ネクストコア

運用報告書(全体版)

第９期（決算日2017年８月17日）

作成対象期間（2017年２月18日～2017年８月17日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／内外／資産複合	
信託期間	2013年１月31日から2028年２月17日までです。	
運用方針	マザーファンドへの投資を通じて、国内および外国の株式、公社債、不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とし、為替予約取引等を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行うことを基本とします。	
主な投資対象	ネクストコア	「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」および「野村マネー マザーファンド」の受益証券を主要投資対象とし、為替予約取引等を主要取引対象とします。
	国内株式マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式を主要投資対象とします。
	外国債券マザーファンド	外国の公社債を主要投資対象とします。
	新興国株式マザーファンド	新興国の株式を主要投資対象とします。
	新興国債券マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。
	J-REITインデックス マザーファンド	J-REITを主要投資対象とします。
	海外REITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とします。
	野村マネー マザーファンド	本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	ネクストコア	株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨建て資産への実質投資割合には制限を設けません。 デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
	国内株式マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。
	国内債券マザーファンド	外貨建て資産への投資は行いません。
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。
	外国債券マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国株式マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。
	新興国債券マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
	J-REITインデックス マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
	海外REITインデックス マザーファンド	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。
	野村マネー マザーファンド	株式への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益等から基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋１－１２－１

サポートダイヤル　0120－753104
〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

ホームページ　http://www.nomura-am.co.jp/

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率						
	円	円	%	%	%	%	%	%	百万円
5期(2015年8月17日)	10,175	0	△2.7	8.9	0.1	53.6	－	6.4	2,712
6期(2016年2月17日)	9,984	0	△1.9	7.1	0.1	58.2	－	9.5	3,004
7期(2016年8月17日)	10,329	0	3.5	7.8	0.1	43.2	－	14.2	3,714
8期(2017年2月17日)	10,153	0	△1.7	10.7	0.2	46.3	－	12.3	4,295
9期(2017年8月17日)	10,230	0	0.8	14.2	0.2	60.4	－	14.4	3,911

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

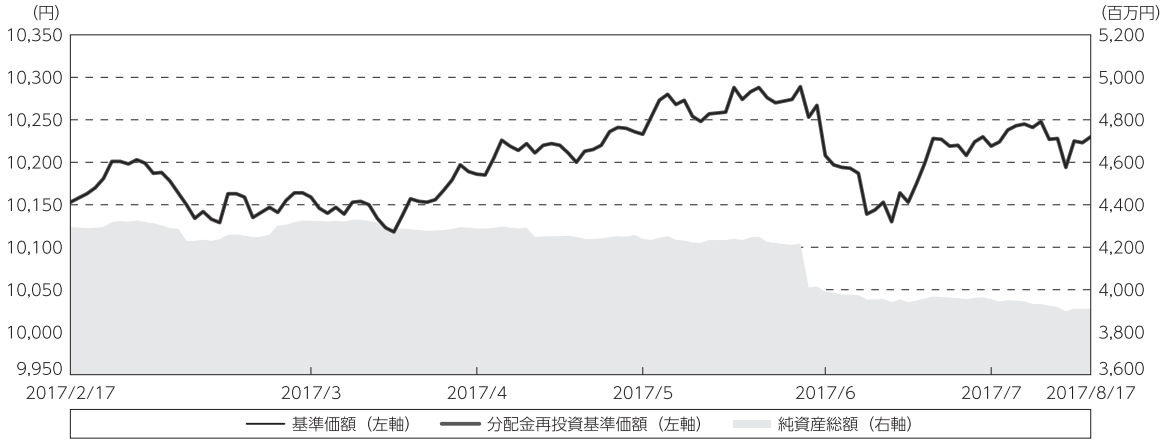
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		株式組入比率	株式先物比率	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					
(期首)	円	%	%	%	%	%	%
2017年2月17日	10,153	－	10.7	0.2	46.3	－	12.3
2月末	10,198	0.4	13.7	0.3	54.5	－	14.4
3月末	10,159	0.1	14.1	0.3	57.7	－	16.1
4月末	10,186	0.3	14.7	0.3	61.1	－	16.6
5月末	10,233	0.8	13.5	0.2	55.1	－	16.4
6月末	10,208	0.5	15.3	0.2	59.4	－	16.8
7月末	10,219	0.7	14.1	0.2	59.4	－	14.4
(期末)							
2017年8月17日	10,230	0.8	14.2	0.2	60.4	－	14.4

＊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：10,153円
期　末：10,230円（既払分配金（税込み）：0円）
騰落率：　0.8%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2017年２月17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）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10,153円から期末10,230円と77円の値上がりとなりました。

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

〇投資環境

先進国の債券市場は、当作成期間では、欧州を中心としてインフレ懸念の高まりやECB（欧州中央銀行）の金融緩和姿勢の後退懸念などから利回りが上昇（価格は下落）する場面もありましたが、FRB（米連邦準備制度理事会）が追加利上げに慎重な姿勢を示したことなどを背景に利回りは低下（価格は上昇）しました。国内の債券市場と新興国の債券市場（現地通貨建て、米ドル建て）も、利回りが低下しました。

国内および先進国の株式市場は、当作成期間では、好調な企業決算などを背景に上昇しました。

国内のREIT市場は、当作成期間では、国内不動産市況の先行きに慎重な見方がなされ下落しました。先進国のREIT市場は先進国の株式市場が上昇したことなどを背景に上昇しました。

為替市場では、当作成期間では、米ドルは対円で下落（円高）、ユーロは対円で上昇（円安）、英ポンドは概ね横ばいとなりました。

〇当ファンドのポートフォリオ

[ネクストコア]

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

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

[各マザーファンド]

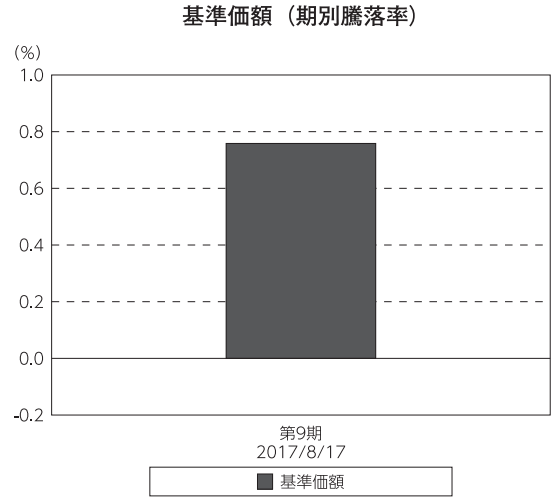
各マザーファンド（野村マネー マザーファンドを除く）は、ポートフォリオの特性値等を各指数に近似させることで、各指数の中長期的な動きを概ね捉える運用を行ないました。

野村マネー マザーファンドは、残存期間の短い公社債やCP等の短期有価証券への投資を行ない、あわせてコール・ローン等で運用を行うことで流動性の確保を図りました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



（注）基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配金は、基準価額水準等を勘案し、１万口当たり０円とさせていただきました。なお、留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり・税込み）

項　　目	第９期 2017年２月18日～ 2017年８月17日
当期分配金	－
（対基準価額比率）	－％
当期の収益	－
当期の収益以外	－
翌期繰越分配対象額	1,003

（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

[ネクストコア]

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

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

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

[各マザーファンド]

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

野村マネー マザーファンドは、残存期間の短い公社債やCP等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図る運用を行なう方針です。

引き続き、当ファンドをご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

（2017年２月18日～2017年８月17日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	74	0.723	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(36)	(0.348)	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）	(36)	(0.348)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（受託会社）	(3)	(0.027)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（新株予約権証券）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.001)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	0	0.001	(c)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(0)	(0.000)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	1	0.008	(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)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	75	0.733	
期中の平均基準価額は、10,200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

（2017年２月18日～2017年８月17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	75,390	111,500	61,393	93,500
国内債券マザーファンド	179,250	239,500	53,823	72,000
外国債券マザーファンド	232,405	503,500	108,023	237,000
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	42,418	98,000	19,953	47,500
野村マネー マザーファンド	－	－	323,261	330,000
J－REITインデックス マザーファンド	37,627	74,000	79,687	152,000
海外REITインデックス マザーファンド	72,102	154,500	13,941	30,500
新興国債券マザーファンド	56,404	102,000	33,252	61,500
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	46,196	59,000	23,903	31,500

＊単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

（2017年２月18日～2017年８月17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
(a) 期中の株式売買金額	22,491,103千円	49,180,091千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	322,273,488千円	354,908,871千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.06	0.13

＊(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

（2017年２月18日～2017年８月17日）

利害関係人との取引状況

＜ネクストコア＞

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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	9,157	6	0.1	13,333	1,277	9.6
貸株	61,910	5,949	9.6	64,672	6,638	10.3

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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	45,401	2,698	5.9	14,184	142	1.0

平均保有割合　0.1%

＜国内債券マザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	8,068	319	4.0	6,900	225	3.3

平均保有割合　3.6%

＜野村マネー マザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	24,076	2,667	11.1	－	－	－

平均保有割合　0.8%

＜外国債券マザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	28,180	892	3.2	52,465	784	1.5

平均保有割合　0.2%

＜新興国債券マザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	2,395	225	9.4	288	－	－

平均保有割合　2.5%

＜新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	3,833	445	11.6	2,966	442	14.9

平均保有割合　3.2%

＜J−REITインデックス マザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	11,683	292	2.5	5,962	138	2.3

平均保有割合　1.5%

＜海外REITインデックス マザーファンド＞

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	2,396	101	4.2	1,403	35	2.5

平均保有割合　1.2%

利害関係人の発行する有価証券等

＜国内株式マザーファンド＞

種類	買付額	売付額	当期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	47	62	1,799

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
	百万円
株式	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）	38千円
うち利害関係人への支払額（B）	0.898千円
（B）／（A）	2.4%

＊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證券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

（2017年８月17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	165,031	179,029	275,866
国内債券マザーファンド	292,514	417,942	559,457
外国債券マザーファンド	518,093	642,475	1,437,281
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	101,516	123,982	298,549
野村マネー マザーファンド	343,183	19,922	20,336
J－REITインデックス マザーファンド	211,640	169,579	321,320
海外REITインデックス マザーファンド	53,789	111,949	242,886
新興国債券マザーファンド	98,605	121,757	223,839
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	88,282	110,575	148,502

＊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８月17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	275,866	7.0
国内債券マザーファンド	559,457	14.1
外国債券マザーファンド	1,437,281	36.3
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	298,549	7.5
野村マネー マザーファンド	20,336	0.5
J－REITインデックス マザーファンド	321,320	8.1
海外REITインデックス マザーファンド	242,886	6.1
新興国債券マザーファンド	223,839	5.7
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	148,502	3.8
コール・ローン等、その他	431,346	10.9
投資信託財産総額	3,959,382	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（652,144,348千円）の投資信託財産総額（653,632,476千円）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（406,654,719千円）の投資信託財産総額（407,327,380千円）に対する比率は99.8%です。

＊海外REITインデックス マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（20,139,346千円）の投資信託財産総額（20,202,285千円）に対する比率は99.7%です。

＊新興国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（10,358,689千円）の投資信託財産総額（10,460,646千円）に対する比率は99.0%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（5,344,927千円）の投資信託財産総額（5,417,454千円）に対する比率は98.7%です。

＊外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。１カタールリヤル＝30.19円、１米ドル＝110.00円、１カナダドル＝87.09円、１英ポンド＝141.77円、１スイスフラン＝113.93円、１スウェーデンクローナ＝13.62円、１ノルウェークローネ＝13.88円、１デンマーククローネ＝17.40円、１トルコリラ＝31.29円、１ユーロ＝129.42円、１チェココルナ＝4.97円、１フォリント＝0.425円、１ズロチ＝30.33円、１ルーブル＝1.85円、１レイ＝28.23円、１香港ドル＝14.06円、１シンガポールドル＝80.70円、１リンギ＝25.63円、１バーツ＝3.31円、１フィリピンペソ＝2.14円、１ルピア＝0.0083円、１ウォン＝0.0969円、１新台湾ドル＝3.62円、１豪ドル＝87.23円、１ニュージーランドドル＝80.38円、１インドルピー＝1.73円、１新シェケル＝30.35円、１パキスタンルピー＝1.05円、１アルゼンチンペソ＝6.39円、１メキシコペソ＝6.23円、１レアル＝34.89円、１チリペソ＝0.1704円、１コロンビアペソ＝0.037円、１ソル＝33.92円、１UAEディルハム＝29.90円、１エジプトポンド＝6.18円、１ランド＝8.35円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年８月17日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	5,923,490,523
コール・ローン等	412,018,996
国内株式マザーファンド(評価額)	275,866,158
国内債券マザーファンド(評価額)	559,457,169
外国債券マザーファンド(評価額)	1,437,281,556
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	298,549,879
野村マネー マザーファンド(評価額)	20,336,534
J-REITインデックス マザーファンド(評価額)	321,320,134
海外REITインデックス マザーファンド(評価額)	242,886,194
新興国債券マザーファンド(評価額)	223,839,098
新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド(評価額)	148,502,944
未収入金	1,983,431,861
(B) 負債	2,011,796,485
未払金	1,978,546,900
未払解約金	2,933,195
未払信託報酬	30,248,696
未払利息	536
その他未払費用	67,158
(C) 純資産総額(A－B)	3,911,694,038
元本	3,823,721,794
次期繰越損益金	87,972,244
(D) 受益権総口数	3,823,721,794口
１万口当たり基準価額(C／D)	10,230円

(注) 期首元本額は4,230,955,304円、期中追加設定元本額は332,500,890円、期中一部解約元本額は739,734,400円、１口当たり純資産額は1.0230円です。

○損益の状況 (2017年２月18日～2017年８月17日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	△ 96,815
支払利息	△ 96,815
(B) 有価証券売買損益	58,598,438
売買益	180,698,157
売買損	△122,099,719
(C) 信託報酬等	△ 30,315,854
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	28,185,769
(E) 前期繰越損益金	4,980,426
(F) 追加信託差損益金	54,806,049
(配当等相当額)	(246,708,328)
(売買損益相当額)	(△191,902,279)
(G) 計(D＋E＋F)	87,972,244
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G＋H)	87,972,244
追加信託差損益金	54,806,049
(配当等相当額)	(247,353,887)
(売買損益相当額)	(△192,547,838)
分配準備積立金	136,253,510
繰越損益金	△103,087,315

＊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 (2017年２月18日～2017年８月17日) は以下の通りです。

項目	当期 2017年２月18日～ 2017年８月17日
a. 配当等収益(経費控除後)	24,260,593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	247,353,887円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	111,992,917円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	383,607,397円
f. 分配対象収益(１万口当たり)	1,003円
g. 分配金	0円
h. 分配金(１万口当たり)	0円

○分配金のお知らせ

１万口当たり分配金（税込み）	0円

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

○お知らせ

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金利先渡取引および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＞

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＞

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2017年８月17日現在）

＜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(215,219,448千口)の内容です。

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業（0.1%）			
極洋	6.2	6.1	20,374
日本水産	204	202.2	128,801
マルハニチロ	29.8	29.5	93,220
カネコ種苗	5.4	5.3	7,748
サカタのタネ	23.2	23	77,280
ホクト	16	15.8	30,415
ホクリヨウ	1.7	2.2	2,156
鉱業（0.3%）			
住石ホールディングス	43.6	43.2	4,795
日鉄鉱業	4.4	4.3	31,562
三井松島産業	9.7	9	12,807
国際石油開発帝石	827.7	820.3	847,369
日本海洋掘削	5.5	5.4	11,502
石油資源開発	24.9	24.7	54,463
Ｋ＆Ｏエナジーグループ	10.6	9.2	15,630
建設業（3.2%）			
ショーボンドホールディングス	15.2	15.1	89,543
ミライト・ホールディングス	48.3	47.9	63,802
タマホーム	11.8	11.7	8,307
サンヨーホームズ	3.3	3.3	2,115
ファーストコーポレーション	2.6	3.5	3,895
インベスターズクラウド	1.5	2.6	13,156
ダイセキ環境ソリューション	3.7	4.3	5,766
安藤・間	112.9	111.9	83,925
東急建設	55.8	55.3	47,558
コムシスホールディングス	61.4	60.8	144,156
ミサワホーム	18.6	18.4	17,903
ビーアールホールディングス	15.6	15.4	6,190
高松コンストラクショングループ	11.8	11.7	33,707
東建コーポレーション	5.9	5.8	86,362
ソネック	2	1.9	1,537
ヤマウラ	7.4	7.3	7,321
大成建設	799	792	840,312
大林組	471.2	467	595,892
清水建設	481	476.4	553,576
飛島建設	151.3	150	23,850
長谷工コーポレーション	183.3	181.7	240,207
松井建設	17.3	17.2	16,942
錢高組	22	22	10,824
鹿島建設	690	684	677,844
不動テトラ	126.8	125.7	22,123
大末建設	5.5	5.5	5,472
鉄建建設	96	95	33,630
西松建設	182	180	111,420
三井住友建設	602	596.7	72,797
大豊建設	57	56	28,224
前田建設工業	99	103	137,093
佐田建設	10.8	10.7	4,868
ナカノフドー建設	12	11.9	7,163
奥村組	129	128	102,272
東鉄工業	18.9	18.7	63,673
イチケン	14	14	6,650
淺沼組	51	54	16,956
戸田建設	183	181	145,886
熊谷組	247	244	85,156
青木あすなろ建設	10.3	10.2	9,271
北野建設	33	32	13,888
植木組	19	19	5,111
三井ホーム	20	20	14,600
矢作建設工業	21.4	21.2	18,634
ピーエス三菱	16.5	16.4	8,446
日本ハウスホールディングス	32	29.8	16,509
大東建託	57.8	56.4	1,087,956
新日本建設	18.7	18.5	15,429
ＮＩＰＰＯ	36	36	75,456
東亜道路工業	30	29	12,412
前田道路	49	49	106,330
日本道路	47	46	26,818
東亜建設工業	12.7	12.6	24,368

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	90	90	16,470
東洋建設	45.2	44.8	21,996
五洋建設	174.3	172.8	108,345
大林道路	16.3	4	3,752
世紀東急工業	22.9	22.7	13,710
福田組	25	5	30,450
住友林業	108.1	107.2	176,558
日本基礎技術	17.5	17.3	6,920
日成ビルド工業	46	46	26,358
ヤマダ・エスバイエルホーム	80	79	6,715
巴コーポレーション	19.5	19.3	7,160
パナホーム	59	29	34,684
大和ハウス工業	464.1	460	1,780,200
ライト工業	30.2	29.9	32,471
積水ハウス	494.4	476.9	913,978
日特建設	13.4	13.3	7,594
北陸電気工事	7.6	7.5	7,177
ユアテック	25	25	19,625
西部電気工業	2.6	2.6	6,299
四電工	12	12	7,320
中電工	19.9	17.6	52,131
関電工	63	62	73,098
きんでん	104.5	103.5	186,300
東京エネシス	16	16.1	16,776
トーエネック	22	22	15,290
住友電設	10.9	10.8	19,126
日本電設工業	25.6	23.9	51,313
協和エクシオ	61.6	61	124,623
新日本空調	12.1	12	18,408
ＮＤＳ	2.5	2.4	7,980
九電工	30.5	30.6	132,192
三機工業	34.8	33	38,577
日揮	146.6	145.3	256,745
中外炉工業	48	47	10,152
ヤマト	14.1	13.9	10,355
太平電業	21	21	30,387
高砂熱学工業	43.2	42.9	77,477
三晃金属工業	1.4	1.4	4,578
朝日工業社	3.6	3.5	11,585
明星工業	28.4	28.2	20,275
大氣社	20.8	20.6	58,318
ダイダン	21	21	27,300

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日比谷総合設備	17.5	17.4	39,063
東芝プラントシステム	25.5	25.3	45,793
ＯＳＪＢホールディングス	48	47.6	14,089
東洋エンジニアリング	92	92	25,024
千代田化工建設	113	112	62,832
新興プランテック	32.3	32	29,664
食料品（4.6%）			
日本製粉	46.7	46.3	80,886
日清製粉グループ本社	172.3	170.7	319,550
日東富士製粉	1	1	3,930
昭和産業	65	64	38,592
鳥越製粉	12.5	12.4	10,242
中部飼料	17.2	17	31,229
フィード・ワン	94.5	93.7	21,925
東洋精糖	24	24	2,856
日本甜菜製糖	8	7.9	17,861
三井製糖	11.1	11	41,195
塩水港精糖	16.8	16.6	4,133
日新製糖	6.7	6.6	12,962
森永製菓	30.7	30.4	193,040
中村屋	3.6	3.6	17,874
江崎グリコ	39.3	38.9	229,510
名糖産業	6.8	6.7	9,782
不二家	90	8.9	21,520
山崎製パン	115.1	114.1	241,435
第一屋製パン	24	2.4	2,858
モロゾフ	24	2.4	17,616
亀田製菓	8.7	8.7	44,370
寿スピリッツ	11.2	14.8	54,464
カルビー	64.1	63.5	259,080
森永乳業	141	140	120,960
六甲バター	7	6.9	16,546
ヤクルト本社	84.2	83.5	631,260
明治ホールディングス	93.1	92.2	823,346
雪印メグミルク	33.9	33.6	109,368
プリマハム	99	98	65,366
日本ハム	107	109	359,700
林兼産業	5	5	4,355
丸大食品	75	74	37,814
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	8.4	8.4	35,154
伊藤ハム米久ホールディングス	90.6	89.8	91,596
サッポロホールディングス	51.5	51	155,040

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アサヒグループホールディングス	294.8	292.2	1,345,288
キリンホールディングス	676.5	670.5	1,625,627
宝ホールディングス	113.7	112.7	119,123
オエノンホールディングス	40	39.6	10,890
養命酒製造	4.8	4.8	10,089
コカ・コーラボトラーズジャパン	53.2	97.9	359,293
コカ・コーライーストジャパン	61.1	－	－
サントリー食品インターナショナル	107.6	106.7	554,840
ダイドーグループホールディングス	7.2	7.1	39,405
伊藤園	46.6	46.2	192,885
キーコーヒー	13.8	13.7	29,920
ユニカフェ	4.2	4.2	4,237
ジャパンフーズ	2	2	2,782
日清オイリオグループ	91	90	70,380
不二製油グループ本社	41.9	41.6	123,676
かどや製油	1.5	1.5	8,955
Ｊ－オイルミルズ	7.3	7.2	27,864
キッコーマン	110	108.9	376,249
味の素	323.7	320.8	713,138
キユーピー	79.9	79.2	218,592
ハウス食品グループ本社	58.2	57.6	186,336
カゴメ	56.4	55.9	194,532
焼津水産化学工業	7.4	7.3	8,694
アリアケジャパン	12.9	12.7	99,568
ピエトロ	1.8	1.8	2,948
エバラ食品工業	3.8	3.7	7,670
ニチレイ	77.3	72.5	211,627
東洋水産	77.2	76.6	306,017
イートアンド	1.7	1.7	4,023
大冷	1.2	1.6	3,012
ヨシムラ・フード・ホールディングス	－	0.3	1,149
日清食品ホールディングス	61.4	60.8	411,616
永谷園ホールディングス	15	15	20,205
一正蒲鉾	5.5	5.4	6,966
フジッコ	15.2	15.1	40,166
ロック・フィールド	15.2	15	28,455
日本たばこ産業	870.8	863	3,265,592
ケンコーマヨネーズ	6.4	8.4	24,998
わらべや日洋ホールディングス	9.2	9.1	27,099
なとり	7.9	7.8	15,795
イフジ産業	－	2.4	1,900
北の達人コーポレーション	3.4	6.7	7,155
ユーグレナ	50.6	53.8	61,063
ミヨシ油脂	54	5.3	7,875
理研ビタミン	4.7	4.6	18,998
繊維製品（0.7%）			
片倉工業	18.4	16.7	21,476
グンゼ	110	109	49,595
東洋紡	582	576	114,048
ユニチカ	402	399	32,718
富士紡ホールディングス	7.1	7.1	24,104
倉敷紡績	148	147	41,013
シキボウ	79	78	12,246
日本毛織	41.4	41	38,622
ダイトウボウ	20	19	1,539
トーア紡コーポレーション	6.2	6.2	3,484
ダイドーリミテッド	16.4	16.3	7,204
帝国繊維	15.4	15.2	32,573
帝人	120	119	262,752
東レ	1,065	1,056	1,059,696
サカイオーベックス	3.6	3.4	6,402
住江織物	40	40	12,440
日本フエルト	8.4	8.3	4,191
イチカワ	10	10	3,300
日東製網	1.6	1.6	2,963
アツギ	121	120	15,000
ダイニック	28	28	5,348
セーレン	36.6	36.3	69,478
ソトー	5.5	5.4	6,291
東海染工	20	20	2,740
小松精練	20.7	20.5	17,486
ワコールホールディングス	87	87	136,068
ホギメディカル	9.2	9.2	72,312
レナウン	39.7	39.3	8,056
クラウディア	3.4	3.3	2,191
ＴＳＩホールディングス	60.5	60	47,760
三陽商会	77	7.6	12,768
ナイガイ	54	5.3	3,487
オンワードホールディングス	95	94	74,730
ルック	27	25	8,975
キムラタン	620	615	3,690
ゴールドウイン	6.2	6.2	47,492
デサント	33.5	33.2	46,513
キング	7.3	7.2	3,211

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ヤマトインターナショナル	9	9.7	4,607
パルプ・紙（0.3%）			
特種東海製紙	8.5	8.5	36,507
王子ホールディングス	574	569	324,330
日本製紙	65.8	65.2	137,376
三菱製紙	20.9	20.7	15,297
北越紀州製紙	82	81.3	60,568
中越パルプ工業	58	58	12,934
巴川製紙所	23	22	6,314
大王製紙	58.5	58	79,054
阿波製紙	2.7	3.5	2,131
レンゴー	141.6	140.4	88,171
トーモク	46	46	17,388
ザ・パック	10.4	10.3	36,616
化学（7.2%）			
クラレ	247.2	245	518,420
旭化成	916	908	1,163,602
共和レザー	8.5	8.5	8,058
昭和電工	97.8	96.9	277,230
住友化学	1,081	1,072	707,520
住友精化	6.1	6	29,520
日産化学工業	80.5	78.7	289,616
ラサ工業	55	55	9,295
クレハ	11.1	11	62,920
多木化学	10	2	9,160
テイカ	22	22	20,108
石原産業	26.4	26.1	35,939
片倉コープアグリ	20	20	5,160
日東エフシー	8.6	8.5	7,743
日本曹達	88	87	54,549
東ソー	425	421	503,937
トクヤマ	228	226	107,576
セントラル硝子	150	148	64,972
東亞合成	91.9	85.4	114,436
大阪ソーダ	63	63	32,445
関東電化工業	30	29.8	34,091
デンカ	304	287	196,308
信越化学工業	263.4	261	2,547,882
日本カーバイド工業	50	50	12,150
堺化学工業	55	54	27,270
エア・ウォーター	121.1	120	247,800
大陽日酸	113.1	112.1	145,617

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
日本化学工業	54	54	12,528
東邦アセチレン	－	2.3	3,647
日本パーカライジング	75.1	74.4	115,840
高圧ガス工業	21.8	21.6	17,949
チタン工業	17	17	3,587
四国化成工業	21	21	30,618
戸田工業	29	29	13,021
ステラ　ケミファ	7	7.1	32,092
保土谷化学工業	5.1	5.1	36,873
日本触媒	23.1	22.9	174,727
大日精化工業	61	60	65,100
カネカ	198	196	167,776
三菱瓦斯化学	136.8	135.6	368,560
三井化学	667	662	419,708
ＪＳＲ	147.6	146.3	301,963
東京応化工業	27.5	27.2	103,496
大阪有機化学工業	9.5	9.4	12,041
三菱ケミカルホールディングス	989.5	980.7	937,058
ＫＨネオケム	18	22.2	54,945
ダイセル	198.1	196.3	268,538
住友ベークライト	130	128	102,784
積水化学工業	333.4	324	668,088
日本ゼオン	124	123	168,141
アイカ工業	47.1	46.7	162,282
宇部興産	740	733	221,366
積水樹脂	22.7	22.5	44,505
タキロンシーアイ	31	31	19,499
旭有機材	47	47	12,549
日立化成	81.6	80.9	245,936
ニチバン	14	14	15,988
リケンテクノス	31.7	31.4	19,154
大倉工業	35	35	23,100
積水化成品工業	20.9	20.3	20,543
群栄化学工業	3.5	3.5	12,477
タイガースポリマー	7.2	7.2	5,104
ミライアル	5.3	5.2	5,933
ダイキアクシス	2.4	4.8	4,512
ダイキョーニシカワ	25.7	25.5	47,328
竹本容器	－	1.6	2,806
日本化薬	95	95	160,265
カーリットホールディングス	13.6	13.5	8,761
日本精化	12.2	12	11,796

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
扶桑化学工業	10.4	10.3	33,320
ＡＤＥＫＡ	63.2	62.6	115,872
日油	118	112	163,296
新日本理化	23.2	23	7,015
ハリマ化成グループ	12.5	12.4	10,912
花王	373	341.8	2,310,568
第一工業製薬	33	32	18,528
日華化学	4.6	4.6	5,115
ニイタカ	2.1	2.1	3,803
三洋化成工業	9.2	9.1	48,685
有機合成薬品工業	9.6	9.5	2,793
大日本塗料	84	83	26,477
日本ペイントホールディングス	113.3	112.3	459,868
関西ペイント	154.3	152.9	403,808
神東塗料	11	11	2,398
中国塗料	42.1	41.7	35,736
日本特殊塗料	10.3	10.2	19,094
藤倉化成	19.9	19.8	12,196
太陽ホールディングス	12	11.9	63,665
ＤＩＣ	58	57.5	222,237
サカタインクス	30	29.7	53,846
東洋インキＳＣホールディングス	145	144	85,968
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	10.6	10.5	12,621
富士フイルムホールディングス	291.3	288.7	1,239,677
資生堂	278.6	258.9	1,189,904
ライオン	182	193.6	411,787
高砂香料工業	9.7	9.6	39,024
マンダム	14.7	14.6	87,892
ミルボン	7.9	9.3	61,287
ファンケル	31.2	30.9	74,654
コーセー	23.7	23.5	307,145
コタ	5.5	6	7,458
シーズ・ホールディングス	19.1	18.9	81,648
シーボン	1.7	1.7	4,260
ポーラ・オルビスホールディングス	15	59.3	201,620
ノエビアホールディングス	9.3	9.2	58,972
アジュバンコスメジャパン	2.8	2.7	2,610
エステー	10	9.9	25,373
アグロ　カネショウ	5.7	5.6	8,691
コニシ	23	22.8	40,378
長谷川香料	18.6	18.4	38,216
星光ＰＭＣ	8	8	9,408

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
小林製薬	40.7	38.9	259,463
荒川化学工業	12.6	12.5	30,550
メック	11.4	11.3	17,209
日本高純度化学	4.1	4.1	10,844
タカラバイオ	31.5	41.6	60,403
ＪＣＵ	4.6	9.1	42,315
新田ゼラチン	8.8	8.7	6,620
ＯＡＴアグリオ	1.7	2.2	3,995
デクセリアルズ	38.5	38.3	52,854
アース製薬	10.6	10.5	57,855
イハラケミカル工業	20.3	－	－
北興化学工業	14	14.2	8,789
大成ラミック	4.1	4.5	13,207
クミアイ化学工業	30.3	63.2	41,143
日本農薬	33.5	36.3	22,614
アキレス	12	11.9	25,811
有沢製作所	24.8	24.7	24,922
日東電工	105.9	105	1,037,505
レック	4.6	9.1	26,963
きもと	26.2	26	6,240
藤森工業	10.9	10.8	39,420
前澤化成工業	9.6	9.5	11,561
ＪＳＰ	6.8	6.8	22,576
エフピコ	13	12.9	76,497
天馬	9.7	9.6	20,025
信越ポリマー	28.8	28.5	29,412
東リ	34.9	34.6	12,905
ニフコ	25.7	25.5	158,865
日本バルカー工業	11.4	11.3	33,210
ユニ・チャーム	297.3	294.7	775,945
医薬品（4.5%）			
協和発酵キリン	175.7	174.1	331,660
武田薬品工業	550.6	546	3,237,780
アステラス製薬	1,500.4	1,428.4	1,991,189
大日本住友製薬	103.9	103	151,101
塩野義製薬	198.7	184.6	1,058,311
田辺三菱製薬	171.1	169.6	437,568
わかもと製薬	17	17	4,760
あすか製薬	16	15.8	26,496
日本新薬	33.6	33.3	239,094
ビオフェルミン製薬	2.4	2.4	7,089
中外製薬	146.2	144.9	634,662

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
科研製薬	27.4	27.2	156,944
エーザイ	180.8	179.2	1,020,185
ロート製薬	71.9	71.2	174,155
小野薬品工業	333.5	330.6	747,651
久光製薬	41.4	41.1	209,199
持田製薬	10	9.7	79,637
参天製薬	265.1	262.9	444,301
扶桑薬品工業	4.9	4.9	13,519
日本ケミファ	2	2	10,540
ツムラ	49.3	48.9	199,023
日医工	34.3	34	57,664
キッセイ薬品工業	26	25.8	70,717
生化学工業	27.2	27	51,219
栄研化学	12.3	12.2	43,310
日水製薬	5.9	5.8	8,096
鳥居薬品	10	8.7	26,187
ＪＣＲファーマ	11.3	11.2	33,364
東和薬品	6.7	6.7	35,845
富士製薬工業	4.8	4.7	18,189
沢井製薬	24.9	24.7	153,634
ゼリア新薬工業	30.1	29.8	58,944
第一三共	432.2	428.3	1,009,074
キョーリン製薬ホールディングス	35.9	35.6	83,054
大幸薬品	7.3	7.3	17,666
ダイト	8.7	8.6	23,624
大塚ホールディングス	315.7	288.9	1,310,739
大正製薬ホールディングス	31.4	31.1	252,843
ペプチドリーム	27.4	54.4	190,672
石油・石炭製品（0.5%）			
日本コークス工業	118.5	117.4	11,857
昭和シェル石油	131.3	130.1	154,558
ニチレキ	17.9	17.8	22,677
東燃ゼネラル石油	239	－	－
ユシロ化学工業	7.9	7.8	12,238
ビーピー・カストロール	6	5.9	11,233
富士石油	34	33.7	11,761
ＭＯＲＥＳＣＯ	5.1	5	10,350
出光興産	69.7	89.8	235,365
ＪＸＴＧホールディングス	1,629.7	2,219.4	1,187,822
コスモエネルギーホールディングス	44.3	43.9	96,623
ゴム製品（1.0%）			
横浜ゴム	88.6	80.5	170,257
東洋ゴム工業	77.5	82.3	170,525
ブリヂストン	495.6	491.2	2,352,356
住友ゴム工業	137.4	136.2	246,930
藤倉ゴム工業	12.2	12.1	8,954
オカモト	44	44	48,840
フコク	6.1	6.1	6,466
ニッタ	13.2	13.1	48,142
住友理工	27.2	26.9	30,047
三ツ星ベルト	36	34	43,588
バンドー化学	26.7	26.5	30,395
ガラス・土石製品（1.0%）			
日東紡績	119	118	70,328
旭硝子	723	142.1	611,740
日本板硝子	66.9	66.3	55,029
石塚硝子	21	20	4,560
日本山村硝子	58	58	11,194
日本電気硝子	303	60.1	244,006
オハラ	5.5	5.5	8,250
住友大阪セメント	273	270	130,140
太平洋セメント	886	878	364,370
日本ヒューム	14.1	13.9	9,313
日本コンクリート工業	32.7	32.4	13,770
三谷セキサン	7.3	7.3	19,381
アジアパイルホールディングス	18	17.9	10,883
東海カーボン	137.1	126.2	92,504
日本カーボン	72	7.1	27,867
東洋炭素	8.1	9	20,646
ノリタケカンパニーリミテド	8.3	8.2	38,212
ＴＯＴＯ	107.9	106.9	448,445
日本碍子	185.4	183.8	376,238
日本特殊陶業	126.5	125.4	264,468
ダントーホールディングス	12	10	1,510
ＭＡＲＵＷＡ	5.4	5.3	30,846
品川リフラクトリーズ	37	37	12,950
黒崎播磨	32	31	16,678
ヨータイ	8	8	3,120
イソライト工業	7.2	7.1	4,586
東京窯業	17.8	17.7	5,274
ニッカトー	4.8	4.7	2,862
フジミインコーポレーテッド	12.5	12.4	29,276
エーアンドエーマテリアル	30	30	3,570
ニチアス	77	76	98,268

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ニチハ	19.5	19.3	74,498
鉄鋼（1.3%）			
新日鐵住金	662	656.1	1,757,035
神戸製鋼所	253.8	251.6	338,402
中山製鋼所	16.5	16.3	10,904
合同製鐵	8.2	8.1	17,155
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	401.3	397.7	869,769
日新製鋼	67	47.4	68,208
東京製鐵	74.3	73.6	73,673
共英製鋼	15.6	15.5	26,272
大和工業	29.5	29.2	88,330
東京鐵鋼	31	30	14,430
大阪製鐵	9.2	9.1	21,275
淀川製鋼所	20.3	20.1	58,008
東洋鋼鈑	35.1	34.8	17,434
丸一鋼管	49.1	48.7	156,570
モリ工業	4.7	4.5	11,146
大同特殊鋼	246	244	158,600
日本高周波鋼業	51	51	5,508
日本冶金工業	121.4	120.4	26,728
山陽特殊製鋼	87	87	54,549
愛知製鋼	8.7	8.6	38,356
日立金属	149.4	148.1	223,631
日本金属	3.5	3.5	8,673
大平洋金属	94	93	26,133
新日本電工	83.1	82.3	35,059
栗本鐵工所	7	6.9	15,345
虹技	20	20	4,420
日本鋳鉄管	14	14	2,534
三菱製鋼	102	101	28,886
日亜鋼業	20.3	20.1	5,869
日本精線	10	10	8,890
シンニッタン	12	11.9	8,377
新家工業	32	31	6,293
非鉄金属（1.0%）			
大紀アルミニウム工業所	25	24	15,720
日本軽金属ホールディングス	357.8	374.5	116,469
三井金属鉱業	399	396	222,552
東邦亜鉛	83	82	42,968
三菱マテリアル	91.6	90.8	339,138
住友金属鉱山	380	376	687,516
ＤＯＷＡホールディングス	162	160	132,160

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
古河機械金属	229	227	44,265
大阪チタニウムテクノロジーズ	16	15.9	26,521
東邦チタニウム	24.8	24.6	20,885
ＵＡＣＪ	186	205	58,835
古河電気工業	49.2	48.8	287,920
住友電気工業	553.1	548.2	962,091
フジクラ	193.2	191.5	178,095
昭和電線ホールディングス	174	173	15,570
東京特殊電線	2.1	2.1	4,554
タツタ電線	27.5	27.2	19,584
沖電線	15	15	4,830
カナレ電気	2.1	2.3	5,747
平河ヒューテック	6.9	6.8	9,907
リョービ	89	85	46,410
アーレスティ	17	16.8	15,657
アサヒホールディングス	22.1	21.9	48,114
金属製品（0.7%）			
稲葉製作所	7.8	7.7	10,764
宮地エンジニアリンググループ	42	42	14,826
トーカロ	9.6	9.5	37,952
アルファＣｏ	4.9	4.8	10,473
ＳＵＭＣＯ	153.2	126.6	213,700
川田テクノロジーズ	2.8	2.8	17,528
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	0.5	1.9	8,170
東洋製罐グループホールディングス	104.3	103.4	190,152
ホッカンホールディングス	38	38	15,884
コロナ	7.7	7.6	8,595
横河ブリッジホールディングス	25.8	25.6	49,612
駒井ハルテック	2.8	2.8	6,484
高田機工	13	13	4,069
三和ホールディングス	145.7	144.4	176,890
文化シヤッター	40.9	40.5	34,789
三協立山	19.2	19.1	30,063
アルインコ	10.1	10	12,600
東洋シヤッター	3.6	3.6	2,332
ＬＩＸＩＬグループ	204.4	202.6	571,332
日本フイルコン	10.6	10.5	6,289
ノーリツ	28.8	30.7	60,970
長府製作所	15.7	15.5	41,059
リンナイ	25	24.8	238,080
ダイニチ工業	7.5	7.4	5,971
日東精工	20.9	19	9,253

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三洋工業	18	18	3,852
岡部	30.4	27.9	28,179
ジーテクト	15.3	15.2	31,524
中国工業	2.1	2.1	1,575
東プレ	28.2	28	85,820
高周波熱錬	27.3	26.5	28,328
東京製綱	9.9	9.8	15,738
サンコール	7.8	7.7	4,958
モリテック　スチール	7.4	7.3	2,277
パイオラックス	7.4	22	62,986
エイチワン	－	11	12,166
日本発條	138.1	136.9	149,905
中央発條	17	17	6,052
アドバネクス	2.5	2.5	5,040
立川ブラインド工業	6.1	6	6,870
三益半導体工業	12.4	12.3	21,217
機械（5.2%）			
日本ドライケミカル	1.9	1.9	4,389
日本製鋼所	48.5	48.1	111,928
三浦工業	60	59.5	137,207
タクマ	47	46.6	57,597
ツガミ	40	39	34,086
オークマ	96	95	95,950
東芝機械	87	78	39,468
アマダホールディングス	197.5	195.8	237,897
アイダエンジニアリング	41.7	41.3	49,064
滝澤鉄工所	43	43	7,998
富士機械製造	44.7	44.3	84,657
牧野フライス製作所	73	72	63,504
オーエスジー	66.8	62.1	147,239
ダイジェット工業	17	17	3,043
旭ダイヤモンド工業	42	40.9	39,059
ＤＭＧ森精機	86.8	76.1	135,458
ソディック	37.2	36.9	48,560
ディスコ	17.2	17	329,800
日東工器	8.5	8.5	22,882
パンチ工業	5.3	5.3	8,162
冨士ダイス	－	5.2	3,967
豊和工業	8.2	8.1	6,836
ＯＫＫ	53	53	7,155
東洋機械金属	9.9	9.8	8,143
津田駒工業	33	32	6,112

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
エンシュウ	36	36	5,148
島精機製作所	19.1	19	104,880
ＮＣホールディングス	4.7	4.7	3,966
フリュー	2.9	8.5	9,256
ヤマシンフィルタ	2.8	3.8	10,621
日阪製作所	20	19.8	18,730
やまびこ	26.9	26.6	31,787
平田機工	－	4.9	56,742
ペガサスミシン製造	14.1	13.9	9,896
ナブテスコ	76.3	75.6	288,414
三井海洋開発	14.7	14.6	32,266
レオン自動機	12.4	12.3	16,678
ＳＭＣ	44	43.6	1,577,884
新川	12.2	12.1	8,385
ホソカワミクロン	24	5.2	25,428
ユニオンツール	6.3	6.3	21,325
オイレス工業	19	17.8	35,671
日精エー・エス・ビー機械	4.7	4.6	19,826
サトーホールディングス	18.2	18.1	46,462
技研製作所	－	6.9	20,624
日本エアーテック	4.7	4.7	3,727
日精樹脂工業	11.6	11.5	14,777
オカダアイヨン	3.1	4.1	6,703
ワイエイシイホールディングス	5.5	5.4	6,080
小松製作所	677.1	671.1	1,916,326
住友重機械工業	428	424	341,744
日立建機	65.6	65	193,700
日工	4.4	4.4	9,314
巴工業	6	5.9	10,820
井関農機	150	13.9	32,567
ＴＯＷＡ	12	11.9	20,325
丸山製作所	31	3	5,409
北川鉄工所	6.7	6.7	16,582
ローツェ	5.2	6.9	15,780
タカキタ	4.9	4.8	2,923
クボタ	702.5	749.8	1,479,730
荏原実業	4.1	4.1	6,367
三菱化工機	48	48	11,664
月島機械	27.8	27.6	35,383
帝国電機製作所	10.7	10.6	12,317
東京機械製作所	55	55	3,685
新東工業	33.3	33	38,280

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
澁谷工業	12.3	12.1	44,286
アイチ　コーポレーション	20.8	20.6	15,635
小森コーポレーション	35.3	34.9	46,172
鶴見製作所	10.9	10.8	20,520
住友精密工業	23	23	8,050
酒井重工業	28	28	9,604
荏原製作所	66.4	65.9	217,140
石井鐵工所	2.1	2.1	3,467
酉島製作所	14.3	14.2	15,449
北越工業	15.8	15.6	15,132
ダイキン工業	191.4	189.7	2,132,228
オルガノ	28	28	15,120
トーヨーカネツ	67	63	20,538
栗田工業	83	80.2	249,422
椿本チエイン	83	83	72,874
大同工業	29	28	9,408
木村化工機	12.6	12.4	5,332
アネスト岩田	25.4	25.2	26,409
ダイフク	70	69.3	318,780
サムコ	3.5	3.8	3,423
加藤製作所	7.7	7.6	24,814
油研工業	27	27	6,480
タダノ	73.3	72.6	91,621
フジテック	40.8	40.5	62,775
ＣＫＤ	42	41.6	73,964
キトー	17.7	17.5	21,542
平和	43.5	43.1	98,828
理想科学工業	13.9	13.8	28,952
ＳＡＮＫＹＯ	39	38.7	137,191
日本金銭機械	12.9	12.8	14,617
マースエンジニアリング	7.9	7.8	16,988
福島工業	8.6	8.6	35,647
オーイズミ	5.9	5.8	3,224
ダイコク電機	5.8	5.7	9,547
竹内製作所	25.6	25.4	51,409
アマノ	43.4	43	110,639
ＪＵＫＩ	22.1	20.6	31,270
サンデンホールディングス	86	85	29,580
蛇の目ミシン工業	13.6	13.5	10,624
マックス	22	21	30,576
グローリー	44.8	44.4	165,834
新晃工業	9.8	12.9	21,143

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	22.5	22.3	25,979
セガサミーホールディングス	139.1	137.9	201,196
日本ピストンリング	5.5	5.4	11,890
リケン	6.5	6.4	33,408
ＴＰＲ	15.7	15.6	54,132
ツバキ・ナカシマ	15.7	13.9	31,678
ホシザキ	30.7	43.7	441,807
大豊工業	11.4	11.3	17,763
日本精工	288	285.5	376,289
ＮＴＮ	325	322	150,052
ジェイテクト	149.5	148.1	221,113
不二越	141	129	78,174
日本トムソン	44.8	44.4	26,640
ＴＨＫ	99.1	98.2	338,790
ユーシン精機	6.2	6.2	17,763
前澤給装工業	5.3	5	8,095
イーグル工業	15.2	15	29,220
前澤工業	9.3	9.2	3,716
日本ピラー工業	14.2	14	21,966
キッツ	67.3	66.7	58,362
日立工機	37.5	－	－
マキタ	91.4	181.3	780,496
日立造船	111.2	110.2	57,634
三菱重工業	2,350	2,329	1,006,128
ＩＨＩ	1,078	1,068	386,616
スター精密	24.6	24.4	43,383
電気機器（13.3%）			
日清紡ホールディングス	77.8	77.2	88,934
イビデン	98.1	97.3	185,161
コニカミノルタ	328.3	325.4	301,320
ブラザー工業	181.2	169.7	447,838
ミネベアミツミ	255.1	252.9	450,667
日立製作所	3,367	3,337	2,423,996
東芝	3,136	－	－
三菱電機	1,495.7	1,482.5	2,528,403
富士電機	423	419	241,763
東洋電機製造	5.9	5.9	12,183
安川電機	162.6	161.1	533,241
シンフォニアテクノロジー	91	90	37,980
明電舎	129	128	52,736
オリジン電気	20	20	6,340
山洋電気	37	36	42,984

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
デンヨー	12.9	12.8	23,091
東芝テック	88	87	53,244
芝浦メカトロニクス	23	22	7,282
マブチモーター	39.6	38.8	198,268
日本電産	181.7	180.1	2,265,658
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	1.6	4.3	8,028
東光高岳	7.1	7	13,048
ダブル・スコープ	13.5	20.2	43,086
ダイヘン	77	76	70,528
田淵電機	21.2	21	6,489
ヤーマン	1.8	1.8	17,136
ＪＶＣケンウッド	102.9	102	30,396
ミマキエンジニアリング	12.6	12.4	10,416
第一精工	6.6	6.5	15,658
日新電機	28.2	27.9	35,712
大崎電気工業	28	27.6	23,432
オムロン	149	147.7	810,873
日東工業	20.6	20.4	35,883
ＩＤＥＣ	18.3	18.1	34,136
不二電機工業	1.5	1.5	2,040
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	270	268	144,452
サクサホールディングス	35	35	7,105
メルコホールディングス	7.7	7.7	27,604
テクノメディカ	3.1	3.1	6,038
日本電気	1,928	1,911	567,567
富士通	1,352	1,340	1,114,076
沖電気工業	60.8	60.2	91,022
岩崎通信機	61	61	5,185
電気興業	40	40	22,680
サンケン電気	82	81	47,790
ナカヨ	15	14	5,278
アイホン	7.9	7.9	14,449
ルネサスエレクトロニクス	72.6	71.9	76,645
セイコーエプソン	208.8	206.9	577,251
ワコム	108.8	107.8	48,510
アルバック	23.6	23.4	139,698
アクセル	5.8	5.8	4,384
ＥＩＺＯ	13.9	13.7	60,211
ジャパンディスプレイ	261.8	259.5	53,716
日本信号	38.7	38.3	42,283
京三製作所	33	33	19,536
能美防災	15.9	15.8	26,465

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ホーチキ	10.2	10.1	19,230
エレコム	12.1	12	27,684
日本無線	8.6	8.5	12,359
パナソニック	1,602	1,596.1	2,385,371
アンリツ	102.2	101.3	87,725
富士通ゼネラル	48	47.2	107,757
日立国際電気	36.6	36.3	106,504
ソニー	990.1	982	4,250,096
ＴＤＫ	79	78.3	599,778
帝国通信工業	31	31	7,130
タムラ製作所	54	54	31,104
アルプス電気	129.4	128.3	393,239
池上通信機	44	44	6,820
パイオニア	210.7	208.8	42,386
日本電波工業	13.6	13.4	11,403
鈴木	5.4	5.3	4,399
日本トリム	3.4	3.4	15,351
ローランド　ディー．ジー．	7.2	7.1	18,680
フォスター電機	16.4	16.3	34,572
クラリオン	74	73	30,222
ＳＭＫ	36	36	17,172
ヨコオ	10	9.9	14,414
ティアック	101	100	4,500
ホシデン	42.5	40.9	73,865
ヒロセ電機	22.7	22.5	347,175
日本航空電子工業	40	40	67,920
ＴＯＡ	16.5	16.4	18,302
日立マクセル	20.9	20.7	50,280
古野電気	18.1	17.9	11,778
ユニデンホールディングス	41	41	12,628
アルパイン	33.4	33.1	67,855
スミダコーポレーション	11.5	14.2	30,160
アイコム	7.8	7.7	19,180
リオン	5.4	5.3	10,388
本多通信工業	4.5	5.9	10,159
船井電機	15.7	15.6	13,431
横河電機	152	150.7	258,450
新電元工業	54	54	37,206
アズビル	42.5	41.7	185,148
東亜ディーケーケー	6.9	6.9	4,636
日本光電工業	58.6	58.1	146,818
チノー	5	5	6,230

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
共和電業	15.9	15.7	6,562
日本電子材料	5.5	5.5	3,575
堀場製作所	27.8	27.5	180,125
アドバンテスト	95.6	94.7	177,751
小野測器	6.8	5.9	4,395
エスペック	12.4	12.3	22,545
パナソニック　デバイスＳＵＮＸ	12.3	－	－
キーエンス	63.5	63	3,350,970
日置電機	7.3	7.3	15,950
シスメックス	109	108	710,640
日本マイクロニクス	26.1	24.2	26,523
メガチップス	13	12.9	46,891
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	8.2	8.1	49,248
澤藤電機	8	8	4,448
コーセル	19.4	19.3	25,649
イリソ電子工業	4.4	5.8	60,030
新日本無線	11.9	11.8	7,929
オプテックスグループ	10.6	11.3	45,708
千代田インテグレ	7.4	6.7	14,900
アイ・オー・データ機器	4.4	5.8	6,333
レーザーテック	15.4	30.5	62,860
スタンレー電気	100	98.9	364,446
岩崎電気	51	51	9,843
ウシオ電機	85.1	84.4	126,937
岡谷電機産業	7.5	7.4	3,004
ヘリオス　テクノ　ホールディング	12.9	12.8	8,896
日本セラミック	11.5	14	39,788
遠藤照明	7.1	7	9,870
古河電池	10	10	9,050
双信電機	6.8	6.7	2,365
山一電機	13.2	13.1	27,352
図研	9.1	9	14,211
日本電子	51	51	26,979
カシオ計算機	112.8	111.8	178,880
ファナック	142.2	140.9	3,058,939
日本シイエムケイ	30.2	29.9	32,650
エンプラス	6.4	6.3	28,161
大真空	5.1	5.1	9,389
ローム	67.8	67.2	565,152
浜松ホトニクス	109.4	101.2	342,562
三井ハイテック	18.5	18.3	33,452
新光電気工業	53	52.5	41,002
京セラ	230.2	228.1	1,546,518
太陽誘電	68.2	67.6	113,297
村田製作所	147.1	145.8	2,507,760
ユーシン	18.6	19.5	14,566
双葉電子工業	22.9	22.7	44,287
北陸電気工業	56	56	8,288
ニチコン	44.1	43.8	54,093
日本ケミコン	121	120	49,800
ＫＯＡ	19.4	19.2	38,457
市光工業	29	29	21,431
小糸製作所	84	83.3	562,275
ミツバ	25.8	25.6	41,779
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	28.7	28.5	207,195
キヤノン電子	12.9	12.7	27,838
キヤノン	754.9	748.2	2,909,001
リコー	421.6	417.9	449,660
ＭＵＴＯＨホールディングス	19	19	4,750
東京エレクトロン	93.5	92.7	1,392,354
輸送用機器（8.7%）			
トヨタ紡織	49	48.6	107,211
芦森工業	32	31	9,641
ユニプレス	27	26.8	73,083
豊田自動織機	127.7	126.5	736,230
モリタホールディングス	24.5	24.3	40,167
三櫻工業	17.8	17.6	15,347
デンソー	345.7	342.7	1,852,293
東海理化電機製作所	36.9	36.6	73,785
三井造船	507	502	69,276
川崎重工業	1,091	1,081	355,649
名村造船所	42.1	41.7	26,854
サノヤスホールディングス	17	16.9	4,360
日本車輌製造	51	51	14,637
ニチユ三菱フォークリフト	16.2	16.5	12,507
近畿車輌	2.1	2.1	5,619
日産自動車	1,653.8	1,639.2	1,808,857
いすゞ自動車	406.3	402.7	573,646
トヨタ自動車	1,704.8	1,689.7	10,433,897
日野自動車	200.1	198.4	247,801
三菱自動車工業	513.9	509.3	409,477
エフテック	7.4	8	12,464
レシップホールディングス	4.6	4.6	4,360
ＧＭＢ	2.3	2.2	3,146

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ファルテック	2.4	2.4	3,432
武蔵精密工業	16.3	16.2	54,999
日産車体	61.6	61.1	77,352
新明和工業	57	56.1	52,060
極東開発工業	27.9	27.7	46,148
日信工業	31.3	31.1	56,695
トピー工業	11.5	11.4	42,237
ティラド	54	54	23,544
曙ブレーキ工業	65.1	64.6	21,188
タチエス	23.8	23.6	41,913
ＮＯＫ	67.8	67.2	166,387
フタバ産業	42.7	42.3	46,783
ＫＹＢ	157	156	92,976
大同メタル工業	17.6	17.5	16,765
プレス工業	74.5	73.8	42,877
ミクニ	17.8	17.6	8,782
カルソニックカンセイ	95	－	－
太平洋工業	28.8	31.4	44,462
ケーヒン	32.2	31.9	56,686
河西工業	18.9	18.8	30,192
アイシン精機	128.3	127.2	700,872
富士機工	13.9	13.8	10,156
マツダ	444	440.1	717,363
今仙電機製作所	12.8	12.7	16,065
本田技研工業	1,261.8	1,250.7	3,805,880
スズキ	277.9	275.4	1,532,876
ＳＵＢＡＲＵ	435.3	431.5	1,698,384
安永	5.1	6.7	11,792
ヤマハ発動機	198	196.3	622,271
ショーワ	36.4	36.1	44,980
ＴＢＫ	17.9	17.8	8,793
エクセディ	19	18.9	62,464
豊田合成	45.3	44.9	115,348
愛三工業	24.6	24.4	23,570
盟和産業	2.1	2.1	2,629
ヨロズ	13.1	13	26,832
エフ・シー・シー	22.9	22.7	53,640
シマノ	56.5	56	880,320
タカタ	25.3	－	－
テイ・エス　テック	32.6	32.3	112,727
ジャムコ	8.2	8.1	19,788

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
精密機器（1.6%）			
テルモ	214.9	213	902,055
クリエートメディック	4.6	4.6	4,765
日機装	48.5	48.1	48,244
島津製作所	180.5	178.9	368,534
ＪＭＳ	26	26	8,736
クボテック	3	3	1,692
長野計器	11	10.9	9,886
ブイ・テクノロジー	2.8	2.8	50,232
東京計器	48	48	14,496
愛知時計電機	1.8	1.8	7,218
インターアクション	－	5.2	3,556
オーバル	13.7	13.6	3,712
東京精密	27.1	26.9	100,202
マニー	18.6	16.9	43,872
ニコン	244.3	242.2	448,070
トプコン	70.6	70	139,790
オリンパス	223.8	221.8	845,058
理研計器	12.4	12.3	24,169
タムロン	12.4	11.2	22,904
ＨＯＹＡ	288.5	285.9	1,810,890
シード	－	1.8	5,481
ノーリツ鋼機	14.2	14.1	16,370
エー・アンド・デイ	12.8	12.7	5,994
シチズン時計	153.4	152.1	116,052
リズム時計工業	56	56	13,888
大研医器	12.5	12.4	9,622
メニコン	9.6	9.5	35,815
松風	7.4	7.3	9,614
セイコーホールディングス	99	98	47,824
ニプロ	97	96.2	139,297
その他製品（2.1%）			
スノーピーク	2.1	2.1	5,359
パラマウントベッドホールディングス	13.4	13.3	63,973
トランザクション	3.1	6.2	6,646
ＳＨＯ－ＢＩ	4.7	4.6	2,304
ニホンフラッシュ	6.5	6.5	9,750
前田工繊	14	13.9	22,392
永大産業	18	18	9,396
アートネイチャー	15	14.8	10,522
ダンロップスポーツ	8.8	8.8	10,190
バンダイナムコホールディングス	154.6	153.3	561,844

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アイフィスジャパン	3.1	3.1	1,736
共立印刷	23.3	23.1	8,038
ＳＨＯＥＩ	6.3	6.2	20,770
フランスベッドホールディングス	17.6	17.4	17,974
パイロットコーポレーション	24.5	24.2	119,548
萩原工業	3.9	3.9	12,402
トッパン・フォームズ	25	24.8	28,892
フジシールインターナショナル	31.4	31.2	104,208
タカラトミー	54.5	54	80,514
廣済堂	14.1	14	5,026
Ａｓ－ｍｅエステール	3.7	3.7	2,608
アーク	59	58.5	5,967
タカノ	6.2	6.1	6,972
プロネクサス	13.1	13	16,419
ホクシン	9.9	9.8	1,920
ウッドワン	24	23	7,107
大建工業	9.9	9.8	24,656
凸版印刷	396	392	437,472
大日本印刷	404	392	513,128
図書印刷	19	19	10,089
共同印刷	43	43	15,566
日本写真印刷	23.5	24.2	74,294
光村印刷	12	12	2,928
宝印刷	7.3	7.3	11,804
アシックス	139.3	138.1	246,922
ツツミ	5.2	5.2	9,578
小松ウオール工業	4.7	4.7	9,780
ヤマハ	94.5	93.6	357,552
河合楽器製作所	5.5	5.4	12,317
クリナップ	16.4	14.5	12,702
ピジョン	84.7	84	343,140
兼松サステック	14	14	3,402
キングジム	11.7	11.6	11,913
リンテック	33.3	33	93,027
ＴＡＳＡＫＩ	3.9	－	－
イトーキ	29.5	29.3	24,787
任天堂	86.4	85.6	3,139,808
三菱鉛筆	11.5	22.9	66,845
タカラスタンダード	29	28.7	54,099
コクヨ	72.9	66.7	119,593
ナカバヤシ	25	25	8,100
グローブライド	6.8	6.7	13,058
岡村製作所	48.9	48.5	52,428
美津濃	75	75	49,125
電気・ガス業（1.8%）			
東京電力ホールディングス	1,189.4	1,178.9	532,862
中部電力	462	457.9	663,039
関西電力	572.2	567.1	857,738
中国電力	193.9	192.1	239,164
北陸電力	137.4	136.1	139,366
東北電力	350.3	347.2	527,744
四国電力	126.3	125.1	177,892
九州電力	309.7	306.9	402,959
北海道電力	131.2	130.1	107,983
沖縄電力	20.6	22.5	55,260
電源開発	111.6	110.6	324,500
エフオン	5.2	6.9	7,886
イーレックス	5.8	17.5	17,132
東京瓦斯	1,504	1,491	862,096
大阪瓦斯	1,361	1,349	579,125
東邦瓦斯	353	347	256,433
北海道瓦斯	34	36	9,828
広島ガス	28.9	28.6	10,238
西部瓦斯	158	156	45,084
静岡ガス	43.1	39.5	33,891
メタウォーター	7.9	7.8	23,064
陸運業（4.1%）			
ＳＢＳホールディングス	13.8	13.7	10,768
東武鉄道	749	743	445,800
相鉄ホールディングス	224	222	118,992
東京急行電鉄	762	377.5	622,120
京浜急行電鉄	384	381	461,391
小田急電鉄	224.6	222.6	480,593
京王電鉄	392	388	351,916
京成電鉄	105.1	104.2	316,768
富士急行	38	38	43,814
新京成電鉄	18	18	7,488
東日本旅客鉄道	271.3	268.9	2,765,636
西日本旅客鉄道	135	133.8	1,088,730
東海旅客鉄道	116.6	115.6	2,124,150
西武ホールディングス	193.6	191.9	380,729
鴻池運輸	19.8	19.7	29,451
西日本鉄道	168	167	86,506
ハマキョウレックス	9.1	9	26,163

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サカイ引越センター	4.8	6.4	35,968
近鉄グループホールディングス	1,411	1,399	583,383
阪急阪神ホールディングス	177.1	175.6	731,374
南海電気鉄道	296	294	165,228
京阪ホールディングス	314	311	210,236
神戸電鉄	34	34	13,872
名古屋鉄道	511	506	249,964
山陽電気鉄道	51	51	28,764
日本通運	542	517	392,920
ヤマトホールディングス	250.7	248.5	560,243
山九	185	183	153,537
丸運	7.6	7.5	2,302
丸全昭和運輸	47	47	22,795
センコーグループホールディングス	64	66	48,642
トナミホールディングス	29	28	12,208
ニッコンホールディングス	47.5	47.1	120,387
日本石油輸送	1.6	1.6	4,476
福山通運	85	84	58,296
セイノーホールディングス	99.5	98.6	147,604
神奈川中央交通	16	16	11,648
日立物流	29.2	28.9	75,689
丸和運輸機関	3.5	3.5	15,557
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	14.5	14.4	18,417
九州旅客鉄道	104.5	138.1	467,468
海運業（0.2%）			
日本郵船	1,185	1,174	251,236
商船三井	735	729	252,963
川崎汽船	532	527	152,830
ＮＳユナイテッド海運	63	62	14,508
明治海運	12.5	12.4	5,046
飯野海運	72.5	71.9	35,302
共栄タンカー	12	12	2,556
乾汽船	10.2	10.1	8,211
空運業（0.6%）			
日本航空	252.7	244.2	933,820
ＡＮＡホールディングス	2,603	2,580	1,050,834
パスコ	13	13	4,550
倉庫・運輸関連業（0.2%）			
トランコム	4	4	21,880
日新	57	57	31,863
三菱倉庫	92	91	123,578
三井倉庫ホールディングス	81	81	25,434

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
住友倉庫	102	94	69,372
澁澤倉庫	36	36	13,464
東陽倉庫	24	23.8	7,330
日本トランスシティ	32	32	14,016
ケイヒン	26	25	4,050
中央倉庫	8.1	8	8,736
川西倉庫	－	2.7	5,802
安田倉庫	10.9	10.8	8,294
東洋埠頭	40	40	7,680
宇徳	11.3	11.2	5,577
上組	167	166	202,022
サンリツ	3.4	3.4	2,556
キムラユニティー	3.5	3.5	4,091
キユーソー流通システム	4.4	3.8	11,099
郵船ロジスティクス	12.9	12.8	13,465
近鉄エクスプレス	25.1	24.9	45,965
東海運	7.6	7.5	3,165
エーアイテイー	8.6	8.5	9,299
内外トランスライン	4.2	4.6	6,297
情報・通信業（8.0%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	15.2	15	37,635
システナ	11	10.9	27,740
デジタルアーツ	6.2	6.1	23,363
新日鉄住金ソリューションズ	23.1	21.5	51,643
キューブシステム	6	7.9	6,414
コア	5.8	5.8	9,245
ソフトクリエイトホールディングス	6.6	6.5	9,626
ＴＩＳ	45.9	45.5	148,785
ネオス	4.1	4.1	1,910
電算システム	4.8	4.8	9,019
グリー	84.2	83.5	70,474
コーエーテクモホールディングス	32.8	32.5	77,740
三菱総合研究所	5.4	5.8	18,415
ボルテージ	2.5	2.5	3,960
電算	1.5	1.5	3,343
ＡＧＳ	3.5	3.5	5,530
ファインデックス	10.2	11.3	10,237
ヒト・コミュニケーションズ	3.1	3.1	5,707
ブレインパッド	2.9	2.9	3,413
ＫＬａｂ	26.4	26.2	60,181
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	10	9.9	14,968
イーブックイニシアティブジャパン	2.2	2.1	2,333

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ネクソン	151.5	151.6	410,229
アイスタイル	29.1	31.3	22,254
エムアップ	3.9	3.9	5,775
エイチーム	7.6	9.2	24,803
テクノスジャパン	10.7	10.6	11,564
ｅｎｉｓｈ	4.1	4	9,248
コロプラ	38.6	44	55,440
モバイルクリエイト	10.1	11	4,092
オルトプラス	5.7	6.6	7,121
ブロードリーフ	34.1	33.8	27,749
ハーツユナイテッドグループ	7.3	7.2	11,743
メディアドゥ	2.9	3.9	10,237
ブイキューブ	7.6	8.4	4,771
サイバーリンクス	2.1	2.1	2,965
ディー・エル・イー	4.6	6.1	2,940
フィックスターズ	2	2.3	8,970
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	4.7	6.8	12,770
オプティム	1.5	2.9	8,424
セレス	2.5	4.2	5,523
ベリサーブ	1.6	1.6	5,432
ティーガイア	13.8	13.6	28,165
日本アジアグループ	15.7	15.5	6,556
豆蔵ホールディングス	10.1	10.1	10,695
テクマトリックス	4.3	8.5	14,382
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	290.2	369.8	117,966
ＧＭＯペイメントゲートウェイ	11.3	9.6	68,832
ザッパラス	7.1	7.1	3,521
システムリサーチ	1.4	1.4	2,851
インターネットイニシアティブ	20.3	20.2	41,167
さくらインターネット	10.6	11.1	9,523
ＧＭＯクラウド	3.1	3	9,705
ＳＲＡホールディングス	7.3	7.2	20,188
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	3.1	3	3,891
システムインテグレータ	1.9	1.9	1,546
朝日ネット	12.5	12.4	6,472
アドソル日進	2.7	3.6	3,898
フリービット	7.6	10.1	9,322
コムチュア	2.3	2.3	12,512
サイバーコム	1.8	2.4	2,565
メディカル・データ・ビジョン	2.3	5.2	12,142
ｇｕｍｉ	15.7	15.7	20,096
ショーケース・ティービー	1.5	2.6	2,815

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
モバイルファクトリー	－	2.5	3,785
デジタル・インフォメーション・テクノロジ	－	2	3,964
ＰＣＩホールディングス	1.6	2.3	6,258
パイプドＨＤ	2.5	2.4	2,829
アイビーシー	1.1	1.4	1,341
オープンドア	1.4	1.8	6,147
ＬＩＮＥ	23.1	38	148,390
オークネット	－	4.3	5,809
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	11.3	11.2	12,308
マクロミル	－	17.6	42,204
ソルクシーズ	3.9	5.2	4,622
フェイス	3.6	6.019	7,030
ハイマックス	1.8	1.8	2,883
野村総合研究所	103.4	102.5	444,337
サイバネットシステム	11.3	11.2	8,086
ＣＥホールディングス	2.1	1.9	2,384
日本システム技術	－	1.6	2,244
インテージホールディングス	7.9	7.8	18,267
東邦システムサイエンス	4.5	4.5	3,334
ソースネクスト	8.3	8.2	4,223
フォーカスシステムズ	5.3	7	7,105
クレスコ	3.1	3.1	12,679
フジ・メディア・ホールディングス	144.1	142.8	234,763
オービック	47.7	47.3	326,843
ジャストシステム	22.4	22.2	53,169
ＴＤＣソフトウェアエンジニアリング	6	6	6,846
ヤフー	991.9	983.3	518,199
トレンドマイクロ	73.3	66.6	346,986
インフォメーション・ディベロプメント	3.9	3.9	5,105
日本オラクル	22.2	22.1	171,054
アルファシステムズ	4.5	4.5	9,544
フューチャー	18.7	18.5	18,056
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	10.3	10.2	11,413
ソフトバンク・テクノロジー	3.3	6.6	12,190
トーセ	3.7	3.7	8,236
オービックビジネスコンサルタント	7	7	39,550
伊藤忠テクノソリューションズ	31.3	31.1	123,156
アイティフォー	17.9	17.8	10,964
東計電算	2.4	2.4	6,288
エックスネット	1.3	2.5	2,282
大塚商会	37.2	41	287,820
サイボウズ	18.4	18.2	8,717

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ソフトブレーン	18.9	10.7	4,611
電通国際情報サービス	8.5	8.4	20,218
デジタルガレージ	20.1	26.5	57,028
EMシステムズ	4.7	4.7	10,419
ウェザーニューズ	4.6	4.6	15,847
ＣＩＪ	11.6	11.5	6,831
東洋ビジネスエンジニアリング	1.4	1.4	2,388
日本エンタープライズ	14.1	14	3,514
WOWOW	6.6	6.5	21,125
スカラ	9.5	9.5	7,581
日本コロムビア	4.1	－	－
イマジカ・ロボット　ホールディングス	11.6	11.5	9,579
ネットワンシステムズ	59.9	59.4	67,359
システムソフト	24.4	32.3	5,006
アルゴグラフィックス	6.3	6.3	17,734
マーベラス	23.3	23.1	25,363
エイベックス・グループ・ホールディングス	25.5	25.2	38,782
日本ユニシス	38.2	37.9	66,287
兼松エレクトロニクス	8.7	8.6	26,617
東京放送ホールディングス	91.2	90.4	190,472
日本テレビホールディングス	126.3	125.2	238,380
朝日放送	13.7	13.5	11,407
テレビ朝日ホールディングス	37.8	37.5	81,187
スカパーＪＳＡＴホールディングス	90	89.2	44,867
テレビ東京ホールディングス	11.3	11.2	27,787
日本ＢＳ放送	3.1	4.6	5,612
ビジョン	1.6	3.5	8,729
Ｕ－ＮＥＸＴ	3.6	3.6	4,057
ワイヤレスゲート	4.8	6.3	8,631
コネクシオ	12.2	12.1	21,925
日本通信	115.7	120.2	17,789
クロップス	2.9	2.9	1,966
日本電信電話	1,110.9	1,101.1	5,811,605
ＫＤＤＩ	1,369.1	1,339.7	3,952,115
光通信	16.6	16.5	212,685
ＮＴＴドコモ	1,034.1	1,009.7	2,603,006
エムティーアイ	21.1	18.4	13,726
GMOインターネット	50.5	50	70,150
アイドママーケティングコミュニケーション	－	1.8	1,195
カドカワ	40.1	39.8	49,033
学研ホールディングス	46	4.6	14,674
ゼンリン	18.3	18.1	62,354
昭文社	7.5	7.8	5,842
インプレスホールディングス	11.4	11.3	1,604
アイネット	7.8	7.7	10,063
松竹	91	90	138,960
東宝	90.5	89.7	366,424
東映	51	51	60,996
エヌ・ティ・ティ・データ	85.5	423.6	512,556
ピー・シー・エー	2	2	3,238
ビジネスブレイン太田昭和	2.4	2.3	2,541
ＤＴＳ	14.3	14.1	44,979
スクウェア・エニックス・ホールディングス	53.3	52.8	206,448
シーイーシー	8.2	8.1	17,520
カプコン	32.4	32.1	96,300
アイ・エス・ビー	2.7	2.6	3,632
ジャステック	8.8	7.9	10,578
ＳＣＳＫ	37.6	37.3	178,480
日本システムウエア	4.5	4.5	9,720
アイネス	17.4	17.3	18,043
ＴＫＣ	12.8	12.7	39,243
富士ソフト	20.5	18.9	63,504
ＮＳＤ	29.4	29.1	59,014
コナミホールディングス	62.5	61.9	365,210
福井コンピュータホールディングス	4	4	14,820
ＪＢＣＣホールディングス	11.6	11.5	11,040
ミロク情報サービス	10.2	13.5	30,037
ソフトバンクグループ	623	617.4	5,397,310
卸売業（4.5%）			
ホウスイ	11	11	1,408
高千穂交易	5.3	5.3	5,485
伊藤忠食品	3.4	3.4	16,252
エレマテック	5.5	5.5	11,088
ＪＡＬＵＸ	4.4	4.4	11,827
あらた	6.2	6.3	31,626
トーメンデバイス	2.1	2.1	4,899
東京エレクトロン　デバイス	5	5	8,840
フィールズ	10.6	10.5	12,001
双日	817.3	810.1	234,929
アルフレッサ　ホールディングス	163.7	162.3	321,678
横浜冷凍	34.3	32.3	33,979
神栄	19	19	3,002
山下医科器械	1.1	1.1	1,889
ラサ商事	5.9	5.9	5,280

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ラクーン	6.6	8.7	5,550
アルコニックス	7.9	7.8	21,840
神戸物産	7.4	8.9	51,887
あい　ホールディングス	19.7	19.5	60,937
ディーブイエックス	4.9	4.9	6,796
ダイワボウホールディングス	117	116	53,360
マクニカ・富士エレホールディングス	25.6	25.4	48,463
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26	25.8	22,962
八洲電機	10.7	10.6	9,624
メディアスホールディングス	－	2.1	5,472
ＵＫＣホールディングス	8.9	8.8	16,227
大光	－	3.1	3,180
ＯＣＨＩホールディングス	4	4	5,356
ＴＯＫＡＩホールディングス	60.8	60.3	51,074
大阪工機	1.6	2.1	2,047
三洋貿易	7.6	7.5	18,780
ビューティガレージ	1.4	1.8	2,748
ウイン・パートナーズ	10	9.9	14,780
ミタチ産業	3.2	3.2	2,678
シップヘルスケアホールディングス	26.6	26.3	85,606
明治電機工業	4.7	4.7	7,393
デリカフーズ	2.9	2.9	4,811
スターティア	3.1	3.1	2,080
コメダホールディングス	18.7	24.8	47,690
富士興産	4.9	4.9	2,915
協栄産業	17	17	4,743
小野建	12	11.9	21,539
佐鳥電機	10.2	10.1	9,382
エコートレーディング	3.2	3.1	2,120
伯東	9.5	9.4	14,889
コンドーテック	11	10.9	10,889
中山福	7.9	7.9	6,106
ナガイレーベン	20	18.1	50,064
三菱食品	15.2	15	48,525
松田産業	10.1	10	15,390
第一興商	22.5	22.3	121,981
メディパルホールディングス	138.4	137.2	259,308
ＳＰＫ	3	2.9	8,511
萩原電気	4.7	4.7	11,660
アズワン	10.8	10.7	60,455
スズデン	4.9	4.9	6,203
尾家産業	4.4	4.4	5,676

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
シモジマ	8.4	8.4	9,349
ドウシシャ	16.3	16.1	35,854
小津産業	3	3	6,303
高速	8.2	8.1	9,217
たけびし	4.8	4.8	6,993
黒田電気	18.9	18.7	36,782
リックス	3.1	3.1	5,555
丸文	12.2	12.1	9,801
ハピネット	11.5	11.4	22,013
橋本総業ホールディングス	2.8	2.8	4,382
日本ライフライン	11.8	15.6	76,908
エクセル	5.9	5.9	8,844
マルカキカイ	4.5	4.4	8,404
ＩＤＯＭ	37.2	36.9	25,940
日本エム・ディ・エム	10.4	10.3	9,836
進和	8.2	8.1	17,868
エスケイジャパン	2.6	2.6	743
ダイトロン	6.3	6.3	11,333
シークス	9.9	8.7	38,062
田中商事	4.2	4.2	3,032
オーハシテクニカ	7.8	7.7	11,565
白銅	3.5	3.4	6,412
伊藤忠商事	1,013.6	1,004.6	1,752,022
丸紅	1,362	1,349.9	941,555
高島	24	24	5,160
長瀬産業	83.2	82.5	150,232
蝶理	8.8	8.7	17,913
豊田通商	154.1	152.8	515,700
三共生興	20.9	20.7	8,528
兼松	294	292	77,672
ツカモトコーポレーション	25	25	3,125
三井物産	1,251.5	1,240.4	2,005,726
日本紙パルプ商事	72	71	30,246
日立ハイテクノロジーズ	48	47.6	186,830
カメイ	18	17.8	28,052
東都水産	2.1	2.1	4,053
ＯＵＧホールディングス	22	22	5,940
スターゼン	5.8	5.7	28,785
山善	53.1	52.6	56,492
椿本興業	16	15	7,830
住友商事	871.2	863.5	1,324,609
内田洋行	6.8	6.3	18,282

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱商事	1,038.4	1,029.2	2,614,168
第一実業	31	31	18,352
キヤノンマーケティングジャパン	39.5	39.1	98,258
西華産業	44	42	19,782
佐藤商事	12.3	12.2	13,127
菱洋エレクトロ	13.2	12.7	22,758
東京産業	13.7	13.6	6,283
ユアサ商事	13.1	13	45,630
神鋼商事	3.5	3.4	10,897
小林産業	10.1	9.1	2,921
阪和興業	138	137	101,243
カナデン	13.2	13.1	14,986
菱電商事	22	22	17,556
フルサト工業	7.6	7.5	13,267
岩谷産業	153	152	102,752
すてきナイスグループ	59	58	8,990
昭光通商	49	49	4,900
ニチモウ	20	20	3,640
極東貿易	21	21	6,258
イワキ	21	19	8,379
三愛石油	37.1	36.8	43,681
稲畑産業	33.2	32.9	51,126
ＧＳＩクレオス	34	33	5,313
明和産業	12.7	12.6	5,367
ワキタ	29.4	29.2	38,193
東邦ホールディングス	44.3	43.9	93,594
サンゲツ	47.4	46.5	91,093
ミツウロコグループホールディングス	22.2	22.1	16,177
シナネンホールディングス	5.9	5.9	13,257
伊藤忠エネクス	30.5	30.3	33,087
サンリオ	42.7	42.3	87,307
サンワテクノス	8.2	8.1	14,580
リョーサン	20.6	18.4	82,432
新光商事	15.2	15	26,790
トーホー	6.2	6.2	18,662
三信電気	15.3	15.2	23,408
東陽テクニカ	18.3	15.8	15,847
モスフードサービス	18.1	18	62,010
加賀電子	12.5	12.4	34,385
ソーダニッカ	14.2	14.1	7,966
立花エレテック	9.3	9.3	15,056
フォーバル	6	6	4,134

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＰＡＬＴＡＣ	22.1	21.9	90,337
三谷産業	14.7	14.5	5,930
太平洋興発	58	57	5,928
ヤマタネ	6.9	6.9	11,930
丸紅建材リース	13	13	2,899
日鉄住金物産	12.1	12	67,200
トラスコ中山	31.6	28.5	74,926
オートバックスセブン	51.2	50.8	94,894
モリト	11.1	11	10,923
加藤産業	21.6	21.4	68,694
イノテック	11.9	11.8	8,696
イエローハット	13	12.9	37,539
ＪＫホールディングス	13.9	13.7	10,275
日伝	5.7	5.7	24,994
北沢産業	11.4	11.3	2,418
杉本商事	7.9	7.9	13,027
因幡電機産業	19.4	19.2	84,864
バイテックホールディングス	5.6	5.6	9,604
ミスミグループ本社	155.5	158	442,242
アルテック	11.8	11.7	2,667
タキヒヨー	21	21	10,017
蔵王産業	2.3	2.2	3,302
スズケン	63	62.4	231,816
ジェコス	9.5	9.4	11,421
ルネサスイーストン	12.7	12.5	7,487
小売業（4.7%）			
ローソン	48	43.3	328,647
サンエー	10.4	10.4	50,648
カワチ薬品	10.7	10.6	29,192
エービーシー・マート	25.2	24.9	151,392
ハードオフコーポレーション	6.1	6	6,696
アスクル	14.4	14.3	48,620
ゲオホールディングス	23.1	22.9	34,876
アダストリア	21.2	21.1	51,842
ジーフット	8.3	8.3	6,673
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	1.8	1.7	1,241
くらコーポレーション	9	8	45,280
キャンドゥ	7.3	6.5	11,128
パルグループホールディングス	7.1	7	24,010
エディオン	53.6	53.2	55,540
サーラコーポレーション	17.3	23.5	20,539
ワッツ	5.9	5.4	7,781

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ハローズ	4.5	4.5	10,764
あみやき亭	2.7	2.7	11,745
ひらまつ	19	18.9	11,680
ゲンキー	2.8	5.5	24,557
大黒天物産	3.3	3.3	18,348
ハニーズホールディングス	13.4	13.2	16,671
ファーマライズホールディングス	3.1	3.1	1,739
アルペン	10.6	10.5	23,509
クオール	15.6	15.5	29,124
ジンズ	9.4	9.3	59,706
ビックカメラ	79.4	78.7	101,444
ＤＣＭホールディングス	84	83.2	80,371
ＭｏｎｏｔａＲＯ	49	48.6	178,362
東京一番フーズ	3.4	3.4	2,043
ダイヤモンドダイニング	3	3	7,719
きちり	3.7	3.6	2,451
アークランドサービスホールディングス	4.3	11.4	23,210
Ｊ．フロント　リテイリング	175.1	173.5	271,701
ドトール・日レスホールディングス	24.2	24	58,488
マツモトキヨシホールディングス	26.2	25.9	194,250
ブロンコビリー	7.2	7.2	19,504
スタートトゥデイ	126.3	121	409,585
トレジャー・ファクトリー	3.9	3.9	3,201
物語コーポレーション	3.9	3.9	26,364
ココカラファイン	14.4	14.3	86,801
三越伊勢丹ホールディングス	275.3	272.9	306,193
Ｈａｍｅｅ	3.1	4.1	6,937
ウエルシアホールディングス	13.7	36.2	156,927
クリエイトＳＤホールディングス	20.4	20.2	58,761
丸善ＣＨＩホールディングス	16.1	16	5,648
ミサワ	2.5	2.5	1,127
ティーライフ	1.2	1.8	2,802
エー・ピーカンパニー	2.3	2.2	1,760
チムニー	4.2	4.2	12,024
シュッピン	5.2	5.2	10,660
ネクステージ	2.7	4.5	7,609
ジョイフル本田	22.5	22.3	68,015
鳥貴族	3.4	5	12,950
キリン堂ホールディングス	4.4	4.4	5,178
ホットランド	6.4	7.9	11,818
すかいらーく	59.4	84.6	136,206
綿半ホールディングス	5.6	5.5	13,255

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	1.3	1.8	3,564
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	45.9	45.5	51,688
ブックオフコーポレーション	7.9	7.8	6,403
ゴルフダイジェスト・オンライン	5.5	5.5	4,251
ＢＥＥＮＯＳ	1.6	2.1	2,669
あさひ	10.3	10.2	13,076
日本調剤	4.9	4.8	18,072
コスモス薬品	7	6.9	168,153
トーエル	6.7	6.6	5,992
一六堂	2.9	2.9	1,171
オンリー	1.6	2.1	1,753
セブン&アイ・ホールディングス	579.2	574.1	2,539,244
薬王堂	6.9	6.8	21,182
クリエイト・レストランツ・ホールディング	37.1	36.8	42,540
ツルハホールディングス	27.7	27.5	352,550
サンマルクホールディングス	8.9	8.8	30,052
フェリシモ	3.9	3.9	4,980
トリドールホールディングス	17	16.8	52,584
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	－	1.7	10,030
サツドラホールディングス	1.8	1.8	3,612
ダイユー・リックホールディングス	4.5	4.4	3,911
バロックジャパンリミテッド	8.1	10.9	12,469
クスリのアオキホールディングス	11	10.9	70,632
スシローグローバルホールディングス	－	12.4	43,400
ＬＩＸＩＬビバ	－	13	24,492
メディカルシステムネットワーク	15.6	15.5	7,843
総合メディカル	6.7	6.6	32,934
はるやまホールディングス	6.5	6.4	6,323
ノジマ	16.1	21.5	46,870
カッパ・クリエイト	19.4	19.2	24,288
ライトオン	10.3	11.5	10,925
ジーンズメイト	4.4	4.4	2,631
良品計画	18.3	18.2	558,740
三城ホールディングス	17.1	16.9	7,959
アドヴァン	14.1	13.9	12,371
アルビス	3.6	3.6	15,984
コナカ	17.6	17.5	10,325
ハウス　オブ　ローゼ	1.7	1.7	2,641
Ｇ－７ホールディングス	4.1	4	9,156
イオン北海道	13.9	13.7	8,494
コジマ	20.4	23.5	9,047
ヒマラヤ	4.3	3.7	3,285

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コーナン商事	19.6	19.5	40,072
エコス	5.4	5.5	6,198
ワタミ	16.3	16.2	23,101
マルシェ	3.1	3	2,490
ドンキホーテホールディングス	89.5	88.7	357,904
西松屋チェーン	24.2	24	27,960
ゼンショーホールディングス	71.7	71	149,455
幸楽苑ホールディングス	8.8	8.7	15,155
ハークスレイ	3.4	3.3	3,699
サイゼリヤ	22.8	20.3	64,960
ＶＴホールディングス	46.8	46.4	27,283
魚力	4.3	4.3	5,258
ポプラ	3.5	3.4	2,108
フジ・コーポレーション	2.1	2.4	4,934
ユナイテッドアローズ	18.4	18.3	63,501
ハイデイ日高	12.6	15	44,535
京都きもの友禅	8.8	8.7	8,091
コロワイド	45.9	45.5	93,184
ピーシーデポコーポレーション	18.3	18.2	12,776
壱番屋	9.7	9.6	42,000
トップカルチャー	5	4.9	2,445
ＰＬＡＮＴ	3.1	3.1	3,999
スギホールディングス	30.3	30.1	177,590
ヴィア・ホールディングス	10.5	10.4	9,308
スクロール	20.9	20.7	7,948
ヨンドシーホールディングス	10.5	13.9	41,978
ユニー・ファミリーマートホールディングス	60.7	60.1	365,408
木曽路	16.9	16.8	44,520
サトレストランシステムズ	16.3	16.1	14,940
千趣会	25	24.8	17,037
タカキュー	10.7	10.6	2,575
ケーヨー	23.3	23.1	17,856
上新電機	33	32	54,656
日本瓦斯	25.4	25.1	94,376
ベスト電器	44.6	－	－
ロイヤルホールディングス	22.8	24.3	69,303
東天紅	11	11	2,607
いなげや	15.4	15.3	28,366
島忠	35.8	35.5	97,589
チヨダ	16.3	16.2	45,716
ライフコーポレーション	10.5	10.4	29,432
リンガーハット	15.6	15.4	38,777

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
さが美	12	12	1,440
ＭｒＭａｘ	17.2	17.1	9,268
テンアライド	12.7	12.6	5,166
ＡＯＫＩホールディングス	27.6	27.4	38,223
オークワ	20	20	23,340
コメリ	21.3	21.1	67,942
青山商事	28.9	28.7	109,634
しまむら	16.1	15.9	215,286
はせがわ	7.3	7.2	3,535
高島屋	232	230	233,220
松屋	30.2	29.9	27,777
エイチ・ツー・オー　リテイリング	70.9	70.2	136,749
近鉄百貨店	53	52	19,292
丸栄	28	－	－
パルコ	13.3	13.1	18,051
丸井グループ	145.6	144.3	223,665
アクシアル　リテイリング	10.7	10.6	48,283
井筒屋	7.5	7.4	3,374
イオン	569.4	564.4	945,370
イズミ	27.5	24.7	144,248
東武ストア	1.7	1.6	5,064
平和堂	28	27.8	69,722
フジ	15.4	15.2	43,517
ヤオコー	15.7	15.5	77,965
ゼビオホールディングス	18.8	18.6	39,283
ケーズホールディングス	63.8	58	140,186
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	8.1	8.1	4,681
日産東京販売ホールディングス	20.3	20.1	7,879
アインホールディングス	18	17.9	153,403
元気寿司	3.5	3.4	8,449
ヤマダ電機	462.9	471.1	277,949
アークランドサカモト	23.4	23.2	35,148
ニトリホールディングス	59.8	59.3	965,404
グルメ杵屋	10	10	11,380
愛眼	10.1	10	2,130
ケーユーホールディングス	7.2	7.1	6,929
吉野家ホールディングス	48.2	47.8	92,684
松屋フーズ	6.6	6.6	26,928
サガミチェーン	17.3	17.2	25,112
関西スーパーマーケット	11.3	11.2	16,374
王将フードサービス	10.1	10	42,750
プレナス	15.5	15.3	39,030

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ミニストップ	10.2	10.1	23,684
アークス	25.9	25.7	63,067
バローホールディングス	29.8	29.5	70,800
藤久	1.1	1.1	1,899
ベルク	6.1	6.1	31,842
大庄	7.4	7.3	12,906
ファーストリテイリング	23.1	22.9	735,319
サンドラッグ	26.3	52.2	237,771
サックスバー　ホールディングス	13	12.9	16,447
ヤマザワ	2.9	2.8	5,028
やまや	2.8	2.8	4,715
ベルーナ	34.5	29.4	34,309
銀行業（7.6%）			
島根銀行	2.9	2.9	3,819
じもとホールディングス	99.3	98.4	18,991
めぶきフィナンシャルグループ	667.3	661.4	272,496
東京ＴＹフィナンシャルグループ	20	19.8	53,875
九州フィナンシャルグループ	227	225	154,575
ゆうちょ銀行	391.8	388.4	549,586
富山第一銀行	35.2	34.9	18,392
コンコルディア・フィナンシャルグループ	906	889	479,348
西日本フィナンシャルホールディングス	93.8	93	114,576
新生銀行	1,317	1,306	236,386
あおぞら銀行	876	868	373,240
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	10,487	10,394.1	7,204,150
りそなホールディングス	1,619	1,604.7	894,941
三井住友トラスト・ホールディングス	288.9	286.4	1,125,265
三井住友フィナンシャルグループ	1,108.2	1,098.4	4,556,163
第四銀行	170	168	84,504
北越銀行	14.9	14.8	38,568
千葉銀行	534	529	412,091
群馬銀行	307.5	304.8	200,253
武蔵野銀行	22.1	21.9	70,080
千葉興業銀行	37.9	37.6	20,830
筑波銀行	57.5	57	19,266
七十七銀行	217	215	115,025
青森銀行	107	106	41,552
秋田銀行	89	88	29,128
山形銀行	78	77	39,347
岩手銀行	9.1	9	38,790
東邦銀行	124	122.6	46,955
東北銀行	70	70	10,640

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
みちのく銀行	83	82	15,334
ふくおかフィナンシャルグループ	561	557	274,044
静岡銀行	376	362	344,986
十六銀行	186	184	62,008
スルガ銀行	141.5	140.2	339,003
八十二銀行	267	264.7	181,054
山梨中央銀行	86	85	36,890
大垣共立銀行	185	212	63,176
福井銀行	118	117	31,824
北國銀行	147	146	69,058
清水銀行	4.7	4.7	15,839
富山銀行	2.7	2.6	10,842
滋賀銀行	130	129	74,820
南都銀行	13.4	15.7	48,120
百五銀行	124	123	55,965
京都銀行	248	245	252,840
紀陽銀行	52	51.6	93,912
三重銀行	6.2	6.1	14,701
ほくほくフィナンシャルグループ	92.1	91.3	158,131
広島銀行	408	405	184,275
山陰合同銀行	83.2	81.3	73,576
中国銀行	98.1	94.8	143,337
鳥取銀行	4.4	4.4	7,532
伊予銀行	148	195.6	169,585
百十四銀行	152	146	54,604
四国銀行	107	105	32,655
阿波銀行	118	117	81,549
大分銀行	80	79	33,338
宮崎銀行	92	91	33,488
佐賀銀行	84	83	21,663
十八銀行	85	84	23,352
沖縄銀行	13.5	13.3	60,182
琉球銀行	28.5	28.2	45,627
セブン銀行	518.8	514.2	215,449
みずほフィナンシャルグループ	18,789.5	18,625.6	3,553,764
高知銀行	50	50	6,200
山口フィナンシャルグループ	129	128	162,560
長野銀行	4.5	4.5	8,874
名古屋銀行	11.6	11.1	45,565
北洋銀行	225.9	223.9	76,797
愛知銀行	4.6	4.6	28,198
第三銀行	7.8	7.8	13,314

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
中京銀行	5.7	5.6	12,992
大光銀行	49	47	10,904
愛媛銀行	16.4	17.4	23,977
トマト銀行	5.3	5.3	8,114
みなと銀行	12.5	12.4	25,296
京葉銀行	113	112	53,648
関西アーバン銀行	19.3	19.1	25,804
栃木銀行	76.4	75.7	32,248
北日本銀行	4.3	4.3	13,330
東和銀行	259	257	29,812
福島銀行	150	149	13,112
大東銀行	72	71	11,928
トモニホールディングス	114.1	113	57,291
フィデアホールディングス	134.3	133.1	23,958
池田泉州ホールディングス	146.8	145.5	61,983
証券、商品先物取引業（1.1%）			
ＦＰＧ	49.4	49	59,486
ＳＢＩホールディングス	156.4	155	242,420
日本アジア投資	13.2	13.1	5,226
ジャフコ	23.1	22.9	113,011
大和証券グループ本社	1,295	1,247	769,274
野村ホールディングス	2,829.2	2,804.2	1,799,735
岡三証券グループ	118	117	76,401
丸三証券	44	43.6	40,199
東洋証券	49	49	12,201
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	158.8	157.4	102,310
光世証券	33	33	5,148
水戸証券	42.8	42.5	12,665
いちよし証券	31	30.7	30,362
松井証券	79	78.3	67,729
だいこう証券ビジネス	6.7	6.6	4,369
マネックスグループ	148.4	145.3	44,607
カブドットコム証券	103.2	102.3	35,805
極東証券	18.6	18.4	28,906
岩井コスモホールディングス	13.1	13	16,536
藍澤證券	25.9	25.6	18,636
マネーパートナーズグループ	17.6	17.5	8,890
小林洋行	4	3.9	1,080
保険業（2.4%）			
かんぽ生命保険	52.2	51.8	124,579
ＳＯＭＰＯホールディングス	289.3	286.8	1,240,410
アニコム　ホールディングス	9.4	9.3	27,211

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	413.6	384	1,449,984
ソニーフィナンシャルホールディングス	132.6	131.4	242,301
第一生命ホールディングス	834.5	827.2	1,540,246
東京海上ホールディングス	560.7	552.4	2,484,142
Ｔ＆Ｄホールディングス	504.4	499.9	791,841
アドバンスクリエイト	3.2	3.2	6,176
その他金融業（1.3%）			
全国保証	39	38.6	175,051
クレディセゾン	105	104	215,488
アクリーティブ	11.3	11.2	4,312
芙蓉総合リース	15.8	15.7	105,190
興銀リース	26	25.8	73,788
東京センチュリー	27.9	27.6	130,962
日本証券金融	61	60.4	33,884
アイフル	232.1	230	92,230
ポケットカード	10.4	10.3	10,948
リコーリース	10.9	10.8	41,850
イオンフィナンシャルサービス	88.4	87.6	205,684
アコム	278	275.5	127,556
ジャックス	76	76	41,648
オリエントコーポレーション	299.2	296.6	53,388
日立キャピタル	32.6	32.3	85,239
アプラスフィナンシャル	66.4	65.8	6,909
オリックス	980	971.4	1,735,406
三菱ＵＦＪリース	351	347.9	195,519
日本取引所グループ	430.3	426.5	826,130
イー・ギャランティ	4.1	4.1	12,607
アサックス	2.4	2.4	4,003
ＮＥＣキャピタルソリューション	5.6	5.6	11,048
不動産業（2.3%）			
いちご	131.5	130.4	44,857
日本駐車場開発	166.9	165.4	27,291
ヒューリック	288.6	286.1	313,279
三栄建築設計	5.5	5.5	11,214
野村不動産ホールディングス	91.9	91.1	205,612
三重交通グループホールディングス	24.5	24.3	10,886
サムティ	11.1	11	17,105
ディア・ライフ	9.5	12.7	5,918
エー・ディー・ワークス	126.8	250.8	10,784
日本商業開発	7.6	7.7	12,835
プレサンスコーポレーション	21.5	21.3	30,096
ユニゾホールディングス	11.4	13.2	34,188

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ＴＨＥグローバル社	4.8	6.4	5,785
日本管理センター	9.9	9	12,546
サンセイランディック	2.8	3.9	3,603
エストラスト	2.4	2.4	1,771
フージャースホールディングス	17.9	17.7	17,611
オープンハウス	20	22.3	74,147
東急不動産ホールディングス	334.8	331.8	217,660
飯田グループホールディングス	115.4	114.3	213,398
ムゲンエステート	4.8	8.4	9,139
ファーストブラザーズ	1.4	1.9	3,547
ハウスドゥ	1.7	2.2	3,555
シーアールイー	2	2.2	3,317
ケイアイスター不動産	2.8	3.7	6,937
パーク２４	70.2	75.9	206,903
パラカ	4	4.4	10,516
三井不動産	734	727.3	1,743,338
三菱地所	1,029	1,020.2	1,985,819
平和不動産	26.2	25.9	46,568
東京建物	160.6	149.8	212,865
ダイビル	35.6	35.3	42,324
京阪神ビルディング	22.9	22.7	15,685
住友不動産	332	329	1,074,185
大京	257	255	56,100
テーオーシー	53.6	53.2	54,902
東京楽天地	23	2.2	12,892
レオパレス２１	174.7	170.5	135,547
スターツコーポレーション	14.1	18.6	49,029
フジ住宅	17.6	17.5	13,440
空港施設	16.7	16.6	10,059
明和地所	7.6	7.5	6,742
住友不動産販売	12.5	－	－
ゴールドクレスト	12.5	12.4	32,884
日本エスリード	5.4	5.3	10,732
日神不動産	16.4	16.2	10,157
日本エスコン	18.4	23.9	10,755
タカラレーベン	60.3	58.9	30,097
サンヨーハウジング名古屋	7.1	7.1	7,923
イオンモール	89.1	88.3	182,516
ファースト住建	5.2	5.1	8,297
トーセイ	18.9	16.7	14,011
穴吹興産	1.5	1.5	4,420
エヌ・ティ・ティ都市開発	86	85.2	94,401
サンフロンティア不動産	14.9	14.8	15,762
エフ・ジェー・ネクスト	12.1	12	10,944
インテリックス	3.2	4.2	3,557
ランドビジネス	8.2	8.1	2,446
グランディハウス	12.1	12	4,920
日本空港ビルデング	44.1	43.7	181,355
サービス業（3.9%）			
日本工営	9.8	9.7	29,730
ＬＩＦＵＬＬ	36.2	35.9	29,617
ジェイエイシーリクルートメント	9	10.7	17,205
日本M&Aセンター	42.3	41.9	206,357
メンバーズ	－	3.6	2,361
アコーディア・ゴルフ	7.4	－	－
中広	1.4	1.4	1,092
タケエイ	12.8	12.7	14,782
トラスト・テック	5.9	5.9	17,228
コシダカホールディングス	5	7	21,910
パソナグループ	10.9	10.8	12,474
ＣＤＳ	3.3	3.6	4,471
リンクアンドモチベーション	34.5	24.4	18,202
ＧＣＡ	13	15.1	14,329
エス・エム・エス	20.8	20.6	67,568
パーソルホールディングス	113.3	112.3	242,904
リニカル	8.6	8.5	13,914
クックパッド	32.7	41.6	32,988
エスクリ	5.2	5.2	4,035
アイ・ケイ・ケイ	6.5	7.8	6,591
学情	6.1	6	7,512
スタジオアリス	6	6.7	17,956
シミックホールディングス	7.4	7.3	11,315
ＮＪＳ	3.3	3.3	4,517
綜合警備保障	53.3	52.8	245,520
カカクコム	104.5	102.1	139,877
セントケア・ホールディング	1.9	1.9	3,648
サイネックス	1.1	1.4	1,390
ルネサンス	7.4	7.4	13,645
ディップ	18.9	18.7	43,234
オプトホールディング	10.5	9.3	12,331
新日本科学	16.3	16.2	8,974
ツクイ	34.7	34.4	25,559
キャリアデザインセンター	3.1	3	4,617
エムスリー	126.9	125.8	357,020

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ツカダ・グローバルホールディング	10.7	10.6	6,116
ブラス	－	0.7	749
アウトソーシング	8.4	7.9	52,851
ウェルネット	11	10.9	12,840
ワールドホールディングス	3.3	4.4	14,432
ディー・エヌ・エー	65.7	65.1	157,216
博報堂ＤＹホールディングス	203	201.2	302,202
ぐるなび	21.2	21	34,902
エスアールジータカミヤ	15.8	15.7	9,357
ジャパンベストレスキューシステム	18.1	16.5	6,765
ファンコミュニケーションズ	37.2	36.9	39,483
ライク	2.6	2.6	10,062
ビジネス・ブレークスルー	4.7	6.2	2,318
ＷＤＢホールディングス	5.2	5.2	13,733
ティア	7	7	6,132
ＣＤＧ	－	1	1,899
バリューコマース	13.5	11.9	8,663
インフォマート	62.1	67.2	49,862
ＪＰホールディングス	42.1	41.7	12,343
ＥＰＳホールディングス	18.1	20	43,380
レッグス	3.3	3.3	2,550
プレステージ・インターナショナル	20.7	27.5	34,127
アミューズ	8.1	8	21,888
ドリームインキュベータ	4.5	4.4	9,301
クイック	7.5	7.4	11,299
ＴＡＣ	8.1	8	1,928
ケネディクス	185.7	184.1	104,384
電通	163.2	161.8	793,629
テイクアンドギヴ・ニーズ	6.8	6.8	4,909
ぴあ	4.4	4.4	17,600
イオンファンタジー	4.3	4.3	14,405
シーティーエス	3.9	15.5	11,702
ネクシィーズグループ	5.3	5.2	10,160
みらかホールディングス	37.4	37.1	185,314
アルプス技研	5.9	5.8	19,517
ダイオーズ	2.6	2.6	3,400
日本空調サービス	14	13.9	9,646
オリエンタルランド	158.3	156.9	1,277,793
ダスキン	37.5	35.7	111,027
明光ネットワークジャパン	18.2	16.8	26,510
ファルコホールディングス	6.9	6.8	10,526
秀英予備校	2.9	2.9	1,368

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
田谷	2.4	2.4	1,634
ラウンドワン	45.7	45.3	56,217
リゾートトラスト	56.7	56.2	120,436
ビー・エム・エル	19.2	19	44,916
ワタベウェディング	2.2	2.1	1,360
りらいあコミュニケーションズ	24.2	24	27,792
リソー教育	24.9	24.7	21,390
早稲田アカデミー	1.9	1.9	3,218
ユー・エス・エス	177.3	175.7	384,255
東京個別指導学院	4.7	4.7	5,555
サイバーエージェント	77.1	87.3	309,915
楽天	748.4	680.5	899,280
クリーク・アンド・リバー社	5.2	6.8	8,744
テー・オー・ダブリュー	11.7	11.6	9,187
セントラルスポーツ	5	4.9	20,727
フルキャストホールディングス	15.1	11.6	21,181
リソルホールディングス	15	14	5,222
テクノプロ・ホールディングス	23.8	23.6	116,230
アトラ	1.7	2.3	1,492
インターワークス	3	3	3,159
ＫｅｅＰｅｒ技研	1.6	4.3	5,822
ファーストロジック	0.8	1	2,426
三機サービス	－	1.4	1,832
デザインワン・ジャパン	1	2.6	3,348
イー・ガーディアン	4.7	6.7	15,456
リブセンス	9.8	8.5	5,533
ジャパンマテリアル	10.7	10.6	26,235
ベクトル	11.8	11.8	17,322
ウチヤマホールディングス	6.6	6.5	3,029
ライクキッズネクスト	1.4	1.4	2,301
キャリアリンク	3.3	3.3	1,930
ＩＢＪ	11.4	9.7	7,284
アサンテ	5.4	5.3	10,552
Ｎ・フィールド	6.9	7.4	9,953
バリューＨＲ	1.1	1.5	4,687
Ｍ&Ａキャピタルパートナーズ	1.9	2.6	13,754
ライドオン・エクスプレス	3.6	3.6	3,585
ＥＲＩホールディングス	3.8	3.7	3,215
アビスト	2.3	1.9	9,167
ウィルグループ	5.8	6.2	6,944
エスクロー・エージェント・ジャパン	2.4	3.2	10,880
日本ビューホテル	3	2.9	4,013

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
リクルートホールディングス	320	951.4	2,045,510
エラン	1.9	1.6	3,808
土木管理総合試験所	1.5	1.9	3,079
日本郵政	382.2	378.8	518,198
ベルシステム２４ホールディングス	22.3	22.1	26,586
一蔵	1.1	1.4	1,551
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	－	1.7	2,684
エボラブルアジア	－	2.7	7,203
ストライク	－	1.3	5,843
ソラスト	6.7	9.2	16,293
リログループ	5.5	72.6	167,125
東祥	3.1	4.1	21,484
エイチ・アイ・エス	23.9	20.7	75,037
ラックランド	2.6	2.5	5,170
共立メンテナンス	11.9	23.6	72,098
イチネンホールディングス	15.3	14.9	21,202
建設技術研究所	9.2	9.2	9,301
スペース	7.9	7.8	11,684
燦ホールディングス	2.9	2.9	6,948
スバル興業	10	1	6,050
東京テアトル	56	55	8,140
タナベ経営	2.9	2.8	3,914
ナガワ	2.7	2.6	10,374
よみうりランド	29	29	14,065
東京都競馬	100	9.9	32,076
常磐興産	5.4	5.3	9,704
カナモト	20.4	20.2	77,366
東京ドーム	58.4	57.9	60,737
西尾レントオール	11.8	11.7	43,173
トランス・コスモス	17	16.8	40,941
乃村工藝社	31.3	31	72,726
藤田観光	48	5.3	18,974
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	83	83	17,928
日本管財	12.6	12.4	24,043
トーカイ	6.5	6.4	31,168
白洋舎	1.4	1.5	5,167
セコム	152.4	151	1,223,100
セントラル警備保障	6.5	6.4	13,011
丹青社	25.3	25.1	28,965
メイテック	17.7	16.8	84,840
アサツー　ディ・ケイ	23.9	25.2	72,752
応用地質	13.8	15	22,440
船井総研ホールディングス	18.8	18.4	57,592
進学会	6.1	6.1	3,318
オオバ	11.4	11.2	5,454
いであ	－	2.7	2,759
学究社	3.8	3.8	6,038
ベネッセホールディングス	49.1	48.6	206,064
イオンディライト	16.5	16.4	63,386
ナック	9	8.9	8,615
ニチイ学館	25.4	25.2	28,904
ダイセキ	25.5	25.3	65,855
ステップ	4.9	4.9	7,154
合計 株数・金額	211,740	206,513	326,221,648
合計 銘柄数＜比率＞	1,991	2,007	＜98.4%＞

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末	
			買建額	売建額
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	5,405	－

＊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(169,012,576千口)の内容です。

外国株式

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
AFLAC INC	390	430	3,475	382,278	保険
AGCO CORP	63	63	437	48,163	機械
AES CORP	650	650	726	79,937	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
AT & T INC	5,909	6,514	24,903	2,739,332	各種電気通信サービス
ABBOTT LABORATORIES	1,648	1,838	9,155	1,007,058	ヘルスケア機器・用品
ABBVIE INC	1,562	1,693	11,922	1,311,431	バイオテクノロジー
ACTIVISION BLIZZARD INC	577	754	4,741	521,609	ソフトウェア
ACUITY BRANDS INC	43	43	803	88,352	電気設備
ADOBE SYSTEMS INC.	477	526	7,984	878,314	ソフトウェア
ADVANCE AUTO PARTS	71	71	650	71,569	専門小売り
ADVANCED MICRO DEVICES	—	900	1,136	125,037	半導体・半導体製造装置
AETNA INC	335	375	5,846	643,087	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	1,052	115,775	資本市場
AGILENT TECHNOLOGIES INC	312	347	2,156	237,188	ライフサイエンス・ツール/サービス
AIR PRODUCTS	199	233	3,450	379,529	化学
AKAMAI TECHNOLOGIES	166	191	884	97,255	インターネットソフトウェア・サービス
ALBEMARLE CORP	111	122	1,383	152,209	化学
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	216	241	3,290	361,994	バイオテクノロジー
ALIGN TECHNOLOGY INC	71	78	1,391	153,118	ヘルスケア機器・用品
ALLEGHANY CORP	15	15	891	98,070	保険
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	57	54	1,252	137,812	情報技術サービス
ALLIANT ENERGY CORP	229	229	963	105,999	電力
ALLSTATE CORP	362	391	3,690	405,928	保険
ALLY FINANCIAL INC	421	481	1,086	119,523	消費者金融
ALPHABET INC-CL C	297	331	30,691	3,376,081	インターネットソフトウェア・サービス
ALPHABET INC-CL A	283	315	29,753	3,272,934	インターネットソフトウェア・サービス
ALTRIA GROUP INC	1,875	2,060	13,482	1,483,097	タバコ
AMAZON.COM INC	387	430	42,061	4,626,791	インターネット販売・通信販売
AMERCO	6	6	254	27,946	陸運・鉄道
AMEREN CORPORATION	229	243	1,437	158,081	総合公益事業
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	125	125	605	66,563	旅客航空輸送業
AMERICAN ELECTRIC POWER	469	526	3,788	416,707	電力
AMERICAN EXPRESS CO	752	816	7,131	784,412	消費者金融
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	—	74	773	85,038	保険
AMERICAN INTL GROUP	1,026	1,043	6,567	722,454	保険
AMERICAN WATER WORKS CO INC	168	193	1,574	173,215	水道
AMERISOURCEBERGEN CORP	182	166	1,328	146,134	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AMERIPRISE FINANCIAL INC	157	166	2,379	261,775	資本市場
AMETEK INC	219	233	1,470	161,750	電気設備
AMGEN INC	718	782	13,402	1,474,296	バイオテクノロジー
AMPHENOL CORP-CL A	293	331	2,625	288,804	電子装置・機器・部品
ANADARKO PETE	536	600	2,551	280,698	石油・ガス・消耗燃料
ANALOG DEVICES INC	292	390	3,122	343,457	半導体・半導体製造装置

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ANDEAVOR	—	164	1,531	168,439	石油・ガス・消耗燃料
ANSYS INC	83	93	1,195	131,465	ソフトウェア
ANTERO RESOURCES CORP	147	218	410	45,178	石油・ガス・消耗燃料
ANTHEM INC	251	281	5,450	599,559	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
APACHE CORPORATION	366	410	1,665	183,241	石油・ガス・消耗燃料
APPLE INC	5,178	5,559	89,472	9,841,931	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS	1,032	1,152	5,121	563,397	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	232	254	999	109,943	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND	567	613	2,583	284,217	食品
ARCONIC INC	436	391	971	106,836	航空宇宙・防衛
ARISTA NETWORKS INC	—	46	798	87,877	通信機器
ARROW ELECTRS INC	89	89	676	74,384	電子装置・機器・部品
ASHLAND GLOBAL HOLDINGS INC	58	—	—	—	化学
ASSURANT INC	62	52	533	58,692	保険
ATMOS ENERGY CORP	105	105	928	102,102	ガス
AUTODESK INC.	189	216	2,386	262,524	ソフトウェア
AUTOLIV INC	84	97	1,053	115,886	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS	436	479	5,321	585,385	情報技術サービス
AUTONATION INC	71	71	297	32,755	専門小売り
AUTOZONE	28	31	1,626	178,885	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	87	87	823	90,580	容器・包装
AVNET	122	122	457	50,378	電子装置・機器・部品
BB&T CORPORATION	778	864	4,045	444,977	銀行
BAKER HUGHES	396	—	—	—	エネルギー設備・サービス
BAKER HUGHES,A GE CO,LLC	—	438	1,481	162,992	エネルギー設備・サービス
BALL CORP	158	338	1,379	151,768	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP	9,800	10,633	25,721	2,829,334	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	1,021	1,106	5,848	643,338	資本市場
BARD (C R)	69	76	2,443	268,827	ヘルスケア機器・用品
BAXTER INTERNATIONAL INC.	471	521	3,196	351,654	ヘルスケア機器・用品
B/E AEROSPACE INC	101	—	—	—	航空宇宙・防衛
BECTON,DICKINSON	205	241	4,859	534,549	ヘルスケア機器・用品
BED BATH & BEYOND	156	156	433	47,636	専門小売り
WR BERKLEY CORP	99	99	675	74,291	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,169	1,315	23,478	2,582,581	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	284	305	1,850	203,547	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	168	187	1,553	170,874	バイオテクノロジー
BIOGEN INC	209	230	6,763	744,022	バイオテクノロジー
BLACKROCK INC	116	129	5,509	606,012	資本市場
H & R BLOCK INC	224	195	599	65,937	各種消費者サービス
BOEING CO	568	617	14,678	1,614,614	航空宇宙・防衛
BORGWARNER INC	213	213	966	106,278	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,314	1,458	3,889	427,893	ヘルスケア機器・用品
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	—	84	486	53,528	保険
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,602	1,778	10,223	1,124,585	医薬品
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	114	130	1,002	110,238	情報技術サービス
BROWN-FORMAN CORP-CL B	200	200	1,002	110,286	飲料
CBS CORP-CL B	396	400	2,660	292,688	メディア

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CBOE HOLDINGS INC	—	100	978	107,613	資本市場
CBRE GROUP INC	296	331	1,183	130,238	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC	128	128	800	88,014	ソフトウェア
CDW CORPORATION	140	165	1,020	112,294	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	229	229	691	76,098	化学
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	136	155	1,054	115,957	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP	245	274	4,928	542,098	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	626	68,860	銀行
CME GROUP INC	324	363	4,581	503,996	資本市場
CMS ENERGY CORP	273	304	1,459	160,545	総合公益事業
CSX CORP	903	989	4,982	548,084	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	1,022	1,091	8,646	951,079	食品・生活必需品小売り
CA INC	309	309	1,009	111,011	ソフトウェア
CABOT OIL & GAS CORP	457	490	1,202	132,270	石油・ガス・消耗燃料
CADENCE DESIGN SYS INC	291	291	1,092	120,229	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	1,031	113,432	食品
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	484	513	4,299	472,996	消費者金融
CARDINAL HEALTH INC	310	339	2,237	246,151	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CARMAX INC	183	204	1,322	145,456	専門小売り
CARNIVAL CORP	348	374	2,575	283,331	ホテル・レストラン・レジャー
CATERPILLAR INC DEL	559	624	7,121	783,319	機械
CELANESE CORP-SERIES A	143	144	1,413	155,485	化学
CELGENE CORP	743	827	10,855	1,194,072	バイオテクノロジー
CENTENE CORP	168	187	1,549	170,463	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENTERPOINT ENERGY INC	384	412	1,192	131,201	総合公益事業
CENTURYLINK INC	522	554	1,157	127,303	各種電気通信サービス
CERNER CORP	287	320	2,046	225,139	ヘルスケア・テクノロジー
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	207	228	9,169	1,008,683	メディア
CHENIERE ENERGY INC	195	222	933	102,661	石油・ガス・消耗燃料
CHEVRON CORP	1,812	2,008	21,453	2,359,881	石油・ガス・消耗燃料
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	27	25	819	90,148	ホテル・レストラン・レジャー
CHURCH & DWIGHT CO INC	241	257	1,291	142,113	家庭用品
CIMAREX ENERGY CO	90	97	936	103,029	石油・ガス・消耗燃料
CINCINNATI FINANCIAL CORP	155	170	1,344	147,935	保険
CISCO SYSTEMS	4,828	5,316	17,191	1,891,113	通信機器
CINTAS CORP	78	92	1,226	134,940	商業サービス・用品
CITIGROUP	2,789	2,940	19,906	2,189,741	銀行
CITIZENS FINANCIAL GROUP	504	550	1,867	205,397	銀行
CITRIX SYSTEMS INC	149	158	1,205	132,609	ソフトウェア
CLOROX CO	124	130	1,780	195,824	家庭用品
COACH INC	279	305	1,241	136,615	繊維・アパレル・贅沢品
COCA COLA CO	3,936	4,328	19,995	2,199,489	飲料
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	587	648	4,669	513,643	情報技術サービス
COLGATE PALMOLIVE CO.	811	893	6,423	706,568	家庭用品
COMCAST CORP-CL A	2,306	5,022	20,710	2,278,180	メディア
COMERICA INC	173	191	1,368	150,557	銀行
COMMSCOPE HOLDING CO INC	—	193	634	69,740	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
COMPUTER SCIENCES CORP	138	—	—	—	情報技術サービス
CONAGRA BRANDS INC	400	472	1,658	182,446	食品
CONCHO RESOURCES INC	134	150	1,658	182,407	石油・ガス・消耗燃料
CONOCOPHILLIPS	1,186	1,317	5,753	632,937	石油・ガス・消耗燃料
CONSOLIDATED EDISON INC	293	328	2,736	301,051	総合公益事業
CONSTELLATION BRANDS INC-A	171	184	3,669	403,653	飲料
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	94	94	307	33,791	石油・ガス・消耗燃料
THE COOPER COMPANIES, INC.	47	50	1,235	135,858	ヘルスケア機器・用品
CORNING INC	1,010	995	2,830	311,385	電子装置・機器・部品
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	419	468	7,476	822,444	食品・生活必需品小売り
COSTAR GROUP INC	32	32	909	100,033	インターネットソフトウェア・サービス
COTY INC-CL A	476	476	936	103,067	パーソナル用品
CROWN HOLDINGS INC	131	145	849	93,498	容器・包装
CUMMINS INC	156	172	2,655	292,086	機械
DR HORTON INC	336	361	1,329	146,251	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	170	193	2,120	233,275	総合公益事業
DXC TECHNOLOGY CO	—	306	2,625	288,769	情報技術サービス
DANAHER CORP	594	665	5,423	596,611	ヘルスケア機器・用品
DARDEN RESTAURANTS INC	118	127	1,071	117,892	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA INC	157	157	900	99,026	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY	258	289	3,659	402,556	機械
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	217	217	1,458	160,461	ソフトウェア
DELTA AIR LINES INC	177	201	1,007	110,837	旅客航空輸送業
DENTSPLY SIRONA INC	220	234	1,251	137,657	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	458	539	1,652	181,783	石油・ガス・消耗燃料
DEXCOM INC	83	83	606	66,703	ヘルスケア機器・用品
DIAMONDBACK ENERGY INC	85	94	827	91,054	石油・ガス・消耗燃料
DICK S SPORTING GOODS INC	82	82	227	24,985	専門小売り
DISNEY (WALT) CO	1,466	1,678	17,149	1,886,407	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	385	414	2,554	281,027	消費者金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	143	143	323	35,549	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	212	212	452	49,788	メディア
DISH NETWORK CORP-A	218	231	1,350	148,546	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	271	282	2,100	231,099	複合小売り
DOLLAR TREE INC	227	255	1,898	208,804	複合小売り
DOMINION ENERGY INC	601	670	5,242	576,628	総合公益事業
DOMINOS PIZZA INC	46	52	989	108,792	ホテル・レストラン・レジャー
DOVER CORP	153	169	1,442	158,684	機械
DOW CHEM CO	1,079	1,291	8,254	908,011	化学
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	178	187	1,728	190,149	飲料
DU PONT E I DE NEMOURS	837	920	7,544	829,941	化学
DUKE ENERGY CORP	659	745	6,430	707,310	電力
DUN & BRADSTREET CORP	36	—	—	—	専門サービス
EOG RESOURCES INC	552	615	5,226	574,889	石油・ガス・消耗燃料
EQT CORP	165	179	1,087	119,636	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	256	280	1,131	124,493	資本市場
EAST WEST BANCORP INC	—	143	805	88,575	銀行
EASTMAN CHEMICAL CO.	141	160	1,364	150,075	化学

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
EATON VANCE CORP	117	117	557	61,364	資本市場
EBAY INC	1,023	1,104	3,903	429,411	インターネットソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	250	281	3,720	409,279	化学
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	58	—	—	—	パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	317	350	2,791	307,114	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	202	228	2,634	289,849	ヘルスケア機器・用品
ELECTRONIC ARTS	290	330	3,935	432,877	ソフトウェア
EMERSON ELEC	615	689	4,087	449,586	電気設備
ENTERGY CORP	171	182	1,421	156,396	電力
ENVISION HEALTHCARE CORP	116	116	591	65,101	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EQUIFAX INC	117	129	1,844	202,917	専門サービス
EVERSOURCE ENERGY	307	342	2,147	236,253	電力
EXELON CORPORATION	881	991	3,778	415,655	電力
EXPEDIA INC	117	133	1,978	217,665	インターネット販売・通信販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	177	197	1,097	120,745	航空貨物・物流サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	602	647	4,011	441,254	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EXXON MOBIL CORP	3,984	4,396	34,055	3,746,139	石油・ガス・消耗燃料
FLIR SYSTEMS INC	127	127	486	53,533	電子装置・機器・部品
FMC CORP	132	132	1,118	123,042	化学
FACEBOOK INC-A	2,231	2,497	42,449	4,669,390	インターネットソフトウェア・サービス
FASTENAL CO	276	293	1,262	138,879	商社・流通業
FEDEX CORPORATION	241	269	5,657	622,370	航空貨物・物流サービス
F5 NETWORKS INC	62	62	735	80,905	通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	303	352	3,219	354,094	情報技術サービス
FNF GROUP	244	265	1,283	141,144	保険
FIFTH THIRD BANCORP	737	808	2,167	238,465	銀行
FIRST DATA CORP- CLASS A	302	370	667	73,382	情報技術サービス
FIRST REPUBLIC BANK/CA	145	155	1,523	167,550	銀行
FISERV INC	214	230	2,871	315,819	情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	418	452	1,477	162,534	電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	88	94	1,348	148,285	情報技術サービス
FLUOR CORP	139	139	534	58,774	建設・土木
FLOWSERVE CORP	122	122	480	52,901	機械
FOOT LOCKER INC	134	134	650	71,592	専門小売り
FORD MOTOR COMPANY	3,550	3,960	4,276	470,448	自動車
FORTINET INC	139	139	516	56,863	ソフトウェア
FORTIVE CORP	295	335	2,216	243,762	機械
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	153	153	981	107,981	建設関連製品
FRANKLIN RESOURCES INC	359	368	1,576	173,375	資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC	1,241	1,400	2,067	227,458	金属・鉱業
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	1,140	—	—	—	各種電気通信サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	166	180	1,060	116,641	保険
GAP INC	229	229	516	56,853	専門小売り
GARTNER INC	81	91	1,083	119,199	情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS	248	274	5,504	605,521	航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	8,608	9,255	23,230	2,555,305	コングロマリット
GENERAL MILLS	580	621	3,572	392,987	食品
GENERAL MOTORS CO	1,337	1,438	5,140	565,493	自動車

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
GENUINE PARTS CO	144	161	1,324	145,664	販売
GILEAD SCIENCES INC	1,266	1,389	10,188	1,120,714	バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	146	156	1,475	162,333	情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	349	381	8,604	946,524	資本市場
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	248	248	751	82,631	自動車部品
WR GRACE & CO	67	67	454	50,020	化学
GRAINGER(W.W.) INC	55	55	914	100,599	商社・流通業
HCA HEALTHCARE INC	295	318	2,511	276,307	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	608	66,895	商社・流通業
HP INC	1,670	1,810	3,433	377,692	コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	824	927	3,644	400,946	エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC	377	377	916	100,813	繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC	168	194	922	101,471	自動車
HARMAN INTERNATIONAL	70	－	－	－	家庭用耐久財
HARRIS CORP	119	127	1,527	167,989	通信機器
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	375	377	2,130	234,346	保険
HASBRO INC	107	115	1,138	125,184	レジャー用品
HELMERICH & PAYNE	106	106	463	51,035	エネルギー設備・サービス
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	－	77	782	86,046	情報技術サービス
HERSHEY CO/THE	137	156	1,654	181,964	食品
HESS CORP	274	293	1,151	126,631	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,588	1,780	3,132	344,608	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	189	203	1,267	139,428	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	166	166	461	50,799	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	247	276	1,054	116,005	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT	1,186	1,293	19,685	2,165,451	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	693	769	10,618	1,168,018	コングロマリット
HORMEL FOODS CORP	273	294	1,009	111,087	食品
HUMANA INC	142	159	3,947	434,265	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	846	93,116	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,070	1,180	1,534	168,740	銀行
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	46	46	969	106,674	航空宇宙・防衛
IDEX CORP	－	75	872	95,939	機械
IDEXX LABORATORIES INC	86	96	1,490	163,901	ヘルスケア機器・用品
ILLINOIS TOOL WORKS INC	305	333	4,662	512,929	機械
ILLUMINA INC	142	156	3,044	334,869	ライフサイエンス・ツール/サービス
INCYTE CORP	160	183	2,275	250,296	バイオテクノロジー
INGREDION INC	68	75	935	102,877	食品
INTEL CORP	4,533	5,018	17,969	1,976,640	半導体・半導体製造装置
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	569	636	4,201	462,155	資本市場
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	871	959	13,665	1,503,232	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	76	87	1,205	132,582	化学
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	376	421	2,290	251,926	容器・包装
INTERPUBRIC GROUP	392	392	825	90,810	メディア
INTUIT INC	235	260	3,585	394,451	ソフトウェア
INTUITIVE SURGICAL INC	37	41	4,103	451,432	ヘルスケア機器・用品
JPMORGAN CHASE & CO	3,470	3,794	34,938	3,843,284	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	123	123	627	69,070	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
JOHNSON & JOHNSON	2,628	2,877	38,600	4,246,077	医薬品
JONES LANG LASALLE INC	47	47	574	63,141	不動産管理・開発
JUNIPER NETWORKS INC	335	378	1,048	115,384	通信機器
KLA TENCOR CORP	150	159	1,460	160,698	半導体・半導体製造装置
KANSAS CITY SOUTHERN	106	106	1,139	125,333	陸運・鉄道
KELLOGG CO	255	284	1,989	218,898	食品
KEYCORP	1,028	1,160	2,085	229,424	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	344	380	4,648	511,339	家庭用品
KINDER MORGAN INC	1,813	2,146	4,015	441,668	石油・ガス・消耗燃料
KOHLS CORP	172	172	651	71,687	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE	583	649	5,613	617,523	食品
KROGER CO	860	1,009	2,329	256,275	食品・生活必需品小売り
L BRANDS, INC	240	240	949	104,412	専門小売り
LKQ CORP	300	337	1,162	127,928	販売
L3 TECHNOLOGIES INC	72	84	1,524	167,659	航空宇宙・防衛
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	98	111	1,736	191,013	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH	154	175	2,856	314,198	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	421	426	2,621	288,376	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	214	239	2,415	265,713	パーソナル用品
LEAR CORP	69	69	1,003	110,404	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	134	134	639	70,398	家庭用耐久財
LEIDOS HOLDINGS INC	—	141	806	88,732	情報技術サービス
LENNAR CORP-A	180	201	1,087	119,592	家庭用耐久財
LENNOX INTERNATIONAL INC	—	38	641	70,559	建設関連製品
LEUCADIA NATIONAL CORP	322	322	794	87,345	各種金融サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	301	331	1,826	200,910	各種電気通信サービス
LIBERTY BROADBAND CORP-C	101	110	1,127	123,988	メディア
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	423	479	1,044	114,864	インターネット販売・通信販売
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	98	98	427	46,978	メディア
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	193	197	852	93,722	メディア
ELI LILLY & CO.	952	1,056	8,520	937,295	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	223	244	1,735	190,939	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP	227	—	—	—	半導体・半導体製造装置
LOCKHEED MARTIN	252	278	8,501	935,136	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	277	311	1,502	165,268	保険
LOWES COS INC	844	926	6,977	767,515	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	106	106	633	69,680	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP	137	149	2,363	259,945	銀行
MGM RESORTS INTERNATIONAL	449	498	1,558	171,461	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	85	93	1,043	114,770	資本市場
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	76	76	546	60,166	運送インフラ
MACYS INC	304	304	612	67,348	複合小売り
MANPOWERGROUP INC	70	71	770	84,785	専門サービス
MARATHON OIL CORP	812	930	1,040	114,473	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	510	566	2,889	317,899	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	13	14	1,515	166,756	保険
MARSH & MCLENNAN COS	495	550	4,298	472,807	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	322	349	3,500	385,051	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	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	59	64	1,318	145,074	建設資材
MASCO CORP	329	329	1,233	135,640	建設関連製品
MASTERCARD INC	930	1,012	13,395	1,473,542	情報技術サービス
MATTEL INC	334	334	581	64,001	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	270	288	1,315	144,745	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	113	113	1,107	121,776	食品
MCDONALD'S CORP	818	882	14,014	1,541,647	ホテル・レストラン・レジャー
MCKESSON CORP	218	227	3,351	368,657	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	390	42,932	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	519	57,196	ホテル・レストラン・レジャー
MERCADOLIBRE INC	39	43	1,040	114,418	インターネットソフトウェア・サービス
MERCK & CO INC	2,655	2,926	18,346	2,018,062	医薬品
METLIFE INC	894	986	4,727	520,065	保険
METTLER-TOLEDO INTL	26	26	1,532	168,585	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP	7,113	7,781	57,307	6,303,777	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	206	234	1,969	216,627	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	1,009	1,123	3,446	379,113	半導体・半導体製造装置
MIDDLEBY CORP	57	57	682	75,020	機械
MOHAWK INDUSTRIES	59	68	1,719	189,132	家庭用耐久財
MOLSON COORS BREWING CO-B	179	204	1,863	204,966	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,490	1,625	7,180	789,896	食品
MONSANTO CO	418	468	5,508	605,919	化学
MONSTER BEVERAGE CORP	384	430	2,335	256,886	飲料
MOODYS CORP	168	185	2,443	268,803	資本市場
MORGAN STANLEY	1,373	1,490	6,855	754,103	資本市場
MOSAIC CO/THE	312	348	715	78,741	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	145	179	1,578	173,646	通信機器
MURPHY OIL CORP	167	167	411	45,263	石油・ガス・消耗燃料
NVR INC	—	3	966	106,266	家庭用耐久財
NASDAQ INC	111	127	979	107,736	資本市場
NATIONAL OILWELL VARCO INC	365	412	1,233	135,688	エネルギー設備・サービス
NAVIENT CORP	299	299	418	46,046	消費者金融
NETAPP INC	267	300	1,272	139,953	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	410	458	7,785	856,359	インターネット販売・通信販売
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	1,140	1,290	976	107,418	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	241	220	1,429	157,251	コングロマリット
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	—	243	1,041	114,591	コングロマリット
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	471	471	579	63,778	貯蓄・抵当・不動産金融
NEWELL BRANDS INC	422	518	2,628	289,116	家庭用耐久財
NEWFIELD EXPLORATION CO	188	188	473	52,092	石油・ガス・消耗燃料
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	510	573	2,070	227,727	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	374	374	495	54,510	メディア
NEXTERA ENERGY INC	442	498	7,469	821,590	電力
NIKE INC-B	1,292	1,410	8,254	907,955	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	303	337	908	99,940	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC	407	473	1,123	123,623	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	127	127	566	62,278	複合小売り

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
NORFOLK SOUTHERN CORP	280	311	3,745	411,991	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	207	234	2,093	230,321	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	162	177	4,778	525,670	航空宇宙・防衛
NUANCE COMMUNICATIONS INC	250	308	499	54,953	ソフトウェア
NUCOR CORP	306	344	1,951	214,666	金属・鉱業
NVIDIA CORP	512	573	9,463	1,040,940	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	196	196	698	76,861	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	92	98	1,991	219,077	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	731	815	4,865	535,210	石油・ガス・消耗燃料
OMNICOM GROUP	230	253	1,990	218,910	メディア
ONEOK INC	198	409	2,069	227,694	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	2,967	3,266	16,085	1,769,355	ソフトウェア
PG&E CORP	481	543	3,777	415,481	電力
PNC FINANCIAL	470	516	6,713	738,447	銀行
PPG INDUSTRIES	257	276	2,863	314,954	化学
PPL CORPORATION	645	730	2,850	313,571	電力
PVH CORP	80	80	993	109,260	繊維・アパレル・贅沢品
PACCAR	341	377	2,429	267,191	機械
PACKAGING CORP OP AMERICA	88	97	1,080	118,906	容器・包装
PALO ALTO NETWORKS INC	85	100	1,329	146,223	通信機器
PARKER HANNIFIN CORP	127	143	2,270	249,776	機械
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	174	217	532	58,624	石油・ガス・消耗燃料
PATTERSON COS INC	87	87	324	35,686	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
PAYCHEX INC	315	329	1,850	203,532	情報技術サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	1,038	1,221	7,361	809,754	情報技術サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	305	354	603	66,392	銀行
PEPSICO INC	1,381	1,515	18,043	1,984,801	飲料
PFIZER INC	5,824	6,315	21,066	2,317,352	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,489	1,646	19,378	2,131,619	タバコ
PHILLIPS 66	450	470	3,902	429,265	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	111	111	994	109,426	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	161	183	2,408	264,971	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	90	140	284	31,339	石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INDUSTRIES INC	62	62	553	60,923	レジャー用品
PRAXAIR INC	272	305	4,074	448,194	化学
T ROWE PRICE GROUP INC	239	262	2,204	242,491	資本市場
PRICELINE GROUP INC/THE	47	52	9,697	1,066,779	インターネット販売・通信販売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	279	293	1,909	210,010	保険
PROCTER & GAMBLE CO	2,455	2,712	25,069	2,757,670	家庭用品
PROGRESSIVE CO	565	623	3,034	333,809	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	418	459	4,829	531,205	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE	487	544	2,537	279,093	総合公益事業
PULTEGROUP INC	289	289	749	82,399	家庭用耐久財
QORVO INC	127	127	919	101,170	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,413	1,571	8,375	921,250	半導体・半導体製造装置
QUEST DIAGNOSTICS INC	133	141	1,505	165,569	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	1,314	144,625	ライフサイエンス・ツール/サービス
RALPH LAUREN CORPORATION	58	58	499	54,963	繊維・アパレル・贅沢品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
RANGE RESOURCES CORP	190	245	429	47,243	石油・ガス・消耗燃料
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	121	133	1,062	116,922	資本市場
RAYTHEON COMPANY	282	312	5,556	611,170	航空宇宙・防衛
RED HAT INC	178	193	1,963	216,015	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS	73	83	3,912	430,353	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1,210	1,300	1,864	205,062	銀行
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	63	63	884	97,338	保険
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	229	243	1,570	172,809	商業サービス・用品
RESMED INC	141	141	1,025	112,757	ヘルスケア機器・用品
REYNOLDS AMERICAN INC	819	—	—	—	タバコ
RITE AID CORP	990	—	—	—	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	133	133	583	64,137	専門サービス
ROCKWELL AUTOMATION INC	124	138	2,263	248,997	電気設備
ROCKWELL COLLINS INC	128	175	2,195	241,491	航空宇宙・防衛
ROLLINS INC	—	97	428	47,150	商業サービス・用品
ROPER TECHNOLOGIES INC	99	109	2,550	280,512	コングロマリット
ROSS STORES INC	390	424	2,305	253,581	専門小売り
S&P GLOBAL INC	255	276	4,202	462,291	資本市場
SEI INVESTMENTS COMPANY	127	150	849	93,472	資本市場
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	—	171	645	70,988	ソフトウェア
SVB FINANCIAL GROUP	—	51	901	99,219	銀行
SABRE CORP	200	200	355	39,072	情報技術サービス
SALESFORCE.COM INC	615	705	6,502	715,321	ソフトウェア
SCANA CORP	129	141	874	96,239	総合公益事業
HENRY SCHEIN INC	80	80	1,374	151,184	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,334	1,482	9,441	1,038,600	エネルギー設備・サービス
SCHWAB(CHARLES)CORP	1,139	1,281	5,218	574,067	資本市場
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	78	91	781	85,935	メディア
SEALED AIR CORP	192	192	873	96,032	容器・包装
SEATTLE GENETICS INC	97	97	457	50,330	バイオテクノロジー
SEMPRA ENERGY	229	255	2,982	328,072	総合公益事業
SERVICENOW INC	157	179	1,960	215,605	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS	75	90	3,000	330,095	化学
SIGNATURE BANK	50	57	743	81,779	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,630	1,630	911	100,228	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	181	199	2,108	231,880	半導体・半導体製造装置
SMITH (A.O.) CORP	144	144	789	86,834	建設関連製品
JM SMUCKER CO/THE-NEW	113	126	1,552	170,727	食品
SNAP-ON INC	54	59	900	99,003	機械
SOUTHERN CO.	948	1,057	5,178	569,606	電力
SOUTHWEST AIRLINES	153	153	846	93,086	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	284	31,331	家庭用品
SPLUNK INC	128	150	911	100,254	ソフトウェア
SPRINT CORP	750	750	622	68,475	無線通信サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	144	164	2,306	253,750	機械
STAPLES INC	620	620	633	69,700	専門小売り

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
STARBUCKS CORP	1,406	1,550	8,292	912,175	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	372	408	3,796	417,563	資本市場
STEEL DYNAMICS	－	240	866	95,356	金属・鉱業
STERICYCLE INC	79	89	643	70,752	商業サービス・用品
STRYKER CORP	322	358	5,277	580,500	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.	483	527	3,028	333,095	銀行
SYMANTEC CORP	608	668	1,890	207,948	ソフトウェア
SYNOPSYS INC	149	149	1,178	129,628	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	805	871	2,688	295,765	消費者金融
SYSCO CORP	514	551	2,820	310,262	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	253	272	1,179	129,763	資本市場
TJX COS INC	628	696	4,982	548,093	専門小売り
T-MOBILE US INC	283	312	2,005	220,608	無線通信サービス
TARGET CORP	522	572	3,220	354,302	複合小売り
TARGA RESOURCES CORP	164	222	951	104,688	石油・ガス・消耗燃料
TEGNA INC	206	－	－	－	メディア
TELEFLEX INC	43	49	1,056	116,244	ヘルスケア機器・用品
TESARO INC	－	37	418	45,986	バイオテクノロジー
TESORO CORP	113	－	－	－	石油・ガス・消耗燃料
TESLA INC	124	137	4,986	548,502	自動車
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	871	967	1,691	186,041	医薬品
TEXAS INSTRUMENTS INC	961	1,063	8,765	964,204	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	264	294	1,444	158,886	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	377	420	7,368	810,532	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	579	633	13,165	1,448,204	コングロマリット
TIFFANY & CO	119	128	1,144	125,847	専門小売り
TIME WARNER INC	745	824	8,398	923,802	メディア
TOLL BROTHERS INC	164	163	647	71,182	家庭用耐久財
TORCHMARK CORP	112	112	882	97,020	保険
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	163	163	1,066	117,280	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	130	130	698	76,833	専門小売り
TRANSDIGM GROUP INC	52	57	1,606	176,710	航空宇宙・防衛
TRAVELERS COS INC/THE	275	299	3,871	425,826	保険
TRIMBLE INC	232	256	954	104,980	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	123	123	494	54,350	インターネット販売・通信販売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,015	1,127	3,154	346,992	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	428	478	1,317	144,910	メディア
TWITTER INC	539	634	1,024	112,699	インターネットソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	289	310	2,035	223,866	食品
UGI CORP	163	180	882	97,039	ガス
US BANCORP	1,641	1,801	9,518	1,047,011	銀行
ULTA BEAUTY INC	56	59	1,455	160,128	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	184	184	334	36,796	繊維・アパレル・贅沢品
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	187	187	311	34,310	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP	799	866	9,166	1,008,327	陸運・鉄道
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	76	76	508	55,945	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	663	733	8,411	925,309	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC	86	85	951	104,691	商社・流通業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
UNITED TECHNOLOGIES	762	814	9,605	1,056,572	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP	43	43	573	63,035	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC	914	1,021	19,793	2,177,296	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	86	98	1,065	117,157	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP	225	250	1,237	136,125	保険
VCA INC	—	80	741	81,514	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
V F CORP	319	378	2,415	265,696	繊維・アパレル・贅沢品
VAIL RESORTS INC	—	39	875	96,263	ホテル・レストラン・レジャー
VALERO ENERGY CORP	440	483	3,187	350,604	石油・ガス・消耗燃料
VALSPAR CORP	73	—	—	—	化学
VANTIV INC - CL A	148	161	1,163	127,990	情報技術サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	87	96	957	105,293	ヘルスケア機器・用品
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	—	105	669	73,654	ヘルスケア・テクノロジー
VERISIGN INC	96	101	1,002	110,244	インターネットソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	3,915	4,325	20,937	2,303,105	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	159	160	1,306	143,704	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	238	266	4,026	442,908	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B	341	378	1,127	123,991	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	1,811	1,972	20,374	2,241,217	情報技術サービス
VMWARE INC - CLASS A	74	74	715	78,681	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	187	187	718	79,050	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	128	135	1,567	172,393	建設資材
WABCO HOLDINGS INC	52	52	716	78,855	機械
WEC ENERGY GROUP INC	306	340	2,195	241,491	総合公益事業
WABTEC CORP	90	90	649	71,448	機械
WAL-MART STORES INC	1,484	1,632	13,215	1,453,752	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	882	976	7,930	872,407	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	165	284	1,821	200,342	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC	422	471	3,579	393,756	商業サービス・用品
WATERS CORP	80	87	1,586	174,556	ライフサイエンス・ツール/サービス
WELLS FARGO CO	4,604	5,054	26,629	2,929,247	銀行
WESTAR ENERGY INC	134	158	814	89,646	電力
WESTERN DIGITAL CORP	278	309	2,652	291,804	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	458	528	1,023	112,559	情報技術サービス
WESTROCK CO	243	272	1,558	171,441	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	71	76	1,324	145,747	家庭用耐久財
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	175	—	—	—	食品
WHOLE FOODS MARKET INC	316	346	1,444	158,900	食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS	785	886	2,624	288,676	石油・ガス・消耗燃料
WORKDAY INC-CLASS A	120	128	1,359	149,529	ソフトウェア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	109	109	1,080	118,820	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN RESORTS LTD	77	84	1,146	126,079	ホテル・レストラン・レジャー
XCEL ENERGY INC	494	545	2,667	293,395	電力
XILINX INC	250	269	1,686	185,558	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	680	74,867	コンピュータ・周辺機器
XYLEM INC	170	186	1,114	122,616	機械
YAHOO! INC	863	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
YUM BRANDS INC	361	361	2,758	303,463	ホテル・レストラン・レジャー
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	155	192	648	71,385	各種電気通信サービス
ZILLOW GROUP INC - C	109	109	441	48,571	インターネットソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	190	215	2,431	267,434	ヘルスケア機器・用品
ZIONS BANCORPORATION	－	200	902	99,264	銀行
ZOETIS INC	458	527	3,241	356,515	医薬品
ALKERMES PLC	152	152	783	86,208	バイオテクノロジー
ALLEGION PLC	－	94	745	81,985	建設関連製品
ALLERGAN PLC	379	356	8,127	894,062	医薬品
AON PLC	257	281	3,914	430,638	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	121	134	1,295	142,476	保険
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	－	114	602	66,261	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	85	85	543	59,746	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	212	212	623	68,560	化学
ACCENTURE PLC-CL A	596	662	8,607	946,878	情報技術サービス
BUNGE LIMITED	138	138	1,064	117,128	食品
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	259	289	2,719	299,143	自動車部品
EATON CORP PLC	434	481	3,495	384,496	電気設備
ENDO INTERNATIONAL PLC	205	－	－	－	医薬品
EVEREST RE GROUP LTD	40	40	1,070	117,734	保険
IHS MARKIT LTD	353	399	1,874	206,239	専門サービス
INGERSOLL-RAND PLC	251	279	2,420	266,205	機械
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	850	850	332	36,558	エネルギー設備・サービス
INVESCO LTD	396	438	1,474	162,173	資本市場
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	56	61	899	98,905	医薬品
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	892	1,004	3,770	414,702	建設関連製品
LIBERTY GLOBAL PLC-A	240	240	828	91,106	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	595	646	2,153	236,914	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC LILAC - C	112	－	－	－	メディア
MALLINCKRODT PLC	111	97	348	38,347	医薬品
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	410	410	653	71,934	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,336	1,459	12,343	1,357,745	ヘルスケア機器・用品
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	161	161	708	77,977	繊維・アパレル・贅沢品
NIELSEN HOLDINGS PLC	342	362	1,465	161,151	専門サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	161	161	932	102,540	ホテル・レストラン・レジャー
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	42	42	621	68,348	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	286	324	1,052	115,758	コンピュータ・周辺機器
PENTAIR PLC	167	189	1,178	129,688	機械
SIGNET JEWELERS LTD	71	68	366	40,309	専門小売り
TECHNIPFMC PLC	433	483	1,250	137,553	エネルギー設備・サービス
WILLIS TOWERS WATSON PLC	126	140	2,100	231,015	保険
PERRIGO CO PLC	138	142	1,124	123,679	医薬品
XL GROUP LTD	264	264	1,177	129,576	保険
CHUBB LTD	445	496	7,341	807,597	保険
GARMIN LTD	114	133	690	75,900	家庭用耐久財
TE CONNECTIVITY LTD	343	381	3,027	333,016	電子装置・機器・部品
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	121	142	1,546	170,086	ソフトウェア
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	15	15	151	16,707	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		150	150	734	80,817	商社・流通業
CORE LABORATORIES N.V.		43	43	384	42,314	エネルギー設備・サービス
MOBILEYE NV		170	203	1,289	141,862	ソフトウェア
LYONDELLBASELL INDU-CL A		337	367	3,217	353,883	化学
MYLAN NV		431	492	1,499	164,903	医薬品
NXP SEMICONDUCTORS NV		280	280	3,158	347,393	半導体・半導体製造装置
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING		169	169	752	82,799	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD		169	185	2,242	246,703	ホテル・レストラン・レジャー
BROADCOM LTD		379	426	10,800	1,188,083	半導体・半導体製造装置
FLEX LTD		550	560	900	99,052	電子装置・機器・部品
小計	株数・金額	298,920	325,405	2,288,122	251,693,420	
	銘柄数<比率>	600	606	—	<61.8%>	
(カナダ)				千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD		329	400	631	54,971	石油・ガス・消耗燃料
AGNICO EAGLE MINES LTD		216	233	1,374	119,661	金属・鉱業
AGRIUM INC		124	141	1,767	153,901	化学
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B		404	453	2,760	240,419	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD		166	166	459	39,987	石油・ガス・消耗燃料
ATCO LTD CL1		68	68	316	27,561	総合公益事業
BCE INC		138	154	914	79,679	各種電気通信サービス
BANK OF MONTREAL		617	691	6,371	554,852	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX		1,152	1,286	9,957	867,198	銀行
BARRICK GOLD		1,120	1,260	2,688	234,171	金属・鉱業
BLACKBERRY LTD		509	509	567	49,426	コンピュータ・周辺機器
BOMBARDIER B SHEARS		1,890	1,890	495	43,125	航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A		833	950	4,692	408,630	資本市場
CAE INC		260	260	540	47,052	航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B		26	155	899	78,374	容器・包装
CI FINANCIAL CORP		242	282	771	67,169	資本市場
CAMECO CORP		386	386	473	41,214	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE		382	460	4,924	428,857	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO		741	810	8,211	715,163	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD		1,052	1,188	4,629	403,194	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD		136	157	3,052	265,832	陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A		64	70	1,068	93,023	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A		124	124	483	42,084	総合公益事業
CENOVUS ENERGY INC		785	1,030	977	85,127	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE INC		17	20	1,450	126,292	ソフトウェア
CRESCENT POINT ENERGY CORP		537	537	465	40,500	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC		107	120	1,476	128,544	複合小売り
ELDORADO GOLD CORPORATION		708	—	—	—	金属・鉱業
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP		360	360	313	27,276	各種金融サービス
EMERA INC		49	49	232	20,214	電力
EMPIRE CO LTD A		162	162	344	30,008	食品・生活必需品小売り
ENCANA CORP		950	1,070	1,240	108,002	石油・ガス・消耗燃料
ENBRIDGE INC		893	1,734	8,572	746,613	石油・ガス・消耗燃料
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD		21	30	1,822	158,710	保険
FINNING INTERNATIONAL INC		152	196	536	46,685	商社・流通業

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円	
FIRST CAPITAL REALTY INC	113	180	356	31,054	不動産管理・開発
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	650	720	965	84,087	金属・鉱業
FORTIS INC	384	410	1,886	164,323	電力
FRANCO-NEVADA CORP	169	194	1,935	168,599	金属・鉱業
GILDAN ACTIVEWEAR INC	208	241	931	81,121	繊維・アパレル・贅沢品
GOLDCORP INC	829	930	1,531	133,396	金属・鉱業
GREAT-WEST LIFECO INC	300	300	1,059	92,254	保険
CGI GROUP INC - CLASS A	214	233	1,477	128,711	情報技術サービス
HUSKY ENERGY INC	357	357	518	45,138	石油・ガス・消耗燃料
HYDRO ONE LTD	173	294	666	58,070	電力
IGM FINANCIAL INC	103	103	426	37,154	資本市場
IMPERIAL OIL	285	308	1,109	96,619	石油・ガス・消耗燃料
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	99	121	661	57,568	保険
INTACT FINANCIAL CORP	126	136	1,340	116,784	保険
INTER PIPELINE LTD	331	409	939	81,854	石油・ガス・消耗燃料
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	94	94	205	17,879	食品・生活必需品小売り
KEYERA CORP	178	209	745	64,889	石油・ガス・消耗燃料
KINROSS GOLD CORP	1,186	1,400	774	67,425	金属・鉱業
LINAMAR CORP	48	48	325	28,325	自動車部品
LOBLAW COMPANIES	210	240	1,638	142,695	食品・生活必需品小売り
MAGNA INTERNATIONAL INC	377	393	2,338	203,681	自動車部品
MANULIFE FINANCIAL CORP	1,884	2,110	5,372	467,852	保険
METHANEX CORP	82	103	574	50,054	化学
METRO INC	232	232	988	86,092	食品・生活必需品小売り
NATIONAL BANK OF CANADA	334	369	2,054	178,902	銀行
ONEX CORPORATION	80	80	775	67,540	各種金融サービス
OPEN TEXT CORP	242	262	1,073	93,529	ソフトウェア
PEMBINA PIPELINE CORP	374	433	1,737	151,330	石油・ガス・消耗燃料
PEYTO EXPLORATION & DEV CORP	172	172	345	30,078	石油・ガス・消耗燃料
POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC	812	860	1,919	167,170	化学
POWER CORPORATION OF CANADA	348	368	1,145	99,800	保険
POWER FINANCIAL CORP	243	278	949	82,656	保険
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	207	207	584	50,865	石油・ガス・消耗燃料
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	213	242	1,844	160,597	ホテル・レストラン・レジャー
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	347	391	2,537	220,964	無線通信サービス
ROYAL BANK OF CANADA	1,424	1,568	14,576	1,269,434	銀行
SNC-LAVALIN GROUP INC	145	168	882	76,828	建設・土木
SAPUTO INC	239	211	911	79,365	食品
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	226	226	394	34,345	石油・ガス・消耗燃料
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	404	460	1,281	111,570	メディア
SHOPIFY INC - CLASS A	—	79	943	82,169	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	659	3,248	282,886	保険
SUNCOR ENERGY INC	1,593	1,778	7,101	618,455	石油・ガス・消耗燃料
TECK RESOURCES LTD	549	586	1,743	151,879	金属・鉱業
TELUS CORP	193	193	866	75,486	各種電気通信サービス
THOMSON REUTERS CORP	324	316	1,849	161,049	資本市場
TORONTO DOMINION BANK	1,778	1,977	12,642	1,101,071	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	
TOURMALINE OIL CORP		216	216	529	46,088	石油・ガス・消耗燃料
TRANSCANADA CORP		817	925	5,758	501,475	石油・ガス・消耗燃料
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD		980	980	391	34,053	金属・鉱業
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL		313	313	559	48,766	医薬品
VERESEN INC		290	360	627	54,678	石油・ガス・消耗燃料
VERMILION ENERGY INC		120	120	461	40,183	石油・ガス・消耗燃料
WEST FRASER TIMBER		68	68	429	37,415	紙製品・林産品
WESTON(GEORGE)LTD		48	48	520	45,331	食品・生活必需品小売り
WHEATON PRECIOUS METALS CORP		—	454	1,085	94,537	金属・鉱業
YAMANA GOLD INC		970	970	334	29,144	金属・鉱業
小計	株数・金額	39,431	43,504	176,355	15,358,824	
	銘柄数<比率>	91	91	—	<3.8%>	
(イギリス)				千英ポンド		
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC		940	—	—	—	資本市場
ANTOFAGASTA PLC		410	410	388	55,132	金属・鉱業
ASHTEAD GROUP PLC		476	516	832	118,069	商社・流通業
BHP BILLITON PLC		2,015	2,260	3,091	438,307	金属・鉱業
BARRATT DEVELOPMENTS PLC		980	980	599	84,958	家庭用耐久財
SKY PLC		990	1,050	1,004	142,383	メディア
AVIVA PLC		3,950	4,350	2,301	326,234	保険
DIAGEO PLC		2,412	2,678	6,946	984,838	飲料
SCHRODERS PLC		133	133	458	64,938	資本市場
DCC PLC		86	98	682	96,767	コングロマリット
BAE SYSTEMS PLC		3,060	3,410	2,037	288,852	航空宇宙・防衛
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC		1,788	2,442	12,036	1,706,431	タバコ
STANDARD CHARTERED PLC		3,200	3,510	2,724	386,197	銀行
IMPERIAL BRANDS PLC		916	1,024	3,303	468,399	タバコ
HSBC HOLDINGS PLC		19,090	21,070	15,760	2,234,346	銀行
LEGAL & GENERAL		5,770	6,410	1,750	248,178	保険
MEGGITT PLC		780	780	393	55,732	航空宇宙・防衛
MORRISON SUPERMARKETS		2,130	2,460	612	86,874	食品・生活必需品小売り
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC		340	362	1,149	162,943	食品
PEARSON		780	910	567	80,502	メディア
PERSIMMON PLC		295	320	811	115,049	家庭用耐久財
PRUDENTIAL PLC		2,467	2,749	5,025	712,418	保険
RIO TINTO PLC-REG		1,183	1,319	4,558	646,253	金属・鉱業
ST JAMES S PLACE PLC		490	540	648	91,866	保険
TRAVIS PERKINS PLC		247	247	373	52,945	商社・流通業
SSE PLC		956	1,091	1,560	221,179	電力
BP PLC		18,020	20,780	9,256	1,312,287	石油・ガス・消耗燃料
LLOYDS BANKING GROUP PLC		61,500	76,100	4,973	705,041	銀行
TATE & LYLE ORD.		480	480	329	46,716	食品
TAYLOR WIMPEY PLC		3,190	3,190	613	87,012	家庭用耐久財
TESCO PLC		7,870	8,810	1,586	224,943	食品・生活必需品小売り
SMITH & NEPHEW PLC		840	891	1,226	173,938	ヘルスケア機器・用品
GLAXOSMITHKLINE PLC		4,674	5,219	7,849	1,112,806	医薬品
WEIR GROUP PLC		220	220	390	55,298	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC		259	259	219	31,118	商業サービス・用品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
ASTRAZENECA PLC	1,211	1,346	6,013	852,499	医薬品
GKN PLC	1,690	1,690	541	76,836	自動車部品
BT GROUP PLC	8,160	9,060	2,667	378,138	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC	187	205	1,102	156,358	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC	1,530	1,810	587	83,344	複合小売り
BARCLAYS PLC	16,180	18,100	3,633	515,131	銀行
INTERTEK GROUP PLC	163	163	788	111,822	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	113,408	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	140	162	690	97,930	複合小売り
KINGFISHER PLC	2,140	2,460	756	107,207	専門小売り
ITV PLC	3,530	4,000	678	96,120	メディア
SAINSBURY	1,500	1,700	412	58,468	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	88	97	705	100,043	金属・鉱業
G4S PLC	1,520	1,520	456	64,647	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	219	185	378	53,687	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	124	124	458	64,938	家庭用耐久財
CENTRICA PLC	5,240	5,950	1,217	172,586	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	4,150	4,704	10,005	1,418,466	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	3,593	3,980	8,624	1,222,718	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE	331	368	856	121,454	商社・流通業
COBHAM PLC	1,695	2,540	353	50,053	航空宇宙・防衛
NATIONAL GRID PLC	3,600	—	—	—	総合公益事業
INMARSAT PLC	425	425	314	44,646	各種電気通信サービス
PETROFAC LTD	260	260	111	15,827	エネルギー設備・サービス
HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	139	139	184	26,189	医薬品
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	300	341	1,335	189,265	資本市場
UNILEVER PLC	1,228	1,366	6,099	864,682	パーソナル用品
TUI AG-DI	490	490	649	92,044	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	610	610	358	50,806	資本市場
EXPERIAN PLC	909	1,017	1,554	220,451	専門サービス
MONDI PLC	370	372	759	107,744	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	237	237	532	75,498	水道
WHITBREAD PLC	173	188	724	102,746	ホテル・レストラン・レジャー
HARGREAVES LANSDOWN PLC	250	250	337	47,811	資本市場
SMITHS GROUP PLC	371	410	647	91,780	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,364	1,430	1,839	260,813	金属・鉱業
3I GROUP PLC	970	1,060	1,017	144,265	資本市場
PROVIDENT FINANCIAL PLC	143	143	273	38,823	消費者金融
CAPITA PLC	640	640	412	58,522	専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	605	708	5,243	743,363	家庭用品
RELX PLC	1,058	1,161	1,962	278,165	専門サービス
SHIRE PLC	861	965	3,719	527,258	バイオテクノロジー
FRESNILLO PLC	209	209	315	44,681	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	670	670	609	86,389	水道
GLENCORE PLC	11,690	13,040	4,502	638,257	金属・鉱業
DIXONS CARPHONE PLC	920	920	229	32,476	専門小売り
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,830	1,780	1,625	230,396	航空宇宙・防衛

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
OLD MUTUAL PLC	4,880	5,360	1,118	158,588	保険
EASYJET PLC	163	163	216	30,641	旅客航空輸送業
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	3,410	3,660	965	136,931	銀行
SAGE GROUP PLC (THE)	1,050	1,190	837	118,769	ソフトウェア
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	375	375	278	39,420	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
WPP PLC	1,234	1,374	2,202	312,251	メディア
COCA-COLA HBC AG-CDI	167	193	496	70,456	飲料
CONVATEC GROUP PLC-WI	—	1,160	337	47,905	ヘルスケア機器・用品
COMPASS GROUP PLC	—	1,692	2,820	399,871	ホテル・レストラン・レジャー
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	—	197	792	112,357	ホテル・レストラン・レジャー
NATIONAL GRID PLC	—	3,670	3,538	501,721	総合公益事業
ROYAL MAIL PLC	880	880	354	50,264	航空貨物・物流サービス
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	690	690	322	45,672	ホテル・レストラン・レジャー
FERGUSON PLC	242	274	1,289	182,765	商社・流通業
IMI PLC	259	259	304	43,180	機械
VODAFONE GROUP PLC	25,480	28,320	6,282	890,711	無線通信サービス
RSA INSURANCE GROUP PLC	987	1,120	729	103,446	保険
COMPASS GROUP PLC	1,566	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	1,870	2,751	1,199	170,040	保険
AUTO TRADER GROUP PLC	950	950	341	48,377	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	525	74,526	保険
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	181	—	—	—	ホテル・レストラン・レジャー
WORLDPAY GROUP PLC	1,660	2,080	888	125,914	情報技術サービス
CRODA INTERNATIONAL PLC	120	136	519	73,594	化学
JOHNSON MATTHEY PLC	191	191	527	74,768	化学
小計 株数・金額	285,636	324,563	200,041	28,359,914	
小計 銘柄数<比率>	104	103	—	<7.0%>	
(スイス)			千スイスフラン		
SYNGENTA AG-REG	89	—	—	—	化学
SIKA AG-BR	2	2	1,463	166,778	化学
SGS SA-REG	5	5	1,195	136,159	専門サービス
BARRY CALLEBAUT AG	2	2	320	36,554	食品
SWISSCOM AG-REG	25	28	1,349	153,797	各種電気通信サービス
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	1	1	561	63,983	食品
LINDT&SPRUENGLI AG-REG	0.1	0.1	647	73,735	食品
GIVAUDAN-REG	8	9	1,946	221,728	化学
ZURICH INSURANCE GROUP AG	143	160	4,762	542,636	保険
NOVARTIS-REG	2,144	2,369	19,413	2,211,831	医薬品
ABB LTD	1,799	2,127	4,781	544,755	電気設備
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	674	745	18,274	2,082,031	医薬品
ADECCO GROUP AG-REG	153	164	1,167	133,033	専門サービス
LAFARGEHOLCIM LTD	439	488	2,854	325,247	建設資材
NESTLE SA-REG	2,989	3,301	27,018	3,078,238	食品
BALOISE HOLDING AG	50	50	770	87,783	保険
SONOVA HOLDING AG-REG	50	58	891	101,564	ヘルスケア機器・用品
STRAUMANN HOLDING AG-REG	—	9	514	58,634	ヘルスケア機器・用品
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,890	2,510	3,662	417,221	資本市場
THE SWATCH GROUP AG-B	29	31	1,192	135,835	繊維・アパレル・贅沢品

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円	
THE SWATCH GROUP AG-REG	46	60	441	50,243	繊維・アパレル・贅沢品
LONZA AG-REG	57	80	1,866	212,694	ライフサイエンス・ツール/サービス
SWISS LIFE HOLDING AG	31	31	1,114	126,949	保険
GALENICA AG-REG	3	—	—	—	医薬品
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	8	8	559	63,734	化学
SWISS PRIME SITE-REG	68	68	594	67,710	不動産管理・開発
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	32	43	344	39,191	各種金融サービス
DUFRY AG-REG	45	36	563	64,215	専門小売り
PARTNERS GROUP HOLDING AG	16	18	1,180	134,472	資本市場
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	38	44	941	107,287	機械
SCHINDLER HOLDING AG-REG	19	19	396	45,186	機械
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	52	59	1,008	114,876	海運業
GEBERIT AG-REG	35	37	1,810	206,283	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	243	1,329	151,436	資本市場
SWISS RE LTD	309	347	3,077	350,664	保険
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	498	557	4,656	530,517	繊維・アパレル・贅沢品
UBS GROUP AG	3,502	3,900	6,477	738,027	資本市場
VIFOR PHARMA AG	—	48	468	53,346	医薬品
小計 株数・金額	15,659	17,666	119,620	13,628,390	
小計 銘柄数<比率>	38	36	—	<3.3%>	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ		
LUNDBERGS AB-B SHS	34	34	2,167	29,521	各種金融サービス
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	1,440	1,640	16,990	231,409	銀行
SWEDBANK AB	881	973	20,948	285,321	銀行
SWEDISH MATCH AB	189	189	5,322	72,488	タバコ
NORDEA BANK AB	2,900	3,250	33,930	462,126	銀行
SECURITAS AB-B SHS	290	333	4,392	59,822	商業サービス・用品
INVESTOR AB-B SHS	441	490	18,673	254,338	各種金融サービス
HENNES&MAURITZ AB-B	917	1,019	21,867	297,838	専門小売り
ERICSSON LM-B	2,970	3,310	16,450	224,058	通信機器
TELIA CO AB	2,470	2,620	9,866	134,387	各種電気通信サービス
SKANSKA AB-B SHS	317	341	6,216	84,667	建設・土木
LUNDIN PETROLEUM AB	171	171	3,110	42,364	石油・ガス・消耗燃料
ALFA LAVAL AB	277	310	5,741	78,195	機械
GETINGE AB-B SHS	191	191	2,744	37,382	ヘルスケア機器・用品
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	68	68	3,393	46,224	無線通信サービス
ICA GRUPPEN AB	78	78	2,402	32,720	食品・生活必需品小売り
HUSQVARNA AB-B SHS	380	450	3,633	49,491	家庭用耐久財
ELECTROLUX AB-B	233	265	7,605	103,586	家庭用耐久財
SKF AB-B SHARES	388	388	6,184	84,235	機械
VOLVO AB-B SHS	1,490	1,670	23,229	316,388	機械
SANDVIK AB	1,030	1,150	14,628	199,233	機械
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	168	168	3,304	45,008	各種金融サービス
SVENSKA CELLULOSA AB-B	576	—	—	—	紙製品・林産品
BOLIDEN AB	263	301	7,822	106,549	金属・鉱業
HEXAGON AB-B SHS	242	281	11,032	150,256	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		
				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	3,253	44,316	無線通信サービス
KINNEVIK AB - B		236	236	5,798	78,975	各種金融サービス
ESSITY AKTIEBOLAG-B		—	657	14,499	197,489	家庭用品
ATLAS COPCO AB-A		646	721	21,219	289,003	機械
ATLAS COPCO AB-B		382	424	11,363	154,766	機械
SVENSKA HANDELSBANKEN-A		1,480	1,640	19,614	267,148	銀行
ASSA ABLOY AB-B		963	1,079	18,580	253,064	建設関連製品
小計	株数・金額	22,451	24,787	345,990	4,712,384	
	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	1,054	15,894	220,613	銀行
TELENOR ASA		719	813	12,804	177,729	各種電気通信サービス
SCHIBSTED ASA		78	78	1,502	20,851	メディア
STATOIL ASA		1,066	1,222	17,865	247,975	石油・ガス・消耗燃料
YARA INTERNATIONAL ASA		168	186	6,039	83,827	化学
MARINE HARVEST ASA		359	372	5,691	78,999	食品
NORSK HYDRO		1,300	1,480	7,762	107,744	金属・鉱業
ORKLA ASA		800	800	6,628	91,996	食品
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA		197	197	2,653	36,831	保険
SCHIBSTED ASA-B SHS		91	91	1,597	22,167	メディア
小計	株数・金額	5,718	6,293	78,439	1,088,736	
	銘柄数<比率>	10	10	—	<0.3%>	
(デンマーク)				千デンマーククローネ		
CARLSBERG B		105	117	7,891	137,314	飲料
A P MOLLER-MAERSK A/S		6	6	8,944	155,634	海運業
A P MOLLER - MAERSK A/S-A		3	3	4,747	82,606	海運業
DANSKE BANK AS		669	790	19,599	341,038	銀行
GENMAB A/S		54	58	8,004	139,282	バイオテクノロジー
TDC A/S		768	768	2,855	49,684	各種電気通信サービス
VESTAS WIND SYSTEMS A/S		212	239	14,877	258,872	電気設備
H LUNDBECK A/S		—	63	2,397	41,710	医薬品
DSV A/S		177	207	9,130	158,875	陸運・鉄道
PANDORA A/S		105	115	7,268	126,463	繊維・アパレル・贅沢品
CHR HANSEN HOLDING A/S		91	102	5,278	91,845	化学
NOVOZYMES A/S-B SHARES		225	252	7,426	129,220	化学
COLOPLAST-B		117	130	6,753	117,510	ヘルスケア機器・用品
NOVO NORDISK A/S-B		1,832	1,927	55,112	958,952	医薬品
ISS A/S		161	186	4,850	84,405	商業サービス・用品
TRYG A/S		118	118	1,670	29,073	保険
DONG ENERGY A/S		141	163	5,220	90,843	電力
WILLIAM DEMANT HOLDING		130	130	2,080	36,192	ヘルスケア機器・用品
小計	株数・金額	4,915	5,376	174,110	3,029,526	
	銘柄数<比率>	17	18	—	<0.7%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
ADIDAS AG		179	201	3,889	503,359	繊維・アパレル・贅沢品
FRESENIUS SE & CO KGAA		396	444	3,089	399,881	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNITED INTERNET AG-REG SHARE		112	129	646	83,642	インターネットソフトウェア・サービス
FUCHS PETROLUB SE -PFD		64	64	307	39,815	化学

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円	
HANNOVER RUECK SE	56	62	654	84,693	保険
GEA GROUP AG	170	186	714	92,509	機械
CONTINENTAL AG	104	118	2,282	295,373	自動車部品
DEUTSCHE POST AG-REG	926	1,061	3,767	487,535	航空貨物・物流サービス
AXEL SPRINGER SE	44	44	236	30,641	メディア
MERCK KGAA	125	131	1,220	157,977	医薬品
RWE AG	496	536	1,083	140,229	総合公益事業
SAP SE	942	1,044	9,432	1,220,759	ソフトウェア
E.ON SE	1,890	2,370	2,274	294,303	総合公益事業
HENKEL AG & CO KGAA	99	106	1,075	139,174	家庭用品
CECONOMY AG	182	—	—	—	専門小売り
BAYER AG-REG	793	879	9,501	1,229,747	医薬品
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	173	191	2,162	279,821	家庭用品
BASF SE	880	977	7,994	1,034,685	化学
BEIERSDORF AG	100	110	986	127,684	パーソナル用品
HOCHTIEF AG	20	20	305	39,524	建設・土木
HEIDELBERGCEMENT AG	143	152	1,242	160,817	建設資材
FRESENIUS MEDICAL CARE	208	232	1,835	237,561	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
ALLIANZ SE-REG	437	485	8,929	1,155,668	保険
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	226	226	468	60,691	旅客航空輸送業
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	155	172	3,061	396,247	保険
VOLKSWAGEN AG	32	32	429	55,563	自動車
VOLKSWAGEN AG-PREF	179	199	2,583	334,294	自動車
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	922	1,025	6,203	802,831	自動車
MAN SE	37	37	348	45,088	機械
THYSSENKRUPP AG	363	402	1,058	136,934	金属・鉱業
SIEMENS AG	734	813	9,134	1,182,129	コングロマリット
LINDE AG	177	198	3,281	424,738	化学
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,330	2,210	3,222	417,014	資本市場
BAYER MOTOREN WERK	316	355	2,844	368,196	自動車
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	53	53	371	48,103	自動車
DEUTSCHE TELEKOM-REG	3,133	3,487	5,444	704,685	各種電気通信サービス
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,089	1,218	2,328	301,395	半導体・半導体製造装置
DEUTSCHE BOERSE AG	—	208	1,866	241,601	資本市場
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	152	152	747	96,785	自動車
FRAPORT AG	38	38	314	40,740	運送インフラ
LANXESS	85	89	566	73,326	化学
DEUTSCHE WOHNEN SE	329	361	1,251	161,980	不動産管理・開発
SYMRISE AG	121	136	838	108,581	化学
BRENNTAG AG	151	170	790	102,251	商社・流通業
K+S AG	188	188	377	48,917	化学
EVONIK INDUSTRIES AG	169	169	463	60,038	化学
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	746	746	340	44,006	各種電気通信サービス
HUGO BOSS AG	63	63	452	58,615	繊維・アパレル・贅沢品
COMMERZBANK AG	1,020	1,090	1,220	157,995	銀行
OSRAM LICHT AG	88	93	657	85,082	電気設備
VONOVIA SE	446	503	1,784	230,903	不動産管理・開発
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	223	256	877	113,525	メディア

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
METRO WHOLESALE&FOOD SPECIALIST AG		—	182	308	39,948	食品・生活必需品小売り
DEUTSCHE BOERSE AG-TENDER		189	—	—	—	資本市場
INNOGY SE		127	146	549	71,065	総合公益事業
ZALANDO SE		81	117	473	61,325	インターネット販売・通信販売
COVESTRO AG		68	116	771	99,789	化学
QIAGEN NV		214	214	579	75,009	ライフサイエンス・ツール/サービス
SCHAEFFLER AG		160	160	189	24,475	自動車部品
小計	株数・金額	21,947	25,168	119,836	15,509,288	
	銘柄数<比率>	57	57	—	<3.8%>	
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI		1,120	1,341	2,086	270,047	保険
INTESA SANPAOLO		12,110	13,540	3,961	512,736	銀行
INTESA SANPAOLO-RSP		920	920	250	32,409	銀行
MEDIOBANCA S.P.A.		530	600	532	68,916	銀行
SAIPEM SPA		5,897	—	—	—	エネルギー設備・サービス
LUXOTTICA GROUP SPA		165	186	895	115,883	繊維・アパレル・贅沢品
ENEL SPA		7,280	8,680	4,396	568,984	電力
ENI SPA		2,430	2,720	3,647	472,062	石油・ガス・消耗燃料
SNAM SPA		2,330	2,330	947	122,609	石油・ガス・消耗燃料
TENARIS SA		460	530	616	79,841	エネルギー設備・サービス
TELECOM ITALIA SPA		9,900	12,400	1,059	137,130	各種電気通信サービス
TELECOM ITALIA-RNC		5,700	6,800	466	60,327	各種電気通信サービス
ATLANTIA SPA		387	467	1,273	164,757	運送インフラ
TERNA SPA		1,520	1,470	737	95,504	電力
RECORDATI SPA		—	112	394	51,037	医薬品
LEONARDO SPA		410	410	600	77,683	航空宇宙・防衛
PRYSMIAN SPA		194	230	611	79,119	電気設備
UNIPOLSAI SPA		1,070	1,070	209	27,072	保険
FERRARI NV		116	125	1,184	153,281	自動車
CNH INDUSTRIAL NV		990	1,050	1,025	132,697	機械
SAIPEM SPA		—	589	192	24,910	エネルギー設備・サービス
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV		890	1,090	1,188	153,763	自動車
UNICREDIT SPA		1,813	2,137	3,853	498,656	銀行
EXOR NV		104	121	643	83,310	各種金融サービス
POSTE ITALIANE SPA		500	500	307	39,796	保険
小計	株数・金額	56,836	59,418	31,081	4,022,541	
	銘柄数<比率>	23	24	—	<1.0%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES		201	234	895	115,943	建設・土木
AIRBUS SE		554	618	4,503	582,905	航空宇宙・防衛
VEOLIA ENVIRONNEMENT		461	523	1,020	132,022	総合公益事業
LOREAL-ORD		240	268	4,738	613,205	パーソナル用品
CHRISTIAN DIOR SE		53	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE		267	296	6,500	841,320	繊維・アパレル・贅沢品
DASSAULT AVIATION SA		2	2	348	45,111	航空宇宙・防衛
THALES SA		105	115	1,098	142,150	航空宇宙・防衛
CAPGEMINI SA		158	174	1,616	209,202	情報技術サービス
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA		59	59	305	39,530	食品・生活必需品小売り

銘柄	期首(前期末)	当期末			業種等
	株数	株数	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円	
INGENICO GROUP	55	55	474	61,379	電子装置・機器・部品
PUBLICIS GROUPE	181	207	1,293	167,437	メディア
LAGARDERE S.C.A	116	116	319	41,284	メディア
BOLLORE	870	870	344	44,553	航空貨物・物流サービス
MICHELIN (CGDE)	175	184	2,166	280,401	自動車部品
PERNOD RICARD SA	207	228	2,714	351,289	飲料
RENAULT SA	186	182	1,391	180,097	自動車
REMY COINTREAU	23	23	223	28,977	飲料
SEB SA	20	24	376	48,671	家庭用耐久財
SCHNEIDER ELECTRIC SE	544	601	4,113	532,336	電気設備
VIVENDI SA	1,000	1,106	2,120	274,468	メディア
ORANGE SA	1,900	2,130	3,052	395,027	各種電気通信サービス
HERMES INTERNATIONAL	24	34	1,510	195,459	繊維・アパレル・贅沢品
SOCIETE BIC SA	28	28	286	37,094	商業サービス・用品
DASSAULT SYSTEMES SA	128	140	1,167	151,074	ソフトウェア
KERING SA	71	81	2,503	323,967	繊維・アパレル・贅沢品
CNP ASSURANCES	165	165	335	43,477	保険
CARREFOUR SUPERMARCHE	535	616	1,271	164,507	食品・生活必需品小売り
ATOS SE	86	96	1,235	159,838	情報技術サービス
SANOFI	1,112	1,235	10,198	1,319,906	医薬品
ACCOR SA	164	191	753	97,455	ホテル・レストラン・レジャー
STMICROELECTRONICS NV	600	650	946	122,483	半導体・半導体製造装置
SOCIETE GENERALE	742	819	4,009	518,951	銀行
EURAZEO SE	40	42	305	39,520	各種金融サービス
SODEXO	89	101	1,005	130,178	ホテル・レストラン・レジャー
AXA	1,855	2,067	5,175	669,847	保険
PEUGEOT CITROEN	473	532	974	126,170	自動車
JC DECAUX SA	68	68	198	25,750	メディア
ESSILOR INTERNATIONAL	197	223	2,363	305,922	ヘルスケア機器・用品
CREDIT AGRICOLE SA	1,080	1,230	1,902	246,182	銀行
ZODIAC AEROSPACE	195	195	472	61,111	航空宇宙・防衛
BNP PARIBAS	1,015	1,193	8,021	1,038,172	銀行
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	481	536	2,532	327,734	建設関連製品
WENDEL	29	29	381	49,354	各種金融サービス
ILIAD SA	27	27	591	76,581	各種電気通信サービス
SES FDR	344	376	748	96,837	メディア
IMERYS	38	38	281	36,437	建設資材
SAFRAN SA	304	335	2,789	361,022	航空宇宙・防衛
ENGIE	1,520	1,830	2,576	333,468	総合公益事業
ALSTOM	155	155	480	62,206	機械
EUTELSAT COMMUNICATIONS	163	163	405	52,453	メディア
ELECTRICITE DE FRANCE	228	570	515	66,665	電力
IPSEN	－	40	438	56,685	医薬品
ARKEMA	67	67	639	82,757	化学
LEGRAND SA	253	288	1,739	225,165	電気設備
EIFFAGE SA	61	77	649	84,087	建設・土木
TOTAL SA	2,161	2,476	10,657	1,379,350	石油・ガス・消耗燃料
ADP	28	28	406	52,616	運送インフラ

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…フランス)		百株	百株	千ユーロ	千円	
NATIXIS		870	980	637	82,503	銀行
SCOR SE		154	180	663	85,879	保険
REXEL SA		286	286	379	49,080	商社・流通業
VINCI		489	535	4,157	538,061	建設・土木
DANONE		564	630	4,227	547,178	食品
AIR LIQUIDE		376	415	4,351	563,142	化学
BUREAU VERITAS SA		255	255	507	65,740	専門サービス
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR		450	450	437	56,579	運送インフラ
SUEZ		333	385	609	78,875	総合公益事業
EDENRED		214	214	480	62,218	商業サービス・用品
VALEO SA		228	259	1,501	194,314	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	26,203	29,348	128,043	16,571,390	
	銘柄数＜比率＞	69	68	－	＜4.1%＞	
(ユーロ…イギリス)						
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS		219	219	819	106,002	飲料
小計	株数・金額	219	219	819	106,002	
	銘柄数＜比率＞	1	1	－	＜0.0%＞	
(ユーロ…オランダ)						
RELX NV		954	1,040	1,856	240,322	専門サービス
RANDSTAD HOLDING NV		116	116	584	75,649	専門サービス
AKZO NOBEL		237	271	2,092	270,832	化学
WOLTERS KLUWER		299	328	1,224	158,507	専門サービス
VOPAK		71	71	294	38,110	石油・ガス・消耗燃料
AEGON NV		1,800	1,930	1,000	129,536	保険
KONINKLIJKE KPN NV		3,200	3,720	1,142	147,850	各種電気通信サービス
KONINKLIJKE PHILIPS NV		916	994	3,204	414,746	コングロマリット
HEINEKEN NV		223	248	2,179	282,061	飲料
ARCELORMITTAL		1,780	－	－	－	金属・鉱業
HEINEKEN HOLDING NV		97	111	913	118,185	飲料
KONINKLIJKE DSM NV		170	197	1,250	161,821	化学
UNILEVER NV-CVA		1,560	1,732	8,694	1,125,260	パーソナル用品
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA		93	96	281	36,435	建設・土木
ASML HOLDING NV		352	398	5,199	672,967	半導体・半導体製造装置
GEMALTO		76	85	380	49,272	ソフトウェア
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV		1,232	1,375	2,325	300,917	食品・生活必需品小売り
NN GROUP NV		300	311	1,093	141,477	保険
ARCELORMITTAL		－	672	1,511	195,639	金属・鉱業
ABN AMRO GROUP NV-CVA		279	411	1,013	131,223	銀行
ALTICE NV - B		100	100	189	24,569	メディア
ALTICE NV - A		368	401	761	98,605	メディア
ING GROEP NV		3,710	4,128	6,377	825,409	銀行
小計	株数・金額	17,933	18,735	43,574	5,639,401	
	銘柄数＜比率＞	22	22	－	＜1.4%＞	
(ユーロ…スペイン)						
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA		630	708	1,188	153,754	運送インフラ
ENDESA S.A.		317	317	659	85,416	電力
BANKINTER S.A.		650	750	615	79,709	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…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.		6,290	7,120	5,457	706,307	銀行
GAS NATURAL SDG		328	358	726	94,008	ガス
REPSOL SA		1,087	1,330	1,895	245,369	石油・ガス・消耗燃料
BANCO SANTANDER SA		13,990	17,040	9,613	1,244,239	銀行
TELEFONICA SA		4,450	4,830	4,528	586,029	各種電気通信サービス
ZARDOYA OTIS S.A		175	—	—	—	機械
ENAGAS		228	228	565	73,134	石油・ガス・消耗燃料
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA		—	236	302	39,156	電気設備
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV		190	245	795	103,003	建設・土木
FERROVIAL SA		464	529	996	129,018	建設・土木
MAPFRE SA		980	980	303	39,292	保険
BANCO DE SABADELL SA		4,995	5,810	1,110	143,769	銀行
CAIXABANK		3,450	3,870	1,729	223,882	銀行
IBERDROLA SA		5,402	6,330	4,412	571,002	電力
AMADEUS IT GROUP SA		426	471	2,449	317,036	情報技術サービス
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP		800	630	435	56,421	旅客航空輸送業
DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL		560	660	370	47,910	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	826	106,954	電力
INDITEX SA		1,049	1,164	3,929	508,577	専門小売り
AENA SA		65	69	1,146	148,412	運送インフラ
GRIFOLS SA		288	329	788	101,998	バイオテクノロジー
BANKIA SA		—	1,075	453	58,655	銀行
小計	株数・金額	54,551	55,511	45,302	5,863,061	
	銘柄数<比率>	25	24	—	<1.4%>	
(ユーロ…ベルギー)						
UMICORE		94	94	606	78,516	化学
KBC GROEP NV		240	270	1,908	246,945	銀行
SOLVAY SA		73	81	999	129,360	化学
UCB SA		121	139	805	104,248	医薬品
COLRUYT SA		60	73	349	45,230	食品・生活必需品小売り
GROUPE BRUXELLES LAM		78	89	792	102,582	各種金融サービス
PROXIMUS		151	151	450	58,343	各種電気通信サービス
TELENET GROUP HOLDING NV		52	52	300	38,905	メディア
AGEAS		190	190	756	97,941	保険
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV		730	810	8,116	1,050,398	飲料
小計	株数・金額	1,789	1,949	15,086	1,952,472	
	銘柄数<比率>	10	10	—	<0.5%>	
(ユーロ…オーストリア)						
OMV AG		138	150	698	90,377	石油・ガス・消耗燃料
VOESTALPINE AG		110	128	551	71,406	金属・鉱業
ERSTE GROUP BANK AG		289	307	1,124	145,557	銀行
IMMOEAST AG-RIGHTS		500	—	—	—	不動産管理・開発
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG		110	169	456	59,021	銀行
ANDRITZ AG		72	72	333	43,222	機械
小計	株数・金額	1,219	826	3,164	409,586	
	銘柄数<比率>	6	5	—	<0.1%>	

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ルクセンブルグ)		百株	百株	千ユーロ	千円	
EUROFINS SCIENTIFIC SE		10	10	493	63,805	ライフサイエンス・ツール/サービス
RTL GROUP		39	39	263	34,100	メディア
小計	株数・金額	49	49	756	97,905	
	銘柄数<比率>	2	2	—	<0.0%>	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA OYJ		147	162	941	121,812	機械
UPM-KYMMENE OYJ		503	579	1,312	169,800	紙製品・林産品
STORA ENSO OYJ-R		540	540	622	80,579	紙製品・林産品
SAMPO OYJ-A SHS		430	480	2,175	281,535	保険
FORTUM OYJ		440	440	636	82,342	電力
ELISA OYJ		129	145	524	67,819	各種電気通信サービス
METSO OYJ		103	124	341	44,228	機械
NOKIA OYJ		5,680	6,240	3,385	438,112	通信機器
NESTE OYJ		125	125	438	56,734	石油・ガス・消耗燃料
NOKIAN RENKAAT OYJ		113	113	411	53,306	自動車部品
KONE OYJ		323	364	1,617	209,398	機械
ORION OYJ		95	108	447	57,866	医薬品
小計	株数・金額	8,628	9,420	12,853	1,663,537	
	銘柄数<比率>	12	12	—	<0.4%>	
(ユーロ…アイルランド)						
BANK OF IRELAND		28,500	—	—	—	銀行
CRH PLC		823	906	2,734	353,874	建設資材
KERRY GROUP PLC-A		158	177	1,396	180,693	食品
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD		1,398	1,398	—	—	銀行
BANK OF IRELAND GROUP PLC		—	1,070	768	99,469	銀行
PADDY POWER PLC		84	93	780	100,958	ホテル・レストラン・レジャー
小計	株数・金額	30,963	3,644	5,679	734,995	
	銘柄数<比率>	5	5	—	<0.2%>	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL		2,350	2,620	831	107,624	電力
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS		470	500	697	90,270	石油・ガス・消耗燃料
JERONIMO MARTINS		230	267	451	58,398	食品・生活必需品小売り
小計	株数・金額	3,050	3,387	1,980	256,292	
	銘柄数<比率>	3	3	—	<0.1%>	
ユーロ計	株数・金額	223,389	207,677	408,178	52,826,475	
	銘柄数<比率>	235	233	—	<13.0%>	
(香港)				千香港ドル		
ASM PACIFIC TECHNOLOGY		219	290	2,842	39,958	半導体・半導体製造装置
HANG LUNG PROPERTIES LTD		2,130	2,130	4,191	58,937	不動産管理・開発
BANK OF EAST ASIA		1,208	1,208	4,060	57,096	銀行
CLP HLDGS		1,590	1,770	14,673	206,306	電力
CATHAY PACIFIC AIRWAYS		1,070	—	—	—	旅客航空輸送業
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		650	—	—	—	電力
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD		1,102	1,244	26,522	372,900	資本市場
LI & FUNG LTD		5,636	5,636	1,583	22,267	繊維・アパレル・贅沢品
MTR CORP		1,370	1,630	7,343	103,244	陸運・鉄道
FIRST PACIFIC CO		2,260	2,260	1,362	19,160	各種金融サービス
HANG LUNG GROUP LTD		810	1,030	3,110	43,735	不動産管理・開発

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)		百株	百株	千香港ドル	千円	
HANG SENG BANK		722	826	14,760	207,534	銀行
HENDERSON LAND		1,078	1,325	6,291	88,463	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD		1,320	1,510	11,815	166,129	電力
WHARF(HOLDING)		1,330	1,250	8,800	123,728	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS		7,198	9,082	13,497	189,770	ガス
HYSAN DEVELOPMENT		650	650	2,392	33,631	不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		2,230	2,550	11,959	168,150	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES		570	570	1,567	22,039	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD		3,635	3,990	15,221	214,019	銀行
NWS HOLDINGS LTD		1,595	1,595	2,542	35,746	コングロマリット
PCCW LTD		3,860	3,860	1,733	24,367	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG		750	750	2,587	36,380	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT		5,196	6,096	6,291	88,462	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD		1,083	1,083	1,410	19,831	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO.LTD		3,140	3,140	4,038	56,774	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES		1,390	1,560	19,203	270,002	不動産管理・開発
SWIRE PACIFIC-A		535	535	4,280	60,176	不動産管理・開発
WHEELOCK & COMPANY LTD		750	840	4,956	69,681	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO		1,400	1,400	4,921	69,189	家庭用耐久財
SJM HOLDINGS LIMITED		1,660	1,660	1,171	16,477	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD		1,484	1,484	2,531	35,595	ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD		940	940	1,477	20,776	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD		11,540	12,820	76,727	1,078,791	保険
HKT TRUST AND HKT LTD		2,596	3,796	3,955	55,613	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD		2,336	2,504	8,776	123,397	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD		1,168	1,168	3,159	44,421	不動産管理・開発
WH GROUP LIMITED		8,100	8,100	6,463	90,881	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD		2,575	2,890	29,424	413,705	コングロマリット
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING		2,610	2,860	19,665	276,493	不動産管理・開発
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD		—	650	4,683	65,846	電力
小計	株数・金額	91,488	98,686	361,997	5,089,685	
	銘柄数<比率>	40	39	—	<1.3%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING		1,400	1,610	589	47,553	航空宇宙・防衛
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD		6,203	6,203	229	18,522	食品
DBS GROUP HLDGS		1,680	1,910	3,894	314,285	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD		410	410	479	38,711	不動産管理・開発
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD		100	100	399	32,271	販売
SATS LTD		590	770	369	29,826	運送インフラ
SINGAPORE EXCHANGE LTD		770	770	582	46,977	資本市場
CAPITALAND LIMITED		2,460	2,850	1,088	87,858	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE PLC		6,146	6,146	728	58,773	ホテル・レストラン・レジャー
COMFORTDELGRO CORP LTD		2,070	2,070	463	37,418	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD		520	520	551	44,474	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK		1,250	1,420	3,369	271,931	銀行
UOL GROUP LIMITED		487	487	399	32,226	不動産管理・開発
SINGAPORE PRESS HOLDINGS		1,480	1,870	532	43,009	メディア
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED		7,570	8,780	3,327	268,538	各種電気通信サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(シンガポール)		百株	百株	千シンガポールドル	千円	
SEMBCORP INDUSTRIES		990	990	298	24,057	コングロマリット
OCBC-ORD		3,030	3,380	3,782	305,225	銀行
WILMAR INTERNATIONAL LTD		1,840	1,750	553	44,627	食品
STARHUB LTD		690	690	178	14,421	無線通信サービス
KEPPEL CORP.		1,427	1,620	1,031	83,277	コングロマリット
YANGZIJIANG SHIPBUILDING		1,630	2,700	432	34,862	機械
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L		2,660	2,660	859	69,335	不動産管理・開発
小計	株数・金額	45,404	49,707	24,141	1,948,187	
	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	1,048	91,433	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK		2,804	3,125	9,506	829,230	銀行
AMCOR		1,120	1,260	2,004	174,866	容器・包装
WESTPAC BANKING CORP		3,207	3,570	11,688	1,019,559	銀行
BANK OF QUEENSLAND LTD		351	420	540	47,114	銀行
FORTESCUE METALS GROUP LTD		1,480	1,640	902	78,681	金属・鉱業
TELSTRA CORP LTD		4,140	4,520	1,957	170,723	各種電気通信サービス
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD		443	540	674	58,833	銀行
COCA-COLA AMATIL LTD		600	600	511	44,591	飲料
ASX LTD		196	196	1,051	91,760	資本市場
BHP BILLITON LIMITED		3,074	3,420	8,779	765,804	金属・鉱業
CALTEX AUSTRALIA LIMITED		255	291	937	81,812	石油・ガス・消耗燃料
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD		530	530	228	19,925	複合小売り
COMPUTERSHARE LTD		470	470	656	57,274	情報技術サービス
CSL LIMITED		435	486	6,088	531,066	バイオテクノロジー
REA GROUP LTD		54	54	364	31,800	メディア
TRANSURBAN GROUP		1,980	2,210	2,612	227,863	運送インフラ
COCHLEAR LTD		58	58	828	72,237	ヘルスケア機器・用品
ORIGIN ENERGY LTD		1,750	1,920	1,386	120,921	石油・ガス・消耗燃料
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA		1,645	1,831	14,618	1,275,189	銀行
BORAL LTD		1,150	1,150	792	69,116	建設資材
RIO TINTO LTD		408	456	2,861	249,599	金属・鉱業
APA GROUP		1,110	1,110	932	81,333	ガス
ARISTOCRAT LEISURE LTD		520	562	1,212	105,792	ホテル・レストラン・レジャー
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD		2,280	2,430	1,630	142,231	保険
TPG TELECOM LTD		330	359	207	18,069	各種電気通信サービス
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD		52	52	241	21,046	ホテル・レストラン・レジャー
ORICA LTD		366	420	834	72,796	化学
BLUESCOPE STEEL LTD		−	600	837	73,011	金属・鉱業
SUNCORP GROUP LTD		1,260	1,400	1,827	159,369	保険
NATIONAL AUSTRALIA BANK		2,544	2,849	8,923	778,359	銀行
NEWCREST MINING		750	830	1,773	154,720	金属・鉱業
OIL SEARCH LTD		1,290	1,430	920	80,331	石油・ガス・消耗燃料
INCITEC PIVOT LTD		1,610	1,610	552	48,171	化学
AMP LIMITED		2,810	3,220	1,645	143,529	各種金融サービス
QANTAS AIRWAYS LIMITED		441	441	257	22,443	旅客航空輸送業
QBE INSURANCE		1,320	1,400	1,682	146,790	保険
CHALLENGER LIMITED		560	560	672	58,618	各種金融サービス

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア)		百株	百株	千豪ドル	千円	
SANTOS LTD.		1,760	2,120	705	61,580	石油・ガス・消耗燃料
SONIC HEALTHCARE LTD		380	440	1,037	90,541	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
TABCORP HOLDINGS		780	780	309	27,011	ホテル・レストラン・レジャー
WESFARMERS LIMITED		1,075	1,209	5,047	440,299	食品・生活必需品小売り
ALUMINA LTD		2,330	2,330	475	41,462	金属・鉱業
WOODSIDE PETROLEUM		735	819	2,448	213,609	石油・ガス・消耗燃料
WOOLWORTHS LIMITED		1,216	1,381	3,748	326,941	食品・生活必需品小売り
DUET GROUP		2,290	—	—	—	総合公益事業
SEEK LTD		328	328	566	49,383	専門サービス
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L		59	59	262	22,902	ホテル・レストラン・レジャー
TATTS GROUP LTD		1,470	1,430	561	49,022	ホテル・レストラン・レジャー
BRAMBLES LTD		1,530	1,620	1,571	137,073	商業サービス・用品
MACQUARIE GROUP LIMITED		295	348	3,084	269,045	資本市場
CROWN RESORTS LTD		360	430	500	43,660	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	779	67,973	建設資材
TREASURY WINE ESTATES LTD		720	820	1,031	89,982	飲料
SYDNEY AIRPORT		1,079	1,079	741	64,661	運送インフラ
AURIZON HOLDINGS LTD		1,910	2,090	1,093	95,348	陸運・鉄道
HEALTHSCOPE LTD		1,760	1,760	381	33,314	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	275	24,016	電力
MEDIBANK PRIVATE LTD		2,610	3,080	853	74,421	保険
AGL ENERGY LTD		657	730	1,794	156,520	総合公益事業
SOUTH32 LTD		5,070	5,800	1,728	150,768	金属・鉱業
CIMIC GROUP LTD		89	89	381	33,268	建設・土木
小計	株数・金額	74,651	78,978	123,567	10,778,834	
	銘柄数<比率>	62	61	—	<2.6%>	
(ニュージーランド)				千ニュージーランドドル		
CONTACT ENERGY LTD		760	760	430	34,637	電力
RYMAN HEALTHCARE LTD		350	450	418	33,602	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	46,033	建設資材
SPARK NEW ZEALAND LTD		1,680	1,890	746	60,007	各種電気通信サービス
MERCURY NZ LTD		600	880	308	24,757	電力
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD		911	1,080	754	60,680	運送インフラ
MERIDIAN ENERGY LTD		1,200	1,200	360	28,936	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
小計	株数・金額	6,191	6,950	3,591	288,655	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(イスラエル)				千新シェケル		
BANK HAPOALIM BM		1,020	1,120	2,807	85,217	銀行
BANK LEUMI LE-ISRAEL		1,420	1,610	2,986	90,641	銀行
BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP		2,040	2,040	1,060	32,195	各種電気通信サービス
ELBIT SYSTEMS LTD		23	23	1,093	33,192	航空宇宙・防衛
FRUTAROM		38	38	980	29,766	化学
ISRAEL CHEMICALS LIMITED		500	500	817	24,811	化学
NICE LTD		59	68	1,876	56,960	ソフトウェア
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD		130	130	857	26,032	銀行

銘柄		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(イスラエル)		百株	百株	千新シェケル	千円	
AZRIELI GROUP		41	41	846	25,695	不動産管理・開発
小計	株数・金額	5,271	5,570	13,328	404,514	
	銘柄数<比率>	9	9	－	<0.1%>	
合計	株数・金額	1,119,127	1,195,165	－	389,207,549	
	銘柄数<比率>	1,266	1,266	－	<95.6%>	

＊邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。
＊邦貨換算金額欄の< >内は、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	791	87,032	0.0
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT		7,600	8,800	1,072	117,999	0.0
AMERICAN TOWER CORP		40,700	45,500	6,419	706,155	0.2
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT		95,000	111,000	1,370	150,793	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC		13,230	14,740	2,818	310,011	0.1
BOSTON PROPERTIES		14,900	15,700	1,915	210,745	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC		30,000	30,000	580	63,855	0.0
CAMDEN PROPERTY TRUST		8,200	9,100	812	89,329	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A		51,000	59,000	783	86,187	0.0
CROWN CASTLE INTL CORP		32,900	43,000	4,462	490,926	0.1
DIGITAL REALTY TRUST INC		15,300	17,200	2,003	220,399	0.1
DUKE REALTY CORP		34,000	38,900	1,124	123,663	0.0
EQUINIX INC		6,770	8,230	3,742	411,721	0.1
EQUITY RESIDENTIAL		34,800	39,400	2,675	294,321	0.1
ESSEX PROPERTY TRUST INC		6,190	7,080	1,859	204,590	0.1
EXTRA SPACE STORAGE INC		11,800	12,700	963	105,990	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST		6,910	7,900	1,024	112,665	0.0
GGP INC		56,500	63,200	1,349	148,425	0.0
HCP INC		44,700	47,400	1,390	152,978	0.0
HOST HOTELS & RESORTS INC		70,100	74,100	1,350	148,592	0.0
IRON MOUNTAIN INC		24,400	24,400	914	100,623	0.0
KIMCO REALTY CORP		40,000	44,400	873	96,117	0.0
LIBERTY PROPERTY TRUST		14,300	14,300	595	65,483	0.0
MACERICH CO /THE		12,300	12,300	674	74,198	0.0
MID-AMERICA APARTMENT COMM		11,200	12,400	1,322	145,525	0.0
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC		14,500	14,500	596	65,570	0.0
PROLOGIS INC		51,400	56,700	3,529	388,253	0.1
PUBLIC STORAGE		14,060	16,700	3,323	365,581	0.1
REALTY INCOME CORP		24,700	26,200	1,509	166,032	0.0
REGENCY CENTERS CORP		10,300	15,100	989	108,828	0.0
SBA COMMUNICATIONS CORP		12,000	13,100	1,882	207,100	0.1
SL GREEN REALTY CORP		9,800	11,000	1,091	120,032	0.0
SIMON PROPERTY GROUP INC		30,070	34,100	5,386	592,470	0.1
UDR INC		25,300	27,500	1,070	117,763	0.0
VENTAS INC		33,400	38,100	2,537	279,078	0.1
VEREIT INC		95,000	95,000	819	90,183	0.0
VORNADO REALTY TRUST		16,500	17,400	1,320	145,272	0.0
WELLTOWER INC		34,000	38,900	2,800	308,088	0.1
WEYERHAEUSER CO		72,200	80,400	2,565	282,212	0.1
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST		509,000	509,000	223	24,635	0.0
小計	口数・金額	1,667,930	1,791,250	72,540	7,979,435	
	銘柄数<比率>	40	40	－	<2.0%>	
(カナダ)				千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		13,600	13,600	288	25,121	0.0
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		16,900	16,900	406	35,441	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	213	18,610	0.0
小計	口数・金額	37,400	37,400	909	79,173	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.0%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		92,000	102,000	636	90,306	0.0
HAMMERSON PLC		74,000	89,000	513	72,866	0.0
INTU PROPERTIES PLC		88,000	88,000	220	31,301	0.0
LAND SECURITIES GROUP PLC		77,500	86,000	884	125,457	0.0
SEGRO PLC		86,000	103,000	553	78,487	0.0
小計	口数・金額	417,500	468,000	2,810	398,419	
	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	276	35,837	0.0
KLEPIERRE		20,500	22,300	760	98,371	0.0
GECINA SA		4,000	5,000	656	84,964	0.0
FONCIERE DES REGIONS		3,100	3,100	256	33,187	0.0
UNIBAIL RODAMCO-NA		9,570	10,670	2,327	301,176	0.1
ユーロ計	口数・金額	40,870	44,770	4,277	553,537	
	銘柄数<比率>	5	5	－	<0.1%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		215,000	239,000	15,176	213,381	0.1
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		260,000	260,000	1,887	26,539	0.0
小計	口数・金額	475,000	499,000	17,064	239,921	
	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	527	42,552	0.0
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		239,000	282,000	752	60,762	0.0
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		192,000	192,000	329	26,572	0.0
SUNTEC REIT		243,000	243,000	460	37,161	0.0
小計	口数・金額	923,900	966,900	2,069	167,048	
	銘柄数<比率>	4	4	－	<0.0%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
MIRVAC GROUP		340,000	381,000	857	74,777	0.0
GPT GROUP		179,000	179,000	895	78,070	0.0
LENDLEASE GROUP		53,000	61,000	1,006	87,796	0.0
STOCKLAND TRUST GROUP		227,000	244,000	1,058	92,373	0.0
DEXUS		91,000	113,000	1,082	94,429	0.0
GOODMAN GROUP		174,000	184,000	1,552	135,464	0.0
SCENTRE GROUP		505,000	575,000	2,317	202,133	0.0
WESTFIELD CORP		191,000	203,000	1,567	136,703	0.0
VICINITY CENTRES		328,704	373,000	999	87,198	0.0
小計	口数・金額	2,088,704	2,313,000	11,337	988,949	
	銘柄数<比率>	9	9	－	<0.2%>	
合計	口数・金額	5,651,304	6,120,320	－	10,406,484	
	銘柄数<比率>	68	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			当期末 買建額	当期末 売建額
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	CAN60	277	－
		EURO50	982	－
		FT100	525	－
		SPI200	213	－
		SPEMINI	4,790	－
		SWISSMKT	257	－

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

＜国内債券マザーファンド＞

下記は、国内債券マザーファンド全体(11,881,687千口)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	14,582,000	15,844,445	99.6	－	63.2	25.2	11.3
	(10,000)	(14,121)	(0.1)	(－)	(0.1)	(－)	(－)
合計	14,582,000	15,844,445	99.6	－	63.2	25.2	11.3
	(10,000)	(14,121)	(0.1)	(－)	(0.1)	(－)	(－)

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

(B)国内(邦貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券　利付（２年）第369回	0.1	100,000	100,253	2018/10/15
国庫債券　利付（２年）第370回	0.1	100,000	100,272	2018/11/15
国庫債券　利付（２年）第371回	0.1	80,000	80,232	2018/12/15
国庫債券　利付（２年）第372回	0.1	120,000	120,370	2019/１/15
国庫債券　利付（２年）第373回	0.1	130,000	130,425	2019/２/15
国庫債券　利付（２年）第374回	0.1	220,000	220,756	2019/３/15
国庫債券　利付（２年）第375回	0.1	70,000	70,259	2019/４/15
国庫債券　利付（２年）第376回	0.1	90,000	90,351	2019/５/15
国庫債券　利付（２年）第377回	0.1	80,000	80,327	2019/６/15
国庫債券　利付（２年）第378回	0.1	20,000	20,085	2019/７/15
国庫債券　利付（５年）第116回	0.2	150,000	150,639	2018/12/20
国庫債券　利付（５年）第117回	0.2	180,000	180,909	2019/３/20
国庫債券　利付（５年）第118回	0.2	110,000	110,655	2019/６/20
国庫債券　利付（５年）第120回	0.2	110,000	110,722	2019/９/20
国庫債券　利付（５年）第121回	0.1	100,000	100,448	2019/９/20
国庫債券　利付（５年）第122回	0.1	200,000	200,980	2019/12/20
国庫債券　利付（５年）第123回	0.1	260,000	261,375	2020/３/20
国庫債券　利付（５年）第124回	0.1	220,000	221,278	2020/６/20
国庫債券　利付（５年）第125回	0.1	180,000	181,139	2020/９/20
国庫債券　利付（５年）第126回	0.1	160,000	161,096	2020/12/20
国庫債券　利付（５年）第127回	0.1	200,000	201,436	2021/３/20
国庫債券　利付（５年）第128回	0.1	230,000	231,722	2021/６/20
国庫債券　利付（５年）第129回	0.1	170,000	171,358	2021/９/20
国庫債券　利付（５年）第130回	0.1	240,000	241,982	2021/12/20
国庫債券　利付（５年）第131回	0.1	150,000	151,309	2022/３/20
国庫債券　利付（５年）第132回	0.1	110,000	110,986	2022/６/20
国庫債券　利付（40年）第１回	2.4	10,000	14,121	2048/３/20
国庫債券　利付（40年）第２回	2.2	30,000	40,845	2049/３/20
国庫債券　利付（40年）第３回	2.2	20,000	27,271	2050/３/20
国庫債券　利付（40年）第４回	2.2	35,000	47,842	2051/３/20
国庫債券　利付（40年）第５回	2.0	40,000	52,362	2052/３/20
国庫債券　利付（40年）第６回	1.9	50,000	63,991	2053/３/20
国庫債券　利付（40年）第７回	1.7	30,000	36,504	2054/３/20
国庫債券　利付（40年）第８回	1.4	40,000	44,860	2055/３/20
国庫債券　利付（40年）第９回	0.4	30,000	23,987	2056/３/20
国庫債券　利付（40年）第10回	0.9	30,000	28,581	2057/３/20
国庫債券　利付（10年）第296回	1.5	65,000	66,140	2018/９/20
国庫債券　利付（10年）第297回	1.4	40,000	40,813	2018/12/20
国庫債券　利付（10年）第298回	1.3	20,000	20,380	2018/12/20
国庫債券　利付（10年）第299回	1.3	45,000	46,013	2019/３/20
国庫債券　利付（10年）第300回	1.5	35,000	35,899	2019/３/20
国庫債券　利付（10年）第301回	1.5	45,000	46,341	2019/６/20
国庫債券　利付（10年）第302回	1.4	40,000	41,118	2019/６/20
国庫債券　利付（10年）第303回	1.4	45,000	46,422	2019/９/20
国庫債券　利付（10年）第304回	1.3	30,000	30,885	2019/９/20
国庫債券　利付（10年）第305回	1.3	110,000	113,637	2019/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券　利付（10年）第306回	1.4	45,000	46,756	2020/3/20
国庫債券　利付（10年）第307回	1.3	30,000	31,093	2020/3/20
国庫債券　利付（10年）第308回	1.3	30,000	31,191	2020/6/20
国庫債券　利付（10年）第309回	1.1	130,000	134,426	2020/6/20
国庫債券　利付（10年）第310回	1.0	30,000	31,020	2020/9/20
国庫債券　利付（10年）第311回	0.8	130,000	133,616	2020/9/20
国庫債券　利付（10年）第312回	1.2	70,000	73,041	2020/12/20
国庫債券　利付（10年）第314回	1.1	30,000	31,287	2021/3/20
国庫債券　利付（10年）第315回	1.2	70,000	73,484	2021/6/20
国庫債券　利付（10年）第316回	1.1	10,000	10,459	2021/6/20
国庫債券　利付（10年）第317回	1.1	30,000	31,469	2021/9/20
国庫債券　利付（10年）第318回	1.0	80,000	83,589	2021/9/20
国庫債券　利付（10年）第319回	1.1	70,000	73,621	2021/12/20
国庫債券　利付（10年）第320回	1.0	90,000	94,265	2021/12/20
国庫債券　利付（10年）第321回	1.0	40,000	41,994	2022/3/20
国庫債券　利付（10年）第322回	0.9	130,000	135,885	2022/3/20
国庫債券　利付（10年）第323回	0.9	120,000	125,701	2022/6/20
国庫債券　利付（10年）第324回	0.8	70,000	72,986	2022/6/20
国庫債券　利付（10年）第325回	0.8	130,000	135,801	2022/9/20
国庫債券　利付（10年）第326回	0.7	60,000	62,488	2022/12/20
国庫債券　利付（10年）第327回	0.8	80,000	83,746	2022/12/20
国庫債券　利付（10年）第328回	0.6	110,000	114,126	2023/3/20
国庫債券　利付（10年）第329回	0.8	130,000	136,580	2023/6/20
国庫債券　利付（10年）第330回	0.8	110,000	115,738	2023/9/20
国庫債券　利付（10年）第331回	0.6	120,000	124,796	2023/9/20
国庫債券　利付（10年）第332回	0.6	200,000	208,322	2023/12/20
国庫債券　利付（10年）第333回	0.6	190,000	198,215	2024/3/20
国庫債券　利付（10年）第334回	0.6	180,000	188,017	2024/6/20
国庫債券　利付（10年）第335回	0.5	140,000	145,420	2024/9/20
国庫債券　利付（10年）第336回	0.5	130,000	135,161	2024/12/20
国庫債券　利付（10年）第337回	0.3	30,000	30,738	2024/12/20
国庫債券　利付（10年）第338回	0.4	140,000	144,572	2025/3/20
国庫債券　利付（10年）第339回	0.4	190,000	196,256	2025/6/20
国庫債券　利付（10年）第340回	0.4	125,000	129,197	2025/9/20
国庫債券　利付（10年）第341回	0.3	150,000	153,813	2025/12/20
国庫債券　利付（10年）第342回	0.1	190,000	191,546	2026/3/20
国庫債券　利付（10年）第343回	0.1	140,000	141,111	2026/6/20
国庫債券　利付（10年）第344回	0.1	190,000	191,377	2026/9/20
国庫債券　利付（10年）第345回	0.1	160,000	161,116	2026/12/20
国庫債券　利付（10年）第346回	0.1	180,000	181,202	2027/3/20
国庫債券　利付（10年）第347回	0.1	130,000	130,763	2027/6/20
国庫債券　利付（30年）第３回	2.3	40,000	50,723	2030/5/20
国庫債券　利付（30年）第５回	2.2	10,000	12,675	2031/5/20
国庫債券　利付（30年）第６回	2.4	10,000	13,002	2031/11/20
国庫債券　利付（30年）第７回	2.3	15,000	19,372	2032/5/20
国庫債券　利付（30年）第８回	1.8	20,000	24,447	2032/11/22
国庫債券　利付（30年）第10回	1.1	60,000	67,043	2033/3/20
国庫債券　利付（30年）第11回	1.7	10,000	12,088	2033/6/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券　利付（30年）第12回	2.1	10,000	12,722	2033/9/20
国庫債券　利付（30年）第13回	2.0	10,000	12,578	2033/12/20
国庫債券　利付（30年）第14回	2.4	30,000	39,667	2034/3/20
国庫債券　利付（30年）第15回	2.5	10,000	13,417	2034/6/20
国庫債券　利付（30年）第16回	2.5	10,000	13,433	2034/9/20
国庫債券　利付（30年）第17回	2.4	10,000	13,295	2034/12/20
国庫債券　利付（30年）第18回	2.3	20,000	26,262	2035/3/20
国庫債券　利付（30年）第19回	2.3	10,000	13,162	2035/6/20
国庫債券　利付（30年）第20回	2.5	10,000	13,518	2035/9/20
国庫債券　利付（30年）第21回	2.3	10,000	13,188	2035/12/20
国庫債券　利付（30年）第22回	2.5	20,000	27,075	2036/3/20
国庫債券　利付（30年）第23回	2.5	40,000	54,234	2036/6/20
国庫債券　利付（30年）第24回	2.5	10,000	13,578	2036/9/20
国庫債券　利付（30年）第25回	2.3	20,000	26,462	2036/12/20
国庫債券　利付（30年）第26回	2.4	20,000	26,848	2037/3/20
国庫債券　利付（30年）第27回	2.5	20,000	27,250	2037/9/20
国庫債券　利付（30年）第28回	2.5	30,000	41,003	2038/3/20
国庫債券　利付（30年）第29回	2.4	20,000	27,015	2038/9/20
国庫債券　利付（30年）第30回	2.3	50,000	66,749	2039/3/20
国庫債券　利付（30年）第31回	2.2	30,000	39,552	2039/9/20
国庫債券　利付（30年）第32回	2.3	40,000	53,681	2040/3/20
国庫債券　利付（30年）第33回	2.0	70,000	89,686	2040/9/20
国庫債券　利付（30年）第34回	2.2	40,000	53,055	2041/3/20
国庫債券　利付（30年）第35回	2.0	82,000	105,379	2041/9/20
国庫債券　利付（30年）第36回	2.0	70,000	90,122	2042/3/20
国庫債券　利付（30年）第37回	1.9	60,000	75,928	2042/9/20
国庫債券　利付（30年）第38回	1.8	50,000	62,201	2043/3/20
国庫債券　利付（30年）第39回	1.9	100,000	126,804	2043/6/20
国庫債券　利付（30年）第40回	1.8	30,000	37,360	2043/9/20
国庫債券　利付（30年）第41回	1.7	60,000	73,339	2043/12/20
国庫債券　利付（30年）第42回	1.7	60,000	73,362	2044/3/20
国庫債券　利付（30年）第43回	1.7	50,000	61,155	2044/6/20
国庫債券　利付（30年）第44回	1.7	50,000	61,174	2044/9/20
国庫債券　利付（30年）第45回	1.5	40,000	46,964	2044/12/20
国庫債券　利付（30年）第46回	1.5	60,000	70,443	2045/3/20
国庫債券　利付（30年）第47回	1.6	60,000	71,907	2045/6/20
国庫債券　利付（30年）第48回	1.4	70,000	80,367	2045/9/20
国庫債券　利付（30年）第49回	1.4	50,000	57,392	2045/12/20
国庫債券　利付（30年）第50回	0.8	60,000	59,652	2046/3/20
国庫債券　利付（30年）第51回	0.3	30,000	25,938	2046/6/20
国庫債券　利付（30年）第52回	0.5	40,000	36,522	2046/9/20
国庫債券　利付（30年）第54回	0.8	90,000	88,936	2047/3/20
国庫債券　利付（20年）第41回	1.5	30,000	30,768	2019/3/20
国庫債券　利付（20年）第42回	2.6	10,000	10,430	2019/3/20
国庫債券　利付（20年）第43回	2.9	10,000	10,628	2019/9/20
国庫債券　利付（20年）第44回	2.5	10,000	10,672	2020/3/20
国庫債券　利付（20年）第45回	2.4	10,000	10,646	2020/3/20
国庫債券　利付（20年）第46回	2.2	5,000	5,327	2020/6/22

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47回	2.2	15,000	16,065	2020/9/21
国庫債券　利付（20年）第48回	2.5	30,000	32,609	2020/12/21
国庫債券　利付（20年）第49回	2.1	40,000	43,156	2021/3/22
国庫債券　利付（20年）第52回	2.1	25,000	27,239	2021/9/21
国庫債券　利付（20年）第53回	2.1	10,000	10,949	2021/12/20
国庫債券　利付（20年）第54回	2.2	10,000	10,993	2021/12/20
国庫債券　利付（20年）第55回	2.0	10,000	10,961	2022/3/21
国庫債券　利付（20年）第56回	2.0	10,000	11,013	2022/6/20
国庫債券　利付（20年）第57回	1.9	10,000	10,965	2022/6/20
国庫債券　利付（20年）第58回	1.9	10,000	11,010	2022/9/20
国庫債券　利付（20年）第59回	1.7	30,000	32,850	2022/12/20
国庫債券　利付（20年）第60回	1.4	10,000	10,789	2022/12/20
国庫債券　利付（20年）第61回	1.0	10,000	10,599	2023/3/20
国庫債券　利付（20年）第62回	0.8	10,000	10,506	2023/6/20
国庫債券　利付（20年）第63回	1.8	10,000	11,091	2023/6/20
国庫債券　利付（20年）第64回	1.9	10,000	11,196	2023/9/20
国庫債券　利付（20年）第65回	1.9	10,000	11,242	2023/12/20
国庫債券　利付（20年）第66回	1.8	20,000	22,357	2023/12/20
国庫債券　利付（20年）第67回	1.9	10,000	11,286	2024/3/20
国庫債券　利付（20年）第68回	2.2	10,000	11,484	2024/3/20
国庫債券　利付（20年）第69回	2.1	30,000	34,256	2024/3/20
国庫債券　利付（20年）第70回	2.4	40,000	46,700	2024/6/20
国庫債券　利付（20年）第71回	2.2	10,000	11,538	2024/6/20
国庫債券　利付（20年）第72回	2.1	20,000	23,047	2024/9/20
国庫債券　利付（20年）第73回	2.0	10,000	11,500	2024/12/20
国庫債券　利付（20年）第74回	2.1	10,000	11,573	2024/12/20
国庫債券　利付（20年）第75回	2.1	40,000	46,488	2025/3/20
国庫債券　利付（20年）第76回	1.9	17,000	19,499	2025/3/20
国庫債券　利付（20年）第77回	2.0	15,000	17,319	2025/3/20
国庫債券　利付（20年）第78回	1.9	10,000	11,510	2025/6/20
国庫債券　利付（20年）第79回	2.0	10,000	11,588	2025/6/20
国庫債券　利付（20年）第80回	2.1	10,000	11,667	2025/6/20
国庫債券　利付（20年）第81回	2.0	10,000	11,630	2025/9/20
国庫債券　利付（20年）第82回	2.1	15,000	17,567	2025/9/20
国庫債券　利付（20年）第83回	2.1	15,000	17,639	2025/12/20
国庫債券　利付（20年）第84回	2.0	50,000	58,380	2025/12/20
国庫債券　利付（20年）第85回	2.1	13,000	15,341	2026/3/20
国庫債券　利付（20年）第86回	2.3	10,000	11,972	2026/3/20
国庫債券　利付（20年）第88回	2.3	20,000	24,051	2026/6/20
国庫債券　利付（20年）第90回	2.2	20,000	23,952	2026/9/20
国庫債券　利付（20年）第91回	2.3	10,000	12,066	2026/9/20
国庫債券　利付（20年）第92回	2.1	30,000	35,795	2026/12/20
国庫債券　利付（20年）第93回	2.0	20,000	23,774	2027/3/20
国庫債券　利付（20年）第94回	2.1	20,000	23,965	2027/3/20
国庫債券　利付（20年）第95回	2.3	10,000	12,212	2027/6/20
国庫債券　利付（20年）第96回	2.1	15,000	18,025	2027/6/20
国庫債券　利付（20年）第97回	2.2	50,000	60,783	2027/9/20
国庫債券　利付（20年）第99回	2.1	130,000	157,229	2027/12/20

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100回	2.2	20,000	24,473	2028/3/20
国庫債券　利付（20年）第101回	2.4	20,000	24,893	2028/3/20
国庫債券　利付（20年）第102回	2.4	20,000	24,982	2028/6/20
国庫債券　利付（20年）第103回	2.3	25,000	30,959	2028/6/20
国庫債券　利付（20年）第104回	2.1	10,000	12,168	2028/6/20
国庫債券　利付（20年）第105回	2.1	70,000	85,438	2028/9/20
国庫債券　利付（20年）第106回	2.2	10,000	12,315	2028/9/20
国庫債券　利付（20年）第107回	2.1	20,000	24,481	2028/12/20
国庫債券　利付（20年）第108回	1.9	50,000	60,084	2028/12/20
国庫債券　利付（20年）第109回	1.9	10,000	12,046	2029/3/20
国庫債券　利付（20年）第110回	2.1	20,000	24,550	2029/3/20
国庫債券　利付（20年）第111回	2.2	10,000	12,426	2029/6/20
国庫債券　利付（20年）第112回	2.1	35,000	43,083	2029/6/20
国庫債券　利付（20年）第113回	2.1	40,000	49,373	2029/9/20
国庫債券　利付（20年）第114回	2.1	30,000	37,127	2029/12/20
国庫債券　利付（20年）第115回	2.2	10,000	12,497	2029/12/20
国庫債券　利付（20年）第116回	2.2	10,000	12,530	2030/3/20
国庫債券　利付（20年）第117回	2.1	60,000	74,443	2030/3/20
国庫債券　利付（20年）第118回	2.0	40,000	49,252	2030/6/20
国庫債券　利付（20年）第119回	1.8	50,000	60,309	2030/6/20
国庫債券　利付（20年）第120回	1.6	50,000	59,014	2030/6/20
国庫債券　利付（20年）第121回	1.9	40,000	48,855	2030/9/20
国庫債券　利付（20年）第122回	1.8	20,000	24,172	2030/9/20
国庫債券　利付（20年）第123回	2.1	10,000	12,499	2030/12/20
国庫債券　利付（20年）第124回	2.0	20,000	24,738	2030/12/20
国庫債券　利付（20年）第125回	2.2	100,000	126,605	2031/3/20
国庫債券　利付（20年）第126回	2.0	30,000	37,162	2031/3/20
国庫債券　利付（20年）第127回	1.9	20,000	24,510	2031/3/20
国庫債券　利付（20年）第128回	1.9	70,000	85,956	2031/6/20
国庫債券　利付（20年）第129回	1.8	20,000	24,290	2031/6/20
国庫債券　利付（20年）第130回	1.8	70,000	85,106	2031/9/20
国庫債券　利付（20年）第131回	1.7	35,000	42,075	2031/9/20
国庫債券　利付（20年）第132回	1.7	30,000	36,093	2031/12/20
国庫債券　利付（20年）第133回	1.8	40,000	48,679	2031/12/20
国庫債券　利付（20年）第134回	1.8	30,000	36,540	2032/3/20
国庫債券　利付（20年）第135回	1.7	15,000	18,059	2032/3/20
国庫債券　利付（20年）第136回	1.6	50,000	59,494	2032/3/20
国庫債券　利付（20年）第137回	1.7	10,000	12,056	2032/6/20
国庫債券　利付（20年）第139回	1.6	10,000	11,904	2032/6/20
国庫債券　利付（20年）第140回	1.7	40,000	48,254	2032/9/20
国庫債券　利付（20年）第141回	1.7	70,000	84,487	2032/12/20
国庫債券　利付（20年）第142回	1.8	20,000	24,433	2032/12/20
国庫債券　利付（20年）第143回	1.6	40,000	47,703	2033/3/20
国庫債券　利付（20年）第144回	1.5	70,000	82,439	2033/3/20
国庫債券　利付（20年）第145回	1.7	70,000	84,618	2033/6/20
国庫債券　利付（20年）第146回	1.7	60,000	72,553	2033/9/20
国庫債券　利付（20年）第147回	1.6	90,000	107,461	2033/12/20
国庫債券　利付（20年）第148回	1.5	60,000	70,700	2034/3/20

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149回	1.5	70,000	82,532	2034/6/20
国庫債券　利付（20年）第150回	1.4	50,000	58,134	2034/9/20
国庫債券　利付（20年）第151回	1.2	100,000	112,966	2034/12/20
国庫債券　利付（20年）第152回	1.2	50,000	56,430	2035/3/20
国庫債券　利付（20年）第153回	1.3	110,000	125,952	2035/6/20
国庫債券　利付（20年）第154回	1.2	120,000	135,274	2035/9/20
国庫債券　利付（20年）第155回	1.0	120,000	130,954	2035/12/20
国庫債券　利付（20年）第156回	0.4	80,000	78,640	2036/3/20
国庫債券　利付（20年）第157回	0.2	40,000	37,772	2036/6/20
国庫債券　利付（20年）第158回	0.5	60,000	59,739	2036/9/20
国庫債券　利付（20年）第159回	0.6	70,000	70,796	2036/12/20
国庫債券　利付（20年）第160回	0.7	70,000	71,919	2037/3/20
国庫債券　利付（20年）第161回	0.6	60,000	60,374	2037/6/20
合計		14,582,000	15,844,445	

＊額面・評価額の単位未満は切り捨て。

＜野村マネー マザーファンド＞

下記は、野村マネー マザーファンド全体(17,391,803千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うちＢＢ格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					５年以上	２年以上	２年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
地方債証券	3,920,000	3,931,303	22.1	－	－	－	22.1
	(3,920,000)	(3,931,303)	(22.1)	(－)	(－)	(－)	(22.1)
特殊債券(除く金融債)	1,805,000	1,807,476	10.2	－	－	－	10.2
	(1,805,000)	(1,807,476)	(10.2)	(－)	(－)	(－)	(10.2)
金融債券	2,090,000	2,090,810	11.8	－	－	－	11.8
	(2,090,000)	(2,090,810)	(11.8)	(－)	(－)	(－)	(11.8)
普通社債券(含む投資法人債券)	4,030,000	4,035,560	22.7	－	－	－	22.7
	(4,030,000)	(4,035,560)	(22.7)	(－)	(－)	(－)	(22.7)
合計	11,845,000	11,865,152	66.8	－	－	－	66.8
	(11,845,000)	(11,865,152)	(66.8)	(－)	(－)	(－)	(66.8)

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

(B)国内(邦貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
東京都　公募第651回	1.62	50,000	50,070	2017/9/20
神奈川県　公募（5年）第52回	0.26	360,000	360,097	2017/9/20
神奈川県　公募（5年）第53回	0.231	480,000	480,109	2017/9/20
大阪府　公募（5年）第86回	0.23	100,000	100,026	2017/9/27
大阪府　公募（5年）第89回	0.2	190,000	190,136	2017/12/27
京都府　公募平成24年度第9回	0.14	30,000	30,027	2018/3/22
静岡県　公募（5年）平成24年度第8回	0.236	170,000	170,063	2017/10/18
岐阜県　公募平成19年度第1回	1.87	150,000	150,526	2017/10/26
共同発行市場地方債　公募第54回	1.7	100,000	100,180	2017/9/25
共同発行市場地方債　公募第57回	1.65	900,000	905,238	2017/12/25
大阪市　公募平成19年度第10回	1.74	800,000	804,562	2017/12/19
鹿児島県　公募（5年）平成24年度第1回	0.22	590,000	590,264	2017/10/31
小計		3,920,000	3,931,303	
特殊債券(除く金融債)				
公営企業債券　政府保証第885回	1.7	33,000	33,420	2018/5/22
政保　地方公共団体金融機構債券（6年）　第1回	0.4	70,000	70,036	2017/9/27
政保　地方公共団体金融機構債券（6年）　第3回	0.4	20,000	20,035	2018/1/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第47回	1.5	4,000	4,021	2017/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第49回	1.5	42,000	42,281	2018/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第52回	1.6	44,000	44,368	2018/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第56回	1.4	25,000	25,231	2018/4/20
東日本高速道路債券　政府保証第10回	1.5	77,000	77,387	2017/12/21
新関西国際空港社債　財投機関債第10回	0.161	260,000	260,035	2017/9/20
首都高速道路　第11回	0.279	500,000	500,476	2017/12/20
住宅金融支援機構債券　財投機関債第5回	2.01	600,000	600,131	2017/8/21
東日本高速道路　第18回	0.387	130,000	130,051	2017/9/20
小計		1,805,000	1,807,476	
金融債券				
商工債券　利付第748回い号	0.3	200,000	200,075	2017/9/27
商工債券　利付第751回い号	0.25	120,000	120,103	2017/12/27
農林債券　利付第747回い号	0.35	370,000	370,033	2017/8/25
しんきん中金債券　利付第274回	0.3	1,000,000	1,000,351	2017/9/27
商工債券　利付（3年）第179回	0.14	400,000	400,246	2017/12/27
小計		2,090,000	2,090,810	
普通社債券(含む投資法人債券)				
関西電力　第400回	3.1	100,000	100,074	2017/8/25
関西電力　第458回	1.83	100,000	100,163	2017/9/20
北陸電力　第288回	1.89	240,000	240,800	2017/10/25
四国電力　第265回	1.79	300,000	300,122	2017/8/25
四国電力　第276回	0.592	200,000	200,123	2017/9/25
九州電力　第417回	0.641	340,000	340,058	2017/8/25
北海道電力　第293回	1.86	100,000	100,188	2017/9/25
北海道電力　第322回	0.3	350,000	350,359	2017/12/25
トヨタ自動車　第12回社債間限定同等特約付	0.317	500,000	500,159	2017/9/20
みずほコーポレート銀行　第31回特定社債間限定同順位特約付	0.33	300,000	300,188	2017/10/25
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	300,000	301,264	2018/8/6

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	
住友不動産　第84回社債間限定同順位特約付	0.388	100,000	100,200	2018/2/28
東日本旅客鉄道　第７回社債間限定同順位特約付	3.3	600,000	600,449	2017/8/25
東日本旅客鉄道　第50回社債間限定同順位特約付	1.86	100,000	100,174	2017/9/20
東海旅客鉄道　第３回	2.825	200,000	201,126	2017/10/30
電源開発　第34回社債間限定同順位特約付	0.592	200,000	200,107	2017/9/20
小計		4,030,000	4,035,560	
合計		11,845,000	11,865,152	

＊額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

区分	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
コマーシャル・ペーパー	899,993	5.1

＊比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。
＊金額の単位未満は切り捨て。

＜外国債券マザーファンド＞

下記は、外国債券マザーファンド全体(290,931,832千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債　種類別開示

区　　分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	2,438,420	2,543,819	279,820,162	43.0	－	17.9	16.8	8.3
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	145,830	159,691	13,907,536	2.1	－	0.9	0.7	0.5
	千英ポンド	千英ポンド						
イギリス	240,030	312,817	44,348,196	6.8	－	5.1	1.5	0.2
	千スイスフラン	千スイスフラン						
スイス	8,350	10,394	1,184,208	0.2	－	0.1	0.1	－
	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
スウェーデン	200,150	229,750	3,129,199	0.5	－	0.3	0.2	－
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	128,300	138,526	1,922,745	0.3	－	0.2	0.1	0.1
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	186,970	234,016	4,071,892	0.6	－	0.4	0.2	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	256,800	324,269	41,967,002	6.4	－	4.3	1.8	0.3
イタリア	425,730	513,123	66,408,412	10.2	－	6.4	2.9	1.0
フランス	397,500	501,783	64,940,794	10.0	－	6.8	2.5	0.6
オランダ	84,000	103,577	13,404,990	2.1	－	1.5	0.4	0.2
スペイン	251,800	313,501	40,573,336	6.2	－	4.0	1.7	0.5
ベルギー	100,000	129,688	16,784,231	2.6	－	2.0	0.5	0.1
オーストリア	60,000	74,549	9,648,181	1.5	－	1.0	0.4	0.1
フィンランド	22,500	25,402	3,287,623	0.5	－	0.3	0.1	0.0
アイルランド	45,630	52,495	6,794,005	1.0	－	0.5	0.3	0.2
	千ズロチ	千ズロチ						
ポーランド	127,500	134,714	4,085,877	0.6	－	0.3	0.3	0.1
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	29,380	31,043	2,505,201	0.4	－	0.2	0.1	0.1
	千リンギ	千リンギ						
マレーシア	108,200	108,567	2,782,583	0.4	－	0.2	0.2	0.0
	千豪ドル	千豪ドル						
オーストラリア	152,390	163,947	14,301,168	2.2	－	1.3	0.7	0.2
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	880,900	928,044	5,781,716	0.9	－	0.5	0.3	0.1
	千ランド	千ランド						
南アフリカ	458,300	421,719	3,521,354	0.5	－	0.5	0.1	0.0
合　　計	－	－	645,170,423	99.1	－	54.7	31.8	12.6

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

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY BOND	8.125	21,390	24,253	2,667,875	2019/8/15
		US TREASURY BOND	8.75	12,700	15,393	1,693,262	2020/8/15
		US TREASURY BOND	8.0	21,100	26,549	2,920,470	2021/11/15
		US TREASURY BOND	6.25	13,800	17,201	1,892,163	2023/8/15
		US TREASURY BOND	2.375	50,100	51,215	5,633,705	2024/8/15
		US TREASURY BOND	6.0	39,200	51,045	5,615,032	2026/2/15
		US TREASURY BOND	6.5	18,800	25,612	2,817,326	2026/11/15
		US TREASURY BOND	6.125	23,700	32,128	3,534,114	2027/11/15
		US TREASURY BOND	5.5	17,000	22,331	2,456,493	2028/8/15
		US TREASURY BOND	5.25	5,000	6,469	711,605	2028/11/15
		US TREASURY BOND	5.25	800	1,038	114,221	2029/2/15
		US TREASURY BOND	4.375	100	128	14,104	2038/2/15
		US TREASURY BOND	2.875	25,300	25,774	2,835,181	2043/5/15
		US TREASURY BOND	3.75	16,000	18,956	2,085,187	2043/11/15
		US TREASURY N/B	2.25	8,800	8,884	977,339	2018/7/31
		US TREASURY N/B	1.375	400	400	44,061	2018/7/31
		US TREASURY N/B	0.75	5,200	5,176	569,452	2018/7/31
		US TREASURY N/B	4.0	4,800	4,930	542,355	2018/8/15
		US TREASURY N/B	1.0	19,600	19,553	2,150,862	2018/8/15
		US TREASURY N/B	1.5	8,800	8,823	970,571	2018/8/31
		US TREASURY N/B	1.0	800	797	87,762	2018/9/15
		US TREASURY N/B	1.375	27,400	27,436	3,018,002	2018/9/30
		US TREASURY N/B	0.75	10,000	9,944	1,093,898	2018/9/30
		US TREASURY N/B	0.875	2,400	2,389	262,803	2018/10/15
		US TREASURY N/B	1.75	9,900	9,957	1,095,295	2018/10/31
		US TREASURY N/B	1.25	21,400	21,395	2,353,540	2018/10/31
		US TREASURY N/B	0.75	700	695	76,515	2018/10/31
		US TREASURY N/B	3.75	40,900	42,131	4,634,496	2018/11/15
		US TREASURY N/B	1.25	7,300	7,297	802,717	2018/11/15
		US TREASURY N/B	1.375	500	500	55,053	2018/11/30
		US TREASURY N/B	1.25	6,000	5,996	659,613	2018/11/30
		US TREASURY N/B	1.25	700	699	76,954	2018/12/15
		US TREASURY N/B	1.375	6,500	6,507	715,809	2018/12/31
		US TREASURY N/B	1.5	5,500	5,515	606,654	2018/12/31
		US TREASURY N/B	1.125	5,100	5,087	559,619	2019/1/15
		US TREASURY N/B	1.25	8,100	8,095	890,547	2019/1/31
		US TREASURY N/B	1.5	3,500	3,510	386,173	2019/1/31
		US TREASURY N/B	1.125	1,000	997	109,737	2019/1/31
		US TREASURY N/B	2.75	37,500	38,295	4,212,494	2019/2/15
		US TREASURY N/B	0.75	200	198	21,820	2019/2/15
		US TREASURY N/B	1.375	17,100	17,118	1,882,983	2019/2/28
		US TREASURY N/B	1.5	16,200	16,249	1,787,429	2019/2/28
		US TREASURY N/B	1.0	10,800	10,749	1,182,477	2019/3/15
		US TREASURY N/B	1.5	4,000	4,012	441,375	2019/3/31
		US TREASURY N/B	1.625	25,500	25,629	2,819,244	2019/3/31
		US TREASURY N/B	1.25	14,300	14,283	1,571,217	2019/3/31
		US TREASURY N/B	0.875	3,500	3,474	382,217	2019/4/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	1.25	5,000	4,993	549,248	2019/4/30
		US TREASURY N/B	1.625	5,600	5,627	619,031	2019/4/30
		US TREASURY N/B	3.125	27,600	28,454	3,130,044	2019/5/15
		US TREASURY N/B	0.875	3,600	3,572	392,983	2019/5/15
		US TREASURY N/B	1.125	1,400	1,395	153,494	2019/5/31
		US TREASURY N/B	1.5	10,600	10,632	1,169,552	2019/5/31
		US TREASURY N/B	1.25	2,100	2,097	230,720	2019/5/31
		US TREASURY N/B	0.875	900	892	98,199	2019/6/15
		US TREASURY N/B	1.0	1,400	1,391	153,115	2019/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	7,900	7,941	873,616	2019/6/30
		US TREASURY N/B	1.25	1,900	1,897	208,681	2019/6/30
		US TREASURY N/B	0.75	5,500	5,439	598,359	2019/7/15
		US TREASURY N/B	1.625	14,500	14,580	1,603,847	2019/7/31
		US TREASURY N/B	3.625	32,400	33,864	3,725,076	2019/8/15
		US TREASURY N/B	0.75	10,000	9,884	1,087,324	2019/8/15
		US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,979	327,795	2019/8/31
		US TREASURY N/B	1.625	9,750	9,805	1,078,574	2019/8/31
		US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,978	327,666	2019/9/30
		US TREASURY N/B	1.75	17,700	17,845	1,962,971	2019/9/30
		US TREASURY N/B	3.375	49,300	51,489	5,663,857	2019/11/15
		US TREASURY N/B	1.0	8,800	8,728	960,172	2019/11/30
		US TREASURY N/B	1.5	1,800	1,804	198,549	2019/11/30
		US TREASURY N/B	1.125	12,000	11,932	1,312,523	2019/12/31
		US TREASURY N/B	1.625	3,800	3,821	420,318	2019/12/31
		US TREASURY N/B	1.375	2,000	1,999	219,922	2020/1/31
		US TREASURY N/B	1.25	5,400	5,381	592,004	2020/1/31
		US TREASURY N/B	3.625	51,800	54,646	6,011,167	2020/2/15
		US TREASURY N/B	1.25	2,700	2,689	295,897	2020/2/29
		US TREASURY N/B	1.375	5,000	4,995	549,527	2020/2/29
		US TREASURY N/B	1.625	5,000	5,027	552,986	2020/3/15
		US TREASURY N/B	1.125	4,000	3,971	436,820	2020/3/31
		US TREASURY N/B	1.375	21,300	21,276	2,340,437	2020/3/31
		US TREASURY N/B	1.375	1,100	1,098	120,829	2020/4/30
		US TREASURY N/B	3.5	47,700	50,370	5,540,708	2020/5/15
		US TREASURY N/B	1.5	5,200	5,207	572,804	2020/5/31
		US TREASURY N/B	1.875	16,600	16,800	1,848,040	2020/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	12,400	12,457	1,370,287	2020/6/30
		US TREASURY N/B	2.0	14,000	14,213	1,563,460	2020/7/31
		US TREASURY N/B	2.625	42,180	43,590	4,794,943	2020/8/15
		US TREASURY N/B	2.125	37,600	38,305	4,213,550	2020/8/31
		US TREASURY N/B	2.0	6,000	6,090	669,900	2020/9/30
		US TREASURY N/B	1.75	1,600	1,611	177,237	2020/10/31
		US TREASURY N/B	2.625	52,600	54,406	5,984,667	2020/11/15
		US TREASURY N/B	2.375	6,800	6,982	768,102	2020/12/31
		US TREASURY N/B	2.125	5,300	5,398	593,885	2021/1/31
		US TREASURY N/B	1.375	7,000	6,952	764,826	2021/1/31
		US TREASURY N/B	3.625	45,800	49,006	5,390,660	2021/2/15
		US TREASURY N/B	2.0	5,000	5,071	557,863	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	9,842	1,082,640	2021/2/28
		US TREASURY N/B	2.25	1,800	1,841	202,547	2021/3/31
		US TREASURY N/B	2.25	10,900	11,150	1,226,539	2021/4/30
		US TREASURY N/B	3.125	38,400	40,502	4,455,329	2021/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	22,500	22,805	2,508,644	2021/5/31
		US TREASURY N/B	2.125	34,000	34,621	3,808,371	2021/6/30
		US TREASURY N/B	2.25	9,700	9,920	1,091,257	2021/7/31
		US TREASURY N/B	2.125	25,300	25,753	2,832,898	2021/8/15
		US TREASURY N/B	2.0	7,300	7,393	813,288	2021/8/31
		US TREASURY N/B	2.125	16,000	16,280	1,790,800	2021/9/30
		US TREASURY N/B	2.0	10,000	10,124	1,113,663	2021/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	26,000	26,337	2,897,090	2021/11/15
		US TREASURY N/B	1.875	8,000	8,058	886,462	2021/11/30
		US TREASURY N/B	2.125	12,400	12,610	1,387,124	2021/12/31
		US TREASURY N/B	1.5	8,000	7,922	871,475	2022/1/31
		US TREASURY N/B	1.875	10,000	10,061	1,106,788	2022/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	33,700	34,114	3,752,613	2022/2/15
		US TREASURY N/B	1.75	7,300	7,305	803,564	2022/2/28
		US TREASURY N/B	1.75	9,900	9,900	1,089,000	2022/3/31
		US TREASURY N/B	1.75	35,000	34,986	3,848,495	2022/4/30
		US TREASURY N/B	1.875	10,000	10,050	1,105,500	2022/4/30
		US TREASURY N/B	1.75	23,900	23,896	2,628,589	2022/5/15
		US TREASURY N/B	2.125	27,600	28,046	3,085,097	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	18,500	18,359	2,019,578	2022/8/15
		US TREASURY N/B	1.625	12,800	12,673	1,394,139	2022/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	13,000	13,182	1,450,109	2022/12/31
		US TREASURY N/B	1.75	22,000	21,871	2,405,820	2023/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	17,000	17,120	1,883,294	2023/2/15
		US TREASURY N/B	1.5	25,000	24,513	2,696,503	2023/2/28
		US TREASURY N/B	1.5	11,000	10,779	1,185,705	2023/3/31
		US TREASURY N/B	1.75	42,200	41,863	4,605,008	2023/5/15
		US TREASURY N/B	1.625	30,400	29,936	3,293,056	2023/5/31
		US TREASURY N/B	1.25	20,000	19,243	2,116,812	2023/7/31
		US TREASURY N/B	2.5	19,400	20,039	2,204,355	2023/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	16,800	17,598	1,935,780	2023/11/15
		US TREASURY N/B	2.75	26,800	28,054	3,085,956	2024/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	25,100	25,884	2,847,281	2024/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	34,200	34,643	3,810,788	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	44,700	44,417	4,885,884	2025/2/15
		US TREASURY N/B	2.125	6,500	6,507	715,781	2025/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	14,500	14,358	1,579,423	2025/8/15
		US TREASURY N/B	2.25	50,300	50,685	5,575,361	2025/11/15
		US TREASURY N/B	1.625	2,000	1,915	210,667	2026/2/15
		US TREASURY N/B	1.625	800	764	84,074	2026/5/15
		US TREASURY N/B	1.5	12,000	11,318	1,245,028	2026/8/15
		US TREASURY N/B	2.25	11,300	11,324	1,245,719	2027/2/15
		US TREASURY N/B	5.375	2,100	2,837	312,156	2031/2/15
		US TREASURY N/B	4.5	100	130	14,334	2038/5/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	3.5	100	113	12,533	2039/2/15
		US TREASURY N/B	4.25	400	505	55,587	2039/5/15
		US TREASURY N/B	4.5	400	522	57,461	2039/8/15
		US TREASURY N/B	4.375	3,500	4,496	494,634	2039/11/15
		US TREASURY N/B	4.625	8,000	10,631	1,169,506	2040/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	5,900	7,594	835,384	2040/5/15
		US TREASURY N/B	3.875	7,200	8,643	950,771	2040/8/15
		US TREASURY N/B	4.25	7,800	9,883	1,087,179	2040/11/15
		US TREASURY N/B	4.75	7,000	9,497	1,044,733	2041/2/15
		US TREASURY N/B	4.375	6,700	8,655	952,054	2041/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	6,500	6,945	763,988	2041/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	3,200	3,418	376,062	2042/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	4,500	4,701	517,197	2042/5/15
		US TREASURY N/B	2.75	9,300	9,281	1,021,001	2042/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	17,600	17,556	1,931,160	2042/11/15
		US TREASURY N/B	3.125	24,200	25,791	2,837,109	2043/2/15
		US TREASURY N/B	3.625	15,400	17,859	1,964,510	2043/8/15
		US TREASURY N/B	3.625	12,200	14,173	1,559,131	2044/2/15
		US TREASURY N/B	3.375	18,900	21,060	2,316,623	2044/5/15
		US TREASURY N/B	3.125	30,600	32,622	3,588,471	2044/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	36,900	38,436	4,228,019	2044/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	27,600	26,013	2,861,430	2045/2/15
		US TREASURY N/B	3.0	21,700	22,564	2,482,106	2045/5/15
		US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,028	223,179	2045/8/15
		US TREASURY N/B	3.0	15,100	15,688	1,725,752	2045/11/15
		US TREASURY N/B	2.5	12,500	11,729	1,290,244	2046/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	9,700	9,098	1,000,812	2046/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	300	266	29,300	2046/8/15
		US TREASURY N/B	2.875	4,000	4,051	445,706	2046/11/15
小計						279,820,162	
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	4,864	423,689	2022/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,100	2,087	181,793	2018/8/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	8,800	8,809	767,196	2018/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	10,000	9,920	863,976	2018/11/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	100	99	8,624	2019/2/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	4,500	4,538	395,294	2019/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	300	297	25,927	2019/5/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.75	10,000	10,444	909,620	2019/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	8,700	8,790	765,555	2019/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	6,300	6,337	551,904	2020/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	7,800	8,269	720,148	2020/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	2,800	2,751	239,657	2020/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	8,200	8,025	698,962	2021/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.25	10,050	10,738	935,226	2021/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	300	292	25,447	2021/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.5	2,800	2,679	233,378	2022/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	4,600	4,573	398,342	2023/6/1

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	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.5	5,700	5,996	522,226	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	6,600	6,842	595,952	2025/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	3,000	2,925	254,782	2026/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	3,700	5,722	498,410	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	3,300	3,044	265,166	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	5,680	7,909	688,824	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	3,400	5,040	439,012	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	5,300	7,618	663,503	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	3,900	5,094	443,669	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	3.5	9,500	11,783	1,026,218	2045/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	3,300	3,622	315,446	2048/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	500	569	49,576	2064/12/1
小計						13,907,536	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	1.75	8,800	9,057	1,284,142	2019/7/22
		UK TREASURY	3.75	1,700	1,824	258,660	2019/9/7
		UK TREASURY	4.75	1,700	1,897	268,985	2020/3/7
		UK TREASURY	2.0	19,190	20,164	2,858,716	2020/7/22
		UK TREASURY	3.75	7,400	8,191	1,161,288	2020/9/7
		UK TREASURY	1.5	2,500	2,600	368,665	2021/1/22
		UK TREASURY	8.0	9,340	12,065	1,710,460	2021/6/7
		UK TREASURY	3.75	8,670	9,866	1,398,755	2021/9/7
		UK TREASURY	4.0	4,850	5,639	799,543	2022/3/7
		UK TREASURY	0.5	6,100	6,097	864,468	2022/7/22
		UK TREASURY	1.75	8,700	9,244	1,310,523	2022/9/7
		UK TREASURY	2.25	5,100	5,590	792,546	2023/9/7
		UK TREASURY	2.75	10,250	11,654	1,652,237	2024/9/7
		UK TREASURY	5.0	11,850	15,502	2,197,860	2025/3/7
		UK TREASURY	4.25	9,530	12,444	1,764,224	2027/12/7
		UK TREASURY	6.0	5,350	8,094	1,147,488	2028/12/7
		UK TREASURY	4.75	5,700	8,042	1,140,132	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	5,750	7,863	1,114,755	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	6,600	9,455	1,340,551	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	3,800	5,373	761,758	2036/3/7
		UK TREASURY	4.75	4,400	6,779	961,194	2038/12/7
		UK TREASURY	4.25	4,200	6,113	866,713	2039/9/7
		UK TREASURY	4.25	5,300	7,812	1,107,610	2040/12/7
		UK TREASURY	4.5	6,100	9,480	1,344,067	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	20,000	27,306	3,871,171	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	5,950	9,291	1,317,258	2046/12/7
		UK TREASURY	1.5	1,000	938	133,036	2047/7/22
		UK TREASURY	4.25	5,350	8,665	1,228,568	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	8,750	13,454	1,907,497	2052/7/22
		UK TREASURY	1.75	1,100	1,130	160,251	2057/7/22
		UK TREASURY	2.5	500	646	91,583	2065/7/22
		UK TREASURY	3.5	6,200	10,238	1,451,537	2068/7/22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	20,300	26,428	3,746,778	2044/1/22

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
	国債証券	UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	4.25	8,000	13,861	1,965,159	2055/12/7
小計						44,348,196	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	SWITZERLAND GOVERNMENT	2.0	4,750	5,230	595,933	2021/4/28
		SWITZERLAND GOVERNMENT	4.0	3,600	5,163	588,275	2028/4/8
小計						1,184,208	
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	5.0	39,700	46,646	635,328	2020/12/1
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	53,400	62,243	847,750	2022/6/1
		SWEDISH GOVERNMENT	1.5	28,300	30,452	414,756	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	35,650	41,100	559,794	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	12,000	12,349	168,204	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	14,100	13,980	190,415	2028/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	17,000	22,977	312,951	2039/3/30
小計						3,129,199	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	4.5	24,800	26,491	367,700	2019/5/22
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.75	27,600	30,486	423,159	2021/5/25
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	14,300	14,930	207,237	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	44,900	49,713	690,020	2024/3/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	4,700	4,812	66,798	2025/3/13
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	4,700	4,695	65,174	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	7,300	7,395	102,656	2027/2/17
小計						1,922,745	
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	2,527	43,973	2018/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.0	34,300	37,834	658,328	2019/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	3.0	37,100	42,342	736,754	2021/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.5	31,370	34,306	596,928	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	31,400	35,177	612,087	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	4,000	3,976	69,191	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	46,300	77,852	1,354,629	2039/11/15
小計						4,071,892	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	0.25	5,000	5,102	660,352	2019/10/11
		BUNDESOBLIGATION	—	3,600	3,662	473,986	2020/4/17
		BUNDESOBLIGATION	0.25	3,000	3,079	398,603	2020/10/16
		BUNDESOBLIGATION	—	1,600	1,629	210,950	2021/4/9
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.5	14,100	15,231	1,971,227	2019/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	6,700	7,333	949,090	2020/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	4,100	4,532	586,581	2020/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	13,300	14,471	1,872,845	2020/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	13,300	14,689	1,901,177	2021/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	7,000	8,025	1,038,669	2021/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.25	8,400	9,329	1,207,462	2021/9/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	11,500	12,721	1,646,405	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	6,500	7,164	927,178	2022/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,000	5,458	706,413	2022/9/4

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	1.5	5,200	5,694	737,038	2023/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	5,200	5,706	738,505	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	14,000	15,813	2,046,609	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	14,100	19,806	2,563,363	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	5,700	6,383	826,114	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,500	1,657	214,459	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	10,300	11,029	1,427,430	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	4,700	4,851	627,866	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	3,200	3,419	442,537	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,300	1,330	172,248	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	3,000	2,965	383,775	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	19,400	30,972	4,008,484	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.625	6,000	9,181	1,188,277	2028/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	3,400	4,945	640,038	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	6,500	10,917	1,412,913	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	5,300	8,604	1,113,635	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	5,800	9,407	1,217,530	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	5,000	7,744	1,002,308	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	7,000	11,489	1,486,953	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	8,200	14,466	1,872,275	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	3,900	5,729	741,500	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	6,500	8,508	1,101,177	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	8,500	11,211	1,451,014	2046/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	9,600	10,044	1,299,993	2018/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	8,000	8,387	1,085,471	2018/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	16,300	17,361	2,246,919	2019/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,800	3,004	388,872	2019/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.1	500	502	65,051	2019/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	7,900	8,264	1,069,653	2019/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	1,800	1,857	240,396	2019/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	11,430	12,444	1,610,629	2019/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.05	400	409	53,046	2019/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	6,100	6,767	875,829	2020/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	29,200	32,312	4,181,912	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	16,200	18,087	2,340,858	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	2,000	2,028	262,541	2020/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	11,400	12,791	1,655,491	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	9,000	10,121	1,309,911	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	8,000	9,036	1,169,439	2021/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	12,800	14,990	1,940,016	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	4,550	4,519	584,962	2021/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	16,800	20,035	2,593,017	2022/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	9,600	11,797	1,526,824	2022/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	20,700	25,521	3,302,931	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	4,000	3,985	515,816	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	6,700	7,968	1,031,237	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	9,300	11,255	1,456,724	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	11,700	17,127	2,216,657	2023/11/1

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	4.5	15,900	19,017	2,461,308	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	3,000	3,083	399,014	2024/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	2,300	2,644	342,226	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	14,900	18,498	2,394,056	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	3,000	2,967	384,078	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	3,000	3,057	395,714	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	10,500	12,754	1,650,667	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	7.25	7,200	10,484	1,356,922	2026/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	19,050	26,830	3,472,341	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	6,300	7,864	1,017,877	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	20,700	27,189	3,518,858	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	18,300	25,910	3,353,397	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	454	58,789	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	6,400	9,006	1,165,649	2033/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,400	11,092	1,435,552	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	6,700	7,932	1,026,576	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	8,000	10,637	1,376,718	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	15,600	20,607	2,667,035	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	11,600	14,960	1,936,190	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	6,100	6,219	804,935	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	1,500	1,284	166,291	2067/3/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0	11,300	11,618	1,503,632	2019/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	10,300	10,546	1,364,909	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	－	2,800	2,836	367,057	2020/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	－	1,100	1,114	144,231	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	7,000	7,055	913,064	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	12,000	14,113	1,826,607	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	600	583	75,524	2036/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	6,000	6,122	792,336	2018/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	－	1,300	1,311	169,793	2019/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	11,500	12,445	1,610,710	2019/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	4,000	4,798	620,958	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	11,500	12,595	1,630,050	2019/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	14,800	16,398	2,122,340	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.5	27,300	29,878	3,866,873	2020/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	0.25	2,000	2,042	264,353	2020/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.75	11,800	13,600	1,760,123	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	15,100	17,341	2,244,392	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.0	14,500	16,666	2,157,042	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	20,100	22,534	2,916,372	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8.5	8,200	12,202	1,579,237	2023/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	31,300	39,389	5,097,787	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	3,000	3,316	429,242	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	19,800	28,745	3,720,260	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	6,000	6,249	808,823	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	33,100	41,477	5,368,032	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	9,200	10,987	1,422,010	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	24,500	37,079	4,798,847	2029/4/25

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	1,000	1,049	135,826	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	19,600	32,240	4,172,505	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	6,600	10,230	1,324,000	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	8,800	12,941	1,674,862	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	16,900	26,889	3,480,050	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	15,200	20,427	2,643,698	2045/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	5,500	8,754	1,133,016	2055/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	3,800	6,198	802,215	2060/4/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	1.25	3,400	3,493	452,089	2019/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	6,500	7,080	916,351	2019/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	2,000	2,041	264,210	2020/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	4,800	5,372	695,264	2020/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	7,900	9,045	1,170,649	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	－	400	405	52,463	2022/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.25	1,500	1,684	218,026	2022/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	5,900	7,145	924,769	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	4,300	6,092	788,457	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	1,400	1,551	200,855	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	13,500	15,264	1,975,525	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	4,000	4,030	521,666	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	2,000	2,035	263,489	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	7,300	10,977	1,420,644	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	4,400	5,419	701,389	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	4,000	6,139	794,555	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	6,200	9,649	1,248,900	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	4,500	6,148	795,680	2047/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.75	4,100	4,308	557,607	2018/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	7,200	7,266	940,422	2019/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	2,600	2,738	354,424	2019/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.6	12,000	13,155	1,702,636	2019/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.3	13,900	15,306	1,980,990	2019/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	25,250	28,119	3,639,197	2020/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	10,600	12,287	1,590,287	2020/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.05	400	401	51,949	2021/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	9,900	11,922	1,543,053	2021/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	5,900	6,071	785,724	2021/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	10,350	12,973	1,678,965	2022/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	17,000	21,559	2,790,188	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	8,000	9,841	1,273,713	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.8	13,900	17,522	2,267,777	2024/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	6,700	8,023	1,038,412	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	900	938	121,428	2025/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	15,600	19,848	2,568,813	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	6,000	6,345	821,259	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	18,400	25,572	3,309,653	2026/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	9,300	12,580	1,628,117	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	5,400	7,668	992,462	2040/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	8,400	11,671	1,510,553	2041/7/30

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	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	7,800	11,503	1,488,746	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	1,000	1,088	140,810	2066/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	17,500	25,411	3,288,802	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	8,500	12,644	1,636,464	2032/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	5,200	6,729	870,870	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.0	7,600	8,170	1,057,459	2019/9/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	5,800	6,570	850,311	2020/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	5,200	6,188	800,918	2021/9/28
		BELGIUM KINGDOM	4.0	4,800	5,749	744,068	2022/3/28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	7,851	1,016,143	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	5,000	5,662	732,840	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	7,000	8,130	1,052,249	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.5	8,400	11,273	1,459,042	2026/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	1,036	134,177	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	2,000	2,010	260,230	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,000	985	127,553	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	3,500	4,883	632,002	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.9	2,000	2,157	279,267	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	6,400	9,868	1,277,236	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	5,500	8,045	1,041,232	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	1,000	963	124,734	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	1,300	1,367	176,970	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	4.0	3,200	3,439	445,113	2019/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	11,900	17,742	2,296,239	2028/3/28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	11,000	17,589	2,276,439	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	4.35	2,500	2,695	348,864	2019/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.95	2,500	2,617	338,692	2019/6/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	2,400	2,442	316,136	2019/10/18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	5,600	6,316	817,484	2020/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.5	4,400	5,096	659,591	2021/9/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.65	3,300	3,906	505,520	2022/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.4	5,000	5,942	769,078	2022/11/22
		REPUBLIC OF AUSTRIA	－	2,000	1,999	258,814	2023/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	2,550	2,824	365,552	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	3,300	3,644	471,631	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,300	1,390	179,905	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.85	5,400	7,456	964,996	2026/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	2,000	2,040	264,016	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	6,100	9,498	1,229,326	2027/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	1,000	1,207	156,209	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	4,700	7,167	927,638	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	5,800	8,051	1,042,078	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	150	252	32,642	2062/1/26
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.125	100	101	13,195	2018/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.375	1,700	1,860	240,810	2019/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	3.375	1,200	1,324	171,471	2020/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.375	2,300	2,359	305,342	2020/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	3.5	2,000	2,285	295,840	2021/4/15

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.625	3,200	3,487	451,369	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	1,200	1,304	168,843	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	4.0	2,000	2,575	333,360	2025/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.875	1,000	1,040	134,698	2025/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	2,000	2,009	260,045	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	3,500	4,264	551,850	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	700	685	88,733	2031/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	1,600	2,102	272,063	2042/7/4
アイルランド	国債証券	IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	4.4	3,600	3,926	508,123	2019/6/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	6,550	6,931	897,020	2018/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.9	3,400	3,871	501,112	2019/10/18
		IRISH GOVERNMENT	4.5	6,180	6,999	905,823	2020/4/18
		IRISH GOVERNMENT	5.0	3,500	4,101	530,754	2020/10/18
		IRISH GOVERNMENT	5.4	3,500	4,757	615,699	2025/3/13
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	800	808	104,645	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	2,500	2,594	335,774	2045/2/18
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	4,600	5,254	679,988	2030/5/15
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	6,600	7,926	1,025,860	2024/3/18
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	4,400	5,325	689,202	2023/3/20
小計						263,808,579	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	—	5,300	5,201	157,759	2018/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	6,300	6,470	196,238	2019/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	7,500	8,076	244,967	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	6,300	6,205	188,212	2020/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	30,700	33,573	1,018,284	2020/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	11,100	12,530	380,058	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	9,400	10,747	325,957	2022/9/23
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	12,500	13,271	402,535	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	23,000	23,088	700,275	2025/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	9,500	8,922	270,630	2026/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	2,200	2,049	62,175	2027/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	3,700	4,575	138,780	2029/4/25
小計						4,085,877	
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	1,050	1,080	87,217	2018/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.5	4,950	5,058	408,181	2019/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.25	4,000	4,220	340,554	2020/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	2,980	3,058	246,858	2021/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.125	1,400	1,498	120,945	2022/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	3,000	3,160	255,052	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	2,300	2,463	198,788	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	3,900	4,354	351,418	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	2,400	2,545	205,435	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.375	500	560	45,252	2033/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	2,900	3,042	245,497	2042/4/1
小計						2,505,201	

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
マレーシア			%	千リンギ	千リンギ	千円	
	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	4.059	400	403	10,339	2024/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.58	2,800	2,811	72,061	2018/9/28
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.759	900	906	23,243	2019/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.654	3,400	3,419	87,638	2019/10/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	11,900	12,158	311,629	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.492	6,600	6,614	169,519	2020/3/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.889	2,400	2,427	62,223	2020/7/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	6,000	6,151	157,668	2021/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	8,700	8,851	226,869	2021/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	4,600	4,530	116,117	2022/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	11,000	10,799	276,787	2023/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	5,800	5,881	150,735	2024/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.955	600	596	15,290	2025/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	8,800	8,998	230,618	2026/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.502	7,000	6,633	170,017	2027/5/31
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	1,800	1,705	43,718	2028/6/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	5.248	2,700	2,938	75,317	2028/9/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	5,700	5,769	147,870	2030/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.232	4,400	4,306	110,365	2031/6/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.127	4,700	4,527	116,039	2032/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	400	375	9,622	2033/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.935	7,600	7,760	198,889	2043/9/30
小計						2,782,583	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	60	61	5,330	2018/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.25	12,900	13,610	1,187,226	2019/3/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	5,200	5,302	462,523	2019/10/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	13,100	13,979	1,219,402	2020/4/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	10,700	10,614	925,936	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	10,200	11,550	1,007,543	2021/5/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.0	400	397	34,677	2021/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	8,400	9,780	853,156	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	8,100	9,478	826,830	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	7,200	7,346	640,868	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	17,600	18,522	1,615,747	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	12,780	14,431	1,258,831	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	9,650	11,403	994,708	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	806	70,319	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	9,000	8,613	751,311	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	10,100	10,597	924,382	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	5,000	5,958	519,776	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,800	1,710	149,167	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	5,400	5,844	509,788	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	3,800	3,758	327,860	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	200	180	15,779	2047/3/21
小計						14,301,168	
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	65,200	66,536	414,523	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	107,000	103,145	642,598	2019/12/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	70,700	73,064	455,194	2020/6/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	126,000	125,153	779,704	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	48,400	47,987	298,962	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	30,700	36,442	227,034	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	8,000	7,448	46,403	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	93,100	97,492	607,378	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	49,600	56,007	348,925	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	46,500	49,734	309,843	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	10,000	10,729	66,847	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	46,000	60,018	373,918	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	30,500	35,099	218,669	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	64,200	68,618	427,495	2042/11/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	2,000	2,201	13,718	2047/11/7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	83,000	88,362	550,499	2023/12/7
小計						5,781,716	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	9,200	9,305	77,704	2018/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.25	25,300	25,268	210,991	2020/1/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	26,100	25,526	213,144	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	25,200	25,095	209,549	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	71,300	80,194	669,625	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	28,000	25,788	215,335	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	30,000	24,981	208,591	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	46,400	42,486	354,760	2032/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	47,100	33,794	282,185	2036/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	32,000	28,793	240,426	2037/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9.0	4,800	4,473	37,354	2040/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	30,600	21,679	181,023	2041/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	32,100	28,971	241,911	2044/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	50,200	45,359	378,748	2048/2/28
小計						3,521,354	
合計						645,170,423	

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

＜新興国債券マザーファンド＞

下記は、新興国債券マザーファンド全体(5,656,393千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債　種類別開示

区分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	86,249	92,994	10,229,449	98.4	52.5	75.6	19.2	3.6
合計	86,249	92,994	10,229,449	98.4	52.5	75.6	19.2	3.6

＊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。
＊組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。
＊金額の単位未満は切り捨て。
＊評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。
＊S&Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・インベスターズ・サービスによる格付けを採用しています。

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	ARGENT-GLOBAL	11.608874	640	1,019	112,176	2033/12/31
		ARGENT-GLOBAL	11.608874	420	653	71,834	2033/12/31
		ARGENT-GLOBAL	2.5	1,100	749	82,461	2038/12/31
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	7.75	400	168	18,524	2019/10/13
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	12.75	500	220	24,255	2022/8/23
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	9.0	350	129	14,246	2023/5/7
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	8.25	400	145	16,024	2024/10/13
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	9.25	300	112	12,342	2028/5/7
		BRAZIL GLOBAL	8.875	350	399	43,986	2019/10/14
		BRAZIL GLOBAL	8.75	650	838	92,235	2025/2/4
		BRAZIL GLOBAL	10.125	200	288	31,735	2027/5/15
		BRAZIL GLOBAL	8.25	720	923	101,574	2034/1/20
		BRAZIL GLOBAL	7.125	700	820	90,282	2037/1/20
		COLOMBIA GLOBAL	8.125	250	320	35,206	2024/5/21
		COLOMBIA GLOBAL	7.375	420	549	60,406	2037/9/18
		CROATIA	6.625	200	221	24,353	2020/7/14
		CROATIA	6.375	200	222	24,520	2021/3/24
		CROATIA	5.5	600	667	73,393	2023/4/4
		CROATIA	6.0	600	684	75,343	2024/1/26
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.875	300	316	34,851	2019/1/15
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.875	930	987	108,591	2021/1/22
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2.625	400	380	41,800	2023/1/5
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.25	800	807	88,770	2025/1/7
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	6.0	200	221	24,365	2026/4/7
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.625	600	598	65,835	2041/1/7
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.0	1,100	999	109,958	2045/1/27
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.625	200	197	21,752	2047/2/21
		HUNGARY	4.0	200	206	22,698	2019/3/25
		HUNGARY	5.375	600	677	74,508	2023/2/21
		HUNGARY	5.75	300	347	38,272	2023/11/22
		HUNGARY	5.375	700	800	88,104	2024/3/25
		INDONESIA GLOBAL	5.875	600	690	75,947	2024/1/15
		INDONESIA GLOBAL	8.5	400	586	64,539	2035/10/12
		MEXICO GLOBAL	7.5	99	133	14,728	2033/4/8
		MEXICO GLOBAL	6.75	380	494	54,340	2034/9/27
		PANAMA GLOBAL	7.125	300	384	42,322	2026/1/29
		PANAMA GLOBAL	8.875	300	430	47,355	2027/9/30
		PANAMA GLOBAL	9.375	250	373	41,112	2029/4/1
		PANAMA GLOBAL	6.7	450	588	64,721	2036/1/26
		PERU GLOBAL	7.35	500	656	72,242	2025/7/21
		PERU GLOBAL	6.55	320	425	46,816	2037/3/14
		PHILIPPINES GLOBAL	9.5	650	1,050	115,501	2030/2/2
		PHILIPPINES GLOBAL	7.75	200	289	31,856	2031/1/14
		PHILIPPINES GLOBAL	6.375	500	659	72,537	2032/1/15
		REPUBLIC OF ARGENTINA	6.25	800	844	92,884	2019/4/22
		REPUBLIC OF ARGENTINA	6.875	1,200	1,302	143,269	2021/4/22
		REPUBLIC OF ARGENTINA	5.625	750	783	86,212	2022/1/26

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	7.5	2,000	2,202	242,264	2026/4/22
		REPUBLIC OF ARGENTINA	6.875	1,400	1,481	162,932	2027/1/26
		REPUBLIC OF ARGENTINA	7.125	800	819	90,156	2036/7/6
		REPUBLIC OF ARGENTINA	7.625	750	804	88,481	2046/4/22
		REPUBLIC OF COLOMBIA	4.375	600	642	70,653	2021/7/12
		REPUBLIC OF COLOMBIA	2.625	200	196	21,637	2023/3/15
		REPUBLIC OF COLOMBIA	4.0	600	625	68,755	2024/2/26
		REPUBLIC OF COLOMBIA	4.5	1,000	1,066	117,356	2026/1/28
		REPUBLIC OF COLOMBIA	6.125	1,020	1,184	130,264	2041/1/18
		REPUBLIC OF COLOMBIA	5.625	900	993	109,296	2044/2/26
		REPUBLIC OF COLOMBIA	5.0	600	610	67,188	2045/6/15
		REPUBLIC OF CROATIA	6.75	300	327	35,991	2019/11/5
		REPUBLIC OF HUNGARY	6.25	720	786	86,527	2020/1/29
		REPUBLIC OF HUNGARY	6.375	600	676	74,464	2021/3/29
		REPUBLIC OF HUNGARY	7.625	350	533	58,737	2041/3/29
		REPUBLIC OF INDONESIA	11.625	350	402	44,251	2019/3/4
		REPUBLIC OF INDONESIA	4.875	700	753	82,910	2021/5/5
		REPUBLIC OF INDONESIA	3.75	900	933	102,659	2022/4/25
		REPUBLIC OF INDONESIA	3.375	600	607	66,877	2023/4/15
		REPUBLIC OF INDONESIA	5.375	250	280	30,805	2023/10/17
		REPUBLIC OF INDONESIA	4.125	1,100	1,150	126,568	2025/1/15
		REPUBLIC OF INDONESIA	4.75	200	217	23,905	2026/1/8
		REPUBLIC OF INDONESIA	7.75	600	850	93,517	2038/1/17
		REPUBLIC OF INDONESIA	5.25	400	438	48,246	2042/1/17
		REPUBLIC OF INDONESIA	6.75	600	789	86,792	2044/1/15
		REPUBLIC OF INDONESIA	5.125	400	434	47,748	2045/1/15
		REPUBLIC OF INDONESIA	5.95	400	482	53,073	2046/1/8
		REPUBLIC OF INDONESIA	5.25	600	665	73,193	2047/1/8
		REPUBLIC OF PANAMA	5.2	150	162	17,861	2020/1/30
		REPUBLIC OF PANAMA	3.75	400	417	45,870	2025/3/16
		REPUBLIC OF PANAMA	3.875	200	208	22,935	2028/3/17
		REPUBLIC OF PERU	4.125	200	219	24,178	2027/8/25
		REPUBLIC OF PERU	8.75	250	387	42,652	2033/11/21
		REPUBLIC OF PERU	5.625	500	620	68,282	2050/11/18
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	4.0	1,300	1,385	152,395	2021/1/15
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	4.2	1,400	1,534	168,809	2024/1/21
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	6.375	600	808	88,953	2034/10/23
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	5.0	400	474	52,222	2037/1/13
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.95	600	628	69,182	2040/1/20
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.875	650	700	77,095	2019/5/27
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.5	400	427	47,009	2020/3/9
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.875	250	274	30,216	2022/5/30
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.665	300	308	33,908	2024/1/17
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.875	550	598	65,852	2025/9/16
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.3	700	666	73,286	2028/10/12
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	250	273	30,037	2041/3/8
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.375	200	196	21,567	2044/7/24
		REPUBLIC OF TURKEY	5.625	400	427	47,013	2021/3/30

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	REPUBLIC OF TURKEY	5.125	600	629	69,265	2022/3/25
		REPUBLIC OF TURKEY	6.25	900	989	108,853	2022/9/26
		REPUBLIC OF TURKEY	4.875	700	700	77,083	2026/10/9
		REPUBLIC OF TURKEY	6.75	400	452	49,762	2040/5/30
		REPUBLIC OF TURKEY	6.0	900	936	103,017	2041/1/14
		REPUBLIC OF TURKEY	4.875	800	721	79,331	2043/4/16
		REPUBLIC OF TURKEY	6.625	700	784	86,272	2045/2/17
		REPUBLIC OF VENEZUELA	11.75	450	186	20,542	2026/10/21
		REPUBLIC OF VENEZUELA	11.95	700	304	33,495	2031/8/5
		REPUBLIC OF VENEZUELA	7.0	200	73	8,030	2038/3/31
		ROMANIA	6.75	400	466	51,262	2022/2/7
		ROMANIA	4.375	600	645	71,014	2023/8/22
		ROMANIA	4.875	500	553	60,936	2024/1/22
		ROMANIA	6.125	200	253	27,924	2044/1/22
		RUSSIA	12.75	200	351	38,671	2028/6/24
		RUSSIA	7.5	1,767	2,125	233,803	2030/3/31
		RUSSIA FOREIGN BOND	5.0	900	955	105,063	2020/4/29
		RUSSIAN FEDERATION	3.5	200	203	22,412	2019/1/16
		RUSSIAN FEDERATION	4.5	1,400	1,487	163,625	2022/4/4
		RUSSIAN FEDERATION	4.875	1,200	1,300	143,019	2023/9/16
		RUSSIAN FEDERATION	4.75	1,000	1,053	115,868	2026/5/27
		RUSSIAN FEDERATION	5.625	600	658	72,480	2042/4/4
		RUSSIAN FEDERATION	5.875	400	454	49,986	2043/9/16
		TURKEY GLOBAL	7.0	650	693	76,302	2019/3/11
		TURKEY GLOBAL	7.0	650	714	78,578	2020/6/5
		TURKEY GLOBAL	5.75	800	857	94,357	2024/3/22
		TURKEY GLOBAL	7.375	1,250	1,466	161,299	2025/2/5
		TURKEY GLOBAL	11.875	450	722	79,509	2030/1/15
		TURKEY GLOBAL	8.0	400	504	55,446	2034/2/14
		TURKEY GLOBAL	6.875	820	938	103,274	2036/3/17
		TURKEY GLOBAL	7.25	150	178	19,618	2038/3/5
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	765	792	87,221	2020/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	409	422	46,525	2021/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	209	213	23,498	2022/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	700	710	78,148	2023/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	800	804	88,493	2024/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	500	491	54,037	2026/9/1
		UNITED MEXICAN STATES	5.125	300	325	35,772	2020/1/15
		UNITED MEXICAN STATES	3.5	200	210	23,133	2021/1/21
		UNITED MEXICAN STATES	3.625	1,100	1,152	126,747	2022/3/15
		UNITED MEXICAN STATES	4.0	850	894	98,408	2023/10/2
		UNITED MEXICAN STATES	3.6	1,000	1,020	112,200	2025/1/30
		UNITED MEXICAN STATES	4.125	1,000	1,049	115,390	2026/1/21
		UNITED MEXICAN STATES	6.05	910	1,081	118,993	2040/1/11
		UNITED MEXICAN STATES	4.75	1,000	1,015	111,650	2044/3/8
		UNITED MEXICAN STATES	5.55	1,000	1,136	124,987	2045/1/21
		UNITED MEXICAN STATES	4.6	900	892	98,208	2046/1/23
		UNITED MEXICAN STATES	5.75	800	848	93,368	2110/10/12

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	VENEZUELA GLOBAL	7.0	150	81	8,910	2018/12/1
		VENEZUELA GLOBAL	6.0	200	78	8,627	2020/12/9
		VENEZUELA GLOBAL	7.65	100	35	3,943	2025/4/21
		VENEZUELA GLOBAL	9.25	600	246	27,060	2027/9/15
		VENEZUELA GLOBAL	9.375	200	78	8,635	2034/1/13
合計						10,229,449	

＊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(3,994,898千口)の内容です。

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債　種類別開示

区　　分	当期末							
	額面金額	評価額		組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			５年以上	２年以上	２年未満
	千トルコリラ	千トルコリラ	千円	%	%	%	%	%
トルコ	13,830	12,957	405,432	7.6	7.6	4.0	2.0	1.5
	千チェココルナ	千チェココルナ						
チェコ	39,500	40,621	201,888	3.8	－	2.3	1.5	－
	千フォリント	千フォリント						
ハンガリー	506,000	569,844	242,183	4.5	－	1.9	2.1	0.4
	千ズロチ	千ズロチ						
ポーランド	15,400	15,638	474,326	8.8	－	3.3	3.8	1.8
	千ルーブル	千ルーブル						
ロシア	187,700	186,345	344,739	6.4	6.4	3.4	3.0	－
	千レイ	千レイ						
ルーマニア	5,210	5,485	154,864	2.9	－	1.1	0.9	0.9
	千リンギ	千リンギ						
マレーシア	13,250	13,244	339,450	6.3	－	2.7	3.3	0.3
	千バーツ	千バーツ						
タイ	111,500	120,022	397,273	7.4	－	3.9	2.6	1.0
	千フィリピンペソ	千フィリピンペソ						
フィリピン	5,000	5,142	11,004	0.2	－	－	0.2	－
	千ルピア	千ルピア						
インドネシア	55,760,000	60,237,401	499,970	9.3	－	7.1	2.0	0.3
	千アルゼンチンペソ	千アルゼンチンペソ						
アルゼンチン	8,700	10,008	63,951	1.2	1.2	0.9	0.3	－
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	82,100	85,425	532,198	9.9	－	5.2	4.4	0.3
	千レアル	千レアル						
ブラジル	9,107	15,222	531,122	9.9	9.9	3.9	1.7	4.3
	千チリペソ	千チリペソ						
チリ	580,000	611,447	104,190	1.9	－	0.9	1.0	－
	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ						
コロンビア	8,720,000	10,077,233	372,857	6.9	－	3.5	3.5	－
	千ソル	千ソル						
ペルー	3,800	4,103	139,192	2.6	－	2.3	0.3	－
	千ランド	千ランド						
南アフリカ	57,050	51,431	429,455	8.0	－	6.9	1.1	－
合　　計	－	－	5,244,103	97.7	25.1	53.2	33.8	10.7

＊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。
＊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	8.5	2,700	2,579	80,724	2019/7/10
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.5	710	702	21,993	2020/1/15
		TURKEY GOVERNMENT BOND	7.4	1,050	968	30,308	2020/2/5
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.4	950	914	28,625	2020/7/8
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.7	300	298	9,349	2021/2/17
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.5	650	622	19,464	2022/1/12
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.5	1,190	1,090	34,117	2022/9/14
		TURKEY GOVERNMENT BOND	7.1	1,770	1,513	47,352	2023/3/8
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.8	1,160	1,068	33,428	2023/9/27
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.4	520	517	16,181	2024/3/20
		TURKEY GOVERNMENT BOND	9.0	310	287	8,996	2024/7/24
		TURKEY GOVERNMENT BOND	8.0	1,020	887	27,767	2025/3/12
		TURKEY GOVERNMENT BOND	10.6	1,500	1,506	47,122	2026/2/11
小計						405,432	
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	15,500	16,113	80,081	2019/10/29
		CZECH REPUBLIC	0.45	4,000	4,060	20,178	2023/10/25
		CZECH REPUBLIC	1.0	17,900	18,393	91,413	2026/6/26
		CZECH REPUBLIC	0.95	2,100	2,055	10,214	2030/5/15
小計						201,888	
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	49,000	54,794	23,287	2019/6/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	2.0	63,000	65,364	27,779	2019/10/30
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.5	38,000	41,078	17,458	2020/6/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	7.5	81,000	98,111	41,697	2020/11/12
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	2.5	20,000	20,857	8,864	2021/10/27
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	7.0	36,000	44,861	19,066	2022/6/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	6.0	77,000	93,940	39,924	2023/11/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.0	50,000	51,880	22,049	2024/6/26
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	5.5	37,000	44,242	18,803	2025/6/24
		HUNGARY GOVERNMENT BOND	3.0	55,000	54,714	23,253	2027/10/27
小計						242,183	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	3,090	3,173	96,250	2019/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	380	409	12,411	2019/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.5	630	620	18,821	2020/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.25	1,230	1,345	40,797	2020/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.0	1,700	1,678	50,895	2021/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.75	1,200	1,168	35,449	2021/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	500	564	17,119	2021/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	900	883	26,783	2022/4/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	5.75	980	1,120	33,982	2022/9/23
		POLAND GOVERNMENT BOND	4.0	1,140	1,210	36,711	2023/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	3.25	700	702	21,312	2025/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,850	1,737	52,701	2026/7/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	1,100	1,024	31,087	2027/7/25
小計						474,326	

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	
ロシア			%	千ルーブル	千ルーブル	千円	
	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	6.8	30,700	30,135	55,749	2019/12/11
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	6.4	28,000	27,104	50,142	2020/5/27
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.6	31,000	30,910	57,183	2022/7/20
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.0	20,000	19,330	35,760	2023/1/25
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.75	39,000	39,273	72,655	2026/9/16
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	7.05	20,000	19,262	35,636	2028/1/19
		RUSSIA GOVT BOND - OFZ	8.5	19,000	20,330	37,610	2031/9/17
小計						344,739	
ルーマニア				千レイ	千レイ		
	国債証券	ROMANIA	2.5	1,600	1,633	46,112	2019/4/29
		ROMANIA	2.25	540	548	15,489	2020/2/26
		ROMANIA	3.25	790	815	23,014	2021/3/22
		ROMANIA	5.95	300	339	9,574	2021/6/11
		ROMANIA	3.5	500	515	14,540	2022/12/19
		ROMANIA	5.85	250	287	8,105	2023/4/26
		ROMANIA	4.75	920	989	27,939	2025/2/24
		ROMANIA	5.8	310	357	10,087	2027/7/26
小計						154,864	
マレーシア				千リンギ	千リンギ		
	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	3.58	660	662	16,986	2018/9/28
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.378	2,060	2,104	53,945	2019/11/29
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.659	1,300	1,306	33,496	2020/10/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.16	320	328	8,409	2021/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.048	900	915	23,469	2021/9/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.62	1,300	1,298	33,292	2021/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.418	1,050	1,034	26,505	2022/8/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.48	1,280	1,256	32,207	2023/3/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.181	1,700	1,723	44,180	2024/7/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.392	340	347	8,910	2026/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.9	800	791	20,280	2026/11/30
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.733	740	701	17,972	2028/6/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.498	200	202	5,188	2030/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	3.844	400	375	9,622	2033/4/15
		MALAYSIAN GOVERNMENT	4.254	200	194	4,983	2035/5/31
小計						339,450	
タイ				千バーツ	千バーツ		
	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.45	4,800	4,945	16,371	2019/3/8
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.875	10,100	10,531	34,858	2019/6/13
		THAILAND GOVERNMENT BOND	2.55	15,500	15,928	52,724	2020/6/26
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.65	15,000	16,180	53,558	2021/12/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	1.875	10,000	10,005	33,118	2022/6/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.625	14,500	15,793	52,276	2023/6/16
		THAILAND GOVERNMENT BOND	4.75	1,500	1,746	5,779	2024/12/20
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.85	9,200	10,229	33,860	2025/12/12
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.58	7,500	8,174	27,057	2027/12/17
		THAILAND GOVERNMENT BOND	4.875	10,000	12,249	40,546	2029/6/22
		THAILAND GOVERNMENT BOND	3.65	5,000	5,434	17,989	2031/6/20

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	
タイ			%	千バーツ	千バーツ	千円	
	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	3.4	8,400	8,801	29,132	2036/6/17
小計						397,273	
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	5,142	11,004	2021/1/15
小計						11,004	
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	1,738,615	14,430	2019/4/15
		INDONESIA GOVERNMENT	11.0	2,900,000	3,271,304	27,151	2020/11/15
		INDONESIA GOVERNMENT	12.8	1,700,000	2,051,170	17,024	2021/6/15
		INDONESIA GOVERNMENT	7.0	7,380,000	7,501,770	62,264	2022/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.375	4,630,000	4,990,084	41,417	2024/3/15
		INDONESIA GOVERNMENT	11.0	5,880,000	7,344,849	60,962	2025/9/15
		INDONESIA GOVERNMENT	7.0	9,050,000	9,139,857	75,860	2027/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	9.0	2,930,000	3,323,542	27,585	2029/3/15
		INDONESIA GOVERNMENT	10.5	1,110,000	1,402,430	11,640	2030/8/15
		INDONESIA GOVERNMENT	9.5	2,400,000	2,832,192	23,507	2031/7/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.25	2,500,000	2,644,530	21,949	2032/6/15
		INDONESIA GOVERNMENT	7.5	1,200,000	1,218,000	10,109	2032/8/15
		INDONESIA GOVERNMENT	6.625	3,500,000	3,237,944	26,874	2033/5/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.375	4,280,000	4,620,260	38,348	2034/3/15
		INDONESIA GOVERNMENT	8.25	4,600,000	4,920,850	40,843	2036/5/15
小計						499,970	
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	2,154	13,764	2021/10/3
		REPUBLIC OF ARGENTINA	15.5	6,800	7,854	50,187	2026/10/17
小計						63,951	
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	2,400	2,449	15,258	2018/12/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	14,100	13,592	84,678	2019/12/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	10,950	11,316	70,500	2020/6/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	3,500	3,476	21,658	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	9,700	9,617	59,916	2022/6/9
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	4,600	5,460	34,018	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	5,100	4,748	29,581	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	2,850	2,984	18,593	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	1,200	1,355	8,441	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	7,900	8,449	52,640	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	4,000	4,291	26,738	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	1,700	2,218	13,818	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	5,000	5,754	35,847	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	5,700	6,092	37,955	2042/11/13
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	3,400	3,619	22,550	2023/12/7
小計						532,198	
ブラジル				千レアル	千レアル		
	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	—	790	725	25,322	2018/10/1
		LETRA TESOURO NACIONAL	—	2,430	2,187	76,321	2019/1/1
		LETRA TESOURO NACIONAL	—	4,310	3,712	129,539	2019/7/1
		LETRA TESOURO NACIONAL	—	800	624	21,779	2020/7/1

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	NOTA DO TESOURO NACIONAL	10.0	196	2,029	70,819	2021/1/1
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	10.0	330	3,386	118,142	2023/1/1
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	10.0	251	2,556	89,197	2025/1/1
小計						531,122	
チリ				千チリペソ	千チリペソ		
	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS	5.0	280,000	291,914	49,742	2035/3/1
		REPUBLIC OF CHILE	5.5	300,000	319,533	54,448	2020/8/5
小計						104,190	
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	4,670,000	5,019,269	185,712	2021/4/14
		REPUBLIC OF COLOMBIA	9.85	4,050,000	5,057,964	187,144	2027/6/28
小計						372,857	
ペルー				千ソル	千ソル		
	国債証券	BONOS DE TESORERIA	5.7	800	836	28,384	2024/8/12
		BONOS DE TESORERIA	6.15	700	730	24,772	2032/8/12
		PERU BONO SOBERANO	7.84	480	533	18,105	2020/8/12
		PERU BONO SOBERANO	6.95	700	781	26,508	2031/8/12
		PERU BONO SOBERANO	6.9	620	686	23,281	2037/8/12
		REPUBLIC OF PERU	6.35	500	534	18,140	2028/8/12
小計						139,192	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	7,340	7,178	59,941	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	4,000	3,983	33,261	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10.5	6,700	7,535	62,924	2026/12/21
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	6,000	5,526	46,143	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	6,360	5,295	44,221	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.875	1,800	1,698	14,181	2035/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	3,700	2,654	22,167	2036/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.5	4,900	4,409	36,815	2037/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	7,850	5,561	46,439	2041/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	2,000	1,805	15,072	2044/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.75	6,400	5,782	48,286	2048/2/28
小計						429,455	
合計						5,244,103	

＊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(14,486,574千口)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	946	1,179	534,676	1.9
ＭＣＵＢＳ　ＭｉｄＣｉｔｙ投資法人　投資証券	519	718	238,376	0.9
森ヒルズリート投資法人　投資証券	3,348	3,812	524,912	1.9
産業ファンド投資法人　投資証券	773	964	473,806	1.7
アドバンス・レジデンス投資法人　投資証券	2,635	3,286	917,451	3.3
ケネディクス・レジデンシャル投資法人　投資証券	674	805	226,527	0.8
アクティビア・プロパティーズ投資法人　投資証券	1,285	1,534	737,087	2.7
ＧＬＰ投資法人　投資証券	5,456	6,213	751,773	2.7
コンフォリア・レジデンシャル投資法人　投資証券	1,085	1,294	302,149	1.1
日本プロロジスリート投資法人　投資証券	3,646	4,464	1,060,200	3.9
星野リゾート・リート投資法人　投資証券	322	441	248,283	0.9
Ｏｎｅリート投資法人　投資証券	179	388	83,264	0.3
イオンリート投資法人　投資証券	2,563	3,114	374,925	1.4
ヒューリックリート投資法人　投資証券	1,999	2,276	383,278	1.4
日本リート投資法人　投資証券	765	954	294,786	1.1
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人　投資証券	1,592	1,985	212,990	0.8
日本ヘルスケア投資法人　投資証券	144	172	28,259	0.1
積水ハウス・リート投資法人　投資証券	1,727	2,226	300,955	1.1
トーセイ・リート投資法人　投資証券	358	446	47,231	0.2
ケネディクス商業リート投資法人　投資証券	833	1,290	312,309	1.1
ヘルスケア＆メディカル投資法人　投資証券	366	437	42,563	0.2
サムティ・レジデンシャル投資法人　投資証券	541	616	52,483	0.2
ジャパン・シニアリビング投資法人　投資証券	164	195	27,846	0.1
野村不動産マスターファンド投資法人　投資証券	8,165	10,182	1,530,354	5.6
いちごホテルリート投資法人　投資証券	493	561	61,429	0.2
ラサールロジポート投資法人　投資証券	2,147	2,677	293,131	1.1
スターアジア不動産投資法人　投資証券	639	737	77,090	0.3
マリモ地方創生リート投資法人　投資証券	174	198	18,909	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	442	574	182,245	0.7
大江戸温泉リート投資法人　投資証券	347	451	39,642	0.1
さくら総合リート投資法人　投資証券	657	853	76,002	0.3
投資法人みらい　投資証券	347	452	77,066	0.3
森トラスト・ホテルリート投資法人　投資証券	38	769	116,580	0.4
日本ビルファンド投資法人　投資証券	2,756	3,437	1,996,897	7.3
ジャパンリアルエステイト投資法人　投資証券	2,581	3,355	1,885,510	6.9
日本リテールファンド投資法人　投資証券	5,032	6,827	1,396,121	5.1
オリックス不動産投資法人　投資証券	4,978	6,847	1,117,430	4.1
日本プライムリアルティ投資法人　投資証券	1,797	2,241	906,484	3.3
プレミア投資法人　投資証券	2,571	3,205	346,781	1.3
東急リアル・エステート投資法人　投資証券	1,908	2,379	322,354	1.2
グローバル・ワン不動産投資法人　投資証券	382	570	220,590	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人　投資証券	6,023	7,827	1,282,845	4.7
森トラスト総合リート投資法人　投資証券	2,472	2,536	460,791	1.7
インヴィンシブル投資法人　投資証券	6,957	7,913	365,976	1.3
フロンティア不動産投資法人　投資証券	968	1,207	570,307	2.1
平和不動産リート投資法人　投資証券	1,941	2,210	200,668	0.7

銘柄		期首(前期末)	当期末		
		口数	口数	評価額	比率
		口	口	千円	%
日本ロジスティクスファンド投資法人　投資証券		1,735	2,255	511,208	1.9
福岡リート投資法人　投資証券		1,443	1,722	293,428	1.1
ケネディクス・オフィス投資法人　投資証券		798	1,037	649,162	2.4
積水ハウス・レジデンシャル投資法人　投資証券		2,158	2,691	312,694	1.1
いちごオフィスリート投資法人　投資証券		2,840	2,748	206,100	0.8
大和証券オフィス投資法人　投資証券		903	765	425,340	1.5
阪急リート投資法人　投資証券		1,166	1,454	200,797	0.7
スターツプロシード投資法人　投資証券		491	559	84,409	0.3
大和ハウスリート投資法人　投資証券		2,906	3,650	1,004,845	3.7
ジャパン・ホテル・リート投資法人　投資証券		7,417	10,243	787,686	2.9
日本賃貸住宅投資法人　投資証券		3,201	3,992	330,537	1.2
ジャパンエクセレント投資法人　投資証券		2,549	3,178	408,055	1.5
合計	口数・金額	113,342	141,111	26,935,607	
	銘柄数＜比率＞	58	58	＜98.1%＞	

＊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
			百万円	百万円
国内	REIT先物取引	東証REIT指数	512	－

＊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(9,290,711千口)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	404	44,509	0.2
AGREE REALTY CORP	3,700	4,500	220	24,269	0.1
ALEXANDERS INC	530	590	243	26,777	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	13,220	14,710	1,793	197,246	1.0
AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,100	6,800	276	30,436	0.2
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	20,400	21,300	1,010	111,105	0.6
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	33,500	38,000	870	95,722	0.5
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	24,200	25,500	1,158	127,403	0.6
APPLE HOSPITALITY REIT INC	23,600	25,100	456	50,222	0.2
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,800	7,600	100	11,010	0.1
ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	3,200	4,800	45	4,979	0.0
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	12,100	12,100	74	8,172	0.0
AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,900	22,160	4,236	466,069	2.3
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	4,200	43	4,795	0.0
BOSTON PROPERTIES	23,390	24,660	3,009	331,018	1.6
BRANDYWINE REALTY TRUST	26,600	28,100	472	51,928	0.3
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	40,400	41,400	801	88,119	0.4
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	25,900	28,400	235	25,929	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	13,210	14,160	1,263	139,000	0.7
CARE CAPITAL PROPERTIES INC	12,900	13,800	334	36,750	0.2
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	9,000	12,000	227	24,987	0.1
CEDAR REALTY TRUST INC	12,000	12,000	60	6,679	0.0
CHATHAM LODGING TRUST	5,900	5,900	119	13,096	0.1
CHESAPEAKE LODGING TRUST	9,200	9,200	232	25,613	0.1
CITY OFFICE REIT INC	3,300	3,300	41	4,555	0.0
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	85,400	88,700	1,177	129,572	0.6
COLONY STARWOOD HOMES	7,500	－	－	－	－
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	18,500	19,400	412	45,347	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,000	2,900	72	8,016	0.0
CORESITE REALTY CORP	5,060	5,560	621	68,315	0.3
CORECIVIC INC	17,700	19,200	485	53,412	0.3
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	14,300	15,800	521	57,319	0.3
COUSINS PROPERTIES INC	51,400	67,700	622	68,512	0.3
CUBESMART	27,900	28,700	693	76,336	0.4
CYRUSONE INC	11,210	12,620	763	83,972	0.4
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	13,700	14,800	849	93,447	0.5
DDR CORP	47,600	50,400	497	54,719	0.3
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	30,600	31,600	353	38,931	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	24,170	25,610	2,983	328,163	1.6
DOUGLAS EMMETT INC	22,200	23,700	901	99,144	0.5
DUKE REALTY CORP	54,600	57,300	1,655	182,156	0.9
DUPONT FABROS TECHNOLOGY	11,700	12,280	775	85,316	0.4
EPR PROPERTIES	9,590	10,340	708	77,957	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	%
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	3,100	4,200	83	9,147	0.0
EASTGROUP PROPERTIES	4,890	5,530	476	52,465	0.3
EDUCATION REALTY TRUST INC	11,100	11,800	449	49,427	0.2
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	19,300	20,500	427	47,061	0.2
EQUITY COMMONWEALTH	18,900	19,800	605	66,559	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,380	13,250	1,156	127,166	0.6
EQUITY ONE INC	14,100	—	—	—	—
EQUITY RESIDENTIAL	55,650	58,800	3,993	439,241	2.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,050	10,550	2,771	304,863	1.5
EXTRA SPACE STORAGE INC	19,350	20,360	1,544	169,918	0.8
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	5,500	47	5,221	0.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,030	11,710	1,518	167,002	0.8
FELCOR LODGING TRUST INC	20,100	20,100	142	15,698	0.1
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	17,600	18,400	560	61,671	0.3
FIRST POTOMAC REALTY TRUST	8,400	10,400	115	12,732	0.1
FOREST CITY REALTY TRUST- A	32,700	35,000	843	92,823	0.5
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	9,100	9,400	236	26,025	0.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	15,800	18,100	183	20,228	0.1
GEO GROUP INC/THE	11,700	20,300	534	58,817	0.3
GGP INC	88,700	94,000	2,006	220,759	1.1
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	30,000	31,500	1,204	132,501	0.7
GETTY REALTY CORP	3,921	5,600	149	16,391	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	3,600	4,900	103	11,383	0.1
GLOBAL NET LEASE INC	25,200	—	—	—	—
GLOBAL NET LEASE INC	—	9,500	205	22,561	0.1
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	11,000	15,300	282	31,034	0.2
GRAMERCY PROPERTY TRUST	21,200	24,600	722	79,475	0.4
HCP INC	71,700	75,600	2,218	243,991	1.2
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	17,500	18,300	596	65,563	0.3
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	22,000	30,900	942	103,669	0.5
HERSHA HOSPITALITY TRUST	5,900	7,200	132	14,588	0.1
HIGHWOODS PROPERTIES INC	15,080	16,500	848	93,381	0.5
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	25,400	26,500	727	80,045	0.4
HOST HOTELS & RESORTS INC	112,400	119,000	2,169	238,630	1.2
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	22,600	25,300	837	92,117	0.5
ISTAR INC	10,500	11,300	136	15,027	0.1
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	9,000	9,000	91	10,098	0.1
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	18,300	18,300	114	12,581	0.1
INVITATION HOMES INC	—	11,900	277	30,565	0.2
IRON MOUNTAIN INC	37,700	39,600	1,484	163,306	0.8
JBG SMITH PROPERTIES	—	13,800	469	51,642	0.3
KILROY REALTY CORP	15,050	15,590	1,083	119,151	0.6
KIMCO REALTY CORP	65,300	67,700	1,332	146,556	0.7
KITE REALTY GROUP TRUST	12,700	13,900	282	31,115	0.2
LTC PROPERTIES INC	6,000	6,500	313	34,470	0.2
LASALLE HOTEL PROPERTIES	17,100	18,100	513	56,464	0.3
LEXINGTON REALTY TRUST	33,500	33,600	332	36,627	0.2
LIBERTY PROPERTY TRUST	22,700	23,600	982	108,071	0.5

銘柄	期首(前期末)	当期末			
	口数	口数	評価額		比率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%
LIFE STORAGE INC	7,010	7,300	524	57,663	0.3
MACERICH CO /THE	18,600	19,210	1,053	115,882	0.6
MACK-CALI REALTY CORP	13,500	14,500	345	37,992	0.2
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	3,100	3,100	35	3,890	0.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	49,700	58,100	741	81,613	0.4
MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,440	18,320	1,954	215,001	1.1
MONMOUTH REIT-CLASS A	10,100	12,000	181	19,971	0.1
MONOGRAM RESIDENTIAL TRUST INC	25,600	25,900	310	34,159	0.2
NATL HEALTH INVESTORS INC	5,900	6,490	510	56,176	0.3
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,700	24,100	990	108,982	0.5
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	6,700	6,700	147	16,184	0.1
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	12,500	12,500	116	12,828	0.1
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3,000	3,000	71	7,913	0.0
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	7,600	9,500	120	13,229	0.1
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	30,100	31,600	1,000	110,015	0.5
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,100	2,100	50	5,520	0.0
PS BUSINESS PARKS INC/CA	2,900	3,110	411	45,311	0.2
PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	—	22,600	599	65,953	0.3
PARKWAY INC	6,473	6,473	148	16,376	0.1
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	11,000	10,900	359	39,507	0.2
PENN REAL ESTATE INVEST TST	10,500	10,500	111	12,289	0.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	20,100	28,300	512	56,376	0.3
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	22,000	23,300	472	51,926	0.3
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	3,500	5,400	98	10,870	0.1
PROLOGIS INC	80,900	85,020	5,292	582,174	2.9
PUBLIC STORAGE	22,720	24,090	4,794	527,356	2.6
QTS REALTY TRUST INC CL A	7,480	7,580	410	45,191	0.2
QUALITY CARE PROPERTIES	14,900	14,700	223	24,546	0.1
RLJ LODGING TRUST	18,700	20,100	396	43,600	0.2
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	12,200	12,200	163	17,969	0.1
REALTY INCOME CORP	39,280	43,910	2,529	278,262	1.4
REGENCY CENTERS CORP	16,100	23,600	1,546	170,089	0.8
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	17,200	18,100	364	40,098	0.2
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	35,800	37,400	491	54,016	0.3
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	10,200	11,000	316	34,860	0.2
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	7,710	8,170	488	53,688	0.3
SL GREEN REALTY CORP	15,370	16,370	1,623	178,629	0.9
SABRA HEALTH CARE REIT INC	10,100	10,100	219	24,130	0.1
SAUL CENTERS INC	1,700	2,070	122	13,427	0.1
SELECT INCOME REIT	9,800	9,800	229	25,246	0.1
SENIOR HOUSING PROP TRUST	36,800	37,500	723	79,571	0.4
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	3,500	4,000	187	20,578	0.1
SILVER BAY REALTY TRUST CORP	5,600	—	—	—	—
SIMON PROPERTY GROUP INC	47,900	50,120	7,916	870,809	4.3
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	74,800	78,800	669	73,591	0.4
STAG INDUSTRIAL INC	11,500	14,100	389	42,885	0.2
STARWOOD WAYPOINT HOMES	—	20,000	752	82,764	0.4
STORE CAPITAL CORP	24,200	27,600	690	75,930	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	%
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC		13,500	16,500	250	27,551	0.1
SUN COMMUNITIES INC		9,970	11,410	1,016	111,791	0.6
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC		32,700	35,800	568	62,574	0.3
TANGER FACTORY OUTLET CENTER		15,000	15,800	386	42,546	0.2
TAUBMAN CENTERS INC		9,370	9,800	522	57,468	0.3
TERRENO REALTY CORP		6,600	8,300	295	32,511	0.2
TIER REIT INC		7,200	7,200	132	14,628	0.1
UDR INC		41,100	43,100	1,677	184,567	0.9
UMH PROPERTIES INC		3,600	5,000	75	8,354	0.0
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME		1,900	1,900	142	15,723	0.1
URBAN EDGE PROPERTIES		14,400	16,200	404	44,478	0.2
URSTADT BIDDLE-CL A		3,900	5,000	103	11,335	0.1
VENTAS INC		53,880	57,080	3,800	418,105	2.1
VEREIT INC		147,500	157,400	1,358	149,419	0.7
VORNADO REALTY TRUST		26,150	27,600	2,094	230,432	1.1
WP CAREY INC		16,390	16,890	1,138	125,203	0.6
WASHINGTON PRIME GROUP INC		28,500	28,500	246	27,086	0.1
WASHINGTON REAL ESTATE INV		11,300	12,200	407	44,782	0.2
WEINGARTEN REALTY INVESTORS		18,300	19,200	618	68,069	0.3
WELLTOWER INC		55,180	58,630	4,221	464,349	2.3
WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		10,000	—	—	—	—
WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		—	1,250	12	1,399	0.0
WHITESTONE REIT		4,200	5,900	76	8,378	0.0
XENIA HOTELS & RESORTS INC		16,900	16,900	335	36,863	0.2
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		87,000	119,000	111	12,304	0.1
小計	口数・金額	3,315,404	3,619,973	129,489	14,243,875	
	銘柄数<比率>	158	159	—	<70.7%>	
(カナダ)				千カナダドル		
AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN		1,500	3,200	36	3,146	0.0
ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT		6,700	7,000	272	23,696	0.1
ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT		11,100	11,100	146	12,760	0.1
BOARDWALK REAL ESTATE INVEST		3,500	3,500	147	12,847	0.1
BROOKFIELD CANADA OFFICE PROPERTIES		2,000	—	—	—	—
CT REAL ESTATE INVESTMENT TR		4,900	4,900	69	6,017	0.0
CAN APARTMENT PROP REAL ESTA		10,500	10,800	370	32,223	0.2
CAN REAL ESTATE INVEST TRUST		5,600	5,600	263	22,922	0.1
CHOICE PROPERTIES REIT		7,000	7,000	92	8,034	0.0
COMINAR REAL ESTATE INV-TR U		13,500	13,500	170	14,884	0.1
CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT		6,700	6,700	91	7,976	0.0
DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS		8,400	8,400	173	15,150	0.1
DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT		4,400	4,400	39	3,464	0.0
DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS		10,400	13,400	146	12,732	0.1
GRANITE REAL ESTATE INVESTME		3,300	3,900	198	17,328	0.1
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		20,900	22,000	466	40,637	0.2
INTERRENT REAL ESTATE INVEST		5,200	5,200	40	3,541	0.0
KILLAM APARTMENT REAL ESTATE		4,600	6,700	87	7,632	0.0
MILESTONE APARTMENTS REAL ES		5,600	—	—	—	—
MORGUARD NORTH AMERICAN RESI		3,300	3,300	49	4,339	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	%
MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS		4,300	4,300	59	5,186	0.0
NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST		3,500	3,500	80	6,980	0.0
NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT		4,700	7,000	75	6,559	0.0
ONEREIT		6,570	6,570	27	2,414	0.0
PLAZA RETAIL REIT		7,500	7,500	33	2,919	0.0
PURE INDUSTRIAL REAL ESTATE		17,000	23,000	153	13,380	0.1
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR		24,200	26,200	630	54,944	0.3
SLATE OFFICE REIT		2,100	—	—	—	—
SLATE OFFICE REIT		—	5,900	47	4,095	0.0
SLATE RETAIL REIT		2,300	2,300	30	2,668	0.0
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		9,700	10,600	328	28,590	0.1
小計	口数・金額	220,970	237,470	4,329	377,076	
	銘柄数<比率>	30	28	—	<1.9%>	
(イギリス)				千英ポンド		
BRITISH LAND		157,600	165,400	1,032	146,437	0.7
CAPITAL & REGIONAL PLC		64,000	93,000	51	7,251	0.0
DERWENT LONDON PLC		17,200	17,700	511	72,519	0.4
BIG YELLOW GROUP PLC		22,500	22,800	173	24,549	0.1
HAMMERSON PLC		121,200	125,500	724	102,749	0.5
MCKAY SECURITIES PLC-ORD		14,200	14,200	33	4,811	0.0
MUCKLOW < A & J > GROUP PLC		7,200	9,200	44	6,377	0.0
INTU PROPERTIES PLC		135,000	147,000	368	52,288	0.3
UNITE GROUP PLC		—	38,400	261	37,100	0.2
SHAFTESBURY PLC		42,100	45,200	447	63,407	0.3
LAND SECURITIES GROUP PLC		121,500	127,300	1,309	185,706	0.9
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		52,200	—	—	—	—
SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST		78,700	78,700	48	6,945	0.0
HANSTEEN HOLDINGS PLC		121,000	138,000	174	24,807	0.1
SAFESTORE HOLDINGS PLC		33,000	33,000	138	19,588	0.1
LONDONMETRIC PROPERTY PLC		101,000	112,000	191	27,183	0.1
SEGRO PLC		124,800	159,800	858	121,769	0.6
WORKSPACE GROUP PLC		17,800	19,900	179	25,447	0.1
REDEFINE INTERNATIONAL PLC		193,000	193,000	75	10,725	0.1
NEWRIVER REIT PLC		35,000	49,000	167	23,799	0.1
CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC		—	29,000	32	4,543	0.0
TRITAX BIG BOX REIT PLC		164,000	217,000	315	44,669	0.2
EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC		67,200	93,857	105	14,936	0.1
ASSURA PLC		256,000	290,000	185	26,312	0.1
LXI REIT PLC		—	18,000	18	2,628	0.0
PRIMARY HEALTH PROPERTIES		91,000	91,000	109	15,481	0.1
REGIONAL REIT LTD		26,000	41,000	42	5,957	0.0
IMPACT HEALTHCARE REIT PLC		—	20,000	20	2,920	0.0
GREAT PORTLAND ESTATES PLC		—	52,500	322	45,699	0.2
小計	口数・金額	2,063,200	2,441,457	7,946	1,126,616	
	銘柄数<比率>	24	28	—	<5.6%>	
(ユーロ…ドイツ)				千ユーロ		
HAMBORNER REIT AG		12,100	12,100	107	13,874	0.1

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…ドイツ)		口	口	千ユーロ	千円	%
ALSTRIA OFFICE REIT-AG		16,600	16,500	206	26,756	0.1
小計	口数・金額	28,700	28,600	313	40,631	
	銘柄数<比率>	2	2	−	<0.2%>	
(ユーロ…イタリア)						
BENI STABILI SPA		168,000	158,000	109	14,201	0.1
IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ		53,604	53,604	46	6,018	0.0
小計	口数・金額	221,604	211,604	156	20,219	
	銘柄数<比率>	2	2	−	<0.1%>	
(ユーロ…フランス)						
ICADE		7,020	7,120	532	68,962	0.3
ALTAREA		355	590	112	14,580	0.1
KLEPIERRE		31,300	33,400	1,138	147,336	0.7
GECINA SA		6,240	7,360	966	125,067	0.6
FONCIERE DES REGIONS		8,020	8,570	708	91,747	0.5
MERCIALYS		8,380	9,400	158	20,468	0.1
UNIBAIL RODAMCO-NA		15,210	16,010	3,491	451,906	2.2
小計	口数・金額	76,525	82,450	7,109	920,069	
	銘柄数<比率>	7	7	−	<4.6%>	
(ユーロ…オランダ)						
EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA		7,500	8,000	280	36,253	0.2
VASTNED RETAIL NV		2,820	2,800	107	13,958	0.1
WERELDHAVE NV		6,000	6,500	270	34,953	0.2
NSI NV		24,000	−	−	−	−
NSI NV		−	2,750	89	11,566	0.1
小計	口数・金額	40,320	20,050	747	96,731	
	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	119	15,411	0.1
HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI		16,900	17,900	276	35,791	0.2
MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA		72,600	76,100	880	114,000	0.6
AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA		8,300	10,000	163	21,095	0.1
小計	口数・金額	112,010	118,210	1,439	186,299	
	銘柄数<比率>	4	4	−	<0.9%>	
(ユーロ…ベルギー)						
BEFIMMO S.C.A.		3,455	3,800	201	26,079	0.1
COFINIMMO		3,050	3,370	362	46,951	0.2
RETAIL ESTATES		870	1,080	81	10,529	0.1
WERELDHAVE BELGIUM		290	290	28	3,728	0.0
INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES		1,900	1,900	42	5,446	0.0
WAREHOUSES DE PAUW SCA		2,520	2,550	246	31,843	0.2
MONTEA SCA		940	940	45	5,863	0.0
AEDIFICA		2,230	2,960	236	30,593	0.2
XIOR STUDENT HOUSING NV		500	750	27	3,591	0.0
小計	口数・金額	15,755	17,640	1,272	164,627	
	銘柄数<比率>	9	9	−	<0.8%>	
(ユーロ…アイルランド)						
GREEN REIT PLC		100,509	114,000	169	21,983	0.1
HIBERNIA REIT PLC		112,000	113,000	165	21,424	0.1

銘柄		期首(前期末)	当期末			
		口数	口数	評価額		比率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…アイルランド)		口	口	千ユーロ	千円	%
IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES		52,800	52,800	71	9,225	0.0
小計	口数・金額	265,309	279,800	406	52,633	
	銘柄数<比率>	3	3	－	<0.3%>	
ユーロ計	口数・金額	760,223	758,354	11,445	1,481,212	
	銘柄数<比率>	31	31	－	<7.3%>	
(香港)				千香港ドル		
LINK REIT		342,000	356,600	22,644	318,376	1.6
PROSPERITY REIT		180,000	180,000	622	8,756	0.0
YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST		160,000	160,000	811	11,405	0.1
CHAMPION REIT		328,000	358,000	2,069	29,093	0.1
SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT		140,000	174,000	896	12,599	0.1
REGAL REAL ESTATE INVESTMENT		120,000	120,000	288	4,049	0.0
FORTUNE REIT		211,000	227,000	2,097	29,490	0.1
SPRING REAL ESTATE INVESTMEN		124,000	124,000	437	6,154	0.0
小計	口数・金額	1,605,000	1,699,600	29,866	419,924	
	銘柄数<比率>	8	8	－	<2.1%>	
(シンガポール)				千シンガポールドル		
CAPITALAND MALL TRUST		406,000	439,000	926	74,751	0.4
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		358,000	393,000	1,049	84,679	0.4
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		335,000	334,000	572	46,225	0.2
SUNTEC REIT		388,000	408,000	773	62,394	0.3
MAPLETREE LOGISTICS TRUST		230,900	255,000	306	24,694	0.1
STARHILL GLOBAL REIT		209,900	209,900	158	12,788	0.1
ASCOTT RESIDENCE TRUST		130,000	193,000	227	18,378	0.1
FRASERS COMMERCIAL TRUST		85,000	83,000	115	9,343	0.0
KEPPEL REIT		285,000	285,000	326	26,334	0.1
FRASERS CENTREPOINT TRUST		94,000	94,000	200	16,157	0.1
ESR REIT		153,300	200,000	111	8,957	0.0
CDL HOSPITALITY TRUSTS		113,000	136,800	217	17,553	0.1
CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST		110,000	110,000	174	14,070	0.1
FIRST REAL ESTATE INVT TRUST		83,500	83,500	111	8,962	0.0
PARKWAY LIFE REAL ESTATE		59,000	59,000	158	12,807	0.1
LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST		282,800	282,800	123	9,927	0.0
MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST		180,000	197,000	361	29,172	0.1
MAPLETREE COMMERCIAL TRUST		273,025	292,025	452	36,527	0.2
CACHE LOGISTICS TRUST		127,000	127,000	112	9,070	0.0
AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT		89,400	89,400	126	10,208	0.1
SABANA SHARIAH COMP IND REIT		133,764	133,764	62	5,073	0.0
MAPLETREE GREATER CHINA COMM		271,900	303,000	333	26,897	0.1
ASCENDAS HOSPITALITY TRUST		129,000	129,000	107	8,640	0.0
FAR EAST HOSPITALITY TRUST		100,000	142,000	93	7,505	0.0
SPH REIT		120,500	120,500	119	9,627	0.0
OUE HOSPITALITY TRUST		160,043	200,043	151	12,188	0.1
SOILBUILD BUSINESS SPACE REI		106,700	106,700	77	6,242	0.0
OUE COMMERCIAL REAL ESTATE I		79,650	79,650	56	4,595	0.0
KEPPEL DC REIT		119,756	119,756	151	12,225	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	%
FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI		158,000	178,000	190	15,370	0.1
小計	口数・金額	5,372,138	5,783,838	7,947	641,373	
	銘柄数<比率>	30	30	－	<3.2%>	
(オーストラリア)				千豪ドル		
BWP TRUST		73,000	80,000	234	20,446	0.1
MIRVAC GROUP		561,000	595,000	1,338	116,779	0.6
INVESTA OFFICE FUND		97,000	95,000	453	39,528	0.2
CROMWELL PROPERTY GROUP		177,000	208,000	193	16,873	0.1
CHARTER HALL RETAIL REIT		48,000	55,000	221	19,286	0.1
ASPEN GROUP		13,000	13,000	14	1,270	0.0
GPT GROUP		271,000	288,000	1,440	125,611	0.6
ABACUS PROPERTY GROUP		45,000	45,000	152	13,267	0.1
ALE PROPERTY GROUP		26,000	26,000	118	10,341	0.1
STOCKLAND TRUST GROUP		370,000	382,000	1,657	144,616	0.7
DEXUS		148,100	162,200	1,553	135,544	0.7
GOODMAN GROUP		245,100	257,400	2,172	189,503	0.9
ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP		7,000	7,000	50	4,365	0.0
360 CAPITAL GROUP LTD		19,000	19,000	18	1,624	0.0
CHARTER HALL GROUP		63,000	76,000	418	36,528	0.2
GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR		26,550	37,550	121	10,612	0.1
GENERATION HEALTHCARE REIT		22,000	－	－	－	－
INGENIA COMMUNITIES GROUP		22,000	32,000	81	7,117	0.0
SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA		109,100	122,000	267	23,306	0.1
ARENA REIT		35,220	43,220	94	8,256	0.0
PROPERTYLINK GROUP		109,000	109,000	92	8,081	0.0
CHARTER HALL LONG WALE REIT		25,000	25,000	104	9,071	0.0
INDUSTRIA REIT		23,000	23,000	54	4,734	0.0
NATIONAL STORAGE REIT		71,018	89,000	137	11,994	0.1
HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L		22,680	22,680	69	6,093	0.0
GDI PROPERTY GROUP		70,300	70,300	72	6,285	0.0
SCENTRE GROUP		809,000	853,000	3,437	299,860	1.5
WESTFIELD CORP		293,400	307,600	2,374	207,142	1.0
FOLKESTONE EDUCATION TRUST		33,250	33,250	93	8,179	0.0
VICINITY CENTRES		504,000	525,000	1,407	122,732	0.6
CENTURIA URBAN REIT		11,100	－	－	－	－
VIVA ENERGY REIT		56,000	69,000	149	13,060	0.1
小計	口数・金額	4,405,818	4,670,200	18,595	1,622,120	
	銘柄数<比率>	32	30	－	<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	202	16,314	0.1
VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST		48,033	48,033	108	8,744	0.0
GOODMAN PROPERTY TRUST		153,000	174,000	222	17,902	0.1
PROPERTY FOR INDUSTRY LTD		67,525	67,525	114	9,227	0.0
ARGOSY PROPERTY LTD		138,000	138,000	144	11,591	0.1
INVESTORE PROPERTY LTD		32,000	32,000	43	3,523	0.0
STRIDE STAPLED GROUP		58,000	58,000	96	7,738	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	
(ニュージーランド)		口	口	千ニュージーランドドル	千円	%
KIWI PROPERTY GROUP LTD		188,000	234,545	320	25,733	0.1
小計	口数・金額	843,129	910,674	1,253	100,777	
	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	397	12,067	0.1
小計	口数・金額	22,490	28,000	397	12,067	
	銘柄数<比率>	1	1	－	<0.1%>	
合計	口数・金額	18,608,372	20,149,566	－	20,025,043	
	銘柄数<比率>	322	323	－	<99.3%>	

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

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当期末		
			買建額	売建額	
外国	REIT先物取引		百万円	百万円	
		DJREA	97	－	
		FTEPR	16	－	

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

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		ベンチマーク 東証株価指数（TOPIX）		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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。

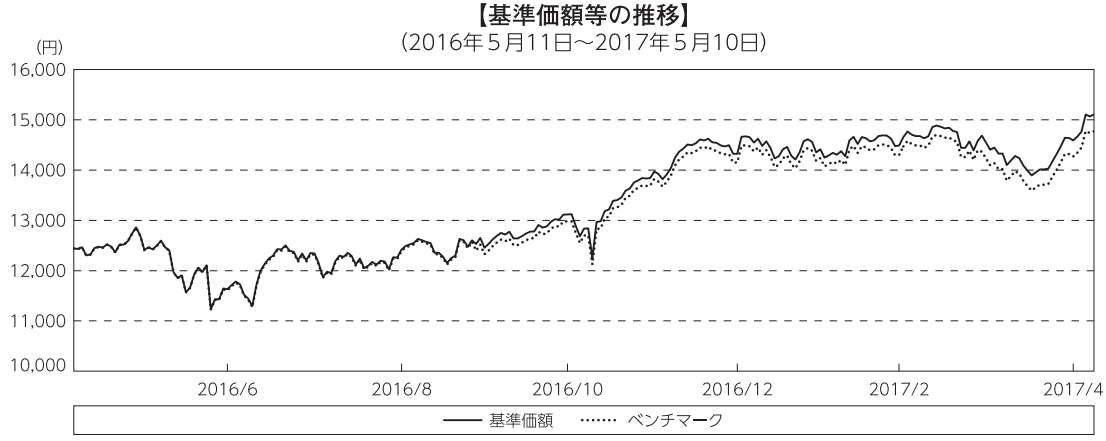
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク 東証株価指数（TOPIX）		株式組入比率	株式先物比率
		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。

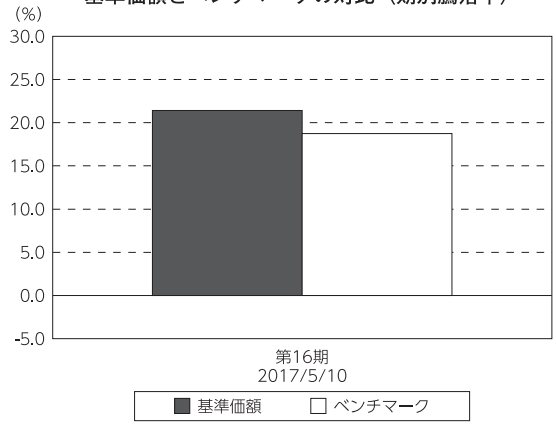
○当ファンドのベンチマークとの差異

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

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（注）ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）です。

◎今後の運用方針

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

（2016年５月11日～2017年５月10日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	0	0.001	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(b) その他費用	0	0.000	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（その他）	(0)	(0.000)	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 株数	買付 金額	売付 株数	売付 金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	20,927 (△16,440)	26,876,464 (－)	17,898	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 新規買付額	買建 決済額	売建 新規売付額	売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	株式先物取引	48,934	51,228	－	－

＊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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	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
	百万円	百万円	百万円
株式	202	84	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
	百万円
株式	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。

○組入資産の明細

(2017年５月10日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
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
ホクリヨウ	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
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
錢高組	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
淺沼組	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
ピーエス三菱	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
ＮＩＰＰＯ	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
大氣社	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
新興プランテック	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
寿スピリッツ	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　Ｆｏｏｄｓ	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－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
キユーピー	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
ピエトロ	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
日本フエルト	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
ＴＳＩ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・パック	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
東亞合成	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
ＪＳＲ	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
ＤＩＣ	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
アジュバンコスメジャパン	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
ＪＣＵ	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
ＪＳＰ	9.4	7	19,782
エフピコ	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
ＪＣＲ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
ビーピー・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
ＪＸＴＧ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
バンドー化学	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
ニッカトー	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
東洋鋼鈑	34.6	35.8	14,749
丸一鋼管	48.4	50	173,000
モリ工業	23	4.7	11,228
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
日本鋳鉄管	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Ｃｏ	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
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	－	0.7	4,949
東洋製罐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
文化シヤッター	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
東洋シヤッター	3.6	3.7	2,349
ＬＩＸＩＬグループ	201.5	208.2	585,458
日本フイルコン	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
東プレ	27.8	28.7	90,692
高周波熱錬	26.9	27.2	26,193
東京製綱	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
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
ペガサスミシン製造	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
酉島製作所	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
蛇の目ミシン工業	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
日本ピストンリング	5.7	5.6	14,397
リケン	64	6.6	34,056
ＴＰＲ	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
ＮＴＮ	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
ユーシン精機	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
日本ピラー工業	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
ＩＨＩ	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
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
ＪＶＣ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
ＩＤＥＣ	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
ＥＩＺＯ	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	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
エスペック	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
オプテックスグループ	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
ＫＯＡ	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	－	－
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	142	29.3	241,432
キヤノン電子	12.7	13.1	28,204
キヤノン	744.1	768.9	2,957,189
リコー	447.5	429.4	399,771
ＭＵＴＯＨ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
三櫻工業	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
日本車輌製造	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
トピー工業	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
ＫＹＢ	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
ＳＵＢＡＲＵ	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
ショーワ	35.9	37.1	40,253
ＴＢＫ	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・デイ	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
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
ＳＨＯ－ＢＩ	4.6	4.8	2,270
ニホンフラッシュ	5.4	6.7	10,036
前田工繊	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
Ａｓ－ｍｅ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
プロネクサス	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
ピジョン	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
ＴＡＳＡＫＩ	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
グローブライド	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%）			
ＳＢＳ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
ＮＳ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
ＡＮＡホールディングス	2,565	2,651	908,232
パスコ	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
キユ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
エーアイテイー	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%）			
ＮＥＣネッツエスアイ	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
ＴＩＳ	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
ＡＧＳ	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
ＫＬａｂ	21.1	26.9	24,694
ポールトゥウィン・ピ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
ｅｎｉｓｈ	4	4.2	4,069
コロプラ	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
オプティム	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
Ｍｉｎｏｒｉ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	−	2.1	4,090
ＰＣＩホールディングス	−	2.3	6,141
パイプド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
ＡＯＩ　ＴＹＯ　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
ＣＩＪ	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
ピー・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
カプコン	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
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
ＪＢＣＣ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%）			
ホウスイ	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
トーメンデバイス	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
佐鳥電機	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
メディパルホールディングス	136.4	141	273,681
アドヴァン	13.9	－	－
ＳＰＫ	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
ハピネット	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
ＩＤＯＭ	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
ダイトロン	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
キヤ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
ＧＳＩ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
ＰＡＬＴＡＣ	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
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
ＪＫ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・ヴイ・エス・ベイエリア	20	1.8	1,247
くらコーポレーション	8	9.2	42,826
キャンドゥ	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
ＤＣＭホールディングス	67.1	85.5	85,072
ＭｏｎｏｔａＲＯ	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
物語コーポレーション	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
Ｈａｍｅｅ	－	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ＣＨＩ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
すかいらーく	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
ブックオフコーポレーション	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
バ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
カッパ・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
ＶＴ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
壱番屋	6.2	9.9	35,838
トップカルチャー	4.9	5.1	2,458
ＰＬＡＮＴ	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
ユニー・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
ＭｒＭａｘ	11.9	17.6	8,518
テンアライド	12.5	13	5,122
ＡＯＫＩ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
Ｏｌｙｍｐｉｃ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
プレナス	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
バ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
サックスバー　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%）			
ＦＰＧ	48.6	50.3	51,809
ＳＢＩ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
だいこう証券ビジネス	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
藍澤證券	25.5	26.4	17,608
マネースクウェアＨＤ	4.7	－	－
マネーパートナーズグループ	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
ＳＯＭＰＯ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
ＮＥＣ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
ＴＨＥ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２４	68.9	71.5	213,213
パラカ	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
レオパレス２１	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
Ｌｉｆｕｌｌ	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
ＣＤＳ	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
ＧＣＡ	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
テ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
ＮＪＳ	2.9	3.3	4,577
綜合警備保障	48.2	54.3	253,309
カカクコム	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ＤＹ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
ＣＤＧ	－	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
ＪＰホールディングス	35.8	42.9	12,827
ＥＰＳ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
ＴＡＣ	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
ぴあ	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
ワタベウェディング	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

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
ＫｅｅＰｅｒ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
ＩＢＪ	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
ＥＲＩ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
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	－	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
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
ＫＮＴ－ＣＴ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	330,412,047
合計 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
			百万円	百万円
国内	株式先物取引	ＴＯＰＩＸ	4,804	－

＊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
	株
貸付有価証券＜株式＞総株数	13,791,000
（野村證券株式会社）	(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
	千円	%
株式	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
のむラップ・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
のむラップ・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
のむラップ・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
のむラップ・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
のむラップ・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
野村ターゲットデートファンド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
野村ターゲットデートファンド2016　2029-2031年目標型	2,532,311
野村ターゲットデートファンド2016　2032-2034年目標型	1,661,340
野村ターゲットデートファンド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

○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	投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）	期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
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	投資信託証券組入比率
		騰落率	MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）	騰落率			
（期首）	円	%		%	%	%	%
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。

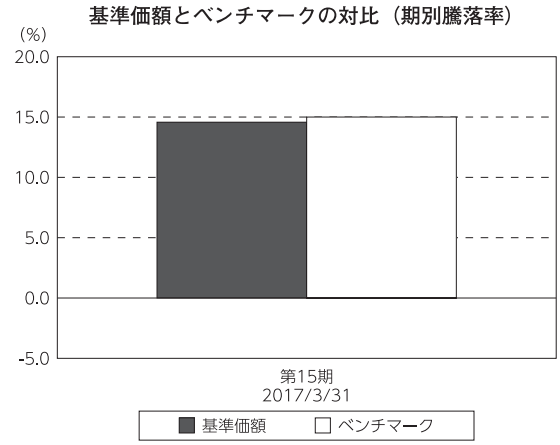
・期中の主な動き

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＋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。



（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。

（マイナス要因）

①コスト負担（売買コストや保管費用など）

②配当金に対する課税（ファンドでは税引き後の配当金が計上される一方、ベンチマークは税引き前で計算されるため）

（その他、差異を生じた要因）

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

◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○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 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	1	0.003	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.001)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	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）	(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
（その他）	(△2)	(△0.007)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
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
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
外国	AGNC INVESTMENT CORP	－ (32,900)	－ (607)	－	－
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,600	741	－	－
	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	－ (△ 32,900)	－ (△ 607)	1,200	22
	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 (△ 56,500)	62 (△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)	－ (277)	11,380	333
	PROLOGIS INC	2,300	115	1,600	79
	PUBLIC STORAGE	1,000	227	790	166
	QUALITY CARE PROPERTIES	－ (9,480)	－ (－)	9,480	117
	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 (32,860)	7,067 (1,485)	66,310	2,689

	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 (15,200)	70 (67)	10,000	49
	SEGRO PLC - NIL PAID RTS	－ (15,200)	－ (－)	－ (15,200)	－ (15)
	小計	32,000 (30,400)	166 (67)	27,000 (15,200)	149 (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	－	－	－ (－)	－ (3)
	UNIBAIL RODAMCO-NA	320	78	350	75
	小計	2,820	251	2,250 (－)	145 (3)
	ユーロ計	2,820	251	2,250 (－)	145 (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 (△ 1)	－ (－)	－ (0.19596)
	SUNTEC REIT	－ (－)	－ (△ 1)	－ (－)	－ (0.38394)
	小計	26,000 (－)	63 (△ 2)	－ (－)	－ (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
		百万円	百万円	百万円	百万円
外国	株式先物取引	61,728	61,796	－	－

＊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	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	33,254	2,377	7.1	42,848	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	期首(前期末)	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	期首(前期末)	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	
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	期首(前期末)	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	
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	期首(前期末)	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	
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	期首(前期末)	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	期首(前期末)	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	
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
INTERPUBRIC 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
KOHLS 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	期首(前期末)	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	
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	期首(前期末)	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	
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 OP 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	期首(前期末)	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
PRAXAIR 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	期首(前期末)	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	期首(前期末)	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	
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	期首(前期末)	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
RENAISSANCERE 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	期首(前期末)	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	
GREAT-WEST LIFECO 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
VERESEN 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	
小計 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
ASHTEAD 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	期首(前期末)	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	
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
DUFRY 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	
小計 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
FRESENIUS 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
FRESENIUS 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	21,587	23,102	111,665	13,376,446	
	銘柄数<比率>	53	57	—	<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	61,952	58,746	25,571	3,063,253	
	銘柄数<比率>	25	23	—	<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	期首(前期末)	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	
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	25,857	26,601	114,235	13,684,273	
	銘柄数<比率>	67	69	—	<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	—	219	771	92,396	
	銘柄数<比率>	—	1	—	<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	17,766	18,183	38,136	4,568,326	
	銘柄数<比率>	24	22	—	<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		期首(前期末)	当期末			業種等
		株数	株数	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(ユーロ…スペイン)		百株	百株	千ユーロ	千円	
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	51,327	55,222	39,595	4,743,167	
	銘柄数<比率>	25	25	—	<1.3%>	
(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	1,947	1,806	13,743	1,646,392	
	銘柄数<比率>	11	10	—	<0.5%>	
(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	1,208	1,231	2,450	293,487	
	銘柄数<比率>	6	6	—	<0.1%>	
(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	39	49	711	85,178	
	銘柄数<比率>	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	期首(前期末)	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	
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
WHEELOCK & 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	88,217	93,790	304,516	4,397,225	
小計 銘柄数<比率>	39	40	—	<1.2%>	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
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
YANGZIJIANG 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	49,892	45,994	21,330	1,712,196	
小計 銘柄数<比率>	23	22	—	<0.5%>	
(オーストラリア)			千豪ドル		
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	期首(前期末)	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	
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	75,126	74,971	116,356	9,988,031	
	銘柄数<比率>	64	62	—	<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	6,271	6,401	3,042	238,652	
	銘柄数<比率>	7	7	—	<0.1%>	
(イスラエル)				千新シェケル		
BANK HAPOALIM 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	5,799	5,271	11,368	351,046	
	銘柄数<比率>	9	9	—	<0.1%>	
合計	株数・金額	1,154,618	1,136,364	—	346,165,525	
	銘柄数<比率>	1,266	1,265	—	<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 INVS 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	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
			百万円	百万円
外国	株式先物取引	CAN60	353	－
		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
	千円	%
株式	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
のむラップ・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
のむラップ・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
のむラップ・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＞

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

野村アセットマネジメント
東京都中央区日本橋１-12-１

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク NOMURA-BPI国債		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
12期(2013年５月10日)	12,185	2.0	357.008	2.0	99.2	－	6,182
13期(2014年５月12日)	12,400	1.8	363.350	1.8	99.1	－	6,349
14期(2015年５月11日)	12,749	2.8	373.608	2.8	99.3	－	6,933
15期(2016年５月10日)	13,701	7.5	401.668	7.5	99.5	－	8,223
16期(2017年５月10日)	13,380	△2.3	392.235	△2.3	99.5	－	16,780

＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク NOMURA-BPI国債		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2016年５月10日	13,701	－	401.668	－	99.5	－
５月末	13,723	0.2	402.312	0.2	99.3	－
６月末	13,912	1.5	407.866	1.5	99.7	－
７月末	13,786	0.6	404.223	0.6	99.4	－
８月末	13,629	△0.5	399.520	△0.5	99.5	－
９月末	13,634	△0.5	399.761	△0.5	99.5	－
10月末	13,593	△0.8	398.501	△0.8	99.5	－
11月末	13,495	△1.5	395.641	△1.5	99.6	－
12月末	13,410	△2.1	393.121	△2.1	99.6	－
2017年１月末	13,330	△2.7	390.734	△2.7	99.6	－
２月末	13,372	△2.4	392.002	△2.4	99.5	－
３月末	13,352	△2.5	391.522	△2.5	99.6	－
４月末	13,423	△2.0	393.569	△2.0	99.7	－
(期末)						
2017年５月10日	13,380	△2.3	392.235	△2.3	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

【基準価額等の推移】
(2016年５月11日～2017年５月10日)

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

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首13,701円から期末13,380円に321円の値下がりとなりました。

日銀による長短金利を誘導目標とした金融政策の導入や、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、外国債券利回りの上昇（価格は下落）などを背景に、国内債券利回りが上昇したため、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、国内債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

その後期末にかけては、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う国内株式の上昇から安全資産としての国債需要が減少したこと、外国債券利回りの上昇（価格は下落）などを背景に、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

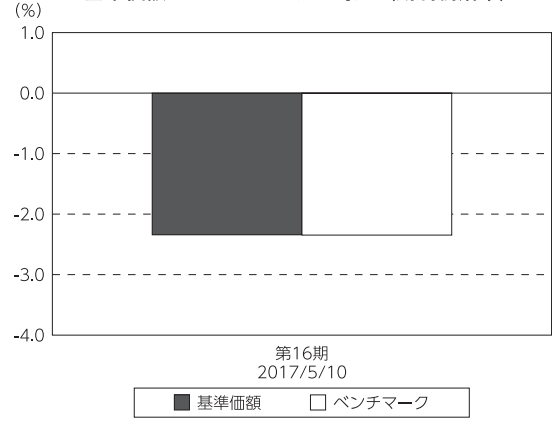
NOMURA-BPI国債の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、デュレーション（金利感応度）などを考慮して選択した日本国債に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は－2.3%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の－2.3%とほぼ同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

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

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（注）ベンチマークは、NOMURA-BPI国債です。

◎今後の運用方針

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

（2016年５月11日～2017年５月10日）

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

（2016年５月11日～2017年５月10日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	11,221,715	2,305,259

＊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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	11,221	172	1.5	2,305	241	10.5

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５月10日現在）

国内公社債

（A）国内（邦貨建）公社債　種類別開示

区分	当期末						
	額面金額	評価額	組入比率	うち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	15,542,000	16,695,477	99.5	－	62.6	25.5	11.4
	（10,000）	（14,223）	（0.1）	（－）	（0.1）	（－）	（－）
合計	15,542,000	16,695,477	99.5	－	62.6	25.5	11.4
	（10,000）	（14,223）	（0.1）	（－）	（0.1）	（－）	（－）

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

(B)国内(邦貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券　利付（２年）第366回	0.1	50,000	50,170	2018/7/15
国庫債券　利付（２年）第367回	0.1	130,000	130,475	2018/8/15
国庫債券　利付（２年）第368回	0.1	170,000	170,652	2018/9/15
国庫債券　利付（２年）第369回	0.1	100,000	100,415	2018/10/15
国庫債券　利付（２年）第371回	0.1	80,000	80,370	2018/12/15
国庫債券　利付（２年）第372回	0.1	120,000	120,585	2019/1/15
国庫債券　利付（２年）第373回	0.1	60,000	60,307	2019/2/15
国庫債券　利付（２年）第374回	0.1	170,000	170,909	2019/3/15
国庫債券　利付（５年）第112回	0.4	130,000	130,856	2018/6/20
国庫債券　利付（５年）第113回	0.3	50,000	50,274	2018/6/20
国庫債券　利付（５年）第114回	0.3	20,000	20,133	2018/9/20
国庫債券　利付（５年）第115回	0.2	140,000	140,743	2018/9/20
国庫債券　利付（５年）第116回	0.2	150,000	150,955	2018/12/20
国庫債券　利付（５年）第117回	0.2	180,000	181,305	2019/3/20
国庫債券　利付（５年）第118回	0.2	110,000	110,860	2019/6/20
国庫債券　利付（５年）第119回	0.1	70,000	70,399	2019/6/20
国庫債券　利付（５年）第120回	0.2	210,000	211,814	2019/9/20
国庫債券　利付（５年）第121回	0.1	160,000	161,003	2019/9/20
国庫債券　利付（５年）第122回	0.1	200,000	201,388	2019/12/20
国庫債券　利付（５年）第123回	0.1	230,000	231,748	2020/3/20
国庫債券　利付（５年）第124回	0.1	240,000	241,946	2020/6/20
国庫債券　利付（５年）第125回	0.1	180,000	181,549	2020/9/20
国庫債券　利付（５年）第126回	0.1	240,000	242,220	2020/12/20
国庫債券　利付（５年）第127回	0.1	200,000	201,938	2021/3/20
国庫債券　利付（５年）第128回	0.1	290,000	292,934	2021/6/20
国庫債券　利付（５年）第129回	0.1	290,000	293,050	2021/9/20
国庫債券　利付（５年）第130回	0.1	170,000	171,972	2021/12/20
国庫債券　利付（５年）第131回	0.1	140,000	141,572	2022/3/20
国庫債券　利付（40年）第１回	2.4	10,000	14,223	2048/3/20
国庫債券　利付（40年）第２回	2.2	30,000	41,237	2049/3/20
国庫債券　利付（40年）第３回	2.2	20,000	27,607	2050/3/20
国庫債券　利付（40年）第４回	2.2	35,000	48,505	2051/3/20
国庫債券　利付（40年）第５回	2.0	40,000	53,227	2052/3/20
国庫債券　利付（40年）第６回	1.9	40,000	52,114	2053/3/20
国庫債券　利付（40年）第７回	1.7	30,000	37,313	2054/3/20
国庫債券　利付（40年）第８回	1.4	40,000	45,971	2055/3/20
国庫債券　利付（40年）第９回	0.4	60,000	49,441	2056/3/20
国庫債券　利付（10年）第293回	1.8	30,000	30,662	2018/6/20
国庫債券　利付（10年）第294回	1.7	40,000	40,838	2018/6/20
国庫債券　利付（10年）第295回	1.5	25,000	25,468	2018/6/20
国庫債券　利付（10年）第296回	1.5	65,000	66,491	2018/9/20
国庫債券　利付（10年）第297回	1.4	40,000	41,029	2018/12/20
国庫債券　利付（10年）第298回	1.3	20,000	20,482	2018/12/20
国庫債券　利付（10年）第299回	1.3	45,000	46,243	2019/3/20
国庫債券　利付（10年）第300回	1.5	35,000	36,097	2019/3/20
国庫債券　利付（10年）第301回	1.5	45,000	46,588	2019/6/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券　利付（10年）第302回	1.4	40,000	41,323	2019/6/20
国庫債券　利付（10年）第303回	1.4	45,000	46,667	2019/9/20
国庫債券　利付（10年）第304回	1.3	30,000	31,040	2019/9/20
国庫債券　利付（10年）第305回	1.3	110,000	114,220	2019/12/20
国庫債券　利付（10年）第306回	1.4	45,000	47,006	2020/3/20
国庫債券　利付（10年）第307回	1.3	30,000	31,251	2020/3/20
国庫債券　利付（10年）第308回	1.3	30,000	31,362	2020/6/20
国庫債券　利付（10年）第309回	1.1	130,000	135,092	2020/6/20
国庫債券　利付（10年）第310回	1.0	30,000	31,164	2020/9/20
国庫債券　利付（10年）第311回	0.8	130,000	134,169	2020/9/20
国庫債券　利付（10年）第312回	1.2	70,000	73,427	2020/12/20
国庫債券　利付（10年）第314回	1.1	30,000	31,447	2021/3/20
国庫債券　利付（10年）第315回	1.2	70,000	73,874	2021/6/20
国庫債券　利付（10年）第316回	1.1	10,000	10,512	2021/6/20
国庫債券　利付（10年）第317回	1.1	30,000	31,624	2021/9/20
国庫債券　利付（10年）第318回	1.0	80,000	83,980	2021/9/20
国庫債券　利付（10年）第319回	1.1	70,000	73,991	2021/12/20
国庫債券　利付（10年）第320回	1.0	90,000	94,714	2021/12/20
国庫債券　利付（10年）第321回	1.0	40,000	42,197	2022/3/20
国庫債券　利付（10年）第322回	0.9	130,000	136,507	2022/3/20
国庫債券　利付（10年）第323回	0.9	120,000	126,289	2022/6/20
国庫債券　利付（10年）第324回	0.8	70,000	73,308	2022/6/20
国庫債券　利付（10年）第325回	0.8	150,000	157,399	2022/9/20
国庫債券　利付（10年）第326回	0.7	60,000	62,742	2022/12/20
国庫債券　利付（10年）第327回	0.8	80,000	84,108	2022/12/20
国庫債券　利付（10年）第328回	0.6	150,000	156,229	2023/3/20
国庫債券　利付（10年）第329回	0.8	130,000	137,187	2023/6/20
国庫債券　利付（10年）第330回	0.8	110,000	116,297	2023/9/20
国庫債券　利付（10年）第331回	0.6	160,000	167,113	2023/9/20
国庫債券　利付（10年）第332回	0.6	110,000	115,044	2023/12/20
国庫債券　利付（10年）第333回	0.6	150,000	157,084	2024/3/20
国庫債券　利付（10年）第334回	0.6	130,000	136,268	2024/6/20
国庫債券　利付（10年）第335回	0.5	130,000	135,380	2024/9/20
国庫債券　利付（10年）第336回	0.5	40,000	41,664	2024/12/20
国庫債券　利付（10年）第337回	0.3	270,000	277,109	2024/12/20
国庫債券　利付（10年）第338回	0.4	160,000	165,481	2025/3/20
国庫債券　利付（10年）第339回	0.4	190,000	196,558	2025/6/20
国庫債券　利付（10年）第340回	0.4	125,000	129,395	2025/9/20
国庫債券　利付（10年）第341回	0.3	150,000	154,005	2025/12/20
国庫債券　利付（10年）第342回	0.1	250,000	252,212	2026/3/20
国庫債券　利付（10年）第343回	0.1	210,000	211,717	2026/6/20
国庫債券　利付（10年）第344回	0.1	290,000	292,166	2026/9/20
国庫債券　利付（10年）第345回	0.1	190,000	191,364	2026/12/20
国庫債券　利付（10年）第346回	0.1	190,000	191,212	2027/3/20
国庫債券　利付（30年）第３回	2.3	40,000	50,757	2030/5/20
国庫債券　利付（30年）第５回	2.2	10,000	12,676	2031/5/20
国庫債券　利付（30年）第６回	2.4	10,000	13,004	2031/11/20
国庫債券　利付（30年）第７回	2.3	15,000	19,353	2032/5/20

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８回	1.8	20,000	24,361	2032/11/22
国庫債券　利付（30年）第９回	1.4	130,000	150,646	2032/12/20
国庫債券　利付（30年）第10回	1.1	60,000	66,709	2033/３/20
国庫債券　利付（30年）第11回	1.7	10,000	12,049	2033/６/20
国庫債券　利付（30年）第12回	2.1	10,000	12,678	2033/９/20
国庫債券　利付（30年）第13回	2.0	10,000	12,540	2033/12/20
国庫債券　利付（30年）第14回	2.4	30,000	39,599	2034/３/20
国庫債券　利付（30年）第15回	2.5	10,000	13,373	2034/６/20
国庫債券　利付（30年）第16回	2.5	10,000	13,397	2034/９/20
国庫債券　利付（30年）第17回	2.4	10,000	13,246	2034/12/20
国庫債券　利付（30年）第18回	2.3	20,000	26,179	2035/３/20
国庫債券　利付（30年）第19回	2.3	10,000	13,097	2035/６/20
国庫債券　利付（30年）第20回	2.5	10,000	13,464	2035/９/20
国庫債券　利付（30年）第21回	2.3	10,000	13,131	2035/12/20
国庫債券　利付（30年）第22回	2.5	10,000	13,492	2036/３/20
国庫債券　利付（30年）第23回	2.5	40,000	54,046	2036/６/20
国庫債券　利付（30年）第24回	2.5	10,000	13,518	2036/９/20
国庫債券　利付（30年）第25回	2.3	20,000	26,334	2036/12/20
国庫債券　利付（30年）第26回	2.4	20,000	26,742	2037/３/20
国庫債券　利付（30年）第27回	2.5	20,000	27,190	2037/９/20
国庫債券　利付（30年）第28回	2.5	30,000	40,906	2038/３/20
国庫債券　利付（30年）第29回	2.4	20,000	26,968	2038/９/20
国庫債券　利付（30年）第30回	2.3	50,000	66,616	2039/３/20
国庫債券　利付（30年）第31回	2.2	30,000	39,462	2039/９/20
国庫債券　利付（30年）第32回	2.3	40,000	53,613	2040/３/20
国庫債券　利付（30年）第33回	2.0	50,000	64,013	2040/９/20
国庫債券　利付（30年）第34回	2.2	40,000	53,078	2041/３/20
国庫債券　利付（30年）第35回	2.0	42,000	54,037	2041/９/20
国庫債券　利付（30年）第36回	2.0	30,000	38,666	2042/３/20
国庫債券　利付（30年）第37回	1.9	30,000	38,080	2042/９/20
国庫債券　利付（30年）第38回	1.8	50,000	62,382	2043/３/20
国庫債券　利付（30年）第39回	1.9	20,000	25,437	2043/６/20
国庫債券　利付（30年）第40回	1.8	30,000	37,468	2043/９/20
国庫債券　利付（30年）第41回	1.7	20,000	24,513	2043/12/20
国庫債券　利付（30年）第42回	1.7	60,000	73,563	2044/３/20
国庫債券　利付（30年）第43回	1.7	50,000	61,391	2044/６/20
国庫債券　利付（30年）第44回	1.7	30,000	36,846	2044/９/20
国庫債券　利付（30年）第45回	1.5	40,000	47,185	2044/12/20
国庫債券　利付（30年）第46回	1.5	60,000	70,776	2045/３/20
国庫債券　利付（30年）第47回	1.6	20,000	24,086	2045/６/20
国庫債券　利付（30年）第48回	1.4	40,000	46,188	2045/９/20
国庫債券　利付（30年）第49回	1.4	50,000	57,723	2045/12/20
国庫債券　利付（30年）第50回	0.8	70,000	70,000	2046/３/20
国庫債券　利付（30年）第51回	0.3	120,000	104,355	2046/６/20
国庫債券　利付（30年）第52回	0.5	100,000	91,992	2046/９/20
国庫債券　利付（30年）第53回	0.6	90,000	84,978	2046/12/20
国庫債券　利付（30年）第54回	0.8	60,000	59,712	2047/３/20
国庫債券　利付（20年）第41回	1.5	30,000	30,940	2019/３/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券　利付（20年）第42回	2.6	10,000	10,518	2019/3/20
国庫債券　利付（20年）第43回	2.9	10,000	10,724	2019/9/20
国庫債券　利付（20年）第44回	2.5	10,000	10,762	2020/3/20
国庫債券　利付（20年）第45回	2.4	10,000	10,734	2020/3/20
国庫債券　利付（20年）第46回	2.2	5,000	5,368	2020/6/22
国庫債券　利付（20年）第47回	2.2	15,000	16,188	2020/9/21
国庫債券　利付（20年）第48回	2.5	30,000	32,880	2020/12/21
国庫債券　利付（20年）第49回	2.1	40,000	43,486	2021/3/22
国庫債券　利付（20年）第52回	2.1	25,000	27,445	2021/9/21
国庫債券　利付（20年）第53回	2.1	10,000	11,033	2021/12/20
国庫債券　利付（20年）第54回	2.2	10,000	11,080	2021/12/20
国庫債券　利付（20年）第55回	2.0	10,000	11,035	2022/3/21
国庫債券　利付（20年）第56回	2.0	10,000	11,083	2022/6/20
国庫債券　利付（20年）第57回	1.9	10,000	11,032	2022/6/20
国庫債券　利付（20年）第58回	1.9	10,000	11,083	2022/9/20
国庫債券　利付（20年）第59回	1.7	30,000	33,054	2022/12/20
国庫債券　利付（20年）第60回	1.4	10,000	10,849	2022/12/20
国庫債券　利付（20年）第61回	1.0	10,000	10,650	2023/3/20
国庫債券　利付（20年）第62回	0.8	10,000	10,556	2023/6/20
国庫債券　利付（20年）第63回	1.8	10,000	11,167	2023/6/20
国庫債券　利付（20年）第64回	1.9	10,000	11,272	2023/9/20
国庫債券　利付（20年）第65回	1.9	10,000	11,315	2023/12/20
国庫債券　利付（20年）第66回	1.8	20,000	22,497	2023/12/20
国庫債券　利付（20年）第67回	1.9	10,000	11,364	2024/3/20
国庫債券　利付（20年）第68回	2.2	10,000	11,571	2024/3/20
国庫債券　利付（20年）第69回	2.1	30,000	34,507	2024/3/20
国庫債券　利付（20年）第70回	2.4	40,000	47,056	2024/6/20
国庫債券　利付（20年）第71回	2.2	10,000	11,621	2024/6/20
国庫債券　利付（20年）第72回	2.1	20,000	23,184	2024/9/20
国庫債券　利付（20年）第73回	2.0	30,000	34,670	2024/12/20
国庫債券　利付（20年）第74回	2.1	10,000	11,633	2024/12/20
国庫債券　利付（20年）第75回	2.1	40,000	46,708	2025/3/20
国庫債券　利付（20年）第76回	1.9	17,000	19,583	2025/3/20
国庫債券　利付（20年）第77回	2.0	15,000	17,397	2025/3/20
国庫債券　利付（20年）第78回	1.9	10,000	11,563	2025/6/20
国庫債券　利付（20年）第79回	2.0	10,000	11,644	2025/6/20
国庫債券　利付（20年）第80回	2.1	10,000	11,726	2025/6/20
国庫債券　利付（20年）第81回	2.0	10,000	11,686	2025/9/20
国庫債券　利付（20年）第82回	2.1	15,000	17,655	2025/9/20
国庫債券　利付（20年）第83回	2.1	15,000	17,719	2025/12/20
国庫債券　利付（20年）第84回	2.0	50,000	58,633	2025/12/20
国庫債券　利付（20年）第85回	2.1	13,000	15,410	2026/3/20
国庫債券　利付（20年）第86回	2.3	10,000	12,031	2026/3/20
国庫債券　利付（20年）第88回	2.3	20,000	24,167	2026/6/20
国庫債券　利付（20年）第90回	2.2	20,000	24,072	2026/9/20
国庫債券　利付（20年）第91回	2.3	10,000	12,129	2026/9/20
国庫債券　利付（20年）第92回	2.1	30,000	35,966	2026/12/20
国庫債券　利付（20年）第93回	2.0	20,000	23,859	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	20,000	24,056	2027/3/20
国庫債券　利付（20年）第95回	2.3	10,000	12,268	2027/6/20
国庫債券　利付（20年）第96回	2.1	15,000	18,101	2027/6/20
国庫債券　利付（20年）第97回	2.2	50,000	61,046	2027/9/20
国庫債券　利付（20年）第99回	2.1	130,000	157,870	2027/12/20
国庫債券　利付（20年）第100回	2.2	20,000	24,562	2028/3/20
国庫債券　利付（20年）第101回	2.4	20,000	24,993	2028/3/20
国庫債券　利付（20年）第102回	2.4	20,000	25,080	2028/6/20
国庫債券　利付（20年）第103回	2.3	25,000	31,075	2028/6/20
国庫債券　利付（20年）第104回	2.1	10,000	12,210	2028/6/20
国庫債券　利付（20年）第105回	2.1	70,000	85,723	2028/9/20
国庫債券　利付（20年）第106回	2.2	10,000	12,358	2028/9/20
国庫債券　利付（20年）第107回	2.1	20,000	24,547	2028/12/20
国庫債券　利付（20年）第108回	1.9	10,000	12,044	2028/12/20
国庫債券　利付（20年）第109回	1.9	10,000	12,066	2029/3/20
国庫債券　利付（20年）第110回	2.1	20,000	24,599	2029/3/20
国庫債券　利付（20年）第111回	2.2	10,000	12,452	2029/6/20
国庫債券　利付（20年）第112回	2.1	35,000	43,166	2029/6/20
国庫債券　利付（20年）第113回	2.1	40,000	49,434	2029/9/20
国庫債券　利付（20年）第114回	2.1	30,000	37,169	2029/12/20
国庫債券　利付（20年）第115回	2.2	10,000	12,513	2029/12/20
国庫債券　利付（20年）第116回	2.2	10,000	12,537	2030/3/20
国庫債券　利付（20年）第118回	2.0	40,000	49,227	2030/6/20
国庫債券　利付（20年）第119回	1.8	50,000	60,256	2030/6/20
国庫債券　利付（20年）第120回	1.6	25,000	29,489	2030/6/20
国庫債券　利付（20年）第121回	1.9	40,000	48,815	2030/9/20
国庫債券　利付（20年）第122回	1.8	20,000	24,147	2030/9/20
国庫債券　利付（20年）第123回	2.1	10,000	12,492	2030/12/20
国庫債券　利付（20年）第124回	2.0	20,000	24,720	2030/12/20
国庫債券　利付（20年）第125回	2.2	10,000	12,653	2031/3/20
国庫債券　利付（20年）第126回	2.0	30,000	37,154	2031/3/20
国庫債券　利付（20年）第127回	1.9	20,000	24,484	2031/3/20
国庫債券　利付（20年）第128回	1.9	70,000	85,855	2031/6/20
国庫債券　利付（20年）第129回	1.8	20,000	24,257	2031/6/20
国庫債券　利付（20年）第130回	1.8	40,000	48,560	2031/9/20
国庫債券　利付（20年）第131回	1.7	85,000	102,012	2031/9/20
国庫債券　利付（20年）第132回	1.7	30,000	36,029	2031/12/20
国庫債券　利付（20年）第133回	1.8	40,000	48,600	2031/12/20
国庫債券　利付（20年）第134回	1.8	30,000	36,503	2032/3/20
国庫債券　利付（20年）第135回	1.7	15,000	18,024	2032/3/20
国庫債券　利付（20年）第136回	1.6	90,000	106,866	2032/3/20
国庫債券　利付（20年）第137回	1.7	10,000	12,031	2032/6/20
国庫債券　利付（20年）第138回	1.5	110,000	129,076	2032/6/20
国庫債券　利付（20年）第139回	1.6	10,000	11,878	2032/6/20
国庫債券　利付（20年）第140回	1.7	120,000	144,453	2032/9/20
国庫債券　利付（20年）第141回	1.7	70,000	84,297	2032/12/20
国庫債券　利付（20年）第142回	1.8	20,000	24,382	2032/12/20
国庫債券　利付（20年）第143回	1.6	40,000	47,582	2033/3/20

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144回	1.5	10,000	11,736	2033/3/20
国庫債券　利付（20年）第145回	1.7	10,000	12,049	2033/6/20
国庫債券　利付（20年）第146回	1.7	60,000	72,309	2033/9/20
国庫債券　利付（20年）第147回	1.6	20,000	23,793	2033/12/20
国庫債券　利付（20年）第148回	1.5	60,000	70,421	2034/3/20
国庫債券　利付（20年）第149回	1.5	70,000	82,131	2034/6/20
国庫債券　利付（20年）第150回	1.4	110,000	127,234	2034/9/20
国庫債券　利付（20年）第151回	1.2	70,000	78,565	2034/12/20
国庫債券　利付（20年）第152回	1.2	50,000	56,058	2035/3/20
国庫債券　利付（20年）第153回	1.3	60,000	68,253	2035/6/20
国庫債券　利付（20年）第154回	1.2	120,000	134,350	2035/9/20
国庫債券　利付（20年）第155回	1.0	120,000	129,992	2035/12/20
国庫債券　利付（20年）第156回	0.4	160,000	155,899	2036/3/20
国庫債券　利付（20年）第157回	0.2	160,000	149,670	2036/6/20
国庫債券　利付（20年）第158回	0.5	150,000	148,039	2036/9/20
国庫債券　利付（20年）第159回	0.6	120,000	120,315	2036/12/20
国庫債券　利付（20年）第160回	0.7	100,000	101,955	2037/3/20
合計		15,542,000	16,695,477	

＊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
	千円	%
公社債	16,695,477	99.4
コール・ローン等、その他	99,493	0.6
投資信託財産総額	16,794,970	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	16,794,970,250
コール・ローン等	65,414,005
公社債(評価額)	16,695,477,060
未収利息	31,056,038
前払費用	3,023,147
(B) 負債	14,102,279
未払解約金	14,102,195
未払利息	84
(C) 純資産総額(A－B)	16,780,867,971
元本	12,541,631,820
次期繰越損益金	4,239,236,151
(D) 受益権総口数	12,541,631,820口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,380円

(注) 期首元本額は6,001,927,033円、期中追加設定元本額は8,264,665,487円、期中一部解約元本額は1,724,960,700円、1口当たり純資産額は1.3380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	107,033,238
受取利息	107,097,913
支払利息	△ 64,675
(B) 有価証券売買損益	△ 405,875,940
売買益	5,486,800
売買損	△ 411,362,740
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 298,842,702
(D) 前期繰越損益金	2,221,574,743
(E) 追加信託差損益金	2,900,432,035
(F) 解約差損益金	△ 583,927,925
(G) 計(C＋D＋E＋F)	4,239,236,151
次期繰越損益金(G)	4,239,236,151

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末元本額
	円
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）	5,425,396,206
野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）	4,286,547,054
野村DC運用戦略ファンド	774,137,021
バランスセレクト50	621,163,457
バランスセレクト30	540,077,672
ネクストコア	434,840,753
バランスセレクト70	246,288,282
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	106,264,907
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	47,377,704
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	21,405,749
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	19,998,284
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	18,134,731

○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＞

野村マネー マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日2016年８月19日）

作成対象期間（2015年８月20日～2016年８月19日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント
東京都中央区日本橋１-12-１

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率			
	円	%	%	%	百万円
10期(2012年８月20日)	10,181	0.1	100.7	－	2,216
11期(2013年８月19日)	10,191	0.1	80.9	－	5,297
12期(2014年８月19日)	10,199	0.1	59.7	－	8,648
13期(2015年８月19日)	10,206	0.1	44.7	－	22,034
14期(2016年８月19日)	10,211	0.0	68.6	－	19,722

＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。
＊当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

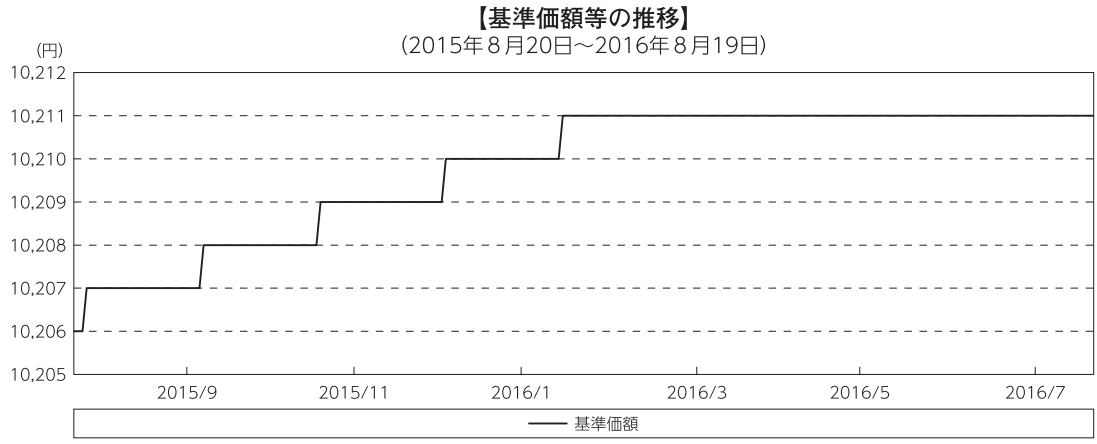
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		
(期　首)	円	%	%	%
2015年８月19日	10,206	－	44.7	－
８月末	10,207	0.0	48.6	－
９月末	10,207	0.0	43.6	－
10月末	10,208	0.0	44.4	－
11月末	10,209	0.0	48.8	－
12月末	10,209	0.0	48.5	－
2016年１月末	10,210	0.0	51.8	－
２月末	10,211	0.0	49.1	－
３月末	10,211	0.0	40.8	－
４月末	10,211	0.0	39.9	－
５月末	10,211	0.0	62.4	－
６月末	10,211	0.0	58.0	－
７月末	10,211	0.0	65.1	－
(期　末) 2016年８月19日	10,211	0.0	68.6	－

＊騰落率は期首比です。
＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



○基準価額の主な変動要因

投資している短期有価証券等からのインカムゲイン（利息収入）。

○投資環境

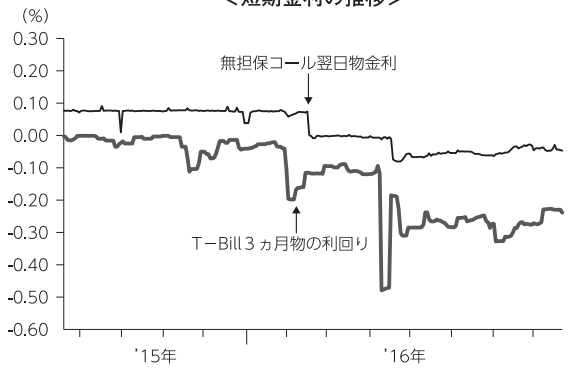
国内経済は、足許の企業収益に弱さがみられるものの、企業収益の水準としては依然として高水準にある事や雇用環境の改善などを受け、基調としては緩やかな回復を続けました。しかしながら、新興国を中心とした海外経済には弱さが見られ、また個人消費の不振が長引く中で物価見通しについても低下するなど、国内経済の下押しリスクがより認識されるようになりました。

このような中、日本銀行は「量的・質的金融緩和」を継続し、2016年１月の金融政策決定会合において「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入を決定するなど、一層の金融緩和を図りました。

・無担保コール翌日物金利の推移

2016年２月半ば頃まで概ね0.07％台で推移しました。日本銀行当座預金の一部へのマイナス金利の適用が開始された２月16日以降は、概ねゼロ％近傍のマイナス圏で推移しました。無担保コール取引による資金の運用ニーズが高まった４月18日以降、そのマイナス幅は深まりました。

＜短期金利の推移＞



・T-Bill（国庫短期証券）３ヵ月物の利回りの推移

日本銀行による買入や海外からの資金流入に伴う需給ひっ迫などにより、期を通じて利回りはマイナス圏で推移しました。日本銀行がマイナス金利導入を決定した2016年１月末以降、利回りは低下し、４月以降についてはマイナス幅が一段と深まりました。

○当ファンドのポートフォリオ

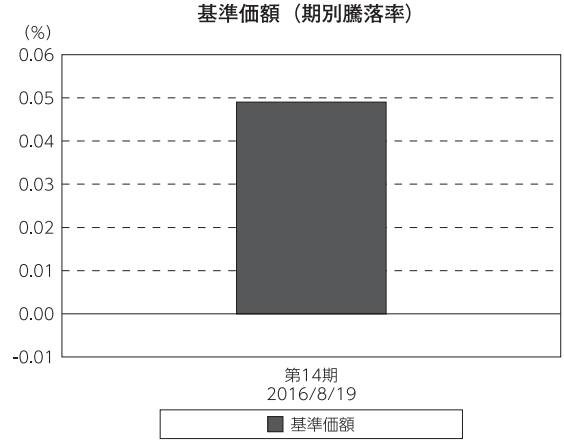
（１）残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせて債券現先取引やコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図るという方針のもと、運用してまいりました。

（２）今期の運用につきましては、残存期間の短い高格付けの公社債等によってポートフォリオを構築し、流動性に関しては、債券現先取引やコール・ローン等により運用してまいりました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

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

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



◎今後の運用方針

今後も、残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資を行ない、あわせて債券現先取引やコール・ローン等で運用を行なうことで流動性の確保を図って運用してまいります。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

（2015年８月20日～2016年８月19日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	0	0.001	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（その他）	(0)	(0.001)	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、10,209円です。			

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

○売買及び取引の状況

（2015年８月20日～2016年８月19日）

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	42,008,214	38,608,278 (4,580,000)
	地方債証券	8,739,283	－ (7,094,300)
	特殊債券	18,846,302	－ (15,866,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	3,709,487	－ (3,400,000)

＊金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）
＊単位未満は切り捨て。
＊（ ）内は償還等による増減分で、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。

その他有価証券

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	コマーシャル・ペーパー	5,898,732	－ (7,200,000)

＊金額は受け渡し代金。
＊単位未満は切り捨て。
＊（ ）内は償還等による増減分です。

○利害関係人との取引状況等

（2015年８月20日～2016年８月19日）

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	34,695	4,630	13.3	－	－	－
預金	231,734	231,734	100.0	231,734	231,734	100.0

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

○組入資産の明細

（2016年８月19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	%	%	%	%	%
地方債証券	2,898,010	2,904,779	14.7	－	－	－	14.7
	(2,898,010)	(2,904,779)	(14.7)	(－)	(－)	(－)	(14.7)
特殊債券（除く金融債）	5,325,000	5,333,466	27.0	－	－	－	27.0
	(5,325,000)	(5,333,466)	(27.0)	(－)	(－)	(－)	(27.0)
金融債券	3,780,000	3,783,502	19.2	－	－	－	19.2
	(3,780,000)	(3,783,502)	(19.2)	(－)	(－)	(－)	(19.2)
普通社債券（含む投資法人債券）	1,500,000	1,501,704	7.6	－	－	－	7.6
	(1,500,000)	(1,501,704)	(7.6)	(－)	(－)	(－)	(7.6)
合計	13,503,010	13,523,452	68.6	－	－	－	68.6
	(13,503,010)	(13,523,452)	(68.6)	(－)	(－)	(－)	(68.6)

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

(B)国内(邦貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
東京都　公募第637回	1.81	200,000	200,273	2016/9/20
東京都　公募第638回	1.9	600,000	600,929	2016/9/20
北海道　公募平成18年度第７回	2.0	1,500	1,505	2016/10/31
北海道　公募平成18年度第10回	1.9	200,000	201,375	2016/12/28
北海道　公募（５年）平成23年度第12回	0.38	5,000	5,007	2017/1/31
北海道　公募（５年）平成23年度第14回	0.35	200,000	200,477	2017/3/23
神奈川県　公募第143回	1.77	100,000	100,596	2016/12/20
神奈川県　公募（５年）第49回	0.37	101,700	101,728	2016/9/20
大阪府　公募第294回	2.0	12,000	12,024	2016/9/28
大阪府　公募第295回	1.9	1,000	1,003	2016/10/28
大阪府　公募（５年）第77回	0.42	100,000	100,071	2016/10/28
兵庫県　公募平成18年度第８回	2.1	200,000	200,060	2016/8/24
埼玉県　公募（５年）平成23年度第５回	0.41	200,000	200,098	2016/9/29
福岡県　公募平成18年度第３回	1.9	1,000	1,003	2016/10/31
千葉県　公募平成18年度第４回	1.8	8,600	8,626	2016/10/25
群馬県　公募第３回	1.9	9,000	9,042	2016/11/25
大分県　公募平成18年度第１回	1.8	198,000	198,709	2016/10/31
共同発行市場地方債　公募第41回	2.0	6,000	6,001	2016/8/25
共同発行市場地方債　公募第43回	1.8	4,000	4,012	2016/10/25
共同発行市場地方債　公募第44回	1.8	100,000	100,476	2016/11/25
島根県　公募平成23年度第１回	0.38	2,500	2,502	2016/11/25
熊本県　公募平成18年度第２回	1.8	7,500	7,524	2016/10/27
名古屋市　公募第456回	1.82	16,000	16,024	2016/9/20
京都市　公募平成23年度第３回	0.364	4,000	4,001	2016/9/29
横浜市　公募平成18年度第３回	1.87	200,000	201,260	2016/12/20
札幌市　公募（５年）平成23年度第５回	0.4	12,900	12,903	2016/9/20
川崎市　公募（５年）第29回	0.36	12,200	12,203	2016/9/20
川崎市　公募（５年）第31回	0.27	2,000	2,002	2017/3/17
北九州市　公募（５年）平成23年度第１回	0.36	7,000	7,002	2016/9/28
福岡市　公募平成23年度第３回	0.39	300,000	300,041	2016/8/26
広島市　公募平成18年度第１回	1.82	6,000	6,037	2016/12/26
仙台市　公募平成23年度第１回	0.36	59,410	59,484	2017/1/27
さいたま市　公募第４回	1.8	5,000	5,030	2016/12/26
鹿児島県　公募平成18年度第１回	1.9	7,200	7,226	2016/10/31
鹿児島県　公募（５年）平成23年度第１回	0.37	8,500	8,505	2016/10/31
小計		2,898,010	2,904,779	
特殊債券(除く金融債)				
政保　地方公共団体金融機構債券（４年）　第２回	0.13	200,000	200,017	2016/8/30
日本政策投資銀行債券　政府保証第13回	2.0	290,000	290,093	2016/8/25
日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第17回	2.0	100,000	100,067	2016/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第19回	1.8	700,000	701,332	2016/9/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券　政府保証債第21回	1.8	125,000	125,645	2016/11/30
日本政策投資銀行社債　財投機関債第19回	0.445	300,000	300,482	2016/12/20
日本政策投資銀行債券　財投機関債第27回	1.98	100,000	100,172	2016/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券　財投機関債第15回	2.05	100,000	100,177	2016/9/20
地方公共団体金融機構債券（５年）　第９回	0.34	100,000	100,251	2017/4/28

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
特殊債券(除く金融債)				
地方公共団体金融機構債券（２年）　第２回	0.1	200,000	200,179	2017/３/28
公営企業債券　第24回財投機関債	1.94	100,000	100,650	2016/12/20
首都高速道路　第８回	0.439	140,000	140,048	2016/９/20
日本政策金融公庫社債　第20回財投機関債	0.471	900,000	900,378	2016/９/20
日本政策金融公庫社債　第43回財投機関債	0.101	200,000	200,076	2016/11/18
関西国際空港社債　財投機関債第31回	0.504	70,000	70,030	2016/９/20
中部国際空港社債　財投機関債第２回	0.489	1,300,000	1,303,478	2017/２/24
日本学生支援債券　財投機関債第38回	0.1	300,000	300,206	2017/２/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券　財投機関債第10回	1.99	100,000	100,176	2016/９/20
小計		5,325,000	5,333,466	
金融債券				
商工債券　利付第736回い号	0.45	300,000	300,133	2016/９/27
商工債券　利付第737回い号	0.45	200,000	200,156	2016/10/27
商工債券　利付第738回い号	0.45	200,000	200,239	2016/11/25
農林債券　利付第735回い号	0.45	150,000	150,012	2016/８/26
農林債券　利付第736回い号	0.5	750,000	750,407	2016/９/27
農林債券　利付第737回い号	0.5	80,000	80,063	2016/10/27
農林債券　利付第739回い号	0.5	500,000	500,885	2016/12/27
農林債券　利付第742回い号	0.45	200,000	200,540	2017/３/27
しんきん中金債券　利付第261回	0.45	500,000	500,073	2016/８/26
しんきん中金債券　利付第262回	0.45	100,000	100,045	2016/９/27
しんきん中金債券　利付第263回	0.5	100,000	100,093	2016/10/27
しんきん中金債券　利付第266回	0.45	300,000	300,618	2017/１/27
商工債券　利付（３年）第164回	0.2	200,000	200,036	2016/９/27
商工債券　利付（３年）第166回	0.2	100,000	100,052	2016/11/25
商工債券　利付（３年）第171回	0.2	100,000	100,142	2017/４/27
小計		3,780,000	3,783,502	
普通社債券(含む投資法人債券)				
アサヒグループホールディングス　第１回特定社債間限定同順位特	0.52	200,000	200,181	2016/10/21
みずほコーポレート銀行　第27回特定社債間限定同順位特約付	0.515	500,000	500,431	2016/10/20
三菱東京ＵＦＪ銀行　第129回特定社債間限定同順位特約付	0.465	100,000	100,078	2016/10/20
三菱東京ＵＦＪ銀行　第148回特定社債間限定同順位特約付	0.195	100,000	100,041	2016/10/31
三井住友銀行　第55回社債間限定同順位特約付	0.47	100,000	100,083	2016/10/20
トヨタファイナンス　第23回社債間限定同等特約付	1.97	100,000	100,166	2016/９/20
三菱ＵＦＪリース　第15回社債間限定同順位特約付	0.66	400,000	400,720	2016/12/14
小計		1,500,000	1,501,704	
合計		13,503,010	13,523,452	

＊額面・評価額の単位未満は切り捨て。

国内その他有価証券

区分	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
コマーシャル・ペーパー	1,199,980	6.1

＊比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
＊金額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年８月19日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	13,523,452	65.9
その他有価証券	1,199,980	5.8
コール・ローン等、その他	5,800,725	28.3
投資信託財産総額	20,524,157	100.0

＊金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年８月19日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	20,524,157,958
コール・ローン等	5,763,236,241
公社債(評価額)	13,523,452,183
その他有価証券	1,199,980,051
未収利息	16,503,055
前払費用	20,986,428
(B) 負債	801,532,052
未払金	801,524,000
未払利息	8,052
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	19,722,625,906
元本	19,315,765,955
次期繰越損益金	406,859,951
(D) 受益権総口数	19,315,765,955口
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	10,211円

(注) 期首元本額は21,588,342,274円、期中追加設定元本額は3,803,787,310円、期中一部解約元本額は6,076,363,629円、１口当たり純資産額は1.0211円です。

○損益の状況 (2015年８月20日～2016年８月19日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	92,619,318
受取利息	92,152,370
その他収益金	1,948,259
支払利息	△ 1,481,311
(B) 有価証券売買損益	△ 83,175,377
売買益	14,438
売買損	△ 83,189,815
(C) 保管費用等	△ 214,563
(D) 当期損益金(Ａ＋Ｂ＋Ｃ)	9,229,378
(E) 前期繰越損益金	445,681,696
(F) 追加信託差損益金	79,665,282
(G) 解約差損益金	△127,716,405
(H) 計(Ｄ＋Ｅ＋Ｆ＋Ｇ)	406,859,951
次期繰越損益金(Ｈ)	406,859,951

＊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
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	5,423,785,404
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)	4,206,288,588
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプライス(適格機関投資家専用)	4,181,906,577
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Zプライス(適格機関投資家専用)	2,296,160,091
日本株インカムプラスα(公社債運用移行型)1305(適格機関投資家転売制限付)	1,186,053,936
野村DC運用戦略ファンド	379,067,282
ネクストコア	343,183,624
野村日本ブランド株投資(マネープールファンド)年2回決算型	317,657,897

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村世界高金利通貨投信	151,953,753
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2015-06	146,986,772
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(マネープールファンド)年2回決算型	113,781,191
バンクローンファンド(為替ヘッジあり)2014-09	98,039,216
ノムラ・アジア・シリーズ(マネープール・ファンド)	84,639,967
野村米国ハイ・イールド債券投信(マネープールファンド)年2回決算型	49,578,893
野村高金利国際機関債投信(毎月分配型)	49,354,623
野村新エマージング債券投信(マネープールファンド)年2回決算型	47,082,117

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村ピクテ・ジェネリック&ゲノム　マネープール・ファンド	33,758,750
野村新中国株投資　マネープール・ファンド	17,198,352
野村世界業種別投資シリーズ(マネープール・ファンド)	10,016,716
米国変動好金利ファンド　Aコース	8,829,589
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（マネープールファンド）年2回決算型	8,788,959
野村グローバルCB投信（マネープールファンド）年2回決算型	6,157,226
野村新興国消費関連株投信　マネープール・ファンド	5,393,879
野村DC運用戦略ファンドM	4,553,821
野村新米国ハイ・イールド債券投信（マネープールファンド）年2回決算型	4,315,818
コインの未来（毎月分配型）	3,965,894
野村アフリカ株投資 マネープール・ファンド	3,607,923
野村・グリーン・テクノロジー　マネープール・ファンド	1,511,406
コインの未来（年2回分配型）	991,474
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（資源国通貨コース）毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（アジア通貨コース）毎月分配型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（資源国通貨コース）年2回決算型	984,834
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（アジア通貨コース）年2回決算型	984,834
野村グローバルCB投信（円コース）毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信（資源国通貨コース）毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信（アジア通貨コース）毎月分配型	984,543
野村グローバルCB投信（円コース）年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信（資源国通貨コース）年2回決算型	984,543
野村グローバルCB投信（アジア通貨コース）年2回決算型	984,543
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（円コース）毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（豪ドルコース）毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（ブラジルレアルコース）毎月分配型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（円コース）年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（豪ドルコース）年2回決算型	984,252
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	984,252
野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）毎月分配型	983,768
野村米国ブランド株投資（円コース）年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資（資源国通貨コース）年2回決算型	983,768
野村米国ブランド株投資（アジア通貨コース）年2回決算型	983,768
ノムラ・グローバルトレンド（円コース）毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）毎月分配型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド（円コース）年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド（資源国通貨コース）年2回決算型	983,672
ノムラ・グローバルトレンド（アジア通貨コース）年2回決算型	983,672
野村テンプルトン・トータル・リターン Aコース	983,381
野村テンプルトン・トータル・リターン Cコース	983,381
野村テンプルトン・トータル・リターン Dコース	983,381
野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型	983,091
野村グローバル高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型	983,091
ノムラ・アジア・コレクション（短期アジア現地通貨建て債券　Aコース）	982,995
野村アジアハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信（アジア通貨セレクトコース）毎月分配型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）年2回決算型	982,898
野村アジアハイ・イールド債券投信（アジア通貨セレクトコース）年2回決算型	982,898
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（欧州通貨コース）	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円コース）	982,609
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（豪ドルコース）	982,609
野村日本ブランド株投資（円コース）毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資（資源国通貨コース）毎月分配型	982,609
野村日本ブランド株投資（アジア通貨コース）毎月分配型	982,609

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村日本ブランド株投資（資源国通貨コース）年2回決算型	982,609
野村日本ブランド株投資（アジア通貨コース）年2回決算型	982,609
野村米国ハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,609
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,609
野村新世界高金利通貨投信	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	982,608
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資（ブラジルレアルコース）毎月分配型	982,608
野村日本ブランド株投資（円コース）年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資（ブラジルレアルコース）年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）年2回決算型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	982,608
野村新米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	982,608
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信　Aコース	982,608
野村新エマージング債券投信（円コース）毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信（ブラジルレアルコース）毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信（インドネシアルピアコース）毎月分配型	982,608
野村新エマージング債券投信（円コース）年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	982,608
野村新エマージング債券投信（中国元コース）年2回決算型	982,608
野村アジアCB投信（毎月分配型）	982,608
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム（円コース）毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,608
野村グローバルREITプレミアム（円コース）年2回決算型	982,608
野村グローバルREITプレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型	982,608
野村日本ブランド株投資（トルコリラコース）毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	982,607
野村新エマージング債券投信（中国元コース）毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（円コース）毎月分配型	982,607
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（資源国通貨コース）毎月分配型	982,607
第12回　野村短期公社債ファンド	982,607
野村日本高配当株プレミアム（円コース）毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,415
野村日本高配当株プレミアム（円コース）年2回決算型	982,415
野村日本高配当株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型	982,415
野村高配当インフラ関連株プレミアム（円コース）毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム（通貨セレクトコース）毎月分配型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム（円コース）年2回決算型	982,029
野村高配当インフラ関連株プレミアム（通貨セレクトコース）年2回決算型	982,029
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547
野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信（ブラジルレアルコース）毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）毎月分配型	981,451
野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）年2回決算型	981,451
野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）年2回決算型	981,451
野村通貨選択日本株投信（ブラジルレアルコース）年2回決算型	981,451
野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）年2回決算型	981,451
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451
ノムラ THE USA Aコース	981,258
ノムラ THE USA Bコース	981,258
米国変動好金利ファンド Bコース	981,066
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489
野村高配当インフラ関連株ファンド（米ドルコース）毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド（通貨セレクトコース）毎月分配型	980,297
野村高配当インフラ関連株ファンド（米ドルコース）年2回決算型	980,297
ノムラ THE ASIA Bコース	979,912
グローバル・ストック Bコース	979,528
グローバル・ストック Dコース	979,528
野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）毎月分配型	588,871
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401
野村通貨選択日本株投信（インドネシアルピアコース）毎月分配型	294,436
野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）年2回決算型	294,436
野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）年2回決算型	196,925
野村通貨選択日本株投信（中国元コース）毎月分配型	196,291
野村通貨選択日本株投信（インドネシアルピアコース）年2回決算型	196,291
野村米国ハイ・イールド債券投信（通貨セレクトコース）年2回決算型	98,262
野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）毎月分配型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型	98,261
野村日本ブランド株投資（南アフリカランドコース）毎月分配型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	98,261
野村新米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信（米ドルコース）毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	98,261
野村新エマージング債券投信（米ドルコース）年2回決算型	98,261
野村新エマージング債券投信（インドネシアルピアコース）年2回決算型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（米ドルコース）毎月分配型	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（米ドルコース）年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（円コース）年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（資源国通貨コース）年2回決算型	98,261
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（アジア通貨コース）年2回決算型	98,261
野村米国ブランド株投資（円コース）毎月分配型	98,261
野村テンプルトン・トータル・リターン Bコース	98,261
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（通貨セレクトコース）年2回決算型	98,261
第1回 野村短期公社債ファンド	98,261
第2回 野村短期公社債ファンド	98,261
第3回 野村短期公社債ファンド	98,261
第4回 野村短期公社債ファンド	98,261
第5回 野村短期公社債ファンド	98,261
第6回 野村短期公社債ファンド	98,261
第7回 野村短期公社債ファンド	98,261
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261
第11回 野村短期公社債ファンド	98,261
野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	98,260
野村日本ブランド株投資（南アフリカランドコース）年2回決算型	98,260
野村新米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	98,260

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型	98,260
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース	98,260
野村新エマージング債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	98,260
ノムラ・アジア・コレクション（短期アジア現地通貨建て債券 Bコース）	98,260
第9回 野村短期公社債ファンド	98,260
第10回 野村短期公社債ファンド	98,260
野村通貨選択日本株投信（中国元コース）年2回決算型	98,146
ノムラ THE EUROPE Aコース	98,117
ノムラ THE EUROPE Bコース	98,117
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049
ノムラ THE ASIA Aコース	97,992
グローバル・ストック Aコース	97,953
グローバル・ストック Cコース	97,953
野村通貨選択日本株投信（ロシアルーブルコース）毎月分配型	48,092
野村通貨選択日本株投信（ロシアルーブルコース）年2回決算型	13,741
ノムラ新興国債券ファンズ（野村SMA向け）	10,000
野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）年2回決算型	9,826
野村新エマージング債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	9,826
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Aコース	9,818
野村DCテンプルトン・トータル・リターン Bコース	9,818
野村日本ブランド株投資（米ドルコース）毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資（メキシコペソコース）毎月分配型	9,809
野村日本ブランド株投資（米ドルコース）年2回決算型	9,809
野村日本ブランド株投資（メキシコペソコース）年2回決算型	9,809
野村アジアハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	9,808
野村アジアハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）毎月分配型	9,808
野村米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）年2回決算型	9,808
野村米国ブランド株投資（米ドルコース）毎月分配型	9,807
野村米国ブランド株投資（米ドルコース）年2回決算型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（米ドルコース）毎月分配型	9,807
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（米ドルコース）年2回決算型	9,807
野村新米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）毎月分配型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型	9,805
野村新米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）年2回決算型	9,805
野村高配当インフラ関連株ファンド（円コース）毎月分配型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド（円コース）年2回決算型	9,803
野村高配当インフラ関連株ファンド（通貨セレクトコース）年2回決算型	9,803
野村新興国高配当株トリプルウイング ブラジルレアル毎月分配型	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド（円コース）	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド（米ドルコース）	9,803
ピムコ・世界インカム戦略ファンド（世界通貨分散コース）	9,803
ノムラ新興国債券ファンズ（野村SMA・EW向け）	9,801
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド（野村SMA・EW向け）	9,801
野村通貨選択日本株投信（ユーロコース）年2回決算型	4,908
野村高金利国際機関債投信（年2回決算型）	1,967
野村通貨選択日本株投信（ユーロコース）毎月分配型	1,963

○お知らせ

該当事項はございません。

外国債券マザーファンド

運用報告書

第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		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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（為替ヘッジを行なわない円ベースの指数）です。シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。
（出所）Citigroup Index LLC

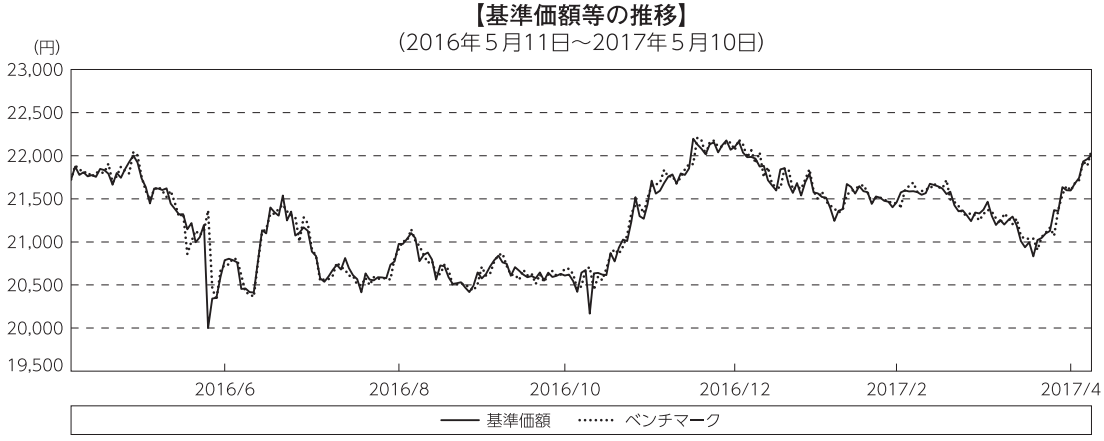
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
（期首）	円	%		%	%	%
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。

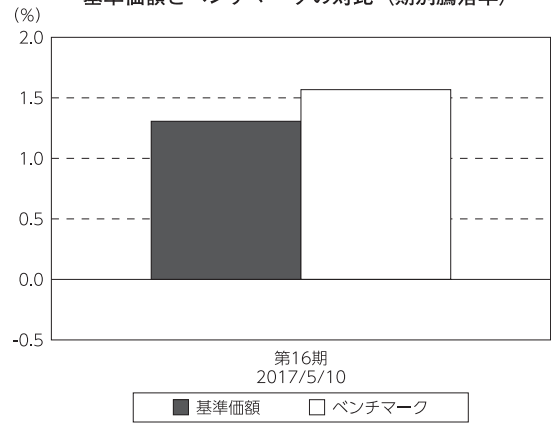
（マイナス要因）

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

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



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

◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

（2016年５月11日～2017年５月10日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	2	0.011	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(2)	(0.011)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	2	0.011	
期中の平均基準価額は、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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	80,883	2,947	3.6	58,257	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
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	2,480,300	2,561,758	291,681,873	43.9	－	18.4	17.7	7.7
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	148,180	165,818	13,771,222	2.1	－	0.9	0.7	0.4
	千英ポンド	千英ポンド						
イギリス	256,410	328,542	48,456,687	7.3	－	5.3	1.8	0.2
	千スイスフラン	千スイスフラン						
スイス	8,600	10,719	1,212,332	0.2	－	0.1	0.1	－
	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
スウェーデン	195,700	228,802	2,935,536	0.4	－	0.3	0.1	0.0
	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
ノルウェー	130,800	141,409	1,855,291	0.3	－	0.2	0.1	－
	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
デンマーク	191,500	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
	千ズロチ	千ズロチ						
ポーランド	136,700	144,005	4,219,347	0.6	－	0.3	0.3	0.1
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	29,930	31,612	2,552,046	0.4	－	0.2	0.2	0.0
	千リンギ	千リンギ						
マレーシア	107,200	107,449	2,815,170	0.4	－	0.2	0.2	0.0
	千豪ドル	千豪ドル						
オーストラリア	153,750	165,638	13,863,902	2.1	－	1.3	0.5	0.3
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	953,500	981,391	5,839,278	0.9	－	0.5	0.2	0.2
	千ランド	千ランド						
南アフリカ	462,800	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				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY BOND	8.125	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			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	1.25	7,500	7,490	852,815	2019/1/31
		US TREASURY N/B	1.5	3,500	3,510	399,661	2019/1/31
		US TREASURY N/B	1.125	1,000	996	113,481	2019/1/31
		US TREASURY N/B	2.75	37,500	38,430	4,375,659	2019/2/15
		US TREASURY N/B	0.75	900	890	101,445	2019/2/15
		US TREASURY N/B	1.375	16,100	16,111	1,834,434	2019/2/28
		US TREASURY N/B	1.5	16,200	16,246	1,849,863	2019/2/28
		US TREASURY N/B	1.0	10,800	10,733	1,222,146	2019/3/15
		US TREASURY N/B	1.5	4,000	4,012	456,809	2019/3/31
		US TREASURY N/B	1.625	25,500	25,633	2,918,627	2019/3/31
		US TREASURY N/B	1.25	2,000	1,996	227,301	2019/3/31
		US TREASURY N/B	0.875	3,500	3,468	394,914	2019/4/15
		US TREASURY N/B	1.25	5,000	4,990	568,165	2019/4/30
		US TREASURY N/B	1.625	5,600	5,629	641,003	2019/4/30
		US TREASURY N/B	3.125	27,600	28,569	3,252,892	2019/5/15
		US TREASURY N/B	0.875	1,300	1,287	146,589	2019/5/15
		US TREASURY N/B	1.125	1,400	1,393	158,638	2019/5/31
		US TREASURY N/B	1.5	10,600	10,629	1,210,263	2019/5/31
		US TREASURY N/B	0.875	500	494	56,336	2019/6/15
		US TREASURY N/B	1.0	1,400	1,389	158,152	2019/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	7,900	7,939	903,991	2019/6/30
		US TREASURY N/B	0.75	5,500	5,423	617,545	2019/7/15
		US TREASURY N/B	1.625	14,500	14,571	1,659,095	2019/7/31
		US TREASURY N/B	3.625	26,100	27,385	3,118,127	2019/8/15
		US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,971	338,364	2019/8/31
		US TREASURY N/B	1.625	8,800	8,842	1,006,782	2019/8/31
		US TREASURY N/B	1.0	3,000	2,969	338,110	2019/9/30
		US TREASURY N/B	1.75	17,700	17,834	2,030,594	2019/9/30
		US TREASURY N/B	3.375	49,300	51,639	5,879,710	2019/11/15
		US TREASURY N/B	1.0	8,800	8,699	990,539	2019/11/30
		US TREASURY N/B	1.5	1,800	1,801	205,148	2019/11/30
		US TREASURY N/B	1.125	12,000	11,891	1,353,937	2019/12/31
		US TREASURY N/B	1.625	3,800	3,814	434,324	2019/12/31
		US TREASURY N/B	1.375	2,000	1,993	227,008	2020/1/31
		US TREASURY N/B	1.25	5,400	5,364	610,809	2020/1/31
		US TREASURY N/B	3.625	51,800	54,744	6,233,163	2020/2/15
		US TREASURY N/B	1.25	2,700	2,680	305,152	2020/2/29
		US TREASURY N/B	1.625	5,000	5,012	570,745	2020/3/15
		US TREASURY N/B	1.125	4,000	3,953	450,156	2020/3/31
		US TREASURY N/B	1.375	21,300	21,201	2,414,039	2020/3/31
		US TREASURY N/B	1.375	3,200	3,182	362,359	2020/4/30
		US TREASURY N/B	3.5	47,700	50,412	5,740,017	2020/5/15
		US TREASURY N/B	1.5	6,500	6,483	738,181	2020/5/31
		US TREASURY N/B	1.875	16,600	16,741	1,906,171	2020/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	13,200	13,207	1,503,773	2020/6/30
		US TREASURY N/B	2.0	14,000	14,164	1,612,720	2020/7/31
		US TREASURY N/B	2.625	42,500	43,844	4,992,160	2020/8/15

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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	US TREASURY N/B	2.125	37,600	38,175	4,346,690	2020/8/31
		US TREASURY N/B	2.0	6,000	6,066	690,738	2020/9/30
		US TREASURY N/B	1.75	1,600	1,603	182,531	2020/10/31
		US TREASURY N/B	2.625	52,600	54,270	6,179,234	2020/11/15
		US TREASURY N/B	2.375	6,800	6,957	792,212	2020/12/31
		US TREASURY N/B	2.125	5,300	5,374	611,896	2021/1/31
		US TREASURY N/B	1.375	7,000	6,905	786,310	2021/1/31
		US TREASURY N/B	3.625	45,800	48,973	5,576,156	2021/2/15
		US TREASURY N/B	2.0	5,000	5,046	574,592	2021/2/28
		US TREASURY N/B	1.125	10,000	9,764	1,111,825	2021/2/28
		US TREASURY N/B	2.25	1,800	1,831	208,566	2021/3/31
		US TREASURY N/B	2.25	12,900	13,124	1,494,383	2021/4/30
		US TREASURY N/B	3.125	38,400	40,373	4,596,983	2021/5/15
		US TREASURY N/B	2.0	22,500	22,674	2,581,664	2021/5/31
		US TREASURY N/B	2.125	34,000	34,406	3,917,513	2021/6/30
		US TREASURY N/B	2.25	9,700	9,859	1,122,561	2021/7/31
		US TREASURY N/B	2.125	26,800	27,122	3,088,160	2021/8/15
		US TREASURY N/B	2.0	7,300	7,342	835,983	2021/8/31
		US TREASURY N/B	2.125	16,000	16,170	1,841,116	2021/9/30
		US TREASURY N/B	2.0	10,000	10,049	1,144,203	2021/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	26,000	26,142	2,976,549	2021/11/15
		US TREASURY N/B	1.875	8,000	7,995	910,310	2021/11/30
		US TREASURY N/B	2.125	12,400	12,522	1,425,761	2021/12/31
		US TREASURY N/B	1.5	5,000	4,906	558,625	2022/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	33,700	33,864	3,855,817	2022/2/15
		US TREASURY N/B	1.75	27,300	27,073	3,082,636	2022/2/28
		US TREASURY N/B	1.75	9,900	9,812	1,117,262	2022/3/31
		US TREASURY N/B	1.75	30,000	29,718	3,383,776	2022/4/30
		US TREASURY N/B	1.75	23,900	23,675	2,695,635	2022/5/15
		US TREASURY N/B	2.125	27,000	27,204	3,097,516	2022/6/30
		US TREASURY N/B	1.625	18,500	18,160	2,067,737	2022/8/15
		US TREASURY N/B	1.625	12,800	12,528	1,426,438	2022/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	13,000	13,049	1,485,846	2022/12/31
		US TREASURY N/B	1.75	22,000	21,620	2,461,670	2023/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	17,000	16,932	1,927,907	2023/2/15
		US TREASURY N/B	1.5	25,000	24,205	2,755,990	2023/2/28
		US TREASURY N/B	1.5	11,000	10,637	1,211,167	2023/3/31
		US TREASURY N/B	1.75	42,200	41,359	4,709,169	2023/5/15
		US TREASURY N/B	1.625	30,400	29,549	3,364,534	2023/5/31
		US TREASURY N/B	2.5	19,400	19,818	2,256,513	2023/8/15
		US TREASURY N/B	2.75	16,800	17,399	1,981,142	2023/11/15
		US TREASURY N/B	2.75	26,800	27,740	3,158,486	2024/2/15
		US TREASURY N/B	2.5	29,100	29,631	3,373,897	2024/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	23,100	23,060	2,625,645	2024/11/15
		US TREASURY N/B	2.0	44,700	43,746	4,980,991	2025/2/15
		US TREASURY N/B	2.125	26,500	26,119	2,973,916	2025/5/15
		US TREASURY N/B	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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	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				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	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
		CANADIAN GOVERNMENT	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(GOVERNMEN	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				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	
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						4,219,347	
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
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	200	175	14,721	2047/3/21
小計						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
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	83,000	86,597	515,253	2023/12/7
小計						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						3,536,092	
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
	千円	%
公社債	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）

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**

（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 （2016年５月11日～2017年５月10日）

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**

＊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
のむラップ・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
のむラップ・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
のむラップ・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
野村外国債券パッシブファンド（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
のむラップ・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
のむラップ・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
野村ターゲットデートファンド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
野村ターゲットデートファンド2016　2029-2031年目標型	1,093,066
野村ターゲットデートファンド2016　2032-2034年目標型	888,025
野村ターゲットデートファンド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	JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。なお、一部ローンに投資する場合があります。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	新興国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

野村アセットマネジメント
東京都中央区日本橋１-12-１

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

○最近５期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
5期(2013年5月10日)	14,992	40.6	152.76	41.9	97.6	－	5,175
6期(2014年5月12日)	14,674	△ 2.1	150.77	△ 1.3	98.2	－	5,526
7期(2015年5月11日)	17,412	18.7	181.84	20.6	98.2	－	6,502
8期(2016年5月10日)	16,574	△ 4.8	173.87	△ 4.4	98.2	－	6,873
9期(2017年5月10日)	18,613	12.3	196.18	12.8	98.1	－	9,252

＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

＊ベンチマーク（＝JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース））は、JP Morgan Emerging Market Bond Index（EMBI）Plus（US$ベース）をもとに、当社が円換算したものです。なお指数の算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。
＊JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（JP Morgan Emerging Market Bond Index（EMBI）Plus）は、J.P. Morgan Securities LLCが公表している、エマージング諸国が発行する米ドル建てのブレディ債、ローン、ユーロボンドを対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。
（出所）J.P. Morgan Securities LLC、ブルームバーグ

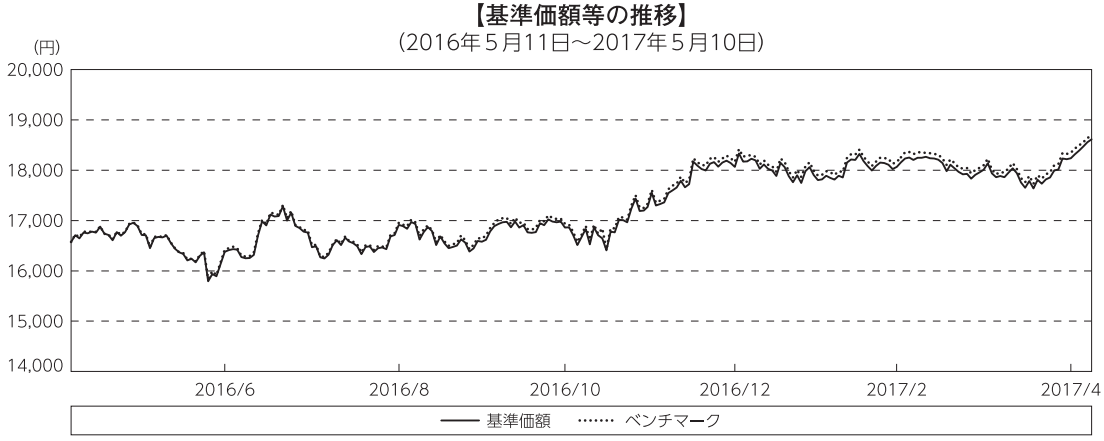
○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
（期首）	円	%		%	%	%
2016年5月10日	16,574	－	173.87	－	98.2	－
5月末	16,957	2.3	177.94	2.3	97.5	－
6月末	16,378	△ 1.2	172.30	△ 0.9	97.5	－
7月末	16,763	1.1	176.29	1.4	98.0	－
8月末	16,915	2.1	177.88	2.3	98.1	－
9月末	16,578	0.0	174.57	0.4	98.3	－
10月末	16,862	1.7	177.70	2.2	98.7	－
11月末	17,270	4.2	181.85	4.6	98.0	－
12月末	18,065	9.0	190.58	9.6	97.6	－
2017年1月末	17,903	8.0	188.72	8.5	97.9	－
2月末	18,069	9.0	190.59	9.6	97.5	－
3月末	18,138	9.4	191.23	10.0	97.9	－
4月末	18,239	10.0	192.50	10.7	98.3	－
（期末）						
2017年5月10日	18,613	12.3	196.18	12.8	98.1	－

＊騰落率は期首比です。
＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首16,574円から期末18,613円へと上昇し、値上がり額は2,039円となりました。

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

○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＋12.3%となり、ベンチマークであるJP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の＋12.8%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。

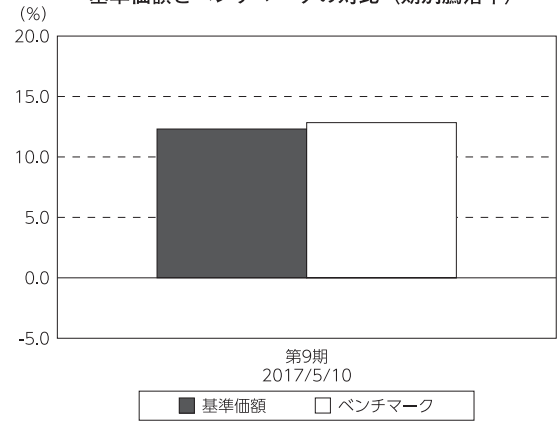
（マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること。

（その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



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

◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

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

○１万口当たりの費用明細

（2016年５月11日～2017年５月10日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) その他費用	4	0.022	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（保管費用）	(4)	(0.022)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（その他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	4	0.022	
期中の平均基準価額は、17,344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 33,425	千米ドル 16,110 (186)

＊金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）
＊単位未満は切り捨て。
＊（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

（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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	2,446	395	16.1	1,030	265	25.7

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

○組入資産の明細

(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
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	73,969	79,679	9,072,316	98.1	62.5	74.3	18.5	5.3
合計	73,969	79,679	9,072,316	98.1	62.5	74.3	18.5	5.3

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

(B)外国(外貨建)公社債　銘柄別開示

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	ARGENT-GLOBAL	11.608874	640	1,004	114,427	2033/12/31
		ARGENT-GLOBAL	11.608874	420	647	73,718	2033/12/31
		ARGENT-GLOBAL	2.5	1,100	730	83,225	2038/12/31
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	7.75	400	218	24,912	2019/10/13
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	12.75	500	277	31,641	2022/８/23
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	9.0	350	168	19,146	2023/５/７
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	8.25	400	179	20,435	2024/10/13
		BOLIVARIAN REP OF VZLA	9.25	300	136	15,576	2028/５/７
		BRAZIL GLOBAL	8.875	350	406	46,326	2019/10/14
		BRAZIL GLOBAL	8.875	250	315	35,937	2024/４/15
		BRAZIL GLOBAL	8.75	450	574	65,455	2025/２/４
		BRAZIL GLOBAL	10.125	300	430	49,059	2027/５/15
		BRAZIL GLOBAL	8.25	720	905	103,117	2034/１/20
		BRAZIL GLOBAL	7.125	700	805	91,657	2037/１/20
		COLOMBIA GLOBAL	7.375	550	606	69,111	2019/３/18
		COLOMBIA GLOBAL	8.125	250	318	36,285	2024/５/21
		COLOMBIA GLOBAL	7.375	320	409	46,673	2037/９/18
		CROATIA	6.625	200	220	25,074	2020/７/14
		CROATIA	6.375	200	221	25,174	2021/３/24
		CROATIA	5.5	400	432	49,272	2023/４/４
		CROATIA	6.0	600	666	75,855	2024/１/26
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.875	300	320	36,494	2019/１/15
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.875	930	984	112,084	2021/１/22
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2.625	400	372	42,412	2023/１/５
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	4.25	800	789	89,835	2025/１/７
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.625	600	589	67,120	2041/１/７

銘柄			当期末				
			利率	額面金額	評価額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.0	500	447	50,952	2045/1/27
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	5.625	200	194	22,179	2047/2/21
		HUNGARY	4.0	300	311	35,457	2019/3/25
		HUNGARY	5.375	600	665	75,764	2023/2/21
		HUNGARY	5.75	300	341	38,876	2023/11/22
		HUNGARY	5.375	500	560	63,844	2024/3/25
		INDONESIA GLOBAL	5.875	600	683	77,848	2024/1/15
		INDONESIA GLOBAL	8.5	400	572	65,150	2035/10/12
		MEXICO GLOBAL	7.5	199	263	30,022	2033/4/8
		MEXICO GLOBAL	6.75	380	477	54,341	2034/9/27
		PANAMA GLOBAL	7.125	300	382	43,551	2026/1/29
		PANAMA GLOBAL	8.875	300	427	48,632	2027/9/30
		PANAMA GLOBAL	9.375	250	369	42,092	2029/4/1
		PANAMA GLOBAL	6.7	450	577	65,711	2036/1/26
		PERU GLOBAL	7.35	300	390	44,456	2025/7/21
		PERU GLOBAL	6.55	320	418	47,639	2037/3/14
		PHILIPPINES GLOBAL	10.625	300	458	52,229	2025/3/16
		PHILIPPINES GLOBAL	9.5	650	1,034	117,789	2030/2/2
		PHILIPPINES GLOBAL	7.75	200	286	32,658	2031/1/14
		PHILIPPINES GLOBAL	6.375	500	649	74,008	2032/1/15
		REPUBLIC OF ARGENTINA	6.25	800	848	96,598	2019/4/22
		REPUBLIC OF ARGENTINA	6.875	900	981	111,747	2021/4/22
		REPUBLIC OF ARGENTINA	7.5	1,800	1,969	224,213	2026/4/22
		REPUBLIC OF ARGENTINA	7.125	400	405	46,113	2036/7/6
		REPUBLIC OF ARGENTINA	7.625	750	787	89,664	2046/4/22
		REPUBLIC OF COLOMBIA	4.375	600	636	72,517	2021/7/12
		REPUBLIC OF COLOMBIA	2.625	200	193	21,974	2023/3/15
		REPUBLIC OF COLOMBIA	4.0	400	412	46,910	2024/2/26
		REPUBLIC OF COLOMBIA	4.5	800	849	96,712	2026/1/28
		REPUBLIC OF COLOMBIA	6.125	1,020	1,167	132,977	2041/1/18
		REPUBLIC OF COLOMBIA	5.625	700	758	86,396	2044/2/26
		REPUBLIC OF COLOMBIA	5.0	400	401	45,703	2045/6/15
		REPUBLIC OF CROATIA	6.75	300	327	37,250	2019/11/5
		REPUBLIC OF HUNGARY	6.25	320	351	39,980	2020/1/29
		REPUBLIC OF HUNGARY	6.375	600	677	77,167	2021/3/29
		REPUBLIC OF HUNGARY	7.625	350	514	58,616	2041/3/29
		REPUBLIC OF INDONESIA	11.625	350	410	46,787	2019/3/4
		REPUBLIC OF INDONESIA	5.875	450	491	55,950	2020/3/13
		REPUBLIC OF INDONESIA	4.875	500	536	61,072	2021/5/5
		REPUBLIC OF INDONESIA	3.75	700	718	81,788	2022/4/25
		REPUBLIC OF INDONESIA	3.375	400	401	45,665	2023/4/15
		REPUBLIC OF INDONESIA	5.375	250	278	31,680	2023/10/17
		REPUBLIC OF INDONESIA	4.125	700	721	82,141	2025/1/15
		REPUBLIC OF INDONESIA	7.75	600	824	93,844	2038/1/17
		REPUBLIC OF INDONESIA	5.25	400	430	48,972	2042/1/17
		REPUBLIC OF INDONESIA	6.75	600	770	87,729	2044/1/15
		REPUBLIC OF INDONESIA	5.125	200	212	24,212	2045/1/15

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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	5.95	400	467	53,271	2046/1/8
		REPUBLIC OF PANAMA	5.2	150	163	18,590	2020/1/30
		REPUBLIC OF PANAMA	3.75	200	205	23,369	2025/3/16
		REPUBLIC OF PERU	4.125	200	216	24,639	2027/8/25
		REPUBLIC OF PERU	8.75	250	381	43,409	2033/11/21
		REPUBLIC OF PERU	5.625	500	600	68,316	2050/11/18
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	4.0	600	639	72,794	2021/1/15
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	4.2	800	870	99,115	2024/1/21
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	6.375	600	800	91,174	2034/10/23
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	5.0	400	468	53,381	2037/1/13
		REPUBLIC OF PHILIPPINES	3.95	400	412	46,917	2040/1/20
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.875	400	433	49,367	2019/5/27
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.5	400	425	48,442	2020/3/9
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.875	250	273	31,179	2022/5/30
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.665	300	306	34,865	2024/1/17
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.875	550	597	68,015	2025/9/16
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4.3	500	472	53,781	2028/10/12
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	250	275	31,329	2041/3/8
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5.375	200	198	22,612	2044/7/24
		REPUBLIC OF TURKEY	5.625	400	423	48,173	2021/3/30
		REPUBLIC OF TURKEY	5.125	600	620	70,660	2022/3/25
		REPUBLIC OF TURKEY	6.25	400	433	49,393	2022/9/26
		REPUBLIC OF TURKEY	4.875	700	688	78,345	2026/10/9
		REPUBLIC OF TURKEY	6.75	400	444	50,562	2040/5/30
		REPUBLIC OF TURKEY	6.0	600	613	69,812	2041/1/14
		REPUBLIC OF TURKEY	4.875	800	712	81,111	2043/4/16
		REPUBLIC OF TURKEY	6.625	700	771	87,832	2045/2/17
		REPUBLIC OF VENEZUELA	11.75	450	241	27,514	2026/10/21
		REPUBLIC OF VENEZUELA	11.95	700	368	42,002	2031/8/5
		REPUBLIC OF VENEZUELA	7.0	200	87	9,905	2038/3/31
		ROMANIA	6.75	400	463	52,815	2022/2/7
		ROMANIA	4.375	400	423	48,244	2023/8/22
		ROMANIA	4.875	300	326	37,206	2024/1/22
		ROMANIA	6.125	200	247	28,199	2044/1/22
		RUSSIA	11.0	200	222	25,317	2018/7/24
		RUSSIA	12.75	320	565	64,360	2028/6/24
		RUSSIA	7.5	1,767	2,134	243,006	2030/3/31
		RUSSIA FOREIGN BOND	5.0	900	961	109,470	2020/4/29
		RUSSIAN FEDERATION	3.5	600	614	69,957	2019/1/16
		RUSSIAN FEDERATION	4.5	800	853	97,194	2022/4/4
		RUSSIAN FEDERATION	4.875	1,000	1,081	123,147	2023/9/16
		RUSSIAN FEDERATION	4.75	600	629	71,687	2026/5/27
		RUSSIAN FEDERATION	5.625	600	660	75,223	2042/4/4
		RUSSIAN FEDERATION	5.875	400	456	51,998	2043/9/16
		TURKEY GLOBAL	7.0	800	855	97,432	2019/3/11
		TURKEY GLOBAL	7.0	650	713	81,235	2020/6/5
		TURKEY GLOBAL	5.75	600	633	72,127	2024/3/22

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	
アメリカ			%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券	TURKEY GLOBAL	7.375	1,450	1,678	191,090	2025/2/5
		TURKEY GLOBAL	11.875	250	397	45,281	2030/1/15
		TURKEY GLOBAL	8.0	400	495	56,381	2034/2/14
		TURKEY GLOBAL	6.875	820	919	104,703	2036/3/17
		TURKEY GLOBAL	7.25	150	175	19,972	2038/3/5
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	765	775	88,278	2020/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	409	411	46,811	2021/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	209	207	23,582	2022/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	500	491	55,947	2023/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	500	483	55,056	2024/9/1
		UKRAINE GOVERNMENT REGS	7.75	500	472	53,770	2026/9/1
		UNITED MEXICAN STATES	5.125	300	325	37,078	2020/1/15
		UNITED MEXICAN STATES	3.625	900	928	105,701	2022/3/15
		UNITED MEXICAN STATES	4.0	850	883	100,613	2023/10/2
		UNITED MEXICAN STATES	3.6	1,000	1,006	114,543	2025/1/30
		UNITED MEXICAN STATES	4.125	600	620	70,604	2026/1/21
		UNITED MEXICAN STATES	6.05	710	818	93,168	2040/1/11
		UNITED MEXICAN STATES	4.75	800	782	89,038	2044/3/8
		UNITED MEXICAN STATES	5.55	1,000	1,097	124,932	2045/1/21
		UNITED MEXICAN STATES	4.6	500	478	54,439	2046/1/23
		UNITED MEXICAN STATES	5.75	800	809	92,135	2110/10/12
		VENEZUELA GLOBAL	7.0	150	99	11,328	2018/12/1
		VENEZUELA GLOBAL	6.0	200	98	11,158	2020/12/9
		VENEZUELA GLOBAL	7.65	100	44	5,037	2025/4/21
		VENEZUELA GLOBAL	9.25	600	308	35,093	2027/9/15
		VENEZUELA GLOBAL	9.375	200	91	10,418	2034/1/13
合計						9,072,316	

＊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
	千円	%
公社債	9,072,316	98.0
コール・ローン等、その他	186,340	2.0
投資信託財産総額	9,258,656	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（9,248,172千円）の投資信託財産総額（9,258,656千円）に対する比率は99.9％です。
＊外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。１米ドル＝113.86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	9,258,656,771
コール・ローン等	70,530,859
公社債(評価額)	9,072,316,431
未収利息	105,968,034
前払費用	9,841,447
(B) 負債	5,943,366
未払解約金	5,715,353
未払利息	13
その他未払費用	228,000
(C) 純資産総額(A－B)	9,252,713,405
元本	4,971,155,882
次期繰越損益金	4,281,557,523
(D) 受益権総口数	4,971,155,882口
1万口当たり基準価額(C／D)	18,613円

(注) 期首元本額は4,147,165,223円、期中追加設定元本額は1,691,769,063円、期中一部解約元本額は867,778,404円、1口当たり純資産額は1.8613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	479,133,299
受取利息	479,147,125
支払利息	△ 13,826
(B) 有価証券売買損益	481,519,977
売買益	652,502,698
売買損	△ 170,982,721
(C) 保管費用等	△ 1,734,991
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	958,918,285
(E) 前期繰越損益金	2,726,326,385
(F) 追加信託差損益金	1,226,459,235
(G) 解約差損益金	△ 630,146,382
(H) 計(D＋E＋F＋G)	4,281,557,523
次期繰越損益金(H)	4,281,557,523

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末元本額
	円
野村新興国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	2,755,092,946
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	1,387,724,466
野村DC運用戦略ファンド	267,072,871
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	241,326,738
ネクストコア	150,138,901
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	78,947,578
新興国債券・インデックスF（適格機関投資家専用）	57,302,519
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	26,458,961
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	3,559,556
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	2,941,562
インデックス・ブレンド（タイプⅣ）	195,674
インデックス・ブレンド（タイプⅢ）	148,339
インデックス・ブレンド（タイプⅤ）	86,161
インデックス・ブレンド（タイプⅠ）	85,367
インデックス・ブレンド（タイプⅡ）	74,243

○お知らせ

①信用リスク集中回避のための投資制限に関する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2016年８月31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＞

④金利先渡取引および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＞

⑤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＞

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・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。
主な投資対象	現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）		債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース））は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified（USドルベース）をもとに、当社が円換算したものです。なお指数の算出にあたっては、基準価額への反映を考慮して、日本の営業日前日の指数値をもとにしています。
＊JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数です（ただし、国別の組入比率には上限が設定されています）。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス－エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円換算ベース)		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
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	－

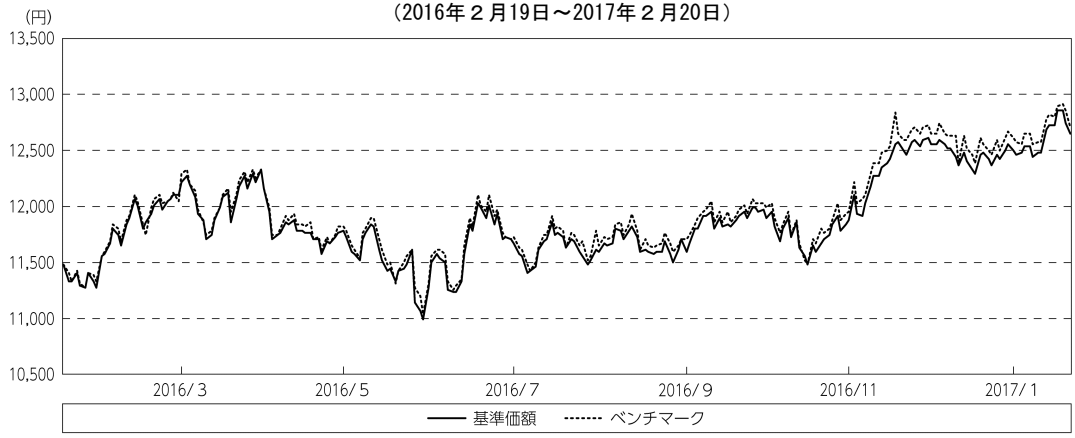
＊騰落率は期首比です。
＊債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移

【基準価額等の推移】

（2016年２月19日～2017年２月20日）



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

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首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・インデックスーエマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、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。

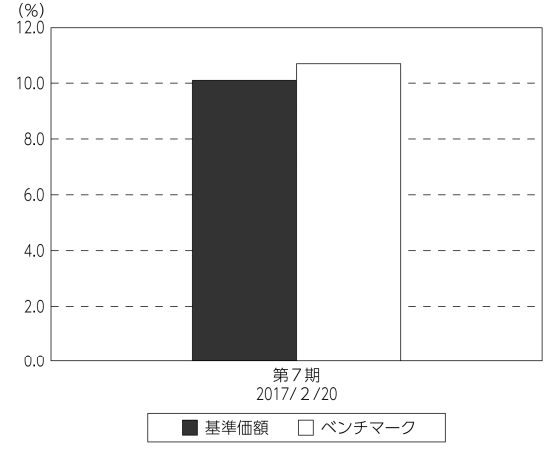
○当ファンドのベンチマークとの差異

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。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



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

◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

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

○１万口当たりの費用明細

（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	
	円	%	
(a) その他費用	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	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	%
為替直物取引	4,958	554	11.2	2,672	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
	千トルコリラ	千トルコリラ	千円	%	%	%	%	%
トルコ	12,330	11,517	358,548	8.5	8.5	4.6	3.8	0.1
	千フォリント	千フォリント						
ハンガリー	471,000	530,698	206,282	4.9	－	3.2	1.7	－
	千ズロチ	千ズロチ						
ポーランド	14,210	14,216	393,799	9.3	－	4.3	4.5	0.6
	千ルーブル	千ルーブル						
ロシア	135,000	134,190	260,330	6.2	5.9	－	0.3	5.9
	千レイ	千レイ						
ルーマニア	4,210	4,565	120,949	2.9	－	1.9	1.0	－
	千リンギ	千リンギ						
マレーシア	13,700	13,624	345,248	8.2	－	4.3	2.8	1.1
	千バーツ	千バーツ						
タイ	91,300	97,550	315,086	7.5	－	3.8	3.7	0.0
	千フィリピンペソ	千フィリピンペソ						
フィリピン	5,000	5,172	11,689	0.3	－	－	0.3	－
	千ルピア	千ルピア						
インドネシア	45,560,000	48,033,135	408,281	9.7	9.7	8.1	1.6	－
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	72,550	73,502	405,735	9.6	－	6.0	2.1	1.5
	千レアル	千レアル						
ブラジル	7,287	11,658	424,831	10.1	10.1	3.0	3.8	3.2
	千コロンビアペソ	千コロンビアペソ						
コロンビア	6,970,000	7,964,013	310,596	7.4	－	3.6	3.8	－
	千ヌエボソル	千ヌエボソル						
ペルー	2,700	2,781	96,167	2.3	－	1.9	0.4	－
	千ランド	千ランド						
南アフリカ	52,630	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		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
インドネシア			%	千ルピア	千ルピア	千円	
	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	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 TESOURO NACIONAL	—	1,540	1,351	49,252	2018/7/1
		LETRA TESOURO NACIONAL	—	400	343	12,506	2018/10/1
		LETRA TESOURO NACIONAL	—	2,430	2,034	74,141	2019/1/1
		LETRA TESOURO NACIONAL	—	2,310	1,842	67,142	2019/7/1
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	10.0	256	2,585	94,215	2021/1/1
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	10.0	100	1,000	36,474	2023/1/1
		NOTA DO TESOURO 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
野村ターゲットデートファンド2016　2026-2028年目標型	1,269,140
野村ターゲットデートファンド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
野村ターゲットデートファンド2016　2035-2037年目標型	264,522
野村ターゲットデートファンド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		投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率	東証REIT指数（配当込み）	期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
８期(2013年６月10日)	12,408	49.2	2,092.40	49.3	98.0	15,237
９期(2014年６月10日)	15,508	25.0	2,615.87	25.0	97.4	14,020
10期(2015年６月10日)	19,029	22.7	3,206.37	22.6	97.7	16,967
11期(2016年６月10日)	20,222	6.3	3,401.82	6.1	98.2	21,436
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		投資信託証券組入比率
		騰落率	東証REIT指数（配当込み）	騰落率	
（期首）	円	%		%	%
2016年６月10日	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。

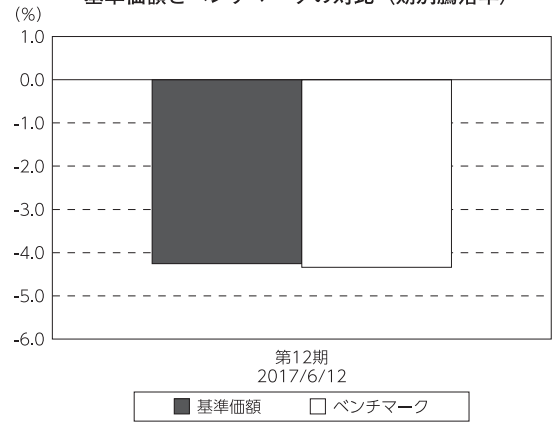
・期中の主な動き

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。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（注）ベンチマークは、東証REIT指数（配当込み）です。

◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

（2016年６月11日～2017年６月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	1	0.003	(a)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（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 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
		口	千円	口	千円
国内	日本アコモデーションファンド投資法人　投資証券	605	290,836	273	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	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		口	千円	口	千円
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・ジェイリート投資法人　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
	ジャパン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
		口	千円	口	千円
国内	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
		百万円	百万円	百万円	百万円
国内	REIT先物取引	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	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	16,023	786	4.9	7,270	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　ＭｉｄＣｉｔｙ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
ジャパン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
スターツプロシード投資法人　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	97,166	141,942	27,928,028	
	銘柄数<比率>	54	58	<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 513	百万円 −

＊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		投資信託証券組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
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		投資信託証券組入比率
		騰落率		騰落率	
（期　首）	円	%		%	%
2016年６月10日	20,525	－	215.72	－	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）

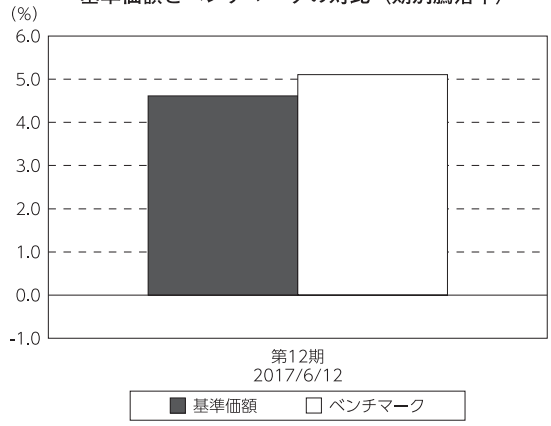
①コスト負担（売買コストや保管費用など）

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）

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



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

◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

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

○１万口当たりの費用明細

（2016年６月11日～2017年６月12日）

項目	当期 金額	当期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 売買委託手数料	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）	(6)	(0.027)	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）	(8)	(0.037)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
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。

○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 口数	買付 金額	売付 口数	売付 金額
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
外国	ACADIA REALTY TRUST	4,500	141	1,500	46
	AGREE REALTY CORP	500	23	－	－
	ALEXANDERS INC	60	24	50	20
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,260	590	2,070	227
	AMERICAN ASSETS TRUST INC	700	27	－	－
	AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	5,320	259	3,420	169
	AMERICAN HOMES 4 RENT-A	16,500	369	6,300	134
	APARTMENT INVT&MGMT CO-A	6,800	299	5,200	225
	APPLE HOSPITALITY REIT INC	9,100	177	8,200	158
	ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	4,400	59	1,600	22
	ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	3,005	38	1,800	25
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,480	989	4,170	730
	BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,500	19	－	－
	BOSTON PROPERTIES	6,170	795	4,760	612
	BRANDYWINE REALTY TRUST	4,900	81	3,300	53
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	19,100	480	7,500	186
	CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	2,400	30	－	－
	CAMDEN PROPERTY TRUST	2,890	240	2,150	177
	CARE CAPITAL PROPERTIES INC	1,800	47	800	20
	CARETRUST REIT INC ACQUIRES	3,500	57	－	－
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	60,891 (29,909)	876 (378)	1,800	25
	COLONY STARWOOD HOMES	10,100	336	－	－
	COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	4,500	101	4,400	99
	CORESITE REALTY CORP	1,790	145	1,130	90
	CORECIVIC INC	4,200 (19,100)	123 (623)	3,900	99
	CORPORATE OFFICE PROPERTIES	4,700	145	3,500	105
	CORRECTIONS CORP OF AMERICA	1,700 (△ 19,100)	24 (△ 623)	600	18
	COUSINS PROPERTIES INC	26,914 (19,886)	228 (219)	9,500	78
	CUBESMART	7,800	207	5,600	151
	CYRUSONE INC	4,170	209	2,050	98
	DCT INDUSTRIAL TRUST INC	3,300	160	2,100	100
	DDR CORP	15,600	225	11,500	181
	DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	4,100	46	1,900	21
	DIGITAL REALTY TRUST INC	8,560	865	5,060	506
	DOUGLAS EMMETT INC	5,100	190	2,900	107
	DUKE REALTY CORP	14,700	391	9,900	259
	DUPONT FABROS TECHNOLOGY	2,850	135	1,500	66

銘柄			買付		売付	
			口数	金額	口数	金額
	アメリカ		口	千米ドル	口	千米ドル
外国		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
	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
外国	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
	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
外		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
国		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 口数	買付 金額	売付 口数	売付 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		口	千英ポンド	口	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
	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				
外		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
国		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 口数	買付 金額	売付 口数	売付 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 (3)
	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ル		千ニュージーランドル
	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	千ニュージーランドドル	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 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	4,722	469	9.9	3,343	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	
小計 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	221,670	237,970	4,526	370,941	
	銘柄数＜比率＞	29	29	－	＜1.8%＞	
(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 PROPERTI-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
			百万円	百万円
外国	REIT先物取引	DJREA	94	－
		FTEPR	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
	千円	%
投資証券	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＞