

JP4 資産バランスファンド 安定成長コース 〈愛称：ゆうバランス〉

運用報告書（全体版）

第1期（決算日 2016年7月15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 安定成長コース」は、2016年7月15日に第1期の決算を行いましたので、第1期の運用状況を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	2016年2月18日から、2026年2月17日までです。			
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
	30%	40%	20%	10%
主な投資対象	JP4 資産バランスファンド 安定成長コース			
	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 国内債券インデックス・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。		
主な投資制限	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）			
	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及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したが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、経費控除後の繰越分を含めた利子・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。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。 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。				

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

J P 4 資産バランスファンド 安定成長コース	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)	11
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)	56
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)	86
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)	132

【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 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配金	期騰 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)	10,251	5	2.6	10,279	99.3	5,222

(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10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

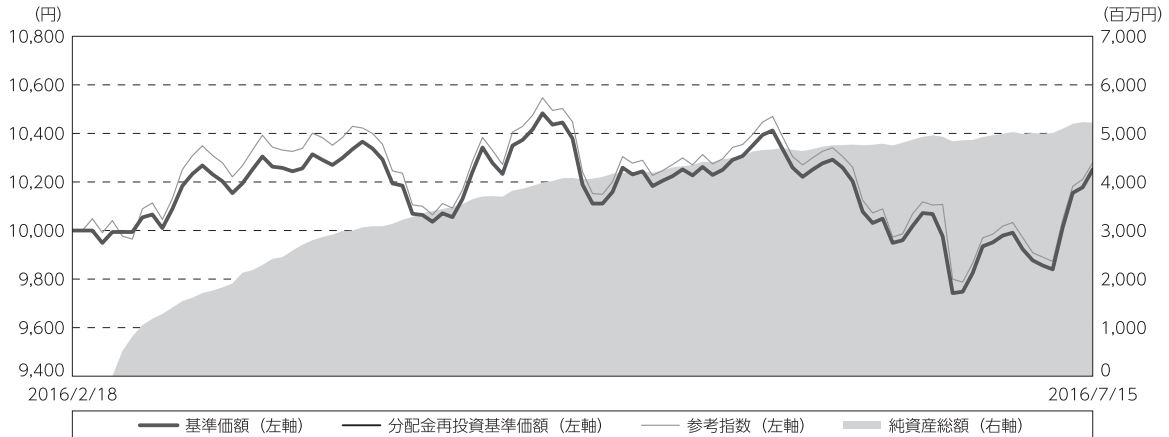
決算期	年 月 日	基準価額		参考指数	投資信託 組入比率
		騰落率	騰落率		
第1期	(設定日)	円	%		%
	2016年2月18日	10,000	—	10,000	—
	2月末	10,066	0.7	10,114	1.1
	3月末	10,338	3.4	10,400	4.0
	4月末	10,379	3.8	10,448	4.5
	5月末	10,394	3.9	10,447	4.5
	6月末	9,935	△0.7	9,970	△0.3
(期末)					
2016年7月15日	10,256	2.6	10,279	2.8	99.3

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

○運用経過

(2016年2月18日～2016年7月15日)

作成期間中の基準価額等の推移



設定日：10,000円

第1期末：10,251円 (既払分配金(税込み)：5円)

騰落率：2.6% (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しますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、設定時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10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。

○基準価額の変動要因

基準価額は、設定時10,000円から当作成期末10,251円となりました。なお、第1期末は5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256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、海外株式(4.3%)、日本債券(4.1%)、日本株式(0.4%)が上昇した一方で、海外債券(-4.0%)が下落しました。海外株式、日本債券などの上昇が主な値上がり要因となりました。

期間末における各資産の組入比率および当作成期間における組入投資信託証券の騰落率は以下の通りです。

資産	組入投資信託証券	組入比率	騰落率
日本株式	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)	29.9%	0.4%
日本債券	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)	39.0%	4.1%
海外株式	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)	20.3%	4.3%
海外債券	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)	10.0%	-4.0%

投資環境

日本債券市場	2016年2月以降の日銀のマイナス金利政策を背景に、日本債券市場では債券利回りは低下(価格は上昇)しました。また、米国の利上げ観測の後退や、英国のEU離脱を問う国民投票の結果を受け、円高・株安の動きが強まりリスク回避の動きとして債券が買われる展開が続き、利回りは継続的に低下(価格は上昇)しました。
日本株式市場	急激な円高進行を背景に、日本株式市場は低迷が続いたものの、円高進行が一服すると回復局面も見られました。しかし2016年6月に実施された英国のEU離脱を問う国民投票の結果、離脱派が勝利すると世界的に株式市場は一時混乱し、更なる円高進行とともに日本株式市場も大きく下げる局面がありました。その後、市場の不透明感が和らぎ、円高も一服すると、英国国民投票前の水準を回復し、ゆるやかな上昇局面となりました。
海外債券市場	米国の早期利上げ観測が後退したこと、欧州において緩和的な金融政策の長期化観測が高まったことなどを背景に、外国債券利回りは低下(価格は上昇)しました。為替レートは、米国の利上げペースが緩やかになるとの見方が強まったことや、英国のEU離脱に伴う不確実性を避ける動きから、相対的に安全とされる円が買われたことを背景に、主要通貨は対円で下落(円高)しました。
海外株式市場	原油価格の上昇などにより投資家心理が改善したこと、底堅い経済指標を受けて米国景気の先行き不透明感が後退したことなどから海外株式市場は上昇しました。為替レートは、米国の先行きの利上げペースが緩やかになるとの見方が強まったことや、英国のEU離脱に伴う不確実性を避ける動きから、相対的に安全とされる円が買われたことを背景に、主要通貨は対円で下落(円高)しました。

当ファンドのポートフォリオ

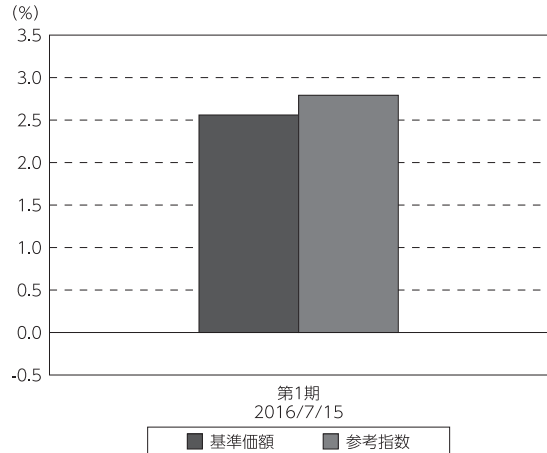
組入投資信託証券の日々の基準価額の動きの違いなどにより基本組入比率からの乖離が生じますが、資金の追加解約に対応した売買や適宜リバランスを行うことにより、できる限り当ファンドの基本組入比率を維持する運用を行いました。

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1期
	2016年2月18日～ 2016年7月15日
当期分配金	5
(対基準価額比率)	0.049%
当期の収益	5
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	251

(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

(2016年 2月18日～2016年 7月15日)

項 目	第 1 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	21	0.202	(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)	(0.079)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(11)	(0.110)	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)	(0.013)	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	21	0.204	
作成期間の平均基準価額は、10,222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

(2016年2月18日～2016年7月15日)

投資信託証券

銘 柄		第1期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	野村Fof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)	1,159,530,909	1,193,200	143,171,961	146,000
	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)	2,217,015,362	2,273,400	264,594,644	276,000
	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)	1,980,183,682	1,860,300	312,050,791	292,000
	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)	645,456,155	604,100	74,471,952	67,000
合 計		6,002,186,108	5,931,000	794,289,348	781,000

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2016年2月18日～2016年7月15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 (2016年2月18日～2016年7月15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

(2016年2月18日～2016年7月15日)

設定時残高 (元本)	当作成期設定 元本	当作成期解約 元本	当作成期末残高 (元本)	取 引 理 由
百万円 1	百万円 —	百万円 1	百万円 —	当初設定時における取得およびその処分

○組入資産の明細

(2016年7月15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1期末		
		口 数	評 価 額	比 率
		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)		1,016,358,948	1,060,875	20.3
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)		1,952,420,718	2,038,717	39.0
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)		1,668,132,891	1,561,872	29.9
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)		570,984,203	522,678	10.0
合	計	5,207,896,760	5,184,144	99.3

(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

(2016年7月15日現在)

項 目	第1期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	5,184,144	97.9
コール・ローン等、その他	111,648	2.1
投資信託財産総額	5,295,792	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 (2016年7月15日現在)

項 目	第1期末
	円
(A) 資産	5,295,792,358
コール・ローン等	38,647,412
投資信託受益証券(評価額)	5,184,144,946
未収入金	73,000,000
(B) 負債	73,659,135
未払収益分配金	2,547,113
未払解約金	63,816,251
未払信託報酬	7,232,816
未払利息	105
その他未払費用	62,850
(C) 純資産総額(A-B)	5,222,133,223
元本	5,094,227,903
次期繰越損益金	127,905,320
(D) 受益権総口数	5,094,227,903口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,251円

(注) 当ファンドの設定時元本額は1,000,000円、第1期中追加設定元本額は6,032,264,624円、第1期中一部解約元本額は939,036,721円です。

(注) 1口当たり純資産額は、第1期1.0251円です。

○損益の状況 (2016年2月18日～2016年7月15日)

項 目	第1期
	円
(A) 配当等収益	24,451,653
受取配当金	24,478,212
受取利息	198
支払利息	△ 26,757
(B) 有価証券売買損益	27,873,935
売買益	65,613,230
売買損	△ 37,739,295
(C) 信託報酬等	△ 7,295,666
(D) 当期損益金(A+B+C)	45,029,922
(E) 追加信託差損益金	85,422,511
(配当等相当額)	(305,373)
(売買損益相当額)	(85,117,138)
(F) 計(D+E)	130,452,433
(G) 収益分配金	△ 2,547,113
次期繰越損益金(F+G)	127,905,320
追加信託差損益金	85,422,511
(配当等相当額)	(305,373)
(売買損益相当額)	(85,117,138)
分配準備積立金	42,482,809

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

(注) 分配金の計算過程(2016年2月18日～2016年7月15日)は以下の通りです。

項 目	2016年2月18日～ 2016年7月15日
a. 配当等収益(経費控除後)	21,042,388円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	23,987,534円
c. 信託約款に定める収益調整金	85,422,511円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	130,452,433円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	256円
g. 分配金	2,547,113円
h. 分配金(1万口当たり)	5円

○分配金のお知らせ

	第 1 期
1 万口当たり分配金 (税込み)	5円

○お知らせ

2016年2月18日から2016年7月15日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

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)	30%
日 本 債 券	NOMURA-BPI総合	40%
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)	20%
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)	10%

- * 「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国内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 (円換算ベース・配当込み・為替ヘッジなし)」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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	

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1期(決算日 2016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。
- ・一印は、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		株式組入率	株式先物比率	純資産額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	騰落率			
第1	設定日(2016年2月3日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	百万円 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

(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		株式組入率	株式先物比率
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
第1期	(設定日)2016年2月3日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —
	2月末	9,230	△7.7	9,229	△7.7	98.7	1.3
	3月末	9,671	△3.3	9,580	△4.2	98.0	1.9
	4月末	9,621	△3.8	9,533	△4.7	98.1	1.9
	5月末	9,906	△0.9	9,812	△1.9	98.0	2.0
	6月末	8,957	△10.4	8,859	△11.4	98.8	1.2
	(期 末)2016年7月7日	8,815	△11.9	8,719	△12.8	99.6	1.0

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

(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。

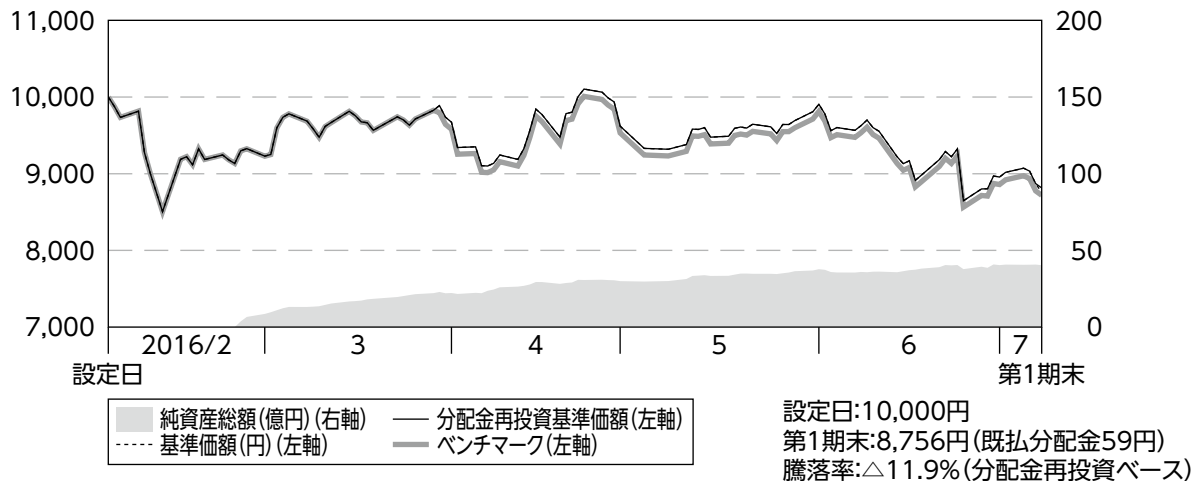
(注3) 株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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。

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

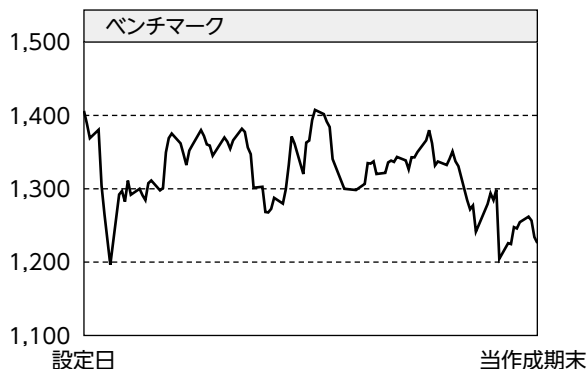


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2016年2月3日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

ベンチマーク(TOPIX(東証株価指数))の動きを反映して基準価額は変動し、設定日比では下落しました。

投資環境



設定当初は、原油価格下落による世界景気への影響や円高進行による企業業績悪化への懸念から、国内株式市場は下落しました。

その後は、原油価格の底打ちなど世界景気に対する過度な懸念が和らぎ反発したものの、米国の早期利上げ観測が後退したことや日銀が追加金融緩和を見送ったことで円高・米ドル安が進行し、国内株式市場は上値の重い展開となりました。

6月下旬には、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱支持が残留支持を上回ったことを受けてリスクを回避する動きが強まり、円相場が急伸するとともに、国内株式市場は下落しました。

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。

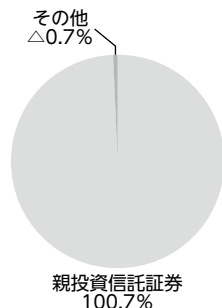
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

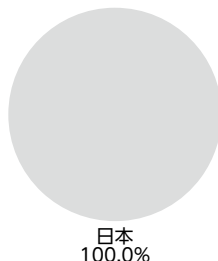
	当作成期末
	2016年7月7日
国内株式インデックス マザーファンド	100.7%
その他	△0.7%
組入ファンド数	1

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

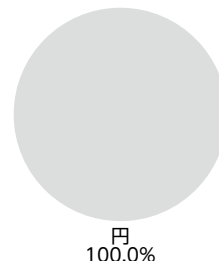
○資産別配分



○国別配分



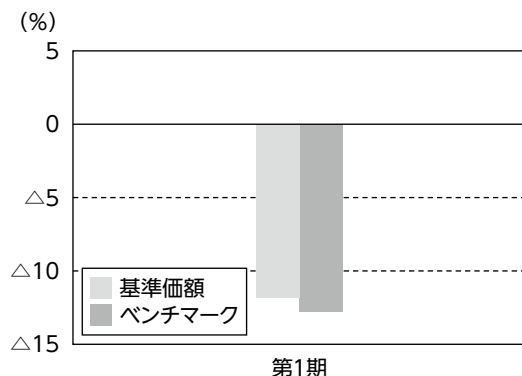
○通貨別配分



(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)などです。

分配金

分配金額は、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す。
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1期	
	2016年2月3日~2016年7月7日	
当期分配金	(円)	59
(対基準価額比率)	(%)	(0.669)
当期の収益	(円)	55
当期の収益以外	(円)	4
翌期繰越分配対象額	(円)	6

(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		項目の概要
	(2016年2月3日~2016年7月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	5円	0.051%	(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9,477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。 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 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(3)	(0.037)	
(販売会社)	(0)	(0.005)	
(受託会社)	(1)	(0.009)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{〔期中の売買委託手数料〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{〔期中の有価証券取引税〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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	0	0.002	(d) その他費用＝ $\frac{〔期中のその他費用〕}{〔期中の平均受益権口数〕} \times 10,000$ 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)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	5	0.053	

(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
国内株式インデックス マザーファンド	千口 4,298,435	千円 4,833,823	千口 453,078	千円 513,210

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	16,316,130千円
(b) 当 作 成 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	142,896,794千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.11

(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
金 銭 信 託	百万円 298	百万円 298	% 100.0	百万円 298	百万円 298	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	654	29	4.4	647	27	4.2

(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
金 銭 信 託	百万円 104,649	百万円 104,649	% 100.0	百万円 104,649	百万円 104,649	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	94,932	3,781	4.0	94,972	3,613	3.8

<平均保有割合 2.1%>

(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。

■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 末		
	買 付 額	売 付 額	当 作 成 期 末 保 有 額
株 式	52百万円	2百万円	467百万円

(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。

自社による当ファンドの設定・解約状況

当 作 成 期 首 残 高 本 (元)	当 作 成 期 設 定 本 元	当 作 成 期 解 約 本 元	当 作 成 期 末 残 高 本 (元)	取 引 の 理 由
千円 -	千円 500	千円 500	千円 -	当初設定時における取得およびその解約

組入資産の明細

<親投資信託残高>

	当 作 成 期 末	
	口 数	評 価 額
国内株式インデックス マザーファンド	千口 3,845,357	千円 4,063,004

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、132,573,601千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
国内株式インデックス マザーファンド	千円 4,063,004	% 99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,351	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	4,070,355	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 1 期 末 2016年7月7日現在
(A) 資 産	4,070,355,873円
コール・ローン等	7,351,187
国内株式インデックス マザーファンド(評価額)	4,063,004,686
(B) 負 債	34,483,944
未払収益分配金	27,195,917
未払解約金	5,999,999
未払信託報酬	1,231,695
未払利息	15
その他未払費用	56,318
(C) 純資産総額(A-B)	4,035,871,929
元 本	4,609,477,561
次期繰越損益金	△573,605,632
(D) 受益権総口数	4,609,477,561口
1万口当たり基準価額(C/D)	8,756円

■損益の状況

項 目	第 1 期 自 2016年2月3日 至 2016年7月7日
(A) 配 当 等 収 益	△2,052円 ²
受 取 利 息	
支 払 利 息	△2,054
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△259,590,833
売 買 益 損	18,458,957
売 買 損 益	△278,049,790
(C) 信 託 報 酬 等	△1,288,446
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△260,881,331
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△285,528,384
(配 当 等 相 当 額)	(△666)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△285,527,718)
(F) 計 (D+E)	△546,409,715
(G) 収 益 分 配 金	△27,195,917
次 期 繰 越 損 益 金 (F+G)	△573,605,632
追 加 信 託 差 損 益 金	△287,372,175
(配 当 等 相 当 額)	(1,766,450)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△289,138,625)
分 配 準 備 積 立 金	1,445,267
繰 越 損 益 金	△287,678,724

- (注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(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) (E) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの第1期首元本額は500,000円、第1期中追加設定元本額は5,293,278,136円、第1期中一部解約元本額は684,300,575円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 1 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	26,797,393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
(C) 収益調整金額	3,610,241円
(D) 分配準備積立金額	－円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	30,407,634円
(F) 期末残存口数	4,609,477,561口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	65円
(H) 分配金額(1万口当たり)	59円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	27,195,917円

分配金のお知らせ

	第1期
1万口当たり分配金	59円

(注)分配金は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16期（決算日 2016年5月30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上げます。

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、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、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		株式先物率 株式先物率	純資産額
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
第12期(2012年5月29日)	円 5,771	% △9.7	727.03	% △11.7	% 97.4	百万円 113,418
第13期(2013年5月29日)	9,567	65.8	1,178.87	62.1	97.8	149,398
第14期(2014年5月29日)	9,940	3.9	1,200.68	1.9	97.9	142,008
第15期(2015年5月29日)	14,114	42.0	1,673.65	39.4	97.9	157,438
第16期(2016年5月30日)	11,755	△16.7	1,366.01	△18.4	97.9	151,002

(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		株式先物率 株式先物率	株式先物率 株式先物率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首) 2015年 5月29日	円 14,114	% －	1,673.65	% －	% 97.9	% 1.8
6月末	13,761	△2.5	1,630.40	△2.6	98.5	1.5
7月末	14,007	△0.8	1,659.52	△0.8	99.0	0.9
8月末	12,976	△8.1	1,537.05	△8.2	99.1	0.9
9月末	12,004	△14.9	1,411.16	△15.7	97.0	2.9
10月末	13,256	△6.1	1,558.20	△6.9	98.3	1.5
11月末	13,446	△4.7	1,580.25	△5.6	98.2	1.7
12月末	13,181	△6.6	1,547.30	△7.5	98.5	1.6
2016年 1月末	12,201	△13.6	1,432.07	△14.4	99.0	1.0
2月末	11,059	△21.6	1,297.85	△22.5	98.7	1.3
3月末	11,589	△17.9	1,347.20	△19.5	98.0	1.9
4月末	11,530	△18.3	1,340.55	△19.9	98.1	1.9
(当期末) 2016年 5月30日	11,755	△16.7	1,366.01	△18.4	97.9	1.9

(注1)騰落率は期首比です。

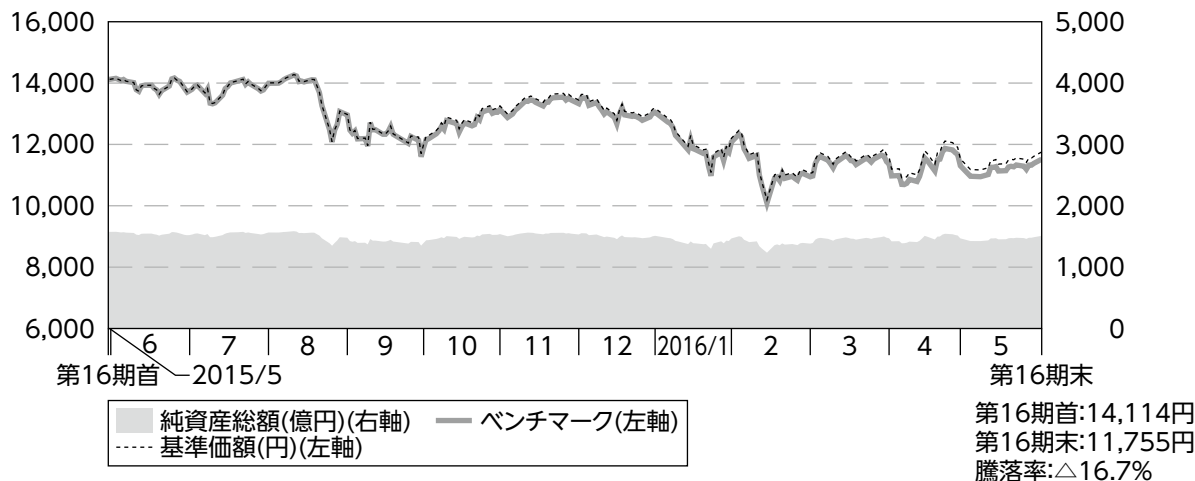
(注2)株式先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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、2015年5月29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(TOPIX(東証株価指数))の動きを反映して基準価額は変動し、期首比では下落しました。

投資環境



国内株式市場は、期初は、一進一退の動きとなりましたが、2015年8月下旬以降は、中国株式市場急落により投資家心理が急激に悪化、世界的な株安となり国内株式市場も下落しました。

10月から11月にかけてはTPP（環太平洋戦略的経済連携協定）交渉の大筋合意や円安の進展などから一時反発しましたが、2016年1月以降は原油価格の下落や世界景気に対する不透明感に加え、円高進行による企業業績下振れへの懸念などから調整局面を迎えました。

期末にかけては、原油価格の底打ちや為替市場における円高一服を好感して、株式市場も落ち着きを取り戻しました。

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

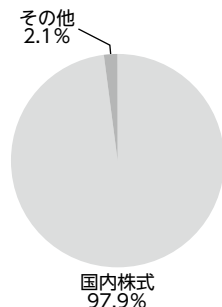
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	トヨタ自動車	日本	3.4%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	2.1%
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	KDDI	日本	1.5%
6	日本たばこ産業	日本	1.4%

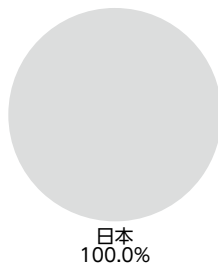
順位	銘柄名	国	組入比率
7	本田技研工業	日本	1.4%
8	三井住友フィナンシャルグループ	日本	1.3%
9	みずほフィナンシャルグループ	日本	1.2%
10	ソニー	日本	1.1%
組入銘柄数		1,905	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

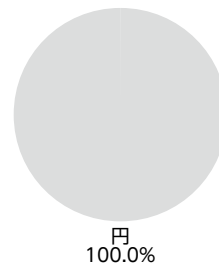
○資産別配分



○国別配分



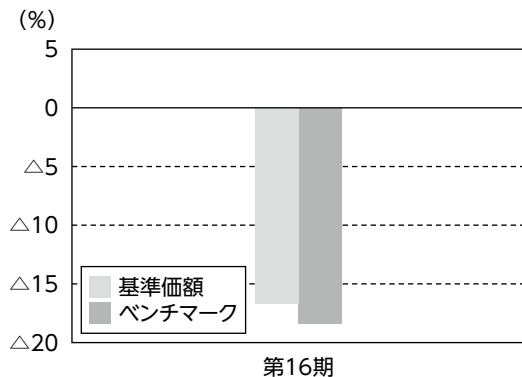
○通貨別配分



(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)などです。

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		項目の概要
	(2015年5月30日~2016年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (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円 (0) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.001% (0.000) (-) (-) (-) (-) (-) (0.001)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	0 (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (0.000)	(c) 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
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(12,760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
国内	上 場	千株 25,883 (△2,635)	千円 31,962,998 (－)	千株 6,945	千円 10,216,390

(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
国内	株 式 先 物 取 引	百万円 36,752	百万円 36,531	百万円 －	百万円 －

(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	42,179,389千円
(b) 当 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	146,141,615千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	0.28

(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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 91,699	百万円 91,699	% 100.0	百万円 91,500	百万円 91,500	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	377,908	25,874	6.8	378,226	25,874	6.8

(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	114百万円	71百万円	579百万円

(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	30	35	9,310
日本水産	86.7	94.4	59,472
マルハニチロ	13.9	16.7	43,236
サカタのタネ	11.4	12.1	31,944
ホクト	7.8	8.3	16,707
ホクリョウ	—	0.8	800
鉱業(0.3%)			
住石ホールディングス	19.6	24.1	2,169
日鉄鉱業	20	23	8,809
三井松島産業	46	54	5,616
国際石油開発帝石	371.6	431.4	386,922
日本海洋掘削	2.1	2.5	6,167
石油資源開発	10.1	13	31,720
K&Oエナジーグループ	4.7	5.5	7,144
建設業(3.3%)			
ショーボンドホールディングス	6.8	8.6	44,204
ミライト・ホールディングス	21.7	25.2	27,997
タマホーム	5.3	6.1	2,696
サンヨーホームズ	0.8	1.7	797
ダイセキ環境ソリューション	0.8	1.9	2,209
安藤・間	47.3	54.7	33,968
東急建設	25.2	26.7	26,326
コムシスホールディングス	31.4	35.2	64,416
ミサワホーム	8.9	10.2	8,292
ピーアールホールディングス	—	3.2	1,404
高松コンストラクショングループ	5.3	6.2	16,647
東建コーポレーション	2.7	3.4	29,206
ソネック	—	0.9	524
ヤマウラ	3.8	4.2	2,234
大成建設	366	425	345,100
大林組	212	245.6	285,632
清水建設	216	251	250,247
飛鳥建設	47.5	65.7	12,220
長谷工コーポレーション	88.2	95.6	117,779
松井建設	8	9.1	9,846
銭高組	10	12	5,028
鹿島建設	310	384	288,768
不動テトラ	53.9	59.8	9,089
大末建設	—	3.1	3,301
鉄建建設	44	51	16,269
日鉄住金テックスエンジ	13	—	—
西松建設	76	95	44,365
三井住友建設	286.2	313.8	31,066

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)
大豊建設	20	32	16,000
前田建設工業	47	50	42,900
佐田建設	26	6.2	2,560
ナカノフドー建設	6.2	6.7	3,229
奥村組	67	78	47,580
大和小田急建設	4	—	—
東鉄工業	8.5	9.8	28,988
イチケン	9	10	3,130
浅沼組	—	26	6,552
戸田建設	89	95	47,690
熊谷組	89	121	37,631
青木あすなろ建設	4.6	5.4	3,888
北野建設	15	18	4,752
植木組	10	11	2,376
三井ホーム	9	11	5,577
矢作建設工業	8.7	11.1	9,879
ビエス三菱	8	10.1	4,161
日本ハウスホールディングス	9	16.7	5,961
大東建託	26.4	30.1	491,533
新日本建設	8.4	9.9	6,662
N I P P O	16	19	37,848
東亜道路工業	13	15	4,650
前田道路	22	26	51,662
日本道路	21	24	10,896
東亜建設工業	53	71	11,999
若築建設	41	47	7,567
東洋建設	20.6	25.7	13,184
五洋建設	78.3	90.9	51,085
大林道路	8	9.6	7,209
世紀東急工業	10.3	12.8	6,912
福田組	11	13	15,639
住友林業	52	56.4	84,882
日本基礎技術	8.4	9.1	3,467
日成ビルド工業	20	23	11,500
巴コーポレーション	9.5	10.8	3,812
パナホーム	26	31	27,218
大和ハウス工業	206.6	241.9	776,982
ライト工業	11.3	15.7	18,918
積水ハウス	221.6	273.8	541,987
日特建設	9.4	9	3,969
北陸電気工事	4	4	3,292
ユアテック	11	13	10,673
西部電気工業	6	7	2,940
四電工	6	6	2,454

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
中電工	10.2	11.8	25,924			
関電工	32	33	27,885			
きんでん	47	49.5	64,102			
東京エネシス	8	9	9,963			
トーエネック	10	12	7,056			
住友電設	5.6	6.5	9,100			
日本電設工業	11.5	13.3	25,309			
協和エクシオ	29.9	32.1	42,757			
新日本空調	6.1	6.9	7,265			
NDS	12	13	3,614			
九電工	13	15	49,050			
三機工業	14.5	18.2	16,016			
日揮	71	82	138,334			
中外炉工業	22	25	5,525			
ヤマト	7	7.4	3,936			
太平電業	10	12	13,428			
高砂熱学工業	19.4	24.4	34,428			
三晃金属工業	8	9	2,565			
朝日工業社	8	10	5,040			
明星工業	11.6	14.8	6,956			
大気社	10.1	10	25,880			
ダイダン	10	11	8,811			
日比谷総合設備	9.1	9.8	16,552			
東芝プラントシステム	11.5	13.3	20,947			
OSJBホールディングス	9.6	16.7	3,540			
東洋エンジニアリング	35	44	15,312			
千代田化工建設	51	59	46,256			
新興プランテック	14.5	16.8	14,834			
食料品(5.2%)						
日本製粉	43	54	45,900			
日清製粉グループ本社	77.4	89.8	168,195			
日東富士製粉	6	6	2,076			
昭和産業	29	34	16,694			
鳥越製粉	5.6	6.5	4,147			
中部飼料	6.8	7.6	6,095			
フィード・ワン	42.7	49.5	6,088			
東洋精糖	11	13	1,456			
日本甜菜製糖	36	42	7,854			
三井製糖	28	32	16,736			
塩水港精糖	7.6	8.9	2,127			
日新製糖	—	3.5	5,047			
森永製菓	64	74	42,402			
中村屋	16	19	8,835			
江崎グリコ	16.3	18.9	113,778			
名糖産業	3.1	3.6	4,784			
不二家	40	47	9,400			
山崎製パン	52	60	162,300			
第一屋製パン	9	13	1,547			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
モロゾフ	11	13	5,590			
亀田製菓	3.9	4.6	23,874			
寿スピリッツ	1.7	5.8	16,495			
カルビー	26.1	30.4	124,944			
森永乳業	63	74	49,802			
六甲バター	3.2	3.7	7,969			
ヤクルト本社	37.8	43.9	231,792			
明治ホールディングス	20.9	48.5	484,515			
雪印メグミルク	16.6	19.3	67,260			
プリマハム	40	52	15,392			
日本ハム	52	60	153,120			
伊藤ハム	39	—	—			
丸大食品	36	42	20,538			
米久	2.3	—	—			
S Foods	4.4	5.1	14,616			
伊藤ハム米久ホールディングス	—	48.9	47,579			
サッポロホールディングス	116	125	73,875			
アサヒグループホールディングス	141.8	153.7	577,912			
キリンホールディングス	285.9	331.9	620,818			
宝ホールディングス	55.4	59.3	58,529			
オエノンホールディングス	18	22	4,642			
養命酒製造	4	2.5	4,592			
コカ・コーラウエスト	23.9	27.8	86,736			
コカ・コーライーストジャパン	21.5	29	62,756			
サントリー食品インターナショナル	42.3	56.1	291,159			
ダイドードリンコ	3.6	4.1	24,026			
伊藤園	20.9	24.3	89,788			
キーコーヒー	6.2	7.2	13,356			
ユニカフェ	1.9	2.2	1,949			
ジャパンフーズ	0.9	1.1	1,329			
日清オイリオグループ	34	43	21,027			
不二製油グループ本社	18.8	21.9	41,960			
かどや製油	0.7	0.8	2,220			
J-オイルミルズ	30	34	12,444			
キッコーマン	58	62	243,660			
味の素	163	172.2	462,615			
キユービー	35.9	41.7	123,765			
ハウス食品グループ本社	26.1	28	62,020			
カゴメ	27.3	29.4	78,292			
焼津水産化学工業	3.3	3.9	3,896			
アリアケジャパン	6.4	6.7	44,086			
ビエトロ	—	0.8	1,512			
エバラ食品工業	1.2	2	3,862			
ニチレイ	75	87	83,346			
東洋水産	36.9	40.3	173,693			
イートアンド	0.8	0.9	1,875			
日清食品ホールディングス	29.9	34.7	193,626			
永谷園ホールディングス	7	8	9,592			

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
一正蒲鉾	2.4	2.9	3,059	
フジッコ	7	8	21,896	
ロック・フィールド	3.7	8.6	14,430	
日本たばこ産業	391	484.2	2,122,248	
ケンコーマヨネーズ	2.3	2.7	7,052	
わらべや日洋	4.1	4.4	9,174	
なとり	3.3	4.1	6,769	
北の達人コーポレーション	—	1.6	779	
ユウグレナ	23.6	27.6	46,340	
ミヨシ油脂	24	28	3,584	
理研ビタミン	2.1	2.4	11,016	
繊維製品(0.7%)				
片倉工業	8.4	9.7	12,328	
グンゼ	53	62	20,522	
東洋紡	261	304	62,624	
ユニチカ	192	223	14,272	
富士紡ホールディングス	32	37	8,991	
日清紡ホールディングス	42	—	—	
倉敷紡績	68	78	15,600	
シキボウ	38	47	5,217	
日本毛織	21	23.6	17,747	
トーア紡コーポレーション	30	3.2	1,500	
ダイドーリミテッド	7.6	8.7	4,028	
帝国繊維	6.9	8	10,776	
帝人	270	313	119,566	
東レ	510	555	528,193	
サカイオーベックス	17	21	3,654	
住江織物	19	23	5,911	
日本フェルト	3.8	4.2	2,041	
イチカワ	5	6	1,626	
日本バイリーン	9	—	—	
芦森工業	18	23	3,887	
アツギ	56	59	6,608	
ダイニック	12	14	2,226	
セーレン	16.4	19.1	22,786	
東海染工	9	11	1,419	
小松精練	11.5	12.5	7,537	
ワコールホールディングス	39	46	54,234	
ホギメディカル	4.2	4.8	32,784	
レナウン	15.8	20.7	2,442	
クラウドシア	2.6	3.5	1,743	
T S I ホールディングス	29.6	34.2	21,614	
三陽商会	36	45	10,845	
オンワードホールディングス	47	51	38,352	
ルック	13	19	2,850	
ゴールドウイン	16	3.4	16,626	
デサント	15.4	17.5	24,447	
キング	3.4	3.8	1,371	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ヤマトインターナショナル	4.4	4.7	1,795	
パルプ・紙(0.3%)				
特種東海製紙	38	44	15,796	
王子ホールディングス	271	314	140,358	
日本製紙	31.8	39.6	76,428	
三菱製紙	100	117	9,477	
北越紀州製紙	40.9	47.5	36,242	
中越パルプ工業	25	30	6,930	
巴川製紙所	10	12	2,316	
大王製紙	29	33.9	39,968	
レンゴー	58	68	45,832	
トーモク	21	24	7,344	
ザ・バック	4.7	5.4	14,250	
化学(6.2%)				
クラレ	112.3	120.8	176,005	
旭化成	411	477	350,499	
共和レザー	4.4	5	4,385	
コープケミカル	10	—	—	
昭和電工	439	510	57,120	
住友化学	485	564	279,744	
日本化成	12	14	1,596	
住友精化	14	16	9,072	
日産化学工業	43.2	46	147,890	
ラサ工業	25	29	3,016	
クレハ	46	58	23,606	
多木化学	4	5	3,320	
テイカ	11	13	7,124	
石原産業	111	137	10,549	
片倉コープアグリ	4	9	1,827	
日東エフシー	—	4.5	3,942	
日本曹達	42	49	25,137	
東ソー	165	207	109,503	
トクヤマ	103	127	37,084	
セントラル硝子	67	83	45,816	
東亜合成	83	47.9	49,863	
大阪ソーダ	26	33	13,728	
関東電化工業	16	18	16,308	
デンカ	137	159	76,002	
信越化学工業	118.3	137.3	871,855	
日本カーバイド工業	22	26	4,368	
堺化学工業	27	31	9,517	
エア・ウォーター	58	63	109,242	
大陽日酸	84.7	59	59,118	
日本化学工業	24	28	6,468	
日本パーカライジング	31.1	39.1	43,948	
高压ガス工業	10	11	7,161	
チタン工業	8	9	1,665	
四国化成工業	10	11	9,669	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
戸田工業	13	15	4,725	
ステラ ケミファ	3.4	3.9	11,001	
保土谷化学工業	20	23	6,762	
日本触媒	52	11.1	72,927	
大日精化工業	27	30	13,800	
カネカ	89	103	88,477	
三菱瓦斯化学	113	132	82,896	
三井化学	300	325	130,975	
J S R	65.1	71.8	115,310	
東京応化工業	13.7	15.4	43,643	
大阪有機化学工業	4.7	5.5	3,366	
三菱ケミカルホールディングス	412.3	512.8	287,116	
日本合成化学工業	15	18	11,538	
ダイセル	92.7	107.7	143,456	
住友ベークライト	62	72	38,448	
積水化学工業	153	173.8	251,314	
日本ゼオン	57	66	54,714	
アイカ工業	19.8	23	56,925	
宇部興産	332	410	83,640	
積水樹脂	10.2	11.8	18,703	
タキロン	14	18	9,252	
旭有機材	23	25	5,125	
日立化成	32.6	37.8	77,792	
ニチバン	6	8	6,280	
リケンテクノス	10.7	16.5	7,243	
大倉工業	16	18	5,778	
積水化成成品工業	19	20	7,200	
群栄化学工業	18	20	5,620	
タイガースポリマー	3.2	3.8	2,135	
ミライアル	2.4	2.8	2,167	
ダイキアクシス	0.8	1.5	1,315	
ダイキョーニシカワ	1.6	9.9	15,127	
日本化薬	43	50	54,350	
カーリットホールディングス	5.4	7.2	3,484	
日本精化	5.5	6.3	4,586	
扶桑化学工業	—	4.9	8,075	
ADEKA	30.4	37.6	56,475	
日油	54	58	54,926	
ハリマ化成グループ	5.8	6.6	3,577	
花王	177.4	205.9	1,253,107	
第一工業製薬	15	17	5,967	
ニイタカ	1	1.1	1,481	
三洋化成工業	21	24	21,168	
大日本塗料	38	44	8,932	
日本ペイントホールディングス	57.1	59.1	182,619	
関西ペイント	80	86.6	188,874	
神東塗料	5	6	1,044	
中国塗料	19	22	17,314	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
日本特殊塗料	5.1	5.4	5,616	
藤倉化成	9	10.4	5,855	
太陽ホールディングス	5.4	5.6	20,552	
D I C	264	302	78,218	
サカタインクス	13.5	15.6	19,843	
東洋インキSCホールディングス	65	76	35,796	
T&K TOKA	2.2	5.6	4,922	
富士フイルムホールディングス	150.9	175.2	786,472	
資生堂	117.3	145.3	423,694	
ライオン	76	88	142,560	
高砂香料工業	22	5	12,925	
マンダム	6.6	7.1	36,068	
ミルボン	3.9	4.5	21,847	
ファンケル	15.3	17.8	25,774	
コーセー	10.7	12.4	121,272	
コタ	2.3	2.6	2,815	
シーズ・ホールディングス	4.5	9.8	22,491	
シーボン	0.8	0.9	2,027	
ポーラ・オルビスホールディングス	7.8	7.8	74,880	
ノエビアホールディングス	4.2	4.8	15,072	
アジュバンコスメジャパン	1.2	1.5	1,387	
エステー	4.5	5.3	6,185	
アグロ カネショウ	1.8	3	3,126	
コニシ	5.2	12	17,052	
長谷川香料	8.3	9.7	18,759	
星光PMC	3.6	4.2	5,174	
小林製薬	10.8	11.6	104,168	
荒川化学工業	5.6	6.5	6,272	
メック	5.1	6	4,986	
日本高純度化学	1.9	2.2	4,657	
タカラバイオ	—	16.4	23,616	
J C U	1.8	2.3	7,659	
新田ゼラチン	4.1	5.1	3,865	
OATアグリオ	—	0.9	1,386	
デクセリアルズ	—	22.9	21,251	
アース製薬	4.7	5.5	27,170	
イハラケミカル工業	10.3	11.8	15,151	
北興化学工業	7	8	2,568	
大成ラミック	1.8	2.1	5,842	
クミアイ化学工業	13.6	15.8	14,204	
日本農薬	15.1	17.5	8,837	
アキレス	56	63	8,568	
有沢製作所	11.1	11.3	6,248	
日東電工	51	59.1	421,974	
レック	2.3	2.4	3,405	
きもと	11.8	12.7	2,095	
藤森工業	5.7	6.6	15,424	
前澤化成工業	4.6	5.4	5,313	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評 価	額 (千円)
J S P	4.9	5	10,865	
エフピコ	5.8	6.8	32,844	
天馬	5.1	5.9	10,366	
信越ポリマー	12.9	15	9,990	
東リ	17	20	6,400	
ニフコ	14.7	14.6	83,074	
日本バルカー工業	27	30	8,430	
ユニ・チャーム	133.5	155	334,335	
医薬品 (5.8%)				
協和発酵キリン	79	91.6	188,421	
武田薬品工業	247.1	304.9	1,469,313	
アステラス製薬	751	857.2	1,280,228	
大日本住友製薬	46.7	54.2	88,346	
塩野義製薬	103	111.6	692,812	
田辺三菱製薬	76.8	89.2	165,822	
わかもと製薬	7	9	2,277	
あすか製薬	7.8	9.7	19,235	
日本新薬	15	17.5	104,300	
ピオフェルミン製薬	1.1	1.2	3,375	
中外製薬	65.6	76.2	298,704	
科研製薬	23	13.2	82,764	
エーザイ	87	94.2	656,668	
ロート製薬	30	37.5	64,200	
小野薬品工業	29.9	173.8	838,411	
久光製薬	18.6	23.8	139,944	
有機合成薬品工業	4	5	1,220	
持田製薬	4.5	5.3	45,050	
参天製薬	121.2	141	230,394	
扶桑薬品工業	22	26	7,644	
日本ケミファ	8	11	5,412	
ツムラ	20.8	24.1	62,250	
日医工	15.4	17.9	44,051	
キッセイ薬品工業	12.2	13.6	32,572	
生化学工業	12.6	14.6	22,980	
栄研化学	5.5	6.4	13,792	
日水製薬	2.6	3.1	3,620	
鳥居薬品	4.5	5.2	13,483	
J C R ファーマ	5.1	5.9	17,936	
東和薬品	3.4	3.5	20,790	
富士製薬工業	1.8	2.5	5,435	
沢井製薬	10.4	13	103,740	
ゼリア新薬工業	13.5	15.7	23,298	
第一三共	221.8	257.4	672,843	
キョーリン製薬ホールディングス	17.6	20.4	44,696	
大幸薬品	2.9	3.8	5,855	
ダイト	2.9	4.3	11,868	
大塚ホールディングス	130.9	164.6	751,563	
大正製薬ホールディングス	15.9	18.4	189,336	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株数 (千株)	株数 (千株)	評 価	額 (千円)
ペプチドリーム	—	12.7	82,550	
石油・石炭製品 (0.5%)				
日本コークス工業	59.1	61.8	4,264	
昭和シェル石油	58.9	77	88,165	
コスモ石油	182	—	—	
ニチレキ	8	9.3	6,537	
東燃ゼネラル石油	99	115	120,635	
ユシロ化学工業	3.5	4.1	5,457	
ビービー・カストロール	2.7	3.1	3,940	
富士石油	15.3	17.7	7,168	
MORESCO	1.7	2.4	2,779	
出光興産	31.3	39.9	89,934	
J Xホールディングス	731.8	906.1	393,519	
コスモエネルギーホールディングス	—	23.1	36,059	
ゴム製品 (0.9%)				
横浜ゴム	73	46.2	77,800	
東洋ゴム工業	29.8	34.6	44,841	
ブリヂストン	206.6	258.3	964,492	
住友ゴム工業	51.4	71.6	115,490	
藤倉ゴム工業	5.5	6.4	2,739	
オカモト	23	24	25,680	
フコク	2.8	2.8	2,293	
ニッタ	6.5	8.2	22,058	
住友理工	12.2	16.5	15,130	
三ツ星ベルト	16	19	17,271	
バンドー化学	24	28	14,840	
ガラス・土石製品 (0.9%)				
日東紡績	49	51	17,544	
旭硝子	325	404	277,548	
日本板硝子	318	369	34,317	
石塚硝子	9	11	1,903	
日本山村硝子	27	32	5,184	
日本電気硝子	126	158	84,056	
オハラ	2.7	3.2	1,731	
住友大阪セメント	123	152	69,464	
太平洋セメント	412	478	142,444	
デイ・シイ	7.3	8.2	3,345	
日本ヒューム	7	7.6	4,529	
日本コンクリート工業	11.5	16.2	5,281	
三谷セキサン	3.3	3.8	6,919	
アジアパイルホールディングス	8.9	9.7	3,870	
東海カーボン	57	67	20,703	
日本カーボン	35	38	8,892	
東洋炭素	3.7	4.3	6,402	
ノリタケカンパニーリミテド	38	43	11,137	
TOTO	97	56.2	235,197	
日本碍子	83	97	232,218	
日本特殊陶業	56.8	66	139,326	

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
MARUWA	2	2.8	8,974			
品川リフラクトリーズ	17	20	4,040			
黒崎播磨	15	18	4,662			
ヨータイ	4	5	1,415			
イソライト工業	3.5	5.8	1,554			
東京窯業	8	11	1,859			
ニッカトー	2.6	3.2	1,200			
フジミインコーポレーテッド	6.4	6.7	11,946			
ニチアス	29	39	33,111			
ニチハ	8.8	10.2	15,524			
鉄鋼(1.2%)						
新日鐵住金	2,787	345.1	776,992			
神戸製鋼所	1,140	1,406	137,788			
合同製鐵	35	44	7,832			
ジェイ エフ イー ホールディングス	168.2	209.2	304,909			
日新製鋼	28.4	35.2	49,033			
東京製鐵	33.7	42.3	27,410			
共英製鋼	7	8.3	14,060			
大和工業	15	16.9	44,210			
東京鐵鋼	13	16	5,248			
大阪製鐵	4.1	4.9	8,996			
淀川製鋼所	46	11.5	30,992			
東洋鋼鈑	15.8	18.5	5,513			
丸一鋼管	20.2	25.6	94,208			
モリ工業	11	14	4,410			
大同特殊鋼	110	129	49,407			
日本高周波鋼業	29	38	2,812			
日本冶金工業	54.7	60.7	9,469			
山陽特殊製鋼	40	46	22,954			
愛知製鋼	39	45	22,185			
日立金属	67	87.6	101,002			
日本金属	17	20	2,080			
大太平洋金属	42	54	18,468			
新日本電工	40.2	44.2	7,867			
栗本鐵工所	34	38	6,422			
缸技	9	14	2,184			
日本鑄鉄管	6	10	1,480			
三菱製鋼	44	55	9,900			
日亜鋼業	9.2	12.7	2,921			
日本精線	5	6	2,826			
シンニッタン	6.9	7.1	4,125			
新家工業	13	18	2,592			
非鉄金属(0.9%)						
大紀アルミニウム工業所	11	12	3,840			
日本軽金属ホールディングス	160	173.3	37,952			
三井金属鉱業	179	195	36,855			
東邦亜鉛	38	40	14,280			
三菱マテリアル	411	478	150,092			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
住友金属鉱山	182	211	236,847			
DOWAホールディングス	79	99	65,538			
古河機械金属	103	119	20,230			
大阪チタニウムテクノロジーズ	6.5	7.6	10,556			
東邦チタニウム	11.1	12.9	9,365			
UACJ	75	107	28,462			
古河電気工業	194	241	64,347			
住友電気工業	248.4	306.3	477,828			
フジクラ	92	106	60,950			
昭和電線ホールディングス	72	91	5,551			
東京特殊電線	0.9	1.3	1,042			
タツタ電線	12.4	16.6	5,411			
沖電線	8	11	2,156			
カナレ電気	1.1	1.3	2,585			
平河ヒューテック	1.7	3.9	3,381			
リョービ	37	47	21,432			
アーレスティ	5.9	8.9	6,853			
アサヒホールディングス	9.9	11.5	17,951			
金属製品(0.6%)						
稲葉製作所	2.9	4.1	5,666			
宮地エンジニアリンググループ	21	28	4,312			
トーカロ	4.3	5.5	10,312			
アルファC o	2.7	3.2	3,136			
SUMCO	51.9	60.9	46,284			
川田テクノロジーズ	1.5	1.7	6,052			
東洋製罐グループホールディングス	46.9	54.4	126,806			
ホッカンホールディングス	18	22	7,634			
コロナ	3.4	4	4,152			
横河ブリッジホールディングス	12.5	15	16,440			
駒井ハルテック	13	17	3,536			
高田機工	6	8	1,608			
三和ホールディングス	62	76.8	75,033			
文化シャッター	18.8	21.3	18,658			
三協立山	9	10.5	16,117			
アルインコ	2.8	5.8	5,823			
東洋シャッター	2.2	2.9	1,597			
LIXILグループ	98.1	106.6	212,773			
日本ファイルコン	5.8	7	3,017			
ノーリツ	12.9	15	32,115			
長府製作所	7	8.2	21,992			
リンナイ	12.2	14.2	134,332			
ダイニチ工業	3.4	3.9	2,379			
日東精工	10	12	3,600			
三洋工業	9	12	2,148			
岡部	13	16.1	13,024			
ジーテクト	4.8	8.3	11,611			
東プレ	12.7	14.7	36,456			
高周波熱練	11.4	14.3	12,069			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
サンコール	4	4.5	2,043			
モリテック スチール	3.5	4.8	1,252			
パイオラックス	3.4	3.9	22,035			
日本発條	57.3	72	68,760			
中央発條	9	11	3,234			
アドバネクス	17	2.1	2,662			
立川ブラインド工業	—	3.2	2,361			
三益半導体工業	4.9	5.7	5,757			
機械(4.8%)						
日本ドライケミカル	0.9	1	2,114			
日本製鋼所	94	127	58,928			
三浦工業	29.4	34.1	78,464			
タクマ	21	28	28,392			
ツガミ	19	22	9,988			
オークマ	43	50	41,200			
東芝機械	36	42	14,616			
アマダホールディングス	98.2	111.6	135,594			
アイダエン지니어リング	14.4	20.1	21,788			
滝澤鉄工所	21	24	3,024			
富士機械製造	21.5	25	26,725			
牧野フライス製作所	33	38	25,840			
オーエスジー	30	34.9	69,346			
ダイジェット工業	10	13	1,885			
旭ダイヤモンド工業	18.1	20.7	18,650			
DMG森精機	41.6	42.7	57,346			
ソディック	13.4	19.4	18,624			
ディスコ	7.7	9.7	99,910			
日東工器	3.8	4.5	10,692			
パンチ工業	1.8	3	2,595			
豊和工業	3.8	4.6	2,539			
OKK	29	34	3,638			
東洋機械金属	4.6	5.6	2,245			
津田駒工業	16	—	—			
島精機製作所	9.3	10.8	24,775			
NCホールディングス	—	2.5	2,985			
フリュー	—	1.5	3,678			
ヤマシンフィルタ	—	1.5	627			
日阪製作所	8.3	9.7	8,458			
やまびこ	2.6	14	11,886			
ベガサスミシン製造	6.6	7.9	4,005			
ナブテスコ	40.1	39.8	109,529			
三井海洋開発	6.6	9	16,128			
レオン自動機	5.2	6.4	3,980			
SMC	19.8	22.9	634,673			
新川	5.5	6.8	3,522			
ホソカワミクロン	11	13	7,904			
ユニオンツール	3.3	3.3	9,738			
オイレス工業	7.8	9.9	18,166			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
日精エー・エス・ピー機械	2.3	2.8	5,787			
サトーホールディングス	8.2	10.3	24,132			
日本エアーテック	2.6	2.7	1,782			
日精樹脂工業	4.9	6	4,284			
オカダアイオン	—	1.5	1,215			
ワイエイシイ	2.7	3.1	3,007			
小松製作所	323	375	702,187			
住友重機械工業	180	223	119,751			
日立建機	29.4	34.2	57,866			
日工	9	12	3,696			
巴工業	2.5	3.1	4,615			
井関農機	67	79	21,172			
TOWA	5.4	7.4	6,452			
丸山製作所	15	18	3,150			
北川鉄工所	31	36	6,588			
タカキタ	—	2.5	1,325			
クボタ	317	367.3	596,127			
荏原実業	2	2.3	2,973			
三菱化工機	22	27	5,535			
日島機械	11.6	14.5	14,616			
帝国電機製作所	4.4	5.6	4,491			
新東工業	15.5	17.4	15,207			
澁谷工業	5.5	6.4	10,681			
アイチ コーポレーション	9.3	10.9	9,101			
小森コーポレーション	16	18.6	24,682			
鶴見製作所	4.9	5.7	7,968			
住友精密工業	10	12	4,080			
酒井重工業	13	15	2,730			
荏原製作所	137	169	94,640			
石井鐵工所	11	14	2,254			
西島製作所	6.5	8.2	8,798			
北越工業	5.2	8.2	4,952			
ダイキン工業	91.7	106.4	999,628			
オルガノ	13	13	5,564			
トーヨーカネツ	38	41	8,159			
栗田工業	37.3	46	117,990			
椿本チエイン	34	43	34,787			
大同工業	15	17	3,451			
日本コンベヤ	21	—	—			
木村化工機	6.9	7.7	2,587			
アネスト岩田	9.9	12.3	13,038			
ダイフク	31.1	39.3	74,748			
サムコ	0.9	1.8	1,668			
加藤製作所	14	18	7,614			
油研工業	14	16	2,848			
タダノ	30	35.3	35,405			
フジテック	18.4	21.3	22,471			
CKD	17.7	20.3	18,797			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
キトー	6.9	9.2	7,728			
平和	13.7	22.7	50,235			
理想科学工業	7.7	8.1	13,867			
SANKYO	17.5	20.3	83,839			
日本金銭機械	5.8	6.7	6,056			
マースエンジニアリング	3.6	4.1	8,638			
福島工業	3.5	4.5	12,708			
オーイズミ	2.7	3.1	1,432			
ダイコク電機	2.6	3	4,542			
竹内製作所	2.7	14.5	26,984			
アマノ	21	22.6	41,493			
JUKI	47	10.8	12,344			
サンデンホールディングス	39	45	16,650			
蛇の目ミシン工業	—	7.1	4,572			
マックス	10	11	14,069			
グローリー	20.1	24.9	80,178			
新晃工業	4.4	5.1	7,277			
大和冷機工業	9.1	11.7	10,845			
セガサミーホールディングス	67.7	78.5	104,640			
日本ビストンリング	26	3	4,722			
リケン	27	34	12,784			
T P R	7	9	25,002			
ツバキ・ナカシマ	—	9	13,752			
ホシザキ電機	13.8	16	168,480			
大豊工業	5.2	5.9	7,085			
日本精工	129.3	150.1	143,945			
NTN	146	181	66,789			
ジェイテクト	67.1	77.9	117,161			
不二越	59	68	26,384			
日本トムソン	22	25	9,575			
THK	41.9	48.6	100,699			
ユーション精機	2.8	2.8	4,813			
前澤給装工業	2.4	3	4,278			
イーグル工業	8.8	9	12,258			
前澤工業	5.8	5.3	1,415			
日本ビラー工業	6.9	7.4	6,756			
キッツ	28.3	35.1	16,883			
日立工機	16.9	19.6	14,170			
マキタ	41.1	47.7	342,963			
日立造船	49.2	58	33,466			
三菱重工業	1,055	1,302	572,880			
I H I	454	564	158,484			
電気機器(11.7%)						
日清紡ホールディングス	—	40.6	46,811			
イビデン	41.3	44.8	62,764			
コニカミノルタ	150.1	182.6	172,009			
ブラザー工業	81.4	94.5	124,834			
ミネベア	94	117.8	101,425			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
日立製作所	1,512	1,865	934,365			
東芝	1,325	1,539	428,765			
三菱電機	630	780	1,024,920			
富士電機	175	220	97,680			
東洋電機製造	12	14	4,564			
安川電機	76.8	90.8	125,031			
シンフォニアテクノロジー	44	47	8,977			
明電舎	58	67	29,681			
オリジン電気	9	11	3,113			
山洋電気	14	19	10,507			
デンヨー	5.4	6.7	8,073			
東芝テック	45	52	20,592			
芝浦メカトロニクス	10	12	2,760			
マブチモーター	18	20.9	110,352			
日本電産	69	88	737,616			
ユール・エム・シー・エレクトロニクス	—	0.9	2,048			
東光高岳	3.2	4.1	7,363			
ダブル・スコープ	—	2.9	17,806			
ダイヘン	34	43	21,973			
田淵電機	5.5	8.4	3,553			
ヤーマン	0.8	0.9	1,845			
JVCケンウッド	46.3	53.8	14,095			
ミマキエンジニアリング	3.8	6.6	3,630			
第一精工	2.3	3.1	3,394			
日新電機	14.8	17.1	22,623			
大崎電気工業	11	13	10,257			
オムロン	68	82.5	292,875			
日東工業	10.1	11.7	18,462			
I D E C	7.5	9.5	9,538			
不二電機工業	0.6	0.7	1,018			
ジーエス・ユアサ コーポレーション	121	141	65,001			
サクサホールディングス	16	18	3,978			
メルコホールディングス	3.5	4.1	9,302			
テクノメディカ	1.4	1.7	3,427			
日本電気	815	1,005	257,280			
富士通	607	705	306,322			
沖電気工業	222	317	50,720			
岩崎通信機	28	34	2,380			
電気興業	18	19	9,671			
サンケン電気	32	40	12,760			
ナカヨ	6	7	2,233			
アイホン	3.6	4.1	7,117			
ルネサスエレクトロニクス	32.6	37.9	24,786			
セイコーエプソン	85.9	108.8	215,750			
ワコム	49.6	57.6	23,040			
アルバック	10.6	13.4	49,915			
アクセル	2.9	3.3	2,871			
E I Z O	5.8	7.2	22,572			

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
ジャパンディスプレイ	129.4	136.7	28,160	
日本信号	17.4	20.2	19,109	
京三製作所	15	17	5,797	
能美防災	8.3	8.3	11,412	
ホーチキ	4.6	5.3	6,964	
エレコム	2	6.3	12,379	
日本無線	13	21	5,964	
パナソニック	767.3	835.1	831,175	
シャープ	532	615	91,635	
アンリツ	37.8	43.9	27,042	
富士通ゼネラル	19	22	44,638	
日立国際電気	16	16.7	24,048	
ソニー	411.6	515.7	1,589,387	
TDK	38	44.1	283,563	
帝国通信工業	15	17	2,686	
ミツミ電機	22.3	27.9	14,229	
タムラ製作所	24	28	9,240	
アルプス電気	49.7	63	136,962	
池上通信機	21	23	2,875	
パイオニア	94.6	118.3	27,445	
日本電波工業	5.7	6.6	4,705	
鈴木	0.8	2.9	1,682	
日本トリム	1.5	2	12,800	
ローランド ディー、ジー、	2.5	3.6	7,531	
フォスター電機	6.7	9.2	19,044	
クラリオン	33	39	12,285	
SMK	19	22	9,900	
ヨコオ	4.9	5.3	2,597	
東光	15	—	—	
ホシデン	19.1	22.2	16,272	
ヒロセ電機	10.7	11.8	159,182	
日本航空電子工業	18	21	30,954	
TOA	6.8	8.6	8,651	
日立マクセル	12.5	12.1	18,997	
古野電気	7.5	8.7	5,176	
ユニデンホールディングス	17	23	2,990	
アルパイン	15	17.4	21,071	
スミダコーポレーション	5.7	6	4,680	
アイコム	3.5	4	8,420	
リオン	1.9	2.8	4,410	
本多通信工業	—	2	1,898	
船井電機	6.4	7.4	6,623	
横河電機	63	73.2	93,403	
新電元工業	24	26	10,686	
アズビル	20.6	23.9	74,209	
東亜ディーケーケー	2.7	4.1	2,029	
日本光電工業	26.9	30.6	98,685	
チノール	2.2	2.6	2,610	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	額 (千円)
共和電業	7.7	8.9	3,195	
日本電子材料	2.7	2.9	1,342	
堀場製作所	11.6	13.5	63,585	
アドバンテスト	42.9	49.8	61,303	
小野測器	3.1	3.6	3,024	
エスペック	7	7.6	11,164	
パナソニック デバイスSUNX	5.6	6.5	4,075	
キーエンス	14.3	16.6	1,150,878	
日置電機	3.3	3.8	9,196	
シスメックス	48.8	56.7	457,002	
日本マイクロニクス	—	13.7	13,206	
メガチップス	6.6	7.6	10,123	
OBARA GROUP	4.1	4.7	18,753	
澤藤電機	4	4	708	
コーセル	9.2	10.2	12,331	
新日本無線	5	5.3	2,326	
オブテックス	4.3	5.4	18,225	
千代田インテグレ	2.8	3.9	8,073	
アイ・オー・データ機器	—	2.3	1,455	
レーザーテック	6.5	8.6	12,177	
スタンレー電気	45.2	52.3	123,166	
岩崎電気	22	25	4,025	
ウシオ電機	38.2	44.4	59,052	
岡谷電機産業	3.4	4	1,516	
ヘリオス テクノ ホールディング	5.9	6.3	2,312	
日本セラミック	3.6	4.2	8,328	
遠藤照明	2.9	3.7	3,762	
日本デジタル研究所	5.3	6.2	8,878	
古河電池	5	5	3,320	
双信電機	3.1	3.7	1,028	
山一電機	7.3	6.4	3,942	
図研	4.6	5.3	5,872	
日本電子	27	29	16,095	
カシオ計算機	63.1	73.3	126,076	
ファナック	65.6	74.8	1,251,778	
日本シイエムケイ	16.1	15.8	6,967	
エンプラス	2.9	3.7	11,803	
大真空	12	13	3,419	
ローム	31	36	166,860	
浜松ホトニクス	49.1	57	169,860	
三井ハイテック	8.3	10.6	7,875	
新光電気工業	23.8	27.7	17,478	
京セラ	103.4	120	657,720	
太陽誘電	33	35.6	42,791	
村田製作所	66.1	77.1	982,254	
ユースン	8.8	9.7	6,741	
双葉電子工業	10.8	12.3	24,895	
北陸電気工業	27	30	3,810	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
ニチコン	19.9	23.1	17,325	
日本ケミコン	51	59	9,086	
KOA	8.7	10.1	8,029	
市光工業	15	18	5,472	
小糸製作所	37.7	43.8	225,570	
ミツバ	11.6	12.4	20,980	
スター精密	12	13.9	17,402	
SCREENホールディングス	60	75	80,475	
キャノン電子	5.8	6.7	10,753	
キャノン	365	393.5	1,243,460	
リコー	189.3	236.7	224,865	
MUTOHホールディングス	9	9	2,169	
東京エレクトロン	53	60	490,020	
輸送用機器(9.5%)				
トヨタ紡織	22.5	25.7	56,540	
鬼怒川ゴム工業	14	17	13,141	
ユニプレス	12.1	15.2	33,379	
豊田自動織機	57.5	66.6	313,353	
モリタホールディングス	11	12.8	18,726	
三櫻工業	8.1	9.8	5,615	
デンソー	155.7	180.6	783,984	
東海理化電機製作所	16.7	21.4	41,409	
三井造船	244	283	50,091	
川崎重工業	457	569	192,322	
名村造船所	17.9	22.4	15,388	
サノヤスホールディングス	11.3	11.2	1,971	
日本車輛製造	23	30	8,610	
ニチユ三菱フォークリフト	7.3	8.4	4,384	
近畿車輛	9	11	3,234	
日産自動車	883.8	1,020	1,127,100	
いすゞ自動車	199	211.8	273,963	
トヨタ自動車	868.7	909	5,164,029	
日野自動車	89.9	104.3	117,024	
三菱自動車工業	230.8	288.3	165,484	
エフテック	3.7	4.2	4,439	
レシップホールディングス	2.1	2.4	1,843	
GMB	0.9	1.6	1,569	
ファルテック	0.7	1.6	1,990	
武蔵精密工業	6.7	7.8	17,612	
日産車体	27.7	35.7	44,482	
新明和工業	25	32	24,544	
極東開発工業	11.7	14.5	16,269	
日信工業	11.5	16.3	24,401	
トピー工業	54	62	13,516	
ティラド	24	28	5,432	
曙ブレーキ工業	28.3	37	9,583	
タチエス	10	11.6	20,775	
NOK	30.6	35.5	70,183	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
フタバ産業	20.9	23.4	12,799	
KYB	71	83	31,457	
シロキ工業	14	—	—	
大同メタル工業	9	10.3	10,289	
プレス工業	32.1	38.9	16,338	
ミクニ	7.6	10.7	3,359	
カルソニックカンセイ	49	56	48,776	
太平洋工業	12.9	16.3	18,125	
ケーヒン	14.5	16.8	30,391	
河西工業	7.9	9.3	11,067	
アイシン精機	57.8	74.9	337,050	
富士機工	7.4	8.5	3,553	
マツダ	187.6	231.4	430,519	
ダイハツ工業	75.1	87.2	129,928	
今仙電機製作所	5.3	6.7	6,331	
本田技研工業	566.6	657.7	2,053,339	
スズキ	131.6	133.2	382,750	
富士重工業	214.3	231	951,720	
安永	2.1	3.2	1,497	
ヤマハ発動機	95.8	103.2	195,564	
ショーワ	14.9	19	15,048	
TBK	8.1	9.4	3,459	
エクセディ	8.6	9.9	25,254	
豊田合成	20.4	26.6	57,589	
愛三工業	10.1	13	11,531	
盟和産業	5	1.3	1,302	
ヨロズ	5.9	6.8	11,804	
エフ・シー・シー	9.3	12	25,188	
シマノ	27.2	29.5	506,810	
テイ・エス テック	13.4	17	48,518	
ジャムコ	2.6	4.4	9,706	
精密機器(1.6%)				
テルモ	96.5	112	510,720	
クリエートメディック	2.1	2.4	2,061	
日機装	20.4	26.5	21,332	
島津製作所	75	94	161,116	
JMS	12	14	3,976	
モリテックス	1.4	—	—	
長野計器	4	4.6	2,764	
ブイ・テクノロジー	1.3	1.7	15,028	
東京計器	22	23	4,002	
愛知時計電機	8	10	2,980	
オーバル	4.8	7.3	1,693	
東京精密	11.3	14.1	35,715	
マニー	1.8	9.7	17,033	
ニコン	117.6	136.5	209,254	
トプコン	19	24.6	27,355	
オリンパス	93.8	108.9	505,840	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
理研計器	5.6	5.9	6,631
タムロン	4.8	5.9	9,369
HOYA	149.8	165.3	635,247
ノーリツ鋼機	5.7	6.6	5,412
エー・アンド・デイ	5.7	6.7	2,874
シチズンホールディングス	77.5	90	54,990
リズム時計工業	28	32	5,376
大研医器	4.5	5.8	5,034
メニコン	—	4.9	15,288
松風	3.1	3.6	5,248
セイコーホールディングス	45	47	18,988
ニプロ	40.2	54.5	68,016
その他製品(1.6%)			
スノーピーク	—	0.8	3,108
パラマウントベッドホールディングス	6.6	7.7	34,342
トランザクション	0.5	1.5	1,380
SHO-BI	2.1	2.4	960
ニホンフラッシュ	—	2.8	3,351
前田工織	6.4	8	8,776
永大産業	9	10	4,310
アートネイチャー	4.5	7.8	7,355
ダンロップスポーツ	4	4.6	4,945
バンダイナムコホールディングス	69.4	75.6	206,085
アイフィスジャパン	—	1.6	680
共立印刷	11.4	12.1	3,593
SHOEI	—	3.5	6,384
フランスベッドホールディングス	44	10.2	9,700
パイロットコーポレーション	5.5	12.7	61,912
萩原工業	1.3	2	5,146
トッパン・フォームズ	11.2	13	16,250
フジシールインターナショナル	7.6	8.9	37,869
タカラトミー	22.6	24	20,040
廣済堂	5.8	6.8	2,244
As-me エステール	1.7	2	1,260
アーク	19.9	30.7	2,548
タカノ	2.8	3.2	1,971
プロネクサス	6.4	6.8	6,847
ホクシン	5	5.8	730
ウッドワン	11	13	3,224
大建工業	26	29	8,816
凸版印刷	178	206	207,030
大日本印刷	192	216	244,944
図書印刷	10	14	7,980
共同印刷	19	25	8,275
日本写真印刷	10.6	12.3	30,823
光村印刷	6	7	1,435
宝印刷	3.3	3.6	4,892
アシックス	62.5	68.1	169,569

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ツツミ	3.1	3.6	7,992
小松ウオール工業	1.9	2.5	4,192
ヤマハ	46.3	53.7	179,358
河合楽器製作所	2.2	2.7	5,332
クリナップ	5.7	8.6	6,579
ビジョン	35.7	41.4	124,614
兼松日産農林	8	8	1,176
キングジム	5.2	6.1	5,215
リンテック	15	17.4	37,636
TASAKI	1.2	1.4	2,198
イトーキ	13.3	15.4	9,794
任天堂	38.8	45	720,000
三菱鉛筆	5.2	5.5	31,680
タカラスタンダード	26	30	30,150
コクヨ	32.7	38	55,290
ナカバヤシ	13	15	4,395
グローブライド	30	3.5	5,222
岡村製作所	24.2	25.5	27,795
美津濃	34	39	20,241
アデランス	7.3	12.7	6,845
電気・ガス業(1.9%)			
東京電力ホールディングス	534.1	620	317,440
中部電力	192.6	223.6	334,058
関西電力	256.9	298.3	308,143
中国電力	87	101	139,279
北陸電力	61.7	71.6	97,376
東北電力	157.3	182.6	259,474
四国電力	56.7	65.8	84,158
九州電力	139	161.4	177,055
北海道電力	58.9	68.4	63,885
沖縄電力	6.15	11.65	24,896
電源開発	45.6	62.3	175,436
ファーストエスコ	—	3	1,701
イーレックス	—	2.2	4,257
東京瓦斯	765	816	366,710
大阪瓦斯	652	757	312,716
東邦瓦斯	160	184	150,696
北海道瓦斯	13	18	5,004
広島ガス	10	12.7	4,470
西部瓦斯	71	82	20,500
静岡ガス	17.9	20.7	15,525
メタウォーター	3	4.7	13,446
陸運業(4.5%)			
SBSホールディングス	4.8	7.2	6,098
東武鉄道	336	391	219,742
相鉄ホールディングス	108	125	83,375
東京急行電鉄	342	425	400,775
京浜急行電鉄	173	200	208,800

銘柄	当期(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
小田急電鉄	202	234	279,630	
京王電鉄	176	204	192,168	
京成電鉄	94	110	157,300	
富士急行	17	20	27,880	
新京成電鉄	8	9	3,744	
東日本旅客鉄道	115.4	133.6	1,346,688	
西日本旅客鉄道	60.6	70.3	486,897	
東海旅客鉄道	56.4	65.5	1,264,150	
西武ホールディングス	50.2	77.6	159,623	
鴻池運輸	7.8	10.3	13,091	
西日本鉄道	81	95	56,905	
ハマキョウレックス	2	5.6	11,827	
サカイ引越センター	1.1	2.9	8,772	
近鉄グループホールディングス	634	736	325,312	
阪急阪神ホールディングス	423	491	371,687	
南海電気鉄道	141	164	95,776	
京阪ホールディングス	141	164	125,296	
神戸電鉄	15	18	6,570	
名糖運輸	2.6	—	—	
名古屋鉄道	229	266	150,024	
山陽電気鉄道	23	27	13,500	
日本通運	244	283	134,142	
ヤマトホールディングス	110.7	130.7	293,682	
山九	76	96	57,216	
丸運	3.4	3.9	928	
丸全昭和運輸	21	25	9,975	
センコー	27	32.9	21,121	
トナミホールディングス	13	15	4,365	
ニッコンホールディングス	20.6	23.8	53,502	
日本石油輸送	7	8	1,840	
福山通運	38	44	24,024	
セイノーホールディングス	48.7	51.8	55,633	
神奈川中央交通	7	9	5,670	
日立物流	13.1	15.2	28,469	
丸和運輸機関	0.6	2.2	6,285	
C&F ロジホールディングス	—	7	6,664	
海運業(0.2%)				
日本郵船	533	656	136,448	
商船三井	331	357	88,536	
川崎汽船	277	320	75,840	
NSユナイテッド海運	33	38	5,624	
飯野海運	34	39	15,678	
共栄タンカー	11	13	2,483	
乾汽船	—	6	5,214	
空運業(0.7%)				
日本航空	120.5	139.9	532,179	
ANAホールディングス	1,237	1,357	438,175	
パスコ	6	7	2,632	

銘柄	当期(前期末)			評 価 額 (千円)
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	株 数 (千株)	
倉庫・運輸関連業(0.2%)				
トランコム	1.8	2.1	13,356	
日新	24	30	10,650	
三菱倉庫	41	52	80,236	
三井倉庫ホールディングス	36	42	12,474	
住友倉庫	46	53	30,263	
澁澤倉庫	16	19	5,396	
東陽倉庫	11	12	2,700	
乾汽船	4.2	—	—	
日本トランスシティ	14	17	5,865	
ケイヒン	12	13	1,820	
中央倉庫	3.6	4.2	3,725	
安田倉庫	4.9	5.7	4,035	
東洋埠頭	20	21	3,318	
宇徳	5.1	5.9	1,941	
上組	75	87	89,088	
サンリツ	1.5	1.8	867	
キムラユニティー	1.6	1.8	1,922	
キューソー流通システム	1.7	2	5,162	
郵船ロジスティクス	5.8	6.7	7,845	
近鉄エクスプレス	5.6	13.1	18,484	
東海運	3.4	3.9	1,025	
エーアイティー	2.9	4.5	4,104	
内外トランスライン	0.7	2.4	2,385	
情報・通信業(8.4%)				
NEC ネットエスアイ	7.8	9	17,217	
システナ	6.1	7	11,424	
デジタルアーツ	3.3	3.5	10,342	
新日鉄住金ソリューションズ	5.2	12	22,932	
キューブシステム	2.7	3.2	1,878	
コア	2.6	3	3,690	
ソフトクリエイトホールディングス	2	3.5	3,286	
ITホールディングス	20.6	23.9	62,618	
ネオス	1.7	2.2	1,515	
電算システム	2.2	2.5	3,807	
グリー	37.6	43.8	27,813	
コーエーテックモホールディングス	14	17.1	33,994	
三菱総合研究所	2.4	2.8	10,248	
ボルテージ	1.1	1.4	1,771	
電算	0.7	0.8	1,583	
AGS	1	1.6	1,608	
ファインデックス	2.7	4.7	7,914	
ヒト・コミュニケーションズ	0.7	1.6	3,072	
ブレインパッド	0.7	1.1	1,233	
KL a b	6.6	11.2	7,974	
ポータルウイン・ビット クルーホールディングス	4.1	4.8	4,713	
イーブックイニシアティブジャパン	1.4	1.6	1,099	

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
ネクソン	59.1	69.2	125,736
アイスタイル	2.3	11.6	10,776
エムアップ	1.7	1.9	1,088
エイチーム	1.6	4	6,628
テクノスジャパン	—	2.1	5,848
e n i s h	1.6	—	—
コロブラ	17.1	20.1	43,094
モバイルクリエイト	3	4.8	2,020
オルトプラス	1.2	—	—
ブロードリーフ	5.1	7.4	8,051
ハーツユナイテッドグループ	1.9	2.2	6,864
メディアドゥ	—	1.5	2,485
ブイキューブ	—	4.7	5,903
サイバーリンクス	—	1.1	1,249
ディー・エル・イー	—	2	2,466
VOYAGE GROUP	—	2.5	3,415
オブティム	—	0.6	2,994
ベリサーブ	0.7	0.8	3,588
ティアーガイア	6.2	7.2	11,203
日本アジアグループ	—	8.2	3,632
豆蔵ホールディングス	4.9	5.7	4,542
テクマトリックス	2.7	3.1	6,993
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	168.1	52,615
GMOペイメントゲートウェイ	5.4	6.3	43,785
ザッパラス	3.5	4.1	1,730
インターネットイニシアティブ	10	11.7	27,495
さくらインターネット	—	4.7	5,799
GMOクラウド	1.1	1.6	2,019
ビットアイル	7	—	—
SRAホールディングス	3.3	4.2	9,580
Minorityソリューションズ	—	1.4	1,236
パイブドビッツ	0.6	—	—
朝日ネット	6.4	6.6	3,201
コムチュア	1	1.2	3,732
サイバーコム	—	0.8	909
g u m i	4.8	7.5	7,807
パイブDHD	—	0.9	1,138
パナソニック インフォメーションシステムズ	1.5	—	—
フェイス	1.9	1.9	2,268
ハイマックス	0.8	1	1,161
野村総合研究所	35.2	50.6	211,255
サイバネットシステム	5.1	5.9	4,961
CEホールディングス	0.7	1.1	1,125
インタージホールディングス	3.5	3.8	5,669
東邦システムサイエンス	1.8	2.2	1,339
ソースネクスト	3.1	3.6	1,800
ティアー・ワイ・オー	6.3	14.3	2,388
フォーカスシステムズ	—	2.8	1,330

銘柄	当期首(前期末)		
	株数 (千株)	株数 (千株)	評価額 (千円)
クレスコ	1.4	1.6	3,025
フジ・メディア・ホールディングス	64.7	75.1	101,009
オービック	21.4	24.9	146,163
ジャストシステム	8.7	13.1	11,776
TDCソフトウェアエンジニアリング	1.4	3.2	2,214
ヤフー	445.3	517	257,466
トレンドマイクロ	32.9	35	140,175
インフォメーション・ディベロプメント	1.2	1.4	1,449
日本オラクル	10	11.6	67,280
アルファシステムズ	2	2.4	4,077
フューチャー	6.5	8.7	6,664
CAC Holdings	4.2	5.4	4,433
ソフトバンク・テクノロジーズ	1.7	2	3,946
トーセ	1.6	2	1,372
オービックビジネスコンサルタント	3.9	3.7	18,148
伊藤忠テクノソリューションズ	14.1	16.3	39,120
アイティフォー	7.5	9.4	5,094
東計電算	1.1	1.3	2,367
エックスネット	0.6	0.7	1,070
大塚商会	16.7	19.4	100,298
サイボウズ	8.3	9.6	3,446
ソフトブレーン	8.5	10.6	2,151
電通国際情報サービス	3.8	4.4	8,597
EMシステムズ	0.7	2.5	2,975
ウェザーニューズ	1.9	2.4	8,796
C I J	5.6	6.6	3,306
東洋ビジネスエンジニアリング	0.6	0.7	970
日本エンタープライズ	4.2	7.5	1,927
WOWOW	3	3.4	8,680
フュージョンパートナー	2.7	4.5	2,704
日本コロムビア	2.1	2.5	1,070
イマジカ・ロボット ホールディングス	3.3	6.1	2,909
ネットワンシステムズ	25.2	31.3	19,406
アルゴグラフィックス	2.6	3.3	5,712
マーベラス	10.5	12.2	11,992
エイベックス・グループ・ホールディングス	12.3	13.3	18,447
日本ユニシス	17.2	19.9	26,367
兼松エレクトロニクス	3.9	4.6	8,855
東京放送ホールディングス	37.2	43.2	67,651
日本テレビホールディングス	56.7	65.9	128,900
朝日放送	6.1	7.2	4,716
テレビ朝日ホールディングス	17	19.7	35,460
スカパーJSATホールディングス	47.2	54.8	28,879
テレビ東京ホールディングス	5.1	6.5	15,028
日本BS放送	1	1.6	1,608
U-NEXT	—	2.3	2,051
ワイヤレスゲート	—	2.1	4,473
コネクシオ	4.4	6.4	8,864

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
日本通信	—	51.2	12,288			
クロップス	0.6	1.4	735			
日本電信電話	243.2	557.6	2,702,129			
KDD I	631.3	732.8	2,339,830			
光通信	5.6	8.7	78,474			
NTTドコモ	479.2	539	1,479,285			
エムティーアイ	7.9	11	7,546			
GMOインターネット	20.7	26.6	34,899			
カドカワ	15.2	22.5	28,845			
学研ホールディングス	21	24	6,168			
ゼンリン	8.2	9.5	24,462			
昭文社	3.7	4	2,332			
インプレスホールディングス	4.4	5.9	885			
アイネット	3.2	4	4,348			
松竹	41	47	50,995			
東宝	44.3	51.5	155,787			
東映	23	27	25,947			
AOI Pro.	2.9	3.7	3,774			
エヌ・ティ・ティ・データ	38.4	44.6	249,314			
ピー・シー・エー	0.8	0.9	1,154			
ビジネスブレイン太田昭和	—	1.1	1,017			
DTS	6.4	8	18,552			
スクウェア・エニックス・ホールディングス	23.9	30.5	107,055			
シーイーシー	4	4.7	7,266			
カプコン	15.9	18.5	48,396			
アイ・エス・ピー	0.7	1.2	1,147			
ジャステック	3.6	4.6	4,383			
SCSK	14.8	17.2	71,896			
日本システムウエア	2.3	2.7	3,059			
アイネス	8.4	10.2	11,352			
TKC	5.3	6.7	19,470			
富士ソフト	8.6	10.7	27,295			
NSD	14.5	15.3	26,423			
コナミホールディングス	25.2	32.6	139,202			
福井コンピュータホールディングス	1.7	2.1	3,278			
JBCホールディングス	5.2	6.1	4,190			
ミロク情報サービス	4.1	5.3	6,980			
ソフトバンクグループ	328.6	408.7	2,523,722			
卸売業(4.2%)						
ハウスイ	5	6	708			
高千穂交易	2.4	2.8	2,461			
伊藤忠食品	1.5	1.8	7,335			
エレマテック	2.9	3.4	6,874			
JALUX	1.8	2.3	4,528			
あらた	14	3.2	7,584			
トーマンデバイス	0.9	1.1	2,143			
東京エレクトロン デバイス	1.3	2.6	3,980			
フィールズ	4.1	6.3	9,834			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
双日	415.9	454.4	113,145			
アルフレッサ ホールディングス	73.5	90.7	213,507			
横浜冷凍	15.4	17.9	19,027			
神栄	—	10	1,260			
山下医科器械	0.5	0.6	1,047			
ラサ商事	3	3.4	1,601			
ラクーン	—	3.1	2,002			
アルコニックス	3.5	4.1	6,355			
神戸物産	2	4.7	11,684			
あい ホールディングス	10	12.8	34,201			
ディーブイエックス	1.8	2.6	2,896			
ダイワボウホールディングス	57	66	14,718			
マクニカ・富士エレホールディングス	11.2	13	15,600			
バイタルケーエスケー・ホールディングス	11.7	12.5	12,800			
八洲電機	4.8	5.6	2,934			
UKCホールディングス	4	4.6	8,712			
OCHIホールディングス	1.6	2.1	2,148			
TOKAIホールディングス	30.4	31.7	21,460			
三洋貿易	3.4	4	5,544			
ウイン・パートナーズ	2	2.6	4,063			
ミタチ産業	1.5	1.9	1,183			
シップヘルスケアホールディングス	11.4	14.6	46,428			
明治電機工業	1.8	2.3	2,380			
デリカフーズ	1.1	1.5	1,423			
スターティア	0.6	1.4	844			
富士興産	2.4	2.8	1,173			
協栄産業	8	10	1,350			
小野建	5.4	6.3	7,938			
佐島電機	4.9	5.7	3,853			
エコートレーディング	1.5	1.7	975			
伯東	4.3	5.5	5,087			
コンドーテック	4.5	5.7	4,434			
中山福	3.6	4.5	3,505			
ナガイレーベン	9	10.4	25,812			
三菱食品	6.8	7.9	22,372			
松田産業	4.5	5.3	6,693			
第一興商	—	12.8	54,144			
メディバルホールディングス	62.2	72.1	138,504			
アドヴァン	3.2	7.3	8,614			
SPK	1.3	1.7	3,396			
萩原電気	1.7	2.5	4,397			
アズワン	4.5	5.6	23,660			
スズデン	2	2.3	2,210			
尾家産業	2	2.3	2,019			
シモジマ	3.8	5	5,160			
ドウシシャ	8.1	8.5	19,813			
小津産業	1.2	1.6	3,217			
高速	3.7	4.3	3,723			

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
たけびし	2.2	2.5	2,500	
黒田電気	10.8	13.4	25,058	
丸文	5.5	6.4	3,808	
ハビネット	3.8	6.6	5,748	
橋本総業ホールディングス	1.2	1.5	2,233	
エクセル	2.8	3.5	4,889	
マルカキカイ	2	2.3	2,750	
ガリバーインターナショナル	18.8	19.4	20,874	
日本エム・ディ・エム	5.2	6	4,824	
進和	3.7	4.3	6,118	
エスケイジャパン	1.6	1.8	549	
ダイトエレクトロン	2.9	3.3	2,098	
シークス	3.9	4.6	17,158	
田中商事	1.9	2.2	1,471	
オーハシテクニカ	3.8	4.1	5,215	
白銅	2	2.1	2,391	
伊藤忠商事	520.1	566.1	781,784	
丸紅	543.6	709.9	372,129	
高島	12	14	2,338	
長瀬産業	34.9	43.4	54,510	
蝶理	4	4.6	7,005	
豊田通商	69.2	80.4	208,075	
三共生興	10.6	10.9	3,804	
兼松	124	153	27,540	
ツカモトコーポレーション	11	13	1,417	
三井物産	526.8	652.3	859,079	
日本紙パルプ商事	32	38	12,920	
日立ハイテクノロジーズ	21.5	25	80,625	
カメイ	8.1	9.4	8,563	
東都水産	10	12	2,040	
OUGホールディングス	10	10	2,520	
スターゼン	24	2.6	9,789	
山善	23.9	27.7	25,761	
椿本興業	7	8	2,304	
住友商事	366.7	454.1	509,954	
内田洋行	15	18	8,388	
三菱商事	476.2	541.3	1,048,227	
第一実業	15	16	8,416	
キャノンマーケティングジャパン	17.7	20.6	42,827	
西華産業	20	24	6,936	
佐藤商事	5.6	6.5	4,140	
菱洋エレクトロ	7.2	8.3	11,254	
東京産業	6.2	7.2	2,721	
ユアサ商事	5.4	6.8	17,013	
神鋼商事	16	16	2,896	
小林産業	4.6	4.8	1,065	
阪和興業	62	72	41,328	
カナデン	5.4	6.9	6,065	

銘柄	当期首(前期末)	当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
菱電商事	10	11	7,161	
フルサト工業	3.4	4	5,536	
岩谷産業	69	86	53,922	
すてきなイスグループ	27	31	5,053	
昭光通商	22	26	1,950	
ニチモウ	10	11	1,848	
極東貿易	7	10	2,020	
イワキ	9	11	2,156	
三菱石油	16	17.9	13,908	
稲畑産業	14.9	17.3	19,497	
G S Iクレオス	17	19	2,109	
明和産業	5	6.7	2,284	
ワキタ	13.2	15.4	11,303	
東邦ホールディングス	21.4	23.1	63,686	
サンゲツ	21.7	25.2	51,634	
ミツウロコグループホールディングス	10	11.6	6,310	
シナネンホールディングス	13	16	6,768	
伊藤忠エネクス	13.7	18.6	17,260	
サンリオ	17.4	22.2	45,399	
サンワテクノス	4	4.6	3,551	
リョーサン	10.5	11.4	30,586	
新光商事	7.3	8.5	9,086	
トーホー	14	3.3	8,223	
三信電気	8.6	10	8,710	
東陽テクニカ	9.1	10.3	11,093	
モスフードサービス	8.1	9.4	27,495	
加賀電子	5.6	6.5	8,703	
ソーダニッカ	6.4	7.5	3,645	
立花エレテック	4.6	5.3	5,814	
フォーバル	1.2	3.8	2,891	
PAL TAC	10	11.5	25,277	
三谷産業	6.6	7.7	2,656	
ヤマタネ	31	33	4,983	
丸紅建材リース	5	6	1,134	
日鉄住金物産	41	63	24,633	
トラスコ中山	7.8	8.2	41,820	
オートバックスセブン	22.9	27.6	46,561	
加藤産業	9.2	11.3	31,007	
イノテック	5.8	6.7	2,726	
イエローハット	5.9	6.8	16,184	
J Kホールディングス	6.3	7.3	3,365	
日伝	2.6	3	8,811	
北沢産業	5.3	6	942	
杉本商事	3.4	4.2	4,758	
因幡電機産業	9.2	10.1	37,925	
バイテックホールディングス	2.1	3	3,087	
ミスミグループ本社	23.2	81	135,999	
アルテック	4.5	6.1	872	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	評 価 (千円)
タキビヨー	10	12	5,376	
蔵王産業	0.8	1.2	1,590	
ズケン	28.3	32.8	118,408	
ジェコス	4.3	5	5,510	
ルネサスイーストン	3.1	6	2,514	
小売業(4.9%)				
ローソン	23.5	27.3	237,237	
サンエー	4.7	4.9	24,892	
ダイユーエイト	1.4	2.4	1,648	
カワチ薬品	4.8	5.6	13,680	
エービーシー・マート	8.8	9.4	66,928	
ハードオフコーポレーション	3	3.5	4,686	
アスクル	6.5	8.8	35,992	
ゲオホールディングス	11.7	12.1	18,404	
アダストリア	5.3	13.3	48,611	
ジーフット	—	4.4	3,476	
シー・ヴィ・エス・ペリエリア	8	10	880	
くらコーポレーション	3.6	4.2	21,378	
キャンドウ	3	3.8	6,015	
パル	3.6	4.2	11,344	
エディオン	28.7	30.7	25,235	
サーラコーポレーション	5.4	6.2	3,335	
ワッツ	2.5	3.1	3,013	
ハローズ	—	2.4	5,392	
あみやき亭	1.1	1.4	6,139	
ひらまつ	8.6	10	7,420	
ゲンキー	0.6	1.5	5,242	
サッポロドラッグストアー	0.6	1	2,093	
大黒天物産	1.5	1.7	8,007	
ハニーズ	5.5	6.4	6,656	
ファーマライズホールディングス	1.2	2.3	1,246	
アルベン	5.5	6.5	11,121	
クオール	6.3	7.3	10,533	
ジェイアイエヌ	4.2	4.9	18,203	
ビックカメラ	30.6	41.4	41,607	
DCMホールディングス	30.1	35.6	28,373	
Monotaro	12.1	25.5	97,410	
東京一番フーズ	—	1.9	989	
ダイヤモンドダイニング	—	1.8	1,780	
きちり	1.3	2	1,292	
アーケランドサービス	0.7	2.3	7,647	
J. フロント リテイリング	78.7	91.3	116,955	
ドトール・日レスホールディングス	10.9	12.7	23,456	
マツモトキヨシホールディングス	13.9	14.9	89,400	
ブロンコビリー	1.1	3.8	11,609	
スタートトゥデイ	19.3	22	111,100	
トレジャー・ファクトリー	1.2	2.1	2,404	
物語コーポレーション	1.7	1.9	10,032	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	評 価 (千円)
ココカラファイン	6.5	7.5	43,350	
三越伊勢丹ホールディングス	123.6	143.5	151,823	
ウエルシアホールディングス	5.3	6.2	38,626	
クリエイトSDホールディングス	2.9	10.6	28,365	
丸善CHIホールディングス	7.2	8.4	3,225	
ミサワ	0.7	1.2	618	
エー・ビーカンパニー	0.9	1.3	1,348	
チムニー	1.2	1.8	5,472	
シュッピン	—	2.7	3,118	
ネクステージ	0.6	1.4	984	
ジョイフル本田	4.5	11.7	29,331	
鳥貴族	—	1.8	4,136	
キリン堂ホールディングス	2	2.5	2,715	
ホットランド	—	2.5	2,557	
すかいいらーく	30.5	22.2	28,993	
綿半ホールディングス	—	2.8	4,384	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	20.4	23.9	25,955	
ブックオフコーポレーション	3.8	4.5	3,816	
ゴルフダイジェスト・オンライン	—	2.1	1,946	
あさひ	4.1	5.4	9,406	
日本調剤	0.8	1.9	8,835	
コスモス薬品	3.1	3.6	69,804	
トーエル	3.3	3.6	2,876	
一六堂	1.5	2.1	703	
セブン&アイ・ホールディングス	259.9	301.8	1,419,063	
薬王堂	0.9	1.4	5,782	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	4.3	19.4	19,729	
ツルハホールディングス	13.3	16.6	188,410	
サンマルクホールディングス	4.5	5.7	18,553	
フェリシモ	1.6	2.1	2,160	
トリドール	6.7	8.9	25,658	
クスリのアオキ	4.9	6.4	41,216	
メディカルシステムネットワーク	5.6	8.6	4,652	
総合メディカル	3	3.5	13,247	
はるやま商事	2.6	3.3	2,468	
カッパ・クリエイト	9.7	10.1	12,473	
ライトオン	4.7	5.4	7,500	
良品計画	7.7	8.3	209,160	
三城ホールディングス	7.7	9	3,834	
アルビス	1.4	2	4,172	
コナカ	7.3	9.3	4,687	
ハウス オブ ローゼ	0.7	1	1,408	
G-7ホールディングス	1.3	2.2	2,692	
イオン北海道	4.2	5	2,560	
コジマ	9.2	11.1	2,730	
ヒマラヤ	1.6	2.4	2,431	
コーナン商事	9.8	10.5	20,139	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
エコス	2.4	3		4,020
マルシェ	1.5	2		1,652
ドンキホーテホールディングス	20.1	46.7	162,983	
西松屋チェーン	12.3	14.2	17,281	
ゼンショーホールディングス	32	37.1	54,240	
幸楽苑ホールディングス	4.1	4.8	7,329	
ハークスレイ	1.9	2.2	2,281	
サイゼリヤ	9.4	11.9	23,847	
V Tホールディングス	—	24.4	12,614	
魚力	1.7	2.3	2,996	
ポプラ	1.5	1.8	873	
ユナイテッドアローズ	8.1	10.3	32,908	
ハイデイ日高	4.7	6.6	17,490	
京都きもの友禅	3.7	5	4,265	
コロワイド	20.8	24.1	46,151	
ピーシーデポコーポレーション	—	8	12,160	
壺番屋	2.8	6.6	23,100	
トップカルチャー	2.8	3.3	1,521	
P L A N T	1.4	1.8	2,176	
スギホールディングス	11.1	12.9	73,272	
スクロール	8.1	11	5,280	
ヨンドシーホールディングス	4.7	5.5	13,909	
ファミリーマート	21	22.2	128,538	
木曽路	7.6	8.8	19,949	
サトレストラシスシステムズ	5.9	8.7	7,029	
千趣会	11.2	14.3	11,268	
タカキュー	4.4	6.4	1,158	
ケーヨー	12.1	12.2	6,527	
上新電機	14	17	15,657	
日本瓦斯	10	11	27,467	
ベスト電器	20	23.2	2,575	
ロイヤルホールディングス	10.4	12	25,320	
東天紅	5	—	—	
いなげや	7	8	11,752	
島忠	16.1	18.7	46,245	
チヨダ	7.3	8.5	22,049	
ライフコーポレーション	4	4.8	15,864	
リンガーハット	6	6.5	15,899	
M r M a x	7	7.6	2,272	
テンアライド	5.2	6.6	2,461	
A O K Iホールディングス	14.3	16.5	19,239	
オークワ	10	12	14,472	
コメリ	10.6	11.1	31,091	
青山商事	15.6	13.8	54,096	
しまむら	7.2	8.4	121,800	
C F Sコーポレーション	4.2	—	—	
はせがわ	2.2	3.9	1,606	
高島屋	90	105	80,745	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価	価 額 (千円)
松屋	12.6	15.3		12,928
エイチ・ツー・オー リテイリング	29.4	37		60,865
近鉄百貨店	24	28		9,884
ニッセンホールディングス	13.1	—		—
パルコ	6	7		6,342
丸井グループ	65.5	88.6		143,975
アクシアル リテイリング	4.8	5.6		21,420
イオン	256.4	296.8		495,359
ユニグループ・ホールディングス	60	69.5		55,600
イズミ	13.9	14.4		60,696
東武ストア	8	9		2,664
平和堂	12.6	14.6		34,120
フジ	7	8.3		21,106
ヤオコー	7.1	8.2		39,934
ゼビオホールディングス	8.4	9.8		15,611
ケーズホールディングス	14.3	30.4		52,196
O l y m p i c グループ	3.8	4.6		2,502
日産東京販売ホールディングス	10.5	12.8		3,020
アインホールディングス	7.5	8.7		61,161
元気寿司	1.9	2.1		4,603
ヤマダ電機	245.9	219.5		111,286
アークランドサカモト	4.5	12.2		14,664
ニトリホールディングス	26.8	31.2		349,752
グルメ杵屋	5	5		4,935
愛眼	4.9	5.7		1,202
ケーユーホールディングス	3.3	3.8		2,774
吉野家ホールディングス	17.6	26.7		38,421
松屋フーズ	3	3.5		9,642
サガミチェーン	8	9.7		11,804
関西スーパーマーケット	4.9	6.1		6,453
王将フードサービス	4.6	5.3		19,769
ブレナス	6.9	8.1		15,519
ミニストップ	4.6	5.3		9,359
アークス	10.8	13.5		35,302
パローホールディングス	13.4	15.6		46,519
藤久	0.5	0.7		1,208
ベルク	2.8	3.6		15,642
大庄	2.9	4		6,032
ファーストリテイリング	12.4	12		352,620
サンドラッグ	13.1	15.2		139,384
サックスパー ホールディングス	4.7	6.8		8,935
ヤマザワ	1.3	1.6		2,716
やまや	1.1	1.5		2,923
ベルーナ	15.5	18		11,016
銀行業(7.6%)				
島根銀行	1.3	1.5		1,866
じもとホールディングス	44.6	51.8		7,821
足利ホールディングス	39.1	52.9		18,144

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
東京TYフィナンシャルグループ	8	9.9	27,205	
九州フィナンシャルグループ	—	110.4	62,044	
ゆうちょ銀行	—	184.8	244,675	
富山第一銀行	—	18.3	9,644	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	502.5	256,727	
新生銀行	591	624	109,824	
あおぞら銀行	419	456	171,456	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	4,985.8	5,787.9	3,160,193	
りそなホールディングス	727	843.9	354,269	
三井住友トラスト・ホールディングス	1,373	1,506	579,659	
三井住友フィナンシャルグループ	469.9	577.6	2,038,350	
第四銀行	79	91	34,216	
北越銀行	67	78	14,664	
西日本シティ銀行	218	235	47,940	
千葉銀行	240	278	159,850	
横浜銀行	417	—	—	
常陽銀行	225	261	105,444	
群馬銀行	147	160	68,640	
武蔵野銀行	9.9	11.5	31,728	
千葉興業銀行	12.9	19.8	8,830	
筑波銀行	25.8	30	9,030	
七十七銀行	105	113	43,618	
青森銀行	49	53	16,430	
秋田銀行	41	47	14,899	
山形銀行	37	41	16,974	
岩手銀行	4.3	5	21,275	
東邦銀行	56	64	23,040	
東北銀行	33	37	5,402	
みちのく銀行	31	36	6,732	
ふくおかフィナンシャルグループ	252	312	121,992	
静岡銀行	182	211	172,809	
十六銀行	78	90	27,360	
スルガ銀行	65.6	68.5	166,112	
八十二銀行	112	130.5	64,206	
山梨中央銀行	38	45	17,280	
大垣共立銀行	78	96	31,008	
福井銀行	53	62	13,206	
北國銀行	69	80	25,280	
清水銀行	2.1	2.5	6,255	
富山銀行	—	1.4	5,110	
滋賀銀行	62	68	32,232	
南都銀行	60	70	23,520	
百五銀行	60	65	26,455	
京都銀行	119	138	98,118	
紀陽銀行	24.4	28.3	40,921	
三重銀行	28	32	6,400	
ほくほくフィナンシャルグループ	423	491	64,321	
広島銀行	183	213	85,839	

銘柄	当期首(前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	額 (千円)
山陰合同銀行	38	43.4	31,378	
中国銀行	44	51.1	63,875	
鳥取銀行	20	23	3,979	
伊予銀行	66.5	77.2	57,128	
百十四銀行	68	79	25,912	
四国銀行	48	56	11,760	
阿波銀行	51	59	36,344	
鹿児島銀行	43	—	—	
大分銀行	38	41	13,448	
宮崎銀行	41	48	13,632	
肥後銀行	51	—	—	
佐賀銀行	38	44	10,428	
十八銀行	38	44	11,748	
沖縄銀行	4.9	5.7	21,631	
琉球銀行	12.8	14.9	17,924	
セブン銀行	209.5	270.3	110,282	
みずほフィナンシャルグループ	8,664.1	10,224.9	1,759,705	
高知銀行	24	28	2,912	
山口フィナンシャルグループ	62	67	73,968	
長野銀行	20	24	4,704	
名古屋銀行	56	60	21,360	
北洋銀行	93.6	108.7	33,805	
愛知銀行	2.2	2.4	12,096	
第三銀行	35	41	6,765	
中京銀行	26	30	7,260	
東日本銀行	27	—	—	
大光銀行	22	26	4,966	
愛媛銀行	37	42	9,870	
トマト銀行	24	28	4,088	
みなと銀行	56	65	11,570	
京葉銀行	51	59	24,308	
関西アーバン銀行	8.7	10	10,250	
栃木銀行	31	39	15,951	
北日本銀行	1.9	2.2	5,704	
東和銀行	87	135	12,015	
福島銀行	76	89	7,832	
大東銀行	4.0	43	7,568	
トモニホールディングス	47.7	55.3	18,802	
フィデアホールディングス	36.6	58.8	9,114	
池田泉州ホールディングス	59.2	76.5	32,053	
証券、商品先物取引業(1.0%)				
F P G	16.5	26.2	31,073	
S B Iホールディングス	74.7	86.8	99,993	
ジャフコ	8.6	12.2	39,894	
大和証券グループ本社	582	675	433,687	
野村ホールディングス	1,271	1,388	659,438	
岡三証券グループ	53	61	34,709	
丸三証券	19.8	21.4	21,571	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	評 価 (千円)
東洋証券	24	28	6,468	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	71.3	82.8	45,043	
光世証券	15	19	2,489	
水戸証券	20	22.4	6,227	
いちよし証券	13.1	16.2	14,515	
松井証券	31.6	36.2	36,200	
だいら証券ビジネス	3.3	3.6	2,660	
マネックスグループ	73.2	84.4	23,800	
カブドットコム証券	27.6	63.6	23,468	
極東証券	8.5	9.7	12,348	
岩井コスモホールディングス	6.4	6.8	7,010	
藍澤証券	8.7	13.5	8,356	
マネースクウェアHD	2.1	2.7	2,594	
マネーパートナーズグループ	6.9	7.2	5,212	
保険業 (2.3%)				
かんぽ生命保険	—	29.4	71,383	
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	138	160.2	497,741	
アニコム ホールディングス	2.7	4.9	13,813	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	198.1	215.6	675,259	
ソニーフィナンシャルホールディングス	59.5	69.1	92,041	
第一生命保険	398.1	462.2	660,252	
東京海上ホールディングス	251.8	292.3	1,122,432	
T&Dホールディングス	226.5	262.9	287,612	
その他金融業 (1.3%)				
全国保証	16.2	18.8	67,680	
クレディセゾン	50.8	54.7	114,651	
アクリーティブ	4.2	5.9	2,643	
芙蓉総合リース	6.5	8.2	38,622	
興銀リース	11.7	13.6	27,036	
東京センチュリーリース	14.6	16.9	64,051	
日本証券金融	27.4	31.8	14,882	
アイフル	104	120.8	45,300	
ポケットカード	4.7	7.2	3,924	
リコーリース	4.9	5.7	17,328	
イオンフィナンシャルサービス	40.8	47.3	114,560	
アコム	124.8	144.9	88,389	
ジャックス	34	40	20,520	
オリエントコーポレーション	143.6	311.9	70,801	
日立キャピタル	12.2	17	41,684	
アプラスフィナンシャル	29.8	34.6	3,667	
オリックス	439.9	510.8	773,606	
三菱UFJリース	157.6	183	84,546	
日本取引所グループ	91.2	211.8	317,488	
イー・ギャランティ	1.8	2.3	6,060	
アサックス	1.1	1.2	1,611	
NECキャピタルソリューション	2.5	2.9	4,408	
不動産業 (2.8%)				
いちごグループホールディングス	—	79.9	36,754	

銘柄	当 期 首 (前期末)		当 期 末	
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 (千円)	評 価 (千円)
日本駐車場開発	67.7	87	11,484	
ヒューリック	115.4	150.4	163,635	
東京建物不動産販売	3.3	—	—	
三栄建築設計	2.5	2.9	3,584	
野村不動産ホールディングス	37.4	47.9	94,075	
三重交通グループホールディングス	11.1	12.9	5,572	
サムティ	—	5.2	5,631	
ディア・ライフ	—	5	1,870	
エー・ディー・ワークス	—	66.8	2,805	
日本商業開発	2	3.2	5,632	
プレサンスコーポレーション	2.1	2.5	9,912	
ユニゾホールディングス	3.4	4.5	24,300	
日本管理センター	3.1	4.7	7,844	
サンセイラディック	0.8	1.7	1,553	
エストラスト	0.7	1.3	703	
フージャースホールディングス	9.3	10.1	6,645	
オープンハウス	4	10.4	30,368	
東急不動産ホールディングス	162.9	174.6	126,759	
飯田グループホールディングス	40.3	66.8	158,182	
ムゲンエステート	—	1.1	2,489	
パーク24	31.3	36.4	114,660	
パラカ	2.2	2.5	4,022	
三井不動産	329	383	1,023,950	
三菱地所	462	536	1,139,000	
平和不動産	11.8	13.7	18,549	
東京建物	135	78.8	109,374	
ダイビル	16	18.6	18,860	
京阪神ビルディング	10.3	12	7,020	
住友不動産	149	173	534,224	
大京	99	134	22,378	
テーオーシー	21.4	28	26,908	
東京楽天地	10	12	5,748	
レオパレス21	68	85	58,820	
スターツコーポレーション	7.1	8.3	19,662	
フジ住宅	8	9.2	6,660	
空港施設	7.6	8.8	4,523	
明和地所	3.6	4	2,352	
住友不動産販売	4.5	5.2	11,336	
ゴールドクレスト	5.6	5.7	10,630	
日本エスリード	2.4	2.8	2,987	
日神不動産	8.3	9.7	3,715	
タカラレーベン	27.6	31.5	23,845	
サンヨーハウジング名古屋	3.5	4.1	3,936	
イオンモール	40.1	46.6	68,408	
ファースト住建	2.3	2.7	3,512	
トーセイ	8.5	11	8,624	
穴吹興産	6	8	2,096	
エス・ティ・ティ都市開発	38.6	44.8	49,817	

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
サンフロンティア不動産	6.7	8.8	10,560			
エフ・ジェー・ネクスト	4.8	6.4	3,302			
ランドビジネス	3.2	4.9	1,298			
グランディハウス	5.5	6.4	2,156			
日本空港ビルデング	21.5	23	86,480			
サービス業(3.9%)						
日本工営	22	26	9,620			
ネクスト	15.8	21.6	24,840			
ジェイエイシーリクルートメント	—	4.7	8,018			
日本M&Aセンター	10.2	11.8	79,060			
ノバレーゼ	1.9	2.4	2,004			
アコーディア・ゴルフ	24.9	21.4	21,828			
中広	—	1.3	837			
タケエイ	6.5	7.2	7,891			
トラスト・テック	1.2	3.1	4,628			
パソナグループ	5.1	7.1	5,140			
CDS	1.5	2	1,740			
リンクアンドモチベーション	9.8	17.2	2,717			
GCAサヴィアン	5.2	7	7,322			
エス・エム・エス	7.4	9.5	21,840			
テンプホールディングス	13	53.5	95,390			
リニカル	1.8	4.6	10,193			
クックパッド	4.2	17	24,871			
エスクリ	2.6	4.4	2,556			
アイ・ケイ・ケイ	3.8	4.5	2,794			
学情	2.6	2.9	3,053			
スタジオアリス	3.1	3.5	9,506			
シミックホールディングス	2.7	4.1	6,863			
NJS	1.5	1.6	1,912			
総合警備保障	22	25.5	138,720			
カカコム	43.4	54.8	114,970			
アイロムグループ	1.7	2.2	2,593			
ルネサンス	3.5	4.3	5,108			
ディップ	1.5	8.5	25,627			
オプトホールディング	3.1	4.9	3,753			
ツクイ	8.2	9.4	14,400			
総合臨床ホールディングス	3.1	—	—			
キャリアデザインセンター	1.9	2.3	2,286			
エムスリー	56.9	66.1	213,172			
ツカダ・グローバルホールディング	5.1	6.2	4,575			
アウトソーシング	2.6	3.6	16,164			
ウェルネット	1.8	2.9	12,542			
ディー・エヌ・エー	32.5	34.2	77,155			
博報堂DYホールディングス	91.2	105.8	147,379			
ぐるなび	7.6	8.8	25,256			
エスアールジータカミヤ	5.7	8.9	3,996			
一休	5.2	—	—			
ファンコミュニケーションズ	15.2	17.7	13,912			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
ジェイコムホールディングス	1.6	2.1	5,271			
PGMホールディングス	9.5	—	—			
WDBホールディングス	2.4	2.8	2,601			
ティア	2.1	4	2,692			
バリューコマース	5.6	7.6	2,903			
インフォマート	—	14.8	14,992			
J Pホールディングス	17	19.9	6,945			
E P Sホールディングス	6.1	9.5	13,670			
レックス	—	1.5	1,084			
プレステージ・インターナショナル	5.1	6.4	9,644			
アミューズ	2	4.2	10,046			
ドリームインキュベータ	2.3	2.6	6,055			
クイック	2.4	4	3,088			
TAC	4.6	8.3	1,767			
ケネディクス	94	102.7	43,442			
電通	73.3	85.1	468,901			
テイクアンドギヴ・ニーズ	2.9	5	2,385			
びあ	1.9	2.3	4,940			
イオンファンタジー	2.2	2.7	7,576			
シーティーエス	—	2.7	2,097			
ネクシーズグループ	2.5	3.1	6,807			
みらかホールディングス	16.8	19.5	91,942			
アルプス技研	2.7	2.8	6,406			
ダイオーズ	1.4	1.4	1,313			
日本空調サービス	3.3	7.4	3,796			
オリエンタルランド	71.1	82.5	601,837			
ダスキン	18.6	19.6	38,494			
明光ネットワークジャパン	6.7	9.5	12,122			
ファルコホールディングス	3.2	3.5	4,634			
秀英予備校	1.3	—	—			
田谷	1.1	—	—			
ラウンドワン	18.9	24	17,760			
リゾートトラスト	24.9	32.1	74,183			
ビー・エム・エル	3.9	4.5	23,625			
ワタベウエディング	2.4	3.3	1,442			
りらいあコミュニケーションズ	12.2	12.6	14,061			
リソー教育	—	14.7	5,865			
早稲田アカデミー	1	1.4	1,171			
ユー・エス・エス	79.6	92.4	162,439			
東京個別指導学院	3.3	3.8	2,565			
サイバーエージェント	16.1	20.1	104,520			
楽天	286	357.2	415,423			
デー・オー・ダブリュー	2	6.2	4,023			
セントラルスポーツ	2.3	2.8	6,683			
フルキャストホールディングス	6.8	7.2	6,098			
リゾートソリューション	8	10	3,040			
テクノプロ・ホールディングス	9.4	12.4	39,370			
インターワークス	—	1.4	1,650			

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
Keepertech	—	0.9	1,523	—	—	—
ファーストロジック	—	0.5	1,226	—	—	—
リブセンス	4	6	3,030	—	—	—
ジャパンマテリアル	2.8	3.2	10,384	—	—	—
ベクトル	1.1	2.4	7,608	—	—	—
ウチヤマホールディングス	3.3	4.9	2,391	—	—	—
サクセスホールディングス	0.9	1.3	1,726	—	—	—
キャリアリンク	0.9	2.4	2,052	—	—	—
I B J	—	6.1	3,464	—	—	—
アサンテ	1.7	2.8	3,880	—	—	—
N・フィールド	1.7	3.7	5,968	—	—	—
M&Aキャピタルパートナーズ	0.2	1	2,143	—	—	—
ライドオン・エクスプレス	—	1.8	2,586	—	—	—
ERIホールディングス	1.7	2.3	1,975	—	—	—
アビスト	0.8	1.2	2,732	—	—	—
ウィルグループ	0.7	2.1	2,503	—	—	—
日本ビューホテル	—	1.3	2,025	—	—	—
リクルートホールディングス	99.5	154	577,500	—	—	—
エラン	—	1.1	1,492	—	—	—
日本郵政	—	224.5	319,014	—	—	—
ベルシステム24ホールディングス	—	15.3	14,152	—	—	—
リロ・ホールディング	2.2	2.9	43,964	—	—	—
東祥	1.5	2.3	9,913	—	—	—
エイチ・アイ・エス	10.8	12.5	36,625	—	—	—
ラックランド	—	1.2	2,094	—	—	—
共立メンテナンス	3.9	5.7	48,792	—	—	—
イチネンホールディングス	7.2	8.7	9,135	—	—	—
建設技術研究所	4	4.5	4,135	—	—	—
スペース	3.6	4.1	5,293	—	—	—
燦ホールディングス	1.3	1.7	2,349	—	—	—
スバル興業	5	6	2,244	—	—	—
東京テアトル	25	29	3,393	—	—	—
ナガワ	—	1.4	4,921	—	—	—
よみうりランド	14	16	7,344	—	—	—
東京都競馬	45	52	11,648	—	—	—
カナモト	9.2	10.7	26,803	—	—	—
東京ドーム	46	62	29,388	—	—	—
西尾レントオール	5.3	6.2	15,227	—	—	—
トランス・コスモス	8.6	8.9	28,391	—	—	—
乃村工藝社	12.9	16.3	27,253	—	—	—
藤田観光	24	29	15,312	—	—	—
KNT-CTホールディングス	32	37	6,142	—	—	—
日本管財	3.2	6.6	10,296	—	—	—
トーカイ	2.9	3.4	11,084	—	—	—
白洋舎	8	10	2,530	—	—	—
セコム	63.8	79.4	688,239	—	—	—
セントラル警備保障	3	3.4	7,595	—	—	—
丹青社	7.8	14.3	13,299	—	—	—

銘柄	当期首(前期末)			当 期 末		
	株 数 (千株)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)	評 価 額 (千円)	株 数 (千株)
メイテック	8.8	9.5	36,860	—	—	—
アサツー ディ・ケイ	12.4	13.4	36,876	—	—	—
応用地質	6.9	7.9	9,211	—	—	—
船井総研ホールディングス	7.2	10.6	16,218	—	—	—
進学会	2.9	3.7	1,961	—	—	—
オオバ	—	5.7	2,496	—	—	—
学究社	—	1.4	1,645	—	—	—
ベネッセホールディングス	24	25.6	62,643	—	—	—
イオンディライト	6.4	7.4	23,680	—	—	—
ナック	4.6	5.1	4,778	—	—	—
ニチイ学館	13	13.9	10,035	—	—	—
ダイセキ	10.6	14.4	30,225	—	—	—
ステップ	2.3	2.7	2,891	—	—	—
合 計	株 数・金 額	104,665	120,967	147,897	985	
	銘柄数<比率>	1,837	1,905	<97.9%>		

(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 T O P I X	2,827	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株 式	147,897,985	97.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,669,481	2.4
投 資 信 託 財 産 総 額	151,567,466	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 2016年5月30日現在
(A) 資 産	151,557,481,183円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,088,665,023
株 式(評価額)	147,897,985,080
未 収 入 金	56,183,620
未 収 配 当 金	1,397,883,460
差 入 委 託 証 拠 金	116,764,000
(B) 負 債	554,919,833
未 払 金	514,726,890
未 払 解 約 金	40,132,872
未 払 利 息	5,180
そ の 他 未 払 費 用	54,891
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	151,002,561,350
元 本	128,457,920,792
次 期 繰 越 損 益 金	22,544,640,558
(D) 受 益 権 総 口 数	128,457,920,792口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,755円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年5月30日 至 2016年5月30日
(A) 配 当 等 収 益	2,945,695,089円
受 取 配 当 金	2,942,898,802
受 取 利 息	842,741
そ の 他 収 益 金	2,087,634
支 払 利 息	△134,088
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△28,053,364,848
売 買 益	5,590,264,508
売 買 損	△33,643,629,356
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△233,472,260
取 引 益	609,039,020
取 引 損	△842,511,280
(D) そ の 他 費 用	△54,891
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△25,341,196,910
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	45,888,142,602
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,258,927,500
(H) 解 約 差 損 益 金	△5,261,232,634
(I) 計 (E+F+G+H)	22,544,640,558
次 期 繰 越 損 益 金(I)	22,544,640,558

(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111,550,527,745円、期中追加設定元本額は34,424,705,801円、期中一部解約元本額は17,517,312,754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	17,448,179,222円
日本株式インデックス・オープン	16,817,570,112円
DCマイセレクション75	15,530,618,733円
SMT TOP1Xインデックス・オープン	8,339,352,553円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	7,079,283,364円
DCマイセレクションS50	6,703,362,930円
DCマイセレクション25	5,647,373,346円
DC日本株式インデックス・オープン	4,831,896,827円
DCマイセレクションS75	4,151,162,817円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,066,936,993円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	3,765,847,635円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	3,642,752,973円
DC日本株式インデックス・オープンS	3,523,683,135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)	3,140,844,026円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	2,692,763,829円
DCマイセレクションS25	2,442,504,510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)	1,856,958,024円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,449,766,917円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,285,212,286円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,148,750,036円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,141,720,564円
DC世界経済インデックスファンド	1,117,380,063円
グローバル・インカム&プラス(毎月決算型)	1,097,542,423円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	1,083,231,845円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	1,045,179,290円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	976,309,928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)	850,050,970円
世界経済インデックスファンド	837,448,369円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	798,715,137円
日本株式ファンド・シリーズ2	678,770,861円
DCターゲット・イヤーファンド2035	584,001,369円
DCターゲット・イヤーファンド2025	514,306,720円
日本株式インデックス・オープン(SMA専用)	387,008,344円
DCターゲット・イヤーファンド2045	307,097,543円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	296,483,987円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	196,733,513円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	176,866,191円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	133,444,558円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	93,240,412円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	92,071,996円
SMTインデックスバランス・オープン	79,815,193円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	76,145,525円
マイセレクション50	74,721,716円
マイセレクション75	70,711,268円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	64,209,570円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	45,800,081円
SBI資産設計オープン(分配型)	30,635,592円
マイセレクション25	27,822,757円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	12,520,792円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	3,113,947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-BP1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	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	

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1期(決算日 2016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。
- ・一印は、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	債券先物率比	純資産額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
第1	設定日(2016年2月3日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	百万円 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

(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	債券先物率比
			騰落率		騰落率		
第1期	(設定日)2016年2月3日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —
	2月末	10,138	1.4	10,138	1.4	99.5	0.1
	3月末	10,218	2.2	10,221	2.2	99.6	0.1
	4月末	10,307	3.1	10,310	3.1	98.8	0.8
	5月末	10,342	3.4	10,346	3.5	99.4	0.2
	6月末	10,467	4.7	10,473	4.7	99.4	0.2
	(期 末)2016年7月7日	10,510	5.1	10,514	5.1	99.4	0.3

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

(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。

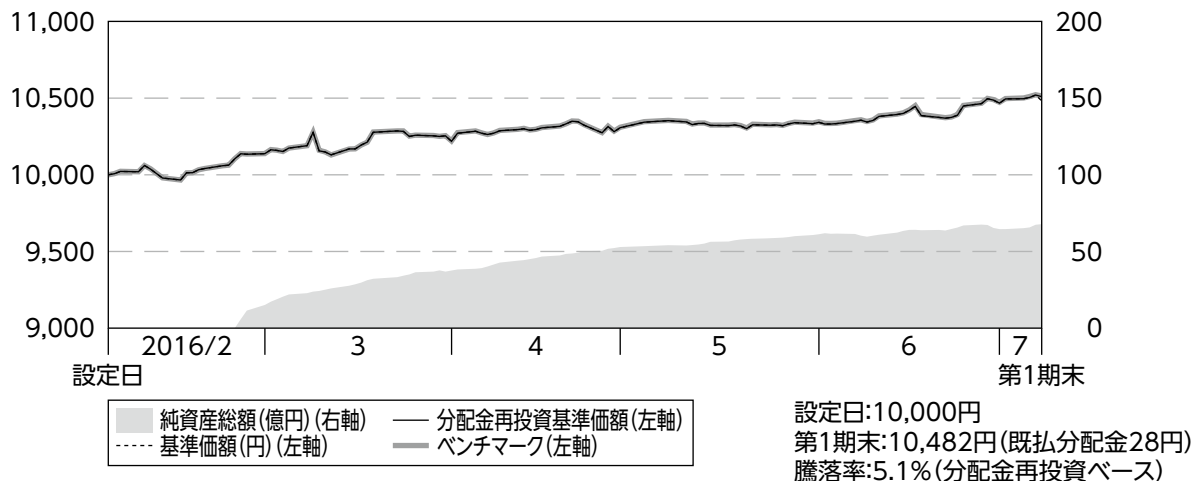
(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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。

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

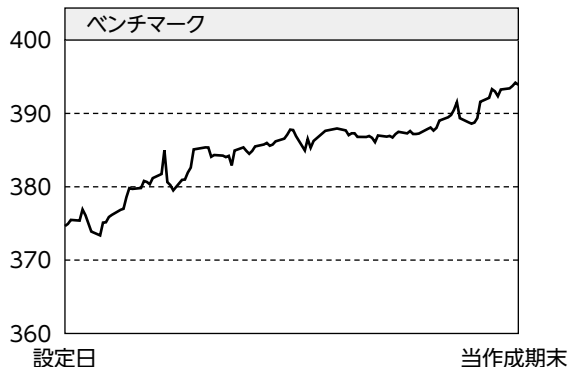


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2016年2月3日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

設定日より、日銀のマイナス金利政策や追加金融緩和に対する期待感から、金利は低下(債券価格は上昇)基調で推移し、3月末にかけて基準価額は上昇しました。その後米国の利上げ観測を受けて米国金利とともに金利が上昇(債券価格は下落)する局面もありましたが、円高・株安への警戒感に加え日銀の国債買い入れオペによる国債需給の逼迫が意識されたことから、金利は低位でのみ合い推移となり、5月末にかけて基準価額はもみ合い推移となりました。6月以降は米国の早期利上げ観測の後退や英国のEU(欧州連合)離脱懸念の高まりを背景に金利低下が続いた後、英国国民投票でEU離脱派が勝利したことを受けて投資家のリスク回避の動きが加速したことから金利は急低下し、基準価額は上昇しました。

投資環境



設定日より、日銀のマイナス金利政策や追加金融緩和に対する期待感から、金利は低下基調で推移しました。4月以降は米国の利上げ観測を受けて米国金利とともに金利が上昇する局面もありましたが、円高・株安への警戒感に加え日銀の国債買い入れオペによる国債需給の逼迫が意識されたことから、金利は低位でのみみ合い推移となりました。6月以降は米国の早期利上げ観測の後退や英国のEU離脱懸念の高まりを背景に金利低下が続き、その後英国国民投票でEU離脱派が勝利したことを受けて投資家のリスク回避の動きが加速したことから、金利はさらに低下しました。

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。

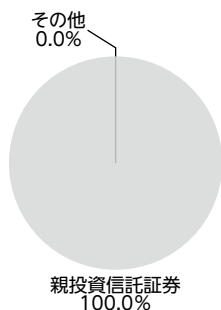
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

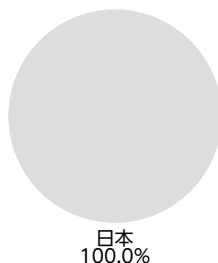
	当作成期末
	2016年7月7日
国内債券インデックス マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

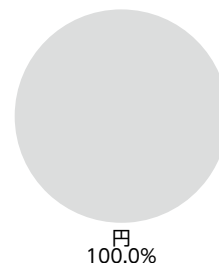
○資産別配分



○国別配分



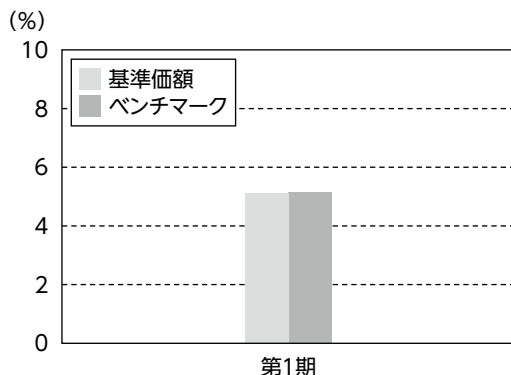
○通貨別配分



(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、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す。
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1期	
	2016年2月3日~2016年7月7日	
当期分配金	(円)	28
(対基準価額比率)	(%)	(0.266)
当期の収益	(円)	28
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	482

(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		項目の概要
	(2016年2月3日~2016年7月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	5円	0.046%	(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10,294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。 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 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(3)	(0.032)	
(販売会社)	(0)	(0.005)	
(受託会社)	(1)	(0.009)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	
(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 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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	0	0.002	(d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	5	0.048	

(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
国内債券インデックス マザーファンド	千口 5,218,656	千円 7,300,358	千口 493,913	千円 701,297

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
金 銭 信 託	百万円 114	百万円 114	% 100.0	百万円 114	百万円 114	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	355	21	5.9	334	16	4.8

(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
金 銭 信 託	百万円 145,408	百万円 145,408	% 100.0	百万円 145,408	百万円 145,408	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	109,723	2,541	2.3	109,665	2,406	2.2

<平均保有割合 1.5%>

(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。

自社による当ファンドの設定・解約状況

当作成期首残高 (元)	当作成期設定 元	当作成期解約 元	当作成期末残高 (元)	取 引 の 理 由
千円 -	千円 500	千円 500	千円 -	当初設定時における取得およびその解約

* 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>

	当 作 成 期 末	
	口 数	評 価 額
国内債券インデックス マザーファンド	千口 4,724,743	千円 6,780,006

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、222,347,116千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券インデックス マザーファンド	千円 6,780,006	% 99.7
コール・ローン等、その他	21,078	0.3
投資信託財産総額	6,801,084	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 1 期 末 2016年7月7日現在
(A)資 産	6,801,084,278円
コール・ローン等	21,077,637
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	6,780,006,641
(B)負 債	20,093,673
未払収益分配金	18,113,556
未払信託報酬	1,885,613
未払利息	44
その他未払費用	94,460
(C)純資産総額(A-B)	6,780,990,605
元 本	6,469,127,400
次期繰越損益金	311,863,205
(D)受益権総口数	6,469,127,400口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,482円

■損益の状況

項 目	第 1 期 自 2016年2月3日 至 2016年7月7日
(A)配 当 等 収 益	△1,138円
支 払 利 息	△1,138
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	167,414,732
売 買 益	180,839,876
売 買 損	△13,425,144
(C)信 託 報 酬 等	△1,980,270
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	165,433,324
(E)追 加 信 託 差 損 益 金	164,543,437
(配 当 等 相 当 額)	(△237)
(売 買 損 益 相 当 額)	(164,543,674)
(F) 計 (D+E)	329,976,761
(G)収 益 分 配 金	△18,113,556
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	311,863,205
追 加 信 託 差 損 益 金	164,543,437
(配 当 等 相 当 額)	(3,775,436)
(売 買 損 益 相 当 額)	(160,768,001)
分 配 準 備 積 立 金	147,319,768

- (注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(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) (E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの第1期首元本額は500,000円、第1期中追加設定元本額は7,251,169,833円、第1期中一部解約元本額は782,542,433円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 1 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	19,190,466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)	146,242,858円
(C) 収益調整金額	164,543,437円
(D) 分配準備積立金額	－円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	329,976,761円
(F) 期末残存口数	6,469,127,400口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	510円
(H) 分配金額(1万口当たり)	28円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	18,113,556円

分配金のお知らせ

	第1期
1万口当たり分配金	28円

(注)分配金は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16期（決算日 2016年5月30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上げます。

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、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、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		債券先物率 債組入比率	純資産額
	期騰落率	中騰落率	期騰落率	中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
第12期(2012年5月29日)	12,436	2.9	341,318	2.9	99.4	197,259
第13期(2013年5月29日)	12,514	0.6	343,438	0.6	99.3	246,098
第14期(2014年5月29日)	12,915	3.2	354,471	3.2	99.3	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	319,650

(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		債券先物率 債組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(当期首) 2015年 5月29日	円	%		%	%
	13,215	—	362,770	—	99.6
6月末	13,209	△0.0	362,542	△0.1	99.5
7月末	13,247	0.2	363,584	0.2	99.6
8月末	13,268	0.4	364,201	0.4	99.3
9月末	13,306	0.7	365,235	0.7	99.2
10月末	13,357	1.1	366,655	1.1	99.5
11月末	13,355	1.1	366,578	1.0	99.6
12月末	13,437	1.7	368,877	1.7	99.5
2016年 1月末	13,604	2.9	373,520	3.0	99.4
2月末	13,836	4.7	379,830	4.7	99.5
3月末	13,947	5.5	382,913	5.6	99.6
4月末	14,069	6.5	386,253	6.5	98.8
(当期末) 2016年 5月30日	14,107	6.7	387,276	6.8	99.4

(注1)騰落率は期首比です。

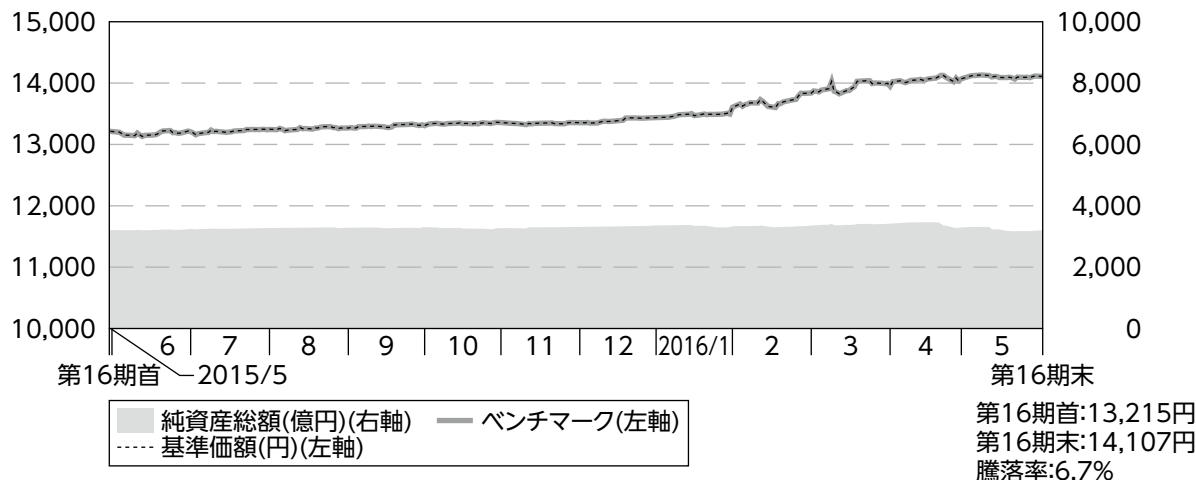
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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

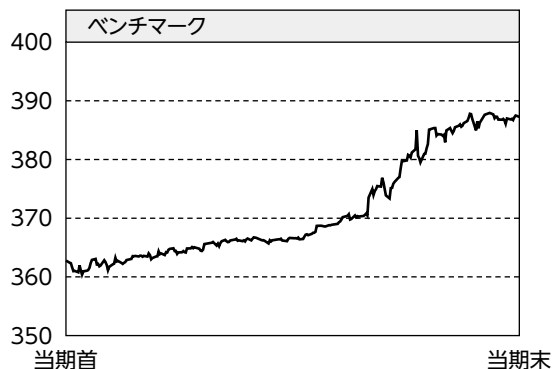


(注)ベンチマークは、2015年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2015年6月に欧米長期金利の上昇の影響を受けて国内金利も上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落する局面もありましたが、その後2016年1月末にかけて、夏場以降の内外株式の下落に加え、原油価格の急落や中国の景気減速懸念、日銀やECB(欧州中央銀行)による追加金融緩和観測の高まりなどから、金利は低下(債券価格は上昇)基調で推移し、基準価額は上昇しました。1月末には、日銀がマイナス金利政策の導入を決定したことを受けて金利は急激に低下し、基準価額は一段と上昇しました。その後も、日銀の追加金融緩和期待が高まったことや国債需給の引き締まりが意識されたことから金利は低下基調で推移し、2月には長期ゾーンまでの国債がマイナス金利となりました。その後は、4月の日銀金融政策決定会合で大方の予想に反し追加金融緩和が見送られましたが、影響は限定的で、基準価額は期末にかけてほぼ横ばいで推移しました。

投資環境



2015年6月に欧米長期金利の上昇の影響から10年国債利回りが上昇する局面もありましたが、その後2016年1月末にかけて、内外株式の下落に加え、原油価格の急落や中国の景気減速懸念、日銀やECBによる追加金融緩和観測の高まりから、10年国債利回りは低下基調で推移しました。1月末には、日銀がマイナス金利政策の導入を決定したことを受けて10年国債利回りは急激に低下し、その後も、日銀の追加金融緩和期待が高まったことや国債需給の引き締まりが意識されたことから低下基調で推移し、2月にはマイナス利回りを付けました。4月の日銀金融政策決定会合では、大方の予想に反し追加金融緩和が見送られましたが、影響は限定的でした。

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

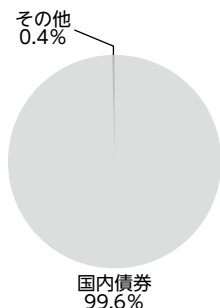
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	第113回利付国債(5年)	日本	1.4%
2	第116回利付国債(5年)	日本	1.2%
3	第125回利付国債(5年)	日本	1.1%
4	第122回利付国債(5年)	日本	1.1%
5	第117回利付国債(5年)	日本	1.1%
6	第118回利付国債(5年)	日本	1.1%

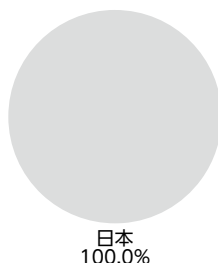
順位	銘柄名	国	組入比率
7	第126回利付国債(5年)	日本	1.1%
8	第105回利付国債(5年)	日本	1.1%
9	第106回利付国債(5年)	日本	1.0%
10	第339回利付国債(10年)	日本	1.0%
組入銘柄数		738	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

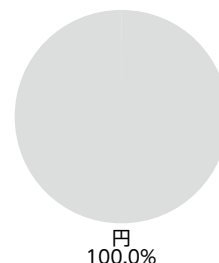
○資産別配分



○国別配分



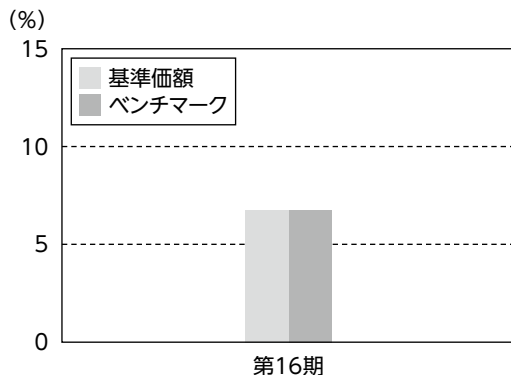
○通貨別配分



(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		項目の概要
	(2015年5月30日~2016年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (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円 (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (0.000)	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有価証券取引税 (株式) (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	0 (-) (-) (0)	0.000 (-) (-) (0.000)	(c) 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
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(13,487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
国 内	国 債 証 券	千円 61,498,082	千円 74,403,104
	地 方 債 証 券	3,271,847	4,836,914
	特 殊 債 券	3,587,305	5,594,098 (385,181)
	社債券(投資法人債券を含む)	1,845,114	4,484,271 (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
国 内	債 券 先 物 取 引	百万円 64,821	百万円 64,088	百万円 -	百万円 -

(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
金 銭 信 託	百万円 131,619	百万円 131,619	% 100.0	百万円 131,361	百万円 131,361	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	361,354	20,705	5.7	361,495	20,705	5.7

(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。

※ 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B 格以 組入比	B 下 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	230,130,000 (3,690,000)	260,746,470 (3,705,736)	81.6 (1.2)	— (—)	— (—)	50.9 (—)	21.5 (0.1)	9.2 (1.1)	
地方債証券	16,892,990 (16,892,990)	18,387,743 (18,387,743)	5.8 (5.8)	— (—)	— (—)	3.7 (3.7)	1.6 (1.6)	0.5 (0.5)	
特殊債証券 (除く金融債)	20,053,097 (20,053,097)	21,718,652 (21,718,652)	6.8 (6.8)	— (—)	— (—)	4.7 (4.7)	1.7 (1.7)	0.4 (0.4)	
金融債証券	2,600,000 (2,600,000)	2,612,051 (2,612,051)	0.8 (0.8)	— (—)	— (—)	— (—)	0.3 (0.3)	0.5 (0.5)	
普通社債証券 (含む投資法人債券)	13,527,000 (13,527,000)	14,128,695 (14,128,695)	4.4 (4.4)	— (—)	— (—)	1.8 (1.8)	1.7 (1.7)	1.0 (1.0)	
合計	283,203,087 (56,763,087)	317,593,613 (60,552,878)	99.4 (18.9)	— (—)	— (—)	61.1 (10.2)	26.7 (5.3)	11.6 (3.5)	

(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 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日		
国債証券						
第353回利付国債(2年)	0.1	1,600,000	1,605,904	2017/6/15		
第354回利付国債(2年)	0.1	550,000	552,189	2017/7/15		
第355回利付国債(2年)	0.1	1,790,000	1,797,679	2017/8/15		
第356回利付国債(2年)	0.1	1,090,000	1,095,079	2017/9/15		
第357回利付国債(2年)	0.1	740,000	743,663	2017/10/15		
第360回利付国債(2年)	0.1	600,000	603,420	2018/1/15		
第362回利付国債(2年)	0.1	1,600,000	1,609,888	2018/3/15		
第364回利付国債(2年)	0.1	410,000	412,693	2018/5/15		
第105回利付国債(5年)	0.2	3,500,000	3,516,415	2017/6/20		
第106回利付国債(5年)	0.2	3,260,000	3,278,973	2017/9/20		
第107回利付国債(5年)	0.2	1,120,000	1,127,851	2017/12/20		
第108回利付国債(5年)	0.1	590,000	593,215	2017/12/20		
第109回利付国債(5年)	0.1	1,190,000	1,197,520	2018/3/20		
第110回利付国債(5年)	0.3	700,000	706,895	2018/3/20		
第111回利付国債(5年)	0.4	1,200,000	1,214,100	2018/3/20		
第112回利付国債(5年)	0.4	900,000	911,970	2018/6/20		
第113回利付国債(5年)	0.3	4,390,000	4,439,343	2018/3/20		
第114回利付国債(5年)	0.3	810,000	820,222	2018/9/20		
第115回利付国債(5年)	0.2	2,450,000	2,475,259	2018/9/20		
第116回利付国債(5年)	0.2	3,830,000	3,873,776	2018/12/20		
第117回利付国債(5年)	0.2	3,520,000	3,564,140	2019/3/20		
第118回利付国債(5年)	0.2	3,510,000	3,557,455	2019/6/20		
第119回利付国債(5年)	0.1	1,000,000	1,010,450	2019/6/20		
第120回利付国債(5年)	0.2	3,080,000	3,125,122	2019/9/20		

銘柄名	当		期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日		
第121回利付国債(5年)	0.1	630,000	637,131	2019/9/20		
第122回利付国債(5年)	0.1	3,560,000	3,602,720	2019/12/20		
第123回利付国債(5年)	0.1	3,140,000	3,179,721	2020/3/20		
第124回利付国債(5年)	0.1	2,810,000	2,847,906	2020/6/20		
第125回利付国債(5年)	0.1	3,610,000	3,661,767	2020/9/20		
第126回利付国債(5年)	0.1	3,480,000	3,532,826	2020/12/20		
第127回利付国債(5年)	0.1	650,000	660,406	2021/3/20		
第1回利付国債(40年)	2.4	150,000	243,210	2048/3/20		
第2回利付国債(40年)	2.2	420,000	661,256	2049/3/20		
第3回利付国債(40年)	2.2	420,000	666,934	2050/3/20		
第4回利付国債(40年)	2.2	530,000	848,641	2051/3/20		
第5回利付国債(40年)	2.0	490,000	758,064	2052/3/20		
第6回利付国債(40年)	1.9	690,000	1,052,388	2053/3/20		
第7回利付国債(40年)	1.7	790,000	1,157,626	2054/3/20		
第8回利付国債(40年)	1.4	670,000	915,005	2055/3/20		
第286回利付国債(10年)	1.8	870,000	888,809	2017/6/20		
第287回利付国債(10年)	1.9	540,000	552,241	2017/6/20		
第288回利付国債(10年)	1.7	2,090,000	2,143,315	2017/9/20		
第289回利付国債(10年)	1.5	2,490,000	2,557,752	2017/12/20		
第290回利付国債(10年)	1.4	470,000	483,888	2018/3/20		
第291回利付国債(10年)	1.3	840,000	863,301	2018/3/20		
第292回利付国債(10年)	1.7	1,110,000	1,148,816	2018/3/20		
第293回利付国債(10年)	1.8	370,000	385,562	2018/6/20		
第294回利付国債(10年)	1.7	180,000	187,200	2018/6/20		
第295回利付国債(10年)	1.5	100,000	103,588	2018/6/20		

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第296回利付国債(10年)	1.5	2,100,000	2,184,651	2018/9/20
第297回利付国債(10年)	1.4	560,000	583,441	2018/12/20
第298回利付国債(10年)	1.3	1,660,000	1,725,221	2018/12/20
第299回利付国債(10年)	1.3	1,310,000	1,366,670	2019/3/20
第300回利付国債(10年)	1.5	830,000	870,587	2019/3/20
第301回利付国債(10年)	1.5	640,000	674,233	2019/6/20
第302回利付国債(10年)	1.4	200,000	210,084	2019/6/20
第303回利付国債(10年)	1.4	1,390,000	1,465,671	2019/9/20
第304回利付国債(10年)	1.3	480,000	504,532	2019/9/20
第305回利付国債(10年)	1.3	2,160,000	2,278,389	2019/12/20
第306回利付国債(10年)	1.4	1,370,000	1,455,871	2020/3/20
第307回利付国債(10年)	1.3	700,000	741,195	2020/3/20
第308回利付国債(10年)	1.3	990,000	1,051,944	2020/6/20
第309回利付国債(10年)	1.1	1,780,000	1,876,814	2020/6/20
第310回利付国債(10年)	1.0	1,590,000	1,674,651	2020/9/20
第311回利付国債(10年)	0.8	610,000	637,169	2020/9/20
第312回利付国債(10年)	1.2	1,670,000	1,779,468	2020/12/20
第313回利付国債(10年)	1.3	1,650,000	1,772,083	2021/3/20
第314回利付国債(10年)	1.1	910,000	968,503	2021/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	1,350,000	1,449,036	2021/6/20
第316回利付国債(10年)	1.1	1,090,000	1,164,392	2021/6/20
第317回利付国債(10年)	1.1	620,000	664,633	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	1,010,000	1,077,276	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	750,000	806,565	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	1,220,000	1,305,143	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	1,640,000	1,759,605	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	750,000	800,287	2022/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	970,000	1,037,909	2022/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	1,810,000	1,925,586	2022/6/20
第325回利付国債(10年)	0.8	2,290,000	2,442,422	2022/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	600,000	637,548	2022/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	740,000	791,237	2022/12/20
第328回利付国債(10年)	0.6	1,720,000	1,819,863	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	2,660,000	2,857,398	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	1,640,000	1,765,476	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	680,000	721,922	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	2,560,000	2,721,228	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	2,060,000	2,192,313	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	2,600,000	2,770,222	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,390,000	2,529,121	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	890,000	942,572	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	1,350,000	1,406,281	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	2,210,000	2,321,494	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	3,080,000	3,236,926	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	2,840,000	2,985,976	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	2,950,000	3,072,690	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	2,370,000	2,421,689	2026/3/20
第1回利付国債(30年)	2.8	40,000	54,936	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	212,550	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	158,328	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	110,000	155,487	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	66,019	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	190,000	258,151	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	180,000	243,190	2032/5/20

銘柄名	期		末	
	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(30年)	1.8	50,000	63,778	2032/11/22
第9回利付国債(30年)	1.4	240,000	290,568	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	160,000	185,820	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	90,000	113,666	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	190,000	253,344	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	290,000	382,411	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	300,000	417,024	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	340,000	480,008	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	370,000	523,501	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	330,000	461,943	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	445,000	615,991	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	280,000	388,270	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	420,000	598,987	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	270,000	375,634	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	400,000	573,036	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	430,000	617,690	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	320,000	460,905	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	350,000	491,704	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	630,000	900,477	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	680,000	992,480	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	530,000	778,135	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	800,000	1,164,592	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	610,000	879,735	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	740,000	1,056,601	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	930,000	1,355,214	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	920,000	1,284,467	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	1,090,000	1,582,647	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	1,180,000	1,665,487	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	1,120,000	1,589,257	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	1,160,000	1,624,371	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	590,000	814,577	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	850,000	1,197,777	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	530,000	734,336	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	580,000	790,673	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	670,000	914,208	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	800,000	1,095,456	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	720,000	986,832	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	680,000	896,967	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	750,000	991,207	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	820,000	1,107,820	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	1,320,000	1,713,412	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	630,000	819,233	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	430,000	486,811	2046/3/20
第36回利付国債(20年)	3.0	70,000	72,976	2017/9/20
第37回利付国債(20年)	3.1	70,000	73,068	2017/9/20
第38回利付国債(20年)	2.7	20,000	21,062	2018/3/20
第39回利付国債(20年)	2.6	500,000	525,670	2018/3/20
第40回利付国債(20年)	2.3	100,000	105,860	2018/9/20
第41回利付国債(20年)	1.5	330,000	346,137	2019/3/20
第42回利付国債(20年)	2.6	80,000	86,392	2019/3/20
第43回利付国債(20年)	2.9	140,000	154,589	2019/9/20
第44回利付国債(20年)	2.5	170,000	187,754	2020/3/20
第45回利付国債(20年)	2.4	290,000	319,176	2020/3/20
第46回利付国債(20年)	2.2	170,000	186,841	2020/6/22

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第47回利付国債 (20年)	2.2	90,000	99,469	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)	2.5	130,000	146,307	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)	2.1	140,000	155,811	2021/3/22
第50回利付国債 (20年)	1.9	220,000	242,651	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	100,000	111,433	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	110,000	123,801	2021/9/21
第53回利付国債 (20年)	2.1	80,000	90,510	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)	2.2	200,000	227,402	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	140,000	158,453	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	150,000	170,634	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)	1.9	240,000	271,540	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	300,000	341,094	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	200,000	225,758	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)	1.4	350,000	388,087	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	240,000	260,570	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)	0.8	320,000	343,747	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	200,000	229,102	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	320,000	370,496	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	220,000	255,725	2023/12/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	330,000	381,054	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	130,000	151,690	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	190,000	226,219	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)	2.1	390,000	461,256	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	400,000	484,712	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	200,000	239,086	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	630,000	751,086	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	360,000	427,802	2024/12/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	200,000	239,404	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	130,000	156,292	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	270,000	319,642	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	290,000	346,062	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	170,000	202,072	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	270,000	323,268	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	220,000	265,423	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	390,000	468,674	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	600,000	726,696	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	290,000	352,216	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	670,000	807,269	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	290,000	353,666	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	210,000	260,265	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	550,000	676,197	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	420,000	522,349	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	350,000	431,739	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	630,000	780,047	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	450,000	561,856	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	880,000	1,084,749	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	410,000	502,901	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	610,000	754,868	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	610,000	771,454	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	320,000	397,564	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	590,000	742,178	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	440,000	548,477	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	940,000	1,175,526	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	600,000	760,242	2028/3/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第101回利付国債 (20年)	2.4	285,000	367,880	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	380,000	492,582	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	360,000	462,297	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	300,000	377,976	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	670,000	846,755	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	330,000	421,139	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	150,000	190,258	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	470,000	584,299	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	340,000	424,044	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	850,000	1,081,939	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	330,000	425,591	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	750,000	957,442	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	1,040,000	1,332,333	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	590,000	758,439	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	720,000	935,316	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	550,000	716,485	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	820,000	1,056,906	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	690,000	882,054	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	380,000	475,114	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	330,000	403,342	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	1,090,000	1,381,291	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	280,000	350,837	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	1,040,000	1,351,937	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	280,000	359,926	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	430,000	566,649	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	430,000	553,999	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	460,000	585,879	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	620,000	791,355	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	420,000	529,804	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	630,000	796,231	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	380,000	474,506	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	730,000	913,777	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	680,000	861,662	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	420,000	533,127	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	380,000	476,421	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	610,000	755,253	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	290,000	364,167	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	390,000	477,387	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	410,000	508,363	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	1,060,000	1,333,140	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	360,000	453,794	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	820,000	1,046,992	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	950,000	1,182,512	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)	1.5	590,000	724,673	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	1,480,000	1,869,180	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	1,360,000	1,719,883	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	1,370,000	1,711,212	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	1,230,000	1,516,565	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	1,510,000	1,863,370	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	1,310,000	1,593,195	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	1,270,000	1,499,870	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	1,510,000	1,783,581	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	1,310,000	1,571,567	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	1,440,000	1,701,316	2035/9/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第155回利付国債(20年)	1.0	1,550,000	1,773,324	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	430,000	442,164	2036/3/20
第18回メキシコ合衆国国債	0.8	100,000	100,851	2019/7/24
第14回ポーランド共和国国債	0.67	200,000	201,302	2018/11/15
小計		230,130,000	260,746,470	
地方債証券				
第3回東京都公募債(20年)	2.26	100,000	117,177	2024/3/19
第6回東京都公募債(20年)	2.0	100,000	117,039	2025/3/19
第9回東京都公募債(30年)	2.37	100,000	140,141	2039/3/18
第11回東京都公募債(30年)	2.19	100,000	138,253	2040/9/20
第17回東京都公募債(20年)	2.09	100,000	124,380	2028/12/20
第19回東京都公募債(20年)	2.13	100,000	125,510	2029/6/20
第26回東京都公募債(20年)	1.74	200,000	248,094	2032/6/18
第27回東京都公募債(20年)	1.68	200,000	246,846	2032/12/20
第695回東京都公募債	1.2	100,000	105,558	2021/3/19
第696回東京都公募債	1.19	100,000	105,771	2021/6/18
第700回東京都公募債	1.02	100,000	105,156	2021/9/17
第702回東京都公募債	1.04	200,000	211,034	2021/12/20
第716回東京都公募債	0.77	100,000	104,741	2022/12/20
第717回東京都公募債	0.63	100,000	103,933	2023/3/20
第720回東京都公募債	0.87	100,000	105,655	2023/6/20
第728回東京都公募債	0.65	100,000	104,400	2023/12/20
平成19年度第9回北海道公募債	1.7	110,000	112,711	2017/11/30
平成20年度第14回北海道公募債	1.74	100,000	104,637	2019/2/27
平成22年度第11回北海道公募債	1.36	100,000	105,721	2020/12/28
平成23年度第6回北海道公募債	1.11	200,000	210,614	2021/8/31
平成24年度第14回北海道公募債	0.8	100,000	104,834	2023/2/28
第4回神奈川県公募債(30年)	2.62	100,000	143,806	2038/3/19
第20回神奈川県公募債(20年)	1.706	100,000	123,134	2032/6/18
第27回神奈川県公募債(20年)	1.398	100,000	118,862	2034/9/20
第150回神奈川県公募債	1.67	100,000	102,565	2017/12/20
第172回神奈川県公募債	1.34	200,000	209,996	2020/3/20
第210回神奈川県公募債	0.451	200,000	206,658	2024/12/20
第9回大阪府公募債(20年)	1.84	200,000	247,482	2031/9/26
第91回大阪府公募債(5年)	0.17	100,000	100,170	2018/2/27
第307回大阪府公募債(10年)	1.84	100,000	102,495	2017/10/30
第311回大阪府公募債(10年)	1.68	100,000	102,811	2018/2/28
第322回大阪府公募債(10年)	1.62	100,000	104,114	2019/1/29
第345回大阪府公募債(10年)	1.26	100,000	105,160	2020/12/25
第349回大阪府公募債(10年)	1.38	100,000	106,341	2021/4/27
第361回大阪府公募債(10年)	0.92	100,000	105,050	2022/6/28
第371回大阪府公募債(10年)	0.58	100,000	103,541	2023/4/26
第375回大阪府公募債(10年)	0.835	100,000	105,479	2023/8/29
第389回大阪府公募債(10年)	0.53	100,000	103,806	2024/10/30
平成22年度第2回京都府公募債	1.16	100,000	104,853	2020/9/24
平成23年度第5回京都府公募債(20年)	1.79	100,000	123,818	2031/10/17
平成23年度第7回京都府公募債	0.8	100,000	105,345	2023/9/19
第1回兵庫県公募債(12年)	1.1	100,000	108,313	2024/6/26
第3回兵庫県公募債(12年)	0.56	100,000	104,186	2025/4/16
第7回兵庫県公募債(15年)	1.12	100,000	111,490	2028/12/25
平成19年度第9回兵庫県公募債	1.84	100,000	102,452	2017/10/18
平成22年度第1回兵庫県公募債	1.46	100,000	105,355	2020/4/16
平成25年度第4回兵庫県公募債	0.82	100,000	105,273	2023/8/18
第9回静岡県公募債(30年)	1.539	100,000	126,675	2045/6/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
平成20年度第4回静岡県公募債	1.65	100,000	103,706	2018/8/28
平成23年度第3回静岡県公募債	1.193	103,290	109,262	2021/5/25
平成23年度第8回静岡県公募債	1.025	100,000	105,313	2021/10/25
平成24年度第10回静岡県公募債	0.678	100,000	104,369	2023/3/22
平成20年度第6回愛知県公募債(10年)	1.71	100,000	104,233	2018/11/28
平成21年度第5回愛知県公募債(20年)	2.28	100,000	127,027	2029/6/20
平成22年度第3回愛知県公募債(10年)	1.364	200,000	210,642	2020/5/28
平成23年度第1回愛知県公募債(10年)	1.38	100,000	106,632	2021/4/28
平成23年度第3回愛知県公募債(10年)	1.212	100,000	105,884	2021/5/27
平成23年度第14回愛知県公募債(10年)	1.006	100,000	105,305	2021/11/30
平成24年度第19回愛知県公募債(10年)	0.639	100,000	104,113	2023/3/28
平成26年度第3回愛知県公募債(10年)	0.665	100,000	104,891	2024/4/30
平成19年度第2回広島県公募債	1.94	200,000	204,752	2017/8/24
平成20年度第1回広島県公募債(20年)	2.34	100,000	126,551	2028/9/21
平成22年度第1回広島県公募債	1.37	100,000	105,426	2020/5/27
平成24年度第4回広島県公募債	0.81	100,000	104,990	2022/11/28
平成20年度第4回埼玉県公募債	1.6	100,000	103,710	2018/9/26
平成20年度第6回埼玉県公募債	1.49	100,000	103,934	2019/1/29
平成22年度第10回埼玉県公募債	1.26	100,000	105,681	2021/1/28
平成22年度第11回埼玉県公募債	1.28	193,000	204,373	2021/2/25
平成24年度第1回埼玉県公募債	1.05	100,000	105,951	2022/4/26
平成24年度第9回埼玉県公募債	0.844	100,000	105,386	2023/1/31
平成25年度第11回埼玉県公募債	0.655	100,000	104,713	2024/3/26
平成20年度第2回福岡県公募債(20年)	2.05	100,000	123,579	2028/12/20
平成23年度第1回福岡県公募債(20年)	2.008	100,000	126,675	2031/5/23
平成23年度第1回福岡県公募債	1.18	200,000	211,556	2021/6/28
平成24年度第1回福岡県公募債(30年)	2.12	100,000	139,119	2042/9/19
第13回千葉県公募債(20年)	1.701	100,000	123,632	2032/10/15
平成21年度第12回千葉県公募債	1.44	100,000	105,289	2020/2/25
平成22年度第8回千葉県公募債	1.0	120,000	125,163	2020/11/25
平成25年度第5回千葉県公募債	0.84	100,000	105,773	2023/8/25
平成27年度第1回千葉県公募債	0.549	100,000	104,368	2025/5/23
第55回共同発行市場公募地方債	1.85	158,400	162,474	2017/10/25
第56回共同発行市場公募地方債	1.72	100,000	102,522	2017/11/24
第62回共同発行市場公募地方債	1.74	100,000	103,437	2018/5/25
第77回共同発行市場公募地方債	1.5	100,000	103,583	2018/10/25
第68回共同発行市場公募地方債	1.39	100,000	104,566	2019/9/25
第85回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	105,534	2020/4/24
第87回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	105,143	2020/6/25
第89回共同発行市場公募地方債	1.04	150,300	156,758	2020/8/25
第91回共同発行市場公募地方債	0.9	100,000	103,800	2020/10/23
第93回共同発行市場公募地方債	1.25	100,000	105,547	2020/12/25
第94回共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	105,578	2021/1/25
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	105,868	2021/2/25
第97回共同発行市場公募地方債	1.38	356,000	379,446	2021/4/23
第98回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	105,691	2021/5/25
第102回共同発行市場公募地方債	1.03	150,000	157,926	2021/9/24
第108回共同発行市場公募地方債	1.01	100,000	105,662	2022/3/25
第109回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	105,980	2022/4/25
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	105,076	2022/5/25
第112回共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	104,942	2022/7/25
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	100,000	104,486	2022/12/22

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第119回共同発行市場公募地方債	0.8	200,000	210,286	2023/2/24
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	100,000	105,591	2023/8/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	104,686	2023/10/25
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	104,667	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	105,456	2024/1/25
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	314,373	2024/3/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	104,555	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	104,273	2024/8/23
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	103,846	2024/11/25
第142回共同発行市場公募地方債	0.406	200,000	206,220	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	208,806	2025/5/23
平成24年度第2回熊本県公債(10年)	0.8	200,000	209,782	2022/10/26
平成22年度第1回静岡市公債	1.008	100,000	104,339	2020/11/25
第3回大阪府市公債(20年)	2.08	200,000	251,538	2030/6/14
平成19年度第7回大阪市公債	1.82	100,000	102,337	2017/9/20
平成22年度第5回大阪市公債	1.2	100,000	104,913	2020/9/17
第5回名古屋市公債(30年)	2.49	100,000	142,484	2039/3/18
第9回名古屋市公債(20年)	2.07	100,000	123,750	2028/12/20
第11回名古屋市公債(30年)	1.774	100,000	131,913	2044/9/20
第481回名古屋市公債(10年)	0.744	100,000	104,571	2022/12/20
平成22年度第2回京都市公債	1.11	102,000	106,555	2020/8/27
平成23年度第4回京都市公債	1.067	100,000	105,643	2021/12/22
平成24年度第4回京都市公債	0.801	100,000	104,786	2022/10/21
平成24年度第5回京都市公債	0.854	100,000	105,313	2023/1/31
平成24年度第6回京都市公債	0.137	100,000	100,194	2018/3/28
第5回横浜市公債(20年)	2.17	100,000	119,169	2025/6/20
第20回横浜市公債(20年)	2.1	100,000	125,186	2029/10/19
平成21年度第1回横浜市公債	1.58	200,000	209,214	2019/5/24
平成21年度第5回横浜市公債	1.56	100,000	105,291	2019/11/19
平成23年度第5回横浜市公債	1.011	100,000	105,429	2022/1/28
平成24年度第10回札幌市公債(10年)	0.8	100,000	104,971	2022/12/20
平成25年度第2回札幌市公債(5年)	0.31	100,000	100,607	2018/6/20
平成26年度第9回札幌市公債(10年)	0.43	100,000	103,150	2024/12/20
第11回川崎市公債(20年)	1.84	100,000	123,199	2030/10/18
第81回川崎市公債	1.57	100,000	104,390	2019/3/20
第82回川崎市公債	1.52	100,000	104,959	2019/9/20
平成26年度第2回北九州市公債	0.451	100,000	103,333	2024/12/24
平成19年度第3回福岡市公債	1.87	100,000	102,595	2017/10/24
平成26年度第5回福岡市公債	0.539	200,000	208,194	2024/10/28
平成22年度第6回広島市公債	1.21	100,000	105,861	2021/5/31
平成25年度第3回広島市公債	0.67	150,000	157,227	2024/2/23
平成23年度第2回千葉市公債	1.06	200,000	211,232	2021/11/25
第113回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	125,315	2027/12/20
小計		16,892,990	18,387,743	
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	332,715	2021/5/21
第5回政府保証日本政策金融公庫債券	1.3	101,000	105,295	2019/9/17
第14回政府保証日本政策投資銀行債券	2.1	100,000	111,124	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	104,502	2023/3/15
第2回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	100,000	115,439	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	108,949	2021/2/26

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
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	218,200	2021/3/26
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	115,000	117,402	2017/6/20
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	300,000	308,001	2017/11/30
第47回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	102,352	2017/12/27
第54回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	30,000	30,759	2018/3/23
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	111,000	113,927	2018/4/20
第60回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	103,737	2018/6/29
第62回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	181,000	187,648	2018/7/31
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	156,212	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	251,150	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	314,190	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	145,105	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	140,475	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	105,258	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	104,193	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	208,540	2020/9/30
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	207,988	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	210,880	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	127,736	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	105,548	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	106,347	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	105,683	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	316,248	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	316,191	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	210,752	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	105,414	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	104,978	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	314,388	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	123,222	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	105,531	2023/1/31

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
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	316,398	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	209,010	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	207,406	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	312,600	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	212,424	2023/6/30
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	104,927	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	241,408	2034/3/31
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	105,076	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	104,781	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	104,407	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	103,863	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	307,926	2025/1/31
第1回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.6	202,000	209,631	2018/10/16
第1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	104,522	2019/6/14
第2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	100,000	104,330	2019/7/12
第18回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	101,000	105,010	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	105,409	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	107,228	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	107,377	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	105,062	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	105,442	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	103,693	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	104,175	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	105,942	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	210,026	2024/2/16
第5回政府保証首都高速道路株式会社債券	1.4	80,000	82,031	2018/3/26
第4回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.245	100,000	100,653	2019/6/20
第14回道路債券	1.91	100,000	112,343	2022/12/20
第17回道路債券	1.54	100,000	109,920	2022/12/20
第21回道路債券	2.75	100,000	139,310	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	125,674	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	159,452	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	126,507	2028/6/20
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.67	100,000	104,582	2019/3/20
第47回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	127,845	2029/4/20
第48回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.71	100,000	104,694	2019/3/20
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.38	100,000	104,462	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	105,579	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	318,156	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	122,792	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	104,688	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	106,882	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	105,125	2023/9/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第153回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	139,965	2055/3/19
第1回地方公営企業等金融機構債券	1.77	100,000	104,015	2018/9/25
第2回公営企業債券(20年)	1.45	100,000	109,331	2022/12/20
第3回公営企業債券(20年)	1.03	100,000	117,516	2023/3/22
第3回地方公共団体金融機構債券(15年)	1.176	100,000	111,979	2029/1/26
第7回公営企業債券(20年)	2.2	100,000	116,683	2024/3/22
第7回公営企業債券(30年)	2.67	100,000	140,701	2035/6/20
第8回公営企業債券(20年)	2.25	40,000	46,846	2024/3/22
第8回地方公共団体金融機構債券	1.453	100,000	105,191	2020/1/28
第10回地方公共団体金融機構債券	1.424	100,000	105,324	2020/3/27
第11回地方公共団体金融機構債券	1.465	100,000	105,585	2020/4/28
第15回地方公共団体金融機構債券	1.093	200,000	208,926	2020/8/28
第23回地方公共団体金融機構債券	1.418	100,000	106,792	2021/4/28
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	100,000	121,831	2032/9/28
第38回地方公共団体金融機構債券	0.835	500,000	524,915	2022/7/28
第42回地方公共団体金融機構債券	0.801	100,000	105,034	2022/11/28
第58回地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	105,330	2024/3/28
第65回地方公共団体金融機構債券	0.535	200,000	207,604	2024/10/28
第11回首都高速道路株式会社債	0.279	200,000	200,812	2017/12/20
第18回株式会社日本政策金融公社債	2.157	100,000	127,383	2031/5/9
第43回都市再生債券	1.29	100,000	105,348	2020/9/18
第5回本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	118,276	2024/12/20
第344回東京交通債券	1.67	100,000	110,665	2023/2/17
第346回東京交通債券	1.13	20,000	21,481	2023/6/20
第1回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.13	26,476	28,316	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.08	22,792	24,513	2037/11/10
第2回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.27	23,341	25,321	2037/11/10
第3回貸付債権担保宅金融公庫債券	2.1	100,000	105,788	2019/3/20
第4回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.29	27,832	30,061	2042/8/10
第4回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.03	24,992	26,890	2038/5/10
第5回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	1.76	19,935	21,050	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	2.26	41,818	45,011	2037/5/10
第6回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	1.94	24,467	26,131	2038/11/10
第8回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	2.15	21,945	23,611	2037/5/10
第8回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.09	25,933	27,687	2039/5/10
第9回貸付債権担保S種宅金融公庫債券	2.19	21,625	23,272	2037/5/10
第10回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.09	26,063	27,623	2039/11/10
第14回貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	1.7	31,268	32,626	2032/5/10
第23回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.25	36,784	40,111	2044/4/10
第24回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.34	38,099	41,673	2044/5/10
第25回貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.28	39,147	42,768	2044/6/10
第28回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.98	44,449	48,048	2044/9/10
第30回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.97	47,585	51,332	2044/11/10
第31回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.89	48,555	52,202	2044/12/10
第33回一般担保住宅金融支援機構債券	1.47	100,000	104,396	2019/6/20
第34回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.86	102,576	110,194	2045/3/10
第36回貸付債権担保宅金融公庫債券	1.88	26,312	27,895	2040/11/10
第36回貸付債権担保宅金融支援機構債券	1.81	56,528	60,462	2045/5/10
第39回貸付債権担保宅金融公庫債券	1.84	26,062	27,602	2041/2/10
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	1.5	100,000	105,189	2019/12/20
第42回貸付債権担保宅金融公庫債券	2.34	26,132	28,222	2041/5/10

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	66,485	71,425	2046/2/10
第46回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	24,222	26,128	2041/9/10
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	66,872	72,052	2046/3/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	64,286	69,415	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	26,959	29,199	2041/12/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	128,214	137,060	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	68,941	73,762	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	26,748	28,770	2042/4/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	77,443	82,283	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	76,026	80,789	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	76,428	81,284	2047/2/10
第58回一般担保住宅金融支援機構債券	1.04	100,000	104,274	2020/9/18
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	155,004	164,068	2047/5/10
第60回一般担保住宅金融支援機構債券	1.33	100,000	105,864	2020/12/18
第63回一般担保住宅金融支援機構債券	1.358	100,000	105,991	2020/12/18
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	162,448	170,563	2047/11/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	82,633	86,625	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	83,034	87,915	2048/1/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	83,580	88,639	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	81,265	85,860	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	81,343	85,201	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	84,401	89,644	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	189,216	2031/6/13
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	83,934	87,937	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	88,361	92,495	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	89,648	93,923	2049/6/10
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	90,911	94,920	2049/8/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	123,558	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	184,580	192,683	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	92,404	96,054	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	187,412	193,234	2050/1/10
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	94,821	98,206	2050/3/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	95,443	98,484	2050/5/10
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	95,655	99,316	2050/6/10
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	193,764	201,946	2050/8/10
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	96,949	100,828	2050/9/10
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	98,602	102,655	2051/1/10
第114回一般担保住宅金融支援機構債券	1.473	100,000	114,192	2027/9/17
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	137,286	2043/3/20
第12回農林漁業金融公庫債券	2.24	100,000	122,412	2027/3/19
第11回沖縄振興開発金融公庫債券	1.97	100,000	103,968	2018/6/20
第19回東日本高速道路株式会社債	0.33	100,000	100,486	2017/12/20
第10回東日本高速道路株式会社債	0.289	100,000	100,427	2017/12/20
第28回中日本高速道路株式会社債	0.782	100,000	101,383	2018/3/20
第33回中日本高速道路株式会社債	1.084	200,000	211,212	2021/9/17
第59回東日本高速道路株式会社債	0.309	100,000	101,576	2021/12/20
第53回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8	200,000	210,148	2022/12/20
小計		20,053,097	21,718,652	
金融債券				
い第750号商工債	0.3	100,000	100,419	2017/11/27
い第752号商工債	0.3	200,000	200,910	2018/1/26
い第756号商工債	0.3	100,000	100,506	2018/5/25
い第779号商工債	0.22	100,000	100,681	2020/4/27
い第748号農林債	0.35	100,000	100,438	2017/9/27

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
い第749号農林債	0.3	300,000	301,185	2017/10/27
い第752号農林債	0.3	200,000	200,910	2018/1/26
い第780号農林債	0.28	100,000	100,874	2020/5/27
第274回信中金債(5年)	0.3	100,000	100,372	2017/9/27
第290回信中金債(5年)	0.3	100,000	100,663	2019/1/25
第299回信中金債(5年)	0.2	100,000	100,525	2019/10/25
第300回信中金債(5年)	0.225	300,000	301,830	2019/11/27
第303回信中金債(5年)	0.25	100,000	100,765	2020/2/27
第309回信中金債(5年)	0.25	100,000	100,846	2020/8/27
第175号商工債(3年)	0.15	100,000	100,160	2017/8/25
第178号商工債(3年)	0.15	300,000	300,585	2017/11/27
第179号商工債(3年)	0.14	200,000	200,382	2017/12/27
小計		2,600,000	2,612,051	
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	124,881	2018/10/23
第459回東京電力株式会社社債	2.7	10,000	10,604	2019/1/29
第521回東京電力株式会社社債	1.97	100,000	100,124	2016/6/27
第528回東京電力株式会社社債	1.905	100,000	104,344	2019/6/13
第536回東京電力株式会社社債	1.672	100,000	102,184	2018/1/29
第542回東京電力株式会社社債	1.602	100,000	102,338	2018/4/25
第544回東京電力株式会社社債	1.976	100,000	103,313	2018/6/25
第554回東京電力株式会社社債	1.608	100,000	103,395	2019/5/29
第499回中部電力株式会社社債	1.194	100,000	106,962	2023/6/23
第503回中部電力株式会社社債	0.584	100,000	102,793	2025/3/25
第473回関西電力株式会社社債	1.665	100,000	104,313	2019/4/25
第496回関西電力株式会社社債	0.908	100,000	104,556	2025/2/25
第358回中国電力株式会社社債	1.702	100,000	103,919	2018/10/25
第385回中国電力株式会社社債	0.728	100,000	104,044	2015/7/25
第286回北陸電力株式会社社債	1.99	100,000	105,751	2019/6/25
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	106,858	2026/6/25
第466回東北電力株式会社社債	0.833	100,000	101,231	2018/2/23
第471回東北電力株式会社社債	1.168	126,000	134,496	2023/12/25
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	105,610	2023/6/23
第276回四国電力株式会社社債	0.592	100,000	100,730	2017/9/25
第279回四国電力株式会社社債	0.579	100,000	100,913	2018/2/23
第417回九州電力株式会社社債	0.641	100,000	100,693	2017/8/25
第420回九州電力株式会社社債	0.82	100,000	101,320	2018/4/25
第423回九州電力株式会社社債	0.959	100,000	102,639	2019/9/25
第426回九州電力株式会社社債	1.064	100,000	105,577	2024/2/23
第261回北海道電力株式会社社債	2.775	31,000	32,220	2017/11/24
第320回北海道電力株式会社社債	0.585	101,000	102,943	2021/12/24
第21回清水建設株式会社無担保社債	0.39	100,000	101,284	2021/12/3
第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.325	100,000	100,502	2017/12/20
第3回キリンホールディングス株式会社無担保社債	1.69	100,000	102,934	2018/3/19
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	105,233	2019/11/5
第10回日本たばこ産業株式会社社債	0.358	100,000	101,663	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	105,125	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	103,395	2024/7/29
第3回株式会社セブン&アールホールディングス無担保社債	1.94	100,000	103,895	2018/6/20
第12回日本製紙株式会社無担保社債	0.97	100,000	103,713	2024/6/19

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第4回住友化学株式会社無担保社債	0.623	100,000	101,134	2018/6/12
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	103,329	2020/6/4
第14回田島工業株式会社無担保社債	0.54	100,000	101,360	2019/7/19
第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,477	2017/12/4
第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	102,552	2024/10/23
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	102,776	2024/6/4
第5回東海ゴム工業無担保社債	0.288	100,000	100,389	2018/2/28
第13回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	100,000	100,406	2017/12/20
第22回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	0.703	100,000	101,734	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	101,541	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	100,781	2022/2/25
第9回株式会社小松製作所無担保社債	0.319	100,000	100,419	2017/12/19
第36回富士通株式会社無担保社債	0.562	200,000	203,044	2021/6/11
第11回パナソニック株式会社無担保社債	1.081	100,000	101,749	2018/3/20
第12回パナソニック株式会社無担保社債	0.387	100,000	100,992	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	203,112	2022/3/18
第24回三菱重工株式会社無担保社債	1.482	100,000	104,638	2019/12/9
第29回三菱重工株式会社無担保社債	0.662	100,000	103,001	2024/9/3
第37回川崎重工業株式会社無担保社債	0.572	100,000	100,994	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	101,507	2018/8/3
第1回B号明治安田生命2012基金特定目的会社特定社債	0.85	100,000	100,744	2017/8/9
第57回日産自動車株式会社無担保社債	0.314	100,000	100,598	2019/3/20
第12回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.317	100,000	100,378	2017/9/20
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	101,030	2020/3/12
第21回株式会社ニコン無担保社債	0.864	100,000	105,248	2024/3/14
第53回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.65	100,000	105,584	2020/3/12
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	103,460	2024/5/30
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	123,057	2033/3/4
第69回三菱商事株式会社無担保社債	1.99	100,000	103,812	2018/5/22
第74回三菱商事株式会社無担保社債	1.657	100,000	105,060	2019/7/29
第76回三菱商事株式会社無担保社債	1.303	100,000	105,940	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	102,947	2024/4/24
第32回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	0.27	200,000	200,776	2018/1/24
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	131,299	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	104,994	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	107,278	2021/6/9
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	103,182	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	106,954	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	106,437	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	103,590	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	106,510	2019/7/24

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
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	105,350	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	107,466	2020/8/7
第10回株式会社みずほ銀行無担保社債 (劣後特約付)	2.06	200,000	206,188	2018/1/26
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	100,940	2021/9/17
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	101,456	2021/3/18
第67回アコム株式会社無担保社債	0.5	100,000	100,719	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	105,929	2026/9/18
第138回オリックス株式会社無担保社債	1.69	100,000	102,017	2017/8/25
第167回オリックス株式会社無担保社債	0.508	100,000	100,640	2018/3/7
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	100,937	2020/2/25
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.853	100,000	101,302	2018/2/26
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	104,151	2020/2/26
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	100,885	2019/2/25
第31回三菱地所株式会社無担保社債	3.125	100,000	104,137	2017/9/26
第84回住友不動産株式会社無担保社債	0.388	100,000	100,529	2018/2/28
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	103,579	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	105,240	2021/9/17
第13回日本ビルファンド投資法人無担保社債	1.168	100,000	105,860	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	106,366	2026/6/17
第36回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.453	100,000	100,788	2018/6/12
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	106,491	2025/12/12
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	1.412	100,000	104,742	2019/12/9
第17回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.3	100,000	110,540	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	113,227	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	104,176	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	252,928	2028/12/12
第81回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.598	100,000	100,890	2017/12/22
第9回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.28	19,000	21,458	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	125,739	2028/3/17
第7回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.2	20,000	22,542	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	105,993	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	137,589	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	132,043	2044/10/28
第9回東京地下鉄株式会社無担保社債	0.442	100,000	105,241	2020/3/19
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	1.69	200,000	208,610	2023/3/20
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	104,835	2023/12/20
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	0.73	100,000	104,832	2023/9/20
第30回電源開発株式会社無担保社債	1.394	100,000	105,120	2020/5/20
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	105,395	2023/12/20
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	2.9	100,000	104,750	2018/1/30
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	106,052	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	102,174	2022/12/16

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第2回ノルデアバンク・アクツイエボラグ・プブリクト円貨社債	1.2	100,000	101,093	2017/6/15
第11回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.437	100,000	100,454	2020/12/11
第4回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンAB円貨社債	0.325	100,000	100,678	2019/9/4
第6回スヴェンスカ・ハンデルスパンケンAB円貨社債	0.292	100,000	100,231	2020/9/3
第9回モルガン・スタンレー円貨社債	0.557	100,000	100,586	2018/5/22
第6回ビー・エス・ビー・バリバ円貨社債	0.439	100,000	100,558	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	101,026	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	100,698	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	100,804	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	100,961	2020/7/24
第27回ラボバンク・ネーランド円貨社債	0.38	200,000	201,928	2020/5/22
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	98,522	2023/6/2
小 計		13,527,000	14,128,695	
合 計		283,203,087	317,593,613	

＜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 10年国債標準物	760	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 317,593,613	% 98.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,611,210	1.1
投 資 信 託 財 産 総 額	321,204,823	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 2016年5月30日現在
(A) 資 産	321,309,772,089円
コール・ローン等	2,707,181,235
公社債(評価額)	317,593,613,451
未 収 利 息	889,395,166
前 払 費 用	14,633,237
差入委託証拠金	104,949,000
(B) 負 債	1,659,041,090
未 払 金	1,500,981,120
未 払 解 約 金	52,960,197
未 払 利 息	6,714
差入委託証拠金代用有価証券	104,949,000
その他未払費用	144,059
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	319,650,730,999
元 本	226,592,497,472
次 期 繰 越 損 益 金	93,058,233,527
(D) 受 益 権 総 口 数	226,592,497,472口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,107円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年5月30日 至 2016年5月30日
(A) 配 当 等 収 益	3,429,137,187円
受 取 利 息	3,429,385,563
支 払 利 息	△248,376
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	18,375,400,295
売 買 益	18,877,288,316
売 買 損	△501,888,021
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	27,050,388
取 引 益	50,875,776
取 引 損	△23,825,388
(D) そ の 他 費 用	△144,059
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	21,831,443,811
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	77,854,747,071
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	16,665,450,997
(H) 解 約 差 損 益 金	△23,293,408,352
(I) 計 (E+F+G+H)	93,058,233,527
次 期 繰 越 損 益 金(I)	93,058,233,527

(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242,124,189,619円、期中追加設定元本額は47,493,545,266円、期中一部解約元本額は63,025,237,413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 106,555,000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	63,402,052,606円
DC日本債券インデックス・オープンP	27,014,329,554円
国内債券SMTBセレクション (SMA専用)	16,472,702,807円
DCマイセレクション50	16,063,713,327円
DCマイセレクション25	14,121,936,865円
日本債券ファンド・シリーズ1	11,376,633,584円
SMT 国内債券インデックス・オープン	7,873,421,503円
バランスA (25) VA1 (適格機関投資家専用)	7,132,957,692円
DCマイセレクションS50	6,243,041,228円
DCマイセレクションS25	5,688,379,379円
バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)	4,933,060,320円

DCマイセレクション75	4,436,822,519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)	4,304,752,312円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	4,106,303,391円
コア投資戦略ファンド(安定型)	3,751,117,456円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	2,857,552,493円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,768,551,569円
コア投資戦略ファンド(成長型)	2,528,307,003円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,989,153,158円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,850,694,165円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	1,824,468,170円
グローバルバランスファンドVA35(適格機関投資家専用)	1,580,141,003円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	1,346,461,291円
DCターゲット・イヤー ファンド2025	1,238,877,798円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	1,170,297,429円
DCマイセレクションS75	1,168,831,033円
分散投資コア戦略ファンドA	1,069,229,249円
日本債券インデックス・オープン(SMA専用)	1,044,228,831円
コア投資戦略ファンド(切替型)	811,006,764円
DCターゲット・イヤー ファンド2035	726,850,571円
DC世界経済インデックスファンド	713,632,790円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンド [®] S(適格機関投資家専用)	713,387,447円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	708,471,028円
世界経済インデックスファンド	591,952,932円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	493,734,884円
分散投資コア戦略ファンドS	464,147,189円
DC日本債券インデックス・オープン	422,133,707円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	257,763,388円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	256,808,168円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	204,302,431円
DCターゲット・イヤー ファンド2045	191,958,236円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	144,264,006円
マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)	128,450,493円
SMT インデックスバランス・オープン	74,624,813円
マイセレクション25	71,578,191円
マイセレクション50	70,346,438円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	55,477,743円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	32,995,858円
SBI資産設計オープン(分配型)	24,329,469円
マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)	21,746,981円
マイセレクション75	20,315,766円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	18,488,628円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	12,251,462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)	857,124円
債券コア戦略ファンド	375,990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1期(2016年2月17日～2016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 (分配落)	標準価額		ベンチマーク		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額 総
		税込み 分配	み金 騰落	騰落率	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

* 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	株 式	投 資 信 託
		騰 落 率	騰 落 率	組 入 比 率	先 物 比 率	証 券 組 入 比 率		
第 1 期	(設定日)	円	%			%	%	%
	2016年 2月17日	10,000	—	100.00	—	—	—	—
	2月末	10,192	1.9	101.95	1.9	95.4	1.8	2.6
	3月末	10,780	7.8	107.99	8.0	94.8	2.5	2.7
	4月末	10,730	7.3	107.39	7.4	95.4	1.8	2.7
	5月末	10,847	8.5	108.64	8.6	95.0	2.2	2.7
	6月末	9,810	△1.9	98.32	△1.7	94.9	2.2	2.9
	(期 末) 2016年 7月 7日	9,675	△3.3	96.89	△3.1	94.9	2.1	2.9

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

* 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、設定時10,000円から期末9,675円（分配金込み）に325円の値下がりとなりました。

原油など商品価格の上昇や、米国の年利上げペースの減速が示唆されたことなどを背景に主要投資国の株式市場は上昇しましたが、米ドルなどの投資国通貨が対円で下落（円高）したため、基準価額は下落しました。

【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、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、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】

収益分配金は、配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案し、1万口当たり75円とさせていただきます。

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。

【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

(2016年2月17日～2016年7月7日)

項 目	第 1 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	7	0.067	(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 ）	(6)	(0.054)	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 ）	(0)	(0.004)	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)	(0.008)	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)	(0.000)	
（ 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	△1	△0.008	(d) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(0)	(0.004)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(△1)	(△0.014)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	6	0.063	
作成期間の平均基準価額は、10,471円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2016年2月17日～2016年7月7日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	第1期			
	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千口 1,391,905	千円 2,679,549	千口 122,869	千円 237,204

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2016年2月17日～2016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1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	17,821,965千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	299,364,473千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.05

*(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2月17日～2016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）>

区分	第1期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
預金	百万円 10	百万円 10	% 100.0	百万円 10	百万円 10	% 100.0

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

区分	第1期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 17,607	百万円 2,702	% 15.3	百万円 9,773	百万円 470	% 4.8
預金	11,745	11,745	100.0	11,916	11,916	100.0

平均保有割合 0.6%

※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

(2016年2月17日～2016年7月7日)

設定時残高 (元本)	設定元本	解約元本	第1期末残高 (元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2016年7月7日現在)

親投資信託残高

銘柄	第1期末	
	口数	評価額
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千口 1,269,035	千円 2,295,431

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年7月7日現在)

項目	第1期末	
	評価額	比率
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	千円 2,295,431	% 99.2
コール・ローン等、その他	19,204	0.8
投資信託財産総額	2,314,635	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1期末における外貨建て純資産(294,704,924千円)の投資信託財産総額(296,856,675千円)に対する比率は99.3%です。

*外貨建て資産は、第1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=100.98円、1カナダドル=77.90円、1英ポンド=130.50円、1スイスフラン=103.55円、1スウェーデンクローナ=11.83円、1ノルウェークローネ=11.96円、1デンマーククローネ=15.04円、1ユーロ=111.95円、1香港ドル=13.02円、1シンガポールドル=74.82円、1豪ドル=75.95円、1ニュージーランドドル=72.08円、1新シッケル=26.03円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第1期末	
	2016年7月7日現在	
	円	
(A) 資産	2,314,635,811	
コール・ローン等	19,193,194	
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額)	2,295,431,908	
未収入金	10,709	
(B) 負債	18,972,642	
未払収益分配金	17,935,466	
未払信託報酬	1,018,097	
未払利息	29	
その他未払費用	19,050	
(C) 純資産総額(A-B)	2,295,663,169	
元本	2,391,395,530	
次期繰越損益金	△ 95,732,361	
(D) 受益権総口数	2,391,395,530口	
1万口当たり基準価額(C/D)	9,600円	

(注) 第1期首元本額は1,000,000円、第1期中追加設定元本額は2,696,602,503円、第1期中一部解約元本額は306,206,973円、1口当たり純資産額は、第1期0.9600円です。

○損益の状況

項 目	第1期	
	2016年2月17日～ 2016年7月7日	
	円	
(A) 配当等収益	△	498
支払利息	△	498
(B) 有価証券売買損益	△147,033,593	
売買益	7,280,307	
売買損	△154,313,900	
(C) 信託報酬等	△	1,037,147
(D) 当期損益金(A+B+C)	△148,071,238	
(E) 追加信託差損益金	70,274,343	
(配当等相当額)	(△	187)
(売買損益相当額)	(70,274,530)
(F) 計(D+E)	△	77,796,895
(G) 収益分配金	△	17,935,466
次期繰越損益金(F+G)	△	95,732,361
追加信託差損益金	70,274,343	
(配当等相当額)	(6,699,019)
(売買損益相当額)	(63,575,324)
分配準備積立金	1,344,631	
繰越損益金	△	167,351,335

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

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

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

○お知らせ

該当事項はございません。

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

第14期(計算期間：2015年4月1日～2016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、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22,274円から期末20,145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9.2%の下落となったのに対して、基準価額は9.6%の下落となりました。

【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

(2015年4月1日～2016年3月31日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式) (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 1 (0) (0) (0)	% 0.003 (0.002) (0.000) (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (株 式) (投 資 信 託 証 券)	2 (2) (0)	0.009 (0.008) (0.000)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	3 (3) (1)	0.015 (0.012) (0.003)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	6	0.027	
期中の平均基準価額は、21,704円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年4月1日～2016年3月31日)

株式

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

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

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

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

投資信託証券

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

銘	柄	買 付		売 付		
		口 数	金 額	口 数	金 額	
アメリカ		口	千米ドル	口	千米ドル	
	WEYERHAEUSER CO	4,300 (27,200)	111 (738)	1,400	45	
小	計	173,746 (129,283)	9,490 (1,945)	49,431 (98,000)	1,958 (1,536)	
カナダ			千カナダドル		千カナダドル	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	3,100	63	—	—	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	2,000	59	—	—	
	SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	6,900	219	—	—	
小	計	12,000	341	—	—	
イギリス			千英ポンド		千英ポンド	
	BRITISH LAND	10,000	77	—	—	
	HAMMERSON PLC	6,000	37	—	—	
	INTU PROPERTIES PLC	11,000	35	—	—	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	12,800	151	3,300	44	
	SEGro PLC	17,000	72	7,000	29	
小	計	56,800	373	10,300	74	
ユーロ			千ユーロ		千ユーロ	
	フランス					
	KLEPIERRE	8,000	328	1,300	52	
	GECINA SA	930	109	—	—	
	FONCIERE DES REGIONS	600	46	(—)	(3)	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	1,580	367	460	112	
小	計	11,110	852	1,760 (—)	165 (3)	
ユ	ロ	計	11,110	852	1,760 (—)	165 (3)
香港			千香港ドル		千香港ドル	
	LINK REIT	19,000	808	—	—	
	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	260,000	1,584	—	—	
小	計	279,000	2,392	—	—	
シンガポール			千シンガポールドル		千シンガポールドル	
	CAPITALAND MALL TRUST	30,000	63	—	—	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	26,000 (—)	61 (0.47038)	(—)	(0.62559)	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV-RTS	— (7,012)	— (0.47038)	(7,012)	(0.47038)	
	SUNTEC REIT	40,000	60	(—)	(1)	
小	計	96,000 (7,012)	185 (0.94076)	(7,012)	— (2)	
オーストラリア			千豪ドル		千豪ドル	
	MIRVAC GROUP	40,000	69	26,000	52	
	GPT GROUP	31,000	145	—	—	
	LENLEASE GROUP	5,000	65	—	—	
	STOCKLAND TRUST GROUP	33,000	135	—	—	
	DEXUS PROPERTY GROUP	17,000	130	—	—	
	GOODMAN GROUP	24,000	147	—	—	
	FEDERATION CENTRES	23,000 (151,504)	68 (467)	(306,704)	(943)	
	SCENTRE GROUP	100,000	400	39,000	154	
	WESTFIELD CORP	21,600	212	—	—	

銘柄	買付		売付		
	口数	金額	口数	金額	
外国	オーストラリア	口	千豪ドル	口	千豪ドル
	NOVION PROPERTY GROUP	—	—	(184,200)	(467)
	VICINITY CENTRES	22,000 (306,704)	69 (943)	—	—
小計	316,600 (458,208)	1,445 (1,411)	65,000 (490,904)	206 (1,411)	

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。ただし、数値が単位未満の場合は小数で記載。

*（ ）内は分割、合併、有償増資などによる増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
外国 株式先物取引	百万円 61,434	百万円 59,941	百万円 —	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

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

○株式売買比率

(2015年4月1日～2016年3月31日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	63,845,739千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	313,772,382千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年4月1日～2016年3月31日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 55,778	百万円 6,339	% 11.4	百万円 29,471	百万円 3,978	% 13.5
預金	9,673	9,673	100.0	8,694	8,694	100.0

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

○組入資産の明細

(2016年3月31日現在)

外国株式

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
ANTHEM INC	236	252	3,534	398,238	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
APACHE CORPORATION	321	369	1,794	202,239	石油・ガス・消耗燃料
APPLE INC	5,102	5,382	58,965	6,644,197	コンピュータ・周辺機器
APPLIED MATERIALS	1,058	1,145	2,409	271,455	半導体・半導体製造装置
ARAMARK	—	216	712	80,269	ホテル・レストラン・レジャー
ARCHER DANIELS MIDLAND	565	582	2,131	240,153	食品
ARROW ELECTRS INC	83	93	592	66,815	電子装置・機器・部品
ASHLAND INC	55	59	652	73,568	化学
ASSURANT INC	62	62	485	54,743	保険
ATMOS ENERGY CORP	—	97	718	80,936	ガス
AUTODESK INC.	196	220	1,273	143,531	ソフトウェア
AUTOLIV INC	81	85	1,007	113,573	自動車部品
AUTOMATIC DATA PROCESS	422	444	3,958	446,016	情報技術サービス
AUTONATION INC	62	71	340	38,377	専門小売り
AUTOZONE	27	29	2,359	265,858	専門小売り
AVERY DENNISON CORP	83	91	658	74,238	容器・包装
AVNET	118	122	539	60,816	電子装置・機器・部品
AVON PRODUCTS INC	378	—	—	—	パーソナル用品
BB&T CORPORATION	622	759	2,544	286,762	銀行
BAKER HUGHES	380	424	1,838	207,205	エネルギー設備・サービス
BALL CORP	109	124	879	99,063	容器・包装
BANK OF AMERICA CORP	9,160	10,030	13,520	1,523,483	銀行
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	984	1,060	3,936	443,603	資本市場
BARD (C R)	65	70	1,426	160,709	ヘルスケア機器・用品
BAXALTA INC	—	657	2,637	297,233	バイオテクノロジー
BAXTER INTERNATIONAL INC.	472	529	2,182	245,941	ヘルスケア機器・用品
B/E AEROSPACE INC	90	101	470	52,999	航空宇宙・防衛
BECTON, DICKINSON	179	204	3,113	350,811	ヘルスケア機器・用品
BED BATH & BEYOND	157	156	773	87,169	専門小売り
WR BERKLEY CORP	98	99	555	62,637	保険
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	1,006	1,146	16,325	1,839,604	各種金融サービス
BEST BUY COMPANY INC	264	305	962	108,497	専門小売り
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	136	153	1,194	134,644	バイオテクノロジー
BIOGEN INC	205	215	5,469	616,354	バイオテクノロジー
BLACKROCK INC	114	119	4,062	457,740	資本市場
H & R BLOCK INC	234	224	591	66,659	各種消費者サービス
BOEING CO	590	614	7,894	889,587	航空宇宙・防衛
BORGWARNER INC	195	213	807	91,011	自動車部品
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,147	1,306	2,457	276,955	ヘルスケア機器・用品
BRISTOL MYERS SQUIBB	1,446	1,608	10,201	1,149,465	医薬品
BROADCOM CORP-CL A	469	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BROWN-FORMAN CORP-CL B	107	110	1,083	122,125	飲料
CBS CORP-CL B	421	414	2,260	254,753	メディア
CBRE GROUP INC	260	296	849	95,690	不動産管理・開発
CDK GLOBAL INC	—	128	597	67,370	ソフトウェア
CDW CORPORATION	—	141	585	65,950	電子装置・機器・部品
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	43	229	732	82,520	化学
C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC	128	137	1,021	115,084	航空貨物・物流サービス
CIGNA CORP	229	249	3,425	385,985	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CIT GROUP INC	164	166	531	59,911	銀行
CME GROUP INC	276	312	2,981	335,987	各種金融サービス
CMS ENERGY CORP	237	273	1,152	129,875	総合公益事業
CSX CORP	872	932	2,451	276,196	陸運・鉄道
CVS HEALTH CORP	999	1,067	11,102	1,250,988	食品・生活必需品小売り

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
CREE INC	107	—	—	—	半導体・半導体製造装置
CROWN HOLDINGS INC	121	133	659	74,332	容器・包装
CUMMINS INC	148	161	1,759	198,304	機械
DR HORTON INC	281	317	956	107,765	家庭用耐久財
DTE ENERGY COMPANY	151	170	1,542	173,779	総合公益事業
DANAHER CORP	549	595	5,654	637,124	コングロマリット
DARDEN RESTAURANTS INC	113	109	725	81,774	ホテル・レストラン・レジャー
DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC	149	160	1,168	131,664	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
DEERE & COMPANY	297	303	2,427	273,546	機械
DELTA AIR LINES INC	179	191	942	106,167	旅客航空輸送業
DENTSPLY INTERNATIONAL INC	124	—	—	—	ヘルスケア機器・用品
DENTSPLY SIRONA INC	—	229	1,421	160,137	ヘルスケア機器・用品
DEVON ENERGY CORP	337	434	1,137	128,126	石油・ガス・消耗燃料
DIAMOND OFFSHORE DRILLING	65	—	—	—	エネルギー設備・サービス
DICK S SPORTING GOODS INC	88	83	390	43,947	専門小売り
DISNEY (WALT) CO	1,403	1,513	14,965	1,686,265	メディア
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	398	417	2,095	236,159	消費者金融
DISCOVERY COMMUNICATIONS INC	125	143	401	45,262	メディア
DISCOVERY COMMUNICATIONS-C	228	265	705	79,547	メディア
DISH NETWORK CORP-A	189	220	1,042	117,428	メディア
DIRECTV	413	—	—	—	メディア
DOLLAR GENERAL CORP	266	281	2,420	272,745	複合小売り
DOLLAR TREE INC	179	213	1,772	199,686	複合小売り
DOMINION RESOURCES INC/VA	504	572	4,275	481,785	総合公益事業
DOVER CORP	145	153	984	110,905	機械
DOW CHEM CO	1,029	1,080	5,559	626,482	化学
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	166	181	1,627	183,433	飲料
DU PONT E I DE NEMOURS	791	846	5,428	611,715	化学
DUKE ENERGY CORP	618	661	5,311	598,458	電力
DUN & BRADSTREET CORP	31	36	372	41,992	専門サービス
EMC CORP	1,777	1,873	5,000	563,502	コンピュータ・周辺機器
EOG RESOURCES INC	474	532	3,918	441,560	石油・ガス・消耗燃料
EQT CORP	134	150	994	112,110	石油・ガス・消耗燃料
E*TRADE FINANCIAL CORP	—	291	717	80,859	資本市場
EASTMAN CHEMICAL CO.	125	142	1,040	117,236	化学
EATON VANCE CORP	100	117	389	43,914	資本市場
EBAY INC	976	1,041	2,502	281,988	インターネットソフトウェア・サービス
ECOLAB INC	236	256	2,877	324,287	化学
EDGEWELL PERSONAL CARE CO	—	61	493	55,592	パーソナル用品
EDISON INTERNATIONAL	269	318	2,276	256,558	電力
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	92	211	1,875	211,340	ヘルスケア機器・用品
ELECTRONIC ARTS	264	296	1,965	221,499	ソフトウェア
EMERSON ELEC	607	634	3,459	389,771	電気設備
ENERGEN CORP	60	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
ENERGIZER HOLDINGS INC	55	—	—	—	家庭用品
ENTERGY CORP	159	174	1,378	155,340	電力
ENVISSION HEALTHCARE HOLDINGS	—	188	384	43,363	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EQUIFAX INC	106	113	1,287	145,027	専門サービス
EVERSOURCE ENERGY	278	309	1,804	203,303	電力
EXELON CORPORATION	745	894	3,167	356,907	電力
EXPEDIA INC	899	117	1,261	142,118	インターネット販売・カタログ販売
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	173	183	891	100,442	航空貨物・物流サービス
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	641	650	4,488	505,736	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
EXXON MOBIL CORP	3,685	4,020	33,977	3,828,532	石油・ガス・消耗燃料

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
FLIR SYSTEMS INC	126	126	425	47,959	電子装置・機器・部品
FMC CORP	118	132	544	61,398	化学
FMC TECHNOLOGIES INC	210	225	609	68,681	エネルギー設備・サービス
FACEBOOK INC-A	1,743	2,193	25,153	2,834,320	インターネットソフトウェア・サービス
FAMILY DOLLAR STORES	90	—	—	—	複合小売り
FASTENAL CO	247	262	1,281	144,451	商社・流通業
FEDEX CORPORATION	233	259	4,192	472,438	航空貨物・物流サービス
F5 NETWORKS INC	65	70	738	83,190	通信機器
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	241	269	1,699	191,504	情報技術サービス
FNF GROUP	211	244	829	93,424	保険
FIFTH THIRD BANCORP	699	767	1,293	145,799	銀行
FIREEYE INC	70	—	—	—	ソフトウェア
FIRST REPUBLIC BANK/CA	114	137	918	103,459	銀行
FISERV INC	214	219	2,235	251,901	情報技術サービス
FIRSTENERGY CORP	366	403	1,442	162,522	電力
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	66	74	1,093	123,207	情報技術サービス
FLUOR CORP	138	139	755	85,141	建設・土木
FLOWSERVE CORP	123	123	541	61,037	機械
FOOT LOCKER INC	123	134	880	99,261	専門小売り
FORD MOTOR COMPANY	3,135	3,580	4,779	538,531	自動車
FORTINET INC	—	139	408	46,047	ソフトウェア
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	—	158	881	99,343	建設関連製品
FOSSIL GROUP INC	41	—	—	—	繊維・アパレル・贅沢品
FRANKLIN RESOURCES INC	352	378	1,479	166,709	資本市場
FREEPORT-MCMORAN INC	885	1,100	1,131	127,542	金属・鉱業
FRONTIER COMMUNICATIONS CO	830	1,140	641	72,320	各種電気通信サービス
ARTHUR J GALLAGHER & CO	—	168	745	83,993	保険
GAMESTOP CORP-CLASS A	100	100	317	35,787	専門小売り
GAP INC	212	229	679	76,533	専門小売り
GARTNER INC	—	81	715	80,592	情報技術サービス
GENERAL DYNAMICS	246	257	3,389	381,919	航空宇宙・防衛
GENERAL ELEC CO	8,742	9,115	29,013	3,269,189	コングロマリット
GENERAL MILLS	529	578	3,659	412,331	食品
GENERAL MOTORS CO	1,111	1,367	4,236	477,350	自動車
GENUINE PARTS CO	129	148	1,466	165,298	販売
GENWORTH FINANCIAL INC-CL A	413	—	—	—	保険
GILEAD SCIENCES INC	1,314	1,388	12,765	1,438,409	バイオテクノロジー
GLOBAL PAYMENTS INC	—	124	778	87,718	情報技術サービス
GOLDMAN SACHS GROUP	342	370	5,799	653,531	資本市場
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	—	252	825	93,051	自動車部品
GOOGLE INC-CL A	248	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス
GOOGLE INC-CL C	251	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス
WR GRACE & CO	—	67	479	54,039	化学
GRAINGER(W.W.) INC	53	54	1,279	144,183	商社・流通業
HCA HOLDINGS INC	262	313	2,444	275,449	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HP INC	—	1,740	2,140	241,157	コンピュータ・周辺機器
HALLIBURTON CO	734	832	2,996	337,686	エネルギー設備・サービス
HANESBRANDS INC	340	377	1,073	120,984	繊維・アパレル・贅沢品
HARLEY-DAVIDSON INC	181	188	930	104,817	自動車
HARMAN INTERNATIONAL	—	70	609	68,630	家庭用耐久財
HARRIS CORP	92	119	936	105,541	通信機器
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	367	394	1,824	205,597	保険
HASBRO INC	94	108	848	95,590	レジャー用品
HELMERICH & PAYNE	91	106	618	69,645	エネルギー設備・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
HERSHEY CO/THE	133	143	1,313	148,000	食品
HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC	387	346	354	39,922	陸運・鉄道
HESS CORP	229	275	1,401	157,940	石油・ガス・消耗燃料
HEWLETT PACKARD CO	1,630	—	—	—	コンピュータ・周辺機器
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	—	1,752	3,134	353,176	コンピュータ・周辺機器
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	343	486	1,104	124,475	ホテル・レストラン・レジャー
HOLLYFRONTIER CORP	166	166	570	64,326	石油・ガス・消耗燃料
HOLOGIC INC	199	231	796	89,800	ヘルスケア機器・用品
HOME DEPOT	1,148	1,225	16,343	1,841,636	専門小売り
HONEYWELL INTERNATIONAL	649	706	7,919	892,335	航空宇宙・防衛
HORMEL FOODS CORP	121	276	1,213	136,683	食品
HOSPIRA INC	148	—	—	—	医薬品
HUDSON CITY BANCORP INC	390	—	—	—	貯蓄・抵当・不動産金融
HUMANA INC	134	143	2,656	299,376	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	80	87	732	82,483	陸運・鉄道
HUNTINGTON BANCSHARES INC	700	750	719	81,045	銀行
IMS HEALTH HOLDINGS INC	—	163	424	47,808	ヘルスケア・テクノロジー
IHS INC-CLASS A	57	66	815	91,867	専門サービス
ILLINOIS TOOL WORKS INC	325	317	3,253	366,589	機械
ILLUMINA INC	122	142	2,246	253,138	ライフサイエンス・ツール/サービス
INCYTE CORP	130	160	1,093	123,226	バイオテクノロジー
INTEL CORP	4,212	4,561	14,919	1,681,076	半導体・半導体製造装置
INTEGRYS ENERGY GROUP INC	70	—	—	—	総合公益事業
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	98	114	2,670	300,884	各種金融サービス
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	819	888	13,178	1,484,988	情報技術サービス
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	68	77	882	99,413	化学
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	343	376	1,541	173,707	容器・包装
INTERPUBLIC GROUP	369	392	896	101,062	メディア
INTUIT INC	233	241	2,486	280,194	ソフトウエア
INTUITIVE SURGICAL INC	31	35	2,129	239,994	ヘルスケア機器・用品
IONIS PHARMACEUTICALS INC	—	121	467	52,669	バイオテクノロジー
ISIS PHARMACEUTICALS INC	99	—	—	—	バイオテクノロジー
JPMORGAN CHASE & CO	3,255	3,556	21,232	2,392,520	銀行
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	120	123	538	60,663	建設・土木
JARDEN CORP	156	200	1,177	132,646	家庭用耐久財
JOHNSON & JOHNSON	2,437	2,672	29,119	3,281,180	医薬品
JOHNSON CONTROLS INC	584	619	2,406	271,183	自動車部品
JONES LANG LASALLE INC	—	42	487	54,881	不動産管理・開発
JOY GLOBAL INC	91	—	—	—	機械
JUNIPER NETWORKS INC	327	335	854	96,294	通信機器
KLA TENCOR CORP	142	150	1,088	122,640	半導体・半導体製造装置
KANSAS CITY SOUTHERN	97	108	926	104,413	陸運・鉄道
KELLOGG CO	235	257	1,974	222,490	食品
KEURIG GREEN MOUNTAIN INC	106	—	—	—	食品
KEYCORP	765	810	903	101,766	銀行
KIMBERLY-CLARK CORP	324	351	4,763	536,742	家庭用品
KINDER MORGAN INC	1,571	1,836	3,279	369,488	石油・ガス・消耗燃料
KOHL'S CORP	173	191	879	99,108	複合小売り
KRAFT HEINZ CO/THE	—	586	4,623	520,980	食品
KRAFT FOODS GROUP INC	516	—	—	—	食品
KROGER CO	403	890	3,390	381,986	食品・生活必需品小売り
L BRANDS, INC	212	240	2,120	238,980	専門小売り
LKQ CORP	263	300	933	105,198	販売
L-3 COMMUNICATIONS HLDGS	75	77	924	104,124	航空宇宙・防衛

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	87	99	1,166	131,465	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
LAM RESEARCH	140	154	1,265	142,622	半導体・半導体製造装置
LAS VEGAS SANDS CORP	342	379	1,979	223,051	ホテル・レストラン・レジャー
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	204	216	2,039	229,807	パーソナル用品
LEAR CORP	—	74	826	93,097	自動車部品
LEGGETT & PLATT INC	123	134	642	72,400	家庭用耐久財
LEGG MASON INC	92	92	318	35,899	資本市場
LENNAR CORP-A	156	168	803	90,505	家庭用耐久財
LEUCADIA NATIONAL CORP	272	322	512	57,798	各種金融サービス
LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC	248	290	1,532	172,666	各種電気通信サービス
LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A	378	436	1,099	123,852	インターネット販売・カタログ販売
LIBERTY MEDIA CORP-A	81	81	315	35,562	メディア
LIBERTY MEDIA CORP-C	179	193	729	82,226	メディア
ELI LILLY & CO.	875	965	6,926	780,508	医薬品
LINCOLN NATIONAL CORP	223	239	955	107,641	保険
LINEAR TECHNOLOGY CORP	213	225	1,007	113,530	半導体・半導体製造装置
LINKEDIN CORP - A	95	113	1,286	144,937	インターネットソフトウェア・サービス
LOCKHEED MARTIN	234	267	5,973	673,048	航空宇宙・防衛
LOEWS CORP	295	269	1,036	116,848	保険
LORILLARD INC	315	—	—	—	タバコ
LOWES COS INC	861	885	6,727	758,085	専門小売り
LULULEMON ATHLETICA INC	98	106	718	80,980	繊維・アパレル・贅沢品
M & T BANK CORP	102	141	1,578	177,896	銀行
MDU RESOURCES GROUP INC	151	—	—	—	総合公益事業
MGM RESORTS INTERNATIONAL	336	423	900	101,475	ホテル・レストラン・レジャー
MSCI INC	—	93	680	76,655	各種金融サービス
MACYS INC	295	304	1,340	151,063	複合小売り
MANPOWERGROUP INC	70	70	566	63,858	専門サービス
MARATHON OIL CORP	593	794	836	94,209	石油・ガス・消耗燃料
MARATHON PETROLEUM CORP	246	508	1,858	209,389	石油・ガス・消耗燃料
MARKEL CORP	—	13	1,209	136,306	保険
MARSH & MCLENNAN COS	472	501	3,043	342,893	保険
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	193	199	1,423	160,438	ホテル・レストラン・レジャー
MARTIN MARIETTA MATERIALS	51	55	851	95,954	建設資材
MASCO CORP	310	329	1,039	117,146	建設関連製品
MASTERCARD INC-CLASS A	873	955	8,958	1,009,483	情報技術サービス
MATTEL INC	301	334	1,121	126,416	レジャー用品
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	239	271	990	111,579	半導体・半導体製造装置
MCCORMICK & CO INC.	101	113	1,127	127,010	食品
MCDONALD'S CORP	849	885	11,135	1,254,799	ホテル・レストラン・レジャー
MCGRAW HILL FINANCIAL INC	237	258	2,552	287,632	各種金融サービス
MCKESSON CORP	202	221	3,492	393,494	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MEAD JOHNSON NUTRITION CO	173	192	1,631	183,872	食品
MEADWESTVACO CORP	140	—	—	—	容器・包装
MEDIVATION INC	66	154	575	64,881	バイオテクノロジー
MEDNAX INC	—	91	594	66,998	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
MELCO CROWN ENTERTAINMENT-ADR	—	104	176	19,863	ホテル・レストラン・レジャー
MERCK & CO INC	2,483	2,691	14,321	1,613,746	医薬品
METLIFE INC	838	914	4,088	460,672	保険
METTLER-TOLEDO INTL	25	27	926	104,425	ライフサイエンス・ツール/サービス
MICROSOFT CORP	6,816	7,327	40,335	4,544,963	ソフトウェア
MICROCHIP TECHNOLOGY	178	198	967	108,965	半導体・半導体製造装置
MICRON TECHNOLOGY	924	1,031	1,080	121,749	半導体・半導体製造装置
MOHAWK INDUSTRIES	54	60	1,150	129,643	家庭用耐久財

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
MOLSON COORS BREWING CO-B	135	180	1,729	194,853	飲料
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	1,467	1,533	6,202	698,899	食品
MONSANTO CO	423	427	3,889	438,273	化学
MONSTER BEVERAGE CORP	122	—	—	—	飲料
MONSTER BEVERAGE CORP	—	137	1,852	208,703	飲料
MOODYS CORP	165	169	1,620	182,545	各種金融サービス
MORGAN STANLEY	1,283	1,397	3,502	394,636	資本市場
MOSAIC CO/THE	281	313	880	99,175	化学
MOTOROLA SOLUTIONS INC	197	151	1,130	127,422	通信機器
MURPHY OIL CORP	150	150	366	41,274	石油・ガス・消耗燃料
NRG ENERGY INC	294	294	380	42,867	独立系発電事業者・エネルギー販売業者
NASDAQ INC	101	111	723	81,511	各種金融サービス
NATIONAL OILWELL VARCO INC	367	366	1,138	128,259	エネルギー設備・サービス
NAVIENT CORP	371	339	405	45,723	消費者金融
NETAPP INC	263	279	743	83,812	コンピュータ・周辺機器
NETFLIX INC	49	391	3,995	450,227	インターネット販売・カタログ販売
NETSUITE INC	28	39	262	29,619	ソフトウェア
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	—	560	341	38,428	不動産管理・開発
JARDINE MATHESON	—	234	1,315	148,235	コングロマリット
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	399	471	751	84,703	貯蓄・抵当・不動産金融
NEWELL RUBBERMAID INC	241	255	1,131	127,490	家庭用耐久財
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	424	517	1,382	155,833	金属・鉱業
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	336	374	476	53,731	メディア
NEXTERA ENERGY INC	378	445	5,273	594,189	電力
NIKE INC-B	597	1,312	8,139	917,175	繊維・アパレル・贅沢品
NISOURCE INC	273	—	—	—	総合公益事業
NOBLE ENERGY INC	333	411	1,265	142,546	石油・ガス・消耗燃料
NORDSTROM INC	120	137	787	88,763	複合小売り
NORFOLK SOUTHERN CORP	270	287	2,432	274,074	陸運・鉄道
NORTHERN TRUST CORP	197	214	1,401	157,895	資本市場
NORTHROP GRUMMAN CORP	168	166	3,298	371,722	航空宇宙・防衛
NUANCE COMMUNICATIONS INC	209	250	461	51,945	ソフトウェア
NUCOR CORP	281	307	1,483	167,117	金属・鉱業
NVIDIA CORP	480	526	1,880	211,948	半導体・半導体製造装置
OGE ENERGY CORP	166	196	560	63,141	電力
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	86	96	2,655	299,249	専門小売り
OCCIDENTAL PETE CORP	681	738	5,062	570,462	石油・ガス・消耗燃料
OCEANEERING INTL INC	94	95	310	35,025	エネルギー設備・サービス
OMNICARE INC	86	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
OMNICOM GROUP	211	231	1,924	216,874	メディア
ONEOK INC	183	198	574	64,790	石油・ガス・消耗燃料
ORACLE CORPORATION	3,088	3,082	12,626	1,422,805	ソフトウェア
OWENS-ILLINOIS INC	140	—	—	—	容器・包装
PG&E CORP	407	473	2,811	316,801	総合公益事業
PNC FINANCIAL	460	487	4,156	468,359	銀行
PPG INDUSTRIES	119	258	2,887	325,309	化学
PPL CORPORATION	567	654	2,465	277,821	電力
PVH CORP	71	82	811	91,399	繊維・アパレル・贅沢品
PACCAR	306	345	1,882	212,138	機械
PACKAGING CORP OP AMERICA	—	89	529	59,609	容器・包装
PALL CORP	90	—	—	—	機械
PALO ALTO NETWORKS INC	58	77	1,248	140,730	通信機器
PARKER HANNIFIN CORP	127	132	1,465	165,083	機械
PATTERSON COS INC	75	87	402	45,398	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PAYCHEX INC	288	317	1,689	190,349	情報技術サービス
PAYPAL HOLDINGS INC	—	1,057	4,126	464,977	情報技術サービス
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	270	305	490	55,297	銀行
PEPCO HOLDINGS INC	227	—	—	—	電力
PEPSICO INC	1,304	1,408	14,458	1,629,212	飲料
PHARMACYCLICS INC	56	—	—	—	バイオテクノロジー
PFIZER INC	5,486	5,965	17,936	2,021,113	医薬品
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	1,354	1,497	14,773	1,664,722	タバコ
PHILLIPS 66	484	517	4,529	510,435	石油・ガス・消耗燃料
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	98	105	784	88,368	電力
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	128	156	2,190	246,813	石油・ガス・消耗燃料
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	—	190	156	17,641	石油・ガス・消耗燃料
POLARIS INDUSTRIES INC	56	62	602	67,940	レジャー用品
PRAXAIR INC	253	276	3,174	357,646	化学
PRECISION CASTPARTS CORP	123	—	—	—	航空宇宙・防衛
T ROWE PRICE GROUP INC	221	240	1,773	199,849	資本市場
PRICELINE GROUP INC/THE	45	48	6,321	712,334	インターネット販売・カタログ販売
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	256	280	1,113	125,475	保険
PROCTER & GAMBLE CO	2,353	2,628	21,728	2,448,345	家庭用品
PROGRESSIVE CO	477	569	1,993	224,594	保険
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	397	435	3,173	357,570	保険
PUBLIC SVC ENTERPRISE	431	493	2,294	258,535	総合公益事業
PULTEGROUP INC	295	295	543	61,195	家庭用耐久財
QEP RESOURCES INC	147	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
QORVO INC	125	139	712	80,239	半導体・半導体製造装置
QUALCOMM INC	1,449	1,450	7,393	833,105	通信機器
QUANTA SERVICES INC	186	163	368	41,545	建設・土木
QUEST DIAGNOSTICS INC	126	141	1,018	114,805	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
QUINTILES TRANSNATIONAL HOLD	58	88	569	64,155	ライフサイエンス・ツール/サービス
RACKSPACE HOSTING INC	110	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス
RALPH LAUREN CORPORATION	52	58	562	63,341	繊維・アパレル・贅沢品
RANGE RESOURCES CORP	143	167	540	60,893	石油・ガス・消耗燃料
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	111	120	573	64,565	資本市場
RAYTHEON COMPANY	270	291	3,601	405,807	航空宇宙・防衛
REALOGY HOLDINGS CORP	130	140	495	55,796	不動産管理・開発
RED HAT INC	167	178	1,317	148,502	ソフトウェア
REGENERON PHARMACEUTICALS	69	74	2,679	301,939	バイオテクノロジー
REGIONS FINANCIAL CORP	1,200	1,260	995	112,161	銀行
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	252	229	1,107	124,760	商業サービス・用品
RESMED INC	122	132	750	84,616	ヘルスケア機器・用品
REYNOLDS AMERICAN INC	276	825	4,164	469,267	タバコ
RITE AID CORP	—	1,000	811	91,383	食品・生活必需品小売り
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	121	133	609	68,712	専門サービス
ROCK-TENN COMPANY CL-A	118	—	—	—	容器・包装
ROCKWELL AUTOMATION INC	119	129	1,475	166,215	電気設備
ROCKWELL COLLINS INC	105	128	1,184	133,427	航空宇宙・防衛
ROPER TECHNOLOGIES INC	86	96	1,747	196,885	コングロマリット
ROSS STORES INC	184	394	2,298	259,005	専門小売り
SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A	114	121	1,209	136,288	各種電気通信サービス
SEI INVESTMENTS COMPANY	129	129	552	62,227	資本市場
SPX CORP	33	—	—	—	機械
SABRE CORP	—	200	571	64,407	情報技術サービス
ST JUDE MEDICAL INC	250	270	1,486	167,481	ヘルスケア機器・用品
SALESFORCE.COM INC	517	610	4,532	510,699	ソフトウェア

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
SALIX PHARMACEUTICALS LTD	55	—	—	—	医薬品
SAN DISK CORPORATION	187	194	1,473	166,026	コンピュータ・周辺機器
SCANA CORP	113	131	910	102,589	総合公益事業
HENRY SCHEIN INC	74	80	1,393	157,000	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
SCHLUMBERGER LTD	1,122	1,220	9,078	1,022,911	エネルギー設備・サービス
SCHWAB (CHARLES) CORP	1,024	1,148	3,233	364,397	資本市場
SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A	71	71	460	51,865	メディア
SEALED AIR CORP	179	192	922	103,910	容器・包装
SEMPRA ENERGY	202	230	2,379	268,156	総合公益事業
SERVICENOW INC	113	143	873	98,403	ソフトウェア
SHERWIN-WILLIAMS	69	76	2,187	246,461	化学
SIGMA-ALDRICH	103	—	—	—	化学
SIGNATURE BANK	—	48	676	76,181	銀行
SIRIUS XM HOLDINGS INC	2,070	2,040	807	91,027	メディア
SKYWORKS SOLUTIONS INC	162	182	1,416	159,652	半導体・半導体製造装置
JM SMUCKER CO/THE-NEW	87	112	1,458	164,289	食品
SNAP-ON INC	49	54	865	97,539	機械
SOUTHERN CO.	780	874	4,475	504,327	電力
SOUTHWEST AIRLINES	153	153	688	77,545	旅客航空輸送業
SOUTHWESTERN ENERGY CO	336	400	308	34,705	石油・ガス・消耗燃料
SPECTRA ENERGY CORP	581	653	1,994	224,787	石油・ガス・消耗燃料
SPLUNK INC	—	128	622	70,095	ソフトウェア
SPRINT CORP	650	710	244	27,600	無線通信サービス
STANLEY BLACK & DECKER INC	127	145	1,524	171,833	機械
STAPLES INC	550	620	682	76,917	専門小売り
STARBUCKS CORP	653	1,437	8,623	971,688	ホテル・レストラン・レジャー
STARWOOD HOTELS & RESORTS	151	162	1,355	152,714	ホテル・レストラン・レジャー
STATE STREET CORP	366	393	2,299	259,145	資本市場
STERICYCLE INC	75	81	1,018	114,709	商業サービス・用品
STRYKER CORP	297	329	3,521	396,852	ヘルスケア機器・用品
SUNTRUST BKS INC.	444	496	1,809	203,939	銀行
SUPERIOR ENERGY SERVICES INC	132	—	—	—	エネルギー設備・サービス
SYMANTEC CORP	601	652	1,198	135,033	ソフトウェア
SYNOPSIS INC	131	149	717	80,806	ソフトウェア
SYNCHRONY FINANCIAL	143	805	2,284	257,427	消費者金融
SYSCO CORP	506	542	2,527	284,781	食品・生活必需品小売り
TD AMERITRADE HOLDING CORP	240	254	803	90,498	資本市場
TECO ENERGY INC	—	224	616	69,486	総合公益事業
TJX COS INC	600	643	5,059	570,062	専門小売り
T-MOBILE US INC	205	271	1,041	117,381	無線通信サービス
TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP	98	—	—	—	自動車部品
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	—	49	222	25,044	ソフトウェア
TARGET CORP	528	567	4,740	534,116	複合小売り
TEGNA INC	—	206	488	55,012	メディア
TERADATA CORP	139	132	344	38,835	情報技術サービス
TESORO CORP	106	113	977	110,100	石油・ガス・消耗燃料
TESLA MOTORS INC	77	93	2,121	239,041	自動車
TEXAS INSTRUMENTS INC	922	980	5,720	644,558	半導体・半導体製造装置
TEXTRON INC	233	264	958	108,042	航空宇宙・防衛
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	350	386	5,444	613,469	ライフサイエンス・ツール/サービス
3M CORP	530	593	9,896	1,115,150	コングロマリット
TIFFANY & CO	112	127	921	103,878	専門小売り
TIME WARNER INC	732	772	5,570	627,712	メディア
TIME WARNER CABLE-A	242	273	5,628	634,203	メディア

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
TOLL BROTHERS INC	147	164	476	53,664	家庭用耐久財
TORCHMARK CORP	112	122	668	75,333	保険
TOWERS WATSON & CO-CL A	63	—	—	—	専門サービス
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	138	163	762	85,864	情報技術サービス
TRACTOR SUPPLY COMPANY	118	132	1,197	134,905	専門小売り
TRANSIDGM GROUP INC	43	52	1,156	130,356	航空宇宙・防衛
TRAVELERS COS INC/THE	290	295	3,464	390,344	保険
TRIMBLE NAVIGATION LTD	232	232	574	64,779	電子装置・機器・部品
TRIPADVISOR INC	103	115	765	86,275	インターネット販売・カタログ販売
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	1,187	1,122	3,131	352,857	メディア
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	379	428	1,206	136,000	メディア
TWITTER INC	328	567	927	104,523	インターネットソフトウェア・サービス
TYSON FOODS INC-CL A	266	285	1,925	216,960	食品
US BANCORP	1,561	1,688	6,919	779,645	銀行
ULTA SALON COSMETICS & FRAGR	53	59	1,153	129,921	専門小売り
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	144	171	1,464	165,013	繊維・アパレル・贅沢品
UNION PAC CORP	775	824	6,638	747,986	陸運・鉄道
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	83	93	556	62,686	旅客航空輸送業
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	613	674	7,126	802,980	航空貨物・物流サービス
UNITED RENTALS INC	86	86	539	60,846	商社・流通業
UNITED TECHNOLOGIES	755	815	8,170	920,637	航空宇宙・防衛
UNITED THERAPEUTICS CORP	—	43	477	53,764	バイオテクノロジー
UNITEDHEALTH GROUP INC	837	918	11,904	1,341,413	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	79	87	1,090	122,863	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
UNUM GROUP	227	227	710	80,034	保険
URBAN OUTFITTERS INC	96	—	—	—	専門小売り
V F CORP	298	331	2,159	243,326	繊維・アパレル・贅沢品
VALERO ENERGY CORP	457	462	2,955	333,068	石油・ガス・消耗燃料
VANTIV INC - CL A	127	151	813	91,658	情報技術サービス
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	88	95	758	85,422	ヘルスケア機器・用品
VERISIGN INC	96	99	886	99,940	インターネットソフトウェア・サービス
VERIZON COMMUNICATIONS	3,614	3,931	21,243	2,393,675	各種電気通信サービス
VERISK ANALYTICS INC	130	152	1,196	134,843	専門サービス
VERTEX PHARMACEUTICALS	211	240	1,881	212,018	バイオテクノロジー
VIACOM INC-CLASS B	307	341	1,367	154,118	メディア
VISA INC-CLASS A SHARES	1,718	1,875	14,396	1,622,169	情報技術サービス
VMWARE INC - CLASS A	74	74	385	43,434	ソフトウェア
VOYA FINANCIAL INC	198	211	644	72,586	各種金融サービス
VULCAN MATERIALS CO	117	128	1,350	152,148	建設資材
WABCO HOLDINGS INC	—	52	552	62,249	機械
WEC ENERGY GROUP INC	—	302	1,800	202,849	総合公益事業
WABTEC CORP	82	94	744	83,898	機械
WAL-MART STORES INC	1,404	1,545	10,629	1,197,743	食品・生活必需品小売り
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	761	843	7,050	794,395	食品・生活必需品小売り
WASTE CONNECTIONS INC	—	117	755	85,113	商業サービス・用品
WASTE MANAGEMENT INC	381	428	2,552	287,577	商業サービス・用品
WATERS CORP	73	80	1,057	119,134	ライフサイエンス・ツール/サービス
WELLS FARGO CO	4,290	4,687	22,802	2,569,358	銀行
WESTERN DIGITAL CORP	192	220	1,015	114,379	コンピュータ・周辺機器
WESTERN UNION CO	463	491	949	106,944	情報技術サービス
WESTLAKE CHEMICAL CORP	41	41	192	21,676	化学
WESTROCK CO	—	243	929	104,733	容器・包装
WHIRLPOOL CORP	68	76	1,358	153,075	家庭用耐久財
WHITEWAVE FOODS CO - CL A	—	175	706	79,585	食品

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
WHITING PETROLEUM CORP	178	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
WHOLE FOODS MARKET INC	306	332	1,058	119,224	食品・生活必需品小売り
WILLIAMS COS	622	695	1,088	122,637	石油・ガス・消耗燃料
WINDSTREAM HOLDINGS INC	510	—	—	—	各種電気通信サービス
WISCONSIN ENERGY CORP	196	—	—	—	総合公益事業
WORKDAY INC-CLASS A	83	107	814	91,800	ソフトウェア
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	110	109	832	93,847	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN RESORTS LTD	69	77	723	81,549	ホテル・レストラン・レジャー
XCEL ENERGY INC	437	483	2,007	226,187	電力
XILINX INC	229	250	1,196	134,849	半導体・半導体製造装置
XEROX CORP	956	890	963	108,608	情報技術サービス
XYLEM INC	154	170	697	78,614	機械
YAHOO! INC	788	869	3,177	357,991	インターネットソフトウェア・サービス
YUM BRANDS INC	383	415	3,413	384,619	ホテル・レストラン・レジャー
ZILLOW GROUP INC - A	43	—	—	—	インターネットソフトウェア・サービス
ZILLOW GROUP INC - C	—	86	198	22,336	インターネットソフトウェア・サービス
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	147	184	1,963	221,222	ヘルスケア機器・用品
ZOETIS INC	439	460	2,024	228,167	医薬品
ACTAVIS PLC	327	—	—	—	医薬品
ALKERMES PLC	123	138	444	50,086	バイオテクノロジー
ALLERGAN PLC	—	379	10,442	1,176,629	医薬品
AON PLC	238	263	2,734	308,083	保険
ARCH CAPITAL GROUP LTD	114	121	864	97,444	保険
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	80	95	522	58,864	保険
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	—	145	419	47,234	化学
ACCENTURE PLC-CL A	548	603	6,956	783,893	情報技術サービス
BUNGE LIMITED	128	138	779	87,856	食品
DELPHI AUTOMOTIVE PLC	260	273	2,045	230,435	自動車部品
EATON CORP PLC	411	445	2,792	314,644	電気設備
ENDO INTERNATIONAL PLC	153	205	583	65,717	医薬品
ENSCO PLC-CL A	199	—	—	—	エネルギー設備・サービス
EVEREST RE GROUP LTD	40	40	791	89,145	保険
INGERSOLL-RAND PLC	233	251	1,557	175,550	機械
WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC	664	850	651	73,461	エネルギー設備・サービス
INVESCO LTD	376	412	1,287	145,121	資本市場
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	51	58	719	81,059	医薬品
LIBERTY GLOBAL PLC-A	212	237	916	103,322	メディア
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	557	574	2,163	243,772	メディア
MALLINCKRODT PLC	100	111	665	74,932	医薬品
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	319	410	423	47,677	半導体・半導体製造装置
MEDTRONIC PLC	1,236	1,362	10,272	1,157,471	ヘルスケア機器・用品
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	176	179	1,017	114,705	繊維・アパレル・贅沢品
NABORS INDUSTRIES INC	229	—	—	—	エネルギー設備・サービス
NIELSEN HOLDINGS PLC	—	334	1,763	198,713	専門サービス
NOBLE CORP PLC	211	—	—	—	エネルギー設備・サービス
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	99	150	812	91,575	ホテル・レストラン・レジャー
PARTNERRE LTD	41	—	—	—	保険
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	40	44	527	59,490	保険
SEAGATE TECHNOLOGY	282	290	990	111,657	コンピュータ・周辺機器
PENTAIR PLC	158	174	940	106,011	機械
SIGNET JEWELERS LTD	65	71	849	95,747	専門小売り
TYCO INTERNATIONAL PLC	356	403	1,475	166,291	商業サービス・用品
WILLIS TOWERS WATSON PLC	—	124	1,472	165,907	保険
WILLIS GROUP HOLDINGS PLC	140	—	—	—	保険

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	百株	百株	千米ドル	千円	
PERRIGO CO PLC	123	139	1,808	203,747	医薬品
XL GROUP PLC	216	288	1,062	119,714	保険
ACE LTD	290	—	—	—	保険
CHUBB LTD	—	446	5,340	601,756	保険
GARMIN LTD	102	114	454	51,202	家庭用耐久財
TE CONNECTIVITY LTD	354	371	2,269	255,758	電子装置・機器・部品
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES	—	67	578	65,182	ソフトウェア
TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD	—	8	113	12,795	医薬品
AERCAP HOLDINGS NV	—	87	340	38,340	商社・流通業
CORE LABORATORIES N. V.	38	43	491	55,395	エネルギー設備・サービス
MOBILEYE NV	—	84	311	35,049	ソフトウェア
LYONDELLBASELL INDU-CL A	373	366	3,143	354,259	化学
MYLAN NV	319	404	1,874	211,225	医薬品
NIELSEN NV	299	—	—	—	専門サービス
NXP SEMICONDUCTORS NV	—	132	1,085	122,274	半導体・半導体製造装置
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	139	169	657	74,096	電気設備
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	145	169	1,357	153,009	ホテル・レストラン・レジャー
AVAGO TECHNOLOGIES LTD	220	—	—	—	半導体・半導体製造装置
BROADCOM LTD	—	375	5,886	663,284	半導体・半導体製造装置
FLEXTRONICS INTL LTD	510	550	656	73,996	電子装置・機器・部品
小 計	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	594	599	1,772,005	199,669,611	
	銘柄 数 < 比 率 >		—	< 1.2% >	
(カナダ)			千カナダドル		
ARC RESOURCES LTD	263	335	621	53,904	石油・ガス・消耗燃料
AGNICO EAGLE MINES LTD	186	206	981	85,210	金属・鉱業
AGRIUM INC	124	126	1,476	128,109	化学
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	364	401	2,321	201,473	食品・生活必需品小売り
ALTAGAS LTD	121	141	455	39,563	石油・ガス・消耗燃料
ATCO LTD CL1	68	68	267	23,252	総合公益事業
BCE INC	118	141	837	72,726	各種電気通信サービス
BANK OF MONTREAL	565	618	4,883	423,833	銀行
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	1,062	1,162	7,384	640,901	銀行
BARRICK GOLD	1,015	1,130	2,013	174,765	金属・鉱業
BAYTEX ENERGY CORP	144	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
BLACKBERRY LTD	439	509	528	45,854	コンピュータ・周辺機器
BOMBARDIER B SHEARS	1,160	1,670	220	19,131	航空宇宙・防衛
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	496	847	3,832	332,637	不動産管理・開発
CAE INC	212	260	390	33,870	航空宇宙・防衛
CCL INDUSTRIES INC - CL B	—	26	646	56,133	容器・包装
CI FINANCIAL CORP	205	226	652	56,646	資本市場
CAMECO CORP	346	386	654	56,784	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	345	383	3,745	325,092	銀行
CANADIAN NATL RAILWAY CO	712	769	6,249	542,408	陸運・鉄道
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	956	1,063	3,684	319,765	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN OIL SANDS LTD	420	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	149	140	2,432	211,116	陸運・鉄道
CANADIAN TIRE CORP LTD A	64	70	938	81,445	複合小売り
CANADIAN UTILITIES LTD A	106	124	449	39,055	総合公益事業
CATAMARAN CORP	177	—	—	—	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス
CENOVUS ENERGY INC	711	790	1,345	116,764	石油・ガス・消耗燃料
CONSTELLATION SOFTWARE	15	17	966	83,891	ソフトウェア
CRESCENT POINT ENERGY CORP	355	488	876	76,109	石油・ガス・消耗燃料
DOLLARAMA INC	108	115	1,022	88,739	複合小売り
ELDORADO GOLD CORPORATION	628	628	254	22,128	金属・鉱業

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)	百株	百株	千カナダドル	千円		
TECK RESOURCES LTD	492	582	590	51,218	金属・鉱業	
TELUS CORP	193	193	820	71,172	各種電気通信サービス	
THOMSON REUTERS CORP	316	330	1,732	150,335	メディア	
TORONTO DOMINION BANK	1,607	1,789	10,066	873,689	銀行	
TOURMALINE OIL CORP	153	173	473	41,095	石油・ガス・消耗燃料	
TRANSALTA CORP	243	—	—	—	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
TRANSCANADA CORP	614	688	3,489	302,856	石油・ガス・消耗燃料	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	630	870	288	25,068	金属・鉱業	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	278	313	1,098	95,350	医薬品	
VERESEN INC	—	248	215	18,725	石油・ガス・消耗燃料	
VERMILION ENERGY INC	93	105	396	34,428	石油・ガス・消耗燃料	
WEST FRASER TIMBER	56	68	366	31,816	紙製品・林産品	
WESTON(GEORGE)LTD	42	48	561	48,757	食品・生活必需品小売り	
YAMANA GOLD INC	790	970	385	33,421	金属・鉱業	
小 計	株 数 ・ 金 額	34,598	38,177	135,925	11,796,937	
	銘柄 数 < 比 率 >	93	90	—	< 3.6% >	
(イギリス)			千英ポンド			
ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC	830	940	262	42,495	資本市場	
AMEC FOSTER WHEELER PLC PLC	332	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
ANTOFAGASTA PLC	349	410	192	31,182	金属・鉱業	
ASHTED GROUP PLC	431	468	407	65,927	商社・流通業	
BHP BILLITON PLC	1,837	2,043	1,621	262,524	金属・鉱業	
ARM HOLDINGS PLC	1,230	1,340	1,372	222,180	半導体・半導体製造装置	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	—	980	559	90,527	家庭用耐久財	
SKY PLC	892	998	1,031	167,090	メディア	
TULLOW OIL PLC	782	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
AVIVA PLC	2,550	3,890	1,789	289,739	保険	
CRODA INTERNATIONAL PLC	115	127	386	62,637	化学	
DIAGEO PLC	2,194	2,427	4,601	745,089	飲料	
SCHRODERS PLC	101	118	319	51,778	資本市場	
BAE SYSTEMS PLC	2,690	3,060	1,566	253,683	航空宇宙・防衛	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	1,625	1,797	7,322	1,185,703	タバコ	
STANDARD CHARTERED PLC	2,132	3,164	1,493	241,885	銀行	
IMPERIAL BRANDS PLC	829	926	3,569	577,935	タバコ	
SABMILLER PLC	846	938	3,994	646,861	飲料	
HSBC HOLDINGS PLC	16,720	18,870	8,247	1,335,375	銀行	
LEGAL & GENERAL	5,150	5,760	1,355	219,547	保険	
MEGGITT PLC	706	780	318	51,491	航空宇宙・防衛	
MORRISON SUPERMARKETS	1,740	2,130	430	69,702	食品・生活必需品小売り	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	313	344	1,158	187,654	食品	
PEARSON	720	790	715	115,828	メディア	
PERSIMMON PLC	254	295	620	100,404	家庭用耐久財	
PRUDENTIAL PLC	2,241	2,493	3,245	525,573	保険	
RIO TINTO PLC-REG	1,112	1,201	2,369	383,681	金属・鉱業	
ST JAMES S PLACE PLC	—	499	462	74,819	保険	
TRAVIS PERKINS PLC	209	247	452	73,229	商社・流通業	
SSE PLC	859	969	1,461	236,605	電力	
BP PLC	15,900	17,660	6,279	1,016,697	石油・ガス・消耗燃料	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	49,800	55,300	3,749	607,093	銀行	
TATE & LYLE ORD.	425	425	245	39,706	食品	
BG GROUP PLC	2,984	—	—	—	石油・ガス・消耗燃料	
TAYLOR WIMPEY PLC	—	3,190	608	98,501	家庭用耐久財	
TESCO PLC	7,050	7,870	1,524	246,897	食品・生活必需品小売り	
SMITH & NEPHEW PLC	764	858	985	159,627	ヘルスケア機器・用品	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円	
GLAXOSMITHKLINE PLC	4,237	4,691	6,623	1,072,508	医薬品
WEIR GROUP PLC	182	220	243	39,398	機械
BABCOCK INTL GROUP PLC	219	259	244	39,651	商業サービス・用品
ASTRAZENECA PLC	1,102	1,219	4,772	772,843	医薬品
GKN PLC	1,430	1,690	496	80,369	自動車部品
BT GROUP PLC	7,110	8,170	3,644	590,139	各種電気通信サービス
CARNIVAL PLC	165	187	690	111,790	ホテル・レストラン・レジャー
MARKS & SPENCER PLC	1,410	1,550	628	101,745	複合小売り
BARCLAYS PLC	14,360	16,300	2,471	400,249	銀行
INTERTEK GROUP PLC	137	151	480	77,775	専門サービス
WILLIAM HILL PLC	760	850	280	45,473	ホテル・レストラン・レジャー
BURBERRY GROUP PLC	393	423	579	93,834	繊維・アパレル・贅沢品
NEXT PLC	133	140	778	126,038	複合小売り
KINGFISHER PLC	2,060	2,170	818	132,605	専門小売り
ICAP PLC	460	540	255	41,392	資本市場
ITV PLC	3,340	3,650	888	143,792	メディア
SAINSBURY	1,118	1,238	347	56,308	食品・生活必需品小売り
RANDGOLD RESOURCES LTD	74	90	565	91,517	金属・鉱業
G4S PLC	1,368	1,520	293	47,525	商業サービス・用品
ADMIRAL GROUP PLC	175	198	389	63,126	保険
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	—	124	403	65,334	家庭用耐久財
CENTRICA PLC	4,230	4,900	1,129	182,880	総合公益事業
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	3,408	3,800	6,484	1,050,002	石油・ガス・消耗燃料
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	2,129	3,820	6,547	1,060,167	石油・ガス・消耗燃料
BUNZLE	295	331	672	108,959	商社・流通業
COBHAM PLC	990	1,130	248	40,253	航空宇宙・防衛
NATIONAL GRID PLC	3,290	3,596	3,572	578,479	総合公益事業
INMARSAT PLC	350	425	410	66,407	各種電気通信サービス
PETROFAC LTD	227	260	238	38,583	エネルギー設備・サービス
LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC	272	302	851	137,897	各種金融サービス
UNILEVER PLC	1,121	1,244	3,968	642,556	パーソナル用品
TUI AG-DI	398	466	479	77,654	ホテル・レストラン・レジャー
INVESTEC PLC	470	550	276	44,839	資本市場
EXPERIAN PLC	860	946	1,178	190,857	専門サービス
MONDI PLC	—	342	461	74,758	紙製品・林産品
SEVERN TRENT PLC	203	221	484	78,510	水道
WHITBREAD PLC	158	175	696	112,720	ホテル・レストラン・レジャー
SPORTS DIRECT INTERNATIONAL	213	253	95	15,485	専門小売り
HARGREAVES LANSDOWN PLC	191	250	333	53,919	資本市場
SMITHS GROUP PLC	339	375	407	66,002	コングロマリット
ANGLO AMERICAN PLC	1,224	1,370	733	118,834	金属・鉱業
3I GROUP PLC	870	970	447	72,500	資本市場
PROVIDENT FINANCIAL PLC	—	143	423	68,514	消費者金融
CAPITA PLC	581	640	670	108,602	専門サービス
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	565	617	4,177	676,454	家庭用品
RELX PLC	967	1,066	1,392	225,424	メディア
SHIRE PLC	511	568	2,224	360,248	医薬品
FRESNILLO PLC	209	209	196	31,760	金属・鉱業
UNITED UTILITIES GROUP PLC	601	670	622	100,838	水道
GLENCORE PLC	9,670	11,880	1,800	291,523	金属・鉱業
DIXONS CARPHONE PLC	850	920	393	63,757	専門小売り
FRIENDS LIFE GROUP LTD	1,260	—	—	—	保険
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	1,633	1,770	1,221	197,752	航空宇宙・防衛
JOHNSON MATTHEY PLC	177	—	—	—	化学

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(イギリス)	百株	百株	千英ポンド	千円		
OLD MUTUAL PLC	4,270	4,680	920	149,056	保険	
EASYJET PLC	142	163	247	40,117	旅客航空輸送業	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	2,210	3,410	762	123,515	銀行	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	1,310	—	—	—	保険	
SAGE GROUP PLC (THE)	950	1,050	658	106,685	ソフトウェア	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	—	375	338	54,830	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
WPP PLC	1,151	1,243	2,032	329,070	メディア	
COCA-COLA HBC AG-CDI	174	198	297	48,250	飲料	
ROYAL MAIL PLC	550	880	426	69,078	航空貨物・物流サービス	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	650	690	316	51,304	ホテル・レストラン・レジャー	
WOLSELEY PLC	221	242	966	156,542	商社・流通業	
IMI PLC	226	259	247	40,133	機械	
VODAFONE GROUP PLC	23,120	25,610	5,698	922,656	無線通信サービス	
AGGREKO PLC	230	262	284	46,086	商業サービス・用品	
RSA INSURANCE GROUP PLC	907	987	471	76,334	保険	
COMPASS GROUP PLC	1,451	1,585	1,949	315,671	ホテル・レストラン・レジャー	
REXAM PLC	595	655	414	67,137	容器・包装	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	201	229	646	104,675	ホテル・レストラン・レジャー	
MELROSE INDUSTRIES PLC	864	—	—	—	機械	
STANDARD LIFE PLC	1,677	1,860	664	107,548	保険	
AUTO TRADER GROUP PLC	—	950	372	60,360	インターネットソフトウェア・サービス	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	—	1,360	507	82,188	保険	
WORLDPAY GROUP PLC	—	1,050	285	46,244	情報技術サービス	
JOHNSON MATTHEY PLC	—	191	523	84,712	化学	
小 計	株 数	246,108	280,828	152,497	24,692,453	
	銘柄 数 < 比 率 >	104	108	—	< 7.6% >	
(スイス)			千スイスフラン			
SYNGENTA AG	81	89	3,560	415,698	化学	
SIKA AG-BR	1	2	805	94,008	化学	
SGS SA-REG	4	5	1,061	123,880	専門サービス	
SULZER AG-REG	20	13	123	14,470	機械	
BARRY CALLEBAUT AG	1	1	198	23,156	食品	
SWISSCOM AG-REG	20	24	1,287	150,338	各種電気通信サービス	
LINDT & SPRUENGLI AG-PC	0.87	0.95	558	65,155	食品	
LINDT&SPRUENGLI AG-REG	0.09	0.1	708	82,692	食品	
GIVAUDAN-REG	7	8	1,709	199,546	化学	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	129	144	3,205	374,217	保険	
NOVARTIS-REG	2,003	2,199	15,403	1,798,262	医薬品	
ABB LTD	1,923	2,134	4,031	470,593	電気設備	
ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE)	611	678	16,080	1,877,269	医薬品	
ADECCO SA-REG	148	163	1,027	119,975	専門サービス	
LAFARGEHOLCIM LTD	201	443	1,989	232,307	建設資材	
NESTLE SA-REG	2,807	3,080	22,253	2,597,815	食品	
BALOISE HOLDING AG	40	50	614	71,736	保険	
SONOVA HOLDING AG-REG	45	50	618	72,167	ヘルスケア機器・用品	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	1,337	1,743	2,394	279,578	資本市場	
THE SWATCH GROUP AG-B	26	29	997	116,401	繊維・アパレル・贅沢品	
THE SWATCH GROUP AG-REG	46	46	306	35,791	繊維・アパレル・贅沢品	
LONZA AG-REG	46	50	813	94,937	ライフサイエンス・ツール/サービス	
SWISS LIFE HOLDING AG	26	31	818	95,518	保険	
GALENICA AG-REG	—	3	524	61,218	医薬品	
EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	7	8	415	48,543	化学	
SWISS PRIME SITE-REG	47	63	531	62,072	不動産管理・開発	
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	24	32	198	23,179	各種金融サービス	

銘柄	株数	当 期 末		業 種 等		
		株 数	評 価 額			
			外貨建金額		邦貨換算金額	
(スイス)	百株	百株	千スイスフラン	千円		
DUFREY AG-REG	—	40	474	55,334	専門小売り	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	15	15	595	69,569	資本市場	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	39	43	765	89,309	機械	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	19	19	340	39,789	機械	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	45	52	719	84,026	海運業	
GEBERIT AG-REG	33	36	1,326	154,836	建設関連製品	
ACTELION LTD	89	97	1,389	162,186	バイオテクノロジー	
ARYZTA AG	72	85	336	39,245	食品	
JULIUS BAER GROUP LTD	198	220	912	106,480	資本市場	
SWISS RE LTD	304	337	3,002	350,531	保険	
TRANSOCEAN LTD	315	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	452	500	3,207	374,443	繊維・アパレル・贅沢品	
UBS GROUP AG	3,188	3,511	5,550	648,011	資本市場	
小 計	株 数 ・ 金 額	14,380	16,053	100,859	11,774,300	
	銘柄 数 < 比 率 >	38	39	—	< 3.6% >	
(スウェーデン)			千スウェーデンクローナ			
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	1,320	1,460	11,577	160,352	銀行	
SWEDBANK AB	787	865	15,146	209,774	銀行	
SWEDISH MATCH AB	174	189	5,239	72,561	タバコ	
NORDEA BANK AB	2,660	2,930	23,073	319,571	銀行	
SECURITAS AB-B SHS	290	294	4,045	56,029	商業サービス・用品	
INVESTOR AB-B SHS	397	444	12,911	178,824	各種金融サービス	
HENNES&MAURITZ AB-B	831	923	25,197	348,990	専門小売り	
ASSA ABLOY AB-B	294	—	—	—	建設関連製品	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	433	—	—	—	銀行	
ERICSSON LM-B	2,660	2,920	23,871	330,613	通信機器	
TELIA AB	2,290	2,510	10,647	147,466	各種電気通信サービス	
SKANSKA AB-B SHS	329	375	7,016	97,175	建設・土木	
LUNDIN PETROLEUM AB	201	201	2,761	38,250	石油・ガス・消耗燃料	
ALFA LAVAL AB	270	277	3,792	52,521	機械	
GETINGE AB-B SHS	171	191	3,646	50,499	ヘルスケア機器・用品	
KINNEVIK INVESTMENT AB-B	203	236	5,482	75,929	各種金融サービス	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	55	61	2,765	38,297	無線通信サービス	
ELEKTA AB-B SHS	317	—	—	—	ヘルスケア機器・用品	
ICA GRUPPEN AB	66	78	2,112	29,254	食品・生活必需品小売り	
HUSQVARNA AB-B SHS	320	380	2,251	31,183	家庭用耐久財	
ELECTROLUX AB-B	208	233	4,979	68,962	家庭用耐久財	
SKF AB-B SHARES	336	388	5,738	79,478	機械	
ATLAS COPCO AB-A	584	—	—	—	機械	
ATLAS COPCO AB-B	344	—	—	—	機械	
VOLVO AB-B SHS	1,326	1,500	13,335	184,689	機械	
SANDVIK AB	927	1,030	8,765	121,399	機械	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	140	168	2,325	32,202	各種金融サービス	
SVENSKA CELLULOSA AB-B	504	584	15,131	209,570	家庭用品	
BOLIDEN AB	225	260	3,377	46,776	金属・鉱業	
HEXAGON AB-B SHS	228	244	7,703	106,687	電子装置・機器・部品	
TELE 2 AB-B SHS	284	284	2,161	29,933	無線通信サービス	
ATLAS COPCO AB-A	—	648	13,238	183,355	機械	
ATLAS COPCO AB-B	—	382	7,326	101,475	機械	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	—	1,450	15,138	209,661	銀行	
ASSA ABLOY AB-B	—	970	15,597	216,026	建設関連製品	
小 計	株 数 ・ 金 額	19,174	22,475	276,354	3,827,514	
	銘柄 数 < 比 率 >	31	30	—	< 1.2% >	

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…ドイツ)	百株	百株	千ユーロ	千円		
HEIDELBERGCEMENT AG	123	137	1,040	132,873	建設資材	
FRESENIUS MEDICAL CARE	188	209	1,628	207,936	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
ALLIANZ SE	398	440	6,373	813,858	保険	
DEUTSCHE LUFTHANSA AG (REGD)	192	226	317	40,591	旅客航空輸送業	
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG (REG)	151	160	2,885	368,437	保険	
VOLKSWAGEN AG	25	34	444	56,788	自動車	
VOLKSWAGEN AG-PREF	141	178	2,024	258,540	自動車	
DAIMLER AG	840	929	6,310	805,876	自動車	
MAN SE	32	32	306	39,102	機械	
THYSSENKRUPP AG	386	363	660	84,343	金属・鉱業	
SIEMENS AG	692	765	7,139	911,745	コングロマリット	
QIAGEN NV	201	223	435	55,630	ライフサイエンス・ツール/サービス	
LINDE AG	161	179	2,344	299,382	化学	
DEUTSCHE BANK AG-REG	1,206	1,331	2,017	257,587	資本市場	
BAYER MOTOREN WERK	287	318	2,611	333,437	自動車	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	47	53	373	47,688	自動車	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	2,773	3,114	4,965	634,065	各種電気通信サービス	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	1,000	1,090	1,379	176,148	半導体・半導体製造装置	
DEUTSCHE BOERSE AG	168	189	1,412	180,387	各種金融サービス	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	134	152	708	90,413	自動車	
FRAPORT AG	29	38	203	25,946	運送インフラ	
LANXESS	83	83	348	44,452	化学	
DEUTSCHE WOHNEN AG-BR	257	329	902	115,221	不動産管理・開発	
SYMRISE AG	106	115	688	87,907	化学	
KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG	20	—	—	—	メディア	
BRENTNAG AG	132	151	760	97,143	商社・流通業	
K+S AG	157	173	361	46,194	化学	
EVONIK INDUSTRIES AG	—	138	368	47,096	化学	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	476	746	358	45,717	各種電気通信サービス	
HUGO BOSS AG	58	63	359	45,857	繊維・アパレル・贅沢品	
COMMERZBANK AG	831	1,020	782	99,917	銀行	
OSRAM LICHT AG	77	88	400	51,150	電気設備	
VONOVIA SE	301	452	1,435	183,319	不動産管理・開発	
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	187	209	959	122,490	メディア	
ZALANDO SE	—	81	233	29,841	インターネット販売・カタログ販売	
小 計	株 数	金 額	18,847	21,587	92,772	11,847,076
	銘柄 数 < 比率 >		53	53	—	< 3.6% >
(ユーロ…イタリア)						
ASSICURAZIONI GENERALI	996	1,137	1,496	191,076	保険	
INTESA SANPAOLO	11,090	12,160	2,940	375,474	銀行	
INTESA SANPAOLO-RSP	760	920	209	26,739	銀行	
MEDIOBANCA SPA-ORD	550	530	335	42,842	資本市場	
PIRELLI&CO	211	—	—	—	自動車部品	
SAIPEM	239	5,497	195	24,990	エネルギー設備・サービス	
LUXOTTICA GROUP SPA	148	165	826	105,563	繊維・アパレル・贅沢品	
ENEL SPA	5,720	6,770	2,708	345,811	電力	
ENI SPA	2,224	2,448	3,309	422,648	石油・ガス・消耗燃料	
SNAM SPA	1,750	2,050	1,133	144,767	ガス	
TENARIS SA	417	460	503	64,322	エネルギー設備・サービス	
UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA	750	900	304	38,892	銀行	
TELECOM ITALIA SPA	8,600	11,100	1,058	135,226	各種電気通信サービス	
TELECOM ITALIA-RNC	5,200	5,700	442	56,484	各種電気通信サービス	
ATLANTIA SPA	352	393	968	123,708	運送インフラ	
TERNA SPA	1,350	1,420	721	92,117	電力	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…イタリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
EXOR SPA	86	112	364	46,497	各種金融サービス	
FINMECCANICA SPA	370	410	463	59,215	航空宇宙・防衛	
PRYSMIAN SPA	174	194	389	49,795	電気設備	
ENEL GREEN POWER SPA	1,600	1,600	310	39,678	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	
UNICREDIT SPA	3,860	4,640	1,517	193,756	銀行	
UNIPOLSAI SPA	800	1,070	218	27,847	保険	
FERRARI NV	—	127	474	60,553	自動車	
CNH INDUSTRIAL NV	801	920	566	72,311	機械	
BANCO POPOLARE SPA	303	339	218	27,965	銀行	
BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA	3,750	—	—	—	銀行	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	780	890	644	82,284	自動車	
小 計	株 数 銘 柄 数 < 比 率 >	52,881 26	61,952 25	22,322 —	2,850,570 <0.9%>	
(ユーロ…フランス)						
BOUYGUES	139	201	747	95,496	建設・土木	
AIRBUS GROUP SE	515	574	3,441	439,505	航空宇宙・防衛	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	372	437	930	118,836	総合公益事業	
LOREAL-ORD	217	242	3,890	496,822	パーソナル用品	
CHRISTIAN DIOR SE	47	53	881	112,569	繊維・アパレル・贅沢品	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	244	268	4,149	529,938	繊維・アパレル・贅沢品	
THALES (EX THOMSON-CSF)	83	99	766	97,914	航空宇宙・防衛	
CAP GEMINI SA	125	160	1,344	171,730	情報技術サービス	
CASINO GUICHARD	49	59	299	38,183	食品・生活必需品小売り	
INGENICO GROUP	—	55	564	72,131	電子装置・機器・部品	
PUBLICIS GROUPE	159	184	1,152	147,230	メディア	
LAFARGE SA	160	—	—	—	建設資材	
LAGARDERE S. C. A	97	116	274	35,107	メディア	
BOLLORE	750	870	303	38,762	航空貨物・物流サービス	
MICHELIN B	162	178	1,625	207,598	自動車部品	
PERNOD-RICARD	187	205	2,055	262,439	飲料	
RENAULT	168	188	1,651	210,882	自動車	
REMY COINTREAU	23	23	155	19,804	飲料	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	460	538	3,019	385,558	電気設備	
VIVENDI SA	1,054	1,132	2,142	273,645	メディア	
TECHNIP SA	88	98	485	62,047	エネルギー設備・サービス	
VALEO	66	76	1,041	132,998	自動車部品	
ORANGE	1,608	1,903	2,966	378,857	各種電気通信サービス	
HERMES INTERNATIONAL	23	24	781	99,751	繊維・アパレル・贅沢品	
BIC	25	28	379	48,425	商業サービス・用品	
DASSAULT SYSTEMES SA	114	121	855	109,243	ソフトウェア	
KERING	66	72	1,165	148,877	繊維・アパレル・贅沢品	
CNP ASSURANCES	135	165	226	28,929	保険	
CARREFOUR SUPERMARCHE	483	541	1,320	168,569	食品・生活必需品小売り	
ATOS SE	71	86	617	78,918	情報技術サービス	
SANOFI	1,041	1,133	8,074	1,031,163	医薬品	
ACCOR SA	182	207	776	99,140	ホテル・レストラン・レジャー	
STMICROELECTRONICS NV	577	577	282	36,104	半導体・半導体製造装置	
SOCIETE GENERALE	626	697	2,285	291,898	銀行	
ALCATEL-LUCENT	2,460	—	—	—	通信機器	
EURAZEO	30	38	230	29,445	各種金融サービス	
SODEXO	80	90	862	110,102	ホテル・レストラン・レジャー	
AXA	1,589	1,912	3,948	504,195	保険	
PEUGEOT CITROEN	342	437	671	85,688	自動車	
JC DECAUX SA	53	68	262	33,488	メディア	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…フランス)	百株	百株	千ユーロ	千円		
ESSILOR INTERNATIONAL	180	199	2,165	276,485	ヘルスケア機器・用品	
CREDIT AGRICOLE SA	879	1,030	986	125,940	銀行	
ZODIAC AEROSPACE	154	195	350	44,735	航空宇宙・防衛	
BNP PARIBAS	925	1,023	4,547	580,681	銀行	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	391	455	1,762	225,063	建設関連製品	
WENDEL	28	29	277	35,377	各種金融サービス	
ILIAD SA	21	24	567	72,413	各種電気通信サービス	
SES FDR	261	316	817	104,333	メディア	
IMERYS	30	38	232	29,678	建設資材	
SAFRAN SA	257	301	1,869	238,774	航空宇宙・防衛	
ENGIE	1,270	1,411	1,952	249,285	総合公益事業	
ALSTOM	187	155	354	45,297	機械	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	130	163	467	59,645	メディア	
ELECTRICITE DE FRANCE	203	228	231	29,537	電力	
ARKEMA	59	67	445	56,853	化学	
LEGRAND SA	232	253	1,260	160,942	電気設備	
TOTAL SA	1,866	2,115	8,667	1,106,810	石油・ガス・消耗燃料	
ADP	24	28	307	39,224	運送インフラ	
VALLOUREC	93	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
NATIXIS	780	870	379	48,494	銀行	
SCOR SE	140	154	484	61,927	保険	
REXEL SA	252	286	360	46,036	商社・流通業	
VINCI	414	460	3,049	389,400	建設・土木	
DANONE	502	567	3,603	460,139	食品	
AIR LIQUIDE	301	330	3,331	425,413	化学	
BUREAU VERITAS SA	231	255	499	63,726	専門サービス	
GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR	410	450	444	56,781	運送インフラ	
SUEZ ENVIRONNEMENT SA	270	299	483	61,702	総合公益事業	
EDENRED	187	187	321	41,097	商業サービス・用品	
NUMERICABLE-SFR	85	110	414	52,922	メディア	
小 計	株 数	金 額	25,435	25,857	97,264	12,420,731
銘 柄 数 < 比 率 >	69	67	—	< 3.8% >		
(ユーロ…オランダ)						
RELX NV	595	970	1,520	194,164	メディア	
RANDSTAD HOLDING NV	110	127	624	79,751	専門サービス	
AKZO NOBEL	209	240	1,448	185,021	化学	
WOLTERS KLUWER	259	289	1,035	132,176	メディア	
VOPAK	61	71	314	40,138	石油・ガス・消耗燃料	
AEGON NV	1,590	1,800	882	112,723	保険	
KONINKLIJKE KPN NV	2,860	3,110	1,146	146,428	各種電気通信サービス	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	798	915	2,298	293,574	コングロマリット	
ING GROEP NV	3,371	3,750	4,074	520,297	銀行	
HEINEKEN NV	200	220	1,776	226,915	飲料	
ARCELORMITTAL	871	960	369	47,185	金属・鉱業	
ARCELORMITTAL-RIGHTS	—	960	110	14,150	金属・鉱業	
HEINEKEN HOLDING NV	91	97	675	86,287	飲料	
KONINKLIJKE DSM NV	149	175	856	109,323	化学	
UNILEVER NV-CVA	1,422	1,571	6,335	808,986	パーソナル用品	
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	71	81	283	36,239	建設・土木	
TNT EXPRESS NV	360	430	339	43,297	航空貨物・物流サービス	
DELTA LLOYD NV	183	—	—	—	保険	
ASML HOLDING NV	306	332	2,964	378,557	半導体・半導体製造装置	
GEMALTO	68	76	497	63,520	ソフトウェア	
OCI	80	80	140	17,959	化学	

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

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(ユーロ…オーストリア)	百株	百株	千ユーロ	千円		
VOESTALPINE AG	96	110	319	40,848	金属・鋳業	
ERSTE GROUP BANK AG	251	268	658	84,070	銀行	
IMMOFINANZ AG	820	—	—	—	不動産管理・開発	
IMMOEAST AG-RIGHTS	500	500	—	—	不動産管理・開発	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	110	110	144	18,492	銀行	
VIENNA INSURANCE GROUP AG WIEN	31	—	—	—	保険	
ANDRITZ AG	65	80	386	49,384	機械	
小 計	株 数 ・ 金 額	1,998	1,208	1,864	238,063	
	銘柄 数 < 比 率 >	8	6	—	< 0.1% >	
(ユーロ…ルクセンブルグ)						
RTL GROUP	33	39	291	37,187	メディア	
ALTICE SA	78	—	—	—	メディア	
小 計	株 数 ・ 金 額	111	39	291	37,187	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	1	—	< 0.0% >	
(ユーロ…フィンランド)						
WARTSILA OYJ	123	147	592	75,613	機械	
UPM-KYMMENE OYJ	475	505	823	105,180	紙製品・林産品	
STORA ENSO OYJ-R	494	540	435	55,649	紙製品・林産品	
SAMPO OYJ-A	388	432	1,817	232,140	保険	
FORTUM OYJ	396	440	590	75,404	電力	
ELISA CORPORATION	125	137	470	60,042	各種電気通信サービス	
METSO OYJ	104	104	220	28,155	機械	
NOKIA OYJ	3,230	5,600	2,987	381,516	通信機器	
NESTE OYJ	107	125	379	48,494	石油・ガス・消耗燃料	
NOKIAN RENKAAT OYJ	102	113	353	45,137	自動車部品	
KONE OYJ	273	319	1,380	176,347	機械	
ORION OYJ	87	96	278	35,539	医薬品	
小 計	株 数 ・ 金 額	5,904	8,558	10,330	1,319,220	
	銘柄 数 < 比 率 >	12	12	—	< 0.4% >	
(ユーロ…アイルランド)						
BANK OF IRELAND	24,500	28,500	741	94,625	銀行	
CRH PLC	737	822	2,073	264,837	建設資材	
KERRY GROUP PLC-A	147	161	1,323	168,959	食品	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	1,398	1,398	—	—	銀行	
PADDY POWER PLC	—	81	983	125,624	ホテル・レストラン・レジャー	
小 計	株 数 ・ 金 額	26,782	30,962	5,121	654,047	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	5	—	< 0.2% >	
(ユーロ…ポルトガル)						
ENERGIAS DE PORTUGAL	2,000	2,200	698	89,226	電力	
BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REGD	30,400	34,000	131	16,759	銀行	
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	335	445	507	64,839	石油・ガス・消耗燃料	
JERONIMO MARTINS	224	252	364	46,484	食品・生活必需品小売り	
小 計	株 数 ・ 金 額	32,959	36,897	1,701	217,309	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.1% >	
ユ ー ロ 計	株 数 ・ 金 額	236,527	258,101	309,569	39,532,030	
	銘柄 数 < 比 率 >	239	233	—	< 12.1% >	
(香港)			千香港ドル			
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	219	219	1,346	19,569	半導体・半導体製造装置	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	1,920	2,130	3,135	45,556	不動産管理・開発	
BANK OF EAST ASIA	1,108	1,208	3,504	50,926	銀行	
CLP HLDGS	1,675	1,855	12,985	188,672	電力	
CATHAY PACIFIC AIRWAYS	1,070	1,070	1,427	20,739	旅客航空輸送業	
CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE	500	600	4,548	66,082	電力	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	975	1,102	20,530	298,304	各種金融サービス	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等
	株 数	株 数	評 価 額		
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(香港)	百株	百株	千香港ドル	千円	
LI & FUNG LTD	4,936	5,636	2,570	37,342	繊維・アパレル・贅沢品
MTR CORP	1,305	1,395	5,335	77,530	陸運・鉄道
FIRST PACIFIC CO	2,260	2,260	1,285	18,684	各種金融サービス
HANG SENG BANK	670	730	9,928	144,253	銀行
HENDERSON LAND	936	1,110	5,389	78,314	不動産管理・開発
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	1,170	1,350	10,692	155,354	電力
WHARF(HOLDING)	1,330	1,330	5,685	82,613	不動産管理・開発
HONG KONG & CHINA GAS	5,514	6,625	9,567	139,012	ガス
HUTCHISON WHAMPOA	1,850	—	—	—	コングロマリット
HYSAN DEVELOPMENT	540	650	2,135	31,025	不動産管理・開発
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	2,060	2,230	6,611	96,071	ホテル・レストラン・レジャー
KERRY PROPERTIES	570	570	1,199	17,433	不動産管理・開発
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	3,145	3,635	8,305	120,685	銀行
NWS HOLDINGS LTD	1,355	1,355	1,658	24,098	コングロマリット
PCCW LTD	3,860	3,860	1,937	28,155	各種電気通信サービス
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	620	750	2,010	29,205	繊維・アパレル・贅沢品
NEW WORLD DEVELOPMENT	4,666	5,166	3,864	56,153	不動産管理・開発
SHANGRI-LA ASIA LTD	743	1,083	971	14,119	ホテル・レストラン・レジャー
SINO LAND CO. LTD	2,560	2,860	3,540	51,446	不動産管理・開発
SUN HUNG KAI PROPERTIES	1,490	1,680	16,077	233,607	不動産管理・開発
WIRES PACIFIC-A	545	585	4,829	70,167	不動産管理・開発
WHEELLOCK & COMPANY LTD	770	870	2,966	43,106	不動産管理・開発
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	1,260	1,280	3,904	56,725	家庭用耐久財
SJM HOLDINGS LIMITED	1,660	1,660	914	13,290	ホテル・レストラン・レジャー
WYNN MACAU LTD	1,324	1,684	2,037	29,606	ホテル・レストラン・レジャー
MGM CHINA HOLDINGS LTD	780	780	912	13,260	ホテル・レストラン・レジャー
AIA GROUP LTD	10,514	11,624	51,029	741,456	保険
HKT TRUST AND HKT LTD	2,196	2,596	2,777	40,360	各種電気通信サービス
SANDS CHINA LTD	2,080	2,348	7,454	108,319	ホテル・レストラン・レジャー
SWIRE PROPERTIES LTD	1,008	1,168	2,470	35,893	不動産管理・開発
WH GROUP LIMITED	3,100	5,900	3,315	48,178	食品
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	1,200	2,625	26,857	390,244	コングロマリット
CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING	—	2,635	13,256	192,610	不動産管理・開発
小 計	株 数	株 数	外貨建金額	邦貨換算金額	
	75,486	88,217	268,973	3,908,181	
銘 柄 数 < 比 率 >	39	39	—	< 1.2% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル		
SINGAPORE TECH ENGINEERING	1,410	1,410	454	37,824	航空宇宙・防衛
GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	6,153	6,153	261	21,786	食品
DBS GROUP HLDS	1,490	1,710	2,648	220,670	銀行
CITY DEVELOPMENTS LTD	370	370	304	25,337	不動産管理・開発
SEMBCORP MARINE	726	726	121	10,161	機械
JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	90	118	482	40,207	販売
SINGAPORE EXCHANGE LTD	680	770	608	50,677	各種金融サービス
CAPITALAND LIMITED	2,290	2,460	765	63,737	不動産管理・開発
GENTING SINGAPORE PLC	5,246	6,146	519	43,265	ホテル・レストラン・レジャー
COMFORTDELGRO CORP LTD	1,670	2,070	610	50,873	陸運・鉄道
SINGAPORE AIRLINES LTD	490	550	631	52,594	旅客航空輸送業
UNITED OVERSEAS BANK	1,100	1,255	2,390	199,175	銀行
UOL GROUP LIMITED	387	487	294	24,546	不動産管理・開発
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	1,460	1,510	614	51,199	メディア
NOBLE GROUP LTD	4,124	4,124	191	15,979	商社・流通業
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	7,010	7,700	2,964	246,972	各種電気通信サービス
SEMBCORP INDUSTRIES	830	990	305	25,413	コングロマリット
OCBC-ORD	2,635	2,975	2,662	221,823	銀行

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		業 種 等	
	株 数	株 数	評 価 額			
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(シンガポール)	百株	百株	千シンガポールドル	千円		
WILMAR INTERNATIONAL LTD	1,600	1,840	625	52,118	食品	
STARHUB LTD	530	530	175	14,615	無線通信サービス	
KEPPEL CORP.	1,237	1,427	851	70,973	コングロマリット	
YANGZIJANG SHIPBUILDING	1,630	1,630	160	13,375	機械	
GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L	2,640	2,940	574	47,884	不動産管理・開発	
小 計	株 数 ・ 金 額	45,799	49,892	19,219	1,601,212	
	銘柄 数 < 比 率 >	23	23	—	< 0.5% >	
(オーストラリア)			千豪ドル			
RAMSAY HEALTH CARE LTD	119	141	854	73,660	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	2,405	2,817	6,510	561,495	銀行	
AMCOR	1,020	1,130	1,607	138,689	容器・包装	
WESTPAC BANKING CORP	2,711	3,206	9,582	826,510	銀行	
BANK OF QUEENSLAND LTD	301	351	411	35,526	銀行	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	1,420	1,420	364	31,476	金属・鉱業	
TELSTRA CORP LTD	3,770	4,170	2,176	187,743	各種電気通信サービス	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	393	443	388	33,509	銀行	
COCA-COLA AMATIL LTD	520	520	446	38,481	飲料	
ASX LTD	175	182	750	64,752	各種金融サービス	
BHP BILLITON LIMITED	2,802	3,084	5,125	442,083	金属・鉱業	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	124	255	835	72,095	石油・ガス・消耗燃料	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	397	530	249	21,530	複合小売り	
COMPUTERSHARE LTD	410	470	456	39,402	情報技術サービス	
CSL LIMITED	412	451	4,526	390,387	バイオテクノロジー	
REA GROUP LTD	41	54	287	24,782	メディア	
TRANSURBAN GROUP	1,566	1,950	2,191	189,046	運送インフラ	
COCHLEAR LTD	52	52	525	45,361	ヘルスケア機器・用品	
ORIGIN ENERGY LTD	980	1,750	864	74,563	石油・ガス・消耗燃料	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	1,413	1,646	12,066	1,040,763	銀行	
BORAL LTD	670	670	408	35,250	建設資材	
RIO TINTO LTD	380	410	1,721	148,487	金属・鉱業	
APA GROUP	990	1,070	930	80,290	ガス	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	—	520	522	45,074	ホテル・レストラン・レジャー	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	2,040	2,320	1,266	109,254	保険	
TPG TELECOM LTD	190	270	303	26,175	各種電気通信サービス	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	52	52	221	19,092	ホテル・レストラン・レジャー	
ORICA LTD	326	366	571	49,276	化学	
LEIGHTON HOLDINGS	89	—	—	—	建設・土木	
WORLEYPARSONS LTD	180	—	—	—	エネルギー設備・サービス	
SUNCORP GROUP LTD	1,090	1,260	1,460	125,954	保険	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	2,065	2,524	6,471	558,169	銀行	
NEWCREST MINING	640	750	1,259	108,610	金属・鉱業	
OIL SEARCH LTD	—	1,300	873	75,348	石油・ガス・消耗燃料	
INCITEC PIVOT LTD	1,430	1,610	515	44,436	化学	
TOLL HLDGS	550	—	—	—	航空貨物・物流サービス	
AMP LIMITED	2,600	2,850	1,621	139,867	保険	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	470	441	175	15,111	旅客航空輸送業	
QBE INSURANCE	1,170	1,330	1,428	123,201	保険	
CHALLENGER LIMITED	—	560	459	39,606	各種金融サービス	
SANTOS LTD.	846	1,670	673	58,047	石油・ガス・消耗燃料	
SONIC HEALTHCARE LTD	339	373	690	59,548	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	
TABCORP HOLDINGS	780	780	321	27,717	ホテル・レストラン・レジャー	
WESFARMERS LIMITED	984	1,079	4,453	384,074	食品・生活必需品小売り	
ALUMINA LTD	2,330	2,330	302	26,125	金属・鉱業	
ILUKA RESOURCES LTD	378	378	247	21,387	金属・鉱業	

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

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

* 邦貨換算金額欄の<>内は、純資産総額に対する各国別株式評価額の比率。

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、数値が単位未満の場合は小数で記載。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	口	口	千米ドル	千円	%	
AMERICAN CAPITAL AGENCY CORP	29,500	34,100	630	71,007	0.0	
AMERICAN REALTY CAPITAL PROP	81,000	—	—	—	—	
AMERICAN TOWER CORP	36,200	41,000	4,194	472,659	0.1	
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	80,000	91,000	926	104,384	0.0	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	11,290	13,330	2,517	283,627	0.1	
BOSTON PROPERTIES	13,280	14,700	1,862	209,898	0.1	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	—	17,300	440	49,669	0.0	
CAMDEN PROPERTY TRUST	7,600	8,300	693	78,111	0.0	
CROWN CASTLE INTL CORP	28,800	32,300	2,807	316,387	0.1	
DIGITAL REALTY TRUST INC	11,800	14,000	1,236	139,342	0.0	
DUKE REALTY CORP	28,600	34,000	760	85,702	0.0	
EQUINIX INC	4,652	6,490	2,129	239,944	0.1	
EQUITY RESIDENTIAL	29,700	35,100	2,627	296,036	0.1	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	5,400	6,300	1,463	164,941	0.1	
EXTRA SPACE STORAGE INC	—	11,000	1,017	114,664	0.0	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,800	6,520	1,016	114,565	0.0	
GENERAL GROWTH PROPERTIES INC	46,600	54,400	1,605	180,890	0.1	
HCP INC	39,800	45,600	1,479	166,683	0.1	
HEALTH CARE REIT INC	30,300	—	—	—	—	
HOTEL & RESORTS INC	65,900	73,900	1,216	137,063	0.0	
IRON MOUNTAIN INC	14,800	19,000	638	71,956	0.0	
KIMCO REALTY CORP	34,800	40,500	1,160	130,791	0.0	
LIBERTY PROPERTY TRUST	12,500	15,000	500	56,368	0.0	
MACERICH CO /THE	12,200	13,300	1,051	118,452	0.0	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	—	7,200	730	82,330	0.0	
PLUM CREEK TIMBER CO	15,400	—	—	—	—	
PROLOGIS INC	43,800	50,700	2,214	249,481	0.1	
PUBLIC STORAGE	12,680	14,240	3,890	438,382	0.1	
RAYONIER INC	11,800	—	—	—	—	
REALTY INCOME CORP	19,300	23,800	1,480	166,833	0.1	
REGENCY CENTERS CORP	8,000	8,800	660	74,438	0.0	
SL GREEN REALTY CORP	8,200	9,800	939	105,854	0.0	
SIMON PROPERTY GROUP INC	27,150	29,970	6,165	694,754	0.2	
UDR INC	22,600	25,700	983	110,767	0.0	
VENTAS INC	28,300	31,700	1,995	224,890	0.1	
VEREIT INC	—	88,000	777	87,656	0.0	
VORNADO REALTY TRUST	14,900	16,600	1,559	175,769	0.1	
WELLTOWER INC	—	34,500	2,376	267,768	0.1	
WEYERHAEUSER CO	45,900	76,000	2,359	265,902	0.1	
HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	509,000	262	29,537	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	1,397,552	1,553,150	58,373	6,577,514	
	銘柄 数 < 比 率 >	35	36	—	< 2.0% >	
(カナダ)				千カナダドル		
H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS		10,500	13,600	282	24,515	0.0

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(カナダ)			千カナダドル	千円	%	
RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	12,400	14,400	383	33,244	0.0	
SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	—	6,900	235	20,402	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	22,900	34,900	900	78,162	
	銘柄 数 < 比 率 >	2	3	—	< 0.0% >	
(イギリス)			千英ポンド			
BRITISH LAND	84,000	94,000	666	107,913	0.0	
HAMMERSON PLC	67,000	73,000	420	68,143	0.0	
INTU PROPERTIES PLC	77,000	88,000	277	44,983	0.0	
LAND SECURITIES GROUP PLC	68,000	77,500	843	136,656	0.0	
SEGRO PLC	60,000	70,000	288	46,686	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	356,000	402,500	2,497	404,383	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.1% >	
(ユーロ…フランス)			千ユーロ			
ICADE	3,000	3,000	203	25,993	0.0	
KLEPIERRE	14,500	21,200	891	113,852	0.0	
GECINA SA	2,470	3,400	407	52,014	0.0	
FONCIERE DES REGIONS	2,500	3,100	259	33,082	0.0	
UNIBAIL RODAMCO-NA	8,480	9,600	2,352	300,350	0.1	
ユ ー ロ 計	口 数 ・ 金 額	30,950	40,300	4,113	525,294	
	銘柄 数 < 比 率 >	5	5	—	< 0.2% >	
(香港)			千香港ドル			
LINK REIT	200,000	219,000	10,161	147,648	0.0	
HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	—	260,000	1,827	26,557	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	200,000	479,000	11,989	174,205	
	銘柄 数 < 比 率 >	1	2	—	< 0.1% >	
(シンガポール)			千シンガポールドル			
CAPITALAND MALL TRUST	219,900	249,900	529	44,136	0.0	
ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	187,000	213,000	513	42,765	0.0	
CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	192,000	192,000	288	23,993	0.0	
SUNTEC REIT	203,000	243,000	413	34,415	0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額	801,900	897,900	1,744	145,310	
	銘柄 数 < 比 率 >	4	4	—	< 0.0% >	
(オーストラリア)			千豪ドル			
MIRVAC GROUP	336,000	350,000	663	57,205	0.0	
GPT GROUP	148,000	179,000	887	76,576	0.0	
LENDLEASE GROUP	48,000	53,000	723	62,397	0.0	
STOCKLAND TRUST GROUP	197,000	230,000	959	82,722	0.0	
DEXUS PROPERTY GROUP	75,000	92,000	723	62,369	0.0	
GOODMAN GROUP	150,000	174,000	1,160	100,100	0.0	
FEDERATION CENTRES	132,200	—	—	—	—	
SCENTRE GROUP	452,000	513,000	2,252	194,241	0.1	
WESTFIELD CORP	171,400	193,000	1,935	166,961	0.1	
NOVION PROPERTY GROUP	184,200	—	—	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末				
		口 数	口 数	評 価 額		比 率
				外貨建金額	邦貨換算金額	
(オーストラリア) VICINITY CENTRES	口 —	口 328,704	千豪ドル 1,035	千円 89,304	% 0.0	
小 計	口 数 ・ 金 額 1,893,800	2,112,704	10,340	891,878		
銘 柄 数 < 比 率 >	10	9	—	< 0.3% >		
合 計	口 数 ・ 金 額 4,703,102	5,520,454	—	8,796,750		
銘 柄 数 < 比 率 >	62	64	—	< 2.7% >		

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

* 比率は、純資産総額に対する投資信託証券評価額の比率。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
株式先物取引		
CAN60	328	—
EURO50	1,087	—
FT100	676	—
SPEMINI	5,592	—
SWISSMKT	324	—

* 単位未満は切り捨て。

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

○投資信託財産の構成

(2016年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 309,377,723	% 94.7
投資信託受益証券	29,537	0.0
投資証券	8,767,212	2.7
コール・ローン等、その他	8,535,586	2.6
投資信託財産総額	326,710,058	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 当期末における外貨建て純資産（324,747,687千円）の投資信託財産総額（326,710,058千円）に対する比率は99.4%です。

* 外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=112.68円、1カナダドル=86.79円、1英ポンド=161.92円、1スイスフラン=116.74円、1スウェーデンクローナ=13.85円、1ノルウェークローネ=13.56円、1デンマーククローネ=17.14円、1ユーロ=127.70円、1香港ドル=14.53円、1シンガポールドル=83.31円、1豪ドル=86.25円、1ニュージーランドドル=77.88円、1新シッケル=29.78円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年3月31日現在）

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

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

○損益の状況（2015年4月1日～2016年3月31日）

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

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	百万円
バランスセレクト30	63
バランスセレクト50	200
バランスセレクト70	187
野村外国株式インデックスファンド	562
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,928
野村世界6資産分散投信（分配コース）	10,449
野村世界6資産分散投信（成長コース）	5,914
野村資産設計ファンド2015	40
野村資産設計ファンド2020	41
野村資産設計ファンド2025	51
野村資産設計ファンド2030	49
野村資産設計ファンド2035	35
野村資産設計ファンド2040	120
野村外国株インデックス（野村投資一任口座向け）	16,151
のむらっぴ・ファンド（保守型）	909
のむらっぴ・ファンド（普通型）	5,321
のむらっぴ・ファンド（積極型）	4,348
野村資産設計ファンド2045	11
野村インデックスファンド・外国株式	2,399
マイ・ロード	1,605
ネクストコア	91
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	90
野村外国株インデックス（野村SMA・EW向け）	419
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	255
野村資産設計ファンド2050	5
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	621
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	458
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	9,968
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	4,059
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	9
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	38
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	28
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	131
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	1,438
野村外国株式インデックスファンド（適格機関投資家専用）	571
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	238
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	34
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	267
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	4,738
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	638
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	896
ノムラFoFs用インデックスファンド・外国株式（適格機関投資家専用）	183
野村FoFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	638
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	3
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	16
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	14
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI（確定拠出年金向け）	55,942
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,377
マイバランス50（確定拠出年金向け）	5,418
マイバランス70（確定拠出年金向け）	5,967
マイバランスDC30	741
マイバランスDC50	1,288
マイバランスDC70	969
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	12,907
野村DC運用戦略ファンド	143
野村DC運用戦略ファンドM	0
野村DC運用戦略ファンドA	1
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	31
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	0
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	0

* 単位未満は切り捨て。

○お知らせ

有価証券の指図範囲に新投資口予約権証券を加える所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年8月3日＞

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	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>	

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1期(決算日 2016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、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、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		債組比	券入率	債先比	券物率	純資産額
		(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	騰落率					
第1	設定日(2016年2月3日)	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	百万円 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		

(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		債組比	券入率	債先比	券物率
		騰落率	騰落率	騰落率	騰落率				
第1期	(設定日)2016年2月3日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	% —	% —	
	2月末	9,526	△4.7	9,526	△4.7	98.5	0.3		
	3月末	9,700	△3.0	9,664	△3.4	98.0	0.9		
	4月末	9,387	△6.1	9,487	△5.1	97.6	1.1		
	5月末	9,469	△5.3	9,456	△5.4	97.8	0.9		
	6月末	8,936	△10.6	8,896	△11.0	97.8	1.0		
	(期 末)2016年7月7日	8,803	△12.0	8,759	△12.4	98.3	0.6		

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定日比です。

(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。

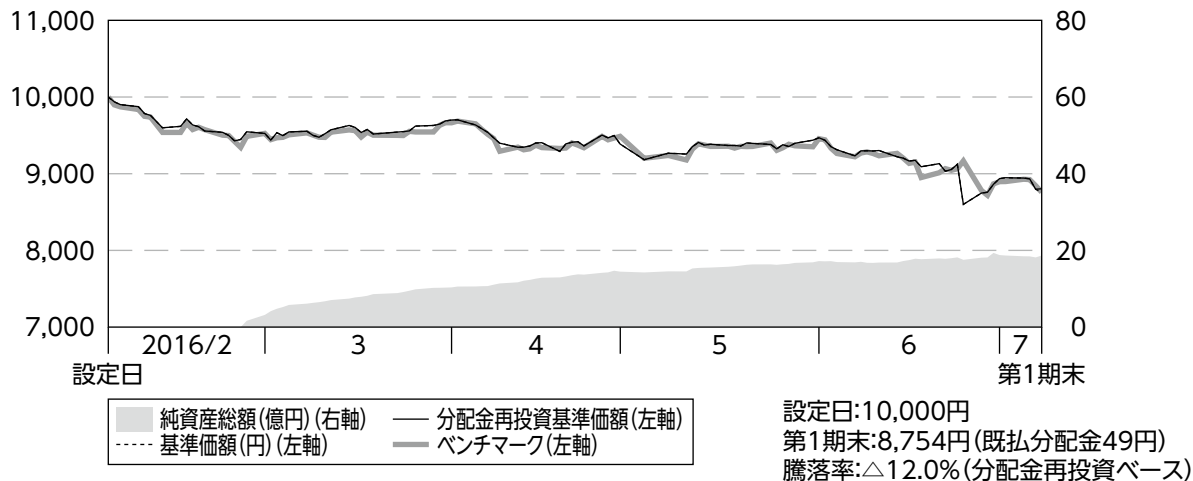
(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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。

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

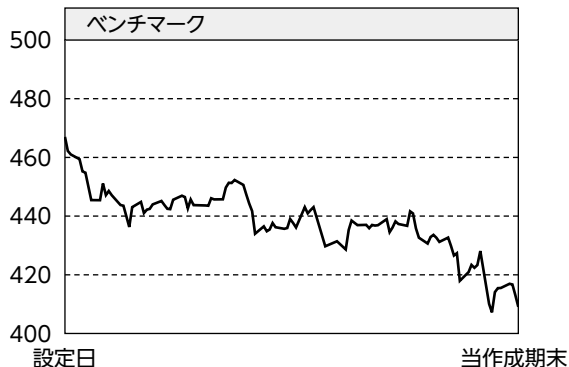


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2016年2月3日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

基準価額は2月下旬まで、世界経済の先行き不透明感の根強さを背景に主要国の長期金利が低下(債券価格は上昇)基調で推移したものの、外国為替市場でリスク回避姿勢の強まりや米国の利上げペースは緩やかになるという見方を受けて円高基調となったことから、下落しました。その後、5月にかけて基準価額はもみ合いとなりました。6月からは、軟調な米国雇用統計やFOMC(米連邦公開市場委員会)を受けて米国の早期利上げ期待が後退したことや、英国のEU(欧州連合)離脱懸念を受けて円高圧力が再度強まったことから、基準価額は下落しました。6月後半に英国の国民投票において大方の予想に反してEU離脱派が勝利したことを受けてリスク回避姿勢が強まり円高が一段と進んだことから、基準価額はさらに下落しました。

投資環境



外国債券市場で主要国の長期金利は、2月下旬にかけて世界経済の先行き不透明感が強まったことから低下し、その後5月にかけてもみ合い推移となりました。6月下旬に、英国においてEU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を受けてリスク回避姿勢が強まったことから、金利は低下しました。

外国為替市場では、世界経済の先行き不透明感の強まりや、米国の利上げペースは緩やかになるという見方などから期を通じて主要通貨に対して円高推移となりました。当作成期末にかけては英国のEU離脱懸念を背景としたリスク回避姿勢の強まりから、さらに円高が進行しました。

当ファンドのポートフォリオ

シティ世界国債インデックス(除く日本、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。

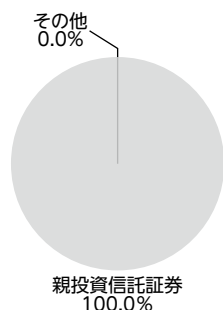
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

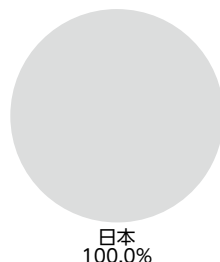
	当作成期末
	2016年7月7日
外国債券インデックス マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

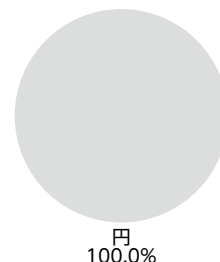
○資産別配分



○国別配分



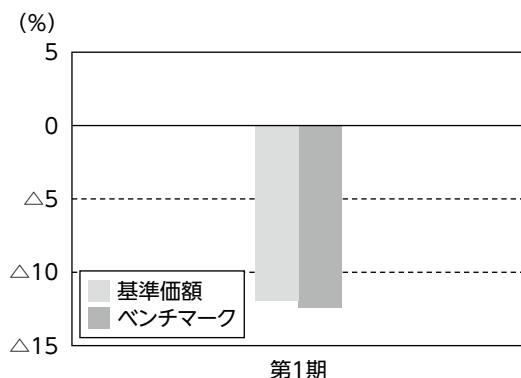
○通貨別配分



(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(マイナス)および為替評価差要因*(プラス)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、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す。
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1期	
	2016年2月3日～2016年7月7日	
当期分配金	(円)	49
(対基準価額比率)	(%)	(0.557)
当期の収益	(円)	49
当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	10

(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		項目の概要
	(2016年2月3日~2016年7月7日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	5円	0.055%	(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9,403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。 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 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 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(4)	(0.041)	
(販売会社)	(0)	(0.005)	
(受託会社)	(1)	(0.009)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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	0.012	(d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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)	(0.010)	
(監査費用)	(0)	(0.002)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	6	0.067	

(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
外国債券インデックス マザーファンド	千口 819,050	千円 2,162,844	千口 66,996	千円 170,415

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
金 銭 信 託	百万円 41	百万円 41	% 100.0	百万円 41	百万円 41	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	108	4	3.7	107	4	3.7

(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。

<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
為 替 直 物 取 引	百万円 6,736	百万円 6	% 0.1	百万円 3,970	百万円 238	% 6.0
金 銭 信 託	116,902	116,902	100.0	116,902	116,902	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	103,722	3,531	3.4	103,293	3,279	3.2

<平均保有割合 0.7%>

(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。

自社による当ファンドの設定・解約状況

当作成期首残高 (元)	当作成期設定 元	当作成期解約 元	当作成期末残高 (元)	取引の理由
千円 -	千円 500	千円 500	千円 -	当初設定時における取得およびその解約

組入資産の明細

<親投資信託残高>

	当 作 成 期 末	
	口 数	評 価 額
外国債券インデックス マザーファンド	千口 752,054	千円 1,864,794

(注) 親投資信託の当作成期末現在の受益権総口数は、80,530,118千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
外国債券インデックス マザーファンド	千円 1,864,794	% 99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	11,944	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	1,876,738	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(198,253,098千円)の投資信託財産総額(200,319,448千円)に対する比率は99.0%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=100.98円

1ユーロ=111.95円

1スウェーデンクローナ=11.83円

1ポーランドズロチ=25.22円

1マレーシアリンギット=25.05円

1カナダドル=77.90円

1イギリスポンド=130.50円

1ノルウェークローネ=11.96円

1オーストラリアドル=75.95円

1南アフリカランド=6.85円

1メキシコペソ=5.38円

1スイスフラン=103.55円

1デンマーククローネ=15.04円

1シンガポールドル=74.82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 1 期 末 2016年7月7日現在
(A) 資 産	1,876,738,628円
コール・ローン等	630,831
外国債券インデックス マザーファンド(評価額)	1,864,794,189
未 収 入 金	11,313,608
(B) 負 債	11,087,282
未 払 収 益 分 配 金	10,442,452
未 払 信 託 報 酬	619,041
未 払 利 息	1
そ の 他 未 払 費 用	25,788
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,865,651,346
元 本	2,131,112,832
次 期 繰 越 損 益 金	△265,461,486
(D) 受 益 権 総 口 数	2,131,112,832口
1万口当たり基準価額(C/D)	8.754円

■損益の状況

項 目	第 1 期 自 2016年2月3日 至 2016年7月7日
(A) 配 当 等 収 益	△356円
支 払 利 息	△356
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△119,697,476
売 買 益	7,806,405
売 買 損	△127,503,881
(C) 信 託 報 酬 等	△644,899
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△120,342,731
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△134,676,303
(配 当 等 相 当 額)	(△106)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△134,676,197)
(F) 計 (D+E)	△255,019,034
(G) 収 益 分 配 金	△10,442,452
次 期 繰 越 損 益 金(F+G)	△265,461,486
追 加 信 託 差 損 益 金	△134,676,303
(配 当 等 相 当 額)	(1,031,075)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△135,707,378)
分 配 準 備 積 立 金	1,261,749
繰 越 損 益 金	△132,046,932

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(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) (E) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの第1期首元本額は500,000円、第1期中追加設定元本額は2,373,853,679円、第1期中一部解約元本額は243,240,847円です。

※分配金の計算過程

項 目	第 1 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	11,704,201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
(C) 収益調整金額	1,031,075円
(D) 分配準備積立金額	－円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	12,735,276円
(F) 期末残存口数	2,131,112,832口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	59円
(H) 分配金額(1万口当たり)	49円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	10,442,452円

分配金のお知らせ

	第1期
1万口当たり分配金	49円

(注)分配金は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16期（決算日 2016年5月30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上げます。

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、金額の表記未满是切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、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		債券先物率 組入比率	債券先物率 比	純資産額
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
第12期(2012年5月29日)	17,637	△0.3	290,859	△0.4	98.4	—	196,358
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

(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		債券先物率 組入比率	債券先物率 比
	騰落率	期中騰落率	騰落率	期中騰落率		
(当期首) 2015年 5月29日	円	%		%	%	%
	28,802	—	477,014	—	98.2	0.7
6月末	28,389	△1.4	468,925	△1.7	97.9	0.8
7月末	28,753	△0.2	475,956	△0.2	98.0	0.6
8月末	28,302	△1.7	467,181	△2.1	98.0	0.5
9月末	28,230	△2.0	465,877	△2.3	97.9	0.7
10月末	28,244	△1.9	467,317	△2.0	97.8	1.0
11月末	28,226	△2.0	467,104	△2.1	98.3	0.5
12月末	27,833	△3.4	459,321	△3.7	98.5	0.3
2016年 1月末	28,268	△1.9	459,284	△3.7	98.2	0.4
2月末	26,822	△6.9	444,836	△6.7	98.5	0.3
3月末	27,314	△5.2	451,281	△5.4	98.0	0.9
4月末	26,436	△8.2	443,058	△7.1	97.6	1.1
(当期末) 2016年 5月30日	26,579	△7.7	436,679	△8.5	97.9	0.9

(注1)騰落率は期首比です。

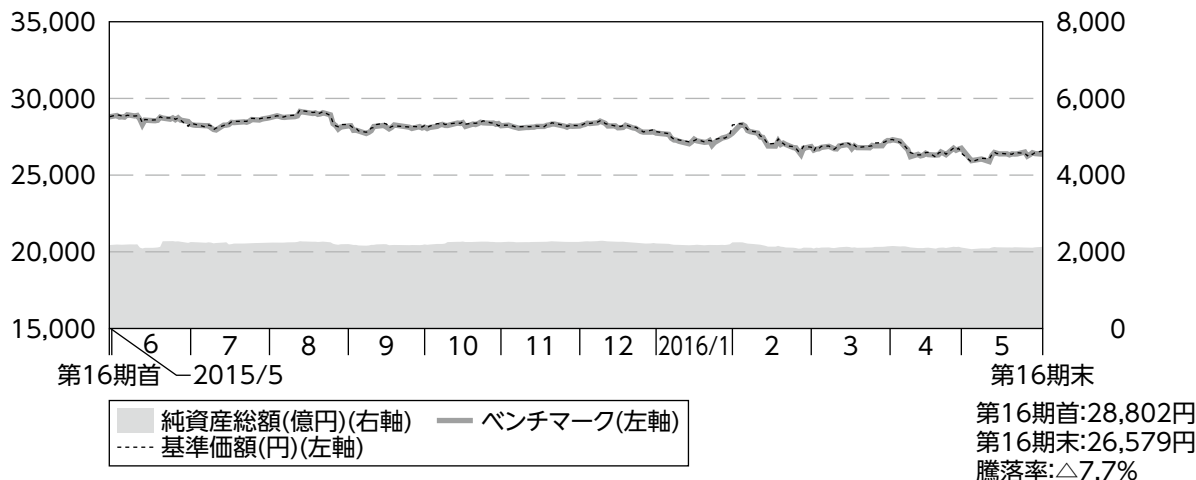
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

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

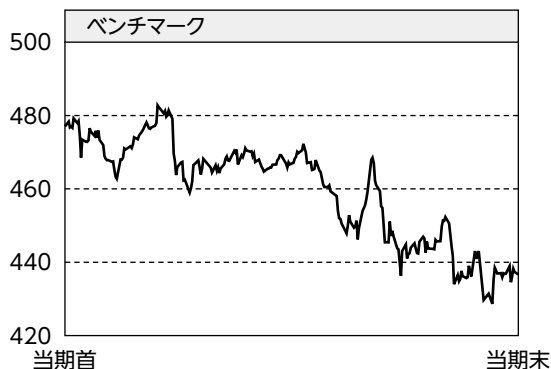


(注)ベンチマークは、2015年5月29日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

基準価額は、2015年7月上旬にかけてギリシャの債務問題を背景に乱高下しましたが、その後8月中旬までは、ギリシャに対する新たな金融支援合意への期待などから外国為替市場で円安推移となったことから上昇しました。8月中旬に世界的な株値急落を受けて円高となったことから一旦下落した後、12月上旬にかけて為替が安定的に推移する中、債券市場でも米国の利上げ観測が金利上昇(債券価格下落)要因となった一方で世界経済の減速懸念が金利低下(債券価格上昇)要因となったことから、基準価額はもみ合い推移となりました。12月上旬からは、世界経済の先行き不透明感の強まりを背景に金利が低下基調で推移したものの、外国為替市場ではリスク回避から円高が進み、基準価額は下落基調となりました。2016年1月末に日銀がマイナス金利政策の導入を決定すると急激な円安となったことから、基準価額は一旦上昇しましたが、その後は米国の利上げペースは緩やかになるという見方を受けて再度円高基調となったことから、下落が続きました。期末の基準価額は期首から下落しました。

投資環境



主要国の長期金利は、米国の利上げ観測の強まりを受けて上昇圧力が強まる局面もありましたが、期を通じては世界経済の先行き不透明感の強まりやリスク回避の動きから、低下基調で推移しました。

外国為替市場では、2015年12月にかけて株価動向や金融政策の見通し変化などから上下動はあったものの、概ねレンジ内での推移となりました。12月後半以降期末にかけては、2016年1月末に日銀がマイナス金利政策の導入を決定すると急激な円安となる場面もありましたが、原油安や株安を受けて米国の利上げペースは緩やかになるという見方やリスク回避姿勢が強まったことから、概ね円高基調推移となりました。

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

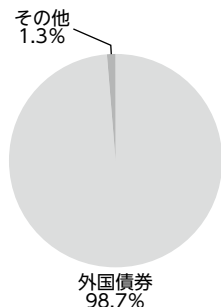
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	T 2.125% 05/15/25	アメリカ	0.7%
2	T 2% 08/15/25	アメリカ	0.7%
3	T 1.5% 12/31/18	アメリカ	0.6%
4	T 0.875% 04/30/17	アメリカ	0.6%
5	T 2.875% 05/15/43	アメリカ	0.6%
6	T 1.375% 04/30/20	アメリカ	0.5%

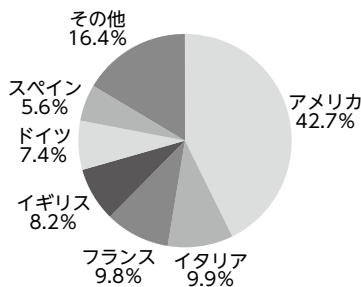
順位	銘柄名	国	組入比率
7	T 1.25% 03/31/21	アメリカ	0.5%
8	T 0.625% 04/30/18	アメリカ	0.5%
9	T 2.75% 12/31/17	アメリカ	0.5%
10	T 1% 06/30/19	アメリカ	0.5%
組入銘柄数		646	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

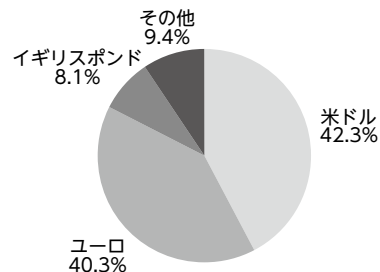
○資産別配分



○国別配分



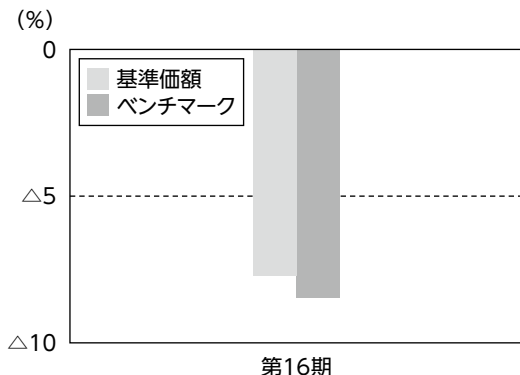
○通貨別配分



(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		項目の概要
	(2015年5月30日~2016年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 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	7	0.025	(c) 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)	(7)	(0.025)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	7	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(27,968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	ア メ リ カ	国 債 証 券	千米ドル 307,415	千米ドル 239,802
	カ ナ ダ	国 債 証 券	千カナダドル 21,141	千カナダドル 19,986
	メ キ シ コ	国 債 証 券	千メキシコペソ 109,116	千メキシコペソ 67,834
	ド イ ツ	国 債 証 券	千ユーロ 35,002	千ユーロ 30,809
	イ タ リ ア	国 債 証 券	43,581	32,049
	フ ラ ン ス	国 債 証 券	41,404	26,295
	オ ラ ン ダ	国 債 証 券	10,066	10,043
	ス ペ イ ン	国 債 証 券	26,900	18,714
	ベ ル ギ ー	国 債 証 券	9,519	6,250
	オ ー ス ト リ ア	国 債 証 券	5,411	4,299
国	フ ィ ン ラ ン ド	国 債 証 券	2,271	1,172
	ア イ ル ラ ン ド	国 債 証 券	2,385	926
	イ ギ リ ス	国 債 証 券	千イギリスポンド 21,784	千イギリスポンド 15,297
	ス イ ス	国 債 証 券	千スイスフラン 707	千スイスフラン 254
	ス ウ ェ ー デ ン	国 債 証 券	千スウェーデンクローナ 18,830	千スウェーデンクローナ 13,901
	ノ ル ウ ェ ー	国 債 証 券	千ノルウェークローネ 12,621	千ノルウェークローネ 1,496
	デ ン マ ー ク	国 債 証 券	千デンマーククローネ 16,865	千デンマーククローネ 13,822
	ポ ー ラ ン ド	国 債 証 券	千ポーランドズロチ 15,720	千ポーランドズロチ 9,493
	オ ー ス ト ラ リ ア	国 債 証 券	千オーストラリアドル 15,984	千オーストラリアドル 8,909
	シ ン ガ ポ ー ル	国 債 証 券	千シンガポールドル 2,085	千シンガポールドル 1,560
マ レ ー シ ア	国 債 証 券	千マレーシアリンギット 10,665	千マレーシアリンギット 8,886	
南 ア フ リ カ	国 債 証 券	千南アフリカランド 34,877	千南アフリカランド 13,581	

(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		売 建	
		新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額
外 国	債 券 先 物 取 引	百万円 23,481	百万円 23,065	百万円 -	百万円 -

(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	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
為 替 直 物 取 引	百万円 32,603	百万円 75	% 0.2	百万円 20,405	百万円 715	% 3.5
金 銭 信 託	104,219	104,219	100.0	104,002	104,002	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	494,817	26,130	5.3	500,157	26,130	5.2

(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
ア メ リ カ	千米ドル 775,890	千米ドル 806,630	千円 89,318,217	% 41.9	% —	% 17.1	% 15.9	% 9.0
カ ナ ダ	千カナダドル 45,180	千カナダドル 51,110	4,329,577	2.0	—	1.0	0.6	0.5
メ キ シ コ	千メキシコペソ 293,200	千メキシコペソ 323,263	1,939,582	0.9	—	0.6	0.2	0.1
ド イ ツ	千ユーロ 102,730	千ユーロ 125,484	15,422,072	7.2	—	4.3	2.0	0.9
イ タ リ ア	139,930	168,111	20,660,870	9.7	—	6.1	2.6	1.0
フ ラ ン ス	136,210	166,271	20,434,725	9.6	—	6.0	2.6	1.0
オ ラ ン ダ	33,510	40,505	4,978,112	2.3	—	1.5	0.7	0.2
ス ペ イ ン	78,760	93,438	11,483,626	5.4	—	3.0	1.6	0.7
ベルギー	34,960	43,912	5,396,826	2.5	—	1.9	0.4	0.3
オーストリア	21,290	26,229	3,223,637	1.5	—	1.0	0.3	0.2
フィンランド	9,130	10,429	1,281,761	0.6	—	0.3	0.2	0.0
アイルランド	11,780	13,785	1,694,272	0.8	—	0.4	0.3	0.1
イ ギ リ ス	千イギリスポンド 85,790	千イギリスポンド 105,168	17,015,175	8.0	—	5.7	1.8	0.5
ス イ ス	千スイスフラン 4,460	千スイスフラン 5,294	589,379	0.3	—	0.1	0.1	0.1
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 67,620	千スウェーデンクローナ 78,201	1,035,390	0.5	—	0.3	0.2	0.1
ノルウェー	千ノルウェークローネ 44,290	千ノルウェークローネ 48,130	637,725	0.3	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 65,880	千デンマーククローネ 85,797	1,418,236	0.7	—	0.5	0.1	0.0
ポーランド	千ポーランドズロチ 40,830	千ポーランドズロチ 43,579	1,221,086	0.6	—	0.2	0.3	0.1
オーストラリア	千オーストラリアドル 42,060	千オーストラリアドル 46,973	3,733,914	1.8	—	1.0	0.6	0.2
シンガポール	千シンガポールドル 8,820	千シンガポールドル 9,317	747,280	0.4	—	0.2	0.1	0.0
マレーシア	千マレーシアリンギット 35,540	千マレーシアリンギット 35,833	969,646	0.5	—	0.3	0.1	0.1
南アフリカ	千南アフリカランド 137,590	千南アフリカランド 123,054	866,304	0.4	—	0.3	0.1	0.0
合 計	—	—	208,397,422	97.9	—	51.9	30.8	15.2

(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 (%)	期末			
		額面金額	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
(アメリカ)		千米ドル	千米ドル		
国債証券					
T 0.5% 07/31/17	0.5	2,000	1,993	220,767	2017/7/31
T 0.625% 04/30/18	0.625	10,000	9,947	1,101,525	2018/4/30
T 0.625% 08/31/17	0.625	7,000	6,985	773,490	2017/8/31
T 0.625% 09/30/17	0.625	1,000	997	110,468	2017/9/30
T 0.625% 11/30/17	0.625	5,000	4,984	551,887	2017/11/30
T 0.75% 02/28/18	0.75	4,400	4,390	486,117	2018/2/28
T 0.75% 04/15/18	0.75	3,000	2,991	331,249	2018/4/15
T 0.75% 06/30/17	0.75	6,000	6,000	664,457	2017/6/30
T 0.75% 12/31/17	0.75	2,900	2,895	320,608	2017/12/31
T 0.875% 01/15/18	0.875	5,200	5,200	575,885	2018/1/15
T 0.875% 01/31/18	0.875	5,500	5,500	609,062	2018/1/31
T 0.875% 04/30/17	0.875	11,600	11,620	1,286,700	2017/4/30
T 0.875% 07/15/17	0.875	4,000	4,005	443,508	2017/7/15
T 0.875% 07/31/19	0.875	5,500	5,464	605,054	2019/7/31
T 0.875% 08/15/17	0.875	8,800	8,809	975,508	2017/8/15
T 0.875% 10/15/17	0.875	6,200	6,204	687,022	2017/10/15
T 0.875% 10/15/18	0.875	4,000	3,990	441,899	2018/10/15
T 0.875% 11/15/17	0.875	1,500	1,500	166,185	2017/11/15
T 1% 03/15/18	1.0	2,800	2,804	310,595	2018/3/15
T 1% 05/15/18	1.0	5,550	5,559	615,559	2018/5/15
T 1% 05/31/18	1.0	5,000	5,008	554,558	2018/5/31
T 1% 06/30/19	1.0	9,000	8,982	994,584	2019/6/30
T 1% 09/15/18	1.0	5,200	5,204	576,268	2018/9/15
T 1% 09/30/19	1.0	4,000	3,984	441,250	2019/9/30
T 1% 11/30/19	1.0	6,300	6,267	693,974	2019/11/30
T 1.125% 04/30/20	1.125	2,000	1,990	220,456	2020/4/30
T 1.125% 06/15/18	1.125	3,000	3,011	333,513	2018/6/15
T 1.125% 12/31/19	1.125	3,050	3,044	337,066	2019/12/31
T 1.25% 01/31/19	1.25	900	905	100,289	2019/1/31
T 1.25% 01/31/20	1.25	8,520	8,533	944,967	2020/1/31
T 1.25% 02/29/20	1.25	3,400	3,405	377,048	2020/2/29
T 1.25% 03/31/21	1.25	10,000	9,934	1,100,033	2021/3/31
T 1.25% 10/31/18	1.25	6,500	6,541	724,383	2018/10/31
T 1.25% 10/31/19	1.25	5,500	5,522	611,453	2019/10/31
T 1.25% 11/30/18	1.25	6,550	6,591	729,871	2018/11/30
T 1.375% 01/31/20	1.375	5,000	5,031	557,175	2020/1/31
T 1.375% 01/31/21	1.375	4,800	4,798	531,389	2021/1/31
T 1.375% 02/28/19	1.375	2,100	2,120	234,758	2019/2/28
T 1.375% 03/31/20	1.375	4,880	4,904	543,116	2020/3/31
T 1.375% 04/30/20	1.375	10,000	10,045	1,112,295	2020/4/30
T 1.375% 05/31/20	1.375	1,550	1,556	172,362	2020/5/31
T 1.375% 06/30/18	1.375	2,200	2,220	245,851	2018/6/30
T 1.375% 09/30/18	1.375	3,900	3,937	435,971	2018/9/30
T 1.375% 09/30/20	1.375	4,000	4,006	443,620	2020/9/30
T 1.375% 10/31/20	1.375	6,000	6,006	665,106	2020/10/31
T 1.375% 12/31/18	1.375	3,000	3,028	335,369	2018/12/31
T 1.5% 01/31/19	1.5	2,000	2,025	224,306	2019/1/31
T 1.5% 01/31/22	1.5	4,500	4,495	497,769	2022/1/31
T 1.5% 02/28/19	1.5	2,000	2,026	224,353	2019/2/28
T 1.5% 02/28/23	1.5	2,400	2,376	263,193	2023/2/28
T 1.5% 03/31/19	1.5	4,400	4,459	493,777	2019/3/31
T 1.5% 03/31/23	1.5	4,000	3,958	438,300	2023/3/31
T 1.5% 05/31/19	1.5	8,000	8,104	897,414	2019/5/31
T 1.5% 08/31/18	1.5	5,800	5,871	650,149	2018/8/31
T 1.5% 10/31/19	1.5	3,550	3,592	397,797	2019/10/31
T 1.5% 11/30/19	1.5	5,000	5,057	560,029	2019/11/30
T 1.5% 12/31/18	1.5	11,500	11,648	1,289,784	2018/12/31
T 1.625% 02/15/26	1.625	3,000	2,936	325,182	2026/2/15
T 1.625% 03/31/19	1.625	3,000	3,049	337,639	2019/3/31

銘柄	利率 (%)	期末			
		額面金額	評価額		
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
T 1.625% 04/30/19	1.625	5,000	5,082	562,819	2019/4/30
T 1.625% 06/30/20	1.625	3,000	3,039	336,524	2020/6/30
T 1.625% 07/31/20	1.625	5,000	5,063	560,678	2020/7/31
T 1.625% 08/15/22	1.625	4,500	4,512	499,657	2022/8/15
T 1.625% 08/31/19	1.625	7,500	7,624	844,310	2019/8/31
T 1.625% 11/15/22	1.625	7,150	7,153	792,090	2022/11/15
T 1.75% 01/31/23	1.75	7,550	7,600	841,612	2023/1/31
T 1.75% 02/28/22	1.75	2,500	2,530	280,215	2022/2/28
T 1.75% 03/31/22	1.75	7,000	7,082	784,223	2022/3/31
T 1.75% 04/30/22	1.75	5,750	5,815	643,972	2022/4/30
T 1.75% 05/15/22	1.75	3,800	3,842	425,441	2022/5/15
T 1.75% 05/15/23	1.75	7,000	7,041	779,681	2023/5/15
T 1.75% 09/30/22	1.75	2,000	2,017	223,354	2022/9/30
T 1.75% 10/31/20	1.75	4,000	4,068	450,463	2020/10/31
T 1.875% 06/30/20	1.875	5,200	5,322	589,347	2020/6/30
T 1.875% 08/31/17	1.875	7,900	8,006	886,504	2017/8/31
T 1.875% 08/31/22	1.875	4,000	4,066	450,307	2022/8/31
T 1.875% 09/30/17	1.875	850	861	95,447	2017/9/30
T 1.875% 10/31/17	1.875	2,500	2,536	280,885	2017/10/31
T 1.875% 11/30/21	1.875	5,400	5,510	610,169	2021/11/30
T 2% 02/15/22	2.0	2,500	2,567	284,275	2022/2/15
T 2% 02/15/23	2.0	2,600	2,660	294,606	2023/2/15
T 2% 02/15/25	2.0	8,400	8,532	944,774	2025/2/15
T 2% 02/28/21	2.0	4,000	4,113	455,437	2021/2/28
T 2% 05/31/21	2.0	3,800	3,907	432,723	2021/5/31
T 2% 07/31/20	2.0	5,200	5,346	591,990	2020/7/31
T 2% 07/31/22	2.0	3,000	3,073	340,319	2022/7/31
T 2% 08/15/25	2.0	12,300	12,469	1,380,786	2025/8/15
T 2% 08/31/21	2.0	6,800	6,988	773,832	2021/8/31
T 2% 09/30/20	2.0	5,000	5,141	569,351	2020/9/30
T 2% 10/31/21	2.0	6,200	6,367	705,997	2021/10/31
T 2% 11/15/21	2.0	2,466	2,466	273,132	2021/11/15
T 2% 11/30/20	2.0	5,500	5,654	626,107	2020/11/30
T 2% 11/30/22	2.0	2,000	2,045	226,503	2022/11/30
T 2.125% 01/31/21	2.125	3,000	3,101	343,453	2021/1/31
T 2.125% 05/15/25	2.125	12,450	12,764	1,413,430	2025/5/15
T 2.125% 06/30/21	2.125	1,000	1,034	114,516	2021/6/30
T 2.125% 06/30/22	2.125	3,500	3,612	400,029	2022/6/30
T 2.125% 08/15/21	2.125	6,100	6,306	698,368	2021/8/15
T 2.125% 08/31/20	2.125	6,500	6,715	743,558	2020/8/31
T 2.125% 09/30/21	2.125	2,000	2,067	228,916	2021/9/30
T 2.125% 12/31/21	2.125	4,500	4,650	514,956	2021/12/31
T 2.25% 03/31/21	2.25	3,050	3,173	351,347	2021/3/31
T 2.25% 04/30/21	2.25	3,500	3,641	403,223	2021/4/30
T 2.25% 07/31/18	2.25	5,300	5,450	603,546	2018/7/31
T 2.25% 11/15/24	2.25	8,150	8,446	935,233	2024/11/15
T 2.25% 11/15/25	2.25	2,900	3,001	332,312	2025/11/15
T 2.25% 11/30/17	2.25	5,000	5,104	565,252	2017/11/30
T 2.375% 05/31/18	2.375	4,000	4,115	455,757	2018/5/31
T 2.375% 08/15/24	2.375	8,500	8,894	984,919	2024/8/15
T 2.375% 12/31/20	2.375	2,300	2,402	266,079	2020/12/31
T 2.5% 02/15/45	2.5	6,300	6,110	676,575	2045/2/15
T 2.5% 02/15/46	2.5	6,900	6,685	740,280	2046/2/15
T 2.5% 05/15/24	2.5	8,400	8,876	982,851	2024/5/15
T 2.5% 08/15/23	2.5	4,550	4,806	532,190	2023/8/15
T 2.625% 01/31/18	2.625	8,000	8,232	911,532	2018/1/31
T 2.625% 04/30/18	2.625	5,000	5,164	571,892	2018/4/30
T 2.625% 08/15/20	2.625	5,500	5,793	641,559	2020/8/15
T 2.625% 11/15/20	2.625	2,000	2,109	233,618	2020/11/15
T 2.75% 02/15/19	2.75	4,600	4,817	533,403	2019/2/15
T 2.75% 02/15/24	2.75	3,000	3,225	357,162	2024/2/15

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評価額 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
T 2.75% 02/28/18	2.75	3,800	3,923	434,440	2018/2/28
T 2.75% 05/31/17	2.75	8,000	8,161	903,677	2017/5/31
T 2.75% 08/15/42	2.75	2,000	2,060	228,190	2042/8/15
T 2.75% 11/15/23	2.75	6,900	7,413	820,921	2023/11/15
T 2.75% 11/15/42	2.75	4,200	4,319	478,300	2042/11/15
T 2.75% 12/31/17	2.75	9,100	9,368	1,037,380	2017/12/31
T 2.875% 03/31/18	2.875	5,250	5,439	602,360	2018/3/31
T 2.875% 05/15/43	2.875	10,300	10,826	1,198,836	2043/5/15
T 2.875% 08/15/45	2.875	7,650	8,009	886,857	2045/8/15
T 3% 05/15/42	3.0	3,950	4,268	472,647	2042/5/15
T 3% 05/15/45	3.0	3,500	3,756	415,947	2045/5/15
T 3% 11/15/44	3.0	6,300	6,763	748,951	2044/11/15
T 3.125% 02/15/43	3.125	1,000	1,103	122,213	2043/2/15
T 3.125% 04/30/17	3.125	6,500	6,643	735,686	2017/4/30
T 3.125% 05/15/19	3.125	5,000	5,302	587,171	2019/5/15
T 3.125% 05/15/21	3.125	5,300	5,735	635,067	2021/5/15
T 3.125% 08/15/44	3.125	6,500	7,151	791,846	2044/8/15
T 3.125% 11/15/41	3.125	4,800	5,316	588,640	2041/11/15
T 3.375% 05/15/44	3.375	4,000	4,613	510,811	2044/5/15
T 3.5% 02/15/18	3.5	5,700	5,953	659,242	2018/2/15
T 3.5% 02/15/39	3.5	2,000	2,370	262,538	2039/2/15
T 3.625% 02/15/21	3.625	5,500	6,062	671,272	2021/2/15
T 3.625% 02/15/44	3.625	5,000	6,035	668,326	2044/2/15
T 3.625% 08/15/19	3.625	2,700	2,916	322,982	2019/8/15
T 3.625% 08/15/43	3.625	2,000	2,417	267,685	2043/8/15
T 3.75% 08/15/41	3.75	3,200	3,924	434,608	2041/8/15
T 3.75% 11/15/18	3.75	5,000	5,338	591,161	2018/11/15
T 3.75% 11/15/43	3.75	2,300	2,842	314,787	2043/11/15
T 3.875% 08/15/40	3.875	2,700	3,371	373,363	2040/8/15
T 4.0% 08/15/18	4.0	3,300	3,528	390,666	2018/8/15
T 4.25% 05/15/39	4.25	900	1,186	131,340	2039/5/15
T 4.25% 11/15/17	4.25	2,550	2,676	296,319	2017/11/15
T 4.25% 11/15/40	4.25	1,450	1,912	211,742	2040/11/15
T 4.375% 02/15/38	4.375	1,000	1,344	148,851	2038/2/15
T 4.375% 05/15/40	4.375	3,000	4,023	445,523	2040/5/15
T 4.375% 11/15/39	4.375	2,700	3,618	400,667	2039/11/15
T 4.5% 02/15/36	4.5	1,840	2,509	277,846	2036/2/15
T 4.5% 05/15/17	4.5	4,800	4,973	550,719	2017/5/15
T 4.5% 05/15/38	4.5	1,000	1,367	151,369	2038/5/15
T 4.5% 08/15/39	4.5	250	341	37,770	2039/8/15
T 4.625% 02/15/40	4.625	3,900	5,409	598,968	2040/2/15
T 4.75% 08/15/17	4.75	3,500	3,667	406,137	2017/8/15
T 5.0% 05/15/37	5.0	1,100	1,599	177,142	2037/5/15
T 5.25% 02/15/29	5.25	400	545	60,351	2029/2/15
T 5.25% 11/15/28	5.25	1,300	1,765	195,458	2028/11/15
T 5.375% 02/15/31	5.375	1,600	2,273	251,779	2031/2/15
T 5.5% 08/15/28	5.5	1,200	1,656	183,472	2028/8/15
T 6.0% 02/15/26	6.0	1,700	2,331	258,162	2026/2/15
T 6.125% 11/15/27	6.125	950	1,358	150,397	2027/11/15
T 6.25% 05/15/30	6.25	1,100	1,663	184,184	2030/5/15
T 6.25% 08/15/23	6.25	1,650	2,166	239,924	2023/8/15
T 8.0% 11/15/21	8.0	1,700	2,283	252,823	2021/11/15
T 8.125% 08/15/19	8.125	2,100	2,565	284,062	2019/8/15
小 計				89,318,217	
(カナダ) 国債証券		千カナダドル	千カナダドル		
CAN 0.25% 05/01/18	0.25	900	893	75,670	2018/5/1
CAN 0.75% 03/01/21	0.75	1,250	1,248	105,769	2021/3/1
CAN 0.75% 09/01/20	0.75	1,700	1,701	144,119	2020/9/1
CAN 1.25% 02/01/18	1.25	1,350	1,363	115,511	2018/2/1
CAN 1.25% 03/01/18	1.25	3,640	3,679	311,676	2018/3/1
CAN 1.25% 08/01/17	1.25	2,250	2,266	191,986	2017/8/1
CAN 1.25% 09/01/18	1.25	500	506	42,933	2018/9/1

銘柄	利率 (%)	期 末			
		額面金額	評価額 外貨建金額	額 邦貨換算金額 (千円)	償還年月日
CAN 1.5% 03/01/20	1.5	1,450	1,492	126,447	2020/3/1
CAN 1.5% 06/01/23	1.5	1,450	1,497	126,828	2023/6/1
CAN 1.5% 06/01/26	1.5	1,280	1,297	109,947	2026/6/1
CAN 1.5% 09/01/17	1.5	2,800	2,830	239,763	2017/9/1
CAN 1.75% 03/01/19	1.75	1,400	1,442	122,221	2019/3/1
CAN 1.75% 09/01/19	1.75	850	879	74,466	2019/9/1
CAN 2.25% 06/01/25	2.25	1,550	1,683	142,640	2025/6/1
CAN 2.5% 06/01/24	2.5	1,700	1,878	159,111	2024/6/1
CAN 2.75% 06/01/22	2.75	1,550	1,716	145,378	2022/6/1
CAN 2.75% 12/01/48	2.75	1,000	1,179	99,902	2048/12/1
CAN 2.75% 12/01/64	2.75	420	524	44,407	2064/12/1
CAN 3.25% 06/01/21	3.25	1,690	1,892	160,325	2021/6/1
CAN 3.5% 06/01/20	3.5	1,800	1,997	169,185	2020/6/1
CAN 3.5% 12/01/45	3.5	1,810	2,421	205,096	2045/12/1
CAN 3.75% 06/01/19	3.75	2,300	2,509	212,554	2019/6/1
CAN 4% 06/01/17	4.0	1,400	1,447	122,619	2017/6/1
CAN 4.0% 06/01/41	4.0	1,970	2,742	232,304	2041/6/1
CAN 4.25% 06/01/18	4.25	2,100	2,250	190,634	2018/6/1
CAN 5% 06/01/37	5.0	1,600	2,431	205,951	2037/6/1
CAN 5.75% 06/01/29	5.75	1,550	2,293	194,277	2029/6/1
CAN 5.75% 06/01/33	5.75	1,560	2,444	209,071	2033/6/1
CAN 8.0% 06/01/27	8.0	360	599	50,756	2027/6/1
小 計				4,329,577	
(メキシコ) 国債証券		千メキシコペソ	千メキシコペソ		
MBONO 10% 11/20/36	10.0	12,000	16,253	97,520	2036/11/20
MBONO 10% 12/05/24	10.0	19,100	24,235	145,413	2024/12/5
MBONO 4.75% 06/14/18	4.75	21,150	21,133	126,802	2018/6/14
MBONO 5% 06/15/17	5.0	21,800	21,954	131,724	2017/6/15
MBONO 5% 12/11/19	5.0	12,300	12,186	73,117	2019/12/11
MBONO 6.5% 06/09/22	6.5	11,800	12,261	73,567	2022/6/9
MBONO 6.5% 06/10/21	6.5	24,000	24,993	149,961	2021/6/10
MBONO 7.5% 06/03/27	7.5	14,700	16,125	96,754	2027/6/3
MBONO 7.75% 05/29/31	7.75	24,550	27,148	162,889	2031/5/29
MBONO 7.75% 11/13/42	7.75	11,300	12,526	75,160	2042/11/13
MBONO 7.75% 12/14/17	7.75	25,700	27,043	162,258	2017/12/14
MBONO 8% 06/11/20	8.0	14,500	15,878	95,273	2020/6/11
MBONO 8% 12/07/23	8.0	28,600	32,245	193,472	2023/12/7
MBONO 8.5% 05/31/29	8.5	15,600	18,397	110,382	2029/5/31
MBONO 8.5% 11/18/38	8.5	16,500	19,633	117,802	2038/11/18
MBONO 8.5% 12/13/18	8.5	19,600	21,246	127,480	2018/12/13
小 計				1,939,582	
(ドイツ) 国債証券		千ユーロ	千ユーロ		
DBR 0.5% 02/15/25	0.5	2,400	2,508	308,318	2025/2/15
DBR 0.5% 02/15/26	0.5	1,950	2,020	248,347	2026/2/15
DBR 1% 08/15/24	1.0	1,150	1,252	153,978	2024/8/15
DBR 1% 08/15/25	1.0	3,000	3,261	400,843	2025/8/15
DBR 1.5% 02/15/23	1.5	2,750	3,075	378,006	2023/2/15
DBR 1.5% 05/15/23	1.5	1,950	2,187	268,836	2023/5/15
DBR 1.5% 05/15/24	1.5	3,390	3,830	470,780	2024/5/15
DBR 1.5% 09/04/22	1.5	1,450	1,614	198,459	2022/9/4
DBR 1.75% 02/15/24	1.75	2,970	3,408	418,954	2024/2/15
DBR 1.75% 07/04/22	1.75	2,700	3,041	373,814	2022/7/4
DBR 2% 01/04/22	2.0	3,150	3,567	438,476	2022/1/4
DBR 2% 08/15/23	2.0	1,100	1,276	156,913	2023/8/15
DBR 2.25% 09/04/20	2.25	2,500	2,793	343,311	2020/9/4
DBR 2.25% 09/04/21	2.25	2,000	2,280	280,242	2021/9/4
DBR 2.5% 01/04/21	2.5	3,000	3,409	418,974	2021/1/4
DBR 2.5% 07/04/44	2.5	2,000	2,841	349,163	2044/7/4
DBR 2.5% 08/15/46	2.5	1,780	2,563	315,043	2046/8/15
DBR 3% 07/04/20	3.0	2,300	2,630	323,317	2020/7/4
DBR 3.25% 01/04/20	3.25	4,700	5,342	656,638	2020/1/4

外国債券インデックス マザーファンド ー第16期ー

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)	
DBR 3.25% 07/04/21	3.25	2,250	2,671	328,377	2021/7/4
DBR 3.25% 07/04/42	3.25	1,900	2,999	368,609	2042/7/4
DBR 3.5% 07/04/19	3.5	3,500	3,938	484,086	2019/7/4
DBR 3.75% 01/04/19	3.75	4,150	4,615	567,253	2019/1/4
DBR 4.0% 01/04/18	4.0	2,650	2,843	349,427	2018/1/4
DBR 4.0% 01/04/37	4.0	2,700	4,432	544,752	2037/1/4
DBR 4.25% 07/04/17	4.25	4,700	4,946	607,955	2017/7/4
DBR 4.25% 07/04/48	4.25	4,550	5,008	615,564	2018/7/4
DBR 4.25% 07/04/39	4.25	1,650	2,885	354,677	2039/7/4
DBR 4.75% 07/04/28	4.75	1,200	1,850	227,404	2028/7/4
DBR 4.75% 07/04/34	4.75	2,450	4,215	518,081	2034/7/4
DBR 4.75% 07/04/40	4.75	2,000	3,765	462,797	2040/7/4
DBR 5.5% 01/04/31	5.5	2,200	3,788	465,647	2031/1/4
DBR 5.625% 01/04/28	5.625	1,550	2,517	309,372	2028/1/4
DBR 6.25% 01/04/24	6.25	1,600	2,387	293,456	2024/1/4
DBR 6.25% 01/04/30	6.25	1,050	1,885	231,714	2030/1/4
DBR 6.5% 07/04/27	6.5	1,550	2,637	324,191	2027/7/4
OBL 0.25% 04/13/18	0.25	2,100	2,131	261,900	2018/4/13
OBL 0.25% 10/11/19	0.25	1,450	1,488	182,894	2019/10/11
OBL 0.25% 10/16/20	0.25	2,400	2,474	304,083	2020/10/16
OBL 0.5% 02/23/18	0.5	2,900	2,951	362,793	2018/2/23
OBL 0.5% 04/12/19	0.5	1,090	1,122	137,957	2019/4/12
OBL 0.5% 10/13/17	0.5	2,750	2,788	342,737	2017/10/13
OBL 1% 10/12/18	1.0	2,150	2,228	273,915	2018/10/12
(イタリア)					
国債証券					
BTPS 0.25% 05/15/18	0.25	2,500	2,515	309,096	2018/5/15
BTPS 0.3% 10/15/18	0.3	1,000	1,007	123,828	2018/10/15
BTPS 0.65% 11/01/20	0.65	1,500	1,523	187,292	2020/11/1
BTPS 0.75% 01/15/18	0.75	2,600	2,634	323,829	2018/1/15
BTPS 0.95% 03/15/23	0.95	1,500	1,513	185,960	2023/3/15
BTPS 1.05% 12/01/19	1.05	1,200	1,240	152,403	2019/12/1
BTPS 1.15% 05/15/17	1.15	800	809	99,536	2017/5/15
BTPS 1.35% 04/15/22	1.35	3,250	3,387	416,354	2022/4/15
BTPS 1.45% 09/15/22	1.45	1,000	1,046	128,644	2022/9/15
BTPS 1.5% 06/01/25	1.5	1,600	1,632	200,656	2025/6/1
BTPS 1.5% 08/01/19	1.5	2,400	2,509	308,426	2019/8/1
BTPS 1.6% 06/01/26	1.6	1,600	1,624	199,695	2026/6/1
BTPS 1.65% 03/01/32	1.65	800	775	95,248	2032/3/1
BTPS 2% 12/01/25	2.0	600	634	78,005	2025/12/1
BTPS 2.15% 12/15/21	2.15	2,500	2,722	334,587	2021/12/15
BTPS 2.25% 09/01/36	2.25	900	906	111,394	2036/9/1
BTPS 2.5% 05/01/19	2.5	2,500	2,678	329,219	2019/5/1
BTPS 2.5% 12/01/24	2.5	2,450	2,707	332,812	2024/12/1
BTPS 2.7% 03/01/47	2.7	1,050	1,084	133,304	2047/3/1
BTPS 3.25% 09/01/46	3.25	1,550	1,789	219,973	2046/9/1
BTPS 3.5% 03/01/30	3.5	2,460	2,973	365,482	2030/3/1
BTPS 3.5% 06/01/18	3.5	1,600	1,713	210,592	2018/6/1
BTPS 3.5% 11/01/17	3.5	2,000	2,101	258,302	2017/11/1
BTPS 3.5% 12/01/18	3.5	3,200	3,482	427,965	2018/12/1
BTPS 3.75% 03/01/21	3.75	4,700	5,452	670,059	2021/3/1
BTPS 3.75% 05/01/21	3.75	1,550	1,802	221,491	2021/5/1
BTPS 3.75% 08/01/21	3.75	4,000	4,676	574,761	2021/8/1
BTPS 3.75% 09/01/24	3.75	3,300	3,970	488,014	2024/9/1
BTPS 4% 02/01/37	4.0	3,050	3,929	482,957	2037/2/1
BTPS 4% 09/01/20	4.0	3,550	4,114	505,637	2020/9/1
BTPS 4.25% 02/01/19	4.25	3,800	4,232	520,143	2019/2/1
BTPS 4.25% 03/01/20	4.25	4,500	5,194	638,391	2020/3/1
BTPS 4.25% 09/01/19	4.25	2,650	3,008	369,787	2019/9/1
BTPS 4.5% 02/01/18	4.5	2,400	2,582	317,437	2018/2/1
BTPS 4.5% 02/01/20	4.5	1,650	1,914	235,281	2020/2/1
BTPS 4.5% 03/01/19	4.5	2,650	2,978	366,016	2019/3/1
BTPS 4.5% 03/01/24	4.5	2,450	3,079	378,425	2024/3/1

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)	
BTPS 4.5% 03/01/26	4.5	2,800	3,594	441,748	2026/3/1
BTPS 4.5% 05/01/23	4.5	2,050	2,556	314,195	2023/5/1
BTPS 4.5% 08/01/18	4.5	1,800	1,977	243,001	2018/8/1
BTPS 4.75% 05/01/17	4.75	3,770	3,939	484,224	2017/5/1
BTPS 4.75% 06/01/17	4.75	1,700	1,783	219,144	2017/6/1
BTPS 4.75% 08/01/23	4.75	3,650	4,636	569,806	2023/8/1
BTPS 4.75% 09/01/21	4.75	2,400	2,934	360,622	2021/9/1
BTPS 4.75% 09/01/28	4.75	2,750	3,681	452,491	2028/9/1
BTPS 4.75% 09/01/44	4.75	1,800	2,618	321,806	2044/9/1
BTPS 5% 03/01/22	5.0	2,250	2,810	345,468	2022/3/1
BTPS 5% 03/01/25	5.0	4,500	5,902	725,408	2025/3/1
BTPS 5% 08/01/34	5.0	2,650	3,796	466,643	2034/8/1
BTPS 5% 09/01/40	5.0	2,650	3,893	478,486	2040/9/1
BTPS 5.0% 08/01/39	5.0	2,200	3,234	397,461	2039/8/1
BTPS 5.25% 08/01/17	5.25	900	956	117,555	2017/8/1
BTPS 5.25% 11/01/29	5.25	3,300	4,660	572,820	2029/11/1
BTPS 5.5% 09/01/22	5.5	3,400	4,401	541,001	2022/9/1
BTPS 5.5% 11/01/22	5.5	1,950	2,530	311,038	2022/11/1
BTPS 5.75% 02/01/33	5.75	3,127	384,425	2033/2/1	
BTPS 6% 05/01/31	6.0	4,350	6,666	819,300	2031/5/1
BTPS 6.5% 11/01/27	6.5	2,000	3,013	370,325	2027/11/1
BTPS 7.25% 11/01/26	7.25	1,400	2,180	267,997	2026/11/1
BTPS 9% 11/01/23	9.0	800	1,260	154,878	2023/11/1
(フランス)					
国債証券					
BTNS 1% 07/25/17	1.0	3,600	3,661	450,030	2017/7/25
FRTR 0.25% 11/25/20	0.25	2,600	2,660	326,975	2020/11/25
FRTR 0.5% 05/25/25	0.5	4,200	4,273	525,197	2025/5/25
FRTR 0.5% 05/25/26	0.5	1,300	1,305	160,456	2026/5/25
FRTR 0.5% 11/25/19	0.5	4,300	4,430	544,567	2019/11/25
FRTR 1% 05/25/18	1.0	4,750	4,887	600,660	2018/5/25
FRTR 1% 05/25/19	1.0	3,250	3,387	416,306	2019/5/25
FRTR 1% 11/25/18	1.0	2,500	2,589	318,244	2018/11/25
FRTR 1% 11/25/25	1.0	3,700	3,915	481,188	2025/11/25
FRTR 1.25% 05/25/36	1.25	600	603	74,154	2036/5/25
FRTR 1.5% 05/25/31	1.5	1,750	1,893	232,718	2031/5/25
FRTR 1.75% 05/25/23	1.75	3,760	4,221	518,801	2023/5/25
FRTR 1.75% 05/25/66	1.75	450	444	54,580	2066/5/25
FRTR 1.75% 11/25/24	1.75	3,200	3,612	443,967	2024/11/25
FRTR 2.25% 05/25/24	2.25	4,400	5,141	631,842	2024/5/25
FRTR 2.25% 10/25/22	2.25	4,100	4,711	579,017	2022/10/25
FRTR 2.5% 05/25/30	2.5	3,500	4,277	525,759	2030/5/25
FRTR 2.5% 10/25/20	2.5	5,450	6,124	752,683	2020/10/25
FRTR 2.75% 10/25/27	2.75	4,100	5,075	623,780	2027/10/25
FRTR 3% 04/25/22	3.0	4,700	5,574	685,121	2022/4/25
FRTR 3.25% 05/25/45	3.25	2,050	2,935	360,804	2045/5/25
FRTR 3.25% 10/25/21	3.25	5,200	6,171	758,524	2021/10/25
FRTR 3.5% 04/25/20	3.5	5,050	5,812	714,365	2020/4/25
FRTR 3.5% 04/25/26	3.5	3,850	5,009	615,634	2026/4/25
FRTR 3.75% 04/25/21	3.75	4,700	5,624	691,252	2021/4/25
FRTR 3.75% 10/25/19	3.75	3,750	4,282	526,307	2019/10/25
FRTR 4% 04/25/18	4.0	4,480	4,861	597,505	2018/4/25
FRTR 4% 04/25/55	4.0	1,750	2,964	364,314	2055/4/25
FRTR 4% 04/25/60	4.0	1,430	2,461	302,543	2060/4/25
FRTR 4% 10/25/38	4.0	3,180	4,891	601,150	2038/10/25
FRTR 4.25% 04/25/19	4.25	4,100	4,658	572,587	2019/4/25
FRTR 4.25% 10/25/17	4.25	3,450	3,679	452,264	2017/10/25
FRTR 4.25% 10/25/18	4.25	3,900	4,341	533,625	2018/10/25
FRTR 4.25% 10/25/23	4.25	5,150	6,761	830,936	2023/10/25
FRTR 4.5% 04/25/41	4.5	3,320	5,579	685,701	2041/4/25
FRTR 4.75% 04/25/35	4.75	2,950	4,802	590,279	2035/4/25
FRTR 5.5% 04/25/29	5.5	3,750	5,978	734,782	2029/4/25
FRTR 5.75% 10/25/32	5.75	3,420	5,937	729,777	2032/10/25

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)	
FRTR	6.0% 10/25/25	6.0	2,400	3,669	451,007	2025/10/25
FRTR	8.5% 04/25/23	8.5	1,000	1,591	195,653	2023/4/25
FRTR	8.5% 10/25/19	8.5	1,120	1,461	179,651	2019/10/25
(オランダ)						
国債証券						
NETHER	0.25% 01/15/20	0.25	1,900	1,947	239,395	2020/1/15
NETHER	0.25% 07/15/25	0.25	1,750	1,757	215,947	2025/7/15
NETHER	0.5% 07/15/26	0.5	750	762	93,695	2026/7/15
NETHER	1.25% 01/15/18	1.25	850	874	107,430	2018/1/15
NETHER	1.25% 01/15/19	1.25	2,700	2,822	346,929	2019/1/15
NETHER	1.75% 07/15/23	1.75	2,000	2,259	277,747	2023/7/15
NETHER	2% 07/15/24	2.0	1,700	1,967	241,842	2024/7/15
NETHER	2.25% 07/15/22	2.25	1,900	2,186	268,673	2022/7/15
NETHER	2.5% 01/15/33	2.5	1,450	1,868	229,692	2033/1/15
NETHER	2.75% 01/15/47	2.75	1,250	1,837	225,791	2047/1/15
NETHER	3.25% 07/15/21	3.25	2,050	2,427	298,282	2021/7/15
NETHER	3.5% 07/15/20	3.5	1,950	2,267	278,709	2020/7/15
NETHER	3.75% 01/15/23	3.75	1,320	1,661	204,204	2023/1/15
NETHER	3.75% 01/15/42	3.75	1,920	3,189	391,990	2042/1/15
NETHER	4% 01/15/37	4.0	1,630	2,638	324,210	2037/1/15
NETHER	4% 07/15/19	4.0	1,800	2,052	252,263	2019/7/15
NETHER	4.0% 07/15/18	4.0	2,350	2,574	316,431	2018/7/15
NETHER	4.5% 07/15/17	4.5	2,450	2,588	318,129	2017/7/15
NETHER	5.5% 01/15/28	5.5	1,590	2,519	309,638	2028/1/15
NETHER	7.5% 01/15/23	7.5	200	301	37,106	2023/1/15
(スペイン)						
国債証券						
SPGB	0.25% 04/30/18	0.25	3,200	3,221	395,903	2018/4/30
SPGB	0.5% 10/31/17	0.5	2,230	2,249	276,469	2017/10/31
SPGB	0.75% 07/30/21	0.75	800	811	99,714	2021/7/30
SPGB	1.15% 07/30/20	1.15	1,350	1,398	171,936	2020/7/30
SPGB	1.4% 01/31/20	1.4	2,800	2,924	359,397	2020/1/31
SPGB	1.6% 04/30/25	1.6	2,300	2,357	289,704	2025/4/30
SPGB	1.95% 04/30/26	1.95	1,250	1,303	160,230	2026/4/30
SPGB	1.95% 07/30/30	1.95	1,350	1,355	166,586	2030/7/30
SPGB	2.1% 04/30/17	2.1	1,000	1,020	125,461	2017/4/30
SPGB	2.15% 10/31/25	2.15	2,450	2,610	320,804	2025/10/31
SPGB	2.75% 04/30/19	2.75	2,250	2,426	298,261	2019/4/30
SPGB	2.75% 10/31/24	2.75	2,750	3,076	378,138	2024/10/31
SPGB	2.9% 10/31/46	2.9	770	799	98,254	2046/10/31
SPGB	3.75% 10/31/18	3.75	1,400	1,529	187,937	2018/10/31
SPGB	3.8% 04/30/24	3.8	2,800	3,358	412,771	2024/4/30
SPGB	4% 04/30/20	4.0	3,700	4,239	521,086	2020/4/30
SPGB	4.1% 07/30/18	4.1	2,730	2,977	365,975	2018/7/30
SPGB	4.2% 01/31/37	4.2	2,100	2,725	334,955	2037/1/31
SPGB	4.3% 10/31/19	4.3	2,950	3,368	413,963	2019/10/31
SPGB	4.4% 10/31/23	4.4	1,150	1,431	175,971	2023/10/31
SPGB	4.5% 01/31/18	4.5	2,830	3,047	374,542	2018/1/31
SPGB	4.6% 07/30/19	4.6	2,200	2,512	308,821	2019/7/30
SPGB	4.65% 07/30/25	4.65	2,450	3,145	386,546	2025/7/30
SPGB	4.7% 07/30/41	4.7	1,550	2,166	266,216	2041/7/30
SPGB	4.8% 01/31/24	4.8	3,050	3,890	478,097	2024/1/31
SPGB	4.85% 10/31/20	4.85	2,150	2,574	316,425	2020/10/31
SPGB	4.9% 07/30/40	4.9	1,600	2,290	281,474	2040/7/30
SPGB	5.15% 10/31/28	5.15	3,400	4,668	573,740	2028/10/31
SPGB	5.15% 10/31/44	5.15	1,400	2,100	258,159	2044/10/31
SPGB	5.4% 01/31/23	5.4	2,350	3,055	375,472	2023/1/31
SPGB	5.5% 04/30/21	5.5	3,000	3,742	459,964	2021/4/30
SPGB	5.5% 07/30/17	5.5	3,200	3,410	419,181	2017/7/30
SPGB	5.75% 07/30/32	5.75	2,270	3,432	421,806	2032/7/30
SPGB	5.85% 01/31/22	5.85	2,800	3,631	446,361	2022/1/31
SPGB	5.9% 07/30/26	5.9	1,680	2,369	291,235	2026/7/30
SPGB	6.0% 01/31/29	6.0	1,500	2,213	272,053	2029/1/31

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)	
(ベルギー)						
国債証券						
BGB	0.8% 06/22/25	0.8	1,570	1,633	200,721	2025/6/22
BGB	1% 06/22/26	1.0	1,750	1,837	225,771	2026/6/22
BGB	1% 06/22/31	1.0	580	583	71,763	2031/6/22
BGB	1.25% 06/22/18	1.25	980	1,015	124,773	2018/6/22
BGB	1.6% 06/22/47	1.6	460	466	57,390	2047/6/22
BGB	1.9% 06/22/38	1.9	510	569	70,000	2038/6/22
BGB	2.25% 06/22/23	2.25	1,500	1,739	213,824	2023/6/22
BGB	2.6% 06/22/24	2.6	2,140	2,556	314,221	2024/6/22
BGB	3% 06/22/34	3.0	1,000	1,315	161,623	2034/6/22
BGB	3% 09/28/19	3.0	1,230	1,370	168,431	2019/9/28
BGB	3.5% 06/28/17	3.5	670	699	85,912	2017/6/28
BGB	3.75% 06/22/45	3.75	1,010	1,570	192,977	2045/6/22
BGB	3.75% 09/28/20	3.75	2,500	2,945	362,061	2020/9/28
BGB	4% 03/28/18	4.0	1,660	1,797	220,859	2018/3/28
BGB	4% 03/28/22	4.0	1,110	1,382	169,850	2022/3/28
BGB	4% 03/28/32	4.0	1,030	1,494	183,691	2032/3/28
BGB	4.0% 03/28/19	4.0	1,700	1,916	235,480	2019/3/28
BGB	4.25% 03/28/41	4.25	1,890	3,071	377,058	2041/3/28
BGB	4.25% 09/28/21	4.25	2,100	2,604	320,053	2021/9/28
BGB	4.25% 09/28/22	4.25	2,250	2,874	353,217	2022/9/28
BGB	4.5% 03/28/26	4.5	1,550	2,168	266,483	2026/3/28
BGB	5% 03/28/35	5.0	2,020	3,366	413,704	2035/3/28
BGB	5.5% 03/28/28	5.5	1,850	2,882	354,285	2028/3/28
BGB	5.5% 09/28/17	5.5	1,900	2,052	252,216	2017/9/28
(オーストリア)						
国債証券						
RAGB	0.25% 10/18/19	0.25	950	971	119,371	2019/10/18
RAGB	0.75% 10/20/26	0.75	400	411	50,512	2026/10/20
RAGB	1.2% 10/20/25	1.2	700	758	93,179	2025/10/20
RAGB	1.65% 10/21/24	1.65	1,080	1,216	149,468	2024/10/21
RAGB	1.75% 10/20/23	1.75	1,750	1,980	243,387	2023/10/20
RAGB	1.95% 06/18/19	1.95	800	858	105,469	2019/6/18
RAGB	2.4% 05/23/34	2.4	660	819	100,697	2034/5/23
RAGB	3.15% 06/20/44	3.15	820	1,198	147,317	2044/6/20
RAGB	3.4% 11/22/22	3.4	1,200	1,477	181,526	2022/11/22
RAGB	3.5% 09/15/21	3.5	1,770	2,125	261,163	2021/9/15
RAGB	3.65% 04/20/22	3.65	1,100	1,350	165,966	2022/4/20
RAGB	3.8% 01/26/62	3.8	450	801	98,493	2062/1/26
RAGB	3.9% 07/15/20	3.9	1,450	1,707	209,885	2020/7/15
RAGB	4.15% 03/15/37	4.15	1,450	2,294	282,037	2037/3/15
RAGB	4.3% 09/15/17	4.3	1,400	1,487	182,756	2017/9/15
RAGB	4.35% 03/15/19	4.35	1,950	2,211	271,805	2019/3/15
RAGB	4.65% 01/15/18	4.65	1,350	1,463	179,881	2018/1/15
RAGB	4.85% 03/15/26	4.85	950	1,365	167,862	2026/3/15
RAGB	6.25% 07/15/27	6.25	1,060	1,731	212,852	2027/7/15
(フィンランド)						
国債証券						
RFGB	0.375% 09/15/20	0.375	550	566	69,627	2020/9/15
RFGB	0.5% 04/15/26	0.5	470	474	58,351	2026/4/15
RFGB	0.75% 04/15/31	0.75	500	499	61,383	2031/4/15
RFGB	0.875% 09/15/25	0.875	500	525	64,585	2025/9/15
RFGB	1.125% 09/15/18	1.125	550	570	70,104	2018/9/15
RFGB	1.5% 04/15/23	1.5	560	619	76,092	2023/4/15
RFGB	1.625% 09/15/22	1.625	590	654	80,418	2022/9/15
RFGB	2% 04/15/24	2.0	570	655	80,593	2024/4/15
RFGB	2.625% 07/04/42	2.625	480	658	80,926	2042/7/4
RFGB	2.75% 07/04/28	2.75	640	805	99,001	2028/7/4
RFGB	3.375% 04/15/20	3.375	600	687	84,531	2020/4/15
RFGB	3.5% 04/15/21	3.5	700	829	101,935	2021/4/15
RFGB	3.875% 09/15/17	3.875	570	602	74,053	2017/9/15
RFGB	4% 07/04/25	4.0	800	1,071	131,672	2025/7/4

銘柄	利率(%)	期 末			
		額面金額	評 価 額	外貨建金額	邦貨換算金額(千円)
RFBG 4.375% 07/04/19	4.375	1,050	1,208	148,484	2019/7/4
(アイルランド)					
国債証券					
IRISH 0.8% 03/15/22	0.8	1,000	1,039	127,698	2022/3/15
IRISH 1% 05/15/26	1.0	650	664	81,695	2026/5/15
IRISH 2% 02/18/45	2.0	670	709	87,147	2045/2/18
IRISH 2.4% 05/15/30	2.4	800	925	113,751	2030/5/15
IRISH 3.4% 03/18/24	3.4	900	1,099	135,090	2024/3/18
IRISH 3.9% 03/20/23	3.9	750	932	114,610	2023/3/20
IRISH 4.4% 06/18/19	4.4	1,100	1,257	154,522	2019/6/18
IRISH 4.5% 04/18/20	4.5	1,950	2,303	283,091	2020/4/18
IRISH 4.5% 10/18/18	4.5	890	992	122,030	2018/10/18
IRISH 5.4% 03/13/25	5.4	1,400	1,961	241,052	2025/3/13
IRISH 5.5% 10/18/17	5.5	920	995	122,339	2017/10/18
IRISH 5.9% 10/18/19	5.9	750	905	111,242	2019/10/18
ユ ー ロ 計				84,575,904	
(イギリス)					
国債証券					
UKT 1% 09/07/17	1.0	3,550	3,575	578,527	2017/9/7
UKT 1.25% 07/22/18	1.25	3,780	3,844	621,968	2018/7/22
UKT 1.5% 01/22/21	1.5	1,170	1,201	194,367	2021/1/22
UKT 1.5% 07/22/26	1.5	700	696	112,703	2026/7/22
UKT 1.75% 07/22/19	1.75	3,550	3,671	594,020	2019/7/22
UKT 1.75% 09/07/22	1.75	2,850	2,964	479,612	2022/9/7
UKT 2% 07/22/20	2.0	3,300	3,459	559,758	2020/7/22
UKT 2% 09/07/25	2.0	2,420	2,539	410,908	2025/9/7
UKT 2.25% 09/07/23	2.25	2,800	3,002	485,853	2023/9/7
UKT 2.5% 07/22/65	2.5	700	794	128,526	2065/7/22
UKT 2.75% 09/07/24	2.75	2,900	3,222	521,289	2024/9/7
UKT 3.25% 01/22/44	3.25	2,950	3,558	575,798	2044/1/22
UKT 3.5% 01/22/45	3.5	3,000	3,793	613,692	2045/1/22
UKT 3.5% 07/22/68	3.5	2,090	3,046	492,915	2068/7/22
UKT 3.75% 07/22/52	3.75	2,000	2,821	456,539	2052/7/22
UKT 3.75% 09/07/19	3.75	550	606	98,115	2019/9/7
UKT 3.75% 09/07/20	3.75	2,650	2,982	482,612	2020/9/7
UKT 3.75% 09/07/21	3.75	2,350	2,690	435,345	2021/9/7
UKT 4% 01/22/60	4.0	1,750	2,727	441,211	2060/1/22
UKT 4% 03/07/22	4.0	2,050	2,400	388,421	2022/3/7
UKT 4.25% 03/07/36	4.25	2,550	3,423	553,894	2036/3/7
UKT 4.25% 06/07/32	4.25	2,250	2,960	478,936	2032/6/7
UKT 4.25% 09/07/39	4.25	1,670	2,295	371,371	2039/9/7
UKT 4.25% 12/07/27	4.25	1,440	1,840	297,748	2027/12/7
UKT 4.25% 12/07/40	4.25	2,080	2,888	467,386	2040/12/7
UKT 4.25% 12/07/46	4.25	2,100	3,046	492,866	2046/12/7
UKT 4.25% 12/07/49	4.25	1,600	2,398	388,050	2049/12/7
UKT 4.25% 12/07/55	4.25	1,920	3,053	493,987	2055/12/7
UKT 4.5% 03/07/19	4.5	2,300	2,555	413,416	2019/3/7
UKT 4.5% 09/07/34	4.5	2,770	3,796	614,283	2034/9/7
UKT 4.5% 12/07/42	4.5	2,300	3,354	542,767	2042/12/7
UKT 4.75% 03/07/20	4.75	4,150	4,778	773,062	2020/3/7
UKT 4.75% 12/07/30	4.75	2,300	3,150	509,671	2030/12/7
UKT 4.75% 12/07/38	4.75	1,900	2,771	448,345	2038/12/7
UKT 5% 03/07/18	5.0	1,800	1,948	315,272	2018/3/7
UKT 5% 03/07/25	5.0	1,900	2,478	400,935	2025/3/7
UKT 6.0% 12/07/28	6.0	1,250	1,870	302,636	2028/12/7
UKT 8% 06/07/21	8.0	1,250	1,686	272,858	2021/6/7
UKT 8.75% 08/25/17	8.75	1,150	1,270	205,494	2017/8/25
小 計				17,015,175	
(スイス)					
国債証券					
SWISS 2% 04/28/21	2.0	540	614	68,454	2021/4/28
SWISS 2.25% 07/06/20	2.25	400	451	50,266	2020/7/6

銘柄	利率(%)	期 末			
		額面金額	評 価 額	外貨建金額	邦貨換算金額(千円)
SWISS 3% 01/08/18	3.0	1,970	2,093	233,059	2018/1/8
SWISS 4% 02/11/23	4.0	1,060	1,395	155,328	2023/2/11
SWISS 4% 04/08/28	4.0	490	739	82,271	2028/4/8
小 計				589,379	
(スウェーデン)					
国債証券					
SGE 1% 11/12/26	1.0	4,800	4,913	65,057	2026/11/12
SGE 1.5% 11/13/23	1.5	9,600	10,413	137,877	2023/11/13
SGE 2.5% 05/12/25	2.5	7,600	8,915	118,042	2025/5/12
SGE 3.5% 03/30/39	3.5	5,470	7,366	97,539	2039/3/30
SGE 3.5% 06/01/22	3.5	10,650	12,799	169,463	2022/6/1
SGE 3.75% 08/12/17	3.75	8,650	9,104	120,549	2017/8/12
SGE 4.25% 03/12/19	4.25	10,150	11,483	152,045	2019/3/12
SGE 5% 12/01/20	5.0	10,700	13,203	174,814	2020/12/1
小 計				1,035,390	
(ノルウェー)					
国債証券					
NGB 1.5% 02/19/26	1.5	3,100	3,133	41,521	2026/2/19
NGB 1.75% 03/13/25	1.75	3,150	3,260	43,199	2025/3/13
NGB 2% 05/24/23	2.0	7,040	7,465	98,914	2023/5/24
NGB 3% 03/14/24	3.0	5,550	6,290	83,352	2024/3/14
NGB 3.75% 05/25/21	3.75	9,350	10,644	141,034	2021/5/25
NGB 4.25% 05/19/17	4.25	7,650	7,918	104,921	2017/5/19
NGB 4.5% 05/22/19	4.5	8,450	9,417	124,782	2019/5/22
小 計				637,725	
(デンマーク)					
国債証券					
DGB 0.25% 11/15/18	0.25	3,500	3,559	58,834	2018/11/15
DGB 1.5% 11/15/23	1.5	5,800	6,404	105,859	2023/11/15
DGB 1.75% 11/15/25	1.75	7,800	8,788	145,278	2025/11/15
DGB 3% 11/15/21	3.0	11,450	13,422	212,866	2021/11/15
DGB 4% 11/15/17	4.0	5,900	6,292	104,013	2017/11/15
DGB 4% 11/15/19	4.0	11,450	13,191	218,056	2019/11/15
DGB 4.5% 11/15/39	4.5	14,980	26,242	433,975	2039/11/15
DGB 7% 11/10/24	7.0	5,000	7,896	130,532	2024/11/10
小 計				1,418,236	
(ポーランド)					
国債証券					
POLGB 1.5% 04/25/20	1.5	2,600	2,548	71,399	2020/4/25
POLGB 2% 04/25/21	2.0	3,500	3,457	96,884	2021/4/25
POLGB 2.5% 07/25/18	2.5	4,900	4,989	139,814	2018/7/25
POLGB 2.5% 07/25/26	2.5	2,100	2,001	56,074	2026/7/25
POLGB 3.25% 07/25/19	3.25	2,800	2,922	81,890	2019/7/25
POLGB 3.25% 07/25/25	3.25	3,260	3,341	93,627	2025/7/25
POLGB 3.75% 04/25/18	3.75	1,800	1,873	52,484	2018/4/25
POLGB 4% 10/25/23	4.0	3,150	3,412	95,629	2023/10/25
POLGB 5.25% 10/25/17	5.25	4,100	4,314	120,896	2017/10/25
POLGB 5.5% 10/25/19	5.5	2,600	2,865	80,292	2019/10/25
POLGB 5.75% 04/25/29	5.75	1,400	1,766	49,487	2029/4/25
POLGB 5.75% 09/23/22	5.75	2,890	3,426	96,014	2022/9/23
POLGB 5.75% 10/25/21	5.75	3,200	3,749	105,067	2021/10/25
小 計				1,221,086	
(オーストラリア)					
国債証券					
ACGB 1.75% 11/21/20	1.75	1,300	1,300	103,371	2020/11/21
ACGB 2.75% 04/21/24	2.75	2,940	3,071	244,180	2024/4/21
ACGB 2.75% 06/21/35	2.75	650	639	50,873	2035/6/21
ACGB 2.75% 10/21/19	2.75	2,150	2,229	177,211	2019/10/21
ACGB 2.75% 11/21/27	2.75	900	934	74,257	2027/11/21

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)	
ACGB 3.25%	04/21/25	3.25	2,750	2,981	236,993	2025/4/21
ACGB 3.25%	04/21/29	3.25	1,680	1,820	144,746	2029/4/21
ACGB 3.25%	06/21/39	3.25	610	633	50,394	2039/6/21
ACGB 3.25%	10/21/18	3.25	2,050	2,127	169,137	2018/10/21
ACGB 3.75%	04/21/37	3.75	900	1,019	81,006	2037/4/21
ACGB 4.25%	04/21/26	4.25	3,560	4,188	332,948	2026/4/21
ACGB 4.25%	07/21/17	4.25	1,500	1,543	122,692	2017/7/21
ACGB 4.5%	04/15/20	4.5	2,600	2,876	228,659	2020/4/15
ACGB 4.5%	04/21/33	4.5	1,300	1,620	128,773	2033/4/21
ACGB 4.75%	04/21/27	4.75	2,410	2,973	236,344	2027/4/21
ACGB 5.25%	03/15/19	5.25	3,890	4,276	339,915	2019/3/15
ACGB 5.5%	01/21/18	5.5	2,770	2,942	233,900	2018/1/21
ACGB 5.5%	04/21/23	5.5	2,850	3,485	277,068	2023/4/21
ACGB 5.75%	05/15/21	5.75	2,850	3,381	268,784	2021/5/15
ACGB 5.75%	07/15/22	5.75	2,400	2,926	232,653	2022/7/15
小	計				3,733,914	
(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 0.5%	04/01/18	0.5	600	594	47,647	2018/4/1
SIGB 1.375%	10/01/17	1.375	340	342	27,439	2017/10/1
SIGB 1.625%	10/01/19	1.625	110	111	8,927	2019/10/1
SIGB 2%	07/01/20	2.0	150	153	12,299	2020/7/1
SIGB 2.25%	06/01/21	2.25	570	585	46,934	2021/6/1
SIGB 2.375%	06/01/25	2.375	270	275	22,088	2025/6/1
SIGB 2.5%	06/01/19	2.5	900	934	74,922	2019/6/1
SIGB 2.75%	03/01/46	2.75	210	220	17,691	2046/3/1
SIGB 2.75%	04/01/42	2.75	590	619	49,718	2042/4/1
SIGB 2.75%	07/01/23	2.75	420	440	35,360	2023/7/1
SIGB 2.875%	07/01/29	2.875	200	211	16,965	2029/7/1
SIGB 2.875%	09/01/30	2.875	300	316	25,377	2030/9/1
SIGB 3%	09/01/24	3.0	770	823	66,054	2024/9/1
SIGB 3.125%	09/01/22	3.125	720	773	62,002	2022/9/1
SIGB 3.25%	09/01/20	3.25	930	998	80,075	2020/9/1
SIGB 3.375%	09/01/33	3.375	400	451	36,195	2033/9/1
SIGB 3.5%	03/01/27	3.5	710	794	63,732	2027/3/1
SIGB 4%	09/01/18	4.0	630	671	53,846	2018/9/1
小	計				747,280	
(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 3.26%	03/01/18	3.26	2,700	2,716	73,496	2018/3/1
MGS 3.314%	10/31/17	3.314	1,000	1,005	27,219	2017/10/31
MGS 3.418%	08/15/22	3.418	2,200	2,153	58,278	2022/8/15
MGS 3.48%	03/15/23	3.48	2,050	2,007	54,330	2023/3/15
MGS 3.492%	03/31/20	3.492	2,000	2,002	54,184	2020/3/31
MGS 3.502%	05/31/27	3.502	800	759	20,539	2027/5/31
MGS 3.58%	09/28/18	3.58	2,150	2,171	58,753	2018/9/28
MGS 3.654%	10/31/19	3.654	1,600	1,615	43,724	2019/10/31
MGS 3.733%	06/15/28	3.733	1,300	1,250	33,849	2028/6/15
MGS 3.844%	04/15/33	3.844	1,150	1,080	29,239	2033/4/15
MGS 3.889%	07/31/20	3.889	1,500	1,523	41,226	2020/7/31
MGS 3.892%	03/15/27	3.892	750	738	19,974	2027/3/15
MGS 3.955%	09/15/25	3.955	540	545	14,754	2025/9/15
MGS 4.012%	09/15/17	4.012	1,000	1,013	27,436	2017/9/15
MGS 4.048%	09/30/21	4.048	1,700	1,735	46,958	2021/9/30
MGS 4.127%	04/15/32	4.127	1,300	1,275	34,524	2032/4/15
MGS 4.16%	07/15/21	4.16	1,650	1,693	45,816	2021/7/15
MGS 4.181%	07/15/24	4.181	2,100	2,140	57,910	2024/7/15
MGS 4.24%	02/07/18	4.24	1,150	1,175	31,801	2018/2/7
MGS 4.378%	11/29/19	4.378	2,600	2,684	72,650	2019/11/29
MGS 4.392%	04/15/26	4.392	1,800	1,865	50,477	2026/4/15
MGS 4.498%	04/15/30	4.498	500	514	13,920	2030/4/15

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)	
MGS 4.935%	09/30/43	4.935	650	673	18,235	2043/9/30
MGS 5.248%	09/15/28	5.248	1,350	1,490	40,339	2028/9/15
小	計				969,646	
(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	23,100	24,810	174,665	2026/12/21
SAGB 6.25%	03/31/36	6.25	9,620	6,629	46,673	2036/3/31
SAGB 6.5%	02/28/41	6.5	8,850	6,052	42,608	2041/2/28
SAGB 6.75%	03/31/21	6.75	8,020	7,362	51,834	2021/3/31
SAGB 7%	02/28/31	7.0	16,300	12,796	90,086	2031/2/28
SAGB 7.25%	01/15/20	7.25	6,800	6,493	45,715	2020/1/15
SAGB 7.75%	02/28/23	7.75	6,850	6,377	44,900	2023/2/28
SAGB 8%	01/31/30	8.0	3,200	2,781	19,584	2030/1/31
SAGB 8%	12/21/18	8.0	6,400	6,339	44,626	2018/12/21
SAGB 8.25%	03/31/32	8.25	5,800	5,058	35,612	2032/3/31
SAGB 8.25%	09/15/17	8.25	6,200	6,216	43,767	2017/9/15
SAGB 8.5%	01/31/37	8.5	10,450	9,119	64,202	2037/1/31
SAGB 8.75%	01/31/44	8.75	6,350	5,593	39,378	2044/1/31
SAGB 8.75%	02/28/48	8.75	14,950	13,130	92,440	2048/2/28
SAGB 8.875%	02/28/35	8.875	4,700	4,290	30,207	2035/2/28
小	計				866,304	
合	計				208,397,422	

(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	
		買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
外 国	EURO-SCHATZ	219	—
	US 5YR NOTE	345	—
	EURO-BOBL FU	306	—
	EURO-BUND	584	—
	US 10YR NOTE	215	—
	US LONG BOND	144	—

(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
公 社 債	千円 208,397,422	% 97.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,593,849	2.2
投 資 信 託 財 産 総 額	212,991,271	100.0

(注1) 当期末における外貨建純資産(210,684,871千円)の投資信託財産総額(212,991,271千円)に対する比率は98.9%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=110.73円、1カナダドル=84.71円、1メキシコペソ=6.00円、1ユーロ=122.90円、1イギリスポンド=161.79円、1スイスフラン=111.31円、1スウェーデンクローナ=13.24円、1ノルウェークローネ=13.25円、1デンマーククローネ=16.53円、1ポーランドズロチ=28.02円、1オーストラリアドル=79.49円、1シンガポールドル=80.20円、1マレーシアリングギット=27.06円、1南アフリカランド=7.04円です。

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 2016年5月30日現在
(A) 資 産	215,451,013,330円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,719,058,154
公 社 債(評価額)	208,397,422,364
未 収 入 金	2,483,916,133
未 収 利 息	1,683,926,596
前 払 費 用	77,304,031
差 入 委 託 証 拠 金	89,386,052
(B) 負 債	2,489,003,676
未 払 金	2,471,353,616
未 払 解 約 金	17,551,356
未 払 利 息	5,672
そ の 他 未 払 費 用	93,032
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	212,962,009,654
元 本	80,122,655,769
次 期 繰 越 損 益 金	132,839,353,885
(D) 受 益 権 総 口 数	80,122,655,769口
1万口当たり基準価額(C/D)	26,579円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年5月30日 至 2016年5月30日
(A) 配 当 等 収 益	5,280,824,559円
受 取 利 息	5,281,247,827
そ の 他 収 益 金	105,281
支 払 利 息	△528,549
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△22,893,038,071
売 買 益	4,127,373,883
売 買 損	△27,020,411,954
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	23,348,713
取 引 益	86,583,924
取 引 損	△63,235,211
(D) そ の 他 費 用	△51,226,974
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△17,640,091,773
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	142,049,351,813
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	54,662,662,514
(H) 解 約 差 損 益 金	△46,232,568,669
(I) 計 (E+F+G+H)	132,839,353,885
次 期 繰 越 損 益 金(I)	132,839,353,885

(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75,548,796,118円、期中追加設定元本額は29,807,722,078円、期中一部解約元本額は25,233,862,427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)	22,335,708,640円
コア投資戦略ファンド (成長型)	7,155,574,131円
SMT グローバル債券インデックス・オープン	5,232,568,345円
バランスA (25) VA1 (適格機関投資家専用)	3,628,175,000円
バランスC (50) VA1 (適格機関投資家専用)	2,952,353,423円
コア投資戦略ファンド (安定型)	2,871,297,369円
外国債券オープン (毎月決算型)	2,827,495,035円
DC世界経済インデックスファンド	2,470,784,175円
グローバルバランスファンドVA35 (適格機関投資家専用)	2,104,353,594円
世界経済インデックスファンド	1,944,514,097円
FOFs用外国債券オープン (適格機関投資家専用)	1,673,665,009円
SBI資産設計オープン (資産成長型)	1,618,281,121円
世界バランスVA2 (適格機関投資家専用)	1,523,320,834円
DC外国債券インデックス・オープン	1,467,939,547円
分散投資コア戦略ファンドS	1,317,727,090円
世界バランスVA1 (適格機関投資家専用)	1,279,792,209円
DCマイセレクション25	1,180,214,133円
グローバル・インカム&プラス (毎月決算型)	1,063,486,588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)	1,018,942,769円
DCマイセレクション50	986,785,992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)	981,491,926円
バランスD (35) VA1 (適格機関投資家専用)	912,370,552円
バランスB (37.5) VA1 (適格機関投資家専用)	880,563,096円
分散投資コア戦略ファンドA	791,895,037円
バランス50VA2 (適格機関投資家専用)	772,843,004円
財産四分法ファンド (毎月決算型)	740,546,081円
DC世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	673,678,353円
DCマイセレクション75	650,408,120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)	635,557,131円
コア投資戦略ファンド (切替型)	618,014,548円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	553,315,377円
外国債券ファンド・シリーズ1	481,675,587円
DCマイセレクションS25	477,101,874円
外国債券インデックス・オープン (SMA専用)	456,510,431円
バランスF (25) VA1 (適格機関投資家専用)	452,237,335円
バランス50VA1 (適格機関投資家専用)	433,306,418円
DCマイセレクションS50	380,959,393円
バランス25VA2 (適格機関投資家専用)	378,494,913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)	347,452,429円
バランスE (25) VA1 (適格機関投資家専用)	323,725,352円
バランス30VA1 (適格機関投資家専用)	294,271,483円
SMT インデックスバランス・オープン	194,743,164円
外国債券インデックス 為替ヘッジあり (SMA専用)	172,752,437円
DCマイセレクションS75	171,107,093円
世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	155,006,148円
外国債券オープン (3ヶ月決算型)	151,866,285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)	99,856,158円
世界経済インデックスファンド (債券シフト型)	88,976,830円
DCターゲット・イヤーフンド2025	53,049,337円
DC世界経済インデックスファンド (株式シフト型)	49,602,045円
DCターゲット・イヤーフンド2035	40,837,516円
DCターゲット・イヤーフンド2045	16,042,041円

SBI資産設計オープン（分配型）	14,063,448円
マイセクション50VA1（適格機関投資家専用）	8,316,841円
マイセクション25	6,359,182円
マイセクション50	4,341,950円
マイセクション75VA1（適格機関投資家専用）	3,394,518円
マイセクション75	2,943,235円

お知らせ

該当事項はありません。