・ガス・消耗燃料
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	3,467	3,947	2,281	32,516	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	720	720	902	12,866	建設・土木
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	31,800	35,830	23,002	327,790	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	210	250	1,285	18,311	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	1,120	1,120	1,122	15,991	自動車
MINTH GROUP LTD	—	280	889	12,668	自動車部品
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	570	570	555	7,919	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	1,070	1,070	476	6,785	建設資材
BANK OF CHINA LTD-H	29,790	33,980	12,878	183,517	銀行
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	420	420	572	8,163	不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	380	380	462	6,595	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK-H	1,521	1,641	3,636	51,825	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	27,610	31,490	16,122	229,751	銀行
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	864	864	385	5,491	各種電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1,600	1,810	1,828	26,050	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO-H	880	880	330	4,702	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	230	230	480	6,849	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	225	225	858	12,231	電気設備
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	420	530	1,091	15,558	家庭用耐久財
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,933	2,343	2,046	29,157	不動産管理・開発
CHINA CITIC BANK-H	3,210	3,640	1,718	24,482	銀行
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	2,480	2,480	1,505	21,451	繊維・アパレル・贅沢品
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	260	300	2,079	29,625	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	400	400	952	13,566	繊維・アパレル・贅沢品
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	974	1,169	1,457	20,763	コングロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	1,280	1,280	363	5,180	不動産管理・開発
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	1,015	1,015	380	5,423	不動産管理・開発
SOHO CHINA LTD	655	655	243	3,472	不動産管理・開発
KINGSOFT CORP LTD	270	350	714	10,174	ソフトウェア
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	5,382	5,382	392	5,598	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,480	1,790	1,086	15,483	建設・土木
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	750	750	754	10,751	建設・土木
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	2,360	2,360	1,217	17,353	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	980	1,146	3,357	47,848	保険
CRRC CORP LTD-H	1,533	1,833	1,314	18,733	機械
SUN ART RETAIL GROUP LTD	975	975	708	10,100	食品・生活必需品小売り
SINOPHARM GROUP CO-H	428	488	1,725	24,582	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	899	1,257	17,913	自動車
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	960	960	500	7,127	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	1,230	1,230	701	9,990	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	241	241	530	7,555	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H	1,560	1,560	369	5,268	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	—	1,550	534	7,620	医薬品
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	740	740	1,062	15,142	不動産管理・開発
LONGFOR PROPERTIES	500	645	997	14,209	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	317	317	1,247	17,775	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H	2,250	2,475	1,871	26,663	銀行
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	960	1,340	483	6,893	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	9,450	11,200	4,032	57,456	銀行
FAR EAST HORIZON LTD	770	770	528	7,527	各種金融サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H	830	1,030	1,670	23,806	資本市場
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	470	470	642	9,148	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	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H		1,228	1,460	1,862	26,547	資本市場
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC		265	325	3,124	44,529	電子装置・機器・部品
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H		2,710	2,710	883	12,589	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H		130	180	562	8,015	医薬品
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H		475	475	344	4,907	建設・土木
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H		1,140	1,515	1,078	15,371	資本市場
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD		1,440	1,440	60	861	食品
CHINA EVERGRANDE GROUP		1,470	1,820	2,686	38,280	不動産管理・開発
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING		1,120	1,120	959	13,677	半導体・半導体製造装置
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H		3,570	3,570	1,035	14,753	資本市場
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS		495	660	934	13,317	機械
TENCENT HOLDINGS LTD		2,140	2,411	67,315	959,240	インターネットソフトウェア・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H		537	537	1,133	16,146	不動産管理・開発
ALIBABA PICTURES GROUP LTD		4,300	5,800	777	11,075	メディア
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LTD		3,670	3,670	39	559	半導体・半導体製造装置
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT		1,080	1,080	383	5,463	ヘルスケア・テクノロジー
CGN POWER CO LTD-H		3,920	4,800	1,046	14,911	独立系電事業者・エネルギー販売業者
FULLSHARE HOLDINGS LIMITED		2,500	3,075	977	13,934	不動産管理・開発
GF SECURITIES CO LTD-H		496	634	1,002	14,292	資本市場
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD		180	180	548	7,810	自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H		558	746	1,110	15,818	資本市場
3SBIO, INC		335	335	343	4,897	バイオテクノロジー
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD		1,860	2,640	802	11,436	資本市場
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD		8,200	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
小 計	株 数 ・ 金 額	282,352	311,681	320,155	4,562,221	
	銘 柄 数 < 比 率 >	136	136	—	< 20.3% >	
(マレーシア)				千リンギ		
AMMB HOLDING		657	808	412	10,689	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD		85	85	94	2,447	食品
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD		1,127	1,585	1,054	27,341	銀行
DIGI.COM BERHAD		1,351	1,262	629	16,335	無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD		243	330	284	7,375	運送インフラ
RHB BANK BHD		222	338	172	4,465	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED		257	257	231	5,999	コングロマリット
BERJAYA SPORTS TOTO BHD		173	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
GAMUDA BERHAD		663	663	358	9,287	建設・土木
YTL CORPORATION		1,573	1,573	231	5,998	総合公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP		63	97	168	4,362	銀行
HONG LEONG BANK		252	252	388	10,077	銀行
IJM CORP		1,017	1,237	428	11,102	建設・土木
KUALA LUMPUR KEPONG		166	196	488	12,659	食品
MALAYAN BANKING		1,326	1,589	1,523	39,528	銀行
LAFARGE MALAYSIA BHD		129	—	—	—	建設資材
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD		395	395	156	4,047	銀行
MISC BHD		434	545	408	10,600	海運業
PPB GROUP BERHAD		185	185	314	8,148	食品
PETRONAS DAGANGAN BHD		83	113	280	7,263	石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BERHAD		251	300	561	14,552	ガス
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD		45	60	262	6,817	タバコ
TELEKOM MALAYSIA		401	500	332	8,625	各種電気通信サービス
TENAGA NASIONAL		1,293	1,465	2,077	53,886	電力
UMW HOLDINGS BHD		213	213	126	3,287	自動車
DIALOG GROUP BHD		1,231	1,231	237	6,165	エネルギー設備・サービス
PUBLIC BANK BHD		1,051	1,246	2,540	65,902	銀行

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(マレーシア)		百株	百株	千リンギ	千円	
YTL POWER INTL		720	720	103	2,692	総合公益事業
AIRASIA BHD		456	667	207	5,380	旅客航空輸送業
GENTING BHD		813	937	897	23,284	ホテル・レストラン・レジャー
GENTING MALAYSIA BHD		1,164	1,164	640	16,606	ホテル・レストラン・レジャー
IOI CORP		910	910	408	10,598	食品
SIME DARBY BERHAD		937	1,066	1,022	26,518	コングロマリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD		197	297	204	5,308	ヘルスケア機器・用品
AXIATA GROUP BERHAD		1,030	1,218	606	15,734	無線通信サービス
MAXIS BHD		634	791	442	11,469	無線通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD		940	1,117	798	20,717	化学
SAPURA ENERGY BHD		1,553	1,553	250	6,485	エネルギー設備・サービス
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD		500	693	185	4,799	メディア
IHH HEALTHCARE BHD		1,286	874	515	13,376	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	66	1,712	食品
WESTPORTS HOLDINGS BHD		332	332	122	3,186	運送インフラ
IOI PROPERTIES GROUP BHD		564	705	152	3,952	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	27,312	29,959	20,385	528,791	
		43	41	—	<2.4%>	
(タイ)				千バーツ		
BANGKOK BANK (F)		75	105	1,984	6,489	銀行
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR		444	444	2,020	6,606	コングロマリット
KRUNG THAI BANK-NVDR		1,172	1,472	2,753	9,004	銀行
ROBINSON PCL -NVDR		166	166	962	3,148	複合小売り
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR		666	729	11,226	36,710	銀行
TRUE CORP PCL-NVDR		3,739	3,739	2,299	7,519	各種電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR		235	235	4,547	14,869	銀行
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR		4,404	4,404	977	3,197	銀行
IRPC PCL - NVDR		3,392	4,221	2,131	6,970	石油・ガス・消耗燃料
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR		429	881	1,532	5,012	石油・ガス・消耗燃料
ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR		44	44	946	3,093	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR		963	1,143	2,943	9,624	食品
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR		396	450	7,987	26,119	無線通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR		1,350	1,350	1,303	4,263	専門小売り
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR		151	210	1,879	6,145	電子装置・機器・部品
PTT PCL-NVDR		385	454	17,115	55,968	石油・ガス・消耗燃料
THAI UNION GROUP PCL-NVDR		577	804	1,720	5,626	食品
SIAM CEMENT PUBLIC (F)		116	131	6,654	21,761	建設資材
SIAM CEMENT PCL-NVDR		40	40	2,032	6,644	建設資材
KCE ELECTRONICS-NVDR		107	107	1,198	3,918	電子装置・機器・部品
BEC WORLD PCL NVDR		276	276	596	1,949	メディア
AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR		164	1,866	8,583	28,068	運送インフラ
KASIKORNBANK PCL (F)		445	488	9,467	30,957	銀行
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR		514	627	4,232	13,839	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR		1,436	1,717	3,262	10,667	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR		132	162	2,770	9,058	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		816	978	3,863	12,632	ホテル・レストラン・レジャー
THAI OIL PCL-NVDR		326	326	2,550	8,341	石油・ガス・消耗燃料
GLOW ENERGY PCL - NVDR		187	187	1,467	4,800	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CP ALL PCL-NVDR		1,860	2,124	13,275	43,409	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR		2,387	2,387	2,040	6,673	陸運・鉄道
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR		551	647	5,612	18,353	石油・ガス・消耗燃料
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR		535	535	2,075	6,787	化学
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR		853	988	6,749	22,070	化学
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR		363	506	1,707	5,584	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	千パーツ	千円	運送インフラ
BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR		2,600	3,417	2,443	7,989	
小 計	株 数 ・ 金 額	32,299	38,363	144,916	473,877	
	銘 柄 数 < 比 率 >	36	36	—	<2.1%>	
(フィリピン)				千フィリピンペソ		
AYALA LAND LTD		2,639	3,325	13,466	29,760	不動産管理・開発
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		806	806	6,109	13,501	コングロマリット
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS		272	358	3,789	8,374	銀行
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC		546	1,674	2,360	5,216	コングロマリット
DMCI HOLDINGS INC		1,275	1,780	2,584	5,711	コングロマリット
GLOBE TELECOM INC		10	14	3,087	6,822	無線通信サービス
INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS		203	203	2,064	4,562	運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC		1,051	1,227	9,754	21,557	コングロマリット
JOLLIBEE FOODS CORPORATION		156	195	4,200	9,282	ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST		215	215	1,829	4,042	銀行
MEGAWORLD CORP		3,740	3,740	1,697	3,752	不動産管理・開発
ROBINSONS LAND CO		491	732	1,826	4,036	不動産管理・開発
SECURITY BANK CORP		80	80	1,768	3,907	銀行
SM PRIME HLDGS		3,093	3,622	12,444	27,501	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP		339	339	5,695	12,586	食品
SM INVESTMENTS CORP		96	96	7,629	16,860	コングロマリット
AYALA CORPORATION		89	105	8,837	19,530	各種金融サービス
ENERGY DEVELOPMENT CORPORATION		3,415	3,415	2,059	4,550	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		4,338	5,738	3,557	7,862	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP		536	536	2,125	4,696	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BDO UNIBANK INC		669	800	9,643	21,312	銀行
GT CAPITAL HOLDINGS INC		30	39	4,740	10,475	各種金融サービス
PLDT INC		39	39	7,245	16,012	無線通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	24,133	29,083	118,514	261,917	
	銘 柄 数 < 比 率 >	23	23	—	<1.2%>	
(インドネシア)				千ルピア		
AKR CORPORINDO TBK PT		533	753	496,980	4,174	商社・流通業
UNITED TRACTORS TBK PT		640	760	2,068,560	17,375	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAK TBK		1,757	1,757	1,493,450	12,544	食品
PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA		2,557	3,199	985,292	8,276	食品
GUDANG GARAM TBK		195	195	1,528,800	12,841	タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT		3,400	4,034	1,549,056	13,012	タバコ
INDOCEMENT TUNGKAL PRAKARSA		577	837	1,565,190	13,147	建設資材
SUMMARECON AGUNG TBK PT		3,233	4,378	564,762	4,744	不動産管理・開発
BANK DANAMON PT		1,251	1,251	644,759	5,415	銀行
BANK MANDIRI		3,625	3,965	5,035,550	42,298	銀行
MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK		908	1,122	1,598,850	13,430	複合小売り
UNILEVER INDONESIA TBK PT		562	687	3,366,300	28,276	家庭用品
BANK RAKYAT INDONESIA		4,301	4,640	7,099,200	59,633	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT		4,408	4,408	1,009,432	8,479	ガス
BANK NEGARA INDONESIA PT		2,987	2,987	1,978,887	16,622	銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT		1,216	1,216	1,240,320	10,418	建設資材
BANK CENTRAL ASIA		4,590	4,222	7,684,040	64,545	銀行
XL AXIATA TBK PT		1,382	1,382	464,352	3,900	無線通信サービス
LIPPO KARAWACI TBK PT		5,925	8,004	528,264	4,437	不動産管理・開発
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT		1,465	2,625	497,437	4,178	メディア
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT		738	738	400,685	3,365	運送インフラ
BUMI SERPONG DAMAI PT		2,937	2,937	530,128	4,453	不動産管理・開発
ADARO ENERGY PT		5,337	5,337	851,251	7,150	石油・ガス・消耗燃料
PAKUWON JATI TBK PT		9,200	9,200	561,200	4,714	不動産管理・開発

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(インドネシア)		百株	百株	千ルピア	千円	
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T		890	890	783,200	6,578	食品
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE		887	887	589,855	4,954	各種電気通信サービス
KALBE FARMA PT		7,685	9,144	1,485,900	12,481	医薬品
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT		1,575	1,575	365,400	3,069	建設・土木
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK		7,554	8,429	7,501,810	63,015	自動車
SURYA CITRA MEDIA PT TBK		1,961	2,535	659,100	5,536	メディア
TELEKOMUNIKASI		19,081	21,867	9,883,884	83,024	各種電気通信サービス
株 数 ・ 金 額		103,359	115,963	65,011,896	546,099	
小 計	銘 柄 数 < 比 率 >	31	31	—	<2.4%>	
(韓国)				千ウォン		
CHEIL WORLDWIDE INC		22	22	40,992	4,004	メディア
HANMI SCIENCE CO LTD		4	4	43,196	4,220	医薬品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD		13	16	182,400	17,820	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE		12	13	375,200	36,657	保険
DONGBU INSURANCE CO LTD		18	23	154,308	15,075	保険
COWAY CO LTD		19	23	238,050	23,257	家庭用耐久財
KT & G CORP		43	50	588,675	57,513	タバコ
S-1 CORPORATION		6	8	80,360	7,851	商業サービス・用品
KOREA GAS CORPORATION		10	10	57,038	5,572	ガス
CJ CORP		5	5	105,844	10,341	コングロマリット
KAKAO CORP		12	15	152,152	14,865	インターネットソフトウェア・サービス
SK TELECOM CO LTD		7	9	234,140	22,875	無線通信サービス
DAELIM INDUSTRIAL COMPANY		9	12	103,939	10,154	建設・土木
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD		55	153	152,023	14,852	資本市場
NCSOFT CORPORATION		6	7	284,700	27,815	ソフトウェア
LG UPLUS CORP		86	48	82,303	8,041	各種電気通信サービス
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES		17	17	38,232	3,735	電気設備
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR		49	49	34,880	3,407	建設・土木
POSCO DAEWOO CORP		18	18	40,521	3,958	商社・流通業
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE		3	4	400,002	39,080	パーソナル用品
LG CHEMICALS LTD		17	19	536,480	52,414	化学
LG CHEM LTD - PREFERRED		2	2	53,841	5,260	化学
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF		0.7	0.7	44,100	4,308	パーソナル用品
SHINHAN FINANCIAL GROUP		159	184	894,387	87,381	銀行
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY		22	22	106,220	10,377	建設・土木
S-OIL CORPORATION		16	19	183,495	17,927	石油・ガス・消耗燃料
HANWHA CHEMICAL CORP		42	42	126,210	12,330	化学
SAMSUNG SECURITIES		18	27	107,329	10,486	資本市場
LOTTE CHEMICAL CORPORATION		6	6	205,265	20,054	化学
HOTEL SHILLA CO LTD		12	12	69,924	6,831	専門小売り
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES		16	14	248,820	24,309	機械
HYUNDAI MOBIS		25	29	753,320	73,599	自動車部品
SK HYNIX INC		219	246	1,599,912	156,311	半導体・半導体製造装置
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR		25	30	139,385	13,617	建設・土木
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD		8	10	120,445	11,767	自動車
HYUNDAI MOTOR CO LTD		58	65	1,054,485	103,023	自動車
HYUNDAI STEEL CO		28	33	190,558	18,617	金属・鉱業
INDUSTRIAL BK OF KOREA		104	104	142,233	13,896	銀行
KCC CORP		2	2	97,055	9,482	建設関連製品
KIA MOTORS CORP		96	115	438,912	42,881	自動車
KOREA ZINC CO LTD		3	3	164,540	16,075	金属・鉱業
KOREA ELECTRIC POWER		99	107	447,560	43,726	電力
HANWHA CORPORATION		18	18	85,002	8,304	コングロマリット
KOREAN AIR LINES CO LTD		10	17	68,248	6,667	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
(韓国)	百株	百株	千ウォン	千円	
OCI COMPANY LTD	6	6	58,590	5,724	化学
CJ KOREA EXPRESS CO LTD	2	2	51,165	4,998	陸連・鉄道
KUMHO PETRO CHEMICAL CO	6	6	49,426	4,828	化学
KT CORP	8	8	28,336	2,768	各種電気通信サービス
LG ELECTRONICS INC	40	45	389,556	38,059	家庭用耐久財
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	1	1	38,000	3,712	食品
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	0.2	0.2	34,420	3,362	飲料
HANSSEM CO LTD	4	4	75,850	7,410	家庭用耐久財
LG CORP	37	41	333,183	32,551	コングロマリット
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	43	59	82,723	8,082	資本市場
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	19	19	58,049	5,671	建設・土木
NAVER CORP	10	12	1,064,800	104,030	インターネットソフトウェア・サービス
HYUNDAI DEPT STORE CO	6	6	67,200	6,565	複合小売り
DONGSUH COMPANIES INC	10	10	30,805	3,009	食品・生活必需品小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	13	18	122,304	11,949	資本市場
OTTOGI CORPORATION	0.4	0.4	33,440	3,267	食品
AMOREPACIFIC GROUP	10	12	166,875	16,303	パーソナル用品
KANGWON LAND INC	42	51	178,245	17,414	ホテル・レストラン・レジャー
POSCO	28	31	841,050	82,170	金属・鉱業
SAMSUNG SDI CO,LTD	19	22	353,130	34,500	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	20	25	237,500	23,203	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRONICS	37	41	9,875,840	964,869	コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	97	97	124,274	12,141	機械
HANWHA TECHWIN CO LTD	14	14	63,921	6,245	航空宇宙・防衛
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	6	7	1,425,750	139,295	コンピュータ・周辺機器
SHINSEGAE CO LTD	2	3	75,210	7,348	複合小売り
HYOSUNG CORPORATION	7	9	162,720	15,897	化学
ORION CORP	1	1	104,538	10,213	食品
YUHAN CORPORATION	2	3	71,850	7,019	医薬品
HANON SYSTEMS	62	85	94,060	9,189	自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	20	27	101,083	9,875	保険
GS HOLDINGS CORP	21	21	142,003	13,873	石油・ガス・消耗燃料
LG.DISPLAY CO LTD	84	101	370,898	36,236	電子装置・機器・部品
SK NETWORKS CO LTD	48	48	32,438	3,169	商社・流通業
CELLTRION INC	29	34	393,642	38,458	バイオテクノロジー
HANA FINANCIAL HOLDINGS	110	127	531,686	51,945	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	6	8	122,800	11,997	航空貨物・物流サービス
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	26	—	—	—	資本市場
LOTTE SHOPPING CO	3	5	150,500	14,703	複合小売り
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	26	29	332,880	32,522	保険
AMOREPACIFIC CORP	12	13	414,800	40,525	パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	3	4	76,670	7,490	パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	13	13	53,584	5,235	消費者金融
SK INNOVATION CO LTD	25	27	427,040	41,721	石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	3	3	119,360	11,661	食品
PAN OCEAN CO LTD	—	87	45,204	4,416	海運業
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	7	7	37,525	3,666	商業サービス・用品
LG INNOTEK CO LTD	4	6	101,990	9,964	電子装置・機器・部品
SK HOLDINGS CO LTD	17	13	379,359	37,063	コングロマリット
KB FINANCIAL GROUP INC	151	167	905,140	88,432	銀行
MEDY-TOX INC	—	1	94,843	9,266	バイオテクノロジー
HYUNDAI WIA CORP	5	5	38,861	3,796	自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	27	27	161,518	15,780	航空宇宙・防衛
BNK FINANCIAL GROUP INC	104	104	108,544	10,604	銀行

銘柄		株数	期首(前期末)	当期		業種等
			株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)		百株	百株	千ウォン	千円	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD		1	2	100,250	9,794	医薬品
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD		86	86	56,998	5,568	保険
CJ E&M CORP		5	8	61,040	5,963	メディア
E-MART CO		7	8	190,198	18,582	食品・生活必需品小売り
DGB FINANCIAL GROUP INC		62	62	71,780	7,012	銀行
GS RETAIL CO LTD		8	11	59,850	5,847	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE CO LTD/NEW		27	32	205,627	20,089	自動車部品
HYUNDAI ROBOTICS CO LTD		—	2	100,487	9,817	半導体・半導体製造装置
NETMARBLE GAMES CORP		—	6	105,570	10,314	ソフトウェア
BGF RETAIL CO LTD		7	10	116,790	11,410	食品・生活必需品小売り
SAMSUNG SDS CO LTD		13	16	257,600	25,167	情報技術サービス
WOORI BANK		111	134	226,464	22,125	銀行
SAMSUNG C&T CORP		28	31	414,216	40,468	コングロマリット
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD		6	6	149,120	14,569	ライフサイエンス・ツール/サービス
DOOSAN BOBCAT INC		—	14	49,549	4,840	機械
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,125 108	3,620 112	34,867,409 — <15.2%>	3,406,545 <15.2%>	
(台湾)				千新台幣ドル		
ACER INC		917	1,237	1,949	7,115	コンピュータ・周辺機器
ASUSTEK COMPUTER INC		268	298	8,494	31,004	コンピュータ・周辺機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP		154	214	2,409	8,794	半導体・半導体製造装置
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC		2,466	2,783	10,409	37,993	半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT		959	959	2,529	9,231	建設資材
TAIWAN BUSINESS BANK		1,174	1,674	1,382	5,047	銀行
TAIWAN FERTILIZER CO LTD		230	230	932	3,404	化学
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI		340	340	1,961	7,160	半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD		250	250	1,762	6,433	コンピュータ・周辺機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD		203	203	1,652	6,030	コンピュータ・周辺機器
QUANTA COMPUTER INC		996	1,136	8,276	30,208	コンピュータ・周辺機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP		281	281	1,425	5,201	不動産管理・開発
EVA AIRWAYS CORP		596	856	1,250	4,563	旅客航空輸送業
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD		238	268	9,903	36,149	コンピュータ・周辺機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK		1,752	2,132	3,647	13,312	銀行
CHINA AIRLINES		795	795	725	2,648	旅客航空輸送業
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD		740	880	5,387	19,665	自動車部品
CHINA STEEL		4,605	5,435	13,316	48,606	金属・鉱業
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD		1,313	1,513	4,464	16,294	保険
ADVANTECH CO.,LTD.		132	132	3,204	11,695	コンピュータ・周辺機器
COMPAL ELECTRONICS		1,575	1,955	4,009	14,635	コンピュータ・周辺機器
DELTA ELECTRONICS INC		726	816	13,518	49,341	電子装置・機器・部品
NANYA TECHNOLOGY CO		230	230	1,207	4,407	半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD		1,470	1,580	16,991	62,020	各種電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP		3,270	3,980	5,074	18,522	電子装置・機器・部品
TAIWAN MOBILE CO LTD		592	672	7,694	28,084	無線通信サービス
EVERGREEN MARINE		447	737	1,106	4,037	海運業
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION		1,144	1,424	3,383	12,348	コングロマリット
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD		143	143	1,703	6,217	繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD		62	82	2,764	10,091	繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD		200	260	3,205	11,698	半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTIC		1,604	1,724	15,638	57,081	化学
FORMOSA TAFFETA CO.		200	320	995	3,632	繊維・アパレル・贅沢品
FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO		1,209	1,289	11,867	43,317	化学
TRANSCEND INFORMATION INC		43	83	859	3,135	コンピュータ・周辺機器
GIANT MANUFACTURING		97	137	2,399	8,758	レジャー用品

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(台湾)	百株	百株	千新台幣ドル	千円	
MEDIATEK INC	565	645	17,392	63,484	半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,465	2,845	13,487	49,228	各種金融サービス
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	2,924	2,924	4,985	18,197	銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	90	110	4,125	15,056	専門小売り
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	580	690	5,416	19,770	無線通信サービス
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	3,493	4,133	5,435	19,841	資本市場
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	3,015	3,425	16,765	61,195	保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	4,847	5,837	4,868	17,771	銀行
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	3,071	3,785	6,983	25,490	銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	5,798	6,648	75,123	274,201	電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	4,133	4,483	11,142	40,669	銀行
LARGAN PRECISION CO LTD	40	40	19,533	71,296	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	3,492	4,162	5,702	20,814	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	2,745	3,445	2,694	9,834	保険
INVENTEC CO.,LTD	1,029	1,029	2,562	9,353	コンピュータ・周辺機器
HTC CORPORATION	237	237	1,660	6,061	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	748	888	4,480	16,353	コンピュータ・周辺機器
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	3,831	4,721	4,216	15,390	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING	6,762	7,332	14,224	51,918	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	3,723	4,003	7,845	28,637	銀行
MERIDA INDUSTRY CO LTD	82	82	1,344	4,908	レジャー用品
POWERTECH TECHNOLOGY INC	271	271	2,540	9,274	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP	1,797	2,087	15,132	55,234	化学
WISTRON CORP	886	1,116	3,462	12,637	コンピュータ・周辺機器
POU CHEN CORP	884	884	3,671	13,400	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	1,858	2,028	12,007	43,828	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	208	238	6,382	23,296	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	463	603	6,639	24,234	石油・ガス・消耗燃料
PHISON ELECTRONICS CORP	43	63	2,254	8,228	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	272	272	921	3,364	不動産管理・開発
RUENTEX INDUSTRIES LTD	207	207	921	3,364	繊維・アパレル・贅沢品
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	348	348	3,117	11,379	コンピュータ・周辺機器
SILICONWARE PRECISION INDUSTRIES	842	842	4,168	15,216	半導体・半導体製造装置
STANDARD FOODS CORP	150	260	2,096	7,650	食品
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	445	595	2,022	7,381	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT	1,313	1,313	4,570	16,680	建設資材
TECO ELECTRIC & MACHINERY	680	680	1,995	7,284	電気設備
TAIWAN SEMICONDUCTOR	9,280	10,450	225,197	821,970	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP	4,545	5,235	6,491	23,693	半導体・半導体製造装置
YULON MOTOR CO	290	290	783	2,861	自動車
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	—	690	1,749	6,384	運送インフラ
INNOLUX CORP	3,583	3,583	5,374	19,618	電子装置・機器・部品
WPG HOLDINGS CO LTD	490	630	2,555	9,328	電子装置・機器・部品
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	68	98	2,016	7,360	機械
TAI MED BIOLOGICS INC	50	80	1,424	5,197	バイオテクノロジー
PEGATRON CORP	746	856	8,312	30,339	コンピュータ・周辺機器
CHAILEASE HOLDING CO LTD	346	436	3,682	13,441	各種金融サービス
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	560	560	558	2,037	各種電気通信サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	134	204	1,522	5,557	電子装置・機器・部品
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	3,145	3,145	4,954	18,082	銀行
OBI PHARMA INC	40	40	1,000	3,650	バイオテクノロジー
CASETEK HOLDINGS LTD	50	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
GLOBALWAFERS CO LTD	—	60	1,347	4,916	半導体・半導体製造装置

銘柄		期首(前期末)		当期		業種等
		株数	株数	評価額	金額	
(台湾)		百株	百株	外貨建金額 千新台幣ドル	邦貨換算金額 千円	家庭用耐久財
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD		50	50	1,530	5,584	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	119,168	136,759	747,904	2,729,849	
(インド)		88	89	—	<12.2%>	
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED		496	550	78,323	136,283	石油・ガス・消耗燃料
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		192	220	14,403	25,061	石油・ガス・消耗燃料
EICHER MOTORS LTD		5	5	14,592	25,391	機械
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED		145	162	22,541	39,221	自動車
SHREE CEMENT LIMITED		2	3	6,255	10,884	建設資材
HINDUSTAN PETROLEUM CORP		152	186	9,887	17,203	石油・ガス・消耗燃料
CONTAINER CORP OF INDIA LTD		9	12	1,446	2,516	陸運・鉄道
LIC HOUSING FINANCE		112	138	10,694	18,609	貯蓄・抵当・不動産金融
TATA STEEL LIMITED		101	130	6,755	11,754	金属・鉱業
JSW STEEL LTD		30	—	—	—	金属・鉱業
NESTLE INDIA LIMITED		9	9	6,353	11,055	食品
GAIL INDIA LTD		118	206	7,612	13,246	ガス
VEDANTA LTD		403	653	15,591	27,128	金属・鉱業
TITAN CO LTD		113	113	5,926	10,312	繊維・アパレル・贅沢品
OIL&NATURAL GAS CORP LTD		498	498	8,221	14,306	石油・ガス・消耗燃料
LUPIN LTD		78	90	9,920	17,262	医薬品
ACC LIMITED		18	18	3,050	5,307	建設資材
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE		572	631	102,889	179,027	貯蓄・抵当・不動産金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE		228	228	11,504	20,018	メディア
INFOSYS LTD		699	773	72,986	126,997	情報技術サービス
WIPRO LTD		227	530	13,587	23,641	情報技術サービス
INDIAN OIL CORPORATION LTD		—	237	9,695	16,870	石油・ガス・消耗燃料
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED		246	267	30,029	52,251	家庭用品
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE		31	31	3,974	6,915	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HCL TECHNOLOGIES LTD		204	251	21,238	36,954	情報技術サービス
DABUR INDIA LTD		176	229	6,592	11,470	パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD		19	19	7,312	12,723	自動車
DR. REDDYS LABORATORIES		46	46	12,521	21,787	医薬品
BHARTI AIRTEL LIMITED		366	488	17,953	31,239	無線通信サービス
UNITED SPIRITS LIMITED		24	24	5,624	9,786	飲料
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD		351	411	21,722	37,797	医薬品
DIVIS LABORATORIES LTD		25	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD		38	45	32,997	57,415	自動車
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD		50	50	3,167	5,510	医薬品
AUROBINDO PHARMA LTD		93	114	7,479	13,013	医薬品
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD		161	161	7,655	13,320	自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE		54	54	5,467	9,513	消費者金融
CIPLA LIMITED		135	135	7,330	12,755	医薬品
LARSEN&TOUBRO LIMITED		114	138	24,365	42,396	建設・土木
ULTRATECH CEMENT LTD		33	38	15,260	26,554	建設資材
ASHOK LEYLAND LIMITED		464	464	4,355	7,578	機械
BOSCH LTD		3	3	7,267	12,645	自動車部品
TATA CONSULTANCY SVS LTD		179	204	49,281	85,748	情報技術サービス
NTPC LIMITED		601	714	11,414	19,861	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PIRAMAL ENTERPRISES LTD		29	29	8,496	14,783	医薬品
YES BANK LTD		122	143	20,573	35,798	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD		236	236	5,686	9,894	建設資材
BHARAT FORGE LIMITED		36	48	5,630	9,796	自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED		406	494	9,719	16,911	金属・鉱業
ITC LTD		1,312	1,454	44,941	78,198	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	
(インド)		百株	百株	千インドルピー	千円	
UPL LTD		137	162	14,109	24,550	化学
SIEMENS INDIA LIMITED		23	32	4,298	7,479	コングロマリット
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD		44	53	10,532	18,326	パーソナル用品
CAIRN INDIA LIMITED		183	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
IDEA CELLULAR LIMITED		475	657	5,312	9,243	無線通信サービス
MARICO LIMITED		156	200	6,341	11,033	パーソナル用品
POWER FINANCE CORPORATION		241	241	3,147	5,475	各種金融サービス
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE		287	330	12,233	21,286	運送インフラ
RURAL ELECTRIFICATION CORP		—	281	5,215	9,075	各種金融サービス
BAJAJ FINSERV LTD		14	14	6,061	10,546	保険
BAJAJ AUTO LIMITED		29	35	9,889	17,207	自動車
COAL INDIA LTD		265	265	6,639	11,552	石油・ガス・消耗燃料
TATA MOTORS LTD-A-DVR		149	149	4,259	7,410	自動車
TATA MOTORS LTD		581	664	30,382	52,865	自動車
BHARAT HEAVY ELECTRICALS		239	239	3,276	5,701	電気設備
TATA POWER COMPANY LIMITED		452	452	3,701	6,440	電力
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS		113	113	3,925	6,830	消費者金融
BHARTI INFRATEL LTD		197	246	9,143	15,910	各種電気通信サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD		118	141	15,895	27,657	貯蓄・抵当・不動産金融
ASIAN PAINTS LTD		104	123	14,246	24,788	化学
BAJAJ FINANCE LTD		59	71	10,143	17,649	消費者金融
AXIS BANK LIMITED		625	716	36,380	63,301	銀行
HAVELLS INDIA LTD		91	91	4,382	7,626	電気設備
ICICI BANK LTD		392	1,038	30,222	52,586	銀行
TECH MAHINDRA LTD		90	179	6,998	12,176	情報技術サービス
CADILA HEALTHCARE LTD		61	88	4,626	8,050	医薬品
GRASIM INDUSTRIES LIMITED		—	114	12,929	22,497	建設資材
IDFC BANK LTD		505	505	2,886	5,021	銀行
JSW STEEL LTD		—	378	7,567	13,167	金属・鉱業
小 計	株 数 ・ 金 額	15,423	19,295	1,115,048	1,940,184	
	銘 柄 数 < 比 率 >	75	76	—	< 8.6% >	
(パキスタン)				千パキスタンルピー		
ENGRO CORPORATION LTD		—	107	3,494	3,739	化学
LUCKY CEMENT		—	53	4,227	4,523	建設資材
MCB BANK LIMITED		—	159	3,268	3,496	銀行
OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD		—	263	3,617	3,870	石油・ガス・消耗燃料
UNITED BANK LTD		—	200	4,487	4,801	銀行
HABIB BANK LTD		—	273	6,726	7,197	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	—	1,055	25,821	27,629	
	銘 柄 数 < 比 率 >	—	6	—	< 0.1% >	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A		992	1,401	3,529	21,527	コングロマリット
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L		177	215	3,325	20,283	飲料
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		694	825	14,475	88,300	飲料
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1		76	76	1,088	6,637	複合小売り
GRUPO FIN SANTANDER-B		626	770	2,672	16,303	銀行
GRUPO TELEvisa SAB - SER CPO		940	1,071	9,338	56,962	メディア
GRUPO BIMBO SAB-SERIES A		614	745	3,479	21,227	食品
GRUMA S. A. B. -B		82	82	1,925	11,743	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF		100	100	2,101	12,817	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1		232	207	1,569	9,576	コングロマリット
CEMEX SAB - CPO		5,281	6,287	10,488	63,977	建設資材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		937	1,042	11,751	71,685	銀行
MEXICHEM SAB DE CV-*		389	486	2,378	14,511	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	
(メキシコ)		百株	百株	千メキシコペソ	千円	
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV		52	52	2,060	12,570	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A		525	645	2,503	15,269	家庭用品
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B		76	92	3,373	20,579	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B		1,463	1,678	8,179	49,893	金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L		12,412	14,081	20,304	123,859	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O		930	930	2,990	18,244	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV		167	167	2,226	13,584	飲料
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH		143	143	2,769	16,894	運送インフラ
OHL MEXICO SAB DE CV		241	241	630	3,845	運送インフラ
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N		200	200	1,908	11,643	ガス
GRUPO LALA SAB DE CV		198	198	631	3,852	食品
GENTERA SAB DE CV		362	362	1,007	6,145	消費者金融
WALMART DE MEXICO-SER V		2,007	2,183	9,059	55,262	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	29,919	34,282	125,770	767,199	
		26	26	—	<3.4%>	
(ブラジル)				千レアル		
BRF SA		234	199	817	27,225	食品
VALE SA		497	536	1,418	47,274	金属・鉱業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB		34	34	82	2,747	電力
VALE SA-PREF A		733	821	2,044	68,115	金属・鉱業
TIM PARTICIPACOES SA		301	375	356	11,874	無線通信サービス
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B		87	87	137	4,577	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER		75	75	88	2,961	電力
BANCO DO BRASIL SA		322	352	910	30,330	銀行
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR		1,493	1,680	1,468	48,926	銀行
LOJAS AMERICANAS S.A. (PREF)		202	322	433	14,439	複合小売り
LOJAS AMERICANAS SA		46	78	92	3,070	複合小売り
GERDAU SA PFD NPV		363	363	333	11,115	金属・鉱業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS		1,116	1,234	1,577	52,547	石油・ガス・消耗燃料
PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR		1,481	1,707	1,986	66,205	石油・ガス・消耗燃料
KROTON EDUCACIONAL SA		498	561	750	24,998	各種消費者サービス
CCR SA		329	527	874	29,149	運送インフラ
WEG SA		213	259	465	15,495	機械
BANCO BRADESCO SA - PREF		1,058	1,287	3,387	112,856	銀行
BANCO BRADESCO S.A.		310	377	993	33,115	銀行
NATURA COSMETICOS SA		63	63	171	5,709	パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA		215	215	131	4,391	金属・鉱業
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA-PREF		163	163	239	7,967	紙製品・林産品
CPFL ENERGIA SA		66	90	238	7,955	電力
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF		1,226	1,355	4,824	160,750	銀行
PORTO SEGURO SA		32	49	148	4,956	保険
FIBRIA CELULOSE SA		99	99	353	11,786	紙製品・林産品
BRASKEM SA-PREF A		63	63	201	6,702	化学
LOCALIZA RENT A CAR		61	64	275	9,164	陸運・鉄道
LOJAS RENNER S.A.		255	320	847	28,246	複合小売り
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA		112	112	151	5,060	電力
ULTRAPAR PARTICIPACOES		134	161	1,224	40,797	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO		42	67	202	6,757	石油・ガス・消耗燃料
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD		80	80	420	13,994	電力
EMBRAER SA		272	272	426	14,219	航空宇宙・防衛
M DIAS BRANCO SA		13	39	192	6,425	食品
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT		—	75	161	5,382	電力
ODONTOPREV S.A.		106	106	124	4,153	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BR MALLS PARTICIPACOES SA		195	378	462	15,416	不動産管理・開発

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ブラジル)		百株	百株	千レアル	千円	
JBS SA		280	373	236	7,867	食品
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF		302	302	224	7,483	電力
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP		125	153	474	15,803	水道
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS		29	38	247	8,249	不動産管理・開発
DURATEX SA		113	113	89	2,985	紙製品・林産品
SUL AMERICA SA - UNITS		53	91	160	5,340	保険
HYPERMARCAS S. A		142	142	411	13,721	医薬品
BM&F BOVESPA SA		629	905	1,729	57,616	資本市場
TELEFONICA BRASIL-PREF		176	198	897	29,919	各種電気通信サービス
QUALICORP SA		77	103	315	10,501	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA		162	162	403	13,440	銀行
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO		76	—	—	—	資本市場
CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF		57	70	441	14,698	食品・生活必需品小売り
CIELO SA		378	536	1,298	43,270	情報技術サービス
RAIA DROGASIL SA		86	101	717	23,893	食品・生活必需品小売り
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES		255	283	800	26,685	保険
ENGIE BRASIL SA		54	71	247	8,244	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AMBEV SA		1,772	2,001	3,628	120,912	飲料
KLABIN SA-UNIT		202	251	421	14,050	容器・包装
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL		266	—	—	—	陸運・鉄道
RUMO SA		—	338	274	9,156	陸運・鉄道
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT		70	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 ・ 金 額	17,901	20,887	42,037	1,400,704	
	銘 柄 数 < 比 率 >	58	57	—	<6.2%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION		13	17	62,986	10,518	銀行
EMPRESAS CMPC SA		500	500	79,686	13,307	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA		172	198	148,024	24,720	石油・ガス・消耗燃料
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM		53	69	50,806	8,484	無線通信サービス
COLBUN SA		2,920	2,920	42,529	7,102	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AGUAS ANDINAS SA-A		953	953	36,131	6,033	水道
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B		103	103	27,857	4,652	飲料
S. A. C. I. FALABELLA		232	273	152,443	25,458	複合小売り
CENCOSUD SA		562	666	117,356	19,598	食品・生活必需品小売り
AES GENER SA		1,215	1,215	29,840	4,983	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 ・ 金 額	6,725	6,916	747,662	124,859	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	10	—	<0.6%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA		151	151	202,340	7,344	電力
CORP FINANCIERA COLOMBIANA		35	—	—	—	各種金融サービス
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF		41	52	196,872	7,146	各種金融サービス
GRUPO AVAL ACCIONES-PFD		1,299	1,634	199,348	7,236	銀行
CEMENTOS ARGOS SA		176	176	200,640	7,283	建設資材
GRUPO ARGOS SA		102	123	258,300	9,376	建設資材
BANCOLOMBIA SA		—	93	285,324	10,357	銀行
GRUPO DE INV SURAMERICANA		92	106	411,068	14,921	各種金融サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	1,896	2,335	1,753,892	63,666	
	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		323	—	—	—	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK		450	575	330	10,035	銀行
EMIRATES TELECOM CORPORATION		669	733	1,273	38,627	各種電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK		738	838	594	18,026	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC		251	626	664	20,152	銀行

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(アラブ首長国連邦)		百株	百株	千UAEディルハム	千円	
EMAAR PROPERTIES PJSC		1,341	1,455	1,157	35,107	不動産管理・開発
ALDAR PROPERTIES PJSC		1,092	1,363	317	9,638	不動産管理・開発
EMAAR MALLS PJSC		660	897	227	6,912	不動産管理・開発
DXB ENTERTAINMENTS PJSC		1,189	1,189	93	2,831	ホテル・レストラン・レジャー
DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC		—	739	219	6,666	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,714 9	8,418 9	4,877 —	147,997 <0.7%>	
(エジプト)				千エジプトポンド		
EGYPTIAN FINANCIAL GROUP-HERMES HOLDING		—	250	598	3,661	資本市場
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK		388	388	3,150	19,278	銀行
GLOBAL TELECOM HOLDING		955	955	641	3,924	無線通信サービス
T M G HOLDING		247	—	—	—	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,592 3	1,594 3	4,389 —	26,864 <0.1%>	
(南アフリカ)				千ランド		
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD		344	—	—	—	各種金融サービス
BIDVEST GROUP LTD		130	153	2,441	20,756	コングロマリット
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD		179	179	1,312	11,159	専門小売り
DISCOVERY LTD		135	165	2,188	18,602	保険
GOLD FIELDS LTD		288	364	1,649	14,023	金属・鉱業
REMGRO LTD		202	222	4,563	38,788	各種金融サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD		82	82	1,139	9,681	専門小売り
EXXARO RESOURCES LTD		57	79	701	5,962	石油・ガス・消耗燃料
CAPIPEC BANK HOLDINGS LTD		16	16	1,286	10,936	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD		42	42	481	4,090	保険
MTN GROUP LTD		619	716	8,139	69,181	無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD		156	178	2,372	20,163	金属・鉱業
TELKOM SA SOC LTD		99	99	646	5,493	各種電気通信サービス
FIRSTRAND LTD		1,285	1,454	6,868	58,383	各種金融サービス
PSG GROUP LTD		29	39	920	7,823	各種金融サービス
NASPERS LTD-N SHS		165	186	48,341	410,904	メディア
CORONATION FUND MANAGERS LTD		68	104	692	5,884	資本市場
NEDBANK GROUP LTD		76	101	2,125	18,070	銀行
NETCARE LTD		384	384	977	8,307	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PICKN PAY STORES LTD		129	129	738	6,279	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD		250	304	1,791	15,227	各種金融サービス
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD		21	21	594	5,057	金属・鉱業
SAPPI LIMITED		215	215	1,916	16,288	紙製品・林産品
SASOL LTD		206	240	8,661	73,621	化学
SHOPRITE HOLDINGS LTD		159	179	3,580	30,430	食品・生活必需品小売り
BRAIT SE		115	151	930	7,910	資本市場
STANDARD BANK GROUP LTD		498	552	7,626	64,829	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE		68	86	1,311	11,143	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		372	428	2,664	22,646	複合小売り
IMPERIAL HOLDINGS LTD		53	53	826	7,022	販売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		134	158	4,417	37,549	医薬品
TIGER BRANDS LTD		62	73	2,748	23,359	食品
SANLAM LIMITED		543	596	3,882	33,005	保険
INVESTEC LTD		85	114	1,109	9,434	資本市場
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD		209	264	897	7,629	金属・鉱業
PIONEER FOODS LTD		50	50	703	5,978	食品
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENT P LC		95	95	1,596	13,572	不動産管理・開発
MASSMART HOLDINGS LTD		41	41	448	3,814	食品・生活必需品小売り
MONDI LTD		47	47	1,639	13,939	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	
(南アフリカ)		百株	百株	千ランド	千円	
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN		335	550	1,471	12,506	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MMI HOLDINGS LTD		400	400	792	6,737	保険
TSOGO SUN HOLDINGS LTD		126	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
VODACOM GROUP		130	212	3,428	29,143	無線通信サービス
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD		155	296	4,211	35,800	銀行
SIBANYE GOLD LTD		285	775	1,237	10,520	金属・鉱業
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD		237	307	1,198	10,190	保険
MR PRICE GROUP LTD		97	97	1,508	12,819	専門小売り
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV		1,144	1,266	8,396	71,367	家庭用耐久財
BID CORP LTD		120	136	4,097	34,828	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	10,759	12,416	161,278	1,370,868	
	銘 柄 数 < 比 率 >	49	47	—	<6.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額	762,507	867,031	—	21,824,802	
	銘 柄 数 < 比 率 >	827	836	—	<97.3%>	

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

外国投資信託証券

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	80,400	235	7,418	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	64,400	80,400	235	7,418	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.0%>	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		94,400	114,100	3,898	23,782	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	94,400	114,100	3,898	23,782	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
(南アフリカ)				千ランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		75,380	88,400	2,194	18,657	0.1
REDEFINE PROPERTIES LTD		161,710	209,710	2,239	19,037	0.1
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS		7,790	10,470	1,244	10,582	0.0
FORTRESS INCOME FUND LTD-A		29,380	41,690	707	6,010	0.0
FORTRESS INCOME FUND LTD		29,020	29,020	1,015	8,628	0.0
RESILIENT REIT LTD		11,572	11,572	1,405	11,947	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	314,852	390,862	8,807	74,862	
	銘 柄 数 < 比 率 >	6	6	—	<0.3%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	473,652	585,362	—	106,063	
	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		期末
			買建額	売建額	額
外国	株式先物取引	MSCIN	百万円 483	百万円 —	

*単位未満は切り捨て。
*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

<国内債券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(528,320,149千口)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	501,084,000 (2,360,000)	548,518,473 (3,218,362)	79.6 (0.5)	— (—)	52.0 (0.4)	19.8 (0.1)	7.8 (—)
地方債証券	49,586,340 (49,586,340)	51,962,430 (51,962,430)	7.5 (7.5)	— (—)	3.9 (3.9)	1.9 (1.9)	1.7 (1.7)
特殊債券 (除く金融債)	47,779,985 (47,779,985)	50,574,790 (50,574,790)	7.3 (7.3)	— (—)	4.9 (4.9)	1.7 (1.7)	0.7 (0.7)
金融債券	5,400,000 (5,400,000)	5,409,371 (5,409,371)	0.8 (0.8)	— (—)	— (—)	0.6 (0.6)	0.2 (0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	27,307,000 (27,307,000)	28,140,706 (28,140,706)	4.1 (4.1)	— (—)	1.9 (1.9)	1.7 (1.7)	0.5 (0.5)
合計	631,157,325 (132,433,325)	684,605,771 (139,305,660)	99.4 (20.2)	— (—)	62.7 (11.1)	25.7 (5.9)	11.0 (3.2)

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

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (2年) 第366回	0.1	4,000,000	4,008,840	2018/7/15
国庫債券	利付 (2年) 第368回	0.1	1,500,000	1,503,750	2018/9/15
国庫債券	利付 (2年) 第369回	0.1	1,500,000	1,504,110	2018/10/15
国庫債券	利付 (2年) 第372回	0.1	5,000,000	5,016,350	2019/1/15
国庫債券	利付 (5年) 第114回	0.3	1,500,000	1,507,605	2018/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第115回	0.2	7,300,000	7,327,959	2018/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第116回	0.2	8,100,000	8,137,341	2018/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第117回	0.2	5,900,000	5,931,683	2019/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第118回	0.2	5,000,000	5,029,800	2019/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第119回	0.1	4,700,000	4,718,659	2019/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第120回	0.2	5,500,000	5,536,300	2019/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第121回	0.1	3,500,000	3,515,260	2019/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第122回	0.1	7,800,000	7,836,894	2019/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第123回	0.1	7,300,000	7,337,960	2020/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第124回	0.1	5,100,000	5,128,968	2020/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第125回	0.1	8,200,000	8,250,512	2020/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第126回	0.1	5,500,000	5,536,520	2020/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第127回	0.1	6,000,000	6,043,800	2021/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第128回	0.1	6,200,000	6,247,058	2021/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第129回	0.1	6,000,000	6,048,420	2021/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第130回	0.1	5,000,000	5,045,050	2021/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第131回	0.1	2,000,000	2,017,560	2022/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第1回	2.4	1,960,000	2,816,931	2048/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第2回	2.2	900,000	1,248,894	2049/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第3回	2.2	900,000	1,252,827	2050/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第4回	2.2	1,300,000	1,814,787	2051/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第5回	2.0	1,300,000	1,742,949	2052/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第6回	1.9	1,300,000	1,706,848	2053/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第7回	1.7	1,400,000	1,752,716	2054/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第8回	1.4	1,500,000	1,733,205	2055/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第9回	0.4	2,200,000	1,821,292	2056/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第10回	0.9	400,000	393,660	2057/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第297回	1.4	1,100,000	1,124,530	2018/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第298回	1.3	1,500,000	1,531,215	2018/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第299回	1.3	1,400,000	1,434,118	2019/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第300回	1.5	1,000,000	1,027,840	2019/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第301回	1.5	1,500,000	1,547,700	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第302回	1.4	700,000	720,867	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第303回	1.4	3,300,000	3,410,880	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第304回	1.3	1,000,000	1,031,360	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第305回	1.3	4,100,000	4,242,434	2019/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第306回	1.4	3,000,000	3,122,370	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第307回	1.3	1,700,000	1,764,702	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第308回	1.3	1,700,000	1,770,414	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第309回	1.1	3,000,000	3,106,320	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第310回	1.0	3,700,000	3,830,240	2020/9/20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (10年) 第311回	0.8	1,800,000	1,851,678	2020/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第312回	1.2	4,950,000	5,172,304	2020/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第313回	1.3	3,200,000	3,365,888	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第314回	1.1	2,200,000	2,297,570	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第315回	1.2	3,600,000	3,784,896	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第316回	1.1	1,400,000	1,466,304	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第317回	1.1	1,800,000	1,890,270	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第318回	1.0	3,200,000	3,346,880	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第319回	1.1	1,850,000	1,948,253	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第320回	1.0	3,500,000	3,670,135	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第321回	1.0	3,200,000	3,363,328	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第322回	0.9	2,400,000	2,511,096	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第323回	0.9	2,700,000	2,830,950	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第324回	0.8	3,200,000	3,339,200	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第325回	0.8	4,900,000	5,122,656	2022/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第326回	0.7	2,100,000	2,187,822	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第327回	0.8	3,100,000	3,246,692	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第328回	0.6	5,500,000	5,708,725	2023/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第329回	0.8	5,300,000	5,571,996	2023/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第330回	0.8	3,800,000	4,002,008	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第331回	0.6	1,900,000	1,977,235	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第332回	0.6	3,400,000	3,543,752	2023/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第333回	0.6	4,000,000	4,175,600	2024/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第334回	0.6	4,100,000	4,285,238	2024/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第335回	0.5	3,700,000	3,842,191	2024/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第336回	0.5	2,700,000	2,806,272	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第337回	0.3	3,700,000	3,790,169	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第338回	0.4	4,900,000	5,057,388	2025/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第339回	0.4	5,900,000	6,090,806	2025/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第340回	0.4	6,000,000	6,195,060	2025/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第341回	0.3	7,200,000	7,376,976	2025/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第342回	0.1	7,500,000	7,555,575	2026/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第343回	0.1	6,900,000	6,949,473	2026/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第344回	0.1	5,800,000	5,840,078	2026/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第345回	0.1	6,800,000	6,845,016	2026/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第346回	0.1	5,800,000	5,833,698	2027/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第1回	2.8	100,000	132,237	2029/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第2回	2.4	200,000	256,044	2030/2/20
国庫債券	利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	203,400	2030/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第4回	2.9	900,000	1,221,165	2030/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	190,567	2031/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第6回	2.4	700,000	913,031	2031/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第7回	2.3	600,000	776,670	2032/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	122,542	2032/11/22
国庫債券	利付 (30年) 第9回	1.4	65,000	75,747	2032/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	280,045	2033/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第11回	1.7	160,000	194,164	2033/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第12回	2.1	220,000	280,871	2033/9/20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	366,003	2033/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	1,062,568	2034/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第15回	2.5	900,000	1,211,157	2034/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第16回	2.5	915,000	1,233,767	2034/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第17回	2.4	1,200,000	1,600,044	2034/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第18回	2.3	1,500,000	1,976,775	2035/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第19回	2.3	1,600,000	2,111,776	2035/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第20回	2.5	1,900,000	2,575,944	2035/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第21回	2.3	1,400,000	1,851,472	2035/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	815,298	2036/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	1,143,164	2036/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	954,037	2036/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	663,325	2036/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,145,188	2037/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第27回	2.5	1,550,000	2,123,562	2037/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第28回	2.5	700,000	962,976	2038/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第29回	2.4	1,500,000	2,041,230	2038/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第30回	2.3	900,000	1,210,428	2039/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第31回	2.2	1,600,000	2,125,152	2039/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第32回	2.3	1,900,000	2,571,821	2040/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第33回	2.0	2,000,000	2,586,800	2040/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第34回	2.2	2,300,000	3,080,459	2041/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	2,987,631	2041/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第36回	2.0	1,800,000	2,342,700	2042/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第37回	1.9	2,300,000	2,945,633	2042/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第38回	1.8	1,400,000	1,762,684	2043/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第39回	1.9	1,600,000	2,053,712	2043/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第40回	1.8	1,100,000	1,386,627	2043/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第41回	1.7	1,000,000	1,237,240	2043/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第42回	1.7	1,200,000	1,485,264	2044/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,609,660	2044/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,734,124	2044/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第45回	1.5	1,900,000	2,260,772	2044/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第46回	1.5	1,800,000	2,141,874	2045/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第47回	1.6	1,900,000	2,308,234	2045/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第48回	1.4	1,400,000	1,631,042	2045/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第49回	1.4	1,800,000	2,096,748	2045/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第50回	0.8	1,900,000	1,917,917	2046/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第51回	0.3	2,400,000	2,107,728	2046/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第52回	0.5	2,000,000	1,860,020	2046/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第53回	0.6	2,400,000	2,290,944	2046/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第54回	0.8	1,700,000	1,710,268	2047/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第40回	2.3	525,000	540,618	2018/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第41回	1.5	255,000	262,099	2019/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第42回	2.6	683,000	715,046	2019/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第43回	2.9	400,000	426,836	2019/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第44回	2.5	150,000	160,638	2020/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第45回	2.4	242,000	258,499	2020/ 3 /20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第46回	2.2	90,000	96,176	2020/6/22
国庫債券	利付 (20年) 第47回	2.2	1,230,000	1,321,044	2020/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第48回	2.5	200,000	218,046	2020/12/21
国庫債券	利付 (20年) 第49回	2.1	200,000	216,422	2021/3/22
国庫債券	利付 (20年) 第50回	1.9	183,000	196,653	2021/3/22
国庫債券	利付 (20年) 第51回	2.0	310,000	335,785	2021/6/21
国庫債券	利付 (20年) 第52回	2.1	100,000	109,271	2021/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第53回	2.1	250,000	274,467	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第54回	2.2	250,000	275,592	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第55回	2.0	231,000	253,771	2022/3/21
国庫債券	利付 (20年) 第56回	2.0	120,000	132,422	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第57回	1.9	210,000	230,687	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第58回	1.9	180,000	198,581	2022/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第59回	1.7	230,000	252,344	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第60回	1.4	780,000	842,899	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第61回	1.0	300,000	318,288	2023/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	462,721	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	333,507	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	448,928	2023/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	512,889	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	336,216	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	350,827	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	334,071	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	641,317	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	632,269	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	231,372	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第72回	2.1	670,000	773,762	2024/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第73回	2.0	1,600,000	1,842,960	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第74回	2.1	1,300,000	1,507,155	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	698,496	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	1,045,289	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	809,487	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	922,080	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	998,107	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第80回	2.1	900,000	1,051,722	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	419,295	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	961,810	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,613,421	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,403,040	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	472,928	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第86回	2.3	1,400,000	1,679,678	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	595,525	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,325,489	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	562,129	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,800,615	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	302,405	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第92回	2.1	1,550,000	1,853,459	2026/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	356,997	2027/3/20

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94回	2.1	200,000	239,938	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第95回	2.3	700,000	856,884	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	481,696	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第97回	2.2	1,300,000	1,583,816	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	362,442	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第99回	2.1	2,100,000	2,545,032	2027/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第100回	2.2	1,520,000	1,863,854	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	312,042	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第102回	2.4	500,000	626,295	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	744,618	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	487,708	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,323,491	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	493,604	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第107回	2.1	300,000	368,127	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,925,904	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	1,086,579	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第110回	2.1	1,100,000	1,353,528	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第111回	2.2	800,000	996,576	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,221,038	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第113回	2.1	2,500,000	3,093,150	2029/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第114回	2.1	2,500,000	3,101,250	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第115回	2.2	1,500,000	1,879,155	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,380,852	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第117回	2.1	1,900,000	2,361,377	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	616,625	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	966,256	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	945,320	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第121回	1.9	2,000,000	2,446,280	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第122回	1.8	1,100,000	1,331,220	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第123回	2.1	2,000,000	2,503,900	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第124回	2.0	1,000,000	1,238,790	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第125回	2.2	900,000	1,141,317	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第126回	2.0	1,000,000	1,241,390	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第127回	1.9	800,000	982,408	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第128回	1.9	1,500,000	1,844,370	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第129回	1.8	800,000	972,792	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第130回	1.8	1,600,000	1,948,944	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	963,424	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,565,681	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,706,908	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第134回	1.8	1,400,000	1,709,526	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第135回	1.7	400,000	482,748	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	834,267	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,207,670	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	943,056	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第139回	1.6	700,000	835,275	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第140回	1.7	3,000,000	3,627,780	2032/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第141回	1.7	1,700,000	2,058,258	2032/12/20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第142回	1.8	1,250,000	1,531,975	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第143回	1.6	2,000,000	2,392,380	2033/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第144回	1.5	1,500,000	1,771,725	2033/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第145回	1.7	2,600,000	3,152,760	2033/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第146回	1.7	2,900,000	3,517,642	2033/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第147回	1.6	2,700,000	3,233,574	2033/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第148回	1.5	2,500,000	2,954,400	2034/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第149回	1.5	2,600,000	3,074,370	2034/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第150回	1.4	2,930,000	3,413,420	2034/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第151回	1.2	2,700,000	3,052,971	2034/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第152回	1.2	3,200,000	3,617,856	2035/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第153回	1.3	3,450,000	3,957,633	2035/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第154回	1.2	3,500,000	3,952,340	2035/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第155回	1.0	2,800,000	3,060,176	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第156回	0.4	2,900,000	2,852,759	2036/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第157回	0.2	3,900,000	3,684,369	2036/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第158回	0.5	2,800,000	2,790,200	2036/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第159回	0.6	3,000,000	3,037,080	2036/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第160回	0.7	3,300,000	3,397,152	2037/ 3 /20
メキシコ合衆国 第22回円貨社債 (2016)		0.7	300,000	300,666	2021/ 6 /16
ポーランド共和国 第15回円貨債券 (2013)		0.91	100,000	100,765	2020/11/13
小 計			501,084,000	548,518,473	
地方債証券					
東京都	公募第664回	1.4	100,000	102,048	2018/12/20
東京都	公募第668回	1.54	200,000	205,296	2019/ 3 /20
東京都	公募第671回	1.42	100,000	102,770	2019/ 6 /20
東京都	公募第685回	1.13	100,000	103,257	2020/ 6 /19
東京都	公募第690回	1.29	200,000	208,640	2020/12/18
東京都	公募第703回	0.99	100,000	104,216	2021/12/20
東京都	公募第707回	0.87	100,000	103,850	2022/ 3 /18
東京都	公募第708回	0.89	100,000	104,133	2022/ 6 /20
東京都	公募第710回	0.81	100,000	103,734	2022/ 6 /20
東京都	公募第712回	0.77	100,000	103,686	2022/ 9 /20
東京都	公募第715回	0.76	100,000	103,777	2022/12/20
東京都	公募第716回	0.77	200,000	207,664	2022/12/20
東京都	公募 (30年) 第 7 回	2.51	100,000	133,604	2038/ 9 /17
東京都	公募第10回	2.31	200,000	260,762	2039/ 9 /20
東京都	公募 (7 年) 第 3 回	0.58	100,000	100,704	2018/ 9 /20
東京都	公募第 1 回	1.54	300,000	326,226	2023/ 6 /20
東京都	公募 (20年) 第 3 回	2.26	100,000	114,652	2024/ 3 /19
東京都	公募第 7 回	2.16	100,000	116,557	2025/ 9 /19
東京都	公募 (20年) 第16回	2.01	200,000	239,072	2028/12/20
東京都	公募 (20年) 第17回	2.09	200,000	240,856	2028/12/20
東京都	公募第23回	2.12	100,000	122,898	2030/12/20
東京都	公募 (20年) 第26回	1.74	100,000	118,615	2032/ 6 /18
北海道	公募平成20年度第 7 回	1.72	300,000	306,366	2018/ 9 /25
北海道	公募平成21年度第 6 回	1.6	100,000	103,379	2019/ 8 /28
北海道	公募平成21年度第10回	1.5	100,000	103,522	2019/11/27

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	
北海道	公募平成24年度第6回	0.84	100,000	103,902	2022/8/31
北海道	公募平成24年度第9回	0.79	100,000	103,760	2022/10/31
北海道	公募平成25年度第1回	0.58	300,000	308,508	2023/4/26
北海道	公募（5年）平成25年度第8回	0.31	100,000	100,346	2018/9/25
北海道	公募（5年）平成26年度第8回	0.178	200,000	200,596	2019/9/25
北海道	公募（5年）平成26年度第10回	0.147	100,000	100,235	2019/11/28
北海道	公募平成27年度第7回	0.529	100,000	103,022	2025/8/28
北海道	公募平成28年度第13回	0.02	200,000	199,494	2022/1/31
宮城県	公募（5年）第9回1号	0.35	500,000	501,775	2018/7/26
神奈川県	公募第156回	1.66	101,000	103,058	2018/9/20
神奈川県	公募第184回	1.02	100,000	103,820	2021/6/18
神奈川県	公募第188回	1.05	200,000	209,302	2022/3/18
神奈川県	公募第196回	0.678	100,000	103,417	2023/3/20
神奈川県	公募第200回	0.825	100,000	104,565	2023/9/20
神奈川県	公募第205回	0.664	100,000	103,845	2024/3/19
神奈川県	公募第206回	0.654	100,000	103,884	2024/6/20
神奈川県	公募第210回	0.451	200,000	204,994	2024/12/20
神奈川県	公募（30年）第3回	2.62	100,000	134,574	2037/3/19
神奈川県	公募第7回	2.22	300,000	357,726	2027/3/19
大阪府	公募第320回	1.84	400,000	410,280	2018/11/27
大阪府	公募第337回	1.44	200,000	207,880	2020/4/28
大阪府	公募第346回	1.25	100,000	104,240	2021/1/28
大阪府	公募第356回	1.06	100,000	104,455	2021/12/27
大阪府	公募第378回	0.7	104,000	107,989	2023/11/28
大阪府	公募第381回	0.683	100,000	103,871	2024/2/27
大阪府	公募第382回	0.674	100,000	103,856	2024/3/28
大阪府	公募第383回	0.695	100,000	104,044	2024/4/26
大阪府	公募第384回	0.67	100,000	103,889	2024/5/29
大阪府	公募第387回	0.521	300,000	308,676	2024/8/28
大阪府	公募第389回	0.53	100,000	102,952	2024/10/30
大阪府	公募第5回	2.16	100,000	122,262	2030/5/28
大阪府	公募第8回	1.83	100,000	118,987	2031/12/22
大阪府	公募第98回	0.295	200,000	200,656	2018/9/27
大阪府	公募（5年）第99回	0.24	240,000	240,648	2018/10/30
大阪府	公募（5年）第101回	0.23	148,000	148,412	2018/12/26
大阪府	公募第102回	0.223	100,000	100,286	2019/1/30
大阪府	公募（5年）第130回	0.001	600,000	598,374	2021/5/28
大阪府	公募（5年）第137回	0.001	1,024,000	1,020,088	2022/4/27
京都府	公募平成20年度第3回	1.57	140,000	143,207	2018/12/19
京都府	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	104,180	2022/6/20
京都府	公募平成24年度第6回	0.8	100,000	103,849	2022/10/21
京都府	公募平成26年度第5回	1.455	100,000	114,445	2034/8/10
京都府	公募平成26年度第7回	0.564	200,000	206,524	2024/9/19
兵庫県	公募平成20年度第12回	1.82	100,000	102,541	2018/11/27
兵庫県	公募平成20年度第16回	1.6	100,000	102,469	2019/1/23
兵庫県	公募平成21年度第13回	1.48	100,000	102,954	2019/7/17
兵庫県	公募平成21年度第25回	1.54	100,000	103,591	2019/11/20
兵庫県	公募平成22年度第1回	1.46	100,000	103,951	2020/4/16

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（30年）第2回	2.36	100,000	131,270	2040/3/19
兵庫県	公募（15年）第1回	1.66	300,000	340,215	2026/7/29
兵庫県	公募（15年）第3回	1.35	100,000	110,791	2027/7/16
兵庫県	公募（12年）第3回	0.56	300,000	309,741	2025/4/16
兵庫県	公募第2回	2.37	100,000	121,192	2027/9/17
兵庫県	公募第9回	2.25	100,000	122,891	2029/11/19
兵庫県	公募（20年）第14回	1.72	100,000	117,678	2032/5/24
静岡県	公募平成21年度第2回	1.65	100,000	103,230	2019/6/25
静岡県	公募平成21年度第7回	1.54	100,000	103,637	2019/11/25
静岡県	公募平成24年度第5回	0.849	100,060	104,002	2022/7/20
静岡県	公募平成24年度第10回	0.678	100,000	103,420	2023/3/22
静岡県	公募平成25年度第5回	0.926	101,000	106,145	2023/7/25
静岡県	公募平成26年度第3回	0.679	165,000	171,631	2024/5/27
静岡県	公募平成26年度第8回	0.564	100,000	103,270	2024/9/25
静岡県	公募平成26年度第9回	0.554	200,000	206,464	2024/10/24
静岡県	公募平成27年度第11回	0.11	115,400	114,901	2026/3/19
静岡県	公募平成28年度第2回	0.08	300,000	297,930	2026/3/19
静岡県	公募（20年）第11回	1.841	100,000	118,990	2030/10/18
静岡県	公募（20年）第14回	1.736	100,000	118,392	2032/6/18
愛知県	公募平成20年度第7回	1.39	210,000	214,571	2019/1/30
愛知県	公募平成20年度第8回	2.04	100,000	119,737	2028/12/20
愛知県	公募平成20年度第10回	1.48	100,000	102,553	2019/3/27
愛知県	公募平成21年度第3回	1.66	114,000	117,710	2019/6/26
愛知県	公募平成21年度第17回	1.41	100,000	103,670	2020/2/26
愛知県	公募平成22年度第3回	1.364	100,000	103,846	2020/5/28
愛知県	公募平成22年度第9回	1.153	100,000	103,573	2020/9/30
愛知県	公募平成23年度第19回	1.006	100,000	104,397	2022/2/28
愛知県	公募平成24年度第2回	0.982	100,000	104,430	2022/4/27
愛知県	公募（20年）平成24年度第4回	1.687	100,000	117,681	2032/6/11
愛知県	公募（15年）平成24年度第14回	1.314	400,000	445,520	2027/12/13
愛知県	公募平成24年度第17回	1.829	100,000	120,049	2033/2/8
愛知県	公募平成26年度第8回	1.814	100,000	121,299	2044/6/20
愛知県	公募平成26年度第13回	1.363	100,000	112,818	2034/11/14
愛知県	公募平成27年度第15回	0.471	100,000	102,673	2025/11/27
広島県	公募平成20年度第3回	1.6	300,000	305,952	2018/9/25
広島県	公募平成22年度第6回	1.26	200,000	208,608	2021/1/25
広島県	公募平成24年度第4回	0.81	100,000	103,950	2022/11/28
広島県	公募平成25年度第3回	0.8	200,000	208,838	2023/9/25
広島県	公募（5年）平成25年度第6回	0.21	300,000	300,879	2019/2/25
広島県	公募平成26年度第5回	0.33	109,650	111,383	2025/1/27
埼玉県	公募平成21年度第5回	1.41	100,000	103,103	2019/9/25
埼玉県	公募平成22年度第2回	1.37	200,000	207,712	2020/5/26
埼玉県	公募平成24年度第4回	0.84	300,000	311,715	2022/7/25
埼玉県	公募平成25年度第4回	0.921	100,000	105,063	2023/7/24
埼玉県	公募平成25年度第6回	0.806	148,000	154,602	2023/9/27
埼玉県	公募（5年）平成25年度第7回	0.261	100,000	100,309	2018/10/25
埼玉県	公募平成25年度第10回	0.67	100,000	103,852	2024/2/26
埼玉県	公募平成25年度第11回	0.655	100,000	103,795	2024/3/26

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26年度第3回	0.67	100,000	103,947	2024/5/20
埼玉県	公募平成26年度第6回	0.554	200,000	206,398	2024/9/26
埼玉県	公募平成26年度第7回	0.476	400,000	410,748	2024/12/25
埼玉県	公募平成26年度第9回	0.429	100,000	102,312	2025/2/25
福岡県	公募平成22年度第5回	0.94	100,000	102,932	2020/10/28
福岡県	公募平成23年度第5回	1.02	100,000	104,158	2021/10/25
福岡県	公募平成26年度第4回	0.135	100,000	100,223	2019/9/26
福岡県	公募平成23年度第1回	1.491	100,000	112,145	2026/11/27
福岡県	公募（30年）平成19年度第1回	2.62	100,000	135,010	2037/9/18
福岡県	公募（30年）平成26年度第1回	1.827	100,000	121,719	2044/6/20
福岡県	公募（20年）平成20年度第2回	2.05	100,000	119,848	2028/12/20
福岡県	公募（20年）平成24年度第2回	1.635	100,000	116,972	2032/8/16
千葉県	公募平成20年度第6回	1.64	200,000	204,320	2018/10/25
千葉県	公募平成21年度第1回	1.53	100,000	102,750	2019/4/25
千葉県	公募平成21年度第11回	1.42	180,000	186,406	2020/1/24
千葉県	公募平成24度第1回	1.05	100,000	104,753	2022/4/25
千葉県	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	104,121	2022/5/25
千葉県	公募平成24年度第7回	0.74	100,000	103,615	2022/12/22
千葉県	公募平成24年度第8回	0.84	100,000	104,244	2023/1/25
千葉県	公募平成25年度第3回	0.89	100,000	104,807	2023/6/23
千葉県	公募平成25年度第4回	0.92	100,000	105,059	2023/7/25
千葉県	公募（20年）第8回	2.18	100,000	122,847	2030/4/19
千葉県	公募（20年）第17回	1.403	100,000	113,570	2034/10/13
新潟県	公募平成20年度第2回	1.52	200,000	205,018	2019/2/27
新潟県	公募平成21年度第2回	1.55	150,000	155,503	2019/11/27
長野県	公募平成25年度第1回	0.24	1,100,000	1,103,399	2018/12/25
群馬県	公募第8回	1.03	100,000	104,283	2021/11/25
群馬県	公募第12回	0.519	100,000	103,053	2025/8/15
群馬県	公募（5年）第4回	0.235	600,000	601,698	2018/11/22
群馬県	公募（20年）第3回	1.687	100,000	117,723	2032/6/25
岐阜県	公募平成26年度第1回	0.554	186,670	192,650	2024/9/30
大分県	公募平成23年度第1回	1.0	902,000	938,810	2021/10/29
共同発行市場地方債	公募第64回	1.78	262,000	267,025	2018/7/25
共同発行市場地方債	公募第65回	1.62	700,000	713,125	2018/8/24
共同発行市場地方債	公募第66回	1.55	181,000	184,464	2018/9/25
共同発行市場地方債	公募第68回	1.69	900,000	921,123	2018/11/22
共同発行市場地方債	公募第70回	1.42	110,000	112,427	2019/1/25
共同発行市場地方債	公募第74回	1.57	500,000	514,730	2019/5/24
共同発行市場地方債	公募第75回	1.64	310,000	319,951	2019/6/25
共同発行市場地方債	公募第82回	1.42	300,000	310,719	2020/1/24
共同発行市場地方債	公募第84回	1.38	500,000	518,445	2020/3/25
共同発行市場地方債	公募第85回	1.44	100,000	103,954	2020/4/24
共同発行市場地方債	公募第88回	1.17	100,000	103,447	2020/7/24
共同発行市場地方債	公募第89回	1.04	100,000	103,110	2020/8/25
共同発行市場地方債	公募第92回	1.03	110,000	113,643	2020/11/25
共同発行市場地方債	公募第93回	1.25	300,000	312,501	2020/12/25
共同発行市場地方債	公募第94回	1.24	300,000	312,696	2021/1/25
共同発行市場地方債	公募第96回	1.29	100,000	104,609	2021/3/25

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101回	1.05	300,000	312,369	2021/8/25
共同発行市場地方債	公募第102回	1.03	150,000	156,178	2021/9/24
共同発行市場地方債	公募第103回	1.0	100,000	104,071	2021/10/25
共同発行市場地方債	公募第104回	1.03	200,000	208,566	2021/11/25
共同発行市場地方債	公募第108回	1.01	200,000	208,960	2022/3/25
共同発行市場地方債	公募第110回	0.89	200,000	208,046	2022/5/25
共同発行市場地方債	公募第111回	0.89	200,000	208,180	2022/6/24
共同発行市場地方債	公募第112回	0.84	100,000	103,905	2022/7/25
共同発行市場地方債	公募第113回	0.77	800,000	828,656	2022/8/25
共同発行市場地方債	公募第114回	0.82	243,700	253,196	2022/9/22
共同発行市場地方債	公募第115回	0.8	100,000	103,857	2022/10/25
共同発行市場地方債	公募第116回	0.8	200,000	207,780	2022/11/25
共同発行市場地方債	公募第118回	0.84	100,000	104,244	2023/1/25
共同発行市場地方債	公募第119回	0.8	200,000	208,120	2023/2/24
共同発行市場地方債	公募第120回	0.68	300,000	310,302	2023/3/24
共同発行市場地方債	公募第121回	0.57	100,000	102,836	2023/4/25
共同発行市場地方債	公募第122回	0.62	400,000	412,644	2023/5/25
共同発行市場地方債	公募第124回	0.91	100,000	104,998	2023/7/25
共同発行市場地方債	公募第126回	0.81	100,000	104,482	2023/9/25
共同発行市場地方債	公募第128回	0.66	300,000	310,923	2023/11/24
共同発行市場地方債	公募第129回	0.71	100,000	104,012	2023/12/25
共同発行市場地方債	公募第130回	0.76	100,000	104,392	2024/1/25
共同発行市場地方債	公募第132回	0.66	100,000	103,827	2024/3/25
共同発行市場地方債	公募第136回	0.611	200,000	207,194	2024/7/25
共同発行市場地方債	公募第137回	0.566	200,000	206,560	2024/8/23
共同発行市場地方債	公募第139回	0.544	155,000	159,899	2024/10/25
共同発行市場地方債	公募第143回	0.448	540,000	553,262	2025/2/25
共同発行市場地方債	公募第145回	0.406	1,000,000	1,021,420	2025/4/25
共同発行市場地方債	公募第156回	0.1	100,000	99,481	2026/3/25
共同発行市場地方債	公募第157回	0.08	100,000	99,302	2026/4/24
堺市	公募平成22年度第1回	1.97	100,000	120,761	2030/11/19
堺市	公募平成26年度第1回	1.664	100,000	117,388	2044/9/20
島根県	公募平成22年度第1回	1.08	100,000	103,486	2020/11/26
島根県	公募平成25年度第3回	0.209	700,000	702,198	2019/3/25
島根県	公募平成28年度第3回	0.001	100,000	99,739	2021/11/25
福島県	公募平成26年度第1回	0.495	200,000	205,602	2024/11/28
滋賀県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	103,584	2023/11/29
滋賀県	公募平成26年度第1回	0.495	142,000	145,977	2024/11/28
栃木県	公募平成24年度第1回	0.79	100,000	103,846	2022/11/30
栃木県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	103,584	2023/11/29
新潟市	公募平成25年度第1回	0.72	233,200	242,709	2023/12/26
奈良県	公募平成28年度第1回	0.001	100,000	99,738	2021/11/30
浜松市	公募平成26年度第1回	0.335	100,000	101,616	2025/1/23
大阪市	公募平成20年度第3回	1.82	110,000	112,140	2018/7/23
大阪市	公募平成21年度第6回	1.57	100,000	103,709	2019/11/25
大阪市	公募平成25年度第6回	0.694	100,000	103,854	2023/11/22
大阪市	公募平成26年度第5回	0.593	100,000	103,481	2024/9/27
大阪市	公募（5年）平成28年度第5回	0.001	100,000	99,738	2021/11/30

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（15年）第1回	1.753	100,000	114,290	2026/7/17
大阪市	公募（20年）第5回	2.47	100,000	124,217	2028/9/21
大阪市	公募（20年）第6回	2.21	100,000	121,700	2028/12/20
大阪市	公募（20年）第17回	1.721	100,000	118,325	2032/12/21
名古屋市	公募第464回	1.61	300,000	305,925	2018/9/20
名古屋市	公募第469回	1.34	100,000	103,241	2019/12/20
名古屋市	公募第478回	1.063	100,000	104,713	2022/3/18
名古屋市	公募第481回	0.744	100,000	103,633	2022/12/20
名古屋市	公募第488回	0.598	300,000	310,524	2024/9/20
名古屋市	公募（12年）第1回	1.033	200,000	214,204	2025/6/20
名古屋市	公募（15年）第2回	0.905	100,000	106,918	2029/11/16
京都市	公募平成20年度第4回	1.54	200,000	205,078	2019/2/26
京都市	公募平成23年度第4回	1.067	100,000	104,520	2021/12/22
京都市	公募平成25年度第3回	0.312	100,000	100,363	2018/9/27
京都市	公募（20年）第2回	2.12	100,000	116,136	2025/9/19
京都市	公募（20年）第13回	1.359	100,000	112,773	2034/11/24
神戸市	公募平成21年度第7回	1.69	100,000	103,288	2019/6/20
神戸市	公募平成26年度第17回	0.28	300,000	303,612	2025/1/27
神戸市	公募平成28年度第1回	0.08	200,000	198,608	2026/4/17
横浜市	公募平成20年度第3回	1.56	100,000	101,852	2018/9/7
横浜市	公募公債平成20年度5回	1.58	200,000	204,620	2018/12/20
横浜市	公募平成21年度第4回	1.35	200,000	205,898	2019/9/20
横浜市	公募平成22年度第5回	1.265	100,000	104,172	2020/12/11
横浜市	公募公債平成24年度2回	0.815	200,000	207,842	2022/10/17
横浜市	公募公債平成25年度1回	0.664	200,000	206,826	2023/5/19
横浜市	公募公債平成25年度5回	0.655	200,000	207,196	2023/11/17
横浜市	公募公債平成26年度5回	0.471	200,000	205,276	2024/12/13
横浜市	公募平成28年度第5回	0.23	300,000	301,470	2027/2/19
横浜市	公募（20年）第26回	1.776	100,000	119,241	2033/1/28
横浜市	公募（20年）第30回	1.376	100,000	113,066	2034/10/20
札幌市	公募平成22年度第4回	1.05	100,000	102,987	2020/6/19
札幌市	公募（20年）平成24年度第11回	1.794	100,000	119,514	2033/2/28
札幌市	公募平成26年度第4回	0.54	100,000	103,092	2024/6/20
札幌市	公募平成26年度第9回	0.43	200,000	204,682	2024/12/20
川崎市	公募第81回	1.57	100,000	102,682	2019/3/20
川崎市	公募第82回	1.52	100,000	103,331	2019/9/20
川崎市	公募第85回	0.72	100,000	103,502	2022/12/20
川崎市	公募（20年）第17回	1.527	100,000	115,530	2033/5/9
北九州市	公募（5年）平成25年度第2回	0.312	100,000	100,363	2018/9/27
北九州市	公募（20年）第14回	1.732	100,000	118,450	2032/11/12
福岡市	公募（5年）平成25年度第2回	0.35	300,000	301,062	2018/7/25
福岡市	公募平成26年度第2回	1.49	100,000	115,071	2034/6/20
福岡市	公募平成26年度第5回	0.539	100,000	103,090	2024/10/28
福岡市	公募平成26年度第8回	0.465	160,000	164,177	2025/3/25
広島市	公募平成21年度第3回	1.34	100,000	103,259	2019/12/25
広島市	公募平成26年度第2回	0.456	100,000	102,538	2024/12/25
広島市	公募平成27年度第2回	0.464	500,000	513,190	2025/12/25
仙台市	公募平成25年度第1回	0.24	600,000	601,968	2019/1/29

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	
千葉県	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	104,753	2022/4/25
三重県	公募平成24年度第1回	0.801	140,660	146,093	2022/10/25
鹿児島県	公募（5年）平成25年度第1回	0.24	100,000	100,285	2018/10/31
鹿児島県	公募（5年）平成28年度第1回	0.001	100,000	99,743	2021/10/29
福井県	公募平成24年度第4回	0.46	100,000	102,198	2023/4/26
福井県	公募平成27年度第4回	0.085	200,000	198,690	2026/4/27
徳島県	公募平成22年度第1回	1.05	400,000	413,580	2020/11/30
山梨県	公募平成21年度第1回	1.37	100,000	103,129	2019/10/30
山梨県	公募平成24年度第1回	0.8	200,000	207,726	2022/10/28
岡山県	公募平成21年度第2回	1.39	100,000	103,738	2020/3/31
愛知県・名古屋市中区折半保証名古屋高速道路債券 第96回		2.34	100,000	121,390	2028/12/20
愛知県・名古屋市中区折半保証名古屋高速道路債券 第102回		2.298	300,000	366,462	2029/12/20
福岡北九州高速道路債券 第117回		2.26	100,000	120,049	2028/12/20
小 計			49,586,340	51,962,430	
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	209,888	2020/7/15
公営企業債券 政府保証15年第1回		1.6	300,000	314,490	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	409,116	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	205,690	2019/10/18
地方公共団体金融機構債券 政府保証第16回		1.0	100,000	103,247	2020/9/14
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回		0.839	194,000	202,087	2022/7/15
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回		0.801	100,000	104,043	2022/8/15
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回		0.819	101,000	105,248	2022/9/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回		0.791	102,000	106,209	2022/10/18
政保 地方公共団体金融機構債券 第42回		0.805	108,000	112,570	2022/11/14
政保 地方公共団体金融機構債券 第43回		0.734	202,000	209,902	2022/12/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第44回		0.834	145,000	151,593	2023/1/20
政保 地方公共団体金融機構債券 第45回		0.815	223,000	232,994	2023/2/17
政保 地方公共団体金融機構債券 第49回		0.882	13,000	13,661	2023/6/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回		0.911	100,000	105,329	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	302,565	2019/7/24
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回		0.669	116,000	120,992	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	301,917	2020/6/18
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回		0.544	100,000	103,520	2024/9/13
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回		0.539	400,000	413,956	2024/10/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回		0.414	320,000	328,384	2025/2/17
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回		0.509	189,000	195,378	2025/5/23
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回		0.381	509,000	521,139	2025/11/18
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回		0.02	116,000	115,138	2026/4/17
日本政策金融公庫債券 政府保証第22回		0.243	2,000,000	2,007,200	2018/10/26
新関西国際空港債券 政府保証第1回		0.801	151,000	157,150	2022/8/29
新関西国際空港債券 政府保証第2回		0.882	191,000	200,767	2023/6/27
日本政策投資銀行債券 政府保証第22回		2.2	100,000	112,979	2023/6/19
日本政策投資銀行社債 政府保証第5回		1.4	100,000	102,585	2019/4/15
日本政策投資銀行社債 政府保証第9回		1.0	141,000	145,578	2020/9/14
日本政策投資銀行社債 政府保証第16回		0.819	102,000	106,299	2022/9/20
日本政策投資銀行社債 政府保証第19回		0.668	140,000	145,188	2023/3/15
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6回		1.9	100,000	107,012	2021/2/26

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9回	1.9	100,000	107,160	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62回	1.7	100,000	101,909	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	348,529	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	102,333	2018/11/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第71回	1.4	100,000	102,151	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	244,206	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	244,454	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	310,344	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	246,856	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	415,328	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	244,886	2030/4/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第114回	1.9	200,000	240,310	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	127,938	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	461,322	2021/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第149回	1.0	140,000	146,248	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	104,126	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	145,874	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	122,686	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	104,227	2022/7/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第169回	1.634	100,000	117,575	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	226,887	2022/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第171回	1.56	100,000	116,527	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	374,286	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	208,474	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	208,254	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	207,874	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	900,000	940,914	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	119,129	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	201,938	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	413,660	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	1,000,000	1,051,210	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	285,442	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	312,837	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	142,714	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	150,971	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	115,470	2034/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第217回	1.72	100,000	120,390	2044/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第219回	1.478	100,000	116,746	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	104,226	2024/6/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第224回	1.72	100,000	120,433	2044/8/31
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	196,815	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	103,037	2024/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第239回	1.16	300,000	333,798	2035/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第271回	0.02	151,000	149,884	2026/3/31
首都高速道路債券	政府保証第8回	1.3	100,000	103,408	2020/1/20
阪神高速道路債券	政府保証第5回	1.3	100,000	103,628	2020/3/18
民間都市開発推進機構	政府保証第16回	0.699	360,000	375,094	2023/10/20
中部国際空港債券	政府保証第18回	0.668	368,000	381,685	2023/3/22

銘	柄	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	
預金保険機構債券 政府保証第209回		0.1	2,000,000	2,007,240	2020/12/11
新関西国際空港社債 財投機関債第12回		1.067	100,000	108,610	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	101,133	2019/6/20
日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回		0.781	300,000	311,310	2022/9/20
日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回		1.027	100,000	108,139	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	133,789	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	239,166	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17回		2.35	100,000	119,670	2026/9/18
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	242,518	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	294,212	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39回		2.37	100,000	122,849	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	124,179	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	104,737	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	418,344	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	208,452	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	118,040	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	103,172	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	412,856	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	120,437	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	301,071	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	206,032	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	205,602	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136回		0.583	200,000	206,354	2024/9/20
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	338,598	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	114,738	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	82,076	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	137,866	2034/6/20
公営企業債券 30年第4回財投機関債		2.95	100,000	138,202	2034/3/24
地方公営企業等金融機構債券 第1回		1.77	200,000	204,450	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	119,804	2028/12/20
地方公共団体金融機構債券 第1回		1.648	100,000	103,315	2019/6/28
地方公共団体金融機構債券 第2回		1.406	100,000	102,932	2019/7/26
地方公共団体金融機構債券 20年第4回		2.12	100,000	121,513	2029/12/28
地方公共団体金融機構債券 20年第6回		2.242	300,000	369,810	2030/3/28
地方公共団体金融機構債券 F24回		1.681	100,000	108,981	2023/3/17
地方公共団体金融機構債券 第13回		1.278	200,000	207,664	2020/6/26
地方公共団体金融機構債券 第16回		1.164	100,000	103,755	2020/9/28
地方公共団体金融機構債券 第27回		1.034	300,000	312,642	2021/8/27
地方公共団体金融機構債券 第28回		1.048	100,000	104,362	2021/9/28
地方公共団体金融機構債券 F104回		1.314	100,000	108,868	2025/3/7
地方公共団体金融機構債券 F106回		1.259	100,000	107,651	2024/3/19
地方公共団体金融機構債券 第37回		0.852	400,000	416,260	2022/6/28
地方公共団体金融機構債券 第41回		0.801	600,000	623,712	2022/10/28
地方公共団体金融機構債券 F142回		1.016	100,000	106,446	2024/11/28
地方公共団体金融機構債券 F144回		0.562	200,000	203,678	2020/10/28
地方公共団体金融機構債券 F145回		1.059	200,000	213,908	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券 第42回		0.801	100,000	104,014	2022/11/28
地方公共団体金融機構債券 第44回		0.791	100,000	103,802	2023/1/27

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	
地方公共団体金融機構債券	F 160回	1.052	100,000	108,191	2028/ 5 /26
地方公共団体金融機構債券	第51回	0.841	600,000	626,550	2023/ 8 /28
地方公共団体金融機構債券	第52回	0.801	300,000	314,292	2023/ 9 /15
地方公共団体金融機構債券	(15年) 第 2 回	1.161	200,000	219,180	2028/12/28
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第38回	1.487	100,000	114,832	2034/ 7 /28
地方公共団体金融機構債券	第64回	0.574	100,000	103,121	2024/ 9 /27
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第39回	1.425	100,000	113,708	2034/ 9 /28
地方公共団体金融機構債券	第79回	0.484	100,000	102,548	2025/12/26
公営企業債券 (20年)	第 2 回財投機関債	1.45	100,000	107,614	2022/12/20
公営企業債券 (20年)	第 5 回財投機関債	2.11	200,000	224,746	2023/ 9 /20
公営企業債券 (20年)	第25回財投機関債	2.5	100,000	123,884	2028/ 6 /20
首都高速道路社債	第12回	0.293	100,000	100,430	2018/12/20
首都高速道路社債	第13回	0.223	100,000	100,464	2019/ 9 /20
首都高速道路	第17回	0.03	200,000	200,000	2021/ 6 /18
阪神高速道路	第13回	0.18	100,000	100,368	2019/ 9 /20
阪神高速道路	第15回	0.01	200,000	199,974	2019/12/20
都市再生債券	財投機関債第21回	1.72	300,000	306,420	2018/ 9 /20
都市再生債券	財投機関債第55回	1.074	100,000	104,441	2021/ 9 /17
都市再生債券	財投機関債第97回	1.017	100,000	108,021	2029/ 9 /20
本州四国連絡橋債券	財投機関債第 7 回	2.26	100,000	116,622	2025/ 6 /20
東京交通債券	第342回	2.4	200,000	222,264	2022/ 6 /21
東京交通債券	第347回	2.05	157,000	176,579	2024/ 3 / 8
関西国際空港社債	財投機関債第26回	1.156	300,000	310,887	2020/ 9 /18
関西国際空港社債	財投機関債第32回	1.164	100,000	104,645	2021/ 9 /17
福祉医療機構債券	第31回財投機関債	0.93	100,000	104,436	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	239,476	2027/ 3 /19
住宅金融支援機構債券	財投機関債第18回	2.15	100,000	112,621	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	307,473	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	103,733	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	113,695	2025/ 3 /19
住宅金融支援機構債券	財投機関債第59回	1.95	100,000	120,163	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	104,885	2021/ 6 /18
住宅金融支援機構債券	財投機関債第75回	2.066	100,000	122,137	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	341,703	2026/ 6 /19
住宅金融支援機構債券	財投機関債第78回	2.056	100,000	122,051	2031/ 7 /11
住宅金融支援機構債券	財投機関債第79回	1.069	100,000	104,420	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	208,644	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	226,294	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	129,841	2042/ 9 /19
成田国際空港	第13回一般担保付	0.802	200,000	207,198	2023/ 2 / 8
成田国際空港	第17回	0.489	200,000	204,362	2025/ 2 /20
沖縄振興開発金融公庫債券	財投機関債第17回	1.208	100,000	104,777	2021/ 6 /18
国際協力機構債券	第 6 回財投機関債	2.098	100,000	122,191	2030/12/13
東日本高速道路	第26回	0.305	100,000	100,578	2019/ 6 /20
東日本高速道路	第27回	0.248	100,000	100,464	2019/ 6 /20
東日本高速道路	第34回	0.225	100,000	100,728	2021/ 3 /19
東日本高速道路	第36回	0.06	200,000	200,238	2021/ 6 /18
中日本高速道路社債	第32回	0.64	200,000	201,584	2018/ 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44回		0.536	100,000	101,167	2019/9/20
中日本高速道路社債 第61回		0.262	100,000	100,727	2020/6/2
中日本高速道路 第62回		0.225	200,000	201,230	2020/9/18
中日本高速道路 第63回		0.576	100,000	102,849	2025/11/13
中日本高速道路 第66回		0.03	1,200,000	1,198,200	2021/9/28
西日本高速道路 第20回		0.759	200,000	207,280	2023/9/20
西日本高速道路 第23回		0.602	100,000	102,950	2024/6/20
西日本高速道路 第30回		0.17	300,000	298,164	2026/5/22
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第35回		1.165	200,000	207,452	2020/9/18
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第68回		0.586	200,000	206,434	2024/8/5
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回		1.441	100,000	114,036	2034/8/4
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第97回		0.001	100,000	99,992	2019/3/20
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券		1.94	13,063	13,429	2037/6/10
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券		1.69	44,307	45,617	2038/9/10
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券		1.8	78,975	81,810	2039/6/10
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券		1.43	81,186	82,856	2038/2/10
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券		1.76	50,463	52,613	2036/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券		2.34	58,098	61,748	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券		2.25	17,675	18,746	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券		1.84	39,406	41,200	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	44,672	47,235	2041/3/10
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券		1.69	48,030	49,708	2039/2/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券		1.69	84,292	87,731	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券		2.12	84,795	88,934	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券		2.3	75,556	80,424	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券		1.99	132,948	140,535	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券		2.14	21,679	22,953	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	32,441	35,226	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	108,264	116,116	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	27,182	28,155	2032/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券		1.43	114,380	120,195	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	55,380	57,493	2032/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券		1.79	143,343	152,638	2046/2/10
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券		1.51	103,800	109,514	2046/9/10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券		2.34	60,286	65,382	2044/5/10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券		1.89	136,953	146,450	2046/5/10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券		1.36	146,907	153,467	2045/9/10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券		1.21	189,672	197,928	2047/7/10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券		1.34	186,303	195,409	2047/5/10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券		1.26	120,636	126,193	2047/6/10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券		1.64	49,177	52,124	2046/8/10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券		1.6	111,334	117,899	2045/12/10
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券		1.07	62,458	64,872	2048/12/10
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券		1.07	133,448	138,679	2049/2/10
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券		1.08	63,448	65,894	2048/5/10
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券		1.87	34,262	35,699	2039/9/10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券		1.25	185,955	194,719	2048/3/10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券		1.88	39,805	42,501	2045/2/10

銘	柄	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34回住宅金融支援機構債券		1.86	41,229	44,000	2045/3/10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券		1.87	42,443	45,164	2045/4/10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券		1.85	48,216	51,471	2046/3/10
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券		1.41	121,408	127,784	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券		1.42	176,124	185,395	2047/1/10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券		1.44	58,429	61,558	2047/2/10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券		1.21	119,338	124,733	2048/9/10
貸付債権担保 S 種第3回住宅金融公庫債券		1.82	16,525	17,242	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	123,705	127,816	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	50,134	51,745	2032/5/10
貸付債権担保第1回住宅金融公庫債券		1.75	21,978	22,205	2036/3/10
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券		1.82	46,484	47,230	2037/8/10
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券		2.25	115,984	125,382	2044/4/10
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券		1.82	115,500	123,066	2045/1/10
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券		1.52	233,675	245,566	2045/8/10
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券		1.4	122,758	129,140	2047/3/10
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券		1.16	199,476	207,690	2047/9/10
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券		1.07	182,874	189,781	2048/4/10
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券		1.3	136,798	143,875	2048/6/10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券		1.26	118,680	124,369	2048/8/10
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券		1.04	279,608	290,140	2049/4/10
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券		1.01	489,951	507,662	2049/5/10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券		0.93	72,639	74,944	2049/9/10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券		0.95	74,711	77,180	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券		0.87	75,572	77,713	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券		0.74	155,646	159,183	2050/1/10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券		0.6	161,272	163,457	2050/2/10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券		0.8	83,803	86,027	2050/3/10
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券		0.74	86,946	88,935	2050/5/10
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券		0.83	258,846	266,287	2050/6/10
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券		0.9	262,674	271,444	2050/7/10
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券		0.88	176,000	181,624	2050/8/10
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券		0.84	87,514	90,069	2050/9/10
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券		0.89	88,394	91,275	2050/10/10
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券		0.41	294,183	294,212	2051/12/10
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券		0.48	196,846	198,023	2052/1/10
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券		0.46	197,402	198,193	2052/2/10
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券		0.47	99,141	99,705	2052/3/10
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券		0.46	198,648	199,577	2052/4/10
貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券		0.4	99,852	99,801	2052/5/10
貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券		0.43	100,000	100,151	2052/6/10
フランス預金供託公庫 第4回円貨債券 (2014)		0.725	100,000	102,195	2024/7/30
韓国産業銀行 第45回円貨社債 (2014)		0.69	100,000	100,718	2019/1/29
小	計		47,779,985	50,574,790	
金融債券					
農林債券	利付第759回い号	0.4	100,000	100,448	2018/8/27
農林債券	利付第760回い号	0.4	100,000	100,480	2018/9/27
農林債券	利付第761回い号	0.3	100,000	100,376	2018/10/26

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	
農林債券	利付第764回い号	0.35	100,000	100,526	2019/ 1 /25	
農林債券	利付第765回い号	0.3	300,000	301,413	2019/ 2 /27	
農林債券	利付第767回い号	0.3	300,000	301,548	2019/ 4 /26	
農林債券	利付第773回い号	0.24	300,000	301,398	2019/10/25	
農林債券	利付第777回い号	0.25	300,000	301,689	2020/ 2 /27	
農林債券	利付第781回い号	0.28	100,000	100,720	2020/ 6 /26	
しんきん中金債券	利付第284回	0.4	100,000	100,416	2018/ 7 /27	
しんきん中金債券	利付第286回	0.35	100,000	100,417	2018/ 9 /27	
しんきん中金債券	利付第287回	0.3	100,000	100,376	2018/10/26	
しんきん中金債券	利付第290回	0.3	100,000	100,446	2019/ 1 /25	
しんきん中金債券	利付第302回	0.2	100,000	100,415	2020/ 1 /27	
しんきん中金債券	利付第308回	0.25	100,000	100,580	2020/ 7 /27	
しんきん中金債券	利付第316回	0.07	100,000	100,037	2021/ 3 /26	
しんきん中金債券	利付第317回	0.06	800,000	800,000	2021/ 4 /27	
商工債券	利付（3年）第202回	0.01	1,100,000	1,098,922	2019/11/27	
商工債券	利付（3年）第203回	0.02	1,100,000	1,099,164	2019/12/27	
小 計				5,400,000	5,409,371	
普通社債券(含む投資法人債券)						
東京電力	第455回	2.075	200,000	204,862	2018/10/23	
東京電力	第459回	2.7	100,000	103,867	2019/ 1 /29	
東京電力	第547回	1.948	100,000	104,699	2020/ 7 /24	
東京電力	第548回	2.347	100,000	114,866	2028/ 9 /29	
東京電力	第559回	1.377	100,000	102,360	2019/10/29	
東京電力	第560回	2.114	100,000	112,981	2029/12/10	
東京電力	第565回	1.313	300,000	308,085	2020/ 6 /24	
中部電力	第482回	2.17	200,000	208,046	2019/ 6 /25	
中部電力	第500回	0.875	200,000	207,936	2024/ 5 /24	
中部電力	第524回	0.39	100,000	100,034	2027/ 5 /25	
関西電力	第469回	1.7	100,000	102,035	2018/10/25	
関西電力	第482回	1.189	100,000	102,902	2020/ 7 /24	
関西電力	第484回	0.976	100,000	102,408	2020/10/23	
関西電力	第496回	0.908	100,000	103,784	2025/ 2 /25	
関西電力	第497回	1.002	200,000	209,164	2025/ 6 /20	
関西電力	第498回	0.416	200,000	201,068	2020/ 9 /18	
中国電力	第330回	2.1	100,000	107,223	2021/ 3 /25	
中国電力	第377回	1.121	200,000	210,656	2023/ 8 /25	
中国電力	第378回	1.004	100,000	104,740	2023/10/25	
北陸電力	第301回	1.158	100,000	105,118	2023/ 3 /24	
北陸電力	第304回	0.989	100,000	104,450	2023/10/25	
北陸電力	第307回	1.055	100,000	106,017	2026/ 6 /25	
北陸電力	第308回	0.769	100,000	103,332	2024/ 9 /25	
東北電力	第473回	0.597	100,000	101,395	2021/ 4 /23	
東北電力	第475回	0.809	100,000	103,359	2024/ 9 /25	
東北電力	第481回	0.803	200,000	206,884	2025/ 7 /25	
四国電力	第281回	1.111	200,000	210,678	2023/ 9 /25	
九州電力	第400回	1.777	100,000	104,613	2020/ 4 /24	
九州電力	第409回	1.483	100,000	102,937	2019/ 8 /23	
九州電力	第424回	1.233	200,000	211,962	2023/11/24	

銘	柄	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451回		0.45	100,000	100,034	2027/5/25
北海道電力 第316回		1.164	207,000	212,837	2020/6/25
北海道電力 第323回		1.337	100,000	109,382	2030/3/25
北海道電力 第338回		0.84	100,000	99,242	2036/11/25
東京電力パワーグリッド 第1回		0.38	100,000	99,948	2020/3/9
東京電力パワーグリッド 第2回		0.58	100,000	100,302	2022/3/9
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付		1.293	100,000	104,116	2021/3/19
清水建設 第18回社債間限定同順位特約付		0.947	100,000	101,285	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	101,001	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	104,018	2024/5/8
アサヒグループホールディングス 第7回特定社債間限定同順位特約付		0.237	100,000	100,286	2020/5/28
アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特約付		0.348	100,000	100,727	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	204,892	2025/2/28
味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付		0.19	200,000	199,734	2024/3/8
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付		0.714	100,000	102,549	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	103,332	2025/5/30
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付		0.34	200,000	196,536	2026/8/28
森ビル 第13回社債間限定同順位特約付		0.466	100,000	100,611	2020/5/19
東急不動産ホールディングス 第2回社債間限定同順位特約付		0.856	100,000	102,985	2024/7/29
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付		0.451	100,000	100,878	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	103,835	2020/4/23
クレハ 第5回社債間限定同順位特約付		0.302	100,000	100,222	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	99,958	2020/9/3
三菱ケミカルホールディングス 第14回社債間限定同順位特約付		0.482	200,000	202,070	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	100,260	2019/6/4
花王 第4回特定社債間限定同順位特約付		0.624	100,000	101,233	2020/6/19
武田薬品工業 第15回社債間限定同順位特約付		0.704	100,000	101,602	2020/7/17
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付		0.23	100,000	99,843	2024/5/31
第一三共 第4回社債間限定同順位特約付		0.846	100,000	103,923	2023/9/15
JXホールディングス 第9回社債間限定同順位特約付		0.82	100,000	103,203	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	100,583	2021/10/29
ブリヂストン 第8回社債間限定同順位特約付		0.249	200,000	200,424	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	103,315	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	100,275	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	100,095	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	101,240	2025/5/21
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回(JFE保証)		0.703	100,000	102,364	2024/9/19
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付		0.3	200,000	200,038	2027/3/1
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付		0.234	100,000	100,264	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	100,248	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	219,630	2028/12/13
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付		0.428	100,000	100,854	2021/6/4
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付		0.956	100,000	103,662	2022/9/20
富士通 第34回社債間限定同順位特約付		0.644	100,000	101,468	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	103,320	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	201,242	2020/3/19
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付		0.3	100,000	99,887	2023/9/20
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付		0.47	100,000	100,240	2026/9/18

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
ソニー 第26回		2.068	100,000	103,628	2019/6/20
ソニー 第32回		0.28	200,000	199,264	2023/9/20
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付		0.34	100,000	99,732	2027/6/7
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付		0.877	100,000	103,925	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	302,031	2019/8/7
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付		0.963	100,000	104,568	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	102,136	2025/2/26
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付		0.39	100,000	99,783	2024/3/21
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付		0.652	100,000	101,810	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	103,871	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	208,296	2021/6/4
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付		0.436	100,000	100,630	2021/7/23
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付		1.014	100,000	104,910	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	209,074	2026/7/10
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付		1.187	100,000	107,576	2029/7/13
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付		1.117	100,000	103,867	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	106,665	2029/1/29
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無		1.657	100,000	103,081	2019/7/29
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付		0.451	200,000	201,144	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	100,328	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	202,182	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	102,346	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	102,262	2024/6/18
イオン 第16回社債間限定同順位特約付		1.01	100,000	100,980	2018/11/21
あおぞら銀行 第9回社債間限定同順位特約付		0.11	300,000	300,075	2019/12/9
あおぞら銀行 第10回社債間限定同順位特約付		0.1	100,000	99,974	2020/3/17
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付		0.94	100,000	102,855	2024/6/26
りそなホールディングス 第11回社債間限定同順位特約付		0.05	100,000	99,674	2021/7/27
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	205,438	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	122,514	2027/7/27
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付		2.5	100,000	104,503	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	107,107	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	111,218	2022/10/27
三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付		1.035	100,000	103,213	2020/10/15
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	306,597	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	102,477	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	106,480	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	105,076	2019/6/20
りそな銀行 第6回劣後特約付		2.084	300,000	315,090	2020/3/4
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付		1.68	100,000	105,332	2021/4/28
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付		1.389	300,000	316,893	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	100,459	2019/4/26
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付		0.803	100,000	103,785	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	102,308	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	205,680	2024/7/16
三井住友銀行 第24回劣後特約付		1.6	100,000	105,147	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	100,422	2019/1/25
みずほ銀行 第38回特定社債間限定同順位特約付		0.24	1,000,000	1,004,710	2019/10/30

銘	柄	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	
興銀リース	第4回社債間限定同順位特約付	0.36	100,000	100,209	2019/5/23
N T Tファイナンス	第46回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,139	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	100,149	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	100,119	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	100,548	2021/12/3
オリエントコーポレーション	第2回社債間限定同順位特約付	0.45	200,000	200,232	2020/1/22
日立キャピタル	第52回社債間限定同順位特約付	0.508	100,000	100,701	2021/6/18
日立キャピタル	第56回社債間限定同順位特約付	0.197	100,000	99,869	2019/12/20
日立キャピタル	第57回社債間限定同順位特約付	0.616	100,000	101,846	2024/12/20
オリックス	第164回社債間限定同順位特約付	1.146	100,000	101,905	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	100,288	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	100,052	2020/5/28
三菱U F J リース	第30回社債間限定同順位特約付	0.426	100,000	100,729	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	100,332	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	100,351	2020/8/12
大和証券グループ本社	第23回社債間限定同順位特約付	0.909	100,000	102,454	2025/8/12
野村ホールディングス	第21回	1.86	100,000	104,530	2020/3/17
三井不動産	第34回社債間限定同順位特約付	2.085	100,000	103,345	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	110,600	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	102,842	2020/6/19
三菱地所	第110回担保提供制限等財務上特約無	0.571	100,000	100,834	2019/9/13
三菱地所	第111回担保提供制限等財務上特約無	0.929	100,000	103,351	2022/9/14
東京建物	第17回社債間限定同順位特約付	1.3	100,000	102,452	2020/3/18
東京建物	第25回社債間限定同順位特約付	0.52	100,000	100,205	2027/3/19
住友不動産	第95回社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	103,353	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	205,782	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	102,274	2024/9/9
エス・ティ・ティ都市開発	第10回社債間限定同順位特約付	1.03	100,000	102,362	2020/9/18
日本ビルファンド投資法人	第13回特定投資法人債間限定同順位	1.168	100,000	104,272	2023/6/26
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	第5回特定投資法人債	0.871	100,000	101,707	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	216,486	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	103,819	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	110,054	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	215,442	2030/6/12
小田急電鉄	第74回社債間限定同順位特約付	0.756	100,000	100,376	2037/5/29
東日本旅客鉄道	第15回	2.65	100,000	107,957	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	220,640	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	205,022	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	119,647	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	110,175	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	120,503	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	104,683	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	103,964	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	246,218	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	112,034	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	116,763	2045/3/6
東京地下鉄	第22回	0.215	100,000	99,951	2027/6/21
東京地下鉄	第23回	0.661	100,000	100,199	2037/6/19

銘	柄	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	
東京地下鉄 第24回		1.035	100,000	100,577	2047/6/21
西武ホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付		0.758	200,000	203,290	2032/3/17
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付		0.857	100,000	104,651	2027/4/30
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付		0.2	100,000	98,744	2026/7/14
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付		0.7	100,000	98,994	2036/7/14
日本梱包運輸倉庫 第4回社債間限定同順位特約付		0.324	100,000	100,192	2018/12/20
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付		0.455	100,000	100,158	2027/2/23
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	101,203	2036/6/9
三菱倉庫 第14回		0.442	100,000	100,894	2021/3/12
住友倉庫 第1回社債間限定同順位特約付		0.279	200,000	200,306	2019/3/14
日本電信電話 第60回		1.31	100,000	103,883	2020/12/18
KDDI 第20回社債間限定同順位特約付		0.803	100,000	102,856	2023/12/20
電源開発 第31回社債間限定同順位特約付		1.155	100,000	103,161	2020/9/18
電源開発 第37回社債間限定同順位特約付		1.035	100,000	103,293	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	104,293	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	104,192	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	103,394	2024/8/20
東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付		1.984	100,000	122,400	2043/12/17
東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付		2.06	100,000	108,753	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	200,706	2018/7/11
ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付		0.491	100,000	100,820	2022/12/16
クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債(2014)		0.865	100,000	102,956	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	200,064	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	197,080	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	100,328	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	99,314	2025/6/5
エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第2回円		0.842	100,000	102,234	2023/9/26
エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円		1.207	100,000	104,454	2026/9/25
エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第12回		2.54	100,000	106,905	2021/2/16
ルノー 第17回円貨社債(2015)		0.75	300,000	302,526	2018/11/26
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	100,623	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	200,408	2020/1/16
オーストラリア・ニュージーランド銀行 第10回円貨社債		0.293	200,000	199,778	2024/1/23
ラボバンク・ネダーランド 第23回円貨社債(2013)(コー		0.557	100,000	100,335	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	100,164	2019/5/22
ソシエテ ジェネラル 第6回円貨社債(2014)		0.552	200,000	201,442	2019/6/13
小 計			27,307,000	28,140,706	
合 計			631,157,325	684,605,771	

* 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(301, 268, 840千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
アメリカ	千米ドル 2,495,270	千米ドル 2,611,461	千円 290,237,858	% 43.6	% —	% 18.3	% 17.5	% 7.8
カナダ	千カナダドル 146,830	千カナダドル 165,328	13,796,646	2.1	—	0.9	0.7	0.5
イギリス	千英ポンド 257,880	千英ポンド 336,175	47,357,028	7.1	—	5.2	1.8	0.2
スイス	千スイスフラン 8,600	千スイスフラン 10,749	1,227,670	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 212,200	千スウェーデンクローナ 247,594	3,141,972	0.5	—	0.2	0.2	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 132,100	千ノルウェークローネ 143,347	1,866,388	0.3	—	0.2	0.1	0.1
デンマーク	千デンマーククローネ 192,770	千デンマーククローネ 243,362	4,056,859	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	265,300	337,699	41,881,520	6.3	—	4.3	1.9	0.0
イタリア	435,080	528,188	65,505,966	9.8	—	6.0	2.7	1.1
フランス	412,200	525,236	65,139,835	9.8	—	6.6	2.4	0.8
オランダ	91,500	113,504	14,076,787	2.1	—	1.5	0.5	0.2
スペイン	258,700	322,683	40,019,259	6.0	—	3.7	1.8	0.6
ベルギー	104,100	137,313	17,029,602	2.6	—	1.9	0.5	0.1
オーストリア	61,000	76,296	9,462,271	1.4	—	0.9	0.3	0.1
フィンランド	28,500	32,240	3,998,420	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	44,880	52,191	6,472,815	1.0	—	0.5	0.3	0.2
ポーランド	千ズロチ 139,000	千ズロチ 147,635	4,305,042	0.6	—	0.3	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 30,380	千シンガポールドル 32,459	2,599,040	0.4	—	0.2	0.1	0.1
マレーシア	千リンギ 109,400	千リンギ 110,025	2,854,067	0.4	—	0.3	0.2	0.0
オーストラリア	千豪ドル 154,240	千豪ドル 168,388	14,144,610	2.1	—	1.4	0.5	0.2
メキシコ	千メキシコペソ 996,700	千メキシコペソ 1,039,237	6,339,348	1.0	—	0.5	0.3	0.2
南アフリカ	千ランド 465,100	千ランド 427,363	3,632,587	0.5	—	0.5	0.1	0.0
合 計	—	—	659,145,600	99.0	—	54.2	32.6	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。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当期末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ	国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
		8.125	19,690	22,514	2,502,237	2019/8/15
		8.75	12,700	15,508	1,723,657	2020/8/15
		8.0	21,100	26,704	2,967,958	2021/11/15
		6.25	13,800	17,310	1,923,875	2023/8/15
		2.375	50,100	51,368	5,709,056	2024/8/15
		6.0	39,200	51,391	5,711,685	2026/2/15
		6.5	18,800	25,827	2,870,520	2026/11/15
		6.125	23,700	32,430	3,604,283	2027/11/15
		5.5	12,000	15,914	1,768,688	2028/8/15
		5.25	5,000	6,529	725,709	2028/11/15
		5.25	800	1,048	116,544	2029/2/15
		4.375	100	130	14,451	2038/2/15
		2.875	25,300	26,106	2,901,469	2043/5/15
		3.75	16,000	19,225	2,136,666	2043/11/15
		2.375	31,200	31,554	3,506,984	2018/6/30
		1.375	3,900	3,904	433,970	2018/6/30
		0.875	1,000	996	110,701	2018/7/15
		2.25	8,800	8,894	988,499	2018/7/31
		1.375	18,400	18,422	2,047,452	2018/7/31
		0.75	17,700	17,601	1,956,189	2018/7/31
		4.0	4,800	4,949	550,059	2018/8/15
		1.0	19,600	19,539	2,171,621	2018/8/15
		1.5	28,800	28,872	3,208,834	2018/8/31
		1.0	800	797	88,588	2018/9/15
		1.375	27,400	27,427	3,048,328	2018/9/30
		0.75	10,000	9,930	1,103,628	2018/9/30
		0.875	2,400	2,387	265,308	2018/10/15
		1.75	9,900	9,961	1,107,119	2018/10/31
		1.25	21,400	21,374	2,375,608	2018/10/31
		0.75	700	694	77,217	2018/10/31
		3.75	40,900	42,275	4,698,508	2018/11/15
		1.25	7,300	7,292	810,466	2018/11/15
		1.375	500	500	55,619	2018/11/30
		1.25	6,000	5,992	666,032	2018/11/30
		1.25	700	699	77,728	2018/12/15
		1.375	6,500	6,504	722,917	2018/12/31
		1.5	5,500	5,515	612,989	2018/12/31
		1.125	5,100	5,083	565,020	2019/1/15
		1.25	8,100	8,089	899,108	2019/1/31
		1.5	3,500	3,509	390,084	2019/1/31
		1.125	1,000	996	110,779	2019/1/31
		2.75	37,500	38,367	4,264,129	2019/2/15
		0.75	200	198	22,017	2019/2/15
		1.375	17,100	17,111	1,901,755	2019/2/28
		1.5	16,200	16,245	1,805,531	2019/2/28
		1.0	10,800	10,738	1,193,513	2019/3/15
		1.5	4,000	4,011	445,827	2019/3/31

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	1.625	25,500	25,627	2,848,240	2019/3/31
		US TREASURY N/B	1.25	2,000	1,996	221,906	2019/3/31
		US TREASURY N/B	0.875	3,500	3,470	385,753	2019/4/15
		US TREASURY N/B	1.25	5,000	4,990	554,636	2019/4/30
		US TREASURY N/B	1.625	5,600	5,628	625,495	2019/4/30
		US TREASURY N/B	3.125	27,600	28,512	3,168,833	2019/5/15
		US TREASURY N/B	0.875	1,300	1,288	143,200	2019/5/15
		US TREASURY N/B	1.125	1,400	1,394	154,945	2019/5/31
		US TREASURY N/B	1.5	10,600	10,630	1,181,443	2019/5/31
		US TREASURY N/B	0.875	900	891	99,068	2019/6/15
		US TREASURY N/B	1.0	1,400	1,390	154,495	2019/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	7,900	7,940	882,533	2019/6/30
		US TREASURY N/B	0.75	5,500	5,430	603,509	2019/7/15
		US TREASURY N/B	1.625	14,500	14,573	1,619,713	2019/7/31
		US TREASURY N/B	3.625	28,700	30,059	3,340,855	2019/8/15
		US TREASURY N/B	0.75	10,000	9,866	1,096,508	2019/8/15
		US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,975	330,645	2019/8/31
		US TREASURY N/B	1.625	8,800	8,844	982,998	2019/8/31
		US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,973	330,528	2019/9/30
		US TREASURY N/B	1.75	17,700	17,841	1,982,853	2019/9/30
		US TREASURY N/B	3.375	49,300	51,589	5,733,685	2019/11/15
		US TREASURY N/B	1.0	8,800	8,714	968,519	2019/11/30
		US TREASURY N/B	1.5	1,800	1,803	200,427	2019/11/30
		US TREASURY N/B	1.125	12,000	11,910	1,323,781	2019/12/31
		US TREASURY N/B	1.625	3,800	3,818	424,344	2019/12/31
		US TREASURY N/B	1.375	2,000	1,996	221,854	2020/1/31
		US TREASURY N/B	1.25	5,400	5,372	597,061	2020/1/31
		US TREASURY N/B	3.625	51,800	54,711	6,080,661	2020/2/15
		US TREASURY N/B	1.25	2,700	2,685	298,472	2020/2/29
		US TREASURY N/B	1.625	5,000	5,021	558,066	2020/3/15
		US TREASURY N/B	1.125	4,000	3,962	440,444	2020/3/31
		US TREASURY N/B	1.375	21,300	21,240	2,360,624	2020/3/31
		US TREASURY N/B	1.375	3,200	3,188	354,397	2020/4/30
		US TREASURY N/B	3.5	47,700	50,418	5,603,514	2020/5/15
		US TREASURY N/B	1.5	6,500	6,497	722,127	2020/5/31
		US TREASURY N/B	1.875	16,600	16,777	1,864,670	2020/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	13,200	13,239	1,471,403	2020/6/30
		US TREASURY N/B	2.0	14,000	14,195	1,577,719	2020/7/31
		US TREASURY N/B	2.625	42,180	43,575	4,842,988	2020/8/15
		US TREASURY N/B	2.125	37,600	38,260	4,252,320	2020/8/31
		US TREASURY N/B	2.0	6,000	6,083	676,113	2020/9/30
		US TREASURY N/B	1.75	1,600	1,609	178,838	2020/10/31
		US TREASURY N/B	2.625	52,600	54,397	6,045,776	2020/11/15
		US TREASURY N/B	2.375	6,800	6,980	775,826	2020/12/31
		US TREASURY N/B	2.125	5,300	5,394	599,534	2021/1/31
		US TREASURY N/B	1.375	7,000	6,939	771,294	2021/1/31
		US TREASURY N/B	3.625	45,800	49,038	5,450,105	2021/2/15
		US TREASURY N/B	2.0	5,000	5,068	563,297	2021/2/28

銘柄			当期末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
国債証券	US TREASURY N/B	1.125	10,000	9,817	1,091,168	2021/ 2 /28	
	US TREASURY N/B	2.25	1,800	1,839	204,490	2021/ 3 /31	
	US TREASURY N/B	2.25	12,900	13,190	1,465,964	2021/ 4 /30	
	US TREASURY N/B	3.125	38,400	40,529	4,504,503	2021/ 5 /15	
	US TREASURY N/B	2.0	22,500	22,793	2,533,275	2021/ 5 /31	
	US TREASURY N/B	2.125	34,000	34,600	3,845,478	2021/ 6 /30	
	US TREASURY N/B	2.25	9,700	9,915	1,102,061	2021/ 7 /31	
	US TREASURY N/B	2.125	25,300	25,739	2,860,719	2021/ 8 /15	
	US TREASURY N/B	2.0	7,300	7,389	821,241	2021/ 8 /31	
	US TREASURY N/B	2.125	16,000	16,272	1,808,525	2021/ 9 /30	
	US TREASURY N/B	2.0	10,000	10,117	1,124,424	2021/10/31	
	US TREASURY N/B	2.0	26,000	26,323	2,925,647	2021/11/15	
	US TREASURY N/B	1.875	8,000	8,051	894,885	2021/11/30	
	US TREASURY N/B	2.125	12,400	12,611	1,401,607	2021/12/31	
	US TREASURY N/B	1.5	5,000	4,945	549,665	2022/ 1 /31	
	US TREASURY N/B	1.875	10,000	10,054	1,117,477	2022/ 1 /31	
	US TREASURY N/B	2.0	33,700	34,108	3,790,772	2022/ 2 /15	
	US TREASURY N/B	1.75	27,300	27,304	3,034,595	2022/ 2 /28	
	US TREASURY N/B	1.75	9,900	9,893	1,099,598	2022/ 3 /31	
	US TREASURY N/B	1.75	30,000	29,974	3,331,334	2022/ 4 /30	
	US TREASURY N/B	1.875	10,000	10,046	1,116,609	2022/ 4 /30	
	US TREASURY N/B	1.75	23,900	23,886	2,654,793	2022/ 5 /15	
	US TREASURY N/B	2.125	27,000	27,432	3,048,839	2022/ 6 /30	
	US TREASURY N/B	1.625	18,500	18,342	2,038,580	2022/ 8 /15	
	US TREASURY N/B	1.625	12,800	12,656	1,406,587	2022/11/15	
	US TREASURY N/B	2.125	13,000	13,184	1,465,363	2022/12/31	
	US TREASURY N/B	1.75	22,000	21,865	2,430,180	2023/ 1 /31	
	US TREASURY N/B	2.0	17,000	17,127	1,903,550	2023/ 2 /15	
	US TREASURY N/B	1.5	25,000	24,498	2,722,712	2023/ 2 /28	
	US TREASURY N/B	1.5	11,000	10,769	1,196,943	2023/ 3 /31	
	US TREASURY N/B	1.75	42,200	41,860	4,652,367	2023/ 5 /15	
	US TREASURY N/B	1.625	30,400	29,929	3,326,392	2023/ 5 /31	
	US TREASURY N/B	2.5	19,400	20,063	2,229,895	2023/ 8 /15	
	US TREASURY N/B	2.75	16,800	17,630	1,959,488	2023/11/15	
	US TREASURY N/B	2.75	26,800	28,129	3,126,315	2024/ 2 /15	
	US TREASURY N/B	2.5	29,100	30,091	3,344,338	2024/ 5 /15	
	US TREASURY N/B	2.25	23,100	23,462	2,607,649	2024/11/15	
	US TREASURY N/B	2.0	44,700	44,553	4,951,656	2025/ 2 /15	
	US TREASURY N/B	2.125	26,500	26,620	2,958,555	2025/ 5 /15	
	US TREASURY N/B	2.0	14,500	14,407	1,601,206	2025/ 8 /15	
	US TREASURY N/B	2.25	50,300	50,873	5,654,106	2025/11/15	
	US TREASURY N/B	1.625	2,000	1,922	213,718	2026/ 2 /15	
	US TREASURY N/B	1.625	800	767	85,292	2026/ 5 /15	
	US TREASURY N/B	1.5	7,000	6,629	736,832	2026/ 8 /15	
	US TREASURY N/B	2.25	6,300	6,352	706,035	2027/ 2 /15	
	US TREASURY N/B	5.375	2,100	2,870	319,056	2031/ 2 /15	
	US TREASURY N/B	4.5	100	132	14,696	2038/ 5 /15	
	US TREASURY N/B	3.5	100	115	12,825	2039/ 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	
			%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4. 25	400	511	56, 834	2039/ 5 /15
		US TREASURY N/B	4. 5	800	1, 057	117, 509	2039/ 8 /15
		US TREASURY N/B	4. 375	4, 200	5, 461	607, 043	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4. 625	8, 000	10, 761	1, 196, 005	2040/ 2 /15
		US TREASURY N/B	4. 375	7, 500	9, 764	1, 085, 243	2040/ 5 /15
		US TREASURY N/B	3. 875	7, 200	8, 751	972, 627	2040/ 8 /15
		US TREASURY N/B	4. 25	7, 800	10, 006	1, 112, 127	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4. 75	7, 000	9, 621	1, 069, 388	2041/ 2 /15
		US TREASURY N/B	4. 375	7, 000	9, 155	1, 017, 512	2041/ 5 /15
		US TREASURY N/B	3. 125	6, 500	7, 034	781, 783	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3. 125	3, 200	3, 462	384, 822	2042/ 2 /15
		US TREASURY N/B	3. 0	4, 500	4, 762	529, 278	2042/ 5 /15
		US TREASURY N/B	2. 75	9, 300	9, 409	1, 045, 754	2042/ 8 /15
		US TREASURY N/B	2. 75	17, 600	17, 776	1, 975, 624	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3. 125	24, 200	26, 128	2, 903, 914	2043/ 2 /15
		US TREASURY N/B	3. 625	15, 400	18, 111	2, 012, 950	2043/ 8 /15
		US TREASURY N/B	3. 625	23, 200	27, 325	3, 036, 928	2044/ 2 /15
		US TREASURY N/B	3. 375	18, 900	21, 358	2, 373, 781	2044/ 5 /15
		US TREASURY N/B	3. 125	30, 600	33, 079	3, 676, 408	2044/ 8 /15
		US TREASURY N/B	3. 0	36, 900	38, 972	4, 331, 430	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2. 5	27, 600	26, 379	2, 931, 824	2045/ 2 /15
		US TREASURY N/B	3. 0	21, 700	22, 905	2, 545, 702	2045/ 5 /15
		US TREASURY N/B	2. 875	2, 000	2, 059	228, 878	2045/ 8 /15
		US TREASURY N/B	3. 0	15, 100	15, 928	1, 770, 253	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2. 5	9, 500	9, 062	1, 007, 245	2046/ 2 /15
		US TREASURY N/B	2. 5	3, 700	3, 527	392, 038	2046/ 5 /15
		US TREASURY N/B	2. 875	4, 000	4, 120	457, 931	2046/11/15
		小 計					
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
	国債証券	CANADA GOVERNMENT	2. 75	4, 600	4, 952	413, 247	2022/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 5	3, 000	2, 988	249, 383	2018/ 8 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 25	9, 500	9, 544	796, 469	2018/ 9 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 5	10, 000	9, 951	830, 452	2018/11/ 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 5	100	99	8, 295	2019/ 2 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 75	4, 500	4, 566	381, 037	2019/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 75	300	299	24, 963	2019/ 5 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	3. 75	10, 000	10, 543	879, 888	2019/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 75	8, 700	8, 854	738, 901	2019/ 9 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 5	6, 300	6, 388	533, 153	2020/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	3. 5	7, 800	8, 367	698, 270	2020/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 75	2, 800	2, 776	231, 734	2020/ 9 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 75	8, 200	8, 110	676, 790	2021/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	3. 25	10, 050	10, 896	909, 271	2021/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 75	300	295	24, 687	2021/ 9 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	0. 5	2, 800	2, 719	226, 977	2022/ 3 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 5	4, 600	4, 673	390, 004	2023/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2. 5	5, 700	6, 165	514, 498	2024/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2. 25	8, 000	8, 550	713, 557	2025/ 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	
			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
カナダ	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	8. 0	3, 700	5, 920	494, 042	2027/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	1. 0	3, 300	3, 151	263, 006	2027/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	5. 75	5, 680	8, 198	684, 203	2029/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	5. 75	3, 400	5, 252	438, 311	2033/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	5. 0	5, 300	7, 980	665, 961	2037/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	4. 0	6, 400	8, 819	735, 951	2041/ 6 / 1
		CANADIAN GOVERNMENT	3. 5	9, 500	12, 525	1, 045, 226	2045/12/ 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2. 75	1, 800	2, 115	176, 511	2048/12/ 1
		CANADIAN GOVERNMENT	2. 75	500	621	51, 844	2064/12/ 1
小 計						13, 796, 646	
イギリス	国債証券	UK TREASURY	4. 5	6, 950	7, 462	1, 051, 202	2019/ 3 / 7
		UK TREASURY	1. 75	19, 000	19, 615	2, 763, 249	2019/ 7 / 22
		UK TREASURY	3. 75	2, 000	2, 158	303, 997	2019/ 9 / 7
		UK TREASURY	4. 75	2, 300	2, 585	364, 209	2020/ 3 / 7
		UK TREASURY	2. 0	19, 190	20, 230	2, 849, 813	2020/ 7 / 22
		UK TREASURY	3. 75	7, 000	7, 795	1, 098, 109	2020/ 9 / 7
		UK TREASURY	1. 5	2, 500	2, 608	367, 494	2021/ 1 / 22
		UK TREASURY	8. 0	9, 340	12, 198	1, 718, 337	2021/ 6 / 7
		UK TREASURY	3. 75	8, 670	9, 924	1, 398, 071	2021/ 9 / 7
		UK TREASURY	4. 0	4, 850	5, 678	799, 913	2022/ 3 / 7
		UK TREASURY	0. 5	4, 000	4, 004	564, 156	2022/ 7 / 22
		UK TREASURY	1. 75	8, 700	9, 279	1, 307, 191	2022/ 9 / 7
		UK TREASURY	2. 25	5, 100	5, 614	790, 927	2023/ 9 / 7
		UK TREASURY	2. 75	10, 500	12, 014	1, 692, 426	2024/ 9 / 7
		UK TREASURY	5. 0	12, 450	16, 438	2, 315, 759	2025/ 3 / 7
		UK TREASURY	4. 25	9, 530	12, 577	1, 771, 819	2027/12/ 7
		UK TREASURY	6. 0	5, 350	8, 166	1, 150, 453	2028/12/ 7
		UK TREASURY	4. 75	5, 700	8, 143	1, 147, 107	2030/12/ 7
		UK TREASURY	4. 25	5, 750	7, 956	1, 120, 881	2032/ 6 / 7
		UK TREASURY	4. 5	6, 600	9, 571	1, 348, 404	2034/ 9 / 7
		UK TREASURY	4. 25	3, 800	5, 440	766, 397	2036/ 3 / 7
		UK TREASURY	4. 75	4, 400	6, 879	969, 163	2038/12/ 7
		UK TREASURY	4. 25	4, 200	6, 205	874, 109	2039/ 9 / 7
		UK TREASURY	4. 25	5, 700	8, 534	1, 202, 190	2040/12/ 7
		UK TREASURY	4. 5	6, 100	9, 650	1, 359, 423	2042/12/ 7
		UK TREASURY	3. 5	20, 000	27, 846	3, 922, 666	2045/ 1 / 22
		UK TREASURY	4. 25	5, 950	9, 464	1, 333, 287	2046/12/ 7
		UK TREASURY	4. 25	5, 350	8, 841	1, 245, 564	2049/12/ 7
		UK TREASURY	3. 75	8, 750	13, 746	1, 936, 434	2052/ 7 / 22
		UK TREASURY	1. 75	1, 100	1, 161	163, 634	2057/ 7 / 22
		UK TREASURY	2. 5	3, 300	4, 401	619, 998	2065/ 7 / 22
		UK TREASURY	3. 5	6, 200	10, 556	1, 487, 127	2068/ 7 / 22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3. 25	21, 050	27, 891	3, 929, 040	2044/ 1 / 22
UNITED KINGDOM(GOVERNMENT	4. 25	6, 500	11, 531	1, 624, 463	2055/12/ 7		
小 計						47, 357, 028	
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	5, 000	5, 535	632, 152	2021/ 4 / 28

銘	柄	当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
スイス		%	千スイスフラン	千スイスフラン	千円	
	国債証券	4.0	3,600	5,214	595,518	2028/4/8
小	計				1,227,670	
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	4.25	2,300	2,497	31,692	2019/3/12
		5.0	45,500	54,088	686,377	2020/12/1
		3.5	53,400	63,041	799,994	2022/6/1
		1.5	28,300	30,871	391,760	2023/11/13
		2.5	41,700	48,926	620,878	2025/5/12
		1.0	9,900	10,398	131,954	2026/11/12
		0.75	14,100	14,212	180,360	2028/5/12
		3.5	17,000	23,558	298,954	2039/3/30
小	計				3,141,972	
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	4.5	28,600	30,699	399,704	2019/5/22
		3.75	27,600	30,641	398,952	2021/5/25
		2.0	14,300	14,993	195,216	2023/5/24
		3.0	44,900	49,978	650,716	2024/3/14
		1.75	4,700	4,843	63,060	2025/3/13
		1.5	4,700	4,735	61,659	2026/2/19
		1.75	7,300	7,456	97,079	2027/2/17
小	計				1,866,388	
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	0.25	2,500	2,529	42,166	2018/11/15
		4.0	34,100	37,796	630,066	2019/11/15
		3.0	41,100	46,979	783,145	2021/11/15
		1.5	31,370	34,401	573,474	2023/11/15
		1.75	31,400	35,331	588,972	2025/11/15
		0.5	4,000	3,989	66,507	2027/11/15
		4.5	48,300	82,335	1,372,524	2039/11/15
小	計				4,056,859	
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	0.5	1,800	1,837	227,921	2019/4/12
		0.25	5,000	5,104	632,998	2019/10/11
		—	3,600	3,663	454,396	2020/4/17
		0.25	3,000	3,082	382,269	2020/10/16
		—	1,600	1,631	202,394	2021/4/9
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5	17,700	19,206	2,382,027	2019/7/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	6,700	7,368	913,877	2020/1/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	4,100	4,552	564,654	2020/7/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	13,300	14,520	1,800,788	2020/9/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	13,300	14,753	1,829,752	2021/1/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	7,000	8,075	1,001,486	2021/7/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	8,400	9,377	1,162,946	2021/9/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	11,500	12,788	1,585,967	2022/1/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	6,500	7,200	893,014	2022/7/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,000	5,486	680,410	2022/9/4
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,726	710,194	2023/2/15
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,741	712,122	2023/5/15

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2. 0	14, 000	15, 926	1, 975, 174	2023/ 8 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6. 25	14, 100	20, 039	2, 485, 244	2024/ 1 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1. 75	5, 700	6, 433	797, 915	2024/ 2 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1. 5	1, 500	1, 669	207, 004	2024/ 5 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1. 0	10, 300	11, 114	1, 378, 474	2024/ 8 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0. 5	9, 700	10, 093	1, 251, 847	2025/ 2 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1. 0	3, 200	3, 453	428, 259	2025/ 8 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0. 5	1, 300	1, 344	166, 707	2026/ 2 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0. 25	600	599	74, 297	2027/ 2 /15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6. 5	19, 400	31, 403	3, 894, 620	2027/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5. 625	6, 000	9, 300	1, 153, 445	2028/ 1 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4. 75	3, 400	5, 013	621, 736	2028/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6. 25	6, 500	11, 091	1, 375, 604	2030/ 1 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5. 5	5, 300	8, 748	1, 084, 969	2031/ 1 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4. 75	5, 800	9, 598	1, 190, 434	2034/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4. 0	5, 000	7, 910	981, 047	2037/ 1 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4. 25	7, 000	11, 772	1, 460, 040	2039/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4. 75	8, 200	14, 834	1, 839, 808	2040/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3. 25	5, 900	8, 918	1, 106, 021	2042/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2. 5	5, 000	6, 744	836, 454	2044/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2. 5	8, 500	11, 572	1, 435, 189	2046/ 8 /15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3. 5	1, 600	1, 659	205, 771	2018/ 6 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 5	18, 600	19, 606	2, 431, 591	2018/ 8 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3. 5	8, 000	8, 435	1, 046, 133	2018/12/ 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 25	16, 300	17, 471	2, 166, 833	2019/ 2 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 5	2, 800	3, 023	374, 939	2019/ 3 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0. 1	500	502	62, 355	2019/ 4 /15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2. 5	7, 300	7, 661	950, 187	2019/ 5 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1. 5	800	827	102, 599	2019/ 8 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 25	11, 430	12, 512	1, 551, 790	2019/ 9 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1. 05	400	410	50, 897	2019/12/ 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 5	6, 100	6, 811	844, 732	2020/ 2 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 25	29, 200	32, 493	4, 029, 876	2020/ 3 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 0	16, 200	18, 203	2, 257, 652	2020/ 9 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0. 65	2, 000	2, 033	252, 231	2020/11/ 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3. 75	11, 400	12, 874	1, 596, 643	2021/ 3 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3. 75	9, 000	10, 184	1, 263, 069	2021/ 5 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3. 75	8, 000	9, 093	1, 127, 788	2021/ 8 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 75	12, 800	15, 097	1, 872, 404	2021/ 9 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0. 35	5, 400	5, 377	666, 903	2021/11/ 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5. 0	16, 800	20, 210	2, 506, 493	2022/ 3 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5. 5	9, 600	11, 914	1, 477, 643	2022/ 9 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5. 5	20, 700	25, 750	3, 193, 614	2022/11/ 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0. 95	4, 000	4, 010	497, 320	2023/ 3 /15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 5	6, 700	8, 047	998, 064	2023/ 5 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 75	9, 300	11, 369	1, 410, 014	2023/ 8 / 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9. 0	11, 700	17, 358	2, 152, 754	2023/11/ 1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4. 5	15, 900	19, 221	2, 383, 851	2024/ 3 / 1

銘	柄		当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	3,000	3,105	385,193	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	2,300	2,671	331,370	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	14,900	18,710	2,320,460	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	3,000	2,993	371,196	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	3,087	382,961	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	8,500	10,443	1,295,258	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	7,200	10,638	1,319,324	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	19,050	27,203	3,373,765	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	6,300	7,987	990,643	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	20,700	27,657	3,430,054	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	18,300	26,408	3,275,210	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	3,000	2,760	342,332	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	6,400	9,178	1,138,285	2033/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,400	11,291	1,400,344	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	6,700	8,102	1,004,848	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,000	10,902	1,352,115	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	15,600	21,083	2,614,763	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	10,100	13,335	1,653,810	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	8,100	8,465	1,049,867	2046/9/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0	8,000	8,241	1,022,092	2019/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	10,300	10,558	1,309,454	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,800	2,838	352,070	2020/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,100	1,115	138,358	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	7,000	7,132	884,539	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	7,000	8,403	1,042,245	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	600	598	74,173	2036/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	21,000	21,476	2,663,535	2018/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	1,300	1,312	162,757	2019/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	11,500	12,529	1,553,927	2019/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	4,000	4,852	601,745	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	11,500	12,668	1,571,099	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	14,800	16,495	2,045,761	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.5	27,300	30,009	3,721,781	2020/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	0.25	2,000	2,046	253,794	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	11,800	13,693	1,698,244	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	15,100	17,469	2,166,622	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.0	14,500	16,808	2,084,545	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	20,100	22,721	2,817,860	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	8,200	12,355	1,532,333	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	31,300	39,855	4,942,923	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	8,000	8,946	1,109,597	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	19,800	29,264	3,629,380	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	6,000	6,324	784,376	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	33,100	42,056	5,215,891	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	9,200	11,148	1,382,644	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	24,500	37,791	4,686,855	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	1,000	1,071	132,867	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	19,600	32,953	4,086,890	2032/10/25

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. 75	6, 600	10, 482	1, 300, 084	2035/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 0	11, 800	17, 809	2, 208, 715	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 5	16, 900	27, 612	3, 424, 452	2041/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 25	15, 200	21, 126	2, 620, 151	2045/ 5 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 0	5, 500	9, 054	1, 122, 923	2055/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 0	3, 800	6, 411	795, 136	2060/ 4 /25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	4. 0	2, 000	2, 099	260, 342	2018/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1. 25	6, 300	6, 487	804, 617	2019/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4. 0	7, 100	7, 781	965, 074	2019/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0. 25	2, 000	2, 044	253, 519	2020/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 5	5, 800	6, 525	809, 302	2020/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 25	7, 900	9, 102	1, 128, 851	2021/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	400	406	50, 397	2022/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2. 25	1, 500	1, 696	210, 377	2022/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 75	5, 900	7, 227	896, 354	2023/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7. 5	4, 300	6, 165	764, 678	2023/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1. 75	1, 400	1, 561	193, 679	2023/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2. 0	13, 500	15, 417	1, 912, 016	2024/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0. 5	4, 000	4, 068	504, 612	2026/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0. 75	2, 000	2, 057	255, 136	2027/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5. 5	7, 300	11, 136	1, 381, 105	2028/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2. 5	4, 400	5, 539	687, 024	2033/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4. 0	5, 000	7, 856	974, 349	2037/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 75	6, 200	9, 949	1, 233, 990	2042/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2. 75	4, 500	6, 380	791, 355	2047/ 1 /15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 1	5, 300	5, 560	689, 602	2018/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3. 75	7, 100	7, 502	930, 400	2018/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0. 25	4, 100	4, 136	512, 954	2019/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2. 75	13, 300	14, 055	1, 743, 121	2019/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 6	8, 900	9, 814	1, 217, 244	2019/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 3	13, 900	15, 387	1, 908, 419	2019/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 0	25, 250	28, 303	3, 510, 232	2020/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 85	10, 600	12, 389	1, 536, 567	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5. 5	7, 900	9, 607	1, 191, 501	2021/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0. 75	5, 900	6, 094	755, 812	2021/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5. 85	10, 350	13, 099	1, 624, 626	2022/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5. 4	17, 000	21, 777	2, 700, 882	2023/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 4	6, 000	7, 448	923, 748	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 8	13, 900	17, 662	2, 190, 552	2024/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3. 8	6, 700	8, 065	1, 000, 236	2024/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1. 6	900	943	117, 042	2025/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 65	15, 600	20, 030	2, 484, 170	2025/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1. 95	6, 000	6, 395	793, 184	2026/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5. 9	18, 400	25, 859	3, 207, 073	2026/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5. 15	7, 800	10, 671	1, 323, 536	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 9	5, 400	7, 800	967, 460	2040/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 7	8, 400	11, 867	1, 471, 809	2041/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5. 15	7, 800	11, 724	1, 454, 075	2044/10/31

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	3.45	1,000	1,109	137,615	2066/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	17,500	25,750	3,193,541	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	8,500	12,803	1,587,896	2032/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	5,200	6,821	845,952	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	1.25	100	101	12,633	2018/6/22
		BELGIUM KINGDOM	3.0	7,600	8,218	1,019,275	2019/9/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	5,800	6,613	820,209	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	5,200	6,234	773,239	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	4,800	5,794	718,631	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	7,922	982,555	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	5,000	5,716	708,949	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	10,000	11,745	1,456,614	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	8,400	11,475	1,423,167	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	1,052	130,487	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	1,007	124,964	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	4,997	619,780	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	10,195	1,264,457	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	6,500	9,849	1,221,505	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	1,000	1,003	124,487	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	1,300	1,409	174,823	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	4.0	7,200	7,789	966,049	2019/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	11,900	18,099	2,244,697	2028/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	11,000	18,086	2,243,069	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.15	2,300	2,353	291,892	2018/10/19
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.35	2,500	2,713	336,478	2019/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.95	2,500	2,624	325,490	2019/6/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	2,400	2,443	303,094	2019/10/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	5,600	6,352	787,819	2020/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	4,400	5,125	635,617	2021/9/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,300	3,927	487,087	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	5,000	5,976	741,205	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	2,000	2,004	248,635	2023/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	3,450	3,847	477,150	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	1,100	1,222	151,673	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,300	1,400	173,688	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,540	935,113	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,059	255,431	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	6,100	9,643	1,195,985	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	1,000	1,229	152,420	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	4,700	7,296	904,872	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	5,800	8,274	1,026,227	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	150	261	32,384	2062/1/26
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.125	1,500	1,533	190,134	2018/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.375	2,100	2,313	286,882	2019/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	3.375	2,000	2,220	275,324	2020/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.375	2,300	2,362	292,940	2020/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	3.5	2,000	2,300	285,271	2021/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	3,200	3,508	435,158	2022/9/15

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.5	4,200	4,597	570,217	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	2,400	3,138	389,204	2025/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	1,000	1,053	130,614	2025/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,033	252,220	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,500	4,330	537,092	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	700	699	86,730	2031/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	1,600	2,149	266,629	2042/7/4
アイルランド	国債証券	IRELAND (REPUBLIC OF) 4.4	4.4	3,600	3,945	489,319	2019/6/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	5,600	5,965	739,856	2018/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.9	3,400	3,902	484,011	2019/10/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	6,180	7,037	872,772	2020/4/18
		IRISH GOVERNMENT	5.0	3,500	4,128	511,968	2020/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.4	3,500	4,821	597,979	2025/3/13
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	1,000	1,030	127,774	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	2,500	2,636	327,028	2045/2/18
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	4,600	5,317	659,488	2030/5/15
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	6,600	8,015	994,082	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	4,400	5,390	668,533	2023/3/20
小 計						263,586,479	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	8,900	8,994	262,274	2018/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	—	6,500	6,355	185,332	2018/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	6,300	6,471	188,723	2019/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	11,100	11,986	349,534	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	6,300	6,202	180,878	2020/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	30,700	33,656	981,420	2020/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	11,100	12,596	367,307	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	9,400	10,824	315,630	2022/9/23
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	12,500	13,386	390,361	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	23,000	23,437	683,422	2025/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	9,500	9,082	264,831	2026/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	3,700	4,640	135,324	2029/4/25
小 計						4,305,042	
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	2,050	2,121	169,855	2018/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.5	4,950	5,076	406,461	2019/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	4,000	4,243	339,785	2020/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	2,980	3,074	246,148	2021/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	1,400	1,510	120,953	2022/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	3,000	3,187	255,223	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	2,300	2,488	199,262	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	3,900	4,422	354,089	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	2,400	2,595	207,807	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	500	576	46,120	2033/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	2,900	3,163	253,333	2042/4/1
		小 計					
マレーシア				千リンギ	千リンギ		
	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	400	405	10,515	2024/9/30

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	
マレーシア			%	千リンギ	千リンギ	千円	
	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.58	5,000	5,020	130,240	2018/9/28
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.759	900	907	23,527	2019/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.654	3,400	3,418	88,670	2019/10/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	11,900	12,163	315,531	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.492	6,600	6,597	171,129	2020/3/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.889	2,400	2,422	62,841	2020/7/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	6,000	6,118	158,721	2021/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	8,700	8,834	229,178	2021/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	4,600	4,531	117,547	2022/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	11,000	10,799	280,131	2023/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	5,800	5,907	153,241	2024/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.955	600	599	15,548	2025/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	8,800	9,023	234,061	2026/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	6,000	5,710	148,131	2027/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	1,800	1,717	44,559	2028/6/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	5.248	2,700	2,969	77,016	2028/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	5,700	5,779	149,930	2030/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	4,400	4,334	112,438	2031/6/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	4,700	4,551	118,075	2032/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	400	377	9,796	2033/4/15
MALAYSIAN GOVERNMENT	4.935	7,600	7,834	203,230	2043/9/30		
小計						2,854,067	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	410	418	35,166	2018/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.25	13,700	14,532	1,220,754	2019/3/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	4,900	5,014	421,253	2019/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	13,100	14,075	1,182,340	2020/4/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	10,400	10,364	870,620	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	10,200	11,669	980,258	2021/5/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	400	400	33,639	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	8,400	9,896	831,337	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	8,100	9,606	806,906	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	7,900	8,167	686,096	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	17,600	18,814	1,580,408	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	12,780	14,697	1,234,548	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	11,650	14,045	1,179,792	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	822	69,085	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	9,000	8,788	738,234	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	10,100	10,832	909,921	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	3,600	4,402	369,841	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	1,759	147,779	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	5,400	6,009	504,794	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	3,800	3,882	326,094	2039/6/21
AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	200	187	15,736	2047/3/21		
小計						14,144,610	
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	70,000	68,485	417,763	2018/6/14
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	110,700	112,971	689,126	2018/12/13

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	
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	97,300	93,123	568,055	2019/12/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	70,700	72,789	444,014	2020/6/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	126,000	124,281	758,116	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	48,400	47,579	290,235	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	30,700	36,170	220,639	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	8,000	7,391	45,086	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	103,100	107,125	653,462	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	49,600	55,742	340,032	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	46,500	49,494	301,917	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	10,675	65,122	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	46,000	59,944	365,661	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	30,500	35,008	213,550	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	64,200	68,571	418,285	2042/11/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	2,000	2,201	13,428	2047/11/7
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	83,000	87,680	534,850	2023/12/7	
小 計						6,339,348	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	20,100	20,258	172,193	2018/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	25,300	25,160	213,865	2020/1/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	26,100	25,376	215,698	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	25,200	24,907	211,712	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	71,300	80,111	680,945	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	28,000	25,624	217,808	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	30,000	24,822	210,987	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	46,400	42,361	360,073	2032/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	47,100	33,578	285,413	2036/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	32,000	28,624	243,304	2037/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0	4,800	4,470	37,997	2040/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	30,600	21,598	183,583	2041/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	32,100	28,907	245,710	2044/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	46,100	41,564	353,294	2048/2/28
小 計						3,632,587	
合 計						659,145,600	

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

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

<新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド>

下記は、新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド全体(3,758,064千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
トルコ	千トルコリラ 13,230	千トルコリラ 12,543	千円 394,987	% 8.0	% 8.0	% 4.2	% 3.7	% 0.1
チェコ	千チェココルナ 21,200	千チェココルナ 21,757	102,693	2.1	—	1.0	1.0	—
ハンガリー	千フォリント 449,000	千フォリント 514,475	206,304	4.2	—	2.1	2.0	—
ポーランド	千ズロチ 15,700	千ズロチ 16,026	467,344	9.5	—	3.2	6.1	0.2
ロシア	千ルーブル 161,000	千ルーブル 158,254	292,770	5.9	5.9	4.0	1.9	—
ルーマニア	千レイ 5,010	千レイ 5,317	143,529	2.9	—	1.1	0.9	0.9
マレーシア	千リンギ 12,700	千リンギ 12,694	329,303	6.7	—	3.6	2.7	0.3
タイ	千バーツ 101,300	千バーツ 108,829	355,872	7.2	—	3.4	2.6	1.2
フィリピン	千フィリピンペソ 5,000	千フィリピンペソ 5,196	11,485	0.2	—	—	0.2	—
インドネシア	千ルピア 52,860,000	千ルピア 57,504,997	483,041	9.8	—	7.3	2.2	0.3
アルゼンチン	千アルゼンチンペソ 8,700	千アルゼンチンペソ 9,919	67,949	1.4	1.4	1.1	0.3	—
メキシコ	千メキシコペソ 80,900	千メキシコペソ 83,964	512,180	10.4	—	5.5	4.2	0.6
ブラジル	千レアル 8,357	千レアル 14,494	482,972	9.8	9.8	3.4	4.2	2.2
チリ	千チリペソ 440,000	千チリペソ 470,697	78,606	1.6	—	0.5	1.1	—
コロンビア	千コロンビアペソ 8,120,000	千コロンビアペソ 9,639,773	349,923	7.1	—	3.9	3.2	—
ペルー	千ソル 3,100	千ソル 3,357	114,051	2.3	—	1.9	0.4	—
南アフリカ	千ランド 55,350	千ランド 49,662	422,134	8.6	—	7.5	1.1	—
合 計	—	—	4,815,152	97.6	25.1	53.8	37.9	5.9

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

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

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
トルコ			%	千トルコリラ	千トルコリラ	千円	
	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	8.8	200	195	6,142	2018/11/14
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.5	2,700	2,596	81,749	2019/7/10
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.5	710	711	22,397	2020/1/15
		TURKEY GOVERNMENT BOND	7.4	1,050	976	30,749	2020/2/5
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.4	950	924	29,122	2020/7/8
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.5	650	628	19,793	2022/1/12
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.5	1,190	1,104	34,775	2022/9/14
		TURKEY GOVERNMENT BOND	7.1	1,770	1,534	48,324	2023/3/8
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.8	1,160	1,084	34,154	2023/9/27
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.4	520	524	16,522	2024/3/20
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.0	310	292	9,215	2024/7/24
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.0	720	639	20,122	2025/3/12
TURKEY GOVERNMENT BOND	10.6	1,300	1,331	41,919	2026/2/11		
小 計						394,987	
チェコ				千チェココルナ	千チェココルナ		
	国債証券	CZECH REPUBLIC	1.5	10,500	10,931	51,594	2019/10/29
		CZECH REPUBLIC	1.0	8,600	8,759	41,343	2026/6/26
		CZECH REPUBLIC	0.95	2,100	2,066	9,755	2030/5/15
小 計						102,693	
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	22,000	24,794	9,942	2019/6/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	2.0	63,000	65,465	26,251	2019/10/30
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.5	38,000	41,337	16,576	2020/6/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	7.5	81,000	99,131	39,751	2020/11/12
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	2.5	20,000	20,987	8,416	2021/10/27
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	7.0	36,000	45,604	18,287	2022/6/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	6.0	77,000	95,172	38,163	2023/11/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.0	50,000	52,106	20,894	2024/6/26
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	5.5	37,000	44,683	17,918	2025/6/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.0	25,000	25,192	10,102	2027/10/27
小 計						206,304	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	—	300	289	8,454	2019/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	3,090	3,174	92,564	2019/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	380	410	11,966	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	1,030	1,014	29,572	2020/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	1,230	1,348	39,320	2020/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	1,700	1,677	48,907	2021/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	1,200	1,168	34,085	2021/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	500	567	16,545	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	900	887	25,889	2022/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	980	1,128	32,906	2022/9/23
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	1,140	1,220	35,600	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	700	713	20,799	2025/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,650	1,577	45,996	2026/7/25

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	2.5	900	848	24,734	2027/7/25
小 計					467,344	
ロシア			千ルーブル	千ルーブル		
	国債証券					
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	6.8	25,000	24,403	45,146	2019/12/11
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	6.4	28,000	26,916	49,795	2020/5/27
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.6	24,000	23,786	44,004	2022/7/20
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.0	20,000	19,249	35,610	2023/1/25
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.75	25,000	24,975	46,204	2026/9/16
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.05	20,000	18,869	34,908	2028/1/19
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	8.5	19,000	20,054	37,100	2031/9/17
小 計					292,770	
ルーマニア			千レイ	千レイ		
	国債証券					
	ROMANIA	2.5	1,600	1,640	44,266	2019/4/29
	ROMANIA	2.25	540	549	14,830	2020/2/26
	ROMANIA	3.25	790	818	22,101	2021/3/22
	ROMANIA	5.95	300	341	9,228	2021/6/11
	ROMANIA	3.5	300	310	8,372	2022/12/19
	ROMANIA	5.85	250	289	7,822	2023/4/26
	ROMANIA	4.75	920	1,003	27,092	2025/2/24
	ROMANIA	5.8	310	363	9,816	2027/7/26
小 計					143,529	
マレーシア			千リンギ	千リンギ		
	国債証券					
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.58	660	662	17,191	2018/9/28
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	1,760	1,799	46,666	2019/11/29
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.659	1,300	1,304	33,825	2020/10/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	320	326	8,465	2021/7/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	900	913	23,708	2021/9/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.62	800	798	20,717	2021/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	750	738	19,165	2022/8/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	1,280	1,256	32,597	2023/3/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	1,700	1,731	44,915	2024/7/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	340	348	9,043	2026/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.9	800	800	20,758	2026/11/30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	740	706	18,318	2028/6/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	200	202	5,260	2030/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	550	532	13,817	2032/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	400	377	9,796	2033/4/15
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4.254	200	194	5,055	2035/5/31
小 計					329,303	
タイ			千バーツ	千バーツ		
	国債証券					
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.45	4,800	4,954	16,200	2019/3/8
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.875	12,700	13,271	43,396	2019/6/13
	THAILAND GOVERNMENT BOND	2.55	12,500	12,830	41,955	2020/6/26
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.65	15,000	16,161	52,848	2021/12/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	1.875	10,000	9,968	32,598	2022/6/17
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.625	14,500	15,708	51,367	2023/6/16
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4.75	1,500	1,745	5,708	2024/12/20

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
タイ			%	千バーツ	千バーツ	千円	
	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	3. 85	9, 200	10, 231	33, 455	2025/12/12
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3. 58	4, 700	5, 114	16, 723	2027/12/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	4. 875	10, 000	12, 176	39, 817	2029/ 6 /22
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3. 4	6, 400	6, 666	21, 800	2036/ 6 /17
小 計						355, 872	
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, 196	11, 485	2021/ 1 /15
小 計						11, 485	
インドネシア				千ルピア	千ルピア		
	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	7. 875	1, 700, 000	1, 748, 186	14, 684	2019/ 4 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	11. 0	2, 900, 000	3, 287, 239	27, 612	2020/11/15
		INDONESIA GOVERNMENT	12. 8	1, 700, 000	2, 064, 031	17, 337	2021/ 6 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	7. 0	7, 380, 000	7, 487, 010	62, 890	2022/ 5 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	8. 375	5, 330, 000	5, 793, 917	48, 668	2024/ 3 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	11. 0	5, 880, 000	7, 413, 462	62, 273	2025/ 9 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	7. 0	6, 650, 000	6, 733, 125	56, 558	2027/ 5 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	9. 0	2, 930, 000	3, 340, 027	28, 056	2029/ 3 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	10. 5	1, 110, 000	1, 406, 556	11, 815	2030/ 8 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	9. 5	2, 400, 000	2, 826, 453	23, 742	2031/ 7 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	8. 25	2, 500, 000	2, 646, 435	22, 230	2032/ 6 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	6. 625	3, 500, 000	3, 227, 661	27, 112	2033/ 5 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	8. 375	4, 280, 000	4, 603, 140	38, 666	2034/ 3 /15
		INDONESIA GOVERNMENT	8. 25	4, 600, 000	4, 927, 750	41, 393	2036/ 5 /15
小 計						483, 041	
アルゼンチン				千アルゼンチンペソ	千アルゼンチンペソ		
	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	18. 2	1, 900	2, 107	14, 433	2021/10/ 3
		REPUBLIC OF ARGENTINA	15. 5	6, 800	7, 812	53, 515	2026/10/17
小 計						67, 949	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8. 5	4, 800	4, 898	29, 880	2018/12/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5. 0	10, 500	10, 049	61, 300	2019/12/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8. 0	10, 950	11, 273	68, 768	2020/ 6 /11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6. 5	3, 500	3, 452	21, 058	2021/ 6 /10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6. 5	9, 700	9, 535	58, 167	2022/ 6 / 9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10. 0	4, 600	5, 419	33, 060	2024/12/ 5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5. 75	5, 100	4, 711	28, 742	2026/ 3 / 5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7. 5	2, 850	2, 961	18, 063	2027/ 6 / 3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8. 5	1, 200	1, 348	8, 226	2029/ 5 /31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7. 75	7, 900	8, 408	51, 293	2031/ 5 /29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7. 75	4, 000	4, 270	26, 049	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10. 0	1, 700	2, 215	13, 513	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8. 5	5, 000	5, 739	35, 008	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7. 75	5, 700	6, 088	37, 137	2042/11/13
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8. 0	3, 400	3, 591	21, 909	2023/12/ 7
		小 計					
ブラジル				千レアル	千レアル		
	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	—	840	770	25, 669	2018/ 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 TESOIRO NACIONAL	—	400	358	11,951	2018/10/1	
		LETRA TESOIRO NACIONAL	—	2,430	2,131	71,013	2019/1/1	
		LETRA TESOIRO NACIONAL	—	3,110	2,599	86,624	2019/7/1	
		LETRA TESOIRO NACIONAL	—	800	601	20,042	2020/7/1	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL	10.0	286	2,991	99,673	2021/1/1	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL	10.0	240	2,479	82,601	2023/1/1	
		NOTA DO TESOIRO NACIONAL	10.0	251	2,562	85,396	2025/1/1	
小 計						482,972		
チリ				千チリペソ	千チリペソ			
	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS	5.0	140,000	151,995	25,383	2035/3/1	
		REPUBLIC OF CHILE	5.5	300,000	318,702	53,223	2020/8/5	
小 計						78,606		
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	4,070,000	4,385,425	159,190	2021/4/14	
		REPUBLIC OF COLOMBIA	9.85	4,050,000	5,254,348	190,732	2027/6/28	
小 計						349,923		
ペルー				千ソル	千ソル			
	国債証券	BONOS DE TESORERIA	5.7	800	832	28,269	2024/8/12	
		PERU BONO SOBERANO	7.84	480	533	18,132	2020/8/12	
		PERU BONO SOBERANO	6.95	700	776	26,386	2031/8/12	
		PERU BONO SOBERANO	6.9	620	682	23,170	2037/8/12	
		REPUBLIC OF PERU	6.35	500	532	18,093	2028/8/12	
小 計						114,051		
南アフリカ				千ランド	千ランド			
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	6,540	6,358	54,048	2021/3/31	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	4,000	3,953	33,605	2023/2/28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	7,100	7,977	67,808	2026/12/21	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	6,000	5,490	46,673	2030/1/31	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	6,360	5,262	44,729	2031/2/28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.875	1,000	937	7,972	2035/2/28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	3,700	2,637	22,421	2036/3/31	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	4,900	4,383	37,255	2037/1/31	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	7,850	5,540	47,095	2041/2/28	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	2,000	1,801	15,309	2044/1/31	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	5,900	5,319	45,215	2048/2/28	
小 計						422,134		
合 計						4,815,152		

* 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(14,769,764千口)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	945	1,198	573,243	2.0
MCUBS Mid City投資法人 投資証券	519	730	253,675	0.9
森ヒルズリート投資法人 投資証券	3,413	3,873	541,445	1.9
産業ファンド投資法人 投資証券	687	980	507,640	1.8
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	2,632	3,338	956,670	3.4
ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	680	818	231,494	0.8
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,288	1,558	773,547	2.7
GLP投資法人 投資証券	5,562	6,313	785,337	2.8
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,001	1,315	320,728	1.1
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	3,710	4,218	1,014,850	3.6
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	319	448	263,424	0.9
One リート投資法人 投資証券	185	394	82,661	0.3
イオンリート投資法人 投資証券	2,553	3,163	392,212	1.4
ヒューリックリート投資法人 投資証券	2,037	2,312	419,859	1.5
日本リート投資法人 投資証券	764	969	289,731	1.0
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	1,590	2,017	217,432	0.8
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	145	175	29,400	0.1
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	1,743	2,262	314,191	1.1
トーセイ・リート投資法人 投資証券	357	453	47,882	0.2
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	824	1,311	315,951	1.1
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	235	444	44,311	0.2
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	552	626	53,397	0.2
ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	165	199	28,317	0.1
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	8,154	10,344	1,658,143	5.8
いちごホテルリート投資法人 投資証券	502	570	67,032	0.2
ラサールロジポート投資法人 投資証券	2,144	2,720	306,000	1.1
スターアジア不動産投資法人 投資証券	672	749	76,997	0.3
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	177	201	19,336	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	437	583	193,847	0.7
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	343	459	40,759	0.1
さくら総合リート投資法人 投資証券	649	867	70,400	0.2
投資法人みらい 投資証券	512	459	79,223	0.3
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	—	781	118,633	0.4
日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,752	3,492	2,032,344	7.2
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	2,552	3,408	1,918,704	6.8
日本リテールファンド投資法人 投資証券	4,975	6,936	1,477,368	5.2
オリックス不動産投資法人 投資証券	4,921	6,956	1,195,040	4.2
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,702	2,276	944,540	3.3
プレミアム投資法人 投資証券	2,567	3,257	370,646	1.3
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,906	2,417	329,920	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	378	579	222,625	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	5,932	7,952	1,306,513	4.6
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,573	2,577	467,725	1.6
インヴィンシブル投資法人 投資証券	7,165	8,040	414,060	1.5

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
フロンティア不動産投資法人 投資証券		967	1,227	600,003	2.1
平和不動産リート投資法人 投資証券		1,978	2,245	195,764	0.7
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券		1,715	2,291	542,508	1.9
福岡リート投資法人 投資証券		1,456	1,750	303,100	1.1
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券		789	1,054	633,454	2.2
積水ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券		2,155	2,734	324,799	1.1
いちごオフィスリート投資法人 投資証券		2,987	2,792	192,089	0.7
大和証券オフィス投資法人 投資証券		971	778	441,126	1.6
阪急リート投資法人 投資証券		1,165	1,478	204,703	0.7
スターツプロシード投資法人 投資証券		501	568	82,473	0.3
大和ハウスリート投資法人 投資証券		2,962	3,708	1,014,138	3.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券		7,333	9,792	793,152	2.8
日本賃貸住宅投資法人 投資証券		3,197	4,056	337,459	1.2
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券		2,545	3,229	421,707	1.5
合 計	口 数 ・ 金 額	113,640	142,439	27,853,742	
	銘 柄 数<比 率>	57	58	<98.0%>	

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国 内	REIT先物取引	東証REIT指数	百万円 510	百万円 —

*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(9,374,274千口)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	12,100	13,900	376	41,896	0.2
AGREE REALTY CORP	3,700	4,000	190	21,143	0.1
ALEXANDERS INC	530	590	248	27,598	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,740	14,790	1,760	195,689	1.0
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,100	6,800	268	29,874	0.1
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19,360	21,800	1,053	117,096	0.6
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	32,100	38,200	861	95,694	0.5
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	23,300	25,700	1,130	125,648	0.6
APPLE HOSPITALITY REIT INC	22,700	25,100	482	53,672	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,800	7,600	104	11,631	0.1
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	3,200	4,800	49	5,452	0.0
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,100	12,100	75	8,445	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,400	22,310	4,340	482,418	2.4
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2,700	4,200	54	6,030	0.0
BOSTON PROPERTIES	22,760	24,780	3,100	344,586	1.7
BRANDYWINE REALTY TRUST	26,600	28,100	488	54,247	0.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	38,500	43,000	755	84,015	0.4
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	25,900	28,400	233	25,913	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	12,990	14,040	1,230	136,785	0.7
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	12,800	13,800	375	41,717	0.2
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	9,000	12,000	231	25,726	0.1
CEDAR REALTY TRUST INC	12,000	12,000	57	6,334	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	5,900	5,900	119	13,245	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	9,200	9,200	231	25,766	0.1
CITY OFFICE REIT INC	3,300	3,300	41	4,639	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	89,000	1,275	141,744	0.7
COLONY STARWOOD HOMES	7,500	18,500	646	71,860	0.4
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	18,500	19,400	431	47,952	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,000	2,000	51	5,701	0.0
CORESITE REALTY CORP	5,060	5,610	625	69,557	0.3
CORECIVIC INC	17,900	19,400	537	59,745	0.3
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14,300	15,800	559	62,127	0.3
COUSINS PROPERTIES INC	51,400	67,700	606	67,416	0.3
CUBESMART	26,500	28,700	703	78,148	0.4
CYRUSONE INC	11,200	12,620	734	81,686	0.4
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	13,700	14,800	805	89,513	0.4
DDR CORP	45,300	50,400	422	46,940	0.2
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	28,900	33,000	379	42,177	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	23,470	25,900	3,084	342,774	1.7
DOUGLAS EMMETT INC	21,300	23,800	919	102,207	0.5
DUKE REALTY CORP	52,200	58,000	1,653	183,714	0.9

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	11,100	12,750	824	91,611	0.4
EPR PROPERTIES	9,340	10,340	765	85,131	0.4
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	3,100	4,200	87	9,774	0.0
EASTGROUP PROPERTIES	4,890	5,530	467	51,940	0.3
EDUCATION REALTY TRUST INC	10,600	11,800	475	52,851	0.3
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	18,000	20,500	431	47,982	0.2
EQUITY COMMONWEALTH	18,300	19,800	622	69,229	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	11,890	13,090	1,136	126,365	0.6
EQUITY ONE INC	13,500	—	—	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	54,280	59,220	4,027	447,622	2.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,680	10,660	2,840	315,724	1.5
EXTRA SPACE STORAGE INC	18,730	20,540	1,603	178,265	0.9
FARMLAND PARTNERS INC	1,800	5,500	48	5,421	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,620	11,770	1,451	161,330	0.8
FELCOR LODGING TRUST INC	20,100	20,100	148	16,463	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17,600	19,400	562	62,527	0.3
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	8,400	8,400	92	10,269	0.1
FOREST CITY REALTY TRUST- A	31,700	35,000	849	94,446	0.5
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	9,100	10,100	256	28,523	0.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,800	18,100	198	22,047	0.1
GEO GROUP INC/THE	11,000	20,300	609	67,684	0.3
GGP INC	—	93,800	2,214	246,132	1.2
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	28,600	31,500	1,177	130,829	0.6
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	86,400	—	—	—	—
GETTY REALTY CORP	3,921	3,921	97	10,859	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,600	3,600	77	8,598	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	25,200	—	—	—	—
GLOBAL NET LEASE INC	—	9,500	211	23,534	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	11,000	11,000	249	27,690	0.1
GRAMERCY PROPERTY TRUST	61,600	—	—	—	—
GRAMERCY PROPERTY TRUST	—	24,800	747	83,129	0.4
HCP INC	69,000	76,200	2,518	279,896	1.4
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	17,500	19,200	681	75,710	0.4
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	20,900	30,900	996	110,788	0.5
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,900	7,200	135	15,019	0.1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14,730	16,600	866	96,249	0.5
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	24,300	26,500	798	88,709	0.4
HOST HOTELS & RESORTS INC	109,600	120,400	2,239	248,891	1.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	18,200	25,400	879	97,758	0.5
ISTAR INC	11,400	10,500	126	14,050	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	9,000	9,000	89	9,952	0.0
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	18,300	18,300	112	12,508	0.1
INVITATION HOMES INC	—	13,000	276	30,760	0.2
IRON MOUNTAIN INC	36,400	39,500	1,344	149,480	0.7
KILROY REALTY CORP	13,690	15,990	1,222	135,843	0.7
KIMCO REALTY CORP	62,900	68,600	1,201	133,576	0.7
KITE REALTY GROUP TRUST	12,700	13,900	246	27,390	0.1

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
LTC PROPERTIES INC	5,600	6,500	328	36,496	0.2
LASALLE HOTEL PROPERTIES	17,100	18,100	557	61,998	0.3
LEXINGTON REALTY TRUST	31,100	36,200	363	40,393	0.2
LIBERTY PROPERTY TRUST	21,800	23,600	983	109,322	0.5
LIFE STORAGE INC	6,770	7,670	578	64,333	0.3
MACERICH CO /THE	17,950	19,280	1,095	121,774	0.6
MACK-CALI REALTY CORP	13,600	14,500	404	44,961	0.2
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,100	3,100	37	4,217	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	47,200	58,100	764	84,977	0.4
MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,810	18,510	2,039	226,683	1.1
MONMOUTH REIT-CLASS A	10,100	12,000	177	19,698	0.1
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	25,600	25,600	252	28,053	0.1
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,900	6,710	526	58,504	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	21,700	24,100	919	102,183	0.5
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	5,300	6,700	148	16,478	0.1
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,500	12,500	123	13,725	0.1
NEW YORK REIT INC	25,000	—	—	—	—
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3,000	3,000	76	8,458	0.0
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	27,200	—	—	—	—
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	7,600	9,500	119	13,335	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	28,700	31,600	1,058	117,687	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,100	2,100	49	5,550	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,900	3,110	415	46,143	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	—	22,800	628	69,836	0.3
PARKWAY INC	6,473	6,473	128	14,237	0.1
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	11,000	10,900	361	40,219	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10,500	10,500	111	12,358	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	20,100	24,600	525	58,453	0.3
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	21,100	23,300	495	55,028	0.3
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	3,500	5,400	87	9,740	0.0
PROLOGIS INC	78,330	85,960	4,989	554,586	2.7
PUBLIC STORAGE	22,050	24,240	5,146	571,943	2.8
QTS REALTY TRUST INC CL A	6,940	7,880	415	46,127	0.2
QUALITY CARE PROPERTIES	13,400	14,700	259	28,803	0.1
RLJ LODGING TRUST	18,700	20,100	417	46,398	0.2
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	12,200	12,200	147	16,365	0.1
REALTY INCOME CORP	38,190	44,120	2,445	271,751	1.3
REGENCY CENTERS CORP	15,530	23,840	1,429	158,895	0.8
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	15,900	17,100	322	35,881	0.2
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	34,700	37,400	442	49,173	0.2
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	10,200	11,000	301	33,473	0.2
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,430	8,170	537	59,738	0.3
SL GREEN REALTY CORP	14,950	16,400	1,746	194,153	0.9
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9,300	10,100	246	27,423	0.1
SAUL CENTERS INC	1,700	1,700	97	10,877	0.1
SELECT INCOME REIT	9,000	9,800	241	26,826	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	34,700	37,800	822	91,415	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	%
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	3,500	4,000	164	18,253	0.1
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	5,600	—	—	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	46,500	50,420	8,005	889,752	4.4
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	72,700	79,800	588	65,364	0.3
STAG INDUSTRIAL INC	11,700	14,100	387	43,047	0.2
STORE CAPITAL CORP	23,200	27,600	558	62,116	0.3
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,500	16,500	312	34,714	0.2
SUN COMMUNITIES INC	9,930	11,410	1,035	115,055	0.6
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	32,700	35,800	589	65,491	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14,100	16,000	403	44,847	0.2
TAUBMAN CENTERS INC	8,920	9,800	566	62,921	0.3
TERRENO REALTY CORP	6,600	8,300	271	30,192	0.1
TIER REIT INC	7,200	7,200	125	13,955	0.1
UDR INC	39,800	43,600	1,748	194,312	1.0
UMH PROPERTIES INC	3,600	5,000	86	9,558	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,900	1,900	148	16,511	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	13,300	16,200	379	42,202	0.2
URSTADT BIDDLE-CL A	3,900	5,000	97	10,825	0.1
VENTAS INC	52,530	57,200	4,046	449,708	2.2
VEREIT INC	143,600	156,200	1,255	139,574	0.7
VORNADO REALTY TRUST	25,450	28,010	2,595	288,484	1.4
WP CAREY INC	15,700	17,060	1,150	127,907	0.6
WASHINGTON PRIME GROUP INC	28,400	28,500	219	24,421	0.1
WASHINGTON REAL ESTATE INV	11,300	12,200	393	43,700	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17,400	19,400	569	63,325	0.3
WELLTOWER INC	53,850	59,330	4,577	508,722	2.5
WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,000	—	—	—	—
WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	1,250	12	1,362	0.0
WHITESTONE REIT	4,200	5,900	71	7,973	0.0
XENIA HOTELS & RESORTS INC	15,500	16,900	332	37,001	0.2
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	87,000	87,000	77	8,605	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	3,225,484	3,577,994	131,453	14,609,708
	銘 柄 数 < 比 率 >	159	158	—	<71.4%>
(カナダ)			千カナダドル		
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN	1,500	3,200	35	2,980	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	5,900	7,000	273	22,822	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	11,100	11,100	146	12,190	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,500	3,500	169	14,180	0.1
BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	2,000	2,000	65	5,427	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,900	4,900	71	5,982	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	9,700	10,800	361	30,201	0.1
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	5,000	5,600	264	22,034	0.1
CHOICE PROPERTIES REIT	7,000	7,000	98	8,178	0.0
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	13,500	13,500	172	14,420	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	6,700	6,700	97	8,118	0.0
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	8,400	8,400	159	13,297	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	4,400	4,400	38	3,231	0.0

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	口	口	千カナダドル	千円	%
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	7,800	10,400	111	9,329	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,300	3,900	202	16,874	0.1
H&R REAL ESTATE INVSTMT-UTS	20,900	23,300	521	43,495	0.2
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,200	5,200	42	3,527	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,600	6,700	85	7,173	0.0
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	5,600	—	—	—	—
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,700	3,300	52	4,370	0.0
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4,300	4,300	63	5,274	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	4,200	3,500	74	6,218	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4,700	7,000	76	6,343	0.0
ONEREIT	6,570	6,570	24	2,039	0.0
PLAZA RETAIL REIT	7,500	7,500	35	2,929	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	17,000	23,000	158	13,205	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	23,400	26,400	653	54,526	0.3
SLATE OFFICE REIT	2,100	—	—	—	—
SLATE OFFICE REIT	—	5,900	47	3,953	0.0
SLATE RETAIL REIT	2,300	2,300	32	2,673	0.0
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,700	10,600	344	28,775	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	214,470	237,970	4,479	373,775
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	29	—	< 1.8% >
(イギリス)			千英ポンド		
BRITISH LAND	152,200	167,100	1,036	146,061	0.7
CAPITAL & REGIONAL PLC	64,000	64,000	36	5,206	0.0
DERWENT LONDON PLC	16,300	17,700	495	69,840	0.3
BIG YELLOW GROUP PLC	22,500	24,800	202	28,577	0.1
HAMMERSON PLC	116,200	129,900	758	106,866	0.5
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	14,200	14,200	32	4,540	0.0
MUCKLOW < A & J > GROUP PLC	7,200	9,200	46	6,603	0.0
INTU PROPERTIES PLC	135,000	149,000	396	55,895	0.3
UNITE GROUP PLC	—	36,100	240	33,868	0.2
SHAFTESBURY PLC	40,500	45,800	444	62,647	0.3
LAND SECURITIES GROUP PLC	119,300	127,100	1,315	185,312	0.9
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	49,900	—	—	—	—
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	78,700	78,700	50	7,123	0.0
HANSTEEN HOLDINGS PLC	105,000	120,000	148	20,961	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,540	33,000	140	19,733	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	89,000	112,000	192	27,137	0.1
SEGRO PLC	122,400	159,800	794	111,969	0.5
WORKSPACE GROUP PLC	17,800	19,900	182	25,776	0.1
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	193,000	193,000	76	10,777	0.1
NEWRIVER REIT PLC	35,000	40,000	138	19,507	0.1
NEWRIVER REIT PLC - RTS	—	3,636	0.40723	57	0.0
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	—	29,000	31	4,473	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC	164,000	217,000	319	45,058	0.2
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	67,200	83,000	94	13,270	0.1
ASSURA PLC	254,700	256,000	163	23,080	0.1
LXI REIT PLC	—	18,000	19	2,732	0.0

銘柄	柄	期首(前期末)				
		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	%
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		91,000	91,000	104	14,709	0.1
REGIONAL REIT LTD		26,000	41,000	43	6,107	0.0
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		—	20,000	20	2,919	0.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		—	52,500	326	45,964	0.2
小計	口数・金額	2,013,640	2,352,436	7,856	1,106,780	
	銘柄数<比率>	24	29	—	<5.4%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG		12,100	12,100	110	13,717	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		15,100	16,500	201	25,006	0.1
小計	口数・金額	27,200	28,600	312	38,723	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.2%>	
(ユーロ…イタリア)						
BENI STABILI SPA		135,000	158,000	102	12,756	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		53,604	53,604	43	5,334	0.0
小計	口数・金額	188,604	211,604	145	18,091	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)						
ICADE		6,580	7,120	529	65,670	0.3
ALTAREA		355	460	90	11,181	0.1
KLEPIERRE		30,900	33,800	1,255	155,686	0.8
GECINA SA		5,980	6,570	900	111,629	0.5
FONCIERE DES REGIONS		7,410	8,570	713	88,450	0.4
MERCIALYS		8,380	8,380	152	18,920	0.1
UNIBAIL RODAMCO-NA		14,750	16,020	3,713	460,540	2.3
小計	口数・金額	74,355	80,920	7,354	912,078	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<4.5%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA		7,000	8,000	292	36,322	0.2
VASTNED RETAIL NV		2,820	3,400	124	15,435	0.1
WERELDHAVE NV		6,000	6,500	282	35,062	0.2
NSI NV		19,000	—	—	—	—
NSI NV		—	2,750	85	10,572	0.1
小計	口数・金額	34,820	20,650	785	97,393	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.5%>	
(ユーロ…スペイン)						
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		14,210	14,210	114	14,209	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		15,300	17,900	260	32,278	0.2
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		69,500	77,000	876	108,673	0.5
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		8,300	10,000	153	19,074	0.1
小計	口数・金額	107,310	119,110	1,404	174,235	
	銘柄数<比率>	4	4	—	<0.9%>	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO S.C.A.		3,455	3,800	200	24,883	0.1
COFINIMMO		3,050	3,370	366	45,493	0.2
RETAIL ESTATES		870	1,080	87	10,843	0.1
WERELDHAVE BELGIUM		290	290	28	3,591	0.0
INTEREST OFFICES & WAREHOUSES		1,900	1,900	43	5,387	0.0

銘柄	期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ベルギー)	口	口	千ユーロ	千円	%
WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,300	2,550	236	29,325	0.1
MONTEA SCA	940	940	46	5,783	0.0
AEDIFICA	1,980	2,787	216	26,832	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV	500	500	18	2,272	0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV - RTS	—	500	1	175	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	15,285	17,717	1,246	154,589
	銘柄 数 < 比 率 >	9	10	—	<0.8%>
(ユーロ…アイルランド)					
GREEN REIT PLC	100,509	114,000	168	20,853	0.1
HIBERNIA REIT PLC	99,000	118,000	167	20,722	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	52,800	52,800	72	9,036	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	252,309	284,800	408	50,612
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.2%>
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	699,883	763,401	11,657	1,445,725
	銘柄 数 < 比 率 >	31	32	—	<7.1%>
(香港)			千香港ドル		
LINK REIT	331,000	359,500	22,073	314,544	1.5
PROSPERITY REIT	180,000	180,000	597	8,515	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	160,000	160,000	748	10,670	0.1
CHAMPION REIT	301,000	358,000	1,815	25,864	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	140,000	174,000	878	12,521	0.1
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT	120,000	120,000	274	3,915	0.0
FORTUNE REIT	211,000	228,000	2,163	30,833	0.2
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	124,000	124,000	421	6,007	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,567,000	1,703,500	28,973	412,873
	銘柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<2.0%>
(シンガポール)			千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST	405,000	438,000	851	68,212	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	345,000	399,000	1,061	84,981	0.4
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	310,000	355,000	582	46,616	0.2
SUNTEC REIT	370,000	408,000	750	60,110	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST	230,900	255,000	300	24,093	0.1
STARHILL GLOBAL REIT	209,900	209,900	160	12,857	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST	130,000	193,000	219	17,539	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST	85,000	105,000	147	11,812	0.1
KEPPEL REIT	252,000	285,000	326	26,128	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST	79,000	94,000	196	15,730	0.1
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	153,300	200,000	117	9,368	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS	91,000	114,000	191	15,335	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	110,000	110,000	173	13,916	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	83,500	83,500	109	8,791	0.0
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	59,000	59,000	153	12,329	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	282,800	282,800	121	9,736	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	180,000	197,000	357	28,629	0.1
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	273,025	292,025	454	36,359	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST	127,000	127,000	114	9,202	0.0
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	89,400	89,400	128	10,307	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	%
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	94,200	133,764	60	4,819	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	271,900	303,000	324	25,959	0.1
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	129,000	129,000	105	8,469	0.0
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	140,000	142,000	96	7,731	0.0
SPH REIT	120,500	120,500	120	9,648	0.0
QUE HOSPITALITY TRUST	160,043	200,043	145	11,612	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	106,700	106,700	76	6,151	0.0
QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	79,650	79,650	56	4,496	0.0
KEPPEL DC REIT	119,756	119,756	150	12,081	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	158,000	178,000	186	14,965	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	5,245,574	5,809,038	7,843	627,996
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	30	—	<3.1%>
(オーストラリア)			千豪ドル		
BWP TRUST	73,000	83,000	262	22,031	0.1
MIRVAC GROUP	546,000	595,000	1,356	113,954	0.6
INVESTA OFFICE FUND	94,000	103,000	482	40,491	0.2
CROMWELL PROPERTY GROUP	204,000	208,000	211	17,734	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	48,000	55,000	239	20,097	0.1
ASPEN GROUP	13,000	13,000	14	1,201	0.0
GPT GROUP	266,000	288,000	1,483	124,588	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP	45,000	45,000	149	12,549	0.1
ALE PROPERTY GROUP	26,000	26,000	120	10,111	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP	355,000	393,000	1,874	157,467	0.8
DEXUS	142,600	157,000	1,657	139,265	0.7
GOODMAN GROUP	234,300	256,200	2,139	179,698	0.9
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	7,000	7,000	45	3,792	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD	42,450	19,000	18	1,548	0.0
CHARTER HALL GROUP	63,000	76,000	439	36,899	0.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26,550	37,550	126	10,629	0.1
GENERATION HEALTHCARE REIT	22,000	—	—	—	—
INGENIA COMMUNITIES GROUP	22,000	32,000	85	7,203	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	109,100	122,000	287	24,185	0.1
ARENA REIT	35,220	35,220	81	6,804	0.0
PROPERTYLINK GROUP	—	109,000	95	8,057	0.0
CHARTER HALL LONG WALE REIT	25,000	25,000	108	9,093	0.0
INDUSTRIA REIT	23,000	23,000	56	4,714	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	71,018	89,000	133	11,176	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	22,680	22,680	69	5,810	0.0
GDI PROPERTY GROUP	70,300	70,300	74	6,229	0.0
360 CAPITAL OFFICE FUND	11,100	—	—	—	—
SCENTRE GROUP	788,000	858,000	3,595	301,981	1.5
WESTFIELD CORP	281,700	307,900	2,607	219,064	1.1
FOLKESTONE EDUCATION TRUST	33,250	33,250	92	7,792	0.0
VICINITY CENTRES	485,000	525,000	1,470	123,480	0.6
CENTURIA URBAN REIT	—	11,100	25	2,181	0.0

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末			
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		口	口	千豪ドル	千円	%
VIVA ENERGY REIT		56,000	69,000	164	13,794	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	4,241,268	4,694,200	19,567	1,643,631	
	銘 柄 数 < 比 率 >	31	31	—	<8.0%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND		158,571	158,571	195	15,718	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST		48,033	48,033	108	8,748	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST		153,000	174,000	217	17,528	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD		67,525	67,525	110	8,924	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD		110,000	138,000	142	11,510	0.1
INVESTORE PROPERTY LTD		32,000	32,000	43	3,507	0.0
STRIDE STAPLED GROUP		58,000	58,000	99	8,039	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD		188,000	215,000	307	24,777	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	815,129	891,129	1,225	98,754	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	8	—	<0.5%>	
(イスラエル)				千新シェケル		
REIT 1 LTD		22,490	28,000	363	11,408	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	22,490	28,000	363	11,408	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	18,044,938	20,057,668	—	20,330,654	
	銘 柄 数 < 比 率 >	322	326	—	<99.4%>	

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

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

* 金額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	REIT先物取引		百万円	百万円
		DJREA	95	—
		FTEPR	7	—

* 単位未満は切り捨て。

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

＜マザーファンドの対象指数について＞

* NOMURA-BPI総合は、野村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（為替ヘッジを行わない円ベースの指数）です。シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

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

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

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

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

当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com 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 サービスーズ エルエルシーの所有する登録商標であり、野村アセットマネジメントに対して利用許諾が与えられています。スタンダード&プアーズは本商品を推奨・支持・販売・促進等するものではなく、また本商品に対する投資適格性等に関しいかなる意思表明等を行なうものではありません。

国内株式マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日2017年5月10日）

作成対象期間（2016年5月11日～2017年5月10日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ー ス 東 証 株 価 指 数 (T O P I X)	マ ー ク 株 価 指 数 (P I X)	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率					
	円	%		%	%	%	百万円
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
16期(2017年5月10日)	15,104	21.4	1,585.19	18.7	98.6	1.4	335,246

* 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

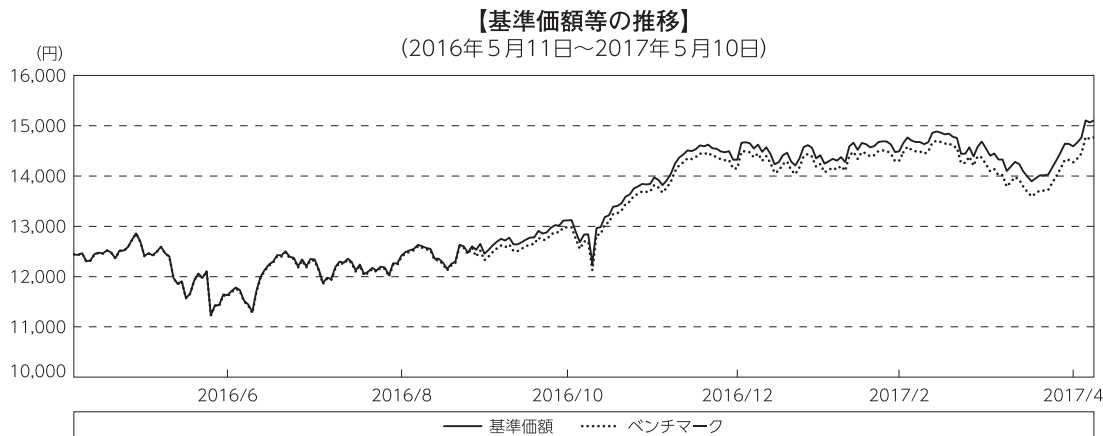
年 月 日	基 準	価 額	ベ 東 （ T O P I X ）	マ ー ク 数 ）	株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2016年 5 月10日	12,439	—	1,334.90	—	97.7	2.3
5 月末	12,861	3.4	1,379.80	3.4	97.4	2.2
6 月末	11,630	△ 6.5	1,245.82	△ 6.7	98.2	1.8
7 月末	12,350	△ 0.7	1,322.74	△ 0.9	98.9	0.6
8 月末	12,417	△ 0.2	1,329.54	△ 0.4	98.9	0.9
9 月末	12,457	0.1	1,322.78	△ 0.9	98.3	1.6
10月末	13,119	5.5	1,393.02	4.4	97.4	2.0
11月末	13,843	11.3	1,469.43	10.1	97.8	1.7
12月末	14,324	15.2	1,518.61	13.8	98.8	1.2
2017年 1 月末	14,355	15.4	1,521.67	14.0	98.7	1.0
2 月末	14,491	16.5	1,535.32	15.0	98.1	1.9
3 月末	14,405	15.8	1,512.60	13.3	97.8	2.2
4 月末	14,591	17.3	1,531.80	14.8	97.9	2.0
(期 末)						
2017年 5 月10日	15,104	21.4	1,585.19	18.7	98.6	1.4

* 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12,439円から期末15,104円に2,665円の値上がりとなりました。

米国次期政権の景気刺激策への期待感や円安の進行による企業業績の改善期待などから、基準価額は上昇しました。

○投資環境

期首から2016年8月まで、日銀による追加金融緩和期待や、消費税増税延期や大型補正予算などへの政策期待、円高の進行が継続したこと、英国のEU（欧州連合）離脱を問う国民投票への見方などを巡り、株式市場は一進一退の展開となりました。

8月以降も、決算発表や米国大統領選挙を控え横ばいの展開となりましたが、11月中旬以降は、米国次期政権の景気刺激策への期待感や円安の進行による企業業績の改善期待、世界的に株式市場が好調だったことなどを受けて、上昇しました。

2017年3月中旬以降は、米国政権の政策運営の不透明感に加え、北朝鮮やシリア情勢など地政学リスクの高まりを背景に下落しましたが、その後、米国の税制改革案への期待やフランス大統領選の結果に対し安堵感が広がったことなどを背景に上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

実質株式組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

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

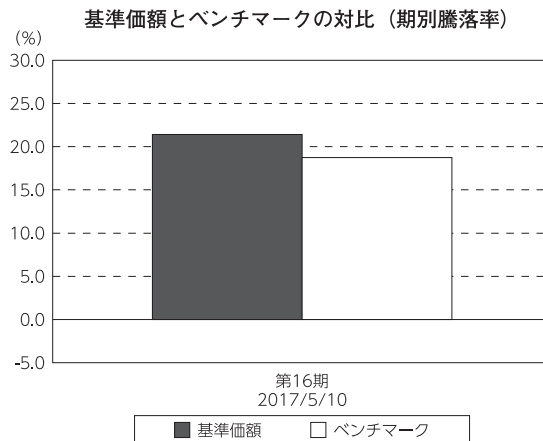
なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+21.4%となり、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）の+18.7%を2.7ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（プラス要因）

保有銘柄の配当権利落ちによりファンドには未収配当金が計上されたこと



（注）ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）です。

◎今後の運用方針

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年5月11日～2017年5月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 0 (0) (0)	% 0.001 (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、13,403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

(2016年5月11日～2017年5月10日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 20,927 (△16,440)	千円 26,876,464 ()	千株 17,898	千円 22,869,094

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

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

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円 48,934	百万円 51,228	百万円 —	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年5月11日～2017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	49,745,559千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	296,609,200千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.16

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月11日～2017年5月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	26,876	9	0.0	22,869	29	0.1
貸株	155,614	8,365	5.4	161,038	7,532	4.7

* 貸株の買付額等は貸付、売付額等は返済を示しています。

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 202	百万円 84	百万円 2,010

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 51

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	3,523千円
うち利害関係人への支払額 (B)	6千円
(B) / (A)	0.2%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

(2017年5月10日現在)

○組入資産の明細

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
極洋	66	6.3	18,837
日本水産	178.4	207.8	116,575
マルハニチロ	31.6	30.4	95,152
カネコ種苗	—	5.5	8,090
サカタのタネ	22.9	23.6	79,768
ホクト	15.7	16.3	35,371
ホクリョウ	1.4	2.3	2,042
鉱業 (0.3%)			
住石ホールディングス	45.5	44.4	4,395
日鉄鉱業	43	4.4	25,960
三井松島産業	101	9.8	14,739
国際石油開発帝石	815.8	843	924,349
日本海洋掘削	4.6	5.6	12,600
石油資源開発	24.5	25.3	63,123
K&Oエナジーグループ	10.4	10.8	19,753
建設業 (3.0%)			
ショーボンドホールディングス	16.2	15.5	80,290
ミライト・ホールディングス	47.6	49.2	58,006
タマホーム	11.6	12	7,956
サンヨーホームズ	3.2	3.4	2,193
ファーストコーポレーション	—	3.5	3,972
インベスターズクラウド	—	2	9,000
ダイセキ環境ソリューション	3.6	4.5	5,877
安藤・間	103.3	115	94,300
東急建設	50.4	56.8	56,061
コムシスホールディングス	66.6	62.5	141,437
ミサワホーム	18.3	18.9	19,221
ビーアールホールディングス	6.1	15.8	6,335
高松コンストラクショングループ	11.7	12.1	33,275
東建コーポレーション	6.4	6	56,880
ソネック	1.7	2	1,412
ヤマウラ	7.2	7.5	4,995
大成建設	804	814	720,390
大林組	464.4	479.9	540,367

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
清水建設	474	490	542,920
飛島建設	124.3	154.1	26,813
長谷工コーポレーション	180.7	186.7	249,804
松井建設	17.1	17.6	17,600
銭高組	22	23	9,844
鹿島建設	726	703	553,261
不動テトラ	109.4	129.2	24,806
大末建設	5.9	5.6	5,633
鉄建建設	94	97	32,592
西松建設	179	185	107,855
三井住友建設	593.4	613.2	76,650
大豊建設	60	58	33,060
前田建設工業	95	105	114,135
佐田建設	10.7	11	4,741
ナカノフドー建設	11.8	12.2	8,296
奥村組	147	132	93,720
東鉄工業	18.6	19.2	62,208
イチケン	17	15	6,450
浅沼組	50	56	19,040
戸田建設	180	186	133,734
熊谷組	227	251	77,810
青木あすなろ建設	10.1	10.5	8,568
北野建設	32	33	10,461
植木組	19	20	5,280
三井ホーム	20	21	14,637
矢作建設工業	21.1	21.8	20,165
ビーエス三菱	18.3	16.8	7,476
日本ハウスホールディングス	31.6	32.6	16,202
大東建託	57	57.9	985,168
新日本建設	18.4	19	17,689
N I P P O	36	37	83,435
東亜道路工業	29	30	10,650
前田道路	48	50	108,700
日本道路	46	48	25,536
東亜建設工業	135	13	28,925

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
若築建設	89	92	13,984
東洋建設	48.6	46	19,136
五洋建設	171.8	177.6	103,896
大林道路	18.1	16.6	11,520
世紀東急工業	24.3	23.3	13,980
福田組	25	26	26,000
住友林業	106.6	110.1	194,987
日本基礎技術	17.2	17.8	6,301
日成ビルド工業	43	47	27,401
ヤマダ・エスバイエルホーム	79	81	6,885
巴コーポレーション	19.2	19.9	7,024
パナホーム	58	60	73,800
大和ハウス工業	457.5	472.7	1,676,666
ライト工業	29.8	30.8	35,943
積水ハウス	517.7	503.5	963,950
日特建設	17	13.6	6,745
北陸電気工事	7.5	7.8	7,121
ユアテック	24	25	18,375
西部電気工業	13	2.7	6,188
四電工	12	12	5,952
中電工	22.4	18	48,780
関電工	62	64	73,152
きんでん	93.6	106.4	187,796
東京エネシス	18	16.5	16,401
トーエネック	22	23	13,846
住友電設	12.2	11.1	15,928
日本電設工業	25.2	26.1	57,759
協和エクシオ	60.7	62.7	115,054
新日本空調	13	12.3	18,609
NDS	24	2.5	7,512
九電工	28.3	31.1	114,137
三機工業	34.3	35.5	36,600
日揮	156	149.3	265,007
中外炉工業	47	48	10,800
ヤマト	13.9	14.3	7,965
太平電業	23	22	25,410
高砂熱学工業	46.2	44	78,452
三晃金属工業	15	1.4	4,375
朝日工業社	18	3.6	11,484
明星工業	28	29	18,531

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大気社	18.9	21.2	61,713
ダイダン	21	21	24,297
日比谷総合設備	18.6	17.9	31,933
東芝プラントシステム	25.1	26	47,476
ＯＳＪＢホールディングス	31.5	48.9	13,007
東洋エンジニアリング	83	94	26,414
千代田化工建設	112	115	84,640
新興ブランテック	31.8	32.9	27,537
食料品 (4.6%)			
日本製粉	99	47.6	81,586
日清製粉グループ本社	169.8	175.5	306,598
日東富士製粉	12	1	3,850
昭和産業	64	66	40,722
鳥越製粉	12.3	12.7	10,452
中部飼料	14.3	17.5	24,535
フィード・ワン	93.2	96.3	21,186
東洋精糖	23	24	2,784
日本甜菜製糖	79	8.2	19,565
三井製糖	61	11.3	31,820
塩水港精糖	16.5	17.1	4,309
日新製糖	6.6	6.8	12,954
森永製菓	140	31.2	183,456
中村屋	36	3.7	18,315
江崎グリコ	35.8	40	241,600
名糖産業	6.8	6.9	10,543
不二家	89	91	23,387
山崎製パン	113	117.2	264,754
第一屋製パン	24	25	3,100
モロゾフ	24	24	14,232
亀田製菓	8.6	8.9	47,793
寿スビリッツ	11	15.2	46,664
カルビー	57.4	65.3	264,138
森永乳業	139	144	132,624
六甲バター	6.9	7.1	17,508
ヤクルト本社	83	85.8	565,422
明治ホールディングス	91.7	94.8	913,872
雪印メグミルク	36.4	34.5	117,645
プリマハム	98	101	54,540
日本ハム	114	112	371,840
林兼産業	50	5.1	4,365

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	80	76	39,064
S F o o d s	9.7	8.6	30,315
伊藤ハム米久ホールディングス	92.5	92.3	97,191
サッポロホールディングス	237	52.4	168,466
アサヒグループホールディングス	290.5	300.2	1,318,178
キリンホールディングス	627.6	689	1,552,317
宝ホールディングス	112.1	115.8	136,065
オエノンホールディングス	42	41	10,455
養命酒製造	4.8	4.9	10,290
コカ・コーラボトラーズジャパン	52.5	100.9	342,555
コカ・コーライーストジャパン	54.8	—	—
サントリー食品インターナショナル	106.1	109.6	574,304
ダイドーグループホールディングス	7.8	7.3	39,566
伊藤園	45.9	47.5	198,550
キーコーヒー	13.6	14.1	31,851
ユニカフェ	4.2	4.3	4,214
ジャパンフーズ	2	2	2,710
日清オイリオグループ	82	92	63,204
不二製油グループ本社	41.3	42.7	107,048
かどや製油	1.5	1.6	9,040
Jーオイルミルズ	65	7.4	32,005
キッコーマン	117	112	394,240
味の素	325.7	329.7	728,472
キュービー	78.8	81.4	234,513
ハウス食品グループ本社	52.9	59.2	149,420
カゴメ	55.6	57.4	191,716
焼津水産化学工業	7.3	7.5	9,600
アリアケジャパン	12.7	13.1	95,630
ビエトロ	1.4	1.9	3,100
エバラ食品工業	3.7	3.8	8,078
ニチレイ	165	78.7	225,396
東洋水産	76.1	78.7	339,197
イートアンド	1.7	1.8	4,147
大冷	—	1.6	2,900
ヨシムラ・フード・ホールディングス	—	0.3	883
日清食品ホールディングス	65.5	62.5	408,125
永谷園ホールディングス	15	15	21,480
一正蒲鉾	5.4	5.6	7,375
フジッコ	15	15.5	40,222
ロック・フィールド	16.1	15.4	28,120

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本たばこ産業	915.5	886.9	3,362,237
ケンコーマヨネーズ	5	8.6	24,828
わらべや日洋ホールディングス	8.3	9.4	26,620
なとり	7.7	8	16,152
イフジ産業	—	2.5	1,920
北の達人コーポレーション	2.8	6.9	5,409
ユーグレナ	49.6	55.3	66,691
ミヨシ油脂	53	55	7,975
理研ビタミン	4.6	4.7	20,069
繊維製品 (0.7%)			
片倉工業	18.1	18.7	26,703
グンゼ	117	112	52,080
東洋紡	573	592	117,216
ユニチカ	421	410	38,950
富士紡ホールディングス	70	7.3	23,068
倉敷紡績	148	151	39,411
シキボウ	88	81	11,421
日本毛織	44.5	42.2	38,317
ダイトウボウ	21	20	1,460
トーア紡コーポレーション	6.1	6.3	3,515
ダイドーリミテッド	16.2	16.7	7,381
帝国繊維	15.1	15.6	27,830
帝人	592	122.3	267,592
東レ	1,050	1,085.2	1,035,389
サカイオーベックス	38	3.5	6,373
住江織物	36	41	10,742
日本フェルト	7.7	8.6	4,472
イチカワ	10	10	3,020
日東製網	16	1.6	3,008
芦森工業	31	—	—
アツギ	111	123	16,605
ダイニック	27	28	5,404
セーレン	36.1	37.3	61,395
ソトー	—	5.6	6,580
東海染工	20	21	2,877
小松精練	22.2	21	16,548
ワコールホールディングス	86	89	128,605
ホギメディカル	9.1	9.4	69,466
レナウン	39.1	40.4	5,979
クラウディア	3.3	3.4	1,880

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
T S I ホールディングス	64.6	61.6	48,048
三陽商会	81	78	13,182
ナイガイ	53	55	3,135
オンワードホールディングス	94	97	83,420
ルック	26	27	5,427
キムラタン	610	632	4,424
ゴールドウイン	6.1	6.3	38,556
デサント	33	34.1	47,092
キング	7.2	7.4	2,982
ヤマトインターナショナル	8.9	9.9	4,158
パルプ・紙 (0.3%)			
特種東海製紙	84	8.7	36,931
王子ホールディングス	594	585	320,580
日本製紙	74.8	67	143,313
三菱製紙	221	21.3	16,614
北越紀州製紙	89.8	83.5	67,134
中越パルプ工業	57	59	14,160
巴川製紙所	22	23	5,612
大王製紙	64.1	59.6	88,088
阿波製紙	—	3.6	2,167
レンゴー	128	144.2	97,190
トーモク	46	47	17,061
ザ・バック	10.2	10.6	34,397
化学 (6.9%)			
クラレ	228.4	251.8	463,815
旭化成	903	933	1,030,965
共和レザー	9.5	8.7	8,038
昭和電工	964	99.6	218,522
住友化学	1,066	1,101	710,145
日本化成	27	—	—
住友精化	30	6.2	31,000
日産化学工業	87	81.9	291,564
ラサ工業	55	56	8,120
クレハ	109	11.3	57,065
多木化学	9	10	9,270
テイカ	24	23	17,871
石原産業	260	26.9	30,504
片倉コープアグリ	17	20	5,000
日東エフシー	8.5	8.7	7,934
日本曹達	94	90	55,890

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東ソー	391	432	457,056
トクヤマ	240	233	124,189
セントラル硝子	157	152	74,784
東亜合成	90.6	93.7	124,995
大阪ソーダ	62	64	32,896
関東電化工業	35	30.6	30,814
デンカ	300	310	182,280
信越化学工業	259.6	268.3	2,648,389
日本カーバイド工業	49	51	8,466
堺化学工業	59	56	22,064
エア・ウォーター	119	123.4	271,850
大陽日酸	111.5	115.2	156,672
日本化学工業	54	55	13,145
日本パーカライジニング	74	76.4	114,829
高圧ガス工業	21	22.2	17,182
チタン工業	17	17	3,247
四国化成工業	21	22	31,812
戸田工業	29	30	8,130
ステラ ケミファ	7.4	7.3	21,542
保土谷化学工業	43	5.2	19,136
日本触媒	21	23.5	163,090
大日精化工業	56	62	49,786
カネカ	195	202	183,214
三菱瓦斯化学	249	139.4	335,675
三井化学	614	680	405,960
J S R	135.8	150.4	299,145
東京応化工業	29	28	102,200
大阪有機化学工業	10.3	9.7	11,775
三菱ケミカルホールディングス	969.6	1,007.8	909,035
KHネオケム	—	24.4	41,089
日本合成化学工業	34	—	—
ダイセル	203.6	201.7	264,227
住友ベークライト	135	132	96,360
積水化学工業	328.6	339.6	677,841
日本ゼオン	122	126	150,696
アイカ工業	43.5	48	158,160
宇部興産	775	754	199,056
積水樹脂	22.3	23.1	48,094
タキロンシーアイ	34	31	18,135
旭有機材	47	48	11,472

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日立化成	71.5	83.2	271,232
ニチバン	14	15	13,320
リケンテクノス	31.2	32.2	18,225
大倉工業	35	36	19,332
積水化成成品工業	37	20.8	17,596
群栄化学工業	39	3.6	13,500
タイガースポリマー	7.1	7.4	5,476
ミライアル	5.2	5.4	5,194
ダイキアクシス	2.7	2.5	5,087
ダイキョーニシカワ	18.6	26.2	37,990
日本化薬	94	97	149,962
カーリットホールディングス	13.4	13.9	8,089
日本精化	12	12.4	12,586
扶桑化学工業	9.1	10.6	39,220
ADEKA	71.2	64.3	109,374
日油	109	116	153,932
新日本理化	22.8	23.6	3,516
ハリマ化成グループ	12.3	12.7	10,528
花王	389.3	373.2	2,460,880
第一工業製薬	32	33	15,411
日華化学	—	4.7	5,588
ニイタカ	2.1	2.2	4,039
三洋化成工業	45	9.4	48,504
有機合成薬品工業	—	9.7	2,842
大日本塗料	83	86	23,134
日本ペイントホールディングス	111.7	115.4	507,760
関西ペイント	163.8	157.2	390,642
神東塗料	11	11	2,365
中国塗料	41	42.9	37,709
日本特殊塗料	10.1	10.5	18,543
藤倉化成	19.7	20.3	13,824
太陽ホールディングス	10.6	12.2	59,109
D I C	572	59.1	244,969
サカタインクス	29.6	30.5	50,599
東洋インキＳＣホールディングス	143	148	84,952
T&K TOKA	10.5	10.8	12,366
富士フイルムホールディングス	331.3	296.7	1,266,909
資生堂	274.7	283.8	907,592
ライオン	167	185.7	396,840
高砂香料工業	9.5	9.8	38,955

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マンダム	13.5	15	83,400
ミルボン	8.5	8.1	45,117
ファンケル	33.6	31.8	59,974
コーセー	23.4	24.2	274,912
コタ	4.9	6.2	7,266
シーズ・ホールディングス	18.2	19.4	65,669
シーボン	1.6	1.7	4,255
ポーラ・オルビスホールディングス	14.7	61	165,920
ノエビアホールディングス	9.1	9.4	43,710
アジupanコスメジャパン	2.7	2.8	2,679
エステー	9.9	10.2	20,155
アグロ カネショウ	5.6	5.8	9,007
コニシ	22.7	23.5	33,769
長谷川香料	18.3	18.9	42,695
星光PMC	7.9	8.2	9,897
小林製薬	21.9	40	251,200
荒川化学工業	12.3	12.8	25,152
メック	11.2	11.6	13,502
日本高純度化学	4.1	4.2	10,155
タカラバイオ	31	42.7	66,185
J C U	4.2	9.4	32,618
新田ゼラチン	9.5	9	6,948
OATアグリオ	1.7	1.7	2,833
デクセリアルズ	43.3	39.3	38,278
アース製薬	10.4	10.7	61,953
イハラケミカル工業	22.3	—	—
北興化学工業	15	15	7,290
大成ラミック	4.1	4.6	13,491
クミアイ化学工業	29.9	63.299	40,258
日本農薬	33.1	37.3	27,602
アキレス	118	12.2	22,387
有沢製作所	21.4	25.3	21,580
日東電工	111.9	107.9	992,356
レック	4.5	9.3	27,574
きもと	23.5	26.7	6,221
藤森工業	12.4	11.1	39,349
前澤化成工業	10.1	9.8	11,985
J S P	9.4	7	19,782
エフビコ	12.8	13.3	73,150
天馬	11.1	9.9	21,789

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
信越ポリマー	28.4	29.3	24,524
東リ	37	35.6	13,243
ニフコ	27.7	26.2	150,126
日本バルカー工業	56	11.6	22,492
ユニ・チャーム	293.1	302.8	853,593
医薬品 (4.7%)			
協和発酵キリン	173.2	178.9	366,566
武田薬品工業	576.5	560.9	3,078,780
アステラス製薬	1,620.9	1,528.2	2,197,551
大日本住友製薬	102.5	105.9	196,550
塩野義製薬	211	189.7	1,172,915
田辺三菱製薬	168.7	174.3	436,795
わかもと製薬	16	17	4,675
あすか製薬	18.4	16.3	27,889
日本新薬	33.2	34.3	215,404
ビオフェルミン製薬	2.3	2.4	7,197
中外製薬	144.1	148.9	615,701
科研製薬	24.9	27.9	192,231
エーザイ	178.2	184.1	1,103,495
ロート製薬	70.9	73.2	164,992
小野薬品工業	328.7	339.7	830,906
久光製薬	44.9	42.2	252,356
有機合成薬品工業	9	—	—
持田製薬	9.9	10	88,800
参天製薬	266.6	270.2	443,128
扶桑薬品工業	49	5	14,660
日本ケミファ	20	2.1	11,613
ツムラ	45.6	50.2	192,517
日医工	33.8	35	63,350
キッセイ薬品工業	25.6	26.5	75,313
生化学工業	27.7	27.7	51,245
栄研化学	12.1	12.6	43,029
日水製薬	5.8	6	8,028
鳥居薬品	9.9	10.2	29,875
J C R ファーマ	11.1	11.5	28,152
東和薬品	6.6	6.9	40,365
富士製薬工業	4.7	4.9	18,081
沢井製薬	24.6	25.4	158,242
ゼリア新薬工業	29.6	30.6	54,284
第一三共	486.8	440.2	1,142,539

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キョーリン製薬ホールディングス	38.6	36.6	89,596
大幸薬品	7.1	7.5	14,302
ダイト	8.1	8.9	21,466
大塚ホールディングス	311.2	321.6	1,657,204
大正製薬ホールディングス	34.8	32	306,560
ペプチドリーム	24.1	28	174,160
石油・石炭製品 (0.5%)			
日本コークス工業	116.8	120.7	12,311
昭和シェル石油	145.6	133.7	152,819
ニチレキ	17.7	18.3	18,940
東燃ゼネラル石油	218	—	—
ユシロ化学工業	7.8	8	11,696
ビービー・カストロール	5.9	6.1	11,461
富士石油	33.6	34.7	12,873
MORESCO	4.6	5.1	9,863
出光興産	75.5	71	278,320
J X T G ホールディングス	1,713.5	2,280.7	1,168,630
コスモエネルギーホールディングス	43.7	45.1	84,923
ゴム製品 (1.0%)			
横浜ゴム	87.3	90.2	202,318
東洋ゴム工業	65.5	79	154,682
ブリヂストン	488.5	504.8	2,408,905
住友ゴム工業	135.5	140	289,380
藤倉ゴム工業	12.1	12.5	8,800
オカモト	45	45	55,980
フコク	5.3	6.2	5,778
ニッタ	15.6	13.4	44,622
住友理工	31.3	27.7	32,879
三ツ星ベルト	35	35	39,970
パンドー化学	53	27.2	29,267
ガラス・土石製品 (1.0%)			
日東紡績	96	121	72,237
旭硝子	764	737	692,043
日本板硝子	698	68.1	62,311
石塚硝子	20	21	4,557
日本山村硝子	57	59	11,859
日本電気硝子	299	309	232,368
オハラ	5.5	5.6	6,283
住友大阪セメント	287	278	141,502
太平洋セメント	903	902	342,760

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
デイ・シイ	13.4	—	—
日本ヒューム	13.9	14.3	9,981
日本コンクリート工業	29.8	33.3	12,254
三谷セキサン	7.2	7.5	21,225
アジアパイルホールディングス	17.8	18.4	11,610
東海カーボン	125	139.7	82,423
日本カーボン	71	73	22,630
東洋炭素	8	8.3	15,894
ノリタケカンパニーリミテド	82	8.4	25,830
TOTO	106.3	109.9	470,372
日本碍子	183	188.8	461,616
日本特殊陶業	124.7	128.9	330,628
ダントーホールディングス	17	12	2,076
MARUWA	5.3	5.5	24,035
品川リフラクトリーズ	36	38	11,970
黒崎播磨	31	32	14,560
ヨータイ	8	9	3,492
イソライト工業	7.1	7.3	3,153
東京窯業	17.6	18.2	3,658
ニッカー	5.1	4.8	2,342
フジミインコーポレーテッド	12.7	12.7	28,092
エーアンドエーマテリアル	30	31	3,999
ニチアス	74	78	100,776
ニチハ	19.2	19.9	70,645
鉄鋼 (1.2%)			
新日鐵住金	652.5	674.3	1,714,407
神戸製鋼所	2,658	258.5	287,452
中山製鋼所	162	16.8	12,432
合同製鐵	81	8.4	14,800
ジェイ エフ イー ホールディングス	395.5	408.7	775,916
日新製鋼	66	48.7	67,595
東京製鐵	79.9	75.6	67,510
共英製鋼	15.4	15.9	29,176
大和工業	31.9	30	87,030
東京鐵鋼	30	31	14,074
大阪製鐵	9.1	9.4	19,693
淀川製鋼所	21.5	20.7	66,447
東洋鋼板	34.6	35.8	14,749
丸一鋼管	48.4	50	173,000
モリ工業	23	4.7	11,228

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大同特殊鋼	242	250	157,250
日本高周波鋼業	57	52	4,264
日本冶金工業	106.4	123.7	30,677
山陽特殊製鋼	86	89	54,468
愛知製鋼	85	8.8	39,160
日立金属	165.7	152.2	245,346
日本金属	37	3.6	5,338
大平洋金属	101	95	33,915
新日本電工	81.9	84.6	29,948
栗本鐵工所	69	7.1	16,131
虹技	20	21	4,641
日本鑄鉄管	16	15	2,550
三菱製鋼	101	104	26,832
日亜鋼業	20	20.7	5,651
日本精線	10	10	6,840
シンニッタン	13	12.2	8,832
新家工業	29	32	6,656
非鉄金属 (0.9%)			
大紀アルミニウム工業所	22	25	14,500
日本軽金属ホールディングス	327.5	384.9	95,455
三井金属鉱業	369	407	152,218
東邦亜鉛	76	84	41,244
三菱マテリアル	903	93.3	312,555
住友金属鉱山	399	387	572,179
DOWAホールディングス	186	165	135,300
古河機械金属	226	233	50,561
大阪チタニウムテクノロジーズ	14.2	16.3	28,671
東邦チタニウム	24.5	25.3	19,607
UACJ	202	211	65,199
古河電気工業	455	50.1	234,969
住友電気工業	579.2	563.3	1,064,355
フジクラ	201	196.8	174,168
昭和電線ホールディングス	172	178	15,308
東京特殊電線	2	2.1	3,670
タツタ電線	30.1	28	16,128
沖電線	17	16	3,648
カナレ電気	2.3	2.1	4,743
平河ヒューテック	6.8	7	9,660
リョービ	88	91	47,229
アーレスティ	16.8	17.3	19,497

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アサヒホールディングス	21.8	22.5	48,172	
金属製品 (0.7%)				
稲葉製作所	7.7	7.9	11,012	
宮地エンジニアリンググループ	45	43	10,234	
トーカロ	10.2	9.8	32,438	
アルファC o	4.8	5	10,955	
SUMCO	113.3	156.1	306,424	
川田テクノロジーズ	2.7	2.9	22,910	
R S T e c h n o l o g i e s	—	0.7	4,949	
東洋製織グループホールディングス	102.8	106.2	204,116	
ホッカンホールディングス	38	39	20,397	
コロナ	7.6	7.8	9,102	
横河ブリッジホールディングス	27.4	26.3	37,372	
駒井ハルテック	26	2.9	6,527	
高田機工	12	13	3,627	
三和ホールディングス	143.6	148.4	174,815	
文化シャッター	40.3	41.6	37,689	
三協立山	19	19.6	34,045	
アルインコ	10.8	10.3	10,712	
東洋シャッター	3.6	3.7	2,349	
L I X I L グループ	201.5	208.2	585,458	
日本フィルコン	10.5	10.8	6,534	
ノーリツ	28.3	29.3	65,807	
長府製作所	15.4	16	43,936	
リンナイ	26.9	25.5	250,920	
ダイニチ工業	7.4	7.6	5,472	
日東精工	21	21.3	9,925	
三洋工業	18	19	3,857	
岡部	30	31	31,403	
ジーテクト	15.1	15.6	32,728	
中国工業	2.2	2.1	1,610	
東ブレ	27.8	28.7	90,692	
高周波熱錬	26.9	27.2	26,193	
東京製網	98	10.1	17,584	
サンコール	7.7	7.9	4,345	
モリテック スチール	7.3	7.5	2,152	
パイオラックス	7.3	22.6	62,602	
エイチワン	—	11.3	15,142	
日本発條	136.2	140.7	177,704	
中央発條	18	17	5,984	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
アドバネクス	2.7	2.6	4,092	
立川ブラインド工業	6	6.2	6,175	
三益半導体工業	10.7	12.6	22,062	
機械 (5.2%)				
日本ドライケミカル	1.8	1.9	4,742	
日本製鋼所	239	49.4	90,599	
三浦工業	64.5	61.1	120,367	
タクマ	53	47.8	55,256	
ツガミ	42	40	36,880	
オークマ	94	97	110,483	
東芝機械	79	89	43,788	
アマダホールディングス	210.9	201.2	274,638	
アイダエンジニアリング	37.9	42.5	42,755	
滝澤鉄工所	45	44	7,612	
富士機械製造	47.2	45.5	65,611	
牧野フライス製作所	72	74	76,220	
オーエスジー	65.9	68.1	158,604	
ダイジェット工業	17	17	3,094	
旭ダイヤモンド工業	38.9	42	37,632	
DMG森精機	79.9	86.1	165,742	
ソディック	36.7	37.9	42,978	
ディスコ	18.4	17.5	321,475	
日東工器	8.4	8.7	23,307	
パンチ工業	5.7	5.4	6,328	
豊和工業	8.1	8.3	5,917	
OKK	56	54	6,534	
東洋機械金属	10.7	10.1	7,231	
津田駒工業	35	33	5,907	
エンシュウ	35	37	3,182	
島精機製作所	20.4	19.5	99,450	
NCホールディングス	4.7	4.8	4,795	
フリュー	2.8	8.8	12,997	
ヤマシンフィルタ	2.8	3.9	8,533	
日阪製作所	18.3	20.3	19,995	
やまびこ	26.5	27.4	37,675	
ベガサスミシン製造	14.9	14.3	13,141	
ナブテスコ	75.2	77.7	261,460	
三井海洋開発	16.9	15	38,775	
レオン自動機	12.2	12.6	13,998	
SMC	43.4	44.8	1,434,048	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
新川	12.9	12.4	10,168
ホソカワミクロン	24	5.3	22,843
ユニオンツール	6.2	6.5	21,417
オイレス工業	18.7	18.3	38,722
日精エー・エス・ビー機械	4.6	4.8	16,464
サトーホールディングス	19.5	18.6	47,857
日本エアーテック	5.1	4.8	3,859
日精樹脂工業	10.5	11.9	13,720
オカダアイヨン	2.8	4.2	4,796
ワイエイシイホールディングス	5.8	5.6	7,868
小松製作所	709.1	689.6	1,991,564
住友重機械工業	422	436	335,720
日立建機	64.6	66.8	186,305
日工	22	4.5	9,342
巴工業	5.9	6.1	11,071
井関農機	148	153	35,802
TOWA	14	12.2	24,131
丸山製作所	30	3.1	5,592
北川鉄工所	66	6.8	15,381
ローツェ	—	7	17,010
タカキタ	4.8	5	2,805
クボタ	694.5	715.5	1,256,775
荏原実業	4.3	4.2	6,237
三菱化工機	48	49	11,123
月島機械	27.4	28.3	36,110
帝国電機製作所	10.5	10.9	12,022
東京機械製作所	54	56	3,696
新東工業	32.8	33.9	35,052
澁谷工業	12.1	12.5	43,875
アイチ コーポレーション	20.5	21.1	16,964
小森コーポレーション	35.2	35.9	56,937
鶴見製作所	10.7	11.1	19,047
住友精密工業	23	24	8,832
酒井重工業	27	28	8,764
荏原製作所	320	67.7	232,211
石井鐵工所	21	2.2	3,702
西島製作所	15.4	14.6	15,753
北越工業	15.5	16.1	15,311
ダイキン工業	201.3	195	2,171,325
オルガノ	25	28	14,784

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トーヨーカネツ	77	69	20,355
栗田工業	86.9	84.5	255,190
椿本チエイン	82	85	85,680
大同工業	28	29	8,700
木村化工機	12.4	12.8	4,262
アネスト岩田	23.3	25.9	26,651
ダイフク	74.3	71.3	216,395
サムコ	3.5	3.9	3,919
加藤製作所	33	7.8	22,869
油研工業	27	28	6,440
タダノ	66.7	74.7	103,833
フジテック	40.2	41.6	58,115
CKD	38.4	42.8	64,414
キトー	17.4	18	21,672
平和	42.8	44.3	128,824
理想科学工業	15.3	14.2	29,919
SANKYO	38.5	39.7	155,822
日本金銭機械	12.7	13.2	17,410
マースエンジニアリング	7.8	8.1	19,585
福島工業	8.5	8.8	37,092
オーイズミ	5.8	6	3,576
ダイコク電機	5.7	5.9	10,543
竹内製作所	27.3	26.1	51,051
アマノ	42.8	44.2	108,201
JUKI	20.5	22.5	35,977
サンデンホールディングス	84	87	29,232
蛇の目シン工業	13.4	13.9	11,161
マックス	21	22	36,300
グローリー	47.1	45.7	176,173
新晃工業	9.6	13.3	23,421
大和冷機工業	22.2	22.9	26,564
セガサミーホールディングス	148.5	141.7	220,060
日本ビストンリング	5.7	5.6	14,397
リケン	64	6.6	34,056
T P R	17	16	62,880
ツバキ・ナカシマ	17.1	16	32,944
ホシザキ	30.3	41.7	396,150
大豊工業	11.1	11.6	17,365
日本精工	283.9	293.4	456,823
N T N	343	331	193,635

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ジェイテクト	147.3	152.2	281,570
不二越	128	144	89,856
日本トムソン	47.3	45.6	29,366
THK	91.9	100.9	300,379
ユースン精機	5.4	6.3	18,169
前澤給装工業	5.6	5.4	8,726
イーグル工業	17.1	15.4	25,687
前澤工業	10.1	9.5	3,135
日本ビラー工業	14	14.4	22,737
キッツ	61.6	68.5	63,225
日立工機	37	10.9	9,439
マキタ	90.1	186.3	784,323
日立造船	109.6	113.2	74,825
三菱重工業	2,461	2,394	1,139,065
I H I	1,062	1,097	468,419
スター精密	—	25	46,475
電気機器 (13.1%)			
日清紡ホールディングス	76.7	79.3	94,049
イビデン	84.6	99.9	200,799
コニカミノルタ	345.1	334.4	336,740
ブラザー工業	178.7	184.6	467,776
ミネベアミツミ	222.7	259.9	451,706
日立製作所	3,526	3,429	2,177,415
東芝	2,910	3,195	859,455
三菱電機	1,474	1,523.5	2,509,204
富士電機	416	430	278,640
東洋電機製造	27	6	10,140
安川電機	171.7	165.6	370,944
シンフォニアテクノロジー	89	92	31,188
明電舎	127	131	55,675
オリジン電気	20	21	6,741
山洋電気	36	37	36,889
デンヨー	12.8	13.2	23,694
東芝テック	99	89	53,133
芝浦メカトロニクス	22	23	6,739
マブチモーター	39.6	40.3	268,398
日本電産	166.3	185.1	1,975,017
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1.6	2.2	6,809
東光高岳	7.7	7.2	12,254
ダブル・スコープ	5.5	13.8	22,494

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ダイヘン	81	78	58,344
田淵電機	15.6	21.6	7,149
ヤーマン	1.8	1.8	10,458
J V C ケンウッド	101.4	104.8	32,278
ミマキエンジニアリング	12.4	12.8	8,985
第一精工	5.7	6.7	12,529
日新電機	32.4	28.7	39,893
大崎電気工業	25	28	25,172
オムロン	156.1	151.8	712,701
日東工業	22.1	21	36,351
I D E C	18	18.6	24,161
不二電機工業	1.3	1.6	2,155
ジーエス・ユアサ コーポレーション	266	275	142,175
サクサホールディングス	35	36	7,956
メルコホールディングス	7.6	7.9	25,596
テクノメディカ	3.1	3.2	6,704
日本電気	1,900	1,964	561,704
富士通	1,333	1,377	1,097,606
沖電気工業	599	61.9	104,363
岩崎通信機	65	63	5,418
電気興業	36	41	23,616
サンケン電気	75	83	45,982
ナカヨ	13	15	5,520
アイホン	7.8	8.1	15,147
ルネサスエレクトロニクス	71.5	73.9	83,359
セイコーエプソン	205.8	212.7	502,397
ワコム	108.8	110.8	48,530
アルバック	25.4	24.1	135,442
アクセル	6.2	6	4,740
E I Z O	13.7	14.1	57,316
ジャパンディスプレイ	258.1	266.7	63,741
日本信号	38.1	39.4	44,916
京三製作所	32	33	15,906
能美防災	15.7	16.2	25,045
ホーチキ	10	10.3	16,500
エレコム	12	12.4	28,036
日本無線	40	8.7	12,554
パナソニック	1,579.1	1,640.2	2,251,994
シャープ	1,168	—	—
アンリツ	83	104.1	100,040

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
富士通ゼネラル	42	48.5	119,649
日立国際電気	31.6	37.3	92,914
ソニー	975.2	1,008.7	4,116,504
TDK	83.4	80.5	586,040
帝国通信工業	33	31	5,983
ミツミ電機	52.6	—	—
タムラ製作所	53	55	28,820
アルプス電気	119.1	131.8	439,553
池上通信機	44	45	6,705
パイオニア	223.6	214.6	45,924
日本電波工業	12.5	13.8	11,495
鈴木	5.3	5.5	3,762
日本トリム	3.7	3.5	13,597
ローランド ディー・ジー	6.8	7.3	21,608
フォスター電機	17.3	16.7	32,147
クラリオン	73	75	34,575
SMK	41	37	14,652
ヨコオ	9.8	10.2	14,565
ティアック	99	103	4,635
ホシデン	41.9	43.3	54,168
ヒロセ電機	22.3	23.1	353,661
日本航空電子工業	40	41	64,903
TOA	16.3	16.8	17,270
日立マクセル	22.9	21.3	48,244
古野電気	16.4	18.4	12,990
ユニデンホールディングス	43	42	7,392
アルパイン	32.9	34	56,100
スミダコーポレーション	11.3	12.9	19,440
アイコム	7.6	7.9	22,341
リオン	5.3	5.5	8,525
本多通信工業	3.6	6.1	9,040
船井電機	14	16	13,936
横河電機	138.3	154.9	279,439
新電元工業	49	55	28,600
アズビル	45.1	43.3	172,117
東亜ディーケーケー	7.7	7.1	4,650
日本光電工業	57.8	59.7	156,055
チノール	4.9	5.1	6,471
共和電業	16.9	16.2	7,840
日本電子材料	5.5	5.6	3,729

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
堀場製作所	25.6	28.3	197,251
アドバンテスト	94.2	97.3	198,978
小野測器	6.7	6.9	5,568
エスベック	14.3	12.7	18,046
パナソニック デバイスSUNX	12.1	—	—
キーエンス	31.3	64.7	3,126,304
日置電機	7.2	7.5	18,240
シスメックス	107.3	111	804,750
日本マイクロニクス	25.8	24.8	23,485
メガチップス	13.8	13.3	42,360
OBARA GROUP	8.1	8.3	46,812
澤藤電機	7	9	4,725
コーセル	19.2	19.8	30,373
イリソ電子工業	—	6	48,720
新日本無線	10.1	12.1	6,788
オブテックスグループ	10.2	10.8	42,336
千代田インテグレ	7.3	7.5	19,110
アイ・オー・データ機器	4.3	5.9	7,115
レーザーテック	16.2	31.4	43,960
スタンレー電気	98.8	101.9	347,988
岩崎電気	47	52	8,996
ウシオ電機	83.9	86.7	127,709
岡谷電機産業	7.4	7.6	3,040
ヘリオス テクノ ホールディング	11.7	13.1	9,838
日本セラミック	7.9	11.7	28,524
遠藤照明	7	7.2	8,013
日本デジタル研究所	11.7	—	—
古河電池	10	10	8,200
双信電機	6.7	6.9	2,063
山一電機	12	13.4	21,105
図研	10	9.3	14,033
日本電子	55	52	30,212
カシオ計算機	138.5	114.9	188,206
ファナック	141.4	144.8	3,315,196
日本シイエムケイ	29.8	30.8	24,917
エンプラス	7	6.5	21,092
大真空	25	5.2	7,519
ローム	68.1	69	595,470
浜松ホトニクス	107.8	104	364,520
三井ハイテック	20	18.8	22,372

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
新光電気工業	52.2	53.9	48,671
京セラ	226.9	234.4	1,565,792
太陽誘電	67.2	69.5	103,694
村田製作所	145,756	149.8	2,444,736
ユーシン	18.3	19.8	15,206
双葉電子工業	22.6	23.4	48,321
北陸電気工業	56	57	8,037
ニチコン	43.5	45	50,445
日本ケミコン	112	123	49,200
K O A	19.1	19.7	40,069
市光工業	33	30	18,750
小糸製作所	82.8	85.6	523,016
ミツバ	23.5	26.3	58,701
スター精密	26.2	—	—
S C R E E Nホールディングス	142	29.3	241,432
キャノン電子	12.7	13.1	28,204
キャノン	744.1	768.9	2,957,189
リコー	447.5	429.4	399,771
M U T O Hホールディングス	16	19	4,693
東京エレクトロン	113.4	95.2	1,406,104
輸送用機器 (8.8%)			
トヨタ紡織	48.3	49.9	119,460
芦森工業	—	32	5,312
鬼怒川ゴム工業	32	—	—
ユニプレス	28.7	27.6	68,144
豊田自動織機	125.8	130	742,300
モリタホールディングス	24.2	25	42,750
三機工業	17.5	18.1	15,348
デンソー	341.5	352.1	1,741,486
東海理化電機製作所	40.4	37.6	82,005
三井造船	535	516	87,720
川崎重工業	1,076	1,111	389,961
名村造船所	41.5	42.9	32,217
サノヤスホールディングス	16.8	17.3	4,878
日本車輛製造	57	52	16,016
ニチユ三菱フォークリフト	15.9	17	10,914
近畿車輛	21	2.1	5,518
日産自動車	1,928.9	1,684.5	1,810,837
いすゞ自動車	400.5	413.9	640,924
トヨタ自動車	1,719	1,736.4	10,559,048

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日野自動車	197.3	203.8	278,187
三菱自動車工業	548.8	523.4	404,588
エフテック	7.3	8.2	11,135
レシップホールディングス	4.5	4.7	4,178
GMB	2.2	2.3	3,344
ファルテック	2.4	2.5	3,462
武蔵精密工業	14.7	16.6	50,132
日産車体	67.5	62.8	68,075
新明和工業	60	58	55,390
極東開発工業	27.5	28.4	52,738
日信工業	30.9	31.9	60,833
トビー工業	114	11.7	36,504
ティラド	54	56	19,096
曙ブレーキ工業	70	66.3	24,862
タチエス	21.9	24.2	54,643
NOK	66.9	69.1	185,188
フタバ産業	42.1	43.5	40,194
K Y B	155	160	84,960
大同メタル工業	19.3	17.9	18,293
プレス工業	73.4	75.8	43,433
ミクニ	17.5	18.1	8,326
カルソニックカンセイ	106	—	—
太平洋工業	30.7	32.1	52,162
ケーヒン	31.8	32.8	59,400
河西工業	17	19.3	27,135
アイシン精機	141.7	130.7	759,367
富士機工	16	14.1	10,419
マツダ	437.6	452.2	724,198
ダイハツ工業	165	—	—
今仙電機製作所	12.6	13.1	14,344
本田技研工業	1,243.8	1,285.2	4,151,196
スズキ	252.9	283.1	1,385,774
S U B A R U	436.8	443.4	1,765,618
安永	4.6	6.9	9,535
ヤマハ発動機	195.2	201.7	552,456
ショーク	35.9	37.1	40,253
T B K	16.4	18.3	9,717
エクセディ	18.8	19.4	62,274
豊田合成	50.2	46.1	132,721
愛三工業	24.2	25	24,750

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
盟和産業	2.3	2.2	2,747
ヨロズ	12.9	13.3	24,339
エフ・シー・シー	22.6	23.3	51,562
シマノ	55.7	57.6	1,035,648
タカタ	25	25.8	10,681
テイ・エス テック	32.1	33.2	110,390
ジャムコ	8.1	8.3	23,655
精密機器 (1.6%)			
テルモ	211.9	218.9	913,907
クリエートメディック	4.6	4.7	4,657
日機装	49.8	49.4	59,625
島津製作所	178	183.8	368,151
JMS	25	26	8,996
クボテック	3	3.1	1,732
長野計器	8.3	11.2	8,232
ブイ・テクノロジー	3.3	2.9	52,780
東京計器	44	49	11,123
愛知時計電機	18	1.9	7,087
インターアクション	—	5.3	4,118
オーバル	13.5	13.9	3,739
東京精密	26.7	27.6	100,188
マニー	18.4	17.4	54,288
ニコン	258.1	248.9	413,920
トプコン	46.4	71.9	156,670
オリンパス	205.9	227.9	977,691
理研計器	11.2	12.6	21,533
タムロン	11.1	12.7	27,393
HOYA	312.5	293.8	1,642,635
シード	—	1.8	3,812
ノーリツ鋼機	12.4	14.4	12,787
エー・アンド・ディ	12.5	13	6,136
シチズン時計	170.1	156.3	121,445
リズム時計工業	60	57	11,058
大研医器	10.9	12.7	10,477
メニコン	9.3	9.8	34,986
松風	6.7	7.5	10,155
セイコーホールディングス	89	101	50,197
ニプロ	103	98.8	170,232
その他製品 (1.9%)			
スノーピーク	1.5	2.2	7,106

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
パラマウントベッドホールディングス	14.6	13.7	66,787
トランザクション	2.8	6.4	6,246
SHOE-BI	4.6	4.8	2,270
ニホンフラッシュ	5.4	6.7	10,036
前田工織	13.8	14.3	20,906
永大産業	20	19	10,165
アートネイチャー	14.8	15.3	11,566
ダンロップスポーツ	8.7	9	10,260
バンダイナムコホールディングス	142.9	157.5	568,575
アイフィスジャパン	3.1	3.2	1,452
共立印刷	23	23.7	8,200
SHOEI	6.2	6.4	17,913
フランスベッドホールディングス	19.3	17.9	17,201
パイロットコーポレーション	24.1	24.9	109,435
萩原工業	3.8	4	11,008
トッパン・フォームズ	24.7	25.5	30,192
フジシールインターナショナル	16.8	32	86,912
タカラトミー	45.5	55.5	65,434
廣済堂	12.8	14.4	5,443
Asme エステール	3.7	3.8	2,705
アーク	58.1	60.1	6,430
タカノ	6.1	6.3	6,489
プロネックス	12.9	13.3	17,635
ホクシン	11	10.1	1,878
ウッドワン	25	24	7,392
大建工業	54	10	21,900
凸版印刷	390	403	474,734
大日本印刷	409	412	522,416
図書印刷	26	19	9,823
共同印刷	46	44	16,940
日本写真印刷	23.2	24.9	72,832
光村印刷	14	13	3,445
宝印刷	6.7	7.5	13,327
アシックス	128.7	141.9	272,731
ツツミ	6.9	5.3	11,267
小松ウオール工業	4.7	4.8	10,272
ヤマハ	101.6	96.2	348,725
河合楽器製作所	5.1	5.6	13,630
クリナップ	16.2	16.7	13,660
ビジョン	78.3	86.3	305,070

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
兼松サステック	14	15	3,390
キングジム	11.5	11.9	10,757
リンテック	32.9	34	91,018
T A S A K I	2.6	3.9	8,529
イトーキ	29.1	30.1	23,839
任天堂	85.1	88	2,596,000
三菱鉛筆	10.3	11.8	78,470
タカラスタンダード	57	29.5	56,168
コクヨ	71.8	74.2	112,338
ナカバヤシ	28	26	7,124
グローブリッド	6.7	6.9	13,703
岡村製作所	48.2	49.8	50,248
美津濃	74	77	46,277
アデランス	24	—	—
電気・ガス業 (1.8%)			
東京電力ホールディングス	1,172.4	1,211.5	557,290
中部電力	422.9	470.6	694,370
関西電力	564	582.8	901,008
中国電力	191.1	197.5	241,542
北陸電力	135.4	139.9	142,837
東北電力	345.3	356.8	561,246
四国電力	124.5	128.6	177,596
九州電力	305.2	315.4	407,181
北海道電力	129.3	133.7	110,302
沖縄電力	14.7	21	61,236
電源開発	117.8	113.6	315,353
エフオン	5.6	7	6,538
イーレックス	4.1	17.9	21,748
東京瓦斯	1,543	1,532	844,898
大阪瓦斯	1,431	1,386	586,139
東邦瓦斯	348	358	291,770
北海道瓦斯	34	36	9,828
広島ガス	24.1	29.4	10,642
西部瓦斯	156	161	42,665
静岡ガス	39.2	43.9	33,934
メタウォーター	8.9	8	23,952
陸運業 (4.2%)			
S B Sホールディングス	13.6	14.1	11,886
東武鉄道	739	763	434,910
相鉄ホールディングス	237	228	122,892

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京急行電鉄	804	776	638,648
京浜急行電鉄	379	391	527,459
小田急電鉄	443	228.8	493,064
京王電鉄	386	399	355,509
京成電鉄	207	107	292,324
富士急行	38	39	40,833
新京成電鉄	18	18	7,542
東日本旅客鉄道	252.7	276.3	2,833,456
西日本旅客鉄道	133	137.5	1,039,500
東海旅客鉄道	123.8	118.8	2,208,492
西武ホールディングス	146.8	197.2	408,006
鴻池運輸	19.5	20.2	32,158
西日本鉄道	179	172	81,012
ハマキョウレックス	10.6	9.3	23,975
サカイ引越センター	5.4	6.6	25,278
近鉄グループホールディングス	1,391	1,437	604,977
阪急阪神ホールディングス	928	180.4	688,226
南海電気鉄道	310	302	171,838
京阪ホールディングス	310	320	231,680
神戸電鉄	34	35	13,580
名古屋鉄道	503	520	271,960
山陽電気鉄道	50	52	30,056
日本通運	535	531	349,398
ヤマトホールディングス	247.1	255.4	618,323
山九	182	188	130,848
丸運	7.5	7.7	2,017
丸全昭和運輸	46	48	22,080
センコーグループホールディングス	62.2	67.8	50,917
トナミホールディングス	28	29	11,397
ニッコンホールディングス	43.9	48.4	118,386
日本石油輸送	16	1.6	4,308
福山通運	84	87	61,248
セイノーホールディングス	98	101.3	137,058
神奈川中央交通	16	17	12,274
日立物流	28.8	29.7	74,576
丸和運輸機関	4.1	3.6	10,724
C＆F ロジホールディングス	13.2	14.8	21,785
九州旅客鉄道	—	141.9	523,611
海運業 (0.2%)			
日本郵船	1,241	1,207	260,712

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
商船三井	673	749	247,170
川崎汽船	605	542	155,554
N S ユナイテッド海運	62	64	15,680
明治海運	12.4	12.8	5,734
飯野海運	71.5	73.9	34,733
共栄タンカー	11	12	2,832
乾汽船	10.9	10.4	9,952
空運業 (0.5%)			
日本航空	264.6	251	858,169
A N A ホールディングス	2,565	2,651	908,232
バスコ	13	13	4,810
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
トランコム	4	4.1	22,714
日新	57	58	25,114
三菱倉庫	98	94	135,548
三井倉庫ホールディングス	80	83	27,058
住友倉庫	101	104	73,216
澁澤倉庫	36	37	13,283
東陽倉庫	24	24.4	7,466
日本トランスシティ	32	33	16,203
ケイヒン	25	26	4,238
中央倉庫	8	8.2	9,003
安田倉庫	10.7	11.1	8,291
東洋埠頭	40	41	7,380
宇徳	11.2	11.6	4,930
上組	165	170	179,010
サンリツ	3.4	3.5	1,834
キムラユニティー	3.5	3.6	4,201
キューソー流通システム	3.8	4.5	12,028
郵船ロジスティクス	12.7	13.1	14,763
近鉄エクスプレス	24.7	25.5	46,435
東海運	7.4	7.7	3,588
エアアイティー	8.5	8.8	9,134
内外トランスライン	4.6	4.3	5,061
情報・通信業 (7.9%)			
N E C ネットズエスアイ	17.1	15.5	37,246
システナ	13.3	11.2	24,292
デジタルアーツ	6.7	6.3	21,640
新日鉄住金ソリューションズ	22.7	23.5	59,995
キューブシステム	5.9	8.1	6,212

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
コア	5.7	5.9	7,770
ソフトクリエイトホールディングス	6.5	6.7	9,292
T I S	45.2	46.7	140,800
ネオス	4	4.2	1,894
電算システム	4.7	4.9	8,364
グリー	82.8	85.8	74,989
コーエーテクモホールディングス	32.4	33.4	74,047
三菱総合研究所	5.3	6	19,200
ボルテージ	2.7	2.5	3,455
電算	1.5	1.6	3,592
A G S	3.1	3.5	6,979
ファインデックス	8.9	10.4	10,722
ヒト・コミュニケーションズ	3.1	3.2	5,654
ブレインパッド	2	3	3,339
K L a b	21.1	26.9	24,694
ポールトゥウィン・ビットクルーホールディ	9	10.1	14,645
イーブックイニシアティブジャパン	3	2.2	2,767
ネクソン	130.7	154.9	322,966
アイスタイル	20.8	29.7	31,006
エムアップ	3.5	4	3,424
エイチーム	7.5	9.5	28,443
テクノスジャパン	3.9	10.9	11,259
e n i s h	4	4.2	4,069
コロブラ	37.9	45.2	49,132
モバイルクリエイト	8.9	10.3	3,800
オルトプラス	5	5.5	4,966
ブロードリーフ	13.7	34.7	25,955
ハーツユナイテッドグループ	4.1	7.4	11,033
メディアドゥ	2.9	4	10,168
ブイキューブ	8.9	7.7	4,535
サイバーリンクス	2.1	2.1	2,257
ディー・エル・イー	—	6.3	3,691
フィックスターズ	—	2.4	7,440
VOYAGE GROUP	4.6	7	16,520
オブティム	1.1	3	8,871
セレス	—	3.3	5,111
ベリサーブ	1.6	1.6	5,208
ティーガイア	13.6	14	27,860
日本アジアグループ	15.4	15.9	6,916
豆蔵ホールディングス	10.8	10.3	9,383

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
テクマトリックス	5.8	8.8	13,411
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	317.8	295.5	81,558
GMOペイメントゲートウェイ	11.2	9.9	57,915
ザッパラス	7.6	7.3	3,628
システムリサーチ	—	1.4	2,923
インターネットイニシアティブ	22.1	20.7	43,884
さくらインターネット	8.9	11.4	10,066
GMOクラウド	3	3.1	7,988
SRAホールディングス	7.8	7.4	23,125
Minorisソリューションズ	2.6	3.1	4,240
システムインテグレータ	1.9	2	1,490
朝日ネット	12.4	12.8	6,617
アドソル日進	—	3.7	4,569
フリービット	—	10.4	9,776
コムチュア	2.3	2.4	9,888
サイバーコム	—	2.5	2,482
メディカル・データ・ビジョン	—	6.2	11,997
gumi	14	16	18,464
ショーケース・ティービー	—	2.1	2,805
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	—	2.1	4,090
PCIホールディングス	—	2.3	6,141
パイブドHD	1.7	2.5	2,677
アイビーシー	—	1.5	1,411
オープンドア	—	1.8	5,634
LINE	—	31.6	119,922
オークネット	—	4.4	5,570
AOITYO Holdings	—	11.5	9,579
マクロミル	—	18.1	35,747
ソルクシーズ	—	5.4	3,110
フェイス	3.6	3.7	4,499
ハイマックス	1.8	1.9	2,912
野村総合研究所	95.6	105.4	437,937
サイバネットシステム	11.1	11.5	8,487
CEホールディングス	2.1	2	2,190
インテージホールディングス	7.1	8	17,624
東邦システムサイエンス	4	4.6	3,141
ソースネクスト	6.8	8.4	4,746
ティー・ワイ・オー	26.8	—	—
フォーカスシステムズ	5.2	7.2	3,981
クレスコ	3.1	3.2	10,944

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・メディア・ホールディングス	142	146.8	241,486
オービック	47	48.6	304,236
ジャストシステム	24.8	22.8	31,623
TDCソフトウェアエンジニアリング	5.9	6.1	7,710
ヤフー	977.6	1,010.3	481,913
トレンドマイクロ	66.2	74.7	398,151
インフォメーション・ディベロプメント	2.6	4	5,016
日本オラクル	21.9	22.6	153,228
アルファシステムズ	4.5	4.6	9,282
フューチャー	16.4	19	16,568
CAC Holdings	10.2	10.5	11,602
ソフトバンク・テクノロジー	3.7	3.4	13,770
トーセ	3.7	3.8	3,275
オービックビジネスコンサルタント	6.9	7.2	40,608
伊藤忠テクノソリューションズ	30.9	31.9	114,999
アイティフォー	17.7	18.3	10,650
東計電算	2.4	2.5	6,032
エックスネット	1.2	2.6	2,423
大塚商会	36.7	37.9	250,140
サイボウズ	18.1	18.7	8,564
ソフトブレーン	19.9	19.2	10,099
電通国際情報サービス	8.4	8.7	21,236
デジタルガレージ	—	27.3	68,523
EMシステムズ	4.6	4.8	9,244
ウェザーニューズ	4.6	4.7	18,518
C I J	12.3	11.8	6,714
東洋ビジネスエンジニアリング	1.4	1.4	2,366
日本エンタープライズ	13.9	14.4	3,816
WOWOW	6.5	6.7	25,560
スカラ	8.5	9.7	8,458
日本コロムビア	4.6	4.2	2,969
イマジカ・ロボット ホールディングス	11.5	11.8	9,239
ネットワンシステムズ	59.1	61	59,719
システムソフト	—	33.2	4,681
アルゴグラフィックス	6.2	6.4	16,460
マーベラス	23	23.8	22,562
エイベックス・グループ・ホールディングス	25.1	25.9	44,237
日本ユニシス	37.6	38.9	67,841
兼松エレクトロニクス	8.6	8.9	30,571
東京放送ホールディングス	81.7	92.9	185,800

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本テレビホールディングス	124.5	128.7	248,391
朝日放送	13.5	13.9	11,036
テレビ朝日ホールディングス	37.3	38.5	79,156
スカパーＪＳＡＴホールディングス	103.5	91.7	47,775
テレビ東京ホールディングス	12.4	11.5	29,555
日本ＢＳ放送	3.1	4.7	5,437
ビジョン	—	2.2	9,306
Ｕ－ＮＥＸＴ	4.2	3.6	3,772
ワイヤレスゲート	4	6.5	9,646
コネクシオ	12	12.4	22,828
日本通信	96.6	117.9	21,575
クロップス	2.5	3	1,827
日本電信電話	1,054.4	1,131.5	5,714,075
KDDI	1,385.7	1,394.5	4,233,702
光通信	16.4	16.9	183,872
NTTドコモ	1,019.3	1,037.6	2,832,648
エムティーアイ	20.7	18.9	11,944
GMOインターネット	49.8	51.4	74,684
アイドママーケティングコミュニケーション	—	1.8	1,299
カドカワ	42.6	40.9	65,440
学研ホールディングス	45	4.7	14,758
ゼンリン	18	18.6	47,430
昭文社	7.4	8.1	6,002
インプレスホールディングス	11.2	11.6	1,600
アイネット	7.6	7.9	10,301
松竹	90	93	123,690
東宝	97.3	92.2	301,494
東映	51	52	52,104
ＡＯＩ Ｐｒｏ.	6.9	—	—
エヌ・ティ・ティ・データ	84.3	87.1	489,502
ビー・シー・エー	1.7	2	3,204
ビジネスブレイン太田昭和	2.1	2.4	2,534
DＴＳ	15.2	14.5	44,370
スクウェア・エニックス・ホールディングス	57.7	54.3	190,593
シーイーシー	8.9	8.3	18,525
カブコン	34.9	33	83,688
アイ・エス・ビー	2.2	2.7	3,836
ジャステック	8.6	8.9	10,858
ＳＣＳＫ	32.4	38.3	185,755
日本システムウエア	5.1	4.6	7,631

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アイネス	19.3	17.8	19,811
TKC	12.6	13	41,080
富士ソフト	20.2	20.9	64,267
NSD	28.9	29.9	54,956
コナミホールディングス	61.6	63.6	315,456
福井コンピュータホールディングス	3.9	4.1	12,361
JBCホールディングス	11.4	11.8	9,994
ミロク情報サービス	10.1	13.9	30,580
ソフトバンクグループ	772.9	634.5	5,520,150
卸売業 (4.4%)			
ハウスイ	11	11	1,353
高千穂交易	5.2	5.4	5,556
伊藤忠食品	3.4	3.5	16,730
エレマテック	6.4	5.6	10,640
JALUX	4.4	4.5	11,884
あらた	6.1	6.4	21,472
トーマンデバイス	2	2.1	4,672
東京エレクトロン デバイス	4.9	5.1	8,506
フィールズ	11.9	10.8	13,510
双日	859.3	832.5	242,257
アルフレッサ ホールディングス	171.5	166.7	360,738
横浜冷凍	33.8	33.1	37,634
神栄	19	19	3,458
山下医科器械	1.1	1.1	1,978
ラサ商事	6.4	6	4,782
ラクーン	5.8	8.9	4,690
アルコニックス	7.7	8	15,968
神戸物産	8.8	7.6	32,680
あい ホールディングス	24.3	20.1	58,450
ディーブイエックス	4.8	5	7,155
ダイワボウホールディングス	124	120	47,280
マクニカ・富士エレホールディングス	24.6	26.1	46,562
バイタルケーエスケー・ホールディングス	23.6	26.5	27,003
八洲電機	10.5	10.9	7,270
メディアスホールディングス	—	2.2	6,100
UKCホールディングス	8.8	9.1	20,638
OCHIホールディングス	3.9	4.1	5,641
TOKAIホールディングス	59.9	61.9	50,634
大阪工機	—	2.1	1,596
三洋貿易	7.5	7.7	16,185

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ビューティガレージ	—	1.9	3,049
ウイン・パートナーズ	4.9	10.1	10,302
ミタチ産業	3.5	3.3	2,263
シップヘルスケアホールディングス	27.7	27.1	83,197
明治電機工業	4.3	4.8	6,216
デリカフーズ	2.9	3	3,510
スターティア	2.6	3.2	1,689
コメダホールディングス	—	25.5	48,042
富士興産	5.3	5	2,515
協栄産業	18	17	2,890
小野建	11.9	12.2	19,032
佐島電機	10.8	10.3	8,590
エコートレーディング	3.1	3.2	2,278
伯東	10.4	9.6	13,267
コンドーテック	10.8	11.2	10,528
中山福	8.5	8.1	6,941
ナガイレーベン	19.7	18.7	48,769
三菱食品	15	15.5	53,707
松田産業	9.9	10.3	15,522
第一興商	24.1	22.9	113,927
メディバルホールディングス	136.4	141	273,681
アドヴァン	13.9	—	—
S P K	3.1	3	8,019
萩原電気	4.6	4.8	11,227
アズワン	10.7	11	58,410
スズデン	4.4	5	5,715
尾家産業	4.4	4.5	5,418
シモジマ	9.4	8.6	10,302
ドウシシャ	16	16.6	36,337
小津産業	3	3.1	7,130
高速	8.1	8.4	9,424
たけびし	4.8	4.9	7,389
黒田電気	25.4	19.2	44,966
リックス	—	3.2	5,491
丸文	12	12.4	9,312
ハビネット	12.4	11.7	22,417
橋本総業ホールディングス	2.8	2.9	4,593
日本ライフライン	—	16	46,240
エクセル	6.6	6	9,108
マルカキカイ	4.4	4.5	8,514

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
I D O M	36.7	37.9	22,929
日本エム・ディ・エム	11.4	10.6	9,179
進和	8	8.3	16,492
エスケイジャパン	3.3	2.6	761
ダイترون	6.2	6.4	8,000
シークス	8.7	10.1	46,662
田中商事	4.2	4.3	3,031
オーハシテクニカ	7.7	7.9	11,336
白銅	3.9	3.5	5,964
伊藤忠商事	1,070.4	1,032.4	1,728,753
丸紅	1,342.5	1,387.2	1,003,916
高島	25	24	4,896
長瀬産業	82	84.7	136,705
蝶理	8.7	9	18,765
豊田通商	151.9	157	575,405
三共生興	20.6	21.3	8,413
兼松	290	300	69,300
ツカモトコーポレーション	24	25	3,025
三井物産	1,233.5	1,274.7	2,000,641
日本紙パルプ商事	71	73	29,565
日立ハイテクノロジーズ	47.3	48.9	223,473
カメイ	17.7	18.3	23,277
東都水産	22	2.1	4,032
ＯＵＧホールディングス	20	22	5,852
スターゼン	4.9	5.9	28,202
山善	52.4	54.1	60,159
椿本興業	15	16	7,232
住友商事	858.7	887.3	1,378,864
内田洋行	34	6.5	17,140
三菱商事	1,023.6	1,057.7	2,500,402
第一実業	31	32	23,456
キャノンマーケティングジャパン	38.9	40.2	97,364
西華産業	44	44	16,148
佐藤商事	12.2	12.6	11,289
菱洋エレクトロ	15.4	13.1	22,649
東京産業	13.5	14	6,552
ユアサ商事	12.9	13.3	44,023
神鋼商事	30	3.5	9,240
小林産業	9	10.2	2,968
阪和興業	136	141	115,479

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カナデン	13	13.4	15,182
菱電商事	22	22	16,500
フルサト工業	7.5	7.8	13,150
岩谷産業	162	156	105,456
すてきナイスグループ	58	60	9,600
昭光通商	48	50	4,850
ニチモウ	21	20	3,700
極東貿易	20	22	5,544
イワキ	21	21	6,888
三愛石油	33.5	37.8	37,459
稲畑産業	32.7	33.8	49,212
G S I クレオス	36	34	5,066
明和産業	12.6	13	5,525
ワキタ	29	30	38,250
東邦ホールディングス	43.7	45.1	113,471
サンゲツ	47.5	48.3	96,938
ミツウロコグループホールディングス	21.9	22.7	16,298
シナネンホールディングス	29	6	13,542
伊藤忠エネクス	35.1	31.1	29,700
サンリオ	42	43.4	91,877
サンワテクノス	8.7	8.3	11,329
リョーサン	21.6	21	79,800
新光商事	16	15.4	20,759
トーホー	6.1	6.3	18,125
三信電気	18.8	15.6	22,308
東陽テクニカ	18.1	16.2	17,739
モスフードサービス	17.9	18.5	65,675
加賀電子	12.3	12.7	26,352
ソーダニッカ	14	14.5	7,902
立花エレテック	10.1	9.5	13,851
フォーバル	7.1	6.1	3,977
P A L T A C	21.8	22.5	77,175
三谷産業	14.5	14.9	5,945
太平洋興発	57	59	5,959
ヤマタネ	63	7	11,088
丸紅建材リース	12	14	3,262
日鉄住金物産	120	12.4	59,148
トラスコ中山	15.6	32.2	81,498
オートバックスセブン	52.2	52.2	92,028
モリト	—	11.3	10,554

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
加藤産業	21.3	22	62,018
イノテック	12.5	12.1	8,010
イエローハット	12.9	13.3	35,245
J Kホールディングス	13.7	14.1	9,630
日伝	5.6	5.8	20,793
北沢産業	11.2	11.6	2,528
杉本商事	7.8	8.1	12,579
因幡電機産業	19.1	19.8	83,358
バイテックホールディングス	5.6	5.7	7,518
ミスミグループ本社	153.2	158.9	355,936
アルテック	11.6	12	2,592
タキヒヨー	23	21	9,723
蔵王産業	2.2	2.3	3,438
スズケン	62.1	64.2	251,664
ジェコス	9.4	9.7	11,465
ルネサスイーストン	11.3	12.9	7,830
小売業 (4.8%)			
ローソン	51.7	44.5	335,975
サンエー	9.3	10.6	54,696
ダイユーエイト	3.6	—	—
カワチ薬品	10.5	10.9	31,184
エービーシー・マート	17.7	25.6	166,656
ハードオフコーポレーション	6.6	6.2	6,578
アスクル	16.6	14.7	49,612
ゲオホールディングス	22.8	23.6	29,523
アダストリア	25.1	21.6	65,988
ジーフット	8.2	8.5	6,562
シー・ヴィ・エス・ペリエリア	20	1.8	1,247
くらコーポレーション	8	9.2	42,826
キャンドウ	7.2	7.4	12,631
パルグループホールディングス	7.9	7.2	21,456
エディオン	57.7	54.6	56,347
サーラコーポレーション	11.7	17.6	11,545
ワッツ	5.8	5.6	6,916
ハローズ	4.4	4.6	10,764
あみやき亭	2.6	2.7	11,286
ひらまつ	18.8	19.4	12,842
ゲンキー	2.7	5.6	16,553
サッポロドラッグストアー	1.8	—	—
大黒天物産	3.2	3.4	19,006

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ハニーズホールディングス	12	13.6	16,156
ファーマライズホールディングス	3.1	3.2	1,705
アルペン	12.2	10.8	22,485
クオール	13.8	15.9	24,724
ジンズ	9.3	9.6	61,152
ビックカメラ	78.3	80.9	92,711
D C Mホールディングス	67.1	85.5	85,072
M o n o t a R O	48.2	50	184,000
東京一番フーズ	3.4	3.5	1,984
ダイヤモンドダイニング	2.8	3.1	6,779
きちり	3.6	3.7	2,460
アークランドサービスホールディングス	4.3	5.9	20,473
J . フロント リテイリング	172.6	178.3	295,086
ドトール・日レスホールディングス	23.9	24.7	60,119
マツモトキヨシホールディングス	28.1	26.7	152,724
ブロンコビリー	7.1	7.4	19,373
スタートトゥデイ	41.5	128.7	353,024
トレジャー・ファクトリー	3.8	4	3,164
物語コラボレーション	3.6	4	20,520
ココカラファイン	14.2	14.7	79,821
三越伊勢丹ホールディングス	271.3	280.4	324,703
H a m e e	—	4.2	4,594
ウエルシアホールディングス	11.8	37.2	136,524
クリエイトSDホールディングス	20.1	20.7	56,034
丸善CH I ホールディングス	15.9	16.4	5,772
ミサワ	2.1	2.5	1,097
ティーライフ	—	1.9	3,363
エー・ピーカンパニー	2.2	2.3	2,231
チムニー	3.3	4.3	12,113
シュッピン	5.1	5.3	10,435
ネクステージ	2.2	5.5	8,035
ジョイフル本田	22.1	22.9	87,249
鳥貴族	—	5.2	13,260
キリン堂ホールディングス	4.4	4.5	3,888
ホットランド	4.7	6.5	7,787
すかいらく	41.7	60.5	107,871
綿半ホールディングス	5.1	5.7	10,556
ヨシックス	—	1.8	2,440
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	45.2	46.7	51,743
ブックオフコラボレーション	7.7	8	6,464

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゴルフダイジェスト・オンライン	3.8	5.7	4,759
BEENOS	—	2.2	3,154
あさひ	10.1	10.5	14,458
日本調剤	3.4	5	20,450
コスモス薬品	6.9	7.1	166,637
トーエル	6.6	6.8	6,181
一六堂	3.3	3	1,173
オンリー	—	2.1	1,883
セブン&アイ・ホールディングス	570.6	590	2,858,550
薬王堂	2.5	7	22,470
クリエイト・レストランツ・ホールディング	36.6	37.8	35,532
ツルハホールディングス	31.3	28.2	329,094
サンマルクホールディングス	10.8	9.1	31,349
フェリシモ	3.9	4	4,260
トリドールホールディングス	16.7	17.3	48,128
クスリのアオキ	12.1	—	—
TOKYO BASE	—	1.8	5,967
サツドラホールディングス	—	1.9	4,170
ダイユー・リックホールディングス	—	4.5	3,460
パロックジャパンリミテッド	—	11.1	13,575
クスリのアオキホールディングス	—	11.2	55,776
スシローグローバルホールディングス	—	12.8	44,672
メディカルシステムネットワーク	15.4	15.9	7,965
総合メディカル	6.6	6.8	32,844
はるやまホールディングス	5.7	6.6	6,573
ノジマ	—	22	34,034
カップバ・クリエイト	19.1	19.7	25,688
ライトオン	10.2	11.8	11,788
ジーンズメイト	4.3	4.5	1,170
良品計画	15.7	18.7	497,420
三城ホールディングス	16.8	17.4	8,334
アドヴァン	—	14.3	16,816
アルビス	3.6	3.7	15,392
コナカ	17.4	18	10,872
ハウス オブ ローゼ	1.7	1.7	2,674
G－7ホールディングス	4	4.1	9,602
イオン北海道	9.1	14.1	8,502
コジマ	20.1	24.2	7,356
ヒマラヤ	4.2	3.8	3,161
コーナン商事	19.3	20	45,620

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エコス	5.2	5.5	6,594
ワタミ	16.1	16.6	22,625
マルシェ	3.3	3.1	2,566
ドンキホーテホールディングス	88.2	91.2	381,672
西松屋チェーン	26.9	24.7	29,812
ゼンショーホールディングス	70.2	73	140,379
幸楽苑ホールディングス	8.6	8.9	16,135
ハークスレイ	3.8	3.4	4,001
サイゼリヤ	22.4	20.9	66,880
V Tホールディングス	46.1	47.6	27,941
魚力	4.2	4.4	5,583
ポプラ	3.4	3.5	1,879
フジ・コーポレーション	—	2.1	4,208
ユナイテッドアローズ	19.5	18.8	66,176
ハイデイ日高	12.4	15.4	37,683
京都きもの友禅	9.3	8.9	8,339
コロワイド	45.2	46.7	90,037
ピーシーデポコーポレーション	15.1	18.7	10,920
売番屋	6.2	9.9	35,838
トップカルチャー	4.9	5.1	2,458
P L A N T	3.1	3.2	3,907
スギホールディングス	24.5	30.9	177,057
ヴィア・ホールディングス	—	10.7	12,026
スクロール	20.6	21.3	8,051
ヨンドシーホールディングス	10.4	14.3	39,139
ユニ・ファミリーマートホールディングス	41.9	61.8	400,464
木曽路	16.7	17.2	45,304
サトレストランシシステムズ	16	16.6	14,508
千趣会	26.9	25.5	20,935
タカキュー	10.5	10.9	2,158
ケーヨー	23	23.7	16,234
上新電機	32	33	42,273
日本瓦斯	20.8	25.8	84,108
ベスト電器	43.9	45.4	7,536
ロイヤルホールディングス	22.6	23.2	51,991
東天紅	10	11	1,914
いなげや	15.2	15.7	28,244
島忠	35.3	36.5	95,885
チヨダ	16.1	16.6	48,090
ライフコーポレーション	8.6	10.7	32,795

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リンガーハット	12.3	15.9	37,301
さが美	11	13	1,573
M r M a x	11.9	17.6	8,518
テンアライド	12.5	13	5,122
A O K I ホールディングス	31.1	28.1	39,255
オークワ	21	20	24,860
コメリ	21	21.7	63,081
青山商事	26.1	29.5	117,705
しまむら	15.8	16.4	259,448
はせがわ	6.4	7.4	3,448
高島屋	198	236	254,408
松屋	27.4	30.7	31,590
エイチ・ツー・オー リテイリング	69.8	72.2	143,389
近鉄百貨店	52	54	19,332
丸栄	28	29	3,683
ニッセンホールディングス	20	—	—
パルコ	13.1	13.5	16,213
丸井グループ	167.4	148.3	229,716
アクシアル リテイリング	10.5	10.9	47,578
井筒屋	74	7.6	3,503
イオン	561.3	580	984,260
ユニーグループ・ホールディングス	130.6	—	—
イズミ	27.1	28	158,480
東武ストア	16	1.7	5,038
平和堂	27.6	28.6	71,786
フジ	15.1	15.7	45,671
ヤオコー	15.5	16	71,600
ゼビオホールディングス	18.5	19.1	36,710
ケーズホールディングス	28.8	59.6	138,272
O l y m p i c グループ	8	8.3	4,764
日産東京販売ホールディングス	22.9	20.7	9,998
アインホールディングス	16.4	18.4	150,880
元気寿司	3.8	3.5	7,794
ヤマダ電機	414.8	471.4	280,954
アークランドサカモト	23.1	23.9	35,682
ニトリホールディングス	58.9	60.9	914,109
グルメ杵屋	10	10	10,840
愛眼	10.9	10.3	2,039
ケーユーホールディングス	7.1	7.3	7,321
吉野家ホールディングス	50.3	49.1	91,031

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
松屋フーズ	6.5	6.8	28,730
サガミチェーン	18.2	17.6	24,868
関西スーパーマーケット	11.1	11.5	18,607
王将フードサービス	10	10.3	44,599
ブレナス	15.2	15.7	37,036
ミニストップ	10.1	10.4	23,244
アークス	25.5	26.4	64,257
パローホールディングス	29.4	30.4	81,016
藤久	1.1	1.1	1,917
ベルク	6.7	6.2	32,054
大庄	7.3	7.5	12,187
ファーストリテイリング	22.8	23.5	903,810
サンドラッグ	28.8	53.6	220,028
サックスパー ホールディングス	12.8	13.2	17,569
ヤマザワ	2.8	2.9	5,269
やまや	2.8	2.9	4,811
ベルーナ	34	30.2	32,978
銀行業 (8.1%)			
島根銀行	2.9	3	4,083
じもとホールディングス	97.9	101.1	20,321
めぶきフィナンシャルグループ	100.1	679.7	301,786
東京ＴＹフィナンシャルグループ	18.8	20.4	69,972
九州フィナンシャルグループ	208.8	231.2	169,238
ゆうちょ銀行	349.5	399.1	564,327
富山第一銀行	34.7	35.8	18,902
コンコルディア・フィナンシャルグループ	950.3	913.6	486,035
西日本フィナンシャルホールディングス	—	95.6	108,028
新生銀行	1,180	1,342	283,162
あおぞら銀行	863	892	375,532
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	10,944.9	10,681.4	7,772,854
りそなホールディングス	1,595.8	1,649	1,006,054
三井住友トラスト・ホールディングス	2,848	294.3	1,178,671
三井住友フィナンシャルグループ	1,092.3	1,128.7	4,745,054
第四銀行	173	173	79,407
北越銀行	147	15.2	43,700
西日本シティ銀行	444	—	—
千葉銀行	526	544	419,968
常陽銀行	493	—	—
群馬銀行	303	313.2	194,184
武蔵野銀行	21.8	22.5	76,950

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
千葉興業銀行	37.4	38.6	25,591
筑波銀行	56.7	58.6	19,220
七十七銀行	214	221	109,616
青森銀行	99	109	43,273
秋田銀行	89	90	33,030
山形銀行	77	79	39,974
岩手銀行	9.5	9.2	43,056
東邦銀行	122	126	53,550
東北銀行	69	72	11,376
みちのく銀行	68	84	15,960
ふくおかフィナンシャルグループ	590	572	300,300
静岡銀行	400	372	358,236
十六銀行	171	189	69,552
スルガ銀行	129.5	144.1	352,900
八十二銀行	246.8	272	182,784
山梨中央銀行	84	87	43,587
大垣共立銀行	182	218	73,248
福井銀行	117	120	34,440
北國銀行	145	150	63,600
清水銀行	4.6	4.8	17,904
富山銀行	2.6	2.7	12,298
滋賀銀行	128	132	79,200
南都銀行	132	13.6	59,432
百五銀行	123	127	59,563
京都銀行	260	252	232,092
紀陽銀行	53.5	53	96,460
三重銀行	61	6.3	14,861
ほくほくフィナンシャルグループ	928	93.8	172,498
広島銀行	402	416	203,008
山陰合同銀行	82	83.5	77,989
中国銀行	96.7	99.9	171,428
鳥取銀行	43	4.5	8,032
伊予銀行	145.9	201	163,212
百十四銀行	150	155	59,520
四国銀行	105	108	38,124
阿波銀行	109	120	93,720
大分銀行	78	81	36,612
宮崎銀行	91	94	34,592
佐賀銀行	83	85	25,670
十八銀行	84	87	29,667

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
沖縄銀行	10.4	13.7	61,307
琉球銀行	28.1	29	48,024
セブン銀行	511.1	528.4	202,377
みずほフィナンシャルグループ	19,335.1	19,137.8	3,997,886
高知銀行	53	51	6,834
山口フィナンシャルグループ	128	132	169,224
長野銀行	45	4.6	9,301
名古屋銀行	114	11.4	48,849
北洋銀行	205.5	230.1	99,863
愛知銀行	4.6	4.7	31,161
第三銀行	77	8	14,040
中京銀行	56	5.8	13,618
大光銀行	48	48	12,528
愛媛銀行	80	17.9	25,256
トマト銀行	53	5.4	8,683
みなと銀行	123	12.8	27,865
京葉銀行	112	115	56,925
関西アーバン銀行	19	19.6	27,812
栃木銀行	71	77.8	43,645
北日本銀行	4.2	4.4	14,344
東和銀行	255	264	31,680
福島銀行	168	153	13,923
大東銀行	82	73	12,629
トモニホールディングス	104.7	116.2	70,882
フィデアホールディングス	111.3	136.8	30,096
池田泉州ホールディングス	144.7	149.5	73,255
証券・商品先物取引業 (1.2%)			
F P G	48.6	50.3	51,809
S B I ホールディングス	163.8	159.3	242,136
日本アジア投資	9.2	13.5	5,764
ジャフコ	22.8	23.6	100,654
大和証券グループ本社	1,276	1,281	871,208
野村ホールディングス	2,624.7	2,881.7	2,010,273
岡三証券グループ	116	120	81,600
丸三証券	40.5	44.8	40,723
東洋証券	52	50	13,250
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	156.5	161.8	95,623
光世証券	33	34	5,712
水戸証券	42.2	43.6	13,777
いちよし証券	30.5	31.5	29,200

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
松井証券	66.8	80.5	74,704
だいら証券ビジネス	6.6	6.8	4,406
マネックスグループ	158.5	149.3	43,147
カブドットコム証券	116.3	105.1	38,256
極東証券	18.3	18.9	32,999
岩井コスモホールディングス	12.9	13.3	14,536
藍澤証券	25.5	26.4	17,608
マネースクウェアHD	4.7	—	—
マネーパターナーズグループ	12.7	18	10,404
小林洋行	3.9	4	1,116
保険業 (2.6%)			
かんぽ生命保険	55.5	53.2	137,894
S O M P O ホールディングス	303	294.7	1,317,309
アニコム ホールディングス	9.2	9.5	21,660
MS&ADインシュアランスグループホール	407.7	421.2	1,571,076
ソニーフィナンシャルホールディングス	130.7	135	252,720
第一生命ホールディングス	874	850	1,681,725
東京海上ホールディングス	552.7	567.7	2,806,141
T & D ホールディングス	497.2	513.7	889,985
アドバンスクリエイト	—	3.3	6,576
その他金融業 (1.2%)			
全国保証	35.5	39.7	175,275
クレディセゾン	103.5	106.9	223,741
アクリーティブ	11.2	11.6	4,164
芙蓉総合リース	15.6	16.1	85,330
興銀リース	25.6	26.5	65,958
東京センチュリー	32	28.4	113,458
日本証券金融	60.1	62.1	37,881
アイフル	228.4	236.4	81,794
ポケットカード	13.6	10.6	7,377
リコーリース	10.7	11.1	41,292
イオンフィナンシャルサービス	89.5	90	192,780
アコム	274	283.1	141,833
ジャックス	75	78	38,064
オリエントコーポレーション	589.8	304.8	61,569
日立キャピタル	32.1	33.2	91,134
アプラスフィナンシャル	65.4	67.6	7,638
オリックス	966	998.2	1,760,325
三菱UFJリース	346	357.5	215,572
日本取引所グループ	400.6	438.3	723,633

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
イー・ギャランティ	4.4	4.2	10,382
アサックス	2.4	2.4	3,986
N E Cキャピタルソリューション	5.5	5.7	10,151
不動産業 (2.5%)			
いちご	151	134	44,890
日本駐車場開発	164	169.9	25,824
ヒューリック	284.4	294	311,346
三栄建築設計	5.5	5.6	8,775
野村不動産ホールディングス	90.5	93.6	187,761
三重交通グループホールディングス	24.2	25	9,875
サムティ	9.8	11.3	13,141
ディア・ライフ	9.2	12.5	4,925
エー・ディー・ワークス	124.9	129.2	5,168
日本商業開発	6	7.9	15,065
プレサンスコーポレーション	4.6	21.9	30,287
ユニゾホールディングス	8.5	11.6	35,670
T H E グローバル社	—	6.6	3,643
日本管理センター	8.9	10.1	13,665
サンセイランディック	3.1	2.9	2,259
エストラスト	2.4	2.5	1,695
フージャースホールディングス	19	18.2	12,394
オープンハウス	19.7	22.9	67,509
東急不動産ホールディングス	330	341	214,148
飯田グループホールディングス	126.4	117.5	216,317
ムゲンエステート	2	6.5	5,947
ファーストブラザーズ	—	1.9	2,926
ハウスドゥ	—	2.3	3,866
シーアールイー	—	2.2	3,524
ケイアイスター不動産	—	3.8	6,406
パーク 2 4	68.9	71.5	213,213
バラカ	3.9	4.5	9,441
三井不動産	723	747.4	1,934,271
三菱地所	1,014	1,048.4	2,350,512
平和不動産	25.8	26.6	49,742
東京建物	149	163.6	255,543
ダイビル	35.1	36.3	40,293
京阪神ビルディング	22.6	23.3	15,471
住友不動産	327	338	1,069,770
大京	253	262	62,618
テーオーシー	52.9	54.6	61,042

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東京楽天地	22	23	12,466
レオバレス 2 1	160.7	177.9	110,298
スターツコーポレーション	15.6	19.2	50,361
フジ住宅	17.4	18	13,302
空港施設	16.5	17	10,336
明和地所	7.5	7.7	5,805
住友不動産販売	9.8	12.7	45,656
ゴールドクレスト	10.7	12.7	26,784
日本エスリード	5.3	5.5	8,184
日神不動産	18.1	16.7	10,537
日本エスコン	—	24.5	10,216
タカラレーベン	59.5	60.5	33,396
サンヨーハウジング名古屋	7	7.3	7,592
イオンモール	88	90.8	185,322
ファースト住建	5.1	5.2	7,753
トーセイ	20.7	19.3	15,748
穴吹興産	15	1.5	4,198
エヌ・ティ・ティ都市開発	84.7	87.6	89,702
サンフロンティア不動産	16.5	15.2	16,963
エフ・ジェー・ネクスト	11.9	12.3	10,701
インテリックス	—	4.3	3,784
ランドビジネス	8	8.3	2,473
グランディハウス	11.9	12.3	5,079
日本空港ビルデング	43.5	45	189,000
サービス業 (3.9%)			
日本工営	48	10	30,600
L i f u l l	40.8	36.9	29,372
ジェイエイシーリクルートメント	8.9	9.2	15,796
日本M&Aセンター	22.3	43.1	171,753
ノバレーゼ	3.7	—	—
アコーディア・ゴルフ	40	—	—
中広	1.4	1.4	1,048
タケエイ	12.6	13.1	13,453
トラスト・テック	5.8	6	12,768
コシダカホールディングス	—	6.8	16,510
パソナグループ	12.5	11.1	10,334
C D S	3.3	3.4	3,954
リンクアンドモチベーション	29.1	35.1	24,991
G C A	12.8	13.2	12,381
エス・エム・エス	18	21.2	65,932

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
デンプホールディングス	101.2	115.4	253,880
リニカル	8.5	8.8	13,349
クックパッド	32.2	33.3	31,368
エスクリ	6.1	5.3	4,261
アイ・ケイ・ケイ	7.7	6.6	5,154
学情	5.3	6.2	8,053
スタジオアリス	6.6	6.1	14,383
シミックホールディングス	7.3	7.6	10,951
N J S	2.9	3.3	4,577
総合警備保障	48.2	54.3	253,309
カカココム	103.6	106.4	168,750
セントケア・ホールディング	—	1.9	3,049
サイネックス	—	1.4	1,622
ルネサンス	7.3	7.6	14,728
ディップ	16	19.2	48,921
オプトホールディング	9	10.9	14,377
新日本科学	13.7	16.6	10,773
ツクイ	17.1	35.3	22,097
キャリアデザインセンター	3	3.1	3,831
エムスリー	125	129.2	380,235
ツカダ・グローバルホールディング	10.5	10.9	6,278
アウトソーシング	6.7	9.6	46,704
ウェルネット	5.4	11.2	16,497
ワールドホールディングス	—	4.5	11,187
ディー・エヌ・エー	64.7	66.9	170,929
博報堂D Yホールディングス	200.1	206.8	291,794
ぐるなび	16.7	21.6	48,859
エスアールジータカミヤ	15.6	16.1	8,919
ジャパンベストレスキューシステム	17.9	16.9	4,630
ファンコミュニケーションズ	33.3	37.9	36,725
ライク	2.9	2.7	7,473
ビジネス・ブレークスルー	—	6.3	2,444
WDBホールディングス	5.2	5.3	8,400
ティア	6.9	7.2	5,508
C D G	—	1	1,820
バリューコマース	13.3	13.8	8,086
インフォマート	27.8	63.3	48,171
J Pホールディングス	35.8	42.9	12,827
E P Sホールディングス	17.9	20.5	34,911
レッグス	2.8	3.4	2,648

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
プレステージ・インターナショナル	12.1	28.2	30,343
アミューズ	8	8.3	21,181
ドリームインキュベータ	4.8	4.5	9,972
クイック	7.4	7.6	10,229
T A C	7.9	8.2	1,902
ケネディクス	193.8	189.2	101,978
電通	160.9	166.3	1,074,298
テイクアンドギヴ・ニーズ	6.7	6.9	6,706
びあ	4.4	4.5	13,432
イオンファンタジー	5.1	4.4	13,288
シーティーエス	4.3	7.9	5,980
ネクシィーズグループ	5.2	5.4	8,548
みらかホールディングス	36.9	38.1	202,692
アルプス技研	5.3	6	23,160
ダイオーズ	2.6	2.7	2,921
日本空調サービス	12.7	14.3	9,995
オリエンタルランド	156.1	161.3	1,092,323
ダスキン	37	36.7	96,961
明光ネットワークジャパン	17.9	17.3	25,707
ファルコホールディングス	6.3	7	11,130
秀英予備校	2.6	3	1,428
田谷	2.4	2.5	1,665
ラウンドワン	45.1	46.6	49,908
リゾートトラスト	60.5	57.7	113,784
ビー・エム・エル	8.5	19.5	48,789
ワタバウエディング	4.3	2.2	1,355
りらいあコミュニケーションズ	23.9	24.7	27,985
リソー教育	26.8	25.4	20,015
早稲田アカデミー	1.9	1.9	2,441
ユー・エス・エス	174.8	180.6	366,437
東京個別指導学院	7	4.8	6,556
サイバーエージェント	38	89.7	324,714
楽天	675.5	762.4	894,295
クリーク・アンド・リバー社	—	7	7,063
テー・オー・ダブリュー	11.6	11.9	9,531
セントラルスポーツ	4.9	5.1	17,544
フルキャストホールディングス	13.2	15.4	18,172
リソルホールディングス	14	15	5,250
テクノプロ・ホールディングス	23.4	24.3	105,705
アトラ	—	2.3	1,485

国内株式マザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
インターワークス	2.5	3	3,348
K e e P e r 技研	1.6	2.2	4,369
ファーストロジック	0.7	1	2,429
デザインワン・ジャパン	—	2.7	3,912
イー・ガーディアン	—	6.9	12,047
リブセンス	9.6	10	5,240
ジャパンマテリアル	6	10.9	20,066
ベクトル	4.5	12.1	19,105
ウチヤマホールディングス	7.4	6.7	3,075
サクセスホールディングス	1.3	1.4	2,179
キャリアリンク	1.9	3.3	1,927
I B J	11.2	11.6	7,006
アサンテ	5.3	5.5	9,746
N・フィールド	6.8	7	9,422
バリューHR	—	1.5	4,402
M&Aキャピタルパートナーズ	1.8	2.5	13,025
ライドオン・エクスプレス	3.1	3.7	3,263
E R I ホールディングス	3.7	3.8	3,298
アビスト	2.2	1.9	7,609
ウィルグループ	3.3	5.9	4,997
エスクロー・エージェント・ジャパン	—	3.3	6,732
日本ビューホテル	2.1	3	4,176
リクルートホールディングス	291.1	325.9	1,955,400
エラン	1.6	2	4,164
土木管理総合試験所	—	2	1,410
日本郵政	424.5	389.3	544,630
ベルシステム24ホールディングス	28.2	22.7	25,174
一蔵	—	1.5	1,755
L I T A L I C O	—	1.7	2,796
エボラブルアジア	—	2.8	8,282
ソラスト	—	9.4	14,447
リロググループ	5.4	74.6	153,377
東祥	4.3	4.2	21,462
エイチ・アイ・エス	23.5	24.3	67,189
ラックランド	2	2.6	5,460
共立メンテナンス	10.9	24.2	79,618
イチネンホールディングス	15.1	15.3	18,436
建設技術研究所	8.5	9.4	11,110
スペース	7.8	8	11,584
燦ホールディングス	2.9	3	5,154

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スバル興業	10	11	5,445
東京テアトル	55	57	8,550
タナベ経営	—	2.9	4,071
ナガワ	2.6	2.7	10,449
よみうりランド	29	30	13,110
東京都競馬	99	102	26,724
常磐興産	53	5.5	9,740
カナモト	20.1	20.8	63,544
東京ドーム	115	59.5	61,285
西尾レントオール	11.6	12	37,320
トランス・コスモス	16.8	17.3	45,187
乃村工藝社	30.9	31.9	72,413
藤田観光	52	49	17,640
K N T - C T ホールディングス	—	85	12,325
日本管財	12.4	12.8	24,896
トーカイ	6.4	6.6	28,347
白洋舎	15	1.4	4,195
セコム	150.2	155.2	1,303,680
セントラル警備保障	6.4	6.6	11,998
丹青社	27	25.8	28,483
メイテック	17.5	17.3	88,403
アサツー ディ・ケイ	25.3	24.3	72,341
応用地質	13.6	14.1	20,473
船井総研ホールディングス	20.1	18.9	51,502
進学会	6.9	6.2	3,664
オオバ	10.5	11.6	6,217
いであ	—	2.7	3,045
学究社	2.1	3.9	6,290
ベネッセホールディングス	48.4	50	194,000
イオンディライト	13.9	16.8	59,640
ナック	8.8	9.1	8,881
ニチイ学館	25.1	25.9	23,180
ダイセキ	27.1	26	65,884
ステップ	4.8	5	7,440
合 計	株 数 ・ 金 額	229,846	216,435
	銘柄数<比率>	1,937	2,001
			<98.6%>

*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいてい
ます。

*銘柄欄の（ ）内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

*評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	百万円 4,804	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2017年5月10日現在)

区 分	当 期 末
	数 量
貸付有価証券＜株式＞総株数 (野 村 證 券 株 式 会 社)	株 13,791,000 (2,318,200)

* () 内は利害関係人との貸付状況です。

○投資信託財産の構成

(2017年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 330, 412, 047	% 92. 9
コール・ローン等、その他	25, 121, 909	7. 1
投資信託財産総額	355, 533, 956	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 (2017年5月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	355,533,956,497
コール・ローン等	21,873,459,041
株式(評価額)	330,412,047,974
未収入金	211,136,178
未収配当金	2,950,845,638
その他未収収益	86,467,666
(B) 負債	20,287,110,120
未払解約金	1,601,919,769
未払利息	△ 515,242
受入担保金	18,667,721,193
前受金	17,984,400
(C) 純資産総額(A－B)	335,246,846,377
元本	221,965,622,884
次期繰越損益金	113,281,223,493
(D) 受益権総口数	221,965,622,884口
1万口当たり基準価額(C／D)	15,104円

(注) 期首元本額は224,682,172,660円、期中追加設定元本額は32,249,274,528円、期中一部解約元本額は34,965,824,304円、1口当たり純資産額は1.5104円です。

○損益の状況 (2016年5月11日～2017年5月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	6,672,173,471
受取配当金	6,377,245,024
その他収益金	280,789,194
支払利息	14,139,253
(B) 有価証券売買損益	53,245,630,926
売買益	59,074,375,143
売買損	△ 5,828,744,217
(C) 先物取引等取引損益	773,759,937
取引益	1,450,366,077
取引損	△ 676,606,140
(D) 保管費用等	△ 1,015,440
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	60,690,548,894
(F) 前期繰越損益金	54,810,036,704
(G) 追加信託差損益金	10,145,916,380
(H) 解約差損益金	△ 12,365,278,485
(I) 計(E＋F＋G＋H)	113,281,223,493
次期繰越損益金(I)	113,281,223,493

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	77,203,300,380
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）	31,298,165,516
マイバランス70（確定拠出年金向け）	17,109,445,525
マイバランス50（確定拠出年金向け）	12,761,236,710
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	8,732,980,916
野村世界6資産分散投信（成長コース）	8,036,894,535
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	6,283,566,619
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）	5,606,629,978
のむらっぴ・ファンド（普通型）	5,220,966,643
野村世界6資産分散投信（分配コース）	4,163,759,183
マイバランス30（確定拠出年金向け）	4,154,306,788
マイ・ロード	3,544,803,938
マイバランスDC50	3,356,581,109
マイバランスDC70	3,064,982,602
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）	2,745,069,556
マイバランスDC30	2,442,487,926
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	2,441,288,679
のむらっぴ・ファンド（保守型）	2,359,839,944
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）	2,027,512,834
野村・国内株式インデックスファンド・VAS（適格機関投資家専用）	1,801,441,145
のむらっぴ・ファンド（積極型）	1,602,447,010
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,426,247,772
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,409,272,944
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,225,604,388
野村インデックスファンド・TOPIX	1,119,555,225
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）	1,100,646,830
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）	1,085,919,937
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）	1,023,038,055
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	793,341,865
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）	698,799,761
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）	622,645,528
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）	599,139,603
バランスセレクト70	492,630,002
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	461,145,203
バランスセレクト50	418,593,693
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）	414,711,205
野村DC運用戦略ファンド	398,436,426
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	394,793,662
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）	351,982,004
野村資産設計ファンド2040	245,929,318
ネクストコア	223,790,775
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	190,765,947
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）	179,929,017
バランスセレクト30	175,483,135
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）	124,256,024
野村資産設計ファンド2025	113,812,816
野村資産設計ファンド2030	107,573,922
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	97,535,624
野村資産設計ファンド2020	85,412,792
野村資産設計ファンド2035	82,715,829
野村資産設計ファンド2015	70,751,521
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）	68,595,015
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	37,271,853
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	32,223,718
野村資産設計ファンド2050	31,653,026

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村資産設計ファンド2045	27,039,967
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）	20,663,460
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	10,507,754
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	8,673,879
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	7,139,774
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	5,234,697
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）	4,858,092
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）	4,498,782
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	4,426,414
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	4,105,773
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	2,532,311
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	1,661,340
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	1,137,429
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	427,066
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	351,039
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	253,742
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	99,736
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	99,658

〇お知らせ

スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2017年3月31日＞

外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2017年3月31日）

作成対象期間（2016年4月1日～2017年3月31日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12- 1

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 額
	円	騰 落 率	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし)	騰 落 率				
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
15期(2017年3月31日)	23,082	14.6	246.86	15.0	95.0	2.4	2.5	364,352

* 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

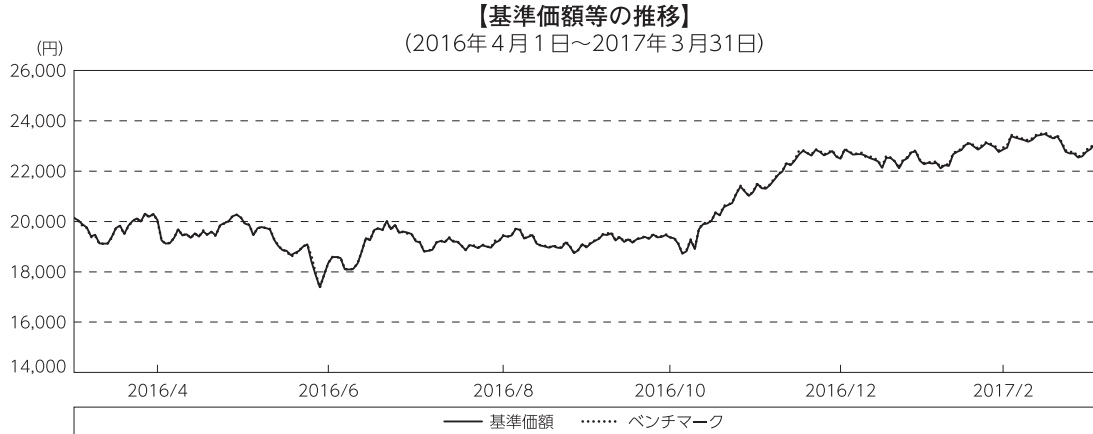
年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	円	騰 落 率	MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし)	騰 落 率			
(期 首) 2016年3月31日	20,145	—	214.69	—	94.8	2.5	2.7
4月末	20,054	△ 0.5	213.50	△ 0.6	95.4	1.8	2.7
5月末	20,277	0.7	215.99	0.6	95.0	2.2	2.7
6月末	18,341	△ 9.0	195.47	△ 9.0	94.9	2.2	2.9
7月末	19,500	△ 3.2	207.78	△ 3.2	95.0	2.0	2.8
8月末	19,439	△ 3.5	207.38	△ 3.4	95.1	1.9	2.8
9月末	18,973	△ 5.8	202.56	△ 5.7	95.0	2.0	2.8
10月末	19,370	△ 3.8	206.47	△ 3.8	95.5	1.8	2.6
11月末	21,160	5.0	225.69	5.1	94.5	2.1	2.6
12月末	22,495	11.7	239.81	11.7	94.9	2.2	2.5
2017年1月末	22,423	11.3	239.35	11.5	95.6	1.8	2.6
2月末	22,861	13.5	244.41	13.8	95.3	1.8	2.6
(期 末) 2017年3月31日	23,082	14.6	246.86	15.0	95.0	2.4	2.5

* 騰落率は期首比です。

* 株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首20,145円から期末23,082円に2,937円の値上がりとなりました。

米国次期政権の景気刺激策への期待感や市場予想を上回る経済指標の発表、主要投資国の株式市場が上昇したことなどを受け、基準価額は上昇しました。

○投資環境

欧米の株式市場は、期首よりもみ合いで推移した後、2016年6月には、英国のEU（欧州連合）離脱問題などから軟調になる場面もありましたが、その後は米国経済指標や欧米企業の決算が市場予想を上回ったことなどを背景に、世界の株式市場は再び上昇しました。11月以降は、米国大統領を巡る不透明感などを受け下落した後、米国次期政権の景気刺激策への期待感や市場予想を上回る経済指標の発表などを受け、上昇に転じました。

2017年以降も、米国新政権による金融規制の緩和や法人税減税などへの期待や利上げ観測を背景に上昇しました。

為替市場は、米国の利上げが緩やかなペースになるとの観測が広がったことや日銀の追加金融緩和が見送られたこと、英国のEU離脱問題などから、主要通貨は対円で下落（円高）しました。11月以降は、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）しました。

2017年1月以降は、米国長期金利の上昇一服を受け内外長期金利差の拡大観測が後退したこと、2月のFOMC（米連邦公開市場委員会）での追加利上げ見送りなどを背景に、米ドルは対円で下落（円高）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

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

・期中の主な動き

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+14.6%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+15.0%を0.4ポイント下回りました。

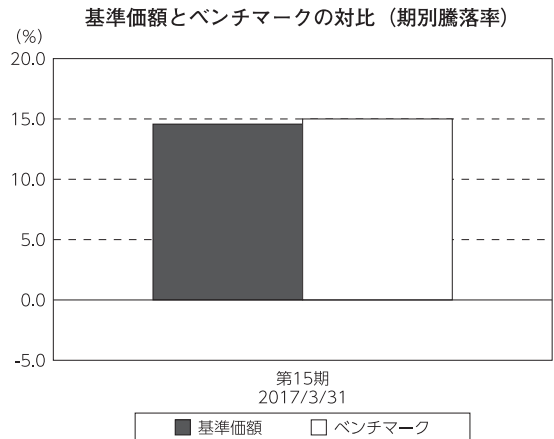
主な差異要因は以下の通りです。

（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）



（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

(2016年 4 月 1 日～2017年 3 月31日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	1	0.003	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.001)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	1	0.003	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(1)	(0.003)	
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.002	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用
(保 管 費 用)	(2)	(0.010)	
(そ の 他)	(△2)	(△0.007)	
合 計	2	0.008	
期中の平均基準価額は、20,419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

(2016年4月1日～2017年3月31日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	アメリカ	百株 21,335 (5,328)	千米ドル 121,481 (11,763)	百株 21,649 (4,891)	千米ドル 118,609 (33,788)
	カナダ	2,815 (526)	千カナダドル 10,505 (19)	1,660 (50)	千カナダドル 6,570 (415)
	イギリス	22,830 (211,229)	千英ポンド 10,823 (1,254)	13,219 (212,472)	千英ポンド 11,897 (1,968)
	スイス	965 (—)	千スイスフラン 5,358 (△ 8)	1,091 (—)	千スイスフラン 5,961 (1,000)
	スウェーデン	1,164 (576)	千スウェーデンクローナ 15,518 (424)	1,546 (—)	千スウェーデンクローナ 12,522 (424)
	ノルウェー	585 (—)	千ノルウェークローネ 8,254 (△ 308)	171	千ノルウェークローネ 2,688
	デンマーク	403 (104)	千デンマーククローネ 13,274 (—)	263	千デンマーククローネ 9,602
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ	2,302 (1,520)	7,405 (△ 23)	2,308 (—)	4,896 (377)
	イタリア	6,885 (△ 2,377)	3,263 (366)	6,001 (1,712)	2,087 (331)
	フランス	1,900 (889)	7,213 (—)	1,838 (208)	4,531 (541)
	イギリス	12 (207)	39 (699)	—	—
	オランダ	1,635 (1,118)	2,723 (1,222)	1,376 (960)	1,887 (301)
	スペイン	3,874 (18,845)	1,817 (819)	3,171 (15,652)	1,498 (636)
	ベルギー	77 (△ 104)	680 (△ 964)	114	926
	オーストリア	67	174	44 (—)	142 (13)
	ルクセンブルグ	10	436	—	—
	フィンランド	369	513	257	404
	アイルランド	42	186	38	150
	ポルトガル	215	127	34,032	155

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	香港	百株 8,234 (760)	千香港ドル 18,907 (-)	百株 3,421	千香港ドル 16,126
	シンガポール	3,970 (4,124)	千シンガポールドル 1,339 (92)	11,993 (-)	千シンガポールドル 1,083 (46)
	オーストラリア	3,665 (399)	千豪ドル 5,855 (172)	3,609 (610)	千豪ドル 4,493 (551)
	ニュージーランド	410	千ニュージーランドドル 147	280	千ニュージーランドドル 113
	イスラエル	764	千新シェケル 3,321	1,292	千新シェケル 14,901

*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
	AGNC INVESTMENT CORP	—	—	—	—
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	(32,900)	(607)	—	—
	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	—	—	1,200	22
		(△ 32,900)	(△ 607)		
	AMERICAN TOWER CORP	2,300	266	1,700	181
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	10,000	108	6,000	60
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	420	73	520	88
	BOSTON PROPERTIES	800	104	600	73
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,700	346	—	—
	CAMDEN PROPERTY TRUST	700	56	800	63
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	51,000	745	—	—
	CROWN CASTLE INTL CORP	3,600	332	900	75
	DIGITAL REALTY TRUST INC	2,100	211	800	75
	EQUINIX INC	1,200	448	240	85
	EQUITY RESIDENTIAL	1,000	68	1,300	82
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	240	54	350	79
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,700	149	900	67
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	390	63	—	—
	GGP INC	—	—	—	—
		(56,500)	(1,667)		
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	2,100	62	—	—
		(△ 56,500)	(△1,667)		
	HCP INC	1,800	66	2,700	78
	HOST HOTELS & RESORTS INC	—	—	3,800	71
	IRON MOUNTAIN INC	5,400	191	—	—
	KIMCO REALTY CORP	2,000	60	2,500	63
	LIBERTY PROPERTY TRUST	—	—	700	26
	MACERICH CO /THE	—	—	1,000	75
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,000	366	—	—
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	14,500	610	—	—
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	—	—	11,380	333
		(11,380)	(277)		
	PROLOGIS INC	2,300	115	1,600	79
	PUBLIC STORAGE	1,000	227	790	166
	QUALITY CARE PROPERTIES	—	—	9,480	117
		(9,480)	(—)		
	REALTY INCOME CORP	2,100	140	1,200	65
	REGENCY CENTERS CORP	6,300	442	—	—
	SBA COMMUNICATIONS CORP	—	—	—	—
		(12,000)	(1,207)		
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,500	292	750	133
	UDR INC	1,700	59	2,100	72
	VENTAS INC	4,300	281	1,200	73
	VEREIT INC	11,000	113	4,000	37
	VORNADO REALTY TRUST	600	59	700	67
	WELLTOWER INC	2,100	146	1,300	85
	WEYERHAEUSER CO	2,000	58	5,800	183
	小計	160,450	7,067	66,310	2,689
		(32,860)	(1,485)		

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	カナダ	口	千カナダドル	口	千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,500	68	—	—
	小 計	2,500	68	—	—
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND	7,000	44	9,000	56
	HAMMERSON PLC	9,000	52	8,000	43
	SEGRO PLC	16,000	70	10,000	49
		(15,200)	(67)		
	SEGRO PLC - NIL PAID RTS	—	—	—	—
		(15,200)	(ー)	(15,200)	(15)
	小 計	32,000	166	27,000	149
		(30,400)	(67)	(15,200)	(15)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	フランス				
	ICADE	700	45	—	—
	KLEPIERRE	1,200	50	1,900	70
	GECINA SA	600	76	—	—
	FONCIERE DES REGIONS	—	—	—	—
				(ー)	(3)
	UNIBAIL RODAMCO-NA	320	78	350	75
	小 計	2,820	251	2,250	145
				(ー)	(3)
	ユ ー ロ 計	2,820	251	2,250	145
				(ー)	(3)
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	7,000	395	11,000	577
	小 計	7,000	395	11,000	577
	シンガポール		千シンガポールドル		千シンガポールドル
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	26,000	63	—	—
		(ー)	(△ 1)	(ー)	(0.19596)
	SUNTEC REIT	—	—	—	—
		(ー)	(△ 1)	(ー)	(0.38394)
	小 計	26,000	63	—	—
		(ー)	(△ 2)	(ー)	(0.5799)
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	MIRVAC GROUP	31,000	71	41,000	89
	STOCKLAND TRUST GROUP	16,000	75	19,000	83
	DEXUS PROPERTY GROUP	8,000	70	9,000	83
	SCENTRE GROUP	27,000	125	22,000	100
	WESTFIELD CORP	8,000	76	10,000	92
	小 計	90,000	420	101,000	448

*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	株式先物取引	百万円 61,728	百万円 61,796	百万円 —	百万円 —

* 単位未満は切り捨て。

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

○株式売買比率

(2016年4月1日～2017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	40,185,994千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	314,518,051千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.12

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年4月1日～2017年3月31日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 33,254	百万円 2,377	% 7.1	百万円 42,848	百万円 1,654	% 3.9
預金	2,243	2,243	100.0	3,221	3,221	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

(2017年3月31日現在)

外国株式

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
ADT CORP/THE		158	—	—	—	商業サービス・用品
AFLAC INC		408	400	2,892	324,543	保険
AGCO CORP		63	63	380	42,662	機械
AGL RESOURCES INC		115	—	—	—	ガス
AES CORP		650	650	720	80,799	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AT & T INC		5,943	5,980	24,972	2,801,662	各種電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES		1,440	1,680	7,484	839,674	ヘルスケア機器・用品
ABBVIE INC		1,576	1,585	10,375	1,164,017	バイオテクノロジー
ACTIVISION BLIZZARD INC		487	577	2,895	324,898	ソフトウェア
ACUITY BRANDS INC		41	43	904	101,501	電気設備
ADOBE SYSTEMS INC.		479	486	6,299	706,689	ソフトウェア
ADVANCE AUTO PARTS		71	71	1,057	118,589	専門小売り
ADVANCED MICRO DEVICES		—	780	1,095	122,949	半導体・半導体製造装置
AETNA INC		337	343	4,353	488,364	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AFFILIATED MANAGERS GROUP		52	52	852	95,640	資本市場
AGILENT TECHNOLOGIES INC		324	312	1,663	186,637	ライフサイエンス・ツール/サービス
AIR PRODUCTS		198	199	2,698	302,737	化学
AIRGAS INC		63	—	—	—	化学
AKAMAI TECHNOLOGIES		167	166	1,004	112,728	インターネットソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP		111	111	1,167	130,931	化学
ALCOA INC		1,250	—	—	—	金属・鉱業
ALEXION PHARMACEUTICALS INC		218	216	2,636	295,836	バイオテクノロジー
ALIGN TECHNOLOGY INC		—	71	809	90,774	ヘルスケア機器・用品
ALLEGHANY CORP		15	15	930	104,395	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP		58	49	1,219	136,817	情報技術サービス
ALLIANT ENERGY CORP		108	229	906	101,661	電力
ALLSTATE CORP		372	361	2,947	330,646	保険
ALLY FINANCIAL INC		421	421	863	96,872	消費者金融
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC		72	—	—	—	バイオテクノロジー
ALPHABET INC-CL C		300	302	25,144	2,820,968	インターネットソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A		281	288	24,490	2,747,590	インターネットソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC		1,889	1,901	13,696	1,536,633	タバコ
AMAZON.COM INC		384	393	34,457	3,865,808	インターネット販売・通信販売
AMERCO		6	6	258	29,007	陸運・鉄道
AMEREN CORPORATION		231	229	1,252	140,506	総合公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC		154	125	531	59,657	旅客航空輸送業
AMERICAN ELECTRIC POWER		475	482	3,237	363,171	電力
AMERICAN EXPRESS CO		811	752	5,956	668,270	消費者金融
AMERICAN INTL GROUP		1,194	1,003	6,275	704,078	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC		171	168	1,293	145,128	水道
AMERISOURCEBERGEN CORP		188	156	1,390	156,009	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC		168	150	1,944	218,198	資本市場
AMETEK INC		233	219	1,185	132,970	電気設備
AMGEN INC		726	725	11,920	1,337,398	バイオテクノロジー
AMPHENOL CORP-CL A		296	304	2,185	245,186	電子装置・機器・部品
ANADARKO PETE		495	536	3,332	373,852	石油・ガス・消耗燃料
ANALOG DEVICES INC		304	357	2,934	329,226	半導体・半導体製造装置
ANSYS INC		84	83	886	99,421	ソフトウェア

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	
				外貨建金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ANTERO RESOURCES CORP	74	147	336	37,766	石油・ガス・消耗燃料
ANTHEM INC	252	257	4,307	483,238	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
APACHE CORPORATION	369	366	1,906	213,889	石油・ガス・消耗燃料
APPLE INC	5,382	5,189	74,685	8,378,941	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS	1,145	1,058	4,114	461,612	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	216	232	861	96,642	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND	582	549	2,531	284,002	食品
ARCONIC INC	—	436	1,159	130,114	航空宇宙・防衛
ARROW ELECTRS INC	93	89	657	73,768	電子装置・機器・部品
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	—	58	719	80,693	化学
ASHLAND INC	59	—	—	—	化学
ASSURANT INC	62	52	496	55,678	保険
ATMOS ENERGY CORP	97	105	829	93,061	ガス
AUTODESK INC.	220	189	1,631	183,032	ソフトウェア
AUTOLIV INC	85	84	851	95,521	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS	444	436	4,454	499,762	情報技術サービス
AUTONATION INC	71	71	308	34,641	専門小売り
AUTOZONE	29	27	1,977	221,852	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	91	87	700	78,552	容器・包装
AVNET	122	122	556	62,427	電子装置・機器・部品
BB&T CORPORATION	759	795	3,595	403,411	銀行
BAKER HUGHES	424	383	2,271	254,847	エネルギー設備・サービス
BALL CORP	124	158	1,163	130,498	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP	10,030	9,841	23,490	2,635,395	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,060	1,021	4,852	544,437	資本市場
BARD (C R)	70	69	1,729	194,070	ヘルスケア機器・用品
BAXALTA INC	657	—	—	—	バイオテクノロジー
BAXTER INTERNATIONAL INC.	529	471	2,460	276,096	ヘルスケア機器・用品
B/E AEROSPACE INC	101	101	651	73,074	航空宇宙・防衛
BECTON, DICKINSON	204	205	3,782	424,368	ヘルスケア機器・用品
BED BATH & BEYOND	156	156	622	69,884	専門小売り
WR BERKLEY CORP	99	99	700	78,558	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,146	1,192	19,961	2,239,427	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	305	284	1,379	154,817	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	153	168	1,497	167,972	バイオテクノロジー
BIOGEN INC	215	212	5,720	641,750	バイオテクノロジー
BLACKROCK INC	119	118	4,554	510,952	資本市場
H & R BLOCK INC	224	224	519	58,277	各種消費者サービス
BOEING CO	614	571	10,176	1,141,746	航空宇宙・防衛
BORGWARNER INC	213	213	893	100,269	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,306	1,314	3,212	360,436	ヘルスケア機器・用品
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,608	1,630	9,023	1,012,366	医薬品
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	—	114	774	86,841	情報技術サービス
BROWN-FORMAN CORP-CL B	110	200	927	104,022	飲料
CBS CORP-CL B	414	374	2,593	290,944	メディア
CBRE GROUP INC	296	296	1,028	115,365	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC	128	128	829	93,054	ソフトウェア
CDW CORPORATION	141	140	803	90,124	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	229	229	679	76,226	化学
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	137	136	1,056	118,477	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP	249	251	3,704	415,637	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CIT GROUP INC	166	194	840	94,263	銀行
CME GROUP INC	312	332	3,945	442,681	資本市場
CMS ENERGY CORP	273	273	1,218	136,692	総合公益事業

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CSX CORP	932	903	4,274	479,590	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	1,067	1,041	8,208	920,887	食品・生活必需品小売り
CA INC	309	309	982	110,170	ソフトウェア
CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A	193	—	—	—	メディア
CABOT OIL & GAS CORP	436	457	1,062	119,153	石油・ガス・消耗燃料
CADENCE DESIGN SYS INC	—	268	840	94,259	ソフトウェア
CALPINE CORP	310	347	375	42,161	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CAMERON INTERNATIONAL CORP	182	—	—	—	エネルギー設備・サービス
CAMPBELL SOUP CO	175	191	1,090	122,376	食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	517	472	4,113	461,438	消費者金融
CARDINAL HEALTH INC	317	310	2,531	284,039	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARMAX INC	193	183	1,099	123,307	専門小売り
CARNIVAL CORP	403	332	1,968	220,837	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC DEL	563	572	5,332	598,217	機械
CELANESE CORP-SERIES A	143	135	1,213	136,144	化学
CELGENE CORP	760	756	9,400	1,054,597	バイオテクノロジー
CENTENE CORP	161	168	1,212	135,987	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	389	384	1,056	118,515	総合公益事業
CENTURYLINK INC	530	522	1,222	137,096	各種電気通信サービス
CERNER CORP	293	301	1,781	199,812	ヘルスケア・テクノロジー
CHARTER COMMUNICATION-A	82	—	—	—	メディア
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	—	211	6,936	778,201	メディア
CHENIERE ENERGY INC	220	195	897	100,700	石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP	1,819	1,839	19,820	2,223,689	石油・ガス・消耗燃料
CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR	84	—	—	—	建設・土木
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	30	27	1,216	136,461	ホテル・レストラン・レジャー
CHURCH & DWIGHT CO INC	128	257	1,285	144,250	家庭用品
CIMAREX ENERGY CO	90	90	1,089	122,255	石油・ガス・消耗燃料
CINCINNATI FINANCIAL CORP	147	155	1,121	125,777	保険
CISCO SYSTEMS	4,890	4,890	16,498	1,851,007	通信機器
CINTAS CORP	91	78	990	111,117	商業サービス・用品
CITIGROUP	2,870	2,776	16,797	1,884,520	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	501	504	1,757	197,224	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	149	149	1,253	140,600	ソフトウェア
CLOROX CO	126	124	1,677	188,209	家庭用品
COACH INC	265	279	1,163	130,493	繊維・アパレル・贅沢品
COCA COLA CO	3,992	3,992	17,005	1,907,894	飲料
COCA COLA ENTERPRISES	207	—	—	—	飲料
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	588	587	3,477	390,128	情報技術サービス
COLGATE PALMOLIVE CO.	825	825	6,041	677,793	家庭用品
COLUMBIA PIPELINE GROUP	370	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
COMCAST CORP-CL A	2,392	4,644	17,419	1,954,309	メディア
COMERICA INC	173	162	1,119	125,642	銀行
COMPUTER SCIENCES CORP	—	138	981	110,155	情報技術サービス
CONAGRA BRANDS INC	412	400	1,611	180,760	食品
CONCHO RESOURCES INC	123	142	1,813	203,470	石油・ガス・消耗燃料
CONOCOPHILLIPS	1,194	1,211	6,055	679,310	石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC	286	293	2,277	255,544	総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	168	171	2,777	311,632	飲料
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	80	94	419	47,055	石油・ガス・消耗燃料
THE COOPER COMPANIES, INC.	47	47	931	104,477	ヘルスケア機器・用品
CORNING INC	1,138	907	2,499	280,440	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	423	426	7,163	803,714	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	—	32	663	74,449	インターネットソフトウェア・サービス

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
COTY INC-CL A	—	476	867	97,370	パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	133	131	688	77,188	容器・包装
CUMMINS INC	161	156	2,370	265,954	機械
DR HORTON INC	317	336	1,123	126,017	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	170	170	1,721	193,145	総合公益事業
DANAHER CORP	595	609	5,220	585,670	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC	109	118	977	109,653	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA INC	160	157	1,075	120,654	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY	303	258	2,816	315,992	機械
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	—	217	1,388	155,792	ソフトウェア
DELTA AIR LINES INC	191	177	818	91,881	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC	229	220	1,378	154,631	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	434	458	1,898	212,982	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC	—	83	705	79,177	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC	—	85	872	97,907	石油・ガス・消耗燃料
DICK S SPORTING GOODS INC	83	82	402	45,188	専門小売り
DISNEY (WALT) CO	1,513	1,473	16,671	1,870,365	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	417	385	2,643	296,564	消費者金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	143	143	410	46,043	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	265	212	594	66,714	メディア
DISH NETWORK CORP-A	220	218	1,377	154,570	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	281	271	1,920	215,439	複合小売り
DOLLAR TREE INC	213	227	1,803	202,310	複合小売り
DOMINION RESOURCES INC/VA	572	613	4,745	532,367	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC	—	46	848	95,220	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP	153	153	1,225	137,440	機械
DOW CHEM CO	1,080	1,095	7,027	788,438	化学
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	181	178	1,732	194,386	飲料
DU PONT E I DE NEMOURS	846	849	6,931	777,615	化学
DUKE ENERGY CORP	661	673	5,521	619,433	電力
DUN & BRADSTREET CORP	36	36	380	42,743	専門サービス
EMC CORP	1,873	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
EOG RESOURCES INC	532	563	5,470	613,754	石油・ガス・消耗燃料
EQT CORP	150	165	1,001	112,326	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	291	256	892	100,177	資本市場
EASTMAN CHEMICAL CO.	142	141	1,143	128,258	化学
EATON VANCE CORP	117	117	525	58,923	資本市場
EBAY INC	1,041	1,023	3,447	386,776	インターネットソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	256	257	3,221	361,390	化学
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	61	58	426	47,820	パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	318	317	2,519	282,700	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	211	211	1,980	222,186	ヘルスケア機器・用品
ELECTRONIC ARTS	296	290	2,617	293,661	ソフトウェア
EMERSON ELEC	634	630	3,755	421,321	電気設備
ENBRIDGE INC	—	666	2,750	308,586	石油・ガス・消耗燃料
ENTERGY CORP	174	171	1,297	145,514	電力
ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS	188	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ENVISION HEALTHCARE CORP	—	116	712	79,880	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EQUIFAX INC	113	117	1,597	179,251	専門サービス
EVERSOURCE ENERGY	309	307	1,799	201,900	電力
EXELON CORPORATION	894	905	3,230	362,469	電力
EXPEDIA INC	117	117	1,514	169,932	インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	183	177	1,002	112,433	航空貨物・物流サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	650	604	4,020	451,028	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
EXXON MOBIL CORP		4,020	4,037	33,789	3,790,865	石油・ガス・消耗燃料
FLIR SYSTEMS INC		126	127	464	52,119	電子装置・機器・部品
FMC CORP		132	132	811	91,075	化学
FMC TECHNOLOGIES INC		225	—	—	—	エネルギー設備・サービス
FACEBOOK INC-A		2,193	2,279	32,455	3,641,153	インターネットソフトウェア・サービス
FASTENAL CO		262	276	1,416	158,909	商社・流通業
FEDEX CORPORATION		259	246	4,794	537,845	航空貨物・物流サービス
F5 NETWORKS INC		70	62	883	99,105	通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION		269	303	2,425	272,118	情報技術サービス
FNF GROUP		244	244	955	107,170	保険
FIFTH THIRD BANCORP		767	737	1,896	212,746	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A		—	302	474	53,227	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA		137	145	1,371	153,874	銀行
FISERV INC		219	207	2,399	269,228	情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP		403	418	1,311	147,110	電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC		74	88	1,310	147,045	情報技術サービス
FLUOR CORP		139	139	732	82,182	建設・土木
FLOWSERVE CORP		123	122	585	65,698	機械
FOOT LOCKER INC		134	134	1,009	113,307	専門小売り
FORD MOTOR COMPANY		3,580	3,630	4,239	475,667	自動車
FORTINET INC		139	139	526	59,024	ソフトウェア
FORTIVE CORP		—	295	1,758	197,318	機械
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC		158	153	932	104,655	建設関連製品
FRANKLIN RESOURCES INC		378	359	1,515	170,046	資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC		1,100	1,241	1,651	185,312	金属・鉱業
FRONTIER COMMUNICATIONS CO		1,140	1,140	242	27,241	各種電気通信サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO		168	166	942	105,725	保険
GAMESTOP CORP-CLASS A		100	—	—	—	専門小売り
GAP INC		229	229	559	62,815	専門小売り
GARTNER INC		81	81	880	98,825	情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS		257	253	4,778	536,046	航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO		9,115	8,614	25,730	2,886,650	コングロマリット
GENERAL MILLS		578	580	3,426	384,369	食品
GENERAL MOTORS CO		1,367	1,344	4,759	533,923	自動車
GENUINE PARTS CO		148	144	1,329	149,178	販売
GILEAD SCIENCES INC		1,388	1,285	8,677	973,540	バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC		124	146	1,178	132,184	情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP		370	349	8,074	905,844	資本市場
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO		252	248	887	99,578	自動車部品
WR GRACE & CO		67	67	459	51,564	化学
GRAINGER(W.W.) INC		54	55	1,295	145,351	商社・流通業
HCA HOLDINGS INC		313	286	2,552	286,370	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HP INC		1,740	1,670	2,947	330,685	コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO		832	846	4,147	465,262	エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC		377	377	780	87,594	繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC		188	168	1,024	114,991	自動車
HARMAN INTERNATIONAL		70	—	—	—	家庭用耐久財
HARRIS CORP		119	119	1,330	149,246	通信機器
HARTFORD FINANCIAL SERVICES		394	359	1,716	192,560	保険
HASBRO INC		108	107	1,065	119,539	レジャー用品
HELMERICH & PAYNE		106	106	705	79,118	エネルギー設備・サービス
HERSHEY CO/THE		143	137	1,491	167,379	食品
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC		346	—	—	—	陸運・鉄道
HESS CORP		275	274	1,342	150,564	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,752	1,632	3,854	432,468	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	486	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	—	189	1,114	125,050	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	166	166	466	52,332	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	231	247	1,054	118,353	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT	1,225	1,187	17,442	1,956,926	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	706	706	8,853	993,324	コングロマリット
HORMEL FOODS CORP	276	273	933	104,777	食品
HUMANA INC	143	146	3,026	339,543	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	799	89,699	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	750	1,070	1,454	163,138	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	—	46	930	104,448	航空宇宙・防衛
IMS HEALTH HOLDINGS INC	163	—	—	—	ヘルスケア・テクノロジー
IDEXX LABORATORIES INC	—	86	1,328	149,086	ヘルスケア機器・用品
IHS INC-CLASS A	66	—	—	—	専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	317	305	4,044	453,764	機械
ILLUMINA INC	142	142	2,458	275,860	ライフサイエンス・ツール/サービス
INCYTE CORP	160	167	2,300	258,122	バイオテクノロジー
INGREDION INC	—	68	818	91,875	食品
INTEL CORP	4,561	4,617	16,505	1,851,782	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	114	584	3,505	393,310	資本市場
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	888	880	15,303	1,716,861	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	77	76	1,006	112,864	化学
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	376	376	1,922	215,726	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP	392	392	963	108,099	メディア
INTUIT INC	241	235	2,717	304,828	ソフトウェア
INTUITIVE SURGICAL INC	35	37	2,842	318,936	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	121	—	—	—	バイオテクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	3,556	3,484	31,018	3,479,915	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	123	123	680	76,351	建設・土木
JARDEN CORP	200	—	—	—	家庭用耐久財
JOHNSON & JOHNSON	2,672	2,648	33,009	3,703,388	医薬品
JOHNSON CONTROLS INC	619	—	—	—	自動車部品
JONES LANG LASALLE INC	42	47	517	58,081	不動産管理・開発
JUNIPER NETWORKS INC	335	335	927	104,106	通信機器
KLA TENCOR CORP	150	150	1,434	160,947	半導体・半導体製造装置
KANSAS CITY SOUTHERN	108	106	922	103,461	陸運・鉄道
KELLOGG CO	257	255	1,849	207,525	食品
KEYCORP	810	1,028	1,849	207,481	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	351	350	4,628	519,260	家庭用品
KINDER MORGAN INC	1,836	1,858	3,981	446,706	石油・ガス・消耗燃料
KOHL'S CORP	191	172	695	78,016	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE	586	595	5,420	608,120	食品
KROGER CO	890	860	2,511	281,731	食品・生活必需品小売り
L BRANDS, INC	240	240	1,140	127,923	専門小売り
LKQ CORP	300	300	888	99,624	販売
L3 TECHNOLOGIES INC	—	72	1,211	135,931	航空宇宙・防衛
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	77	—	—	—	航空宇宙・防衛
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	99	98	1,411	158,300	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH	154	160	2,059	231,021	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	379	421	2,400	269,364	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	216	214	1,826	204,889	パーソナル用品
LEAR CORP	74	69	975	109,420	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	134	134	675	75,783	家庭用耐久財

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LEGG MASON INC	92	—	—	—	資本市場
LENNAR CORP-A	168	201	1,031	115,682	家庭用耐久財
LEUCADIA NATIONAL CORP	322	322	845	94,900	各種金融サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	290	301	1,717	192,686	各種電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND CORP-C	—	101	875	98,173	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	436	423	841	94,438	インターネット販売・通信販売
LIBERTY MEDIA CORP-A	81	—	—	—	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-C	193	—	—	—	メディア
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	—	98	386	43,395	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	—	193	753	84,575	メディア
ELI LILLY & CO.	965	969	8,213	921,443	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	239	223	1,459	163,695	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP	225	—	—	—	半導体・半導体製造装置
LINKEDIN CORP - A	113	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス
LOCKHEED MARTIN	267	257	6,963	781,257	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	269	277	1,298	145,625	保険
LOWES COS INC	885	849	6,987	783,901	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	106	106	538	60,364	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP	141	137	2,145	240,756	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	423	449	1,227	137,670	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	93	85	822	92,224	資本市場
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	—	76	613	68,833	運送インフラ
MACYS INC	304	304	895	100,475	複合小売り
MANPOWERGROUP INC	70	62	638	71,616	専門サービス
MARATHON OIL CORP	794	812	1,287	144,390	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	508	510	2,557	286,885	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	13	13	1,299	145,746	保険
MARSH & MCLENNAN COS	501	495	3,668	411,562	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	199	322	3,047	341,888	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	55	59	1,250	140,273	建設資材
MASCO CORP	329	329	1,112	124,831	建設関連製品
MASTERCARD INC	955	939	10,579	1,186,938	情報技術サービス
MATTEL INC	334	334	848	95,177	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	271	270	1,212	136,068	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	113	113	1,102	123,643	食品
MCDONALD'S CORP	885	810	10,474	1,175,181	ホテル・レストラン・レジャー
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	258	—	—	—	各種金融サービス
MCKESSON CORP	221	218	3,258	365,589	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	192	178	1,584	177,731	食品
MEDIVATION INC	154	—	—	—	バイオテクノロジー
MEDNAX INC	91	91	631	70,893	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	184	340	38,168	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC	—	39	831	93,242	インターネットソフトウェア・サービス
MERCK & CO INC	2,691	2,686	17,042	1,912,017	医薬品
METLIFE INC	914	914	4,855	544,701	保険
METTLER-TOLEDO INTL	27	26	1,254	140,705	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP	7,327	7,189	47,238	5,299,734	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	198	206	1,521	170,745	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	1,031	1,009	2,923	327,939	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	—	57	777	87,257	機械
MOHAWK INDUSTRIES	60	59	1,359	152,547	家庭用耐久財
MOLSON COORS BREWING CO-B	180	179	1,710	191,923	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,533	1,508	6,526	732,221	食品
MONSANTO CO	427	428	4,851	544,276	化学

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MONSTER BEVERAGE CORP	137	384	1,776	199,292	飲料
MOODYS CORP	169	168	1,875	210,380	資本市場
MORGAN STANLEY	1,397	1,372	5,958	668,494	資本市場
MOSAIC CO/THE	313	312	915	102,734	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	151	145	1,230	138,062	通信機器
MURPHY OIL CORP	150	167	472	52,984	石油・ガス・消耗燃料
NRG ENERGY INC	294	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NASDAQ INC	111	111	770	86,411	資本市場
NATIONAL OILWELL VARCO INC	366	365	1,462	164,084	エネルギー設備・サービス
NAVIENT CORP	339	299	444	49,881	消費者金融
NETAPP INC	279	267	1,118	125,510	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	391	419	6,203	695,994	インターネット販売・通信販売
NETSUITE INC	39	—	—	—	ソフトウェア
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	560	1,140	869	97,585	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	234	241	1,552	174,123	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	—	220	934	104,823	コングロマリット
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	471	471	670	75,246	貯蓄・抵当・不動産金融
NEWELL BRANDS INC	255	422	1,998	224,222	家庭用耐久財
NEWFIELD EXPLORATION CO	—	188	690	77,427	石油・ガス・消耗燃料
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	517	510	1,679	188,415	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	374	374	495	55,553	メディア
NEXTERA ENERGY INC	445	452	5,791	649,745	電力
NIKE INC-B	1,312	1,292	7,240	812,296	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	—	303	714	80,190	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC	411	407	1,396	156,664	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	137	127	589	66,182	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	287	280	3,199	358,895	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	214	207	1,804	202,484	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	166	162	3,875	434,754	航空宇宙・防衛
NUANCE COMMUNICATIONS INC	250	250	431	48,409	ソフトウェア
NUCOR CORP	307	306	1,839	206,324	金属・鉱業
NVIDIA CORP	526	521	5,699	639,453	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	196	196	689	77,336	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	96	92	2,519	282,695	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	738	747	4,800	538,620	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	231	230	1,975	221,653	メディア
ONEOK INC	198	198	1,087	121,997	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,082	3,001	13,408	1,504,296	ソフトウェア
PG&E CORP	473	496	3,291	369,268	電力
PNC FINANCIAL	487	470	5,711	640,819	銀行
PPG INDUSTRIES	258	257	2,704	303,407	化学
PPL CORPORATION	654	668	2,487	279,087	電力
PVH CORP	82	80	828	93,001	繊維・アパレル・贅沢品
PACCAR	345	341	2,306	258,768	機械
PACKAGING CORP OF AMERICA	89	88	801	89,950	容器・包装
PALO ALTO NETWORKS INC	77	90	1,021	114,602	通信機器
PARKER HANNIFIN CORP	132	127	2,032	228,041	機械
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	—	217	692	77,661	石油・ガス・消耗燃料
PATTERSON COS INC	87	87	393	44,185	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PAYCHEX INC	317	315	1,862	208,964	情報技術サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	1,057	1,062	4,623	518,760	情報技術サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	305	305	561	62,995	銀行
PEPSICO INC	1,408	1,397	15,671	1,758,190	飲料

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
PFIZER INC		5,965	5,910	20,300	2,277,552	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL		1,497	1,511	17,152	1,924,380	タバコ
PHILLIPS 66		517	450	3,536	396,765	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP		105	111	924	103,709	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO		156	166	3,038	340,865	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A		190	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A		—	140	435	48,894	石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INDUSTRIES INC		62	62	518	58,136	レジャー用品
PRAIRAIR INC		276	280	3,320	372,560	化学
T ROWE PRICE GROUP INC		240	239	1,630	182,894	資本市場
PRICELINE GROUP INC/THE		48	48	8,613	966,315	インターネット販売・通信販売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP		280	279	1,760	197,540	保険
PROCTER & GAMBLE CO		2,628	2,490	22,459	2,519,764	家庭用品
PROGRESSIVE CO		569	565	2,230	250,253	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC		435	418	4,485	503,187	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE		493	487	2,138	239,909	総合公益事業
PULTEGROUP INC		295	289	688	77,263	家庭用耐久財
QORVO INC		139	127	877	98,426	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC		1,450	1,441	8,242	924,728	半導体・半導体製造装置
QUANTA SERVICES INC		163	—	—	—	建設・土木
QUEST DIAGNOSTICS INC		141	133	1,308	146,780	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
QUINTILES IMS HOLDINGS INC		88	142	1,135	127,336	ライフサイエンス・ツール/サービス
RALPH LAUREN CORPORATION		58	58	475	53,292	繊維・アパレル・贅沢品
RANGE RESOURCES CORP		167	190	543	60,985	石油・ガス・消耗燃料
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC		120	121	920	103,292	資本市場
RAYTHEON COMPANY		291	287	4,395	493,152	航空宇宙・防衛
REALOGY HOLDINGS CORP		140	—	—	—	不動産管理・開発
RED HAT INC		178	178	1,529	171,580	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS		74	76	2,942	330,140	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP		1,260	1,210	1,776	199,280	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA		—	63	796	89,409	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A		229	229	1,438	161,394	商業サービス・用品
RESMED INC		132	141	1,008	113,135	ヘルスケア機器・用品
REYNOLDS AMERICAN INC		825	836	5,251	589,194	タバコ
RITE AID CORP		1,000	990	437	49,092	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC		133	133	646	72,547	専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC		129	124	1,926	216,157	電気設備
ROCKWELL COLLINS INC		128	128	1,259	141,291	航空宇宙・防衛
ROPER TECHNOLOGIES INC		96	99	2,080	233,460	コングロマリット
ROSS STORES INC		394	390	2,597	291,446	専門小売り
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A		121	—	—	—	各種電気通信サービス
S&P GLOBAL INC		—	254	3,286	368,741	資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY		129	127	638	71,639	資本市場
SABRE CORP		200	200	430	48,331	情報技術サービス
ST JUDE MEDICAL INC		270	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
SALESFORCE.COM INC		610	624	5,151	577,974	ソフトウェア
SAN DISK CORPORATION		194	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
SCANA CORP		131	129	845	94,867	総合公益事業
HENRY SCHEIN INC		80	76	1,300	145,848	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD		1,220	1,357	10,562	1,185,050	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP		1,148	1,167	4,801	538,628	資本市場
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A		71	78	613	68,842	メディア
SEALED AIR CORP		192	192	831	93,270	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC		—	97	611	68,624	バイオテクノロジー

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
SEMPRA ENERGY		230	229	2,524	283,197	総合公益事業
SERVICENOW INC		143	157	1,364	153,134	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS		76	75	2,338	262,410	化学
SIGNATURE BANK		48	50	759	85,240	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC		2,040	1,630	849	95,275	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC		182	181	1,776	199,286	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP		—	144	736	82,618	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW		112	113	1,483	166,404	食品
SNAP-ON INC		54	54	917	102,910	機械
SOUTHERN CO.		874	948	4,708	528,270	電力
SOUTHWEST AIRLINES		153	153	823	92,399	旅客航空輸送業
SOUTHWESTERN ENERGY CO		400	468	378	42,476	石油・ガス・消耗燃料
SPECTRA ENERGY CORP		653	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC		—	26	364	40,866	家庭用品
SPLUNK INC		128	128	801	89,953	ソフトウェア
SPRINT CORP		710	750	639	71,689	無線通信サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC		145	144	1,910	214,284	機械
STAPLES INC		620	620	541	60,793	専門小売り
STARBUCKS CORP		1,437	1,420	8,258	926,545	ホテル・レストラン・レジャー
STARWOOD HOTELS & RESORTS		162	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP		393	372	2,977	334,044	資本市場
STERICYCLE INC		81	79	642	72,109	商業サービス・用品
STRYKER CORP		329	330	4,354	488,514	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.		496	469	2,630	295,076	銀行
SYMANTEC CORP		652	608	1,863	209,068	ソフトウェア
SYNOPSYS INC		149	149	1,075	120,708	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL		805	805	2,771	310,947	消費者金融
SYSCO CORP		542	496	2,580	289,471	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP		254	253	984	110,414	資本市場
TECO ENERGY INC		224	—	—	—	総合公益事業
TJX COS INC		643	628	5,009	562,022	専門小売り
T-MOBILE US INC		271	283	1,843	206,786	無線通信サービス
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A		49	—	—	—	ソフトウェア
TARGET CORP		567	510	2,817	316,123	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP		—	178	1,051	117,941	石油・ガス・消耗燃料
TEGNA INC		206	206	532	59,765	メディア
TELEFLEX INC		—	43	842	94,523	ヘルスケア機器・用品
TERADATA CORP		132	—	—	—	情報技術サービス
TESORO CORP		113	113	911	102,231	石油・ガス・消耗燃料
TESLA INC		93	124	3,448	386,941	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR		—	888	2,904	325,872	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC		980	975	7,901	886,458	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC		264	264	1,249	140,153	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC		386	382	5,879	659,605	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP		593	586	11,216	1,258,396	コングロマリット
TIFFANY & CO		127	119	1,133	127,164	専門小売り
TIME WARNER INC		772	745	7,303	819,433	メディア
TIME WARNER CABLE-A		273	—	—	—	メディア
TOLL BROTHERS INC		164	142	516	57,972	家庭用耐久財
TORCHMARK CORP		122	112	864	96,966	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC		163	163	868	97,396	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY		132	130	892	100,123	専門小売り
TRANSDIGM GROUP INC		52	52	1,150	129,103	航空宇宙・防衛
TRAVELERS COS INC/THE		295	275	3,328	373,404	保険

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TRIMBLE INC	232	232	747	83,810	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	115	123	532	59,765	インターネット販売・通信販売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,122	1,015	3,284	368,492	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	428	428	1,355	152,070	メディア
TWITTER INC	567	539	804	90,221	インターネットソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	285	276	1,701	190,864	食品
UGI CORP	—	163	807	90,630	ガス
US BANCORP	1,688	1,658	8,641	969,489	銀行
ULTA BEAUTY INC	59	56	1,621	181,938	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	171	184	369	41,471	繊維・アパレル・贅沢品
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	—	187	343	38,539	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP	824	804	8,597	964,606	陸運・鉄道
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	93	76	537	60,350	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	674	673	7,178	805,324	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC	86	79	980	110,051	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES	815	763	8,579	962,582	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP	43	43	591	66,389	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC	918	938	15,476	1,736,259	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	87	86	1,080	121,241	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP	227	225	1,053	118,186	保険
V F CORP	331	319	1,726	193,723	繊維・アパレル・贅沢品
VALERO ENERGY CORP	462	440	2,914	326,935	石油・ガス・消耗燃料
VALSPAR CORP	—	73	809	90,825	化学
VANTIV INC - CL A	151	161	1,034	116,034	情報技術サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	95	87	793	88,986	ヘルスケア機器・用品
VERISIGN INC	99	88	767	86,080	インターネットソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	3,931	3,971	19,481	2,185,654	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	152	150	1,211	135,957	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	240	238	2,553	286,477	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B	341	341	1,580	177,358	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	1,875	1,820	16,199	1,817,457	情報技術サービス
VMWARE INC - CLASS A	74	62	566	63,589	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	211	187	711	79,869	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	128	128	1,506	169,006	建設資材
WABCO HOLDINGS INC	52	52	610	68,518	機械
WEC ENERGY GROUP INC	302	306	1,849	207,457	総合公益事業
WABTEC CORP	94	90	695	78,010	機械
WAL-MART STORES INC	1,545	1,508	10,795	1,211,177	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	843	899	7,489	840,254	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	117	—	—	—	商業サービス・用品
WASTE CONNECTIONS INC	—	165	1,449	162,640	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC	428	433	3,157	354,281	商業サービス・用品
WATERS CORP	80	80	1,250	140,264	ライフサイエンス・ツール/サービス
WELLS FARGO CO	4,687	4,646	26,129	2,931,424	銀行
WESTAR ENERGY INC	—	134	728	81,721	電力
WESTERN DIGITAL CORP	220	278	2,328	261,206	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	491	458	938	105,283	情報技術サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	41	—	—	—	化学
WESTROCK CO	243	243	1,277	143,289	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	76	71	1,211	135,914	家庭用耐久財
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	175	175	973	109,259	食品
WHOLE FOODS MARKET INC	332	316	924	103,768	食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS	695	785	2,281	255,928	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A	107	120	1,004	112,683	ソフトウェア

銘柄	柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
WYNDHAM WORLDWIDE CORP		109	109	927	104,066	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN RESORTS LTD		77	77	880	98,739	ホテル・レストラン・レジャー
XCEL ENERGY INC		483	494	2,188	245,574	電力
XILINX INC		250	250	1,447	162,338	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP		890	840	619	69,548	コンピュータ・周辺機器
XYLEM INC		170	170	848	95,170	機械
YAHOO! INC		869	887	4,135	463,927	インターネットソフトウェア・サービス
YUM BRANDS INC		415	332	2,125	238,455	ホテル・レストラン・レジャー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC		—	155	508	57,054	各種電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C		86	109	362	40,697	インターネットソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC		184	197	2,390	268,222	ヘルスケア機器・用品
ZOETIS INC		460	458	2,448	274,745	医薬品
ALKERMES PLC		138	152	895	100,509	バイオテクノロジー
ALLERGAN PLC		379	365	8,774	984,386	医薬品
AON PLC		263	257	3,044	341,611	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD		121	121	1,153	129,356	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD		95	85	573	64,340	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD		145	212	680	76,395	化学
ACCENTURE PLC-CL A		603	605	7,291	818,028	情報技術サービス
BUNGE LIMITED		138	138	1,098	123,207	食品
DELPHI AUTOMOTIVE PLC		273	259	2,097	235,363	自動車部品
EATON CORP PLC		445	434	3,220	361,283	電気設備
ENDO INTERNATIONAL PLC		205	—	—	—	医薬品
EVEREST RE GROUP LTD		40	40	941	105,672	保険
IHS MARKIT LTD		—	353	1,472	165,208	専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC		251	251	2,030	227,811	機械
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC		850	850	561	62,938	エネルギー設備・サービス
INVESCO LTD		412	396	1,216	136,480	資本市場
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC		58	56	815	91,525	医薬品
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC		—	917	3,864	433,528	建設関連製品
LIBERTY GLOBAL PLC-A		237	240	856	96,124	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C		574	595	2,087	234,169	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C		—	112	264	29,628	メディア
MALLINCKRODT PLC		111	97	440	49,395	医薬品
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD		410	410	640	71,802	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC		1,362	1,359	11,006	1,234,823	ヘルスケア機器・用品
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD		179	161	613	68,872	繊維・アパレル・贅沢品
NIELSEN HOLDINGS PLC		334	342	1,404	157,619	専門サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN		150	161	824	92,552	ホテル・レストラン・レジャー
RENAISSANCE HOLDINGS LTD		44	42	611	68,578	保険
SEAGATE TECHNOLOGY		290	286	1,347	151,190	コンピュータ・周辺機器
PENTAIR PLC		174	167	1,050	117,829	機械
SIGNET JEWELERS LTD		71	54	381	42,813	専門小売り
TECHNIPFMC PLC		—	433	1,393	156,324	エネルギー設備・サービス
TYCO INTERNATIONAL PLC		403	—	—	—	商業サービス・用品
WILLIS TOWERS WATSON PLC		124	126	1,652	185,421	保険
PERRIGO CO PLC		139	138	923	103,622	医薬品
XL GROUP PLC		288	—	—	—	保険
XL GROUP LTD		—	264	1,059	118,887	保険
CHUBB LTD		446	454	6,222	698,054	保険
GARMIN LTD		114	114	582	65,342	家庭用耐久財
TE CONNECTIVITY LTD		371	343	2,568	288,108	電子装置・機器・部品
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.		67	126	1,299	145,769	ソフトウェア
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD		8	15	180	20,253	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	
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円		
AERCAP HOLDINGS NV		87	150	688	77,259	商社・流通業	
CORE LABORATORIES N.V.		43	43	490	55,029	エネルギー設備・サービス	
MOBILEYE NV		84	170	1,038	116,474	ソフトウェア	
LYONDELLBASELL INDU-CL A		366	337	3,075	345,073	化学	
MYLAN NV		404	431	1,706	191,433	医薬品	
NXP SEMICONDUCTORS NV		132	280	2,905	325,911	半導体・半導体製造装置	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		169	169	744	83,538	電気設備	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		169	169	1,684	188,937	ホテル・レストラン・レジャー	
BROADCOM LTD		375	392	8,636	968,936	半導体・半導体製造装置	
FLEX LTD		550	505	847	95,125	電子装置・機器・部品	
小 計		株 数 ・ 金 額	303,589	303,712	2,024,883	227,171,661	
銘 柄 数 < 比 率 >			599	599	—	<62.3%>	
(カナダ)				千カナダドル			
ARC RESOURCES LTD		335	329	627	52,705	石油・ガス・消耗燃料	
AGNICO EAGLE MINES LTD		206	216	1,218	102,374	金属・鉱業	
AGRIUM INC		126	124	1,587	133,404	化学	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B		401	404	2,442	205,299	食品・生活必需品小売り	
ALTAGAS LTD		141	166	513	43,140	石油・ガス・消耗燃料	
ATCO LTD CL1		68	68	353	29,720	総合公益事業	
BCE INC		141	154	905	76,070	各種電気通信サービス	
BANK OF MONTREAL		618	632	6,309	530,346	銀行	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX		1,162	1,179	9,360	786,714	銀行	
BARRICK GOLD		1,130	1,120	2,813	236,469	金属・鉱業	
BLACKBERRY LTD		509	509	471	39,658	コンピュータ・周辺機器	
BOMBARDIER B SHEARS		1,670	1,890	395	33,200	航空宇宙・防衛	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		847	856	4,183	351,604	資本市場	
CAE INC		260	260	529	44,492	航空宇宙・防衛	
CCL INDUSTRIES INC - CL B		26	26	768	64,614	容器・包装	
CI FINANCIAL CORP		226	242	642	54,002	資本市場	
CAMECO CORP		386	386	577	48,502	石油・ガス・消耗燃料	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE		383	389	4,426	372,008	銀行	
CANADIAN NATL RAILWAY CO		769	750	7,395	621,549	陸運・鉄道	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD		1,063	1,083	4,700	395,053	石油・ガス・消耗燃料	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		140	136	2,683	225,586	陸運・鉄道	
CANADIAN TIRE CORP LTD A		70	64	1,001	84,179	複合小売り	
CANADIAN UTILITIES LTD A		124	124	485	40,792	総合公益事業	
CENOVUS ENERGY INC		790	785	1,181	99,298	石油・ガス・消耗燃料	
CONSTELLATION SOFTWARE INC		17	19	1,245	104,672	ソフトウェア	
CRESCENT POINT ENERGY CORP		488	537	779	65,490	石油・ガス・消耗燃料	
DOLLARAMA INC		115	107	1,186	99,718	複合小売り	
ELDORADO GOLD CORPORATION		628	708	328	27,611	金属・鉱業	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP		360	360	438	36,854	各種金融サービス	
EMERA INC		—	49	230	19,348	電力	
EMPIRE CO LTD A		162	162	324	27,245	食品・生活必需品小売り	
ENCANA CORP		790	950	1,459	122,645	石油・ガス・消耗燃料	
ENBRIDGE INC		883	918	5,053	424,754	石油・ガス・消耗燃料	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		21	21	1,357	114,126	保険	
FINNING INTERNATIONAL INC		149	152	376	31,670	商社・流通業	
FIRST CAPITAL REALTY INC		113	113	225	18,976	不動産管理・開発	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD		704	650	924	77,742	金属・鉱業	
FORTIS INC		273	384	1,693	142,333	電力	
FRANCO-NEVADA CORP		165	169	1,464	123,095	金属・鉱業	
GILDAN ACTIVEWEAR INC		231	208	743	62,482	繊維・アパレル・贅沢品	
GOLDCORP INC		800	829	1,619	136,149	金属・鉱業	

銘 柄	株 数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
GREAT-WEST LIFE CO INC	280	300	1,116	93,850	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	214	214	1,382	116,158	情報技術サービス
HUSKY ENERGY INC	357	357	539	45,365	石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD	—	173	416	34,970	電力
IGM FINANCIAL INC	103	103	413	34,741	資本市場
IMPERIAL OIL	283	285	1,159	97,445	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	99	99	573	48,228	保険
INTACT FINANCIAL CORP	127	126	1,195	100,491	保険
INTER PIPELINE LTD	331	362	1,022	85,923	石油・ガス・消耗燃料
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	94	94	192	16,204	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP	161	178	699	58,796	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP	1,186	1,186	550	46,253	金属・鉱業
LINAMAR CORP	48	48	293	24,674	自動車部品
LOBLAW COMPANIES	214	210	1,516	127,454	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	388	377	2,194	184,449	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,918	1,934	4,591	385,900	保険
METHANEX CORP	82	82	527	44,343	化学
METRO INC	232	232	951	79,967	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	334	334	1,870	157,179	銀行
ONEX CORPORATION	80	80	764	64,294	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP	121	262	1,189	99,953	ソフトウェア
PEMBINA PIPELINE CORP	362	374	1,577	132,560	石油・ガス・消耗燃料
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	151	172	475	39,958	石油・ガス・消耗燃料
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	818	812	1,862	156,562	化学
POWER CORPORATION OF CANADA	350	348	1,102	92,691	保険
POWER FINANCIAL CORP	243	243	860	72,301	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	186	207	579	48,724	石油・ガス・消耗燃料
PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS	104	—	—	—	商業サービス・用品
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	198	213	1,588	133,553	ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	348	347	2,041	171,550	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,433	1,448	14,171	1,191,120	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	145	145	759	63,873	建設・土木
SAPUTO INC	239	239	1,102	92,665	食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	170	226	548	46,082	石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	404	404	1,117	93,888	メディア
SILVER WHEATON CORP	392	416	1,126	94,684	金属・鉱業
SUN LIFE FINANCIAL INC	588	591	2,878	241,910	保険
SUNCOR ENERGY INC	1,524	1,628	6,705	563,616	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD	582	549	1,630	137,046	金属・鉱業
TELUS CORP	193	193	832	69,996	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	330	324	1,877	157,783	資本市場
TORONTO DOMINION BANK	1,789	1,812	11,999	1,008,521	銀行
TOURMALINE OIL CORP	173	216	638	53,665	石油・ガス・消耗燃料
TRANSCANADA CORP	688	846	5,183	435,668	石油・ガス・消耗燃料
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	870	980	401	33,771	金属・鉱業
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	313	313	461	38,803	医薬品
VERESIN INC	248	290	423	35,562	石油・ガス・消耗燃料
VERMILION ENERGY INC	105	120	588	49,431	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER	68	68	380	32,000	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE)LTD	48	48	556	46,750	食品・生活必需品小売り
YAMANA GOLD INC	970	970	359	30,247	金属・鉱業
小計	株数・金額	38,177	39,808	162,014	13,617,347
	銘柄数<比率>	90	91	—	<3.7%>

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	
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC		940	940	251	35,223	資本市場
ANTOFAGASTA PLC		410	410	344	48,243	金属・鉱業
ASHTREAD GROUP PLC		468	476	798	111,885	商社・流通業
BHP BILLITON PLC		2,043	2,071	2,631	368,579	金属・鉱業
ARM HOLDINGS PLC		1,340	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		980	980	534	74,816	家庭用耐久財
SKY PLC		998	990	967	135,489	メディア
AVIVA PLC		3,890	3,950	2,085	292,150	保険
CRODA INTERNATIONAL PLC		127	—	—	—	化学
DIAGEO PLC		2,427	2,456	5,670	794,380	飲料
SCHRODERS PLC		118	133	404	56,637	資本市場
DCC PLC		—	86	605	84,810	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC		3,060	3,060	2,004	280,762	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,797	1,817	9,648	1,351,529	タバコ
STANDARD CHARTERED PLC		3,164	3,220	2,466	345,510	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		926	938	3,603	504,754	タバコ
SABMILLER PLC		938	—	—	—	飲料
HSBC HOLDINGS PLC		18,870	19,290	12,654	1,772,605	銀行
LEGAL & GENERAL		5,760	5,770	1,425	199,640	保険
MEGGITT PLC		780	780	349	49,026	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS		2,130	2,130	516	72,295	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		344	340	882	123,592	食品
PEARSON		790	780	521	72,987	メディア
PERSIMMON PLC		295	295	619	86,820	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC		2,493	2,521	4,252	595,750	保険
RIO TINTO PLC-REG		1,201	1,210	3,980	557,644	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC		499	490	520	72,894	保険
TRAVIS PERKINS PLC		247	247	372	52,245	商社・流通業
SSE PLC		969	990	1,450	203,165	電力
BP PLC		17,660	18,450	8,517	1,193,123	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC		55,300	62,800	4,185	586,321	銀行
TATE & LYLE ORD.		425	480	372	52,244	食品
TAYLOR WIMPEY PLC		3,190	3,190	614	86,108	家庭用耐久財
TESCO PLC		7,870	7,870	1,487	208,359	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC		858	840	1,023	143,318	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC		4,691	4,755	7,983	1,118,348	医薬品
WEIR GROUP PLC		220	220	429	60,094	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC		259	259	226	31,745	商業サービス・用品
ASTRAZENECA PLC		1,219	1,235	6,084	852,365	医薬品
GKN PLC		1,690	1,690	620	86,881	自動車部品
BT GROUP PLC		8,170	8,160	2,586	362,347	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC		187	187	862	120,837	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC		1,550	1,530	507	71,026	複合小売り
BARCLAYS PLC		16,300	16,400	3,740	523,902	銀行
INTERTEK GROUP PLC		151	163	643	90,190	専門サービス
WILLIAM HILL PLC		850	850	244	34,196	ホテル・レストラン・レジャー
BURBERRY GROUP PLC		423	419	729	102,126	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC		140	140	596	83,543	複合小売り
KINGFISHER PLC		2,170	2,140	695	97,425	専門小売り
ICAP PLC		540	—	—	—	資本市場
ITV PLC		3,650	3,530	746	104,533	メディア
SAINSBURY		1,238	1,500	397	55,723	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD		90	88	614	86,042	金属・鉱業
G4S PLC		1,520	1,520	465	65,196	商業サービス・用品

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
ADMIRAL GROUP PLC	198	219	435	61,048	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	124	124	394	55,288	家庭用耐久財
CENTRICA PLC	4,900	5,240	1,140	159,722	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,800	4,261	9,046	1,267,178	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	3,820	3,653	8,115	1,136,768	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE	331	331	769	107,802	商社・流通業
COBHAM PLC	1,130	1,695	229	32,148	航空宇宙・防衛
NATIONAL GRID PLC	3,596	3,680	3,702	518,587	総合公益事業
INMARSAT PLC	425	425	355	49,740	各種電気通信サービス
PETROFAC LTD	260	260	244	34,271	エネルギー設備・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	—	139	279	39,117	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	302	300	939	131,661	資本市場
UNILEVER PLC	1,244	1,254	5,009	701,675	パーソナル用品
TUI AG-DI	466	490	551	77,287	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	550	610	368	51,611	資本市場
EXPERIAN PLC	946	909	1,474	206,533	専門サービス
MONDI PLC	342	343	678	94,989	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	221	237	560	78,548	水道
WHITBREAD PLC	175	173	681	95,505	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	326	45,771	資本市場
SMITHS GROUP PLC	375	371	605	84,762	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,370	1,364	1,722	241,224	金属・鉱業
3I GROUP PLC	970	970	715	100,209	資本市場
PROVIDENT FINANCIAL PLC	143	143	419	58,832	消費者金融
CAPITA PLC	640	640	353	49,577	専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	617	616	4,520	633,277	家庭用品
RELX PLC	1,066	1,058	1,656	232,088	専門サービス
SHIRE PLC	568	874	4,137	579,522	バイオテクノロジー
FRESNILLO PLC	209	209	324	45,525	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	670	670	663	92,915	水道
GLENCORE PLC	11,880	11,970	3,800	532,370	金属・鉱業
DIXONS CARPHONE PLC	920	920	291	40,814	専門小売り
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,770	1,740	1,332	186,704	航空宇宙・防衛
OLD MUTUAL PLC	4,680	4,880	1,058	148,270	保険
EASYJET PLC	163	163	164	22,992	旅客航空輸送業
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,410	3,410	826	115,787	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,050	1,050	666	93,324	ソフトウェア
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	375	375	284	39,870	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WPP PLC	1,243	1,234	2,140	299,909	メディア
COCA-COLA HBC AG-CDI	198	167	344	48,213	飲料
ROYAL MAIL PLC	880	880	368	51,650	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	690	690	325	45,601	ホテル・レストラン・レジャー
WOLSELEY PLC	242	242	1,229	172,208	商社・流通業
IMI PLC	259	259	318	44,552	機械
VODAFONE GROUP PLC	25,610	25,990	5,426	760,173	無線通信サービス
AGGREKO PLC	262	—	—	—	商業サービス・用品
RSA INSURANCE GROUP PLC	987	987	578	80,991	保険
COMPASS GROUP PLC	1,585	1,611	2,430	340,534	ホテル・レストラン・レジャー
REXAM PLC	655	—	—	—	容器・包装
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	229	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
STANDARD LIFE PLC	1,860	1,870	665	93,227	保険
AUTO TRADER GROUP PLC	950	950	369	51,766	インターネットソフトウェア・サービス
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,360	1,360	464	65,003	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
(イギリス)		百株	百株	千英ポンド	千円	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC		—	181	715	100,278	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDPAY GROUP PLC		1,050	1,660	483	67,736	情報技術サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC		—	120	429	60,195	化学
JOHNSON MATTHEY PLC		191	191	585	81,978	化学
小 計	株 数 ・ 金 額	280,828	289,196	179,660	25,166,797	
	銘 柄 数 < 比 率 >	108	104	—	<6.9%>	
(スイス)				千スイスフラン		
SYNGENTA AG-REG		89	89	3,944	442,033	化学
SIKA AG-BR		2	2	1,234	138,316	化学
SGS SA-REG		5	5	1,094	122,646	専門サービス
SULZER AG-REG		13	—	—	—	機械
BARRY CALLEBAUT AG		1	2	304	34,076	食品
SWISSCOM AG-REG		24	25	1,172	131,399	各種電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG-PC		0.95	1	588	65,910	食品
LINDT&SPRUENGLI AG-REG		0.1	0.1	664	74,498	食品
GIVAUDAN-REG		8	8	1,596	178,927	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG		144	147	4,136	463,542	保険
NOVARTIS-REG		2,199	2,175	16,323	1,829,360	医薬品
ABB LTD		2,134	1,841	4,302	482,171	電気設備
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)		678	684	17,645	1,977,533	医薬品
ADECCO GROUP AG-REG		163	153	1,082	121,312	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD		443	439	2,590	290,272	建設資材
NESTLE SA-REG		3,080	3,030	23,421	2,624,892	食品
BALOISE HOLDING AG		50	50	691	77,496	保険
SONOVA HOLDING AG-REG		50	50	682	76,431	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG		1,743	1,950	2,940	329,553	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B		29	29	1,043	116,930	繊維・アパレル・贅沢品
THE SWATCH GROUP AG-REG		46	46	319	35,828	繊維・アパレル・贅沢品
LONZA AG-REG		50	57	1,082	121,264	ライフサイエンス・ツール/サービス
SWISS LIFE HOLDING AG		31	31	1,031	115,610	保険
GALENICA AG-REG		3	3	381	42,765	医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG		8	8	485	54,462	化学
SWISS PRIME SITE-REG		63	68	591	66,338	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES		32	32	226	25,408	各種金融サービス
DUFREY AG-REG		40	45	670	75,193	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG		15	16	920	103,127	資本市場
SCHINDLER HOLDING-PART CERT		43	38	748	83,879	機械
SCHINDLER HOLDING AG-REG		19	19	366	41,096	機械
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG		52	52	739	82,842	海運業
GEBERIT AG-REG		36	35	1,573	176,291	建設関連製品
ACTELION LTD		97	—	—	—	バイオテクノロジー
ARYZTA AG		85	85	268	30,140	食品
JULIUS BAER GROUP LTD		220	220	1,098	123,055	資本市場
SWISS RE LTD		337	309	2,781	311,666	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A		500	511	3,988	446,974	繊維・アパレル・贅沢品
ACTELION LTD-NEW LINE		—	93	2,624	294,128	バイオテクノロジー
UBS GROUP AG		3,511	3,570	5,694	638,143	資本市場
小 計	株 数 ・ 金 額	16,053	15,927	111,051	12,445,526	
	銘 柄 数 < 比 率 >	39	38	—	<3.4%>	
(スウェーデン)				千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS		—	34	2,024	25,409	各種金融サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB		1,460	1,500	14,880	186,744	銀行
SWEDBANK AB		865	881	19,461	244,239	銀行
SWEDISH MATCH AB		189	189	5,486	68,857	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		
(スウェーデン)	百株	百株	千スウェーデンクローナ 千円		
NORDEA BANK AB	2,930	2,950	30,001	376,518	銀行
SECURITAS AB-B SHS	294	290	4,016	50,407	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	444	441	16,405	205,885	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B	923	917	20,880	262,045	専門小売り
ERICSSON LM-B	2,920	2,970	17,419	218,609	通信機器
TELIA CO AB	2,510	2,470	9,264	116,275	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	375	341	7,167	89,956	建設・土木
LUNDIN PETROLEUM AB	201	171	3,148	39,508	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB	277	277	4,664	58,541	機械
GETINGE AB-B SHS	191	191	2,954	37,082	ヘルスケア機器・用品
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	236	—	—	—	各種金融サービス
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	61	68	3,410	42,798	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB	78	78	2,352	29,523	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	380	380	2,937	36,864	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B	233	233	5,652	70,939	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES	388	388	6,852	85,993	機械
VOLVO AB-B SHS	1,500	1,520	20,018	251,230	機械
SANDVIK AB	1,030	1,030	13,637	171,146	機械
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	168	168	3,240	40,671	各種金融サービス
SVENSKA CELLULOSA AB-B	584	600	17,232	216,261	家庭用品
BOLIDEN AB	260	263	7,177	90,074	金属・鉱業
HEXAGON AB-B SHS	244	258	9,339	117,211	電子装置・機器・部品
TELE 2 AB-B SHS	284	340	2,886	36,226	無線通信サービス
KINNEVIK AB - B	—	236	5,638	70,757	各種金融サービス
ATLAS COPCO AB-A	648	660	20,704	259,837	機械
ATLAS COPCO AB-B	382	382	10,783	135,337	機械
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	1,450	1,480	18,070	226,788	銀行
ASSA ABLOY AB-B	970	963	17,728	222,496	建設関連製品
小 計	株 数 ・ 金 額	22,475	22,669	325,437	4,084,242
	銘 柄 数 < 比 率 >	30	31	—	<1.1%>
(ノルウェー)			千ノルウェークローネ		
DNB ASA	956	940	12,943	169,434	銀行
TELENOR ASA	719	719	10,216	133,740	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA	78	78	1,708	22,370	メディア
STATOIL ASA	1,055	1,113	16,494	215,915	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA	168	168	5,476	71,691	化学
MARINE HARVEST ASA	—	372	4,951	64,812	食品
NORSK HYDRO	1,300	1,300	6,552	85,765	金属・鉱業
ORKLA ASA	800	800	6,116	80,058	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	197	197	2,600	34,039	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS	91	91	1,783	23,347	メディア
小 計	株 数 ・ 金 額	5,364	5,778	68,844	901,175
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	10	—	<0.2%>
(デンマーク)			千デンマーククローネ		
CARLSBERG B	105	105	6,783	109,206	飲料
A P MOLLER-MAERSK A/S	6	6	7,285	117,288	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A	3	3	4,237	68,223	海運業
DANSKE BANK AS	686	669	15,775	253,977	銀行
GENMAB A/S	51	54	7,757	124,893	バイオテクノロジー
TDC A/S	768	768	2,781	44,785	各種電気通信サービス
WILLIAM DEMANT HOLDING	26	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	216	212	11,935	192,163	電気設備
DSV A/S	182	190	6,817	109,756	陸運・鉄道
PANDORA A/S	108	108	8,262	133,018	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	
(デンマーク)		百株	百株	千デンマーククローネ	千円	
CHR HANSEN HOLDING A/S		93	91	3,991	64,259	化学
NOVOZYMES A/S-B SHARES		225	225	6,174	99,401	化学
COLOPLAST-B		105	117	6,282	101,154	ヘルスケア機器・用品
NOVO NORDISK A/S-B		1,888	1,867	44,135	710,587	医薬品
ISS A/S		141	161	4,313	69,442	商業サービス・用品
TRYG A/S		118	118	1,487	23,956	保険
DONG ENERGY A/S		—	141	3,702	59,612	電力
WILLIAM DEMANT HOLDING		—	130	1,883	30,327	ヘルスケア機器・用品
小 計	株 数 ・ 金 額	4,722	4,966	143,605	2,312,055	
	銘柄 数 < 比 率 >	16	17	—	<0.6%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		202	184	3,280	392,960	繊維・アパレル・贅沢品
PRESENTIUS SE & CO KGAA		371	396	2,954	353,878	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	112	469	56,215	インターネットソフトウェア・サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD		64	64	291	34,863	化学
HANNOVER RUECK SE		57	56	602	72,214	保険
GEA GROUP AG		175	170	676	80,978	機械
CONTINENTAL AG		106	104	2,155	258,247	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG		940	926	2,950	353,464	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE		44	44	226	27,144	メディア
MERCK KGAA		126	125	1,323	158,572	医薬品
RWE AG		462	496	748	89,628	総合公益事業
SAP SE		948	959	8,764	1,049,875	ソフトウェア
E.ON SE		1,940	2,150	1,569	188,061	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA		100	99	1,032	123,632	家庭用品
METRO AG		166	182	546	65,405	食品・生活必需品小売り
BAYER AG-REG		797	807	8,618	1,032,441	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG		174	173	2,071	248,165	家庭用品
BASF SE		887	896	8,332	998,186	化学
BEIERSDORF AG		100	100	885	106,014	パーソナル用品
HOCHTIEF AG		—	20	309	37,039	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG		137	143	1,258	150,709	建設資材
PRESENTIUS MEDICAL CARE		209	208	1,639	196,340	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG		440	445	7,702	922,733	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG		226	226	340	40,784	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG		160	155	2,854	341,904	保険
VOLKSWAGEN AG		34	32	458	54,874	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF		178	179	2,437	292,045	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES		929	940	6,517	780,673	自動車
MAN SE		32	37	357	42,766	機械
THYSSENKRUPP AG		363	363	832	99,773	金属・鉱業
SIEMENS AG		765	746	9,530	1,141,616	コングロマリット
QIAGEN NV		223	—	—	—	ライフサイエンス・ツール/サービス
LINDE AG		179	182	2,849	341,354	化学
DEUTSCHE BANK AG-REG		1,331	2,026	3,248	389,160	資本市場
BAYER MOTOREN WERK		318	316	2,704	323,951	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD		53	53	390	46,734	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG		3,114	3,199	5,206	623,671	各種電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG		1,090	1,089	2,083	249,553	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG		189	—	—	—	各種金融サービス
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE		152	152	775	92,861	自動車
FRAPORT AG		38	38	250	29,965	運送インフラ
LANXESS		83	89	567	67,933	化学
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR		329	342	1,044	125,157	不動産管理・開発

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
SYMRISE AG		115	121	734	87,982	化学
BRENNTAG AG		151	151	797	95,584	商社・流通業
K+S AG		173	188	400	47,923	化学
EVONIK INDUSTRIES AG		138	169	517	62,019	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG		746	746	342	41,071	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG		63	63	424	50,819	繊維・アパレル・贅沢品
COMMERZBANK AG		1,020	1,020	870	104,310	銀行
OSRAM LICHT AG		88	88	508	60,915	電気設備
VONOVIA SE		452	446	1,459	174,784	不動産管理・開発
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE		209	223	913	109,457	メディア
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER		—	189	1,613	193,280	資本市場
INNOGY SE		—	127	442	53,056	総合公益事業
ZALANDO SE		81	81	303	36,308	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG		—	88	633	75,909	化学
QIAGEN NV		—	214	582	69,814	ライフサイエンス・ツール/サービス
SCHAEFFLER AG		—	160	264	31,653	自動車部品
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	21,587 53	23,102 57	111,665 —	13,376,446 <3.7%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		1,137	1,120	1,647	197,356	保険
INTESA SANPAOLO		12,160	12,340	3,117	373,395	銀行
INTESA SANPAOLO-RSP		920	920	218	26,119	銀行
MEDIOBANCA S. P. A.		530	530	449	53,901	銀行
SAIPEM SPA		5,497	5,897	254	30,438	エネルギー設備・サービス
LUXOTTICA GROUP SPA		165	165	853	102,285	繊維・アパレル・贅沢品
ENEL SPA		6,770	7,470	3,262	390,862	電力
ENI SPA		2,448	2,490	3,814	456,960	石油・ガス・消耗燃料
SNAM SPA		2,050	2,330	931	111,588	石油・ガス・消耗燃料
TENARIS SA		460	460	742	88,936	エネルギー設備・サービス
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA		900	—	—	—	銀行
TELECOM ITALIA SPA		11,100	11,300	955	114,449	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC		5,700	5,700	389	46,703	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA		393	387	932	111,724	運送インフラ
TERNA SPA		1,420	1,520	697	83,611	電力
EXOR SPA		112	—	—	—	各種金融サービス
LEONARDO SPA		410	410	552	66,156	航空宇宙・防衛
PRYSMIAN SPA		194	194	474	56,889	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		4,640	—	—	—	銀行
UNIPOLSAI SPA		1,070	1,070	220	26,429	保険
FERRARI NV		127	116	806	96,574	自動車
CNH INDUSTRIAL NV		920	990	892	106,910	機械
BANCO POPOLARE SPA		339	—	—	—	銀行
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		890	890	914	109,491	自動車
UNICREDIT SPA		—	1,843	2,632	315,292	銀行
EXOR NV		—	104	499	59,799	各種金融サービス
POSTE ITALIANE SPA		—	500	312	37,374	保険
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	61,952 25	58,746 23	25,571 —	3,063,253 <0.8%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES		201	201	772	92,530	建設・土木
AIRBUS SE		574	567	4,061	486,585	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT		437	461	797	95,536	総合公益事業
LOREAL-ORD		242	246	4,410	528,274	パーソナル用品

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
CHRISTIAN DIOR SE	53	53	1,162	139,237	繊維・アパレル・贅沢品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	268	272	5,526	662,078	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT AVIATION SA	—	2	234	28,099	航空宇宙・防衛
THALES SA	99	105	949	113,792	航空宇宙・防衛
CAP GEMINI SA	160	158	1,353	162,164	情報技術サービス
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	59	59	304	36,440	食品・生活必需品小売り
INGENICO GROUP	55	55	479	57,438	電子装置・機器・部品
PUBLICIS GROUPE	184	181	1,171	140,390	メディア
LAGARDERE S. C. A	116	116	313	37,497	メディア
BOLLORE	870	870	312	37,424	航空貨物・物流サービス
MICHELIN (CGDE)	178	175	1,965	235,417	自動車部品
PERNOD RICARD SA	205	207	2,272	272,265	飲料
RENAULT SA	188	186	1,516	181,611	自動車
REMY COINTREAU	23	23	204	24,485	飲料
SEB SA	—	20	258	31,001	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	538	544	3,719	445,603	電気設備
VIVENDI SA	1,132	1,000	1,763	211,189	メディア
TECHNIP SA	98	—	—	—	エネルギー設備・サービス
VALEO SA	76	—	—	—	自動車部品
ORANGE SA	1,903	1,940	2,837	339,874	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	24	26	1,149	137,701	繊維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA	28	28	323	38,726	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	121	128	1,035	123,983	ソフトウェア
KERING SA	72	74	1,802	215,922	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	165	165	316	37,939	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE	541	552	1,213	145,406	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	86	86	989	118,472	情報技術サービス
SANOFI	1,133	1,132	9,535	1,142,313	医薬品
ACCOR SA	207	164	639	76,656	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV	577	600	861	103,247	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE	697	742	3,492	418,377	銀行
EURAZEO	38	40	247	29,684	各種金融サービス
SODEXO	90	89	970	116,314	ホテル・レストラン・レジャー
AXA	1,912	1,897	4,593	550,265	保険
PEUGEOT CITROEN	437	473	896	107,371	自動車
JC DECAUX SA	68	68	219	26,322	メディア
ESSILOR INTERNATIONAL	199	204	2,305	276,139	ヘルスケア機器・用品
CREDIT AGRICOLE SA	1,030	1,080	1,365	163,527	銀行
ZODIAC AEROSPACE	195	195	456	54,660	航空宇宙・防衛
BNP PARIBAS	1,023	1,034	6,390	765,472	銀行
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	455	481	2,290	274,410	建設関連製品
WENDEL	29	29	336	40,349	各種金融サービス
ILIAD SA	24	27	570	68,318	各種電気通信サービス
SES FDR	316	344	722	86,536	メディア
IMERYS	38	38	299	35,824	建設資材
SAFRAN SA	301	304	2,129	255,058	航空宇宙・防衛
ENGIE	1,411	1,520	1,976	236,705	総合公益事業
ALSTOM	155	155	429	51,431	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	163	163	328	39,403	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	228	370	290	34,793	電力
ARKEMA	67	67	626	75,010	化学
LEGRAND SA	253	264	1,479	177,287	電気設備
EIFFAGE SA	—	61	446	53,510	建設・土木
TOTAL SA	2,115	2,219	10,445	1,251,319	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…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
ADP		28	28	325	39,008	運送インフラ
NATIXIS		870	870	497	59,643	銀行
SCOR SE		154	154	540	64,778	保険
REXEL SA		286	286	486	58,241	商社・流通業
VINCI		460	489	3,626	434,409	建設・土木
DANONE		567	578	3,673	440,011	食品
AIR LIQUIDE		330	376	4,015	481,038	化学
BUREAU VERITAS SA		255	255	487	58,343	専門サービス
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR		450	450	412	49,377	運送インフラ
SUEZ		299	333	483	57,860	総合公益事業
EDENRED		187	214	470	56,397	商業サービス・用品
VALEO SA		—	228	1,424	170,673	自動車部品
SFR GROUP SA		110	77	226	27,081	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	25,857 67	26,601 69	114,235 —	13,684,273 <3.8%>	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		—	219	771	92,396	飲料
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	— —	219 1	771 —	92,396 <0.0%>	
(ユーロ…オランダ)						
RELX NV		970	954	1,649	197,589	専門サービス
RANDSTAD HOLDING NV		127	116	626	75,092	専門サービス
AKZO NOBEL		240	248	1,917	229,731	化学
WOLTERS KLUWER		289	299	1,154	138,326	専門サービス
VOPAK		71	71	288	34,611	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV		1,800	1,700	814	97,544	保険
KONINKLIJKE KPN NV		3,110	3,410	953	114,252	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV		915	916	2,748	329,182	コングロマリット
ING GROEP NV		3,750	—	—	—	銀行
HEINEKEN NV		220	223	1,771	212,236	飲料
ARCELORMITTAL		960	1,780	1,420	170,133	金属・鉱業
ARCELORMITTAL-RIGHTS		960	—	—	—	金属・鉱業
HEINEKEN HOLDING NV		97	97	716	85,869	飲料
KONINKLIJKE DSM NV		175	180	1,146	137,394	化学
UNILEVER NV-CVA		1,571	1,589	7,424	889,393	パーソナル用品
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA		81	93	301	36,095	建設・土木
TNT EXPRESS NV		430	—	—	—	航空貨物・物流サービス
ASML HOLDING NV		332	362	4,490	537,930	半導体・半導体製造装置
GEMALTO		76	76	390	46,803	ソフトウェア
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		—	1,232	2,440	292,358	食品・生活必需品小売り
OCI		80	—	—	—	化学
KONINKLIJKE AHOLD NV		812	—	—	—	食品・生活必需品小売り
NN GROUP NV		232	300	919	110,164	保険
ABN AMRO GROUP NV-CVA		—	279	637	76,418	銀行
ALTICE NV - B		100	100	214	25,684	メディア
ALTICE NV - A		368	368	789	94,546	メディア
ING GROEP NV		—	3,790	5,317	636,967	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 >	17,766 24	18,183 22	38,136 —	4,568,326 <1.3%>	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		502	630	953	114,200	運送インフラ
ENDESA S.A.		317	317	689	82,573	電力
BANKINTER S.A.		650	650	507	60,811	銀行
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.		6,172	6,420	4,628	554,486	銀行

銘柄		株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
				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	
GAS NATURAL SDG		328	328	663	79,426	ガス
REPSOL SA		1,043	1,087	1,588	190,250	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA		13,978	14,220	8,169	978,611	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA		102	—	—	—	電力
TELEFONICA SA		4,356	4,430	4,629	554,549	各種電気通信サービス
ZARDOYA OTIS S.A		168	175	151	18,201	機械
ENAGAS		213	228	547	65,535	石油・ガス・消耗燃料
ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV		185	190	600	71,990	建設・土木
FERROVIAL SA		463	464	868	104,087	建設・土木
MAPFRE SA		1,110	980	316	37,941	保険
BANCO DE SABADELL SA		4,845	5,300	906	108,565	銀行
CAIXABANK		2,482	3,450	1,390	166,550	銀行
IBERDROLA SA		5,287	5,410	3,587	429,795	電力
AMADEUS IT GROUP SA		419	426	2,003	239,971	情報技術サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP		800	800	489	58,639	旅客航空輸送業
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		570	560	302	36,278	食品・生活必需品小売り
BANKIA SA		4,300	4,300	455	54,548	銀行
BCO POPULAR ESPANOL		1,624	3,002	276	33,090	銀行
RED ELECTRICA CORPORACION SA		—	432	772	92,527	電力
INDITEX SA		1,056	1,068	3,476	416,430	専門小売り
AENA SA		65	65	955	114,459	運送インフラ
GRIFOLS SA		288	288	664	79,642	バイオテクノロジー
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	51,327	55,222	39,595	4,743,167	
(ユーロ…ベルギー)						
UMICORE		88	94	501	60,107	化学
DELHAIZE GROUP		98	—	—	—	食品・生活必需品小売り
KBC GROEP NV		240	244	1,512	181,130	銀行
ANHEUSER-BUSCH INBEV NV		774	—	—	—	飲料
SOLVAY SA		73	73	832	99,776	化学
UCB SA		123	121	875	104,882	医薬品
COLRUYT SA		70	60	271	32,569	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAM		78	78	663	79,476	各種金融サービス
PROXIMUS		151	151	444	53,288	各種電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		52	52	289	34,627	メディア
AGEAS		200	190	695	83,347	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		—	743	7,656	917,185	飲料
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,947	1,806	13,743	1,646,392	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG		140	150	562	67,417	石油・ガス・消耗燃料
VOESTALPINE AG		110	110	419	50,217	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		268	289	887	106,263	銀行
IMMOEAST AG-RIGHTS		500	500	—	—	不動産管理・開発
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		110	110	232	27,809	銀行
ANDRITZ AG		80	72	348	41,778	機械
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,208	1,231	2,450	293,487	
(ユーロ…ルクセンブルグ)						
EUROFINS SCIENTIFIC SE		—	10	418	50,130	ライフサイエンス・ツール/サービス
RTL GROUP		39	39	292	35,047	メディア
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	39	49	711	85,178	
		1	2	—	<0.0%>	

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ユーロ…フィンランド)		百株	百株	千ユーロ	千円	
WARTSILA OYJ		147	147	737	88,397	機械
UPM-KYMMENE OYJ		505	529	1,174	140,742	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R		540	540	596	71,478	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS		432	430	1,907	228,497	保険
FORTUM OYJ		440	440	643	77,111	電力
ELISA OYJ		137	145	480	57,510	各種電気通信サービス
METSO OYJ		104	103	293	35,152	機械
NOKIA OYJ		5,600	5,680	2,836	339,795	通信機器
NESTE OYJ		125	125	461	55,223	石油・ガス・消耗燃料
NOKIAN RENKAAT OYJ		113	113	442	52,994	自動車部品
KONE OYJ		319	323	1,321	158,289	機械
ORION OYJ		96	95	463	55,568	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額	8,558	8,670	11,359	1,360,761	
	銘 柄 数 < 比 率 >	12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
BANK OF IRELAND		28,500	28,500	669	80,229	銀行
CRH PLC		822	823	2,701	323,661	建設資材
KERRY GROUP PLC-A		161	158	1,165	139,566	食品
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD		1,398	1,398	—	—	銀行
PADDY POWER PLC		81	87	864	103,508	ホテル・レストラン・レジャー
小 計	株 数 ・ 金 額	30,962	30,966	5,400	646,966	
	銘 柄 数 < 比 率 >	5	5	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL		2,200	2,350	740	88,758	電力
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REGD		34,000	—	—	—	銀行
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		445	500	707	84,751	石油・ガス・消耗燃料
JERONIMO MARTINS		252	230	379	45,405	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	36,897	3,080	1,827	218,915	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	3	—	<0.1%>	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	258,101	227,877	365,469	43,779,566	
	銘 柄 数 < 比 率 >	233	235	—	<12.0%>	
(香港)				千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		219	219	2,297	33,173	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		2,130	2,130	4,409	63,667	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA		1,208	1,208	3,915	56,545	銀行
CLP HLDGS		1,855	1,590	13,030	188,153	電力
CATHAY PACIFIC AIRWAYS		1,070	1,070	1,202	17,366	旅客航空輸送業
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE		600	650	4,000	57,770	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD		1,102	1,120	21,772	314,399	資本市場
LI & FUNG LTD		5,636	5,636	1,904	27,507	繊維・アパレル・贅沢品
MTR CORP		1,395	1,480	6,512	94,033	陸運・鉄道
FIRST PACIFIC CO		2,260	2,260	1,292	18,666	各種金融サービス
HANG LUNG GROUP LTD		—	810	2,729	39,416	不動産管理・開発
HANG SENG BANK		730	756	12,012	173,465	銀行
HENDERSON LAND		1,110	1,078	5,213	75,275	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,350	1,320	8,830	127,516	電力
WHARF (HOLDING)		1,330	1,330	8,997	129,923	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS		6,625	7,548	11,729	169,377	ガス
HYSAN DEVELOPMENT		650	650	2,275	32,851	不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		2,230	2,230	9,611	138,787	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES		570	570	1,539	22,223	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		3,635	3,635	11,668	168,490	銀行
NWS HOLDINGS LTD		1,355	1,595	2,274	32,843	コングロマリット
PCCW LTD		3,860	3,860	1,752	25,305	各種電気通信サービス

銘柄		株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
			株数	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		750	750	2,332	33,681	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT		5,166	5,496	5,265	76,038	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD		1,083	1,083	1,178	17,019	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO.LTD		2,860	3,140	4,333	62,571	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,680	1,390	15,985	230,823	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A		585	535	4,164	60,142	不動産管理・開発
WHEELLOCK & COMPANY LTD		870	750	4,702	67,904	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		1,280	1,400	4,340	62,669	家庭用耐久財
SJM HOLDINGS LIMITED		1,660	1,660	1,059	15,293	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD		1,684	1,484	2,418	34,929	ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD		780	940	1,515	21,880	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD		11,624	11,760	58,329	842,279	保険
HKT TRUST AND HKT LTD		2,596	3,796	3,811	55,033	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD		2,348	2,336	8,503	122,783	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD		1,168	1,168	2,908	41,996	不動産管理・開発
WH GROUP LIMITED		5,900	8,100	5,410	78,131	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		2,625	2,645	25,594	369,580	コングロマリット
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING		2,635	2,610	13,691	197,705	不動産管理・開発
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	88,217	93,790	304,516	4,397,225	
(シンガポール)		39	40	—	<1.2%>	
SINGAPORE TECH ENGINEERING		1,410	1,610	605	48,592	航空宇宙・防衛
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		6,153	6,203	238	19,170	食品
DBS GROUP HLDGS		1,710	1,720	3,319	266,464	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD		370	410	419	33,634	不動産管理・開発
SEMBCORP MARINE		726	—	—	—	機械
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD		118	100	443	35,631	販売
SATS LTD		—	590	289	23,206	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD		770	770	597	47,962	資本市場
CAPITALAND LIMITED		2,460	2,460	892	71,679	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE PLC		6,146	6,146	626	50,320	ホテル・レストラン・レジャー
COMFORTDELGRO CORP LTD		2,070	2,070	536	43,035	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD		550	520	529	42,482	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK		1,255	1,300	2,862	229,780	銀行
UOL GROUP LIMITED		487	487	340	27,364	不動産管理・開発
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		1,510	1,480	529	42,530	メディア
NOBLE GROUP LTD		4,124	—	—	—	商社・流通業
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED		7,700	7,860	3,088	247,952	各種電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES		990	990	315	25,360	コングロマリット
OCBC-ORD		2,975	3,030	2,942	236,164	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,840	1,840	653	52,432	食品
STARHUB LTD		530	690	199	16,006	無線通信サービス
KEPPEL CORP.		1,427	1,427	983	78,921	コングロマリット
YANGZIJANG SHIPBUILDING		1,630	1,630	184	14,784	機械
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L		2,940	2,660	731	58,717	不動産管理・開発
小 計	株数・金額 銘柄数<比率>	49,892	45,994	21,330	1,712,196	
(オーストラリア)		23	22	—	<0.5%>	
RAMSAY HEALTH CARE LTD		141	141	989	84,941	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK		2,817	2,857	9,219	791,405	銀行
AMCOR		1,130	1,120	1,712	146,999	容器・包装
WESTPAC BANKING CORP		3,206	3,263	11,505	987,618	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD		351	351	422	36,291	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,420	1,480	919	78,893	金属・鉱業

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等
		株数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)	百株	百株	千豪ドル	千円	
TELSTRA CORP LTD	4,170	4,140	1,912	164,184	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	443	443	532	45,746	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD	520	600	648	55,675	飲料
ASX LTD	182	196	993	85,317	資本市場
BHP BILLITON LIMITED	3,084	3,137	7,550	648,157	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	255	255	764	65,623	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	530	530	236	20,336	複合小売り
COMPUTERSHARE LTD	470	470	664	57,047	情報技術サービス
CSL LIMITED	451	446	5,596	480,433	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD	54	54	321	27,636	メディア
TRANSURBAN GROUP	1,950	1,980	2,320	199,196	運送インフラ
COCHLEAR LTD	52	58	787	67,556	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD	1,750	1,750	1,249	107,257	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,646	1,680	14,535	1,247,715	銀行
BORAL LTD	670	1,150	675	57,946	建設資材
RIO TINTO LTD	410	408	2,467	211,852	金属・鉱業
APA GROUP	1,070	1,110	997	85,658	ガス
ARISTOCRAT LEISURE LTD	520	520	937	80,435	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	2,320	2,280	1,386	118,994	保険
TPG TELECOM LTD	270	330	229	19,687	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	52	52	150	12,913	ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD	366	366	651	55,954	化学
SUNCORP GROUP LTD	1,260	1,260	1,670	143,418	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,524	2,594	8,687	745,718	銀行
NEWCREST MINING	750	750	1,680	144,211	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD	1,300	1,290	940	80,724	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD	1,610	1,610	606	52,102	化学
AMP LIMITED	2,850	2,810	1,447	124,223	各種金融サービス
QANTAS AIRWAYS LIMITED	441	441	175	15,077	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE	1,330	1,320	1,706	146,508	保険
CHALLENGER LIMITED	560	560	705	60,520	各種金融サービス
SANTOS LTD.	1,670	1,760	674	57,863	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE LTD	373	380	845	72,545	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TABCORP HOLDINGS	780	780	369	31,736	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LIMITED	1,079	1,107	5,035	432,268	食品・生活必需品小売り
ALUMINA LTD	2,330	2,330	422	36,301	金属・鉱業
ILUKA RESOURCES LTD	378	—	—	—	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM	711	735	2,376	203,977	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS LIMITED	1,229	1,236	3,300	283,282	食品・生活必需品小売り
DUET GROUP	2,290	2,290	636	54,647	総合公益事業
SEEK LTD	328	328	523	44,936	専門サービス
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	—	59	341	29,354	ホテル・レストラン・レジャー
TATTS GROUP LTD	1,470	1,470	654	56,152	ホテル・レストラン・レジャー
BRAMBLES LTD	1,550	1,530	1,445	124,111	商業サービス・用品
PLATINUM ASSET MANAGEMENT	250	—	—	—	資本市場
ASCIANO LTD	610	—	—	—	陸運・鉄道
MACQUARIE GROUP LIMITED	296	295	2,656	228,031	資本市場
CROWN RESORTS LTD	360	360	426	36,650	ホテル・レストラン・レジャー
VOCUS GROUP LTD	430	540	234	20,117	各種電気通信サービス
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	440	440	910	78,145	建設資材
TREASURY WINE ESTATES LTD	720	720	888	76,267	飲料
SYDNEY AIRPORT	1,079	1,079	724	62,148	運送インフラ
AURIZON HOLDINGS LTD	2,090	1,910	1,021	87,715	陸運・鉄道
HEALTHSCOPE LTD	1,760	1,760	401	34,445	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	
(オーストラリア)		百株	百株	千豪ドル	千円	
AUSNET SERVICES		1,634	1,634	276	23,704	電力
MEDIBANK PRIVATE LTD		2,610	2,610	738	63,403	保険
AGL ENERGY LTD		645	657	1,711	146,913	総合公益事業
SOUTH32 LTD		5,000	5,070	1,414	121,423	金属・鉱業
CIMIC GROUP LTD		89	89	325	27,904	建設・土木
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	75,126 64	74,971 62	116,356 —	9,988,031 <2.7%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
CONTACT ENERGY LTD		760	760	379	29,743	電力
RYMAN HEALTHCARE LTD		350	350	295	23,140	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
FLETCHER BUILDING LTD		690	690	572	44,862	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,700	1,890	652	51,140	各種電気通信サービス
MERCURY NZ LTD		600	600	190	14,964	電力
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		971	911	617	48,448	運送インフラ
MERIDIAN ENERGY LTD		1,200	1,200	336	26,352	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	6,271 7	6,401 7	3,042 —	238,652 <0.1%>	
(イスラエル)				千新シェケル		
BANK HAPOLIM BM		1,020	1,020	2,252	69,546	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		1,380	1,420	2,272	70,159	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP		1,860	2,040	1,328	41,009	各種電気通信サービス
DELEK GROUP LTD		4	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ELBIT SYSTEMS LTD		—	23	953	29,446	航空宇宙・防衛
FRUTAROM		—	38	769	23,762	化学
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		440	500	770	23,777	化学
NICE LTD		53	59	1,436	44,345	ソフトウェア
TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD		881	—	—	—	医薬品
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		130	130	798	24,664	銀行
AZRIELI GROUP		31	41	788	24,334	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	5,799 9	5,271 9	11,368 —	351,046 <0.1%>	
合 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	1,154,618 1,266	1,136,364 1,265	— —	346,165,525 <95.0%>	

* 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。

* 邦貨換算金額欄の〈 〉内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
AGNC INVESTMENT CORP	—	32,900	656	73,636	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	—	7,600	834	93,637	0.0
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	34,100	—	—	—	—
AMERICAN TOWER CORP	41,000	41,600	5,029	564,299	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	91,000	95,000	1,055	118,410	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	13,330	13,230	2,425	272,097	0.1
BOSTON PROPERTIES	14,700	14,900	1,957	219,618	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	17,300	30,000	636	71,420	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST	8,300	8,200	660	74,075	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	51,000	663	74,381	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP	32,300	35,000	3,311	371,539	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC	14,000	15,300	1,613	180,988	0.0
DUKE REALTY CORP	34,000	34,000	882	99,023	0.0
EQUINIX INC	6,490	7,450	2,958	331,935	0.1
EQUITY RESIDENTIAL	35,100	34,800	2,164	242,802	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC	6,300	6,190	1,439	161,509	0.0
EXTRA SPACE STORAGE INC	11,000	11,800	873	97,964	0.0
FEDERAL REALTY INVST TRUST	6,520	6,910	921	103,369	0.0
GGP INC	—	56,500	1,296	145,410	0.0
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	54,400	—	—	—	—
HCP INC	45,600	44,700	1,385	155,411	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC	73,900	70,100	1,299	145,808	0.0
IRON MOUNTAIN INC	19,000	24,400	863	96,877	0.0
KIMCO REALTY CORP	40,500	40,000	878	98,547	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST	15,000	14,300	545	61,172	0.0
MACERICH CO /THE	13,300	12,300	790	88,647	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM	7,200	11,200	1,139	127,889	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	—	14,500	632	70,910	0.0
PROLOGIS INC	50,700	51,400	2,630	295,132	0.1
PUBLIC STORAGE	14,240	14,450	3,170	355,679	0.1
REALTY INCOME CORP	23,800	24,700	1,455	163,300	0.0
REGENCY CENTERS CORP	8,800	15,100	1,004	112,655	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP	—	12,000	1,427	160,099	0.0
SL GREEN REALTY CORP	9,800	9,800	1,030	115,619	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC	29,970	30,720	5,223	586,038	0.2
UDR INC	25,700	25,300	914	102,608	0.0
VENTAS INC	31,700	34,800	2,244	251,821	0.1
VEREIT INC	88,000	95,000	805	90,380	0.0
VORNADO REALTY TRUST	16,600	16,500	1,656	185,798	0.1
WELLTOWER INC	34,500	35,300	2,498	280,310	0.1
WEYERHAEUSER CO	76,000	72,200	2,446	274,512	0.1
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	509,000	211	23,698	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,553,150	1,680,150	63,633	7,139,043
	銘 柄 数 < 比 率 >	36	40	—	<2.0%>
(カナダ)			千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		13,600	312	26,302	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			14,400	16,900	438	36,888	0.0
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST			6,900	6,900	224	18,859	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		34,900	37,400	976	82,051	
	銘 柄 数 < 比 率 >		3	3	—	<0.0%>	
(イギリス)					千英ポンド		
BRITISH LAND			94,000	92,000	545	76,357	0.0
HAMMERSON PLC			73,000	74,000	415	58,152	0.0
INTU PROPERTIES PLC			88,000	88,000	239	33,517	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC			77,500	77,500	795	111,493	0.0
SEGRO PLC			70,000	91,200	413	57,987	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		402,500	422,700	2,409	337,507	
	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	250	29,961	0.0
KLEPIERRE			21,200	20,500	739	88,540	0.0
GECINA SA			3,400	4,000	492	58,936	0.0
FONCIERE DES REGIONS			3,100	3,100	237	28,497	0.0
UNIBAIL RODAMCO-NA			9,600	9,570	2,057	246,473	0.1
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額		40,300	40,870	3,776	452,409	
	銘 柄 数 < 比 率 >		5	5	—	<0.1%>	
(香港)					千香港ドル		
LINK REIT			219,000	215,000	11,663	168,424	0.0
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS			260,000	260,000	1,866	26,956	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		479,000	475,000	13,530	195,381	
	銘 柄 数 < 比 率 >		2	2	—	<0.1%>	
(シンガポール)					千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST			249,900	249,900	489	39,316	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT			213,000	239,000	602	48,345	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST			192,000	192,000	299	24,042	0.0
SUNTEC REIT			243,000	243,000	434	34,915	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		897,900	923,900	1,826	146,619	
	銘 柄 数 < 比 率 >		4	4	—	<0.0%>	
(オーストラリア)					千豪ドル		
MIRVAC GROUP			350,000	340,000	754	64,792	0.0
GPT GROUP			179,000	179,000	930	79,899	0.0
LENDLEASE GROUP			53,000	53,000	837	71,882	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP			230,000	227,000	1,069	91,777	0.0
DEXUS PROPERTY GROUP			92,000	91,000	902	77,489	0.0
GOODMAN GROUP			174,000	174,000	1,379	118,443	0.0
SCENTRE GROUP			513,000	518,000	2,268	194,757	0.1
WESTFIELD CORP			193,000	191,000	1,699	145,919	0.0
VICINITY CENTRES			328,704	328,704	946	81,261	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額		2,112,704	2,101,704	10,790	926,223	
	銘 柄 数 < 比 率 >		9	9	—	<0.3%>	
合 計	口 数 ・ 金 額		5,520,454	5,681,724	—	9,279,236	
	銘 柄 数 < 比 率 >		64	68	—	<2.5%>	

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

* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	株式先物取引	CAN60	百万円 353	百万円 —
		EURO50	1,119	—
		FT100	644	—
		SPI200	277	—
		SPEMINI	5,928	—
		SWISSMKT	316	—

* 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

(2017年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 346,165,525	% 94.1
投資信託受益証券	23,698	0.0
投資証券	9,255,537	2.5
コール・ローン等、その他	12,558,812	3.4
投資信託財産総額	368,003,572	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（363,772,868千円）の投資信託財産総額（368,003,572千円）に対する比率は98.9%です。

* 外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝112.19円、1カナダドル＝84.05円、1英ポンド＝140.08円、1スイスフラン＝112.07円、1スウェーデンクローナ＝12.55円、1ノルウェークローネ＝13.09円、1デンマーククローネ＝16.10円、1ユーロ＝119.79円、1香港ドル＝14.44円、1シンガポールドル＝80.27円、1豪ドル＝85.84円、1ニュージーランドドル＝78.43円、1新シェケル＝30.88円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年3月31日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	368,529,943,626
コール・ローン等	9,302,494,133
株式(評価額)	346,165,525,144
投資信託受益証券(評価額)	23,698,454
投資証券(評価額)	9,255,537,649
未収入金	618,366,696
未収配当金	667,272,812
差入委託証拠金	2,497,048,738
(B) 負債	4,177,463,308
未払金	4,078,311,393
未払解約金	96,836,434
未払利息	1,081
その他未払費用	2,314,400
(C) 純資産総額(A-B)	364,352,480,318
元本	157,848,148,117
次期繰越損益金	206,504,332,201
(D) 受益権総口数	157,848,148,117口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,082円

(注) 期首元本額は162,042,393,593円、期中追加設定元本額は25,464,062,503円、期中一部解約元本額は29,658,307,979円、1口当たり純資産額は2.3082円です。

○損益の状況 (2016年4月1日～2017年3月31日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	7,562,537,903
受取配当金	7,549,560,671
受取利息	194,460
その他収益金	14,648,084
支払利息	△ 1,865,312
(B) 有価証券売買損益	38,989,644,972
売買益	54,524,255,472
売買損	△ 15,534,610,500
(C) 先物取引等取引損益	939,113,844
取引益	1,124,591,484
取引損	△ 185,477,640
(D) 保管費用等	△ 8,690,376
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	47,482,606,343
(F) 前期繰越損益金	164,389,040,297
(G) 追加信託差損益金	26,711,651,041
(H) 解約差損益金	△ 32,078,965,480
(I) 計(E+F+G+H)	206,504,332,201
次期繰越損益金(I)	206,504,332,201

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI (確定拠出年金向け)	57,909,675,125
野村外国株インデックス (野村投資一任口座向け)	15,855,656,967
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	14,348,735,324
野村世界6資産分散投信 (分配コース)	8,025,722,266
マイバランス70 (確定拠出年金向け)	6,045,603,337
マイバランス50 (確定拠出年金向け)	5,435,884,073
のむラップ・ファンド (普通型)	5,241,102,762
野村世界6資産分散投信 (成長コース)	5,141,767,715
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)	4,947,597,390
のむラップ・ファンド (積極型)	4,126,307,425
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)	4,100,237,575
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)	3,273,346,313
野村インデックスファンド・外国株式	3,011,835,177
野村世界6資産分散投信 (安定コース)	2,671,959,785
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド (適格機関投資家専用)	1,573,089,951
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)	1,514,456,345
マイ・ロード	1,483,419,527

ファンド名	当期末
	元本額
	円
マイバランスDC50	1,426,628,611
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,332,662,431
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）	1,175,162,406
マイバランスDC70	1,070,344,629
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,055,615,343
のむらップ・ファンド（保守型）	978,642,923
マイバランスDC30	768,749,026
野村外国株式インデックスファンド	558,511,277
野村外国株インデックス Bコース（野村SMA・EW向け）	554,662,250
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	506,871,900
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）	462,017,543
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）	445,672,787
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）	383,379,354
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）	298,530,621
野村DC運用戦略ファンド	229,748,994
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	224,369,794
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	188,654,290
バランスセレクト50	177,879,911
バランスセレクト70	173,844,266
ネクストコア	136,539,032
のむらップ・ファンド（やや保守型）	122,882,103
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）	106,704,577
野村資産設計ファンド2040	96,985,703
のむらップ・ファンド（やや積極型）	87,114,839
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	85,321,443
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	63,510,527
バランスセレクト30	56,305,333
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）	52,436,276
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	45,768,316
野村資産設計ファンド2025	43,796,632
野村資産設計ファンド2030	41,035,697
野村資産設計ファンド2020	32,610,809
野村資産設計ファンド2035	31,725,271
野村資産設計ファンド2015	27,470,529
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）	20,746,593
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	13,934,551
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	13,320,585
野村資産設計ファンド2050	12,348,732
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）	11,273,610
野村資産設計ファンド2045	10,372,087
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	3,781,629
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	2,860,100
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	2,799,223
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	2,290,001
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	1,938,035
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	1,660,830
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	741,539
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	501,273
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	415,364
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	203,400
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	175,867
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	149,515
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	42,852
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	39,831

○お知らせ

- ①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＞
- ②スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って
評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2017年3月31日＞
- ③外国為替予約取引に係る担保授受に関する規定を追加する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2017年3月31日＞

新興国株式マザーファンド

運用報告書

第9期（決算日2017年5月10日）

作成対象期間（2016年5月11日～2017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 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率	期 騰 落 率	中 率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
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
9期(2017年5月10日)	11,642	32.7	117.96	33.4	95.7	3.7	0.5	21,796

*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

*株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*ベンチマーク（＝「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」）は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに当社が円換算したものです。なお指数算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。

*MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行われますので、変動することがあります。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。

請求目論見書には、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 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	中 率	騰 落 率	中 率			
(期 首)	円	%		%	%	%	%
2016年5月10日	8,770	—	88.42	—	95.5	3.9	0.6
5月末	9,073	3.5	91.32	3.3	95.0	4.3	0.5
6月末	8,637	△ 1.5	86.84	△ 1.8	96.7	2.5	0.5
7月末	9,336	6.5	94.22	6.6	97.2	2.3	0.6
8月末	9,487	8.2	95.78	8.3	95.9	3.5	0.5
9月末	9,439	7.6	95.60	8.1	96.4	3.0	0.5
10月末	9,691	10.5	98.13	11.0	96.7	2.8	0.5
11月末	9,912	13.0	100.02	13.1	96.3	3.1	0.5
12月末	10,277	17.2	104.02	17.6	96.8	2.7	0.5
2017年1月末	10,658	21.5	108.13	22.3	96.1	3.4	0.5
2月末	10,880	24.1	110.22	24.6	96.3	3.1	0.5
3月末	11,159	27.2	113.49	28.3	96.6	2.8	0.5
4月末	11,252	28.3	113.94	28.9	95.9	3.5	0.5
(期 末)							
2017年5月10日	11,642	32.7	117.96	33.4	95.7	3.7	0.5

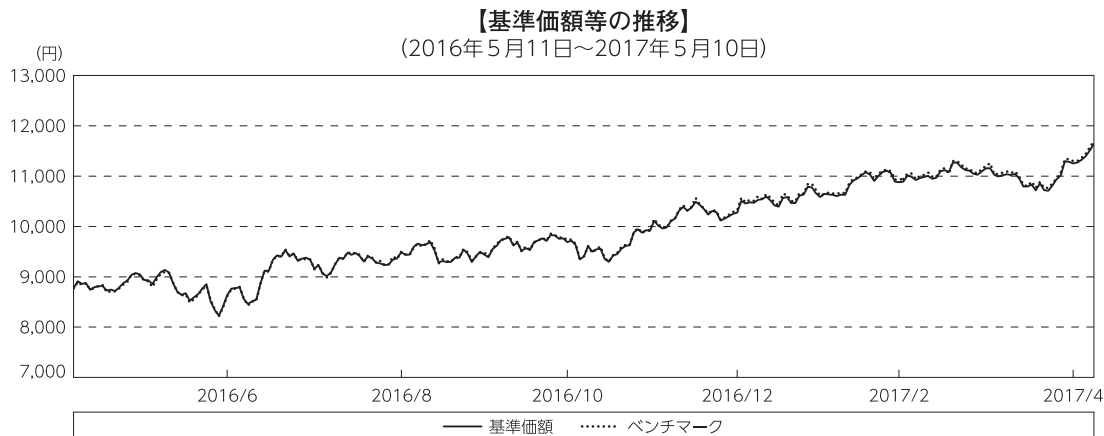
*騰落率は期首比です。

*株式組入比率には、新株予約権証券を含みます。

*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8,770円から期末11,642円に2,872円の値上がりとなりました。

中国における追加金融緩和期待や、中国の経済指標が市場予想を上回ったこと、各国通貨が対円で上昇（円安）したことなどを受けて、基準価額は上昇しました。

○投資環境

期首より、中国における追加金融緩和期待や、香港・深セン株式市場の相互取引開始への期待、米国の早期利上げ観測の後退などを背景に、新興国株式市場は上昇しました。

2016年11月より新興国株式市場は、米国の新政権による保護主義的な貿易政策が新興国経済に悪影響を与えるとの懸念などから下落したものの、その後は、中国の経済指標が市場予想を上回ったことや、中国において年金基金による株式投資が本格的に始まるとの観測などを背景に再び上昇しました。

為替市場は、期首より、EU（欧州連合）離脱派が勝利した英国の国民投票の結果を受けて、米国の早期利上げ観測が後退したことなどを背景に各国通貨が対円で下落（円高）したものの、2016年後半より、米国利上げペースの加速が意識され日米金利差の拡大観測が高まったこと

や、世界的な株式市場の上昇を受けて投資家のリスク選好が強まったことなどから、各国通貨が対円で上昇（円安）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指すため、新興国の株式（DR（預託証券）を含む）に幅広く分散投資し、株式先物への投資も一部行いました。期中の資金流入出や「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」の変更（銘柄入れ替え、比率変更など）に対応して適宜ポートフォリオの見直しを行い、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+32.7%となり、ベンチマークの+33.4%を0.7ポイント下回りました。

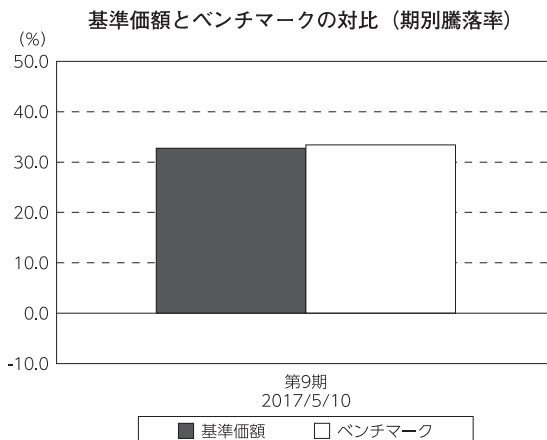
主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

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

（その他の要因）

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



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

◎今後の運用方針

引き続き、「MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年5月11日～2017年5月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 4	% 0.036	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(3)	(0.030)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.006)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	2	0.018	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株 式)	(2)	(0.018)	
(新株予約権証券)	(0)	(0.000)	
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	13	0.128	(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)	(11)	(0.112)	
(そ の 他)	(2)	(0.016)	
合 計	19	0.182	
期中の平均基準価額は、9,983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

(2016年5月11日～2017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 230 (55)	千カタールリヤル 1,083 (106)	百株 144 (18)	千カタールリヤル 236 (12)
	アメリカ	25,443 (147)	千米ドル 8,303 (ー)	335 (43)	千米ドル 376 (251)
	トルコ	1,459 (22)	千トルコリラ 1,243 (ー)	286	千トルコリラ 156
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ギリシャ	755	89	34	10
	チェコ	227 (19)	千チェココルナ 2,762 (△ 11)	ー	千チェココルナ ー
	ハンガリー	25	千フォリント 20,993	ー	千フォリント ー
	ポーランド	709 (29)	千ズロチ 1,841 (90)	178 (16)	千ズロチ 229 (40)
	香港	73,268 (△ 9,711)	千香港ドル 59,420 (287)	10,539 (165)	千香港ドル 5,373 (130)
	マレーシア	5,489 (333)	千リンギ 3,908 (48)	2,910 (141)	千リンギ 1,295 (9)
	タイ	6,349 (2,577)	千バーツ 32,151 (885)	29 (1,101)	千バーツ 854 (248)
	フィリピン	4,825 (289)	千フィリピンペソ 24,658 (2,501)	80 (131)	千フィリピンペソ 1,529 (300)
	インドネシア	32,385 (3,925)	千ルピア 12,442,605 (41,279)	3,812 (46)	千ルピア 872,750 (4,939)
	韓国	750 (132)	千ウォン 5,867,346 (53,471)	105 (34)	千ウォン 1,080,281 (8,795)
	台湾	25,030 (3,165)	千新台幣ドル 131,551 (1,110)	809 (1,563)	千新台幣ドル 7,663 (5,196)
	インド	5,742 (1,074)	千インドルピー 296,239 (ー)	794	千インドルピー 28,004
	メキシコ	7,211 (237)	千メキシコペソ 25,814 (△ 47)	685	千メキシコペソ 1,668

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
外 国	ブラジル	百株 4,232 (552)	千レアル 8,784 (171)	百株 559 (93)	千レアル 975 (399)
	チリ	1,422 (23)	千チリペソ 154,496 (7,462)	228 (11)	千チリペソ 30,263 (1,133)
	コロンビア	444 (0.54)	千コロンビアペソ 299,233 (ー)	ー	千コロンビアペソ ー
	アラブ首長国連邦	2,446 (276)	千UAEディルハム 1,069 (64)	1,606 (90)	千UAEディルハム 349 (35)
	エジプト	20	千エジプトポンド 98	ー	千エジプトポンド ー
	南アフリカ	2,419 (357)	千ランド 35,412 (361)	659 (114)	千ランド 2,699 (80)

*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。

新株予約権証券

		買 付		売 付	
		証 券 数	金 額	証 券 数	金 額
外 国	タイ	証券 ー (28,600)	千バーツ ー (214)	証券 14,300 (14,300)	千バーツ 131 (107)

*金額は受け渡し代金。
*単位未満は切り捨て。
*（ ）内は権利割当、権利行使および権利行使期間満了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。

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	16,000	50	—	—
	小 計	16,000	50	—	—
	メキシコ		千メキシコペソ		千メキシコペソ
	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	33,700 (—)	1,175 (△ 124)	— (—)	— (0.00001)
	小 計	33,700 (—)	1,175 (△ 124)	— (—)	— (0.00001)
	南アフリカ		千ランド		千ランド
	GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	13,020	352	—	—
	REDEFINE PROPERTIES LTD	48,000	543	—	—
	HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	2,680	323	—	—
	FORTRESS INCOME FUND LTD-A	12,310	216	—	—
	FORTRESS INCOME FUND LTD	7,800	277	—	—
	RESILIENT REIT LTD	2,500	296	—	—
	小 計	86,310	2,008	—	—

*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	株式先物取引	百万円 5,736	百万円 5,569	百万円 —	百万円 —

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

○株式売買比率

(2016年5月11日～2017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	4,945,912千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	16,323,436千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.30

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2016年5月11日～2017年5月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
為替直物取引	百万円 7,652	百万円 2,119	% 27.7	百万円 3,792	百万円 1,614	% 42.6

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

(2017年5月10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
(カタル)		百株	百株	千カタルリヤル	千円	
QATAR INSURANCE CO		37	53	375	11,775	保険
QATAR NATIONAL BANK		68	94	1,299	40,689	銀行
COMMERCIAL BANK OF QATAR		56	70	203	6,368	銀行
OOREDOO QSC		27	33	341	10,709	各種電気通信サービス
DOHA BANK LTD		42	67	204	6,407	銀行
QATAR ELECTRICITY & WATER CO		8	10	222	6,968	総合公益事業
INDUSTRIES QATAR		50	66	674	21,138	コングロマリット
QATAR ISLAMIC BANK		21	21	212	6,646	銀行
QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT		96	96	184	5,778	石油・ガス・消耗燃料
MASRAF AL RAYAN		133	152	639	20,015	銀行
BARWA REAL ESTATE CO		32	32	104	3,287	不動産管理・開発
EZDAN HOLDING GROUP		253	351	536	16,807	不動産管理・開発
VODAFONE QATAR		99	—	—	—	無線通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	928	1,051	4,999	156,592	
	銘 柄 数 < 比 率 >	13	12	—	<0.7%>	
(アメリカ)				千米ドル		
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR		166	457	5,488	624,954	インターネットソフトウェア・サービス
BAIDU INC - SPON ADR		45	110	2,020	230,008	インターネットソフトウェア・サービス
BANCO DE CHILE-ADR		12	16	116	13,274	銀行
BANCO SANTANDER CHILE-ADR		52	68	162	18,553	銀行
BANCOLOMBIA S.A. -SPONS ADR		36	48	198	22,544	銀行
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR		25	32	81	9,276	飲料
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR		66	66	81	9,250	金属・鉱業
CTRIIP.COM INTERNATIONAL -ADR		45	154	852	97,018	インターネット販売・通信販売
ECOPETROL SA-SPONSORED ADR		88	99	91	10,438	石油・ガス・消耗燃料
ENEL GENERACION CHILE-SP ADR		37	44	102	11,622	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ENDESA AMERICAS SA - ADR		37	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
ENEL AMERICAS S.A-ADR		135	247	241	27,494	電力
ENEL CHILE SA-ADR		135	167	90	10,302	電力
58.COM INC-ADR		11	37	157	17,900	インターネットソフトウェア・サービス
ITAU CORPBANCA-ADR		31	39	54	6,231	銀行
JD.COM INC-ADR		58	278	1,071	121,959	インターネット販売・通信販売
STATE BANK OF INDIA-GDR		52	65	297	33,859	銀行
PJSC GAZPROM-ADR		1,988	2,182	990	112,792	石油・ガス・消耗燃料
LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR		109	129	158	18,007	旅客航空輸送業
TRANSNEFT PJSC		0.48	0.62	202	23,108	石油・ガス・消耗燃料
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR		176	202	191	21,765	無線通信サービス
NETEASE INC-ADR		13	32	870	99,067	インターネットソフトウェア・サービス
NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR		20	56	375	42,701	各種消費者サービス
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B		153	408	63	7,184	不動産管理・開発
QIHOO 360 TECHNOLOGY CO-ADR		17	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス
QUNAR CAYMAN ISLANDS LTD-ADR		8	—	—	—	インターネット販売・通信販売
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR		35	42	142	16,225	化学
SOUFUN HOLDINGS LTD-ADR		37	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス
SOUTHERN COPPER CORP		54	33	113	12,872	金属・鉱業
TAL EDUCATION GROUP-ADR		6	17	209	23,802	各種消費者サービス

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アメリカ)		百株	百株	千米ドル	千円	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS		60	175	249	28,353	インターネット販売・通信販売
WEIBO CORP-SPON ADR		—	12	73	8,338	インターネットソフトウェア・サービス
YY INC-ADR		4	10	54	6,258	インターネットソフトウェア・サービス
YUM CHINA HOLDINGS INC		—	146	497	56,686	ホテル・レストラン・レジャー
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR		490	570	278	31,703	石油・ガス・消耗燃料
SISTEMA PJSC-REG S SPONS GDR		56	73	42	4,792	無線通信サービス
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S		30	38	461	52,525	石油・ガス・消耗燃料
ROSTELECOM-SPONSORED ADR		38	56	44	5,092	各種電気通信サービス
ROSNEFT OJSC - GDR		377	476	254	28,990	石油・ガス・消耗燃料
PJSC ALROSA		557	1,002	160	18,316	金属・鉱業
SEVERSTAL-GDR REG S		65	81	108	12,363	金属・鉱業
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI		838	1,048	236	26,977	銀行
DP WORLD LTD		57	67	147	16,790	運送インフラ
PJSC RUSHYDRO		38,910	46,910	71	8,177	電力
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS		87	125	433	49,391	食品・生活必需品小売り
INTER RAO UES PJSC		—	13,580	92	10,574	電力
PJSC SBERBANK OF RUSSIA		3,575	4,356	1,241	141,306	銀行
PJSC PHOSAGRO-GDR REG S		—	37	55	6,319	化学
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC		374	516	103	11,745	資本市場
MEGAFON PJSC-GDR		31	—	—	—	無線通信サービス
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR		180	233	350	39,860	金属・鉱業
TATNEFT-SPONSORED ADR		80	93	358	40,816	石油・ガス・消耗燃料
LUKOIL PJSC-SPON ADR		168	175	864	98,481	石油・ガス・消耗燃料
CREDICORP LTD		22	28	446	50,881	銀行
SINA CORP		—	25	202	23,079	インターネットソフトウェア・サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	49,657	74,870	21,254	2,420,041	
	銘 柄 数 < 比 率 >	50	50	—	<11.1%>	
(トルコ)				千トルコリラ		
AKBANK T. A. S		771	956	897	28,207	銀行
ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYIII		59	78	155	4,892	飲料
ARCELIK A. S		84	84	198	6,239	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	560	369	11,610	金属・鉱業
FORD OTOMOTIVE SANAYI AS		23	23	91	2,867	自動車
KOC HLDGS		199	281	479	15,065	コングロマリット
PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS		205	286	153	4,828	化学
TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS		181	273	120	3,778	コングロマリット
TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA		43	43	131	4,119	自動車
TURK HAVA YOLLARI AO		183	183	117	3,708	旅客航空輸送業
TURKCELL ILETISIM HIZMET AS		305	355	413	12,991	無線通信サービス
TURKIYE GARANTI BANKASI		739	996	952	29,939	銀行
TURKIYE IS BANKASI AS-C		545	651	457	14,370	銀行
TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE		40	48	455	14,323	石油・ガス・消耗燃料
ULKER BISKUVI SANAYI AS		45	60	119	3,759	食品
YAPI VE KREDI BANKASI A. S.		250	331	144	4,536	銀行
HACI OMER SABANCI HOLDING		334	398	427	13,451	各種金融サービス
COCA-COLA ICECEK AS		20	28	101	3,201	飲料
BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS		71	81	488	15,355	食品・生活必需品小売り
TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D		240	317	191	6,023	銀行
TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS		44	67	100	3,166	運送インフラ
TURKIYE HALK BANKASI		222	270	318	10,024	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	各種電気通信サービス
TURK TELEKOMUNIKASYON AS		155	222	138	4,348	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,403	6,599	7,023	220,810	
	銘柄 数 < 比 率 >	24	23	—	<1.0%>	
(ユーロ…ギリシャ)				千ユーロ		
HELLENIC TELECOM		76	108	107	13,297	各種電気通信サービス
OPAP SA		75	91	85	10,568	ホテル・レストラン・レジャー
JUMBO SA		31	40	63	7,918	専門小売り
PUBLIC POWER CORP		34	—	—	—	電力
TITAN CEMENT CO		15	20	50	6,319	建設資材
FF GROUP		8	13	26	3,290	専門小売り
PIRAEUS BANK S.A.		2,006	2,616	61	7,627	銀行
EUROBANK ERGASIAS SA		676	676	59	7,430	銀行
ALPHA BANK A.E.		474	554	123	15,260	銀行
NATIONAL BANK OF GREECE		1,999	1,999	66	8,311	銀行
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	5,399	6,120	645	80,025	
	銘柄 数 < 比 率 >	10	9	—	<0.4%>	
(チェコ)				千チェココルナ		
KOMERCNI BANKA AS		4	28	2,802	13,057	銀行
O2 CZECH REPUBLIC AS		18	27	738	3,439	各種電気通信サービス
CEZ AS		58	68	2,945	13,725	電力
MONETA MONEY BANK AS		—	205	1,660	7,737	銀行
小 計	株 数 ・ 金 額	82	329	8,146	37,960	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	4	—	<0.2%>	
(ハンガリー)				千フォリント		
MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC		13	15	33,945	13,499	石油・ガス・消耗燃料
OTP BANK NYRT		76	93	76,459	30,407	銀行
RICHTER GEDEON NYRT		46	52	36,765	14,621	医薬品
小 計	株 数 ・ 金 額	136	162	147,169	58,529	
	銘柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.3%>	
(ポーランド)				千ズロチ		
BANK MILLENNIUM SA		190	263	189	5,555	銀行
MBANK		4	5	266	7,815	銀行
BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA		8	12	94	2,781	銀行
KGHM POLSKA MIEDZ S.A.		48	57	662	19,423	金属・鉱業
BANK PEKAO SA		45	67	974	28,540	銀行
ORANGE POLSKA SA		217	284	133	3,917	各種電気通信サービス
POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.		112	135	1,604	47,006	石油・ガス・消耗燃料
LPP SA		0.4	0.5	323	9,464	繊維・アパレル・贅沢品
BANK ZACHODNI WBK SA		12	14	511	14,978	銀行
PKO BANK POLSKI SA		306	371	1,386	40,622	銀行
CCC SA		7	10	225	6,599	繊維・アパレル・贅沢品
SYNTHOS SA		181	181	99	2,921	化学
EUROCASH SA		25	25	83	2,449	食品・生活必需品小売り
GRUPA LOTOS SA		25	35	210	6,162	石油・ガス・消耗燃料
POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I		587	688	454	13,328	石油・ガス・消耗燃料
CYFROWY POLSAT SA		62	75	187	5,506	メディア
GRUPA AZOTY SA		15	15	105	3,099	化学
ENEA SA		56	—	—	—	電力
POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA		299	364	419	12,302	電力
TAURON POLSKA ENERGIA SA		286	401	134	3,948	電力
POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE		178	227	1,024	30,009	保険
JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S		—	19	150	4,396	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
(ポーランド)		百株	百株	千ズロチ	千円	銀行 電力
ALIOR BANK SA		16	38	284	8,348	
ENERGA SA		62	—	—	—	
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	2,750 23	3,294 22	9,528 —	279,178 <1.3%>	
(香港)				千香港ドル		
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H		450	450	520	7,610	金属・鉱業
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H		360	480	526	7,696	運送インフラ
CHINA SOUTHERN AIRLINES H		500	760	414	6,070	旅客航空輸送業
CHINA MOBILE LTD		2,045	2,490	21,115	308,915	無線通信サービス
ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H		450	530	1,362	19,927	建設資材
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	215	793	11,606	コングロマリット
HUANENG POWER INTL INC-H		1,460	1,840	1,030	15,074	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
YANZHOU COAL MINING-H		460	700	440	6,441	石油・ガス・消耗燃料
HENGAN INTL GROUP CO LTD		250	305	1,753	25,657	パーソナル用品
HUADIAN POWER INTL CORP-H		500	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBIL-B		268	268	261	3,826	自動車
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE		1,040	1,240	1,621	23,728	自動車
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED		1,280	1,740	1,955	28,612	医薬品
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT		1,320	1,560	3,439	50,324	不動産管理・開発
CHINA RESOURCES LAND LTD		944	1,144	2,363	34,574	不動産管理・開発
CITIC LTD		1,520	1,710	1,925	28,169	コングロマリット
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H		480	660	712	10,428	運送インフラ
LENOVO GROUP LTD		2,460	2,880	1,425	20,856	コンピュータ・周辺機器
PETROCHINA CO LTD-H		7,180	8,720	4,639	67,869	石油・ガス・消耗燃料
CHINA UNICOM HONGKONG LTD		2,000	2,480	2,489	36,427	各種電気通信サービス
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING		536	660	1,269	18,578	保険
CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H		8,449	10,489	6,534	95,601	石油・ガス・消耗燃料
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H		280	370	821	12,017	情報技術サービス
ENN ENERGY HOLDINGS LTD		260	320	1,382	20,224	ガス
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD		1,180	1,440	995	14,557	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING PORTS LTD		520	680	593	8,684	運送インフラ
YUEXIU PROPERTY CO LTD		2,382	—	—	—	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING		380	580	1,258	18,413	運送インフラ
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H		1,320	1,700	617	9,028	金属・鉱業
CHINA EVERBRIGHT LTD		280	360	614	8,995	資本市場
CHINA GAS HOLDINGS LTD		520	660	818	11,973	ガス
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT		1,900	2,100	2,301	33,672	自動車
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT		320	400	1,032	15,098	ガス
BYD CO LTD-H		205	245	1,082	15,842	自動車
CHINA TELECOM CORP LTD-H		4,700	5,800	2,192	32,074	各種電気通信サービス
CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H		520	720	493	7,226	エネルギー設備・サービス
SINOTRANS LIMITED-H		610	610	233	3,409	航空貨物・物流サービス
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD		810	980	983	14,394	商業サービス・用品
PICC PROPERTY & CASUALTY -H		1,262	1,902	2,386	34,908	保険
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H		720	720	370	5,414	航空宇宙・防衛
CHINA RESOURCES POWER HOLDING		700	860	1,229	17,991	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H		1,130	1,375	1,113	16,294	自動車
CHINA LIFE INSURANCE CO-H		2,460	3,080	7,284	106,567	保険
ZIJIN MINING GROUP CO-H		2,010	2,010	520	7,616	金属・鉱業
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H		520	720	429	6,278	ヘルスケア機器・用品
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING		9,180	—	—	—	半導体・半導体製造装置

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額 千香港ドル		邦貨換算金額 千円
(香港)	百株	百株			
WEICHAI POWER CO LTD-H	264	384	471	6,898	機械
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	1,140	1,480	642	9,397	化学
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	130	190	460	6,740	コングロマリット
TINGYI (CAYMAN ISLN) HLDG CO	580	740	717	10,501	食品
TSING TAO BREWERY CO-H	100	140	469	6,871	飲料
GUANGDONG INVESTMENT	900	1,260	1,423	20,830	水道
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	380	613	1,124	16,456	飲料
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	460	640	592	8,670	運送インフラ
CNOOC LTD	6,020	7,330	6,531	95,548	石油・ガス・消耗燃料
SINO BIOPHARMACEUTICAL	1,540	1,860	1,169	17,116	医薬品
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT-H	1,130	—	—	—	海運業
CHINA MENGNIU DAIRY CO	910	1,200	1,735	25,385	食品
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	1,710	2,130	9,340	136,644	保険
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	1,510	1,850	1,091	15,968	水道
GOME ELECTRICAL APPLIANCES	3,833	5,233	539	7,886	専門小売り
CHINA POWER INTERNATIONAL	1,150	1,150	336	4,929	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AIR CHINA LIMITED-H	540	760	544	7,961	旅客航空輸送業
ZTE CORP-H	234	338	488	7,141	通信機器
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	880	1,260	438	6,414	電気設備
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	1,185	1,330	2,420	35,413	石油・ガス・消耗燃料
COSCO SHIPPING HOLDINGS - H	760	—	—	—	海運業
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	2,787	3,467	2,035	29,781	銀行
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	560	720	986	14,431	建設・土木
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	28,060	34,110	21,386	312,891	銀行
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	170	210	1,121	16,406	繊維・アパレル・贅沢品
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	900	1,120	936	13,698	自動車
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	570	570	501	7,338	紙製品・林産品
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	770	1,070	512	7,498	建設資材
BANK OF CHINA LTD-H	26,600	32,340	12,095	176,952	銀行
SHUI ON LAND LTD	1,261	—	—	—	不動産管理・開発
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	420	420	506	7,410	不動産管理・開発
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	276	380	459	6,726	不動産管理・開発
CHINA MERCHANTS BANK-H	1,541	1,641	3,333	48,763	銀行
IND & COMM BK OF CHINA-H	24,650	29,970	15,104	220,984	銀行
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	864	864	396	5,801	各種電気通信サービス
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	1,410	1,810	1,940	28,386	建設・土木
CHINA COAL ENERGY CO-H	880	880	315	4,621	石油・ガス・消耗燃料
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	230	230	432	6,326	機械
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	180	225	913	13,364	電気設備
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	420	530	983	14,391	家庭用耐久財
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	1,933	2,343	1,757	25,717	不動産管理・開発
CHINA CITIC BANK-H	2,680	3,640	1,776	25,987	銀行
BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS	1,650	2,480	1,505	22,023	繊維・アパレル・贅沢品
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	—	300	1,938	28,352	電子装置・機器・部品
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	320	400	884	12,932	繊維・アパレル・贅沢品
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	784	974	1,128	16,507	コングロマリット
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	1,280	1,280	303	4,438	不動産管理・開発
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	1,015	1,015	369	5,405	不動産管理・開発
SOHO CHINA LTD	655	655	273	4,005	不動産管理・開発
KINGSOFT CORP LTD	270	270	588	8,611	ソフトウェア
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	4,092	5,382	505	7,401	半導体・半導体製造装置
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	1,210	1,790	1,170	17,126	建設・土木

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 RAILWAYS CONSTRUCTIO-H		595	750	822	12,025	建設・土木
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD		1,960	2,360	1,250	18,299	食品
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H		906	1,050	2,961	43,319	保険
EVERGRANDE REAL ESTATE GROUP		1,470	—	—	—	不動産管理・開発
CRRC CORP LTD-H		1,553	1,833	1,345	19,688	機械
SUN ART RETAIL GROUP LTD		720	975	731	10,698	食品・生活必需品小売り
SINOPHARM GROUP CO-H		380	488	1,666	24,381	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	899	1,165	17,049	自動車
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H		680	960	481	7,050	銀行
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H		1,000	1,230	731	10,706	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H		241	241	500	7,316	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HUANENG RENEWABLES CORP-H		1,120	1,560	435	6,367	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD		520	740	775	11,345	不動産管理・開発
LONGFOR PROPERTIES		500	645	839	12,286	不動産管理・開発
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H		257	317	1,269	18,574	保険
CHINA MINSHENG BANKING-H		2,030	2,550	1,909	27,942	銀行
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H		960	1,340	475	6,959	銀行
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H		7,450	10,260	3,673	53,737	銀行
FAR EAST HORIZON LTD		580	770	563	8,246	各種金融サービス
CITIC SECURITIES CO LTD-H		715	830	1,301	19,040	資本市場
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING		360	470	657	9,612	医薬品
HAITONG SECURITIES CO LTD-H		1,092	1,228	1,549	22,672	資本市場
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC		235	295	3,236	47,344	電子装置・機器・部品
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS -H		136	—	—	—	機械
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H		2,190	2,710	859	12,568	保険
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H		130	130	380	5,563	医薬品
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H		325	475	353	5,177	建設・土木
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H		1,140	1,140	779	11,407	資本市場
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD		1,440	1,440	60	884	食品
CHINA EVERGRANDE GROUP		—	1,820	1,421	20,795	不動産管理・開発
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING		—	1,120	1,049	15,353	半導体・半導体製造装置
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H		2,930	3,570	1,024	14,989	資本市場
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS		495	495	741	10,848	機械
TENCENT HOLDINGS LTD		1,718	2,316	58,085	849,787	インターネットソフトウェア・サービス
CHINA VANKE CO LTD-H		441	537	1,065	15,586	不動産管理・開発
LUYE PHARMA GROUP LTD		370	—	—	—	医薬品
ALIBABA PICTURES GROUP LTD		3,400	4,300	537	7,863	メディア
CAR INC		250	—	—	—	陸運・鉄道
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LTD		3,670	3,670	39	574	半導体・半導体製造装置
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT		700	1,080	334	4,898	ヘルスケア・テクノロジー
CGN POWER CO LTD-H		3,100	3,920	921	13,477	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
FULLSHARE HOLDINGS LIMITED		—	2,500	847	12,398	不動産管理・開発
DALIAN WANDA COMMERCIAL PROP		194	—	—	—	不動産管理・開発
GF SECURITIES CO LTD-H		496	496	773	11,320	資本市場
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD		—	180	493	7,215	自動車部品
HUATAI SECURITIES CO LTD-H		464	558	796	11,657	資本市場
3SBIO, INC		—	335	337	4,940	バイオテクノロジー
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD		—	2,640	863	12,629	資本市場
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD		—	8,200	118	1,739	繊維・アパレル・贅沢品
小 計	株 数 ・ 金 額	252,504	305,357	292,282	4,276,089	
	銘 柄 数 < 比 率 >	140	136	—	<19.6%>	

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	
AMMB HOLDING		657	808	448	11,749	銀行
GENTING PLANTATIONS BHD		85	85	98	2,569	食品
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD		1,793	1,344	786	20,599	銀行
DIGI.COM BERHAD		1,112	1,562	791	20,748	無線通信サービス
MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD		243	330	267	7,015	運送インフラ
RHB BANK BHD		170	338	184	4,838	銀行
HAP SENG CONSOLIDATED		168	257	227	5,965	コングロマリット
BERJAYA SPORTS TOTO BHD		173	173	47	1,255	ホテル・レストラン・レジャー
GAMUDA BERHAD		523	663	353	9,258	建設・土木
YTL CORPORATION		1,573	1,573	232	6,099	総合公益事業
HONG LEONG FINANCIAL GROUP		63	97	170	4,457	銀行
HONG LEONG BANK		201	252	349	9,146	銀行
IJM CORP		1,017	1,237	440	11,537	建設・土木
KUALA LUMPUR KEPONG		134	166	411	10,786	食品
MALAYAN BANKING		1,631	1,451	1,358	35,583	銀行
LAFARGE MALAYSIA BHD		129	129	83	2,179	建設資材
ALLIANCE FINANCIAL GROUP BHD		395	395	173	4,532	銀行
MISC BHD		348	434	319	8,369	海運業
PPB GROUP BERHAD		149	185	315	8,278	食品
PETRONAS DAGANGAN BHD		83	83	199	5,219	石油・ガス・消耗燃料
PETRONAS GAS BERHAD		251	300	555	14,541	ガス
BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD		45	60	270	7,077	タバコ
TELEKOM MALAYSIA		401	500	324	8,488	各種電気通信サービス
TENAGA NASIONAL		1,129	1,385	1,925	50,438	電力
UMW HOLDINGS BHD		213	213	125	3,292	自動車
DIALOG GROUP BHD		1,231	1,231	235	6,162	建設・土木
PUBLIC BANK BHD		825	1,130	2,258	59,184	銀行
YTL POWER INTL		720	720	108	2,851	総合公益事業
AIRASIA BHD		456	667	228	5,994	旅客航空輸送業
GENTING BHD		721	937	910	23,862	ホテル・レストラン・レジャー
GENTING MALAYSIA BHD		1,004	1,164	668	17,505	ホテル・レストラン・レジャー
IOI CORP		965	910	417	10,943	食品
SIME DARBY BERHAD		1,035	937	872	22,855	コングロマリット
HARTALEGA HOLDINGS BHD		197	197	106	2,781	ヘルスケア機器・用品
AXIATA GROUP BERHAD		882	1,030	540	14,167	無線通信サービス
BUMI ARMADA BERHAD		820	—	—	—	エネルギー設備・サービス
MAXIS BHD		634	791	518	13,574	無線通信サービス
PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD		943	940	673	17,633	化学
SAPURA ENERGY BHD		1,173	1,553	295	7,730	エネルギー設備・サービス
ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD		500	693	187	4,902	メディア
IIHH HEALTHCARE BHD		783	1,286	794	20,822	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	72	1,901	食品
WESTPORTS HOLDINGS BHD		332	332	130	3,409	運送インフラ
IOI PROPERTIES GROUP BHD		564	705	148	3,881	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額	26,861	29,633	19,625	514,194	
	銘 柄 数 < 比 率 >	44	43	—	<2.4%>	
(タイ)				千バーツ		
BANGKOK BANK (F)		75	105	1,947	6,369	銀行
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR		—	444	1,909	6,243	コングロマリット
KRUNG THAI BANK-NVDR		1,172	1,472	2,797	9,148	銀行
ROBINSON PCL -NVDR		—	166	1,037	3,392	複合小売り
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR		524	729	11,408	37,306	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	
(タイ)		百株	百株	千バーツ	千円	
TRUE CORP PCL-NVDR		2,798	3,739	2,449	8,008	各種電気通信サービス
TRUE CORP PCL (NVDR)-RTS		940	—	—	—	各種電気通信サービス
KASIKORNBANK PCL-NVDR		195	235	4,535	14,831	銀行
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR		4,404	4,404	986	3,225	銀行
IRPC PCL - NVDR		3,392	4,221	2,300	7,522	石油・ガス・消耗燃料
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR		286	653	1,208	3,950	石油・ガス・消耗燃料
BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR-RIGHTS		143	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR		—	44	941	3,079	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR		963	1,143	2,834	9,269	食品
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR		350	450	8,077	26,413	無線通信サービス
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR		1,350	1,350	1,317	4,307	専門小売り
DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR		151	210	1,911	6,248	電子装置・機器・部品
PTT PCL-NVDR		346	407	15,750	51,505	石油・ガス・消耗燃料
THAI UNION GROUP PCL-NVDR		577	804	1,688	5,521	食品
SIAM CEMENT PUBLIC (F)		101	131	6,812	22,275	建設資材
SIAM CEMENT PCL-NVDR		31	40	2,080	6,801	建設資材
KCE ELECTRONICS-NVDR		—	107	1,187	3,883	電子装置・機器・部品
BEC WORLD PCL NVDR		276	276	521	1,705	メディア
AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR		144	1,866	7,743	25,322	運送インフラ
KASIKORNBANK PCL(F)		401	488	9,418	30,798	銀行
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR		420	514	3,084	10,084	不動産管理・開発
BANGKOK DUSIT MED SERV-NVDR		1,217	1,717	3,519	11,509	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	7,899	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR		626	816	3,039	9,939	ホテル・レストラン・レジャー
THAI OIL PCL-NVDR		251	326	2,493	8,155	石油・ガス・消耗燃料
GLOW ENERGY PCL - NVDR		187	187	1,481	4,846	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
CP ALL PCL-NVDR		1,507	1,991	12,642	41,342	食品・生活必需品小売り
BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR		1,808	2,387	1,993	6,517	陸運・鉄道
PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR		461	551	5,193	16,981	石油・ガス・消耗燃料
INDORAMA VENTURES PCL-NVDR		360	535	1,941	6,349	化学
PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR		731	853	6,276	20,524	化学
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR		363	363	989	3,234	石油・ガス・消耗燃料
BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR		2,000	2,600	1,911	6,248	運送インフラ
小 計	株 数 ・ 金 額	28,663	36,459	137,847	450,762	
	銘柄 数 < 比 率 >	34	36	—	<2.1%>	
(フィリピン)				千フィリピンペソ		
AYALA LAND LTD		2,354	2,971	11,408	26,011	不動産管理・開発
ABOITIZ EQUITY VENTURES INC		666	806	6,165	14,058	コングロマリット
BANK OF PHILIPPINE ISLANDS		272	272	2,877	6,560	銀行
ALLIANCE GLOBAL GROUP INC		546	546	803	1,832	コングロマリット
DMCI HOLDINGS INC		1,275	1,780	2,346	5,348	コングロマリット
GLOBE TELECOM INC		10	14	3,116	7,105	無線通信サービス
INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS		130	203	1,873	4,270	運送インフラ
JG SUMMIT HOLDINGS INC		869	1,227	10,552	24,059	コングロマリット
JOLLIBEE FOODS CORPORATION		156	156	3,416	7,789	ホテル・レストラン・レジャー
METROPOLITAN BANK & TRUST		85	215	1,861	4,244	銀行
MEGAWORLD CORP		3,740	3,740	1,634	3,726	不動産管理・開発
PHILIPPINE LONG DISTANCE TELEPHONE CO.		33	—	—	—	無線通信サービス
ROBINSONS LAND CO		491	732	1,895	4,322	不動産管理・開発
SECURITY BANK CORP		—	80	1,752	3,994	銀行
SM PRIME HLDGS		2,641	3,622	11,773	26,844	不動産管理・開発
UNIVERSAL ROBINA CORP		281	339	6,051	13,796	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
(フィリピン)		百株	百株	千フィリピンペソ	千円	
SM INVESTMENTS CORP		53	96	7,561	17,240	コングロマリット
AYALA CORPORATION		73	105	9,273	21,143	各種金融サービス
ENERGY DEVELOPMENT CORPORATION		3,415	3,415	2,011	4,586	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
METRO PACIFIC INVESTMENTS CO		4,338	5,738	3,838	8,752	各種金融サービス
ABOITIZ POWER CORP		536	536	2,197	5,010	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
BDO UNIBANK INC		571	800	9,844	22,444	銀行
GT CAPITAL HOLDINGS INC		24	30	3,965	9,040	各種金融サービス
PLDT INC		—	39	7,007	15,976	無線通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	22,563	27,467	113,227	258,158	
		22	23	—	<1.2%>	
(インドネシア)				千ルピア		
AKR CORPORINDO TBK PT		533	753	495,097	4,257	商社・流通業
ASTRA AGRO LESTARI TBK PT		105	—	—	—	食品
UNITED TRACTORS TBK PT		506	640	1,633,275	14,046	石油・ガス・消耗燃料
INDOFOOD SUKSES MAK TBK		1,457	1,757	1,489,057	12,805	食品
PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA		2,557	3,199	982,093	8,445	食品
GUDANG GARAM TBK		160	195	1,388,400	11,940	タバコ
HM SAMPOERNA TBK PT		136	4,034	1,536,954	13,217	タバコ
INDOCEMENT TUNGAL PRAKARSA		456	577	963,590	8,286	建設資材
SUMMARECON AGUNG TBK PT		3,233	4,378	612,920	5,271	不動産管理・開発
BANK DANAMON PT		1,251	1,251	618,468	5,318	銀行
BANK MANDIRI		3,088	3,965	4,758,000	40,918	銀行
MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK		726	908	1,368,810	11,771	複合小売り
UNILEVER INDONESIA TBK PT		517	597	2,758,140	23,720	家庭用品
BANK RAKYAT INDONESIA		3,819	4,640	6,496,000	55,865	銀行
PERUSAHAAN GAS NEGARA PT		3,658	4,408	1,066,736	9,173	ガス
BANK NEGARA INDONESIA PT		2,527	2,987	1,986,355	17,082	銀行
SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT		1,016	1,216	1,064,000	9,150	建設資材
BANK CENTRAL ASIA		4,094	5,096	9,172,800	78,886	銀行
XL AXIATA TBK PT		862	1,382	431,184	3,708	無線通信サービス
LIPPO KARAWACI TBK PT		5,925	8,004	656,328	5,644	不動産管理・開発
GLOBAL MEDIACOM TBK PT		2,587	—	—	—	メディア
MEDIA NUSANTARA CITRA TBK PT		1,465	1,465	295,930	2,544	メディア
JASA MARGA (PERSERO) TBK PT		692	738	353,046	3,036	運送インフラ
BUMI SERPONG DAMAI PT		2,209	2,937	536,002	4,609	不動産管理・開発
ADARO ENERGY PT		3,595	5,337	827,235	7,114	石油・ガス・消耗燃料
PAKUWON JATI TBK PT		—	9,200	607,200	5,221	不動産管理・開発
INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T		353	890	767,625	6,601	食品
TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE		567	887	503,372	4,329	各種電気通信サービス
KALBE FARMA PT		7,685	9,144	1,421,892	12,228	医薬品
WASKITA KARYA PERSERO TBK PT		—	1,575	357,525	3,074	建設・土木
PT ASTRA INTERNATIONAL TBK		6,597	8,429	7,333,230	63,065	自動車
SURYA CITRA MEDIA PT TBK		1,961	2,535	727,545	6,256	メディア
TELEKOMUNIKASI		17,167	20,831	9,040,654	77,749	各種電気通信サービス
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	81,505	113,957	62,249,465	535,345	
		31	31	—	<2.5%>	
(韓国)				千ウォン		
CHEIL WORLDWIDE INC		22	22	40,880	4,104	メディア
HANMI SCIENCE CO LTD		3	4	31,752	3,187	医薬品
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD		13	16	167,200	16,786	自動車
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE		11	14	388,370	38,992	保険
DONGBU INSURANCE CO LTD		14	18	130,526	13,104	保険

銘柄	株数	期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株数	評 価 額	外貨建金額		邦貨換算金額
			千円			
(韓国)	百株	百株	千ウォン	千円		
COWAY CO LTD	17	23	255,300	25,632	家庭用耐久財	
KT & G CORP	35	46	492,685	49,465	タバコ	
S-1 CORPORATION	6	8	82,820	8,315	商業サービス・用品	
KOREA GAS CORPORATION	6	10	50,169	5,037	ガス	
CJ CORP	4	5	111,314	11,175	コングロマリット	
KAKAO CORP	9	12	115,900	11,636	インターネットソフトウェア・サービス	
SK TELECOM CO LTD	6	7	181,720	18,244	無線通信サービス	
DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	9	12	97,768	9,815	建設・土木	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	55	153	143,406	14,398	資本市場	
NCSOFT CORPORATION	6	6	248,880	24,987	ソフトウェア	
LG UPLUS CORP	68	48	68,341	6,861	各種電気通信サービス	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	17	17	41,772	4,193	電気設備	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	27	49	37,375	3,752	建設・土木	
POSCO DAEWOO CORP	11	18	42,873	4,304	商社・流通業	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	3	3	349,074	35,047	パーソナル用品	
LG CHEMICALS LTD	15	19	536,480	53,862	化学	
LG CHEM LTD - PREFERRED	2	2	50,142	5,034	化学	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	—	0.7	42,630	4,280	パーソナル用品	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	141	175	875,864	87,936	銀行	
HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	18	22	102,717	10,312	建設・土木	
S-OIL CORPORATION	16	19	198,900	19,969	石油・ガス・消耗燃料	
HANWHA CHEMICAL CORP	33	42	107,100	10,752	化学	
SAMSUNG SECURITIES	18	27	99,506	9,990	資本市場	
LOTTE CHEMICAL CORPORATION	5	6	214,415	21,527	化学	
HOTEL SHILLA CO LTD	9	12	69,676	6,995	専門小売り	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	14	16	267,795	26,886	機械	
HYUNDAI MOBIS	23	28	695,130	69,791	自動車部品	
SK HYNIX INC	192	240	1,367,307	137,277	半導体・半導体製造装置	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	25	30	144,875	14,545	建設・土木	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	8	8	78,732	7,904	自動車	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	52	63	998,560	100,255	自動車	
HYUNDAI STEEL CO	28	33	184,529	18,526	金属・鉱業	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	85	104	133,376	13,390	銀行	
KCC CORP	1	2	81,427	8,175	建設関連製品	
KIA MOTORS CORP	90	105	376,447	37,795	自動車	
KOREA ZINC CO LTD	3	3	161,310	16,195	金属・鉱業	
KOREA ELECTRIC POWER	87	107	490,976	49,293	電力	
HANWHA CORPORATION	14	18	76,353	7,665	コングロマリット	
KOREAN AIR LINES CO LTD	10	17	58,459	5,869	旅客航空輸送業	
OCI COMPANY LTD	4	6	50,158	5,035	化学	
CJ KOREA EXPRESS CO LTD	2	2	46,440	4,662	陸運・鉄道	
KUMHO PETRO CHEMICAL CO	3	6	51,121	5,132	化学	
KT CORP	8	8	28,116	2,822	各種電気通信サービス	
LG ELECTRONICS INC	34	45	349,195	35,059	家庭用耐久財	
LOTTE CONFECTIONERY CO LTD	0.19	1	40,470	4,063	食品	
LOTTE CHILSUNG BEVERAGE CO	0.2	0.2	33,900	3,403	飲料	
HANSSEM CO LTD	3	4	93,275	9,364	家庭用耐久財	
LG CORP	33	37	266,030	26,709	コングロマリット	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	43	59	82,723	8,305	資本市場	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	14	19	59,441	5,967	建設・土木	
NAVER CORP	9	11	980,200	98,412	インターネットソフトウェア・サービス	
PARADISE CO LTD	12	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー	

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 DEPT STORE CO	4	6	66,900	6,716	複合小売り
DONGSUH COMPANIES INC	10	10	31,815	3,194	食品・生活必需品小売り
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	13	13	75,060	7,536	資本市場
OTTOGI CORPORATION	0.4	0.4	30,560	3,068	食品
DOOSAN CORP	2	—	—	—	コングロマリット
AMOREPACIFIC GROUP	10	12	186,250	18,699	パーソナル用品
KANGWON LAND INC	37	51	191,760	19,252	ホテル・レストラン・レジャー
POSCO	23	29	800,130	80,333	金属・鉱業
SAMSUNG SDI CO,LTD	17	22	317,370	31,863	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	21	25	191,250	19,201	電子装置・機器・部品
SAMSUNG ELECTRONICS	36	40	9,427,510	946,522	コンピュータ・周辺機器
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	47	97	107,704	10,813	機械
HANWHA TECHWIN CO LTD	—	14	73,788	7,408	航空宇宙・防衛
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	6	7	1,280,130	128,525	コンピュータ・周辺機器
SHINSEGAE CO LTD	2	3	69,814	7,009	複合小売り
HYOSUNG CORPORATION	7	7	112,805	11,325	化学
ORION CORP	1	1	90,914	9,127	食品
YUHAN CORPORATION	2	3	72,750	7,304	医薬品
HANON SYSTEMS	62	62	55,304	5,552	自動車部品
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	20	27	103,115	10,352	保険
GS HOLDINGS CORP	17	21	124,701	12,519	石油・ガス・消耗燃料
LG.DISPLAY CO LTD	73	94	286,368	28,751	電子装置・機器・部品
SK NETWORKS CO LTD	23	48	37,355	3,750	商社・流通業
CELLTRION INC	22	34	324,216	32,551	バイオテクノロジー
HANA FINANCIAL HOLDINGS	97	118	495,187	49,716	銀行
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	6	8	120,000	12,048	航空貨物・物流サービス
MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD	26	—	—	—	資本市場
LOTTE SHOPPING CO	3	3	101,400	10,180	複合小売り
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	27	29	334,340	33,567	保険
AMOREPACIFIC CORP	10	13	452,880	45,469	パーソナル用品
AMOREPACIFIC CORP-PREF	3	3	64,950	6,520	パーソナル用品
SAMSUNG CARD CO	9	13	57,188	5,741	消費者金融
SK INNOVATION CO LTD	21	27	467,840	46,971	石油・ガス・消耗燃料
CJ CHEILJEDANG CORP	2	3	113,440	11,389	食品
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	7	7	45,267	4,544	商業サービス・用品
LG INNOTEK CO LTD	4	6	80,910	8,123	電子装置・機器・部品
SK HOLDINGS CO LTD	11	19	480,500	48,242	コングロマリット
KB FINANCIAL GROUP INC	125	160	856,000	85,942	銀行
HYUNDAI WIA CORP	5	5	35,663	3,580	自動車部品
KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	19	27	177,920	17,863	航空宇宙・防衛
BNK FINANCIAL GROUP INC	82	104	101,552	10,195	銀行
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	1	1	66,310	6,657	医薬品
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	61	86	54,415	5,463	保険
CJ E&M CORP	5	8	67,840	6,811	メディア
E-MART CO	7	7	178,581	17,929	食品・生活必需品小売り
DGB FINANCIAL GROUP INC	45	62	74,601	7,489	銀行
GS RETAIL CO LTD	8	11	62,586	6,283	食品・生活必需品小売り
HANKOOK TIRE CO LTD/NEW	27	32	194,991	19,577	自動車部品
BGF RETAIL CO LTD	2	7	83,990	8,432	食品・生活必需品小売り
SAMSUNG SDS CO LTD	10	13	200,020	20,082	情報技術サービス
WOORI BANK	111	134	208,940	20,977	銀行
SAMSUNG C&T CORP	24	31	396,957	39,854	コングロマリット

銘柄	株数	当期(前期末)		期末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(韓国)	百株	百株	千ウォン	千円		
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	—	6	117,440	11,790		ライフサイエンス・ツール/サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	2,656	3,400	32,321,187	3,245,047	
	銘柄 数 < 比 率 >	107	107	—	< 14.9% >	
(台湾)			千新台幣ドル			
ACER INC	917	1,237	1,782	6,701		コンピュータ・周辺機器
ASUSTEK COMPUTER INC	238	298	8,881	33,395		コンピュータ・周辺機器
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	154	154	1,541	5,796		半導体・半導体製造装置
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	2,036	2,783	10,297	38,719		半導体・半導体製造装置
ASIA CEMENT	729	959	2,754	10,357		建設資材
TAIWAN BUSINESS BANK	1,118	1,174	969	3,647		銀行
TAIWAN FERTILIZER CO LTD	230	230	931	3,502		化学
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	250	340	1,822	6,852		半導体・半導体製造装置
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	—	250	1,582	5,950		コンピュータ・周辺機器
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	142	203	1,629	6,127		コンピュータ・周辺機器
QUANTA COMPUTER INC	876	1,136	7,139	26,843		コンピュータ・周辺機器
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	281	281	1,413	5,316		不動産管理・開発
EVA AIRWAYS CORP	567	856	1,263	4,748		旅客航空輸送業
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	208	268	9,045	34,009		コンピュータ・周辺機器
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	1,653	2,132	3,753	14,114		銀行
CHINA AIRLINES	795	795	731	2,749		旅客航空輸送業
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	530	740	4,531	17,036		自動車部品
CHINA STEEL	3,945	4,945	11,819	44,441		金属・鉱業
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	972	1,313	3,795	14,270		保険
ADVANTECH CO.,LTD.	102	132	3,131	11,773		コンピュータ・周辺機器
COMPAL ELECTRONICS	1,285	1,575	3,214	12,087		コンピュータ・周辺機器
DELTA ELECTRONICS INC	676	816	13,885	52,210		電子装置・機器・部品
NANYA TECHNOLOGY CO	—	230	1,159	4,358		半導体・半導体製造装置
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	1,240	1,580	16,596	62,404		各種電気通信サービス
AU OPTRONICS CORP	2,620	3,270	3,793	14,262		電子装置・機器・部品
TAIWAN MOBILE CO LTD	592	672	7,560	28,425		無線通信サービス
EVERGREEN MARINE	447	737	962	3,618		海運業
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	1,144	1,424	3,490	13,122		コングロマリット
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	92	143	1,639	6,162		繊維・アパレル・贅沢品
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	62	82	2,657	9,991		繊維・アパレル・贅沢品
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	200	260	3,218	12,100		半導体・半導体製造装置
FORMOSA PLASTIC	1,414	1,724	15,259	57,375		化学
FORMOSA TAFFETA CO.	200	320	985	3,705		繊維・アパレル・贅沢品
FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	1,059	1,289	11,506	43,264		化学
TRANSCEND INFORMATION INC	43	83	814	3,061		コンピュータ・周辺機器
GIANT MANUFACTURING	97	97	1,774	6,673		レジャー用品
MEDIATEK INC	505	605	12,591	47,345		半導体・半導体製造装置
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,295	2,635	12,570	47,266		各種金融サービス
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	2,292	2,924	5,029	18,911		銀行
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	90	110	3,844	14,455		専門小売り
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	580	690	5,244	19,717		無線通信サービス
SIMPLO TECHNOLOGY CO LTD	83	—	—	—		電子装置・機器・部品
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	3,493	4,133	5,353	20,128		資本市場
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	2,805	3,425	16,765	63,039		保険
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	4,847	5,837	4,804	18,065		銀行
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	2,428	3,255	5,957	22,398		銀行
HON HAI PRECISION INDUSTRY	4,705	6,338	65,916	247,845		電子装置・機器・部品
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	3,773	4,483	10,985	41,304		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
(台湾)		百株	百株	千新台幣ドル	千円	
LARGAN PRECISION CO LTD		30	40	20,179	75,876	電子装置・機器・部品
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS		2,641	3,492	4,383	16,480	銀行
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS		2,745	3,445	2,735	10,286	保険
INVENTEC CO.,LTD		779	1,029	2,372	8,919	コンピュータ・周辺機器
HTC CORPORATION		237	237	1,498	5,635	コンピュータ・周辺機器
LITE-ON TECHNOLOGY CORP		745	888	4,400	16,545	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	3,831	3,517	13,226	銀行
CTBC FINANCIAL HOLDING		5,316	7,332	13,931	52,380	銀行
FIRST FINANCIAL HOLDING CO		3,084	3,723	7,073	26,597	銀行
MERIDA INDUSTRY CO LTD		52	82	1,278	4,808	レジャー用品
POWERTECH TECHNOLOGY INC		211	271	2,483	9,339	半導体・半導体製造装置
NAN YA PLASTICS CORP		1,537	1,937	13,638	51,280	化学
WISTRON CORP		861	1,116	2,993	11,254	コンピュータ・周辺機器
POU CHEN CORP		714	884	3,697	13,904	繊維・アパレル・贅沢品
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO		1,598	2,028	11,379	42,785	食品
PRESIDENT CHAIN STORE CORP		178	238	6,287	23,640	食品・生活必需品小売り
FORMOSA PETROCHEMICAL CORP		403	463	4,728	17,779	石油・ガス・消耗燃料
PHISON ELECTRONICS CORP		43	63	1,778	6,686	半導体・半導体製造装置
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD		272	272	985	3,706	不動産管理・開発
RUENTEX INDUSTRIES LTD		147	207	970	3,649	繊維・アパレル・贅沢品
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD		274	348	3,222	12,115	コンピュータ・周辺機器
SILICONWARE PRECISION INDUSTRIES		702	842	4,050	15,231	半導体・半導体製造装置
STANDARD FOODS CORP		85	150	1,138	4,280	食品
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP		424	595	1,935	7,278	電子装置・機器・部品
TAIWAN CEMENT		1,103	1,313	4,550	17,109	建設資材
TECO ELECTRIC & MACHINERY		680	680	1,982	7,453	電気設備
TAIWAN SEMICONDUCTOR		8,180	10,030	204,110	767,455	半導体・半導体製造装置
UNITED MICROELECTRONICS CORP		3,955	5,235	6,334	23,817	半導体・半導体製造装置
YULON MOTOR CO		290	290	760	2,860	自動車
INOTERA MEMORIES INC		770	—	—	—	半導体・半導体製造装置
INNOLUX CORP		2,933	3,583	4,694	17,649	電子装置・機器・部品
WPG HOLDINGS CO LTD		490	630	2,499	9,396	電子装置・機器・部品
HIWIN TECHNOLOGIES CORP		67	68	1,342	5,048	機械
TAIEMD BIOLOGICS INC		—	50	855	3,214	バイオテクノロジー
HERMES MICROVISION INC		10	—	—	—	半導体・半導体製造装置
PEGATRON CORP		646	746	6,699	25,191	コンピュータ・周辺機器
CHAILEASE HOLDING CO LTD		346	436	3,381	12,714	各種金融サービス
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD		560	560	528	1,987	各種電気通信サービス
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING		134	134	952	3,579	電子装置・機器・部品
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL		2,416	3,145	4,922	18,509	銀行
OBI PHARMA INC		30	40	1,044	3,925	バイオテクノロジー
CASETEK HOLDINGS LTD		50	50	414	1,556	コンピュータ・周辺機器
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD		—	50	1,550	5,828	家庭用耐久財
小 計	株 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	103,727 88	129,549 88	683,682 —	2,570,646 <11.8%>	
(インド)				千インドルピー		
RELIANCE INDUSTRIES LIMITED		436	534	71,107	125,859	石油・ガス・消耗燃料
BHARAT PETROLEUM CORP LTD		30	220	15,878	28,104	石油・ガス・消耗燃料
EICHER MOTORS LTD		4	5	14,378	25,449	機械
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED		121	145	19,509	34,532	自動車
SHREE CEMENT LIMITED		2	3	7,024	12,433	建設資材

銘柄	株数	期首(前期末)	当期		業種等
		株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(インド)	百株	百株	千インドルピー	千円	
HINDUSTAN PETROLEUM CORP	—	152	8,015	14,187	石油・ガス・消耗燃料
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	9	12	1,449	2,566	陸運・鉄道
LIC HOUSING FINANCE	84	112	7,674	13,583	貯蓄・抵当・不動産金融
TATA STEEL LIMITED	101	130	5,657	10,013	金属・鉱業
JSW STEEL LTD	30	—	—	—	金属・鉱業
NESTLE INDIA LIMITED	7	9	6,302	11,155	食品
GAIL INDIA LTD	118	157	6,653	11,775	ガス
VEDANTA LTD	316	653	14,728	26,069	金属・鉱業
TITAN CO LTD	—	113	5,292	9,368	繊維・アパレル・贅沢品
OIL&NATURAL GAS CORP LTD	264	498	9,284	16,433	石油・ガス・消耗燃料
GLAXOSMITHKLINE CONSUMER	3	—	—	—	食品
LUPIN LTD	78	90	11,326	20,047	医薬品
ACC LIMITED	12	18	3,130	5,540	建設資材
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	503	613	93,481	165,463	貯蓄・抵当・不動産金融
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	193	228	11,300	20,002	メディア
INFOSYS LTD	615	750	71,055	125,768	情報技術サービス
WIPRO LTD	196	265	13,510	23,913	情報技術サービス
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	259	267	25,448	45,043	家庭用品
APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE	23	31	3,990	7,063	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HCL TECHNOLOGIES LTD	181	226	19,272	34,112	情報技術サービス
DABUR INDIA LTD	176	229	6,263	11,086	パーソナル用品
HERO MOTOCORP LTD	15	19	6,367	11,270	自動車
DR. REDDYS LABORATORIES	40	46	12,028	21,289	医薬品
BHARTI AIRTEL LIMITED	399	422	14,573	25,794	無線通信サービス
UNITED SPIRITS LIMITED	18	24	4,596	8,135	飲料
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	328	380	24,351	43,102	医薬品
DIVIS LABORATORIES LTD	25	25	1,630	2,886	ライフサイエンス・ツール/サービス
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	34	41	27,776	49,164	自動車
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	50	50	4,338	7,678	医薬品
AUROBINDO PHARMA LTD	93	114	6,785	12,009	医薬品
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	96	161	6,550	11,593	自動車部品
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	44	54	5,493	9,723	消費者金融
CIPLA LIMITED	110	135	7,492	13,261	医薬品
LARSEN&TOUBRO LIMITED	103	127	22,209	39,310	建設・土木
ULTRATECH CEMENT LTD	12	38	16,845	29,815	建設資材
ASHOK LEYLAND LIMITED	341	464	3,853	6,820	機械
BOSCH LTD	2	3	7,000	12,391	自動車部品
TATA CONSULTANCY SVS LTD	156	194	45,851	81,156	情報技術サービス
NTPC LIMITED	374	714	11,518	20,387	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	21	29	7,373	13,050	医薬品
YES BANK LTD	—	143	23,011	40,731	銀行
AMBUJA CEMENTS LTD	236	236	6,093	10,785	建設資材
BHARAT FORGE LIMITED	36	36	4,028	7,130	自動車部品
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	406	494	9,217	16,314	金属・鉱業
ITC LTD	735	1,404	38,136	67,501	タバコ
UPL LTD	93	137	11,223	19,865	化学
RELIANCE COMMUNICATION LTD	227	—	—	—	無線通信サービス
SIEMENS INDIA LIMITED	23	23	3,344	5,919	コングロマリット
UNITED BREWERIES LTD	22	—	—	—	飲料
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	36	44	8,527	15,094	パーソナル用品
CAIRN INDIA LIMITED	127	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
IDEA CELLULAR LIMITED	336	475	4,139	7,326	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
(インド)		百株	百株	千インドルピー	千円	
MARICO LIMITED		156	200	6,059	10,724	パーソナル用品
POWER FINANCE CORPORATION		63	241	4,027	7,128	各種金融サービス
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE		287	344	11,957	21,164	運送インフラ
RURAL ELECTRIFICATION CORP		74	—	—	—	各種金融サービス
BAJAJ FINSERV LTD		—	14	6,217	11,004	保険
BAJAJ AUTO LIMITED		29	35	10,084	17,850	自動車
COAL INDIA LTD		217	265	7,373	13,051	石油・ガス・消耗燃料
TATA MOTORS LTD-A-DVR		114	149	3,923	6,944	自動車
TATA MOTORS LTD		256	664	28,356	50,190	自動車
BHARAT HEAVY ELECTRICALS		169	239	4,240	7,506	電気設備
TATA POWER COMPANY LIMITED		327	452	3,762	6,659	電力
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS		84	113	3,691	6,533	消費者金融
BHARTI INFRATEL LTD		197	246	9,001	15,932	各種電気通信サービス
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD		96	118	12,825	22,700	貯蓄・抵当・不動産金融
ASIAN PAINTS LTD		104	123	14,368	25,431	化学
BAJAJ FINANCE LTD		—	71	9,208	16,299	消費者金融
AXIS BANK LIMITED		188	664	34,444	60,967	銀行
HAVELLS INDIA LTD		—	91	4,497	7,959	電気設備
ICICI BANK LTD		392	452	13,614	24,097	銀行
TECH MAHINDRA LTD		67	179	7,628	13,503	情報技術サービス
CADILA HEALTHCARE LTD		61	88	4,207	7,447	医薬品
GRASIM INDUSTRIES LIMITED		—	80	9,340	16,533	建設資材
IDFC BANK LTD		—	505	3,279	5,805	銀行
JSW STEEL LTD		—	378	7,276	12,879	金属・鉱業
小 計	株 数 ・ 金 額	11,212	17,234	1,015,480	1,797,399	
	銘 柄 数 < 比 率 >	72	75	—	<8.2%>	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
ALFA S. A. B. -A		992	1,187	3,095	18,419	コングロマリット
COCA-COLA FEMSA SAB-SER L		152	215	3,035	18,061	飲料
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD		602	764	13,219	78,655	飲料
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1		60	76	1,092	6,501	複合小売り
GRUPO FIN SANTANDER-B		626	770	2,692	16,021	銀行
GRUPO TELEvisa SAB - SER CPO		831	994	9,399	55,925	メディア
GRUPO BIMBO SAB-SERIES A		524	614	2,782	16,553	食品
GRUMA S. A. B. -B		62	82	2,031	12,087	食品
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF		77	100	2,031	12,086	運送インフラ
GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1		183	232	2,016	11,998	コングロマリット
CEMEX SAB - CPO		4,715	5,931	9,959	59,259	建設資材
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O		822	1,042	11,446	68,105	銀行
MEXICHEM SAB DE CV-*		380	389	2,078	12,364	化学
INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV		40	52	2,214	13,174	金属・鉱業
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A		525	645	2,580	15,351	家庭用品
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B		76	92	3,419	20,347	運送インフラ
GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B		1,311	1,551	8,375	49,832	金属・鉱業
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L		10,353	13,590	20,045	119,269	無線通信サービス
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O		800	930	3,027	18,011	銀行
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV		131	167	2,271	13,516	飲料
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH		94	143	2,839	16,897	運送インフラ
OHL MEXICO SAB DE CV		241	241	545	3,247	運送インフラ
GRUPO COMERCIAL CHEDRAUI SA		123	—	—	—	食品・生活必需品小売り
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N		—	200	1,737	10,336	ガス
GRUPO LALA SAB DE CV		198	198	693	4,129	食品

銘柄		期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	評 価 額	
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(メキシコ)		百株	百株	千メキシコペソ	千円	
GENTERA SAB DE CV		362	362	1,155	6,877	消費者金融
WALMART DE MEXICO-SER V		1,707	2,183	9,465	56,319	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	25,989	32,753	123,252	733,352	
	銘柄 数 < 比 率 >	26	26	—	<3.4%>	
(ブラジル)				千レアル		
BRF SA		225	258	1,120	40,001	食品
VALE SA		415	536	1,420	50,708	金属・鉱業
CIA PARANAENSE DE ENERGI-PFB		34	34	92	3,296	電力
VALE SA-PREF A		675	775	1,960	69,998	金属・鉱業
TIM PARTICIPACOES SA		301	375	384	13,741	無線通信サービス
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B		87	87	168	6,000	電力
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER		—	75	123	4,420	電力
BANCO DO BRASIL SA		275	352	1,140	40,715	銀行
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR		1,264	1,583	1,587	56,685	銀行
LOJAS AMERICANAS S. A. (PREF)		202	322	559	19,989	複合小売り
LOJAS AMERICANAS SA		46	78	113	4,035	複合小売り
GERDAU SA PFD NPV		313	363	347	12,401	金属・鉱業
PETROBRAS - PETROLEO BRAS		990	1,234	1,836	65,552	石油・ガス・消耗燃料
PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR		1,354	1,617	2,286	81,625	石油・ガス・消耗燃料
KROTON EDUCACIONAL SA		439	561	869	31,053	各種消費者サービス
CCR SA		281	474	853	30,459	運送インフラ
WEG SA		173	213	401	14,349	機械
BANCO BRADESCO SA - PREF		920	1,247	3,865	138,010	銀行
BANCO BRADESCO S. A.		269	377	1,123	40,091	銀行
NATURA COSMETICOS SA		63	63	210	7,516	パーソナル用品
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA		215	215	159	5,679	金属・鉱業
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA-PREF		119	163	218	7,797	紙製品・林産品
CPFL ENERGIA SA		66	90	235	8,409	電力
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF		999	1,314	5,113	182,562	銀行
PORTO SEGURO SA		32	49	143	5,113	保険
FIBRIA CELULOSE SA		75	99	295	10,556	紙製品・林産品
BRASKEM SA-PREF A		44	63	219	7,829	化学
TRACTEBEL ENERGIA SA		54	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
LOCALIZA RENT A CAR		45	64	301	10,776	陸運・鉄道
LOJAS RENNER S. A.		222	280	788	28,148	複合小売り
EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA		73	112	151	5,401	電力
EDP-ENERGIAS DO BRASIL RIGHTS		20	—	—	—	電力
ULTRAPAR PARTICIPACOES		122	146	1,079	38,528	石油・ガス・消耗燃料
COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO		42	42	155	5,546	石油・ガス・消耗燃料
TOTVS SA		38	—	—	—	ソフトウェア
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD		65	80	445	15,907	電力
EMBRAER SA		224	272	419	14,983	航空宇宙・防衛
CIA ENERGETICA DE SP-PREF B		49	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
M DIAS BRANCO SA		8	39	207	7,411	食品
TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT		20	—	—	—	電力
ODONTOPREV S. A.		68	106	122	4,359	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・通信販売
BR MALLS PARTICIPACOES SA		195	276	356	12,710	不動産管理・開発
JBS SA		221	280	309	11,045	食品
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF		235	302	272	9,712	電力
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP		125	153	466	16,659	水道
MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS		29	29	199	7,121	不動産管理・開発

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(ブラジル)		百株	百株	千レアル	千円	
ESTACIO PARTICIPACOES SA		76	—	—	—	各種消費者サービス
DURATEX SA		113	113	100	3,578	紙製品・林産品
SUL AMERICA SA - UNITS		53	91	161	5,781	保険
HYPERMARCAS S.A		117	142	433	15,492	医薬品
BM&F BOVESPA SA		589	841	1,638	58,509	資本市場
TELEFONICA BRASIL-PREF		125	176	829	29,602	各種電気通信サービス
QUALICORP SA		77	77	187	6,685	ヘルスクエア・プロバイダー/ヘルスクエア・サービス
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA		126	162	446	15,944	銀行
CETIP SA-MERCADOS ORGANIZADO		76	—	—	—	資本市場
CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF		57	70	506	18,068	食品・生活必需品小売り
CIELO SA		352	489	1,172	41,864	情報技術サービス
RAIA DROGASIL SA		73	101	697	24,882	食品・生活必需品小売り
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES		226	283	853	30,481	保険
ENGIE BRASIL SA		—	71	241	8,630	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AMBEV SA		1,549	1,943	3,683	131,484	飲料
KLABIN SA-UNIT		202	202	325	11,617	容器・包装
RUMO LOGISTICA OPERADORA MUL		266	—	—	—	陸運・鉄道
RUMO SA		—	338	327	11,704	陸運・鉄道
AES TIETE ENERGIA SA-UNIT		—	70	98	3,507	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 ・ 金 額	15,846	19,978	43,830	1,564,752	
	銘 柄 数 < 比 率 >	62	57	—	<7.2%>	
(チリ)				千チリペソ		
BANCO DE CREDITO E INVERSION		12	13	48,335	8,115	銀行
EMPRESAS CMPC SA		414	500	78,795	13,229	紙製品・林産品
EMPRESAS COPEC SA		149	198	147,409	24,749	石油・ガス・消耗燃料
EMPRESA NACIONAL DE TELECOM		42	53	41,243	6,924	無線通信サービス
COLBUN SA		2,430	2,920	42,529	7,140	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AGUAS ANDINAS SA-A		953	953	36,504	6,129	水道
EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B		76	103	27,447	4,608	飲料
S. A. C. I. FALABELLA		158	232	125,215	21,023	複合小売り
CENCOSUD SA		399	562	107,363	18,026	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	1,215	30,208	5,072	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小 計	株 数 ・ 金 額	5,545	6,751	685,052	115,020	
	銘 柄 数 < 比 率 >	11	10	—	<0.5%>	
(コロンビア)				千コロンビアペソ		
INTERCONEXION ELECTRICA SA		107	151	179,086	6,858	電力
CORP FINANCIERA COLOMBIANA		25	35	106,994	4,097	各種金融サービス
GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF		30	41	156,456	5,992	各種金融サービス
GRUPO AVAL ACCIONES-PFD		996	1,299	153,282	5,870	銀行
CEMENTOS ARGOS SA		135	176	213,312	8,169	建設資材
GRUPO ARGOS SA		102	123	255,348	9,779	建設資材
GRUPO DE INV SURAMERICANA		78	92	361,192	13,833	各種金融サービス
小 計	株 数 ・ 金 額	1,473	1,917	1,425,670	54,603	
	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	—	—	—	銀行
DUBAI ISLAMIC BANK		360	450	258	8,036	銀行
EMIRATES TELECOM CORPORATION		586	733	1,302	40,442	各種電気通信サービス
ABU DHABI COMMERCIAL BANK		618	738	538	16,727	銀行
FIRST ABU DHABI BANK PJSC		195	626	701	21,791	銀行
EMAAR PROPERTIES PJSC		1,151	1,455	1,077	33,443	不動産管理・開発

銘柄		期首(前期末)	当 期 末		業 種 等	
		株 数	株 数	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
(アラブ首長国連邦)		百株	百株	千UAEディルハム	千円	
ARABTEC HOLDING CO		637	—	—	—	建設・土木
ALDAR PROPERTIES PJSC		1,092	1,363	304	9,440	不動産管理・開発
DUBAI FINANCIAL MARKET PJSC		608	—	—	—	資本市場
EMAAR MALLS PJSC		660	660	170	5,287	不動産管理・開発
DXB ENTERTAINMENTS PJSC		—	1,189	113	3,533	ホテル・レストラン・レジャー
小 計	株 数 ・ 金 額	6,190	7,216	4,467	138,702	
	銘 柄 数 < 比 率 >	10	8	—	<0.6%>	
(エジプト)				千エジプトポンド		
COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK		368	388	2,975	18,688	銀行
GLOBAL TELECOM HOLDING		955	955	670	4,212	無線通信サービス
T M G HOLDING		247	247	210	1,321	不動産管理・開発
小 計	株 数 ・ 金 額	1,572	1,592	3,857	24,223	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	<0.1%>	
(南アフリカ)				千ランド		
AFRICAN BANK INVESTMENTS LTD		344	—	—	—	各種金融サービス
BARLOWORLD LTD		58	—	—	—	商社・流通業
BIDVEST GROUP LTD		110	130	2,158	18,045	コングロマリット
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD		143	179	1,413	11,816	専門小売り
DISCOVERY LTD		109	135	1,802	15,072	保険
GOLD FIELDS LTD		236	364	1,569	13,122	金属・鉱業
REMGRO LTD		154	222	4,908	41,033	各種金融サービス
THE FOSCHINI GROUP LTD		64	82	1,232	10,304	専門小売り
EXXARO RESOURCES LTD		37	79	842	7,040	石油・ガス・消耗燃料
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		12	16	1,238	10,355	銀行
LIBERTY HOLDINGS LTD		28	42	441	3,688	保険
MTN GROUP LTD		550	683	8,107	67,781	無線通信サービス
ANGLOGOLD ASHANTI LTD		139	178	2,538	21,225	金属・鉱業
TELKOM SA SOC LTD		62	99	754	6,306	各種電気通信サービス
FIRSTRAND LTD		1,106	1,364	6,684	55,886	各種金融サービス
PSG GROUP LTD		29	39	964	8,067	各種金融サービス
NASPERS LTD-N SHS		132	177	47,742	399,124	メディア
CORONATION FUND MANAGERS LTD		68	68	440	3,681	資本市場
NEDBANK GROUP LTD		61	76	1,705	14,254	銀行
NETCARE LTD		307	384	1,040	8,695	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PICKN PAY STORES LTD		79	129	820	6,862	食品・生活必需品小売り
RMB HOLDINGS LTD		250	304	1,863	15,579	各種金融サービス
ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD		14	21	650	5,440	金属・鉱業
SAPPI LIMITED		175	215	2,217	18,540	紙製品・林産品
SASOL LTD		187	228	9,358	78,236	化学
SHOPRITE HOLDINGS LTD		162	179	3,582	29,948	食品・生活必需品小売り
BRAIT SE		115	151	1,307	10,928	資本市場
STANDARD BANK GROUP LTD		416	521	7,692	64,309	銀行
SPAR GROUP LIMITED/THE		50	86	1,542	12,898	食品・生活必需品小売り
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD		326	428	3,055	25,547	複合小売り
IMPERIAL HOLDINGS LTD		53	53	845	7,067	販売
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT		114	146	4,094	34,229	医薬品
TIGER BRANDS LTD		52	62	2,464	20,599	食品
SANLAM LIMITED		569	596	4,150	34,699	保険
INVESTEC LTD		85	85	876	7,327	資本市場
IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD		209	264	1,102	9,216	金属・鉱業
PIONEER FOODS LTD		36	50	822	6,878	食品
NEW EUROPE PROPERTY INVESTMENT P LC		67	95	1,489	12,449	不動産管理・開発

銘柄		期首(前期末)	当 期 末			業 種 等
		株 数	株 数	評 価 額	外貨建金額	
(南アフリカ)		百株	百株	千ランド	千円	
MASSMART HOLDINGS LTD		25	41	519	4,343	食品・生活必需品小売り
MONDI LTD		37	47	1,670	13,968	紙製品・林産品
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN		335	550	1,634	13,666	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MMI HOLDINGS LTD		400	400	898	7,511	保険
TSOGO SUN HOLDINGS LTD		126	126	316	2,649	ホテル・レストラン・レジャー
VODACOM GROUP		130	155	2,351	19,658	無線通信サービス
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD		117	183	2,718	22,727	銀行
SIBANYE GOLD LTD		232	285	744	6,228	金属・鉱業
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD		237	237	1,001	8,370	保険
MR PRICE GROUP LTD		80	97	1,444	12,079	専門小売り
STEINHOFF INTERNATIONAL H NV		956	1,203	8,390	70,148	家庭用耐久財
BID CORP LTD		—	136	4,059	33,941	食品・生活必需品小売り
小 計	株 数 ・ 金 額	9,407	11,410	159,276	1,331,554	
	銘 柄 数 < 比 率 >	49	48	—	< 6.1% >	
合 計	株 数 ・ 金 額	660,078	837,105	—	20,862,992	
	銘 柄 数 < 比 率 >	832	821	—	< 95.7% >	

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

* 邦貨換算金額欄の< >内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。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		64,400	80,400	231	7,279	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	64,400	80,400	231	7,279	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.0% >	
(メキシコ)				千メキシコペソ		
FIBRA UNO ADMINISTRACION SA		80,400	114,100	3,789	22,546	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	80,400	114,100	3,789	22,546	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	1	—	< 0.1% >	
(南アフリカ)				千ランド		
GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		75,380	88,400	2,254	18,845	0.1
REDEFINE PROPERTIES LTD		161,710	209,710	2,306	19,284	0.1
HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS		7,790	10,470	1,279	10,695	0.0
FORTRESS INCOME FUND LTD-A		29,380	41,690	721	6,029	0.0
FORTRESS INCOME FUND LTD		21,220	29,020	977	8,175	0.0
RESILIENT REIT LTD		9,072	11,572	1,367	11,429	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	304,552	390,862	8,906	74,459	
	銘柄 数 < 比 率 >	6	6	—	< 0.3% >	
合 計	口 数 ・ 金 額	449,352	585,362	—	104,285	
	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、純資産総額に対する評価額の比率。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	末
			買 建 額	売 建 額
外国	株式先物取引	MSCIN	百万円 814	百万円 —

*単位未満は切り捨て。
*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○投資信託財産の構成 (2017年5月10日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
株式	千円 20,862,992	% 95.6
投資証券	104,285	0.5
コール・ローン等、その他	850,761	3.9
投資信託財産総額	21,818,038	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（21,756,022千円）の投資信託財産総額（21,818,038千円）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=31.32円、 1 米ドル=113.86円、 1 トルコリラ=31.44円、 1 ユーロ=124.06円、 1 チェココルナ=4.66円、 1 フォリント=0.3977円、 1 ズロチ=29.30円、 1 香港ドル=14.63円、 1 リンギ=26.20円、 1 パーツ=3.27円、 1 フィリピンペソ=2.28円、 1 ルビア=0.0086円、 1 ウォン=0.1004円、 1 新台幣ドル=3.76円、 1 インドルピー=1.77円、 1 メキシコペソ=5.95円、 1 レアル=35.70円、 1 チリペソ=0.1679円、 1 コロンビアペソ=0.0383円、 1 UAEディルハム=31.05円、 1 エジプトポンド=6.28円、 1 ランド=8.36円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年5月10日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	21,848,645,062
コール・ローン等	613,396,009
株式(評価額)	20,862,992,506
投資証券(評価額)	104,285,826
未収入金	53,940,205
未収配当金	26,672,479
差入委託証拠金	187,358,037
(B) 負債	52,396,805
未払金	30,606,541
未払解約金	19,639,184
未払利息	80
その他未払費用	2,151,000
(C) 純資産総額(A－B)	21,796,248,257
元本	18,721,841,208
次期繰越損益金	3,074,407,049
(D) 受益権総口数	18,721,841,208口
1万円当たり基準価額(C／D)	11,642円

(注) 期首元本額は14,807,501,610円、期中追加設定元本額は5,014,244,870円、期中一部解約元本額は1,099,905,272円、1口当たり純資産額は1.1642円です。

○損益の状況（2016年5月11日～2017年5月10日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	384,053,675
受取配当金	383,927,427
受取利息	149,224
支払利息	△ 22,976
(B) 有価証券売買損益	4,433,661,336
売買益	4,978,606,066
売買損	△ 544,944,730
(C) 先物取引等取引損益	129,729,151
取引益	165,166,368
取引損	△ 35,437,217
(D) 保管費用等	△ 21,939,331
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	4,925,504,831
(F) 前期繰越損益金	△ 1,820,754,429
(G) 追加信託差損益金	△ 30,642,302
(H) 解約差損益金	298,949
(I) 計(E＋F＋G＋H)	3,074,407,049
次期繰越損益金(I)	3,074,407,049

* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
* 損益の状況の中で(G)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
* 損益の状況の中で(H)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村新興国株式インデックスファンド（確定拠出年金向け）	14,466,567,462
野村インデックスファンド・新興国株式	2,860,128,361
ノムラF0Fs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）	693,289,854
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	171,401,273
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	127,970,683
野村資産設計ファンド2040	126,490,480
野村資産設計ファンド2025	58,270,185
野村資産設計ファンド2030	55,165,542
野村資産設計ファンド2020	44,312,943
野村資産設計ファンド2035	42,475,822
野村資産設計ファンド2015	36,706,530
野村資産設計ファンド2050	16,302,912
野村資産設計ファンド2045	13,918,978
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	5,428,401
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	1,308,110
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	861,749
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	590,005
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	247,523
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	209,402
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	119,889
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	40,246
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	34,858

○お知らせ

- ①スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2017年3月31日＞

- ②外国為替予約取引に係る担保授受に関する規定を追加する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2017年3月31日＞

- ③先物取引等の運用指図において店頭デリバティブ取引または店頭オプション取引に係る評価の方法および担保授受の指図が行われる場合の規定を追加する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2017年3月31日＞

- ④直物為替先渡取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2017年3月31日＞

国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2017年3月31日）

作成対象期間（2016年4月1日～2017年3月31日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12- 1

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

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰	中 落 率	NOMURA-BPI 総 合	期 騰 落 中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
15期(2017年３月31日)	12,991	△1.1	378.492	△1.2	99.5	—	687,986

*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

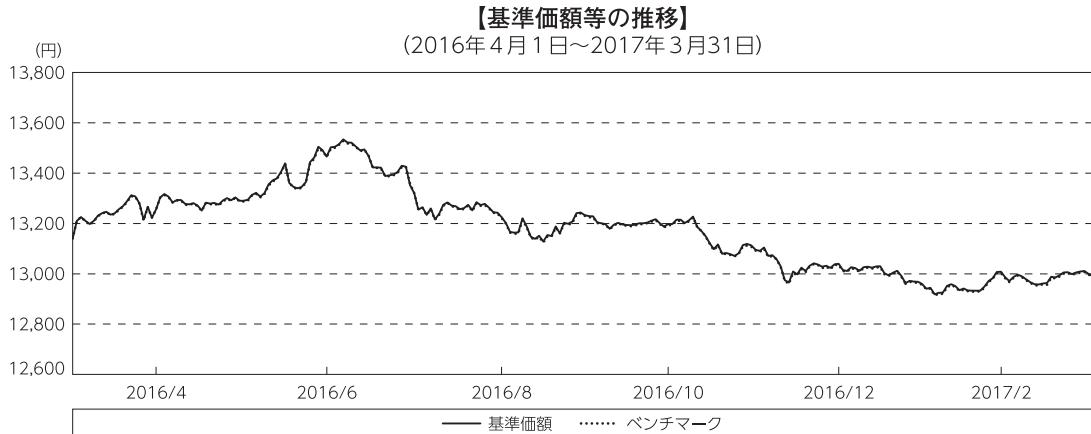
年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	期 騰	中 落 率	NOMURA-BPI 総 合	期 騰 落 中 率		
	円	%		%	%	%
(期 首) 2016年３月31日	13,141	—	382.913	—	99.5	—
４月末	13,256	0.9	386.253	0.9	99.5	—
５月末	13,304	1.2	387.599	1.2	99.5	—
６月末	13,466	2.5	392.355	2.5	98.6	—
７月末	13,352	1.6	389.242	1.7	99.5	—
８月末	13,225	0.6	385.240	0.6	99.4	—
９月末	13,233	0.7	385.504	0.7	99.5	—
10月末	13,198	0.4	384.444	0.4	99.3	—
11月末	13,113	△0.2	381.967	△0.2	99.6	—
12月末	13,040	△0.8	379.825	△0.8	99.3	—
2017年１月末	12,968	△1.3	377.739	△1.4	99.2	—
２月末	13,008	△1.0	378.896	△1.0	99.5	—
(期 末) 2017年３月31日	12,991	△1.1	378.492	△1.2	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13,141円から期末12,991円に150円の値下がりとなりました。

当運用期間では、国内債券利回りが上昇（価格は下落）したため、基準価額は下落しました。

○投資環境

期首から2016年7月上旬にかけては日銀のマイナス金利政策や、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱支持という結果になったことを受けたリスク回避的な投資家動向から、国債の需要が高まり、国内債券利回りが低下（価格は上昇）しました。

2016年7月上旬から期末にかけては、日銀による長短金利を誘導目標とした金融政策の導入や、米国の大統領選挙の結果を受けた円安進行に伴い、国内株式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。

当運用期間では、国内債券利回りは上昇（価格は下落）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

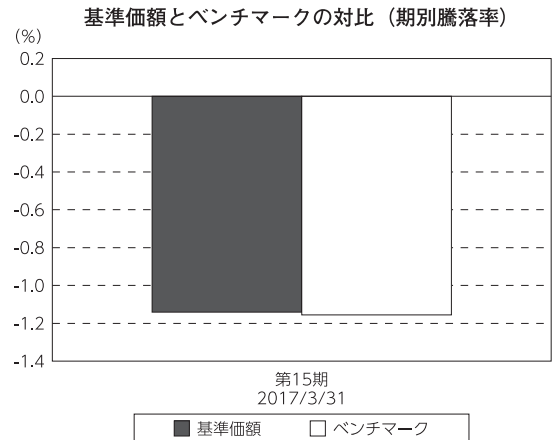
NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、種別構成、デュレーション(金利感応度)、流動性などを考慮して選択した債券銘柄に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値(デュレーションなど)を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス(投資比率の再調整)を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

○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-1.1%となり、ベンチマークの-1.2%を0.1ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

(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

(2016年４月１日～2017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

(2016年４月１日～2017年３月31日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	103,462,570	59,235,133
	地方債証券	10,713,381	7,905,024
	特殊債券	16,401,735	13,895,660
	社債券（投資法人債券を含む）	4,316,753	(1,593,707)
			5,953,885

*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

(2016年４月１日～2017年３月31日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 134,894	百万円 1,580	% 1.2	百万円 86,989	百万円 1,244	% 1.4
預金	34,509	34,509	100.0	36,192	36,192	100.0

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第１項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2017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	498,584,000 (2,360,000)	544,815,612 (3,179,080)	79.2 (0.5)	— (—)	51.4 (0.4)	20.9 (0.1)	6.9 (—)
地方債証券	51,562,340 (51,562,340)	54,040,358 (54,040,358)	7.9 (7.9)	— (—)	4.0 (4.0)	1.8 (1.8)	2.1 (2.1)
特殊債券 (除く金融債)	50,049,754 (50,049,754)	52,856,056 (52,856,056)	7.7 (7.7)	— (—)	4.9 (4.9)	1.8 (1.8)	1.1 (1.1)
金融債券	5,000,000 (5,000,000)	5,012,606 (5,012,606)	0.7 (0.7)	— (—)	— (—)	0.6 (0.6)	0.2 (0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	27,107,000 (27,107,000)	27,962,347 (27,962,347)	4.1 (4.1)	— (—)	1.9 (1.9)	1.7 (1.7)	0.5 (0.5)
合 計	632,303,094 (136,079,094)	684,686,981 (143,050,448)	99.5 (20.8)	— (—)	62.2 (11.2)	26.7 (5.9)	10.6 (3.8)

* () 内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄		柄	当 期 末			
			利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券			%	千円	千円	
国庫債券	利付 (2年) 第366回		0.1	4,000,000	4,017,440	2018/7/15
国庫債券	利付 (2年) 第368回		0.1	1,500,000	1,507,410	2018/9/15
国庫債券	利付 (2年) 第369回		0.1	1,500,000	1,507,710	2018/10/15
国庫債券	利付 (2年) 第372回		0.1	5,000,000	5,030,000	2019/1/15
国庫債券	利付 (5年) 第113回		0.3	5,500,000	5,536,355	2018/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第114回		0.3	1,500,000	1,511,880	2018/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第115回		0.2	7,300,000	7,347,085	2018/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第116回		0.2	8,100,000	8,161,236	2018/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第117回		0.2	5,900,000	5,948,144	2019/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第118回		0.2	5,000,000	5,044,400	2019/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第119回		0.1	4,700,000	4,731,302	2019/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第120回		0.2	5,500,000	5,553,075	2019/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第121回		0.1	3,500,000	3,525,095	2019/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第122回		0.1	7,800,000	7,860,528	2019/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第123回		0.1	7,300,000	7,360,736	2020/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第124回		0.1	8,100,000	8,170,551	2020/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第125回		0.1	8,200,000	8,274,210	2020/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第126回		0.1	5,500,000	5,552,360	2020/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第127回		0.1	6,000,000	6,059,700	2021/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第128回		0.1	6,200,000	6,264,356	2021/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第129回		0.1	6,000,000	6,064,620	2021/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第130回		0.1	5,000,000	5,056,900	2021/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第131回		0.1	500,000	505,610	2022/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第1回		2.4	1,960,000	2,779,515	2048/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第2回		2.2	900,000	1,233,243	2049/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第3回		2.2	900,000	1,239,948	2050/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第4回		2.2	1,300,000	1,798,017	2051/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第5回		2.0	1,300,000	1,726,166	2052/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第6回		1.9	1,300,000	1,692,236	2053/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第7回		1.7	1,400,000	1,737,106	2054/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第8回		1.4	1,500,000	1,719,495	2055/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第9回		0.4	1,700,000	1,396,397	2056/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第297回		1.4	1,100,000	1,130,822	2018/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第298回		1.3	1,500,000	1,539,450	2018/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第299回		1.3	1,400,000	1,441,720	2019/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第300回		1.5	1,000,000	1,033,730	2019/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第301回		1.5	1,500,000	1,556,625	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第302回		1.4	700,000	724,871	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第303回		1.4	3,300,000	3,429,822	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第304回		1.3	1,000,000	1,036,870	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第305回		1.3	4,100,000	4,265,968	2019/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第306回		1.4	3,000,000	3,140,520	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第307回		1.3	1,700,000	1,774,579	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第308回		1.3	1,700,000	1,780,393	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第309回		1.1	3,000,000	3,122,490	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第310回		1.0	3,700,000	3,848,777	2020/9/20

銘柄			当 期 末			
			利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券			%	千円	千円	
国庫債券	利付 (10年)	第311回	0.8	1,800,000	1,859,850	2020/9/20
国庫債券	利付 (10年)	第312回	1.2	4,950,000	5,198,490	2020/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第313回	1.3	3,200,000	3,384,768	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年)	第314回	1.1	2,200,000	2,309,516	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年)	第315回	1.2	3,600,000	3,804,336	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年)	第316回	1.1	1,400,000	1,473,528	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年)	第317回	1.1	1,800,000	1,899,378	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年)	第318回	1.0	3,200,000	3,362,304	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年)	第319回	1.1	1,850,000	1,957,411	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第320回	1.0	3,500,000	3,686,620	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第321回	1.0	3,200,000	3,377,088	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年)	第322回	0.9	2,400,000	2,520,840	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年)	第323回	0.9	2,700,000	2,842,911	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年)	第324回	0.8	3,200,000	3,352,608	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年)	第325回	0.8	4,900,000	5,143,628	2022/9/20
国庫債券	利付 (10年)	第326回	0.7	2,100,000	2,196,516	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第327回	0.8	3,100,000	3,260,270	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第328回	0.6	5,500,000	5,729,075	2023/3/20
国庫債券	利付 (10年)	第329回	0.8	5,300,000	5,592,825	2023/6/20
国庫債券	利付 (10年)	第330回	0.8	3,800,000	4,015,916	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年)	第331回	0.6	1,900,000	1,983,277	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年)	第332回	0.6	3,400,000	3,553,612	2023/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第333回	0.6	4,000,000	4,184,480	2024/3/20
国庫債券	利付 (10年)	第334回	0.6	4,100,000	4,291,306	2024/6/20
国庫債券	利付 (10年)	第335回	0.5	3,700,000	3,846,668	2024/9/20
国庫債券	利付 (10年)	第336回	0.5	2,700,000	2,808,432	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第337回	0.3	3,700,000	3,791,427	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第338回	0.4	4,900,000	5,059,985	2025/3/20
国庫債券	利付 (10年)	第339回	0.4	5,900,000	6,093,756	2025/6/20
国庫債券	利付 (10年)	第340回	0.4	6,000,000	6,197,820	2025/9/20
国庫債券	利付 (10年)	第341回	0.3	7,200,000	7,375,320	2025/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第342回	0.1	7,500,000	7,550,250	2026/3/20
国庫債券	利付 (10年)	第343回	0.1	6,900,000	6,941,124	2026/6/20
国庫債券	利付 (10年)	第344回	0.1	5,800,000	5,830,044	2026/9/20
国庫債券	利付 (10年)	第345回	0.1	6,800,000	6,829,512	2026/12/20
国庫債券	利付 (10年)	第346回	0.1	800,000	802,768	2027/3/20
国庫債券	利付 (30年)	第1回	2.8	100,000	132,017	2029/9/20
国庫債券	利付 (30年)	第2回	2.4	200,000	255,578	2030/2/20
国庫債券	利付 (30年)	第3回	2.3	160,000	202,844	2030/5/20
国庫債券	利付 (30年)	第4回	2.9	900,000	1,218,375	2030/11/20
国庫債券	利付 (30年)	第5回	2.2	150,000	189,649	2031/5/20
国庫債券	利付 (30年)	第6回	2.4	700,000	908,565	2031/11/20
国庫債券	利付 (30年)	第7回	2.3	600,000	772,512	2032/5/20
国庫債券	利付 (30年)	第8回	1.8	100,000	121,675	2032/11/22
国庫債券	利付 (30年)	第9回	1.4	65,000	75,108	2032/12/20
国庫債券	利付 (30年)	第10回	1.1	250,000	277,082	2033/3/20
国庫債券	利付 (30年)	第11回	1.7	160,000	192,249	2033/6/20
国庫債券	利付 (30年)	第12回	2.1	220,000	278,412	2033/9/20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	362,685	2033/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	1,053,264	2034/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第15回	2.5	900,000	1,200,465	2034/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第16回	2.5	915,000	1,222,650	2034/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第17回	2.4	1,200,000	1,585,164	2034/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第18回	2.3	1,500,000	1,957,830	2035/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第19回	2.3	1,600,000	2,087,664	2035/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第20回	2.5	1,900,000	2,546,589	2035/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第21回	2.3	1,400,000	1,829,632	2035/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	805,710	2036/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	1,129,506	2036/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	940,807	2036/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	655,025	2036/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,130,772	2037/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第27回	2.5	1,550,000	2,098,204	2037/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第28回	2.5	700,000	951,153	2038/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第29回	2.4	1,500,000	2,015,295	2038/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第30回	2.3	900,000	1,195,695	2039/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第31回	2.2	1,600,000	2,098,432	2039/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第32回	2.3	1,900,000	2,538,970	2040/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第33回	2.0	2,000,000	2,552,260	2040/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第34回	2.2	2,300,000	3,042,187	2041/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	2,949,129	2041/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第36回	2.0	1,800,000	2,314,386	2042/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第37回	1.9	2,300,000	2,909,017	2042/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第38回	1.8	1,400,000	1,742,118	2043/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第39回	1.9	1,600,000	2,029,712	2043/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第40回	1.8	1,100,000	1,370,149	2043/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第41回	1.7	1,000,000	1,222,290	2043/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第42回	1.7	1,200,000	1,467,156	2044/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,589,874	2044/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,712,620	2044/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第45回	1.5	1,900,000	2,232,063	2044/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第46回	1.5	1,800,000	2,114,460	2045/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第47回	1.6	1,900,000	2,281,349	2045/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第48回	1.4	1,400,000	1,609,664	2045/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第49回	1.4	1,800,000	2,069,064	2045/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第50回	0.8	1,900,000	1,891,089	2046/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第51回	0.3	2,400,000	2,076,528	2046/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第52回	0.5	2,000,000	1,828,600	2046/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第53回	0.6	2,400,000	2,252,328	2046/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第54回	0.8	800,000	791,392	2047/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第40回	2.3	525,000	544,535	2018/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第41回	1.5	255,000	263,575	2019/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第42回	2.6	683,000	720,749	2019/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第43回	2.9	400,000	430,584	2019/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第44回	2.5	150,000	161,910	2020/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第45回	2.4	242,000	260,493	2020/ 3 /20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第46回	2.2	90,000	96,882	2020/6/22
国庫債券	利付 (20年) 第47回	2.2	1,230,000	1,331,155	2020/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第48回	2.5	200,000	219,718	2020/12/21
国庫債券	利付 (20年) 第49回	2.1	200,000	217,816	2021/3/22
国庫債券	利付 (20年) 第50回	1.9	183,000	197,841	2021/3/22
国庫債券	利付 (20年) 第51回	2.0	310,000	337,974	2021/6/21
国庫債券	利付 (20年) 第52回	2.1	100,000	109,992	2021/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第53回	2.1	250,000	276,300	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第54回	2.2	250,000	277,485	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第55回	2.0	231,000	255,250	2022/3/21
国庫債券	利付 (20年) 第56回	2.0	120,000	133,269	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第57回	1.9	210,000	232,121	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第58回	1.9	180,000	199,774	2022/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第59回	1.7	230,000	253,710	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第60回	1.4	780,000	847,212	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第61回	1.0	300,000	319,494	2023/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	464,164	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	335,100	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	451,012	2023/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	515,273	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	337,833	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	352,457	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	335,799	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	644,526	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	635,515	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	232,482	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第72回	2.1	670,000	776,449	2024/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第73回	2.0	1,600,000	1,849,632	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第74回	2.1	1,300,000	1,512,875	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	700,836	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	1,048,438	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	812,070	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	924,800	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	1,001,220	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第80回	2.1	900,000	1,055,187	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	420,577	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	964,910	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,617,833	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,406,640	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	473,980	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第86回	2.3	1,400,000	1,683,948	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	596,940	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,328,745	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	563,421	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,804,590	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	303,120	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第92回	2.1	1,550,000	1,856,218	2026/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	357,615	2027/3/20

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94回	2.1	200,000	240,390	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第95回	2.3	700,000	858,256	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	482,324	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第97回	2.2	1,300,000	1,586,780	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	363,066	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第99回	2.1	2,100,000	2,549,190	2027/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第100回	2.2	1,520,000	1,867,016	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	312,500	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第102回	2.4	500,000	626,800	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	745,512	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	488,152	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,324,061	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	493,796	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第107回	2.1	300,000	367,755	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,924,496	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	1,085,031	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第110回	2.1	1,100,000	1,351,988	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第111回	2.2	800,000	995,456	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,218,230	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第113回	2.1	2,500,000	3,086,975	2029/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第114回	2.1	2,500,000	3,092,675	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第115回	2.2	500,000	624,745	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,377,893	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第117回	2.1	1,900,000	2,355,981	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	614,650	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	962,264	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	941,728	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第121回	1.9	1,500,000	1,827,105	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第122回	1.8	1,100,000	1,325,522	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第123回	2.1	2,000,000	2,493,840	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第124回	2.0	1,000,000	1,233,640	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第125回	2.2	900,000	1,136,709	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第126回	2.0	1,000,000	1,235,210	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第127回	1.9	800,000	977,384	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第128回	1.9	1,500,000	1,834,605	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第129回	1.8	800,000	967,512	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第130回	1.8	1,600,000	1,936,704	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	957,232	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,556,438	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,695,890	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第134回	1.8	1,400,000	1,698,200	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第135回	1.7	400,000	479,140	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	828,499	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,199,290	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	935,568	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第139回	1.6	700,000	828,758	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第140回	1.7	3,000,000	3,599,370	2032/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第141回	1.7	1,700,000	2,040,272	2032/12/20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第142回	1.8	1,250,000	1,519,937	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第143回	1.6	2,500,000	2,965,600	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第144回	1.5	1,500,000	1,755,420	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第145回	1.7	2,600,000	3,124,056	2033/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第146回	1.7	3,700,000	4,446,364	2033/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第147回	1.6	2,700,000	3,202,524	2033/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第148回	1.5	2,500,000	2,922,800	2034/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第149回	1.5	2,600,000	3,038,490	2034/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第150回	1.4	2,930,000	3,375,184	2034/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第151回	1.2	2,700,000	3,017,331	2034/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第152回	1.2	3,200,000	3,572,064	2035/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第153回	1.3	3,450,000	3,904,158	2035/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第154回	1.2	3,500,000	3,894,345	2035/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第155回	1.0	2,800,000	3,013,752	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第156回	0.4	2,900,000	2,806,040	2036/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第157回	0.2	3,900,000	3,618,810	2036/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第158回	0.5	2,800,000	2,741,620	2036/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第159回	0.6	3,000,000	2,986,830	2036/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第160回	0.7	800,000	809,928	2037/3/20
メキシコ合衆国	第22回円貨社債 (2016)	0.7	300,000	298,779	2021/6/16
ポーランド共和国	第15回円貨債券 (2013)	0.91	100,000	100,786	2020/11/13
小 計			498,584,000	544,815,612	
地方債証券					
東京都	公募第659回	1.62	300,000	305,808	2018/6/20
東京都	公募第660回	1.58	100,000	101,887	2018/6/20
東京都	公募第664回	1.4	100,000	102,359	2018/12/20
東京都	公募第668回	1.54	200,000	205,944	2019/3/20
東京都	公募第671回	1.42	100,000	103,086	2019/6/20
東京都	公募第685回	1.13	100,000	103,538	2020/6/19
東京都	公募第690回	1.29	200,000	209,360	2020/12/18
東京都	公募第703回	0.99	100,000	104,526	2021/12/20
東京都	公募第707回	0.87	100,000	104,164	2022/3/18
東京都	公募第708回	0.89	100,000	104,484	2022/6/20
東京都	公募第710回	0.81	100,000	104,067	2022/6/20
東京都	公募第712回	0.77	100,000	104,045	2022/9/20
東京都	公募第715回	0.76	100,000	104,171	2022/12/20
東京都	公募第716回	0.77	200,000	208,458	2022/12/20
東京都	公募 (30年) 第7回	2.51	100,000	132,060	2038/9/17
東京都	公募第10回	2.31	200,000	257,748	2039/9/20
東京都	公募 (7年) 第3回	0.58	100,000	100,801	2018/9/20
東京都	公募第1回	1.54	300,000	328,116	2023/6/20
東京都	公募 (20年) 第3回	2.26	100,000	115,306	2024/3/19
東京都	公募第7回	2.16	100,000	117,061	2025/9/19
東京都	公募 (20年) 第16回	2.01	200,000	238,726	2028/12/20
東京都	公募 (20年) 第17回	2.09	200,000	240,540	2028/12/20
東京都	公募第23回	2.12	100,000	122,453	2030/12/20
東京都	公募 (20年) 第26回	1.74	100,000	117,699	2032/6/18
北海道	公募平成20年度第7回	1.72	300,000	307,512	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	
北海道	公募平成21年度第 6 回	1. 6	100,000	103,783	2019/ 8 /28
北海道	公募平成21年度第10回	1. 5	100,000	103,908	2019/11/27
北海道	公募平成24年度第 6 回	0. 84	100,000	104,327	2022/ 8 /31
北海道	公募平成24年度第 9 回	0. 79	100,000	104,181	2022/10/31
北海道	公募平成25年度第 1 回	0. 58	300,000	309,522	2023/ 4 /26
北海道	公募（ 5 年）平成25年度第 8 回	0. 31	100,000	100,407	2018/ 9 /25
北海道	公募（ 5 年）平成26年度第 8 回	0. 178	200,000	200,734	2019/ 9 /25
北海道	公募（ 5 年）平成26年度第10回	0. 147	100,000	100,311	2019/11/28
北海道	公募平成27年度第 7 回	0. 529	100,000	103,064	2025/ 8 /28
北海道	公募平成28年度第13回	0. 02	200,000	199,900	2022/ 1 /31
宮城県	公募（ 5 年）第 9 回 1 号	0. 35	500,000	502,075	2018/ 7 /26
神奈川県	公募第155回	1. 61	100,000	101,923	2018/ 6 /20
神奈川県	公募第156回	1. 66	101,000	103,415	2018/ 9 /20
神奈川県	公募第184回	1. 02	100,000	104,170	2021/ 6 /18
神奈川県	公募第188回	1. 05	200,000	210,114	2022/ 3 /18
神奈川県	公募第196回	0. 678	100,000	103,831	2023/ 3 /20
神奈川県	公募第200回	0. 825	100,000	104,968	2023/ 9 /20
神奈川県	公募第205回	0. 664	100,000	104,118	2024/ 3 /19
神奈川県	公募第206回	0. 654	100,000	104,084	2024/ 6 /20
神奈川県	公募第210回	0. 451	200,000	205,144	2024/12/20
神奈川県	公募（30年）第 3 回	2. 62	100,000	132,945	2037/ 3 /19
神奈川県	公募第 7 回	2. 22	300,000	358,182	2027/ 3 /19
大阪府	公募第320回	1. 84	400,000	412,004	2018/11/27
大阪府	公募第337回	1. 44	200,000	208,668	2020/ 4 /28
大阪府	公募第346回	1. 25	100,000	104,668	2021/ 1 /28
大阪府	公募第356回	1. 06	100,000	104,876	2021/12/27
大阪府	公募第378回	0. 7	104,000	108,309	2023/11/28
大阪府	公募第381回	0. 683	100,000	104,145	2024/ 2 /27
大阪府	公募第382回	0. 674	100,000	104,094	2024/ 3 /28
大阪府	公募第383回	0. 695	100,000	104,251	2024/ 4 /26
大阪府	公募第384回	0. 67	100,000	104,090	2024/ 5 /29
大阪府	公募第387回	0. 521	300,000	308,949	2024/ 8 /28
大阪府	公募第389回	0. 53	100,000	103,042	2024/10/30
大阪府	公募第 5 回	2. 16	100,000	121,916	2030/ 5 /28
大阪府	公募第 8 回	1. 83	100,000	118,411	2031/12/22
大阪府	公募第98回	0. 295	200,000	200,774	2018/ 9 /27
大阪府	公募（ 5 年）第99回	0. 24	240,000	240,782	2018/10/30
大阪府	公募（ 5 年）第101回	0. 23	148,000	148,512	2018/12/26
大阪府	公募第102回	0. 223	100,000	100,353	2019/ 1 /30
大阪府	公募（ 5 年）第130回	0. 001	600,000	599,274	2021/ 5 /28
京都府	公募平成20年度第 3 回	1. 57	140,000	143,705	2018/12/19
京都府	公募平成24年度第 2 回	0. 91	100,000	104,589	2022/ 6 /20
京都府	公募平成24年度第 6 回	0. 8	100,000	104,274	2022/10/21
京都府	公募平成26年度第 5 回	1. 455	100,000	113,071	2034/ 8 /10
京都府	公募平成26年度第 7 回	0. 564	200,000	206,806	2024/ 9 /19
兵庫県	公募平成20年度第 3 回	1. 76	100,000	101,968	2018/ 5 /22
兵庫県	公募平成20年度第12回	1. 82	100,000	102,967	2018/11/27
兵庫県	公募平成20年度第16回	1. 6	100,000	102,850	2019/ 1 /23

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13回	1.48	100,000	103,327	2019/7/17
兵庫県	公募平成21年度第25回	1.54	100,000	103,985	2019/11/20
兵庫県	公募平成22年度第1回	1.46	100,000	104,349	2020/4/16
兵庫県	公募(30年)第2回	2.36	100,000	129,901	2040/3/19
兵庫県	公募(15年)第1回	1.66	300,000	340,743	2026/7/29
兵庫県	公募(15年)第3回	1.35	100,000	110,757	2027/7/16
兵庫県	公募(12年)第3回	0.56	300,000	309,906	2025/4/16
兵庫県	公募第2回	2.37	100,000	121,311	2027/9/17
兵庫県	公募第9回	2.25	100,000	122,547	2029/11/19
兵庫県	公募(20年)第14回	1.72	100,000	116,764	2032/5/24
静岡県	公募平成21年度第2回	1.65	100,000	103,619	2019/6/25
静岡県	公募平成21年度第7回	1.54	100,000	104,006	2019/11/25
静岡県	公募平成24年度第5回	0.849	100,060	104,400	2022/7/20
静岡県	公募平成24年度第10回	0.678	100,000	103,834	2023/3/22
静岡県	公募平成25年度第5回	0.926	101,000	106,568	2023/7/25
静岡県	公募平成26年度第3回	0.679	165,000	172,032	2024/5/27
静岡県	公募平成26年度第8回	0.564	100,000	103,410	2024/9/25
静岡県	公募平成26年度第9回	0.554	200,000	206,664	2024/10/24
静岡県	公募平成27年度第11回	0.11	115,400	114,787	2026/3/19
静岡県	公募平成28年度第2回	0.08	300,000	297,612	2026/3/19
静岡県	公募(20年)第11回	1.841	100,000	118,524	2030/10/18
静岡県	公募(20年)第14回	1.736	100,000	117,476	2032/6/18
愛知県	公募平成20年度第7回	1.39	210,000	215,237	2019/1/30
愛知県	公募平成20年度第8回	2.04	100,000	119,568	2028/12/20
愛知県	公募平成20年度第10回	1.48	100,000	102,882	2019/3/27
愛知県	公募平成21年度第3回	1.66	114,000	118,156	2019/6/26
愛知県	公募平成21年度第17回	1.41	100,000	104,012	2020/2/26
愛知県	公募平成22年度第3回	1.364	100,000	104,210	2020/5/28
愛知県	公募平成22年度第9回	1.153	100,000	103,928	2020/9/30
愛知県	公募平成23年度第19回	1.006	100,000	104,790	2022/2/28
愛知県	公募平成24年度第2回	0.982	100,000	104,824	2022/4/27
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	1.687	100,000	116,762	2032/6/11
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	1.314	400,000	444,840	2027/12/13
愛知県	公募平成24年度第17回	1.829	100,000	118,922	2033/2/8
愛知県	公募平成26年度第8回	1.814	100,000	119,851	2044/6/20
愛知県	公募平成26年度第13回	1.363	100,000	111,444	2034/11/14
愛知県	公募平成27年度第15回	0.471	100,000	102,700	2025/11/27
広島県	公募平成20年度第3回	1.6	300,000	306,978	2018/9/25
広島県	公募平成22年度第6回	1.26	200,000	209,392	2021/1/25
広島県	公募平成24年度第4回	0.81	100,000	104,410	2022/11/28
広島県	公募平成25年度第3回	0.8	200,000	209,700	2023/9/25
広島県	公募(5年)平成25年度第6回	0.21	300,000	301,026	2019/2/25
広島県	公募平成26年度第5回	0.33	109,650	111,477	2025/1/27
埼玉県	公募平成21年度第5回	1.41	100,000	103,431	2019/9/25
埼玉県	公募平成22年度第2回	1.37	200,000	208,444	2020/5/26
埼玉県	公募平成24年度第4回	0.84	300,000	312,903	2022/7/25
埼玉県	公募平成25年度第4回	0.921	100,000	105,479	2023/7/24
埼玉県	公募平成25年度第6回	0.806	148,000	155,191	2023/9/27

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（5年）平成25年度第7回	0.261	100,000	100,356	2018/10/25
埼玉県	公募平成25年度第10回	0.67	100,000	104,162	2024/2/26
埼玉県	公募平成25年度第11回	0.655	100,000	104,067	2024/3/26
埼玉県	公募平成26年度第3回	0.67	100,000	104,187	2024/5/20
埼玉県	公募平成26年度第6回	0.554	200,000	206,674	2024/9/26
埼玉県	公募平成26年度第7回	0.476	400,000	411,072	2024/12/25
埼玉県	公募平成26年度第9回	0.429	100,000	102,380	2025/2/25
福岡県	公募平成20年度第3回	1.59	100,000	101,899	2018/6/20
福岡県	公募平成22年度第5回	0.94	100,000	103,253	2020/10/28
福岡県	公募平成23年度第5回	1.02	100,000	104,516	2021/10/25
福岡県	公募平成26年度第4回	0.135	100,000	100,261	2019/9/26
福岡県	公募平成23年度第1回	1.491	100,000	112,131	2026/11/27
福岡県	公募（30年）平成19年度第1回	2.62	100,000	133,287	2037/9/18
福岡県	公募（30年）平成26年度第1回	1.827	100,000	120,135	2044/6/20
福岡県	公募（20年）平成20年度第2回	2.05	100,000	119,681	2028/12/20
福岡県	公募（20年）平成24年度第2回	1.635	100,000	116,043	2032/8/16
千葉県	公募平成20年度第6回	1.64	200,000	205,040	2018/10/25
千葉県	公募平成21年度第1回	1.53	100,000	103,101	2019/4/25
千葉県	公募平成21年度第11回	1.42	180,000	187,047	2020/1/24
千葉県	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,163	2022/4/25
千葉県	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	104,526	2022/5/25
千葉県	公募平成24年度第7回	0.74	100,000	104,062	2022/12/22
千葉県	公募平成24年度第8回	0.84	100,000	104,690	2023/1/25
千葉県	公募平成25年度第2回	0.26	900,000	902,313	2018/5/25
千葉県	公募平成25年度第3回	0.89	100,000	105,244	2023/6/23
千葉県	公募平成25年度第4回	0.92	100,000	105,475	2023/7/25
千葉県	公募（20年）第8回	2.18	100,000	122,527	2030/4/19
千葉県	公募（20年）第17回	1.403	100,000	112,106	2034/10/13
新潟県	公募平成20年度第2回	1.52	200,000	205,694	2019/2/27
新潟県	公募平成21年度第2回	1.55	150,000	156,060	2019/11/27
長野県	公募平成25年度第1回	0.24	1,100,000	1,103,993	2018/12/25
群馬県	公募第8回	1.03	100,000	104,647	2021/11/25
群馬県	公募第12回	0.519	100,000	103,141	2025/8/15
群馬県	公募（5年）第4回	0.235	600,000	601,998	2018/11/22
群馬県	公募（20年）第3回	1.687	100,000	116,802	2032/6/25
岐阜県	公募平成26年度第1回	0.554	186,670	192,979	2024/9/30
大分県	公募平成23年度第1回	1.0	902,000	942,003	2021/10/29
共同発行市場地方債	公募第62回	1.74	100,000	101,959	2018/5/25
共同発行市場地方債	公募第63回	1.88	200,000	204,556	2018/6/25
共同発行市場地方債	公募第64回	1.78	262,000	268,020	2018/7/25
共同発行市場地方債	公募第65回	1.62	700,000	715,519	2018/8/24
共同発行市場地方債	公募第66回	1.55	181,000	185,074	2018/9/25
共同発行市場地方債	公募第68回	1.69	900,000	924,552	2018/11/22
共同発行市場地方債	公募第70回	1.42	110,000	112,783	2019/1/25
共同発行市場地方債	公募第74回	1.57	500,000	516,525	2019/5/24
共同発行市場地方債	公募第75回	1.64	310,000	321,150	2019/6/25
共同発行市場地方債	公募第82回	1.42	300,000	311,745	2020/1/24
共同発行市場地方債	公募第84回	1.38	500,000	520,120	2020/3/25

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85回	1.44	100,000	104,319	2020/4/24
共同発行市場地方債	公募第88回	1.17	100,000	103,776	2020/7/24
共同発行市場地方債	公募第89回	1.04	100,000	103,433	2020/8/25
共同発行市場地方債	公募第92回	1.03	110,000	114,016	2020/11/25
共同発行市場地方債	公募第93回	1.25	300,000	313,665	2020/12/25
共同発行市場地方債	公募第94回	1.24	300,000	313,860	2021/1/25
共同発行市場地方債	公募第96回	1.29	100,000	105,014	2021/3/25
共同発行市場地方債	公募第101回	1.05	300,000	313,452	2021/8/25
共同発行市場地方債	公募第102回	1.03	150,000	156,715	2021/9/24
共同発行市場地方債	公募第103回	1.0	100,000	104,425	2021/10/25
共同発行市場地方債	公募第104回	1.03	200,000	209,294	2021/11/25
共同発行市場地方債	公募第108回	1.01	200,000	209,754	2022/3/25
共同発行市場地方債	公募第110回	0.89	200,000	208,846	2022/5/25
共同発行市場地方債	公募第111回	0.89	200,000	208,988	2022/6/24
共同発行市場地方債	公募第112回	0.84	100,000	104,301	2022/7/25
共同発行市場地方債	公募第113回	0.77	800,000	831,936	2022/8/25
共同発行市場地方債	公募第114回	0.82	243,700	254,232	2022/9/22
共同発行市場地方債	公募第115回	0.8	100,000	104,282	2022/10/25
共同発行市場地方債	公募第116回	0.8	200,000	208,696	2022/11/25
共同発行市場地方債	公募第118回	0.84	100,000	104,690	2023/1/25
共同発行市場地方債	公募第119回	0.8	200,000	208,998	2023/2/24
共同発行市場地方債	公募第120回	0.68	300,000	311,547	2023/3/24
共同発行市場地方債	公募第121回	0.57	100,000	103,206	2023/4/25
共同発行市場地方債	公募第122回	0.62	400,000	414,216	2023/5/25
共同発行市場地方債	公募第124回	0.91	100,000	105,412	2023/7/25
共同発行市場地方債	公募第126回	0.81	100,000	104,881	2023/9/25
共同発行市場地方債	公募第128回	0.66	300,000	311,925	2023/11/24
共同発行市場地方債	公募第129回	0.71	100,000	104,362	2023/12/25
共同発行市場地方債	公募第130回	0.76	100,000	104,720	2024/1/25
共同発行市場地方債	公募第132回	0.66	100,000	104,100	2024/3/25
共同発行市場地方債	公募第136回	0.611	200,000	207,500	2024/7/25
共同発行市場地方債	公募第137回	0.566	200,000	206,844	2024/8/23
共同発行市場地方債	公募第139回	0.544	155,000	160,049	2024/10/25
共同発行市場地方債	公募第143回	0.448	540,000	553,656	2025/2/25
共同発行市場地方債	公募第145回	0.406	1,000,000	1,022,070	2025/4/25
共同発行市場地方債	公募第156回	0.1	100,000	99,380	2026/3/25
共同発行市場地方債	公募第157回	0.08	100,000	99,195	2026/4/24
堺市	公募平成22年度第1回	1.97	100,000	120,304	2030/11/19
堺市	公募平成26年度第1回	1.664	100,000	115,797	2044/9/20
島根県	公募平成22年度第1回	1.08	100,000	103,837	2020/11/26
島根県	公募平成25年度第3回	0.209	700,000	702,478	2019/3/25
島根県	公募平成28年度第3回	0.001	100,000	99,862	2021/11/25
福島県	公募平成26年度第1回	0.495	200,000	205,850	2024/11/28
滋賀県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	103,917	2023/11/29
滋賀県	公募平成26年度第1回	0.495	142,000	146,098	2024/11/28
栃木県	公募平成24年度第1回	0.79	100,000	104,301	2022/11/30
栃木県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	103,917	2023/11/29
新潟市	公募平成25年度第1回	0.72	233,200	243,530	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	
奈良県	公募平成28年度第 1 回		0.001	100,000	99,862	2021/11/30
浜松市	公募平成26年度第 1 回		0.335	100,000	101,704	2025/ 1 /23
大阪市	公募平成20年度第 3 回		1.82	110,000	112,575	2018/ 7 /23
大阪市	公募平成21年度第 6 回		1.57	100,000	104,085	2019/11/25
大阪市	公募平成25年度第 1 回		0.401	800,000	803,336	2018/ 5 /23
大阪市	公募平成25年度第 6 回		0.694	100,000	104,197	2023/11/22
大阪市	公募平成26年度第 5 回		0.593	100,000	103,628	2024/ 9 /27
大阪市	公募（ 5 年）平成28年度第 5 回		0.001	100,000	99,862	2021/11/30
大阪市	公募（15年）第 1 回		1.753	100,000	114,489	2026/ 7 /17
大阪市	公募（20年）第 5 回		2.47	100,000	124,143	2028/ 9 /21
大阪市	公募（20年）第 6 回		2.21	100,000	121,560	2028/12/20
大阪市	公募（20年）第17回		1.721	100,000	117,377	2032/12/21
名古屋市	公募第464回		1.61	300,000	306,957	2018/ 9 /20
名古屋市	公募第469回		1.34	100,000	103,565	2019/12/20
名古屋市	公募第478回		1.063	100,000	105,121	2022/ 3 /18
名古屋市	公募第481回		0.744	100,000	104,080	2022/12/20
名古屋市	公募第488回		0.598	300,000	310,968	2024/ 9 /20
名古屋市	公募（ 6 年）第 1 回		0.283	200,000	200,604	2018/ 6 /20
名古屋市	公募（12年）第 1 回		1.033	200,000	214,622	2025/ 6 /20
名古屋市	公募（15年）第 2 回		0.905	100,000	106,383	2029/11/16
京都市	公募平成20年度第 4 回		1.54	200,000	205,764	2019/ 2 /26
京都市	公募平成23年度第 4 回		1.067	100,000	104,895	2021/12/22
京都市	公募平成25年度第 3 回		0.312	100,000	100,412	2018/ 9 /27
京都市	公募（20年）第 2 回		2.12	100,000	116,579	2025/ 9 /19
京都市	公募（20年）第13回		1.359	100,000	111,399	2034/11/24
神戸市	公募平成21年度第 7 回		1.69	100,000	103,686	2019/ 6 /20
神戸市	公募平成26年度第17回		0.28	300,000	303,720	2025/ 1 /27
神戸市	公募平成28年度第 1 回		0.08	200,000	198,394	2026/ 4 /17
横浜市	公募平成20年度第 3 回		1.56	100,000	102,191	2018/ 9 / 7
横浜市	公募公債平成20年度 5 回		1.58	200,000	205,338	2018/12/20
横浜市	公募平成21年度第 4 回		1.35	200,000	206,526	2019/ 9 /20
横浜市	公募平成22年度第 5 回		1.265	100,000	104,563	2020/12/11
横浜市	公募公債平成24年度 2 回		0.815	200,000	208,698	2022/10/17
横浜市	公募公債平成25年度 1 回		0.664	200,000	207,628	2023/ 5 /19
横浜市	公募公債平成25年度 5 回		0.655	200,000	207,862	2023/11/17
横浜市	公募公債平成26年度 5 回		0.471	200,000	205,436	2024/12/13
横浜市	公募平成28年度第 5 回		0.23	300,000	300,723	2027/ 2 /19
横浜市	公募（20年）第26回		1.776	100,000	118,201	2033/ 1 /28
横浜市	公募（20年）第30回		1.376	100,000	111,693	2034/10/20
札幌市	公募平成22年度第 4 回		1.05	100,000	103,280	2020/ 6 /19
札幌市	公募（20年）平成24年度第11回		1.794	100,000	118,468	2033/ 2 /28
札幌市	公募平成26年度第 4 回		0.54	100,000	103,266	2024/ 6 /20
札幌市	公募平成26年度第 9 回		0.43	200,000	204,822	2024/12/20
川崎市	公募第81回		1.57	100,000	103,032	2019/ 3 /20
川崎市	公募第82回		1.52	100,000	103,683	2019/ 9 /20
川崎市	公募第85回		0.72	100,000	103,943	2022/12/20
川崎市	公募（20年）第17回		1.527	100,000	114,279	2033/ 5 / 9
北九州市	公募（ 5 年）平成25年度第 2 回		0.312	100,000	100,412	2018/ 9 /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	
北九州市	公募（20年）第14回	1.732	100,000	117,512	2032/11/12
福岡市	公募平成20年度第3回	1.52	100,000	101,814	2018/6/20
福岡市	公募（5年）平成25年度第2回	0.35	300,000	301,242	2018/7/25
福岡市	公募平成26年度第2回	1.49	100,000	113,610	2034/6/20
福岡市	公募平成26年度第5回	0.539	100,000	103,263	2024/10/28
福岡市	公募平成26年度第8回	0.465	160,000	164,364	2025/3/25
広島市	公募平成21年度第3回	1.34	100,000	103,582	2019/12/25
広島市	公募平成26年度第2回	0.456	100,000	102,654	2024/12/25
広島市	公募平成27年度第2回	0.464	500,000	513,540	2025/12/25
仙台市	公募平成25年度第1回	0.24	600,000	602,304	2019/1/29
千葉市	公募平成24度第1回	1.05	100,000	105,163	2022/4/25
三重県	公募平成24年度第1回	0.801	140,660	146,691	2022/10/25
鹿児島県	公募（5年）平成25年度第1回	0.24	100,000	100,327	2018/10/31
鹿児島県	公募（5年）平成28年度第1回	0.001	100,000	99,864	2021/10/29
福井県	公募平成24年度第4回	0.46	100,000	102,541	2023/4/26
福井県	公募平成27年度第4回	0.085	200,000	198,478	2026/4/27
徳島県	公募平成22年度第1回	1.05	400,000	414,952	2020/11/30
山梨県	公募平成21年度第1回	1.37	100,000	103,459	2019/10/30
山梨県	公募平成24年度第1回	0.8	200,000	208,578	2022/10/28
岡山県	公募平成21年度第2回	1.39	100,000	104,076	2020/3/31
愛知県・名古屋半保証名古屋高速道路債券	第96回	2.34	100,000	121,247	2028/12/20
愛知県・名古屋半保証名古屋高速道路債券	第102回	2.298	300,000	365,370	2029/12/20
福岡北九州高速道路債券	第117回	2.26	100,000	119,886	2028/12/20
小	計		51,562,340	54,040,358	
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	210,702	2020/7/15
公営企業債券	政府保証第886回	1.8	203,000	207,504	2018/6/19
公営企業債券	政府保証15年第1回	1.6	300,000	315,744	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	410,580	2018/11/16
地方公共団体金融機構債券	政府保証第5回	1.2	200,000	206,252	2019/10/18
地方公共団体金融機構債券	政府保証第16回	1.0	100,000	103,547	2020/9/14
政保	地方公共団体金融機構債券 第38回	0.839	194,000	202,879	2022/7/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第39回	0.801	100,000	104,447	2022/8/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第40回	0.819	101,000	105,663	2022/9/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第41回	0.791	102,000	106,626	2022/10/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第42回	0.805	108,000	113,050	2022/11/14
政保	地方公共団体金融機構債券 第43回	0.734	202,000	210,770	2022/12/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第44回	0.834	145,000	152,261	2023/1/20
政保	地方公共団体金融機構債券 第45回	0.815	223,000	234,085	2023/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第49回	0.882	13,000	13,724	2023/6/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第50回	0.911	100,000	105,790	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	302,847	2019/7/24
政保	地方公共団体金融機構債券 第59回	0.669	116,000	121,287	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	302,163	2020/6/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第64回	0.544	100,000	103,669	2024/9/13
政保	地方公共団体金融機構債券 第65回	0.539	400,000	414,548	2024/10/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第69回	0.414	320,000	328,630	2025/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第72回	0.509	189,000	195,571	2025/5/23

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	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回		0.381	509,000	521,246	2025/11/18
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回		0.02	116,000	115,063	2026/4/17
日本政策金融公庫債券 政府保証第22回		0.243	2,000,000	2,008,300	2018/10/26
新関西国際空港債券 政府保証第1回		0.801	151,000	157,761	2022/8/29
新関西国際空港債券 政府保証第2回		0.882	191,000	201,690	2023/6/27
原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第3回		0.117	2,100,000	2,103,255	2018/5/23
日本政策投資銀行債券 政府保証第22回		2.2	100,000	113,782	2023/6/19
日本政策投資銀行社債 政府保証第5回		1.4	100,000	102,909	2019/4/15
日本政策投資銀行社債 政府保証第9回		1.0	141,000	146,001	2020/9/14
日本政策投資銀行社債 政府保証第16回		0.819	102,000	106,719	2022/9/20
日本政策投資銀行社債 政府保証第19回		0.668	140,000	145,784	2023/3/15
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6回		1.9	100,000	107,534	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	107,682	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58回		1.7	136,000	138,721	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	289,418	2018/6/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第62回		1.7	100,000	102,294	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	349,770	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	102,700	2018/11/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第71回		1.4	100,000	102,475	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	243,512	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	243,726	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	311,289	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	246,198	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	416,628	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	244,222	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	239,486	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	126,499	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	462,928	2021/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回		1.0	140,000	146,704	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	104,480	2022/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回		0.9	140,000	146,372	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	121,182	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	104,610	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	116,646	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	227,772	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	115,590	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	369,732	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	209,300	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	209,130	2022/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回		0.734	200,000	208,740	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	900,000	945,333	2023/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回		1.726	100,000	118,083	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	202,683	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	415,288	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	211,210	2023/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回		0.835	272,000	286,663	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	314,022	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	143,107	2024/2/29

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213回	0.645		145,000	151,382	2024/ 3 /29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第216回	1.483		100,000	114,103	2034/ 4 /28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第217回	1.72		100,000	118,936	2044/ 5 /31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第219回	1.478		100,000	114,004	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	104,401	2024/ 6 /28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第224回	1.72		100,000	118,842	2044/ 8 /31
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	197,176	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	103,129	2024/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第239回	1.16		300,000	326,382	2035/ 2 /28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第271回	0.02		151,000	149,787	2026/ 3 /31
首都高速道路債券	政府保証第 8 回	1.3		100,000	103,723	2020/ 1 /20
阪神高速道路債券	政府保証第 5 回	1.3		100,000	103,930	2020/ 3 /18
民間都市開発推進機構	政府保証第16回	0.699		360,000	376,495	2023/10/20
中部国際空港債券	政府保証第18回	0.668		368,000	383,260	2023/ 3 /22
預金保険機構債券	政府保証第209回	0.1		2,000,000	2,009,240	2020/12/11
新関西国際空港社債	財投機関債第12回	1.067		100,000	108,182	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	101,239	2019/ 6 /20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第31回	0.781		300,000	311,631	2022/ 9 /20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第47回	1.027		100,000	107,706	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	131,950	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	240,178	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17回	2.35		100,000	120,094	2026/ 9 /18
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	242,748	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	290,516	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	102,260	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	122,755	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	124,044	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	104,901	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	418,812	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	208,652	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	116,791	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	103,666	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	407,669	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	118,952	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	301,125	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	206,596	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	206,152	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136回	0.583		200,000	206,706	2024/ 9 /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	334,092	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	113,310	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	81,507	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	136,581	2034/ 6 /20
公営企業債券	30年第 4 回財投機関債	2.95		100,000	136,945	2034/ 3 /24
地方公営企業等金融機構債券	第 1 回	1.77		200,000	205,204	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	119,636	2028/12/20
地方公共団体金融機構債券	第 1 回	1.648		100,000	103,663	2019/ 6 /28
地方公共団体金融機構債券	第 2 回	1.406		100,000	103,227	2019/ 7 /26
地方公共団体金融機構債券	20年第 4 回	2.12		100,000	121,143	2029/12/28

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	20年第6回	2.242	300,000	368,901	2030/3/28
地方公共団体金融機構債券	F24回	1.681	100,000	109,695	2023/3/17
地方公共団体金融機構債券	第13回	1.278	200,000	208,142	2020/6/26
地方公共団体金融機構債券	第16回	1.164	100,000	103,997	2020/9/28
地方公共団体金融機構債券	第27回	1.034	300,000	313,119	2021/8/27
地方公共団体金融機構債券	第28回	1.048	100,000	104,522	2021/9/28
地方公共団体金融機構債券	F104回	1.314	100,000	109,171	2025/3/7
地方公共団体金融機構債券	F106回	1.259	100,000	108,132	2024/3/19
地方公共団体金融機構債券	第37回	0.852	400,000	416,344	2022/6/28
地方公共団体金融機構債券	第41回	0.801	600,000	624,372	2022/10/28
地方公共団体金融機構債券	F142回	1.016	100,000	106,683	2024/11/28
地方公共団体金融機構債券	F144回	0.562	200,000	203,876	2020/10/28
地方公共団体金融機構債券	F145回	1.059	200,000	214,398	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券	第42回	0.801	100,000	104,124	2022/11/28
地方公共団体金融機構債券	第44回	0.791	100,000	104,319	2023/1/27
地方公共団体金融機構債券	F160回	1.052	100,000	107,875	2028/5/26
地方公共団体金融機構債券	第51回	0.841	600,000	629,718	2023/8/28
地方公共団体金融機構債券	第52回	0.801	300,000	315,624	2023/9/15
地方公共団体金融機構債券	(15年) 第2回	1.161	200,000	218,536	2028/12/28
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第38回	1.487	100,000	113,371	2034/7/28
地方公共団体金融機構債券	第64回	0.574	100,000	103,295	2024/9/27
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第39回	1.425	100,000	112,336	2034/9/28
地方公共団体金融機構債券	第79回	0.484	100,000	102,615	2025/12/26
公営企業債券 (20年) 第2回財投機関債		1.45	100,000	107,868	2022/12/20
公営企業債券 (20年) 第5回財投機関債		2.11	200,000	226,370	2023/9/20
公営企業債券 (20年) 第25回財投機関債		2.5	100,000	123,814	2028/6/20
首都高速道路社債 第12回		0.293	100,000	100,460	2018/12/20
首都高速道路社債 第13回		0.223	100,000	100,489	2019/9/20
首都高速道路 第17回		0.03	200,000	199,830	2021/6/18
阪神高速道路 第13回		0.18	100,000	100,383	2019/9/20
阪神高速道路 第15回		0.01	200,000	199,890	2019/12/20
都市再生債券 財投機関債第21回		1.72	300,000	307,512	2018/9/20
都市再生債券 財投機関債第55回		1.074	100,000	104,608	2021/9/17
都市再生債券 財投機関債第97回		1.017	100,000	107,587	2029/9/20
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回		2.26	100,000	117,148	2025/6/20
東京交通債券 第342回		2.4	200,000	223,796	2022/6/21
東京交通債券 第347回		2.05	157,000	177,420	2024/3/8
関西国際空港社債 財投機関債第26回		1.156	300,000	311,706	2020/9/18
関西国際空港社債 財投機関債第32回		1.164	100,000	104,915	2021/9/17
福祉医療機構債券 第31回財投機関債		0.93	100,000	104,475	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	240,034	2027/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回		2.15	100,000	113,443	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	308,553	2018/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第41回		1.5	100,000	104,042	2019/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回		1.94	100,000	114,140	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	119,710	2030/10/22
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回		1.256	100,000	105,163	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	121,577	2031/6/13

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	
住宅金融支援機構債券	財投機関債第77回	1.751	300,000	342,591	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	121,471	2031/7/11
住宅金融支援機構債券	財投機関債第79回	1.069	100,000	104,585	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	208,966	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	226,492	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	128,324	2042/9/19
成田国際空港	第13回一般担保付	0.802	200,000	208,214	2023/2/8
成田国際空港	第17回	0.489	200,000	204,570	2025/2/20
沖縄振興開発金融公庫債券	財投機関債第17回	1.208	100,000	104,961	2021/6/18
国際協力機構債券	第6回財投機関債	2.098	100,000	121,742	2030/12/13
東日本高速道路	第21回	0.58	100,000	100,684	2018/6/20
東日本高速道路	第26回	0.305	100,000	100,621	2019/6/20
東日本高速道路	第27回	0.248	100,000	100,495	2019/6/20
東日本高速道路	第34回	0.225	100,000	100,692	2021/3/19
東日本高速道路	第36回	0.06	200,000	200,082	2021/6/18
中日本高速道路社債	第32回	0.64	200,000	201,824	2018/9/20
中日本高速道路社債	第44回	0.536	100,000	101,263	2019/9/20
中日本高速道路社債	第61回	0.262	100,000	100,735	2020/6/2
中日本高速道路	第62回	0.225	200,000	201,350	2020/9/18
中日本高速道路	第63回	0.576	100,000	102,968	2025/11/13
中日本高速道路	第66回	0.03	1,200,000	1,198,356	2021/9/28
西日本高速道路	第20回	0.759	200,000	208,210	2023/9/20
西日本高速道路	第23回	0.602	100,000	103,229	2024/6/20
西日本高速道路	第30回	0.17	300,000	297,984	2026/5/22
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第35回	1.165	200,000	207,938	2020/9/18
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第68回	0.586	200,000	206,788	2024/8/5
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第69回	1.441	100,000	112,664	2034/8/4
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第97回	0.001	100,000	99,972	2019/3/20
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券		1.94	13,440	13,866	2037/6/10
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券		1.69	45,801	47,296	2038/9/10
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券		1.8	81,945	85,198	2039/6/10
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券		1.43	83,868	85,875	2038/2/10
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券		1.76	52,158	54,570	2036/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券		2.34	61,452	65,578	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券		2.25	18,325	19,512	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券		1.84	41,154	43,164	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	46,364	49,150	2041/3/10
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券		1.69	50,061	51,952	2039/2/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券		1.69	90,628	94,615	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券		2.12	87,980	92,610	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券		2.3	79,412	84,809	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券		1.99	138,810	147,180	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券		2.14	22,659	24,066	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	33,458	36,382	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	113,058	121,397	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	28,543	29,657	2032/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券		1.43	120,064	126,219	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	58,202	60,618	2032/11/10

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45回住宅金融支援機構債券		1.79	152,103	162,167	2046/2/10
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券		1.51	110,322	116,448	2046/9/10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券		2.34	62,494	67,855	2044/5/10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券		1.89	146,406	156,812	2046/5/10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券		1.36	154,830	161,871	2045/9/10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券		1.21	198,186	206,834	2047/7/10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券		1.34	195,882	205,480	2047/5/10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券		1.26	127,690	133,572	2047/6/10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券		1.64	52,507	55,691	2046/8/10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券		1.6	117,432	124,443	2045/12/10
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券		1.07	66,396	68,943	2048/12/10
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券		1.07	140,256	145,709	2049/2/10
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券		1.08	67,085	69,663	2048/5/10
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券		1.87	35,320	36,907	2039/9/10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券		1.25	195,447	204,674	2048/3/10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券		1.88	41,515	44,377	2045/2/10
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券		1.86	43,358	46,311	2045/3/10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券		1.87	44,361	47,283	2045/4/10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券		1.85	51,092	54,607	2046/3/10
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券		1.41	128,068	134,815	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券		1.42	186,213	196,074	2047/1/10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券		1.44	62,083	65,421	2047/2/10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券		1.21	125,380	131,084	2048/9/10
貸付債権担保 S 種第 3 回住宅金融公庫債券		1.82	17,102	17,911	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	129,935	134,693	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	52,774	54,646	2032/5/10
貸付債権担保第 1 回住宅金融公庫債券		1.75	22,828	23,165	2036/3/10
貸付債権担保第 7 回住宅金融公庫債券		1.82	48,280	49,234	2037/8/10
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券		2.25	121,552	131,567	2044/4/10
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券		1.82	119,910	127,903	2045/1/10
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券		1.52	246,815	259,706	2045/8/10
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券		1.4	128,676	135,407	2047/3/10
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券		1.16	208,998	217,614	2047/9/10
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券		1.07	192,726	199,997	2048/4/10
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券		1.3	143,350	150,768	2048/6/10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券		1.26	124,938	130,973	2048/8/10
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券		1.04	294,264	305,172	2049/4/10
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券		1.01	513,716	532,040	2049/5/10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券		0.93	75,543	77,884	2049/9/10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券		0.95	77,932	80,445	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券		0.87	78,578	80,736	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券		0.74	162,396	165,872	2050/1/10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券		0.6	166,394	168,387	2050/2/10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券		0.8	86,007	88,191	2050/3/10
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券		0.74	88,806	90,718	2050/5/10
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券		0.83	263,673	270,947	2050/6/10
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券		0.9	268,254	276,867	2050/7/10
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券		0.88	179,340	184,833	2050/8/10

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100回住宅金融支援機構債券		0.84	89,604	92,082	2050/9/10
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券		0.89	90,080	92,888	2050/10/10
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券		0.41	297,159	296,329	2051/12/10
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券		0.48	198,766	199,398	2052/1/10
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券		0.46	199,550	199,761	2052/2/10
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券		0.47	100,000	100,279	2052/3/10
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券		0.46	200,000	200,328	2052/4/10
フランス預金供託公庫 第4回円貨債券 (2014)		0.725	100,000	102,114	2024/7/30
韓国産業銀行 第45回円貨社債 (2014)		0.69	100,000	100,520	2019/1/29
小計			50,049,754	52,856,056	
金融債券					
農林債券 利付第756回い号		0.3	100,000	100,314	2018/5/25
農林債券 利付第759回い号		0.4	100,000	100,526	2018/8/27
農林債券 利付第760回い号		0.4	100,000	100,558	2018/9/27
農林債券 利付第761回い号		0.3	100,000	100,434	2018/10/26
農林債券 利付第764回い号		0.35	100,000	100,600	2019/1/25
農林債券 利付第765回い号		0.3	300,000	301,605	2019/2/27
農林債券 利付第767回い号		0.3	300,000	301,707	2019/4/26
農林債券 利付第773回い号		0.24	300,000	301,656	2019/10/25
農林債券 利付第777回い号		0.25	300,000	301,962	2020/2/27
農林債券 利付第781回い号		0.28	100,000	100,743	2020/6/26
しんきん中金債券 利付第284回		0.4	100,000	100,495	2018/7/27
しんきん中金債券 利付第286回		0.35	100,000	100,484	2018/9/27
しんきん中金債券 利付第287回		0.3	100,000	100,434	2018/10/26
しんきん中金債券 利付第290回		0.3	100,000	100,509	2019/1/25
しんきん中金債券 利付第302回		0.2	100,000	100,494	2020/1/27
しんきん中金債券 利付第308回		0.25	100,000	100,663	2020/7/27
しんきん中金債券 利付第316回		0.07	100,000	100,079	2021/3/26
しんきん中金債券 利付第317回		0.06	300,000	299,937	2021/4/27
商工債券 利付(3年)第202回		0.01	1,100,000	1,099,560	2019/11/27
商工債券 利付(3年)第203回		0.02	1,100,000	1,099,846	2019/12/27
小計			5,000,000	5,012,606	
普通社債券(含む投資法人債券)					
東京電力 第455回		2.075	200,000	205,642	2018/10/23
東京電力 第459回		2.7	100,000	104,422	2019/1/29
東京電力 第544回		1.976	100,000	102,113	2018/6/25
東京電力 第547回		1.948	100,000	105,289	2020/7/24
東京電力 第548回		2.347	100,000	114,063	2028/9/29
東京電力 第559回		1.377	100,000	102,745	2019/10/29
東京電力 第560回		2.114	100,000	111,845	2029/12/10
東京電力 第565回		1.313	300,000	309,384	2020/6/24
中部電力 第482回		2.17	200,000	209,258	2019/6/25
中部電力 第500回		0.875	200,000	208,486	2024/5/24
関西電力 第448回		2.16	200,000	205,028	2018/6/20
関西電力 第469回		1.7	100,000	102,493	2018/10/25
関西電力 第482回		1.189	100,000	103,325	2020/7/24
関西電力 第484回		0.976	100,000	102,801	2020/10/23
関西電力 第496回		0.908	100,000	103,853	2025/2/25

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	
関西電力 第497回		1.002	200,000	209,350	2025/6/20
関西電力 第498回		0.416	200,000	201,592	2020/9/18
中国電力 第330回		2.1	100,000	107,659	2021/3/25
中国電力 第377回		1.121	200,000	211,108	2023/8/25
中国電力 第378回		1.004	100,000	104,908	2023/10/25
北陸電力 第301回		1.158	100,000	105,568	2023/3/24
北陸電力 第304回		0.989	100,000	104,811	2023/10/25
北陸電力 第307回		1.055	100,000	106,117	2026/6/25
北陸電力 第308回		0.769	100,000	103,434	2024/9/25
東北電力 第473回		0.597	100,000	101,641	2021/4/23
東北電力 第475回		0.809	100,000	103,462	2024/9/25
東北電力 第481回		0.803	200,000	206,998	2025/7/25
四国電力 第281回		1.111	200,000	211,330	2023/9/25
九州電力 第400回		1.777	100,000	104,885	2020/4/24
九州電力 第409回		1.483	100,000	103,208	2019/8/23
九州電力 第424回		1.233	200,000	211,962	2023/11/24
北海道電力 第296回		2.027	100,000	102,403	2018/6/25
北海道電力 第316回		1.164	207,000	213,619	2020/6/25
北海道電力 第323回		1.337	100,000	108,864	2030/3/25
北海道電力 第338回		0.84	100,000	97,770	2036/11/25
東京電力パワーグリッド 第1回		0.38	100,000	99,944	2020/3/9
東京電力パワーグリッド 第2回		0.58	100,000	99,918	2022/3/9
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付		1.293	100,000	104,422	2021/3/19
清水建設 第18回社債間限定同順位特約付		0.947	100,000	101,685	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	101,116	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	104,186	2024/5/8
アサヒグループホールディングス 第7回特定社債間限定同順位特約付		0.237	100,000	100,417	2020/5/28
アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特約付		0.348	100,000	100,770	2022/5/27
麒麟ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付		0.603	200,000	204,086	2025/2/28
味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付		0.19	200,000	199,930	2024/3/8
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付		0.714	100,000	102,840	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	102,938	2025/5/30
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付		0.34	200,000	196,010	2026/8/28
森ビル 第13回社債間限定同順位特約付		0.466	100,000	100,925	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	103,042	2024/7/29
セブン&アイ・ホールディングス 第3回社債間限定同順位特約付		1.94	100,000	102,336	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	101,184	2021/9/3
住友化学 第43回社債間限定同順位特約付		1.58	100,000	104,395	2020/4/23
クレハ 第5回社債間限定同順位特約付		0.302	100,000	100,490	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	100,242	2020/9/3
三菱ケミカルホールディングス 第14回社債間限定同順位特約付		0.482	200,000	202,728	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	100,436	2019/6/4
花王 第4回特定社債間限定同順位特約付		0.624	100,000	101,601	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	102,002	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	104,269	2023/9/15
JXホールディングス 第9回社債間限定同順位特約付		0.82	100,000	103,306	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	100,879	2021/10/29
ブリヂストン 第8回社債間限定同順位特約付		0.249	200,000	200,746	2019/9/26

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	
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付		0.755	100,000	102,982	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	100,547	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	99,587	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	100,158	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	102,028	2024/9/19
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付		0.3	200,000	200,230	2027/3/1
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付		0.234	100,000	100,392	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	100,421	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	218,526	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	101,191	2021/6/4
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付		0.956	100,000	103,913	2022/9/20
富士通 第34回社債間限定同順位特約付		0.644	100,000	101,796	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	103,817	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	201,524	2020/3/19
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付		0.3	100,000	99,919	2023/9/20
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付		0.47	100,000	99,700	2026/9/18
ソニー 第26回		2.068	100,000	104,259	2019/6/20
ソニー 第32回		0.28	200,000	199,618	2023/9/20
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付		0.877	100,000	104,264	2023/9/4
明治安田生命2014基金特定目的会社 第1回特定社債		0.51	300,000	301,272	2019/8/7
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付		0.963	100,000	104,935	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	102,119	2025/2/26
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付		0.39	100,000	99,730	2024/3/21
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付		0.652	100,000	102,157	2022/3/14
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付		1.358	100,000	104,445	2020/12/18
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付		1.378	200,000	209,362	2021/6/4
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付		0.436	100,000	100,616	2021/7/23
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付		1.014	100,000	104,687	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	208,364	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	106,899	2029/7/13
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付		1.117	100,000	103,954	2022/4/20
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付		1.286	100,000	105,553	2029/1/29
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無		1.657	100,000	103,621	2019/7/29
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付		0.451	200,000	201,710	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	100,185	2019/6/4
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付		0.543	200,000	201,326	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	102,143	2024/4/24
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付		0.884	100,000	101,978	2024/6/18
イオン 第16回社債間限定同順位特約付		1.01	100,000	101,331	2018/11/21
あおぞら銀行 第10回社債間限定同順位特約付		0.1	100,000	99,988	2020/3/17
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	103,088	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	205,264	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	122,707	2027/7/27
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付		2.5	100,000	105,088	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	107,757	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	111,726	2022/10/27
三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付		1.035	100,000	103,483	2020/10/15
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	307,125	2024/9/12

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	
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	102,625	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	106,359	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	105,739	2019/6/20
りそな銀行	第6回劣後特約付	2.084	300,000	316,359	2020/3/4
三菱UFJ信託銀行	第9回劣後特約付	1.68	100,000	105,916	2021/4/28
三井住友信託銀行	第1回劣後特約付	1.389	300,000	317,130	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	100,519	2019/4/26
セブン銀行	第10回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	103,910	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	102,416	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	205,854	2024/7/16
三井住友銀行	第24回劣後特約付	1.6	100,000	105,763	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	100,495	2019/1/25
みずほ銀行	第38回特定社債間限定同順位特約付	0.24	1,000,000	1,005,710	2019/10/30
興銀リース	第4回社債間限定同順位特約付	0.36	100,000	100,463	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	100,381	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	100,371	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	100,358	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	100,289	2021/12/3
オリエントコーポレーション	第2回社債間限定同順位特約付	0.45	200,000	200,200	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	101,029	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	100,117	2019/12/20
日立キャピタル	第57回社債間限定同順位特約付	0.616	100,000	101,519	2024/12/20
オリックス	第164回社債間限定同順位特約付	1.146	100,000	102,339	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	100,525	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	100,322	2020/5/28
三菱UFJリース	第30回社債間限定同順位特約付	0.426	100,000	100,937	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	100,599	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	100,676	2020/8/12
大和証券グループ本社	第23回社債間限定同順位特約付	0.909	100,000	102,437	2025/8/12
野村ホールディングス	第21回	1.86	100,000	105,154	2020/3/17
野村ホールディングス	第41回	0.783	200,000	201,722	2018/6/20
日本取引所グループ	第1回社債間限定同順位特約付 特定投資家	0.355	100,000	100,190	2027/3/16
三井不動産	第34回社債間限定同順位特約付	2.085	100,000	104,009	2019/3/20
三菱地所	第56回担保提供制限等財務上特約無	2.42	100,000	111,347	2022/6/20
三菱地所	第98回担保提供制限等財務上特約無	1.165	100,000	103,336	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	101,157	2019/9/13
三菱地所	第111回担保提供制限等財務上特約無	0.929	100,000	103,755	2022/9/14
東京建物	第17回社債間限定同順位特約付	1.3	100,000	102,896	2020/3/18
東京建物	第25回社債間限定同順位特約付	0.52	100,000	99,764	2027/3/19
住友不動産	第95回社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	103,570	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	206,110	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	102,306	2024/9/9
エス・ティ・ティ都市開発	第10回社債間限定同順位特約付	1.03	100,000	102,824	2020/9/18
日本ビルファンド投資法人	第13回特定投資法人債間限定同順位	1.168	100,000	104,214	2023/6/26
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	第5回特定投資法人債	0.871	100,000	101,721	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	216,656	2025/10/23
東京急行電鉄	第75回社債間限定同順位特約付	0.982	100,000	104,137	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	108,741	2033/6/3

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	
小田急電鉄	第68回社債間限定同順位特約付	1.098	200,000	213,246	2030/6/12
東日本旅客鉄道	第15回	2.65	100,000	108,833	2020/8/25
東日本旅客鉄道	第19回社債間限定同順位特約付	2.36	200,000	222,182	2022/2/25
東日本旅客鉄道	第58回社債間限定同順位特約付	1.58	200,000	206,208	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	119,347	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	108,742	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	120,869	2027/12/20
西日本旅客鉄道	第31回社債間限定同順位特約付	1.408	100,000	105,238	2021/2/26
東海旅客鉄道	第16回社債間限定同順位特約付	1.875	100,000	104,574	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	245,888	2030/4/23
東海旅客鉄道	第70回社債間限定同順位特約付	1.309	100,000	111,239	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	115,218	2045/3/6
西武ホールディングス	第1回社債間限定同順位特約付	0.758	200,000	201,290	2032/3/17
名古屋鉄道	第50回社債間限定同順位特約付	0.857	100,000	104,349	2027/4/30
日本通運	第11回社債間限定同順位特約付	0.2	100,000	98,490	2026/7/14
日本通運	第12回社債間限定同順位特約付	0.7	100,000	95,988	2036/7/14
日本梱包運輸倉庫	第4回社債間限定同順位特約付	0.324	100,000	100,449	2018/12/20
横浜高速鉄道	第2回社債間限定同順位特約付	0.455	100,000	99,730	2027/2/23
ANAホールディングス	第32回社債間限定同順位特約付	0.99	100,000	96,708	2036/6/9
三菱倉庫	第14回	0.442	100,000	101,083	2021/3/12
住友倉庫	第1回社債間限定同順位特約付	0.279	200,000	200,784	2019/3/14
日本電信電話	第60回	1.31	100,000	104,424	2020/12/18
KDDI	第20回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	103,092	2023/12/20
NTTドコモ	第15回社債間限定同順位特約付	1.96	100,000	102,373	2018/6/20
電源開発	第31回社債間限定同順位特約付	1.155	100,000	103,504	2020/9/18
電源開発	第37回社債間限定同順位特約付	1.035	100,000	103,668	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	104,439	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	104,253	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	103,462	2024/8/20
東京瓦斯	第17回社債間限定同順位特約付	2.625	100,000	103,136	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	120,997	2043/12/17
東邦瓦斯	第31回社債間限定同順位特約付	2.06	100,000	109,306	2022/3/18
東京都競馬	第2回社債間限定同順位特約付	0.572	200,000	201,212	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	101,116	2022/12/16
クレディ・アグリコル・エス・エー	第6回円貨社債(2014)	0.865	100,000	101,258	2024/11/28
ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング	第2回円貨社債	0.345	200,000	199,802	2019/6/27
マラヤン・バンキング・ベルハッド	第2回円貨社債	0.509	200,000	196,052	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	99,778	2020/6/5
スタンダード・チャータード	第3回円貨社債(2015)	1.043	100,000	96,957	2025/6/5
エイチエスピーシー・ホールディングス・ビーエルシー	第2回円	0.842	100,000	100,105	2023/9/26
エイチエスピーシー・ホールディングス・ビーエルシー	第3回円	1.207	100,000	101,497	2026/9/25
エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション	第12回	2.54	100,000	107,060	2021/2/16
ルノー	第17回円貨社債(2015)	0.75	300,000	302,574	2018/11/26
パークレイズ・バンク・ビーエルシー	第7回円貨社債	0.478	100,000	99,927	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	200,398	2020/1/16
オーストラリア・ニュージーランド銀行	第10回円貨社債	0.293	200,000	199,524	2024/1/23
ラボバンク・ネダーランド	第23回円貨社債(2013)(コー	0.557	100,000	100,365	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	100,165	2019/5/22

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) ソシエテ ジェネラル 第6回円貨社債 (2014)	% 0.552	千円 200,000	千円 200,718	2019/6/13
小 計		27,107,000	27,962,347	
合 計		632,303,094	684,686,981	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 684,686,981	% 98.9
コール・ローン等、その他	7,327,867	1.1
投資信託財産総額	692,014,848	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 (2017年3月31日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	692,014,848,132
コール・ローン等	3,980,279,468
公社債(評価額)	684,686,981,163
未収入金	2,428,555,800
未収利息	907,072,393
前払費用	11,959,308
(B) 負債	4,028,310,985
未払金	2,909,856,000
未払解約金	1,118,448,600
未払利息	6,385
(C) 純資産総額(A－B)	687,986,537,147
元本	529,579,862,968
次期繰越損益金	158,406,674,179
(D) 受益権総口数	529,579,862,968口
1万口当たり基準価額(C／D)	12,991円

(注) 期首元本額は499,328,368,105円、期中追加設定元本額は86,855,218,642円、期中一部解約元本額は56,603,723,779円、1口当たり純資産額は1.2991円です。

○損益の状況 (2016年4月1日～2017年3月31日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	6,359,909,485
受取利息	6,361,688,148
支払利息	△ 1,778,663
(B) 有価証券売買損益	△ 14,363,745,365
売買益	195,131,094
売買損	△ 14,558,876,459
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 8,003,835,880
(D) 前期繰越損益金	156,845,852,941
(E) 追加信託差損益金	27,729,068,802
(F) 解約差損益金	△ 18,164,411,684
(G) 計(C＋D＋E＋F)	158,406,674,179
次期繰越損益金(G)	158,406,674,179

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	279,442,486,108
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)	42,674,764,391
マイ・ロード	34,734,526,525
マイバランス50(確定拠出年金向け)	19,053,036,144
野村世界6資産分散投信(分配コース)	18,799,177,271
野村世界6資産分散投信(安定コース)	18,776,125,783
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	14,368,441,567
マイバランス30(確定拠出年金向け)	12,838,199,051
のむラップ・ファンド(保守型)	10,062,134,648
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	9,036,441,388
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,466,851,659
マイバランスDC30	7,420,128,557
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)	7,278,712,341
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	7,134,100,901
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	5,526,922,361
マイバランスDC50	4,988,221,006
のむラップ・ファンド(普通型)	4,328,550,112
野村世界6資産分散投信(成長コース)	2,580,836,266
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)	2,064,493,416
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,781,995,566
野村円債投資インデックスファンド	1,751,889,740

ファンド名	当期末
	元本額
	円
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）	1,733,623,187
野村インデックスファンド・国内債券	1,673,194,174
マイバランスDC70	1,491,798,276
野村日本債券インデックスファンド	1,210,745,413
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）	1,070,268,432
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）	939,535,756
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）	900,399,076
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	883,710,078
のむらっぴ・ファンド（積極型）	717,349,966
ノムラF0Fs用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）	639,052,414
野村世界6資産分散投資（配分変更コース）	583,472,423
野村資産設計ファンド2015	482,549,118
野村国内債券インデックスファンド	422,027,603
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）	394,183,998
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）	394,129,328
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）	374,875,808
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）	368,439,571
ファンドラップ（ウェルス・スクエア）債券・安定型	339,213,201
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	332,360,772
野村資産設計ファンド2020	327,370,484
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）	269,378,588
野村資産設計ファンド2025	247,548,712
野村資産設計ファンド2040	155,771,659
野村資産設計ファンド2030	146,349,005
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	94,027,920
野村資産設計ファンド2035	79,082,251
野村ターゲットブライズ「日経225」（国内債券運用移行型）	47,593,942
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）	35,027,278
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）	26,504,432
野村時間分散投資「日経225・国内債券」（限定追加型）	21,255,342
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）	18,421,585
野村資産設計ファンド2045	12,273,247
野村資産設計ファンド2050	10,951,269
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	7,863,309
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	6,448,977
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	5,820,170
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	3,600,599
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	1,530,394
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	1,048,876
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	884,802
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	687,909
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	538,561
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	413,214
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	312,339
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	194,709

〇お知らせ

- ①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＞
- ②スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って
 評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。
 ＜変更適用日：2017年3月31日＞

外国債券マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日2017年5月10日）

作成対象期間（2016年5月11日～2017年5月10日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1

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

○最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
		期 騰 落 中 率		期 騰 落 中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
16期(2017年 5 月10日)	22,009	1.3	223.71	1.6	99.0	—	664,754

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* ベンチマーク（＝シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））は、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。
* シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（為替ヘッジを行わない円ベースの指数）です。シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
(出所) Citigroup Index LLC

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2016年 5 月10日	21,725	—	220.26	—	99.0	—
5 月末	22,003	1.3	223.46	1.5	99.0	—
6 月末	20,789	△4.3	210.22	△4.6	99.0	—
7 月末	21,130	△2.7	215.10	△2.3	98.9	—
8 月末	20,978	△3.4	212.03	△3.7	99.0	—
9 月末	20,577	△5.3	210.00	△4.7	99.0	—
10月末	20,610	△5.1	209.77	△4.8	99.0	—
11月末	21,435	△1.3	218.09	△1.0	99.1	—
12月末	22,103	1.7	223.73	1.6	99.0	—
2017年 1 月末	21,576	△0.7	218.90	△0.6	98.9	—
2 月末	21,462	△1.2	217.38	△1.3	99.0	—
3 月末	21,467	△1.2	216.67	△1.6	99.0	—
4 月末	21,598	△0.6	218.98	△0.6	99.0	—
(期 末)						
2017年 5 月10日	22,009	1.3	223.71	1.6	99.0	—

* 騰落率は期首比です。

* 債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首21,725円から期末22,009円へと上昇し、値上がり額は284円となりました。

外国債券利回りが長期債を中心に上昇（価格は下落）したことはマイナスに影響しましたが、内外長期金利差の拡大などを背景に主要通貨が概ね対円で上昇（円安）したことがプラスに寄与したため、基準価額は上昇しました。

○投資環境

当運用期間では、米大統領選におけるトランプ氏の勝利を受けて、同氏の拡張的な財政政策方針による景気加速や財政赤字拡大、インフレ率上昇への警戒感が高まったことに加え、2016年12月や2017年3月に米国の政策金利が引き上げられたこと、ユーロ圏の景況感回復などからECB（欧州中央銀行）の量的緩和政策の終了が前倒しになるとの警戒感が強まったことなどを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に上昇（価格は下落）しました。

為替市場は、内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨が概ね対円で上昇（円安）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

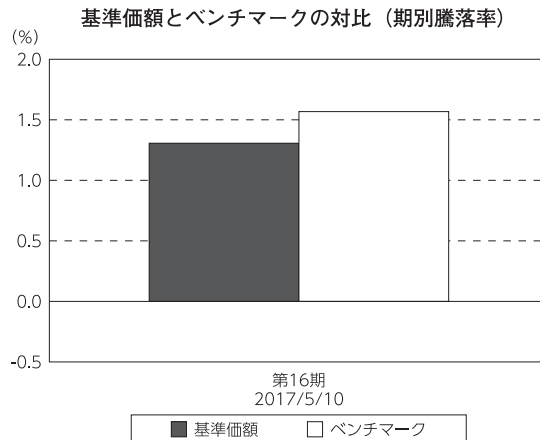
今期の基準価額の騰落率は+1.3%となり、ベンチマークの+1.6%を0.3ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

（その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること



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

◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年5月11日～2017年5月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 2	% 0.011	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(2)	(0.011)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	2	0.011	
期中の平均基準価額は、21,310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

(2016年5月11日～2017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 875,907	千米ドル 663,493
	カナダ	国債証券	千カナダドル 54,140	千カナダドル 39,082
	イギリス	国債証券	千英ポンド 77,511	千英ポンド 76,763
	スイス	国債証券	千スイスフラン 110	千スイスフラン 4,752
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 31,328	千スウェーデンクローナ 33,919
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 29,418	千ノルウェークローネ 30,617
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 53,780	千デンマーククローネ 63,569
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	121,678	58,188
	イタリア	国債証券	117,739	145,876
	フランス	国債証券	120,159	35,977

			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	26,941	17,592
	スペイン	国債証券	92,244	128,149
	ベルギー	国債証券	27,370	18,103
	オーストリア	国債証券	14,861	6,610
	フィンランド	国債証券	8,806	2,097
	アイルランド	国債証券	13,346	12,631
	ポーランド	国債証券	千ズロチ 39,693	千ズロチ 23,267
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 5,760	千シンガポールドル 2,049
	マレーシア	国債証券	千リンギ 19,633	千リンギ 19,392
	オーストラリア	国債証券	千豪ドル 56,350	千豪ドル 27,304
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 221,884	千メキシコペソ 152,346
	南アフリカ	国債証券	千ランド 60,487	千ランド 22,936

*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

(2016年5月11日~2017年5月10日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 80,883	百万円 2,947	% 3.6	百万円 58,257	百万円 4,384	% 7.5

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

(2017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
アメリカ	千米ドル 2,480,300	千米ドル 2,561,758	千円 291,681,873	% 43.9	% —	% 18.4	% 17.7	% 7.7
カナダ	千カナダドル 148,180	千カナダドル 165,818	13,771,222	2.1	—	0.9	0.7	0.4
イギリス	千英ポンド 256,410	千英ポンド 328,542	48,456,687	7.3	—	5.3	1.8	0.2
スイス	千スイスフラン 8,600	千スイスフラン 10,719	1,212,332	0.2	—	0.1	0.1	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 195,700	千スウェーデンクローナ 228,802	2,935,536	0.4	—	0.3	0.1	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ 130,800	千ノルウェークローネ 141,409	1,855,291	0.3	—	0.2	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 191,500	千デンマーククローネ 239,451	3,989,260	0.6	—	0.4	0.2	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	268,700	338,808	42,032,643	6.3	—	4.2	2.0	0.0
イタリア	433,880	516,485	64,075,205	9.6	—	5.8	2.7	1.1
フランス	425,300	528,147	65,521,961	9.9	—	6.3	2.6	1.0
オランダ	96,970	118,139	14,656,379	2.2	—	1.5	0.5	0.3
スペイン	254,300	313,107	38,844,080	5.8	—	3.6	1.7	0.6
ベルギー	102,100	132,549	16,444,084	2.5	—	1.9	0.5	0.1
オーストリア	63,200	77,961	9,671,942	1.5	—	1.0	0.4	0.1
フィンランド	28,500	32,000	3,970,030	0.6	—	0.4	0.2	0.0
アイルランド	43,000	49,616	6,155,386	0.9	—	0.5	0.3	0.1
ポーランド	千ズロチ 136,700	千ズロチ 144,005	4,219,347	0.6	—	0.3	0.3	0.1
シンガポール	千シンガポールドル 29,930	千シンガポールドル 31,612	2,552,046	0.4	—	0.2	0.2	0.0
マレーシア	千リンギ 107,200	千リンギ 107,449	2,815,170	0.4	—	0.2	0.2	0.0
オーストラリア	千豪ドル 153,750	千豪ドル 165,638	13,863,902	2.1	—	1.3	0.5	0.3
メキシコ	千メキシコペソ 953,500	千メキシコペソ 981,391	5,839,278	0.9	—	0.5	0.2	0.2
南アフリカ	千ランド 462,800	千ランド 422,977	3,536,092	0.5	—	0.4	0.1	0.0
合 計	—	—	658,099,760	99.0	—	53.7	33.0	12.3

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

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY BOND	8.125	19,300	22,183	2,525,834	2019/8/15
		US TREASURY BOND	8.75	12,700	15,567	1,772,506	2020/8/15
		US TREASURY BOND	8.0	21,100	26,675	3,037,217	2021/11/15
		US TREASURY BOND	6.25	13,800	17,154	1,953,159	2023/8/15
		US TREASURY BOND	2.375	50,100	50,522	5,752,516	2024/8/15
		US TREASURY BOND	6.0	39,200	50,586	5,759,764	2026/2/15
		US TREASURY BOND	6.5	18,800	25,384	2,890,268	2026/11/15
		US TREASURY BOND	6.125	23,700	31,802	3,621,025	2027/11/15
		US TREASURY BOND	5.5	12,000	15,549	1,770,451	2028/8/15
		US TREASURY BOND	5.25	5,000	6,373	725,679	2028/11/15
		US TREASURY BOND	5.25	800	1,023	116,485	2029/2/15
		US TREASURY BOND	4.375	100	124	14,172	2038/2/15
		US TREASURY BOND	2.875	25,300	24,588	2,799,639	2043/5/15
		US TREASURY BOND	3.75	16,000	18,155	2,067,128	2043/11/15
		US TREASURY N/B	2.625	8,500	8,616	981,079	2018/4/30
		US TREASURY N/B	0.625	500	497	56,618	2018/4/30
		US TREASURY N/B	3.875	400	410	46,764	2018/5/15
		US TREASURY N/B	1.0	600	598	68,174	2018/5/15
		US TREASURY N/B	2.375	600	607	69,143	2018/5/31
		US TREASURY N/B	1.0	4,900	4,889	556,693	2018/5/31
		US TREASURY N/B	1.125	21,400	21,379	2,434,224	2018/6/15
		US TREASURY N/B	2.375	31,200	31,603	3,598,363	2018/6/30
		US TREASURY N/B	1.375	8,500	8,513	969,397	2018/6/30
		US TREASURY N/B	0.875	1,000	995	113,379	2018/7/15
		US TREASURY N/B	2.25	8,800	8,911	1,014,688	2018/7/31
		US TREASURY N/B	1.375	18,400	18,428	2,098,297	2018/7/31
		US TREASURY N/B	0.75	17,700	17,594	2,003,277	2018/7/31
		US TREASURY N/B	4.0	4,800	4,967	565,549	2018/8/15
		US TREASURY N/B	1.0	19,600	19,539	2,224,769	2018/8/15
		US TREASURY N/B	1.5	28,800	28,887	3,289,158	2018/8/31
		US TREASURY N/B	1.0	800	797	90,757	2018/9/15
		US TREASURY N/B	1.375	27,400	27,436	3,123,907	2018/9/30
		US TREASURY N/B	0.75	10,000	9,927	1,130,371	2018/9/30
		US TREASURY N/B	0.875	2,400	2,386	271,694	2018/10/15
		US TREASURY N/B	1.75	9,900	9,967	1,134,919	2018/10/31
		US TREASURY N/B	1.25	21,400	21,389	2,435,461	2018/10/31
		US TREASURY N/B	0.75	700	694	79,069	2018/10/31
		US TREASURY N/B	3.75	35,700	37,006	4,213,579	2018/11/15
		US TREASURY N/B	1.25	1,700	1,699	193,478	2018/11/15
		US TREASURY N/B	1.375	500	500	56,990	2018/11/30
		US TREASURY N/B	1.25	6,000	5,994	682,546	2018/11/30
		US TREASURY N/B	1.25	700	699	79,649	2018/12/15
		US TREASURY N/B	1.375	6,500	6,506	740,812	2018/12/31
		US TREASURY N/B	1.5	5,500	5,515	628,040	2018/12/31
		US TREASURY N/B	1.125	5,100	5,083	578,848	2019/1/15

銘	柄	当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ	国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
		1.25	7,500	7,490	852,815	2019/1/31
		1.5	3,500	3,510	399,661	2019/1/31
		1.125	1,000	996	113,481	2019/1/31
		2.75	37,500	38,430	4,375,659	2019/2/15
		0.75	900	890	101,445	2019/2/15
		1.375	16,100	16,111	1,834,434	2019/2/28
		1.5	16,200	16,246	1,849,863	2019/2/28
		1.0	10,800	10,733	1,222,146	2019/3/15
		1.5	4,000	4,012	456,809	2019/3/31
		1.625	25,500	25,633	2,918,627	2019/3/31
		1.25	2,000	1,996	227,301	2019/3/31
		0.875	3,500	3,468	394,914	2019/4/15
		1.25	5,000	4,990	568,165	2019/4/30
		1.625	5,600	5,629	641,003	2019/4/30
		3.125	27,600	28,569	3,252,892	2019/5/15
		0.875	1,300	1,287	146,589	2019/5/15
		1.125	1,400	1,393	158,638	2019/5/31
		1.5	10,600	10,629	1,210,263	2019/5/31
		0.875	500	494	56,336	2019/6/15
		1.0	1,400	1,389	158,152	2019/6/30
		1.625	7,900	7,939	903,991	2019/6/30
		0.75	5,500	5,423	617,545	2019/7/15
		1.625	14,500	14,571	1,659,095	2019/7/31
		3.625	26,100	27,385	3,118,127	2019/8/15
		1.0	3,000	2,971	338,364	2019/8/31
		1.625	8,800	8,842	1,006,782	2019/8/31
		1.0	3,000	2,969	338,110	2019/9/30
		1.75	17,700	17,834	2,030,594	2019/9/30
		3.375	49,300	51,639	5,879,710	2019/11/15
		1.0	8,800	8,699	990,539	2019/11/30
		1.5	1,800	1,801	205,148	2019/11/30
		1.125	12,000	11,891	1,353,937	2019/12/31
		1.625	3,800	3,814	434,324	2019/12/31
		1.375	2,000	1,993	227,008	2020/1/31
		1.25	5,400	5,364	610,809	2020/1/31
		3.625	51,800	54,744	6,233,163	2020/2/15
		1.25	2,700	2,680	305,152	2020/2/29
		1.625	5,000	5,012	570,745	2020/3/15
		1.125	4,000	3,953	450,156	2020/3/31
		1.375	21,300	21,201	2,414,039	2020/3/31
		1.375	3,200	3,182	362,359	2020/4/30
		3.5	47,700	50,412	5,740,017	2020/5/15
		1.5	6,500	6,483	738,181	2020/5/31
		1.875	16,600	16,741	1,906,171	2020/6/30
		1.625	13,200	13,207	1,503,773	2020/6/30
		2.0	14,000	14,164	1,612,720	2020/7/31
		2.625	42,500	43,844	4,992,160	2020/8/15

銘	柄	当 期 末				
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ	国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
		2.125	37,600	38,175	4,346,690	2020/8/31
		2.0	6,000	6,066	690,738	2020/9/30
		1.75	1,600	1,603	182,531	2020/10/31
		2.625	52,600	54,270	6,179,234	2020/11/15
		2.375	6,800	6,957	792,212	2020/12/31
		2.125	5,300	5,374	611,896	2021/1/31
		1.375	7,000	6,905	786,310	2021/1/31
		3.625	45,800	48,973	5,576,156	2021/2/15
		2.0	5,000	5,046	574,592	2021/2/28
		1.125	10,000	9,764	1,111,825	2021/2/28
		2.25	1,800	1,831	208,566	2021/3/31
		2.25	12,900	13,124	1,494,383	2021/4/30
		3.125	38,400	40,373	4,596,983	2021/5/15
		2.0	22,500	22,674	2,581,664	2021/5/31
		2.125	34,000	34,406	3,917,513	2021/6/30
		2.25	9,700	9,859	1,122,561	2021/7/31
		2.125	26,800	27,122	3,088,160	2021/8/15
		2.0	7,300	7,342	835,983	2021/8/31
		2.125	16,000	16,170	1,841,116	2021/9/30
		2.0	10,000	10,049	1,144,203	2021/10/31
		2.0	26,000	26,142	2,976,549	2021/11/15
		1.875	8,000	7,995	910,310	2021/11/30
		2.125	12,400	12,522	1,425,761	2021/12/31
		1.5	5,000	4,906	558,625	2022/1/31
		2.0	33,700	33,864	3,855,817	2022/2/15
		1.75	27,300	27,073	3,082,636	2022/2/28
		1.75	9,900	9,812	1,117,262	2022/3/31
		1.75	30,000	29,718	3,383,776	2022/4/30
		1.75	23,900	23,675	2,695,635	2022/5/15
		2.125	27,000	27,204	3,097,516	2022/6/30
		1.625	18,500	18,160	2,067,737	2022/8/15
		1.625	12,800	12,528	1,426,438	2022/11/15
		2.125	13,000	13,049	1,485,846	2022/12/31
		1.75	22,000	21,620	2,461,670	2023/1/31
		2.0	17,000	16,932	1,927,907	2023/2/15
		1.5	25,000	24,205	2,755,990	2023/2/28
		1.5	11,000	10,637	1,211,167	2023/3/31
		1.75	42,200	41,359	4,709,169	2023/5/15
		1.625	30,400	29,549	3,364,534	2023/5/31
		2.5	19,400	19,818	2,256,513	2023/8/15
		2.75	16,800	17,399	1,981,142	2023/11/15
		2.75	26,800	27,740	3,158,486	2024/2/15
		2.5	29,100	29,631	3,373,897	2024/5/15
		2.25	23,100	23,060	2,625,645	2024/11/15
		2.0	44,700	43,746	4,980,991	2025/2/15
		2.125	26,500	26,119	2,973,916	2025/5/15
		2.0	16,000	15,590	1,775,077	2025/8/15

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
			%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2.25	50,300	49,879	5,679,282	2025/11/15
		US TREASURY N/B	1.625	3,400	3,198	364,138	2026/2/15
		US TREASURY N/B	5.375	2,100	2,794	318,235	2031/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	100	126	14,406	2038/5/15
		US TREASURY N/B	3.5	100	109	12,497	2039/2/15
		US TREASURY N/B	4.25	800	974	110,977	2039/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	2,500	3,148	358,503	2039/8/15
		US TREASURY N/B	4.375	4,200	5,200	592,160	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4.625	8,000	10,251	1,167,207	2040/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	8,000	9,910	1,128,423	2040/5/15
		US TREASURY N/B	3.875	7,200	8,304	945,514	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.25	7,800	9,503	1,082,104	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4.75	7,000	9,153	1,042,228	2041/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	7,000	8,693	989,861	2041/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	6,500	6,642	756,337	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	3,200	3,266	371,866	2042/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	4,500	4,486	510,888	2042/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	9,300	8,848	1,007,524	2042/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	17,600	16,735	1,905,461	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	25,200	25,654	2,921,053	2043/2/15
		US TREASURY N/B	3.625	15,400	17,100	1,947,007	2043/8/15
		US TREASURY N/B	3.625	23,200	25,788	2,936,250	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.375	18,900	20,121	2,290,990	2044/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	30,600	31,123	3,543,726	2044/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	36,900	36,629	4,170,579	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	26,000	23,308	2,653,916	2045/2/15
US TREASURY N/B	3.0	21,700	21,528	2,451,265	2045/5/15		
US TREASURY N/B	2.875	2,000	1,934	220,301	2045/8/15		
US TREASURY N/B	3.0	15,100	14,972	1,704,779	2045/11/15		
US TREASURY N/B	2.5	9,500	8,493	967,080	2046/2/15		
US TREASURY N/B	2.5	3,700	3,306	376,454	2046/5/15		
小 計						291,681,873	
カナダ				千カナダドル	千カナダドル		
国債証券	CANADA GOVERNMENT	2.75	4,600	4,975	413,230	2022/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	4.25	5,000	5,189	430,996	2018/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	3,000	2,993	248,646	2018/8/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.25	9,500	9,571	794,923	2018/9/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	10,000	9,973	828,332	2018/11/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	4,500	4,585	380,822	2019/3/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	3.75	10,000	10,617	881,758	2019/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	8,700	8,900	739,211	2019/9/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,700	4,792	398,024	2020/3/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	3.5	7,800	8,428	699,969	2020/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,800	2,789	231,693	2020/9/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	0.75	8,200	8,142	676,215	2021/3/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	3.25	10,500	11,452	951,169	2021/6/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,800	2,728	226,586	2022/3/1	

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,600	4,679	388,593	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	5,700	6,155	511,189	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	8,500	9,046	751,280	2025/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	3,700	5,891	489,280	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,000	943	78,336	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	5,680	8,097	672,518	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	3,400	5,128	425,921	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	5,300	7,728	641,839	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	6,400	8,474	703,838	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	9,500	11,942	991,836	2045/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	2,008	166,845	2048/12/1
		2.75	500	579	48,159	2064/12/1	
小 計						13,771,222	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	1.25	150	152	22,422	2018/7/22
		UK TREASURY	4.5	7,100	7,666	1,130,743	2019/3/7
		UK TREASURY	1.75	19,600	20,287	2,992,271	2019/7/22
		UK TREASURY	3.75	2,000	2,167	319,728	2019/9/7
		UK TREASURY	4.75	2,300	2,596	383,021	2020/3/7
		UK TREASURY	2.0	17,490	18,462	2,723,025	2020/7/22
		UK TREASURY	3.75	7,000	7,820	1,153,430	2020/9/7
		UK TREASURY	1.5	2,200	2,293	338,333	2021/1/22
		UK TREASURY	8.0	9,340	12,253	1,807,216	2021/6/7
		UK TREASURY	3.75	8,900	10,194	1,503,521	2021/9/7
		UK TREASURY	4.0	4,850	5,676	837,289	2022/3/7
		UK TREASURY	0.5	4,000	3,980	587,010	2022/7/22
		UK TREASURY	1.75	8,700	9,240	1,362,847	2022/9/7
		UK TREASURY	2.25	5,100	5,587	824,034	2023/9/7
		UK TREASURY	2.75	11,200	12,712	1,874,892	2024/9/7
		UK TREASURY	5.0	12,450	16,315	2,406,406	2025/3/7
		UK TREASURY	4.25	9,530	12,411	1,830,627	2027/12/7
		UK TREASURY	6.0	5,350	8,077	1,191,419	2028/12/7
		UK TREASURY	4.75	5,700	8,010	1,181,509	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	5,750	7,789	1,148,877	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	6,600	9,355	1,379,842	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	3,400	4,748	700,397	2036/3/7
		UK TREASURY	4.75	4,400	6,699	988,035	2038/12/7
		UK TREASURY	4.25	4,200	6,036	890,346	2039/9/7
		UK TREASURY	4.25	5,700	8,293	1,223,208	2040/12/7
		UK TREASURY	4.5	6,100	9,366	1,381,472	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	20,000	26,952	3,975,150	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	5,950	9,171	1,352,767	2046/12/7
		UK TREASURY	4.25	5,350	8,544	1,260,226	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	8,750	13,284	1,959,294	2052/7/22
		UK TREASURY	1.75	900	910	134,254	2057/7/22
UK TREASURY	2.5	2,600	3,298	486,436	2065/7/22		
UK TREASURY	3.5	6,200	10,058	1,483,584	2068/7/22		

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	3. 25	21,050	27,009	3,983,595	2044/ 1 /22
		UNITED KINGDOM(GOVERNMENT	4. 25	6, 500	11, 115	1, 639, 447	2055/12/ 7
小 計						48,456,687	
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	5, 000	5, 538	626, 347	2021/ 4 /28
		SWITZERLAND GOVERNMENT	4. 0	3, 600	5, 181	585, 984	2028/ 4 / 8
小 計						1, 212, 332	
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	4. 25	2, 300	2, 507	32, 167	2019/ 3 /12
		SWEDISH GOVERNMENT	5. 0	45, 500	54, 113	694, 271	2020/12/ 1
		SWEDISH GOVERNMENT	3. 5	53, 400	62, 803	805, 771	2022/ 6 / 1
		SWEDISH GOVERNMENT	1. 5	26, 600	28, 761	369, 005	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2. 5	41, 700	48, 405	621, 040	2025/ 5 /12
		SWEDISH GOVERNMENT	1. 0	9, 900	10, 225	131, 196	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3. 5	16, 300	21, 986	282, 081	2039/ 3 /30
小 計						2, 935, 536	
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	27, 300	29, 420	385, 995	2019/ 5 /22
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3. 75	27, 600	30, 623	401, 781	2021/ 5 /25
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2. 0	14, 300	14, 893	195, 402	2023/ 5 /24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3. 0	44, 900	49, 654	651, 472	2024/ 3 /14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1. 75	4, 700	4, 797	62, 941	2025/ 3 /13
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1. 5	4, 700	4, 664	61, 204	2026/ 2 /19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1. 75	7, 300	7, 354	96, 494	2027/ 2 /17
小 計						1, 855, 291	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	0. 25	2, 500	2, 530	42, 157	2018/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4. 0	34, 100	37, 970	632, 586	2019/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3. 0	41, 100	47, 043	783, 737	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1. 5	30, 100	32, 843	547, 164	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1. 75	31, 400	34, 985	582, 864	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0. 5	4, 000	3, 923	65, 369	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4. 5	48, 300	80, 154	1, 335, 380	2039/11/15
小 計						3, 989, 260	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESobligation	0. 5	1, 800	1, 841	228, 504	2019/ 4 /12
		BUNDESobligation	0. 25	10, 000	10, 222	1, 268, 153	2019/10/11
		BUNDESobligation	—	3, 600	3, 665	454, 780	2020/ 4 /17
		BUNDESobligation	0. 25	3, 000	3, 081	382, 310	2020/10/16
		BUNDESobligation	—	1, 600	1, 630	202, 241	2021/ 4 / 9
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3. 5	17, 700	19, 303	2, 394, 763	2019/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3. 25	6, 700	7, 402	918, 403	2020/ 1 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3. 0	4, 100	4, 568	566, 748	2020/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2. 25	13, 300	14, 552	1, 805, 361	2020/ 9 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2. 5	13, 300	14, 779	1, 833, 576	2021/ 1 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3. 25	7, 000	8, 088	1, 003, 441	2021/ 7 / 4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2. 25	8, 400	9, 379	1, 163, 665	2021/ 9 / 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	2.0	11,500	12,779	1,585,452	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	7,500	8,287	1,028,147	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,000	5,468	678,471	2022/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,705	707,778	2023/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,717	709,313	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	14,000	15,859	1,967,509	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	14,100	20,007	2,482,145	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	5,700	6,393	793,137	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,500	1,658	205,718	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	6,300	6,742	836,460	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	9,700	9,991	1,239,555	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	3,200	3,415	423,757	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	2,000	2,041	253,320	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	600	589	73,141	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	19,400	31,111	3,859,655	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	6,000	9,216	1,143,418	2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	3,400	4,961	615,471	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	6,500	10,988	1,363,218	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	5,300	8,642	1,072,142	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	5,800	9,435	1,170,521	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	5,400	8,353	1,036,344	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	8,000	13,118	1,627,420	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	8,200	14,442	1,791,718	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	5,900	8,629	1,070,563	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	4,300	5,595	694,141	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	8,500	11,141	1,382,167	2046/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	2,700	2,807	348,347	2018/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	20,400	21,576	2,676,827	2018/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	8,000	8,444	1,047,651	2018/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	15,300	16,422	2,037,363	2019/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,800	3,026	375,508	2019/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.1	500	501	62,180	2019/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	5,800	6,081	754,446	2019/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	800	824	102,314	2019/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	11,080	12,127	1,504,483	2019/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	6,100	6,799	843,491	2020/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	29,200	32,432	4,023,568	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	16,200	18,098	2,245,317	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	2,000	2,016	250,154	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	11,400	12,790	1,586,753	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	9,000	10,107	1,253,986	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	8,000	9,016	1,118,624	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	12,800	14,965	1,856,652	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	5,400	5,300	657,537	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	19,966	2,477,081	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	9,600	11,763	1,459,421	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	20,700	25,427	3,154,582	2022/11/1

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	4,000	3,930	487,605	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	6,700	7,912	981,622	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	9,300	11,174	1,386,355	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	11,700	17,104	2,121,950	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	15,900	18,825	2,335,503	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	3,000	3,029	375,864	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	2,300	2,609	323,715	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	14,900	18,289	2,269,055	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	3,000	2,915	361,650	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	2,997	371,882	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	8,500	10,169	1,261,615	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	7,200	10,366	1,286,075	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	18,200	25,314	3,140,501	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	6,300	7,728	958,839	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	20,700	26,769	3,320,991	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	18,300	25,554	3,170,244	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	3,000	2,677	332,133	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	6,400	8,843	1,097,127	2033/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,400	10,830	1,343,584	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	6,700	7,745	960,869	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,000	10,380	1,287,742	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	15,600	20,085	2,491,745	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	10,100	12,677	1,572,773	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	8,100	8,056	999,459	2046/9/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0	8,000	8,248	1,023,326	2019/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	10,300	10,558	1,309,947	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,800	2,835	351,814	2020/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,100	1,114	138,247	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	7,000	6,986	866,763	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	7,000	8,160	1,012,360	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	600	569	70,669	2036/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	200	203	25,214	2018/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	10,800	11,559	1,434,055	2018/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	26,200	26,816	3,326,869	2018/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	2,200	2,220	275,442	2019/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	11,500	12,583	1,561,152	2019/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	4,000	4,891	606,778	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	11,500	12,710	1,576,827	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	14,800	16,540	2,051,955	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.5	27,300	30,019	3,724,167	2020/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	0.25	2,000	2,042	253,355	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	11,800	13,684	1,697,694	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	15,100	17,423	2,161,525	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.0	14,500	16,726	2,075,043	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	20,100	22,550	2,797,608	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	8,200	12,308	1,527,036	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	31,300	39,472	4,896,949	2023/10/25

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	1. 75	8, 000	8, 798	1, 091, 594	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	6. 0	19, 800	28, 753	3, 567, 166	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1. 0	6, 000	6, 192	768, 179	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 5	33, 100	41, 285	5, 121, 895	2026/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2. 75	7, 200	8, 519	1, 056, 872	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5. 5	24, 500	36, 986	4, 588, 551	2029/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1. 5	1, 000	1, 034	128, 331	2031/ 5 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5. 75	19, 600	31, 970	3, 966, 216	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 75	6, 600	10, 094	1, 252, 317	2035/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 0	11, 800	16, 979	2, 106, 490	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 5	15, 900	24, 679	3, 061, 798	2041/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3. 25	15, 200	19, 817	2, 458, 572	2045/ 5 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 0	4, 500	6, 891	854, 968	2055/ 4 /25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4. 0	3, 800	5, 918	734, 201	2060/ 4 /25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	4. 0	7, 470	7, 880	977, 698	2018/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1. 25	6, 300	6, 502	806, 740	2019/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4. 0	7, 100	7, 816	969, 701	2019/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0. 25	2, 000	2, 044	253, 642	2020/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 5	5, 800	6, 545	812, 045	2020/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 25	7, 900	9, 109	1, 130, 163	2021/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	400	404	50, 231	2022/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2. 25	1, 500	1, 692	209, 946	2022/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 75	5, 900	7, 201	893, 423	2023/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7. 5	4, 300	6, 166	765, 032	2023/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1. 75	1, 400	1, 553	192, 722	2023/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2. 0	13, 500	15, 288	1, 896, 722	2024/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0. 5	4, 000	4, 004	496, 736	2026/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0. 75	2, 000	2, 021	250, 791	2027/ 7 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5. 5	7, 300	11, 011	1, 366, 064	2028/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2. 5	4, 400	5, 453	676, 543	2033/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4. 0	5, 000	7, 676	952, 345	2037/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3. 75	6, 200	9, 639	1, 195, 867	2042/ 1 /15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2. 75	4, 500	6, 125	759, 961	2047/ 1 /15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0. 25	100	100	12, 475	2018/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 1	7, 800	8, 219	1, 019, 748	2018/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3. 75	7, 100	7, 535	934, 833	2018/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0. 25	2, 700	2, 723	337, 936	2019/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2. 75	13, 300	14, 103	1, 749, 667	2019/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 6	8, 900	9, 863	1, 223, 697	2019/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 3	8, 800	9, 782	1, 213, 674	2019/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 0	27, 500	30, 869	3, 829, 717	2020/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 85	10, 600	12, 404	1, 538, 848	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5. 5	7, 900	9, 607	1, 191, 916	2021/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0. 75	5, 900	6, 048	750, 406	2021/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5. 85	9, 200	11, 592	1, 438, 215	2022/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5. 4	17, 000	21, 602	2, 680, 062	2023/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4. 4	6, 000	7, 363	913, 465	2023/10/31

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	4.8	13,900	17,450	2,164,854	2024/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	6,700	7,982	990,252	2024/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	900	923	114,623	2025/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	14,000	17,632	2,187,463	2025/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	6,000	6,253	775,818	2026/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	18,400	25,401	3,151,277	2026/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	7,800	10,524	1,305,674	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	5,400	7,437	922,713	2040/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	8,400	11,308	1,402,905	2041/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	7,800	11,158	1,384,326	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	1,000	1,044	129,584	2066/ 7 /30
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	17,500	25,194	3,125,691	2029/ 1 /31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	8,500	12,435	1,542,748	2032/ 7 /30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	5,200	6,541	811,479	2037/ 1 /31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	1.25	100	102	12,659	2018/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	3.0	7,600	8,239	1,022,244	2019/ 9 /28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	5,800	6,624	821,839	2020/ 9 /28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	5,200	6,233	773,360	2021/ 9 /28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	4,800	5,789	718,203	2022/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	7,895	979,458	2022/ 9 /28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	5,000	5,672	703,741	2023/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	10,000	11,610	1,440,336	2024/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	8,400	11,293	1,401,112	2026/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	1,032	128,141	2026/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	974	120,884	2031/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	4,845	601,079	2032/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	9,741	1,208,472	2041/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	6,500	9,341	1,158,917	2045/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	1,000	939	116,525	2047/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	1,300	1,291	160,211	2066/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	4.0	5,200	5,649	700,875	2019/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	11,900	17,798	2,208,122	2028/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	11,000	17,474	2,167,897	2035/ 3 /28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.15	2,300	2,357	292,471	2018/10/19
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.35	2,500	2,726	338,218	2019/ 3 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.95	2,500	2,632	326,525	2019/ 6 /18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	2,400	2,445	303,401	2019/10/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	5,600	6,374	790,783	2020/ 7 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	4,400	5,127	636,095	2021/ 9 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,300	3,923	486,774	2022/ 4 /20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	5,000	5,966	740,203	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	2,000	1,989	246,842	2023/ 7 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	3,900	4,323	536,339	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	3,000	3,309	410,514	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,300	1,386	172,002	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,489	929,184	2026/ 3 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,032	252,208	2026/10/20

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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	6.25	6,100	9,570	1,187,352	2027/ 7 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	1,000	1,203	149,281	2034/ 5 /23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	4,700	7,119	883,235	2037/ 3 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	5,800	7,984	990,506	2044/ 6 /20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.125	1,500	1,536	190,572	2018/ 9 /15
		FINNISH GOVERNMENT	4.375	2,100	2,324	288,353	2019/ 7 / 4
		FINNISH GOVERNMENT	3.375	2,000	2,226	276,182	2020/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	0.375	2,300	2,359	292,748	2020/ 9 /15
		FINNISH GOVERNMENT	3.5	2,000	2,302	285,686	2021/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	1.625	3,200	3,491	433,150	2022/ 9 /15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	4,200	4,571	567,114	2023/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	2,400	3,111	386,054	2025/ 7 / 4
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	1,000	1,039	128,966	2025/ 9 /15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,002	248,387	2026/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,500	4,276	530,522	2028/ 7 / 4
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	700	684	84,869	2031/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	1,600	2,074	257,421	2042/ 7 / 4
アイルランド	国債証券	IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	4.4	3,600	3,971	492,693	2019/ 6 /18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	5,600	5,998	744,173	2018/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.9	3,400	3,925	487,048	2019/10/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	5,300	6,061	751,937	2020/ 4 /18
		IRISH GOVERNMENT	5.0	3,500	4,143	514,061	2020/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.4	3,500	4,769	591,702	2025/ 3 /13
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	1,000	989	122,726	2037/ 5 /15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	2,500	2,495	309,596	2045/ 2 /18
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	4,600	5,183	643,037	2030/ 5 /15
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	6,600	7,936	984,643	2024/ 3 /18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	3,400	4,141	513,765	2023/ 3 /20
小 計						261,371,715	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	8,900	8,983	263,221	2018/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	—	6,200	6,036	176,882	2018/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	5,800	5,942	174,120	2019/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	11,100	11,990	351,313	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	6,300	6,153	180,289	2020/ 4 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	30,700	33,515	981,995	2020/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	11,100	12,495	366,111	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	9,400	10,701	313,565	2022/ 9 /23
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	12,500	13,190	386,485	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	23,000	22,979	673,293	2025/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	8,000	7,478	219,105	2026/ 7 /25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	3,700	4,538	132,964	2029/ 4 /25
		小 計					
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	1,660	134,024	2018/ 9 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.5	4,950	5,077	409,933	2019/ 6 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	4,000	4,230	341,487	2020/ 9 / 1

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
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. 25	2,980	3,054	246,589	2021/ 6 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3. 125	1, 400	1,498	120,956	2022/ 9 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2. 75	3, 000	3,148	254,178	2023/ 7 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3. 0	2,300	2,456	198,305	2024/ 9 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3. 5	3,900	4,346	350,915	2027/ 3 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2. 875	2,400	2,541	205,200	2030/ 9 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3. 375	500	563	45,450	2033/ 9 / 1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2. 75	2,900	3,034	245,003	2042/ 4 / 1
小 計						2,552,046	
マレーシア				千リンギ	千リンギ		
	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4. 059	400	405	10,614	2024/ 9 /30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3. 58	5,000	5,019	131,514	2018/ 9 /28
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3. 759	900	907	23,777	2019/ 3 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3. 654	3,400	3,414	89,463	2019/10/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4. 378	11,900	12,157	318,514	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3. 492	6,600	6,590	172,673	2020/ 3 /31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3. 889	2,400	2,421	63,445	2020/ 7 /31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4. 16	6,000	6,109	160,073	2021/ 7 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4. 048	8,700	8,834	231,472	2021/ 9 /30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3. 418	4,600	4,524	118,536	2022/ 8 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3. 48	11,000	10,822	283,560	2023/ 3 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4. 181	5,800	5,883	154,144	2024/ 7 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3. 955	600	598	15,672	2025/ 9 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4. 392	8,800	8,997	235,732	2026/ 4 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3. 502	6,000	5,623	147,331	2027/ 5 /31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3. 733	1,800	1,708	44,756	2028/ 6 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	5. 248	2,700	2,940	77,050	2028/ 9 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4. 498	3,500	3,528	92,435	2030/ 4 /15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4. 232	4,400	4,326	113,354	2031/ 6 /30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4. 127	4,700	4,569	119,725	2032/ 4 /15
MALAYSIAN GOVERNMENT	3. 844	400	375	9,834	2033/ 4 /15		
MALAYSIAN GOVERNMENT	4. 935	7,600	7,690	201,487	2043/ 9 /30		
小 計						2,815,170	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3. 25	6,600	6,749	564,965	2018/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5. 25	13,700	14,573	1,219,813	2019/ 3 /15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2. 75	4,900	5,011	419,436	2019/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4. 5	13,100	14,074	1,178,051	2020/ 4 /15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1. 75	6,800	6,744	564,517	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5. 75	10,200	11,651	975,218	2021/ 5 /15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2. 0	400	397	33,276	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5. 75	8,400	9,854	824,818	2022/ 7 /15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5. 5	8,100	9,527	797,464	2023/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2. 75	7,900	8,047	673,595	2024/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3. 25	18,300	19,211	1,608,018	2025/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4. 25	12,600	14,222	1,190,455	2026/ 4 /21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4. 75	11,250	13,267	1,110,493	2027/ 4 /21

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
オーストラリア			%	千豪ドル	千豪ドル	千円	
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	800	66,971	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	5,800	5,502	460,555	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	10,100	10,506	879,380	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	3,600	4,235	354,539	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	1,675	140,210	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	5,400	5,727	479,389	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	3,800	3,679	308,009	2039/6/21
小 計						14,721	2047/3/21
						13,863,902	
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	70,000	68,614	408,253	2018/6/14
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	110,700	113,368	674,545	2018/12/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	60,300	57,460	341,889	2019/12/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	70,700	72,492	431,328	2020/6/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	124,300	121,531	723,114	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	48,400	47,053	279,965	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	30,700	35,719	212,530	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	8,000	7,245	43,113	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	103,100	104,793	623,523	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	47,100	51,498	306,414	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	44,500	45,760	272,276	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	10,257	61,034	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	46,000	57,661	343,088	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	30,500	33,630	200,099	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	64,200	65,613	390,397	2042/11/13
MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	2,000	2,092	12,449	2047/11/7		
小 計						515,253	2023/12/7
						5,839,278	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	20,100	20,241	169,218	2018/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	25,300	25,063	209,527	2020/1/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	26,100	25,197	210,648	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	25,200	24,654	206,108	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	70,000	77,582	648,587	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	27,000	24,505	204,863	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	30,000	24,738	206,809	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	46,400	42,126	352,177	2032/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	47,100	33,644	281,267	2036/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	32,000	28,816	240,901	2037/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0	4,800	4,475	37,411	2040/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	30,600	21,566	180,293	2041/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	32,100	28,925	241,818	2044/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	46,100	41,442	346,459	2048/2/28
		小 計					
合 計						658,099,760	

* 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

(2017年5月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 658,099,760	% 98.5
コール・ローン等、その他	10,157,962	1.5
投資信託財産総額	668,257,722	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（662,230,664千円）の投資信託財産総額（668,257,722千円）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＝113.86円、1カナダドル＝83.05円、1英ポンド＝147.49円、1スイスフラン＝113.10円、1スウェーデンクローナ＝12.83円、1ノルウェークローネ＝13.12円、1デンマーククローネ＝16.66円、1ユーロ＝124.06円、1ズロチ＝29.30円、1シンガポールドル＝80.73円、1リンギ＝26.20円、1豪ドル＝83.70円、1メキシコペソ＝5.95円、1ランド＝8.36円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年5月10日現在)

○損益の状況 (2016年5月11日～2017年5月10日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	671,226,552,802
コール・ローン等	3,356,752,811
公社債(評価額)	658,099,760,346
未収入金	3,247,987,864
未収利息	6,265,289,584
前払費用	256,762,197
(B) 負債	6,472,404,827
未払金	5,818,573,835
未払解約金	645,927,677
未払利息	4,115
その他未払費用	7,899,200
(C) 純資産総額(A－B)	664,754,147,975
元本	302,031,601,625
次期繰越損益金	362,722,546,350
(D) 受益権総口数	302,031,601,625口
1万口当たり基準価額(C／D)	22,009円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	19,591,670,788
受取利息	19,593,036,598
支払利息	△ 1,365,810
(B) 有価証券売買損益	△ 10,359,248,853
売買益	20,672,406,631
売買損	△ 31,031,655,484
(C) 保管費用等	△ 69,320,663
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	9,163,101,272
(E) 前期繰越損益金	341,572,524,818
(F) 追加信託差損益金	46,613,959,629
(G) 解約差損益金	△ 34,627,039,369
(H) 計(D＋E＋F＋G)	362,722,546,350
次期繰越損益金(H)	362,722,546,350

(注) 期首元本額は291,325,475,847円、期中追加設定元本額は41,419,676,069円、期中一部解約元本額は30,713,550,291円、1口当たり純資産額は2.2009円です。

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 *損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
 *損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村外国債券インデックス（野村投資一任口座向け）	186,858,504,066
野村世界6資産分散投信（分配コース）	28,123,863,474
野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	12,779,489,266
マイ・ロード	8,396,053,347
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,074,282,593
のむらっ・ファンド（普通型）	7,049,506,140
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）	5,771,334,376
のむらっ・ファンド（保守型）	4,923,155,923
野村DC外国債券インデックスファンド	3,259,609,223
マイバランス50（確定拠出年金向け）	2,900,464,411
マイバランス70（確定拠出年金向け）	2,589,009,498
野村外国債券インデックス Bコース（野村SMA・EW向け）	2,465,959,976
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）	2,265,600,667
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）	2,164,169,025
マイバランス30（確定拠出年金向け）	2,130,321,675
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）	1,963,921,785
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,903,770,200
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）	1,854,139,207
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）	1,727,512,193
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	1,726,688,217
のむらっ・ファンド（積極型）	1,650,685,398
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,550,992,042
マイバランスDC30	1,241,002,811
野村DC運用戦略ファンド	1,207,900,516
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,073,157,685
マイバランスDC50	765,928,639
野村インデックスファンド・外国債券	704,799,284
ネクストコア	678,789,899
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）	647,553,052
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	540,099,984
野村外国債券バッシブファンド（確定拠出年金向け）	530,972,422
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）	504,205,034
マイバランスDC70	461,341,370
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）	455,477,950
野村外国債券インデックスファンド	294,047,502
のむらっ・ファンド（やや保守型）	289,746,172
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）	237,745,036
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	200,013,315
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）	195,849,097
バランスセレクト50	95,597,698
バランスセレクト30	90,376,727
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	89,259,609
のむらっ・ファンド（やや積極型）	80,942,919
バランスセレクト70	75,084,362
野村資産設計ファンド2040	71,599,738
野村資産設計ファンド2025	50,575,113
野村資産設計ファンド2020	48,213,634
野村資産設計ファンド2030	41,284,644
野村資産設計ファンド2015	39,664,609
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	31,841,681
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	29,700,278
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	29,086,187
野村資産設計ファンド2035	28,505,057
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）	18,611,102
野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	11,603,558

ファンド名	当期末
	元本額
	円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	7,306,024
野村資産設計ファンド2045	6,164,098
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	5,631,680
野村資産設計ファンド2050	5,453,395
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	3,895,239
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3,625,898
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	3,038,940
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	1,511,427
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）	1,312,663
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	1,163,075
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	1,093,066
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	888,025
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	793,345
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	36,599
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	24,808
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	24,301
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	17,860
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	11,796

○お知らせ

- ①スワップ取引に係る評価の方法につき、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価する汎用的な記載に変更する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2017年3月31日＞

- ②外国為替予約取引に係る担保授受に関する規定を追加する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2017年3月31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7期（決算日2017年2月20日）

作成対象期間（2016年2月19日～2017年2月20日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベンチマーク JPモルガン・ガバメント・ボンド・ インデックス・エマージング・ マーケット・グローバル・ディバースファイド (円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 額
	騰 落 率	中 率	騰 落 率	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
7期(2017年2月20日)	12,644	10.1	131.55	10.7	96.4	—	4,218

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*ベンチマーク（＝JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース））は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets（GBI-EM）Global Diversified（USドルベース）をもとに、当社が円換算したものです。なお指数の算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。
*JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets（GBI-EM）Global Diversified）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数です（ただし、国別の組入比率には上限が設定されています）。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベンチマーク JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・ エマージング・マーケット・グローバル・ ディバースファイド(円換算ベース)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2016年2月18日	11,485	—	118.83	—	97.0	—
2月末	11,326	△ 1.4	117.90	△ 0.8	97.2	—
3月末	12,213	6.3	127.16	7.0	97.5	—
4月末	12,161	5.9	125.83	5.9	97.8	—
5月末	11,779	2.6	122.23	2.9	97.6	—
6月末	11,506	0.2	119.54	0.6	96.4	—
7月末	11,671	1.6	121.41	2.2	97.9	—
8月末	11,672	1.6	121.38	2.1	97.3	—
9月末	11,594	0.9	121.23	2.0	97.3	—
10月末	11,902	3.6	124.09	4.4	97.3	—
11月末	11,886	3.5	123.66	4.1	97.0	—
12月末	12,552	9.3	130.96	10.2	96.7	—
2017年1月末	12,493	8.8	130.50	9.8	97.2	—
(期 末)						
2017年2月20日	12,644	10.1	131.55	10.7	96.4	—

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（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11,485円から期末12,644円に1,159円の値上がりとなりました。

新興国債券利回りが低下（価格は上昇）したことに加え、新興国通貨が対円で上昇（円安）したことを受けて、基準価額は上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（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

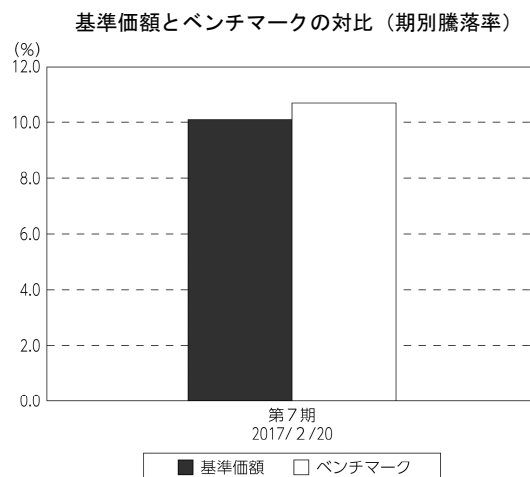
今期の基準価額の騰落率は+10.1%となり、ベンチマークの+10.7%を0.6ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

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

（その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること。



（注）ベンチマークは、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（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・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える運用を行ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

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

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

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

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

当情報に関して追加に必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index_research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年 2 月19日～2017年 2 月20日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 16	% 0.131	(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 ）	(15)	(0.130)	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)	(0.001)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	16	0.131	
期中の平均基準価額は、11,896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

(2016年2月19日～2017年2月20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 9,258	千トルコリラ 1,449
	ハンガリー	国債証券	千フォリント 432,413	千フォリント 109,827
	ポーランド	国債証券	千ズロチ 10,265	千ズロチ 1,116
	ロシア	国債証券	千ルーブル 78,551	千ルーブル —
		特殊債券	5,494	—
	ルーマニア	国債証券	千レイ 4,744	千レイ 1,720
	マレーシア	国債証券	千リンギ 9,597	千リンギ 1,430
	タイ	国債証券	千バーツ 64,395	千バーツ 9,225
	インドネシア	国債証券	千ルピア 32,005,398	千ルピア 2,697,165
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 60,034	千メキシコペソ 5,973
	ブラジル	国債証券	千レアル 7,709	千レアル 3,370
	コロンビア	国債証券	千コロンビアペソ 4,904,011	千コロンビアペソ —
	ペルー	国債証券	千ヌエボソル 1,953	千ヌエボソル —
	南アフリカ	国債証券	千ランド 33,341	千ランド 6,702

*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

(2016年2月19日～2017年2月20日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
		うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 4,958	百万円 554	% 11.2	百万円 2,672	百万円 554	% 20.7
預金	347	347	100.0	354	354	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

(2017年2月20日現在)

外国公社債

(A) 外国（外貨建）公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
トルコ	千トルコリラ 12,330	千トルコリラ 11,517	千円 358,548	% 8.5	% 8.5	% 4.6	% 3.8	% 0.1
ハンガリー	千フォリント 471,000	千フォリント 530,698	206,282	4.9	—	3.2	1.7	—
ポーランド	千ズロチ 14,210	千ズロチ 14,216	393,799	9.3	—	4.3	4.5	0.6
ロシア	千ルーブル 135,000	千ルーブル 134,190	260,330	6.2	5.9	—	0.3	5.9
ルーマニア	千レイ 4,210	千レイ 4,565	120,949	2.9	—	1.9	1.0	—
マレーシア	千リンギ 13,700	千リンギ 13,624	345,248	8.2	—	4.3	2.8	1.1
タイ	千バーツ 91,300	千バーツ 97,550	315,086	7.5	—	3.8	3.7	0.0
フィリピン	千フィリピンペソ 5,000	千フィリピンペソ 5,172	11,689	0.3	—	—	0.3	—
インドネシア	千ルピア 45,560,000	千ルピア 48,033,135	408,281	9.7	9.7	8.1	1.6	—
メキシコ	千メキシコペソ 72,550	千メキシコペソ 73,502	405,735	9.6	—	6.0	2.1	1.5
ブラジル	千レアル 7,287	千レアル 11,658	424,831	10.1	10.1	3.0	3.8	3.2
コロンビア	千コロンビアペソ 6,970,000	千コロンビアペソ 7,964,013	310,596	7.4	—	3.6	3.8	—
ペルー	千ヌエボソル 2,700	千ヌエボソル 2,781	96,167	2.3	—	1.9	0.4	—
南アフリカ	千ランド 52,630	千ランド 47,488	410,301	9.7	—	8.5	1.3	—
合 計	—	—	4,067,847	96.4	34.2	52.9	31.0	12.5

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

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

* スタンダード・アンド・プアーズ、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。

(B) 外国（外貨建）公社債 銘柄別開示

銘 柄			当 期 末					
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
					外貨建金額	邦貨換算金額		
トルコ			%	千トルコリラ	千トルコリラ	千円		
	国債証券	TURKEY GOVERNMENT BOND	8.8	200	193	6,014	2018/11/14	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.5	300	284	8,862	2019/ 7 /10	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.5	1,410	1,398	43,542	2020/ 1 /15	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	7.4	1,050	958	29,826	2020/ 2 / 5	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.4	950	912	28,405	2020/ 7 / 8	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.5	1,650	1,574	49,001	2022/ 1 /12	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.5	1,390	1,262	39,311	2022/ 9 /14	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	7.1	570	480	14,958	2023/ 3 / 8	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.8	460	419	13,059	2023/ 9 /27	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.4	520	512	15,960	2024/ 3 /20	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.0	1,010	929	28,941	2024/ 7 /24	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.0	1,620	1,392	43,345	2025/ 3 /12	
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.6	1,200	1,198	37,318	2026/ 2 /11	
小 計						358,548		
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	32,000	36,200	14,070	2019/ 6 /24	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.5	48,000	51,168	19,889	2020/ 6 /24	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	7.5	81,000	98,014	38,098	2020/11/12	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	7.0	36,000	44,595	17,334	2022/ 6 /24	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	6.0	77,000	92,688	36,027	2023/11/24	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.0	30,000	29,842	11,599	2024/ 6 /26	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	5.5	92,000	106,741	41,490	2025/ 6 /24	
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.0	75,000	71,449	27,772	2027/10/27	
小 計						206,282		
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ			
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3.75	910	932	25,834	2018/ 4 /25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	990	1,011	28,026	2019/ 7 /25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	380	410	11,357	2019/10/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	1,730	1,677	46,454	2020/ 4 /25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	830	900	24,945	2020/10/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	1,700	1,665	46,143	2021/ 4 /25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	600	570	15,813	2021/ 7 /25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	500	561	15,553	2021/10/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	400	383	10,620	2022/ 4 /25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	980	1,103	30,577	2022/ 9 /23	
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	1,140	1,179	32,675	2023/10/25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	2,100	2,058	57,006	2025/ 7 /25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,650	1,493	41,374	2026/ 7 /25	
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	300	267	7,415	2027/ 7 /25	
小 計						393,799		
ロシア				千ルーブル	千ルーブル			
	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND	7.85	130,000	128,731	249,738	2018/ 3 /10	
	特殊債券 (除く金融債)	INTL FINANCE CORP	11.0	5,000	5,459	10,591	2020/ 1 /21	
小 計						260,330		

銘 柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ルーマニア			%	千レイ	千レイ	千円	
	国債証券	ROMANIA	2.25	440	442	11,730	2020/2/26
		ROMANIA	3.25	790	808	21,421	2021/3/22
		ROMANIA	5.95	300	339	8,988	2021/6/11
		ROMANIA	3.5	300	303	8,041	2022/12/19
		ROMANIA	5.85	950	1,083	28,694	2023/4/26
		ROMANIA	4.75	820	884	23,433	2025/2/24
		ROMANIA	5.8	610	703	18,639	2027/7/26
小 計						120,949	
マレーシア				千リンギ	千リンギ		
	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.58	1,760	1,768	44,803	2018/9/28
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	1,760	1,798	45,584	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.659	1,300	1,301	32,978	2020/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	1,020	1,035	26,247	2021/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	500	505	12,815	2021/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	750	733	18,577	2022/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	1,280	1,248	31,624	2023/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	1,200	1,211	30,693	2024/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	1,240	1,263	32,023	2026/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.9	800	787	19,955	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	740	696	17,640	2028/6/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	200	199	5,065	2030/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	550	518	13,129	2032/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	400	366	9,284	2033/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.254	200	190	4,825	2035/5/31
小 計						345,248	
タイ				千バーツ	千バーツ		
	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	5.125	600	622	2,010	2018/3/13
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.45	11,200	11,619	37,532	2019/3/8
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.875	9,700	10,195	32,930	2019/6/13
		THAILAND GOVERNMENT BOND	2.55	9,700	9,938	32,100	2020/6/26
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.65	15,000	16,069	51,903	2021/12/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	1.875	6,000	5,901	19,060	2022/6/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.625	8,700	9,373	30,277	2023/6/16
		THAILAND GOVERNMENT BOND	4.75	1,500	1,732	5,597	2024/12/20
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.85	9,200	10,102	32,631	2025/12/12
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.58	6,700	7,098	22,927	2027/12/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	4.875	10,000	11,884	38,387	2029/6/22
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.4	3,000	3,011	9,728	2036/6/17
小 計						315,086	
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	5,172	11,689	2021/1/15
小 計						11,689	
インドネシア				千ルピア	千ルピア		
	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	7.875	2,700,000	2,759,670	23,457	2019/4/15
		INDONESIA GOVERNMENT	11.0	2,900,000	3,268,880	27,785	2020/11/15
		INDONESIA GOVERNMENT	12.8	1,700,000	2,040,059	17,340	2021/6/15
		INDONESIA GOVERNMENT	7.0	1,880,000	1,867,701	15,875	2022/5/15

銘柄			当期末			
			利 率	額面金額	評 価 額	
					外貨建金額	邦貨換算金額
						償還年月日
インドネシア			%	千ルピア	千ルピア	千円
国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	8.375	5,330,000	5,586,373	47,484	2024/3/15
	INDONESIA GOVERNMENT	11.0	6,880,000	8,313,743	70,666	2025/9/15
	INDONESIA GOVERNMENT	7.0	4,650,000	4,500,883	38,257	2027/5/15
	INDONESIA GOVERNMENT	9.0	1,330,000	1,442,651	12,262	2029/3/15
	INDONESIA GOVERNMENT	10.5	1,110,000	1,336,454	11,359	2030/8/15
	INDONESIA GOVERNMENT	9.5	1,400,000	1,569,502	13,340	2031/7/15
	INDONESIA GOVERNMENT	8.25	3,300,000	3,368,930	28,635	2032/6/15
	INDONESIA GOVERNMENT	6.625	4,500,000	3,928,806	33,394	2033/5/15
	INDONESIA GOVERNMENT	8.375	4,280,000	4,396,416	37,369	2034/3/15
	INDONESIA GOVERNMENT	8.25	3,600,000	3,653,064	31,051	2036/5/15
小計					408,281	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ	
国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4.75	6,850	6,675	36,846	2018/6/14
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	4,800	4,935	27,243	2018/12/13
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	2,200	2,090	11,541	2019/12/11
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	10,950	11,271	62,219	2020/6/11
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	3,000	2,931	16,184	2021/6/10
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	8,200	7,955	43,914	2022/6/9
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	4,600	5,335	29,454	2024/12/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	4,000	3,564	19,678	2026/3/5
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	4,350	4,347	23,998	2027/6/3
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	2,000	2,138	11,805	2029/5/31
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	4,300	4,291	23,690	2031/5/29
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	4,000	3,947	21,790	2034/11/23
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	1,700	2,055	11,347	2036/11/20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	5,000	5,296	29,235	2038/11/18
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,200	3,132	17,293	2042/11/13
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	3,400	3,531	19,491	2023/12/7
小計					405,735	
ブラジル				千レアル	千レアル	
国債証券	LETRA TESOIRO NACIONAL	—	1,540	1,351	49,252	2018/7/1
	LETRA TESOIRO NACIONAL	—	400	343	12,506	2018/10/1
	LETRA TESOIRO NACIONAL	—	2,430	2,034	74,141	2019/1/1
	LETRA TESOIRO NACIONAL	—	2,310	1,842	67,142	2019/7/1
	NOTA DO TESOIRO NACIONAL	10.0	256	2,585	94,215	2021/1/1
	NOTA DO TESOIRO NACIONAL	10.0	100	1,000	36,474	2023/1/1
	NOTA DO TESOIRO NACIONAL	10.0	251	2,499	91,099	2025/1/1
小計					424,831	
コロンビア				千コロンビアペソ	千コロンビアペソ	
国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	7.75	3,820,000	4,068,918	158,687	2021/4/14
	REPUBLIC OF COLOMBIA	9.85	3,150,000	3,895,094	151,908	2027/6/28
小計					310,596	
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	20,716	2024/8/12
	PERU BONO SOBERANO	7.84	480	523	18,088	2020/8/12
	PERU BONO SOBERANO	6.95	500	521	18,039	2031/8/12
	PERU BONO SOBERANO	6.9	620	634	21,942	2037/8/12

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ペルー			%	千ヌエボソル	千ヌエボソル	千円	
	国債証券	REPUBLIC OF PERU	6.35	500	502	17,380	2028/8/12
小 計						96,167	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	2,980	2,939	25,394	2020/1/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	3,340	3,203	27,674	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	3,300	3,220	27,827	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	7,100	7,941	68,613	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	6,000	5,516	47,662	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	6,160	5,132	44,344	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.875	1,000	960	8,296	2035/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	3,700	2,692	23,262	2036/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	4,700	4,292	37,087	2037/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	8,450	6,124	52,912	2041/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	5,900	5,466	47,226	2048/2/28
小 計						410,301	
合 計						4,067,847	

* 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

(2017年2月20日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	4,067,847	96.2
コール・ローン等、その他	158,800	3.8
投資信託財産総額	4,226,647	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（4,213,117千円）の投資信託財産総額（4,226,647千円）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=112.88円、1トルコリラ=31.13円、1フォリント=0.3887円、1ズロチ=27.70円、1ルーブル=1.94円、1レイ=26.49円、1リンギ=25.34円、1バーツ=3.23円、1フィリピンペソ=2.26円、1ルピア=0.0085円、1メキシコペソ=5.52円、1レアル=36.44円、1コロンビアペソ=0.039円、1ヌエボソル=34.58円、1ランド=8.64円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年2月20日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	4,230,485,369
コール・ローン等	76,921,021
公社債(評価額)	4,067,847,968
未収入金	3,837,580
未収利息	71,125,158
前払費用	10,753,642
(B) 負債	12,157,274
未払金	3,865,479
未払解約金	8,056,077
未払利息	18
その他未払費用	235,700
(C) 純資産総額(A－B)	4,218,328,095
元本	3,336,334,894
次期繰越損益金	881,993,201
(D) 受益権総口数	3,336,334,894口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,644円

(注) 期首元本額は1,403,841,235円、期中追加設定元本額は2,182,677,648円、期中一部解約元本額は250,183,989円、1口当たり純資産額は1,2644円です。

○損益の状況（2016年2月19日～2017年2月20日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	213,442,762
受取利息	213,451,665
支払利息	△ 8,903
(B) 有価証券売買損益	106,704,281
売買益	315,126,433
売買損	△208,422,152
(C) 保管費用等	△ 3,906,396
(D) 当期損益金(A+B+C)	316,240,647
(E) 前期繰越損益金	208,438,621
(F) 追加信託差損益金	408,771,843
(G) 解約差損益金	△ 51,457,910
(H) 計(D+E+F+G)	881,993,201
次期繰越損益金(H)	881,993,201

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
ノムラ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）	2,134,037,600
野村インデックスファンド・新興国債券	455,287,145
野村DC新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド	261,518,795
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	155,242,565
野村DC運用戦略ファンド	139,276,794
ネクストコア	88,282,206
野村資産設計ファンド2040	25,175,806
野村資産設計ファンド2025	17,203,557
野村資産設計ファンド2020	16,091,763
野村資産設計ファンド2015	14,406,102

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村資産設計ファンド2030	14,172,151
野村資産設計ファンド2035	9,787,968
野村資産設計ファンド2045	2,071,064
野村資産設計ファンド2050	1,456,540
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	1,269,140
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	291,552
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	265,702
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	264,522
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	233,922

○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12期（決算日2017年6月12日）

作成対象期間（2016年6月11日～2017年6月12日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		投 資 信 託 組 入 比	純 資 産 額
	騰 落 率	中 率	東証REIT指数 (配当込み)	騰 落 率		
8期(2013年6月10日)	円 12,408	% 49.2	2,092.40	% 49.3	% 98.0	百万円 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
12期(2017年6月12日)	19,362	△ 4.3	3,254.14	△ 4.3	98.2	28,442

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		投 資 信 託 組 入 比
	騰 落 率	中 率	東証REIT指数 (配当込み)	騰 落 率	
(期 首) 2016年6月10日	円 20,222	% —	3,401.82	% —	% 98.2
6月末	19,857	△1.8	3,340.35	△1.8	97.1
7月末	20,177	△0.2	3,394.01	△0.2	98.2
8月末	19,775	△2.2	3,325.60	△2.2	98.2
9月末	19,847	△1.9	3,336.34	△1.9	97.8
10月末	19,452	△3.8	3,269.40	△3.9	98.3
11月末	19,625	△3.0	3,298.65	△3.0	98.4
12月末	20,352	0.6	3,422.06	0.6	98.0
2017年1月末	20,270	0.2	3,407.69	0.2	97.8
2月末	20,089	△0.7	3,376.46	△0.7	97.6
3月末	19,679	△2.7	3,307.66	△2.8	98.1
4月末	19,247	△4.8	3,234.60	△4.9	98.2
5月末	19,464	△3.7	3,271.22	△3.8	98.2
(期 末) 2017年6月12日	19,362	△4.3	3,254.14	△4.3	98.2

*騰落率は期首比です。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首20,222円から期末19,362円に860円の値下がりとなりました。

長期金利が上昇し国内REITの配当利回りの魅力が低下したことや、国内REITの資金調達が相次いだことで需給悪化が懸念されたことなどを受けて、基準価額は下落しました。

○投資環境

国内REIT市場は、期首より、英国のEU（欧州連合）離脱を問う国民投票で離脱派の勝利が確定したことを受け、リスク回避的な動きがあったことなどを背景に大きく下落する場面もありましたが、その後は相対的に高い配当利回りを見直されたことなどから上昇する展開となりました。

その後、長期金利が上昇したことや、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懸念などを背景に、国内REIT市場は下落しました。

2016年11月中旬以降、長期金利の上昇が一服したことや、日本銀行の金融政策により長期金利の上昇が抑制されるとの見方が広がったことなどを受け、国内REIT市場は上昇しました。

2017年1月上旬以降は、長期金利が再び上昇したことや、国内株式市場の下落が嫌気されたこと、地政学リスクに伴いリスク回避の姿勢が強まったことなどを背景に、国内REIT市場は下落基調となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

・REIT組入比率

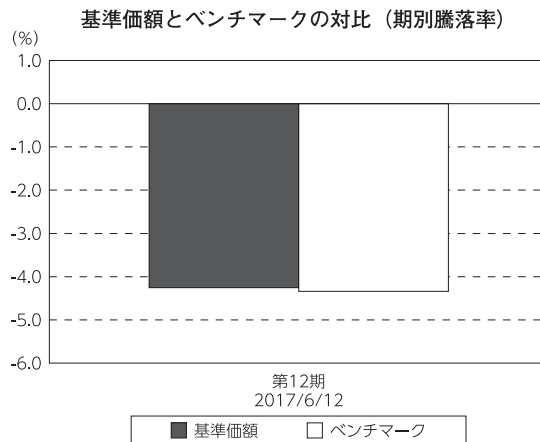
REITの実質組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・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－4.3%となり、ベンチマークである東証REIT指数（配当込み）の－4.3%と同程度となりました。



（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

(2016年 6 月11日～2017年 6 月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 1	% 0.003	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.002)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
合 計	1	0.003	
期中の平均基準価額は、19,819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

(2016年 6 月11日～2017年 6 月12日)

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	口 605	千円 290,836	口 273	千円 130,373
	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	415	141,271	161	55,176
	森ヒルズリート投資法人 投資証券	1,908	286,165	1,162	173,054
	産業ファンド投資法人 投資証券	559	289,984	210	108,476
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	29 (△ 620)	17,657 (△ 375,219)	33	20,848
	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	1,770	522,060	755	220,481
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	397	119,481	203	59,601
	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	856	451,962	370	196,398
	GLP投資法人 投資証券	3,542	452,034	1,865	238,451
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	709	176,304	312	77,369
	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	2,174	521,035	1,247	299,715
	星野リゾート・リート投資法人 投資証券	241 (149)	152,959 (—)	88	60,602
	One リート投資法人 投資証券	188 (179)	50,216 (—)	108	26,359
	イオンリート投資法人 投資証券	2,091	260,578	1,268	157,095
	ヒューリックリート投資法人 投資証券	1,286	234,848	684	125,244

銘柄	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	日本リート投資法人 投資証券	487	137,217	219	61,380
	インベスコ・オフィス・ジェリート投資法人 投資証券	1,034	100,544	454	43,690
	日本ヘルスケア投資法人 投資証券	83	14,468	42	7,242
	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	1,301	189,981	629	90,635
	トーセイ・リート投資法人 投資証券	268	28,750	103	11,130
	ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	824	207,261	268	68,197
	ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	331	33,640	102	10,370
	サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	510	43,239	177	14,816
	ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	94	13,412	47	6,617
	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	5,212 (786)	871,356 (130,238)	2,311	386,053
	いちごホテルリート投資法人 投資証券	490	66,892	168	20,582
	ラサールロジポート投資法人 投資証券	1,376	147,093	622	66,658
	スターアジア不動産投資法人 投資証券	481	45,914	348	33,589
	マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	251	22,433	50	4,396
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	679	218,848	98	32,027
	大江戸温泉リート投資法人 投資証券	537	48,713	80	6,978
	さくら総合リート投資法人 投資証券	1,009	86,647	145	11,400
	投資法人みらい 投資証券	675	120,554	218	37,326
	森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	856	128,065	78	11,701
	日本ビルファンド投資法人 投資証券	1,763	1,095,387	795	495,929
	ジャパニリアルエステイト投資法人 投資証券	1,815	1,100,163	748	455,934
	日本リテールファンド投資法人 投資証券	3,848	875,498	1,476	339,070
	オリックス不動産投資法人 投資証券	4,071	720,845	1,446	257,045
	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,208	535,350	492	216,824
	プレミア投資法人 投資証券	1,641	211,314	739	95,428
	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,217	170,508	547	77,467
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	352	140,521	120	47,462
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	4,558	790,748	1,682	293,001
	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	1,343	240,692	1,123	199,615
	インヴィンシブル投資法人 投資証券	4,313	220,111	2,839	146,481
	フロンティア不動産投資法人 投資証券	617	309,401	277	139,292
	平和不動産リート投資法人 投資証券	1,114	93,435	681	57,263
	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,222	289,071	504	118,109
	福岡リート投資法人 投資証券	850	153,272	435	79,827
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	568	362,276	238	150,160
	積水ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,522	185,875	609	73,277
	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	1,532	111,350	1,465	103,238
	大和証券オフィス投資法人 投資証券	505	297,262	591	339,160
	阪急リート投資法人 投資証券	743	110,777	334	48,672
	スターツプロシード投資法人 投資証券	423	64,553	166	25,127
	トップリート投資法人 投資証券	15 (△ 300)	6,395 (△ 130,238)	28	12,151
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	1,984 (1,364)	564,893 (375,219)	983	280,359

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	口		千円	口	千円
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	5,982	475,133	2,133	168,861
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	2,050	167,728	926	75,717
	ジャパンエクスセレント投資法人 投資証券	1,698	238,924	729	100,953
合 計		80,222 (1,558)	16,023,931 (—)	37,004	7,270,483

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	REIT先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		2,051	1,907	—	—

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2016年6月11日～2017年6月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
投資信託証券	百万円 16,023	百万円 786	% 4.9	百万円 7,270	百万円 362	% 5.0

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)	658千円
うち利害関係人への支払額 (B)	49千円
(B) / (A)	7.5%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2017年6月12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	862	1,194	575,508	2.0
MCUBS Mid City投資法人 投資証券	473	727	252,269	0.9
森ヒルズリート投資法人 投資証券	3,114	3,860	555,454	2.0
産業ファンド投資法人 投資証券	627	976	494,832	1.7
大和ハウスリート投資法人 投資証券	624	—	—	—
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	2,312	3,327	959,174	3.4
ケネディクス・レジデンシャル投資法人 投資証券	621	815	231,541	0.8
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,067	1,553	775,723	2.7
GLP投資法人 投資証券	4,614	6,291	774,422	2.7
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	913	1,310	315,579	1.1
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	3,276	4,203	1,003,676	3.5
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	145	447	259,260	0.9
One リート投資法人 投資証券	134	393	81,351	0.3
イオンリート投資法人 投資証券	2,329	3,152	395,260	1.4
ヒューリックリート投資法人 投資証券	1,702	2,304	425,779	1.5
日本リート投資法人 投資証券	697	965	288,245	1.0
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	1,430	2,010	202,407	0.7
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	133	174	29,110	0.1
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	1,582	2,254	317,137	1.1
トーセイ・リート投資法人 投資証券	286	451	47,986	0.2
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	751	1,307	320,215	1.1
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	214	443	43,812	0.2
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	291	624	52,291	0.2
ジャパン・シニアリビング投資法人 投資証券	151	198	28,413	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	10,308	1,665,772	5.9
いちごホテルリート投資法人 投資証券	246	568	67,251	0.2
ラサールロジポート投資法人 投資証券	1,957	2,711	303,903	1.1
スターアジア不動産投資法人 投資証券	613	746	74,898	0.3
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	—	201	18,894	0.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	—	581	196,378	0.7
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	—	457	40,810	0.1
さくら総合リート投資法人 投資証券	—	864	69,206	0.2
投資法人みらい 投資証券	—	457	74,856	0.3
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	—	778	122,223	0.4
日本ビルファンド投資法人 投資証券	2,512	3,480	2,025,360	7.1
ジャパニリアルエステイト投資法人 投資証券	2,329	3,396	1,908,552	6.7
日本リテールファンド投資法人 投資証券	4,540	6,912	1,501,977	5.3
オリックス不動産投資法人 投資証券	4,307	6,932	1,198,542	4.2
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	1,553	2,269	948,442	3.3
プレミアム投資法人 投資証券	2,343	3,245	396,863	1.4
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	1,739	2,409	331,237	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	345	577	227,915	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	5,049	7,925	1,310,002	4.6
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,348	2,568	475,336	1.7

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
インヴィンシブル投資法人 投資証券	6,538	8,012	431,045	1.5
フロンティア不動産投資法人 投資証券	882	1,222	603,057	2.1
平和不動産リート投資法人 投資証券	1,805	2,238	192,244	0.7
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	1,565	2,283	547,463	1.9
福岡リート投資法人 投資証券	1,329	1,744	304,676	1.1
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	720	1,050	639,450	2.2
積水ハウス・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,811	2,724	326,062	1.1
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	2,715	2,782	191,958	0.7
大和証券オフィス投資法人 投資証券	861	775	444,075	1.6
阪急リート投資法人 投資証券	1,063	1,472	207,257	0.7
スタートアップリート投資法人 投資証券	309	566	83,371	0.3
トップリート投資法人 投資証券	313	—	—	—
大和ハウスリート投資法人 投資証券	1,330	3,695	1,020,559	3.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	5,909	9,758	786,494	2.8
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	2,917	4,041	337,019	1.2
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	2,249	3,218	425,419	1.5
合 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	97,166 54	141,942 58	27,928,028 < 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評価額の比率。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末
			買 建 額 売 建 額
国内	REIT先物取引	東証REIT指数	百万円 百万円
			513 —

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017年6月12日現在)

項 目	当 期 末
	評 価 額 比 率
	千円 %
投資証券	27,928,028 97.4
コール・ローン等、その他	742,698 2.6
投資信託財産総額	28,670,726 100.0

*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 (2017年6月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	28,670,726,615
コール・ローン等	542,980,218
投資証券(評価額)	27,928,028,500
未収入金	5,865,000
未収配当金	175,464,397
差入委託証拠金	18,388,500
(B) 負債	228,052,865
未払金	202,250,235
未払解約金	25,801,843
未払利息	787
(C) 純資産総額(A－B)	28,442,673,750
元本	14,690,222,837
次期繰越損益金	13,752,450,913
(D) 受益権総口数	14,690,222,837口
1万口当たり基準価額(C／D)	19,362円

(注) 期首元本額は10,600,385,360円、期中追加設定元本額は8,007,338,244円、期中一部解約元本額は3,917,500,767円、1口当たり純資産額は1.9362円です。

○損益の状況 (2016年6月11日～2017年6月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	821,584,678
受取配当金	814,299,585
その他収益金	7,502,041
支払利息	△ 216,948
(B) 有価証券売買損益	△ 1,869,091,287
売買益	144,721,888
売買損	△ 2,013,813,175
(C) 先物取引等取引損益	△ 22,265,896
取引益	9,611,964
取引損	△ 31,877,860
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	△ 1,069,772,505
(E) 前期繰越損益金	10,836,079,849
(F) 追加信託差損益金	7,776,137,458
(G) 解約差損益金	△ 3,789,993,889
(H) 計(D＋E＋F＋G)	13,752,450,913
次期繰越損益金(H)	13,752,450,913

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,121,632,017
野村インデックスファンド・J-REIT	2,970,330,522
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,738,957,804
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,067,362,258
野村DC運用戦略ファンド	971,900,502
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）	917,602,353
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）	887,441,928
野村世界6資産分散投信（成長コース）	854,860,432
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	752,569,054
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	626,406,304
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	363,964,640
ネクストコア	229,908,767
野村資産設計ファンド2040	34,506,815
野村資産設計ファンド2015	25,950,925
野村資産設計ファンド2030	25,934,209
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	24,021,437
野村資産設計ファンド2020	22,962,375
野村資産設計ファンド2025	22,469,821
野村資産設計ファンド2035	19,029,777
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	6,049,675
野村資産設計ファンド2045	3,066,177
野村資産設計ファンド2050	3,057,639
インデックス・ブレンド（タイプV）	85,802
インデックス・ブレンド（タイプIV）	64,174
インデックス・ブレンド（タイプIII）	56,856
インデックス・ブレンド（タイプI）	19,849
インデックス・ブレンド（タイプII）	10,725

○お知らせ

該当事項はございません。

海外REITインデックス マザーファンド

運用報告書

第12期（決算日2017年6月12日）

作成対象期間（2016年6月11日～2017年6月12日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		投 資 信 託 券 率 組 入 比	純 資 産 額
		期 騰 落 中 率		期 騰 落 中 率		
	円	%		%	%	百万円
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
12期(2017年6月12日)	21,472	4.6	226.73	5.1	99.4	20,175

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		投 資 信 託 券 率 組 入 比
		騰 落 率		騰 落 率	
(期 首) 2016年6月10日	円 20,525	% —		% —	% 99.2
6月末	20,062	△2.3	210.90	△2.2	99.0
7月末	21,275	3.7	223.66	3.7	99.1
8月末	20,571	0.2	216.52	0.4	99.1
9月末	19,917	△3.0	209.81	△2.7	99.1
10月末	19,006	△7.4	199.99	△7.3	99.2
11月末	20,397	△0.6	214.75	△0.4	99.2
12月末	21,581	5.1	227.41	5.4	97.5
2017年1月末	21,118	2.9	222.76	3.3	99.1
2月末	21,874	6.6	231.17	7.2	97.9
3月末	21,238	3.5	224.48	4.1	99.0
4月末	21,577	5.1	227.86	5.6	98.6
5月末	21,273	3.6	224.63	4.1	99.3
(期 末) 2017年6月12日	21,472	4.6	226.73	5.1	99.4

*騰落率は期首比です。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首20,525円から期末21,472円に947円の値上がりとなりました。

主要通貨が対円で上昇（円安）したことや、堅調な米国経済指標が発表されたこと、米国株式市場の上昇などを背景に、基準価額は上昇しました。

○投資環境

当運用期間中のREIT市場は、期首から2016年7月中旬まで、主要国・地域の中央銀行による政策対応への期待や、市場予想を上回る米国経済指標の発表などから上昇しましたが、7月下旬から11月にかけては、FRB（米連邦準備制度理事会）の要人発言などにより年内の利上げ観測が高まり、米長期金利が上昇したことや、米大統領選を巡る懸念が広がったことなどを受けて下落しました。

11月以降は、堅調な米国経済指標が発表されたことや、米国株式市場の上昇などを背景に上昇に転じたものの、2017年1月以降は、米国新政権による金融規制の緩和や法人税減税などへの期待、欧州域内での政治リスクに対する懸念の高まり、米国の利上げの行方などを巡り、一進一退の展開となりました。

為替市場は、2016年11月以降に内外長期金利差の拡大などを背景に、主要通貨は対円で上昇（円安）した後、2017年1月以降は、内外長期金利差の拡大観測が後退したこと、FOMC（米連邦公開市場委員会）で先行きの利上げペースの加速が示唆されなかったことなどを背景に、主要通貨は対円で下落（円高）基調となりました。

○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+4.6%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+5.1%を0.5ポイント下回りました。

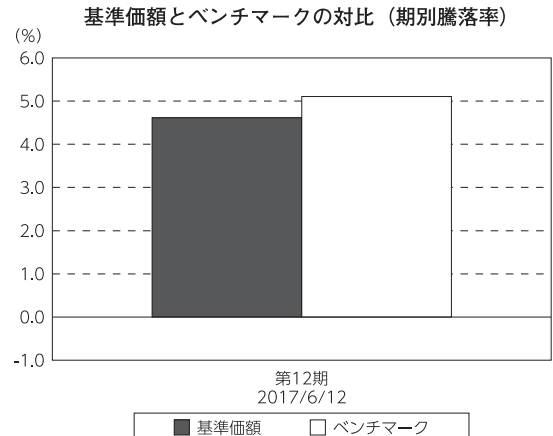
主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

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

（その他の要因）

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



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

◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

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

○ 1 万口当たりの費用明細

(2016年6月11日～2017年6月12日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 5	% 0.023	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(投 資 信 託 証 券)	(5)	(0.022)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(b) 有 価 証 券 取 引 税	3	0.014	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投 資 信 託 証 券)	(3)	(0.014)	
(c) そ の 他 費 用	13	0.064	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用
(保 管 費 用)	(6)	(0.027)	
(そ の 他)	(8)	(0.037)	
合 計	21	0.101	
期中の平均基準価額は、20,824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。

投資信託証券

— 444 —

	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
	EPR PROPERTIES	2,720	199	2,080	154
	EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	3,500	68	1,100	21
	EASTGROUP PROPERTIES	1,380	100	750	53
	EDUCATION REALTY TRUST INC	3,700	158	1,700	72
	EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	5,600	112	3,000	60
	EQUITY COMMONWEALTH	5,200	160	4,800	146
	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	2,510	193	1,720	127
	EQUITY ONE INC	1,500 (△ 14,100)	46 (△ 427)	1,500	46
	EQUITY RESIDENTIAL	13,900	882	10,360	654
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,630	610	2,020	453
	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,480	342	3,140	241
	FARMLAND PARTNERS INC	3,700	42	—	—
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,210	453	2,090	302
	FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	5,700	156	4,300	118
	FOREST CITY REALTY TRUST- A	10,700	236	8,800	187
	FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	2,074	45	500	10
	FRANKLIN STREET PROPERTIES C	4,800	57	800	10
	GEO GROUP INC/THE	3,750 (6,250)	135 (—)	1,800	68
	GGP INC	13,500 (85,600)	319 (2,356)	4,000	98
	GAMING AND LEISURE PROPERTIE	8,700	290	5,200	167
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	9,600 (△ 85,600)	262 (△ 2,356)	13,400	363
	GLOBAL NET LEASE INC	— (△ 25,200)	— (△ 215)	1,300	11
	GLOBAL NET LEASE INC	1,100 (8,400)	24 (215)	—	—
	GRAMERCY PROPERTY TRUST	8,600 (△ 64,700)	77 (△ 593)	7,900	71
	GRAMERCY PROPERTY TRUST	6,200 (21,566)	172 (593)	2,966	82
	HCP INC	19,300	630	14,700	467
	HEALTHCARE REALTY TRUST INC	6,200	203	2,800	87
	HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	13,400	411	3,500	108
	HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,300	24	1,000	21
	HIGHWOODS PROPERTIES INC	3,690	186	2,290	116
	HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	6,100	184	2,600	79
	HOST HOTELS & RESORTS INC	29,700	525	24,700	430
	HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	13,900	478	2,200	76
	ISTAR INC	11,400	119	900	10
	INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,715	43	—	—
	INVESTORS REAL ESTATE TRUST	—	—	1,500	9
	INVITATION HOMES INC	13,000	281	—	—
	IRON MOUNTAIN INC	11,100	394	8,700	308

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
	KILROY REALTY CORP	3,820	277	2,030	147
	KIMCO REALTY CORP	17,600	439	12,500	330
	KITE REALTY GROUP TRUST	1,200	23	—	—
	LTC PROPERTIES INC	1,190	57	490	22
	LASALLE HOTEL PROPERTIES	5,800	158	4,800	134
	LEXINGTON REALTY TRUST	7,400	77	3,900	40
	LIBERTY PROPERTY TRUST	4,100	161	2,800	110
	LIFE STORAGE INC	2,270 (6,900)	187 (712)	1,500	127
	MACERICH CO /THE	5,020	344	4,650	341
	MACK-CALI REALTY CORP	2,500	69	1,600	44
	MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,100	32	—	—
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,900	386	5,900	76
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	3,910 (5,843)	385 (481)	2,843	276
	MONMOUTH REIT-CLASS A	3,300	49	1,400	21
	NATL HEALTH INVESTORS INC	1,910	145	900	66
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	8,100	360	5,700	255
	NATIONAL STORAGE AFFILIATES	4,200	94	1,000	22
	NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	—	—	700	7
	NEW YORK REIT INC	—	—	25,000	243
	NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	1,680 (△ 27,200)	24 (△ 378)	3,370	47
	NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	1,900	23	1,900	21
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	11,800	393	5,400	170
	PS BUSINESS PARKS INC/CA	680	76	570	64
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	20,300	540	—	—
	PARKWAY INC	— (6,473)	— (—)	—	—
	PARKWAY PROPERTIES INC	600 (△ 12,200)	10 (△ 219)	1,200	21
	PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	1,700	52	700	20
	PHYSICIANS REALTY TRUST	7,500	148	3,300	64
	PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	4,600	98	3,900	81
	POST PROPERTIES INC	330 (△ 8,230)	21 (△ 481)	300	18
	PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	1,900	29	—	—
	PROLOGIS INC	21,650	1,134	16,190	837
	PUBLIC STORAGE	5,900	1,296	4,260	940
	QTS REALTY TRUST INC CL A	1,010	53	730	38
	QUALITY CARE PROPERTIES	2,700 (14,720)	48 (—)	2,720	46
	RLJ LODGING TRUST	6,200	133	5,600	122
	REALTY INCOME CORP	12,330	742	6,710	409
	REGENCY CENTERS CORP	4,655 (6,345)	333 (427)	2,060	145

	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
	RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	4,000	85	2,300	47
	RETAIL PROPERTIES OF AME-A	9,100	139	8,100	126
	REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	1,700	42	900	21
	ROUSE PROPERTIES INC	—	—	—	—
				(5,600)	(102)
	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,830	168	2,460	143
	SL GREEN REALTY CORP	4,210	449	3,110	338
	SABRA HEALTH CARE REIT INC	2,600	65	2,700	61
	SELECT INCOME REIT	3,200	82	3,100	78
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	10,300	210	9,000	179
	SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	1,900	89	—	—
	SILVER BAY REALTY TRUST CORP	500	8	700	11
				(5,600)	(91)
	SIMON PROPERTY GROUP INC	12,990	2,356	8,600	1,629
	SOVRAN SELF STORAGE INC	100	10	200	20
		(△ 6,900)	(△ 712)		
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	25,300	273	18,800	217
	STAG INDUSTRIAL INC	6,700	165	3,200	77
	STORE CAPITAL CORP	7,500	183	3,300	84
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	3,000	49	—	—
	SUN COMMUNITIES INC	3,140	255	1,530	120
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	6,700	97	4,400	62
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	3,900	129	2,600	92
	TAUBMAN CENTERS INC	2,060	143	1,560	112
	TERRENO REALTY CORP	2,600	74	1,000	27
	TIER REIT INC	7,200	112	—	—
	UDR INC	10,500	381	8,000	284
	UMH PROPERTIES INC	1,400	23	—	—
	URBAN EDGE PROPERTIES	3,900	101	1,800	48
	URSTADT BIDDLE-CL A	2,000	44	900	20
	VENTAS INC	14,490	962	8,470	546
	VEREIT INC	45,900	428	29,000	264
	VORNADO REALTY TRUST	6,860	687	6,050	608
	WP CAREY INC	4,380	275	2,120	132
	WP GLIMCHER INC	—	—	—	—
		(△ 28,400)	(△ 324)		
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	2,200	21	2,100	20
		(28,400)	(324)		
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	2,900	92	1,700	54
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	3,900	137	2,000	73
	WELLTOWER INC	14,050	995	9,660	664
	WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	10,000	18	—	—
		(△ 10,000)	(△ 18)		
	WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	—	—	—
		(1,250)	(18)		
	WHITESTONE REIT	1,700	20	—	—

	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
	WINTHROP REALTY TRUST	—	—	5,400 (—)	48 (6)
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	1,400	25	1,800	32
	MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	87,000 (—)	72 (△ 1)	—	—
	小 計	1,092,284 (△ 40,988)	35,699 (△ 1)	563,459 (11,200)	21,638 (201)
	カナダ		千カナダドル		千カナダドル
	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN	3,200	34	—	—
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2,500	91	1,200	41
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,800	119	3,000	93
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	1,700	80	1,700	79
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	2,900	49	1,400	25
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	1,700	23	1,000	13
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	10,600	100	8,600	79
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,100	48	600	25
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	6,000	137	4,000	89
	INNVEST REAL ESTATE INVESTME	—	—	— (10,400)	— (70)
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,100	26	—	—
	MILESTONE APARTMENTS REAL ES	—	—	4,700 (5,600)	85 (103)
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,600	22	—	—
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	1,100	22	700	13
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	5,000	53	2,700	27
	PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	14,400	90	5,000	32
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	6,900	185	4,500	123
	SLATE OFFICE REIT	2,100 (△ 2,100)	17 (△ 17)	—	—
	SLATE OFFICE REIT	3,800 (2,100)	30 (17)	—	—
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	900	28	—	—
	小 計	71,400	1,162	39,100 (16,000)	733 (173)
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND	38,800	242	28,500	176
	CAPITAL & REGIONAL PLC	88,000	53	24,000	12
	DERWENT LONDON PLC	3,600	96	2,700	69
	BIG YELLOW GROUP PLC	4,800	36	3,400	25
	HAMMERSON PLC	33,300	191	23,600	133
	MUCKLOW < A & J > GROUP PLC	12,700	63	3,500	16
	INTU PROPERTIES PLC	37,800	106	13,000	36
	UNITE GROUP PLC	36,100	227	—	—
	SHAFTESBURY PLC	11,900	109	8,300	75
	LAND SECURITIES GROUP PLC	37,900	398	32,300	334

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	8,100 (△ 52,200)	53 (△ 380)	9,300	61
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	57,600	65	46,100	50
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	4,960	18	4,500	16
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	45,500	72	33,000	51
	SEGRO PLC	45,540 (24,960)	211 (112)	25,500	112
	SEGRO PLC - NIL PAID RTS	— (24,960)	— (—)	— (24,960)	— (26)
	WORKSPACE GROUP PLC	2,100	18	—	—
	NEWRIVER REIT PLC	40,000	131	—	—
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	29,000	31	—	—
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	123,000 (11,454)	174 (17)	43,454	59
	TRITAX BIG BOX REIT PLC-RTS	— (27,544)	— (21)	— (27,544)	— (2)
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	15,800	18	—	—
	ASSURA PLC	30,000	16	28,700	16
	REGIONAL REIT LTD	15,000	15	—	—
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	2,910 (49,590)	19 (380)	—	—
	小 計	724,410 (86,308)	2,371 (152)	329,854 (52,504)	1,247 (29)
	ユーロ		千ユーロ		千ユーロ
	ドイツ				
	HAMBORNER REIT AG	2,974	28	700	7
	HAMBORNER REIT AG-RIGHTS	— (9,126)	— (—)	9,126	0.20148
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	4,700 (—)	53 (△ 8)	4,500	52
	小 計	7,674 (9,126)	81 (△ 8)	14,326	59
	イタリア				
	BENI STABILI SPA	53,000	29	57,000	31
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	— (—)	— (△0.97119)	—	—
	小 計	53,000 (—)	29 (△0.97119)	57,000	31
	フランス				
	AFFINE	—	—	900	13
	ICADE	2,415	166	835	56
	ALTAREA	105 (35)	20 (2)	—	—
	ALTAREA-RIGHTS	—	—	— (315)	— (1)
	KLEPIERRE	9,394	360	4,450	163

銘	柄	買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外 国	ユーロ	口	千ユーロ	口	千ユーロ
	フランス				
	GECINA SA	1,700	222	600	73
	FONCIERE DES REGIONS	3,670 (—)	295 (△ 8)	1,900	149
	ANF IMMOBILIER	—	—	1,300	27
	MERCIALYS	5,800	120	—	—
	FONCIERE DES MURS	— (1,300)	— (35)	1,300 (1,300)	34 (35)
	UNIBAIL RODAMCO-NA	3,960	890	2,910	641
	FONCIERE DES MURS	— (1,300)	— (35)	— (1,300)	— (35)
	小 計	27,044 (2,635)	2,076 (64)	14,195 (2,915)	1,160 (72)
	オランダ				
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	1,480	55	1,010	37
	VASTNED RETAIL NV	580	20	—	—
	WERELDHAVE NV	840	34	500	19
	NSI NV	8,930	33	7,000	25
	小 計	11,830	144	8,510	82
	スペイン				
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	— (4,680)	— (26)	— (—)	— (8)
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM-RTS	— (9,530)	— (8)	66 (9,464)	0.04312 (7)
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	19,540	236	1,640	18
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	40,645 (—)	403 (△ 7)	10,700 (—)	110 (0.96)
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	2,640	36	1,500	19
	小 計	62,825 (14,210)	675 (27)	13,906 (9,464)	148 (16)
	ベルギー				
	BEFIMMO S. C. A.	595 (355)	31 (18)	350	18
	BEFIMMO - RTS	— (3,200)	— (—)	5 (3,195)	0.00185 (1)
	COFINIMMO	820	87	560	59
	RETAIL ESTATES	210	16	—	—
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	760	18	—	—
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	750 (282)	64 (22)	552	46
	WAREHOUSES DE PAUW CVA - RTS	— (2,260)	— (169)	— (2,260)	— (1)
	MONTEA SCA	940	45	—	—
	AEDIFICA	1,332 (557)	94 (37)	1,340	95

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
	ベルギー				
	AEDIFICA RIGHTS	— (2,230)	— (—)	2 (2,228)	0.00288 (—)
	XIOR STUDENT HOUSING NV - RTS	— (500)	— (—)	—	—
	小 計	5,407 (9,384)	359 (248)	2,809 (7,683)	219 (6)
	アイルランド				
	GREEN REIT PLC	13,491	18	—	—
	HIBERNIA REIT PLC	40,000	53	30,000	37
	小 計	53,491	72	30,000	37
	ユ ー ロ 計	221,271 (35,355)	3,440 (331)	140,746 (20,062)	1,740 (95)
	香港		千香港ドル		千香港ドル
	LINK REIT	76,500	4,228	63,500	3,393
	CHAMPION REIT	90,000	412	71,000	303
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	95,000	439	71,000	325
	FORTUNE REIT	51,000	479	33,000	306
	NEW CENTURY REIT	—	—	65,000	149
	小 計	312,500	5,559	303,500	4,477
	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	84,200	169	58,500	116
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	109,400 (—)	268 (△ 2)	54,000	125
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	150,700	235	105,000	160
	SUNTEC REIT	83,700 (—)	142 (△ 3)	57,000	93
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	24,100 (—)	27 (△ 1)	—	—
	STARHILL GLOBAL REIT	— (—)	— (△ 1)	—	—
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	120,000 (—)	133 (△ 6)	51,000	58
	ASCOTT RESIDENCE TRUST-RIGHTS	— (37,700)	— (34)	37,700	5
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	20,000 (—)	27 (△0.97715)	—	—
	KEPPEL REIT	93,000 (—)	97 (△ 1)	82,000	86
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	44,900	93	41,000	82
	CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST	46,700	26	—	—
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	84,600 (—)	122 (△0.38252)	81,000	116
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	— (—)	— (△ 6)	—	—

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
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	— (—)	— (△ 2)	—	—
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	— (—)	— (△ 1)	—	—
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	— (—)	— (△ 2)	—	—
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	48,000 (—)	84 (△ 0.18)	28,000	48
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	100,000	153	56,600	83
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST-RIGHTS	— (36,125)	— (51)	—	—
	CACHE LOGISTICS TRUST	— (—)	— (△0.23749)	—	—
	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	— (—)	— (△0.27266)	—	—
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	— (39,564)	— (17)	—	—
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT-RIGHTS	— (39,564)	— (10)	— (39,564)	— (7)
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	59,100 (—)	61 (△ 4)	28,000	29
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	— (—)	— (△ 1)	—	—
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	42,000	25	40,000	23
	OUE HOSPITALITY TRUST	84,300	57	40,000	25
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI-RIGHTS	— (9,700)	— (6)	—	—
	OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	— (—)	— (△ 0.7726)	— (—)	— (0.15133)
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	—	—	88,000	67
	KEPPEL DC REIT	— (25,756)	— (31)	51,000	60
	KEPPEL DC REIT-RIGHTS	— (25,756)	— (—)	— (25,756)	— (1)
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	178,000 (—)	170 (△ 4)	—	—
	小 計	1,372,700 (214,165)	1,898 (108)	898,800 (65,320)	1,182 (8)
	オーストラリア		千豪ドル		千豪ドル
	BWP TRUST	10,000	30	—	—
	MIRVAC GROUP	135,000	291	95,000	198
	INVESTA OFFICE FUND	29,000	135	20,000	92
	CROMWELL PROPERTY GROUP	89,000	88	85,000	82
	CHARTER HALL RETAIL REIT	7,000	30	5,000	23
	GPT GROUP	63,000	313	52,000	260
	ABACUS PROPERTY GROUP	9,000	25	9,000	26

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
	STOCKLAND TRUST GROUP	87,000	401	58,000	262
	DEXUS	37,300	357	26,300	246
	GOODMAN GROUP	56,900	428	43,700	311
	360 CAPITAL GROUP LTD	—	—	23,450	20
	CHARTER HALL GROUP	28,000	154	5,000	27
	GALILEO JAPAN TRUST	—	—	18,170	48
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	11,000	34	—	—
	GENERATION HEALTHCARE REIT	22,000	46	—	—
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	19,715 (—)	54 (0.2743)	10,000	26
	INGENIA COMMUNITIES GROUP RIGHTS	— (2,000)	— (5)	— (2,000)	— (0.2743)
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	12,900	30	—	—
	PROPERTYLINK GROUP	109,000	84	—	—
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	25,000	97	—	—
	INDUSTRIA REIT-RIGHTS	— (4,600)	— (9)	—	—
	NATIONAL STORAGE REIT	30,682 (13,458)	47 (22)	— (—)	— (1)
	NATIONAL STORAGE REIT-RIGHTS	— (13,458)	— (1)	— (13,458)	— (1)
	360 CAPITAL OFFICE FUND	— (△ 11,100)	— (△ 25)	—	—
	SCENTRE GROUP	212,000	946	165,000	748
	WESTFIELD CORP	81,700	750	62,300	585
	VICINITY CENTRES	103,000	302	77,000	230
	CENTURIA URBAN REIT	— (11,100)	— (25)	—	—
	VIVA ENERGY REIT	69,000	153	—	—
	小 計	1,247,197 (33,516)	4,804 (39)	754,920 (15,458)	3,193 (3)
	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
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	— (8,733)	— (18)	— (—)	— (0.80903)
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST - RTS	— (8,733)	— (0.80903)	— (8,733)	— (0.80903)
	GOODMAN PROPERTY TRUST	42,000	54	38,000	50
	STRIDE PROPERTY LTD	—	—	— (58,000)	— (129)
	ARGOSY PROPERTY LTD	49,000	51	30,000	31
	INVESTORE PROPERTY LTD	17,500 (14,500)	28 (21)	—	—
	STRIDE STAPLED GROUP	— (58,000)	— (107)	—	—

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	口	千ニュージーランドドル
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	70,000	100	45,000	64
	小 計	178,500 (89,966)	235 (148)	113,000 (66,733)	145 (130)
	イスラエル		千新シェケル		千新シェケル
	REIT 1 LTD	5,510	73	—	—
	小 計	5,510	73	—	—

*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 635	百万円 677	百万円 —	百万円 —

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

○利害関係人との取引状況等 (2016年6月11日～2017年6月12日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 4,722	百万円 469	% 9.9	百万円 3,343	百万円 188	% 5.6

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

(2017年6月12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	10,900	13,900	389	42,901	0.2
AGREE REALTY CORP	3,500	4,000	190	20,948	0.1
ALEXANDERS INC	580	590	253	27,893	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,300	14,490	1,718	189,479	0.9
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,100	6,800	275	30,372	0.2
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	19,900	21,800	1,032	113,830	0.6
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	28,000	38,200	840	92,637	0.5
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	24,100	25,700	1,140	125,667	0.6
APPLE HOSPITALITY REIT INC	24,200	25,100	477	52,679	0.3
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,800	7,600	102	11,276	0.1
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	3,595	4,800	48	5,333	0.0
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,100	12,100	80	8,896	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,000	22,310	4,350	479,525	2.4
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	2,700	4,200	53	5,925	0.0
BOSTON PROPERTIES	23,600	25,010	3,132	345,268	1.7
BRANDYWINE REALTY TRUST	26,500	28,100	485	53,493	0.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	31,400	43,000	811	89,441	0.4
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	23,500	25,900	209	23,125	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,300	14,040	1,216	134,055	0.7
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	12,800	13,800	349	38,500	0.2
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	8,500	12,000	222	24,523	0.1
CEDAR REALTY TRUST INC	12,000	12,000	63	6,957	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	5,900	5,900	118	13,072	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	9,200	9,200	223	24,683	0.1
CITY OFFICE REIT INC	3,300	3,300	41	4,572	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	—	89,000	1,262	139,210	0.7
COLONY STARWOOD HOMES	5,900	16,000	553	60,988	0.3
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	19,300	19,400	424	46,746	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,000	2,000	51	5,683	0.0
CORESITE REALTY CORP	4,700	5,360	570	62,876	0.3
CORECIVIC INC	—	19,400	613	67,618	0.3
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14,600	15,800	557	61,410	0.3
CORRECTIONS CORP OF AMERICA	18,000	—	—	—	—
COUSINS PROPERTIES INC	30,400	67,700	601	66,342	0.3
CUBESMART	26,500	28,700	683	75,325	0.4
CYRUSONE INC	10,500	12,620	725	79,946	0.4
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	13,600	14,800	804	88,732	0.4
DDR CORP	46,300	50,400	462	50,944	0.3
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	30,800	33,000	380	41,977	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	22,400	25,900	2,934	323,523	1.6
DOUGLAS EMMETT INC	21,600	23,800	906	99,901	0.5
DUKE REALTY CORP	53,200	58,000	1,650	181,890	0.9

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	11,400	12,750	775	85,450	0.4
EPR PROPERTIES	9,700	10,340	746	82,337	0.4
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	1,800	4,200	87	9,694	0.0
EASTGROUP PROPERTIES	4,900	5,530	469	51,734	0.3
EDUCATION REALTY TRUST INC	9,800	11,800	460	50,766	0.3
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	17,900	20,500	435	48,018	0.2
EQUITY COMMONWEALTH	19,400	19,800	627	69,165	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,300	13,090	1,108	122,243	0.6
EQUITY ONE INC	14,100	—	—	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	56,100	59,640	4,033	444,607	2.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,050	10,660	2,838	312,834	1.6
EXTRA SPACE STORAGE INC	19,200	20,540	1,530	168,722	0.8
FARMLAND PARTNERS INC	1,800	5,500	53	5,892	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	10,650	11,770	1,467	161,760	0.8
FELCOR LODGING TRUST INC	20,100	20,100	151	16,727	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	18,000	19,400	576	63,512	0.3
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	8,400	8,400	95	10,500	0.1
FOREST CITY REALTY TRUST- A	33,100	35,000	852	93,982	0.5
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	8,526	10,100	256	28,300	0.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	14,100	18,100	207	22,904	0.1
GEO GROUP INC/THE	11,400	19,600	652	71,944	0.4
GGP INC	—	95,100	2,217	244,460	1.2
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	28,000	31,500	1,142	125,973	0.6
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	89,400	—	—	—	—
GETTY REALTY CORP	3,921	3,921	101	11,151	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,600	3,600	77	8,527	0.0
GLOBAL NET LEASE INC	26,500	—	—	—	—
GLOBAL NET LEASE INC	—	9,500	215	23,781	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	11,000	11,000	247	27,245	0.1
GRAMERCY PROPERTY TRUST	64,000	—	—	—	—
GRAMERCY PROPERTY TRUST	—	24,800	763	84,116	0.4
HCP INC	71,600	76,200	2,375	261,897	1.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	15,800	19,200	661	72,952	0.4
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	21,000	30,900	971	107,053	0.5
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6,900	7,200	140	15,523	0.1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	14,800	16,200	825	90,947	0.5
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	23,000	26,500	787	86,814	0.4
HOST HOTELS & RESORTS INC	115,400	120,400	2,212	243,933	1.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	13,700	25,400	901	99,394	0.5
ISTAR INC	—	10,500	127	14,097	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4,285	9,000	90	9,940	0.0
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	19,800	18,300	112	12,446	0.1
INVITATION HOMES INC	—	13,000	278	30,665	0.2
IRON MOUNTAIN INC	37,100	39,500	1,315	145,034	0.7
KILROY REALTY CORP	14,200	15,990	1,207	133,109	0.7
KIMCO REALTY CORP	63,500	68,600	1,272	140,270	0.7
KITE REALTY GROUP TRUST	12,700	13,900	262	28,897	0.1

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
LTC PROPERTIES INC	5,800	6,500	319	35,194	0.2
LASALLE HOTEL PROPERTIES	17,100	18,100	553	60,972	0.3
LEXINGTON REALTY TRUST	32,700	36,200	362	39,943	0.2
LIBERTY PROPERTY TRUST	22,300	23,600	986	108,713	0.5
LIFE STORAGE INC	—	7,670	567	62,530	0.3
MACERICH CO /THE	19,400	19,770	1,153	127,159	0.6
MACK-CALI REALTY CORP	13,600	14,500	400	44,146	0.2
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	—	3,100	36	4,052	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	36,100	58,100	775	85,498	0.4
MID-AMERICA APARTMENT COMM	11,600	18,510	1,984	218,726	1.1
MONMOUTH REIT-CLASS A	10,100	12,000	183	20,211	0.1
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	25,600	25,600	253	27,964	0.1
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,300	6,310	483	53,327	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	21,700	24,100	911	100,470	0.5
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	3,500	6,700	156	17,267	0.1
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	13,200	12,500	121	13,337	0.1
NEW YORK REIT INC	25,000	—	—	—	—
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3,000	3,000	77	8,502	0.0
NORTHSTAR REALTY FINANCE CORP	28,890	—	—	—	—
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	9,500	9,500	121	13,424	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	25,200	31,600	1,000	110,315	0.5
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,100	2,100	49	5,497	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,000	3,110	408	45,069	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	—	20,300	553	61,065	0.3
PARKWAY INC	—	6,473	128	14,199	0.1
PARKWAY PROPERTIES INC	12,800	—	—	—	—
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	10,800	11,800	385	42,442	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10,500	10,500	118	13,020	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	20,400	24,600	509	56,212	0.3
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,600	23,300	498	54,962	0.3
POST PROPERTIES INC	8,200	—	—	—	—
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	3,500	5,400	87	9,672	0.0
PROLOGIS INC	80,500	85,960	4,910	541,327	2.7
PUBLIC STORAGE	22,600	24,240	5,031	554,595	2.7
QTS REALTY TRUST INC CL A	7,200	7,480	400	44,095	0.2
QUALITY CARE PROPERTIES	—	14,700	253	27,967	0.1
RLJ LODGING TRUST	19,500	20,100	430	47,502	0.2
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	12,200	12,200	162	17,966	0.1
REALTY INCOME CORP	38,500	44,120	2,440	268,991	1.3
REGENCY CENTERS CORP	14,900	23,840	1,486	163,901	0.8
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	15,400	17,100	347	38,320	0.2
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	36,400	37,400	468	51,656	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	10,200	11,000	306	33,817	0.2
ROUSE PROPERTIES INC	5,600	—	—	—	—
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,800	8,170	532	58,663	0.3
SL GREEN REALTY CORP	15,300	16,400	1,741	191,949	1.0
SABRA HEALTH CARE REIT INC	10,200	10,100	230	25,450	0.1

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
SAUL CENTERS INC	1,700	1,700	100	11,123	0.1
SELECT INCOME REIT	9,700	9,800	242	26,747	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	36,500	37,800	800	88,250	0.4
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	2,100	4,000	165	18,271	0.1
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	5,800	—	—	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	47,500	51,890	8,074	890,006	4.4
SOVRAN SELF STORAGE INC	7,000	—	—	—	—
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	73,300	79,800	598	65,972	0.3
STAG INDUSTRIAL INC	10,600	14,100	396	43,751	0.2
STORE CAPITAL CORP	23,400	27,600	560	61,759	0.3
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	13,500	16,500	313	34,575	0.2
SUN COMMUNITIES INC	9,800	11,410	1,004	110,704	0.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	33,500	35,800	584	64,442	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	14,700	16,000	413	45,608	0.2
TAUBMAN CENTERS INC	9,300	9,800	586	64,685	0.3
TERRENO REALTY CORP	6,700	8,300	275	30,374	0.2
TIER REIT INC	—	7,200	124	13,754	0.1
UDR INC	41,100	43,600	1,753	193,298	1.0
UMH PROPERTIES INC	3,600	5,000	87	9,590	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,900	1,900	144	15,925	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES	14,100	16,200	395	43,553	0.2
URSTADT BIDDLE-CL A	3,900	5,000	96	10,631	0.1
VENTAS INC	51,600	57,620	3,853	424,721	2.1
VEREIT INC	139,300	156,200	1,299	143,253	0.7
VORNADO REALTY TRUST	27,200	28,010	2,623	289,148	1.4
WP CAREY INC	14,800	17,060	1,141	125,882	0.6
WP GLIMCHER INC	28,400	—	—	—	—
WASHINGTON PRIME GROUP INC	—	28,500	230	25,446	0.1
WASHINGTON REAL ESTATE INV	11,000	12,200	400	44,163	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	17,500	19,400	594	65,543	0.3
WELLTOWER INC	54,500	58,890	4,325	476,796	2.4
WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	1,250	11	1,304	0.0
WHITESTONE REIT	4,200	5,900	71	7,901	0.0
WINTHROP REALTY TRUST	5,400	—	—	—	—
XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,300	16,900	335	36,978	0.2
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	87,000	78	8,631	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	3,096,197	3,572,834	130,367	14,370,428
	銘 柄 数 < 比 率 >	156	158	—	<71.2%>
(カナダ)			千カナダドル		
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN	—	3,200	35	2,939	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	5,700	7,000	269	22,117	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	11,100	11,100	146	11,978	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,500	3,500	171	14,084	0.1
BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES	2,000	2,000	64	5,317	0.0
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,900	4,900	73	6,014	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	10,000	10,800	366	30,052	0.1
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	5,600	5,600	269	22,057	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	%
CHOICE PROPERTIES REIT	7,000	7,000	98	8,041	0.0
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	12,000	13,500	176	14,468	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	6,000	6,700	96	7,894	0.0
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	8,400	8,400	166	13,662	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	4,400	4,400	38	3,154	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	8,400	10,400	109	8,973	0.0
GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,400	3,900	202	16,585	0.1
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	21,300	23,300	537	44,064	0.2
INNVEST REAL ESTATE INVESTME	10,400	—	—	—	—
INTERRENT REAL ESTATE INVEST	5,200	5,200	42	3,472	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	4,600	6,700	84	6,961	0.0
MILESTONE APARTMENTS REAL ES	10,300	—	—	—	—
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	1,700	3,300	50	4,142	0.0
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4,300	4,300	64	5,263	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	3,100	3,500	73	6,048	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	4,700	7,000	75	6,165	0.0
ONEREIT	6,570	6,570	24	2,008	0.0
PLAZA RETAIL REIT	7,500	7,500	35	2,925	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE	13,600	23,000	157	12,928	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	24,000	26,400	673	55,162	0.3
SLATE OFFICE REIT	—	5,900	47	3,877	0.0
SLATE RETAIL REIT	2,300	2,300	33	2,757	0.0
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	9,700	10,600	339	27,820	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >	221,670 29	237,970 29	4,526 — <1.8%>	370,941
(イギリス)			千英ポンド		
BRITISH LAND	156,800	167,100	1,056	148,537	0.7
CAPITAL & REGIONAL PLC	—	64,000	36	5,104	0.0
DERWENT LONDON PLC	16,800	17,700	482	67,761	0.3
BIG YELLOW GROUP PLC	23,400	24,800	198	27,900	0.1
HAMMERSON PLC	120,200	129,900	765	107,619	0.5
MCKAY SECURITIES PLC-ORD	14,200	14,200	32	4,535	0.0
MUCKLOW < A & J > GROUP PLC	—	9,200	45	6,461	0.0
INTU PROPERTIES PLC	124,200	149,000	395	55,575	0.3
UNITE GROUP PLC	—	36,100	231	32,597	0.2
SHAFTESBURY PLC	42,200	45,800	445	62,565	0.3
LAND SECURITIES GROUP PLC	123,300	128,900	1,366	192,025	1.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC	53,400	—	—	—	—
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	78,700	78,700	50	7,161	0.0
HANSTEEN HOLDINGS PLC	108,500	120,000	149	21,013	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC	32,540	33,000	145	20,475	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC	99,500	112,000	185	26,050	0.1
SEGRO PLC	114,800	159,800	799	112,403	0.6
WORKSPACE GROUP PLC	17,800	19,900	180	25,352	0.1
REDEFINE INTERNATIONAL PLC	193,000	193,000	74	10,442	0.1
NEWRIVER REIT PLC	—	40,000	142	20,063	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	—	29,000	32	4,523	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	
(イギリス)		口	口	千英ポンド	千円	%
TRITAX BIG BOX REIT PLC		126,000	217,000	317	44,586	0.2
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		67,200	83,000	93	13,093	0.1
ASSURA PLC		254,700	256,000	157	22,108	0.1
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		91,000	91,000	102	14,451	0.1
REGIONAL REIT LTD		26,000	41,000	43	6,122	0.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		—	52,500	321	45,229	0.2
小 計	口 数 ・ 金 額	1,884,240	2,312,600	7,853	1,103,764	
	銘 柄 数 < 比 率 >	21	26	—	<5.5%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG		9,826	12,100	113	14,062	0.1
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		16,300	16,500	206	25,565	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	26,126	28,600	320	39,628	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.2%>	
(ユーロ…イタリア)						
BENI STABILI SPA		162,000	158,000	101	12,586	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		53,604	53,604	44	5,508	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	215,604	211,604	146	18,095	
	銘 柄 数 < 比 率 >	2	2	—	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)						
AFFINE		900	—	—	—	—
ICADE		5,540	7,120	530	65,541	0.3
ALTAREA		320	460	86	10,695	0.1
ALTAREA-RIGHTS		315	—	—	—	—
KLEPIERRE		28,856	33,800	1,275	157,529	0.8
GECINA SA		5,470	6,570	901	111,332	0.6
FONCIERE DES REGIONS		6,800	8,570	713	88,097	0.4
ANF IMMOBILIER		1,300	—	—	—	—
MERCIALYS		2,580	8,380	151	18,666	0.1
FONCIERE DES MURS		1,300	—	—	—	—
UNIBAIL RODAMCO-NA		15,060	16,110	3,762	464,705	2.3
小 計	口 数 ・ 金 額	68,441	81,010	7,421	916,567	
	銘 柄 数 < 比 率 >	11	7	—	<4.5%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPTI-CVA		7,530	8,000	295	36,474	0.2
VASTNED RETAIL NV		2,820	3,400	122	15,159	0.1
WERELDHAVE NV		6,160	6,500	285	35,303	0.2
NSI NV		20,070	22,000	85	10,616	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	36,580	39,900	789	97,554	
	銘 柄 数 < 比 率 >	4	4	—	<0.5%>	
(ユーロ…スペイン)						
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM		9,530	14,210	111	13,780	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		—	17,900	261	32,344	0.2
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		47,055	77,000	887	109,653	0.5
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		8,860	10,000	155	19,211	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	65,445	119,110	1,416	174,990	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	4	—	<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	
(ユーロ…ベルギー)		口	口	千ユーロ	千円	%
BEFIMMO S. C. A.		3,200	3,800	202	24,992	0.1
COFINIMMO		3,110	3,370	366	45,306	0.2
RETAIL ESTATES		870	1,080	86	10,671	0.1
WERELDHAVE BELGIUM		290	290	28	3,533	0.0
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES		1,140	1,900	42	5,268	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA		2,070	2,550	240	29,690	0.1
MONTEA SCA		—	940	45	5,630	0.0
AEDIFICA		2,238	2,787	213	26,398	0.1
XIOR STUDENT HOUSING NV		500	500	18	2,284	0.0
XIOR STUDENT HOUSING NV - RTS		—	500	1	145	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	13,418	17,717	1,246	153,921	
	銘 柄 数 < 比 率 >	8	10	—	< 0.8% >	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		100,509	114,000	162	20,064	0.1
HIBERNIA REIT PLC		108,000	118,000	158	19,616	0.1
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		52,800	52,800	71	8,869	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	261,309	284,800	393	48,550	
	銘 柄 数 < 比 率 >	3	3	—	< 0.2% >	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	686,923	782,741	11,734	1,449,308	
	銘 柄 数 < 比 率 >	33	32	—	< 7.2% >	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		346,500	359,500	22,738	321,520	1.6
PROSPERITY REIT		180,000	180,000	601	8,500	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		160,000	160,000	755	10,678	0.1
CHAMPION REIT		339,000	358,000	1,847	26,120	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT		150,000	174,000	904	12,793	0.1
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT		120,000	120,000	274	3,885	0.0
FORTUNE REIT		210,000	228,000	2,177	30,788	0.2
NEW CENTURY REIT		65,000	—	—	—	—
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN		124,000	124,000	422	5,978	0.0
小 計	口 数 ・ 金 額	1,694,500	1,703,500	29,721	420,267	
	銘 柄 数 < 比 率 >	9	8	—	< 2.1% >	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		412,300	438,000	843	67,156	0.3
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		343,600	399,000	1,077	85,806	0.4
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		309,300	355,000	582	46,372	0.2
SUNTEC REIT		381,300	408,000	750	59,794	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		230,900	255,000	304	24,271	0.1
STARHILL GLOBAL REIT		209,900	209,900	157	12,538	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST		124,000	193,000	220	17,601	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		85,000	105,000	145	11,624	0.1
KEPPEL REIT		274,000	285,000	324	25,878	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		90,100	94,000	194	15,498	0.1
CAMBRIDGE INDUSTRIAL TRUST		153,300	200,000	115	9,159	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		110,400	114,000	183	14,618	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST		110,000	110,000	172	13,755	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		83,500	83,500	110	8,779	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	%
PARKWAY LIFE REAL ESTATE	59,000	59,000	155	12,359	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	282,800	282,800	120	9,573	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	177,000	197,000	359	28,636	0.1
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	212,500	292,025	454	36,168	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST	127,000	127,000	112	8,952	0.0
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	89,400	89,400	126	10,111	0.1
SABANA SHARIAH COMP IND REIT	94,200	133,764	57	4,581	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM	271,900	303,000	331	26,426	0.1
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	129,000	129,000	103	8,219	0.0
FAR EAST HOSPITALITY TRUST	140,000	142,000	93	7,408	0.0
SPH REIT	120,500	120,500	119	9,549	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST	155,743	200,043	146	11,631	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	97,000	106,700	74	5,949	0.0
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	79,650	79,650	56	4,536	0.0
FRASERS HOSPITALITY TRUST	88,000	—	—	—	—
KEPPEL DC REIT	145,000	119,756	153	12,257	0.1
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	—	178,000	186	14,886	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	5,186,293	5,809,038	7,835	624,104
銘 柄 数 < 比 率 >	30	30	—	<3.1%>	—
(オーストラリア)			千豪ドル		
BWP TRUST	73,000	83,000	258	21,427	0.1
MIRVAC GROUP	555,000	595,000	1,314	109,153	0.5
INVESTA OFFICE FUND	94,000	103,000	481	39,928	0.2
CROMWELL PROPERTY GROUP	204,000	208,000	206	17,179	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT	53,000	55,000	236	19,631	0.1
ASPEN GROUP	13,000	13,000	14	1,208	0.0
GPT GROUP	277,000	288,000	1,463	121,446	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP	45,000	45,000	151	12,588	0.1
ALE PROPERTY GROUP	26,000	26,000	120	9,971	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP	364,000	393,000	1,831	152,022	0.8
DEXUS	146,000	157,000	1,601	132,932	0.7
GOODMAN GROUP	243,000	256,200	2,136	177,368	0.9
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	7,000	7,000	46	3,864	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD	42,450	19,000	18	1,498	0.0
CHARTER HALL GROUP	53,000	76,000	434	36,086	0.2
GALILEO JAPAN TRUST	18,170	—	—	—	—
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	26,550	37,550	127	10,566	0.1
GENERATION HEALTHCARE REIT	—	22,000	49	4,127	0.0
INGENIA COMMUNITIES GROUP	22,285	32,000	85	7,118	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	109,100	122,000	283	23,495	0.1
ARENA REIT	35,220	35,220	78	6,490	0.0
PROPERTYLINK GROUP	—	109,000	89	7,419	0.0
CHARTER HALL LONG WALE REIT	—	25,000	105	8,716	0.0
INDUSTRIA REIT	18,400	23,000	51	4,295	0.0
NATIONAL STORAGE REIT	44,860	89,000	130	10,860	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	22,680	22,680	67	5,591	0.0
GDI PROPERTY GROUP	70,300	70,300	73	6,098	0.0

銘 柄		期首(前期末)		当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		口	口	千豪ドル	千円	%
360 CAPITAL OFFICE FUND		11,100	—	—	—	—
SCENTRE GROUP		819,000	866,000	3,619	300,486	1.5
WESTFIELD CORP		292,000	311,400	2,615	217,134	1.1
FOLKESTONE EDUCATION TRUST		33,250	33,250	92	7,645	0.0
VICINITY CENTRES		499,000	525,000	1,438	119,409	0.6
CENTURIA URBAN REIT		—	11,100	27	2,257	0.0
VIVA ENERGY REIT		—	69,000	163	13,574	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	4,217,365	4,727,700	19,414	1,611,596	
	銘 柄 数 < 比 率 >	29	32	—	<8.0%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND		158,571	158,571	193	15,358	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST		39,300	48,033	107	8,503	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST		170,000	174,000	215	17,129	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD		67,525	67,525	109	8,684	0.0
STRIDE PROPERTY LTD		58,000	—	—	—	—
ARGOSY PROPERTY LTD		119,000	138,000	144	11,503	0.1
INVESTORE PROPERTY LTD		—	32,000	43	3,455	0.0
STRIDE STAPLED GROUP		—	58,000	101	8,058	0.0
KIWI PROPERTY GROUP LTD		190,000	215,000	306	24,323	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	802,396	891,129	1,222	97,015	
	銘 柄 数 < 比 率 >	7	8	—	<0.5%>	
(イスラエル)				千新シェケル		
REIT 1 LTD		22,490	28,000	361	11,297	0.1
小 計	口 数 ・ 金 額	22,490	28,000	361	11,297	
	銘 柄 数 < 比 率 >	1	1	—	<0.1%>	
合 計	口 数 ・ 金 額	17,812,074	20,065,512	—	20,058,724	
	銘 柄 数 < 比 率 >	315	324	—	<99.4%>	

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

* 比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別			当 期 末	
			買 建 額	売 建 額
外 国	REIT先物取引	DJREA FTEPR	百万円	百万円
			94	—
			8	—

* 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

(2017年6月12日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
投資証券	千円 20,058,724	% 99.3
コール・ローン等、その他	139,307	0.7
投資信託財産総額	20,198,031	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産（20,160,824千円）の投資信託財産総額（20,198,031千円）に対する比率は99.8%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝110.23円、1カナダドル＝81.94円、1英ポンド＝140.54円、1ユーロ＝123.51円、1香港ドル＝14.14円、1シンガポールドル＝79.65円、1豪ドル＝83.01円、1ニュージーランドドル＝79.39円、1新シェケル＝31.23円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年6月12日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	20,205,404,582
コール・ローン等	86,646,805
投資証券(評価額)	20,058,724,899
未収入金	12,325,807
未収配当金	14,651,752
差入委託証拠金	33,055,319
(B) 負債	30,042,775
未払金	21,314,690
未払解約金	8,171,552
未払利息	33
その他未払費用	556,500
(C) 純資産総額(A－B)	20,175,361,807
元本	9,395,943,368
次期繰越損益金	10,779,418,439
(D) 受益権総口数	9,395,943,368口
1万口当たり基準価額(C／D)	21,472円

(注) 期首元本額は8,726,852,013円、期中追加設定元本額は2,960,942,947円、期中一部解約元本額は2,291,851,592円、1口当たり純資産額は2,1472円です。

○損益の状況 (2016年6月11日～2017年6月12日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	712,793,795
受取配当金	712,815,117
受取利息	1,967
支払利息	△ 23,289
(B) 有価証券売買損益	174,343,752
売買益	1,763,203,374
売買損	△ 1,588,859,622
(C) 先物取引等取引損益	3,259,408
取引益	11,810,259
取引損	△ 8,550,851
(D) 保管費用等	△ 11,636,169
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	878,760,786
(F) 前期繰越損益金	9,184,971,268
(G) 追加信託差損益金	3,187,775,270
(H) 解約差損益金	△ 2,472,088,885
(I) 計(E＋F＋G＋H)	10,779,418,439
次期繰越損益金(I)	10,779,418,439

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村世界 6 資産分散投信 (分配コース)	2,856,366,230
野村インデックスファンド・外国REIT	1,731,393,787
野村世界 6 資産分散投信 (安定コース)	976,661,403
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)	956,675,297
野村世界 6 資産分散投信 (成長コース)	782,217,270
野村世界 6 資産分散投信 (配分変更コース)	683,303,192
野村DC運用戦略ファンド	494,494,297
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)	443,014,268
野村インデックスファンド・海外 5 資産バランス	182,259,148
ネクストコア	117,401,540
野村資産設計ファンド2040	31,574,541
野村資産設計ファンド2015	23,745,703
野村資産設計ファンド2030	23,729,926
野村資産設計ファンド2020	21,011,205
野村資産設計ファンド2025	20,560,411
ファンドラップ (ウエルス・スクエア) REIT	19,069,820
野村資産設計ファンド2035	17,412,690
野村DC運用戦略ファンド (マイルド)	9,086,491
野村資産設計ファンド2045	2,805,616
野村資産設計ファンド2050	2,797,811
インデックス・ブレンド (タイプV)	130,637
インデックス・ブレンド (タイプIV)	107,266
インデックス・ブレンド (タイプIII)	71,717
インデックス・ブレンド (タイプI)	36,681
インデックス・ブレンド (タイプII)	16,421

○お知らせ

外国為替予約取引に係る担保授受に関する規定を追加する所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日：2017年3月31日>