ＪＰ４資産バランスファンド 安定コース
＜愛称：ゆうバランス＞

運用報告書（全体版）

第５期（決算日　2017年３月15日）第６期（決算日　2017年５月15日）第７期（決算日　2017年７月18日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
「ＪＰ４資産バランスファンド 安定コース」は、2017年７月18日に第７期の決算を行いましたので、第５期から第７期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引き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	無期限（2016年２月18日設定）			
運用方針	日本と海外の債券と株式に資産を分散することで、安定的な収益の確保と信託財産の着実な成長を目指します。海外債券は、信用力の高い先進国の債券に、海外株式は、より安定的な先進国の株式に投資します。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。 ＜基本組入比率＞			
	日本株式	日本債券	海外株式	海外債券
	20%	55%	10%	15%
主な投資対象	ＪＰ４資産バランスファンド 安定コース	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）、FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）、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）、FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）を主要投資対象とします。		
	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	日本株式を主要投資対象とします。		
	FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	日本債券を主要投資対象とします。		
	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）	海外株式を主要投資対象とします。		
	FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	海外債券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。 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。 デリバティブの直接利用は行いません。 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの投資信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託者は、一般社団法人投資信託協会規則に従い当該比率以内となるよう調整を行うこととします。			
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。			

JP投信株式会社

＜照会先＞
ホームページ：http://www.jp-toushin.japanpost.jp
サポートダイヤル：0120-104-017
（受付時間：営業日の午前９時～午後５時）

目　次

ＪＰ４資産バランスファンド 安定コース‥‥‥‥‥‥‥‥‥‥‥‥ 1

（ご参考）投資対象先の直近の内容

FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）‥‥ 12

FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）‥‥ 57

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）‥‥ 87

FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）‥‥ 135

【運用報告書の表記について】
・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			参考指数		投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率		
(設定日)	円	円	%		%	%	百万円
2016年２月18日	10,000	－	－	10,000	－	－	1
１期(2016年７月15日)	10,221	5	2.3	10,265	2.7	99.2	8,204
２期(2016年９月15日)	9,995	0	△2.2	10,047	△2.1	99.0	7,987
３期(2016年11月15日)	10,184	5	1.9	10,243	2.0	99.6	7,808
４期(2017年１月16日)	10,532	5	3.5	10,626	3.7	99.3	6,915
５期(2017年３月15日)	10,562	10	0.4	10,677	0.5	98.6	7,439
６期(2017年５月15日)	10,643	10	0.9	10,757	0.7	98.3	8,759
７期(2017年７月18日)	10,729	10	0.9	10,886	1.2	98.4	13,200

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。
(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。
(注) 参考指数は合成指数です。計算方法は11ページをご参照ください。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

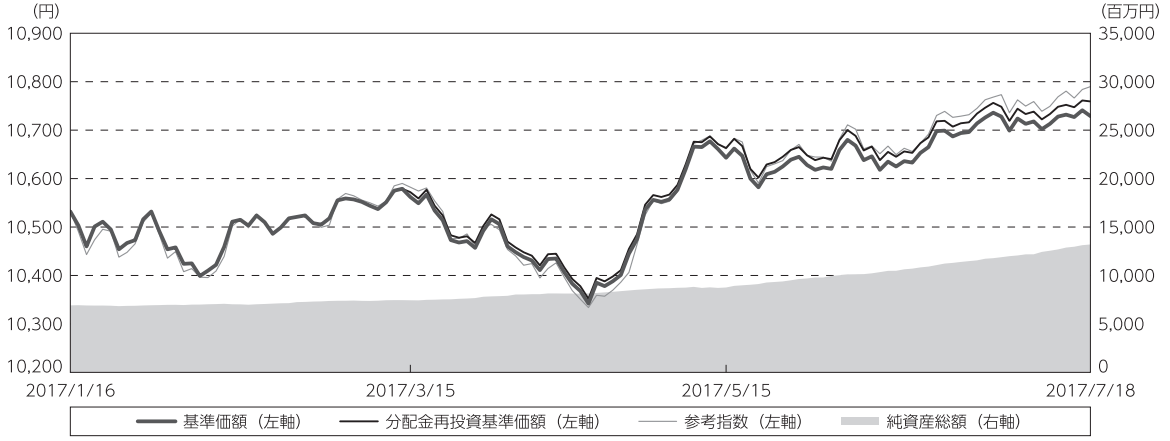
決算期	年月日	基準価額		参考指数		投資信託証券組入比率
			騰落率		騰落率	
	（期　首）	円	%		%	%
	2017年１月16日	10,532	－	10,626	－	99.3
第５期	１月末	10,491	△0.4	10,578	△0.5	98.7
	２月末	10,505	△0.3	10,593	△0.3	98.7
	（期　末）					
	2017年３月15日	10,572	0.4	10,677	0.5	98.6
	（期　首）					
	2017年３月15日	10,562	－	10,677	－	98.6
第６期	３月末	10,506	△0.5	10,588	△0.8	99.1
	４月末	10,552	△0.1	10,642	△0.3	98.7
	（期　末）					
	2017年５月15日	10,653	0.9	10,757	0.7	98.3
	（期　首）					
	2017年５月15日	10,643	－	10,757	－	98.3
第７期	５月末	10,623	△0.2	10,739	△0.2	99.0
	６月末	10,728	0.8	10,869	1.0	98.2
	（期　末）					
	2017年７月18日	10,739	0.9	10,886	1.2	98.4

（注）期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

○運用経過

（2017年１月17日～2017年７月18日）

作成期間中の基準価額等の推移



第５期首：10,532円
第７期末：10,729円（既払分配金(税込み)：30円）
騰　落　率：　2.2%（分配金再投資ベース）

（注）分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
（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）分配金再投資基準価額および参考指数は、作成期首（2017年１月16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）参考指数は合成指数です。計算方法は11ページをご参照ください。
（注）上記騰落率は、小数点以下第２位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、第５期首10,532円から当作成期末10,729円となりました。この間、分配金として１万口当たり合計30円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値上がり額は227円となりました。

投資対象とする４本の組入投資信託証券の当作成期間の値動きは、日本株式、海外株式、海外債券が上昇した一方で、日本債券が下落しました。日本株式、海外株式などの上昇が主な値上がり要因となりました。

投資環境

日本債券市場	2017年1月から2月にかけ、米国の長期金利が徐々に上昇すると、日本にも波及し、債券利回りが上昇（価格は下落）しましたが、日銀による指値オペの実施により上昇幅を縮小しました。4月にはシリアや北朝鮮を巡る地政学リスクの高まりに加え、フランス大統領選などを巡る欧州政治リスクへの警戒感を背景に、利回りは大きく低下（価格は上昇）しました。その後、これらのリスクが後退したことで、利回りは概ね横ばいの推移でしたが、6月末にECB（欧州中央銀行）の金融緩和縮小観測の強まりを背景に、欧米金利が上昇したことなどを受けて、利回りは上昇（価格は下落）しました。
日本株式市場	2017年1月から2月にかけ、トランプ米大統領の保護主義的な通商政策に対する警戒感と、米国景気拡大への期待感とが交錯し、日本株式市場は一進一退の推移となりました。3月にはFRB（米連邦準備制度理事会）による追加利上げ観測を背景に、一時円安・ドル高が進行したことなどが好感されて、日本株式市場は堅調に推移しましたが、その後、米国景気に対する楽観的な見通しが後退したことに加え、地政学リスクの高まりや欧州政治リスクへの警戒感から、軟調な推移となりました。5月のフランス大統領選の結果、欧州政治リスクが後退すると、日本株式市場は急速に持ち直す展開となり、さらに欧米金利の上昇などを背景に円安・ドル高が進んだことや、米国株式市場が底堅く推移したことなどが好感され、年初来高値を更新するなど、堅調に推移しました。
海外債券市場	2017年1月から3月にかけ、FRBによる利上げペースが加速するか否かの見方が交錯し、米国を中心に利回りは大きな上昇と低下を繰り返しながら推移しました。4月には、シリアや北朝鮮を巡る地政学リスクの高まりに加え、フランス大統領選の不透明感の高まりなどを背景に、利回りは低下（価格は上昇）しましたが、その後、これらのリスクが後退したことで投資家のリスク選好機運が高まり、利回りは上昇（価格は下落）しました。6月末には、ECBの金融緩和縮小観測を背景に、利回りは上昇（価格は下落）する展開となりました。また、米ドルは一進一退の推移ながらも対円で下落（円高）、ユーロはECBの金融緩和縮小観測を背景に、対円で上昇（円安）となりました。
海外株式市場	2017年1月から2月にかけ、米国のトランプ政権による減税策や金融規制の緩和などへの期待に加え、主要経済指標が総じて好調だったことなどを背景に、海外株式市場は上昇しました。しかし、3月にはトランプ大統領の政策運営を巡る不透明感の広がりを受け、さらに4月には米軍によるシリア空爆や北朝鮮の情勢悪化などにおける地政学リスク、フランス大統領選の不透明感などが強く意識されたことから、下落基調となりました。その後、5月のフランス大統領選でマクロン氏が勝利し、欧州政治リスクは後退、さらに米国および欧州における堅調な企業業績もあり、株式市場は上昇しました。6月にECBの量的金融緩和縮小観測を背景に、欧州を中心に下落したものの、米国を含む海外株式市場全般は堅調に推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

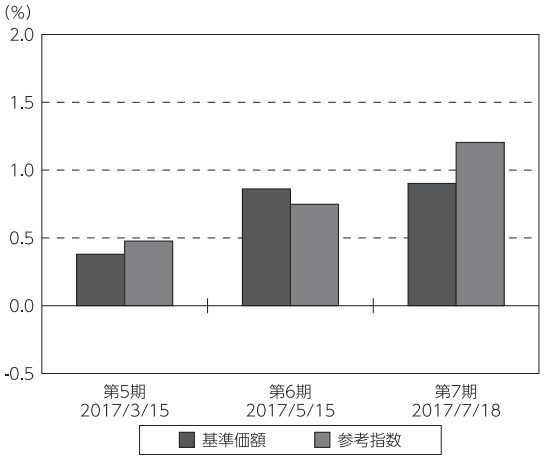
組入投資信託証券の日々の基準価額の動きなどにより基本組入比率からの乖離が生じますが、日々のリバランスや資金の追加解約に対応した売買により、できる限り当ファンドの基本組入比率を維持する運用を行いました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。

グラフは、基準価額と参考指数の対比です。

基準価額と参考指数の対比（期別騰落率）



（注）基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。

分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向等を勘案し以下のとおりといたしました。留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

（単位：円、１万口当たり・税込み）

項目	第５期 2017年１月17日～ 2017年３月15日	第６期 2017年３月16日～ 2017年５月15日	第７期 2017年５月16日～ 2017年７月18日
当期分配金	10	10	10
（対基準価額比率）	0.095%	0.094%	0.093%
当期の収益	10	10	10
当期の収益以外	－	－	－
翌期繰越分配対象額	561	643	728

（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

引き続き、組入投資信託証券を通じて、日本株式、日本債券、海外株式、海外債券に分散投資を行い、信託財産の着実な成長を目指します。

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○１万口当たりの費用明細

（2017年１月17日～2017年７月18日）

項目	第５期～第７期 金額	第５期～第７期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	26	0.249	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(10)	(0.097)	委託した資金の運用の対価
（販売会社）	(14)	(0.135)	交付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、購入後の情報提供等の対価
（受託会社）	(2)	(0.016)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用	0	0.002	(b)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（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
合計	26	0.251	
作成期間の平均基準価額は、10,567円です。			

（注）作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
（注）各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注）各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません。
（注）各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2017年１月17日～2017年７月18日）

投資信託証券

銘柄		第５期～第７期			
		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		口	千円	口	千円
国内	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）	521,786,984	640,000	95,594,427	117,000
	FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	3,816,356,731	3,825,000	391,808,803	393,000
	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	1,200,169,248	1,347,000	194,949,295	216,000
	FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	1,028,619,673	948,000	112,903,858	104,000
合計		6,566,932,636	6,760,000	795,256,383	830,000

（注）金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

（2017年１月17日～2017年７月18日）

該当事項はございません。

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す。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況

（2017年１月17日～2017年７月18日）

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2017年１月17日～2017年７月18日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

（2017年７月18日現在）

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

銘柄	第４期末	第７期末		
	口数	口数	評価額	比率
	口	口	千円	%
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）	573,709,159	999,901,716	1,272,574	9.6
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	3,781,399,081	7,205,947,009	7,200,182	54.5
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	1,238,827,717	2,244,047,670	2,608,256	19.8
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	1,108,921,744	2,024,637,559	1,906,398	14.4
合計	6,702,857,701	12,474,533,954	12,987,412	98.4

（注）比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○投資信託財産の構成

（2017年７月18日現在）

項目	第７期末	
	評価額	比率
	千円	%
投資信託受益証券	12,987,412	96.9
コール・ローン等、その他	414,439	3.1
投資信託財産総額	13,401,851	100.0

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第５期末	第６期末	第７期末
	2017年３月15日現在	2017年５月15日現在	2017年７月18日現在
	円	円	円
(A) 資産	**7,663,247,208**	**9,187,975,370**	**13,401,851,141**
コール・ローン等	271,006,546	551,793,872	414,438,646
投資信託受益証券(評価額)	7,334,240,662	8,611,181,498	12,987,412,495
未収入金	58,000,000	25,000,000	－
(B) 負債	**223,519,739**	**428,528,836**	**201,770,939**
未払収益分配金	7,043,984	8,229,891	12,303,451
未払解約金	210,812,407	413,407,273	179,811,059
未払信託報酬	5,613,814	6,782,411	9,465,260
未払利息	740	1,510	1,135
その他未払費用	48,794	107,751	190,034
(C) 純資産総額(Ａ－Ｂ)	**7,439,727,469**	**8,759,446,534**	**13,200,080,202**
元本	7,043,984,387	8,229,891,126	12,303,451,728
次期繰越損益金	395,743,082	529,555,408	896,628,474
(D) 受益権総口数	**7,043,984,387口**	**8,229,891,126口**	**12,303,451,728口**
１万口当たり基準価額(Ｃ／Ｄ)	**10,562円**	**10,643円**	**10,729円**

（注）当ファンドの第５期首元本額は6,566,391,404円、第５～７期中追加設定元本額は9,502,768,498円、第５～７期中一部解約元本額は3,765,708,174円です。
（注）１口当たり純資産額は、第５期1.0562円、第６期1.0643円、第７期1.0729円です。

○損益の状況

項目	第５期 2017年１月17日～ 2017年３月15日	第６期 2017年３月16日～ 2017年５月15日	第７期 2017年５月16日～ 2017年７月18日
	円	円	円
(A) **配当等収益**	**9,421,406**	**23,844,757**	**20,318,644**
受取配当金	9,447,191	23,877,168	20,377,155
受取利息	－	22	－
支払利息	△ 25,785	△ 32,433	△ 58,511
(B) **有価証券売買損益**	**28,544,595**	**69,639,498**	**89,730,001**
売買益	59,989,270	74,216,972	114,262,852
売買損	△ 31,444,675	△ 4,577,474	△ 24,532,851
(C) **信託報酬等**	**△ 5,662,608**	**△ 6,841,368**	**△ 9,547,543**
(D) **当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）**	**32,303,393**	**86,642,887**	**100,501,102**
(E) **前期繰越損益金**	**178,894,864**	**179,198,626**	**222,914,607**
(F) **追加信託差損益金**	**191,588,809**	**271,943,786**	**585,516,216**
（配当等相当額）	(84,159,169)	(158,420,175)	(399,872,220)
（売買損益相当額）	(107,429,640)	(113,523,611)	(185,643,996)
(G) **計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）**	**402,787,066**	**537,785,299**	**908,931,925**
(H) **収益分配金**	**△ 7,043,984**	**△ 8,229,891**	**△ 12,303,451**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	**395,743,082**	**529,555,408**	**896,628,474**
追加信託差損益金	191,588,809	271,943,786	585,516,216
（配当等相当額）	(84,159,169)	(158,420,175)	(399,872,220)
（売買損益相当額）	(107,429,640)	(113,523,611)	(185,643,996)
分配準備積立金	204,154,273	257,611,622	311,112,258

（注）損益の状況の中で**(B)有価証券売買損益**は各期末の評価換えによるものを含みます。
（注）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。
（注）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１月17日～2017年７月18日）は以下の通りです。

項目	2017年１月17日～ 2017年３月15日	2017年３月16日～ 2017年５月15日	2017年５月16日～ 2017年７月18日
a. 配当等収益(経費控除後)	8,015,947円	22,099,524円	18,556,168円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	24,287,446円	64,543,363円	81,944,934円
c. 信託約款に定める収益調整金	191,588,809円	271,943,786円	585,516,216円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	178,894,864円	179,198,626円	222,914,607円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	402,787,066円	537,785,299円	908,931,925円
f. 分配対象収益（１万口当たり）	571円	653円	738円
g. 分配金	7,043,984円	8,229,891円	12,303,451円
h. 分配金（１万口当たり）	10円	10円	10円

○分配金のお知らせ

	第５期	第６期	第７期
１万口当たり分配金（税込み）	10円	10円	10円

○お知らせ

2017年１月17日から2017年７月18日までの期間に実施いたしました約款変更は以下の通りです。

2017年４月15日付で、信託期間を無期限とする約款変更を行いました。

合成指数について

合成指数は、下記の指数と基本組入比率をもとにＪＰ投信が計算したものです。

資　産	指　数	基本組入比率
日本株式	TOPIX（東証株価指数、配当なし）	20%
日本債券	NOMURA-BPI総合	55%
海外株式	MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・配当込み・為替ヘッジなし）	10%
海外債券	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）	15%

＊「TOPIX（東証株価指数、配当なし）」とは、株式会社東京証券取引所（以下「東証」）が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定また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。

＊「NOMURA-BPI総合」とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われるＪＰ投信株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

＊「MSCI-KOKUSAI指数」とは、MSCI Inc.が開発した日本を除く世界の主要国の株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。同指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、MSCI Inc.は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

＊「シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）」とは、Citigroup Index LLCが開発した、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です。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定また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。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。	
運用方針	TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内株式インデックスマザーファンド	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
組入制限	FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	株式への実質投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	国内株式インデックスマザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 ①分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 ②分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)

運用報告書(全体版)

第5期（決算日　2017年3月7日）
第6期（決算日　2017年5月8日）
第7期（決算日　2017年7月7日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

お問い合わせ先
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

PCサイト　http://www.smtam.jp/
モバイルサイト　http://m.smtam.jp/

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-8574　東京都港区芝三丁目33番1号

【本運用報告書の記載について】
・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

作成期	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	純資産総額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
		円	円	%		%	%	%	百万円
第1	設定日(2016年 2月 3日)	10,000	－	－	10,000	－	－	－	0.5
	第1期(2016年 7月 7日)	8,756	59	△11.9	8,719	△12.8	99.6	1.0	4,035
第2	第2期(2016年 9月 7日)	9,636	3	10.1	9,597	10.1	99.0	0.9	4,393
	第3期(2016年11月 7日)	9,730	80	1.8	9,691	1.0	98.9	1.9	4,106
	第4期(2017年 1月10日)	11,009	15	13.3	10,967	13.2	99.1	0.9	4,535
第3	第5期(2017年 3月 7日)	11,100	6	0.9	11,058	0.8	99.1	0.9	5,398
	第6期(2017年 5月 8日)	11,336	86	2.9	11,277	2.0	98.8	2.0	6,917
	第7期(2017年 7月 7日)	11,489	16	1.5	11,428	1.3	99.0	1.2	8,769

(注1)基準価額の騰落率は分配金込みです。
(注2)当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当作成期中の基準価額と市況の推移

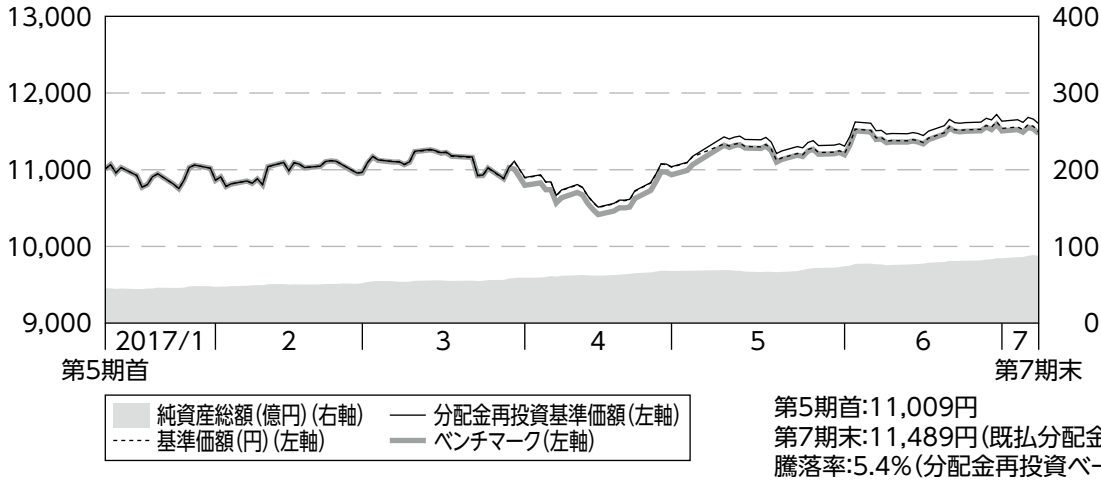
決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率
			騰落率		騰落率		
		円	%		%	%	%
第5期	(期 首)2017年1月10日	11,009	－	10,967	－	99.1	0.9
	1月末	10,863	△1.3	10,821	△1.3	98.7	1.3
	2月末	10,966	△0.4	10,918	△0.5	98.8	1.1
	(期 末)2017年3月 7日	11,106	0.9	11,058	0.8	99.1	0.9
第6期	(期 首)2017年3月 7日	11,100	－	11,058	－	99.1	0.9
	3月末	10,893	△1.9	10,756	△2.7	97.4	2.6
	4月末	11,033	△0.6	10,893	△1.5	97.9	2.1
	(期 末)2017年5月 8日	11,422	2.9	11,277	2.0	98.8	2.0
第7期	(期 首)2017年5月 8日	11,336	－	11,277	－	98.8	2.0
	5月末	11,216	△1.1	11,153	△1.1	98.2	1.8
	6月末	11,539	1.8	11,462	1.6	98.5	1.6
	(期 末)2017年7月 7日	11,505	1.5	11,428	1.3	99.0	1.2

(注1)期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注2)当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。
TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定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。
設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



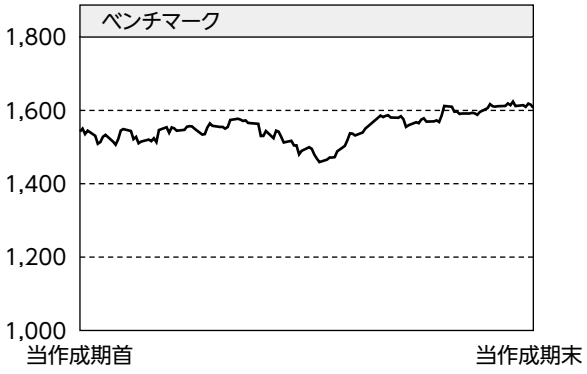
第5期首:11,009円
第7期末:11,489円(既払分配金108円)
騰落率:5.4%(分配金再投資ベース)

(注1)分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)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。
(注2)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3)分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2017年1月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)の動きを反映して基準価額は変動し、当作成期末は当作成期首比で上昇しました。

投資環境



当作成期前半の国内株式市場は、それまでの上昇に対する警戒感に加え、トランプ米大統領による保護主義的な発言や、欧州景気の先行き不透明感などが懸念され、上値の重い展開となりました。2017年4月には、北朝鮮を巡る地政学リスクの高まりや、為替が円高に振れたことが嫌気され下落する局面もありましたが、その後は、地政学リスクの後退や、フランス大統領選挙の結果を受けて欧州の政治情勢に対する過度な懸念の後退などを背景に上昇基調に転じました。6月後半には円安・ドル高が進んだことや、米国株式市場が底堅く推移したことなど背景に主要指数が年初来高値を更新しました。

当ファンドのポートフォリオ

株式への投資は「国内株式インデックス マザーファンド」受益証券の組み入れにより行いました。

【「国内株式インデックス マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1)株式組入比率は期を通じて100%に近い水準で維持し、効率的な運用に努めました。設定や解約による資金変動には、主に株価指数先物取引を活用しました。

(2)東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、TOPIX(東証株価指数)の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成しました。

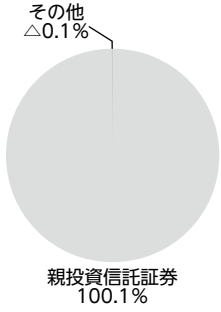
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

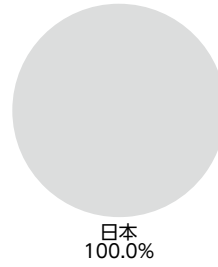
	当作成期末
	2017年7月7日
国内株式インデックス マザーファンド	100.1%
その他	△0.1%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

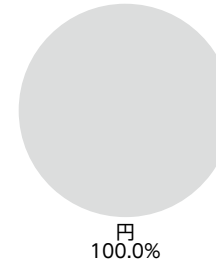
○資産別配分



○国別配分



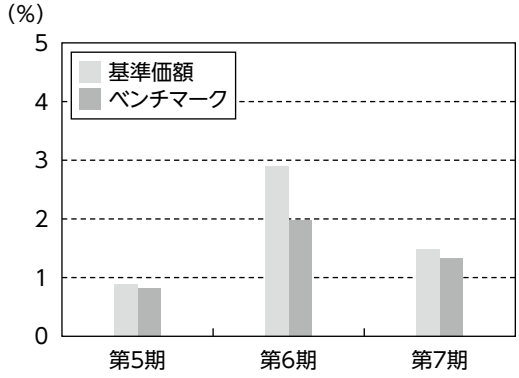
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当作成期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)が配当相当分を含まない指数であることによって生じる要因(プラス)および信託報酬要因(マイナス)です。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきました。
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（1万口当たり・税引前）

項目		第5期	第6期	第7期
		2017年1月11日～2017年3月7日	2017年3月8日～2017年5月8日	2017年5月9日～2017年7月7日
当期分配金	（円）	6	86	16
（対基準価額比率）	（%）	(0.054)	(0.753)	(0.139)
当期の収益	（円）	6	86	16
当期の収益以外	（円）	－	－	－
翌期繰越分配対象額	（円）	1,588	1,879	2,019

（注1）「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。
（注2）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）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3）－印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

国内株式インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、東京証券取引所市場第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当作成期 (2017年1月11日~2017年7月7日) 金額	当作成期 (2017年1月11日~2017年7月7日) 比率	項目の概要
(a) 信託報酬	6円	0.058%	(a)信託報酬=〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は11,085円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。
(投信会社)	(5)	(0.042)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
(販売会社)	(1)	(0.005)	交付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、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(1)	(0.011)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b)売買委託手数料=$\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕}$×10,000
(株式)	(0)	(0.000)	
(新株予約権証券)	(−)	(−)	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
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(商品)	(−)	(−)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	−	−	(c)有価証券取引税=$\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕}$×10,000
(株式)	(−)	(−)	
(新株予約権証券)	(−)	(−)	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
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(公社債)	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(d) その他費用	0	0.003	(d)その他費用=$\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕}$×10,000
(保管費用)	(−)	(−)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	6	0.062	

(注1)期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当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。
(注2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜親投資信託受益証券の設定、解約状況＞

	当作成期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内株式インデックス マザーファンド	3,476,856	4,736,138	654,948	900,518

株式売買比率

＜親投資信託の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	当作成期
	国内株式インデックス マザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	12,480,280千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	156,876,846千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.07

(注1) (b)当作成期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	10	10	100.0	10	10	100.0
コール・ローン	1,303	304	23.3	1,333	310	23.3

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

＜国内株式インデックス マザーファンド＞

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	1,427	1,427	100.0	1,427	1,427	100.0
コール・ローン	226,822	52,603	23.2	226,767	52,484	23.1

〈平均保有割合　4.2%〉
(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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す。

■利害関係人の発行する有価証券等

＜国内株式インデックス マザーファンド＞

種類	当作成期		
	買付額	売付額	当作成期末保有額
株式	18百万円	20百万円	580百万円

(注1)買付額および売付額は受渡代金、当作成期末保有額は評価額です。
(注2)当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	前作成期末	当作成期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
国内株式インデックス マザーファンド	3,382,783	6,204,691	8,781,499

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、117,164,082千口です。

投資信託財産の構成

項目	当作成期末	
	評価額	比率
	千円	%
国内株式インデックス マザーファンド	8,781,499	99.6
コール・ローン等、その他	36,639	0.4
投資信託財産総額	8,818,138	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	第5期末 2017年3月7日現在	第6期末 2017年5月8日現在	第7期末 2017年7月7日現在
(A)資産	5,472,178,535円	7,039,247,034円	8,818,138,643円
コール・ローン等	914,239	3,175,895	1,638,878
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	5,401,189,679	6,969,908,375	8,781,499,766
未収入金	70,074,617	66,162,764	34,999,999
(B)負債	73,852,326	121,761,602	48,759,248
未払収益分配金	2,918,124	52,476,939	12,212,675
未払解約金	70,000,000	67,999,999	34,999,999
未払信託報酬	893,601	1,228,822	1,479,317
未払利息	1	7	3
その他未払費用	40,600	55,835	67,254
(C)純資産総額(A-B)	5,398,326,209	6,917,485,432	8,769,379,395
元本	4,863,540,253	6,101,969,753	7,632,922,381
次期繰越損益金	534,785,956	815,515,679	1,136,457,014
(D)受益権総口数	4,863,540,253口	6,101,969,753口	7,632,922,381口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,100円	11,336円	11,489円

■損益の状況

項目	第5期 自 2017年1月11日 至 2017年3月7日	第6期 自 2017年3月8日 至 2017年5月8日	第7期 自 2017年5月9日 至 2017年7月7日
(A)配当等収益	△932円	△525円	△1,608円
受取利息	4	—	—
支払利息	△936	△525	△1,608
(B)有価証券売買損益	54,304,905	226,877,762	120,407,185
売買益	57,086,289	229,256,287	123,506,634
売買損	△2,781,384	△2,378,525	△3,099,449
(C)信託報酬等	△934,201	△1,284,657	△1,546,571
(D)当期損益金(A+B+C)	53,369,772	225,592,580	118,859,006
(E)前期繰越損益金	536,747,421	571,423,630	695,697,197
(F)追加信託差損益金	△52,413,113	70,976,408	334,113,486
(配当等相当額)	(185,111,903)	(397,679,809)	(738,655,823)
(売買損益相当額)	(△237,525,016)	(△326,703,401)	(△404,542,337)
(G)計 (D+E+F)	537,704,080	867,992,618	1,148,669,689
(H)収益分配金	△2,918,124	△52,476,939	△12,212,675
次期繰越損益金(G+H)	534,785,956	815,515,679	1,136,457,014
追加信託差損益金	△52,413,113	70,976,408	334,113,486
(配当等相当額)	(185,219,509)	(402,121,914)	(739,037,591)
(売買損益相当額)	(△237,632,622)	(△331,145,506)	(△404,924,105)
分配準備積立金	587,199,069	744,539,271	802,343,528

(注1)(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(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。
(注3)(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。

〈注記事項〉
※当ファンドの第5期首元本額は4,119,797,440円、第5～7期中追加設定元本額は4,378,568,190円、第5～7期中一部解約元本額は865,443,249円です。
※分配金の計算過程

項　　目	第　5　期	第　6　期	第　7　期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	3,233,264円	54,092,992円	12,403,076円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	50,136,508円	171,499,588円	106,455,930円
(C) 収益調整金額	185,219,509円	402,121,914円	739,037,591円
(D) 分配準備積立金額	536,747,421円	571,423,630円	695,697,197円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	775,336,702円	1,199,138,124円	1,553,593,794円
(F) 期末残存口数	4,863,540,253口	6,101,969,753口	7,632,922,381口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	1,594円	1,965円	2,035円
(H) 分配金額(1万口当たり)	6円	86円	16円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	2,918,124円	52,476,939円	12,212,675円

分配金のお知らせ

	第5期	第6期	第7期
1万口当たり分配金	6円	86円	16円

(注)分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

お知らせ

該当事項はありません。

国内株式インデックス マザーファンド

運 用 報 告 書

第17期（決算日　2017年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運　用　方　針	わが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX(東証株価指数)と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の取引所に上場されている株式を主要投資対象とします。
組　入　制　限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は、行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】
・基準価額は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第13期(2013年5月29日)	9,567	65.8	1,178.87	62.1	97.8	2.2	149,398
第14期(2014年5月29日)	9,940	3.9	1,200.68	1.9	97.9	2.2	142,008
第15期(2015年5月29日)	14,114	42.0	1,673.65	39.4	97.9	1.8	157,438
第16期(2016年5月30日)	11,755	△16.7	1,366.01	△18.4	97.9	1.9	151,002
第17期(2017年5月29日)	13,812	17.5	1,570.21	14.9	98.2	1.8	162,440

(注)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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
		騰落率		騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2016年 5月30日	11,755	－	1,366.01	－	97.9	1.9
5月末	11,873	1.0	1,379.80	1.0	98.0	2.1
6月末	10,736	△8.7	1,245.82	△8.8	98.8	1.2
7月末	11,400	△3.0	1,322.74	△3.2	98.7	1.3
8月末	11,462	△2.5	1,329.54	△2.7	98.9	1.1
9月末	11,498	△2.2	1,322.78	△3.2	98.1	1.8
10月末	12,109	3.0	1,393.02	2.0	98.5	1.4
11月末	12,776	8.7	1,469.43	7.6	98.0	1.8
12月末	13,220	12.5	1,518.61	11.2	98.6	1.4
2017年 1月末	13,248	12.7	1,521.67	11.4	98.7	1.3
2月末	13,375	13.8	1,535.32	12.4	98.8	1.1
3月末	13,295	13.1	1,512.60	10.7	97.4	2.6
4月末	13,467	14.6	1,531.80	12.1	97.9	2.1
(当期末)						
2017年 5月29日	13,812	17.5	1,570.21	14.9	98.2	1.8

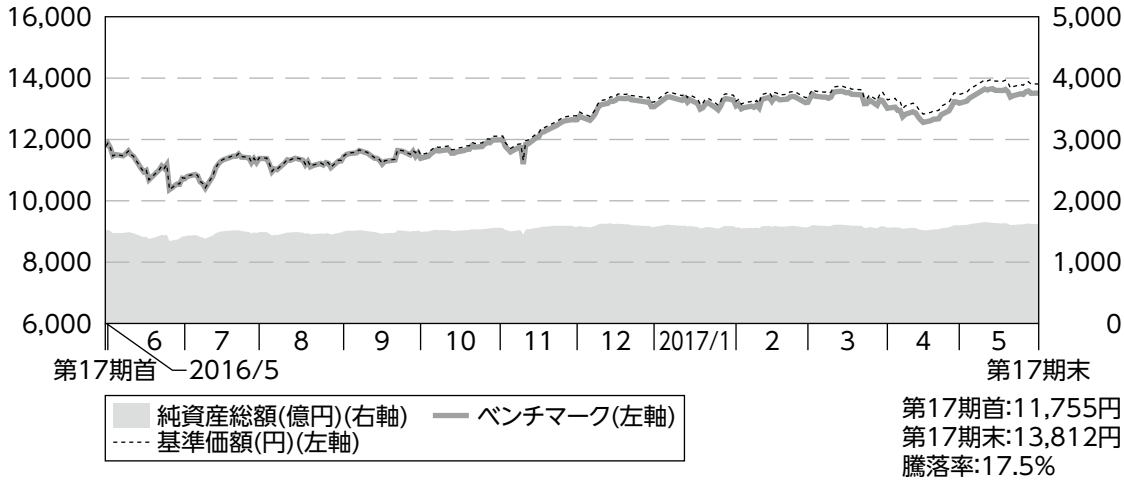
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、TOPIX(東証株価指数)です。

TOPIX(東証株価指数)とは、株式会社東京証券取引所(以下「東証」)が算出、公表する指数で、東京証券取引所市場第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした時価総額加重型の株価指数です。同指数は、東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関する全ての権利は、東証が有しています。なお、東証は、ファンドの設定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。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

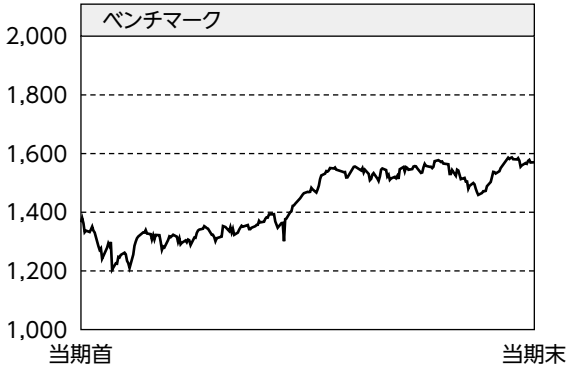


(注)ベンチマークは、2016年5月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるTOPIX(東証株価指数)の動きを反映して基準価額は変動し、期首比では上昇しました。

投資環境



期前半の国内株式市場は、英国のEU（欧州連合）離脱決定後の先行きに対する不透明感などから、上値の重い展開が続きましたが、2016年11月から12月にかけては、トランプ氏が掲げる政策への好感や、米国金利の先高観などを背景とした円安・米ドル高の進行から、上昇しました。

その後は、それまでの急ピッチな上昇に対する警戒感に加え、トランプ米大統領による保護主義的な発言や、シリアや北朝鮮を巡る地政学リスクの高まりなどを背景に調整する局面もありましたが、地政学リスクの後退や、フランス大統領選挙の結果を受けて欧州の政治情勢に対する過度な懸念が後退したことなどから、期末にかけて上昇に転じました。

当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

（1）株式組入比率は期を通じて100%に近い水準で維持し、効率的な運用に努めました。設定や解約による資金変動には、主に株価指数先物取引を活用しました。

（2）東証一部上場銘柄の中から信用リスクが極めて高いと判断される銘柄を除外し、TOPIX（東証株価指数）の個別銘柄構成比率に合わせたポートフォリオを組成しました。

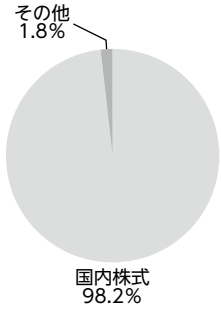
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

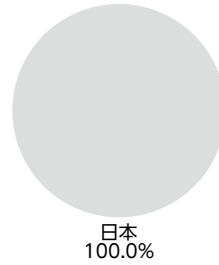
順位	銘柄名	国	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.1%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	2.2%
3	日本電信電話	日本	1.8%
4	ソフトバンクグループ	日本	1.7%
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.4%
6	KDDI	日本	1.3%
7	ソニー	日本	1.2%
8	本田技研工業	日本	1.2%
9	みずほフィナンシャルグループ	日本	1.1%
10	日本たばこ産業	日本	1.1%
組入銘柄数		1,967	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

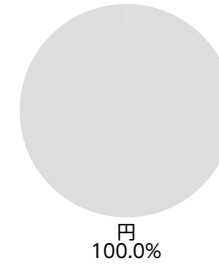
○資産別配分



○国別配分



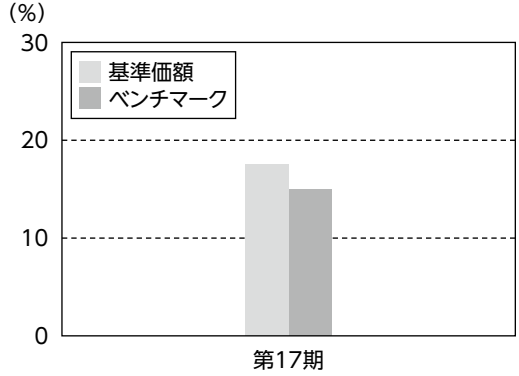
○通貨別配分



（注）資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率に概ね連動しました。

差異の主な要因は、ベンチマークであるTOPIX（東証株価指数）が配当相当分を含まない指数であることによって生じる要因（プラス）です。

今後の運用方針

原則として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に分散投資を行い、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2016年5月31日～2017年5月29日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	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〕×10,000 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）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
（商品）	(－)	(－)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(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〕×10,000 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）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) その他費用	0	0.000	(c)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
（保管費用）	(－)	(－)	
（監査費用）	(－)	(－)	
（その他）	(0)	(0.000)	
合計	0	0.001	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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。
（注2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注3）「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額（12,371円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜株　式＞

		当期			
		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
		千株	千円	千株	千円
国内	上場	11,518 (△8,530)	14,625,518 (－)	19,013	25,342,824

(注1)金額は受渡代金です。
(注2)(　)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		当期			
		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	株式先物取引	33,148	33,405	－	－

(注)金額は受渡代金です。

株式売買比率

＜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) 当期中の株式売買金額	39,968,343千円
(b) 当期中の平均組入株式時価総額	151,070,732千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	0.26

(注1) (b)当期中の平均組入株式時価総額は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。
(注2) (c)売買高比率は小数第3位以下を切り捨てております。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	16,021	16,021	100.0	16,220	16,220	100.0
コール・ローン	389,816	77,074	19.8	389,250	76,435	19.6

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

■利害関係人の発行する有価証券等

種類	当期		
	買付額	売付額	当期末保有額
株式	45百万円	81百万円	538百万円

(注1)買付額および売付額は受渡代金、当期末保有額は評価額です。
(注2)当該株式の銘柄は、三井住友トラスト・ホールディングス株式会社です。

※ 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す。

組入資産の明細

＜国内株式(上場株式)＞

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
水産・農林業(0.1%)			
極洋	35	3.1	9,501
日本水産	94.4	101.3	58,956
マルハニチロ	16.7	14.8	47,656
カネコ種苗	－	2.7	3,963
サカタのタネ	12.1	11.5	40,940
ホクト	8.3	7.9	15,981
ホクリヨウ	0.8	1.1	1,025
鉱業(0.3%)			
住石ホールディングス	24.1	21.7	2,170
日鉄鉱業	23	2.2	11,946
三井松島産業	54	4.8	6,691
国際石油開発帝石	431.4	410.9	417,474
日本海洋掘削	2.5	2.7	5,972
石油資源開発	13	12.4	27,887
K&Oエナジーグループ	5.5	5.2	9,484
建設業(3.1%)			
ショーボンドホールディングス	8.6	7.5	39,675
ミライト・ホールディングス	25.2	24	27,048
タマホーム	6.1	5.9	3,799
サンヨーホームズ	1.7	1.6	1,049
ファーストコーポレーション	－	1.7	1,912
インベスターズクラウド	－	1	4,375
ダイセキ環境ソリューション	1.9	2.2	2,853
安藤・間	54.7	56.1	44,992
東急建設	26.7	27.7	26,592
コムシスホールディングス	35.2	30.5	72,010
ミサワホーム	10.2	9.6	9,436
ビーアールホールディングス	3.2	7.7	2,979
高松コンストラクショングループ	6.2	5.9	16,348
東建コーポレーション	3.4	2.9	29,145
ソネック	0.9	1	742
ヤマウラ	4.2	3.8	3,192
大成建設	425	397	373,577
大林組	245.6	233.9	286,527
清水建設	251	239	268,158
飛島建設	65.7	76.8	13,209
長谷工コーポレーション	95.6	91	128,765
松井建設	9.1	8.6	7,688
錢高組	12	11	5,016
鹿島建設	384	343	289,149
不動テトラ	59.8	62.7	11,599
大末建設	3.1	2.8	2,665
鉄建建設	51	48	16,224
西松建設	95	90	54,630
三井住友建設	313.8	298.9	37,063
大豊建設	32	28	14,504
前田建設工業	50	51	60,639
佐田建設	6.2	5.7	2,490
ナカノフドー建設	6.7	6.1	3,647
奥村組	78	64	47,488
東鉄工業	9.8	9.4	33,229
イチケン	10	7	2,814
淺沼組	26	27	8,775
戸田建設	95	91	64,246
熊谷組	121	122	41,846
青木あすなろ建設	5.4	5.1	4,477
北野建設	18	16	5,088
植木組	11	11	2,871
三井ホーム	11	10	7,370
矢作建設工業	11.1	10.6	9,391
ピーエス三菱	10.1	8.7	4,080
日本ハウスホールディングス	16.7	15.9	8,093
大東建託	30.1	28.2	486,309
新日本建設	9.9	9.3	9,597
ＮＩＰＰＯ	19	18	40,104
東亜道路工業	15	15	6,630
前田道路	26	24	53,928
日本道路	24	23	13,110
東亜建設工業	71	6.3	12,669
若築建設	47	45	7,515
東洋建設	25.7	22.5	9,405
五洋建設	90.9	86.5	53,976
大林道路	9.6	8.1	7,605
世紀東急工業	12.8	11.4	6,919
福田組	13	13	13,377
住友林業	56.4	53.7	95,586
日本基礎技術	9.1	8.7	3,071
日成ビルド工業	23	23	14,950
巴コーポレーション	10.8	10	3,510
パナホーム	31	29	35,641
大和ハウス工業	241.9	230.4	835,660
ライト工業	15.7	15	17,850
積水ハウス	273.8	244.2	466,422
日特建設	9	6.7	3,812
北陸電気工事	4	3.8	3,530
ユアテック	13	12	8,964
西部電気工業	7	1.3	2,974

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
四電工	6	6	2,958
中電工	11.8	8.8	24,860
関電工	33	31	34,968
きんでん	49.5	51.9	87,607
東京エネシス	9	8.1	7,719
トーエネック	12	11	6,710
住友電設	6.5	5.4	7,921
日本電設工業	13.3	12.7	28,752
協和エクシオ	32.1	30.6	56,977
新日本空調	6.9	6	9,012
ＮＤＳ	13	1.2	3,582
九電工	15	15.2	59,736
三機工業	18.2	17.3	20,068
日揮	82	72.8	121,576
中外炉工業	25	24	5,136
ヤマト	7.4	7.1	3,997
太平電業	12	11	13,519
高砂熱学工業	24.4	21.5	38,743
三晃金属工業	9	0.7	2,240
朝日工業社	10	1.8	5,661
明星工業	14.8	14.1	9,038
大氣社	10	10.3	30,900
ダイダン	11	10	12,330
日比谷総合設備	9.8	8.7	15,425
東芝プラントシステム	13.3	12.7	20,726
ＯＳＪＢホールディングス	16.7	23.9	6,883
東洋エンジニアリング	44	47	12,220
千代田化工建設	59	56	35,448
新興プランテック	16.8	16	12,752
食料品(4.8%)			
日本製粉	54	23.2	40,762
日清製粉グループ本社	89.8	85.5	159,115
日東富士製粉	6	0.5	1,947
昭和産業	34	32	18,720
鳥越製粉	6.5	6.2	5,015
中部飼料	7.6	8.5	12,410
フィード・ワン	49.5	47	10,622
東洋精糖	13	12	1,404
日本甜菜製糖	42	4	8,916
三井製糖	32	5.5	18,452
塩水港精糖	8.9	8.3	2,008
日新製糖	3.5	3.3	6,200
森永製菓	74	15.2	99,256
中村屋	19	1.8	9,090
江崎グリコ	18.9	19.5	121,875
名糖産業	3.6	3.4	5,001
不二家	47	45	11,520
山崎製パン	60	57.1	132,300

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
第一屋製パン	13	12	1,452
モロゾフ	13	12	7,152
亀田製菓	4.6	4.3	25,327
寿スピリッツ	5.8	7.4	27,676
カルビー	30.4	31.8	140,874
森永乳業	74	70	65,520
六甲バター	3.7	3.5	9,380
ヤクルト本社	43.9	41.8	329,802
明治ホールディングス	48.5	46.2	419,496
雪印メグミルク	19.3	16.8	56,784
プリマハム	52	49	29,057
日本ハム	60	55	190,300
林兼産業	－	2.5	2,120
丸大食品	42	37	19,351
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	5.1	4.2	15,750
伊藤ハム米久ホールディングス	48.9	45	46,440
サッポロホールディングス	125	25.5	84,787
アサヒグループホールディングス	153.7	146.3	656,009
キリンホールディングス	331.9	335.8	786,275
宝ホールディングス	59.3	56.5	64,410
オエノンホールディングス	22	20	5,340
養命酒製造	2.5	2.4	5,116
コカ・コーラボトラーズジャパン	27.8	49.2	170,232
コカ・コーライーストジャパン	29	－	－
サントリー食品インターナショナル	56.1	53.4	286,224
ダイドーグループホールディングス	4.1	3.6	20,088
伊藤園	24.3	23.1	105,798
キーコーヒー	7.2	6.9	15,255
ユニカフェ	2.2	2.1	2,058
ジャパンフーズ	1.1	1	1,348
日清オイリオグループ	43	45	29,610
不二製油グループ本社	21.9	20.8	55,224
かどや製油	0.8	0.8	4,464
Ｊ－オイルミルズ	34	3.6	14,580
キッコーマン	62	54.6	192,738
味の素	172.2	160.7	384,555
キユーピー	41.7	39.7	116,519
ハウス食品グループ本社	28	28.9	80,110
カゴメ	29.4	28	99,540
焼津水産化学工業	3.9	3.7	4,591
アリアケジャパン	6.7	6.4	51,008
ピエトロ	0.8	0.9	1,458
エバラ食品工業	2	1.9	4,014
ニチレイ	87	38.4	121,728
東洋水産	40.3	38.3	165,264
イートアンド	0.9	0.9	2,066
大冷	－	0.8	1,459
ヨシムラ・フード・ホールディングス	－	0.1	288

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
日清食品ホールディングス	34.7	30.5	212,585
永谷園ホールディングス	8	7	10,003
一正蒲鉾	2.9	2.7	3,580
フジッコ	8	7.6	20,064
ロック・フィールド	8.6	7.5	14,737
日本たばこ産業	484.2	432.3	1,816,956
ケンコーマヨネーズ	2.7	4.2	13,314
わらべや日洋ホールディングス	4.4	4.6	13,869
なとり	4.1	3.9	7,784
イフジ産業	－	1.2	945
北の達人コーポレーション	1.6	3.4	2,890
ユーグレナ	27.6	26.9	31,957
ミヨシ油脂	28	27	3,807
理研ビタミン	2.4	2.3	10,108
繊維製品(0.7%)			
片倉工業	9.7	9.2	12,144
グンゼ	62	55	21,670
東洋紡	304	289	54,332
ユニチカ	223	199	15,721
富士紡ホールディングス	37	3.6	11,502
倉敷紡績	78	74	19,462
シキボウ	47	39	5,382
日本毛織	23.6	20.6	17,468
トーア紡コーポレーション	3.2	3.1	1,708
ダイドーリミテッド	8.7	8.3	3,552
帝国繊維	8	7.6	13,915
帝人	313	59.6	124,385
東レ	555	529	487,156
サカイオーベックス	21	1.7	2,958
住江織物	23	20	5,160
日本フエルト	4.2	4.3	2,214
イチカワ	6	5	1,555
日東製網	－	0.8	1,444
芦森工業	23	－	－
アツギ	59	62	7,812
ダイニック	14	14	2,688
セーレン	19.1	18.2	29,192
ソトー	－	2.7	3,113
東海染工	11	14	1,876
小松精練	12.5	10.3	7,652
ワコールホールディングス	46	43	61,060
ホギメディカル	4.8	4.6	34,040
レナウン	20.7	19.7	2,718
クラウディア	3.5	2.4	1,384
ＴＳＩホールディングス	34.2	30.1	21,551
三陽商会	45	43	6,880
オンワードホールディングス	51	47	37,318
ルック	19	18	4,212

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ゴールドウイン	3.4	3.2	19,712
デサント	17.5	16.7	22,595
キング	3.8	3.6	1,436
ヤマトインターナショナル	4.7	4.9	2,082
パルプ・紙(0.3%)			
特種東海製紙	44	4.2	16,989
王子ホールディングス	314	285	158,175
日本製紙	39.6	32.7	71,384
三菱製紙	117	10.4	7,675
北越紀州製紙	47.5	40.7	35,490
中越パルプ工業	30	29	7,076
巴川製紙所	12	11	2,750
大王製紙	33.9	29.1	40,187
阿波製紙	－	1.8	1,121
レンゴー	68	70.3	43,726
トーモク	24	23	8,579
ザ・パック	5.4	5.2	17,342
化学(6.9%)			
クラレ	120.8	122.7	244,418
旭化成	477	455	483,210
共和レザー	5	4.3	4,089
昭和電工	510	48.5	99,425
住友化学	564	537	313,608
日本化成	14	－	－
住友精化	16	3	14,730
日産化学工業	46	39.9	155,211
ラサ工業	29	27	3,834
クレハ	58	5.5	30,965
多木化学	5	5	4,615
テイカ	13	11	10,725
石原産業	137	13.1	13,846
片倉コープアグリ	9	10	2,790
日東エフシー	4.5	4.3	3,844
日本曹達	49	44	24,904
東ソー	207	211	198,129
トクヤマ	127	113	54,127
セントラル硝子	83	74	33,300
東亞合成	47.9	45.6	56,954
大阪ソーダ	33	31	15,655
関東電化工業	18	14.9	13,618
デンカ	159	151	85,013
信越化学工業	137.3	130.8	1,296,489
日本カーバイド工業	26	25	3,925
堺化学工業	31	27	11,097
エア・ウォーター	63	60.1	119,418
大陽日酸	59	56.2	63,168
日本化学工業	28	27	5,805
日本パーカライジング	39.1	37.3	60,463

国内株式インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
高圧ガス工業	11	10.8	8,218
チタン工業	9	9	1,728
四国化成工業	11	11	14,729
戸田工業	15	15	4,005
ステラ　ケミファ	3.9	3.5	9,929
保土谷化学工業	23	2.5	10,087
日本触媒	11.1	11.5	76,705
大日精化工業	30	30	23,940
カネカ	103	98	82,320
三菱瓦斯化学	132	67.9	148,565
三井化学	325	331	178,409
ＪＳＲ	71.8	73.3	136,484
東京応化工業	15.4	13.6	49,640
大阪有機化学工業	5.5	4.7	6,180
三菱ケミカルホールディングス	512.8	491.2	403,815
ＫＨネオケム	－	11.9	22,859
日本合成化学工業	18	－	－
ダイセル	107.7	98.3	126,905
住友ベークライト	72	64	48,128
積水化学工業	173.8	165.5	320,904
日本ゼオン	66	61	67,283
アイカ工業	23	23.4	75,933
宇部興産	410	367	96,888
積水樹脂	11.8	11.2	22,926
タキロンシーアイ	18	15	8,385
旭有機材	25	24	5,784
日立化成	37.8	40.5	118,179
ニチバン	8	7	6,594
リケンテクノス	16.5	15.7	8,744
大倉工業	18	17	9,775
積水化成品工業	20	10.2	8,588
群栄化学工業	20	1.8	6,615
タイガースポリマー	3.8	3.6	2,689
ミライアル	2.8	2.7	2,430
ダイキアクシス	1.5	1.2	2,498
ダイキョーニシカワ	9.9	12.8	18,291
日本化薬	50	47	72,521
カーリットホールディングス	7.2	6.8	3,814
日本精化	6.3	6	5,856
扶桑化学工業	4.9	5.2	18,304
ＡＤＥＫＡ	37.6	31.4	50,114
日油	58	56	79,800
ハリマ化成グループ	6.6	6.2	4,854
花王	205.9	181.9	1,256,565
第一工業製薬	17	16	7,264
日華化学	－	2.3	2,737
ニイタカ	1.1	1.1	1,908
三洋化成工業	24	4.6	23,690
有機合成薬品工業	－	4.9	1,347
大日本塗料	44	42	11,424
日本ペイントホールディングス	59.1	56.3	245,468
関西ペイント	86.6	76.6	179,550
神東塗料	6	5	1,045
中国塗料	22	20.9	16,866
日本特殊塗料	5.4	5.1	8,731
藤倉化成	10.4	9.9	6,336
太陽ホールディングス	5.6	5.9	28,438
ＤＩＣ	302	28.8	106,848
サカタインクス	15.6	14.9	25,434
東洋インキＳＣホールディングス	76	72	40,032
Ｔ＆Ｋ　ＴＯＫＡ	5.6	5.3	6,020
富士フイルムホールディングス	175.2	144.6	585,340
資生堂	145.3	138.3	511,848
ライオン	88	90.5	205,163
高砂香料工業	5	4.8	19,008
マンダム	7.1	7.3	41,683
ミルボン	4.5	3.9	22,659
ファンケル	17.8	15.5	32,271
コーセー	12.4	11.8	138,178
コタ	2.6	3	3,561
シーズ・ホールディングス	9.8	9.5	33,060
シーボン	0.9	0.8	1,980
ポーラ・オルビスホールディングス	7.8	29.7	89,694
ノエビアホールディングス	4.8	4.6	23,460
アジュバンコスメジャパン	1.5	1.4	1,345
エステー	5.3	5	11,560
アグロ　カネショウ	3	2.8	4,032
コニシ	12	11.4	17,442
長谷川香料	9.7	9.2	20,249
星光ＰＭＣ	4.2	4	4,856
小林製薬	11.6	19.5	127,140
荒川化学工業	6.5	6.2	11,904
メック	6	5.7	7,147
日本高純度化学	2.2	2.1	4,825
タカラバイオ	16.4	20.8	30,950
ＪＣＵ	2.3	4.6	19,918
新田ゼラチン	5.1	4.4	3,198
ＯＡＴアグリオ	0.9	0.9	1,444
デクセリアルズ	22.9	19.2	18,604
アース製薬	5.5	5.2	30,524
イハラケミカル工業	11.8	－	－
北興化学工業	8	7	3,297
大成ラミック	2.1	2.3	6,594
クミアイ化学工業	15.8	30.9	19,745
日本農薬	17.5	18.2	11,593
アキレス	63	6	11,154

国内株式インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
有沢製作所	11.3	12.4	10,081
日東電工	59.1	52.6	465,615
レック	2.4	4.5	13,302
きもと	12.7	13.2	3,273
藤森工業	6.6	5.4	17,928
前澤化成工業	5.4	4.8	5,803
ＪＳＰ	5	3.4	9,224
エフピコ	6.8	6.5	37,635
天馬	5.9	4.8	9,604
信越ポリマー	15	14.3	11,254
東リ	20	17.4	6,107
ニフコ	14.6	12.8	72,832
日本バルカー工業	30	5.7	13,030
ユニ・チャーム	155	147.6	435,567
医薬品(4.7%)			
協和発酵キリン	91.6	87.2	174,661
武田薬品工業	304.9	273.4	1,583,259
アステラス製薬	857.2	744.8	1,045,326
大日本住友製薬	54.2	51.6	86,326
塩野義製薬	111.6	92.5	558,977
田辺三菱製薬	89.2	84.9	209,787
わかもと製薬	9	8	2,208
あすか製薬	9.7	7.9	13,674
日本新薬	17.5	16.7	108,049
ビオフェルミン製薬	1.2	1.2	3,624
中外製薬	76.2	72.6	305,283
科研製薬	13.2	13.6	88,672
エーザイ	94.2	89.7	528,422
ロート製薬	37.5	35.7	82,359
小野薬品工業	173.8	165.6	388,332
久光製薬	23.8	20.6	116,390
有機合成薬品工業	5	－	－
持田製薬	5.3	4.9	39,053
参天製薬	141	131.7	198,603
扶桑薬品工業	26	2.5	7,132
日本ケミファ	11	1	5,250
ツムラ	24.1	24.5	98,000
日医工	17.9	17	27,931
キッセイ薬品工業	13.6	12.9	36,494
生化学工業	14.6	13.5	23,652
栄研化学	6.4	6.1	19,703
日水製薬	3.1	2.9	4,054
鳥居薬品	5.2	5	13,640
ＪＣＲファーマ	5.9	5.6	14,901
東和薬品	3.5	3.3	17,490
富士製薬工業	2.5	2.4	9,624
沢井製薬	13	12.4	76,384
ゼリア新薬工業	15.7	14.9	25,777
第一三共	257.4	214.5	519,626
キョーリン製薬ホールディングス	20.4	17.8	41,029
大幸薬品	3.8	3.7	6,952
ダイト	4.3	4.3	9,902
大塚ホールディングス	164.6	156.7	788,984
大正製薬ホールディングス	18.4	15.6	136,188
ペプチドリーム	12.7	13.6	82,960
石油・石炭製品(0.5%)			
日本コークス工業	61.8	58.9	5,772
昭和シェル石油	77	65.2	67,351
ニチレキ	9.3	8.9	10,475
東燃ゼネラル石油	115	－	－
ユシロ化学工業	4.1	3.9	5,709
ビーピー・カストロール	3.1	3	5,790
富士石油	17.7	16.9	5,779
ＭＯＲＥＳＣＯ	2.4	2.5	4,917
出光興産	39.9	34.6	111,066
ＪＸＴＧホールディングス	906.1	1,111.6	546,240
コスモエネルギーホールディングス	23.1	22	37,730
ゴム製品(1.0%)			
横浜ゴム	46.2	44	96,668
東洋ゴム工業	34.6	38.5	84,238
ブリヂストン	258.3	246	1,159,890
住友ゴム工業	71.6	68.2	130,125
藤倉ゴム工業	6.4	6.1	4,001
オカモト	24	22	27,478
フコク	2.8	3	2,841
ニッタ	8.2	6.5	21,092
住友理工	16.5	13.5	15,363
三ツ星ベルト	19	17	19,618
バンドー化学	28	13.3	13,699
ガラス・土石製品(1.0%)			
日東紡績	51	59	32,214
旭硝子	404	359	322,382
日本板硝子	369	33.2	28,884
石塚硝子	11	10	2,110
日本山村硝子	32	29	5,307
日本電気硝子	158	151	116,874
オハラ	3.2	3	3,306
住友大阪セメント	152	135	66,690
太平洋セメント	478	440	157,080
デイ・シイ	8.2	－	－
日本ヒューム	7.6	7	4,704
日本コンクリート工業	16.2	16.5	6,220
三谷セキサン	3.8	3.7	9,886
アジアパイルホールディングス	9.7	9.4	5,978
東海カーボン	67	68.2	37,305
日本カーボン	38	37	11,174

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
東洋炭素	4.3	4.1	7,736
ノリタケカンパニーリミテド	43	4.1	13,653
ＴＯＴＯ	56.2	53.6	223,244
日本碍子	97	92	205,068
日本特殊陶業	66	62.8	141,676
ＭＡＲＵＷＡ	2.8	2.7	11,475
品川リフラクトリーズ	20	19	5,320
黒崎播磨	18	16	6,912
ヨータイ	5	4	1,520
イソライト工業	5.8	4.1	1,590
東京窯業	11	9.2	1,812
ニッカトー	3.2	2.5	1,277
フジミインコーポレーテッド	6.7	6.3	13,230
ニチアス	39	38	48,602
ニチハ	10.2	9.7	38,897
鉄鋼(1.2%)			
新日鐵住金	345.1	328.6	784,368
神戸製鋼所	1,406	126	128,646
中山製鋼所	－	8.2	5,379
合同製鐵	44	4.1	7,363
ジェイ エフ イー ホールディングス	209.2	199.2	364,934
日新製鋼	35.2	23.7	29,459
東京製鐵	42.3	36.9	32,804
共英製鋼	8.3	7.8	13,275
大和工業	16.9	14.6	39,317
東京鐵鋼	16	15	5,925
大阪製鐵	4.9	4.6	9,517
淀川製鋼所	11.5	10.1	30,502
東洋鋼鈑	18.5	17.5	6,842
丸一鋼管	25.6	24.4	79,422
モリ工業	14	2.3	5,365
大同特殊鋼	129	122	71,614
日本高周波鋼業	38	25	2,025
日本冶金工業	60.7	60	13,500
山陽特殊製鋼	46	43	24,553
愛知製鋼	45	4.3	18,210
日立金属	87.6	74.2	108,406
日本金属	20	1.7	2,726
大平洋金属	54	47	13,583
新日本電工	44.2	41	15,375
栗本鐵工所	38	3.5	6,898
虹技	14	10	2,100
日本鋳鉄管	10	7	1,183
三菱製鋼	55	51	12,393
日亜鋼業	12.7	10.1	2,656
日本精線	6	5	3,480
シンニッタン	7.1	6	4,164
新家工業	18	16	3,104

銘柄	当期首(前期末) 株数(千株)	当期末 株数(千株)	当期末 評価額(千円)
非鉄金属(0.9%)			
大紀アルミニウム工業所	12	12	7,308
日本軽金属ホールディングス	173.3	187.6	47,087
三井金属鉱業	195	198	82,170
東邦亜鉛	40	41	17,261
三菱マテリアル	478	45.5	141,277
住友金属鉱山	211	189	257,512
ＤＯＷＡホールディングス	99	80	63,840
古河機械金属	119	114	22,458
大阪チタニウムテクノロジーズ	7.6	8	13,160
東邦チタニウム	12.9	12.4	9,262
ＵＡＣＪ	107	103	29,973
古河電気工業	241	24.4	116,998
住友電気工業	306.3	274.6	488,925
フジクラ	106	95.9	90,625
昭和電線ホールディングス	91	87	7,482
東京特殊電線	1.3	1.2	2,180
タツタ電線	16.6	14.1	7,740
沖電線	11	9	1,944
カナレ電気	1.3	1	2,327
平河ヒューテック	3.9	3.6	5,112
リョービ	47	44	20,108
アーレスティ	8.9	8.4	9,198
アサヒホールディングス	11.5	11	20,900
金属製品(0.7%)			
稲葉製作所	4.1	3.9	5,432
宮地エンジニアリンググループ	28	21	5,208
トーカロ	5.5	4.8	16,872
アルファＣｏ	3.2	2.4	5,776
ＳＵＭＣＯ	60.9	76.1	135,458
川田テクノロジーズ	1.7	1.4	9,058
ＲＳ Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	－	0.4	3,480
東洋製罐グループホールディングス	54.4	51.8	91,012
ホッカンホールディングス	22	19	8,474
コロナ	4	3.8	4,347
横河ブリッジホールディングス	15	12.8	19,443
駒井ハルテック	17	1.4	3,222
高田機工	8	6	1,650
三和ホールディングス	76.8	72.3	86,832
文化シヤッター	21.3	20.3	17,478
三協立山	10.5	9.6	15,628
アルインコ	5.8	5	5,340
東洋シヤッター	2.9	1.8	1,132
ＬＩＸＩＬグループ	106.6	101.5	269,482
日本フイルコン	7	5.3	3,164
ノーリツ	15	14.3	30,401
長府製作所	8.2	7.8	20,974
リンナイ	14.2	12.4	123,008

国内株式インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ダイニチ工業	3.9	3.7	2,778
日東精工	12	10.4	4,680
三洋工業	12	9	1,917
岡部	16.1	15.1	15,145
ジーテクト	8.3	7.6	15,336
東プレ	14.7	14	42,980
高周波熱錬	14.3	13.3	13,499
東京製綱	－	4.9	8,530
サンコール	4.5	3.9	2,441
モリテック　スチール	4.8	3.7	1,080
パイオラックス	3.9	11	30,382
エイチワン	－	5.5	6,886
日本発條	72	68.6	80,262
中央発條	11	8	2,744
アドバネクス	2.1	1.3	1,957
立川ブラインド工業	3.2	3	3,066
三益半導体工業	5.7	6.1	11,108
機械(5.0%)			
日本ドライケミカル	1	0.9	2,149
日本製鋼所	127	24.1	39,186
三浦工業	34.1	29.8	64,725
タクマ	28	23.3	23,789
ツガミ	22	20	15,860
オークマ	50	47	47,000
東芝機械	42	43	21,199
アマダホールディングス	111.6	98.1	128,216
アイダエンジニアリング	20.1	20.7	20,244
滝澤鉄工所	24	21	3,633
富士機械製造	25	22.2	36,252
牧野フライス製作所	38	36	32,832
オーエスジー	34.9	33.2	73,040
ダイジェット工業	13	13	2,366
旭ダイヤモンド工業	20.7	20.5	16,933
ＤＭＧ森精機	42.7	42.2	73,090
ソディック	19.4	18.5	21,312
ディスコ	9.7	8.5	159,375
日東工器	4.5	4.2	10,659
パンチ工業	3	2.6	2,914
豊和工業	4.6	5.2	4,186
ＯＫＫ	34	32	4,000
東洋機械金属	5.6	4.9	3,797
島精機製作所	10.8	9.5	48,830
ＮＣホールディングス	2.5	2.4	2,169
フリュー	1.5	4.3	5,564
ヤマシンフィルタ	1.5	1.9	4,406
日阪製作所	9.7	9.9	9,335
やまびこ	14	13.3	16,186
ペガサスミシン製造	7.9	7	5,068
ナブテスコ	39.8	37.9	123,364
三井海洋開発	9	7.3	17,571
レオン自動機	6.4	6.1	5,837
ＳＭＣ	22.9	21.8	764,526
新川	6.8	6.1	3,958
ホソカワミクロン	13	2.6	12,714
ユニオンツール	3.3	3.1	10,152
オイレス工業	9.9	8.9	17,168
日精エー・エス・ビー機械	2.8	2.3	7,475
サトーホールディングス	10.3	9.1	22,859
日本エアーテック	2.7	2.4	2,052
日精樹脂工業	6	6.1	6,374
オカダアイヨン	1.5	2	2,802
ワイエイシイホールディングス	3.1	2.7	4,220
小松製作所	375	336.1	890,665
住友重機械工業	223	213	152,508
日立建機	34.2	32.6	84,303
日工	12	2.2	4,681
巴工業	3.1	3	5,334
井関農機	79	75	17,250
ＴＯＷＡ	7.4	5.9	9,646
丸山製作所	18	1.8	3,247
北川鉄工所	36	3.3	7,613
ローツェ	－	3.4	9,200
タカキタ	2.5	2.4	1,276
クボタ	367.3	348.7	613,188
荏原実業	2.3	2	2,936
三菱化工機	27	24	5,952
月島機械	14.5	13.8	16,477
帝国電機製作所	5.6	5.3	5,904
新東工業	17.4	16.5	18,298
澁谷工業	6.4	6.1	20,740
アイチ　コーポレーション	10.9	10.3	7,828
小森コーポレーション	18.6	17.5	25,830
鶴見製作所	5.7	5.4	9,487
住友精密工業	12	11	3,751
酒井重工業	15	16	5,376
荏原製作所	169	33	102,630
石井鐵工所	14	1.1	1,818
酉島製作所	8.2	7.3	7,796
北越工業	8.2	7.8	7,199
ダイキン工業	106.4	95	1,036,925
オルガノ	13	14	7,658
トーヨーカネツ	41	35	10,815
栗田工業	46	41.2	120,015
椿本チエイン	43	41	39,073
大同工業	17	16	4,704
木村化工機	7.7	7.9	2,891

国内株式インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
アネスト岩田	12.3	12.6	12,927
ダイフク	39.3	34.7	115,030
サムコ	1.8	1.9	1,886
加藤製作所	18	3.9	12,616
油研工業	16	14	3,276
タダノ	35.3	36.4	47,793
フジテック	21.3	20.3	26,126
ＣＫＤ	20.3	20.9	35,404
キトー	9.2	8.8	10,076
平和	22.7	21.6	53,049
理想科学工業	8.1	6.9	15,490
ＳＡＮＫＹＯ	20.3	19.4	72,653
日本金銭機械	6.7	6.4	7,436
マースエンジニアリング	4.1	3.9	9,379
福島工業	4.5	4.3	18,404
オーイズミ	3.1	2.9	1,673
ダイコク電機	3	2.9	5,063
竹内製作所	14.5	12.7	23,393
アマノ	22.6	21.5	54,158
ＪＵＫＩ	10.8	11	16,236
サンデンホールディングス	45	42	12,936
蛇の目ミシン工業	7.1	6.8	6,215
マックス	11	11	17,754
グローリー	24.9	22.3	82,621
新晃工業	5.1	6.5	12,161
大和冷機工業	11.7	11.2	13,641
セガサミーホールディングス	78.5	69	97,497
日本ピストンリング	3	2.7	6,091
リケン	34	3.2	15,264
ＴＰＲ	9	7.8	29,055
ツバキ・ナカシマ	9	7.8	15,623
ホシザキ	16	20.3	197,519
大豊工業	5.9	5.7	8,008
日本精工	150.1	143	191,477
ＮＴＮ	181	161	81,627
ジェイテクト	77.9	74.2	123,914
不二越	68	70	39,410
日本トムソン	25	22.1	13,392
ＴＨＫ	48.6	49.2	148,092
ユーシン精機	2.8	3.1	8,168
前澤給装工業	3	2.6	4,108
イーグル工業	9	7.5	13,365
前澤工業	5.3	4.6	1,495
日本ピラー工業	7.4	7	11,172
キッツ	35.1	33.4	30,293
日立工機	19.6	－	－
マキタ	47.7	90.8	378,182
日立造船	58	55.2	29,587
三菱重工業	1,302	1,167	512,079
ＩＨＩ	564	536	217,080
スター精密	－	12.2	20,008
電気機器(13.1%)			
日清紡ホールディングス	40.6	38.6	41,263
イビデン	44.8	48.7	95,208
コニカミノルタ	182.6	163	144,581
ブラザー工業	94.5	90	221,400
ミネベアミツミ	117.8	126.7	222,611
日立製作所	1,865	1,671	1,116,060
東芝	1,539	1,545	405,253
三菱電機	780	742.5	1,150,503
富士電機	220	210	124,530
東洋電機製造	14	2.9	4,790
安川電機	90.8	80.7	177,540
シンフォニアテクノロジー	47	45	15,390
明電舎	67	64	24,512
オリジン電気	11	10	3,010
山洋電気	19	18	17,838
デンヨー	6.7	6.4	11,475
東芝テック	52	44	26,576
芝浦メカトロニクス	12	11	3,894
マブチモーター	20.9	19.7	126,474
日本電産	88	90.2	979,121
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	0.9	2.2	3,278
東光高岳	4.1	3.5	5,796
ダブル・スコープ	2.9	6.7	11,644
ダイヘン	43	38	31,616
田淵電機	8.4	10.6	3,423
ヤーマン	0.9	0.9	5,148
ＪＶＣケンウッド	53.8	51.2	15,001
ミマキエンジニアリング	6.6	6.3	3,861
第一精工	3.1	3.3	6,477
日新電機	17.1	14	17,514
大崎電気工業	13	14	11,718
オムロン	82.5	74	339,290
日東工業	11.7	10.2	18,176
ＩＤＥＣ	9.5	9.1	14,232
不二電機工業	0.7	0.8	1,082
ジーエス・ユアサ コーポレーション	141	134	67,536
サクサホールディングス	18	18	3,744
メルコホールディングス	4.1	3.9	12,343
テクノメディカ	1.7	1.6	3,088
日本電気	1,005	957	275,616
富士通	705	671	541,765
沖電気工業	317	30.2	50,222
岩崎通信機	34	31	2,573
電気興業	19	20	10,800

国内株式インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
サンケン電気	40	41	18,696
ナカヨ	7	7	2,779
アイホン	4.1	3.9	7,421
ルネサスエレクトロニクス	37.9	36.1	32,598
セイコーエプソン	108.8	103.6	243,770
ワコム	57.6	54.1	19,313
アルバック	13.4	11.7	71,136
アクセル	3.3	3	2,394
ＥＩＺＯ	7.2	6.9	29,566
ジャパンディスプレイ	136.7	130.2	26,430
日本信号	20.2	19.2	20,467
京三製作所	17	16	8,880
能美防災	8.3	7.9	12,023
ホーチキ	5.3	5.1	8,001
エレコム	6.3	6	14,274
日本無線	21	4.3	5,839
パナソニック	835.1	799.4	1,099,974
シャープ	615	－	－
アンリツ	43.9	50.7	47,455
富士通ゼネラル	22	23.6	60,510
日立国際電気	16.7	18.3	47,433
ソニー	515.7	491.7	1,985,484
ＴＤＫ	44.1	39.2	261,856
帝国通信工業	17	16	3,376
ミツミ電機	27.9	－	－
タムラ製作所	28	27	13,527
アルプス電気	63	64.3	197,722
池上通信機	23	22	3,300
パイオニア	118.3	104.6	20,920
日本電波工業	6.6	6.8	5,977
鈴木	2.9	2.7	1,871
日本トリム	2	1.7	7,012
ローランド ディー．ジー．	3.6	3.6	9,410
フォスター電機	9.2	8.1	13,446
クラリオン	39	37	14,393
ＳＭＫ	22	18	6,930
ヨコオ	5.3	5	6,955
ホシデン	22.2	21.1	25,552
ヒロセ電機	11.8	11.2	165,312
日本航空電子工業	21	20	30,080
ＴＯＡ	8.6	8.2	8,200
日立マクセル	12.1	10.4	22,380
古野電気	8.7	9	6,075
ユニデンホールディングス	23	20	5,100
アルパイン	17.4	16.6	25,945
スミダコーポレーション	6	6.3	10,508
アイコム	4	3.9	10,518
リオン	2.8	2.7	4,257
本多通信工業	2	3	4,173
船井電機	7.4	7.8	6,942
横河電機	73.2	75.5	144,809
新電元工業	26	27	15,120
アズビル	23.9	21.1	83,872
東亜ディーケーケー	4.1	3.5	2,198
日本光電工業	30.6	29.1	71,411
チノー	2.6	2.5	3,100
共和電業	8.9	7.9	3,468
日本電子材料	2.9	2.8	1,934
堀場製作所	13.5	13.8	92,460
アドバンテスト	49.8	47.4	91,339
小野測器	3.6	3.4	2,621
エスペック	7.6	6.2	10,285
パナソニック デバイスSUNX	6.5	－	－
キーエンス	16.6	31.5	1,540,980
日置電機	3.8	3.7	8,143
シスメックス	56.7	54.1	347,322
日本マイクロニクス	13.7	12.1	13,273
メガチップス	7.6	6.5	16,536
ＯＢＡＲＡ ＧＲＯＵＰ	4.7	4.1	24,026
澤藤電機	4	4	2,212
コーセル	10.2	9.7	13,162
イリソ電子工業	－	2.9	23,925
新日本無線	5.3	5.9	3,905
オプテックスグループ	5.4	5.3	19,769
千代田インテグレ	3.9	3.7	8,480
アイ・オー・データ機器	2.3	2.9	4,016
レーザーテック	8.6	15.3	23,975
スタンレー電気	52.3	49.7	165,749
岩崎電気	25	26	4,498
ウシオ電機	44.4	42.3	60,362
岡谷電機産業	4	3.8	1,482
ヘリオス テクノ ホールディング	6.3	6.5	5,258
日本セラミック	4.2	5.7	14,899
遠藤照明	3.7	3.5	3,920
日本デジタル研究所	6.2	－	－
古河電池	5	5	3,885
双信電機	3.7	3.5	1,053
山一電機	6.4	6.6	12,401
図研	5.3	4.5	7,195
日本電子	29	25	13,775
カシオ計算機	73.3	56	98,392
ファナック	74.8	70.6	1,537,315
日本シイエムケイ	15.8	15.1	13,242
エンプラス	3.7	3.2	10,592
大真空	13	2.6	3,920
ローム	36	33.7	298,582

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
浜松ホトニクス	57	50.7	179,731
三井ハイテック	10.6	9.2	11,067
新光電気工業	27.7	26.3	22,933
京セラ	120	114.3	730,719
太陽誘電	35.6	33.9	53,223
村田製作所	77.1	73	1,133,690
ユーシン	9.7	9.7	7,003
双葉電子工業	12.3	11.4	21,774
北陸電気工業	30	28	3,892
ニチコン	23.1	22	24,024
日本ケミコン	59	60	23,040
ＫＯＡ	10.1	9.6	18,969
市光工業	18	15	9,600
小糸製作所	43.8	41.7	247,281
ミツバ	12.4	12.8	24,076
スター精密	13.9	－	－
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	75	14.3	112,970
キヤノン電子	6.7	6.4	13,638
キヤノン	393.5	374.8	1,426,863
リコー	236.7	209.3	197,369
ＭＵＴＯＨホールディングス	9	10	2,450
東京エレクトロン	60	46.4	733,816
輸送用機器(8.6%)			
トヨタ紡織	25.7	24.4	52,777
芦森工業	－	17	3,417
鬼怒川ゴム工業	17	－	－
ユニプレス	15.2	13.4	34,652
豊田自動織機	66.6	63.4	358,210
モリタホールディングス	12.8	12.2	20,276
三櫻工業	9.8	8.9	6,959
デンソー	180.6	171.6	814,585
東海理化電機製作所	21.4	18.3	38,045
三井造船	283	259	40,145
川崎重工業	569	545	175,490
名村造船所	22.4	20.8	12,708
サノヤスホールディングス	11.2	11.9	3,034
日本車輌製造	30	－	－
ニチユ三菱フォークリフト	8.4	10.4	7,134
近畿車輌	11	1	2,538
日産自動車	1,020	821	881,754
いすゞ自動車	211.8	201.7	274,816
トヨタ自動車	909	846.3	5,052,411
日野自動車	104.3	99.4	133,693
三菱自動車工業	288.3	256.4	183,069
エフテック	4.2	4.3	5,736
レシップホールディングス	2.4	2.3	2,056
ＧＭＢ	1.6	1.5	1,966
ファルテック	1.6	1.2	1,514
武蔵精密工業	7.8	8.1	22,777
日産車体	35.7	30.6	34,822
新明和工業	32	29	25,636
極東開発工業	14.5	14.4	25,588
日信工業	16.3	15.6	27,424
トピー工業	62	5.7	15,880
ティラド	28	27	9,531
曙ブレーキ工業	37	32.4	11,469
タチエス	11.6	11.8	22,868
ＮＯＫ	35.5	33.7	81,048
フタバ産業	23.4	22.2	18,981
ＫＹＢ	83	78	40,950
大同メタル工業	10.3	8.7	8,439
プレス工業	38.9	37	18,648
ミクニ	10.7	9.5	4,398
カルソニックカンセイ	56	－	－
太平洋工業	16.3	15.7	23,204
ケーヒン	16.8	16	25,168
河西工業	9.3	9.5	13,062
アイシン精機	74.9	63.7	358,631
富士機工	8.5	6.9	5,085
マツダ	231.4	220.8	334,291
ダイハツ工業	87.2	－	－
今仙電機製作所	6.7	6.4	7,526
本田技研工業	657.7	626.4	1,919,289
スズキ	133.2	138	716,634
ＳＵＢＡＲＵ	231	216.1	814,048
安永	3.2	4.1	5,207
ヤマハ発動機	103.2	98.4	274,929
ショーワ	19	18.6	20,125
ＴＢＫ	9.4	9	4,581
エクセディ	9.9	9.5	29,022
豊田合成	26.6	22.5	60,435
愛三工業	13	12.2	10,894
盟和産業	1.3	1.1	1,322
ヨロズ	6.8	6.5	10,998
エフ・シー・シー	12	11.4	24,407
シマノ	29.5	28.1	490,345
テイ・エス　テック	17	16.2	51,597
ジャムコ	4.4	4.3	11,657
精密機器(1.6%)			
テルモ	112	106.7	475,348
クリエートメディック	2.4	2.3	2,281
日機装	26.5	24.1	25,811
島津製作所	94	89.6	192,460
ＪＭＳ	14	13	4,095
長野計器	4.6	5.5	3,850
ブイ・テクノロジー	1.7	1.4	31,010

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
東京計器	23	24	6,024
愛知時計電機	10	0.9	3,541
インターアクション	－	2.6	2,082
オーバル	7.3	6.9	1,780
東京精密	14.1	13.5	50,827
マニー	9.7	8.5	26,520
ニコン	136.5	121.3	207,544
トプコン	24.6	35.1	71,533
オリンパス	108.9	111.1	452,177
理研計器	5.9	6.2	11,662
タムロン	5.9	6.2	12,623
ＨＯＹＡ	165.3	143.2	780,440
シード	－	0.9	2,124
ノーリツ鋼機	6.6	7.1	6,390
エー・アンド・デイ	6.7	6.4	2,841
シチズン時計	90	76.2	56,464
リズム時計工業	32	28	6,188
大研医器	5.8	6.2	4,817
メニコン	4.9	4.8	16,392
松風	3.6	3.7	4,858
セイコーホールディングス	47	49	22,932
ニプロ	54.5	48.2	72,733
その他製品(2.1%)			
スノーピーク	0.8	1.1	3,795
パラマウントベッドホールディングス	7.7	6.7	31,758
トランザクション	1.5	3.1	3,605
ＳＨＯ－ＢＩ	2.4	2.3	1,009
ニホンフラッシュ	2.8	3.2	4,694
前田工繊	8	7	10,290
永大産業	10	9	4,734
アートネイチャー	7.8	7.4	5,461
ダンロップスポーツ	4.6	4.4	4,721
バンダイナムコホールディングス	75.6	76.8	303,360
アイフィスジャパン	1.6	1.6	1,067
共立印刷	12.1	11.6	3,955
ＳＨＯＥＩ	3.5	3.1	8,298
フランスベッドホールディングス	10.2	8.7	8,534
パイロットコーポレーション	12.7	12.1	52,272
萩原工業	2	1.9	4,993
トッパン・フォームズ	13	12.4	14,148
フジシールインターナショナル	8.9	15.6	43,243
タカラトミー	24	27.1	38,238
廣済堂	6.8	7	2,548
Ａｓ－ｍｅエステール	2	1.9	1,352
アーク	30.7	29.3	3,281
タカノ	3.2	3.1	3,484
プロネクサス	6.8	6.5	8,086
ホクシン	5.8	4.9	833
ウッドワン	13	12	3,552
大建工業	29	4.9	11,485
凸版印刷	206	197	241,522
大日本印刷	216	201	249,240
図書印刷	14	9	4,653
共同印刷	25	21	8,001
日本写真印刷	12.3	12.1	37,328
光村印刷	7	6	1,536
宝印刷	3.6	3.6	5,965
アシックス	68.1	69.2	129,196
ツツミ	3.6	2.6	5,335
小松ウオール工業	2.5	2.4	4,929
ヤマハ	53.7	46.9	169,074
河合楽器製作所	2.7	2.7	6,204
クリナップ	8.6	8.2	6,609
ピジョン	41.4	42.1	162,085
兼松サステック	8	7	1,463
キングジム	6.1	5.8	5,341
リンテック	17.4	16.5	43,180
ＴＡＳＡＫＩ	1.4	－	－
イトーキ	15.4	14.7	10,980
任天堂	45	42.9	1,456,455
三菱鉛筆	5.5	5.7	37,050
タカラスタンダード	30	14.4	26,611
コクヨ	38	36.2	53,720
ナカバヤシ	15	12	3,372
グローブライド	3.5	3.4	6,602
岡村製作所	25.5	24.3	24,154
美津濃	39	37	24,568
アデランス	12.7	－	－
電気・ガス業(1.9%)			
東京電力ホールディングス	620	590.5	272,811
中部電力	223.6	229.4	345,017
関西電力	298.3	284	443,182
中国電力	101	96.2	123,424
北陸電力	71.6	68.2	75,565
東北電力	182.6	173.9	285,543
四国電力	65.8	62.7	89,410
九州電力	161.4	153.7	212,567
北海道電力	68.4	65.1	55,920
沖縄電力	11.65	11.22	30,866
電源開発	62.3	55.4	165,369
エフオン	3	3.4	3,539
イーレックス	2.2	8.7	9,161
東京瓦斯	816	747	433,484
大阪瓦斯	757	675	289,102
東邦瓦斯	184	174	151,380
北海道瓦斯	18	17	4,607

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
広島ガス	12.7	14.4	5,054
西部瓦斯	82	78	20,748
静岡ガス	20.7	21.4	16,520
メタウォーター	4.7	3.9	11,610
陸運業(4.3%)			
ＳＢＳホールディングス	7.2	6.9	5,540
東武鉄道	391	372	220,968
相鉄ホールディングス	125	111	59,052
東京急行電鉄	425	378	307,692
京浜急行電鉄	200	191	258,996
小田急電鉄	234	111.5	248,199
京王電鉄	204	194	179,450
京成電鉄	110	52.2	150,283
富士急行	20	19	22,173
新京成電鉄	9	9	3,807
東日本旅客鉄道	133.6	134.7	1,441,290
西日本旅客鉄道	70.3	67	523,002
東海旅客鉄道	65.5	57.9	1,056,385
西武ホールディングス	77.6	96.1	201,233
鴻池運輸	10.3	9.8	15,425
西日本鉄道	95	84	40,236
ハマキョウレックス	5.6	4.5	11,326
サカイ引越センター	2.9	3.2	12,640
近鉄グループホールディングス	736	701	300,028
阪急阪神ホールディングス	491	87.9	356,874
南海電気鉄道	164	147	86,142
京阪ホールディングス	164	156	113,412
神戸電鉄	18	17	6,698
名古屋鉄道	266	253	130,548
山陽電気鉄道	27	25	14,125
日本通運	283	259	175,861
ヤマトホールディングス	130.7	124.5	298,737
山九	96	92	63,940
丸運	3.9	3.8	984
丸全昭和運輸	25	23	10,419
センコーグループホールディングス	32.9	32.9	21,944
トナミホールディングス	15	14	5,964
ニッコンホールディングス	23.8	23.6	57,418
日本石油輸送	8	0.8	2,108
福山通運	44	42	29,610
セイノーホールディングス	51.8	49.4	68,567
神奈川中央交通	9	8	5,840
日立物流	15.2	14.5	35,742
丸和運輸機関	2.2	1.7	5,312
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	7	7.2	10,562
九州旅客鉄道	－	69.2	253,618
海運業(0.2%)			
日本郵船	656	588	119,364
商船三井	357	366	116,754
川崎汽船	320	264	76,032
ＮＳユナイテッド海運	38	33	7,590
飯野海運	39	37.6	17,183
共栄タンカー	13	10	2,110
乾汽船	6	5.1	4,554
空運業(0.5%)			
日本航空	139.9	122.3	403,834
ＡＮＡホールディングス	1,357	1,292	456,722
パスコ	7	6	2,136
倉庫・運輸関連業(0.2%)			
トランコム	2.1	2	11,740
日新	30	28	12,544
三菱倉庫	52	46	65,412
三井倉庫ホールディングス	42	40	12,280
住友倉庫	53	51	36,720
澁澤倉庫	19	18	6,444
東陽倉庫	12	11.9	3,534
日本トランスシティ	17	16	7,152
ケイヒン	13	13	2,015
中央倉庫	4.2	4	4,316
安田倉庫	5.7	5.4	3,904
東洋埠頭	21	20	3,540
宇徳	5.9	5.6	2,324
上組	87	83	95,450
サンリツ	1.8	1.7	936
キムラユニティー	1.8	1.8	2,046
キユーソー流通システム	2	2.2	5,810
郵船ロジスティクス	6.7	6.4	6,457
近鉄エクスプレス	13.1	12.4	20,869
東海運	3.9	3.8	1,637
エーアイテイー	4.5	4.3	4,416
内外トランスライン	2.4	2.1	2,526
情報・通信業(8.1%)			
ＮＥＣネッツエスアイ	9	7.5	18,120
システナ	7	5.5	13,051
デジタルアーツ	3.5	3.1	11,733
新日鉄住金ソリューションズ	12	11.5	30,222
キューブシステム	3.2	4	3,932
コア	3	2.9	4,231
ソフトクリエイトホールディングス	3.5	3.3	4,699
ＴＩＳ	23.9	22.8	73,302
ネオス	2.2	2.1	1,016
電算システム	2.5	2.4	4,101
グリー	43.8	41.9	38,254
コーエーテクモホールディングス	17.1	16.3	36,854
三菱総合研究所	2.8	2.9	8,946
ボルテージ	1.4	1.3	1,809

国内株式インデックス マザーファンド　－第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
電算	0.8	0.8	1,806
ＡＧＳ	1.6	1.7	2,976
ファインデックス	4.7	5.1	4,794
ヒト・コミュニケーションズ	1.6	1.6	2,904
ブレインパッド	1.1	1.5	1,876
ＫＬａｂ	11.2	13.1	17,711
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディングス	4.8	5	7,565
イーブックイニシアティブジャパン	1.6	1.1	1,262
ネクソン	69.2	75.5	156,813
アイスタイル	11.6	14.5	15,138
エムアップ	1.9	2	4,422
エイチーム	4	4.6	14,283
テクノスジャパン	2.1	5.3	6,413
コロプラ	20.1	22.1	26,520
モバイルクリエイト	4.8	5.1	1,978
ブロードリーフ	7.4	17	12,053
ハーツユナイテッドグループ	2.2	3.6	5,475
メディアドゥ	1.5	2	4,934
ブイキューブ	4.7	3.8	2,139
サイバーリンクス	1.1	1.1	1,537
ディー・エル・イー	2	3.1	1,466
フィックスターズ	－	1.2	3,828
ＶＯＹＡＧＥ　ＧＲＯＵＰ	2.5	3.4	7,959
オプティム	0.6	1.5	4,942
セレス	－	1.7	2,840
ベリサーブ	0.8	0.8	2,928
ティーガイア	7.2	6.9	13,869
日本アジアグループ	8.2	7.8	3,408
豆蔵ホールディングス	5.7	5.1	5,232
テクマトリックス	3.1	4.3	7,348
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	168.1	144.2	39,943
GMOペイメントゲートウェイ	6.3	4.8	31,104
ザッパラス	4.1	3.6	1,814
システムリサーチ	－	0.7	1,662
インターネットイニシアティブ	11.7	10.1	21,230
さくらインターネット	4.7	5.6	5,359
GMOクラウド	1.6	1.5	5,775
ＳＲＡホールディングス	4.2	3.6	10,339
Ｍｉｎｏｒｉソリューションズ	1.4	1.5	1,996
朝日ネット	6.6	6.3	3,175
アドソル日進	－	1.8	2,212
フリービット	－	5.1	4,982
コムチュア	1.2	1.2	5,538
サイバーコム	0.8	1.3	1,281
メディカル・データ・ビジョン	－	3	7,146
ｇｕｍｉ	7.5	7.8	10,608
ショーケース・ティービー	－	1.1	1,226
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	－	1	2,074
ＰＣＩホールディングス	－	1.2	3,210
パイプドＨＤ	0.9	1.3	1,357
アイビーシー	－	0.7	738
オープンドア	－	0.9	2,830
ＬＩＮＥ	－	15.4	58,982
オークネット	－	2.2	3,130
ＡＯＩ　ＴＹＯ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	－	5.6	5,084
マクロミル	－	8.8	17,987
ソルクシーズ	－	2.7	2,224
フェイス	1.9	1.8	2,140
ハイマックス	1	0.9	1,446
野村総合研究所	50.6	51.4	217,936
サイバネットシステム	5.9	5.7	4,086
ＣＥホールディングス	1.1	1	1,097
インテージホールディングス	3.8	3.9	8,572
東邦システムサイエンス	2.2	2.3	1,495
ソースネクスト	3.6	4.2	2,688
ティー・ワイ・オー	14.3	－	－
フォーカスシステムズ	2.8	3.6	2,214
クレスコ	1.6	1.6	6,264
フジ・メディア・ホールディングス	75.1	71.6	108,044
オービック	24.9	23.7	154,524
ジャストシステム	13.1	11.1	18,503
TDCソフトウェアエンジニアリング	3.2	3	3,837
ヤフー	517	492.5	246,742
トレンドマイクロ	35	36.4	200,564
インフォメーション・ディベロプメント	1.4	2	2,836
日本オラクル	11.6	11	72,380
アルファシステムズ	2.4	2.3	4,609
フューチャー	8.7	9.3	8,091
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	5.4	5.2	5,543
ソフトバンク・テクノロジー	2	3.4	7,337
トーセ	2	1.9	1,681
オービックビジネスコンサルタント	3.7	3.5	19,775
伊藤忠テクノソリューションズ	16.3	15.6	59,202
アイティフォー	9.4	9	5,517
東計電算	1.3	1.2	2,895
エックスネット	0.7	1.3	1,158
大塚商会	19.4	18.5	127,650
サイボウズ	9.6	9.2	4,287
ソフトブレーン	10.6	9.4	4,888
電通国際情報サービス	4.4	4.2	11,176
デジタルガレージ	－	13.3	26,280
ＥＭシステムズ	2.5	2.4	5,275
ウェザーニューズ	2.4	2.3	8,843
ＣＩＪ	6.6	5.8	3,497
東洋ビジネスエンジニアリング	0.7	0.7	1,192

国内株式インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
日本エンタープライズ	7.5	7.1	1,824
WOWOW	3.4	3.3	10,923
スカラ	4.5	4.8	3,969
日本コロムビア	2.5	2	1,380
イマジカ・ロボット ホールディングス	6.1	5.8	4,611
ネットワンシステムズ	31.3	29.8	30,604
システムソフト	－	16.4	2,378
アルゴグラフィックス	3.3	3.2	8,198
マーベラス	12.2	11.6	14,152
エイベックス・グループ・ホールディングス	13.3	12.7	18,110
日本ユニシス	19.9	19	35,226
兼松エレクトロニクス	4.6	4.3	14,770
東京放送ホールディングス	43.2	45.3	83,216
日本テレビホールディングス	65.9	62.7	110,540
朝日放送	7.2	6.8	5,365
テレビ朝日ホールディングス	19.7	18.8	37,186
スカパーＪＳＡＴホールディングス	54.8	44.8	21,907
テレビ東京ホールディングス	6.5	5.6	12,566
日本ＢＳ放送	1.6	2.3	2,720
ビジョン	－	1.1	5,643
Ｕ－ＮＥＸＴ	2.3	1.8	1,902
ワイヤレスゲート	2.1	3.2	4,956
コネクシオ	6.4	6.1	11,730
日本通信	51.2	57.6	9,734
クロップス	1.4	1.5	856
日本電信電話	557.6	551.5	2,894,823
ＫＤＤＩ	732.8	679.7	2,079,882
光通信	8.7	8.3	89,806
ＮＴＴドコモ	539	505.7	1,375,504
エムティーアイ	11	9.3	5,831
ＧＭＯインターネット	26.6	25.1	37,148
アイドママーケティングコミュニケーション	－	0.9	653
カドカワ	22.5	19.9	27,860
学研ホールディングス	24	2.3	7,440
ゼンリン	9.5	9.1	24,469
昭文社	4	4	2,916
インプレスホールディングス	5.9	5.7	780
アイネット	4	3.9	5,042
松竹	47	45	61,290
東宝	51.5	44.9	149,966
東映	27	26	27,586
ＡＯＩ　Ｐｒｏ.	3.7	－	－
エヌ・ティ・ティ・データ	44.6	42.4	256,944
ピー・シー・エー	0.9	1	1,537
ビジネスブレイン太田昭和	1.1	1.2	1,258
ＤＴＳ	8	7.1	23,004
スクウェア・エニックス・ホールディングス	30.5	26.5	93,412
シーイーシー	4.7	4.1	9,401
カプコン	18.5	16.1	42,520
アイ・エス・ビー	1.2	1.3	2,316
ジャステック	4.6	4.4	5,196
ＳＣＳＫ	17.2	18.7	92,004
日本システムウエア	2.7	2.3	3,813
アイネス	10.2	8.7	10,074
ＴＫＣ	6.7	6.4	20,256
富士ソフト	10.7	10.2	33,354
ＮＳＤ	15.3	14.6	28,630
コナミホールディングス	32.6	31	169,570
福井コンピュータホールディングス	2.1	2	6,930
ＪＢＣＣホールディングス	6.1	5.8	4,877
ミロク情報サービス	5.3	6.8	15,476
ソフトバンクグループ	408.7	309.3	2,700,807
卸売業(4.3%)			
ホウスイ	6	6	702
高千穂交易	2.8	2.7	2,894
伊藤忠食品	1.8	1.7	7,930
エレマテック	3.4	2.8	5,003
ＪＡＬＵＸ	2.3	2.2	5,742
あらた	3.2	3.1	10,896
トーメンデバイス	1.1	1	2,239
東京エレクトロン　デバイス	2.6	2.5	4,147
フィールズ	6.3	5.3	6,312
双日	454.4	405.7	108,727
アルフレッサ　ホールディングス	90.7	81.3	174,469
横浜冷凍	17.9	16.2	17,334
神栄	10	9	1,494
山下医科器械	0.6	0.6	1,035
ラサ商事	3.4	3	2,562
ラクーン	3.1	4.4	2,301
アルコニックス	4.1	3.9	7,449
神戸物産	4.7	3.7	15,910
あい　ホールディングス	12.8	9.8	28,841
ディーブイエックス	2.6	2.5	3,195
ダイワボウホールディングス	66	58	23,548
マクニカ・富士エレホールディングス	13	12.7	20,916
バイタルケーエスケー・ホールディングス	12.5	12.9	12,474
八洲電機	5.6	5.3	3,678
メディアスホールディングス	－	1.1	3,197
ＵＫＣホールディングス	4.6	4.4	9,055
ＯＣＨＩホールディングス	2.1	2	2,658
ＴＯＫＡＩホールディングス	31.7	30.1	24,170
大阪工機	－	1.1	828
三洋貿易	4	3.8	8,200
ビューティガレージ	－	0.9	1,754
ウイン・パートナーズ	2.6	5	5,830
ミタチ産業	1.9	1.6	1,052

国内株式インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
シップヘルスケアホールディングス	14.6	13.2	40,854
明治電機工業	2.3	2.4	3,031
デリカフーズ	1.5	1.5	1,915
スターティア	1.4	1.6	844
コメダホールディングス	－	12.4	24,576
富士興産	2.8	2.5	1,235
協栄産業	10	8	1,368
小野建	6.3	6	9,672
佐鳥電機	5.7	5.1	4,064
エコートレーディング	1.7	1.6	1,129
伯東	5.5	4.7	6,528
コンドーテック	5.7	5.5	5,148
中山福	4.5	4	3,192
ナガイレーベン	10.4	9.1	23,032
三菱食品	7.9	7.5	25,050
松田産業	5.3	5	7,370
第一興商	12.8	11.2	59,584
メディパルホールディングス	72.1	68.7	138,567
アドヴァン	7.3	－	－
ＳＰＫ	1.7	1.5	4,012
萩原電気	2.5	2.3	5,253
アズワン	5.6	5.4	28,782
スズデン	2.3	2.5	2,827
尾家産業	2.3	2.2	2,618
シモジマ	5	4.2	4,834
ドウシシャ	8.5	8.1	16,758
小津産業	1.6	1.5	3,250
高速	4.3	4.1	4,218
たけびし	2.5	2.4	3,484
黒田電気	13.4	9.4	19,805
リックス	－	1.6	2,955
丸文	6.4	6.1	4,623
ハピネット	6.6	5.7	12,431
橋本総業ホールディングス	1.5	1.4	2,140
日本ライフライン	－	7.8	30,498
エクセル	3.5	2.9	4,274
マルカキカイ	2.3	2.2	4,169
ＩＤＯＭ	19.4	18.5	10,822
日本エム・ディ・エム	6	5.2	4,409
進和	4.3	4.1	8,068
エスケイジャパン	1.8	1.4	400
ダイトロン	3.3	3.1	3,803
シークス	4.6	4.9	22,540
田中商事	2.2	2.1	1,509
オーハシテクニカ	4.1	3.9	5,541
白銅	2.1	1.7	2,796
伊藤忠商事	566.1	503.2	793,043
丸紅	709.9	676.1	460,694
高島	14	12	2,508
長瀬産業	43.4	41.3	64,675
蝶理	4.6	4.4	8,734
豊田通商	80.4	76.5	260,100
三共生興	10.9	10.4	4,004
兼松	153	146	30,952
ツカモトコーポレーション	13	12	1,428
三井物産	652.3	621.3	929,464
日本紙パルプ商事	38	36	14,436
日立ハイテクノロジーズ	25	23.8	105,077
カメイ	9.4	9	11,808
東都水産	12	1.1	2,088
ＯＵＧホールディングス	10	11	2,882
スターゼン	2.6	2.9	13,485
山善	27.7	26.4	28,432
椿本興業	8	8	3,584
住友商事	454.1	432.5	611,338
内田洋行	18	3.2	8,086
三菱商事	541.3	515.5	1,149,049
第一実業	16	16	9,872
キヤノンマーケティングジャパン	20.6	19.6	45,628
西華産業	24	21	7,665
佐藤商事	6.5	6.1	5,343
菱洋エレクトロ	8.3	6.4	10,771
東京産業	7.2	6.9	3,084
ユアサ商事	6.8	6.5	22,035
神鋼商事	16	1.7	4,346
小林産業	4.8	5.1	1,438
阪和興業	72	69	53,751
カナデン	6.9	6.6	7,293
菱電商事	11	11	9,086
フルサト工業	4	3.8	6,498
岩谷産業	86	76	55,328
すてきナイスグループ	31	29	4,292
昭光通商	26	24	2,280
ニチモウ	11	10	1,720
極東貿易	10	11	2,871
イワキ	11	10	3,210
三愛石油	17.9	18.4	18,602
稲畑産業	17.3	16.5	22,473
ＧＳＩクレオス	19	17	2,550
明和産業	6.7	6.4	2,643
ワキタ	15.4	14.6	17,826
東邦ホールディングス	23.1	22	49,588
サンゲツ	25.2	23.5	46,154
ミツウロコグループホールディングス	11.6	11.1	7,892
シナネンホールディングス	16	3	6,612
伊藤忠エネクス	18.6	15.2	13,923

国内株式インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
サンリオ	22.2	21.2	44,117
サンワテクノス	4.6	4.1	5,719
リョーサン	11.4	10.2	40,647
新光商事	8.5	7.5	9,720
トーホー	3.3	3.1	9,141
三信電気	10	7.6	10,343
東陽テクニカ	10.3	7.9	8,334
モスフードサービス	9.4	9	30,645
加賀電子	6.5	6.2	12,821
ソーダニッカ	7.5	7.1	3,706
立花エレテック	5.3	4.7	6,786
フォーバル	3.8	3	2,139
ＰＡＬＴＡＣ	11.5	11	41,415
三谷産業	7.7	7.3	2,847
ヤマタネ	33	3.4	5,117
丸紅建材リース	6	7	1,547
日鉄住金物産	63	6	30,360
トラスコ中山	8.2	15.7	38,810
オートバックスセブン	27.6	25.4	44,754
モリト	－	5.5	4,922
加藤産業	11.3	10.7	30,002
イノテック	6.7	5.9	3,994
イエローハット	6.8	6.5	17,530
ＪＫホールディングス	7.3	6.9	4,478
日伝	3	2.8	10,094
北沢産業	6	5.8	1,183
杉本商事	4.2	4	6,132
因幡電機産業	10.1	9.6	39,360
バイテックホールディングス	3	2.8	3,679
ミスミグループ本社	81	77.5	190,572
アルテック	6.1	5.9	1,280
タキヒヨー	12	10	4,590
蔵王産業	1.2	1.1	1,624
スズケン	32.8	31.3	112,367
ジェコス	5	4.7	5,376
ルネサスイーストン	6	6.3	3,710
小売業(4.8%)			
ローソン	27.3	21.7	164,052
サンエー	4.9	5.2	26,156
ダイユーエイト	2.4	－	－
カワチ薬品	5.6	5.3	14,696
エービーシー・マート	9.4	12.5	80,500
ハードオフコーポレーション	3.5	3.1	3,410
アスクル	8.8	7.2	24,300
ゲオホールディングス	12.1	11.6	13,595
アダストリア	13.3	10.6	31,333
ジーフット	4.4	4.3	3,345
シー・ヴイ・エス・ベイエリア	10	0.9	652

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
くらコーポレーション	4.2	4.5	22,590
キャンドゥ	3.8	3.6	6,080
パルグループホールディングス	4.2	3.5	9,635
エディオン	30.7	26.7	28,622
サーラコーポレーション	6.2	8.6	5,607
ワッツ	3.1	2.8	3,488
ハローズ	2.4	2.3	5,375
あみやき亭	1.4	1.3	5,317
ひらまつ	10	9.5	6,403
ゲンキー	1.5	2.8	8,400
サッポロドラッグストアー	1	－	－
大黒天物産	1.7	1.6	8,560
ハニーズホールディングス	6.4	6.7	7,323
ファーマライズホールディングス	2.3	1.7	897
アルペン	6.5	5.3	10,191
クオール	7.3	7.9	13,232
ジンズ	4.9	4.7	30,127
ビックカメラ	41.4	39.5	46,847
ＤＣＭホールディングス	35.6	41.7	41,157
ＭｏｎｏｔａＲＯ	25.5	24.4	90,402
東京一番フーズ	1.9	1.9	1,088
ダイヤモンドダイニング	1.8	1.5	3,276
きちり	2	2	1,316
アークランドサービスホールディングス	2.3	2.9	10,498
Ｊ．フロント　リテイリング	91.3	86.9	137,736
ドトール・日レスホールディングス	12.7	12	28,344
マツモトキヨシホールディングス	14.9	13	83,590
ブロンコビリー	3.8	3.6	9,478
スタートトゥデイ	22	62.7	174,995
トレジャー・ファクトリー	2.1	2.1	1,667
物語コーポレーション	1.9	2	11,060
ココカラファイン	7.5	7.2	38,448
三越伊勢丹ホールディングス	143.5	136.7	156,248
Ｈａｍｅｅ	－	2.3	2,582
ウエルシアホールディングス	6.2	18.1	72,581
クリエイトSDホールディングス	10.6	10.1	26,340
丸善ＣＨＩホールディングス	8.4	8	2,768
ミサワ	1.2	1.5	663
ティーライフ	－	1	1,774
エー・ピーカンパニー	1.3	1.3	1,250
チムニー	1.8	2.1	5,768
シュッピン	2.7	2.7	4,660
ネクステージ	1.4	2.8	4,149
ジョイフル本田	11.7	11.2	41,384
鳥貴族	1.8	2.5	6,962
キリン堂ホールディングス	2.5	2.4	2,032
ホットランド	2.5	3.3	5,240
すかいらーく	22.2	29.5	51,507

国内株式インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
綿半ホールディングス	2.8	2.8	5,367
ヨシックス	－	1	1,480
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	23.9	22.8	24,646
ブックオフコーポレーション	4.5	3.9	3,026
ゴルフダイジェスト・オンライン	2.1	3	2,685
ＢＥＥＮＯＳ	－	1.2	1,803
あさひ	5.4	5.2	7,087
日本調剤	1.9	2.5	9,900
コスモス薬品	3.6	3.5	81,585
トーエル	3.6	3.4	3,056
一六堂	2.1	1.8	696
オンリー	－	1.1	1,007
セブン&アイ・ホールディングス	301.8	287.5	1,362,462
薬王堂	1.4	3.5	12,582
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	19.4	18.5	18,167
ツルハホールディングス	16.6	13.7	166,729
サンマルクホールディングス	5.7	4.4	14,894
フェリシモ	2.1	2	2,130
トリドールホールディングス	8.9	8.5	24,055
クスリのアオキ	6.4	－	－
ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	－	0.9	2,893
サツドラホールディングス	－	1	2,068
ダイユー・リックホールディングス	－	2.3	1,794
バロックジャパンリミテッド	－	5.6	6,921
クスリのアオキホールディングス	－	5.5	29,535
スシローグローバルホールディングス	－	6.2	21,142
メディカルシステムネットワーク	8.6	8	3,864
総合メディカル	3.5	3.3	15,576
はるやまホールディングス	3.3	3.3	3,224
ノジマ	－	10.8	18,619
カッパ・クリエイト	10.1	9.6	12,048
ライトオン	5.4	5.8	5,968
良品計画	8.3	9.1	259,896
三城ホールディングス	9	8.6	4,042
アドヴァン	－	7.1	7,952
アルビス	2	1.8	8,325
コナカ	9.3	8.9	5,331
ハウス　オブ　ローゼ	1	0.9	1,403
Ｇ－７ホールディングス	2.2	2.1	4,821
イオン北海道	5	7	4,214
コジマ	11.1	12.1	3,666
ヒマラヤ	2.4	1.9	1,573
コーナン商事	10.5	9.8	20,981
エコス	3	2.8	3,343
マルシェ	2	1.6	1,320
ドンキホーテホールディングス	46.7	44.5	191,350
西松屋チェーン	14.2	12.1	14,217

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ゼンショーホールディングス	37.1	35.6	71,947
幸楽苑ホールディングス	4.8	4.4	8,184
ハークスレイ	2.2	1.7	1,910
サイゼリヤ	11.9	10.2	32,130
ＶＴホールディングス	24.4	23.4	14,180
魚力	2.3	2.2	2,752
ポプラ	1.8	1.7	943
フジ・コーポレーション	－	1.1	2,191
ユナイテッドアローズ	10.3	9.2	31,234
ハイデイ日高	6.6	7.5	18,435
京都きもの友禅	5	4.4	4,065
コロワイド	24.1	22.8	42,750
ピーシーデポコーポレーション	8	9.4	5,752
壱番屋	6.6	4.8	18,168
トップカルチャー	3.3	2.6	1,240
ＰＬＡＮＴ	1.8	1.6	1,939
スギホールディングス	12.9	15.1	88,335
ヴィア・ホールディングス	－	5.3	5,056
スクロール	11	10.6	3,911
ヨンドシーホールディングス	5.5	7	18,445
ユニー・ファミリーマートホールディングス	22.2	30.2	197,508
木曽路	8.8	8.4	21,344
サトレストランシステムズ	8.7	8.1	7,249
千趣会	14.3	12.5	10,137
タカキュー	6.4	6	1,182
ケーヨー	12.2	11.8	8,720
上新電機	17	16	22,448
日本瓦斯	11	12.6	46,053
ベスト電器	23.2	22.7	3,745
ロイヤルホールディングス	12	11.3	26,611
いなげや	8	7.7	14,221
島忠	18.7	17.8	46,262
チヨダ	8.5	8.1	22,761
ライフコーポレーション	4.8	5.4	16,189
リンガーハット	6.5	7.7	18,680
ＭｒＭａｘ	7.6	8.8	4,136
テンアライド	6.6	6.3	2,507
ＡＯＫＩホールディングス	16.5	13.7	19,865
オークワ	12	10	11,820
コメリ	11.1	10.6	30,178
青山商事	13.8	14.4	58,464
しまむら	8.4	8	113,920
はせがわ	3.9	3.8	1,808
高島屋	105	115	120,175
松屋	15.3	15.7	15,213
エイチ・ツー・オー　リテイリング	37	35.2	65,894
近鉄百貨店	28	26	9,230
パルコ	7	6.6	8,184

国内株式インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
丸井グループ	88.6	72.6	118,773
アクシアル　リテイリング	5.6	5.3	23,108
イオン	296.8	282.7	471,260
ユニーグループ・ホールディングス	69.5	－	－
イズミ	14.4	13.7	81,789
東武ストア	9	0.8	2,385
平和堂	14.6	13.9	33,638
フジ	8.3	7.6	21,470
ヤオコー	8.2	7.8	36,426
ゼビオホールディングス	9.8	9.3	16,535
ケーズホールディングス	30.4	29.1	67,221
Ｏｌｙｍｐｉｃグループ	4.6	4.3	2,455
日産東京販売ホールディングス	12.8	10.4	4,544
アインホールディングス	8.7	9	79,920
元気寿司	2.1	1.7	3,833
ヤマダ電機	219.5	229.8	135,122
アークランドサカモト	12.2	11.7	17,538
ニトリホールディングス	31.2	29.7	475,200
グルメ杵屋	5	5	5,445
愛眼	5.7	5	990
ケーユーホールディングス	3.8	3.6	3,614
吉野家ホールディングス	26.7	24	43,608
松屋フーズ	3.5	3.3	13,678
サガミチェーン	9.7	8.6	11,911
関西スーパーマーケット	6.1	5.7	8,954
王将フードサービス	5.3	5	20,475
プレナス	8.1	7.7	18,241
ミニストップ	5.3	5.1	11,735
アークス	13.5	12.9	31,218
バローホールディングス	15.6	14.8	37,917
藤久	0.7	0.6	1,047
ベルク	3.6	3.1	16,306
大庄	4	3.7	6,434
ファーストリテイリング	12	11.5	427,800
サンドラッグ	15.2	26.1	112,882
サックスバー　ホールディングス	6.8	6.6	8,032
ヤマザワ	1.6	1.4	2,528
やまや	1.5	1.5	2,443
ベルーナ	18	14.8	18,204
銀行業(7.8%)			
島根銀行	1.5	1.4	1,814
じもとホールディングス	51.8	49.4	9,731
めぶきフィナンシャルグループ	52.9	331.3	146,765
東京ＴＹフィナンシャルグループ	9.9	9.9	29,700
九州フィナンシャルグループ	110.4	112.7	79,002
ゆうちょ銀行	184.8	194.5	268,604
富山第一銀行	18.3	17.5	9,030
コンコルディア・フィナンシャルグループ	502.5	445.3	237,968

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
西日本フィナンシャルホールディングス	－	46.6	50,980
新生銀行	624	654	120,990
あおぞら銀行	456	435	180,090
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	5,787.9	5,206	3,633,267
りそなホールディングス	843.9	803.7	456,180
三井住友トラスト・ホールディングス	1,506	143.4	538,036
三井住友フィナンシャルグループ	577.6	550.1	2,222,954
第四銀行	91	84	40,572
北越銀行	78	7.4	19,972
西日本シティ銀行	235	－	－
千葉銀行	278	265	197,955
常陽銀行	261	－	－
群馬銀行	160	152.7	91,314
武蔵野銀行	11.5	11	37,345
千葉興業銀行	19.8	18.7	10,958
筑波銀行	30	28.6	9,094
七十七銀行	113	108	53,892
青森銀行	53	53	20,458
秋田銀行	47	44	14,300
山形銀行	41	39	18,837
岩手銀行	5	4.5	19,192
東邦銀行	64	61	23,851
東北銀行	37	35	5,250
みちのく銀行	36	41	7,708
ふくおかフィナンシャルグループ	312	279	143,964
静岡銀行	211	181	171,407
十六銀行	90	92	30,084
スルガ銀行	68.5	70.2	171,498
八十二銀行	130.5	132.6	85,527
山梨中央銀行	45	43	19,651
大垣共立銀行	96	106	33,284
福井銀行	62	59	16,520
北國銀行	80	73	28,105
清水銀行	2.5	2.3	8,291
富山銀行	1.4	1.3	5,837
滋賀銀行	68	65	35,555
南都銀行	70	6.6	21,945
百五銀行	65	62	27,590
京都銀行	138	123	117,465
紀陽銀行	28.3	25.8	46,749
三重銀行	32	3.1	7,176
ほくほくフィナンシャルグループ	491	45.7	75,405
広島銀行	213	203	92,771
山陰合同銀行	43.4	40.7	34,310
中国銀行	51.1	48.7	75,533
鳥取銀行	23	2.2	3,762
伊予銀行	77.2	98	80,262
百十四銀行	79	75	26,850

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
四国銀行	56	53	16,536
阿波銀行	59	59	45,135
大分銀行	41	39	16,185
宮崎銀行	48	46	16,376
佐賀銀行	44	42	11,508
十八銀行	44	42	12,810
沖縄銀行	5.7	6.7	28,609
琉球銀行	14.9	14.1	21,248
セブン銀行	270.3	257.5	107,635
みずほフィナンシャルグループ	10,224.9	9,327.7	1,818,901
高知銀行	28	25	3,150
山口フィナンシャルグループ	67	64	81,344
長野銀行	24	2.3	4,586
名古屋銀行	60	5.6	22,204
北洋銀行	108.7	112.1	43,382
愛知銀行	2.4	2.3	14,352
第三銀行	41	3.9	6,532
中京銀行	30	2.8	6,490
大光銀行	26	24	5,784
愛媛銀行	42	8.7	11,919
トマト銀行	28	2.7	4,114
みなと銀行	65	6.2	12,449
京葉銀行	59	56	25,424
関西アーバン銀行	10	9.6	12,537
栃木銀行	39	37.9	18,987
北日本銀行	2.2	2.1	6,583
東和銀行	135	129	15,996
福島銀行	89	75	6,525
大東銀行	43	36	5,940
トモニホールディングス	55.3	56.6	30,903
フィデアホールディングス	58.8	66.3	12,795
池田泉州ホールディングス	76.5	72.9	33,606
証券、商品先物取引業(1.1%)			
ＦＰＧ	26.2	25.2	25,099
ＳＢＩホールディングス	86.8	77.7	111,577
ジャフコ	12.2	11.5	48,875
大和証券グループ本社	675	624	421,137
野村ホールディングス	1,388	1,404.6	939,677
岡三証券グループ	61	59	39,648
丸三証券	21.4	21.9	19,293
東洋証券	28	25	6,150
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	82.8	78.9	46,156
光世証券	19	20	3,100
水戸証券	22.4	21.4	6,548
いちよし証券	16.2	15.4	13,413
松井証券	36.2	39.3	36,352
だいこう証券ビジネス	3.6	4.4	2,640
マネックスグループ	84.4	74.8	20,420
カブドットコム証券	63.6	51.1	18,600
極東証券	9.7	9.2	15,180
岩井コスモホールディングス	6.8	6.5	7,397
藍澤證券	13.5	12.9	8,617
マネースクウェアＨＤ	2.7	－	－
マネーパートナーズグループ	7.2	9.6	5,001
保険業(2.5%)			
かんぽ生命保険	29.4	25.9	62,056
ＳＯＭＰＯホールディングス	160.2	143.6	620,639
アニコム　ホールディングス	4.9	4.7	10,443
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	215.6	205.3	789,378
ソニーフィナンシャルホールディングス	69.1	65.8	112,912
第一生命ホールディングス	462.2	414.3	761,069
東京海上ホールディングス	292.3	276.7	1,298,829
Ｔ＆Ｄホールディングス	262.9	250.4	390,749
アドバンスクリエイト	－	1.6	3,051
その他金融業(1.3%)			
全国保証	18.8	19.3	87,718
クレディセゾン	54.7	52.1	109,462
アクリーティブ	5.9	5.6	2,088
芙蓉総合リース	8.2	7.9	46,373
興銀リース	13.6	12.9	31,205
東京センチュリー	16.9	13.8	56,925
日本証券金融	31.8	30.3	16,816
アイフル	120.8	115.2	36,979
ポケットカード	7.2	5.2	3,504
リコーリース	5.7	5.4	18,846
イオンフィナンシャルサービス	47.3	43.9	101,496
アコム	144.9	138	64,998
ジャックス	40	38	17,784
オリエントコーポレーション	311.9	148.5	27,918
日立キャピタル	17	16.2	42,719
アプラスフィナンシャル	34.6	33	3,399
オリックス	510.8	486.5	853,321
三菱ＵＦＪリース	183	174.3	98,653
日本取引所グループ	211.8	213.6	382,344
イー・ギャランティ	2.3	2	5,116
アサックス	1.2	1.2	2,018
ＮＥＣキャピタルソリューション	2.9	2.8	4,751
不動産業(2.5%)			
いちご	79.9	65.3	21,222
日本駐車場開発	87	82.4	13,019
ヒューリック	150.4	143.3	149,318
三栄建築設計	2.9	2.8	4,466
野村不動産ホールディングス	47.9	45.7	110,639
三重交通グループホールディングス	12.9	12.2	4,806
サムティ	5.2	5.5	6,391

国内株式インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
ディア・ライフ	5	6.1	2,366
エー・ディー・ワークス	66.8	69.4	2,984
日本商業開発	3.2	3.9	6,298
プレサンスコーポレーション	2.5	10.7	16,039
ユニゾホールディングス	4.5	5.7	16,165
ＴＨＥグローバル社	－	3.2	1,971
日本管理センター	4.7	5.2	6,567
サンセイランディック	1.7	1.7	1,319
エストラスト	1.3	1.6	1,084
フージャースホールディングス	10.1	8.9	7,805
オープンハウス	10.4	11.2	39,368
東急不動産ホールディングス	174.6	166.2	111,187
飯田グループホールディングス	66.8	57.3	104,859
ムゲンエステート	1.1	3.2	3,004
ファーストブラザーズ	－	1	1,523
ハウスドゥ	－	1.1	1,890
シーアールイー	－	1.1	1,812
ケイアイスター不動産	－	2.1	3,651
パーク２４	36.4	34.9	107,666
パラカ	2.5	2.2	4,334
三井不動産	383	364.3	940,986
三菱地所	536	511	1,054,704
平和不動産	13.7	13	23,959
東京建物	78.8	79.7	122,897
ダイビル	18.6	17.7	19,770
京阪神ビルディング	12	11.4	7,546
住友不動産	173	165	544,830
大京	134	128	28,544
テーオーシー	28	26.8	27,175
東京楽天地	12	11	6,160
レオパレス２１	85	86.7	57,395
スターツコーポレーション	8.3	9.3	24,951
フジ住宅	9.2	8.8	6,415
空港施設	8.8	8.3	4,905
明和地所	4	3.8	3,351
住友不動産販売	5.2	－	－
ゴールドクレスト	5.7	6.2	14,334
日本エスリード	2.8	2.7	4,792
日神不動産	9.7	8.1	4,932
日本エスコン	－	11.9	5,355
タカラレーベン	31.5	29.5	15,517
サンヨーハウジング名古屋	4.1	3.7	3,722
イオンモール	46.6	44.2	90,919
ファースト住建	2.7	2.6	4,004
トーセイ	11	9.4	7,736
穴吹興産	8	0.7	2,026
エヌ・ティ・ティ都市開発	44.8	42.7	45,347
サンフロンティア不動産	8.8	7.4	8,687
エフ・ジェー・ネクスト	6.4	6.6	5,616
インテリックス	－	2.1	1,814
ランドビジネス	4.9	4.1	1,225
グランディハウス	6.4	6	2,550
日本空港ビルデング	23	21.9	96,250
サービス業(3.9%)			
日本工営	26	4.9	14,651
Ｌｉｆｕｌｌ	21.6	17.9	12,601
ジェイエイシーリクルートメント	4.7	4.5	7,236
日本M&Aセンター	11.8	21	91,770
ノバレーゼ	2.4	－	－
アコーディア・ゴルフ	21.4	－	－
中広	1.3	0.9	671
タケエイ	7.2	6.5	7,592
トラスト・テック	3.1	3	6,483
コシダカホールディングス	－	3.5	8,760
パソナグループ	7.1	5.5	5,296
ＣＤＳ	2	1.8	2,394
リンクアンドモチベーション	17.2	17.3	12,629
ＧＣＡ	7	6.6	5,966
エス・エム・エス	9.5	10.3	31,363
テンプホールディングス	53.5	56.3	121,157
リニカル	4.6	4.3	7,030
クックパッド	17	16.2	14,677
エスクリ	4.4	3	2,181
アイ・ケイ・ケイ	4.5	3.4	2,601
学情	2.9	3.1	4,250
スタジオアリス	3.5	3	7,161
シミックホールディングス	4.1	3.8	5,392
ＮＪＳ	1.6	1.7	2,380
綜合警備保障	25.5	26.5	137,005
カカクコム	54.8	51.9	81,586
アイロムグループ	2.2	2.2	3,410
セントケア・ホールディング	－	1.1	1,757
サイネックス	－	0.8	782
ルネサンス	4.3	3.8	7,383
ディップ	8.5	9.4	22,907
オプトホールディング	4.9	5.4	8,051
ツクイ	9.4	17.5	12,057
キャリアデザインセンター	2.3	1.6	2,000
エムスリー	66.1	63	200,970
ツカダ・グローバルホールディング	6.2	5.6	3,119
アウトソーシング	3.6	4.7	24,017
ウェルネット	2.9	5.5	7,892
ワールドホールディングス	－	2.3	5,855
ディー・エヌ・エー	34.2	32.6	80,750
博報堂DYホールディングス	105.8	100.8	149,587
ぐるなび	8.8	10.5	20,958

国内株式インデックス マザーファンド　－第17期－

銘柄	当期首(前期末)	当期末	
	株数(千株)	株数(千株)	評価額(千円)
エスアールジータカミヤ	8.9	8.1	4,341
ジャパンベストレスキューシステム	－	8.3	2,241
ファンコミュニケーションズ	17.7	18.5	18,074
ライク	2.1	1.4	3,953
ビジネス・ブレークスルー	－	3.6	1,404
ＷＤＢホールディングス	2.8	2.6	4,849
ティア	4	3.7	2,786
ＣＤＧ	－	0.6	1,137
バリューコマース	7.6	6.8	4,318
インフォマート	14.8	30.7	24,560
ＪＰホールディングス	19.9	21.4	6,398
ＥＰＳホールディングス	9.5	10	16,340
レッグス	1.5	1.8	1,411
プレステージ・インターナショナル	6.4	13.8	15,801
アミューズ	4.2	4.1	12,956
ドリームインキュベータ	2.6	2.3	4,639
クイック	4	3.8	5,065
ＴＡＣ	8.3	5.3	1,224
ケネディクス	102.7	92.4	52,945
電通	85.1	81	463,320
テイクアンドギヴ・ニーズ	5	3.6	3,074
ぴあ	2.3	2.2	7,744
イオンファンタジー	2.7	2.2	6,963
シーティーエス	2.7	4.1	4,259
ネクシィーズグループ	3.1	2.7	4,484
みらかホールディングス	19.5	18.6	84,723
アルプス技研	2.8	2.9	10,947
ダイオーズ	1.4	1.4	1,622
日本空調サービス	7.4	7.2	4,716
オリエンタルランド	82.5	78.6	562,147
ダスキン	19.6	17.9	49,063
明光ネットワークジャパン	9.5	8.4	11,709
ファルコホールディングス	3.5	3.5	5,362
ラウンドワン	24	22.8	25,786
リゾートトラスト	32.1	28.2	58,317
ビー・エム・エル	4.5	9.5	21,346
ワタベウェディング	3.3	1.3	700
りらいあコミュニケーションズ	12.6	12	14,556
リソー教育	14.7	12.5	10,712
早稲田アカデミー	1.4	1	1,315
ユー・エス・エス	92.4	88	195,272
東京個別指導学院	3.8	2.4	3,595
サイバーエージェント	20.1	43.7	170,648
楽天	357.2	371.6	511,135
クリーク・アンド・リバー社	－	3.5	3,318
テー・オー・ダブリュー	6.2	5.9	4,808
セントラルスポーツ	2.8	2.5	9,812
フルキャストホールディングス	7.2	7.6	9,568
リソルホールディングス	10	8	2,888
テクノプロ・ホールディングス	12.4	11.9	53,252
アトラ	－	1.4	1,029
インターワークス	1.4	1.6	1,897
ＫｅｅＰｅｒ技研	0.9	1.1	2,645
ファーストロジック	0.5	0.5	1,450
デザインワン・ジャパン	－	1.3	1,911
イー・ガーディアン	－	3.4	6,956
リブセンス	6	5	2,825
ジャパンマテリアル	3.2	5.3	10,107
ベクトル	2.4	5.9	9,575
ウチヤマホールディングス	4.9	3.6	1,630
サクセスホールディングス	1.3	0.9	1,320
キャリアリンク	2.4	2	1,174
ＩＢＪ	6.1	5.8	3,973
アサンテ	2.8	2.7	4,922
Ｎ・フィールド	3.7	3.5	4,931
バリューＨＲ	－	0.8	2,318
M&Aキャピタルパートナーズ	1	1.2	6,336
ライドオン・エクスプレス	1.8	1.9	1,736
ＥＲＩホールディングス	2.3	2.1	1,766
アビスト	1.2	1	3,660
ウィルグループ	2.1	3.1	2,790
エスクロー・エージェント・ジャパン	－	1.7	3,918
日本ビューホテル	1.3	1.6	2,201
リクルートホールディングス	154	158.8	913,100
エラン	1.1	1	2,504
土木管理総合試験所	－	1.2	840
日本郵政	224.5	189.7	256,474
ベルシステム２４ホールディングス	15.3	11.4	11,992
一蔵	－	0.9	1,003
ＬＩＴＡＬＩＣＯ	－	0.9	1,500
エボラブルアジア	－	1.4	4,047
ソラスト	－	4.7	7,012
リログループ	2.9	36.4	80,334
東祥	2.3	2.1	11,592
エイチ・アイ・エス	12.5	11.9	38,080
ラックランド	1.2	1.4	3,033
共立メンテナンス	5.7	11.8	38,350
イチネンホールディングス	8.7	7.6	8,968
建設技術研究所	4.5	4.7	5,306
スペース	4.1	3.9	5,666
燦ホールディングス	1.7	1.5	2,752
スバル興業	6	5	2,425
東京テアトル	29	28	3,920
タナベ経営	－	1.5	2,089
ナガワ	1.4	1.3	5,284
よみうりランド	16	15	6,720

銘柄		当期首(前期末)	当期末	
		株数（千株）	株数（千株）	評価額（千円）
東京都競馬		52	50	12,250
カナモト		10.7	10.2	30,600
東京ドーム		62	29.2	29,141
西尾レントオール		6.2	5.9	18,319
トランス・コスモス		8.9	8.4	20,353
乃村工藝社		16.3	15.6	36,488
藤田観光		29	24	8,568
KNT－CTホールディングス		37	41	5,822
日本管財		6.6	6.2	11,643
トーカイ		3.4	3.2	13,760
白洋舎		10	0.8	2,412
セコム		79.4	75.6	615,762
セントラル警備保障		3.4	3.3	6,138
丹青社		14.3	12.6	14,011
メイテック		9.5	8.4	39,396
アサツー　ディ・ケイ		13.4	11.8	32,072
応用地質		7.9	6.9	10,239
船井総研ホールディングス		10.6	9.2	23,506
進学会		3.7	3.1	1,785
オオバ		5.7	6	3,024
いであ		－	1.4	1,629
学究社		1.4	2	3,008
ベネッセホールディングス		25.6	24.4	99,918
イオンディライト		7.4	8.2	29,151
ナック		5.1	4.6	4,503
ニチイ学館		13.9	12.8	13,568
ダイセキ		14.4	12.7	30,073
ステップ		2.7	2.5	3,615
合計	株数・金額	120,967	104,942	159,491,000
	銘柄数<比率>	1,905	1,967	<98.2%>

(注1)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です。
(注2)合計欄の<　>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

銘柄別		当期末	
		買建額（百万円）	売建額（百万円）
国内	TOPIX	2,936	－

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
株式	159,491,000	97.6
コール・ローン等、その他	3,967,219	2.4
投資信託財産総額	163,458,219	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2017年5月29日現在
(A) 資産	163,451,917,414円
コール・ローン等	2,455,460,039
株式(評価額)	159,491,000,360
未収入金	72,555,360
未収配当金	1,380,622,855
差入委託証拠金	52,278,800
(B) 負債	1,011,232,116
未払金	901,612,940
未払解約金	109,613,189
未払利息	5,987
(C) 純資産総額(A－B)	162,440,685,298
元本	117,609,049,928
次期繰越損益金	44,831,635,370
(D) 受益権総口数	117,609,049,928口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,812円

■損益の状況

項目	当期 自 2016年5月31日 至 2017年5月29日
(A) 配当等収益	3,336,586,787円
受取配当金	3,335,725,896
受取利息	3,278
その他収益金	1,978,131
支払利息	△1,120,518
(B) 有価証券売買損益	22,310,321,725
売買益	25,745,845,270
売買損	△3,435,523,545
(C) 先物取引等取引損益	366,160,780
取引益	660,715,740
取引損	△294,554,960
(D) その他費用	△66,202
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	26,013,003,090
(F) 前期繰越損益金	22,544,640,558
(G) 追加信託差損益金	3,744,548,770
(H) 解約差損益金	△7,470,557,048
(I) 計 (E＋F＋G＋H)	44,831,635,370
次期繰越損益金(I)	44,831,635,370

(注1) (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。
(注2) (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。
(注3) (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。

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は128,457,920,792円、期中追加設定元本額は17,732,358,198円、期中一部解約元本額は28,581,229,062円です。

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DCマイセレクション50	16,811,893,795円
DCマイセレクション75	15,529,920,865円
日本株式インデックス・オープン	9,693,935,710円
SMT TOPIXインデックス・オープン	8,142,871,783円
DCマイセレクションS50	6,687,287,094円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	5,726,309,975円
DCマイセレクション25	5,551,167,652円
FOFs用 国内株式インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	5,231,671,241円
DC日本株式インデックス・オープン	4,911,146,813円
DCマイセレクションS75	4,326,872,130円
DC日本株式インデックス・オープンS	4,117,669,404円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,985,109,777円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	3,835,396,401円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,692,283,342円
DCマイセレクションS25	2,276,716,529円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,224,613,674円
日本株式ファンド・シリーズ2	1,573,293,713円
FOFs用 日本株式インデックス・オープン(適格機関投資家専用)	1,362,407,617円
世界経済インデックスファンド	1,190,474,094円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,143,015,987円
DC世界経済インデックスファンド	1,142,025,115円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,022,027,489円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	897,923,057円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	891,829,193円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	866,558,083円
グローバル・インカム＆プラス(毎月決算型)	825,534,512円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	750,845,593円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	638,800,855円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	574,204,997円
日本株式インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	567,669,371円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	433,367,528円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	331,404,641円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	315,554,301円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	225,629,401円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	203,550,715円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	202,152,001円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	118,321,687円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	110,276,396円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	100,111,813円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	95,154,833円
SMT インデックスバランス・オープン	90,625,183円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	68,798,358円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	51,896,937円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	28,707,607円
SBI資産設計オープン(分配型)	26,811,146円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,404,766円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	2,806,754円

お知らせ

該当事項はありません。

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／国内／債券／インデックス型	
信託期間	信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。	
運用方針	NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	外貨建資産への投資は行いません。
	国内債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は、行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 (1)分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。 (2)分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)

運用報告書(全体版)

第5期(決算日　2017年3月7日)
第6期(決算日　2017年5月8日)
第7期(決算日　2017年7月7日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

お問い合わせ先
フリーダイヤル:0120-668001
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

PCサイト　http://www.smtam.jp/
モバイルサイト　http://m.smtam.jp/

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-8574　東京都港区芝三丁目33番1号

【本運用報告書の記載について】
・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

作成期	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
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
		円	円	%		%	%	%	百万円
第1	設定日(2016年 2月 3日)	10,000	－	－	10,000	－	－	－	0.5
	第1期(2016年 7月 7日)	10,482	28	5.1	10,514	5.1	99.4	0.3	6,780
第2	第2期(2016年 9月 7日)	10,234	12	△2.3	10,277	△2.3	99.5	0.1	7,070
	第3期(2016年11月 7日)	10,208	11	△0.1	10,266	△0.1	99.4	－	6,882
	第4期(2017年 1月10日)	10,056	11	△1.4	10,125	△1.4	99.6	0.0	6,691
第3	第5期(2017年 3月 7日)	10,020	10	△0.3	10,101	△0.2	99.6	－	7,593
	第6期(2017年 5月 8日)	10,040	11	0.3	10,133	0.3	99.7	－	9,310
	第7期(2017年 7月 7日)	9,978	10	△0.5	10,084	△0.5	99.7	0.0	12,625

(注1)基準価額の騰落率は分配金込みです。
(注2)当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当作成期中の基準価額と市況の推移

決算期	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		
		円	%		%	%	%
第5期	(期 首)2017年1月10日	10,056	－	10,125	－	99.6	0.0
	1月末	10,014	△0.4	10,083	△0.4	99.6	0.0
	2月末	10,044	△0.1	10,113	△0.1	99.6	－
	(期 末)2017年3月 7日	10,030	△0.3	10,101	△0.2	99.6	－
第6期	(期 首)2017年3月 7日	10,020	－	10,101	－	99.6	－
	3月末	10,020	0.0	10,103	0.0	99.7	0.0
	4月末	10,068	0.5	10,152	0.5	99.7	－
	(期 末)2017年5月 8日	10,051	0.3	10,133	0.3	99.7	－
第7期	(期 首)2017年5月 8日	10,040	－	10,133	－	99.7	－
	5月末	10,037	△0.0	10,131	△0.0	99.6	－
	6月末	10,008	△0.3	10,105	△0.3	99.7	－
	(期 末)2017年7月 7日	9,988	△0.5	10,084	△0.5	99.7	0.0

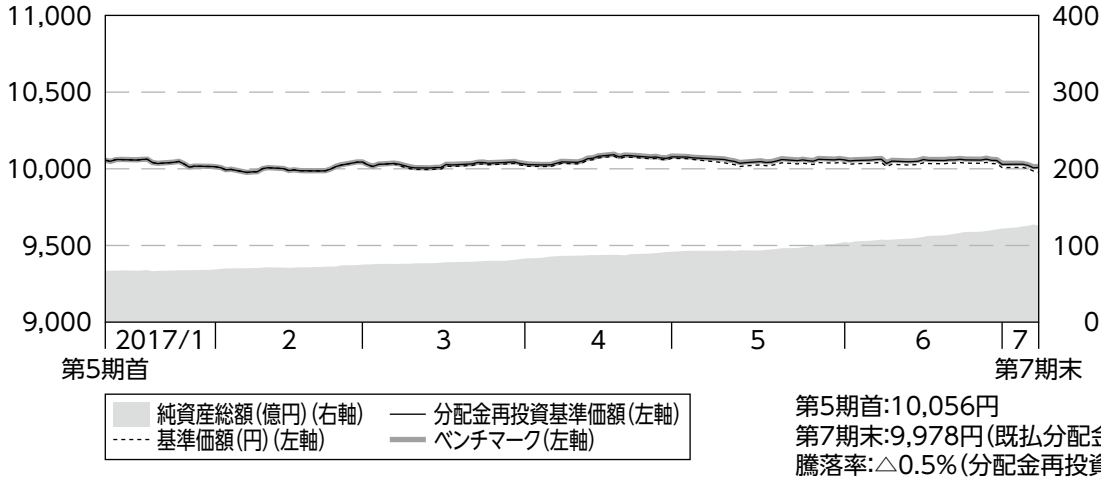
(注1)期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注2)当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



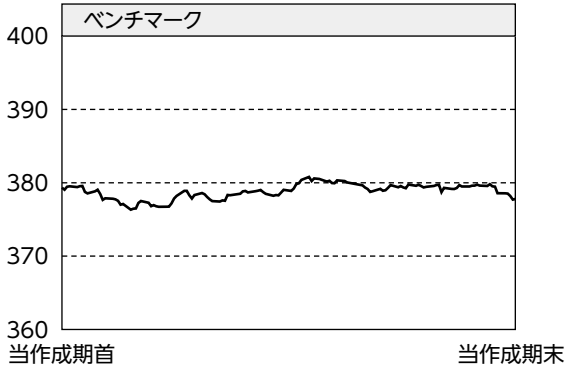
第5期首:10,056円
第7期末:9,978円(既払分配金31円)
騰落率:△0.5%(分配金再投資ベース)

(注1)分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)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。
(注2)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3)分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2017年1月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当作成期の基準価額は下落しました。当作成期初より2017年2月上旬にかけて、米トランプ政権への政策期待を背景に米国金利が上昇基調となったことや日銀の国債買い入れオペ運営に対する不透明感から金利は上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しましたが、その後は日銀が指し値オペを実施し需給の引き締まりが意識されたことから、金利は低下(債券価格は上昇)し、2月末にかけて基準価額は上昇しました。3月中旬以降は、米国で先行きの利上げペースが加速するとの見方が後退したことに加え、地政学リスクの高まりや欧州政治リスクへの警戒感を背景にリスク回避の動きとなったことから、金利は低下基調で推移し、基準価額は上昇しましたが、4月中旬以降は、フランス大統領選挙に対する警戒感が和らいだことや北朝鮮情勢の一服を受けてリスク回避の動きが後退したことから金利が上昇し、6月以降期末にかけても、欧州の金融緩和縮小観測を受けた欧米金利の上昇の影響から国内でも金利が上昇したことから、基準価額は下落基調推移となりました。

投資環境



2017年2月上旬にかけて、米トランプ政権への政策期待を背景に米国の長期金利が上昇した影響や日銀の国債買い入れオペ運営に対する不透明感から、金利は上昇しましたが、その後日銀が指し値オペを実施し需給の引き締まりが意識されたことから、2月末にかけて低下しました。3月中旬以降は、地政学リスクの高まりや欧州政治リスクへの警戒感を背景にリスク回避の動きから、金利は低下基調で推移しましたが、4月中旬以降は、フランス大統領選挙に対する警戒感が和らいだことや北朝鮮情勢の一服を受けてリスク回避の動きが後退したことに加え、欧州の金融緩和縮小観測を受けた欧米金利上昇の影響から、国内でも金利が上昇しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、主要投資対象である「国内債券インデックスマザーファンド」への投資を通じて、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

【「国内債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

(1)債券組入比率

キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引を利用し、先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2)ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの構成銘柄変更に合わせて毎月組入銘柄の見直しを実施することで、ベンチマークとの連動を目指しました。

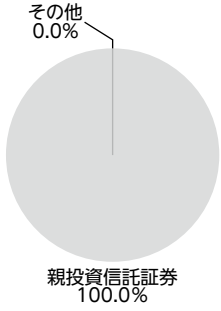
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

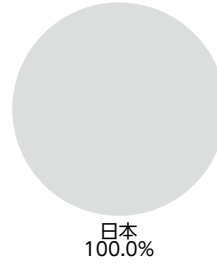
	当作成期末
	2017年7月7日
国内債券インデックス マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

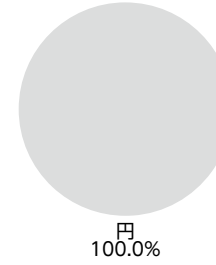
○資産別配分



○国別配分



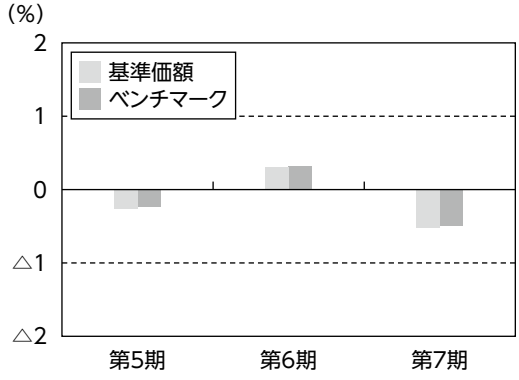
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

ベンチマークとの乖離の主な要因は、信託報酬によるものです。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきました。
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（1万口当たり・税引前）

項目		第5期 2017年1月11日～ 2017年3月7日	第6期 2017年3月8日～ 2017年5月8日	第7期 2017年5月9日～ 2017年7月7日
当期分配金	（円）	10	11	10
（対基準価額比率）	（%）	(0.100)	(0.109)	(0.100)
当期の収益	（円）	10	11	10
当期の収益以外	（円）	－	－	－
翌期繰越分配対象額	（円）	247	251	255

（注1）「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。
（注2）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）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3）－印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

国内債券インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当作成期 (2017年1月11日~2017年7月7日) 金額	当作成期 (2017年1月11日~2017年7月7日) 比率	項目の概要
(a) 信託報酬	5円	0.053%	(a)信託報酬=〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,031円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。
(投信会社)	(4)	(0.037)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
(販売会社)	(1)	(0.005)	交付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、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(1)	(0.011)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b)売買委託手数料=$\frac{\text{〔期中の売買委託手数料〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}}\times 10{,}000$
(株式)	(−)	(−)	
(新株予約権証券)	(−)	(−)	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
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(商品)	(−)	(−)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	−	−	(c)有価証券取引税=$\frac{\text{〔期中の有価証券取引税〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}}\times 10{,}000$
(株式)	(−)	(−)	
(新株予約権証券)	(−)	(−)	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
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(公社債)	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(d) その他費用	0	0.003	(d)その他費用=$\frac{\text{〔期中のその他費用〕}}{\text{〔期中の平均受益権口数〕}}\times 10{,}000$
(保管費用)	(−)	(−)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	その他は、金銭信託預入に係る手数料等
合計	5	0.056	

(注1)期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当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。

(注2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜親投資信託受益証券の設定、解約状況＞

	当作成期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内債券インデックス マザーファンド	4,784,679	6,607,594	453,693	626,550

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	9	9	100.0	9	9	100.0
コール・ローン	771	177	23.0	805	183	22.7

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

＜国内債券インデックス マザーファンド＞

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	1,362	1,362	100.0	1,362	1,362	100.0
コール・ローン	187,947	44,050	23.4	187,936	43,989	23.4

〈平均保有割合　3.1%〉
(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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す。

組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	前作成期末	当作成期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
国内債券インデックス マザーファンド	4,840,634	9,171,620	12,623,818

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、223,133,196千口です。

投資信託財産の構成

項目	当作成期末	
	評価額	比率
	千円	%
国内債券インデックス マザーファンド	12,623,818	99.2
コール・ローン等、その他	105,097	0.8
投資信託財産総額	12,728,915	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	第5期末 2017年3月7日現在	第6期末 2017年5月8日現在	第7期末 2017年7月7日現在
(A)資産	**7,616,192,917円**	**9,330,257,963円**	**12,728,915,613円**
コール・ローン等	20,625,249	20,757,194	16,096,876
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	7,592,567,669	9,309,500,769	12,623,818,738
未収入金	2,999,999	－	88,999,999
(B)負債	**22,804,829**	**19,831,165**	**103,651,451**
未払収益分配金	7,578,531	10,200,551	12,652,823
未払解約金	13,999,999	8,000,000	88,999,999
未払信託報酬	1,167,895	1,552,937	1,903,385
未払利息	29	46	31
その他未払費用	58,375	77,631	95,213
(C)純資産総額(A-B)	**7,593,388,088**	**9,310,426,798**	**12,625,264,162**
元本	7,578,531,436	9,273,228,376	12,652,823,575
次期繰越損益金	14,856,652	37,198,422	△27,559,413
(D)受益権総口数	**7,578,531,436口**	**9,273,228,376口**	**12,652,823,575口**
1万口当たり基準価額(C/D)	**10,020円**	**10,040円**	**9,978円**

■損益の状況

項目	第5期 自 2017年1月11日 至 2017年3月7日	第6期 自 2017年3月8日 至 2017年5月8日	第7期 自 2017年5月9日 至 2017年7月7日
(A)配当等収益	**△459円**	**△777円**	**△737円**
支払利息	△459	△777	△737
(B)有価証券売買損益	**△14,415,812**	**27,513,300**	**△59,808,813**
売買益	534,020	28,091,244	654,127
売買損	△14,949,832	△577,944	△60,462,940
(C)信託報酬等	**△1,226,270**	**△1,630,568**	**△1,998,598**
(D)当期損益金(A+B+C)	**△15,642,541**	**25,881,955**	**△61,808,148**
(E)前期繰越損益金	**△118,418,467**	**△138,942,591**	**△119,500,051**
(F)追加信託差損益金	**156,496,191**	**160,459,609**	**166,401,609**
(配当等相当額)	(73,596,276)	(118,363,773)	(207,568,706)
(売買損益相当額)	(82,899,915)	(42,095,836)	(△41,167,097)
(G)計(D+E+F)	**22,435,183**	**47,398,973**	**△14,906,590**
(H)収益分配金	**△7,578,531**	**△10,200,551**	**△12,652,823**
次期繰越損益金(G+H)	**14,856,652**	**37,198,422**	**△27,559,413**
追加信託差損益金	156,496,191	160,459,609	166,401,609
(配当等相当額)	(74,217,576)	(119,039,899)	(209,414,153)
(売買損益相当額)	(82,278,615)	(41,419,710)	(△43,012,544)
分配準備積立金	113,534,575	114,302,382	113,340,500
繰越損益金	△255,174,114	△237,563,569	△307,301,522

(注1)(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(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。
(注3)(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。

〈注記事項〉
※当ファンドの第5期首元本額は6,653,684,554円、第5～7期中追加設定元本額は6,809,519,302円、第5～7期中一部解約元本額は810,380,281円です。
※分配金の計算過程

項　　目	第　5　期	第　6　期	第　7　期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	9,344,989円	13,130,162円	15,178,715円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円	－円	－円
(C) 収益調整金額	74,217,576円	119,039,899円	209,414,153円
(D) 分配準備積立金額	111,768,117円	111,372,771円	110,814,608円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	195,330,682円	243,542,832円	335,407,476円
(F) 期末残存口数	7,578,531,436口	9,273,228,376口	12,652,823,575口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	257円	262円	265円
(H) 分配金額(1万口当たり)	10円	11円	10円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	7,578,531円	10,200,551円	12,652,823円

分配金のお知らせ

	第5期	第6期	第7期
1万口当たり分配金	10円	11円	10円

(注)分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

お知らせ

該当事項はありません。

国内債券インデックス マザーファンド

運 用 報 告 書

第17期（決算日　2017年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運　用　方　針	わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組　入　制　限	外貨建資産への投資は、行いません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】
・基準価額は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

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
第13期(2013年5月29日)	12,514	0.6	343.438	0.6	99.3	0.2	246,098
第14期(2014年5月29日)	12,915	3.2	354.471	3.2	99.3	0.3	256,692
第15期(2015年5月29日)	13,215	2.3	362.770	2.3	99.6	－	319,978
第16期(2016年5月30日)	14,107	6.7	387.276	6.8	99.4	0.2	319,650
第17期(2017年5月29日)	13,829	△2.0	379.592	△2.0	99.7	－	300,760

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

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		
(当期首)	円	%		%	%	%
2016年 5月30日	14,107	－	387.276	－	99.4	0.2
5月末	14,119	0.1	387.599	0.1	99.4	0.2
6月末	14,291	1.3	392.355	1.3	99.4	0.2
7月末	14,171	0.5	389.242	0.5	99.5	0.1
8月末	14,035	△0.5	385.240	△0.5	99.4	0.2
9月末	14,044	△0.4	385.504	△0.5	99.7	－
10月末	14,006	△0.7	384.444	△0.7	99.7	－
11月末	13,917	△1.3	381.967	△1.4	99.7	－
12月末	13,840	△1.9	379.825	△1.9	99.7	－
2017年 1月末	13,764	△2.4	377.739	△2.5	99.6	0.0
2月末	13,806	△2.1	378.896	△2.2	99.6	－
3月末	13,788	△2.3	378.492	△2.3	99.7	0.0
4月末	13,856	△1.8	380.333	△1.8	99.7	－
(当期末)						
2017年 5月29日	13,829	△2.0	379.592	△2.0	99.7	－

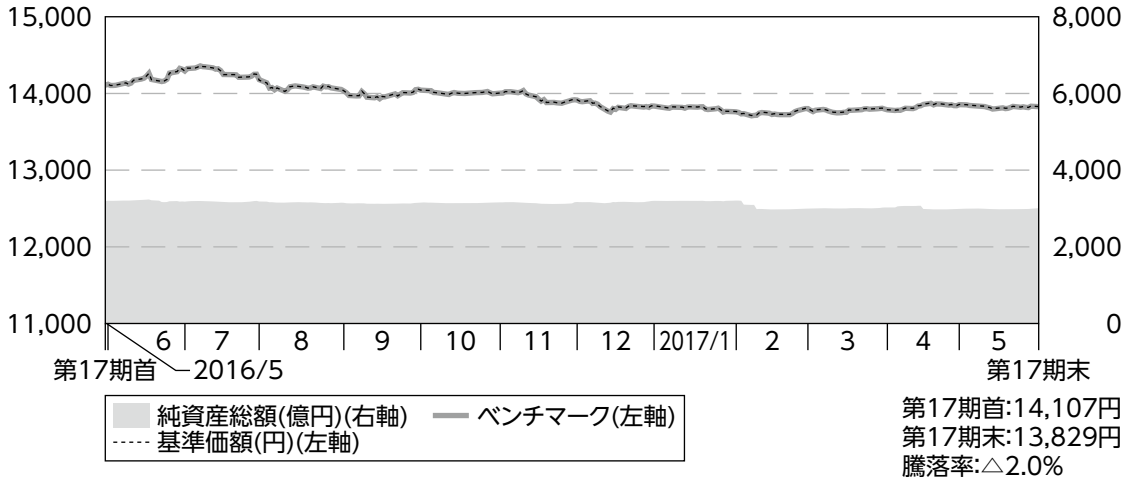
(注1)騰落率は期首比です。
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。同指数の知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2016年5月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

期初より7月上旬にかけて、英国の国民投票でEU(欧州連合)離脱派が勝利したことによるリスク回避の動きから金利は低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。その後は9月中旬にかけて、日銀の金融政策に対する先行きの不透明感や米国の早期利上げ観測の高まりを背景に金利は上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。9月下旬以降は、日銀のイールドカーブ・コントロール政策導入を受けて金利が横ばい圏で推移し基準価額も横ばい推移となりましたが、11月上旬以降2017年2月にかけては、米国大統領選挙の結果を受けた米トランプ政権の政策期待による米国金利上昇の影響や日銀の国債買い入れオペ運営に対する警戒感などから金利の上昇が続き、基準価額は下落推移となりました。2月上旬以降は日銀が指し値オペを実施し需給の引き締まりが意識される中、地政学リスクの高まりや欧州政治リスクへの警戒感を背景にリスク回避の動きが強まったことから金利は低下基調で推移し、基準価額は上昇しました。

投資環境

2016年7月上旬にかけて、英国の国民投票でEU離脱派が勝利したことを受けたリスク回避の動きから金利は低下しましたが、7月中旬から9月中旬にかけて、日銀による金融政策の先行き不透明感などから上昇しました。その後は、日銀のイールドカーブ・コントロール政策導入を受けて金利は横ばい圏で推移しましたが、11月上旬以降は、米国大統領選挙の結果を受けた米国金利上昇の影響などから上昇しました。2017年2月上旬以降は、日銀が指し値オペを実施し需給の引き締まりが意識される中、地政学リスクの高まりや欧州政治リスクへの警戒感を背景にリスク回避の動きが強まり、金利は低下基調で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、公社債の組入比率を高位に保ち、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1)債券組入比率

キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引を利用し、先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

(2)ポートフォリオ構成

ポートフォリオの構築に際しては、ベンチマークの構成銘柄変更に合わせて毎月組入銘柄の見直しを実施することで、ベンチマークとの連動を目指しました。

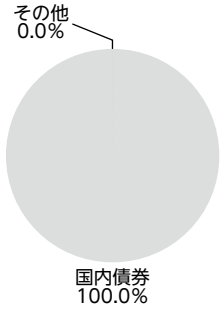
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

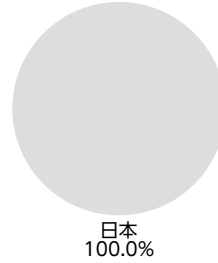
順位	銘柄名	国	組入比率
1	第113回利付国債(5年)	日本	1.5%
2	第131回利付国債(5年)	日本	1.4%
3	第127回利付国債(5年)	日本	1.3%
4	第116回利付国債(5年)	日本	1.3%
5	第125回利付国債(5年)	日本	1.2%
6	第122回利付国債(5年)	日本	1.2%
7	第118回利付国債(5年)	日本	1.2%
8	第117回利付国債(5年)	日本	1.1%
9	第339回利付国債(10年)	日本	1.1%
10	第129回利付国債(5年)	日本	1.1%
組入銘柄数		703	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

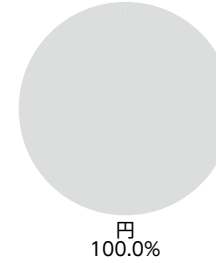
○資産別配分



○国別配分



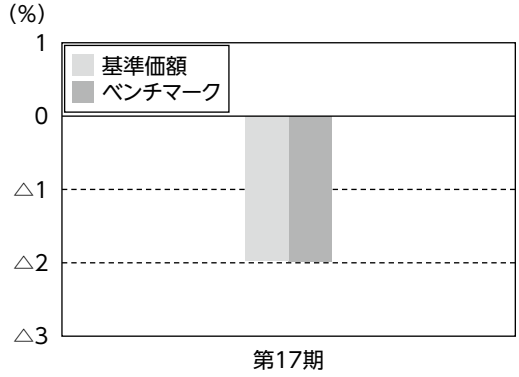
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

今後の運用方針

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2016年5月31日～2017年5月29日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.000%	(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〕×10,000 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）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
（商品）	(－)	(－)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(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〕×10,000 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）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) その他費用	0	0.000	(c)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
（保管費用）	(－)	(－)	
（監査費用）	(－)	(－)	
（その他）	(0)	(0.000)	
合計	0	0.000	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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。
（注2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注3）「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額（13,969円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

		当期	
		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	75,073,251	78,997,691
	地方債証券	1,232,658	2,316,350
	特殊債券	3,160,377	4,070,746 (708,627)
	社債券(投資法人債券を含む)	1,939,141	3,574,027 (100,000)

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)
(注2)(　)内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。
(注3)社債券には新株予約権付社債(転換社債)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		当期			
		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	債券先物取引	30,990	31,746	－	－

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	15,154	15,154	100.0	15,412	15,412	100.0
コール・ローン	331,161	64,841	19.6	331,220	64,218	19.4

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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す。

組入資産の明細

＜国内(邦貨建)公社債＞

(A)債券種類別開示

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	227,575,000 (5,720,000)	248,331,087 (5,744,170)	82.6 (1.9)	－ (－)	51.7 (－)	19.9 (－)	10.9 (1.9)
地方債証券	15,824,590 (15,824,590)	16,991,916 (16,991,916)	5.6 (5.6)	－ (－)	3.5 (3.5)	2.0 (2.0)	0.1 (0.1)
特殊債券 (除く金融債)	18,775,470 (18,775,470)	20,130,919 (20,130,919)	6.7 (6.7)	－ (－)	4.7 (4.7)	2.0 (2.0)	0.0 (0.0)
金融債券	2,200,000 (2,200,000)	2,206,522 (2,206,522)	0.7 (0.7)	－ (－)	－ (－)	0.7 (0.7)	0.0 (0.0)
普通社債券 (含む投資法人債券)	11,796,000 (11,796,000)	12,246,422 (12,246,422)	4.1 (4.1)	－ (－)	1.7 (1.7)	1.8 (1.8)	0.5 (0.5)
合計	276,171,060 (54,316,060)	299,906,867 (57,319,951)	99.7 (19.1)	－ (－)	61.7 (9.9)	26.5 (6.5)	11.5 (2.6)

(注1)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注2)(　)内は非上場債で内書きです。
(注3)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)個別銘柄開示

銘柄名	当期末 利率(%)	当期末 額面金額(千円)	当期末 評価額(千円)	当期末 償還年月日
国債証券				
第365回利付国債（2年）	0.1	400,000	401,104	2018/6/15
第366回利付国債（2年）	0.1	1,110,000	1,113,307	2018/7/15
第367回利付国債（2年）	0.1	1,280,000	1,284,096	2018/8/15
第368回利付国債（2年）	0.1	650,000	652,184	2018/9/15
第369回利付国債（2年）	0.1	1,060,000	1,063,869	2018/10/15
第370回利付国債（2年）	0.1	1,340,000	1,345,293	2018/11/15
第371回利付国債（2年）	0.1	760,000	763,169	2018/12/15
第372回利付国債（2年）	0.1	920,000	924,048	2019/1/15
第373回利付国債（2年）	0.1	140,000	140,648	2019/2/15
第374回利付国債（2年）	0.1	560,000	562,710	2019/3/15
第375回利付国債（2年）	0.1	1,270,000	1,276,438	2019/4/15
第376回利付国債（2年）	0.1	880,000	884,655	2019/5/15
第112回利付国債（5年）	0.4	900,000	905,418	2018/6/20
第113回利付国債（5年）	0.3	4,390,000	4,411,774	2018/6/20
第114回利付国債（5年）	0.3	810,000	814,981	2018/9/20
第115回利付国債（5年）	0.2	2,450,000	2,461,858	2018/9/20
第116回利付国債（5年）	0.2	3,770,000	3,792,054	2018/12/20
第117回利付国債（5年）	0.2	3,300,000	3,322,077	2019/3/20
第118回利付国債（5年）	0.2	3,510,000	3,535,658	2019/6/20
第119回利付国債（5年）	0.1	1,000,000	1,005,250	2019/6/20
第120回利付国債（5年）	0.2	2,560,000	2,580,736	2019/9/20
第121回利付国債（5年）	0.1	630,000	633,641	2019/9/20
第122回利付国債（5年）	0.1	3,520,000	3,542,563	2019/12/20
第123回利付国債（5年）	0.1	3,140,000	3,162,074	2020/3/20
第124回利付国債（5年）	0.1	1,950,000	1,964,644	2020/6/20
第125回利付国債（5年）	0.1	3,610,000	3,639,385	2020/9/20
第126回利付国債（5年）	0.1	2,960,000	2,985,900	2020/12/20
第127回利付国債（5年）	0.1	3,790,000	3,825,474	2021/3/20
第128回利付国債（5年）	0.1	1,300,000	1,312,454	2021/6/20
第129回利付国債（5年）	0.1	3,200,000	3,231,872	2021/9/20
第130回利付国債（5年）	0.1	1,360,000	1,374,647	2021/12/20
第131回利付国債（5年）	0.1	4,290,000	4,335,559	2022/3/20
第1回利付国債（40年）	2.4	150,000	214,071	2048/3/20
第2回利付国債（40年）	2.2	420,000	579,352	2049/3/20
第3回利付国債（40年）	2.2	420,000	581,855	2050/3/20
第4回利付国債（40年）	2.2	630,000	876,336	2051/3/20
第5回利付国債（40年）	2.0	490,000	654,522	2052/3/20
第6回利付国債（40年）	1.9	390,000	510,104	2053/3/20
第7回利付国債（40年）	1.7	630,000	785,622	2054/3/20

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第８回利付国債（４０年）	1.4	670,000	772,108	2055/3/20
第９回利付国債（４０年）	0.4	970,000	801,695	2056/3/20
第２９３回利付国債（１０年）	1.8	190,000	193,944	2018/6/20
第２９４回利付国債（１０年）	1.7	180,000	183,546	2018/6/20
第２９５回利付国債（１０年）	1.5	100,000	101,759	2018/6/20
第２９６回利付国債（１０年）	1.5	2,100,000	2,145,780	2018/9/20
第２９７回利付国債（１０年）	1.4	560,000	573,669	2018/12/20
第２９８回利付国債（１０年）	1.3	550,000	562,567	2018/12/20
第２９９回利付国債（１０年）	1.3	1,240,000	1,272,959	2019/3/20
第３００回利付国債（１０年）	1.5	830,000	855,057	2019/3/20
第３０１回利付国債（１０年）	1.5	340,000	351,597	2019/6/20
第３０２回利付国債（１０年）	1.4	200,000	206,410	2019/6/20
第３０３回利付国債（１０年）	1.4	1,390,000	1,440,040	2019/9/20
第３０４回利付国債（１０年）	1.3	480,000	496,166	2019/9/20
第３０５回利付国債（１０年）	1.3	1,910,000	1,981,052	2019/12/20
第３０６回利付国債（１０年）	1.4	1,170,000	1,220,859	2020/3/20
第３０７回利付国債（１０年）	1.3	700,000	728,462	2020/3/20
第３０８回利付国債（１０年）	1.3	990,000	1,033,569	2020/6/20
第３０９回利付国債（１０年）	1.1	1,610,000	1,670,986	2020/6/20
第３１０回利付国債（１０年）	1.0	1,090,000	1,131,278	2020/9/20
第３１１回利付国債（１０年）	0.8	610,000	629,044	2020/9/20
第３１２回利付国債（１０年）	1.2	1,670,000	1,749,659	2020/12/20
第３１３回利付国債（１０年）	1.3	240,000	253,113	2021/3/20
第３１４回利付国債（１０年）	1.1	310,000	324,570	2021/3/20
第３１５回利付国債（１０年）	1.2	900,000	948,591	2021/6/20
第３１６回利付国債（１０年）	1.1	1,090,000	1,144,412	2021/6/20
第３１７回利付国債（１０年）	1.1	410,000	431,746	2021/9/20
第３１８回利付国債（１０年）	1.0	650,000	681,661	2021/9/20
第３１９回利付国債（１０年）	1.1	680,000	717,835	2021/12/20
第３２０回利付国債（１０年）	1.0	1,120,000	1,177,187	2021/12/20
第３２１回利付国債（１０年）	1.0	1,530,000	1,611,992	2022/3/20
第３２２回利付国債（１０年）	0.9	750,000	786,570	2022/3/20
第３２３回利付国債（１０年）	0.9	970,000	1,019,790	2022/6/20
第３２４回利付国債（１０年）	0.8	1,280,000	1,339,200	2022/6/20
第３２５回利付国債（１０年）	0.8	2,290,000	2,400,584	2022/9/20
第３２６回利付国債（１０年）	0.7	420,000	438,769	2022/12/20
第３２７回利付国債（１０年）	0.8	740,000	777,207	2022/12/20
第３２８回利付国債（１０年）	0.6	1,720,000	1,790,262	2023/3/20
第３２９回利付国債（１０年）	0.8	2,250,000	2,372,625	2023/6/20
第３３０回利付国債（１０年）	0.8	1,440,000	1,521,288	2023/9/20
第３３１回利付国債（１０年）	0.6	580,000	605,380	2023/9/20
第３３２回利付国債（１０年）	0.6	2,230,000	2,330,706	2023/12/20
第３３３回利付国債（１０年）	0.6	1,130,000	1,182,556	2024/3/20
第３３４回利付国債（１０年）	0.6	2,390,000	2,503,525	2024/6/20
第３３５回利付国債（１０年）	0.5	2,290,000	2,383,225	2024/9/20
第３３６回利付国債（１０年）	0.5	610,000	635,205	2024/12/20
第３３７回利付国債（１０年）	0.3	1,350,000	1,385,302	2024/12/20
第３３８回利付国債（１０年）	0.4	1,800,000	1,861,254	2025/3/20
第３３９回利付国債（１０年）	0.4	3,200,000	3,309,760	2025/6/20

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第３４０回利付国債（１０年）	0.4	2,760,000	2,855,247	2025/9/20
第３４１回利付国債（１０年）	0.3	2,770,000	2,842,297	2025/12/20
第３４２回利付国債（１０年）	0.1	2,600,000	2,621,710	2026/3/20
第３４３回利付国債（１０年）	0.1	2,530,000	2,550,594	2026/6/20
第３４４回利付国債（１０年）	0.1	1,500,000	1,511,145	2026/9/20
第３４５回利付国債（１０年）	0.1	2,110,000	2,124,073	2026/12/20
第３４６回利付国債（１０年）	0.1	3,180,000	3,200,161	2027/3/20
第１回利付国債（３０年）	2.8	40,000	52,904	2029/9/20
第２回利付国債（３０年）	2.4	160,000	204,955	2030/2/20
第３回利付国債（３０年）	2.3	120,000	152,532	2030/5/20
第４回利付国債（３０年）	2.9	110,000	149,163	2030/11/20
第５回利付国債（３０年）	2.2	50,000	63,460	2031/5/20
第６回利付国債（３０年）	2.4	190,000	247,579	2031/11/20
第７回利付国債（３０年）	2.3	180,000	232,741	2032/5/20
第８回利付国債（３０年）	1.8	50,000	61,094	2032/11/22
第９回利付国債（３０年）	1.4	240,000	279,028	2032/12/20
第１０回利付国債（３０年）	1.1	160,000	178,636	2033/3/20
第１１回利付国債（３０年）	1.7	90,000	108,799	2033/6/20
第１２回利付国債（３０年）	2.1	190,000	241,851	2033/9/20
第１３回利付国債（３０年）	2.0	290,000	364,880	2033/12/20
第１４回利付国債（３０年）	2.4	300,000	397,281	2034/3/20
第１５回利付国債（３０年）	2.5	340,000	456,178	2034/6/20
第１６回利付国債（３０年）	2.5	370,000	497,376	2034/9/20
第１７回利付国債（３０年）	2.4	330,000	438,626	2034/12/20
第１８回利付国債（３０年）	2.3	345,000	453,185	2035/3/20
第１９回利付国債（３０年）	2.3	280,000	368,340	2035/6/20
第２０回利付国債（３０年）	2.5	420,000	567,541	2035/9/20
第２１回利付国債（３０年）	2.3	270,000	355,849	2035/12/20
第２２回利付国債（３０年）	2.5	400,000	542,152	2036/3/20
第２３回利付国債（３０年）	2.5	430,000	583,677	2036/6/20
第２４回利付国債（３０年）	2.5	260,000	353,111	2036/9/20
第２５回利付国債（３０年）	2.3	290,000	383,672	2036/12/20
第２６回利付国債（３０年）	2.4	410,000	550,859	2037/3/20
第２７回利付国債（３０年）	2.5	600,000	819,708	2037/9/20
第２８回利付国債（３０年）	2.5	690,000	945,576	2038/3/20
第２９回利付国債（３０年）	2.4	660,000	894,570	2038/9/20
第３０回利付国債（３０年）	2.3	640,000	857,203	2039/3/20
第３１回利付国債（３０年）	2.2	740,000	978,709	2039/9/20
第３２回利付国債（３０年）	2.3	880,000	1,186,020	2040/3/20
第３３回利付国債（３０年）	2.0	1,110,000	1,427,748	2040/9/20
第３４回利付国債（３０年）	2.2	845,000	1,126,596	2041/3/20
第３５回利付国債（３０年）	2.0	1,160,000	1,498,140	2041/9/20
第３６回利付国債（３０年）	2.0	930,000	1,203,299	2042/3/20
第３７回利付国債（３０年）	1.9	1,060,000	1,349,411	2042/9/20
第３８回利付国債（３０年）	1.8	540,000	675,723	2043/3/20
第３９回利付国債（３０年）	1.9	840,000	1,071,562	2043/6/20
第４０回利付国債（３０年）	1.8	600,000	751,632	2043/9/20
第４１回利付国債（３０年）	1.7	480,000	590,131	2043/12/20
第４２回利付国債（３０年）	1.7	650,000	799,396	2044/3/20

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第43回利付国債（30年）	1.7	750,000	922,695	2044/6/20
第44回利付国債（30年）	1.7	470,000	578,405	2044/9/20
第45回利付国債（30年）	1.5	690,000	815,628	2044/12/20
第46回利付国債（30年）	1.5	810,000	957,460	2045/3/20
第47回利付国債（30年）	1.6	900,000	1,087,389	2045/6/20
第48回利付国債（30年）	1.4	1,100,000	1,274,383	2045/9/20
第49回利付国債（30年）	1.4	740,000	857,156	2045/12/20
第50回利付国債（30年）	0.8	520,000	521,830	2046/3/20
第51回利付国債（30年）	0.3	790,000	689,559	2046/6/20
第52回利付国債（30年）	0.5	770,000	710,933	2046/9/20
第53回利付国債（30年）	0.6	930,000	882,365	2046/12/20
第54回利付国債（30年）	0.8	750,000	750,000	2047/3/20
第40回利付国債（20年）	2.3	100,000	103,221	2018/9/20
第41回利付国債（20年）	1.5	330,000	339,933	2019/3/20
第42回利付国債（20年）	2.6	80,000	83,999	2019/3/20
第43回利付国債（20年）	2.9	140,000	149,884	2019/9/20
第44回利付国債（20年）	2.5	170,000	182,627	2020/3/20
第45回利付国債（20年）	2.4	290,000	310,726	2020/3/20
第46回利付国債（20年）	2.2	170,000	182,224	2020/6/22
第47回利付国債（20年）	2.2	90,000	96,985	2020/9/21
第48回利付国債（20年）	2.5	130,000	142,248	2020/12/21
第49回利付国債（20年）	2.1	140,000	151,977	2021/3/22
第50回利付国債（20年）	1.9	220,000	237,135	2021/3/22
第51回利付国債（20年）	2.0	100,000	108,644	2021/6/21
第52回利付国債（20年）	2.1	110,000	120,552	2021/9/21
第53回利付国債（20年）	2.1	80,000	88,116	2021/12/20
第54回利付国債（20年）	2.2	200,000	221,206	2021/12/20
第55回利付国債（20年）	2.0	140,000	154,270	2022/3/21
第56回利付国債（20年）	2.0	150,000	166,045	2022/6/20
第57回利付国債（20年）	1.9	240,000	264,451	2022/6/20
第58回利付国債（20年）	1.9	300,000	332,187	2022/9/20
第59回利付国債（20年）	1.7	200,000	220,174	2022/12/20
第60回利付国債（20年）	1.4	350,000	379,438	2022/12/20
第61回利付国債（20年）	1.0	240,000	255,408	2023/3/20
第62回利付国債（20年）	0.8	320,000	337,440	2023/6/20
第63回利付国債（20年）	1.8	200,000	223,080	2023/6/20
第64回利付国債（20年）	1.9	320,000	360,390	2023/9/20
第65回利付国債（20年）	1.9	220,000	248,789	2023/12/20
第66回利付国債（20年）	1.8	330,000	371,009	2023/12/20
第67回利付国債（20年）	1.9	130,000	147,555	2024/3/20
第68回利付国債（20年）	2.2	190,000	219,554	2024/3/20
第69回利付国債（20年）	2.1	390,000	447,996	2024/3/20
第70回利付国債（20年）	2.4	400,000	470,044	2024/6/20
第71回利付国債（20年）	2.2	200,000	232,186	2024/6/20
第72回利付国債（20年）	2.1	630,000	729,596	2024/9/20
第73回利付国債（20年）	2.0	360,000	415,659	2024/12/20
第74回利付国債（20年）	2.1	200,000	232,438	2024/12/20
第75回利付国債（20年）	2.1	130,000	151,655	2025/3/20
第76回利付国債（20年）	1.9	270,000	310,753	2025/3/20

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第77回利付国債（20年）	2.0	290,000	336,040	2025/3/20
第78回利付国債（20年）	1.9	170,000	196,333	2025/6/20
第79回利付国債（20年）	2.0	270,000	313,999	2025/6/20
第80回利付国債（20年）	2.1	220,000	257,626	2025/6/20
第81回利付国債（20年）	2.0	390,000	455,169	2025/9/20
第82回利付国債（20年）	2.1	600,000	705,252	2025/9/20
第83回利付国債（20年）	2.1	290,000	342,104	2025/12/20
第84回利付国債（20年）	2.0	470,000	550,426	2025/12/20
第85回利付国債（20年）	2.1	290,000	343,455	2026/3/20
第86回利付国債（20年）	2.3	210,000	252,405	2026/3/20
第87回利付国債（20年）	2.2	550,000	656,221	2026/3/20
第88回利付国債（20年）	2.3	420,000	506,780	2026/6/20
第89回利付国債（20年）	2.2	350,000	419,149	2026/6/20
第90回利付国債（20年）	2.2	630,000	757,228	2026/9/20
第91回利付国債（20年）	2.3	450,000	545,053	2026/9/20
第92回利付国債（20年）	2.1	880,000	1,053,069	2026/12/20
第93回利付国債（20年）	2.0	410,000	488,465	2027/3/20
第94回利付国債（20年）	2.1	610,000	732,695	2027/3/20
第95回利付国債（20年）	2.3	610,000	747,683	2027/6/20
第96回利付国債（20年）	2.1	320,000	385,820	2027/6/20
第97回利付国債（20年）	2.2	340,000	414,531	2027/9/20
第98回利付国債（20年）	2.1	440,000	531,942	2027/9/20
第99回利付国債（20年）	2.1	870,000	1,055,057	2027/12/20
第100回利付国債（20年）	2.2	480,000	588,984	2028/3/20
第101回利付国債（20年）	2.4	415,000	518,115	2028/3/20
第102回利付国債（20年）	2.4	320,000	400,912	2028/6/20
第103回利付国債（20年）	2.3	160,000	198,704	2028/6/20
第104回利付国債（20年）	2.1	360,000	439,203	2028/6/20
第105回利付国債（20年）	2.1	760,000	929,936	2028/9/20
第106回利付国債（20年）	2.2	230,000	283,999	2028/9/20
第107回利付国債（20年）	2.1	150,000	184,062	2028/12/20
第108回利付国債（20年）	1.9	610,000	734,592	2028/12/20
第109回利付国債（20年）	1.9	130,000	156,929	2029/3/20
第110回利付国債（20年）	2.1	990,000	1,218,828	2029/3/20
第111回利付国債（20年）	2.2	290,000	361,461	2029/6/20
第112回利付国債（20年）	2.1	610,000	753,069	2029/6/20
第113回利付国債（20年）	2.1	1,290,000	1,595,884	2029/9/20
第114回利付国債（20年）	2.1	690,000	855,289	2029/12/20
第115回利付国債（20年）	2.2	380,000	475,710	2029/12/20
第116回利付国債（20年）	2.2	630,000	790,738	2030/3/20
第117回利付国債（20年）	2.1	630,000	782,838	2030/3/20
第118回利付国債（20年）	2.0	690,000	850,176	2030/6/20
第119回利付国債（20年）	1.8	220,000	265,458	2030/6/20
第120回利付国債（20年）	1.6	330,000	389,518	2030/6/20
第121回利付国債（20年）	1.9	930,000	1,136,394	2030/9/20
第122回利付国債（20年）	1.8	200,000	241,790	2030/9/20
第123回利付国債（20年）	2.1	1,000,000	1,250,760	2030/12/20
第124回利付国債（20年）	2.0	390,000	482,648	2030/12/20
第125回利付国債（20年）	2.2	310,000	392,748	2031/3/20

国内債券インデックス マザーファンド　－第17期－

銘柄名	当期末 利率(%)	当期末 額面金額(千円)	当期末 評価額(千円)	当期末 償還年月日
第１２６回利付国債（２０年）	2.0	570,000	706,857	2031/3/20
第１２７回利付国債（２０年）	1.9	460,000	564,277	2031/3/20
第１２８回利付国債（２０年）	1.9	840,000	1,031,688	2031/6/20
第１２９回利付国債（２０年）	1.8	100,000	121,457	2031/6/20
第１３０回利付国債（２０年）	1.8	630,000	766,464	2031/9/20
第１３１回利付国債（２０年）	1.7	380,000	457,052	2031/9/20
第１３２回利付国債（２０年）	1.7	690,000	830,518	2031/12/20
第１３３回利付国債（２０年）	1.8	600,000	730,614	2031/12/20
第１３４回利付国債（２０年）	1.8	560,000	682,925	2032/3/20
第１３５回利付国債（２０年）	1.7	420,000	505,848	2032/3/20
第１３６回利付国債（２０年）	1.6	410,000	487,961	2032/3/20
第１３７回利付国債（２０年）	1.7	350,000	422,100	2032/6/20
第１３８回利付国債（２０年）	1.5	390,000	458,729	2032/6/20
第１３９回利付国債（２０年）	1.6	510,000	607,685	2032/6/20
第１４０回利付国債（２０年）	1.7	1,310,000	1,580,711	2032/9/20
第１４１回利付国債（２０年）	1.7	360,000	434,905	2032/12/20
第１４２回利付国債（２０年）	1.8	420,000	513,630	2032/12/20
第１４３回利付国債（２０年）	1.6	890,000	1,062,152	2033/3/20
第１４４回利付国債（２０年）	1.5	540,000	635,844	2033/3/20
第１４５回利付国債（２０年）	1.7	1,410,000	1,705,818	2033/6/20
第１４６回利付国債（２０年）	1.7	1,390,000	1,682,066	2033/9/20
第１４７回利付国債（２０年）	1.6	1,240,000	1,481,403	2033/12/20
第１４８回利付国債（２０年）	1.5	1,170,000	1,378,049	2034/3/20
第１４９回利付国債（２０年）	1.5	1,250,000	1,473,050	2034/6/20
第１５０回利付国債（２０年）	1.4	1,220,000	1,416,322	2034/9/20
第１５１回利付国債（２０年）	1.2	1,330,000	1,498,391	2034/12/20
第１５２回利付国債（２０年）	1.2	1,360,000	1,531,904	2035/3/20
第１５３回利付国債（２０年）	1.3	1,360,000	1,554,316	2035/6/20
第１５４回利付国債（２０年）	1.2	1,010,000	1,136,189	2035/9/20
第１５５回利付国債（２０年）	1.0	1,530,000	1,664,135	2035/12/20
第１５６回利付国債（２０年）	0.4	930,000	910,879	2036/3/20
第１５７回利付国債（２０年）	0.2	1,400,000	1,316,616	2036/6/20
第１５８回利付国債（２０年）	0.5	1,280,000	1,269,926	2036/9/20
第１５９回利付国債（２０年）	0.6	1,350,000	1,360,705	2036/12/20
第１６０回利付国債（２０年）	0.7	910,000	932,704	2037/3/20
第１４回ポーランド共和国円貨債券	0.67	200,000	200,426	2018/11/15
小　計		227,575,000	248,331,087	
地方債証券				
第3回東京都公募公債（２０年）	2.26	100,000	114,991	2024/3/19
第6回東京都公募公債（２０年）	2.0	100,000	114,807	2025/3/19
第9回東京都公募公債（３０年）	2.37	100,000	130,830	2039/3/18
第１１回東京都公募公債（３０年）	2.19	100,000	128,046	2040/9/20
第１７回東京都公募公債（２０年）	2.09	100,000	120,409	2028/12/20
第１９回東京都公募公債（２０年）	2.13	100,000	121,439	2029/6/20
第２６回東京都公募公債（２０年）	1.74	200,000	236,874	2032/6/18
第２７回東京都公募公債（２０年）	1.68	200,000	235,254	2032/12/20
第６９５回東京都公募公債	1.2	100,000	104,527	2021/3/19
第６９６回東京都公募公債	1.19	100,000	104,783	2021/6/18
第７００回東京都公募公債	1.02	100,000	104,345	2021/9/17
第７０２回東京都公募公債	1.04	200,000	209,392	2021/12/20
第７１６回東京都公募公債	0.77	100,000	104,106	2022/12/20
第７１７回東京都公募公債	0.63	100,000	103,509	2023/3/20
第７２０回東京都公募公債	0.87	100,000	105,081	2023/6/20
第７２８回東京都公募公債	0.65	100,000	103,992	2023/12/20
平成２２年度第１１回北海道公募公債	1.36	100,000	104,817	2020/12/28
平成２３年度第６回北海道公募公債	1.11	200,000	209,228	2021/8/31
平成２４年度第１４回北海道公募公債	0.8	100,000	104,325	2023/2/28
第４回神奈川県公募公債（３０年）	2.62	100,000	135,000	2038/3/19
第２０回神奈川県公募公債（２０年）	1.706	100,000	117,790	2032/6/18
第２７回神奈川県公募公債（２０年）	1.398	100,000	112,959	2034/9/20
第１７２回神奈川県公募公債	1.34	200,000	207,468	2020/3/20
第２１０回神奈川県公募公債	0.451	200,000	205,346	2024/12/20
第２１８回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,499	2025/12/19
第７回大阪府公募公債（２０年）	1.84	200,000	237,748	2031/9/26
第３４５回大阪府公募公債（１０年）	1.26	100,000	104,449	2020/12/25
第３４９回大阪府公募公債（１０年）	1.38	100,000	105,316	2021/4/27
第３６１回大阪府公募公債（１０年）	0.92	100,000	104,463	2022/6/28
第３７１回大阪府公募公債（１０年）	0.58	100,000	103,153	2023/4/26
第３７５回大阪府公募公債（１０年）	0.835	100,000	104,859	2023/8/29
第３８９回大阪府公募公債（１０年）	0.53	100,000	103,164	2024/10/30
第３９９回大阪府公募公債（１０年）	0.529	100,000	103,214	2025/8/28
第４０２回大阪府公募公債（１０年）	0.493	100,000	102,915	2025/11/27
平成２２年度第２回京都府公募公債	1.16	100,000	103,820	2020/9/24
平成２３年度第５回京都府公募公債（２０年）	1.79	100,000	118,668	2031/10/17
平成２５年度第７回京都府公募公債	0.8	100,000	104,750	2023/9/19
平成２７年度第４回京都府公募公債	0.553	100,000	103,497	2025/6/19
第１回兵庫県公募公債（１２年）	1.1	100,000	107,178	2024/6/26
第３回兵庫県公募公債（１２年）	0.56	100,000	103,436	2025/4/16
第７回兵庫県公募公債（１５年）	1.12	100,000	108,930	2028/12/25
平成２２年度第１回兵庫県公募公債	1.46	100,000	104,179	2020/4/16
平成２５年度第４回兵庫県公募公債	0.82	100,000	104,776	2023/8/18
平成２６年度第１７回兵庫県公募公債	0.46	100,000	102,649	2025/2/26
第９回静岡県公募公債（３０年）	1.539	100,000	114,024	2045/6/20
平成２３年度第３回静岡県公募公債	1.193	103,290	108,162	2021/5/25
平成２３年度第８回静岡県公募公債	1.025	100,000	104,449	2021/10/25
平成２４年度第１０回静岡県公募公債	0.678	100,000	103,730	2023/3/22
平成２１年度第５回愛知県公募公債（２０年）	2.28	100,000	123,116	2029/6/20
平成２２年度第３回愛知県公募公債（１０年）	1.364	200,000	208,116	2020/5/28
平成２３年度第１回愛知県公募公債（１０年）	1.38	100,000	105,362	2021/4/28
平成２３年度第３回愛知県公募公債（１０年）	1.212	100,000	104,799	2021/5/27
平成２３年度第１４回愛知県公募公債（１０年）	1.006	100,000	104,463	2021/11/30
平成２４年度第１９回愛知県公募公債（１０年）	0.639	100,000	103,514	2023/3/28
平成２６年度第３回愛知県公募公債（１０年）	0.665	100,000	104,134	2024/4/30
平成２０年度第１回広島県公募公債（２０年）	2.34	100,000	122,794	2028/9/21
平成２２年度第１回広島県公募公債	1.37	100,000	104,072	2020/5/27
平成２４年度第４回広島県公募公債	0.81	100,000	104,225	2022/11/28
平成２２年度第１０回埼玉県公募公債	1.26	100,000	104,584	2021/1/28

国内債券インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄名	当期末 利率(%)	当期末 額面金額(千円)	当期末 評価額(千円)	当期末 償還年月日
平成２２年度第１１回埼玉県公募公債	1.28	193,000	202,175	2021/2/25
平成２４年度第１回埼玉県公募公債	1.05	100,000	105,016	2022/4/26
平成２４年度第９回埼玉県公募公債	0.844	100,000	104,566	2023/1/31
平成２５年度第１１回埼玉県公募公債	0.655	100,000	104,044	2024/3/26
平成２０年度第２回福岡県公募公債（２０年）	2.05	100,000	119,826	2028/12/20
平成２３年度第１回福岡県公募公債（２０年）	2.008	100,000	121,455	2031/5/23
平成２３年度第１回福岡県公募公債	1.18	200,000	209,550	2021/6/28
平成２４年度第１回福岡県公募公債（３０年）	2.12	100,000	127,364	2042/9/19
第１３回千葉県公募公債（２０年）	1.701	100,000	117,743	2032/10/15
平成２１年度第１２回千葉県公募公債	1.44	100,000	103,925	2020/2/25
平成２２年度第８回千葉県公募公債	1.0	120,000	124,147	2020/11/25
平成２５年度第５回千葉県公募公債	0.84	100,000	104,947	2023/8/25
平成２６年度第７回千葉県公募公債	0.429	100,000	102,489	2025/2/25
平成２７年度第１回千葉県公募公債	0.549	100,000	103,474	2025/5/23
第７８回共同発行市場公募地方債	1.39	100,000	103,209	2019/9/25
第８５回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	104,152	2020/4/24
第８７回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	103,934	2020/6/25
第８９回共同発行市場公募地方債	1.04	150,300	155,317	2020/8/25
第９１回共同発行市場公募地方債	0.9	100,000	103,027	2020/10/23
第９３回共同発行市場公募地方債	1.25	100,000	104,432	2020/12/25
第９４回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	104,501	2021/1/25
第９５回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	104,754	2021/2/25
第９７回共同発行市場公募地方債	1.38	356,000	375,021	2021/4/23
第９８回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	104,666	2021/5/25
第１０２回共同発行市場公募地方債	1.03	150,000	156,577	2021/9/24
第１０８回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	104,742	2022/3/25
第１０９回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	105,013	2022/4/25
第１１０回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	104,292	2022/5/25
第１１２回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	104,170	2022/7/25
第１１７回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	103,775	2022/12/22
第１１９回共同発行市場公募地方債	0.8	200,000	208,750	2023/2/24
第１２５回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	104,823	2023/8/25
第１２７回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	104,057	2023/10/25
第１２８回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	103,946	2023/11/24
第１３０回共同発行市場公募地方債	0.76	200,000	209,398	2024/1/25
第１３２回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	312,231	2024/3/25
第１３６回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	103,812	2024/7/25
第１３７回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	103,491	2024/8/23
第１４０回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	103,048	2024/11/25
第１４５回共同発行市場公募地方債	0.406	200,000	204,640	2025/4/25
第１４６回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	207,012	2025/5/23
第１５９回共同発行市場公募地方債	0.07	200,000	198,388	2026/6/25
平成２４年度第２回熊本県公募公債（１０年）	0.8	200,000	208,262	2022/10/26
平成２２年度第１回静岡市公募公債	1.008	100,000	103,485	2020/11/25
第１３回大阪市公募公債（２０年）	2.08	200,000	243,312	2030/6/14
平成２２年度第５回大阪市公募公債	1.2	100,000	103,931	2020/9/17
第５回名古屋市公募公債（３０年）	2.49	100,000	133,088	2039/3/18
第９回名古屋市公募公債（２０年）	2.07	100,000	120,591	2028/12/20
第１１回名古屋市公募公債（３０年）	1.774	100,000	119,027	2044/9/20
第４８１回名古屋市公募公債（１０年）	0.744	100,000	103,904	2022/12/20
平成２２年度第２回京都市公募公債	1.11	102,000	105,642	2020/8/27
平成２３年度第４回京都市公募公債	1.067	100,000	104,801	2021/12/22
平成２４年度第４回京都市公募公債	0.801	100,000	104,126	2022/10/21
平成２４年度第５回京都市公募公債	0.854	100,000	104,623	2023/1/31
第５回横浜市公募公債（２０年）	2.17	100,000	116,461	2025/6/20
第２０回横浜市公募公債（２０年）	2.1	100,000	121,284	2029/10/19
平成２１年度第１回横浜市公募公債	1.58	200,000	206,234	2019/5/24
平成２１年度第５回横浜市公募公債	1.56	100,000	103,838	2019/11/19
平成２３年度第５回横浜市公募公債	1.011	100,000	104,622	2022/1/28
平成２４年度第１０回札幌市公募公債（１０年）	0.8	100,000	104,215	2022/12/20
平成２６年度第９回札幌市公募公債（１０年）	0.43	100,000	102,515	2024/12/20
第１１回川崎市公募公債（２０年）	1.84	100,000	118,818	2030/10/18
第８１回川崎市公募公債	1.57	100,000	102,820	2019/3/20
第８２回川崎市公募公債	1.52	100,000	103,491	2019/9/20
平成２６年度第２回北九州市公募公債	0.451	100,000	102,676	2024/12/24
平成２６年度第５回福岡市公募公債	0.539	200,000	206,608	2024/10/28
平成２２年度第６回広島市公募公債	1.21	100,000	104,805	2021/5/31
平成２５年度第３回広島市公募公債	0.67	150,000	156,156	2024/2/23
平成２６年度第２回広島市公募公債	0.456	100,000	102,715	2024/12/25
平成２３年度第２回千葉市公募公債	1.06	200,000	209,384	2021/11/25
平成２６年度第１回岡山県公募公債（１０年）	0.33	200,000	203,502	2025/1/30
第１１３回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	120,555	2027/12/20
小計		15,824,590	16,991,916	
特殊債券（除く金融債）				
第３回政府保証公営企業債券（１５年）	2.2	300,000	326,577	2021/5/21
第５回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	101,000	104,084	2019/9/17
第１４回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	109,131	2021/9/13
第１９回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.668	100,000	104,019	2023/3/15
第２２回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	113,463	2023/6/19
第６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	107,221	2021/2/26
第９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	214,738	2021/3/26
第８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.4	100,000	137,875	2049/6/30
第９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	243,674	2029/9/28
第９８回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	300,000	310,644	2020/1/31
第１０７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	138,000	143,489	2020/5/29
第１０９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	129,334	2040/5/31
第１１０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	104,095	2020/6/30
第１１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	103,341	2020/8/31
第１１７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	200,000	206,850	2020/9/30

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第１２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	200,000	206,492	2020/11/30
第１２４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	200,000	208,786	2020/12/28
第１２５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	122,999	2030/12/27
第１２６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	104,501	2021/1/29
第１３３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	105,199	2021/4/30
第１３９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	100,000	104,695	2021/7/30
第１４７回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	300,000	313,602	2021/10/29
第１５５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	301,000	314,033	2022/1/31
第１６３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.901	200,000	209,240	2022/5/31
第１６６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.895	100,000	104,660	2022/6/30
第１７０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	100,000	104,321	2022/8/31
第１８０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.734	300,000	312,642	2022/12/28
第１８１回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.66	100,000	117,788	2032/12/28
第１８２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	100,000	104,865	2023/1/31
第１８４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.815	300,000	314,496	2023/2/28
第１８６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	200,000	208,048	2023/3/17
第１８９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	200,000	206,644	2023/4/28
第１９０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	300,000	311,271	2023/5/31
第１９３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	200,000	210,994	2023/6/30
第２００回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	148,000	155,659	2023/9/29
第２１３回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	100,000	104,407	2024/3/29
第２１４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.475	200,000	229,928	2034/3/31
第２１５回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	102,000	106,649	2024/4/30
第２２０回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	104,450	2024/6/28
第２２２回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	100,000	104,158	2024/7/31
第２２９回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	100,000	103,728	2024/10/31
第２３４回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	100,000	103,220	2024/12/27
第２３６回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	300,000	306,312	2025/1/31
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	100,000	103,023	2019/7/12

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第１８回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	101,000	104,245	2020/11/17
第１９回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	104,346	2020/12/14
第２２回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	101,000	106,071	2021/3/12
第２３回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	101,000	106,199	2021/4/16
第３２回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	100,000	104,315	2022/1/25
第４５回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	104,803	2023/2/17
第４７回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	103,311	2023/4/21
第４８回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.605	100,000	103,731	2023/5/16
第５１回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	105,284	2023/8/14
第５７回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	200,000	208,890	2024/2/16
第８２回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	99,388	2026/3/13
第４４回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.245	100,000	100,494	2019/6/20
第１４回道路債券	1.91	100,000	110,222	2022/12/20
第１７回道路債券	1.54	100,000	108,172	2022/12/20
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.35	400,000	479,688	2026/9/18
第２１回道路債券	2.75	100,000	133,657	2033/6/20
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	122,310	2028/3/17
第36回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.84	100,000	144,374	2048/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	123,025	2028/6/20
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	124,157	2029/4/20
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.38	100,000	103,181	2019/9/20
第81回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.03	100,000	104,555	2021/12/20
第82回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.07	300,000	314,961	2022/3/18
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	100,000	118,437	2032/9/17
第１０４回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	100,000	103,821	2023/3/20
第１０６回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.038	100,000	105,691	2023/3/20
第１１５回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.738	100,000	104,230	2023/9/20
第１５３回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	122,666	2055/3/19
第2回公営企業債券（２０年）	1.45	100,000	107,673	2022/12/20
第3回公営企業債券（２０年）	1.03	110,000	116,215	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券（１５年）	1.176	100,000	109,685	2029/1/26
第7回公営企業債券（２０年）	2.2	100,000	114,407	2024/3/22
第7回公営企業債券（３０年）	2.67	100,000	134,286	2035/6/20
第8回公営企業債券（２０年）	2.25	40,000	45,898	2024/3/22
第8回地方公共団体金融機構債券	1.453	100,000	103,864	2020/1/28
第１０回地方公共団体金融機構債券	1.424	100,000	104,014	2020/3/27
第１１回地方公共団体金融機構債券	1.465	100,000	104,256	2020/4/28
第１５回地方公共団体金融機構債券	1.093	200,000	207,036	2020/8/28
第２３回地方公共団体金融機構債券	1.418	100,000	105,511	2021/4/28
第２４回地方公共団体金融機構債券（２０年）	1.702	100,000	117,372	2032/9/28
第３８回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	519,815	2022/7/28
第４２回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	104,032	2022/11/28
第５８回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	104,477	2024/3/28
第６５回地方公共団体金融機構債券	0.535	200,000	206,244	2024/10/28
第８８回地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	98,944	2026/9/28
第１８回株式会社日本政策金融公庫社債	2.157	100,000	123,127	2031/5/9

国内債券インデックス マザーファンド　－第17期－

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第４３回都市再生債券	1.29	100,000	104,232	2020/9/18
第５回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	115,901	2024/12/20
第３４４回東京交通債券	1.67	100,000	108,799	2023/2/17
第３４６回東京交通債券	1.13	20,000	21,208	2023/6/20
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	20,226	21,364	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	19,392	20,628	2037/11/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	19,812	21,244	2037/11/10
第3回一般担保住宅金融公庫債券	2.1	100,000	103,788	2019/3/20
第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	21,556	22,979	2042/8/10
第4回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.03	21,204	22,602	2038/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	16,948	17,703	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	35,640	37,896	2037/5/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.94	20,712	21,939	2038/11/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	18,785	19,977	2037/5/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	21,905	23,246	2039/5/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	18,699	19,911	2037/5/10
第１０回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	2.09	21,627	22,825	2039/11/10
第１４回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.7	25,116	25,990	2032/5/10
第１５回貸付債権担保Ｓ種住宅金融支援機構債券	1.65	25,484	26,341	2032/5/10
第２３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	29,278	31,704	2044/4/10
第２４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	30,415	33,044	2044/5/10
第２５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	32,742	35,608	2044/6/10
第２８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	36,660	39,354	2044/9/10
第３０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	38,633	41,421	2044/11/10
第３１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	39,518	42,243	2044/12/10
第３３回一般担保住宅金融支援機構債券	1.47	100,000	103,018	2019/6/20
第３４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	83,582	89,295	2045/3/10
第３６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	19,809	20,752	2040/11/10
第３６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	44,187	46,957	2045/5/10
第３９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	19,927	20,868	2041/2/10
第４１回一般担保住宅金融支援機構債券	1.5	100,000	103,830	2019/12/20
第４２回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	19,582	20,849	2041/5/10
第４５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	48,632	51,830	2046/2/10
第４６回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	18,160	19,269	2041/9/10
第４６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	48,931	52,289	2046/3/10
第４８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	46,467	49,736	2046/5/10
第４９回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	20,019	21,352	2041/12/10
第５０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	91,672	97,194	2046/7/10
第５１回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	50,078	53,120	2046/8/10
第５３回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	20,526	21,791	2042/4/10
第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	61,535	64,811	2046/12/10
第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	59,490	62,667	2047/1/10
第５７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	59,372	62,589	2047/2/10
第５８回一般担保住宅金融支援機構債券	1.04	100,000	103,405	2020/9/18
第６０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	125,974	132,213	2047/5/10
第６０回一般担保住宅金融支援機構債券	1.33	100,000	104,693	2020/12/18
第６３回一般担保住宅金融支援機構債券	1.358	100,000	104,792	2020/12/18
第６６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	135,042	140,397	2047/11/10
第６７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	68,359	70,966	2047/12/10
第６８回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	68,413	71,679	2048/1/10
第６９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	69,930	73,369	2048/2/10
第７０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	62,661	65,661	2048/3/10
第７２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	64,421	66,936	2048/5/10
第７３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	69,270	72,892	2048/6/10
第７５回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	182,976	2031/6/13
第７９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	63,515	65,995	2048/12/10
第８４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	70,824	73,418	2049/5/10
第８５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	72,651	75,355	2049/6/10
第８７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	71,450	73,875	2049/8/10
第８８回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	119,443	2031/11/18
第８９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	150,894	155,950	2049/10/10
第９０回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	76,367	78,563	2049/11/10
第９２回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	157,872	161,496	2050/1/10
第９４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	84,377	86,650	2050/3/10
第９６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	87,550	89,582	2050/5/10
第９７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	86,803	89,332	2050/6/10
第９９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	176,934	182,654	2050/8/10
第１００回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	87,988	90,586	2050/9/10
第１０４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	93,050	95,836	2051/1/10
第１１３回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	97,724	97,529	2051/10/10
第１１４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	97,990	97,516	2051/11/10
第１１４回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	112,225	2027/9/17
第１１５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	98,362	98,360	2051/12/10
第１１６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	98,748	99,330	2052/1/10
第１１７回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	98,980	99,365	2052/2/10
第１３５回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	125,636	2043/3/20
第１２回農林漁業金融公庫債券	2.24	100,000	119,848	2027/3/19
第３８回東日本高速道路株式会社社債	0.03	100,000	99,956	2021/9/17
第３３回中日本高速道路株式会社社債	1.084	200,000	208,970	2021/9/17
第５９回中日本高速道路株式会社社債	0.309	100,000	101,178	2021/12/20
第３２回西日本高速道路株式会社社債	0.2	100,000	99,631	2026/10/19
第５３回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8	200,000	208,140	2022/12/20
第６０回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	103,897	2023/9/20
小計		18,775,470	20,130,919	
金融債券				
い第７７９号商工債	0.22	100,000	100,582	2020/4/27
い第７８６号商工債	0.22	300,000	301,884	2020/11/27
い第７９５号商工債	0.03	200,000	199,744	2021/8/27
い第７６８号農林債	0.3	100,000	100,558	2019/5/27
い第７８０号農林債	0.28	100,000	100,779	2020/5/27
い第７９５号農林債	0.03	100,000	99,872	2021/8/27
い第７９６号農林債	0.03	200,000	199,740	2021/9/27
第２９９回信金中金債（５年）	0.2	100,000	100,433	2019/10/25
第３００回信金中金債（５年）	0.225	300,000	301,536	2019/11/27
第３０３回信金中金債（５年）	0.25	100,000	100,632	2020/2/27
第３０９回信金中金債（５年）	0.25	100,000	100,681	2020/8/27

国内債券インデックス マザーファンド －第17期－

銘柄名	当期末 利率(%)	当期末 額面金額(千円)	当期末 評価額(千円)	当期末 償還年月日
第３１７回信金中金債（５年）	0.06	200,000	200,156	2021/4/27
第２０１号商工債（３年）	0.01	300,000	299,925	2019/10/25
小計		2,200,000	2,206,522	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第４５５回東京電力株式会社社債	2.075	120,000	123,018	2018/10/23
第４５９回東京電力株式会社社債	2.7	10,000	10,400	2019/1/29
第５２８回東京電力株式会社社債	1.905	100,000	103,245	2019/6/13
第５３６回東京電力株式会社社債	1.672	100,000	101,024	2018/1/29
第５４２回東京電力株式会社社債	1.602	100,000	101,292	2018/4/25
第５４４回東京電力株式会社社債	1.976	100,000	101,865	2018/6/25
第５５４回東京電力株式会社社債	1.608	100,000	102,590	2019/5/29
第４９９回中部電力株式会社社債	1.194	100,000	105,801	2023/6/23
第５０３回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	102,131	2025/3/25
第４７３回関西電力株式会社社債	1.665	100,000	102,880	2019/4/25
第４９６回関西電力株式会社社債	0.908	100,000	104,011	2025/2/25
第５０５回関西電力株式会社社債	0.24	100,000	99,723	2023/8/25
第３５８回中国電力株式会社社債	1.702	100,000	102,260	2018/10/25
第３８５回中国電力株式会社社債	0.728	100,000	103,284	2025/7/25
第２８６回北陸電力株式会社社債	1.99	100,000	103,847	2019/6/25
第３０７回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	106,107	2026/6/25
第４７１回東北電力株式会社社債	1.168	126,000	133,263	2023/12/25
第４８７回東北電力株式会社社債	0.17	100,000	99,347	2023/9/25
第２５３回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	104,827	2023/6/23
第４２６回九州電力株式会社社債	1.064	100,000	105,022	2024/2/23
第３２０回北海道電力株式会社社債	0.585	101,000	102,645	2021/12/24
第２１回清水建設株式会社無担保社債	0.39	100,000	100,419	2021/12/3
第７回キリンホールディングス株式会社無担保社債	1.639	100,000	103,756	2019/11/5
第１０回日本たばこ産業株式会社社債	0.358	100,000	101,110	2022/7/15
第５回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	100,000	103,571	2024/4/24
第２回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.856	100,000	103,200	2024/7/29
第３回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	1.94	100,000	101,932	2018/6/20
第１２回日本製紙株式会社無担保社債	0.97	100,000	103,615	2024/6/19
第８回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.948	100,000	102,365	2020/6/4
第１４回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.54	100,000	100,875	2019/7/19
第７回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	103,985	2024/10/23
第９回ＪＸホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	103,418	2024/6/4
第２２回ＪＦＥホールディングス株式会社無担保社債	0.703	100,000	102,612	2024/9/19
第２８回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.77	100,000	100,765	2018/8/31
第１０回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.494	100,000	101,140	2022/2/25
第５回日本電産株式会社無担保社債	0.001	100,000	99,828	2019/11/25
第３６回富士通株式会社無担保社債	0.562	200,000	202,978	2021/6/11
第１２回パナソニック株式会社無担保社債	0.387	100,000	100,620	2020/3/19
第１３回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	200,000	203,250	2022/3/18
第１６回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,145	2023/9/20

銘柄名	当期末 利率(%)	当期末 額面金額(千円)	当期末 評価額(千円)	当期末 償還年月日
第１２回株式会社デンソー無担保社債	0.01	100,000	99,550	2021/9/17
第２４回三菱重工業株式会社無担保社債	1.482	100,000	103,463	2019/12/9
第２９回三菱重工業株式会社無担保社債	0.662	100,000	102,934	2024/9/3
第３７回川崎重工業株式会社無担保社債	0.572	100,000	100,519	2018/7/18
第１回日本生命２０１２基金特定目的会社特定社債	0.87	100,000	100,813	2018/8/3
第６回ＪＡ三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	99,949	2022/1/27
第５７回日産自動車株式会社無担保社債	0.314	100,000	100,377	2019/3/20
第８回株式会社ドンキホーテホールディングス無担保社債	0.55	100,000	100,552	2020/3/12
第２１回株式会社ニコン無担保社債	0.864	100,000	103,811	2024/3/14
第５３回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.65	100,000	104,017	2020/3/12
第７８回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	102,680	2024/5/30
第７０回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	118,169	2033/3/4
第７４回三菱商事株式会社無担保社債	1.657	100,000	103,300	2019/7/29
第７６回三菱商事株式会社無担保社債	1.303	100,000	104,461	2021/5/24
第５０回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.904	100,000	102,376	2024/4/24
第２３回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	2.91	100,000	125,969	2029/10/16
第２５回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	1.31	100,000	103,811	2020/11/12
第３２回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債（劣後特約付）	1.62	100,000	105,340	2021/6/9
第８８回株式会社三菱東京ＵＦＪ銀行無担保社債	2.34	100,000	120,271	2027/4/20
第１回三井住友ＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	0.849	100,000	102,405	2024/9/12
第６回株式会社りそな銀行無担保社債（劣後特約付）	2.084	100,000	105,150	2020/3/4
第６回三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社無担保社債（劣後特約付）	1.9	100,000	104,722	2020/3/2
第１回みずほＦＧ無担保社債（実質破綻時免除特約・劣後特約）	0.95	100,000	102,979	2024/7/16
第２０回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	2.21	100,000	104,354	2019/7/24
第２２回株式会社三井住友銀行無担保社債（劣後特約付）	1.43	100,000	104,073	2020/9/28
第３回株式会社みずほ銀行無担保社債（劣後特約付）	2.04	100,000	105,835	2020/8/7
第３９回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.001	100,000	99,798	2019/12/20
第６６回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.233	100,000	100,247	2021/9/17
第２３回リコーリース株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,545	2021/9/24
第２回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.572	100,000	100,754	2021/3/18
第６７回アコム株式会社無担保社債	0.5	100,000	100,331	2019/6/6
第５５回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	104,233	2026/9/18
第４４回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,172	2023/10/25
第４８回三菱ＵＦＪリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,765	2022/1/26
第１９回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.412	100,000	100,537	2020/2/25
第４０回野村ホールディングス株式会社無担保社債	1.249	100,000	103,007	2020/2/26

当期末				
銘柄名	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第４３回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.454	100,000	100,573	2019/2/25
第９７回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	103,133	2024/4/26
第１１回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	1.12	100,000	103,745	2021/9/17
第１３回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	1.168	100,000	104,609	2023/6/26
第１０５回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	106,205	2026/6/17
第６３回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	105,324	2025/12/12
第３０回京王電鉄株式会社無担保社債	1.412	100,000	103,287	2019/12/9
第１７回東日本旅客鉄道株式会社社債	2.3	100,000	108,269	2021/2/25
第１９回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.36	100,000	110,673	2022/2/25
第５６回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.7	100,000	102,542	2018/12/20
第５７回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.376	200,000	246,456	2028/12/12
第９回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.28	19,000	20,997	2022/3/25
第１７回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	122,699	2028/3/17
第４６回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	92,013	2056/12/13
第７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.2	20,000	22,075	2022/5/10
第１６回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.875	100,000	104,203	2019/9/20
第４７回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.375	100,000	129,958	2039/12/16
第７１回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.917	100,000	121,694	2044/10/28
第６３回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	200,000	205,922	2023/3/20
第２０回ＫＤＤＩ株式会社無担保社債	0.803	100,000	103,126	2023/12/20
第２０回株式会社ＮＴＴドコモ無担保社債	0.73	100,000	102,718	2023/9/20
第１３回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	113,452	2025/6/20
第３０回電源開発株式会社無担保社債	1.394	100,000	103,623	2020/5/20
第３８回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	104,722	2023/12/20
第２７回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	104,222	2023/6/20
第３回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.491	100,000	101,064	2022/12/16
第２０回フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）円貨社債	0.16	100,000	99,358	2021/10/14
第１１回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.437	100,000	100,584	2020/12/11
第１５回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	99,867	2024/1/26
第４回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンＡＢ円貨社債	0.325	100,000	100,062	2019/9/4
第６回スヴェンスカ・ハンデルスバンケンＡＢ円貨社債	0.292	100,000	99,615	2020/9/3
第１回ＨＳＢＣ・ホールディングス・ピーエルシー円貨社債	0.45	100,000	100,580	2021/9/24
第６回ビー・エヌ・ピー・パリバ円貨社債	0.439	100,000	100,465	2019/9/17
第９回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	0.457	100,000	100,454	2019/1/17
第１１回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	0.284	100,000	100,224	2020/1/16
第１１回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.3	100,000	100,319	2021/1/22
第９回オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	0.343	100,000	100,437	2020/7/24
第２７回ラボバンク・ネダーランド円貨社債	0.38	200,000	200,092	2020/5/22
第８回ソシエテ　ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	99,623	2023/6/2
小　計		11,796,000	12,246,422	
合　計		276,171,060	299,906,867	

投資信託財産の構成

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	299,906,867	99.0
コール・ローン等、その他	3,174,714	1.0
投資信託財産総額	303,081,581	100.0

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2017年5月29日現在
(A) 資産	303,186,530,044円
コール・ローン等	2,390,259,799
公社債(評価額)	299,906,867,638
未収利息	773,449,322
前払費用	11,004,285
差入委託証拠金	104,949,000
(B) 負債	2,426,281,639
未払金	2,297,210,528
未払解約金	24,116,283
未払利息	5,828
差入委託証拠金代用有価証券	104,949,000
(C) 純資産総額(A－B)	300,760,248,405
元本	217,479,302,929
次期繰越損益金	83,280,945,476
(D) 受益権総口数	217,479,302,929口
1万口当たり基準価額(C／D)	13,829円

■損益の状況

項目	当期 自 2016年5月31日 至 2017年5月29日
(A) 配当等収益	2,956,981,053円
受取利息	2,957,878,676
支払利息	△897,623
(B) 有価証券売買損益	△9,324,730,663
売買益	130,140,645
売買損	△9,454,871,308
(C) 先物取引等取引損益	△4,584,460
取引益	18,702,004
取引損	△23,286,464
(D) その他費用	△57,746
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	△6,372,391,816
(F) 前期繰越損益金	93,058,233,527
(G) 追加信託差損益金	15,883,710,017
(H) 解約差損益金	△19,288,606,252
(I) 計　(E＋F＋G＋H)	83,280,945,476
次期繰越損益金(I)	83,280,945,476

(注1) (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。
(注2) (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。
(注3) (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。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は226,592,497,472円、期中追加設定元本額は40,375,203,761円、期中一部解約元本額は49,488,398,304円です。
※担保に供している資産
先物取引に係る差入委託証拠金の代用として、次の有価証券を差し入れております。
国債証券　104,770,000円
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC日本債券インデックス・オープンS	69,940,086,297円
DC日本債券インデックス・オープンP	31,218,115,591円
DCマイセレクション50	18,218,093,765円
DCマイセレクション25	15,767,023,152円
SMT 国内債券インデックス・オープン	9,626,726,316円
日本債券ファンド・シリーズ1	9,295,699,138円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	7,375,458,848円
DCマイセレクションS50	7,193,338,355円
DCマイセレクションS25	6,434,799,757円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	6,239,507,705円
DCマイセレクション75	4,969,203,943円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,686,337,684円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	4,647,096,765円

SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,978,277,779円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,567,062,262円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,826,533,196円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,659,990,333円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,596,667,834円
DCマイセレクションS75	1,391,595,812円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,274,132,238円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,229,870,247円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,051,592,120円
世界経済インデックスファンド	933,952,975円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	885,841,161円
DC世界経済インデックスファンド	864,913,294円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	581,203,933円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	484,562,095円
DC日本債券インデックス・オープン	450,914,639円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	389,697,859円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	352,118,262円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	258,985,553円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	236,807,865円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	191,776,992円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	190,010,457円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	104,974,542円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	103,362,839円
SMT インデックスバランス・オープン	85,193,106円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	59,407,120円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	35,490,769円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	28,330,415円
SBI資産設計オープン(分配型)	22,091,976円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	17,050,168円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	9,335,858円
SMT日米インデックスバランス・オープン	2,915,014円
エマージング株式オープン	2,227,240円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	929,660円

お知らせ

該当事項はありません。

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）
第５期～第７期(2017年１月11日～2017年７月７日)

○当ファンドの仕組み

商品分類	－	
信託期間	2016年２月17日以降、無期限とします。	
運用方針	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主要投資対象とし、MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・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。実質組入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	野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド	マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	外国の株式を主要投資対象とします。
主な投資制限	野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド	株式への実質投資割合には制限を設けません。
	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。
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配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案して分配します。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。	

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率		期中騰落率				
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2016年2月17日	10,000	－	－	100.00	－	－	－	－	1
1期(2016年7月7日)	9,600	75	△ 3.3	96.89	△ 3.1	94.9	2.1	2.9	2,295
2期(2016年9月7日)	10,220	30	6.8	103.62	6.9	95.8	1.3	2.8	2,493
3期(2016年11月7日)	9,932	20	△ 2.6	101.06	△ 2.5	95.9	1.3	2.6	2,392
4期(2017年1月10日)	11,924	40	20.5	121.67	20.4	95.5	1.8	2.6	2,553
5期(2017年3月7日)	12,189	30	2.5	124.89	2.6	95.3	2.1	2.6	3,139
6期(2017年5月8日)	12,425	40	2.3	127.86	2.4	95.8	1.5	2.5	4,028
7期(2017年7月7日)	12,551	55	1.5	129.78	1.5	96.6	0.7	2.6	5,110

＊基準価額の騰落率は分配金込み。
＊当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。
＊株式先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

＊ベンチマーク（＝MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・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。
＊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

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
			騰落率		騰落率			
	（期首）	円	%		%	%	%	%
	2017年１月10日	11,924	－	121.67	－	95.5	1.8	2.6
第５期	１月末	11,791	△1.1	120.39	△1.1	95.6	1.8	2.6
	２月末	12,019	0.8	122.94	1.0	95.2	1.8	2.6
	（期末）							
	2017年３月７日	12,219	2.5	124.89	2.6	95.3	2.1	2.6
	（期首）							
	2017年３月７日	12,189	－	124.89	－	95.3	2.1	2.6
第６期	３月末	12,104	△0.7	124.17	△0.6	95.0	2.4	2.5
	４月末	12,186	△0.0	124.91	0.0	95.5	1.8	2.6
	（期末）							
	2017年５月８日	12,465	2.3	127.86	2.4	95.8	1.5	2.5
	（期首）							
	2017年５月８日	12,425	－	127.86	－	95.8	1.5	2.5
第７期	５月末	12,330	△0.8	126.93	△0.7	95.7	1.7	2.6
	６月末	12,523	0.8	128.89	0.8	95.7	1.2	2.6
	（期末）							
	2017年７月７日	12,606	1.5	129.78	1.5	96.6	0.7	2.6

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

○当作成期中の運用経過と今後の運用方針

[基準価額の推移]

基準価額は、当作成期首11,924円から当作成期末12,551円（分配落ち後）となりました。この間、合計125円の分配金をお支払いしましたので、分配金を考慮した値上がり額は752円となりました。当作成期の基準価額の騰落率は＋6.3%（分配金再投資ベース）となり、ベンチマークの＋6.7%を0.4%下回りました。主要投資国の株式市場が、米国新政権の政策への期待、フランス大統領選の結果に対する安堵感、また欧米の企業決算や経済指標の堅調さなどを背景に上昇したことから、基準価額は上昇しました。

[運用経過]

［外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド］受益証券を主要な投資対象とし、当作成期を通じてほぼ全額を投資しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行いませんでした。

［外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド］の運用につきましては、株式の実質組入比率（投資信託証券や先物を含む）は、当作成期を通じ高位に維持しました。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。

[分配金]

当作成期を通じて、配当等収益から、１万口当たり計125円の収益分配を行いました。尚、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。

[今後の運用方針]

主要投資対象である［外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド］受益証券を高位に組み入れ、引き続き、MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・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ます。

［外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド］の運用につきましては、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。

※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）のベンチマークである「MSCI-KOKUSAI指数（円換算ベース・為替ヘッジなし）」は、主要投資対象である外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドのベンチマークである「MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）」と同一の指数です。

○１万口当たりの費用明細

（2017年１月11日～2017年７月７日）

項目	第５期～第７期 金額	第５期～第７期 比率	項目の概要
	円	%	
(a) 信託報酬	10	0.084	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(8)	(0.068)	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）	(1)	(0.005)	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）	(1)	(0.011)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売買委託手数料	0	0.001	(b)売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（株式）	(0)	(0.001)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(c) 有価証券取引税	0	0.003	(c)有価証券取引税＝作成期間の有価証券取引税÷作成期間の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（株式）	(0)	(0.003)	
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	△ 0	△0.003	(d)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（保管費用）	(1)	(0.005)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（監査費用）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（その他）	(△ 1)	(△0.010)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合計	10	0.085	
作成期間の平均基準価額は、12,158円です。			

＊作成期間の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
＊各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
＊売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
＊各比率は１万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第３位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

（2017年１月11日～2017年７月７日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第５期～第７期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,205,382	2,792,358	213,658	501,795

＊単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

（2017年１月11日～2017年７月７日）

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	第５期～第７期
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	22,964,263千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	349,439,183千円
(c) 売買高比率 (a) ／ (b)	0.06

＊(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１月11日～2017年７月７日）

利害関係人との取引状況

＜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）＞

該当事項はございません。

＜外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド＞

区分	第５期～第７期					
	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	22,619	3,347	14.8	17,556	142	0.8

平均保有割合　1.1%

※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。

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。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

（2017年１月11日～2017年７月７日）

第５期首残高（元本）	設定元本	解約元本	第７期末残高（元本）	取　引　の　理　由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	－	－	1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

（2017年７月７日現在）

親投資信託残高

銘　　柄	第４期末	第７期末	
	口　　数	口　　数	評　価　額
	千口	千口	千円
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,126,001	2,117,725	5,110,071

＊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７月７日現在）

項　　目	第７期末	
	評　価　額	比　　率
	千円	%
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	5,110,071	99.5
コール・ローン等、その他	24,175	0.5
投資信託財産総額	5,134,246	100.0

＊金額の単位未満は切り捨て。

＊外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、第７期末における外貨建て純資産（382,759,608千円）の投資信託財産総額（383,324,046千円）に対する比率は99.9%です。

＊外貨建て資産は、第７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＝113.28円、１カナダドル＝87.28円、１英ポンド＝146.83円、１スイスフラン＝117.88円、１スウェーデンクローナ＝13.41円、１ノルウェークローネ＝13.54円、１デンマーククローネ＝17.38円、１ユーロ＝129.28円、１香港ドル＝14.50円、１シンガポールドル＝81.93円、１豪ドル＝85.84円、１ニュージーランドドル＝82.54円、１新シェケル＝32.11円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	第５期末 2017年３月７日現在	第６期末 2017年５月８日現在	第７期末 2017年７月７日現在
	円	円	円
(A) 資産	**3,181,471,062**	**4,047,821,754**	**5,134,246,687**
コール・ローン等	1,066,133	6,449,639	1,757,519
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	3,139,664,435	4,028,402,422	5,110,071,016
未収入金	40,740,494	12,969,693	22,418,152
(B) 負債	**41,491,490**	**19,023,933**	**23,660,730**
未払収益分配金	7,728,501	12,969,693	22,394,625
未払解約金	32,999,999	5,000,000	－
未払信託報酬	748,966	1,034,846	1,242,822
未払利息	1	11	2
その他未払費用	14,023	19,383	23,281
(C) 純資産総額（Ａ－Ｂ）	**3,139,979,572**	**4,028,797,821**	**5,110,585,957**
元本	2,576,167,186	3,242,423,339	4,071,750,138
次期繰越損益金	563,812,386	786,374,482	1,038,835,819
(D) 受益権総口数	**2,576,167,186口**	**3,242,423,339口**	**4,071,750,138口**
１万口当たり基準価額（Ｃ／Ｄ）	**12,189円**	**12,425円**	**12,551円**

（注）第５期首元本額は2,141,411,294円、第５～７期中追加設定元本額は2,363,549,787円、第５～７期中一部解約元本額は433,210,943円、１口当たり純資産額は、第５期1.2189円、第６期1.2425円、第７期1.2551円です。

○損益の状況

項目	第５期 2017年１月11日～ 2017年３月７日	第６期 2017年３月８日～ 2017年５月８日	第７期 2017年５月９日～ 2017年７月７日
	円	円	円
(A) 配当等収益	**△ 98**	**△ 160**	**△ 247**
支払利息	△ 98	△ 160	△ 247
(B) 有価証券売買損益	**79,390,723**	**109,533,833**	**74,681,191**
売買益	81,930,163	110,114,172	76,932,442
売買損	△ 2,539,440	△ 580,339	△ 2,251,251
(C) 信託報酬等	**△ 762,989**	**△ 1,054,229**	**△ 1,266,103**
(D) 当期損益金（Ａ＋Ｂ＋Ｃ）	**78,627,636**	**108,479,444**	**73,414,841**
(E) 前期繰越損益金	**293,636,476**	**356,396,553**	**421,256,777**
(F) 追加信託差損益金	**199,276,775**	**334,468,178**	**566,558,826**
（配当等相当額）	(91,180,957)	(218,399,866)	(422,978,886)
（売買損益相当額）	(108,095,818)	(116,068,312)	(143,579,940)
(G) 計（Ｄ＋Ｅ＋Ｆ）	**571,540,887**	**799,344,175**	**1,061,230,444**
(H) 収益分配金	**△ 7,728,501**	**△ 12,969,693**	**△ 22,394,625**
次期繰越損益金（Ｇ＋Ｈ）	**563,812,386**	**786,374,482**	**1,038,835,819**
追加信託差損益金	199,276,775	334,468,178	566,558,826
（配当等相当額）	(92,151,113)	(220,376,496)	(425,824,465)
（売買損益相当額）	(107,125,662)	(114,091,682)	(140,734,361)
分配準備積立金	364,535,611	451,906,304	472,276,993

＊損益の状況の中で**(B)有価証券売買損益**は各期末の評価換えによるものを含みます。
＊損益の状況の中で**(C)信託報酬等**には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
＊損益の状況の中で**(F)追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○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＞

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

第15期(計算期間：2016年４月１日～2017年３月31日)

○当期中の運用経過と今後の運用方針

[運用経過]

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

（２）基準価額は、期首20,145円から期末23,082円となりました。ベンチマークとしているMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）が15.0%の上昇となったのに対して、基準価額は14.6%の上昇となりました。

[今後の運用方針]

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

＊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。

＊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

○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
外国	アメリカ	口	千米ドル	口	千米ドル
	AGNC INVESTMENT CORP	－	－	－	－
		(32,900)	(607)		
	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	7,600	741	－	－
	AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	－	－	1,200	22
		(△ 32,900)	(△ 607)		
	AMERICAN TOWER CORP	2,300	266	1,700	181
	ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	10,000	108	6,000	60
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	420	73	520	88
	BOSTON PROPERTIES	800	104	600	73
	BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	12,700	346	－	－
	CAMDEN PROPERTY TRUST	700	56	800	63
	COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	51,000	745	－	－
	CROWN CASTLE INTL CORP	3,600	332	900	75
	DIGITAL REALTY TRUST INC	2,100	211	800	75
	EQUINIX INC	1,200	448	240	85
	EQUITY RESIDENTIAL	1,000	68	1,300	82
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	240	54	350	79
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,700	149	900	67
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	390	63	－	－
	GGP INC	－	－	－	－
		(56,500)	(1,667)		
	GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	2,100	62	－	－
		(△ 56,500)	(△1,667)		
	HCP INC	1,800	66	2,700	78
	HOST HOTELS & RESORTS INC	－	－	3,800	71
	IRON MOUNTAIN INC	5,400	191	－	－
	KIMCO REALTY CORP	2,000	60	2,500	63
	LIBERTY PROPERTY TRUST	－	－	700	26
	MACERICH CO /THE	－	－	1,000	75
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,000	366	－	－
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	14,500	610	－	－
	PARK HOTELS & RESORTS INC-WI	－	－	11,380	333
		(11,380)	(277)		
	PROLOGIS INC	2,300	115	1,600	79
	PUBLIC STORAGE	1,000	227	790	166
	QUALITY CARE PROPERTIES	－	－	9,480	117
		(9,480)	(－)		
	REALTY INCOME CORP	2,100	140	1,200	65
	REGENCY CENTERS CORP	6,300	442	－	－
	SBA COMMUNICATIONS CORP	－	－	－	－
		(12,000)	(1,207)		
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1,500	292	750	133
	UDR INC	1,700	59	2,100	72
	VENTAS INC	4,300	281	1,200	73
	VEREIT INC	11,000	113	4,000	37
	VORNADO REALTY TRUST	600	59	700	67
	WELLTOWER INC	2,100	146	1,300	85
	WEYERHAEUSER CO	2,000	58	5,800	183
	小計	160,450	7,067	66,310	2,689
		(32,860)	(1,485)		

	銘柄	買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	カナダ	口	千カナダドル	口	千カナダドル
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,500	68	－	－
	小計	2,500	68	－	－
	イギリス		千英ポンド		千英ポンド
	BRITISH LAND	7,000	44	9,000	56
	HAMMERSON PLC	9,000	52	8,000	43
	SEGRO PLC	16,000 (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 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
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	
小計 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	
小計 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	
	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	
	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＞

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／海外／債券／インデックス型	
信託期間	信託期間は2016年2月3日から2026年3月9日までです。	
運用方針	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	外国債券インデックスマザーファンド	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）	外貨建資産への実質投資割合には、制限を設けません。
	外国債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。 (1)分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 (2)分配金額については、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP（適格機関投資家専用）

運用報告書（全体版）

第5期（決算日　2017年3月7日）
第6期（決算日　2017年5月8日）
第7期（決算日　2017年7月7日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申しあげます。
さて、当ファンドはこのたび上記の決算を行いましたので、ここに期中の運用状況をご報告申しあげます。
今後とも一層のご愛顧を賜りますよう、お願い申しあげます。

お問い合わせ先
フリーダイヤル：0120-668001
（受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。）

PCサイト　http://www.smtam.jp/
モバイルサイト　http://m.smtam.jp/

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-8574　東京都港区芝三丁目33番1号

【本運用報告書の記載について】
・基準価額および税込分配金は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・設定日の基準価額は当初設定価額を、純資産総額は当初設定元本を記載しています。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

設定以来の運用実績

作成期	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
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
		円	円	%		%	%	%	百万円
第1	設定日(2016年 2月 3日)	10,000	－	－	10,000	－	－	－	0.5
	第1期(2016年 7月 7日)	8,754	49	△12.0	8,759	△12.4	98.3	0.6	1,865
第2	第2期(2016年 9月 7日)	8,857	30	1.5	8,989	2.6	98.4	0.6	1,967
	第3期(2016年11月 7日)	8,772	27	△0.7	8,789	△2.2	98.2	0.7	1,951
	第4期(2017年 1月10日)	9,315	30	6.5	9,466	7.7	97.9	0.8	1,867
第3	第5期(2017年 3月 7日)	9,109	25	△1.9	9,258	△2.2	98.2	0.5	2,174
	第6期(2017年 5月 8日)	9,234	24	1.6	9,412	1.7	97.9	0.9	2,701
	第7期(2017年 7月 7日)	9,407	28	2.2	9,613	2.1	98.6	0.3	3,599

(注1)基準価額の騰落率は分配金込みです。
(注2)当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当作成期中の基準価額と市況の推移

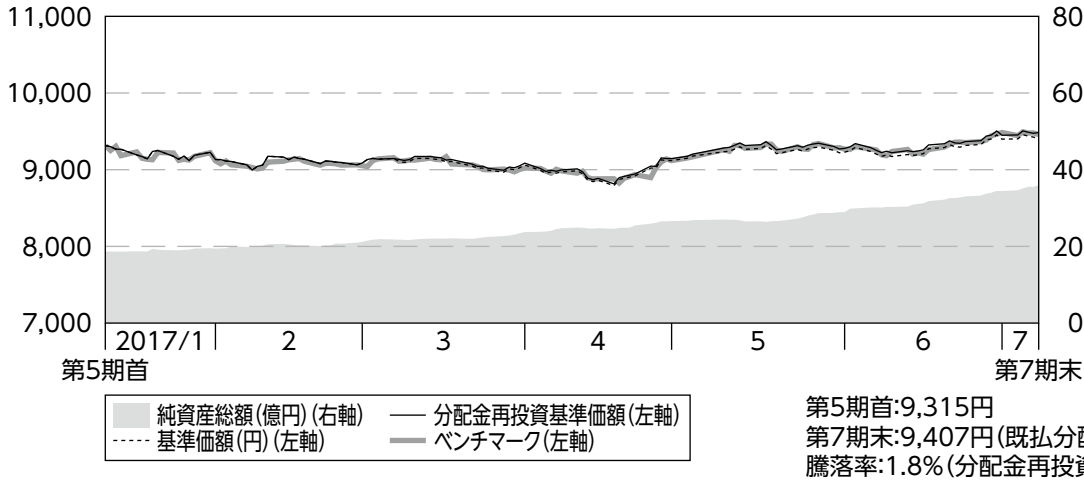
決算期	年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
			騰落率		騰落率		
		円	%		%	%	%
第5期	(期　首)2017年1月10日	9,315	－	9,466	－	97.9	0.8
	1月末	9,132	△2.0	9,263	△2.1	98.9	0.1
	2月末	9,088	△2.4	9,199	△2.8	98.4	0.4
	(期　末)2017年3月 7日	9,134	△1.9	9,258	△2.2	98.2	0.5
第6期	(期　首)2017年3月 7日	9,109	－	9,258	－	98.2	0.5
	3月末	9,061	△0.5	9,169	△1.0	98.0	0.8
	4月末	9,119	0.1	9,267	0.1	98.3	0.6
	(期　末)2017年5月 8日	9,258	1.6	9,412	1.7	97.9	0.9
第7期	(期　首)2017年5月 8日	9,234	－	9,412	－	97.9	0.9
	5月末	9,229	△0.1	9,418	0.1	97.0	1.5
	6月末	9,399	1.8	9,639	2.4	97.3	1.2
	(期　末)2017年7月 7日	9,435	2.2	9,613	2.1	98.6	0.3

(注1)期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。
(注2)当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。
(注3)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。
シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、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です。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定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。
基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。
設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

当作成期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



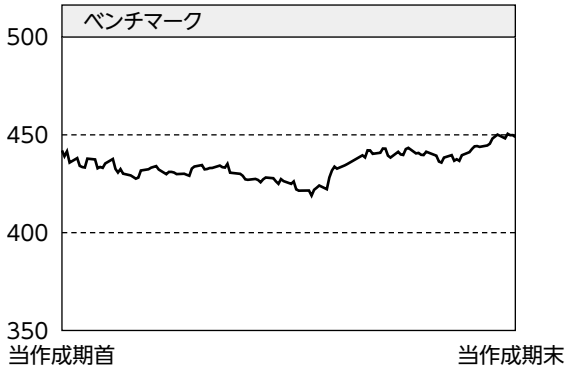
第5期首:9,315円
第7期末:9,407円(既払分配金77円)
騰落率:1.8%(分配金再投資ベース)

(注1)分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)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。
(注2)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3)分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2017年1月10日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

基準価額は4月中旬にかけて、米国トランプ政権の政策不透明感の高まり、シリアや北朝鮮を巡る地政学リスクの高まり、またフランス大統領選挙などを巡る欧州政治リスクへの警戒感から、外国為替市場で円高推移となり、下落しました。4月中旬以降5月中旬にかけては、フランス大統領選挙の結果や米国の利上げ期待が高まったことを背景に円安方向に転じたことや、トランプ大統領を巡る米国の政情不安から金利が低下(債券価格は上昇)したことから、基準価額は上昇に転じました。その後の基準価額は、6月中旬までもみ合いで推移した後、当作成期末にかけて、ECB(欧州中央銀行)やBOE(英中央銀行)の金融緩和縮小観測などを背景に欧米金利が上昇したことを受けて円安基調推移となったことから、上昇しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2月にかけてもみ合いで推移した後、3月に入ると米国の利上げ観測が強まったことから、上昇しました。6月下旬にかけては、地政学リスクや米国の政情不安などから金利は低下しましたが、その後作成期末にかけては、主要中央銀行による金融緩和縮小観測の強まりを受けて、上昇しました。

外国為替市場では、4月中旬にかけて、米国の政策不透明感が高まったことなどから円高推移となりました。5月中旬にかけては、フランス大統領選挙結果などから円安となりましたが、6月中旬にかけては米国の政情不安から、円高となりました。その後作成期末にかけては、欧米金利が上昇に転じたことを受けて、円安となりました。

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、円ベース）に連動することを目的とする「外国債券インデックス マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れ、運用しました。

【「外国債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

ベンチマークであるシティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

(1)債券組入比率

先物を含む債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。キャッシュ部分は運用の効率化を図るため債券先物取引と為替予約取引を利用しました。

(2)ポートフォリオ構成

ベンチマークの通貨構成比率やデュレーション・満期構成等の諸属性を極力反映させることでベンチマークとの連動を目指しました。

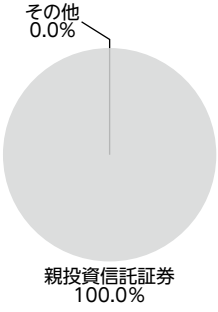
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

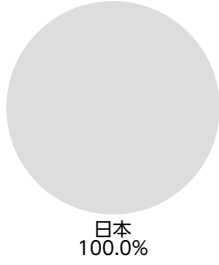
	当作成期末
	2017年7月7日
外国債券インデックス マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

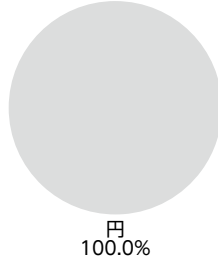
○資産別配分



○国別配分



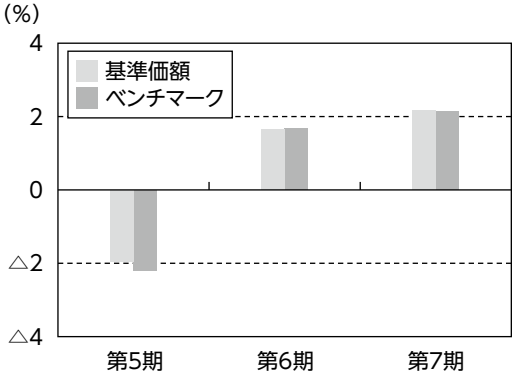
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額(分配金込み)とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。
ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、信託報酬および為替評価差要因※です。

※当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異です。

分配金

分配金額は、各期ごとの経費控除後の利子・配当等収益、基準価額水準等を考慮して以下の通りとさせていただきました。
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（1万口当たり・税引前）

項目		第5期	第6期	第7期
		2017年1月11日～2017年3月7日	2017年3月8日～2017年5月8日	2017年5月9日～2017年7月7日
当期分配金	（円）	25	24	28
（対基準価額比率）	（%）	(0.274)	(0.259)	(0.297)
当期の収益	（円）	25	24	28
当期の収益以外	（円）	－	－	－
翌期繰越分配対象額	（円）	50	61	217

（注1）「当期の収益」及び「当期の収益以外」は、円未満を切り捨てて表示していることから、合計した額が「当期分配金」と一致しない場合があります。
（注2）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税引前）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3）－印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

外国債券インデックス マザーファンド受益証券への投資を通じて、日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）に連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当作成期 (2017年1月11日~2017年7月7日) 金額	比率	項目の概要
(a) 信託報酬	6円	0.063%	(a)信託報酬=〔期中の平均基準価額〕×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,171円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。
(投信会社)	(4)	(0.047)	委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価
(販売会社)	(0)	(0.005)	交付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、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(1)	(0.011)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b)売買委託手数料=$\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕}$×10,000 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)	(−)	(−)	
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(商品)	(−)	(−)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	−	−	(c)有価証券取引税=$\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕}$×10,000 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)	(−)	(−)	
(新株予約権証券)	(−)	(−)	
(オプション証券等)	(−)	(−)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(−)	(−)	
(公社債)	(−)	(−)	
(投資信託証券)	(−)	(−)	
(d) その他費用	1	0.015	(d)その他費用=$\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕}$×10,000 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(1)	(0.012)	
(監査費用)	(0)	(0.003)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	7	0.078	

(注1)期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって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。
なお、売買委託手数料、有価証券取引税及びその他費用は、当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。
(注2)各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
(注3)「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜親投資信託受益証券の設定、解約状況＞

	当作成期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	697,790	1,839,214	73,174	193,856

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
金銭信託	5	5	100.0	5	5	100.0
コール・ローン	234	55	23.5	255	59	23.1

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

＜外国債券インデックス マザーファンド＞

区分	当作成期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替直物取引	20,976	2	0.0	5,956	245	4.1
金銭信託	1,401	1,401	100.0	1,401	1,401	100.0
コール・ローン	274,045	64,001	23.4	274,861	64,072	23.3

〈平均保有割合　1.2%〉
(注1)平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当ファンドの親投資信託所有口数の割合です。
(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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す。

組入資産の明細

＜親投資信託残高＞

	前作成期末	当作成期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
外国債券インデックス マザーファンド	700,058	1,324,673	3,598,209

(注)親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、83,345,124千口です。

投資信託財産の構成

項目	当作成期末	
	評価額	比率
	千円	%
外国債券インデックス マザーファンド	3,598,209	99.6
コール・ローン等、その他	12,672	0.4
投資信託財産総額	3,610,881	100.0

(注1)外国債券インデックス マザーファンドにおいて、当作成期末における外貨建純資産(225,348,214千円)の投資信託財産総額(227,074,436千円)に対する比率は99.2%です。

(注2)外貨建資産は、当作成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＝113.28円　1カナダドル＝87.28円　1メキシコペソ＝6.21円
1ユーロ＝129.28円　1イギリスポンド＝146.83円　1スイスフラン＝117.88円
1スウェーデンクローナ＝13.41円　1ノルウェークローネ＝13.54円　1デンマーククローネ＝17.38円
1ポーランドズロチ＝30.51円　1オーストラリアドル＝85.84円　1シンガポールドル＝81.93円
1マレーシアリンギット＝26.36円　1南アフリカランド＝8.44円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	第5期末 2017年3月7日現在	第6期末 2017年5月8日現在	第7期末 2017年7月7日現在
(A)資産	2,188,074,432円	2,708,684,654円	3,610,881,447円
コール・ローン等	6,983,265	7,483,819	645,187
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	2,174,091,167	2,700,131,721	3,598,209,946
未収入金	7,000,000	1,069,114	12,026,314
(B)負債	13,381,711	7,573,861	11,386,210
未払収益分配金	5,968,334	7,020,363	10,714,394
未払解約金	7,000,000	—	—
未払信託報酬	396,850	531,365	644,935
未払利息	10	16	1
その他未払費用	16,517	22,117	26,880
(C)純資産総額(A-B)	2,174,692,721	2,701,110,793	3,599,495,237
元本	2,387,333,681	2,925,151,587	3,826,569,584
次期繰越損益金	△212,640,960	△224,040,794	△227,074,347
(D)受益権総口数	2,387,333,681口	2,925,151,587口	3,826,569,584口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,109円	9,234円	9,407円

■損益の状況

項目	第5期 自 2017年1月11日 至 2017年3月7日	第6期 自 2017年3月8日 至 2017年5月8日	第7期 自 2017年5月9日 至 2017年7月7日
(A)配当等収益	△72円	△229円	△304円
支払利息	△72	△229	△304
(B)有価証券売買損益	△33,848,839	49,989,831	71,542,252
売買益	1,244,873	50,227,379	72,029,898
売買損	△35,093,712	△237,548	△487,646
(C)信託報酬等	△413,367	△553,482	△671,815
(D)当期損益金(A+B+C)	△34,262,278	49,436,120	70,870,133
(E)前期繰越損益金	6,843,217	△32,812,559	9,141,118
(F)追加信託差損益金	△179,253,565	△233,643,992	△296,371,204
(配当等相当額)	(3,948,144)	(7,027,726)	(13,385,611)
(売買損益相当額)	(△183,201,709)	(△240,671,718)	(△309,756,815)
(G)計(D+E+F)	△206,672,626	△217,020,431	△216,359,953
(H)収益分配金	△5,968,334	△7,020,363	△10,714,394
次期繰越損益金(G+H)	△212,640,960	△224,040,794	△227,074,347
追加信託差損益金	△179,253,565	△233,643,992	△296,371,204
(配当等相当額)	(4,157,893)	(7,285,222)	(13,834,343)
(売買損益相当額)	(△183,411,458)	(△240,929,214)	(△310,205,547)
分配準備積立金	7,971,755	10,821,223	69,296,857
繰越損益金	△41,359,150	△1,218,025	—

(注1)(B)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。
(注2)(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。
(注3)(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。

〈注記事項〉
※当ファンドの第5期首元本額は2,004,488,006円、第5～7期中追加設定元本額は2,111,141,431円、第5～7期中一部解約元本額は289,059,853円です。
※分配金の計算過程

項　　目	第　5　期	第　6　期	第　7　期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	7,096,872円	10,007,085円	12,195,165円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円	－円	57,515,550円
(C) 収益調整金額	4,157,893円	7,285,222円	13,834,343円
(D) 分配準備積立金額	6,843,217円	7,834,501円	10,300,536円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	18,097,982円	25,126,808円	93,845,594円
(F) 期末残存口数	2,387,333,681口	2,925,151,587口	3,826,569,584口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	75円	85円	245円
(H) 分配金額(1万口当たり)	25円	24円	28円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	5,968,334円	7,020,363円	10,714,394円

分配金のお知らせ

	第5期	第6期	第7期
1万口当たり分配金	25円	24円	28円

(注)分配金は各決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

お知らせ

該当事項はありません。

外国債券インデックス マザーファンド

運 用 報 告 書

第17期（決算日　2017年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

信　託　期　間	信託期間は2000年5月30日から無期限です。
運　用　方　針	日本を除く世界の主要国の公社債を中心に投資を行い、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	日本を除く世界の主要国の公社債を主要投資対象とします。
組　入　制　限	外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

当親投資信託はこのたび上記の決算を行いましたので、期中の運用状況をご報告申しあげます。

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】
・基準価額は1万口当たりで表記しています。
・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
・－印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

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
第13期(2013年5月29日)	23,637	34.0	391.203	34.5	98.7	0.0	244,967
第14期(2014年5月29日)	25,092	6.2	414.505	6.0	97.2	1.3	222,288
第15期(2015年5月29日)	28,802	14.8	477.014	15.1	98.2	0.7	217,598
第16期(2016年5月30日)	26,579	△7.7	436.679	△8.5	97.9	0.9	212,962
第17期(2017年5月29日)	26,633	0.2	440.540	0.9	97.3	1.4	219,477

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

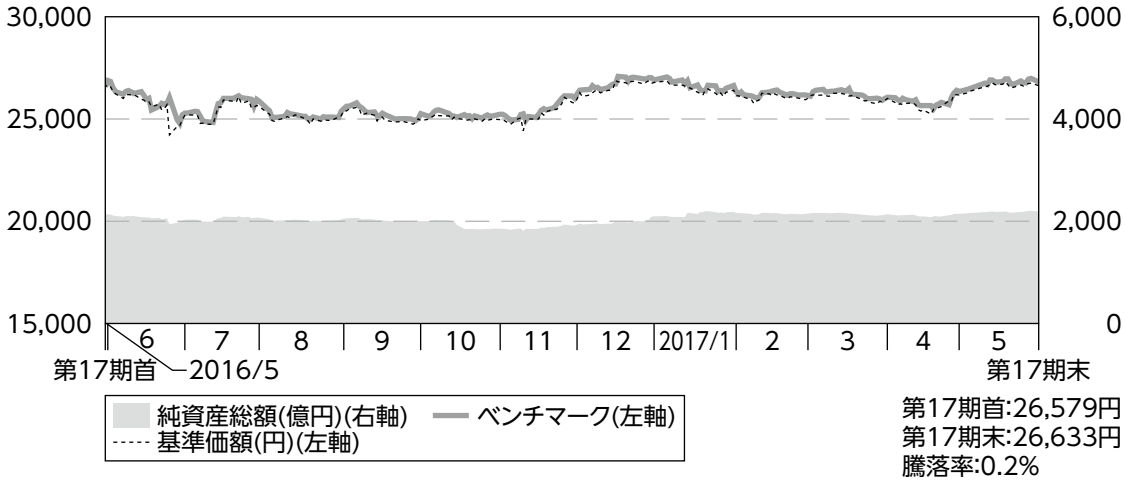
年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率		騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2016年 5月30日	26,579	－	436.679	－	97.9	0.9
5月末	26,669	0.3	441.613	1.1	97.8	0.9
6月末	25,170	△5.3	415.449	△4.9	97.7	1.0
7月末	25,609	△3.6	425.076	△2.7	97.9	0.8
8月末	25,406	△4.4	419.023	△4.0	98.1	0.7
9月末	24,925	△6.2	414.999	△5.0	98.5	0.5
10月末	24,972	△6.0	414.548	△5.1	98.2	0.6
11月末	25,988	△2.2	431.000	△1.3	97.7	0.9
12月末	26,786	0.8	442.149	1.3	97.9	0.8
2017年 1月末	26,136	△1.7	432.597	△0.9	98.9	0.1
2月末	26,014	△2.1	429.599	△1.6	98.4	0.4
3月末	26,009	△2.1	428.190	△1.9	98.0	0.8
4月末	26,179	△1.5	432.744	△0.9	98.3	0.6
(当期末)						
2017年 5月29日	26,633	0.2	440.540	0.9	97.3	1.4

(注1)騰落率は期首比です。
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)です。
シティ世界国債インデックスとは、Citigroup Index LLCが開発した、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です。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定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。基準価額への反映を考慮して前営業日の値を採用しています。

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

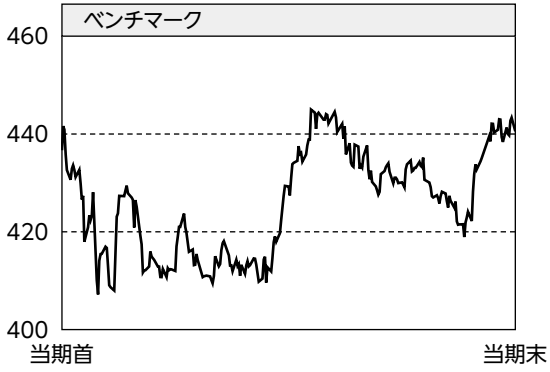


(注)ベンチマークは、2016年5月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

基準価額は、6月下旬に英国のEU(欧州連合)離脱の是非を問う国民投票の結果が大方の予想に反してEU離脱派の勝利となったことなどから、金利は低下(債券価格は上昇)したものの、外国為替市場で円高が進み、下落しました。その後、基準価額はもみ合い推移となりましたが、11月から12月にかけて、米国トランプ政権下での経済政策への期待や米国の利上げ観測の強まりなどを背景に金利が上昇(債券価格は下落)したものの、円安推移により、基準価額は上昇しました。4月中旬にかけては、米国トランプ政権の政策不透明感の高まりやフランス大統領選挙などを巡る欧州政治リスクへの警戒感から円高となり、基準価額は下落しました。4月中旬以降期末にかけては、フランス大統領選挙の結果や米国の利上げ期待が高まったことを背景に一時円高から円安方向に反転したことや、トランプ大統領を巡る米国の政情不安から金利が低下したことから、基準価額は上昇に転じました。

投資環境



主要国の長期金利は、7月上旬にかけて、英国でのEU離脱の是非を問う国民投票の予想外の結果を受けて低下しました。その後12月にかけて、米国の早期利上げ観測が強まったことや米国の経済政策への期待から長期金利は上昇しましたが、2017年3月以降は、米国の政策不透明感や地政学リスクの強まりなどを受けて低下しました。

外国為替市場では、9月にかけて、日銀による政策期待の後退などから主要通貨に対して円高となりました。11月以降に、米国の経済政策への期待から円安となりましたが、2017年1月から期末にかけては、米国の政策不透明感や地政学リスクの強まりなどから円高となりました。

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、円ベース）と連動する投資成果を目標として運用を行いました。当期の運用につきましては、インデックスとの連動性を考慮し外国債券の組入比率を高位に維持するとともに適宜ポートフォリオの見直しを行い、投資対象国の拡大と保有債券の残存期間を意識した銘柄分散に努めました。当期末時点では全てのベンチマーク対象国に分散投資を図りました。

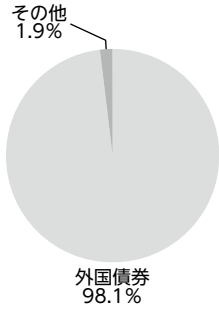
当ファンドの組入資産の内容

○上位10銘柄

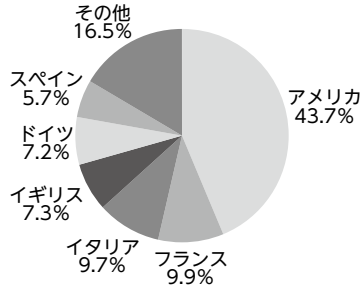
順位	銘柄名	国	組入比率
1	T 2.5% 02/15/46	アメリカ	0.8%
2	T 2.875% 05/15/43	アメリカ	0.7%
3	T 1.5% 08/15/26	アメリカ	0.6%
4	T 2% 08/15/25	アメリカ	0.6%
5	T 2.625% 11/15/20	アメリカ	0.6%
6	T 2.25% 11/15/24	アメリカ	0.5%
7	T 0.875% 07/15/18	アメリカ	0.5%
8	T 0.625% 04/30/18	アメリカ	0.5%
9	T 2.875% 08/15/45	アメリカ	0.5%
10	T 1.25% 03/31/21	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		661	

（注）組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

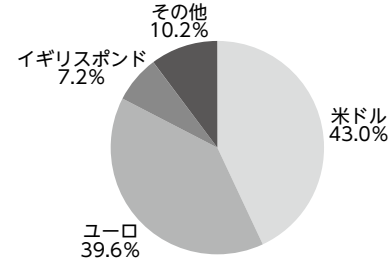
○資産別配分



○国別配分



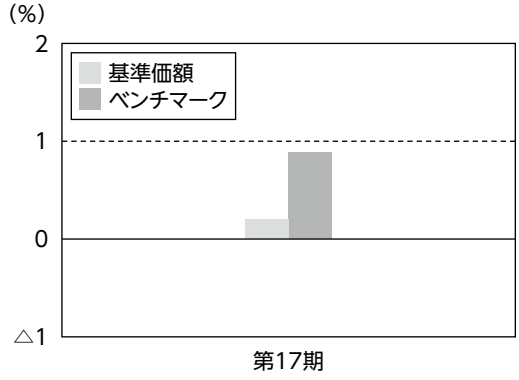
○通貨別配分



（注）資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。
ベンチマークとの乖離が生じた主な要因は、為替評価差要因※です。

※当ファンドとベンチマークで外貨建資産の評価に使用する為替レートが異なることによる差異要因です。

今後の運用方針

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ベース）をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期（2016年5月31日～2017年5月29日）		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	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〕×10,000 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）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
（商品）	(－)	(－)	
（先物・オプション）	(0)	(0.001)	
(b) 有価証券取引税	－	－	(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〕×10,000 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）	(－)	(－)	
（新株予約権証券）	(－)	(－)	
（オプション証券等）	(－)	(－)	
（新株予約権付社債（転換社債））	(－)	(－)	
（公社債）	(－)	(－)	
（投資信託証券）	(－)	(－)	
(c) その他費用	6	0.025	(c)その他費用＝〔期中のその他費用〕／〔期中の平均受益権口数〕×10,000 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 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
（保管費用）	(6)	(0.025)	
（監査費用）	(－)	(－)	
（その他）	(0)	(0.000)	
合計	6	0.026	

（注1）期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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。
（注2）各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
（注3）「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額（25,821円）で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

＜公社債＞

			当期	
			買付額	売付額
外国	アメリカ	国債証券	千米ドル 272,081	千米ドル 222,614
	カナダ	国債証券	千カナダドル 21,092	千カナダドル 17,120
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 84,659	千メキシコペソ 70,600
	ドイツ	国債証券	千ユーロ 33,380	千ユーロ 31,938
	イタリア	国債証券	44,958	38,678
	フランス	国債証券	40,025	30,444
	オランダ	国債証券	10,667	11,975
	スペイン	国債証券	24,905	19,931
	ベルギー	国債証券	10,635	9,824
	オーストリア	国債証券	6,191	5,774
	フィンランド	国債証券	1,924	1,468
	アイルランド	国債証券	2,831	2,209
	イギリス	国債証券	千イギリスポンド 20,799	千イギリスポンド 22,522
	スイス	国債証券	千スイスフラン 962	千スイスフラン 2,513
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 15,274	千スウェーデンクローナ 17,015
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 10,840	千ノルウェークローネ 12,186
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 17,272	千デンマーククローネ 22,038
	ポーランド	国債証券	千ポーランドズロチ 15,607	千ポーランドズロチ 11,048
	オーストラリア	国債証券	千オーストラリアドル 18,284	千オーストラリアドル 9,721
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 3,095	千シンガポールドル 2,041
	マレーシア	国債証券	千マレーシアリンギット 8,694	千マレーシアリンギット 9,538
	南アフリカ	国債証券	千南アフリカランド 29,635	千南アフリカランド 18,688

(注)金額は受渡代金です。(経過利子分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		当期 買建 新規買付額	当期 買建 決済額	当期 売建 新規売付額	当期 売建 決済額
		百万円	百万円	百万円	百万円
外国	債券先物取引	26,185	24,949	－	－

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区分	当期 買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	当期 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	31,008	68	0.2	25,239	676	2.7
金銭信託	15,414	15,414	100.0	15,631	15,631	100.0
コール・ローン	474,993	95,909	20.2	473,231	94,911	20.1

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

※ 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す。

組入資産の明細

＜外国(外貨建)公社債＞

(A)債券種類別開示

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	829,790	840,892	93,625,022	42.7	－	17.4	17.8	7.4
	千カナダドル	千カナダドル						
カナダ	49,510	54,417	4,499,746	2.1	－	0.9	0.7	0.4
	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
メキシコ	308,800	318,224	1,915,711	0.9	－	0.5	0.2	0.1
	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	103,480	123,099	15,301,237	7.0	－	4.1	1.9	0.9
イタリア	145,830	166,531	20,699,819	9.4	－	5.5	2.8	1.2
フランス	144,910	170,612	21,207,142	9.7	－	6.0	2.6	1.1
オランダ	32,250	38,142	4,741,099	2.2	－	1.4	0.5	0.2
スペイン	83,110	97,031	12,060,960	5.5	－	3.3	1.6	0.6
ベルギー	35,630	43,570	5,415,855	2.5	－	1.8	0.5	0.2
オーストリア	21,810	25,898	3,219,205	1.5	－	0.9	0.4	0.1
フィンランド	9,610	10,678	1,327,289	0.6	－	0.4	0.2	0.0
アイルランド	12,320	14,093	1,751,825	0.8	－	0.4	0.3	0.1
	千イギリスポンド	千イギリスポンド						
イギリス	85,080	109,213	15,584,717	7.1	－	5.2	1.5	0.4
	千スイスフラン	千スイスフラン						
スイス	2,990	3,587	409,585	0.2	－	0.1	0.1	0.0
	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	65,600	75,582	967,458	0.4	－	0.3	0.1	0.1
	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	42,970	46,068	610,869	0.3	－	0.1	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	63,250	78,253	1,306,826	0.6	－	0.4	0.2	0.0
	千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ						
ポーランド	46,550	47,551	1,413,224	0.6	－	0.3	0.3	0.1
	千オーストラリアドル	千オーストラリアドル						
オーストラリア	50,270	54,655	4,528,794	2.1	－	1.3	0.5	0.2
	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
シンガポール	9,850	10,414	838,282	0.4	－	0.2	0.1	0.0
	千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット						
マレーシア	34,720	34,902	910,251	0.4	－	0.3	0.1	0.0
	千南アフリカランド	千南アフリカランド						
南アフリカ	149,820	140,444	1,219,055	0.6	－	0.5	0.1	0.0
合計	－	－	213,553,982	97.3	－	51.3	32.7	13.3

(注1)邦貨換算金額は、当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。
(注2)組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。
(注3)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)個別銘柄開示

銘柄	利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 0.625% 04/30/18	0.625	10,000	9,949	1,107,777	2018/4/30
T 0.75% 10/31/18	0.75	3,300	3,277	364,961	2018/10/31
T 0.875% 07/15/18	0.875	10,000	9,964	1,109,460	2018/7/15
T 0.875% 07/31/19	0.875	5,500	5,447	606,569	2019/7/31
T 0.875% 10/15/18	0.875	4,000	3,981	443,271	2018/10/15
T 1% 05/15/18	1.0	5,550	5,540	616,900	2018/5/15
T 1% 05/31/18	1.0	5,000	4,990	555,697	2018/5/31
T 1% 06/30/19	1.0	9,000	8,944	995,831	2019/6/30
T 1% 08/31/19	1.0	7,500	7,444	828,901	2019/8/31
T 1% 09/15/18	1.0	5,200	5,185	577,365	2018/9/15
T 1% 09/30/19	1.0	4,000	3,969	441,911	2019/9/30
T 1% 11/30/18	1.0	5,200	5,181	576,956	2018/11/30
T 1% 11/30/19	1.0	6,300	6,243	695,122	2019/11/30
T 1.125% 01/15/19	1.125	5,800	5,787	644,430	2019/1/15
T 1.125% 01/31/19	1.125	2,850	2,843	316,614	2019/1/31
T 1.125% 04/30/20	1.125	4,000	3,963	441,349	2020/4/30
T 1.125% 06/15/18	1.125	3,000	2,998	333,819	2018/6/15
T 1.125% 06/30/21	1.125	9,800	9,582	1,066,968	2021/6/30
T 1.125% 07/31/21	1.125	5,000	4,884	543,818	2021/7/31
T 1.125% 12/31/19	1.125	7,050	7,003	779,798	2019/12/31
T 1.25% 01/31/19	1.25	900	899	100,187	2019/1/31
T 1.25% 01/31/20	1.25	1,320	1,314	146,380	2020/1/31
T 1.25% 02/29/20	1.25	3,400	3,384	376,862	2020/2/29
T 1.25% 03/31/21	1.25	10,000	9,853	1,097,048	2021/3/31
T 1.25% 07/31/23	1.25	4,550	4,358	485,322	2023/7/31
T 1.25% 10/31/18	1.25	6,500	6,502	723,975	2018/10/31
T 1.25% 10/31/19	1.25	5,500	5,486	610,863	2019/10/31
T 1.25% 11/30/18	1.25	6,550	6,550	729,330	2018/11/30
T 1.25% 12/15/18	1.25	2,520	2,520	280,592	2018/12/15
T 1.375% 01/15/20	1.375	5,000	4,997	556,422	2020/1/15
T 1.375% 01/31/20	1.375	5,000	4,996	556,308	2020/1/31
T 1.375% 01/31/21	1.375	4,800	4,758	529,849	2021/1/31
T 1.375% 02/28/19	1.375	2,100	2,103	234,227	2019/2/28
T 1.375% 02/29/20	1.375	5,000	4,993	555,991	2020/2/29
T 1.375% 03/31/20	1.375	4,880	4,872	542,524	2020/3/31
T 1.375% 04/30/20	1.375	1,000	997	111,097	2020/4/30
T 1.375% 04/30/21	1.375	9,500	9,398	1,046,471	2021/4/30
T 1.375% 05/31/20	1.375	1,550	1,545	172,060	2020/5/31
T 1.375% 06/30/18	1.375	2,200	2,204	245,413	2018/6/30
T 1.375% 06/30/23	1.375	5,000	4,831	537,900	2023/6/30
T 1.375% 07/31/18	1.375	4,000	4,008	446,261	2018/7/31
T 1.375% 08/31/23	1.375	2,500	2,410	268,396	2023/8/31
T 1.375% 09/30/18	1.375	3,900	3,907	435,113	2018/9/30
T 1.375% 09/30/20	1.375	4,000	3,977	442,866	2020/9/30
T 1.375% 09/30/23	1.375	8,000	7,705	857,914	2023/9/30
T 1.375% 10/31/20	1.375	6,000	5,961	663,798	2020/10/31
T 1.375% 12/15/19	1.375	7,650	7,648	851,588	2019/12/15
T 1.375% 12/31/18	1.375	3,000	3,005	334,635	2018/12/31
T 1.5% 01/31/19	1.5	2,000	2,007	223,556	2019/1/31
T 1.5% 01/31/22	1.5	4,500	4,445	494,915	2022/1/31
T 1.5% 02/28/19	1.5	2,000	2,007	223,550	2019/2/28
T 1.5% 02/28/23	1.5	2,400	2,344	261,043	2023/2/28
T 1.5% 03/31/19	1.5	4,400	4,418	491,931	2019/3/31
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	3,903	434,644	2023/3/31
T 1.5% 05/31/19	1.5	3,250	3,262	363,287	2019/5/31
T 1.5% 08/15/26	1.5	13,200	12,394	1,379,957	2026/8/15
T 1.5% 08/31/18	1.5	5,800	5,820	648,095	2018/8/31
T 1.5% 10/31/19	1.5	3,550	3,561	396,561	2019/10/31
T 1.5% 11/30/19	1.5	5,000	5,015	558,419	2019/11/30
T 1.5% 12/31/18	1.5	2,550	2,559	285,009	2018/12/31
T 1.625% 02/15/26	1.625	8,100	7,724	860,000	2026/2/15
T 1.625% 03/31/19	1.625	3,000	3,018	336,121	2019/3/31
T 1.625% 04/30/19	1.625	5,000	5,032	560,299	2019/4/30
T 1.625% 05/15/26	1.625	8,270	7,869	876,144	2026/5/15
T 1.625% 05/31/23	1.625	5,000	4,906	546,239	2023/5/31
T 1.625% 06/30/20	1.625	3,000	3,011	335,317	2020/6/30
T 1.625% 07/31/20	1.625	5,000	5,017	558,668	2020/7/31
T 1.625% 08/15/22	1.625	4,500	4,451	495,662	2022/8/15
T 1.625% 08/31/19	1.625	7,500	7,549	840,531	2019/8/31
T 1.625% 10/31/23	1.625	9,000	8,798	979,643	2023/10/31
T 1.625% 11/15/22	1.625	7,150	7,055	785,578	2022/11/15
T 1.625% 11/30/20	1.625	3,050	3,054	340,104	2020/11/30
T 1.75% 01/31/23	1.75	7,550	7,483	833,249	2023/1/31
T 1.75% 02/28/22	1.75	2,500	2,496	277,941	2022/2/28
T 1.75% 03/31/22	1.75	9,550	9,530	1,061,092	2022/3/31
T 1.75% 04/30/22	1.75	5,750	5,736	638,646	2022/4/30
T 1.75% 05/15/22	1.75	3,800	3,791	422,175	2022/5/15
T 1.75% 05/15/23	1.75	7,000	6,920	770,527	2023/5/15
T 1.75% 09/30/19	1.75	5,000	5,046	561,896	2019/9/30
T 1.75% 09/30/22	1.75	2,000	1,988	221,404	2022/9/30
T 1.75% 10/31/20	1.75	4,000	4,025	448,180	2020/10/31
T 1.75% 12/31/20	1.75	8,200	8,242	917,767	2020/12/31
T 1.875% 02/28/22	1.875	2,500	2,511	279,676	2022/2/28
T 1.875% 06/30/20	1.875	5,200	5,261	585,799	2020/6/30
T 1.875% 08/31/22	1.875	4,000	4,005	446,012	2022/8/31
T 1.875% 10/31/22	1.875	3,150	3,150	350,764	2022/10/31
T 1.875% 11/30/21	1.875	5,400	5,429	604,553	2021/11/30
T 2% 02/15/22	2.0	2,500	2,526	281,356	2022/2/15
T 2% 02/15/23	2.0	2,600	2,611	290,805	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,400	8,317	926,070	2025/2/15
T 2% 02/28/21	2.0	4,000	4,055	451,534	2021/2/28
T 2% 05/31/21	2.0	3,800	3,848	428,526	2021/5/31
T 2% 07/31/20	2.0	5,200	5,278	587,690	2020/7/31
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	3,023	336,679	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	12,300	12,136	1,351,231	2025/8/15
T 2% 08/31/21	2.0	6,800	6,879	765,943	2021/8/31
T 2% 09/30/20	2.0	5,000	5,073	564,929	2020/9/30
T 2% 10/31/21	2.0	400	404	45,029	2021/10/31
T 2% 11/15/21	2.0	2,400	2,427	270,301	2021/11/15
T 2% 11/15/26	2.0	1,300	1,272	141,707	2026/11/15
T 2% 11/30/20	2.0	5,500	5,577	621,043	2020/11/30
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	2,011	224,009	2022/11/30
T 2% 12/31/21	2.0	2,200	2,223	247,527	2021/12/31
T 2.125% 01/31/21	2.125	3,000	3,054	340,088	2021/1/31
T 2.125% 03/31/24	2.125	7,400	7,436	827,989	2024/3/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	8,700	8,680	966,441	2025/5/15
T 2.125% 06/30/21	2.125	7,500	7,628	849,407	2021/6/30
T 2.125% 06/30/22	2.125	3,500	3,550	395,347	2022/6/30
T 2.125% 08/15/21	2.125	6,100	6,205	690,908	2021/8/15
T 2.125% 08/31/20	2.125	6,500	6,622	737,388	2020/8/31
T 2.125% 09/30/21	2.125	2,000	2,033	226,408	2021/9/30
T 2.125% 11/30/23	2.125	2,000	2,014	224,329	2023/11/30
T 2.125% 12/31/21	2.125	4,500	4,572	509,069	2021/12/31
T 2.25% 02/15/27	2.25	2,500	2,499	278,243	2027/2/15
T 2.25% 03/31/21	2.25	3,050	3,118	347,246	2021/3/31
T 2.25% 04/30/21	2.25	3,500	3,578	398,413	2021/4/30
T 2.25% 07/31/18	2.25	5,300	5,364	597,239	2018/7/31
T 2.25% 07/31/21	2.25	3,000	3,065	341,364	2021/7/31
T 2.25% 08/15/46	2.25	2,700	2,338	260,386	2046/8/15
T 2.25% 11/15/24	2.25	10,150	10,246	1,140,889	2024/11/15

外国債券インデックス マザーファンド　－第17期－

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
T 2.25% 11/15/25	2.25	2,900	2,912	324,248	2025/11/15
T 2.25% 12/31/23	2.25	2,000	2,028	225,847	2023/12/31
T 2.375% 05/31/18	2.375	4,000	4,046	450,582	2018/5/31
T 2.375% 08/15/24	2.375	8,500	8,667	964,985	2024/8/15
T 2.375% 12/31/20	2.375	2,300	2,362	263,076	2020/12/31
T 2.5% 02/15/45	2.5	6,300	5,794	645,186	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	17,550	16,092	1,791,745	2046/2/15
T 2.5% 05/15/24	2.5	8,400	8,642	962,310	2024/5/15
T 2.5% 05/15/46	2.5	1,050	962	107,123	2046/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,688	522,014	2023/8/15
T 2.625% 04/30/18	2.625	5,000	5,065	564,011	2018/4/30
T 2.625% 08/15/20	2.625	5,500	5,690	633,586	2020/8/15
T 2.625% 11/15/20	2.625	11,000	11,387	1,267,926	2020/11/15
T 2.75% 02/15/19	2.75	4,600	4,716	525,087	2019/2/15
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,136	349,204	2024/2/15
T 2.75% 08/15/42	2.75	3,000	2,926	325,890	2042/8/15
T 2.75% 11/15/23	2.75	6,900	7,213	803,145	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	4,200	4,092	455,672	2042/11/15
T 2.875% 05/15/43	2.875	14,150	14,091	1,568,984	2043/5/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	9,900	9,816	1,092,946	2045/8/15
T 3% 05/15/42	3.0	3,950	4,037	449,510	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	3,500	3,558	396,206	2045/5/15
T 3% 11/15/44	3.0	2,300	2,341	260,689	2044/11/15
T 3.125% 02/15/42	3.125	1,600	1,673	186,357	2042/2/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	1,000	1,042	116,089	2043/2/15
T 3.125% 05/15/19	3.125	5,000	5,177	576,438	2019/5/15
T 3.125% 05/15/21	3.125	5,300	5,596	623,078	2021/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	6,500	6,776	754,481	2044/8/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	2,400	2,512	279,692	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	5,610	6,117	681,135	2044/5/15
T 3.375% 11/15/19	3.375	8,750	9,175	1,021,616	2019/11/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	3,000	3,367	374,922	2039/2/15
T 3.625% 02/15/20	3.625	7,000	7,411	825,189	2020/2/15
T 3.625% 02/15/21	3.625	5,500	5,898	656,792	2021/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	5,000	5,689	633,428	2044/2/15
T 3.625% 08/15/19	3.625	2,700	2,835	315,657	2019/8/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,272	253,020	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	3,900	4,519	503,191	2041/8/15
T 3.75% 11/15/18	3.75	5,000	5,181	576,876	2018/11/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	2,300	2,670	297,304	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	1,650	1,946	216,756	2040/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,120	124,727	2039/5/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	1,450	1,806	201,107	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,269	141,346	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	1,900	2,405	267,859	2040/5/15
T 4.375% 05/15/41	4.375	1,500	1,904	212,083	2041/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,700	3,416	380,415	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,840	2,367	263,552	2036/2/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	1,000	1,290	143,719	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	250	321	35,813	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	3,900	5,106	568,552	2040/2/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,504	167,519	2037/5/15
T 5.25% 02/15/29	5.25	400	518	57,743	2029/2/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,679	187,000	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,600	2,161	240,628	2031/2/15
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,200	1,574	175,349	2028/8/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	2,216	246,730	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	1,450	1,968	219,161	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	400	572	63,785	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	2,066	230,049	2023/8/15
T 8.0% 11/15/21	8.0	1,700	2,156	240,080	2021/11/15
T 8.125% 08/15/19	8.125	2,100	2,409	268,328	2019/8/15
小計				93,625,022	

当期末					
銘柄	利率(%)	額面金額	評価額		償還年月日
			外貨建金額	邦貨換算金額(千円)	
(カナダ)		千カナダドル	千カナダドル		
国債証券					
CAN 0.25% 05/01/18	0.25	3,650	3,636	300,736	2018/5/1
CAN 0.5% 02/01/19	0.5	920	917	75,844	2019/2/1
CAN 0.5% 03/01/22	0.5	3,100	3,032	250,786	2022/3/1
CAN 0.5% 11/01/18	0.5	1,500	1,496	123,731	2018/11/1
CAN 0.75% 03/01/21	0.75	1,250	1,244	102,884	2021/3/1
CAN 0.75% 09/01/20	0.75	1,350	1,346	111,364	2020/9/1
CAN 0.75% 09/01/21	0.75	1,730	1,718	142,101	2021/9/1
CAN 1% 06/01/27	1.0	1,150	1,102	91,171	2027/6/1
CAN 1.25% 09/01/18	1.25	500	503	41,650	2018/9/1
CAN 1.5% 03/01/20	1.5	2,600	2,651	219,240	2020/3/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,750	1,792	148,255	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,480	1,500	124,111	2026/6/1
CAN 1.75% 03/01/19	1.75	1,400	1,425	117,908	2019/3/1
CAN 1.75% 09/01/19	1.75	2,250	2,301	190,284	2019/9/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,550	1,668	137,961	2025/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,850	2,015	166,698	2024/6/1
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	2,550	2,768	228,934	2022/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,450	1,676	138,604	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	420	510	42,223	2064/12/1
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,690	1,847	152,732	2021/6/1
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	1,800	1,944	160,788	2020/6/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,970	2,555	211,295	2045/12/1
CAN 3.75% 06/01/19	3.75	3,200	3,392	280,558	2019/6/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,890	2,568	212,403	2041/6/1
CAN 4.25% 06/01/18	4.25	2,100	2,175	179,915	2018/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,600	2,383	197,121	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,200	1,738	143,728	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,250	1,919	158,758	2033/6/1
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	360	579	47,951	2027/6/1
小計				4,499,746	
(メキシコ)		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
国債証券					
MBONO 10% 11/20/36	10.0	10,650	13,351	80,375	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	30,950	35,855	215,848	2024/12/5
MBONO 4.75% 06/14/18	4.75	22,400	21,877	131,701	2018/6/14
MBONO 5% 12/11/19	5.0	31,100	29,539	177,828	2019/12/11
MBONO 5.75% 03/05/26	5.75	10,350	9,321	56,115	2026/3/5
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	11,800	11,432	68,822	2022/6/9
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	37,300	36,361	218,895	2021/6/10
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	14,700	14,899	89,693	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	17,100	17,619	106,066	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	14,550	14,867	89,502	2042/11/13
MBONO 7.75% 11/23/34	7.75	4,150	4,268	25,694	2034/11/23
MBONO 8% 06/11/20	8.0	21,150	21,606	130,073	2020/6/11
MBONO 8% 11/07/47	8.0	4,750	4,991	30,047	2047/11/7
MBONO 8% 12/07/23	8.0	20,450	21,252	127,941	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	15,600	17,016	102,436	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	16,500	18,175	109,417	2038/11/18
MBONO 8.5% 12/13/18	8.5	25,300	25,789	155,250	2018/12/13
小計				1,915,711	
(ドイツ)		千ユーロ	千ユーロ		
国債証券					
DBR 0% 08/15/26	－	2,100	2,052	255,109	2026/8/15
DBR 0.25% 02/15/27	0.25	1,550	1,538	191,246	2027/2/15
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	2,400	2,491	309,638	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	4,450	4,581	569,521	2026/2/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	1,680	1,809	224,901	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	2,450	2,635	327,547	2025/8/15
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,000	2,203	273,896	2023/2/15
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	2,950	3,258	405,027	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	3,390	3,769	468,562	2024/5/15

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	1,450	1,591	197,871	2022/9/4
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	1,300	1,465	182,204	2024/2/15
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	4,000	4,436	551,444	2022/7/4
DBR 2% 01/04/22	2.0	3,150	3,510	436,386	2022/1/4
DBR 2% 08/15/23	2.0	2,100	2,389	297,046	2023/8/15
DBR 2.25% 09/04/20	2.25	2,500	2,736	340,139	2020/9/4
DBR 2.25% 09/04/21	2.25	2,000	2,238	278,200	2021/9/4
DBR 2.5% 01/04/21	2.5	3,050	3,393	421,784	2021/1/4
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	2,450	3,235	402,208	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	2,500	3,331	414,145	2046/8/15
DBR 3% 07/04/20	3.0	3,500	3,899	484,700	2020/7/4
DBR 3.25% 01/04/20	3.25	3,000	3,310	411,528	2020/1/4
DBR 3.25% 07/04/21	3.25	3,400	3,934	489,028	2021/7/4
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	1,850	2,743	341,077	2042/7/4
DBR 3.5% 07/04/19	3.5	4,400	4,789	595,357	2019/7/4
DBR 3.75% 01/04/19	3.75	4,150	4,450	553,199	2019/1/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,850	4,454	553,751	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/18	4.25	6,050	6,384	793,620	2018/7/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,650	2,739	340,462	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,740	2,555	317,702	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,330	3,823	475,322	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,000	3,565	443,131	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,200	3,614	449,260	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,550	2,396	297,846	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	1,600	2,279	283,323	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,050	1,784	221,845	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,200	1,937	240,806	2027/7/4
OBL 0% 04/17/20	－	1,600	1,630	202,707	2020/4/17
OBL 0% 10/08/21	－	2,350	2,400	298,372	2021/10/8
OBL 0.25% 10/11/19	0.25	1,150	1,175	146,123	2019/10/11
OBL 0.25% 10/16/20	0.25	1,350	1,389	172,671	2020/10/16
OBL 0.5% 04/12/19	0.5	1,440	1,473	183,124	2019/4/12
OBL 1% 02/22/19	1.0	1,450	1,493	185,676	2019/2/22
OBL 1% 10/12/18	1.0	2,150	2,202	273,710	2018/10/12
（イタリア）					
国債証券					
BTPS 0.1% 04/15/19	0.1	1,000	1,003	124,751	2019/4/15
BTPS 0.25% 05/15/18	0.25	1,500	1,508	187,484	2018/5/15
BTPS 0.3% 10/15/18	0.3	1,000	1,006	125,153	2018/10/15
BTPS 0.35% 11/01/21	0.35	3,800	3,756	466,877	2021/11/1
BTPS 0.45% 06/01/21	0.45	1,400	1,399	173,985	2021/6/1
BTPS 0.65% 10/15/23	0.65	1,300	1,251	155,521	2023/10/15
BTPS 0.65% 11/01/20	0.65	3,900	3,947	490,652	2020/11/1
BTPS 0.95% 03/15/23	0.95	1,500	1,488	185,033	2023/3/15
BTPS 1.05% 12/01/19	1.05	4,350	4,450	553,227	2019/12/1
BTPS 1.25% 12/01/26	1.25	1,350	1,271	158,063	2026/12/1
BTPS 1.35% 04/15/22	1.35	650	666	82,849	2022/4/15
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	1,600	1,576	195,896	2025/6/1
BTPS 1.5% 08/01/19	1.5	2,400	2,477	307,960	2019/8/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,600	1,561	194,047	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	2,100	1,908	237,216	2032/3/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	3,300	3,350	416,486	2025/12/1
BTPS 2.15% 12/15/21	2.15	2,500	2,666	331,393	2021/12/15
BTPS 2.2% 06/01/27	2.2	200	202	25,121	2027/6/1
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	1,550	1,446	179,817	2036/9/1
BTPS 2.5% 05/01/19	2.5	2,500	2,623	326,076	2019/5/1
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,450	2,603	323,612	2024/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	2,220	2,023	251,520	2047/3/1
BTPS 2.8% 03/01/67	2.8	550	469	58,299	2067/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,550	1,582	196,737	2046/9/1
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	2,760	3,107	386,285	2030/3/1
BTPS 3.5% 06/01/18	3.5	2,700	2,802	348,349	2018/6/1
BTPS 3.5% 12/01/18	3.5	800	843	104,897	2018/12/1
BTPS 3.75% 03/01/21	3.75	3,250	3,658	454,740	2021/3/1
BTPS 3.75% 05/01/21	3.75	1,550	1,747	217,270	2021/5/1
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	4,000	4,532	563,332	2021/8/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	1,800	2,069	257,226	2024/9/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,300	3,912	486,302	2037/2/1
BTPS 4% 09/01/20	4.0	3,550	3,978	494,510	2020/9/1
BTPS 4.25% 02/01/19	4.25	3,800	4,076	506,731	2019/2/1
BTPS 4.25% 03/01/20	4.25	4,500	5,002	621,767	2020/3/1
BTPS 4.25% 09/01/19	4.25	2,650	2,901	360,690	2019/9/1
BTPS 4.5% 02/01/20	4.5	1,650	1,840	228,753	2020/2/1
BTPS 4.5% 03/01/19	4.5	2,650	2,863	355,949	2019/3/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,950	3,531	439,015	2024/3/1
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	4,250	5,158	641,196	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	2,050	2,443	303,753	2023/5/1
BTPS 4.5% 08/01/18	4.5	4,000	4,222	524,876	2018/8/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	5,150	6,246	776,451	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	2,400	2,820	350,633	2021/9/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,750	3,429	426,269	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,900	2,441	303,479	2044/9/1
BTPS 5% 03/01/22	5.0	2,600	3,108	386,439	2022/3/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	2,650	3,293	409,431	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,950	3,896	484,341	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,850	3,758	467,134	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,450	3,260	405,273	2039/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,650	4,805	597,362	2029/11/1
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	3,400	4,194	521,417	2022/9/1
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	2,350	2,906	361,323	2022/11/1
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	2,700	3,807	473,215	2033/2/1
BTPS 6% 05/01/31	6.0	4,200	5,963	741,210	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	3,150	4,439	551,841	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	2,043	254,005	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	1,179	146,551	2023/11/1
（フランス）					
国債証券					
FRTR 0% 05/25/21	－	3,000	3,041	378,100	2021/5/25
FRTR 0% 05/25/22	－	800	806	100,257	2022/5/25
FRTR 0.25% 11/25/20	0.25	3,500	3,584	445,499	2020/11/25
FRTR 0.25% 11/25/26	0.25	1,750	1,680	208,933	2026/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	4,200	4,237	526,695	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	4,130	4,098	509,475	2026/5/25
FRTR 0.5% 11/25/19	0.5	3,350	3,437	427,252	2019/11/25
FRTR 1% 05/25/18	1.0	4,250	4,316	536,592	2018/5/25
FRTR 1% 05/25/19	1.0	3,250	3,351	416,631	2019/5/25
FRTR 1% 11/25/18	1.0	2,500	2,559	318,164	2018/11/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	4,250	4,432	550,974	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	2,450	2,372	294,907	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	4,350	4,564	567,329	2031/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	5,650	6,249	776,769	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	850	791	98,438	2066/5/25
FRTR 1.75% 06/25/39	1.75	750	779	96,896	2039/6/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	4,550	5,048	627,514	2024/11/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	3,450	3,951	491,219	2024/5/25
FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	4,100	4,625	574,992	2022/10/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	3,500	4,126	512,969	2030/5/25
FRTR 2.5% 10/25/20	2.5	5,450	6,002	746,062	2020/10/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,950	5,920	735,927	2027/10/25
FRTR 3% 04/25/22	3.0	4,800	5,561	691,317	2022/4/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	3,050	4,077	506,795	2045/5/25
FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	5,200	6,020	748,300	2021/10/25
FRTR 3.5% 04/25/20	3.5	5,700	6,368	791,565	2020/4/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	4,230	5,322	661,639	2026/4/25
FRTR 3.75% 04/25/21	3.75	3,950	4,591	570,784	2021/4/25
FRTR 3.75% 10/25/19	3.75	4,080	4,506	560,127	2019/10/25

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
FRTR 4% 04/25/55	4.0	1,750	2,755	342,502	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,450	2,331	289,764	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,250	4,762	591,936	2038/10/25
FRTR 4.25% 04/25/19	4.25	5,250	5,738	713,293	2019/4/25
FRTR 4.25% 10/25/18	4.25	3,900	4,167	517,981	2018/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,150	6,539	812,888	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	3,750	5,936	737,938	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	3,050	4,732	588,299	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	3,050	4,639	576,656	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	3,750	6,189	769,332	2032/10/25
FRTR 6.0% 10/25/25	6.0	2,400	3,517	437,238	2025/10/25
FRTR 8.5% 04/25/23	8.5	1,000	1,507	187,320	2023/4/25
FRTR 8.5% 10/25/19	8.5	1,120	1,366	169,851	2019/10/25
（オランダ）					
国債証券					
NETHER 0% 01/15/22	－	1,500	1,522	189,300	2022/1/15
NETHER 0.25% 01/15/20	0.25	1,900	1,944	241,676	2020/1/15
NETHER 0.25% 07/15/25	0.25	1,690	1,693	210,481	2025/7/15
NETHER 0.5% 07/15/26	0.5	1,950	1,972	245,133	2026/7/15
NETHER 0.75% 07/15/27	0.75	650	663	82,479	2027/7/15
NETHER 1.25% 01/15/19	1.25	900	928	115,356	2019/1/15
NETHER 1.75% 07/15/23	1.75	1,500	1,671	207,809	2023/7/15
NETHER 2% 07/15/24	2.0	2,000	2,277	283,106	2024/7/15
NETHER 2.25% 07/15/22	2.25	2,970	3,359	417,626	2022/7/15
NETHER 2.5% 01/15/33	2.5	1,550	1,936	240,651	2033/1/15
NETHER 2.75% 01/15/47	2.75	1,450	2,007	249,509	2047/1/15
NETHER 3.25% 07/15/21	3.25	2,050	2,367	294,252	2021/7/15
NETHER 3.5% 07/15/20	3.5	1,750	1,975	245,532	2020/7/15
NETHER 3.75% 01/15/23	3.75	750	918	114,155	2023/1/15
NETHER 3.75% 01/15/42	3.75	1,820	2,865	356,170	2042/1/15
NETHER 4% 01/15/37	4.0	1,880	2,916	362,575	2037/1/15
NETHER 4% 07/15/19	4.0	1,000	1,099	136,641	2019/7/15
NETHER 4.0% 07/15/18	4.0	3,150	3,316	412,291	2018/7/15
NETHER 5.5% 01/15/28	5.5	1,590	2,418	300,618	2028/1/15
NETHER 7.5% 01/15/23	7.5	200	287	35,728	2023/1/15
（スペイン）					
国債証券					
SPGB 0.25% 01/31/19	0.25	140	141	17,557	2019/1/31
SPGB 0.25% 04/30/18	0.25	3,050	3,067	381,241	2018/4/30
SPGB 0.75% 07/30/21	0.75	2,850	2,930	364,322	2021/7/30
SPGB 1.15% 07/30/20	1.15	1,350	1,403	174,447	2020/7/30
SPGB 1.3% 10/31/26	1.3	2,100	2,080	258,620	2026/10/31
SPGB 1.4% 01/31/20	1.4	2,360	2,461	305,904	2020/1/31
SPGB 1.5% 04/30/27	1.5	1,950	1,945	241,879	2027/4/30
SPGB 1.6% 04/30/25	1.6	1,350	1,398	173,886	2025/4/30
SPGB 1.95% 04/30/26	1.95	2,500	2,630	327,023	2026/4/30
SPGB 1.95% 07/30/30	1.95	2,750	2,759	342,944	2030/7/30
SPGB 2.15% 10/31/25	2.15	3,550	3,801	472,548	2025/10/31
SPGB 2.75% 04/30/19	2.75	2,250	2,382	296,115	2019/4/30
SPGB 2.75% 10/31/24	2.75	2,950	3,316	412,207	2024/10/31
SPGB 2.9% 10/31/46	2.9	1,050	1,062	132,085	2046/10/31
SPGB 3.45% 07/30/66	3.45	500	528	65,657	2066/7/30
SPGB 3.75% 10/31/18	3.75	1,400	1,483	184,356	2018/10/31
SPGB 3.8% 04/30/24	3.8	2,800	3,351	416,576	2024/4/30
SPGB 4% 04/30/20	4.0	3,000	3,360	417,765	2020/4/30
SPGB 4.1% 07/30/18	4.1	3,280	3,449	428,833	2018/7/30
SPGB 4.2% 01/31/37	4.2	2,800	3,576	444,582	2037/1/31
SPGB 4.3% 10/31/19	4.3	3,900	4,324	537,573	2019/10/31
SPGB 4.4% 10/31/23	4.4	1,750	2,156	268,028	2023/10/31
SPGB 4.6% 07/30/19	4.6	3,030	3,349	416,308	2019/7/30
SPGB 4.65% 07/30/25	4.65	2,600	3,301	410,322	2025/7/30
SPGB 4.7% 07/30/41	4.7	1,950	2,665	331,380	2041/7/30
SPGB 4.8% 01/31/24	4.8	3,050	3,845	477,959	2024/1/31
SPGB 4.85% 10/31/20	4.85	2,500	2,919	362,831	2020/10/31
SPGB 4.9% 07/30/40	4.9	1,850	2,590	322,041	2040/7/30
SPGB 5.15% 10/31/28	5.15	3,150	4,275	531,477	2028/10/31
SPGB 5.15% 10/31/44	5.15	1,500	2,180	271,047	2044/10/31
SPGB 5.4% 01/31/23	5.4	3,000	3,821	475,046	2023/1/31
SPGB 5.5% 04/30/21	5.5	3,000	3,645	453,174	2021/4/30
SPGB 5.75% 07/30/32	5.75	2,270	3,365	418,292	2032/7/30
SPGB 5.85% 01/31/22	5.85	2,850	3,595	446,890	2022/1/31
SPGB 5.9% 07/30/26	5.9	1,680	2,335	290,290	2026/7/30
SPGB 6.0% 01/31/29	6.0	1,050	1,526	189,736	2029/1/31
（ベルギー）					
国債証券					
BGB 0.2% 10/22/23	0.2	750	758	94,303	2023/10/22
BGB 0.8% 06/22/25	0.8	1,570	1,626	202,225	2025/6/22
BGB 0.8% 06/22/27	0.8	500	505	62,859	2027/6/22
BGB 1% 06/22/26	1.0	2,100	2,191	272,400	2026/6/22
BGB 1% 06/22/31	1.0	1,200	1,193	148,340	2031/6/22
BGB 1.25% 06/22/18	1.25	1,800	1,835	228,161	2018/6/22
BGB 1.6% 06/22/47	1.6	700	684	85,109	2047/6/22
BGB 1.9% 06/22/38	1.9	760	830	103,279	2038/6/22
BGB 2.15% 06/22/66	2.15	350	367	45,682	2066/6/22
BGB 2.25% 06/22/23	2.25	1,500	1,713	212,977	2023/6/22
BGB 2.25% 06/22/57	2.25	400	437	54,393	2057/6/22
BGB 2.6% 06/22/24	2.6	2,250	2,638	328,025	2024/6/22
BGB 3% 06/22/34	3.0	1,650	2,119	263,454	2034/6/22
BGB 3% 09/28/19	3.0	2,000	2,168	269,487	2019/9/28
BGB 3.75% 06/22/45	3.75	1,150	1,704	211,833	2045/6/22
BGB 3.75% 09/28/20	3.75	2,350	2,684	333,719	2020/9/28
BGB 4% 03/28/22	4.0	1,200	1,451	180,365	2022/3/28
BGB 4% 03/28/32	4.0	1,030	1,452	180,537	2032/3/28
BGB 4.0% 03/28/19	4.0	790	856	106,513	2019/3/28
BGB 4.25% 03/28/41	4.25	2,130	3,327	413,580	2041/3/28
BGB 4.25% 09/28/21	4.25	2,100	2,523	313,630	2021/9/28
BGB 4.25% 09/28/22	4.25	2,250	2,787	346,531	2022/9/28
BGB 4.5% 03/28/26	4.5	1,100	1,494	185,769	2026/3/28
BGB 5% 03/28/35	5.0	1,610	2,607	324,158	2035/3/28
BGB 5.5% 03/28/28	5.5	2,390	3,608	448,517	2028/3/28
（オーストリア）					
国債証券					
RAGB 0.25% 10/18/19	0.25	1,050	1,071	133,132	2019/10/18
RAGB 0.75% 10/20/26	0.75	2,300	2,351	292,283	2026/10/20
RAGB 1.15% 10/19/18	1.15	400	409	50,941	2018/10/19
RAGB 1.2% 10/20/25	1.2	1,250	1,340	166,601	2025/10/20
RAGB 1.5% 02/20/47	1.5	300	299	37,253	2047/2/20
RAGB 1.65% 10/21/24	1.65	1,200	1,330	165,367	2024/10/21
RAGB 1.75% 10/20/23	1.75	1,750	1,949	242,341	2023/10/20
RAGB 1.95% 06/18/19	1.95	950	999	124,298	2019/6/18
RAGB 2.4% 05/23/34	2.4	750	906	112,710	2034/5/23
RAGB 3.15% 06/20/44	3.15	850	1,183	147,127	2044/6/20
RAGB 3.4% 11/22/22	3.4	1,150	1,376	171,045	2022/11/22
RAGB 3.5% 09/15/21	3.5	1,770	2,066	256,903	2021/9/15
RAGB 3.65% 04/20/22	3.65	1,100	1,311	163,018	2022/4/20
RAGB 3.8% 01/26/62	3.8	420	705	87,706	2062/1/26
RAGB 3.9% 07/15/20	3.9	1,720	1,958	243,481	2020/7/15
RAGB 4.15% 03/15/37	4.15	1,500	2,286	284,216	2037/3/15
RAGB 4.35% 03/15/19	4.35	1,550	1,688	209,893	2019/3/15
RAGB 4.85% 03/15/26	4.85	950	1,323	164,487	2026/3/15
RAGB 6.25% 07/15/27	6.25	850	1,338	166,394	2027/7/15
（フィンランド）					
国債証券					
RFGB 0% 04/15/22	－	220	222	27,670	2022/4/15
RFGB 0% 09/15/23	－	490	489	60,886	2023/9/15
RFGB 0.375% 09/15/20	0.375	860	884	109,886	2020/9/15

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
RFGB 0.5% 04/15/26	0.5	570	575	71,568	2026/4/15
RFGB 0.75% 04/15/31	0.75	540	533	66,356	2031/4/15
RFGB 0.875% 09/15/25	0.875	550	576	71,636	2025/9/15
RFGB 1.125% 09/15/18	1.125	550	562	69,964	2018/9/15
RFGB 1.5% 04/15/23	1.5	700	765	95,198	2023/4/15
RFGB 1.625% 09/15/22	1.625	590	646	80,395	2022/9/15
RFGB 2% 04/15/24	2.0	520	588	73,200	2024/4/15
RFGB 2.625% 07/04/42	2.625	550	723	89,963	2042/7/4
RFGB 2.75% 07/04/28	2.75	560	690	85,811	2028/7/4
RFGB 3.375% 04/15/20	3.375	700	779	96,877	2020/4/15
RFGB 3.5% 04/15/21	3.5	740	852	106,023	2021/4/15
RFGB 4% 07/04/25	4.0	800	1,044	129,809	2025/7/4
RFGB 4.375% 07/04/19	4.375	670	740	92,040	2019/7/4
（アイルランド）					
国債証券					
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	450	470	58,442	2022/3/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	1,080	1,101	136,873	2026/5/15
IRISH 1.7% 05/15/37	1.7	470	472	58,779	2037/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	810	823	102,382	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	1,090	1,242	154,392	2030/5/15
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	900	1,087	135,151	2024/3/18
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	900	1,101	136,855	2023/3/20
IRISH 4.4% 06/18/19	4.4	1,100	1,211	150,554	2019/6/18
IRISH 4.5% 04/18/20	4.5	2,080	2,375	295,299	2020/4/18
IRISH 4.5% 10/18/18	4.5	890	951	118,278	2018/10/18
IRISH 5% 10/18/20	5.0	350	414	51,484	2020/10/18
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,400	1,919	238,639	2025/3/13
IRISH 5.9% 10/18/19	5.9	800	922	114,692	2019/10/18
ユーロ計				85,724,435	
（イギリス）		千イギリスポンド	千イギリスポンド		
国債証券					
UKT 0.5% 07/22/22	0.5	2,050	2,054	293,197	2022/7/22
UKT 1.25% 07/22/18	1.25	3,780	3,829	546,496	2018/7/22
UKT 1.25% 07/22/27	1.25	200	203	28,984	2027/7/22
UKT 1.5% 01/22/21	1.5	3,430	3,589	512,169	2021/1/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	2,200	2,307	329,228	2026/7/22
UKT 1.5% 07/22/47	1.5	1,150	1,110	158,424	2047/7/22
UKT 1.75% 07/22/19	1.75	5,050	5,229	746,300	2019/7/22
UKT 1.75% 07/22/57	1.75	150	159	22,828	2057/7/22
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	2,850	3,047	434,862	2022/9/7
UKT 1.75% 09/07/37	1.75	550	558	79,765	2037/9/7
UKT 2% 07/22/20	2.0	5,100	5,395	769,962	2020/7/22
UKT 2% 09/07/25	2.0	2,690	2,947	420,560	2025/9/7
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,400	2,650	378,255	2023/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	1,600	2,151	307,008	2065/7/22
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	2,250	2,579	368,126	2024/9/7
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,900	3,860	550,925	2044/1/22
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	3,000	4,195	598,719	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	2,250	3,863	551,369	2068/7/22
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	2,050	3,249	463,742	2052/7/22
UKT 3.75% 09/07/19	3.75	550	595	85,048	2019/9/7
UKT 3.75% 09/07/20	3.75	750	839	119,733	2020/9/7
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	2,000	2,297	327,916	2021/9/7
UKT 4% 01/22/60	4.0	2,000	3,566	509,009	2060/1/22
UKT 4% 03/07/22	4.0	1,450	1,704	243,244	2022/3/7
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,650	3,805	543,098	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	1,950	2,701	385,508	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,700	2,519	359,522	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,440	1,904	271,766	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,100	3,154	450,096	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,100	3,361	479,750	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,670	2,779	396,626	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,920	3,431	489,676	2055/12/7
UKT 4.5% 03/07/19	4.5	2,300	2,480	353,971	2019/3/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	2,650	3,852	549,750	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,200	3,494	498,654	2042/12/7
UKT 4.75% 03/07/20	4.75	2,100	2,371	338,445	2020/3/7
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	1,800	2,576	367,698	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,900	2,979	425,224	2038/12/7
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,900	2,514	358,858	2025/3/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,915	273,406	2028/12/7
UKT 8% 06/07/21	8.0	1,050	1,379	196,783	2021/6/7
小計				15,584,717	
（スイス）		千スイスフラン	千スイスフラン		
国債証券					
SWISS 2% 04/28/21	2.0	1,000	1,108	126,525	2021/4/28
SWISS 2.25% 07/06/20	2.25	400	438	50,057	2020/7/6
SWISS 3% 05/12/19	3.0	350	377	43,055	2019/5/12
SWISS 4% 02/11/23	4.0	710	896	102,341	2023/2/11
SWISS 4% 04/08/28	4.0	530	767	87,605	2028/4/8
小計				409,585	
（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					
SGB 1% 11/12/26	1.0	7,550	7,897	101,091	2026/11/12
SGB 1.5% 11/13/23	1.5	10,200	11,116	142,288	2023/11/13
SGB 2.5% 05/12/25	2.5	7,650	8,971	114,839	2025/5/12
SGB 3.5% 03/30/39	3.5	5,500	7,574	96,953	2039/3/30
SGB 3.5% 06/01/22	3.5	10,800	12,774	163,507	2022/6/1
SGB 4.25% 03/12/19	4.25	12,100	13,183	168,749	2019/3/12
SGB 5% 12/01/20	5.0	11,800	14,064	180,028	2020/12/1
小計				967,458	
（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					
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	4,620	4,649	61,652	2026/2/19
NGB 1.75% 02/17/27	1.75	2,250	2,298	30,480	2027/2/17
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	4,100	4,224	56,019	2025/3/13
NGB 2% 05/24/23	2.0	6,900	7,257	96,236	2023/5/24
NGB 3% 03/14/24	3.0	5,550	6,195	82,148	2024/3/14
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	10,150	11,311	149,993	2021/5/25
NGB 4.5% 05/22/19	4.5	9,400	10,131	134,339	2019/5/22
小計				610,869	
（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					
DGB 0.25% 11/15/18	0.25	6,100	6,174	103,113	2018/11/15
DGB 0.5% 11/15/27	0.5	2,200	2,163	36,135	2027/11/15
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	6,600	7,206	120,345	2023/11/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	10,300	11,493	191,939	2025/11/15
DGB 3% 11/15/21	3.0	11,400	13,048	217,905	2021/11/15
DGB 4% 11/15/19	4.0	11,000	12,221	204,095	2019/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	15,650	25,945	433,291	2039/11/15
小計				1,306,826	
（ポーランド）		千ポーランドズロチ	千ポーランドズロチ		
国債証券					
POLGB 1.5% 04/25/20	1.5	4,200	4,120	122,449	2020/4/25
POLGB 1.75% 07/25/21	1.75	3,200	3,101	92,181	2021/7/25
POLGB 2% 04/25/21	2.0	3,500	3,436	102,139	2021/4/25
POLGB 2.25% 04/25/22	2.25	2,150	2,106	62,608	2022/4/25
POLGB 2.5% 07/25/18	2.5	7,200	7,268	216,007	2018/7/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	4,500	4,262	126,690	2026/7/25
POLGB 2.5% 07/25/27	2.5	2,350	2,195	65,254	2027/7/25
POLGB 3.25% 07/25/19	3.25	2,000	2,053	61,038	2019/7/25

銘柄	当期末 利率(%)	当期末 額面金額	当期末 評価額 外貨建金額	当期末 評価額 邦貨換算金額(千円)	当期末 償還年月日
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	3,680	3,730	110,860	2025/7/25
POLGB 4% 10/25/23	4.0	3,650	3,891	115,653	2023/10/25
POLGB 5.25% 10/25/20	5.25	2,530	2,771	82,367	2020/10/25
POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	2,600	2,810	83,542	2019/10/25
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	950	1,183	35,159	2029/4/25
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	2,890	3,317	98,584	2022/9/23
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	1,150	1,301	38,689	2021/10/25
小計				1,413,224	
（オーストラリア）		千オーストラリアドル	千オーストラリアドル		
国債証券					
ACGB 1.75% 11/21/20	1.75	2,250	2,249	186,406	2020/11/21
ACGB 2% 12/21/21	2.0	1,300	1,306	108,219	2021/12/21
ACGB 2.25% 05/21/28	2.25	2,030	1,981	164,152	2028/5/21
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	2,940	3,046	252,417	2024/4/21
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	800	774	64,210	2035/6/21
ACGB 2.75% 10/21/19	2.75	2,450	2,514	208,388	2019/10/21
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	2,450	2,515	208,445	2027/11/21
ACGB 2.75% 11/21/28	2.75	1,600	1,634	135,464	2028/11/21
ACGB 3% 03/21/47	3.0	1,000	930	77,087	2047/3/21
ACGB 3.25% 04/21/25	3.25	3,350	3,584	297,026	2025/4/21
ACGB 3.25% 04/21/29	3.25	1,450	1,552	128,601	2029/4/21
ACGB 3.25% 06/21/39	3.25	650	659	54,656	2039/6/21
ACGB 3.25% 10/21/18	3.25	2,150	2,199	182,274	2018/10/21
ACGB 3.75% 04/21/37	3.75	1,100	1,213	100,570	2037/4/21
ACGB 4.25% 04/21/26	4.25	3,960	4,562	378,072	2026/4/21
ACGB 4.5% 04/15/20	4.5	3,020	3,260	270,136	2020/4/15
ACGB 4.5% 04/21/33	4.5	1,400	1,705	141,278	2033/4/21
ACGB 4.75% 04/21/27	4.75	3,350	4,040	334,826	2027/4/21
ACGB 5.25% 03/15/19	5.25	3,200	3,407	282,343	2019/3/15
ACGB 5.5% 04/21/23	5.5	3,300	3,928	325,503	2023/4/21
ACGB 5.75% 05/15/21	5.75	3,950	4,542	376,422	2021/5/15
ACGB 5.75% 07/15/22	5.75	2,570	3,044	252,290	2022/7/15
小計				4,528,794	
（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					
SIGB 1.25% 10/01/21	1.25	250	247	19,939	2021/10/1
SIGB 1.625% 10/01/19	1.625	160	161	12,996	2019/10/1
SIGB 1.75% 04/01/22	1.75	100	100	8,125	2022/4/1
SIGB 2% 07/01/20	2.0	400	408	32,881	2020/7/1
SIGB 2.125% 06/01/26	2.125	250	253	20,401	2026/6/1
SIGB 2.25% 06/01/21	2.25	870	894	72,019	2021/6/1
SIGB 2.375% 06/01/25	2.375	270	279	22,477	2025/6/1
SIGB 2.5% 06/01/19	2.5	1,150	1,180	94,996	2019/6/1
SIGB 2.75% 03/01/46	2.75	280	297	23,949	2046/3/1
SIGB 2.75% 04/01/42	2.75	620	660	53,127	2042/4/1
SIGB 2.75% 07/01/23	2.75	560	593	47,749	2023/7/1
SIGB 2.875% 07/01/29	2.875	200	215	17,316	2029/7/1
SIGB 2.875% 09/01/30	2.875	470	504	40,635	2030/9/1
SIGB 3% 09/01/24	3.0	770	830	66,860	2024/9/1
SIGB 3.125% 09/01/22	3.125	720	775	62,396	2022/9/1
SIGB 3.25% 09/01/20	3.25	590	626	50,395	2020/9/1
SIGB 3.375% 09/01/33	3.375	360	411	33,147	2033/9/1
SIGB 3.5% 03/01/27	3.5	850	957	77,081	2027/3/1
SIGB 4% 09/01/18	4.0	980	1,016	81,783	2018/9/1
小計				838,282	
（マレーシア）		千マレーシアリンギット	千マレーシアリンギット		
国債証券					
MGS 3.418% 08/15/22	3.418	2,500	2,467	64,349	2022/8/15
MGS 3.48% 03/15/23	3.48	2,050	2,018	52,647	2023/3/15
MGS 3.492% 03/31/20	3.492	2,000	1,999	52,135	2020/3/31
MGS 3.502% 05/31/27	3.502	800	759	19,808	2027/5/31
MGS 3.58% 09/28/18	3.58	2,150	2,159	56,332	2018/9/28
MGS 3.654% 10/31/19	3.654	1,050	1,056	27,555	2019/10/31
MGS 3.733% 06/15/28	3.733	1,300	1,244	32,457	2028/6/15
MGS 3.795% 09/30/22	3.795	500	502	13,109	2022/9/30
MGS 3.844% 04/15/33	3.844	1,150	1,091	28,462	2033/4/15
MGS 3.889% 07/31/20	3.889	1,500	1,514	39,507	2020/7/31
MGS 3.892% 03/15/27	3.892	1,130	1,112	29,021	2027/3/15
MGS 3.955% 09/15/25	3.955	1,390	1,388	36,216	2025/9/15
MGS 4.048% 09/30/21	4.048	3,100	3,151	82,195	2021/9/30
MGS 4.127% 04/15/32	4.127	1,450	1,410	36,790	2032/4/15
MGS 4.16% 07/15/21	4.16	1,650	1,683	43,918	2021/7/15
MGS 4.181% 07/15/24	4.181	2,350	2,394	62,436	2024/7/15
MGS 4.232% 06/30/31	4.232	650	641	16,724	2031/6/30
MGS 4.378% 11/29/19	4.378	2,200	2,250	58,699	2019/11/29
MGS 4.392% 04/15/26	4.392	1,800	1,849	48,238	2026/4/15
MGS 4.498% 04/15/30	4.498	500	508	13,254	2030/4/15
MGS 4.935% 09/30/43	4.935	1,600	1,627	42,438	2043/9/30
MGS 5.248% 09/15/28	5.248	1,900	2,068	53,951	2028/9/15
小計				910,251	
（南アフリカ）		千南アフリカランド	千南アフリカランド		
国債証券					
SAGB 10.5% 12/21/26	10.5	22,400	25,300	219,607	2026/12/21
SAGB 6.25% 03/31/36	6.25	9,620	7,035	61,069	2036/3/31
SAGB 6.5% 02/28/41	6.5	8,850	6,379	55,376	2041/2/28
SAGB 6.75% 03/31/21	6.75	5,300	5,162	44,813	2021/3/31
SAGB 7% 02/28/31	7.0	12,900	10,866	94,323	2031/2/28
SAGB 7.25% 01/15/20	7.25	7,550	7,523	65,302	2020/1/15
SAGB 7.75% 02/28/23	7.75	8,300	8,238	71,509	2023/2/28
SAGB 8% 01/31/30	8.0	11,100	10,283	89,264	2030/1/31
SAGB 8% 12/21/18	8.0	4,850	4,896	42,504	2018/12/21
SAGB 8.25% 03/31/32	8.25	7,400	6,873	59,659	2032/3/31
SAGB 8.5% 01/31/37	8.5	11,550	10,589	91,917	2037/1/31
SAGB 8.75% 01/31/44	8.75	12,450	11,452	99,405	2044/1/31
SAGB 8.75% 02/28/48	8.75	13,850	12,726	110,469	2048/2/28
SAGB 8.875% 02/28/35	8.875	8,900	8,545	74,176	2035/2/28
SAGB 9% 01/31/40	9.0	4,800	4,568	39,655	2040/1/31
小計				1,219,055	
合計				213,553,982	

（注）邦貨換算金額は、当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。

＜先物取引の銘柄別期末残高＞

	銘柄別	当期末 買建額(百万円)	当期末 売建額(百万円)
外国	EURO-SCHATZ	390	－
	US 5YR NOTE	604	－
	EURO-BOBL FU	508	－
	EURO-BUND	904	－
	US 10YR NOTE	378	－
	US LONG BOND	271	－

（注）外貨建資産は、当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

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	213,553,982	97.2
コール・ローン等、その他	6,156,988	2.8
投資信託財産総額	219,710,970	100.0

(注1)当期末における外貨建純資産(215,876,981千円)の投資信託財産総額(219,710,970千円)に対する比率は98.3%です。
(注2)外貨建資産は、当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＝111.34円　1カナダドル＝82.69円　1メキシコペソ＝6.02円
1ユーロ＝124.30円　1イギリスポンド＝142.70円　1スイスフラン＝114.18円
1スウェーデンクローナ＝12.80円　1ノルウェークローネ＝13.26円　1デンマーククローネ＝16.70円
1ポーランドズロチ＝29.72円　1オーストラリアドル＝82.86円　1シンガポールドル＝80.49円
1マレーシアリンギット＝26.08円　1南アフリカランド＝8.68円

資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

■資産、負債、元本および基準価額の状況

項目	当期末 2017年5月29日現在
(A) 資産	223,933,468,323円
コール・ローン等	4,299,281,581
公社債(評価額)	213,553,982,883
未収入金	4,227,115,730
未収利息	1,636,771,189
前払費用	73,006,266
差入委託証拠金	143,310,674
(B) 負債	4,456,153,060
未払金	4,258,142,443
未払解約金	198,001,277
未払利息	9,340
(C) 純資産総額(A－B)	219,477,315,263
元本	82,408,164,040
次期繰越損益金	137,069,151,223
(D) 受益権総口数	82,408,164,040口
1万口当たり基準価額(C／D)	26,633円

■損益の状況

項目	当期 自 2016年5月31日 至 2017年5月29日
(A) 配当等収益	5,115,218,643円
受取利息	5,117,371,800
支払利息	△2,153,157
(B) 有価証券売買損益	△5,685,021,332
売買益	3,425,476,162
売買損	△9,110,497,494
(C) 先物取引等取引損益	16,799,925
取引益	84,594,315
取引損	△67,794,390
(D) その他費用	△52,551,622
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	△605,554,386
(F) 前期繰越損益金	132,839,353,885
(G) 追加信託差損益金	32,143,777,606
(H) 解約差損益金	△27,308,425,882
(I) 計 (E＋F＋G＋H)	137,069,151,223
次期繰越損益金(I)	137,069,151,223

(注1)(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。
(注2)(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。
(注3)(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。

〈注記事項〉
※当ファンドの期首元本額は80,122,655,769円、期中追加設定元本額は19,826,581,417円、期中一部解約元本額は17,541,073,146円です。
※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

外国債券SMTBセレクション(SMA専用)	21,977,785,272円
コア投資戦略ファンド(成長型)	6,484,814,301円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,555,308,968円
世界経済インデックスファンド	3,651,364,890円
DC世界経済インデックスファンド	3,442,263,413円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,163,086,179円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	2,884,387,746円
外国債券オープン(毎月決算型)	2,354,816,143円
コア投資戦略ファンド(安定型)	2,272,158,879円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,090,912,966円
分散投資コア戦略ファンドS	2,047,146,155円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	1,815,112,091円
DC外国債券インデックス・オープン	1,586,357,819円
FOFs用外国債券オープン(適格機関投資家専用)	1,415,582,834円
DCマイセレクション25	1,383,220,530円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドS(適格機関投資家専用)	1,197,226,165円
DCマイセレクション50	1,183,135,629円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,158,283,975円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,093,017,669円
FOFs用 外国債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	1,079,528,233円
コア投資戦略ファンド(切替型)	1,056,150,735円
グローバル・インカム＆プラス(毎月決算型)	927,048,945円
分散投資コア戦略ファンドA	922,467,652円
グローバル債券ファンド・シリーズ1(適格機関投資家専用)	907,804,231円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	841,132,454円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	816,316,203円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	715,398,232円
DCマイセレクション75	697,787,782円
財産四分法ファンド(毎月決算型)	668,084,521円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	665,809,229円
SMT グローバル債券インデックス・オープン(為替ヘッジあり)	642,518,325円
外国債券ファンド・シリーズ1	573,831,140円
DCマイセレクションS25	565,741,631円
外国債券インデックス・オープン(SMA専用)	506,634,196円
DCマイセレクションS50	468,740,579円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	440,040,245円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	407,523,533円
外国債券インデックス・ファンド(適格機関投資家専用)	382,974,159円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	370,674,662円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	311,455,980円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	273,160,051円
SMT インデックスバランス・オープン	265,375,721円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	232,475,588円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	196,202,888円
DCマイセレクションS75	190,448,230円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	112,048,879円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	96,675,012円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり(SMA専用)	89,757,341円
外国債券インデックス・オープンVA1(適格機関投資家専用)	76,577,996円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	56,204,029円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	51,171,943円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	21,269,433円

SBI資産設計オープン(分配型)	13,688,398円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	6,853,200円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	2,611,040円

お知らせ

該当事項はありません。