

バランスセレクト30 (確定拠出年金向け)

バランスセレクト50 (確定拠出年金向け)

バランスセレクト70 (確定拠出年金向け)

運用報告書(全体版)

第15期(決算日2016年5月10日)

作成対象期間 (2015年5月12日～2016年5月10日)

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | | バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) | バランスセレクト50 (確定拠出年金向け) | バランスセレクト70 (確定拠出年金向け) |
|--------|--|---|--------------------------|--------------------------|
| 商品分類 | 追加型投信/内外/資産複合/インデックス型 | | | |
| 信託期間 | 2001年11月22日以降、無期限とします。 | | | |
| 運用方針 | 内外の株式および公社債に実質的に投資し、信託財産の成長を目指して運用を行います。 各マザーファンドへの投資比率は以下を基本とし、原則として3カ月毎にリバランスを行います。 | | | |
| | 国内株式マザーファンド | 20% | 30% | 45% |
| | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 10% | 20% | 25% |
| | 国内債券マザーファンド | 55% | 40% | 20% |
| | 外国債券マザーファンド | 15% | 10% | 10% |
| 主な投資対象 | バランスセレクト30/50/70 (確定拠出年金向け) | 「国内株式マザーファンド」受益証券、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」受益証券、「国内債券マザーファンド」受益証券および「外国債券マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。 なお、株式および公社債に直接投資する場合があります。 | | |
| | 国内株式マザーファンド | わが国の株式を主要投資対象とします。 | | |
| | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 外国の株式を主要投資対象とします。 | | |
| | 国内債券マザーファンド | わが国の公社債を主要投資対象とします。 | | |
| | 外国債券マザーファンド | 外国の公社債を主要投資対象とします。 | | |
| 主な投資制限 | 株式への実質投資割合 | 信託財産の純資産総額の50%未満 | 信託財産の純資産総額の70%未満 | 制限を設けません。 |
| | 外貨建て資産への実質投資割合 | 信託財産の純資産総額の30%以内 | 信託財産の純資産総額の40%以内 | 信託財産の純資産総額の50%以内 |
| | 国内株式マザーファンド | 株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資は行いません。 | | |
| | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 | | |
| | 国内債券マザーファンド | 外貨建て資産への投資は行いません。 | | |
| | 外国債券マザーファンド | 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。 | | |
| 分配方針 | 毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益等から、基準価額水準等を勘案して分配します。 留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。 | | | |

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104

(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

<バランスセレクト30（確定拠出年金向け）>

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配額) | 税金 配分 | 期末 騰落率 | 参考 指数 | 株 式 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 債 券 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 投資信託 証券 組 入 比 率 | 純資 産 額 |
|-----------------|---------------|----------|-----------|----------|----------------------------|-----------------------|----------------------------|-----------------------|--------------------------------|--------------|
| | | | | | | | | | | |
| 11期(2012年5月10日) | 11,174 | 5 | △0.6 | 113.86 | 28.0 | 0.7 | 70.2 | — | 0.2 | 29 |
| 12期(2013年5月10日) | 13,603 | 5 | 21.8 | 138.95 | 30.1 | 0.5 | 68.3 | — | 0.2 | 45 |
| 13期(2014年5月12日) | 13,943 | 5 | 2.5 | 142.85 | 29.1 | 0.6 | 69.3 | — | 0.2 | 48 |
| 14期(2015年5月11日) | 15,742 | 5 | 12.9 | 161.78 | 29.4 | 0.5 | 69.2 | — | 0.2 | 65 |
| 15期(2016年5月10日) | 15,452 | 5 | △1.8 | 158.62 | 28.8 | 0.6 | 69.7 | — | 0.3 | 62 |

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

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

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* '11年10月4日まで、参考指数は、主要投資対象である「国内株式マザーファンド」(ベンチマーク＝東証株価指数(TOPIX))、「外国株式マザーファンド」(ベンチマーク＝FTSE 全世界・日本を除く先進国指数(円ベース))、「国内債券マザーファンド」(ベンチマーク＝NOMURA-BPI国債)、「外国債券マザーファンド」(ベンチマーク＝シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース))の各ベンチマークから、当ファンドが基本とする投資比率(国内株式20%、外国株式10%、国内債券55%、外国債券15%)に基づいて当社で算出し、設定時を100として指数化しておりましたが、「11年10月5日からは、主要投資対象の1つである「外国株式マザーファンド」を、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」に変更したため、参考指数は、「国内株式マザーファンド」(ベンチマーク＝東証株価指数(TOPIX))、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」(ベンチマーク＝MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし))、「国内債券マザーファンド」(ベンチマーク＝NOMURA-BPI国債)、「外国債券マザーファンド」(ベンチマーク＝シティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース))の各ベンチマークから、基本投資比率(国内株式20%、外国株式10%、国内債券55%、外国債券15%)に基づいて独自に合成した指数へ変更しております。なお、投資対象であるマザーファンドの変更以外には、当ファンドの運用方針に一切変更はございません。

* MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)は、MSCIが開発したMSCI-KOKUSAI指数を当社が独自に円換算したものです。円換算にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しております。

* FTSE 全世界・日本を除く先進国指数(円ベース)及びシティ世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値をもとにしております。

(出所) MSCI, FTSE International Limited, Citigroup Index LLC、野村證券株式会社、東京証券取引所、ブルームバーグ

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準 価額 | 騰 落 率 | 参 考 指 数 | 騰 落 率 | 株 式 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 | 債 券 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 投 資 信 託 証 券 組 入 比 率 |
|--------------------|----------|-------------|------------------|-------------|----------------------------|-----------------------|----------------------------|-----------------------|--|
| | | | | | | | | | |
| (期首) 2015年5月11日 | 15,742 | — | 161.78 | — | 29.4 | 0.5 | 69.2 | — | 0.2 |
| 5月末 | 15,987 | 1.6 | 164.35 | 1.6 | 29.9 | 0.6 | 67.8 | — | 0.2 |
| 6月末 | 15,793 | 0.3 | 162.34 | 0.3 | 28.9 | 0.6 | 69.1 | — | 0.2 |
| 7月末 | 15,945 | 1.3 | 164.03 | 1.4 | 29.5 | 0.5 | 68.7 | — | 0.2 |
| 8月末 | 15,557 | △1.2 | 160.02 | △1.1 | 27.8 | 0.5 | 69.9 | — | 0.2 |
| 9月末 | 15,250 | △3.1 | 156.74 | △3.1 | 26.6 | 0.6 | 70.9 | — | 0.2 |
| 10月末 | 15,727 | △0.1 | 161.64 | △0.1 | 28.9 | 0.4 | 69.0 | — | 0.2 |
| 11月末 | 15,782 | 0.3 | 162.27 | 0.3 | 29.0 | 0.5 | 68.8 | — | 0.2 |
| 12月末 | 15,702 | △0.3 | 161.40 | △0.2 | 29.0 | 0.5 | 68.7 | — | 0.2 |
| 2016年1月末 | 15,502 | △1.5 | 158.83 | △1.8 | 29.5 | 0.6 | 67.8 | — | 0.3 |
| 2月末 | 15,172 | △3.6 | 156.09 | △3.5 | 28.3 | 0.5 | 70.1 | — | 0.3 |
| 3月末 | 15,518 | △1.4 | 159.30 | △1.5 | 28.9 | 0.6 | 69.7 | — | 0.3 |
| 4月末 | 15,515 | △1.4 | 159.52 | △1.4 | 29.6 | 0.6 | 69.0 | — | 0.3 |
| (期末) 2016年5月10日 | 15,457 | △1.8 | 158.62 | △2.0 | 28.8 | 0.6 | 69.7 | — | 0.3 |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

<バランスセレクト50（確定拠出年金向け）>

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配額) | 基準価額 | | 参考指数 | 参考指数 | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託組入比率 | 純資産額 総 |
|-----------------|---------------|----------|------------|--------|------------|-----------|----------|-----------|--------|----------|----------|-----------|
| | | 税込 分配 | 騰落率 | | 騰落率 | 騰落率 | | | | | | |
| 11期(2012年5月10日) | 10,587 | 円 5 | % △ 2.6 | 105.39 | % △ 3.3 | % 47.1 | % 1.2 | % 50.7 | % — | % 0.4 | % 0.4 | 百万円 94 |
| 12期(2013年5月10日) | 13,868 | 5 | 31.0 | 138.56 | 31.5 | 49.8 | 0.8 | 48.2 | — | 0.5 | 129 | |
| 13期(2014年5月12日) | 14,346 | 5 | 3.5 | 143.47 | 3.5 | 48.2 | 1.0 | 49.8 | — | 0.4 | 137 | |
| 14期(2015年5月11日) | 16,994 | 5 | 18.5 | 170.22 | 18.6 | 48.9 | 0.8 | 49.3 | — | 0.5 | 159 | |
| 15期(2016年5月10日) | 16,012 | 5 | △ 5.7 | 160.23 | △ 5.9 | 47.9 | 1.0 | 50.1 | — | 0.5 | 164 | |

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

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

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* '11年10月4日まで、参考指数は、主要投資対象である「国内株式マザーファンド」（ベンチマーク＝東証株価指数（TOPIX））、「外国株式マザーファンド」（ベンチマーク＝FTSE 全世界・日本を除く先進国指数（円ベース））、「国内債券マザーファンド」（ベンチマーク＝NOMURA-BPI国債）、「外国債券マザーファンド」（ベンチマーク＝シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））の各ベンチマークから、当ファンドが基本とする投資比率（国内株式30%、外国株式20%、国内債券40%、外国債券10%）に基づいて当社で算出し、設定時を100として指数化しておりましたが、「11年10月5日からは、主要投資対象の1つである「外国株式マザーファンド」を、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」に変更したため、参考指数は、「国内株式マザーファンド」（ベンチマーク＝東証株価指数（TOPIX））、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」（ベンチマーク＝MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし））、「国内債券マザーファンド」（ベンチマーク＝NOMURA-BPI国債）、「外国債券マザーファンド」（ベンチマーク＝シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））の各ベンチマークから、基本投資比率（国内株式30%、外国株式20%、国内債券40%、外国債券10%）に基づいて独自に合成した指数へ変更しております。なお、投資対象であるマザーファンドの変更以外には、当ファンドの運用方針に一切変更はございません。

* MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）は、MSCIが開発したMSCI-KOKUSAI指数を当社が独自に円換算したものです。円換算にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しております。

* FTSE 全世界・日本を除く先進国指数（円ベース）及びシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値をもとにしております。

(出所) MSCI、FTSE International Limited、Citigroup Index LLC、野村證券株式会社、東京証券取引所、ブルームバーグ

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 基準価額 | | 参考指数 | 参考指数 | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 投資信託組入比率 |
|--------------------|-------------|-----------|--------|-----------|-----------|----------|-----------|--------|----------|--------|----------|
| | | 騰落率 | 騰落率 | | 騰落率 | 騰落率 | | | | | |
| (期首) 2015年5月11日 | 円 16,994 | % — | 170.22 | % — | % 48.9 | % 0.8 | % 49.3 | % — | % 0.5 | | |
| 5月末 | 17,379 | 2.3 | 174.10 | 2.3 | 49.2 | 1.0 | 48.2 | — | 0.5 | | |
| 6月末 | 17,075 | 0.5 | 171.00 | 0.5 | 48.0 | 1.0 | 49.7 | — | 0.4 | | |
| 7月末 | 17,298 | 1.8 | 173.37 | 1.8 | 49.0 | 0.8 | 48.9 | — | 0.5 | | |
| 8月末 | 16,620 | △2.2 | 166.59 | △2.1 | 47.0 | 0.9 | 50.5 | — | 0.5 | | |
| 9月末 | 16,050 | △5.6 | 160.65 | △5.6 | 45.5 | 1.0 | 51.9 | — | 0.5 | | |
| 10月末 | 16,874 | △0.7 | 168.85 | △0.8 | 48.4 | 0.7 | 49.1 | — | 0.5 | | |
| 11月末 | 16,977 | △0.1 | 169.97 | △0.1 | 48.6 | 0.8 | 49.0 | — | 0.5 | | |
| 12月末 | 16,811 | △1.1 | 168.26 | △1.2 | 48.3 | 0.8 | 49.2 | — | 0.5 | | |
| 2016年1月末 | 16,264 | △4.3 | 162.51 | △4.5 | 47.4 | 1.0 | 49.7 | — | 0.5 | | |
| 2月末 | 15,697 | △7.6 | 157.31 | △7.6 | 47.2 | 0.9 | 50.8 | — | 0.5 | | |
| 3月末 | 16,178 | △4.8 | 161.72 | △5.0 | 48.2 | 1.0 | 49.8 | — | 0.5 | | |
| 4月末 | 16,145 | △5.0 | 161.68 | △5.0 | 48.2 | 0.9 | 50.0 | — | 0.5 | | |
| (期末) 2016年5月10日 | 円 16,012 | % △5.7 | 160.23 | % △5.9 | % 47.9 | % 1.0 | % 50.1 | % — | % 0.5 | | |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

<バランスセレクト70（確定拠出年金向け）>

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 (分配額) | 税金 込配分 | 期騰落率 | 参考指数 | 株式比率 | | 債券比率 | | 投資信託 組入比率 | 純資産額 | |
|-----------------|---------------|-----------|--------|--------|--------|------|------|------|--------------|------|-----------|
| | | | | | 騰落率 | 組入比率 | 騰落率 | 組入比率 | | | |
| 11期(2012年5月10日) | 9,814 | 0 | △ 5.0 | 95.48 | △ 5.9 | 67.4 | 1.7 | 29.8 | — | 0.5 | 百万円 69 |
| 12期(2013年5月10日) | 14,047 | 5 | 43.2 | 136.66 | 43.1 | 69.1 | 1.2 | 28.6 | — | 0.6 | 97 |
| 13期(2014年5月12日) | 14,577 | 5 | 3.8 | 141.30 | 3.4 | 68.0 | 1.4 | 29.6 | — | 0.6 | 82 |
| 14期(2015年5月11日) | 18,263 | 5 | 25.3 | 177.06 | 25.3 | 68.3 | 1.2 | 29.6 | — | 0.6 | 109 |
| 15期(2016年5月10日) | 16,411 | 5 | △ 10.1 | 158.54 | △ 10.5 | 67.7 | 1.4 | 29.9 | — | 0.7 | 109 |

* 基準価額の騰落率は分配金込み。

* 株式組入比率には新株予約権証券を含みます。

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

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

* '11年10月4日まで、参考指数は、主要投資対象である「国内株式マザーファンド」（ベンチマーク＝東証株価指数（TOPIX））、「外国株式マザーファンド」（ベンチマーク＝FTSE 全世界・日本を除く先進国指数（円ベース））、「国内債券マザーファンド」（ベンチマーク＝NOMURA-BPI国債）、「外国債券マザーファンド」（ベンチマーク＝シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））の各ベンチマークから、当ファンドが基本とする投資比率（国内株式45%、外国株式25%、国内債券20%、外国債券10%）に基づいて当社で算出し、設定時を100として指数化しておりましたが、'11年10月5日からは、主要投資対象の1つである「外国株式マザーファンド」を、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」に変更したため、参考指数は、「国内株式マザーファンド」（ベンチマーク＝東証株価指数（TOPIX））、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」（ベンチマーク＝MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし））、「国内債券マザーファンド」（ベンチマーク＝NOMURA-BPI国債）、「外国債券マザーファンド」（ベンチマーク＝シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース））の各ベンチマークから、基本投資比率（国内株式45%、外国株式25%、国内債券20%、外国債券10%）に基づいて独自に合成した指数へ変更しております。なお、投資対象であるマザーファンドの変更以外には、当ファンドの運用方針に一切変更はございません。

* MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）は、MSCIが開発したMSCI-KOKUSAI指数を当社が独自に円換算したものです。円換算にあたっては、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値を営業日当日の対顧客電信売買相場仲値で円換算しております。

* FTSE 全世界・日本を除く先進国指数（円ベース）及びシティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日の指数値をもとにしております。

(出所) MSCI, FTSE International Limited, Citigroup Index LLC、野村證券株式会社、東京証券取引所、ブルームバーグ

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | 騰落率 | 参考指数 | 株式比率 | | 債券比率 | | 投資信託 組入比率 | |
|--------------------|--------|--------|--------|--------|------|------|------|--------------|-----|
| | | | | 騰落率 | 組入比率 | 騰落率 | 組入比率 | | |
| (期首) 2015年5月11日 | 18,263 | — | 177.06 | — | 68.3 | 1.2 | 29.6 | — | 0.6 |
| 5月末 | 18,838 | 3.1 | 182.64 | 3.1 | 67.8 | 1.4 | 29.3 | — | 0.6 |
| 6月末 | 18,399 | 0.7 | 178.36 | 0.7 | 67.7 | 1.4 | 29.8 | — | 0.6 |
| 7月末 | 18,706 | 2.4 | 181.45 | 2.5 | 68.1 | 1.1 | 29.7 | — | 0.6 |
| 8月末 | 17,690 | △ 3.1 | 171.56 | △ 3.1 | 67.0 | 1.2 | 30.4 | — | 0.6 |
| 9月末 | 16,800 | △ 8.0 | 162.59 | △ 8.2 | 66.3 | 1.5 | 30.9 | — | 0.6 |
| 10月末 | 18,028 | △ 1.3 | 174.28 | △ 1.6 | 67.9 | 1.0 | 29.3 | — | 0.6 |
| 11月末 | 18,189 | △ 0.4 | 175.92 | △ 0.6 | 68.0 | 1.2 | 29.4 | — | 0.6 |
| 12月末 | 17,910 | △ 1.9 | 173.14 | △ 2.2 | 68.2 | 1.1 | 29.4 | — | 0.6 |
| 2016年1月末 | 16,982 | △ 7.0 | 164.03 | △ 7.4 | 66.8 | 1.4 | 30.3 | — | 0.6 |
| 2月末 | 16,058 | △ 12.1 | 155.53 | △ 12.2 | 66.6 | 1.2 | 31.1 | — | 0.7 |
| 3月末 | 16,679 | △ 8.7 | 160.97 | △ 9.1 | 67.5 | 1.4 | 30.0 | — | 0.7 |
| 4月末 | 16,594 | △ 9.1 | 160.43 | △ 9.4 | 67.5 | 1.3 | 30.3 | — | 0.7 |
| (期末) 2016年5月10日 | 16,416 | △ 10.1 | 158.54 | △ 10.5 | 67.7 | 1.4 | 29.9 | — | 0.7 |

* 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

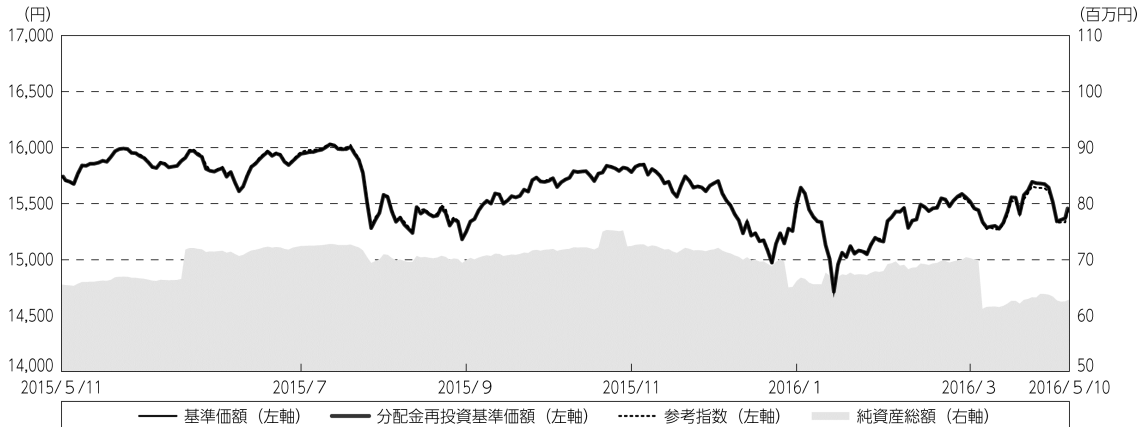
* 当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しております。

* 株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

<バランスセレクト30（確定拠出年金向け）>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期首：15,742円

期末：15,452円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率：△1.8%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成年首（2015年5月11日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、投資対象とする各マザーファンドのベンチマークを基本投資比率に基づいて合成した指数です。作成年首（2015年5月11日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首15,742円から期末15,457円（分配金込み）に285円の値下がりとなりました。

投資対象とする4本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国株式（-14.9%）、国内株式（-14.8%）、外国債券（-6.6%）が下落した一方で、国内債券（+7.5%）が上昇しました。国内株式や外国株式などの下落が主な値下がり要因となりました。

<バランスセレクト30（確定拠出年金向け）>

○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。

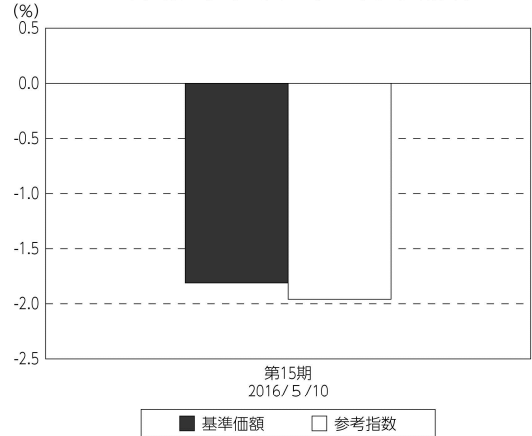
コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数（基本投資比率に基づいて各マザーファンドのベンチマークより合成）の騰落率が-2.0%となったのに対し、基準価額の騰落率は-1.8%となりました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬、及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。

また、外国資産のマザーファンドとそのベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることなどから、基準価額と参考指数の騰落率に評価上の差異が生じる場合があります。

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込みです。

(注) 参考指数は、投資対象とする各マザーファンドのベンチマークを基本投資比率に基づいて合成した指数です。

○分配金

- (1) 収益分配金は、基準価額水準等を勘案して決定させていただきました。
- (2) 留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり・税込み)

| 項目 | 第15期 |
|--------------------|---------------------------|
| | 2015年5月12日～ 2016年5月10日 |
| 当期分配金 (対基準価額比率) | 5 0.032% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 7,152 |

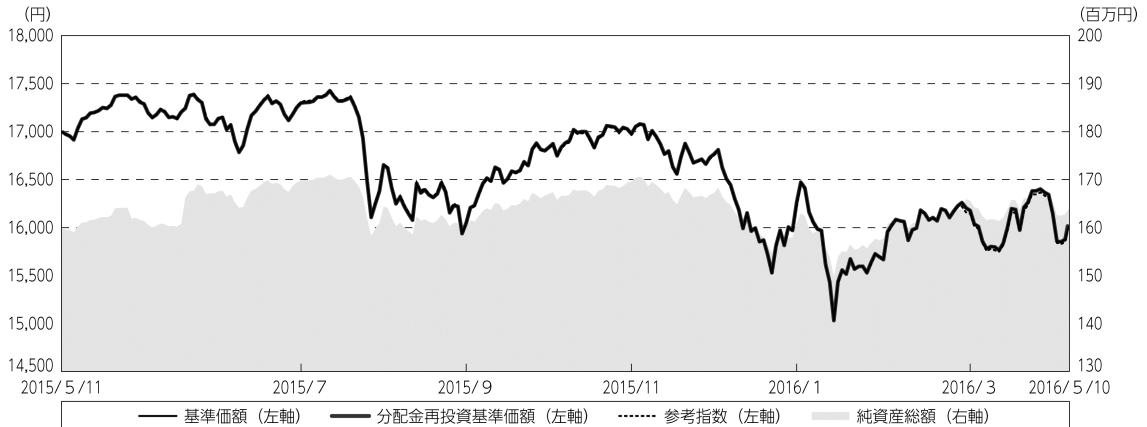
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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。

<バランスセレクト50（確定拠出年金向け）>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期 首：16,994円

期 末：16,012円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率：△5.7%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首（2015年5月11日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、投資対象とする各マザーファンドのベンチマークを基本投資比率に基づいて合成した指数です。作成期首（2015年5月11日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首16,994円から期末16,017円（分配金込み）に977円の値下がりとなりました。

投資対象とする4本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国株式（-14.9%）、国内株式（-14.8%）、外国債券（-6.6%）が下落した一方で、国内債券（+7.5%）が上昇しました。国内株式や外国株式などの下落が主な値下がり要因となりました。

<バランスセレクト50（確定拠出年金向け）>

○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。

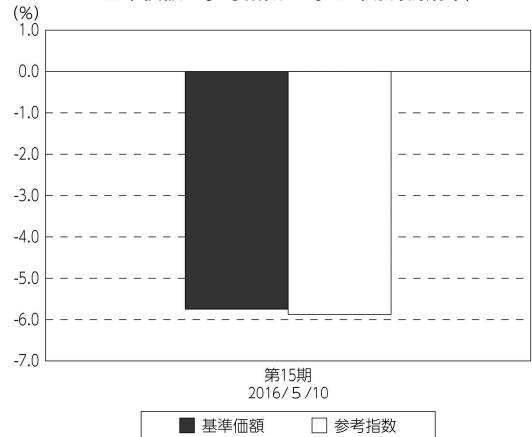
コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数（基本投資比率に基づいて各マザーファンドのベンチマークより合成）の騰落率が-5.9%となったのに対し、基準価額の騰落率は-5.7%となりました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬、及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。

また、外国資産のマザーファンドとそのベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることなどから、基準価額と参考指数の騰落率に評価上の差異が生じる場合があります。

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込みです。

(注) 参考指数は、投資対象とする各マザーファンドのベンチマークを基本投資比率に基づいて合成した指数です。

○分配金

- (1) 収益分配金は、基準価額水準等を勘案して決定させていただきました。
- (2) 留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

| 項目 | 第15期 |
|--------------------|---------------------------|
| | 2015年5月12日～ 2016年5月10日 |
| 当期分配金 (対基準価額比率) | 5 0.031% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 8,924 |

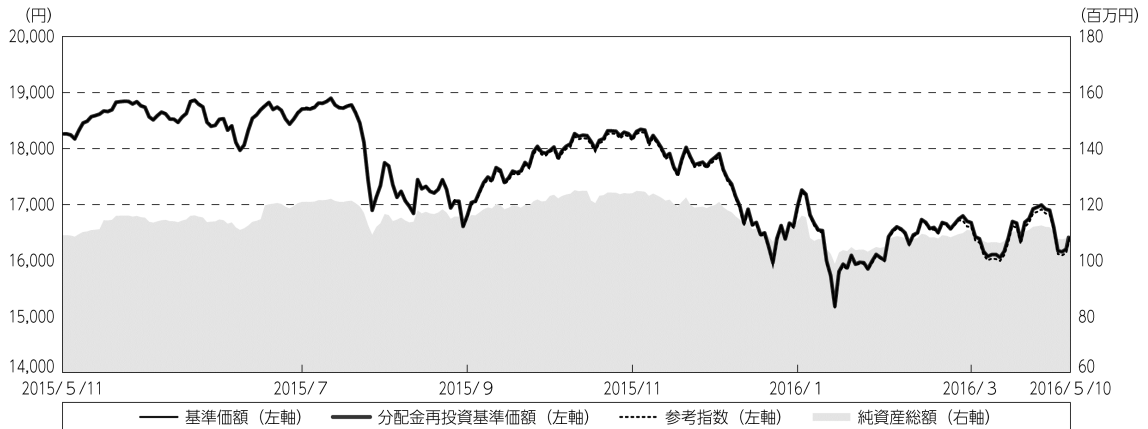
(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(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。

<バランスセレクト70（確定拠出年金向け）>

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



期首：18,263円

期末：16,411円（既払分配金（税込み）：5円）

騰落率：△10.1%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成年首（2015年5月11日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 参考指数は、投資対象とする各マザーファンドのベンチマークを基本投資比率に基づいて合成した指数です。作成年首（2015年5月11日）の値が基準価額と同一となるように計算しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首18,263円から期末16,416円（分配金込み）に1,847円の値下がりとなりました。

投資対象とする4本のマザーファンドの当期間の値動きは、外国株式（-14.9%）、国内株式（-14.8%）、外国債券（-6.6%）が下落した一方で、国内債券（+7.5%）が上昇しました。国内株式や外国株式などの下落が主な値下がり要因となりました。

<バランスセレクト70（確定拠出年金向け）>

○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。

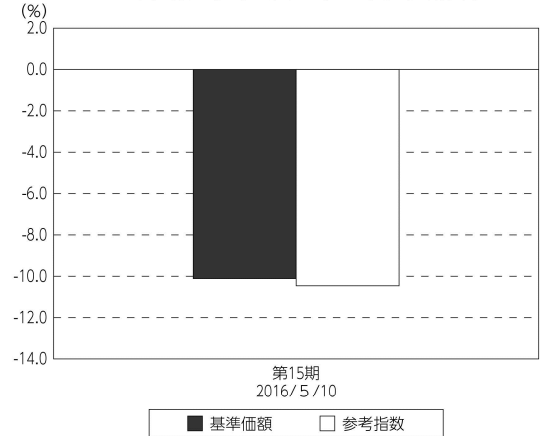
コメント・グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

参考指数（基本投資比率に基づいて各マザーファンドのベンチマークより合成）の騰落率が-10.5%となったのに対し、基準価額の騰落率は-10.1%となりました。

主なマイナス要因は、当ファンドの信託報酬、及び各マザーファンドにおける売買コストや保管費用などのコスト負担です。主なプラス要因は、国内株式部分で保有銘柄の配当権利落ちにより未収配当金が計上されたことです。

また、外国資産のマザーファンドとそのベンチマークで評価に用いる為替レートが異なることなどから、基準価額と参考指数の騰落率に評価上の差異が生じる場合があります。

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込みです。

(注) 参考指数は、投資対象とする各マザーファンドのベンチマークを基本投資比率に基づいて合成した指数です。

○分配金

- (1) 収益分配金は、基準価額水準等を勘案して決定させていただきました。
- (2) 留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり・税込み)

| 項目 | 第15期 |
|--------------------|---------------------------|
| | 2015年5月12日～ 2016年5月10日 |
| 当期分配金 (対基準価額比率) | 5 0.030% |
| 当期の収益 | 5 |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 10,197 |

(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。

<バランスセレクト30/50/70（確定拠出年金向け）>

○投資環境

| 資産 | 変動要因等 |
|------|---|
| 国内債券 | 国内株式市場の下落に伴い安全資産とされる国債への需要が高まったことや、日銀による国債買入れの平均残存年限の長期化やマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入などを背景に、国内債券利回りは長期債・超長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。 |
| 外国債券 | 商品価格の下落に伴う低インフレの長期化観測やECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和、米国の利上げペースが緩やかなものにとどまるとの観測などを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。為替市場は、ECBによる追加金融緩和や米国の利上げペースの鈍化観測などを背景に、主要通貨は対円で下落（円高）しました。 |
| 国内株式 | 外国株式市場の下落や、円高基調に伴う国内輸出関連企業の業績改善期待の後退、日銀による追加金融緩和への期待感の剥落などを背景に、下落しました。 |
| 外国株式 | 中国における景気減速への警戒感と世界経済への波及懸念、商品価格下落に伴う資源関連株の業績悪化懸念などを背景に、下落しました。為替市場は、ECBによる追加金融緩和や米国の利上げペースの鈍化観測などを背景に、主要通貨は対円で下落（円高）しました。 |

○当ファンドのポートフォリオ

各マザーファンドの日々の基準価額の動きの違いなどにより基本とする投資比率からの乖離が生じますが、原則として3ヵ月毎のリバランスや資金の追加解約に対応した売買などにより、当ファンドの基本とする投資比率からの乖離が小さくなるように運用を行いました。

なお、実質外貨建て資産については、為替ヘッジを行っておりません。

マザーファンドの運用経過については、11ページをご参照ください。

◎今後の運用方針

引き続き、内外の株式および公社債を実質的な主要投資対象とし、これらに分散投資するバランス運用を行うことで、キャピタルゲインとインカムゲインを総合したトータルリターンへの獲得を目指します。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

<バランスセレクト30/50/70（確定拠出年金向け）>

◎マザーファンドの運用経過

[国内株式マザーファンド]

東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果を目指し、先物を含む実質の株式組入比率は高位に維持しました。現物株式につきましては、東証1部上場銘柄に幅広く分散投資し、個別銘柄の時価構成比がポートフォリオと東証株価指数でほぼ同水準になるように銘柄見直し及び銘柄間の投資比率調整を適宜行ってまいりました。ただし、財務評価の視点から一部の銘柄は組み入れを見合わせました。また、日々の追加設定・解約による資金移動に対しては売買にかかるコストなどを考慮し、従来通り株式先物を利用してまいりました。

[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]

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

[国内債券マザーファンド]

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

[外国債券マザーファンド]

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

<バランスセレクト30/50/70（確定拠出年金向け）>

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。
東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

バランスセレクト30/50/70（確定拠出年金向け）は、FTSE International Limited（以下、「FTSE」といいます。）またはLondon Stock Exchange Plc（以下、「Exchange」といいます。）（これらを総称して「Licensor Parties」といいます。）により、何ら支援、推奨、販売または販促されるものではなく、いずれのLicensor Partiesも、FTSE 全世界・日本を除く先進国指数（円ベース）（以下、「指数」といいます。）を用いることによって得られる結果に関しておよび/または特定の時間、日付またはその他の方法で公表される当該指数の数値に関して、明示的または黙示的に担保もしくは表明するものではありません。指数はFTSEによって編集、計算されます。いずれのLicensor Partiesも、指数のいかなる誤りについて、何人に対しても（過失であろうとなかろうと）責任を負わず、当該いかなる誤りについて、何人に対しても通知する義務を負いません。

MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。
ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したものではなく、また、これを発行、後援、推奨、販売、運用または宣伝するものでもなく、ここに記載されたいかなるファンドに関していかなる保証も行わず、いかなる責任も負いません。
請求目論見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、ファンドの運用成果に関して一切の責任を負うものではありません。

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLCが開発した日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス（為替ヘッジを行わない円ベースの指数）です。
シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

<バランスセレクト30（確定拠出年金向け）>

○1万口当たりの費用明細

（2015年5月12日～2016年5月10日）

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 89 | 0.571 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (39) | (0.248) | 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 ） | (42) | (0.269) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 |
| （ 受 託 会 社 ） | (8) | (0.054) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.001 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (0) | (0.000) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.001 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.001) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 1 | 0.006 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (0) | (0.003) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.003) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.000) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 90 | 0.579 | |
| 期中の平均基準価額は、15,620円です。 | | | |

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

<バランスセレクト30（確定拠出年金向け）>

○売買及び取引の状況

(2015年5月12日～2016年5月10日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|-------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国内株式マザーファンド | 千口 3,563 | 千円 4,709 | 千口 2,450 | 千円 3,189 |
| 国内債券マザーファンド | 6,759 | 8,789 | 9,622 | 12,770 |
| 外国債券マザーファンド | 1,301 | 2,977 | 1,173 | 2,659 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 945 | 1,997 | 707 | 1,457 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年5月12日～2016年5月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 | |
|---------------------|---------------|-----------------------------|
| | 国内株式マザーファンド | 外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 96,548,801千円 | 58,477,189千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 273,880,605千円 | 312,657,091千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.35 | 0.18 |

* (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

<バランスセレクト30（確定拠出年金向け）>

○利害関係人との取引状況等

（2015年5月12日～2016年5月10日）

利害関係人との取引状況

<バランスセレクト30（確定拠出年金向け）>

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|-----|--------------------|---------------|-------|--------------------|---------------|-------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | % | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | % |
| 預金 | 百万円 5 | 百万円 5 | 100.0 | 百万円 5 | 百万円 5 | 100.0 |

<国内株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|-----|--------------------|---------------|-------|--------------------|---------------|-------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | % | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | % |
| 株式 | 百万円 81,654 | 百万円 652 | 0.8 | 百万円 14,893 | 百万円 62 | 0.4 |
| 貸株 | 83,949 | 13,049 | 15.5 | 97,775 | 11,630 | 11.9 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

平均保有割合 0.0%

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

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|--------------------|---------------|-------|--------------------|---------------|-------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | % | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | % |
| 為替直物取引 | 百万円 56,676 | 百万円 6,438 | 11.4 | 百万円 29,625 | 百万円 3,116 | 10.5 |
| 預金 | 11,916 | 11,916 | 100.0 | 11,916 | 11,916 | 100.0 |

平均保有割合 0.0%

<国内債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|-----|--------------------|---------------|-------|--------------------|---------------|-------|
| | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | % | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ | % |
| 公社債 | 百万円 3,775 | 百万円 288 | 7.6 | 百万円 3,040 | 百万円 210 | 6.9 |
| 預金 | 1,919 | 1,919 | 100.0 | 1,919 | 1,919 | 100.0 |

平均保有割合 0.4%

<バランスセレクト30（確定拠出年金向け）>

<外国債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------|----------------|---------------|---------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 283,335 | 7,530 | 2.7 | 115,284 | 1,324 | 1.1 |
| 為替直物取引 | 195,271 | 19,369 | 9.9 | 44,170 | 2,035 | 4.6 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合 0.0%

利害関係人の発行する有価証券等

<国内株式マザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|-------|-------|-------------|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 454 | 168 | 1,208 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 0.445千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0千円 |
| (B) / (A) | 0.0% |

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

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

<バランスセレクト30（確定拠出年金向け）>

○組入資産の明細

（2016年5月10日現在）

親投資信託残高

| 銘 | 柄 | 期首(前期末) | | |
|-------------------------|---|---------|--------|--------|
| | | 口数 | 口数 | 評価額 |
| | | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | | 9,023 | 10,136 | 12,608 |
| 国内債券マザーファンド | | 28,174 | 25,311 | 34,679 |
| 外国債券マザーファンド | | 4,225 | 4,353 | 9,458 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | | 2,918 | 3,156 | 6,107 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「参考情報」または「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

（2016年5月10日現在）

| 項 | 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|---|--------|-------|
| | | 評価額 | 比率 |
| | | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | | 12,608 | 20.0 |
| 国内債券マザーファンド | | 34,679 | 54.9 |
| 外国債券マザーファンド | | 9,458 | 15.0 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | | 6,107 | 9.7 |
| コール・ローン等、その他 | | 281 | 0.4 |
| 投資信託財産総額 | | 63,133 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（631,449,795千円）の投資信託財産総額（637,494,756千円）に対する比率は99.1%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（309,340,516千円）の投資信託財産総額（312,057,375千円）に対する比率は99.1%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=108.46円、1カナダドル=83.59円、1英ポンド=156.26円、1スイスフラン=111.70円、1スウェーデンクローナ=13.28円、1ノルウェークローネ=13.19円、1デンマーククローネ=16.60円、1ユーロ=123.49円、1ズロチ=27.86円、1香港ドル=13.97円、1シンガポールドル=79.08円、1リンギ=26.78円、1豪ドル=79.20円、1ニュージーランドドル=73.10円、1新シケル=28.67円、1メキシコペソ=5.96円、1ランド=7.16円。

＜バランスセレクト30（確定拠出年金向け）＞

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年5月10日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------|-------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 63,133,606 |
| コール・ローン等 | 260,235 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 12,608,931 |
| 国内債券マザーファンド(評価額) | 34,679,693 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 9,458,348 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 6,107,511 |
| 未収入金 | 18,888 |
| (B) 負債 | 216,807 |
| 未払収益分配金 | 20,359 |
| 未払信託報酬 | 195,396 |
| その他未払費用 | 1,052 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 62,916,799 |
| 元本 | 40,718,167 |
| 次期繰越損益金 | 22,198,632 |
| (D) 受益権総口数 | 40,718,167口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 15,452円 |

(注) 期首元本額は41,676,191円、期中追加設定元本額は10,885,849円、期中一部解約元本額は11,843,873円、1口当たり純資産額は1.5452円です。

○損益の状況（2015年5月12日～2016年5月10日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | △ 1 |
| 受取利息 | 2 |
| 支払利息 | △ 3 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 704,194 |
| 売買益 | 3,096,469 |
| 売買損 | △ 3,800,663 |
| (C) 信託報酬等 | △ 398,350 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 1,102,545 |
| (E) 前期繰越損益金 | 11,620,281 |
| (F) 追加信託差損益金 | 11,701,255 |
| (配当等相当額) | (16,808,848) |
| (売買損益相当額) | (△ 5,107,593) |
| (G) 計(D+E+F) | 22,218,991 |
| (H) 収益分配金 | △ 20,359 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 22,198,632 |
| 追加信託差損益金 | 11,701,255 |
| (配当等相当額) | (16,833,193) |
| (売買損益相当額) | (△ 5,131,938) |
| 分配準備積立金 | 12,290,623 |
| 繰越損益金 | △ 1,793,246 |

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

(注) 分配金の計算過程（2015年5月12日～2016年5月10日）は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|---------------------------|
| | 2015年5月12日～ 2016年5月10日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 690,701円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 16,833,193円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 11,620,281円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 29,144,175円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 7,157円 |
| g. 分配金 | 20,359円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 5円 |

<バランスセレクト30（確定拠出年金向け）>

○分配金のお知らせ

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

○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>

<バランスセレクト50（確定拠出年金向け）>

○1万口当たりの費用明細

（2015年5月12日～2016年5月10日）

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|-----------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 107 | 0.646 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (47) | (0.280) | 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 ） | (52) | (0.312) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 |
| （ 受 託 会 社 ） | (9) | (0.054) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.001 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ） | (0) | (0.001) | |
| (c) 有 価 証 券 取 引 税 | 0 | 0.002 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.002) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 1 | 0.007 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (1) | (0.003) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ 監 査 費 用 ） | (1) | (0.003) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.001) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 108 | 0.656 | |
| 期中の平均基準価額は、16,614円です。 | | | |

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

<バランスセレクト50（確定拠出年金向け）>

○売買及び取引の状況

(2015年5月12日～2016年5月10日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|-------------------------|-------------|--------------|-------------|-------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国内株式マザーファンド | 千口 8,705 | 千円 11,559 | 千口 1,919 | 千円 2,859 |
| 国内債券マザーファンド | 5,762 | 7,418 | 7,179 | 9,398 |
| 外国債券マザーファンド | 1,095 | 2,493 | 368 | 858 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 3,226 | 6,835 | 933 | 2,059 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年5月12日～2016年5月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 | |
|---------------------|---------------|-------------------------|
| | 国内株式マザーファンド | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 96,548,801千円 | 58,477,189千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 273,880,605千円 | 312,657,091千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.35 | 0.18 |

* (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

<バランスセレクト50（確定拠出年金向け）>

○利害関係人との取引状況等

（2015年5月12日～2016年5月10日）

利害関係人との取引状況

<バランスセレクト50（確定拠出年金向け）>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|------|----------------|---------------|------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 預金 | 13 | 13 | 100.0 | 13 | 13 | 100.0 |

<国内株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|---------|----------------|---------------|---------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 81,654 | 652 | 0.8 | 14,893 | 62 | 0.4 |
| 貸株 | 83,949 | 13,049 | 15.5 | 97,775 | 11,630 | 11.9 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

平均保有割合 0.0%

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

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------|----------------|---------------|--------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 56,676 | 6,438 | 11.4 | 29,625 | 3,116 | 10.5 |
| 預金 | 11,916 | 11,916 | 100.0 | 11,916 | 11,916 | 100.0 |

平均保有割合 0.0%

<国内債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|-------|----------------|---------------|-------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 3,775 | 288 | 7.6 | 3,040 | 210 | 6.9 |
| 預金 | 1,919 | 1,919 | 100.0 | 1,919 | 1,919 | 100.0 |

平均保有割合 0.8%

<バランスセレクト50（確定拠出年金向け）>

<外国債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------|----------------|---------------|---------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 283,335 | 7,530 | 2.7 | 115,284 | 1,324 | 1.1 |
| 為替直物取引 | 195,271 | 19,369 | 9.9 | 44,170 | 2,035 | 4.6 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合 0.0%

利害関係人の発行する有価証券等

<国内株式マザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|-------|-------|-------------|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 454 | 168 | 1,208 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 1千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0千円 |
| (B) / (A) | 0.0% |

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

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

<バランスセレクト50（確定拠出年金向け）>

○組入資産の明細

（2016年5月10日現在）

親投資信託残高

| 銘柄 | 期首(前期末) | | |
|-------------------------|---------|--------|--------|
| | 口数 | 口数 | 評価額 |
| | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 32,892 | 39,678 | 49,356 |
| 国内債券マザーファンド | 49,788 | 48,371 | 66,274 |
| 外国債券マザーファンド | 6,847 | 7,574 | 16,454 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 14,182 | 16,475 | 31,875 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「参考情報」または「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

（2016年5月10日現在）

| 項目 | 当期末 | |
|-------------------------|---------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 49,356 | 30.0 |
| 国内債券マザーファンド | 66,274 | 40.2 |
| 外国債券マザーファンド | 16,454 | 10.0 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 31,875 | 19.3 |
| コール・ローン等、その他 | 779 | 0.5 |
| 投資信託財産総額 | 164,738 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（631,449,795千円）の投資信託財産総額（637,494,756千円）に対する比率は99.1%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（309,340,516千円）の投資信託財産総額（312,057,375千円）に対する比率は99.1%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=108.46円、1カナダドル=83.59円、1英ポンド=156.26円、1スイスフラン=111.70円、1スウェーデンクローナ=13.28円、1ノルウェークローネ=13.19円、1デンマーククローネ=16.60円、1ユーロ=123.49円、1ズロチ=27.86円、1香港ドル=13.97円、1シンガポールドル=79.08円、1リンギ=26.78円、1豪ドル=79.20円、1ニュージーランドドル=73.10円、1新シエクル=28.67円、1メキシコペソ=5.96円、1ランド=7.16円。

＜バランスセレクト50（確定拠出年金向け）＞

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年5月10日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------|--------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 164,738,800 |
| コール・ローン等 | 670,727 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 49,356,329 |
| 国内債券マザーファンド(評価額) | 66,274,097 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 16,454,782 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 31,875,935 |
| 未収入金 | 106,930 |
| (B) 負債 | 613,262 |
| 未払収益分配金 | 51,249 |
| 未払解約金 | 33,752 |
| 未払信託報酬 | 525,698 |
| 未払利息 | 1 |
| その他未払費用 | 2,562 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 164,125,538 |
| 元本 | 102,499,720 |
| 次期繰越損益金 | 61,625,818 |
| (D) 受益権総口数 | 102,499,720口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 16,012円 |

(注) 期首元本額は94,020,762円、期中追加設定元本額は14,550,524円、期中一部解約元本額は6,071,566円、1口当たり純資産額は1,6012円です。

○損益の状況（2015年5月12日～2016年5月10日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 53 |
| 受取利息 | 76 |
| 支払利息 | △ 23 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 8,527,422 |
| 売買益 | 5,180,030 |
| 売買損 | △13,707,452 |
| (C) 信託報酬等 | △ 1,064,327 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 9,591,696 |
| (E) 前期繰越損益金 | 43,749,055 |
| (F) 追加信託差損益金 | 27,519,708 |
| (配当等相当額) | (45,806,192) |
| (売買損益相当額) | (△18,286,484) |
| (G) 計(D+E+F) | 61,677,067 |
| (H) 収益分配金 | △ 51,249 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 61,625,818 |
| 追加信託差損益金 | 27,519,708 |
| (配当等相当額) | (45,847,467) |
| (売買損益相当額) | (△18,327,759) |
| 分配準備積立金 | 45,627,199 |
| 繰越損益金 | △11,521,089 |

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

(注) 分配金の計算過程（2015年5月12日～2016年5月10日）は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|---------------------------|
| | 2015年5月12日～ 2016年5月10日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 1,929,393円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 45,847,467円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 43,749,055円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 91,525,915円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 8,929円 |
| g. 分配金 | 51,249円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 5円 |

<バランスセレクト50（確定拠出年金向け）>

○分配金のお知らせ

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

○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>

<バランスセレクト70（確定拠出年金向け）>

○1万口当たりの費用明細

（2015年5月12日～2016年5月10日）

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|----------|------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 127 | % 0.722 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 |
| （ 投 信 会 社 ） | (55) | (0.312) | 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 ） | (62) | (0.355) | 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等 |
| （ 受 託 会 社 ） | (9) | (0.054) | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.002 | (b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.000) | |
| （ 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 | 0.002 | (c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金 |
| （ 株 式 ） | (0) | (0.002) | |
| （ 投 資 信 託 証 券 ） | (0) | (0.000) | |
| (d) そ の 他 費 用 | 1 | 0.008 | (d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (1) | (0.004) | 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 ） | (1) | (0.003) | 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.001) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 128 | 0.734 | |
| 期中の平均基準価額は、17,572円です。 | | | |

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

<バランスセレクト70（確定拠出年金向け）>

○売買及び取引の状況

(2015年5月12日～2016年5月10日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|-------------------------|--------|--------|-------|-------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 国内株式マザーファンド | 10,736 | 14,634 | 4,563 | 6,445 |
| 国内債券マザーファンド | 3,600 | 4,611 | 4,690 | 6,149 |
| 外国債券マザーファンド | 1,205 | 2,779 | 800 | 1,867 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 3,545 | 7,589 | 1,847 | 3,908 |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年5月12日～2016年5月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 | |
|---------------------|---------------|-------------------------|
| | 国内株式マザーファンド | 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 96,548,801千円 | 58,477,189千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 273,880,605千円 | 312,657,091千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.35 | 0.18 |

* (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

<バランスセレクト70（確定拠出年金向け）>

○利害関係人との取引状況等

（2015年5月12日～2016年5月10日）

利害関係人との取引状況

<バランスセレクト70（確定拠出年金向け）>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|------|----------------|---------------|------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 預金 | 10 | 10 | 100.0 | 10 | 10 | 100.0 |

<国内株式マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|---------|----------------|---------------|---------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 株式 | 81,654 | 652 | 0.8 | 14,893 | 62 | 0.4 |
| 貸株 | 83,949 | 13,049 | 15.5 | 97,775 | 11,630 | 11.9 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

平均保有割合 0.0%

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

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|--------|----------------|---------------|--------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 為替直物取引 | 56,676 | 6,438 | 11.4 | 29,625 | 3,116 | 10.5 |
| 預金 | 11,916 | 11,916 | 100.0 | 11,916 | 11,916 | 100.0 |

平均保有割合 0.0%

<国内債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|-----|-------|----------------|---------------|-------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 3,775 | 288 | 7.6 | 3,040 | 210 | 6.9 |
| 預金 | 1,919 | 1,919 | 100.0 | 1,919 | 1,919 | 100.0 |

平均保有割合 0.3%

<バランスセレクト70（確定拠出年金向け）>

<外国債券マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 | | | 売付額等 | | |
|--------|---------|----------------|---------------|---------|----------------|---------------|
| | A | うち利害関係人との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | C | うち利害関係人との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| | 百万円 | 百万円 | % | 百万円 | 百万円 | % |
| 公社債 | 283,335 | 7,530 | 2.7 | 115,284 | 1,324 | 1.1 |
| 為替直物取引 | 195,271 | 19,369 | 9.9 | 44,170 | 2,035 | 4.6 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

平均保有割合 0.0%

利害関係人の発行する有価証券等

<国内株式マザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|-------|-------|-------------|
| | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式 | 454 | 168 | 1,208 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 1千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 0千円 |
| (B) / (A) | 0.0% |

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

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

<バランスセレクト70（確定拠出年金向け）>

○組入資産の明細

（2016年5月10日現在）

親投資信託残高

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------|--------|--------|-------|
| | 口 数 | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| | 千口 | 千口 | 千口 | 千円 |
| 国内株式マザーファンド | 33,612 | 39,785 | 49,489 | |
| 国内債券マザーファンド | 17,001 | 15,911 | 21,800 | |
| 外国債券マザーファンド | 4,658 | 5,063 | 10,999 | |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 12,069 | 13,766 | 26,634 | |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「参考情報」または「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

（2016年5月10日現在）

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-------------------------|---------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 国内株式マザーファンド | 49,489 | 45.1 |
| 国内債券マザーファンド | 21,800 | 19.9 |
| 外国債券マザーファンド | 10,999 | 10.0 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド | 26,634 | 24.3 |
| コール・ローン等、その他 | 890 | 0.7 |
| 投資信託財産総額 | 109,812 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（631,449,795千円）の投資信託財産総額（637,494,756千円）に対する比率は99.1%です。

*外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（309,340,516千円）の投資信託財産総額（312,057,375千円）に対する比率は99.1%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=108.46円、1カナダドル=83.59円、1英ポンド=156.26円、1スイスフラン=111.70円、1スウェーデンクローナ=13.28円、1ノルウェークローネ=13.19円、1デンマーククローネ=16.60円、1ユーロ=123.49円、1ズロチ=27.86円、1香港ドル=13.97円、1シンガポールドル=79.08円、1リンギ=26.78円、1豪ドル=79.20円、1ニュージーランドドル=73.10円、1新シケル=28.67円、1メキシコペソ=5.96円、1ランド=7.16円。

＜バランスセレクト70（確定拠出年金向け）＞

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2016年5月10日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|------------------------------|-------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 109,812,521 |
| コール・ローン等 | 501,184 |
| 国内株式マザーファンド(評価額) | 49,489,302 |
| 国内債券マザーファンド(評価額) | 21,800,698 |
| 外国債券マザーファンド(評価額) | 10,999,367 |
| 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド(評価額) | 26,634,879 |
| 未収入金 | 387,091 |
| (B) 負債 | 779,421 |
| 未払収益分配金 | 33,219 |
| 未払解約金 | 338,417 |
| 未払信託報酬 | 406,031 |
| その他未払費用 | 1,754 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 109,033,100 |
| 元本 | 66,438,130 |
| 次期繰越損益金 | 42,594,970 |
| (D) 受益権総口数 | 66,438,130口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 16,411円 |

(注) 期首元本額は59,734,218円、期中追加設定元本額は15,486,501円、期中一部解約元本額は8,782,589円、1口当たり純資産額は1.6411円です。

○損益の状況（2015年5月12日～2016年5月10日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 18 |
| 受取利息 | 31 |
| 支払利息 | △ 13 |
| (B) 有価証券売買損益 | △10,697,568 |
| 売買益 | 2,297,525 |
| 売買損 | △12,995,093 |
| (C) 信託報酬等 | △ 832,681 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △11,530,231 |
| (E) 前期繰越損益金 | 23,261,914 |
| (F) 追加信託差損益金 | 30,896,506 |
| (配当等相当額) | (42,986,062) |
| (売買損益相当額) | (△12,089,556) |
| (G) 計(D+E+F) | 42,628,189 |
| (H) 収益分配金 | △ 33,219 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 42,594,970 |
| 追加信託差損益金 | 30,896,506 |
| (配当等相当額) | (43,039,679) |
| (売買損益相当額) | (△12,143,173) |
| 分配準備積立金 | 24,707,744 |
| 繰越損益金 | △13,009,280 |

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

(注) 分配金の計算過程（2015年5月12日～2016年5月10日）は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|---------------------------|
| | 2015年5月12日～ 2016年5月10日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 1,479,049円 |
| b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後) | 0円 |
| c. 信託約款に定める収益調整金 | 43,039,679円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 23,261,914円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 67,780,642円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 10,202円 |
| g. 分配金 | 33,219円 |
| h. 分配金(1万口当たり) | 5円 |

<バランスセレクト70（確定拠出年金向け）>

○分配金のお知らせ

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

○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>

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

（2016年5月10日現在）

<外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド>

下記は、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド全体（160,220,261千口）の内容です。

外国株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-----------------------------|---------|-------|--------|-----------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| ADT CORP/THE | 158 | — | — | — | 商業サービス・用品 |
| AFLAC INC | 392 | 408 | 2,800 | 303,743 | 保険 |
| AGCO CORP | 78 | 63 | 321 | 34,889 | 機械 |
| AGL RESOURCES INC | — | 115 | 761 | 82,558 | ガス |
| AES CORP | 582 | 650 | 725 | 78,676 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| AT & T INC | 4,501 | 5,943 | 23,094 | 2,504,829 | 各種電気通信サービス |
| ABBOTT LABORATORIES | 1,314 | 1,440 | 5,469 | 593,180 | ヘルスケア機器・用品 |
| ABBVIE INC | 1,381 | 1,576 | 10,039 | 1,088,842 | バイオテクノロジー |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 436 | 487 | 1,809 | 196,226 | ソフトウェア |
| ACUITY BRANDS INC | — | 41 | 1,037 | 112,531 | 電気設備 |
| ADOBE SYSTEMS INC. | 409 | 479 | 4,531 | 491,521 | ソフトウェア |
| ADVANCE AUTO PARTS | 63 | 71 | 1,083 | 117,509 | 専門小売り |
| AETNA INC | 308 | 337 | 3,839 | 416,425 | 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 | 842 | 91,332 | 資本市場 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 290 | 324 | 1,339 | 145,237 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| AIR PRODUCTS | 186 | 198 | 2,829 | 306,874 | 化学 |
| AIRGAS INC | 59 | 63 | 901 | 97,747 | 化学 |
| AKAMAI TECHNOLOGIES | 154 | 167 | 837 | 90,835 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ALBEMARLE CORP | 96 | 111 | 746 | 80,998 | 化学 |
| ALCOA INC | 1,021 | 1,250 | 1,182 | 128,253 | 金属・鉱業 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 171 | 218 | 3,131 | 339,654 | バイオテクノロジー |
| ALLEGHANY CORP | 14 | 15 | 783 | 84,999 | 保険 |
| ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | 55 | 58 | 1,193 | 129,433 | 情報技術サービス |
| ALLIANT ENERGY CORP | 95 | 108 | 787 | 85,439 | 総合公益事業 |
| ALLSTATE CORP | 368 | 372 | 2,500 | 271,172 | 保険 |
| ALLY FINANCIAL INC | 381 | 421 | 715 | 77,624 | 消費者金融 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | — | 72 | 416 | 45,144 | バイオテクノロジー |
| ALPHABET INC-CL C | — | 300 | 21,415 | 2,322,726 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ALPHABET INC-CL A | — | 281 | 20,517 | 2,225,351 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ALTERA CORP. | 260 | — | — | — | 半導体・半導体製造装置 |
| ALTRIA GROUP INC | 1,713 | 1,889 | 12,025 | 1,304,272 | タバコ |
| AMAZON.COM INC | 341 | 384 | 26,163 | 2,837,701 | インターネット販売・カタログ販売 |
| AMERCO | — | 6 | 245 | 26,600 | 陸運・鉄道 |
| AMEREN CORPORATION | 206 | 231 | 1,118 | 121,337 | 総合公益事業 |
| AMERICAN AIRLINES GROUP INC | 160 | 154 | 507 | 55,019 | 旅客航空輸送業 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 424 | 475 | 3,101 | 336,364 | 電力 |
| AMERICAN EXPRESS CO | 813 | 811 | 5,188 | 562,774 | 消費者金融 |
| AMERICAN INTL GROUP | 1,213 | 1,194 | 6,596 | 715,494 | 保険 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 154 | 171 | 1,270 | 137,783 | 水道 |
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 192 | 188 | 1,454 | 157,761 | 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 | 1,561 | 169,330 | 資本市場 |
| AMETEK INC | 213 | 233 | 1,079 | 117,030 | 電気設備 |
| AMGEN INC | 659 | 726 | 11,296 | 1,225,245 | バイオテクノロジー |
| AMPHENOL CORP-CL A | 265 | 296 | 1,662 | 180,329 | 電子装置・機器・部品 |
| ANADARKO PETE | 438 | 495 | 2,227 | 241,540 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ANALOG DEVICES INC | 270 | 304 | 1,678 | 182,103 | 半導体・半導体製造装置 |
| ANSYS INC | 78 | 84 | 719 | 78,078 | ソフトウェア |
| ANTERO RESOURCES CORP | 41 | 74 | 188 | 20,458 | 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 | 3,495 | 379,133 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| APACHE CORPORATION | 324 | 369 | 1,923 | 208,593 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| APPLE INC | 5,095 | 5,382 | 49,939 | 5,416,446 | コンピュータ・周辺機器 |
| APPLIED MATERIALS | 1,058 | 1,145 | 2,277 | 247,007 | 半導体・半導体製造装置 |
| ARAMARK | — | 216 | 735 | 79,723 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ARCHER DANIELS MIDLAND | 565 | 582 | 2,195 | 238,165 | 食品 |
| ARROW ELECTRS INC | 83 | 93 | 555 | 60,207 | 電子装置・機器・部品 |
| ASHLAND INC | 59 | 59 | 652 | 70,787 | 化学 |
| ASSURANT INC | 62 | 62 | 533 | 57,877 | 保険 |
| ATMOS ENERGY CORP | — | 97 | 720 | 78,168 | ガス |
| AUTODESK INC. | 196 | 220 | 1,293 | 140,279 | ソフトウェア |
| AUTOLIV INC | 81 | 85 | 1,059 | 114,888 | 自動車部品 |
| AUTOMATIC DATA PROCESS | 422 | 444 | 3,869 | 419,729 | 情報技術サービス |
| AUTONATION INC | 62 | 71 | 343 | 37,232 | 専門小売り |
| AUTOZONE | 27 | 29 | 2,304 | 249,906 | 専門小売り |
| AVERY DENNISON CORP | 83 | 91 | 684 | 74,211 | 容器・包装 |
| AVNET | 118 | 122 | 476 | 51,658 | 電子装置・機器・部品 |
| AVON PRODUCTS INC | 378 | — | — | — | パーソナル用品 |
| BB&T CORPORATION | 620 | 786 | 2,651 | 287,546 | 銀行 |
| BAKER HUGHES | 380 | 424 | 1,876 | 203,492 | エネルギー設備・サービス |
| BALL CORP | 117 | 124 | 893 | 96,859 | 容器・包装 |
| BANK OF AMERICA CORP | 9,125 | 10,030 | 14,031 | 1,521,907 | 銀行 |
| BANK OF NEWYORK MELLON CORP | 984 | 1,060 | 4,173 | 452,627 | 資本市場 |
| BARD (C R) | 65 | 70 | 1,530 | 166,013 | ヘルスケア機器・用品 |
| BAXALTA INC | — | 657 | 2,782 | 301,778 | バイオテクノロジー |
| BAXTER INTERNATIONAL INC. | 472 | 529 | 2,388 | 259,049 | ヘルスケア機器・用品 |
| B/E AEROSPACE INC | 90 | 101 | 477 | 51,748 | 航空宇宙・防衛 |
| BECTON, DICKINSON | 180 | 204 | 3,387 | 367,424 | ヘルスケア機器・用品 |
| BED BATH & BEYOND | 165 | 156 | 706 | 76,663 | 専門小売り |
| WR BERKLEY CORP | 98 | 99 | 545 | 59,142 | 保険 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B | 1,002 | 1,146 | 16,377 | 1,776,302 | 各種金融サービス |
| BEST BUY COMPANY INC | 264 | 305 | 996 | 108,040 | 専門小売り |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 136 | 153 | 1,284 | 139,359 | バイオテクノロジー |
| BIOGEN INC | 204 | 215 | 5,814 | 630,592 | バイオテクノロジー |
| BLACKROCK INC | 114 | 119 | 4,224 | 458,202 | 資本市場 |
| H & R BLOCK INC | 234 | 224 | 444 | 48,225 | 各種消費者サービス |
| BOEING CO | 587 | 614 | 8,110 | 879,712 | 航空宇宙・防衛 |
| BORGWARNER INC | 195 | 213 | 720 | 78,177 | 自動車部品 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 1,147 | 1,306 | 2,891 | 313,610 | ヘルスケア機器・用品 |
| BRISTOL MYERS SQUIBB | 1,438 | 1,608 | 11,471 | 1,244,195 | 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 | 1,078 | 116,979 | 飲料 |
| CBS CORP-CL B | 421 | 414 | 2,318 | 251,453 | メディア |
| CBRE GROUP INC | 260 | 296 | 859 | 93,198 | 不動産管理・開発 |
| CDK GLOBAL INC | — | 128 | 655 | 71,108 | ソフトウェア |
| CDW CORPORATION | — | 141 | 575 | 62,410 | 電子装置・機器・部品 |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 43 | 229 | 696 | 75,530 | 化学 |
| C. H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 128 | 137 | 1,002 | 108,678 | 航空貨物・物流サービス |
| CIGNA CORP | 229 | 249 | 3,273 | 355,096 | 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 | 534 | 57,956 | 銀行 |
| CME GROUP INC | 276 | 312 | 2,932 | 318,091 | 各種金融サービス |
| CMS ENERGY CORP | 237 | 273 | 1,129 | 122,554 | 総合公益事業 |
| CSX CORP | 872 | 932 | 2,409 | 261,304 | 陸運・鉄道 |
| CVS HEALTH CORP | 994 | 1,067 | 11,282 | 1,223,695 | 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 | 921 | 99,905 | ソフトウェア |
| CABLEVISION SYSTEMS-NY GRP-A | 167 | 193 | 667 | 72,427 | メディア |
| CABOT OIL & GAS CORP | 352 | 436 | 1,046 | 113,539 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CALPINE CORP | 300 | 310 | 462 | 50,131 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 |
| CAMERON INTERNATIONAL CORP | 168 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| CAMPBELL SOUP CO | 181 | 175 | 1,136 | 123,259 | 食品 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 486 | 517 | 3,598 | 390,273 | 消費者金融 |
| CARDINAL HEALTH INC | 290 | 317 | 2,487 | 269,794 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CARMAX INC | 184 | 193 | 988 | 107,238 | 専門小売り |
| CARNIVAL CORP | 330 | 403 | 2,004 | 217,410 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CATERPILLAR INC DEL | 503 | 563 | 3,984 | 432,203 | 機械 |
| CELANESE CORP-SERIES A | 129 | 143 | 997 | 108,211 | 化学 |
| CELGENE CORP | 692 | 760 | 7,783 | 844,161 | バイオテクノロジー |
| CENTENE CORP | — | 161 | 976 | 105,924 | 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 | 843 | 91,469 | 総合公益事業 |
| CENTURYLINK INC | 500 | 530 | 1,495 | 162,161 | 各種電気通信サービス |
| CERNER CORP | 266 | 293 | 1,624 | 176,149 | ヘルスケア・テクノロジー |
| CHARTER COMMUNICATION-A | 66 | 82 | 1,759 | 190,789 | メディア |
| CHENIERE ENERGY INC | 197 | 220 | 707 | 76,713 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHESAPEAKE ENERGY CORP | 463 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHEVRON CORP | 1,641 | 1,819 | 18,253 | 1,979,792 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CHICAGO BRIDGE & IRON-NY SHR | 84 | 84 | 310 | 33,709 | 建設・土木 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | 26 | 30 | 1,382 | 149,909 | ホテル・レストラン・レジャー |
| CHUBB CORP | 207 | — | — | — | 保険 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 117 | 128 | 1,242 | 134,774 | 家庭用品 |
| CIMAREX ENERGY CO | 75 | 90 | 994 | 107,824 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 137 | 147 | 988 | 107,236 | 保険 |
| CISCO SYSTEMS | 4,436 | 4,890 | 12,963 | 1,406,009 | 通信機器 |
| CINTAS CORP | 89 | 91 | 832 | 90,269 | 商業サービス・用品 |
| CITIGROUP | 2,628 | 2,870 | 12,596 | 1,366,208 | 銀行 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | — | 501 | 1,094 | 118,729 | 銀行 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 143 | 149 | 1,213 | 131,562 | ソフトウェア |
| CLOROX CO | 112 | 126 | 1,659 | 179,953 | 家庭用品 |
| COACH INC | 243 | 265 | 1,078 | 116,950 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| COBALT INTERNATIONAL ENERGY | 236 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COCA COLA CO | 3,420 | 3,992 | 18,059 | 1,958,766 | 飲料 |
| COCA COLA ENTERPRISES | 206 | 207 | 1,109 | 120,338 | 飲料 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP | 525 | 588 | 3,576 | 387,876 | 情報技術サービス |
| COLGATE PALMOLIVE CO. | 796 | 825 | 5,920 | 642,104 | 家庭用品 |
| COLUMBIA PIPELINE GROUP | — | 370 | 947 | 102,813 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| COMCAST CORP-CL A | 1,865 | 2,392 | 14,691 | 1,593,457 | メディア |
| COMCAST CORP SPECIAL CL-A | 366 | — | — | — | メディア |
| COMERICA INC | 159 | 173 | 729 | 79,163 | 銀行 |
| COMPUTER SCIENCE | 126 | — | — | — | 情報技術サービス |
| CONAGRA INC | 367 | 412 | 1,882 | 204,123 | 食品 |
| CONCHO RESOURCES INC | 102 | 123 | 1,396 | 151,455 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CONOCOPHILLIPS | 1,074 | 1,194 | 4,973 | 539,372 | 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 | 2,126 | 230,630 | 総合公益事業 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 147 | 168 | 2,706 | 293,563 | 飲料 |
| CONTINENTAL RESOURCES INC/OK | 80 | 94 | 364 | 39,496 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| THE COOPER COMPANIES, INC. | 41 | 47 | 729 | 79,079 | ヘルスケア機器・用品 |
| CORNING INC | 1,120 | 1,138 | 2,087 | 226,365 | 電子装置・機器・部品 |
| COSTCO WHOLESALE CORPORATION | 382 | 423 | 6,294 | 682,676 | 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 | 713 | 77,347 | 容器・包装 |
| CUMMINS INC | 149 | 161 | 1,809 | 196,308 | 機械 |
| DR HORTON INC | 281 | 317 | 938 | 101,770 | 家庭用耐久財 |
| DTE ENERGY COMPANY | 157 | 170 | 1,535 | 166,570 | 総合公益事業 |
| DANAHER CORP | 547 | 595 | 5,775 | 626,364 | コングロマリット |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 113 | 109 | 702 | 76,193 | ホテル・レストラン・レジャー |
| DAVITA HEALTHCARE PARTNERS INC | 149 | 160 | 1,216 | 131,956 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| DEERE & COMPANY | 297 | 303 | 2,441 | 264,813 | 機械 |
| DELTA AIR LINES INC | 179 | 191 | 809 | 87,835 | 旅客航空輸送業 |
| DENTSPLY INTERNATIONAL INC | 124 | — | — | — | ヘルスケア機器・用品 |
| DENTSPLY SIRONA INC | — | 229 | 1,385 | 150,315 | ヘルスケア機器・用品 |
| DEVON ENERGY CORP | 337 | 434 | 1,303 | 141,403 | 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 | 78 | 83 | 377 | 40,950 | 専門小売り |
| DISNEY (WALT) CO | 1,398 | 1,513 | 15,937 | 1,728,629 | メディア |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 398 | 417 | 2,300 | 249,476 | 消費者金融 |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS INC | 125 | 143 | 402 | 43,660 | メディア |
| DISCOVERY COMMUNICATIONS-C | 246 | 265 | 730 | 79,241 | メディア |
| DISH NETWORK CORP-A | 190 | 220 | 1,048 | 113,746 | メディア |
| DIRECTV | 412 | — | — | — | メディア |
| DOLLAR GENERAL CORP | 266 | 281 | 2,390 | 259,300 | 複合小売り |
| DOLLAR TREE INC | 179 | 213 | 1,748 | 189,690 | 複合小売り |
| DOMINION RESOURCES INC/VA | 504 | 572 | 4,088 | 443,455 | 総合公益事業 |
| DOVER CORP | 145 | 153 | 965 | 104,727 | 機械 |
| DOW CHEM CO | 1,029 | 1,080 | 5,490 | 595,523 | 化学 |
| DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC | 166 | 181 | 1,717 | 186,281 | 飲料 |
| DU PONT E I DE NEMOURS | 791 | 846 | 5,422 | 588,071 | 化学 |
| DUKE ENERGY CORP | 618 | 661 | 5,291 | 573,966 | 電力 |
| DUN & BRADSTREET CORP | 31 | 36 | 402 | 43,637 | 専門サービス |
| EMC CORP | 1,777 | 1,873 | 5,030 | 545,649 | コンピュータ・周辺機器 |
| EOG RESOURCES INC | 474 | 532 | 4,183 | 453,758 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| EQT CORP | 134 | 165 | 1,149 | 124,716 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| E*TRADE FINANCIAL CORP | — | 291 | 724 | 78,620 | 資本市場 |
| EASTMAN CHEMICAL CO. | 126 | 142 | 1,061 | 115,155 | 化学 |
| EATON VANCE CORP | 100 | 117 | 400 | 43,386 | 資本市場 |
| EBAY INC | 976 | 1,041 | 2,500 | 271,202 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ECOLAB INC | 236 | 256 | 2,956 | 320,611 | 化学 |
| EDGEWELL PERSONAL CARE CO | — | 61 | 478 | 51,869 | パーソナル用品 |
| EDISON INTERNATIONAL | 269 | 318 | 2,308 | 250,364 | 電力 |
| EDWARDS LIFESCIENCES CORP | 92 | 211 | 2,244 | 243,451 | ヘルスケア機器・用品 |
| ELECTRONIC ARTS | 266 | 296 | 1,909 | 207,136 | ソフトウェア |
| EMERSON ELEC | 607 | 634 | 3,336 | 361,834 | 電気設備 |
| ENERGEN CORP | 60 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ENERGIZER HOLDINGS INC | 55 | — | — | — | 家庭用品 |
| ENERGY CORP | 159 | 174 | 1,331 | 144,446 | 電力 |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS | — | 188 | 443 | 48,080 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EQUIFAX INC | 106 | 113 | 1,366 | 148,260 | 専門サービス |
| EVERSOURCE ENERGY | 278 | 309 | 1,779 | 192,974 | 電力 |
| EXELON CORPORATION | 745 | 894 | 3,151 | 341,795 | 電力 |
| EXPEDIA INC | 89 | 117 | 1,317 | 142,887 | インターネット販売・カタログ販売 |
| EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC | 173 | 183 | 883 | 95,866 | 航空貨物・物流サービス |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON | 641 | 650 | 4,795 | 520,071 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EXXON MOBIL CORP | 3,677 | 4,020 | 35,605 | 3,861,733 | 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 | 385 | 41,776 | 電子装置・機器・部品 |
| FMC CORP | 118 | 132 | 615 | 66,715 | 化学 |
| FMC TECHNOLOGIES INC | 198 | 225 | 620 | 67,304 | エネルギー設備・サービス |
| FACEBOOK INC-A | 1,736 | 2,193 | 26,149 | 2,836,156 | 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 | 1,209 | 131,170 | 商社・流通業 |
| FEDEX CORPORATION | 232 | 259 | 4,211 | 456,771 | 航空貨物・物流サービス |
| F5 NETWORKS INC | 65 | 70 | 713 | 77,334 | 通信機器 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION | 243 | 269 | 1,929 | 209,248 | 情報技術サービス |
| FNF GROUP | 211 | 244 | 823 | 89,316 | 保険 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 705 | 767 | 1,329 | 144,166 | 銀行 |
| FIREEYE INC | 70 | — | — | — | ソフトウェア |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 114 | 137 | 929 | 100,818 | 銀行 |
| FISERV INC | 214 | 219 | 2,269 | 246,125 | 情報技術サービス |
| FIRSTENERGY CORP | 366 | 403 | 1,352 | 146,644 | 電力 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 66 | 74 | 1,111 | 120,510 | 情報技術サービス |
| FLUOR CORP | 138 | 139 | 711 | 77,158 | 建設・土木 |
| FLOWSERVE CORP | 123 | 123 | 556 | 60,379 | 機械 |
| FOOT LOCKER INC | 123 | 134 | 832 | 90,341 | 専門小売り |
| FORD MOTOR COMPANY | 3,135 | 3,580 | 4,768 | 517,198 | 自動車 |
| FORTINET INC | — | 139 | 445 | 48,333 | ソフトウェア |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | — | 158 | 896 | 97,233 | 建設関連製品 |
| FOSSIL GROUP INC | 41 | — | — | — | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 352 | 378 | 1,358 | 147,387 | 資本市場 |
| FREEPORT-MCMORAN INC | 894 | 1,100 | 1,157 | 125,509 | 金属・鉱業 |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CO | 910 | 1,140 | 598 | 64,913 | 各種電気通信サービス |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | — | 168 | 788 | 85,476 | 保険 |
| GAMESTOP CORP-CLASS A | 100 | 100 | 301 | 32,744 | 専門小売り |
| GAP INC | 212 | 229 | 499 | 54,170 | 専門小売り |
| GARTNER INC | — | 81 | 776 | 84,259 | 情報技術サービス |
| GENERAL DYNAMICS | 246 | 257 | 3,678 | 398,982 | 航空宇宙・防衛 |
| GENERAL ELEC CO | 8,718 | 9,115 | 27,226 | 2,952,986 | コングロマリット |
| GENERAL MILLS | 529 | 578 | 3,625 | 393,253 | 食品 |
| GENERAL MOTORS CO | 1,111 | 1,367 | 4,207 | 456,359 | 自動車 |
| GENUINE PARTS CO | 136 | 148 | 1,435 | 155,721 | 販売 |
| GENWORTH FINANCIAL INC-CL A | 413 | — | — | — | 保険 |
| GILEAD SCIENCES INC | 1,309 | 1,388 | 11,890 | 1,289,697 | バイオテクノロジー |
| GLOBAL PAYMENTS INC | — | 149 | 1,088 | 118,036 | 情報技術サービス |
| GOLDMAN SACHS GROUP | 342 | 370 | 5,837 | 633,115 | 資本市場 |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO | — | 252 | 710 | 77,021 | 自動車部品 |
| GOOGLE INC-CL A | 247 | — | — | — | インターネットソフトウェア・サービス |
| GOOGLE INC-CL C | 250 | — | — | — | インターネットソフトウェア・サービス |
| WR GRACE & CO | — | 67 | 507 | 55,082 | 化学 |
| GRAINGER(W.W.) INC | 53 | 54 | 1,263 | 137,047 | 商社・流通業 |
| HCA HOLDINGS INC | 262 | 313 | 2,534 | 274,910 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| HP INC | — | 1,740 | 1,988 | 215,707 | コンピュータ・周辺機器 |
| HALLIBURTON CO | 732 | 832 | 3,219 | 349,133 | エネルギー設備・サービス |
| HANESBRANDS INC | 340 | 377 | 1,047 | 113,590 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| HARLEY-DAVIDSON INC | 191 | 188 | 862 | 93,592 | 自動車 |
| HARMAN INTERNATIONAL | — | 70 | 513 | 55,650 | 家庭用耐久財 |
| HARRIS CORP | 92 | 119 | 900 | 97,665 | 通信機器 |
| HARTFORD FINANCIAL SERVICES | 370 | 394 | 1,740 | 188,752 | 保険 |
| HASBRO INC | 94 | 108 | 929 | 100,866 | レジャー用品 |
| HELMERICH & PAYNE | 91 | 106 | 617 | 66,991 | 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 | 1,322 | 143,418 | 食品 |
| HERTZ GLOBAL HOLDINGS INC | 387 | 346 | 303 | 32,873 | 陸運・鉄道 |
| HESS CORP | 231 | 275 | 1,497 | 162,464 | 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 | 2,778 | 301,374 | コンピュータ・周辺機器 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | 343 | 486 | 1,076 | 116,703 | ホテル・レストラン・レジャー |
| HOLLYFRONTIER CORP | 166 | 166 | 465 | 50,502 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| HOLOGIC INC | 199 | 231 | 782 | 84,883 | ヘルスケア機器・用品 |
| HOME DEPOT | 1,143 | 1,225 | 16,689 | 1,810,132 | 専門小売り |
| HONEYWELL INTERNATIONAL | 649 | 706 | 7,989 | 866,497 | 航空宇宙・防衛 |
| HORMEL FOODS CORP | 131 | 276 | 1,096 | 118,961 | 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 | 2,461 | 266,951 | 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 | 730 | 79,187 | 陸運・鉄道 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 700 | 750 | 734 | 79,636 | 銀行 |
| IMS HEALTH HOLDINGS INC | — | 163 | 413 | 44,851 | ヘルスケア・テクノロジー |
| IHS INC-CLASS A | 57 | 66 | 805 | 87,417 | 専門サービス |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC | 325 | 317 | 3,299 | 357,880 | 機械 |
| ILLUMINA INC | 122 | 142 | 2,022 | 219,405 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| INCYTE CORP | 130 | 160 | 1,165 | 126,438 | バイオテクノロジー |
| INTEL CORP | 4,195 | 4,561 | 13,591 | 1,474,164 | 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 | 2,982 | 323,506 | 各種金融サービス |
| INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES | 815 | 888 | 13,083 | 1,419,068 | 情報技術サービス |
| INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE | 68 | 77 | 923 | 100,125 | 化学 |
| IP (INTERNATIONAL PAPER CO) | 346 | 376 | 1,598 | 173,400 | 容器・包装 |
| INTERPUBLIC GROUP | 369 | 392 | 923 | 100,168 | メディア |
| INTUIT INC | 234 | 241 | 2,450 | 265,753 | ソフトウェア |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 31 | 35 | 2,220 | 240,883 | ヘルスケア機器・用品 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | — | 121 | 415 | 45,119 | 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 | 3,245 | 3,556 | 21,766 | 2,360,770 | 銀行 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 120 | 123 | 605 | 65,689 | 建設・土木 |
| JARDEN CORP | 156 | — | — | — | 家庭用耐久財 |
| JOHNSON & JOHNSON | 2,430 | 2,672 | 30,385 | 3,295,663 | 医薬品 |
| JOHNSON CONTROLS INC | 584 | 619 | 2,522 | 273,582 | 自動車部品 |
| JONES LANG LASALLE INC | — | 42 | 477 | 51,807 | 不動産管理・開発 |
| JOY GLOBAL INC | 91 | — | — | — | 機械 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 327 | 335 | 760 | 82,514 | 通信機器 |
| KLA TENCOR CORP | 142 | 150 | 1,037 | 112,483 | 半導体・半導体製造装置 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 97 | 108 | 988 | 107,180 | 陸運・鉄道 |
| KELLOGG CO | 235 | 257 | 1,936 | 210,004 | 食品 |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC | 106 | — | — | — | 食品 |
| KEYCORP | 765 | 810 | 955 | 103,666 | 銀行 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 323 | 351 | 4,497 | 487,783 | 家庭用品 |
| KINDER MORGAN INC | 1,571 | 1,836 | 3,123 | 338,724 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KOHL'S CORP | 182 | 191 | 805 | 87,358 | 複合小売り |
| KRAFT HEINZ CO/THE | — | 586 | 4,937 | 535,536 | 食品 |
| KRAFT FOODS GROUP INC | 509 | — | — | — | 食品 |
| KROGER CO | 402 | 890 | 3,189 | 345,961 | 食品・生活必需品小売り |
| L BRANDS, INC | 213 | 240 | 1,680 | 182,290 | 専門小売り |
| LKQ CORP | 263 | 300 | 978 | 106,106 | 販売 |
| L-3 COMMUNICATIONS HLDGS | 75 | 77 | 1,046 | 113,520 | 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 | 1,236 | 134,154 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| LAM RESEARCH | 140 | 154 | 1,149 | 124,669 | 半導体・半導体製造装置 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 344 | 379 | 1,703 | 184,772 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 204 | 216 | 2,024 | 219,608 | パーソナル用品 |
| LEAR CORP | — | 74 | 851 | 92,379 | 自動車部品 |
| LEGGETT & PLATT INC | 123 | 134 | 664 | 72,072 | 家庭用耐久財 |
| LEGG MASON INC | 92 | 92 | 285 | 30,942 | 資本市場 |
| LENNAR CORP-A | 156 | 168 | 737 | 79,973 | 家庭用耐久財 |
| LEUCADIA NATIONAL CORP | 272 | 322 | 538 | 58,393 | 各種金融サービス |
| LEVEL 3 COMMUNICATIONS INC | 248 | 290 | 1,489 | 161,544 | 各種電気通信サービス |
| LIBERTY INTERACTIVE CORPORATION QVC GR-A | 381 | 436 | 1,151 | 124,936 | インターネット販売・カタログ販売 |
| LIBERTY MEDIA CORP-A | 81 | — | — | — | メディア |
| LIBERTY MEDIA CORP-C | 179 | — | — | — | メディア |
| LIBERTY SIRIUSXM GROUP | — | 81 | 264 | 28,719 | メディア |
| LIBERTY SIRIUS GROUP-C | — | 193 | 615 | 66,712 | メディア |
| ELI LILLY & CO. | 868 | 965 | 7,294 | 791,154 | 医薬品 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 223 | 239 | 994 | 107,835 | 保険 |
| LINEAR TECHNOLOGY CORP | 213 | 225 | 994 | 107,887 | 半導体・半導体製造装置 |
| LINKEDIN CORP - A | 95 | 113 | 1,374 | 149,032 | インターネットソフトウェア・サービス |
| LOCKHEED MARTIN | 234 | 267 | 6,438 | 698,284 | 航空宇宙・防衛 |
| LOEWS CORP | 295 | 269 | 1,060 | 115,010 | 保険 |
| LORILLARD INC | 315 | — | — | — | タバコ |
| LOWES COS INC | 861 | 885 | 6,711 | 727,966 | 専門小売り |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 98 | 106 | 678 | 73,613 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| M & T BANK CORP | 102 | 141 | 1,605 | 174,170 | 銀行 |
| MDU RESOURCES GROUP INC | 151 | — | — | — | 総合公益事業 |
| MGM RESORTS INTERNATIONAL | 336 | 423 | 924 | 100,244 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MSCI INC | — | 93 | 710 | 77,073 | 各種金融サービス |
| MACYS INC | 297 | 304 | 1,147 | 124,435 | 複合小売り |
| MANPOWERGROUP INC | 70 | 70 | 537 | 58,292 | 専門サービス |
| MARATHON OIL CORP | 593 | 794 | 908 | 98,518 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 246 | 508 | 1,775 | 192,566 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| MARKEL CORP | — | 13 | 1,293 | 140,246 | 保険 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 472 | 501 | 3,177 | 344,614 | 保険 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA | 194 | 199 | 1,375 | 149,207 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 51 | 55 | 1,002 | 108,717 | 建設資材 |
| MASCO CORP | 310 | 329 | 1,043 | 113,187 | 建設関連製品 |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 868 | 955 | 9,236 | 1,001,818 | 情報技術サービス |
| MATTEL INC | 301 | 334 | 1,036 | 112,371 | レジャー用品 |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 239 | 271 | 971 | 105,402 | 半導体・半導体製造装置 |
| MCCORMICK & CO INC. | 101 | 113 | 1,095 | 118,700 | 食品 |
| MCDONALD'S CORP | 843 | 885 | 11,578 | 1,255,799 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MCGRAW HILL FINANCIAL INC | 237 | — | — | — | 各種金融サービス |
| MCKESSON CORP | 202 | 221 | 3,812 | 413,552 | 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 | 1,623 | 176,069 | 食品 |
| MEADWESTVACO CORP | 140 | — | — | — | 容器・包装 |
| MEDIVATION INC | 66 | 154 | 963 | 104,459 | バイオテクノロジー |
| MEDNAX INC | — | 91 | 633 | 68,743 | 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 | 149 | 16,265 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MERCK & CO INC | 2,474 | 2,691 | 14,558 | 1,578,994 | 医薬品 |
| METLIFE INC | 835 | 914 | 3,922 | 425,476 | 保険 |
| METTLER-TOLEDO INTL | 25 | 27 | 971 | 105,405 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| MICROSOFT CORP | 6,800 | 7,327 | 36,686 | 3,978,994 | ソフトウェア |
| MICROCHIP TECHNOLOGY | 178 | 207 | 984 | 106,800 | 半導体・半導体製造装置 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | | 業 種 等 |
|---------------------------------|---------|-------|--------|-----------|-------------------------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | | |
| MICRON TECHNOLOGY | 925 | 1,031 | 1,017 | 110,368 | 半導体・半導体製造装置 | |
| MOHAWK INDUSTRIES | 54 | 60 | 1,179 | 127,948 | 家庭用耐久財 | |
| MOLSON COORS BREWING CO-B | 135 | 180 | 1,784 | 193,529 | 飲料 | |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 1,467 | 1,533 | 6,788 | 736,239 | 食品 | |
| MONSANTO CO | 423 | 427 | 3,801 | 412,319 | 化学 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 122 | — | — | — | 飲料 | |
| MONSTER BEVERAGE CORP | — | 137 | 2,042 | 221,571 | 飲料 | |
| MOODYS CORP | 165 | 169 | 1,599 | 173,509 | 各種金融サービス | |
| MORGAN STANLEY | 1,283 | 1,397 | 3,646 | 395,463 | 資本市場 | |
| MOSAIC CO/THE | 281 | 313 | 780 | 84,632 | 化学 | |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 197 | 151 | 1,069 | 115,985 | 通信機器 | |
| MURPHY OIL CORP | 150 | 150 | 432 | 46,919 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| NRG ENERGY INC | 294 | 294 | 460 | 49,903 | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| NASDAQ INC | 101 | 111 | 715 | 77,651 | 各種金融サービス | |
| NATIONAL OILWELL VARCO INC | 370 | 366 | 1,149 | 124,725 | エネルギー設備・サービス | |
| NAVIENT CORP | 371 | 339 | 446 | 48,423 | 消費者金融 | |
| NETAPP INC | 279 | 279 | 641 | 69,629 | コンピュータ・周辺機器 | |
| NETFLIX INC | 49 | 391 | 3,540 | 383,960 | インターネット販売・カタログ販売 | |
| NETSUITE INC | 28 | 39 | 296 | 32,109 | ソフトウェア | |
| HONGKONG LAND HOLDINGS LTD | — | 560 | 346 | 37,535 | 不動産管理・開発 | |
| JARDINE MATHESON HLDGS LTD | — | 234 | 1,300 | 141,060 | コングロマリット | |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP | 399 | 471 | 689 | 74,787 | 貯蓄・抵当・不動産金融 | |
| NEWELL BRANDS INC | 241 | 427 | 2,043 | 221,673 | 家庭用耐久財 | |
| NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO | 424 | 517 | 1,645 | 178,482 | 金属・鉱業 | |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I | 336 | 374 | 459 | 49,812 | メディア | |
| NEXTERA ENERGY INC | 377 | 445 | 5,290 | 573,819 | 電力 | |
| NIKE INC-B | 597 | 1,312 | 7,704 | 835,582 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| NISOURCE INC | 273 | — | — | — | 総合公益事業 | |
| NOBLE ENERGY INC | 333 | 411 | 1,448 | 157,089 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| NORDSTROM INC | 121 | 137 | 674 | 73,106 | 複合小売り | |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 270 | 287 | 2,533 | 274,798 | 陸運・鉄道 | |
| NORTHERN TRUST CORP | 197 | 214 | 1,470 | 159,502 | 資本市場 | |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 168 | 166 | 3,562 | 386,427 | 航空宇宙・防衛 | |
| NUANCE COMMUNICATIONS INC | 209 | 250 | 416 | 45,200 | ソフトウェア | |
| NUCOR CORP | 281 | 307 | 1,426 | 154,765 | 金属・鉱業 | |
| NVIDIA CORP | 480 | 526 | 1,855 | 201,272 | 半導体・半導体製造装置 | |
| OGE ENERGY CORP | 166 | 196 | 589 | 63,965 | 電力 | |
| OREILLY AUTOMOTIVE INC, | 87 | 96 | 2,565 | 278,202 | 専門小売り | |
| OCCIDENTAL PETE CORP | 681 | 738 | 5,574 | 604,648 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| OCEANEERING INTL INC | 94 | 95 | 307 | 33,311 | 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 | 213 | 231 | 1,932 | 209,628 | メディア | |
| ONEOK INC | 183 | 198 | 776 | 84,268 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| ORACLE CORPORATION | 3,075 | 3,082 | 12,130 | 1,315,701 | ソフトウェア | |
| OWENS-ILLINOIS INC | 140 | — | — | — | 容器・包装 | |
| PG&E CORP | 409 | 473 | 2,796 | 303,294 | 電力 | |
| PNC FINANCIAL | 460 | 487 | 4,139 | 448,917 | 銀行 | |
| PPG INDUSTRIES | 119 | 258 | 2,771 | 300,645 | 化学 | |
| PPL CORPORATION | 572 | 654 | 2,513 | 272,665 | 電力 | |
| PVH CORP | 71 | 82 | 751 | 81,510 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| PACCAR | 306 | 345 | 1,926 | 208,946 | 機械 | |
| PACKAGING CORP OP AMERICA | — | 89 | 583 | 63,323 | 容器・包装 | |
| PALL CORP | 95 | — | — | — | 機械 | |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 58 | 77 | 1,073 | 116,444 | 通信機器 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-------------------------------|---------|-------|--------|-----------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| PARKER HANNIFIN CORP | 127 | 132 | 1,465 | 158,987 | 機械 |
| PATTERSON COS INC | 75 | 87 | 378 | 41,084 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| PAYCHEX INC | 288 | 317 | 1,648 | 178,751 | 情報技術サービス |
| PAYPAL HOLDINGS INC | — | 1,057 | 4,187 | 454,212 | 情報技術サービス |
| PEOPLES UNITED FINANCIAL INC | 270 | 305 | 461 | 50,050 | 銀行 |
| PEPCO HOLDINGS INC | 227 | — | — | — | 電力 |
| PEPSICO INC | 1,298 | 1,408 | 14,823 | 1,607,748 | 飲料 |
| PHARMACYCLICS INC | 56 | — | — | — | バイオテクノロジ |
| PFIZER INC | 5,469 | 5,965 | 20,173 | 2,188,031 | 医薬品 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 1,347 | 1,497 | 15,028 | 1,629,978 | タバコ |
| PHILLIPS 66 | 484 | 517 | 4,049 | 439,170 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PINNACLE WEST CAPITAL CORP | 98 | 105 | 772 | 83,783 | 電力 |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 128 | 156 | 2,494 | 270,597 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A | — | 190 | 171 | 18,587 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| POLARIS INDUSTRIES INC | 56 | 62 | 547 | 59,350 | レジャー用品 |
| PRAXAIR INC | 253 | 276 | 3,119 | 338,354 | 化学 |
| PRECISION CASTPARTS CORP | 123 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 223 | 240 | 1,800 | 195,332 | 資本市場 |
| PRICELINE GROUP INC/THE | 45 | 48 | 5,975 | 648,115 | インターネット販売・カタログ販売 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 256 | 280 | 1,173 | 127,275 | 保険 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 2,345 | 2,628 | 21,581 | 2,340,690 | 家庭用品 |
| PROGRESSIVE CO | 477 | 569 | 1,886 | 204,581 | 保険 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 397 | 435 | 3,289 | 356,823 | 保険 |
| PUBLIC SVC ENTERPRISE | 434 | 493 | 2,277 | 247,035 | 総合公益事業 |
| PULTEGROUP INC | 295 | 295 | 539 | 58,488 | 家庭用耐久財 |
| QEP RESOURCES INC | 147 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| QORVO INC | 125 | 139 | 634 | 68,776 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUALCOMM INC | 1,442 | 1,450 | 7,424 | 805,207 | 半導体・半導体製造装置 |
| QUANTA SERVICES INC | 186 | 163 | 378 | 41,032 | 建設・土木 |
| QUEST DIAGNOSTICS INC | 126 | 141 | 1,079 | 117,051 | 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 | 589 | 63,976 | 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 | 523 | 56,804 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| RANGE RESOURCES CORP | 143 | 167 | 696 | 75,530 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 111 | 120 | 604 | 65,544 | 資本市場 |
| RAYTHEON COMPANY | 270 | 291 | 3,790 | 411,093 | 航空宇宙・防衛 |
| REALOGY HOLDINGS CORP | 130 | 140 | 426 | 46,282 | 不動産管理・開発 |
| RED HAT INC | 167 | 178 | 1,276 | 138,500 | ソフトウェア |
| REGENERON PHARMACEUTICALS | 69 | 74 | 2,797 | 303,389 | バイオテクノロジ |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 1,200 | 1,260 | 1,140 | 123,676 | 銀行 |
| REPUBLIC SERVICES INC-CL A | 252 | 229 | 1,107 | 120,163 | 商業サービス・用品 |
| RESMED INC | 122 | 132 | 750 | 81,376 | ヘルスケア機器・用品 |
| REYNOLDS AMERICAN INC | 276 | 825 | 4,115 | 446,323 | タバコ |
| RITE AID CORP | — | 1,000 | 807 | 87,527 | 食品・生活必需品小売り |
| ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | 121 | 133 | 518 | 56,243 | 専門サービス |
| ROCK-TENN COMPANY CL-A | 118 | — | — | — | 容器・包装 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 119 | 129 | 1,435 | 155,709 | 電気設備 |
| ROCKWELL COLLINS INC | 105 | 128 | 1,159 | 125,765 | 航空宇宙・防衛 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 86 | 96 | 1,676 | 181,858 | コングロマリット |
| ROSS STORES INC | 184 | 394 | 2,291 | 248,536 | 専門小売り |
| SBA COMMUNICATIONS CORP-CL A | 114 | 121 | 1,212 | 131,512 | 各種電気通信サービス |
| S&P GLOBAL INC | — | 258 | 2,696 | 292,474 | 各種金融サービス |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 129 | 129 | 623 | 67,648 | 資本市場 |
| SPX CORP | 33 | — | — | — | 機械 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------|-------|--------|-----------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| SABRE CORP | — | 200 | 572 | 62,104 | 情報技術サービス |
| ST JUDE MEDICAL INC | 250 | 270 | 2,028 | 219,982 | ヘルスケア機器・用品 |
| SALESFORCE.COM INC | 518 | 610 | 4,551 | 493,690 | ソフトウェア |
| SAN DISK CORPORATION | 188 | 194 | 1,464 | 158,882 | コンピュータ・周辺機器 |
| SCANA CORP | 113 | 131 | 915 | 99,273 | 総合公益事業 |
| HENRY SCHEIN INC | 74 | 80 | 1,376 | 149,250 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| SCHLUMBERGER LTD | 1,116 | 1,345 | 9,789 | 1,061,803 | エネルギー設備・サービス |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 1,024 | 1,148 | 3,130 | 339,544 | 資本市場 |
| SCRIPPS NETWORKS INTER-CL A | 71 | 71 | 462 | 50,115 | メディア |
| SEALED AIR CORP | 179 | 192 | 907 | 98,394 | 容器・包装 |
| SEMPRA ENERGY | 201 | 230 | 2,406 | 261,007 | 総合公益事業 |
| SERVICENOW INC | 113 | 143 | 964 | 104,582 | ソフトウェア |
| SHERWIN-WILLIAMS | 70 | 76 | 2,243 | 243,377 | 化学 |
| SIGMA-ALDRICH | 103 | — | — | — | 化学 |
| SIGNATURE BANK | — | 48 | 639 | 69,329 | 銀行 |
| SIRIUS XM HOLDINGS INC | 2,220 | 2,040 | 801 | 86,954 | メディア |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 163 | 182 | 1,183 | 128,406 | 半導体・半導体製造装置 |
| JM SMUCKER CO/THE=NEW | 87 | 112 | 1,449 | 157,213 | 食品 |
| SNAP-ON INC | 49 | 54 | 870 | 94,419 | 機械 |
| SOUTHERN CO. | 777 | 874 | 4,353 | 472,169 | 電力 |
| SOUTHWEST AIRLINES | 153 | 153 | 645 | 70,011 | 旅客航空輸送業 |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO | 336 | 400 | 461 | 50,021 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SPECTRA ENERGY CORP | 581 | 653 | 2,028 | 220,051 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SPLUNK INC | — | 128 | 603 | 65,457 | ソフトウェア |
| SPRINT CORP | 650 | 710 | 241 | 26,182 | 無線通信サービス |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 127 | 145 | 1,607 | 174,346 | 機械 |
| STAPLES INC | 550 | 620 | 638 | 69,262 | 専門小売り |
| STARBUCKS CORP | 1,306 | 1,437 | 8,139 | 882,774 | ホテル・レストラン・レジャー |
| STARWOOD HOTELS & RESORTS | 153 | 162 | 1,316 | 142,778 | ホテル・レストラン・レジャー |
| STATE STREET CORP | 366 | 393 | 2,350 | 254,896 | 資本市場 |
| STERICYCLE INC | 75 | 81 | 777 | 84,347 | 商業サービス・用品 |
| STRYKER CORP | 297 | 329 | 3,662 | 397,226 | ヘルスケア機器・用品 |
| SUNTRUST BKS INC. | 448 | 496 | 2,001 | 217,121 | 銀行 |
| SUPERIOR ENERGY SERVICES INC | 132 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| SYMANTEC CORP | 601 | 652 | 1,084 | 117,671 | ソフトウェア |
| SYNOPSYS INC | 131 | 149 | 715 | 77,554 | ソフトウェア |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 143 | 805 | 2,411 | 261,581 | 消費者金融 |
| SYSCO CORP | 505 | 542 | 2,694 | 292,280 | 食品・生活必需品小売り |
| TD AMERITRADE HOLDING CORP | 240 | 254 | 723 | 78,459 | 資本市場 |
| TECO ENERGY INC | — | 224 | 622 | 67,467 | 総合公益事業 |
| TJX COS INC | 599 | 643 | 5,001 | 542,436 | 専門小売り |
| T-MOBILE US INC | 205 | 271 | 1,081 | 117,276 | 無線通信サービス |
| TRW AUTOMOTIVE HOLDINGS CORP | 98 | — | — | — | 自動車部品 |
| TABLEAU SOFTWARE INC-CL A | — | 49 | 227 | 24,654 | ソフトウェア |
| TARGET CORP | 528 | 567 | 4,532 | 491,544 | 複合小売り |
| TEGNA INC | — | 206 | 469 | 50,963 | メディア |
| TERADATA CORP | 139 | 132 | 359 | 38,941 | 情報技術サービス |
| TESORO CORP | 113 | 113 | 855 | 92,790 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TESLA MOTORS INC | 77 | 95 | 1,993 | 216,171 | 自動車 |
| TEXAS INSTRUMENTS INC | 922 | 980 | 5,577 | 604,900 | 半導体・半導体製造装置 |
| TEXTRON INC | 235 | 264 | 1,004 | 108,950 | 航空宇宙・防衛 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 346 | 386 | 5,702 | 618,469 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| 3M CORP | 527 | 593 | 10,001 | 1,084,780 | コングロマーット |
| TIFFANY & CO | 112 | 127 | 880 | 95,525 | 専門小売り |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--------------------------------------|---------|-------|--------|-----------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| TIME WARNER INC | 732 | 772 | 5,725 | 620,949 | メディア |
| TIME WARNER CABLE-A | 242 | 273 | 5,847 | 634,182 | メディア |
| TOLL BROTHERS INC | 147 | 164 | 437 | 47,421 | 家庭用耐久財 |
| TORCHMARK CORP | 112 | 122 | 710 | 77,010 | 保険 |
| TOWERS WATSON & CO-CL A | 63 | — | — | — | 専門サービス |
| TOTAL SYSTEM SERVICES INC | 138 | 163 | 861 | 93,415 | 情報技術サービス |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 118 | 132 | 1,241 | 134,663 | 専門小売り |
| TRANSDIGM GROUP INC | 43 | 52 | 1,180 | 128,010 | 航空宇宙・防衛 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 290 | 295 | 3,268 | 354,544 | 保険 |
| TRIMBLE NAVIGATION LTD | 232 | 232 | 537 | 58,327 | 電子装置・機器・部品 |
| TRIPADVISOR INC | 103 | 115 | 725 | 78,691 | インターネット販売・カタログ販売 |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC | 1,187 | 1,122 | 3,299 | 357,896 | メディア |
| TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B | 379 | 428 | 1,258 | 136,477 | メディア |
| TWITTER INC | 328 | 567 | 805 | 87,325 | インターネットソフトウェア・サービス |
| TYSON FOODS INC-CL A | 266 | 285 | 1,944 | 210,937 | 食品 |
| US BANCORP | 1,561 | 1,688 | 7,011 | 760,516 | 銀行 |
| ULTA SALON COSMETICS & FRAGR | 53 | 59 | 1,238 | 134,300 | 専門小売り |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS A | 144 | 171 | 661 | 71,775 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| UNDER ARMOUR INC-CLASS C | — | 171 | 620 | 67,342 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| UNION PAC CORP | 771 | 824 | 6,973 | 756,347 | 陸運・鉄道 |
| UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC | 83 | 93 | 425 | 46,106 | 旅客航空輸送業 |
| UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 613 | 674 | 6,921 | 750,684 | 航空貨物・物流サービス |
| UNITED RENTALS INC | 86 | 86 | 524 | 56,916 | 商社・流通業 |
| UNITED TECHNOLOGIES | 751 | 815 | 8,157 | 884,744 | 航空宇宙・防衛 |
| UNITED THERAPEUTICS CORP | — | 43 | 484 | 52,536 | バイオテクノロジー |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 832 | 918 | 12,179 | 1,320,945 | 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 | 1,175 | 127,452 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| UNUM GROUP | 227 | 227 | 760 | 82,453 | 保険 |
| URBAN OUTFITTERS INC | 96 | — | — | — | 専門小売り |
| V F CORP | 297 | 331 | 2,137 | 231,879 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| VALERO ENERGY CORP | 457 | 462 | 2,540 | 275,496 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VANTIV INC - CL A | 127 | 151 | 841 | 91,304 | 情報技術サービス |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 88 | 95 | 780 | 84,603 | ヘルスケア機器・用品 |
| VERISIGN INC | 96 | 99 | 836 | 90,732 | インターネットソフトウェア・サービス |
| VERIZON COMMUNICATIONS | 3,602 | 3,931 | 20,079 | 2,177,827 | 各種電気通信サービス |
| VERISK ANALYTICS INC | 130 | 152 | 1,182 | 128,210 | 専門サービス |
| VERTEX PHARMACEUTICALS | 211 | 240 | 2,113 | 229,223 | バイオテクノロジー |
| VIACOM INC-CLASS B | 309 | 341 | 1,378 | 149,529 | メディア |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 1,711 | 1,875 | 14,666 | 1,590,701 | 情報技術サービス |
| VMWARE INC - CLASS A | 74 | 74 | 409 | 44,448 | ソフトウェア |
| VOYA FINANCIAL INC | 198 | 211 | 636 | 69,044 | 各種金融サービス |
| VULCAN MATERIALS CO | 117 | 128 | 1,479 | 160,444 | 建設資材 |
| WABCO HOLDINGS INC | — | 52 | 546 | 59,247 | 機械 |
| WEC ENERGY GROUP INC | — | 302 | 1,814 | 196,791 | 総合公益事業 |
| WABTEC CORP | 82 | 94 | 735 | 79,818 | 機械 |
| WAL-MART STORES INC | 1,397 | 1,545 | 10,652 | 1,155,399 | 食品・生活必需品小売り |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 761 | 843 | 6,819 | 739,591 | 食品・生活必需品小売り |
| WASTE CONNECTIONS INC | — | 117 | 808 | 87,686 | 商業サービス・用品 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 381 | 428 | 2,619 | 284,095 | 商業サービス・用品 |
| WATERS CORP | 73 | 80 | 1,069 | 116,017 | ライフサイエンス・ツール/サービス |
| WELLS FARGO CO | 4,278 | 4,687 | 22,910 | 2,484,824 | 銀行 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 192 | 220 | 813 | 88,190 | コンピュータ・周辺機器 |
| WESTERN UNION CO | 463 | 491 | 935 | 101,448 | 情報技術サービス |
| WESTLAKE CHEMICAL CORP | 41 | 41 | 187 | 20,291 | 化学 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-------------------------------|---------|-------|--------|-----------|--------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | |
| WESTROCK CO | — | 243 | 1,010 | 109,560 | 容器・包装 |
| WHIRLPOOL CORP | 68 | 76 | 1,341 | 145,465 | 家庭用耐久財 |
| WHITEWAVE FOODS CO - CL A | — | 175 | 728 | 79,053 | 食品 |
| WHITING PETROLEUM CORP | 178 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WHOLE FOODS MARKET INC | 308 | 332 | 1,006 | 109,178 | 食品・生活必需品小売り |
| WILLIAMS COS | 622 | 695 | 1,316 | 142,769 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WISCONSIN ENERGY CORP | 196 | — | — | — | 総合公益事業 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 83 | 107 | 751 | 81,503 | ソフトウェア |
| WYNDHAM WORLDWIDE CORP | 110 | 109 | 766 | 83,097 | ホテル・レストラン・レジャー |
| WYNN RESORTS LTD | 69 | 77 | 690 | 74,845 | ホテル・レストラン・レジャー |
| XCEL ENERGY INC | 437 | 483 | 1,988 | 215,621 | 電力 |
| XILINX INC | 229 | 250 | 1,076 | 116,784 | 半導体・半導体製造装置 |
| XEROX CORP | 956 | 890 | 832 | 90,254 | 情報技術サービス |
| XYLEM INC | 154 | 170 | 707 | 76,702 | 機械 |
| YAHOO! INC | 788 | 869 | 3,230 | 350,427 | インターネットソフトウェア・サービス |
| YUM BRANDS INC | 383 | 415 | 3,398 | 368,549 | 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 | 227 | 24,708 | インターネットソフトウェア・サービス |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 147 | 184 | 2,142 | 232,355 | ヘルスケア機器・用品 |
| ZOETIS INC | 439 | 460 | 2,185 | 236,985 | 医薬品 |
| ACTAVIS PLC | 326 | — | — | — | 医薬品 |
| ALKERMES PLC | 123 | 138 | 548 | 59,510 | バイオテクノロジー |
| ALLERGAN PLC | — | 379 | 8,116 | 880,337 | 医薬品 |
| AON PLC | 238 | 263 | 2,753 | 298,685 | 保険 |
| ARCH CAPITAL GROUP LTD | 114 | 121 | 851 | 92,390 | 保険 |
| AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | 80 | 95 | 517 | 56,113 | 保険 |
| AXALTA COATING SYSTEMS LTD | — | 145 | 410 | 44,506 | 化学 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 548 | 603 | 6,962 | 755,189 | 情報技術サービス |
| BUNGE LIMITED | 128 | 138 | 837 | 90,822 | 食品 |
| DELPHI AUTOMOTIVE PLC | 260 | 273 | 1,911 | 207,326 | 自動車部品 |
| EATON CORP PLC | 409 | 445 | 2,699 | 292,773 | 電気設備 |
| ENDO INTERNATIONAL PLC | 153 | 205 | 313 | 33,951 | 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 | 726 | 78,808 | 保険 |
| INGERSOLL-RAND PLC | 233 | 251 | 1,637 | 177,633 | 機械 |
| WEATHERFORD INTERNATIONAL PLC | 664 | 850 | 447 | 48,584 | エネルギー設備・サービス |
| INVESCO LTD | 376 | 412 | 1,217 | 132,001 | 資本市場 |
| JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | 51 | 58 | 856 | 92,907 | 医薬品 |
| LIBERTY GLOBAL PLC-A | 212 | 237 | 885 | 96,033 | メディア |
| LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C | 557 | 574 | 2,082 | 225,864 | メディア |
| MALLINCKRODT PLC | 100 | 111 | 664 | 72,053 | 医薬品 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 319 | 410 | 396 | 42,956 | 半導体・半導体製造装置 |
| MEDTRONIC PLC | 1,228 | 1,362 | 10,940 | 1,186,655 | ヘルスケア機器・用品 |
| MICHAEL KORS HOLDINGS LTD | 176 | 179 | 907 | 98,391 | 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 | 1,726 | 187,286 | 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 | 738 | 80,124 | ホテル・レストラン・レジャー |
| PARTNERRE LTD | 37 | — | — | — | 保険 |
| RENAISSANCE HOLDINGS LTD | 40 | 44 | 500 | 54,303 | 保険 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 282 | 290 | 546 | 59,321 | コンピュータ・周辺機器 |
| PENTAIR PLC | 167 | 174 | 1,000 | 108,551 | 機械 |
| SIGNET JEWELERS LTD | 65 | 71 | 764 | 82,874 | 専門小売り |
| TYCO INTERNATIONAL PLC | 358 | 403 | 1,518 | 164,696 | 商業サービス・用品 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|--|---------|-------|---------|---------|-------------------------|-------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (アメリカ) | 百株 | 百株 | 千米ドル | 千円 | | |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | — | 124 | 1,530 | 166,014 | 保険 | |
| WILLIS GROUP HOLDINGS PLC | 140 | — | — | — | 保険 | |
| PERRIGO CO PLC | 123 | 139 | 1,308 | 141,890 | 医薬品 | |
| XL GROUP PLC | 267 | 288 | 960 | 104,173 | 保険 | |
| ACE LTD | 290 | — | — | — | 保険 | |
| CHUBB LTD | — | 446 | 5,481 | 594,506 | 保険 | |
| GARMIN LTD | 102 | 114 | 460 | 49,964 | 家庭用耐久財 | |
| TE CONNECTIVITY LTD | 354 | 371 | 2,186 | 237,166 | 電子装置・機器・部品 | |
| CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD. | — | 67 | 552 | 59,936 | ソフトウェア | |
| TARO PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD | — | 8 | 106 | 11,556 | 医薬品 | |
| AERCAP HOLDINGS NV | — | 87 | 348 | 37,753 | 商社・流通業 | |
| CORE LABORATORIES N. V. | 38 | 43 | 522 | 56,627 | エネルギー設備・サービス | |
| MOBILEYE NV | — | 84 | 297 | 32,269 | ソフトウェア | |
| LYONDELLBASELL INDU-CL A | 368 | 366 | 2,970 | 322,175 | 化学 | |
| MYLAN NV | 362 | 404 | 1,647 | 178,645 | 医薬品 | |
| NIELSEN NV | 299 | — | — | — | 専門サービス | |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | — | 132 | 1,128 | 122,431 | 半導体・半導体製造装置 | |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 139 | 169 | 584 | 63,439 | 電気設備 | |
| ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | 145 | 169 | 1,279 | 138,811 | 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 | 5,341 | 579,330 | 半導体・半導体製造装置 | |
| FLEXTRONICS INTL LTD | 510 | 550 | 666 | 72,239 | 電子装置・機器・部品 | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 270,174 | 303,609 | 1,766,647 | 191,610,556 |
| 銘 柄 数 < 比 率 > | 592 | 597 | — | — | — | <61.8%> |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | | |
| ARC RESOURCES LTD | 266 | 335 | 693 | 57,965 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 186 | 206 | 1,177 | 98,461 | 金属・鉱業 | |
| AGRIUM INC | 124 | 126 | 1,381 | 115,455 | 化学 | |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B | 364 | 401 | 2,179 | 182,178 | 食品・生活必需品小売り | |
| ALTAGAS LTD | 121 | 141 | 410 | 34,274 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| ATCO LTD CL1 | 68 | 68 | 285 | 23,878 | 総合公益事業 | |
| BCE INC | 130 | 141 | 834 | 69,715 | 各種電気通信サービス | |
| BANK OF MONTREAL | 565 | 618 | 4,973 | 415,748 | 銀行 | |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX | 1,053 | 1,162 | 7,168 | 599,204 | 銀行 | |
| BARRICK GOLD | 1,015 | 1,130 | 2,544 | 212,716 | 金属・鉱業 | |
| BAYTEX ENERGY CORP | 185 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| BLACKBERRY LTD | 439 | 509 | 433 | 36,207 | コンピュータ・周辺機器 | |
| BOMBARDIER B SHEARS | 1,160 | 1,670 | 332 | 27,779 | 航空宇宙・防衛 | |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 496 | 847 | 3,685 | 308,053 | 不動産管理・開発 | |
| CAE INC | 212 | 260 | 396 | 33,165 | 航空宇宙・防衛 | |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | — | 26 | 603 | 50,411 | 容器・包装 | |
| CI FINANCIAL CORP | 205 | 226 | 600 | 50,232 | 資本市場 | |
| CAMECO CORP | 346 | 386 | 579 | 48,463 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 345 | 383 | 3,788 | 316,660 | 銀行 | |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 712 | 769 | 5,837 | 487,954 | 陸運・鉄道 | |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 956 | 1,063 | 3,808 | 318,371 | 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 | 2,480 | 207,346 | 陸運・鉄道 | |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A | 64 | 70 | 984 | 82,333 | 複合小売り | |
| CANADIAN UTILITIES LTD A | 106 | 124 | 448 | 37,449 | 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 | 1,466 | 122,563 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 15 | 17 | 886 | 74,067 | ソフトウェア | |
| CONSTELLATION SOFTWARE-RIGHTS | 15 | — | — | — | ソフトウェア | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|-------------------------------------|---------|-------|--------|---------|----------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダドル | 千円 | |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 359 | 488 | 953 | 79,666 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DOLLARAMA INC | 108 | 115 | 1,055 | 88,217 | 複合小売り |
| ELDORADO GOLD CORPORATION | 628 | 628 | 341 | 28,557 | 金属・鉱業 |
| ELEMENT FINANCIAL CORP | — | 360 | 529 | 44,235 | 各種金融サービス |
| EMPIRE CO LTD A | 46 | 162 | 343 | 28,694 | 食品・生活必需品小売り |
| ENCANA CORP | 720 | 790 | 610 | 51,045 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ENBRIDGE INC | 739 | 883 | 4,408 | 368,533 | 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 | 1,412 | 118,057 | 保険 |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 149 | 149 | 312 | 26,142 | 商社・流通業 |
| FIRST CAPITAL REALTY INC | 77 | 113 | 233 | 19,533 | 不動産管理・開発 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 510 | 704 | 561 | 46,960 | 金属・鉱業 |
| FORTIS INC | 235 | 273 | 1,093 | 91,417 | 電力 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 135 | 165 | 1,439 | 120,310 | 金属・鉱業 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 208 | 231 | 896 | 74,900 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| GOLDCORP INC | 707 | 800 | 1,892 | 158,152 | 金属・鉱業 |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 261 | 280 | 955 | 79,858 | 保険 |
| CGI GROUP INC - CLASS A | 188 | 214 | 1,215 | 101,605 | 情報技術サービス |
| HUSKY ENERGY INC | 301 | 357 | 528 | 44,191 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| IGM FINANCIAL INC | 85 | 103 | 380 | 31,813 | 資本市場 |
| IMPERIAL OIL | 253 | 283 | 1,146 | 95,853 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC | 83 | 99 | 405 | 33,937 | 保険 |
| INTACT FINANCIAL CORP | 111 | 127 | 1,113 | 93,112 | 保険 |
| INTER PIPELINE LTD | 280 | 331 | 832 | 69,585 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A | 62 | 94 | 179 | 14,992 | 食品・生活必需品小売り |
| KEYERA CORP | 144 | 161 | 587 | 49,121 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| KINROSS GOLD CORP | 1,046 | 1,186 | 800 | 66,917 | 金属・鉱業 |
| LINAMAR CORP | — | 48 | 256 | 21,425 | 自動車部品 |
| LOBLAW COMPANIES | 202 | 214 | 1,477 | 123,464 | 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 | 2,064 | 172,575 | 自動車部品 |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 1,726 | 1,918 | 3,479 | 290,830 | 保険 |
| METHANEX CORP | 82 | 82 | 315 | 26,334 | 化学 |
| METRO INC | 229 | 232 | 996 | 83,311 | 食品・生活必需品小売り |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 280 | 334 | 1,368 | 114,412 | 銀行 |
| NEW GOLD INC | 431 | — | — | — | 金属・鉱業 |
| ONEX CORP | 80 | 80 | 614 | 51,404 | 各種金融サービス |
| OPEN TEXT CORP | 111 | 121 | 850 | 71,124 | ソフトウェア |
| PARAMOUNT RESOURCES LTD. | 49 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 286 | 362 | 1,316 | 110,023 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PEYTO EXPLORATION & DEV CORP | 129 | 151 | 455 | 38,106 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| POTASH CORP OF SASKATCHEWAN INC | 720 | 818 | 1,655 | 138,394 | 化学 |
| POWER CORPORATION OF CANADA | 330 | 350 | 1,009 | 84,375 | 保険 |
| POWER FINANCIAL CORP | 223 | 243 | 756 | 63,232 | 保険 |
| PRAIRIESKY ROYALTY LTD | 111 | 186 | 443 | 37,034 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| PROGRESSIVE WASTE SOLUTIONS | — | 104 | 447 | 37,390 | 商業サービス・用品 |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | 169 | 198 | 1,085 | 90,764 | ホテル・レストラン・レジャー |
| ROGERS COMMUNICATIONS-CL B | 320 | 348 | 1,708 | 142,828 | 無線通信サービス |
| ROYAL BANK OF CANADA | 1,250 | 1,433 | 10,836 | 905,810 | 銀行 |
| SNC-LAVALIN GROUP INC | 128 | 145 | 724 | 60,554 | 建設・土木 |
| SAPUTO INC | 216 | 239 | 972 | 81,330 | 食品 |
| SEVEN GENERATIONS ENERGY - A | — | 170 | 413 | 34,545 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 351 | 404 | 959 | 80,170 | メディア |
| SILVER WHEATON CORP | 351 | 420 | 991 | 82,889 | 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 | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 531 | 588 | 2,481 | 207,416 | 保険 |
| SUNCOR ENERGY INC | 1,254 | 1,524 | 5,067 | 423,614 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TALISMAN ENERGY | 910 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TECK RESOURCES LTD | 492 | 582 | 697 | 58,281 | 金属・鉱業 |
| TELUS CORP | 193 | 193 | 771 | 64,466 | 各種電気通信サービス |
| THOMSON REUTERS CORP | 316 | 330 | 1,741 | 145,564 | メディア |
| TORONTO DOMINION BANK | 1,596 | 1,789 | 9,902 | 827,717 | 銀行 |
| TOURMALINE OIL CORP | 153 | 173 | 517 | 43,253 | 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 | 611 | 688 | 3,519 | 294,163 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| TURQUOISE HILL RESOURCES LTD | 650 | 870 | 294 | 24,653 | 金属・鉱業 |
| VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL | 276 | 313 | 1,144 | 95,654 | 医薬品 |
| VERESEN INC | — | 248 | 225 | 18,885 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| VERMILION ENERGY INC | 93 | 105 | 430 | 35,976 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WEST FRASER TIMBER | 56 | 68 | 284 | 23,748 | 紙製品・林産品 |
| WESTON(GEORGE)LTD | 42 | 48 | 529 | 44,247 | 食品・生活必需品小売り |
| YAMANA GOLD INC | 790 | 970 | 546 | 45,649 | 金属・鉱業 |
| 小 計 | 株 数 | 株 数 | 金額 | 金額 | |
| | 94 | 90 | 135,562 | 11,331,704 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | | — | < 3.7% > | |
| (イギリス) | | | 千英ポンド | | |
| ABERDEEN ASSET MANAGEMENT PLC | 830 | 940 | 247 | 38,645 | 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 | 170 | 26,690 | 金属・鉱業 |
| ASHTREAD GROUP PLC | 431 | 468 | 408 | 63,842 | 商社・流通業 |
| BHP BILLITON PLC | 1,826 | 2,043 | 1,620 | 253,252 | 金属・鉱業 |
| ARM HOLDINGS PLC | 1,230 | 1,340 | 1,273 | 198,918 | 半導体・半導体製造装置 |
| BARRATT DEVELOPMENTS PLC | — | 980 | 521 | 81,544 | 家庭用耐久財 |
| SKY PLC | 892 | 998 | 943 | 147,448 | メディア |
| TULLOW OIL PLC | 782 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| AVIVA PLC | 3,482 | 3,890 | 1,658 | 259,187 | 保険 |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 115 | — | — | — | 化学 |
| DIAGEO PLC | 2,176 | 2,427 | 4,596 | 718,286 | 飲料 |
| SCHRODERS PLC | 114 | 118 | 290 | 45,340 | 資本市場 |
| BAE SYSTEMS PLC | 2,710 | 3,060 | 1,502 | 234,822 | 航空宇宙・防衛 |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 1,616 | 1,797 | 7,571 | 1,183,147 | タバコ |
| STANDARD CHARTERED PLC | 2,135 | 3,164 | 1,510 | 236,025 | 銀行 |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 827 | 926 | 3,513 | 548,979 | タバコ |
| SABMILLER PLC | 846 | 938 | 3,962 | 619,192 | 飲料 |
| HSBC HOLDINGS PLC | 16,650 | 18,870 | 8,111 | 1,267,466 | 銀行 |
| LEGAL & GENERAL | 5,150 | 5,760 | 1,257 | 196,482 | 保険 |
| MEGGITT PLC | 706 | 780 | 316 | 49,484 | 航空宇宙・防衛 |
| MORRISON SUPERMARKETS | 1,920 | 2,130 | 406 | 63,537 | 食品・生活必需品小売り |
| ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | 313 | 344 | 1,089 | 170,290 | 食品 |
| PEARSON | 720 | 790 | 639 | 99,929 | メディア |
| PERSIMMON PLC | 277 | 295 | 580 | 90,764 | 家庭用耐久財 |
| PRUDENTIAL PLC | 2,241 | 2,493 | 3,243 | 506,812 | 保険 |
| RIO TINTO PLC-REG | 1,112 | 1,201 | 2,359 | 368,674 | 金属・鉱業 |
| ST JAMES S PLACE PLC | — | 499 | 434 | 67,915 | 保険 |
| TRAVIS PERKINS PLC | 209 | 247 | 457 | 71,480 | 商社・流通業 |
| SSE PLC | 859 | 969 | 1,460 | 228,183 | 電力 |
| BP PLC | 15,820 | 17,660 | 6,207 | 969,982 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 49,400 | 55,300 | 3,559 | 556,232 | 銀行 |
| TATE & LYLE ORD. | 425 | 425 | 259 | 40,576 | 食品 |
| BG GROUP PLC | 2,954 | — | — | — | 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 | |
| (イギリス) | 百株 | 百株 | 千英ポンド | 千円 | |
| TAYLOR WIMPEY PLC | — | 3,190 | 586 | 91,718 | 家庭用耐久財 |
| TESCO PLC | 7,050 | 7,870 | 1,234 | 192,827 | 食品・生活必需品小売り |
| SMITH & NEPHEW PLC | 764 | 858 | 999 | 156,192 | ヘルスケア機器・用品 |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 4,214 | 4,691 | 6,872 | 1,073,867 | 医薬品 |
| WEIR GROUP PLC | 182 | 220 | 242 | 37,814 | 機械 |
| BABCOCK INTL GROUP PLC | 219 | 259 | 243 | 38,063 | 商業サービス・用品 |
| ASTRAZENECA PLC | 1,094 | 1,219 | 4,808 | 751,352 | 医薬品 |
| GKN PLC | 1,430 | 1,690 | 462 | 72,304 | 自動車部品 |
| BT GROUP PLC | 7,110 | 8,170 | 3,601 | 562,808 | 各種電気通信サービス |
| CARNIVAL PLC | 165 | 187 | 660 | 103,178 | ホテル・レストラン・レジャー |
| MARKS & SPENCER PLC | 1,410 | 1,550 | 648 | 101,410 | 複合小売り |
| BARCLAYS PLC | 14,360 | 16,300 | 2,582 | 403,578 | 銀行 |
| INTERTEK GROUP PLC | 137 | 151 | 492 | 76,991 | 専門サービス |
| WILLIAM HILL PLC | 760 | 850 | 270 | 42,316 | ホテル・レストラン・レジャー |
| BURBERRY GROUP PLC | 393 | 423 | 497 | 77,731 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| NEXT PLC | 133 | 140 | 745 | 116,491 | 複合小売り |
| KINGFISHER PLC | 2,060 | 2,170 | 787 | 123,121 | 専門小売り |
| ICAP PLC | 460 | 540 | 251 | 39,312 | 資本市場 |
| ITV PLC | 3,340 | 3,650 | 805 | 125,818 | メディア |
| SAINSBURY | 1,118 | 1,338 | 353 | 55,237 | 食品・生活必需品小売り |
| RANDGOLD RESOURCES LTD | 74 | 90 | 534 | 83,536 | 金属・鉱業 |
| G4S PLC | 1,368 | 1,520 | 293 | 45,887 | 商業サービス・用品 |
| ADMIRAL GROUP PLC | 175 | 198 | 378 | 59,125 | 保険 |
| THE BERKELEY GRP HOLDINGS | — | 124 | 370 | 57,818 | 家庭用耐久財 |
| CENTRICA PLC | 4,260 | 4,900 | 1,029 | 160,791 | 総合公益事業 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 3,391 | 3,800 | 6,471 | 1,011,220 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B | 2,114 | 3,820 | 6,566 | 1,026,093 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BUNZLE | 295 | 331 | 684 | 106,961 | 商社・流通業 |
| COBHAM PLC | 990 | 1,130 | 183 | 28,622 | 航空宇宙・防衛 |
| NATIONAL GRID PLC | 3,290 | 3,596 | 3,601 | 562,753 | 総合公益事業 |
| INMARSAT PLC | 389 | 425 | 348 | 54,489 | 各種電気通信サービス |
| PETROFAC LTD | 227 | 260 | 208 | 32,502 | エネルギー設備・サービス |
| LONDON STOCK EXCHANGE GRP PLC | 272 | 302 | 780 | 121,987 | 各種金融サービス |
| UNILEVER PLC | 1,121 | 1,244 | 3,924 | 613,195 | パーソナル用品 |
| TUI AG-DI | 398 | 466 | 483 | 75,595 | ホテル・レストラン・レジャー |
| INVESTEC PLC | 470 | 550 | 263 | 41,166 | 資本市場 |
| EXPERIAN PLC | 860 | 946 | 1,190 | 185,960 | 専門サービス |
| MONDI PLC | — | 342 | 444 | 69,526 | 紙製品・林産品 |
| SEVERN TRENT PLC | 203 | 221 | 497 | 77,700 | 水道 |
| WHITBREAD PLC | 158 | 175 | 682 | 106,647 | ホテル・レストラン・レジャー |
| SPORTS DIRECT INTERNATIONAL | 213 | 253 | 95 | 14,963 | 専門小売り |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 220 | 250 | 314 | 49,143 | 資本市場 |
| SMITHS GROUP PLC | 339 | 375 | 406 | 63,461 | コングロマリット |
| ANGLO AMERICAN PLC | 1,224 | 1,370 | 766 | 119,775 | 金属・鉱業 |
| 3I GROUP PLC | 870 | 970 | 450 | 70,390 | 資本市場 |
| PROVIDENT FINANCIAL PLC | — | 143 | 405 | 63,437 | 消費者金融 |
| CAPITA PLC | 581 | 640 | 655 | 102,406 | 専門サービス |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 565 | 617 | 4,218 | 659,171 | 家庭用品 |
| RELX PLC | 974 | 1,066 | 1,317 | 205,884 | メディア |
| SHIRE PLC | 510 | 568 | 2,311 | 361,146 | 医薬品 |
| FRESNILLO PLC | 209 | 209 | 217 | 33,932 | 金属・鉱業 |
| UNITED UTILITIES GROUP PLC | 601 | 670 | 632 | 98,778 | 水道 |
| GLENCORE PLC | 9,620 | 11,880 | 1,574 | 246,061 | 金属・鉱業 |
| DIXONS CARPHONE PLC | 850 | 920 | 384 | 60,076 | 専門小売り |

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|------------------------------------|--------------|---------|---------|-----------|-------------------------|--|
| | | | 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 | | |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | 1,626 | 1,770 | 1,136 | 177,564 | 航空宇宙・防衛 | |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 177 | — | — | — | 化学 | |
| OLD MUTUAL PLC | 4,270 | 4,680 | 808 | 126,294 | 保険 | |
| EASYJET PLC | 142 | 163 | 239 | 37,441 | 旅客航空輸送業 | |
| ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP | 2,210 | 3,410 | 725 | 113,443 | 銀行 | |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 1,310 | — | — | — | 保険 | |
| SAGE GROUP PLC (THE) | 950 | 1,050 | 622 | 97,295 | ソフトウェア | |
| MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC | — | 375 | 324 | 50,716 | 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 | 2,002 | 312,906 | メディア | |
| COCA-COLA HBC AG-CDI | 174 | 198 | 276 | 43,160 | 飲料 | |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS C-ENTITLEMENT | — | 125,670 | 12 | 1,963 | 航空宇宙・防衛 | |
| ROYAL MAIL PLC | 550 | 880 | 436 | 68,163 | 航空貨物・物流サービス | |
| MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI | 650 | 690 | 300 | 46,879 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| WOLSELEY PLC | 223 | 242 | 948 | 148,234 | 商社・流通業 | |
| IMI PLC | 226 | 259 | 251 | 39,236 | 機械 | |
| VODAFONE GROUP PLC | 22,970 | 25,610 | 5,606 | 875,998 | 無線通信サービス | |
| AGGREKO PLC | 230 | 262 | 271 | 42,426 | 商業サービス・用品 | |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 907 | 987 | 474 | 74,159 | 保険 | |
| COMPASS GROUP PLC | 1,451 | 1,585 | 1,993 | 311,571 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| REXAM PLC | 595 | 655 | 412 | 64,381 | 容器・包装 | |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 201 | — | — | — | ホテル・レストラン・レジャー | |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 864 | — | — | — | 機械 | |
| STANDARD LIFE PLC | 1,737 | 1,860 | 596 | 93,238 | 保険 | |
| ROLLS-ROYCE HOLDINGS C-ENTITLEMENT | 235,329 | — | — | — | 航空宇宙・防衛 | |
| AUTO TRADER GROUP PLC | — | 950 | 359 | 56,172 | インターネットソフトウェア・サービス | |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | — | 1,360 | 517 | 80,804 | 保険 | |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | — | 190 | 515 | 80,511 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| WORLDPAY GROUP PLC | — | 1,350 | 352 | 55,079 | 情報技術サービス | |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | — | 122 | 366 | 57,194 | 化学 | |
| JOHNSON MATTHEY PLC | — | 191 | 545 | 85,222 | 化学 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 480,625 | 406,855 | 150,105 | 23,455,553 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 104 | 109 | — | < 7.6% > | |
| (スイス) | | | | 千スイスフラン | | |
| SYNGENTA AG-REG | 81 | 89 | 3,487 | 389,599 | 化学 | |
| SIKA AG-BR | 1 | 2 | 855 | 95,505 | 化学 | |
| SGS SA-REG | 4 | 5 | 1,091 | 121,920 | 専門サービス | |
| SULZER AG-REG | 20 | 13 | 109 | 12,190 | 機械 | |
| BARRY CALLEBAUT AG | 1 | 1 | 218 | 24,448 | 食品 | |
| SWISSCOM AG-REG | 20 | 24 | 1,180 | 131,812 | 各種電気通信サービス | |
| LINDT & SPRUENGLI AG-PC | 0.87 | 0.95 | 579 | 64,677 | 食品 | |
| LINDT&SPRUENGLI AG-REG | 0.09 | 0.1 | 720 | 80,479 | 食品 | |
| GIVAUDAN-REG | 7 | 8 | 1,715 | 191,630 | 化学 | |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 129 | 144 | 3,045 | 340,182 | 保険 | |
| NOVARTIS-REG | 1,997 | 2,199 | 15,843 | 1,769,751 | 医薬品 | |
| ABB LTD | 1,923 | 2,134 | 4,242 | 473,875 | 電気設備 | |
| ROCHE HOLDINGS (GENUSSCHEINE) | 609 | 678 | 16,304 | 1,821,243 | 医薬品 | |
| ADECCO SA-REG | 148 | 163 | 1,008 | 112,610 | 専門サービス | |
| LAFARGEHOLCIM LTD | 201 | 443 | 1,908 | 213,222 | 建設資材 | |
| NESTLE SA-REG | 2,799 | 3,080 | 22,006 | 2,458,137 | 食品 | |
| BALOISE HOLDING AG | 40 | 50 | 578 | 64,618 | 保険 | |
| SONOVA HOLDING AG-REG | 45 | 50 | 686 | 76,692 | ヘルスケア機器・用品 | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 1,337 | 1,743 | 2,340 | 261,472 | 資本市場 | |
| THE SWATCH GROUP AG-B | 26 | 29 | 933 | 104,324 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| THE SWATCH GROUP AG-REG | 46 | 46 | 285 | 31,908 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|-------------------------------------|--------------|--------|-------------|---------|-------------------|--|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (スイス) | 百株 | 百株 | 千スイスフラン | 千円 | | |
| LONZA AG-REG | 46 | 50 | 820 | 91,680 | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| SWISS LIFE HOLDING AG | 28 | 31 | 755 | 84,432 | 保険 | |
| GALENICA AG-REG | — | 3 | 538 | 60,178 | 医薬品 | |
| EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG | 7 | 8 | 390 | 43,574 | 化学 | |
| SWISS PRIME SITE-REG | 47 | 63 | 539 | 60,237 | 不動産管理・開発 | |
| PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES | 24 | 32 | 204 | 22,804 | 各種金融サービス | |
| DUFREY AG-REG | — | 40 | 510 | 56,967 | 専門小売り | |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 15 | 15 | 609 | 68,104 | 資本市場 | |
| SCHINDLER HOLDING-PART CERT | 39 | 43 | 752 | 84,057 | 機械 | |
| SCHINDLER HOLDING AG-REG | 19 | 19 | 338 | 37,834 | 機械 | |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 45 | 52 | 702 | 78,463 | 海運業 | |
| GEBERIT AG-REG | 33 | 36 | 1,338 | 149,463 | 建設関連製品 | |
| ACTELION LTD | 89 | 97 | 1,514 | 169,152 | バイオテクノロジー | |
| ARYZTA AG | 72 | 85 | 314 | 35,129 | 食品 | |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 198 | 220 | 852 | 95,224 | 資本市場 | |
| SWISS RE LTD | 304 | 337 | 2,938 | 328,246 | 保険 | |
| TRANSOCEAN LTD | 315 | — | — | — | エネルギー設備・サービス | |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A | 451 | 500 | 3,082 | 344,315 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| UBS GROUP AG | 3,163 | 3,511 | 5,347 | 597,288 | 資本市場 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 | 14,340 | 16,053 | 100,693 | 11,247,460 | |
| | 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 | 10,950 | 145,416 | 銀行 | |
| SWEDBANK AB | 787 | 865 | 14,921 | 198,154 | 銀行 | |
| SWEDISH MATCH AB | 174 | 189 | 5,161 | 68,545 | タバコ | |
| NORDEA BANK AB | 2,620 | 2,930 | 22,165 | 294,357 | 銀行 | |
| SECURITAS AB-B SHS | 258 | 294 | 3,698 | 49,116 | 商業サービス・用品 | |
| INVESTOR AB-B SHS | 397 | 444 | 12,680 | 168,398 | 各種金融サービス | |
| HENNES&MAURITZ AB-B | 820 | 923 | 25,170 | 334,260 | 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 | 18,512 | 245,849 | 通信機器 | |
| TELIA CO AB | 2,290 | 2,510 | 9,354 | 124,231 | 各種電気通信サービス | |
| SKANSKA AB-B SHS | 329 | 375 | 6,667 | 88,544 | 建設・土木 | |
| LUNDIN PETROLEUM AB | 201 | 201 | 2,872 | 38,144 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| ALFA LAVAL AB | 270 | 277 | 3,451 | 45,834 | 機械 | |
| GETINGE AB-B SHS | 171 | 191 | 3,315 | 44,033 | ヘルスケア機器・用品 | |
| KINNEVIK INVESTMENT AB-B | 203 | 236 | 5,258 | 69,827 | 各種金融サービス | |
| MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR | 60 | 61 | 2,763 | 36,696 | 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 | 2,182 | 28,982 | 食品・生活必需品小売り | |
| HUSQVARNA AB-B SHS | 380 | 380 | 2,492 | 33,104 | 家庭用耐久財 | |
| ELECTROLUX AB-B | 208 | 233 | 5,340 | 70,919 | 家庭用耐久財 | |
| SKF AB-B SHARES | 336 | 388 | 5,540 | 73,579 | 機械 | |
| ATLAS COPCO AB-A | 584 | — | — | — | 機械 | |
| ATLAS COPCO AB-B | 344 | — | — | — | 機械 | |
| VOLVO AB-B SHS | 1,320 | 1,500 | 13,725 | 182,268 | 機械 | |
| SANDVIK AB | 927 | 1,030 | 8,147 | 108,196 | 機械 | |
| INDUSTRIVARDEN AB-C SHS | 140 | 168 | 2,422 | 32,171 | 各種金融サービス | |
| SVENSKA CELLULOSA AB-B | 502 | 584 | 14,816 | 196,757 | 家庭用品 | |
| BOLDEN AB | 230 | 260 | 3,408 | 45,266 | 金属・鉱業 | |
| HEXAGON AB-B SHS | 228 | 244 | 7,639 | 101,454 | 電子装置・機器・部品 | |
| TELE 2 AB-B SHS | 284 | 284 | 2,141 | 28,437 | 無線通信サービス | |
| ATLAS COPCO AB-A | — | 648 | 13,037 | 173,141 | 機械 | |

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 期末 | | 業種等 | |
|------------------------------|------------------|--------------|--------------|--------------|-------------------------|--|
| | | | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (スウェーデン) | 百株 | 百株 | 千スウェーデンクローナ | 千円 | | |
| ATLAS COPCO AB-B | — | 382 | 7,105 | 94,357 | 機械 | |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A | — | 1,450 | 15,080 | 200,262 | 銀行 | |
| ASSA ABLOY AB-B | — | 970 | 16,014 | 212,675 | 建設関連製品 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 19,153 31 | 22,475 30 | 266,038 — | 3,532,984 <1.1%> | |
| (ノルウェー) | | | 千ノルウェークローネ | | | |
| DNB ASA | 837 | 956 | 9,445 | 124,583 | 銀行 | |
| TELENOR ASA | 656 | 719 | 9,821 | 129,546 | 各種電気通信サービス | |
| SCHIBSTED ASA | — | 78 | 1,861 | 24,557 | メディア | |
| SUBSEA 7 SA | 259 | — | — | — | エネルギー設備・サービス | |
| STATOIL ASA | 982 | 1,055 | 14,126 | 186,327 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 157 | 168 | 5,344 | 70,488 | 化学 | |
| SEADRILL LTD | 338 | — | — | — | エネルギー設備・サービス | |
| NORSK HYDRO | 1,160 | 1,300 | 4,088 | 53,927 | 金属・鉱業 | |
| ORKLA ASA | 688 | 800 | 6,000 | 79,140 | 食品 | |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 172 | 197 | 2,691 | 35,494 | 保険 | |
| SCHIBSTED ASA-B SHS | — | 91 | 2,088 | 27,546 | メディア | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 5,249 9 | 5,364 9 | 55,467 — | 731,612 <0.2%> | |
| (デンマーク) | | | 千デンマーククローネ | | | |
| CARLSBERG B | 93 | 105 | 6,720 | 111,552 | 飲料 | |
| A P MOLLER-MAERSK A/S | 6 | 6 | 5,887 | 97,727 | 海運業 | |
| A P MOLLER - MAERSK A/S-A | 3 | 3 | 3,241 | 53,815 | 海運業 | |
| DANSKE BANK AS | 564 | 686 | 12,553 | 208,393 | 銀行 | |
| GENMAB A/S | — | 51 | 5,036 | 83,601 | バイオテクノロジー | |
| TDC A/S | 688 | 768 | 2,618 | 43,473 | 各種電気通信サービス | |
| WILLIAM DEMANT HOLDING | 21 | 26 | 1,794 | 29,780 | ヘルスケア機器・用品 | |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 189 | 216 | 9,728 | 161,495 | 電気設備 | |
| TRYG A/S | 19 | — | — | — | 保険 | |
| DSV A/S | 160 | 182 | 4,904 | 81,421 | 陸運・鉄道 | |
| PANDORA A/S | 98 | 108 | 9,229 | 153,209 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| CHR HANSEN HOLDING A/S | — | 93 | 3,843 | 63,805 | 化学 | |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES | 212 | 225 | 7,078 | 117,503 | 化学 | |
| COLOPLAST-B | 99 | 105 | 5,175 | 85,912 | ヘルスケア機器・用品 | |
| NOVO NORDISK A/S-B | 1,740 | 1,888 | 67,590 | 1,122,000 | 医薬品 | |
| ISS A/S | 104 | 141 | 3,578 | 59,404 | 商業サービス・用品 | |
| TRYG A/S | — | 118 | 1,453 | 24,132 | 保険 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 3,996 14 | 4,722 16 | 150,435 — | 2,497,227 <0.8%> | |
| (ユーロ…ドイツ) | | | 千ユーロ | | | |
| ADIDAS AG | 186 | 202 | 2,308 | 285,121 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| FRESENIUS SE & CO KGAA | 326 | 371 | 2,402 | 296,742 | 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 | 506 | 62,535 | インターネットソフトウェア・サービス | |
| FUCHS PETROLUB SE -FPD | 64 | 64 | 234 | 28,993 | 化学 | |
| HANNOVER RUECK SE | 53 | 57 | 576 | 71,198 | 保険 | |
| GEA GROUP AG | 163 | 175 | 697 | 86,183 | 機械 | |
| CONTINENTAL AG | 94 | 106 | 1,968 | 243,046 | 自動車部品 | |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 834 | 940 | 2,412 | 297,920 | 航空貨物・物流サービス | |
| AXEL SPRINGER SE | 35 | 44 | 218 | 27,015 | メディア | |
| MERCK KGAA | 113 | 126 | 1,011 | 124,851 | 医薬品 | |
| RWE AG | 432 | 462 | 534 | 66,038 | 総合公益事業 | |
| SAP SE | 804 | 948 | 6,525 | 805,782 | ソフトウェア | |
| E.ON SE | 1,742 | 1,940 | 1,629 | 201,239 | 総合公益事業 | |
| HENKEL AG & CO KGAA | 101 | 100 | 905 | 111,869 | 家庭用品 | |

| 銘柄 | 株数 | 当 期 末 | | | | 業 種 等 |
|-----------------------------------|-----------|----------|--------------|--------------|-------------------------|----------------------|
| | | 株数 | 株数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ユーロ…ドイツ) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| METRO AG | 134 | 166 | 453 | 56,014 | 食品・生活必需品小売り | |
| BAYER AG-REG | 717 | 797 | 7,966 | 983,723 | 医薬品 | |
| HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | 154 | 174 | 1,768 | 218,417 | 家庭用品 | |
| BASF SE | 796 | 887 | 6,100 | 753,386 | 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 | 796 | 98,298 | パーソナル用品 | |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 123 | 137 | 1,063 | 131,352 | 建設資材 | |
| FRESENIUS MEDICAL CARE | 188 | 209 | 1,591 | 196,590 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| ALLIANZ SE-REG | 395 | 440 | 6,212 | 767,154 | 保険 | |
| DEUTSCHE LUFTHANSA-REG | 192 | 226 | 282 | 34,858 | 旅客航空輸送業 | |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 151 | 160 | 2,621 | 323,765 | 保険 | |
| VOLKSWAGEN AG | 25 | 34 | 462 | 57,174 | 自動車 | |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 140 | 178 | 2,218 | 273,907 | 自動車 | |
| DAIMLER AG-REGISTERED SHARES | 834 | 929 | 5,548 | 685,235 | 自動車 | |
| MAN SE | 32 | 32 | 304 | 37,596 | 機械 | |
| THYSSENKRUPP AG | 404 | 363 | 666 | 82,302 | 金属・鉱業 | |
| SIEMENS AG | 692 | 765 | 7,116 | 878,853 | コングロマリット | |
| QIAGEN NV | 201 | 223 | 429 | 53,038 | ライフサイエンス・ツール/サービス | |
| LINDE AG | 160 | 179 | 2,267 | 280,001 | 化学 | |
| DEUTSCHE BANK AG-REG | 1,206 | 1,331 | 1,949 | 240,795 | 資本市場 | |
| BAYER MOTOREN WERK | 286 | 318 | 2,433 | 300,492 | 自動車 | |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD | 47 | 53 | 355 | 43,910 | 自動車 | |
| DEUTSCHE TELEKOM-REG | 2,773 | 3,114 | 4,806 | 593,549 | 各種電気通信サービス | |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 1,000 | 1,090 | 1,317 | 162,736 | 半導体・半導体製造装置 | |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 168 | 189 | 1,423 | 175,747 | 各種金融サービス | |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 134 | 152 | 710 | 87,789 | 自動車 | |
| FRAPORT AG | 29 | 38 | 190 | 23,491 | 運送インフラ | |
| LANXESS | 83 | 83 | 366 | 45,221 | 化学 | |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR | 257 | 329 | 899 | 111,118 | 不動産管理・開発 | |
| SYMRISE AG | 106 | 115 | 664 | 82,083 | 化学 | |
| KABEL DEUTSCHLAND HOLDING AG | 20 | — | — | — | メディア | |
| BRENTAG AG | 132 | 151 | 734 | 90,761 | 商社・流通業 | |
| K+S AG | 157 | 173 | 381 | 47,064 | 化学 | |
| EVONIK INDUSTRIES AG | — | 138 | 398 | 49,156 | 化学 | |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | 476 | 746 | 338 | 41,851 | 各種電気通信サービス | |
| HUGO BOSS AG | 58 | 63 | 341 | 42,151 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| COMMERZBANK AG | 831 | 1,020 | 713 | 88,159 | 銀行 | |
| OSRAM LICHT AG | 77 | 88 | 400 | 49,491 | 電気設備 | |
| VONOVIA SE | 301 | 452 | 1,370 | 169,238 | 不動産管理・開発 | |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE | 187 | 209 | 923 | 113,987 | メディア | |
| ZALANDO SE | — | 81 | 229 | 28,372 | インターネット販売・カタログ販売 | |
| 小 計 | 株数 銘柄数 | 金額 比率 | 18,862 53 | 21,587 53 | 90,755 — | 11,207,378 <3.6%> |
| (ユーロ…イタリア) | | | | | | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 1,011 | 1,137 | 1,470 | 181,547 | 保険 | |
| INTESA SANPAOLO | 11,090 | 12,160 | 2,723 | 336,367 | 銀行 | |
| INTESA SANPAOLO-RSP | 760 | 920 | 198 | 24,471 | 銀行 | |
| MEDIOBANCA S. P. A. | 550 | 530 | 330 | 40,873 | 資本市場 | |
| PIRELLI&CO | 211 | — | — | — | 自動車部品 | |
| SAIPEM SPA | 239 | 5,497 | 205 | 25,333 | エネルギー設備・サービス | |
| LUXOTTICA GROUP SPA | 148 | 165 | 814 | 100,615 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| ENEL SPA | 5,720 | 7,387 | 2,873 | 354,882 | 電力 | |
| ENI SPA | 2,199 | 2,448 | 3,275 | 404,482 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| SNAM SPA | 1,780 | 2,050 | 1,091 | 134,804 | ガス | |

| 銘柄 | 株数 | 当 期 末 | | | | 業 種 等 |
|-------------------------------------|------------------|--------|--------|-----------|--------------------|-------|
| | | 株数 | 評 価 額 | | 株数 | |
| | | | 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 | | |
| TENARIS SA | 417 | 460 | 511 | 63,224 | エネルギー設備・サービス | |
| UNIONE DI BANCHE ITALIANE SCPA | 750 | 900 | 286 | 35,342 | 銀行 | |
| TELECOM ITALIA SPA | 8,600 | 11,100 | 943 | 116,512 | 各種電気通信サービス | |
| TELECOM ITALIA-RNC | 5,200 | 5,700 | 391 | 48,322 | 各種電気通信サービス | |
| ATLANTIA SPA | 351 | 393 | 944 | 116,621 | 運送インフラ | |
| TERNA SPA | 1,350 | 1,420 | 695 | 85,889 | 電力 | |
| EXOR SPA | 86 | 112 | 356 | 44,009 | 各種金融サービス | |
| LEONARDO-FINMECCANICA SPA | 370 | 410 | 420 | 51,947 | 航空宇宙・防衛 | |
| PRYSMIAN SPA | 174 | 194 | 395 | 48,896 | 電気設備 | |
| ENEL GREEN POWER SPA | 1,600 | — | — | — | 独立系発電事業者・エネルギー販売業者 | |
| UNICREDIT SPA | 3,790 | 4,640 | 1,388 | 171,439 | 銀行 | |
| UNIPOLSAI SPA | 800 | 1,070 | 207 | 25,673 | 保険 | |
| FERRARI NV | — | 127 | 480 | 59,327 | 自動車 | |
| CNH INDUSTRIAL NV | 801 | 920 | 552 | 68,280 | 機械 | |
| BANCO POPOLARE SPA | 303 | 339 | 169 | 20,914 | 銀行 | |
| BANCA MONTE DEI PASCHI SIENA | 3,750 | — | — | — | 銀行 | |
| FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV | 780 | 890 | 588 | 72,702 | 自動車 | |
| 小 計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 52,830 | 60,970 | 21,317 | 2,632,484 | |
| | | 26 | 24 | — | <0.8%> | |
| (ユーロ…フランス) | | | | | | |
| BOUYGUES | 141 | 201 | 576 | 71,138 | 建設・土木 | |
| AIRBUS GROUP SE | 515 | 574 | 3,121 | 385,463 | 航空宇宙・防衛 | |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 372 | 437 | 879 | 108,631 | 総合公益事業 | |
| LOREAL-ORD | 217 | 242 | 3,882 | 479,397 | パーソナル用品 | |
| CHRISTIAN DIOR SE | 47 | 53 | 817 | 100,918 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 244 | 268 | 3,909 | 482,780 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| THALES SA | 83 | 99 | 754 | 93,146 | 航空宇宙・防衛 | |
| CAP GEMINI SA | 125 | 160 | 1,298 | 160,299 | 情報技術サービス | |
| CASINO GUICHARD-PERRACHON SA | 49 | 59 | 293 | 36,189 | 食品・生活必需品小売り | |
| INGENICO GROUP | — | 55 | 564 | 69,651 | 電子装置・機器・部品 | |
| PUBLICIS GROUPE | 161 | 184 | 1,175 | 145,194 | メディア | |
| LAFARGE SA | 160 | — | — | — | 建設資材 | |
| LAGARDERE S. C. A | 97 | 116 | 256 | 31,622 | メディア | |
| BOLLORE | 750 | 870 | 291 | 35,948 | 航空貨物・物流サービス | |
| MICHELIN (CGDE) | 162 | 178 | 1,607 | 198,534 | 自動車部品 | |
| PERNOD RICARD SA | 183 | 205 | 1,980 | 244,547 | 飲料 | |
| RENAULT SA | 168 | 188 | 1,515 | 187,191 | 自動車 | |
| REMY COINTREAU | 23 | 23 | 168 | 20,790 | 飲料 | |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 460 | 538 | 2,896 | 357,700 | 電気設備 | |
| VIVENDI SA | 1,054 | 1,132 | 1,917 | 236,805 | メディア | |
| TECHNIP SA | 88 | 98 | 453 | 55,971 | エネルギー設備・サービス | |
| VALEO SA | 66 | 76 | 1,039 | 128,425 | 自動車部品 | |
| ORANGE SA | 1,598 | 1,903 | 2,769 | 342,044 | 各種電気通信サービス | |
| HERMES INTERNATIONAL | 23 | 24 | 786 | 97,133 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| SOCIETE BIC SA | 25 | 28 | 352 | 43,584 | 商業サービス・用品 | |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 114 | 121 | 835 | 103,131 | ソフトウェア | |
| KERING SA | 66 | 72 | 1,051 | 129,907 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| CNP ASSURANCES | 135 | 165 | 233 | 28,831 | 保険 | |
| CARREFOUR SUPERMARCHE | 483 | 541 | 1,301 | 160,673 | 食品・生活必需品小売り | |
| ATOS SE | 71 | 86 | 680 | 83,994 | 情報技術サービス | |
| SANOFI | 1,036 | 1,133 | 8,136 | 1,004,723 | 医薬品 | |
| ACCOR SA | 182 | 207 | 797 | 98,504 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| STMICROELECTRONICS NV | 577 | 577 | 271 | 33,539 | 半導体・半導体製造装置 | |
| SOCIETE GENERALE | 625 | 697 | 2,295 | 283,436 | 銀行 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|-----------------------------|---------|-------|--------|-----------|----------------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…フランス) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| ALCATEL-LUCENT | 2,460 | — | — | — | 通信機器 | |
| EURAZEO | 30 | 38 | 239 | 29,551 | 各種金融サービス | |
| SODEXO | 80 | 90 | 810 | 100,038 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| AXA | 1,589 | 1,912 | 3,952 | 488,045 | 保険 | |
| PEUGEOT CITROEN | 342 | 437 | 584 | 72,151 | 自動車 | |
| JC DECAUX SA | 53 | 68 | 267 | 33,039 | メディア | |
| ESSILOR INTERNATIONAL | 176 | 199 | 2,288 | 282,606 | ヘルスケア機器・用品 | |
| CREDIT AGRICOLE SA | 882 | 1,030 | 928 | 114,640 | 銀行 | |
| ZODIAC AEROSPACE | 156 | 195 | 376 | 46,463 | 航空宇宙・防衛 | |
| BNP PARIBAS | 917 | 1,023 | 4,516 | 557,748 | 銀行 | |
| COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD) | 391 | 455 | 1,745 | 215,536 | 建設関連製品 | |
| WENDEL | 28 | 29 | 301 | 37,190 | 各種金融サービス | |
| ILIAD SA | 21 | 24 | 474 | 58,545 | 各種電気通信サービス | |
| SES FDR | 261 | 316 | 764 | 94,435 | メディア | |
| IMERYS | 30 | 38 | 236 | 29,206 | 建設資材 | |
| SAFRAN SA | 257 | 301 | 1,766 | 218,116 | 航空宇宙・防衛 | |
| ENGIE | 1,270 | 1,411 | 1,876 | 231,745 | 総合公益事業 | |
| ALSTOM | 187 | 155 | 335 | 41,459 | 機械 | |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS | 130 | 163 | 443 | 54,770 | メディア | |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 203 | 228 | 261 | 32,294 | 電力 | |
| ARKEMA | 59 | 67 | 452 | 55,897 | 化学 | |
| LEGRAND SA | 232 | 253 | 1,239 | 153,121 | 電気設備 | |
| TOTAL SA | 1,856 | 2,115 | 8,899 | 1,099,051 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| ADP | 24 | 28 | 301 | 37,239 | 運送インフラ | |
| VALLOUREC | 93 | — | — | — | エネルギー設備・サービス | |
| NATIXIS | 790 | 870 | 381 | 47,121 | 銀行 | |
| SCOR SE | 140 | 154 | 459 | 56,795 | 保険 | |
| REXEL SA | 252 | 286 | 367 | 45,383 | 商社・流通業 | |
| VINCI | 414 | 460 | 2,940 | 363,100 | 建設・土木 | |
| DANONE | 500 | 567 | 3,461 | 427,464 | 食品 | |
| AIR LIQUIDE | 301 | 330 | 3,144 | 388,282 | 化学 | |
| BUREAU VERITAS SA | 231 | 255 | 516 | 63,814 | 専門サービス | |
| GROUPE EUROTUNNEL SE - REGR | 410 | 450 | 501 | 61,933 | 運送インフラ | |
| SUEZ ENVIRONNEMENT SA | 270 | 299 | 482 | 59,631 | 総合公益事業 | |
| EDENRED | 187 | 187 | 317 | 39,153 | 商業サービス・用品 | |
| NUMERICABLE-SFR | 85 | 110 | 302 | 37,308 | メディア | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 25,409 | 25,857 | 94,847 | 11,712,740 |
| 銘 柄 数 < 比 率 > | 69 | 67 | — | < 3.8% > | | |
| (ユーロ…オランダ) | | | | | | |
| RELX NV | 599 | 970 | 1,444 | 178,420 | メディア | |
| RANDSTAD HOLDING NV | 110 | 127 | 600 | 74,213 | 専門サービス | |
| AKZO NOBEL | 210 | 240 | 1,476 | 182,300 | 化学 | |
| WOLTERS KLUWER | 259 | 289 | 973 | 120,163 | メディア | |
| VOPAK | 61 | 71 | 327 | 40,397 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| AEGON NV | 1,590 | 1,800 | 869 | 107,339 | 保険 | |
| KONINKLIJKE KPN NV | 2,720 | 3,110 | 1,060 | 130,923 | 各種電気通信サービス | |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 805 | 915 | 2,122 | 262,144 | コングロマリット | |
| ING GROEP NV | 3,371 | 3,750 | 3,825 | 472,349 | 銀行 | |
| HEINEKEN NV | 200 | 220 | 1,823 | 225,139 | 飲料 | |
| ARCELORMITTAL | 871 | 1,632 | 665 | 82,125 | 金属・鉱業 | |
| HEINEKEN HOLDING NV | 91 | 97 | 708 | 87,443 | 飲料 | |
| KONINKLIJKE DSM NV | 149 | 175 | 903 | 111,597 | 化学 | |
| UNILEVER NV-CVA | 1,422 | 1,571 | 6,163 | 761,072 | パーソナル用品 | |
| BOSKALIS WESTMINSTER-CVA | 71 | 81 | 289 | 35,734 | 建設・土木 | |

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 期末 | | 業種等 | |
|---|---------|--------|--------|-----------|-------------|--|
| | | | 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 | | |
| TNT EXPRESS NV | 360 | 430 | 343 | 42,374 | 航空貨物・物流サービス | |
| DELTA LLOYD NV | 183 | — | — | — | 保険 | |
| ASML HOLDING NV | 306 | 332 | 2,697 | 333,114 | 半導体・半導体製造装置 | |
| GEMALTO | 68 | 76 | 426 | 52,698 | ソフトウェア | |
| OCI | 80 | 80 | 116 | 14,428 | 化学 | |
| KONINKLIJKE AHOLD NV | 786 | 812 | 1,563 | 193,077 | 食品・生活必需品小売り | |
| NN GROUP NV | 136 | 306 | 899 | 111,096 | 保険 | |
| ALTICE NV - B | — | 100 | 130 | 16,137 | メディア | |
| ALTICE NV - A | — | 368 | 476 | 58,898 | メディア | |
| 小計 | 株数・金額 | 14,448 | 17,552 | 29,906 | 3,693,192 | |
| | 銘柄数<比率> | 22 | 23 | — | <1.2%> | |
| (ユーロ…スペイン) | | | | | | |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA | 350 | 502 | 723 | 89,392 | 運送インフラ | |
| ENDESA S.A. | 263 | 317 | 582 | 71,892 | 電力 | |
| BANKINTER S.A. | 580 | 650 | 411 | 50,842 | 銀行 | |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A. | 5,517 | 6,306 | 3,485 | 430,443 | 銀行 | |
| GAS NATURAL SDG | 305 | 328 | 584 | 72,118 | ガス | |
| REPSOL SA | 915 | 1,043 | 1,155 | 142,670 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| BANCO SANTANDER SA | 12,478 | 13,978 | 5,536 | 683,732 | 銀行 | |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 96 | 102 | 798 | 98,601 | 電力 | |
| TELEFONICA SA | 3,875 | 4,356 | 3,998 | 493,724 | 各種電気通信サービス | |
| ZARDOYA OTIS S.A | 162 | 168 | 153 | 18,980 | 機械 | |
| ENAGAS | 175 | 213 | 567 | 70,137 | ガス | |
| ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV | 150 | 185 | 510 | 63,047 | 建設・土木 | |
| GRIFOLS SA | 132 | — | — | — | バイオテクノロジー | |
| FERROVIAL SA | 363 | 463 | 843 | 104,123 | 建設・土木 | |
| FERROVIAL SA-RIGHTS | 363 | — | — | — | 建設・土木 | |
| MAPFRE SA | 790 | 1,110 | 240 | 29,676 | 保険 | |
| BANCO DE SABADELL SA | 3,816 | 5,045 | 772 | 95,396 | 銀行 | |
| CAIXABANK | 1,979 | 2,482 | 589 | 72,850 | 銀行 | |
| IBERDROLA SA | 4,450 | 5,287 | 3,224 | 398,140 | 電力 | |
| AMADEUS IT HOLDING SA-A SHS | 384 | 419 | 1,689 | 208,599 | 情報技術サービス | |
| INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP | 740 | 800 | 519 | 64,155 | 旅客航空輸送業 | |
| DISTRIBUIDORA INTERNACIONAL | 570 | 570 | 274 | 33,948 | 食品・生活必需品小売り | |
| BANKIA SA | 3,850 | 4,300 | 331 | 40,993 | 銀行 | |
| BCO POPULAR ESPANOL | 1,563 | 1,624 | 334 | 41,281 | 銀行 | |
| BCO POPULAR ESPANOL - RTS | 1,562 | — | — | — | 銀行 | |
| INDITEX SA | 941 | 1,056 | 2,974 | 367,352 | 専門小売り | |
| AENA SA | 55 | 65 | 800 | 98,810 | 運送インフラ | |
| GRIFOLS SA | — | 288 | 532 | 65,724 | バイオテクノロジー | |
| 小計 | 株数・金額 | 46,428 | 51,662 | 31,635 | 3,906,637 | |
| | 銘柄数<比率> | 27 | 25 | — | <1.3%> | |
| (ユーロ…ベルギー) | | | | | | |
| UMICORE | 88 | 88 | 385 | 47,614 | 化学 | |
| DELHAIZE GROUP | 87 | 98 | 903 | 111,604 | 食品・生活必需品小売り | |
| KBC GROEP NV | 214 | 240 | 1,099 | 135,769 | 銀行 | |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV NV | 697 | 774 | 8,575 | 1,059,040 | 飲料 | |
| SOLVAY SA | 51 | 73 | 648 | 80,114 | 化学 | |
| UCB SA | 110 | 123 | 812 | 100,385 | 医薬品 | |
| COLRUYT SA | 61 | 70 | 354 | 43,748 | 食品・生活必需品小売り | |
| GROUPE BRUXELLES LAM | 72 | 78 | 576 | 71,182 | 各種金融サービス | |
| PROXIMUS | 137 | 151 | 424 | 52,453 | 各種電気通信サービス | |
| TELENET GROUP HOLDING NV | 43 | 52 | 221 | 27,403 | メディア | |

| 銘柄 | 株数 | 株数 | 期末 | | 業種等 | |
|----------------------------------|------------------|----------------|----------------|--------------|-----------------------|--|
| | | | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (ユーロ…ベルギー) | 百株 | 百株 | 千ユーロ | 千円 | | |
| AGEAS | 194 | 200 | 645 | 79,749 | 保険 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,754 11 | 1,947 11 | 14,649 - | 1,809,067 <0.6%> | |
| (ユーロ…オーストリア) | | | | | | |
| OMV AG | 125 | 140 | 345 | 42,607 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| VOESTALPINE AG | 96 | 110 | 316 | 39,053 | 金属・鉱業 | |
| ERSTE GROUP BANK AG | 251 | 268 | 630 | 77,807 | 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 | 147 | 18,188 | 銀行 | |
| VIENNA INSURANCE GROUP AG WIEN | 31 | - | - | - | 保険 | |
| ANDRITZ AG | 65 | 80 | 363 | 44,866 | 機械 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 1,998 8 | 1,208 6 | 1,801 - | 222,523 <0.1%> | |
| (ユーロ…ルクセンブルグ) | | | | | | |
| RTL GROUP | 33 | 39 | 288 | 35,571 | メディア | |
| ALTICE SA | 78 | - | - | - | メディア | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 111 2 | 39 1 | 288 - | 35,571 <0.0%> | |
| (ユーロ…フィンランド) | | | | | | |
| WARTSILA OYJ | 123 | 147 | 536 | 66,240 | 機械 | |
| UPM-KYMMENE OYJ | 452 | 505 | 836 | 103,334 | 紙製品・林産品 | |
| STORA ENSO OYJ-R | 494 | 540 | 387 | 47,846 | 紙製品・林産品 | |
| SAMPO OYJ-A SHS | 388 | 432 | 1,687 | 208,376 | 保険 | |
| FORTUM OYJ | 396 | 440 | 559 | 69,060 | 電力 | |
| ELISA CORPORATION | 125 | 137 | 442 | 54,611 | 各種電気通信サービス | |
| METSO OYJ | 104 | 104 | 207 | 25,634 | 機械 | |
| NOKIA OYJ | 3,220 | 5,600 | 2,805 | 346,463 | 通信機器 | |
| NESTE OYJ | 107 | 125 | 347 | 42,912 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| NOKIAN RENKAAT OYJ | 102 | 113 | 356 | 44,053 | 自動車部品 | |
| KONE OYJ | 273 | 319 | 1,238 | 152,964 | 機械 | |
| ORION OYJ | 87 | 96 | 291 | 36,015 | 医薬品 | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 5,871 12 | 8,558 12 | 9,697 - | 1,197,514 <0.4%> | |
| (ユーロ…アイルランド) | | | | | | |
| BANK OF IRELAND | 25,300 | 28,500 | 664 | 82,003 | 銀行 | |
| CRH PLC | 737 | 822 | 2,081 | 257,070 | 建設資材 | |
| KERRY GROUP PLC-A | 147 | 161 | 1,288 | 159,055 | 食品 | |
| IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD | 1,398 | 1,398 | - | - | 銀行 | |
| PADDY POWER PLC | - | 81 | 928 | 114,680 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 27,582 4 | 30,962 5 | 4,962 - | 612,810 <0.2%> | |
| (ユーロ…ポルトガル) | | | | | | |
| ENERGIAS DE PORTUGAL | 2,000 | 2,200 | 696 | 86,067 | 電力 | |
| BANCO COMERCIAL PORTUGUES-REGD | 30,400 | 34,000 | 114 | 14,191 | 銀行 | |
| GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS | 335 | 445 | 518 | 64,020 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| JERONIMO MARTINS | 224 | 252 | 351 | 43,349 | 食品・生活必需品小売り | |
| 小計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 32,959 4 | 36,897 4 | 1,681 - | 207,628 <0.1%> | |
| ユーロ計 | 株数・金額 銘柄数<比率> | 228,254 238 | 257,239 231 | 301,543 - | 37,237,550 <12.0%> | |
| (香港) | | | 千香港ドル | | | |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 219 | 219 | 1,206 | 16,857 | 半導体・半導体製造装置 | |
| HANG LUNG PROPERTIES LTD | 1,920 | 2,130 | 3,071 | 42,908 | 不動産管理・開発 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|------------------------------------|---------|--------|-----------|---------|----------------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | | |
| BANK OF EAST ASIA | 968 | 1,208 | 3,420 | 47,782 | 銀行 | |
| CLP HLDGS | 1,675 | 1,855 | 13,513 | 188,786 | 電力 | |
| CATHAY PACIFIC AIRWAYS | 1,070 | 1,070 | 1,294 | 18,086 | 旅客航空輸送業 | |
| CHEUNG KONG INFRASTRUCTURE | 550 | 600 | 4,467 | 62,403 | 電力 | |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | 959 | 1,102 | 20,353 | 284,344 | 各種金融サービス | |
| LI & FUNG LTD | 4,936 | 5,636 | 2,485 | 34,722 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| MTR CORP | 1,305 | 1,395 | 5,370 | 75,029 | 陸運・鉄道 | |
| FIRST PACIFIC CO | 2,260 | 2,260 | 1,098 | 15,344 | 各種金融サービス | |
| HANG SENG BANK | 670 | 730 | 10,059 | 140,529 | 銀行 | |
| HENDERSON LAND | 936 | 1,110 | 5,184 | 72,427 | 不動産管理・開発 | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 1,230 | 1,350 | 10,320 | 144,180 | 電力 | |
| WHARF (HOLDING) | 1,330 | 1,330 | 5,559 | 77,664 | 不動産管理・開発 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 5,514 | 6,625 | 9,633 | 134,580 | ガス | |
| HUTCHISON WHAMPOA | 1,850 | — | — | — | コングロマリット | |
| HYSAN DEVELOPMENT | 540 | 650 | 2,106 | 29,420 | 不動産管理・開発 | |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 2,060 | 2,230 | 5,496 | 76,792 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| KERRY PROPERTIES | 570 | 570 | 1,145 | 16,005 | 不動産管理・開発 | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 3,155 | 3,635 | 8,015 | 111,971 | 銀行 | |
| NWS HOLDINGS LTD | 1,355 | 1,355 | 1,598 | 22,336 | コングロマリット | |
| PCCW LTD | 3,860 | 3,860 | 1,976 | 27,609 | 各種電気通信サービス | |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 620 | 750 | 2,126 | 29,703 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 4,666 | 5,166 | 3,756 | 52,473 | 不動産管理・開発 | |
| SHANGRI-LA ASIA LTD | 743 | 1,083 | 965 | 13,484 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| SINO LAND CO.LTD | 2,560 | 2,860 | 3,329 | 46,506 | 不動産管理・開発 | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 1,460 | 1,680 | 15,548 | 217,211 | 不動産管理・開発 | |
| SWIRE PACIFIC-A | 545 | 585 | 4,832 | 67,504 | 不動産管理・開発 | |
| WHEELOK & COMPANY LTD | 770 | 870 | 3,040 | 42,477 | 不動産管理・開発 | |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 1,260 | 1,280 | 3,788 | 52,929 | 家庭用耐久財 | |
| SJM HOLDINGS LIMITED | 1,660 | 1,660 | 803 | 11,224 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| WYNN MACAU LTD | 1,324 | 1,684 | 1,822 | 25,454 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| MGM CHINA HOLDINGS LTD | 780 | 780 | 804 | 11,245 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| AIA GROUP LTD | 10,434 | 11,624 | 51,784 | 723,435 | 保険 | |
| HKT TRUST AND HKT LTD | 2,196 | 2,596 | 2,860 | 39,965 | 各種電気通信サービス | |
| SANDS CHINA LTD | 2,080 | 2,348 | 6,386 | 89,220 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 1,008 | 1,168 | 2,347 | 32,797 | 不動産管理・開発 | |
| WH GROUP LIMITED | 3,100 | 5,900 | 3,492 | 48,794 | 食品 | |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 1,200 | 2,625 | 24,298 | 339,444 | コングロマリット | |
| CHEUNG KONG PROPERTY HOLDING | — | 2,635 | 12,808 | 178,928 | 不動産管理・開発 | |
| 小 計 | 株 数 | 金 額 | 75,340 | 88,217 | 262,175 | 3,662,585 |
| 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 | 452 | 35,792 | 航空宇宙・防衛 | |
| GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD | 6,153 | 6,153 | 233 | 18,490 | 食品 | |
| DBS GROUP HLDGS | 1,494 | 1,710 | 2,549 | 201,623 | 銀行 | |
| CITY DEVELOPMENTS LTD | 370 | 370 | 299 | 23,671 | 不動産管理・開発 | |
| SEBMCORP MARINE | 726 | 726 | 114 | 9,071 | 機械 | |
| JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD | 90 | 118 | 420 | 33,266 | 販売 | |
| SINGAPORE EXCHANGE LTD | 680 | 770 | 576 | 45,607 | 各種金融サービス | |
| CAPITALAND LIMITED | 2,290 | 2,460 | 733 | 57,971 | 不動産管理・開発 | |
| GENTING SINGAPORE PLC | 5,246 | 6,146 | 470 | 37,180 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| COMFORTDELGRO CORP LTD | 1,670 | 2,070 | 575 | 45,507 | 陸運・鉄道 | |
| SINGAPORE AIRLINES LTD | 490 | 550 | 624 | 49,401 | 旅客航空輸送業 | |
| UNITED OVERSEAS BANK | 1,119 | 1,255 | 2,243 | 177,450 | 銀行 | |
| UOL GROUP LIMITED | 387 | 487 | 278 | 21,990 | 不動産管理・開発 | |

| 銘柄 | 株数 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|--------------------------------------|---------------------------|---------|-----------|---------|-------------------------|-------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 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 | | |
| SINGAPORE PRESS HOLDINGS | 1,460 | 1,510 | 594 | 47,047 | メディア | |
| NOBLE GROUP LTD | 4,124 | 4,124 | 144 | 11,416 | 商社・流通業 | |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED | 6,860 | 7,700 | 2,995 | 236,868 | 各種電気通信サービス | |
| SEMBCORP INDUSTRIES | 830 | 990 | 269 | 21,303 | コングロマリット | |
| OCBC-ORD | 2,635 | 2,975 | 2,507 | 198,326 | 銀行 | |
| WILMAR INTERNATIONAL LTD | 1,600 | 1,840 | 642 | 50,782 | 食品 | |
| STARHUB LTD | 530 | 530 | 179 | 14,166 | 無線通信サービス | |
| KEPPEL CORP. | 1,237 | 1,427 | 749 | 59,244 | コングロマリット | |
| YANGZIJIANG SHIPBUILDING | 1,630 | 1,630 | 145 | 11,536 | 機械 | |
| GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES L | 2,640 | 2,940 | 529 | 41,849 | 不動産管理・開発 | |
| 小 計 | 株 数 ・ 金 額 銘柄 数 < 比 率 > | 45,672 | 49,892 | 18,330 | 1,449,567 | |
| | | 23 | 23 | — | <0.5%> | |
| (オーストラリア) | | | | 千豪ドル | | |
| RAMSAY HEALTH CARE LTD | 119 | 141 | 965 | 76,506 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK | 2,387 | 2,817 | 6,867 | 543,933 | 銀行 | |
| AMCOR | 1,070 | 1,130 | 1,794 | 142,119 | 容器・包装 | |
| WESTPAC BANKING CORP | 2,694 | 3,206 | 9,973 | 789,930 | 銀行 | |
| BANK OF QUEENSLAND LTD | 301 | 351 | 397 | 31,482 | 銀行 | |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 1,420 | 1,420 | 431 | 34,189 | 金属・鉱業 | |
| TELSTRA CORP LTD | 3,770 | 4,170 | 2,347 | 185,938 | 各種電気通信サービス | |
| BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD | 393 | 443 | 420 | 33,331 | 銀行 | |
| COCA-COLA AMATIL LTD | 520 | 520 | 454 | 35,994 | 飲料 | |
| ASX LTD | 175 | 182 | 812 | 64,360 | 各種金融サービス | |
| BHP BILLITON LIMITED | 2,782 | 3,084 | 5,677 | 449,669 | 金属・鉱業 | |
| CALTEX AUSTRALIA LIMITED | 235 | 255 | 851 | 67,434 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD | 397 | 530 | 251 | 19,896 | 複合小売り | |
| COMPUTERSHARE LTD | 410 | 470 | 483 | 38,266 | 情報技術サービス | |
| CSL LIMITED | 412 | 451 | 4,961 | 392,911 | バイオテクノロジー | |
| REA GROUP LTD | 41 | 54 | 291 | 23,077 | メディア | |
| TRANSURBAN GROUP | 1,566 | 1,950 | 2,412 | 191,046 | 運送インフラ | |
| COCHLEAR LTD | 52 | 52 | 587 | 46,492 | ヘルスケア機器・用品 | |
| ORIGIN ENERGY LTD | 980 | 1,750 | 910 | 72,072 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 1,406 | 1,646 | 12,473 | 987,892 | 銀行 | |
| BORAL LTD | 670 | 670 | 446 | 35,340 | 建設資材 | |
| RIO TINTO LTD | 380 | 410 | 1,916 | 151,774 | 金属・鉱業 | |
| APA GROUP | 990 | 1,070 | 977 | 77,456 | ガス | |
| ARISTOCRAT LEISURE LTD | — | 520 | 529 | 41,925 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD | 2,040 | 2,320 | 1,392 | 110,246 | 保険 | |
| TPG TELECOM LTD | 270 | 270 | 303 | 24,035 | 各種電気通信サービス | |
| FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD | 52 | 52 | 202 | 16,053 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| ORICA LTD | 326 | 366 | 495 | 39,219 | 化学 | |
| WORLEYPARSONS LTD | 180 | — | — | — | エネルギー設備・サービス | |
| SUNCORP GROUP LTD | 1,100 | 1,260 | 1,611 | 127,633 | 保険 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK | 2,065 | 2,524 | 7,180 | 568,717 | 銀行 | |
| NEWCREST MINING | 650 | 750 | 1,511 | 119,691 | 金属・鉱業 | |
| OIL SEARCH LTD | — | 1,300 | 890 | 70,527 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| INCITEC PIVOT LTD | 1,430 | 1,610 | 460 | 36,468 | 化学 | |
| TOLL HLDGS | 620 | — | — | — | 航空貨物・物流サービス | |
| AMP LIMITED | 2,600 | 2,850 | 1,672 | 132,497 | 保険 | |
| QANTAS AIRWAYS LIMITED | 470 | 441 | 146 | 11,639 | 旅客航空輸送業 | |
| QBE INSURANCE | 1,170 | 1,330 | 1,518 | 120,293 | 保険 | |
| CHALLENGER LIMITED | — | 560 | 520 | 41,203 | 各種金融サービス | |
| SANTOS LTD. | 846 | 1,670 | 698 | 55,286 | 石油・ガス・消耗燃料 | |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 339 | 373 | 756 | 59,939 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス | |

| 銘柄 | 株数 | 当期(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 | | |
| TABCORP HOLDINGS | 780 | 780 | 329 | 26,131 | | ホテル・レストラン・レジャー |
| WESFARMERS LIMITED | 984 | 1,079 | 4,656 | 368,831 | | 食品・生活必需品小売り |
| ALUMINA LTD | 2,330 | 2,330 | 322 | 25,558 | | 金属・鉱業 |
| ILUKA RESOURCES LTD | 378 | 378 | 233 | 18,471 | | 金属・鉱業 |
| WOODSIDE PETROLEUM | 646 | 711 | 1,943 | 153,954 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| WOOLWORTHS LIMITED | 1,088 | 1,229 | 2,644 | 209,468 | | 食品・生活必需品小売り |
| DUET GROUP | — | 2,290 | 528 | 41,896 | | 総合公益事業 |
| SEEK LTD | 288 | 328 | 562 | 44,577 | | 専門サービス |
| TATTS GROUP LTD | 1,310 | 1,470 | 580 | 45,987 | | ホテル・レストラン・レジャー |
| BRAMBLES LTD | 1,360 | 1,550 | 2,028 | 160,692 | | 商業サービス・用品 |
| PLATINUM ASSET MANAGEMENT | 170 | 250 | 149 | 11,860 | | 資本市場 |
| ASCIANO LTD | 850 | 610 | 543 | 43,045 | | 陸運・鉄道 |
| MACQUARIE GROUP LIMITED | 248 | 296 | 1,983 | 157,069 | | 資本市場 |
| CROWN RESORTS LTD | 297 | 360 | 444 | 35,183 | | ホテル・レストラン・レジャー |
| VOCUS COMMUNICATIONS LTD | — | 430 | 382 | 30,309 | | 各種電気通信サービス |
| JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | 369 | 440 | 860 | 68,127 | | 建設資材 |
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 540 | 720 | 736 | 58,335 | | 飲料 |
| SYDNEY AIRPORT | 979 | 1,079 | 776 | 61,528 | | 運送インフラ |
| ALS LTD | 352 | — | — | — | | 専門サービス |
| AURIZON HOLDINGS LTD | 1,910 | 2,090 | 930 | 73,659 | | 陸運・鉄道 |
| HEALTHSCOPE LTD | 960 | 1,760 | 484 | 38,332 | | 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 | 262 | 20,770 | | 電力 |
| MEDIBANK PRIVATE LTD | 2,300 | 2,610 | 837 | 66,354 | | 保険 |
| AGL ENERGY LTD | 566 | 645 | 1,226 | 97,110 | | 総合公益事業 |
| SOUTH32 LTD | — | 5,000 | 820 | 64,944 | | 金属・鉱業 |
| CIMIC GROUP LTD | 89 | 89 | 336 | 26,673 | | 建設・土木 |
| 小計 | 株数・金額 | 57,757 | 75,126 | 101,204 | 8,015,372 | |
| | 銘柄数<比率> | 61 | 64 | — | <2.6%> | |
| (ニュージーランド) | | | 千ニュージーランドドル | | | |
| CONTACT ENERGY LTD | 318 | 760 | 401 | 29,333 | | 電力 |
| RYMAN HEALTHCARE LTD | 300 | 350 | 318 | 23,282 | | 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 | 578 | 42,318 | | 建設資材 |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | 1,630 | 1,700 | 635 | 46,476 | | 各種電気通信サービス |
| MIGHTY RIVER POWER | 600 | 600 | 183 | 13,377 | | 電力 |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 881 | 971 | 636 | 46,496 | | 運送インフラ |
| MERIDIAN ENERGY LTD | 1,000 | 1,200 | 320 | 23,421 | | 独立系発電事業者・エネルギー販売者 |
| 小計 | 株数・金額 | 5,349 | 6,271 | 3,073 | 224,706 | |
| | 銘柄数<比率> | 7 | 7 | — | <0.1%> | |
| (イスラエル) | | | 千新シケケル | | | |
| BANK HAPAOALIM BM | 930 | 1,020 | 1,978 | 56,732 | | 銀行 |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL | 1,150 | 1,380 | 1,904 | 54,599 | | 銀行 |
| BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP | 1,650 | 1,860 | 1,469 | 42,127 | | 各種電気通信サービス |
| DELEK GROUP LTD | 4 | 4 | 322 | 9,253 | | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ISRAEL CHEMICALS LIMITED | 340 | 440 | 726 | 20,814 | | 化学 |
| NICE SYSTEMS LTD | 53 | 53 | 1,275 | 36,574 | | ソフトウェア |
| TEVA PHARMACEUTICAL IND LTD | 751 | 881 | 17,514 | 502,134 | | 医薬品 |
| ISRAEL CORP LIMITED/THE | 2 | — | — | — | | 化学 |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 90 | 130 | 554 | 15,907 | | 銀行 |
| AZRIELI GROUP | — | 31 | 469 | 13,473 | | 不動産管理・開発 |
| 小計 | 株数・金額 | 4,970 | 5,799 | 26,216 | 751,616 | |
| | 銘柄数<比率> | 9 | 9 | — | <0.2%> | |
| 合計 | 株数・金額 | 1,245,611 | 1,279,833 | — | 295,748,498 | |
| | 銘柄数<比率> | 1,259 | 1,263 | — | <95.4%> | |

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

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

* 株数・評価額の単位未満は切り捨て。ただし、単位未満の場合は小数で記載。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

外国投資信託証券

| 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 | 644 | 69,938 | 0.0 | |
| AMERICAN REALTY CAPITAL PROP | 81,000 | — | — | — | — | |
| AMERICAN TOWER CORP | 36,300 | 41,000 | 4,372 | 474,257 | 0.2 | |
| ANNALY CAPITAL MANAGEMENT | 80,000 | 91,000 | 993 | 107,778 | 0.0 | |
| AVALONBAY COMMUNITIES INC | 11,340 | 13,330 | 2,519 | 273,221 | 0.1 | |
| BOSTON PROPERTIES | 13,280 | 14,700 | 1,944 | 210,886 | 0.1 | |
| BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | — | 20,300 | 539 | 58,522 | 0.0 | |
| CAMDEN PROPERTY TRUST | 7,600 | 8,300 | 714 | 77,535 | 0.0 | |
| COMMUNICATIONS SALES & LEASING INC | 10,200 | — | — | — | — | |
| CROWN CASTLE INTL CORP | 28,700 | 32,300 | 2,889 | 313,436 | 0.1 | |
| DIGITAL REALTY TRUST INC | 11,800 | 14,000 | 1,304 | 141,457 | 0.0 | |
| DUKE REALTY CORP | 28,600 | 34,000 | 798 | 86,622 | 0.0 | |
| EQUINIX INC | 4,690 | 6,490 | 2,213 | 240,059 | 0.1 | |
| EQUITY RESIDENTIAL | 29,600 | 35,100 | 2,522 | 273,643 | 0.1 | |
| ESSEX PROPERTY TRUST INC | 5,460 | 6,300 | 1,471 | 159,556 | 0.1 | |
| EXTRA SPACE STORAGE INC | — | 11,500 | 1,073 | 116,434 | 0.0 | |
| FEDERAL REALTY INVS TRUST | 5,800 | 6,520 | 1,039 | 112,763 | 0.0 | |
| GENERAL GROWTH PROPERTIES INC | 46,600 | 54,400 | 1,612 | 174,882 | 0.1 | |
| HCP INC | 39,800 | 45,600 | 1,641 | 177,998 | 0.1 | |
| HEALTH CARE REIT INC | 30,300 | — | — | — | — | |
| HOST HOTELS & RESORTS INC | 65,900 | 73,900 | 1,212 | 131,529 | 0.0 | |
| IRON MOUNTAIN INC | 14,800 | 24,400 | 930 | 100,961 | 0.0 | |
| KIMCO REALTY CORP | 36,900 | 40,500 | 1,201 | 130,285 | 0.0 | |
| LIBERTY PROPERTY TRUST | 12,500 | 15,000 | 548 | 59,512 | 0.0 | |
| MACERICH CO /THE | 12,200 | 13,300 | 1,073 | 116,425 | 0.0 | |
| MID-AMERICA APARTMENT COMM | — | 7,200 | 738 | 80,144 | 0.0 | |
| PLUM CREEK TIMBER CO | 15,400 | — | — | — | — | |
| PROLOGIS INC | 43,800 | 50,700 | 2,397 | 260,044 | 0.1 | |
| PUBLIC STORAGE | 12,640 | 14,240 | 3,770 | 408,944 | 0.1 | |
| RAYONIER INC | 11,800 | — | — | — | — | |
| REALTY INCOME CORP | 19,300 | 23,800 | 1,524 | 165,309 | 0.1 | |
| REGENCY CENTERS CORP | 8,000 | 8,800 | 698 | 75,735 | 0.0 | |
| SL GREEN REALTY CORP | 8,600 | 9,800 | 1,034 | 112,253 | 0.0 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 27,150 | 29,970 | 6,384 | 692,496 | 0.2 | |
| UDR INC | 22,600 | 25,700 | 956 | 103,747 | 0.0 | |
| VENTAS INC | 28,300 | 31,700 | 2,113 | 229,189 | 0.1 | |
| VEREIT INC | — | 88,000 | 859 | 93,249 | 0.0 | |
| VORNADO REALTY TRUST | 14,900 | 16,600 | 1,608 | 174,444 | 0.1 | |
| WELLTOWER INC | — | 34,500 | 2,577 | 279,517 | 0.1 | |
| WEYERHAEUSER CO | 45,900 | 76,000 | 2,352 | 255,119 | 0.1 | |
| HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST | 509,000 | 509,000 | 216 | 23,462 | 0.0 | |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 1,410,260 | 1,562,050 | 60,495 | 6,561,370 | |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 36 | 36 | — | < 2.1% > | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | |
|------------------------------------|--------------|---------|-----------|---------|---------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 | | 比 率 |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | 千円 | % |
| H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS | 10,500 | 13,600 | 299 | 25,032 | 0.0 |
| RIOCAN REAL ESTATE INVST TR | 14,400 | 14,400 | 406 | 34,004 | 0.0 |
| SMART REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | — | 6,900 | 238 | 19,962 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 24,900 | 34,900 | 945 | 78,999 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 2 | 3 | — | <0.0%> |
| (イギリス) | | | 千英ポンド | | |
| BRITISH LAND | 84,000 | 94,000 | 693 | 108,327 | 0.0 |
| HAMMERSON PLC | 67,000 | 73,000 | 428 | 66,901 | 0.0 |
| INTU PROPERTIES PLC | 77,000 | 88,000 | 263 | 41,115 | 0.0 |
| LAND SECURITIES GROUP PLC | 68,000 | 77,500 | 912 | 142,536 | 0.0 |
| SEGRO PLC | 69,000 | 70,000 | 301 | 47,078 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 365,000 | 402,500 | 2,597 | 405,958 |
| | 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 | 205 | 25,354 | 0.0 |
| KLEPIERRE | 15,600 | 21,200 | 880 | 108,685 | 0.0 |
| GECINA SA | 2,470 | 3,400 | 432 | 53,364 | 0.0 |
| FONCIERE DES REGIONS | 2,500 | 3,100 | 256 | 31,617 | 0.0 |
| UNIBAIL RODAMCO-NA | 8,440 | 9,600 | 2,288 | 282,564 | 0.1 |
| ユ ー ロ 計 | 口 数 ・ 金 額 | 32,010 | 40,300 | 4,061 | 501,587 |
| | 銘柄 数 < 比 率 > | 5 | 5 | — | <0.2%> |
| (香港) | | | 千香港ドル | | |
| LINK REIT | 200,000 | 219,000 | 10,303 | 143,946 | 0.0 |
| HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS | — | 260,000 | 1,807 | 25,243 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 200,000 | 479,000 | 12,110 | 169,189 |
| | 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 | 532 | 42,093 | 0.0 |
| ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT | 187,000 | 213,000 | 519 | 41,099 | 0.0 |
| CAPITALAND COMMERCIAL TRUST | 192,000 | 192,000 | 266 | 21,104 | 0.0 |
| SUNTEC REIT | 203,000 | 243,000 | 403 | 31,899 | 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 | 801,900 | 897,900 | 1,722 | 136,196 |
| | 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 | 682 | 54,054 | 0.0 |
| GPT GROUP | 148,000 | 179,000 | 927 | 73,435 | 0.0 |
| LENDLEASE GROUP | 48,000 | 53,000 | 689 | 54,568 | 0.0 |
| STOCKLAND TRUST GROUP | 197,000 | 230,000 | 1,048 | 83,064 | 0.0 |
| DEXUS PROPERTY GROUP | 75,000 | 92,000 | 786 | 62,298 | 0.0 |
| GOODMAN GROUP | 150,000 | 174,000 | 1,254 | 99,359 | 0.0 |
| FEDERATION CENTRES | 132,200 | — | — | — | — |
| SCENTRE GROUP | 455,000 | 513,000 | 2,385 | 188,927 | 0.1 |
| WESTFIELD CORP | 171,400 | 193,000 | 2,018 | 159,887 | 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 1,117 | 千円 88,513 | % 0.0 |
| 小 計 | 口 数 ・ 金 額 1,896,800 | 2,112,704 | 10,910 | 864,110 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > 10 | 9 | — | <0.3%> | |
| 合 計 | 口 数 ・ 金 額 4,730,870 | 5,529,354 | — | 8,717,413 | |
| | 銘 柄 数 < 比 率 > 63 | 64 | — | <2.8%> | |

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

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

* 金額の単位未満は切り捨て。

* 銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘 柄 別 | | | 当 期 末 | |
|-------|--------|----------|-------|-------|
| | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 外 国 | 株式先物取引 | | 百万円 | 百万円 |
| | | CAN60 | 211 | — |
| | | EUR050 | 702 | — |
| | | FT100 | 446 | — |
| | | SPEMINI | 3,676 | — |
| | | SWISSMKT | 208 | — |

* 単位未満は切り捨て。

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

国内株式マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2016年5月10日）

作成対象期間（2015年5月12日～2016年5月10日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク指数 | | 株組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|-------|----------|-------|-------|--------|---------|
| | 円 | 騰落率 | (TOPIX) | (騰落率) | | | |
| 11期(2012年5月10日) | 6,581 | △ 8.5 | 765.42 | △10.6 | 96.7 | 3.2 | 137,638 |
| 12期(2013年5月10日) | 10,640 | 61.7 | 1,210.60 | 58.2 | 98.1 | 1.8 | 190,083 |
| 13期(2014年5月12日) | 10,381 | △ 2.4 | 1,157.91 | △ 4.4 | 97.7 | 2.3 | 174,610 |
| 14期(2015年5月11日) | 14,594 | 40.6 | 1,598.33 | 38.0 | 98.1 | 1.9 | 259,915 |
| 15期(2016年5月10日) | 12,439 | △14.8 | 1,334.90 | △16.5 | 97.7 | 2.3 | 279,492 |

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「東証」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東証が有します。東証は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

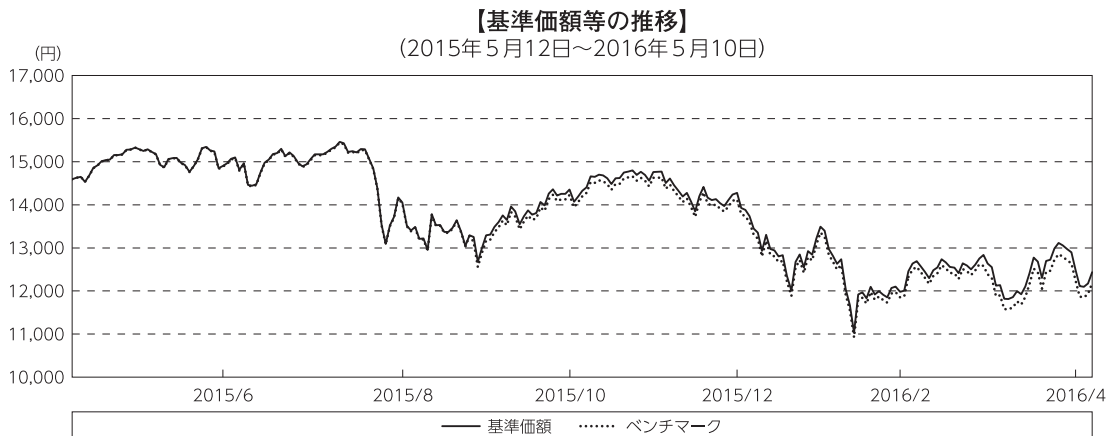
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク指数 | | 株組入比率 | 株式先物比率 |
|--------------------|--------|-------|----------|-------|-------|--------|
| | 円 | 騰落率 | (TOPIX) | (騰落率) | | |
| (期首) 2015年5月11日 | 14,594 | — | 1,598.33 | — | 98.1 | 1.9 |
| 5月末 | 15,285 | 4.7 | 1,673.65 | 4.7 | 97.3 | 2.0 |
| 6月末 | 14,903 | 2.1 | 1,630.40 | 2.0 | 97.8 | 2.1 |
| 7月末 | 15,171 | 4.0 | 1,659.52 | 3.8 | 98.8 | 1.2 |
| 8月末 | 14,054 | △ 3.7 | 1,537.05 | △ 3.8 | 98.3 | 1.7 |
| 9月末 | 13,001 | △10.9 | 1,411.16 | △11.7 | 97.5 | 2.5 |
| 10月末 | 14,357 | △ 1.6 | 1,558.20 | △ 2.5 | 97.6 | 1.5 |
| 11月末 | 14,563 | △ 0.2 | 1,580.25 | △ 1.1 | 97.8 | 1.8 |
| 12月末 | 14,276 | △ 2.2 | 1,547.30 | △ 3.2 | 98.6 | 1.4 |
| 2016年1月末 | 13,215 | △ 9.4 | 1,432.07 | △10.4 | 98.0 | 2.0 |
| 2月末 | 11,978 | △17.9 | 1,297.85 | △18.8 | 98.2 | 1.8 |
| 3月末 | 12,553 | △14.0 | 1,347.20 | △15.7 | 98.1 | 1.7 |
| 4月末 | 12,489 | △14.4 | 1,340.55 | △16.1 | 98.1 | 1.8 |
| (期末) 2016年5月10日 | 12,439 | △14.8 | 1,334.90 | △16.5 | 97.7 | 2.3 |

*騰落率は期首比です。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、東証株価指数 (TOPIX) です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首14,594円から期末12,439円に2,155円の値下がりとなりました。

中国や新興国への景気減速懸念が高まったことや、原油価格下落などを背景とした世界的な株安が進行したこと、為替が円高に進行したことなどから下落しました。

○投資環境

期首から2015年8月中旬までは、米国の利上げに対する見方や、ギリシャの債務問題の進展状況、中国株式市場の急落などを巡り、株式市場は一進一退の展開となりました。

8月中旬以降は、中国や新興国への景気減速懸念が高まったことや、為替が円高に進行したことが企業収益への不安につながり下落しましたが、10月以降は、中国経済への懸念が後退したことや、ECB（欧州中央銀行）総裁の追加金融緩和を示唆する発言など世界的な金融緩和継続の流れ、国内企業の決算への期待などが相場を押し上げました。

12月以降は、日銀金融政策決定会合の内容が金融緩和への手詰まり感の表れと受け取られたことや、中国経済への懸念が再び高まったこと、原油価格下落などを背景とした世界的な株安が進行したこと、為替が円高に進行したことなどを受けて、株式市場は下落しました。

2016年1月下旬には、日欧の中央銀行における金融緩和姿勢から反発に転じましたが、2月上旬には、米国経済の先行き懸念の高まりや、日銀によるマイナス金利導入の影響により金融機関の利益減少懸念が高まったことなどから再び下落しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

実質株式組入比率（先物を含む）は、期を通じ高位に維持しました。

・期中の主な動き

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

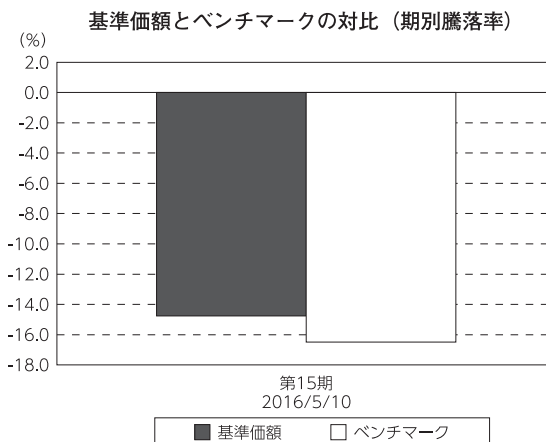
なお、追加設定・解約に伴う資金増減への対応などを考慮して、従来通り株式先物を利用しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-14.8%となり、ベンチマークである東証株価指数（TOPIX）の-16.5%を1.7ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（プラス要因）

保有銘柄の配当権利落ちによりファンドには未収配当金が計上されたこと



（注）ベンチマークは、東証株価指数（TOPIX）です。

◎今後の運用方針

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2015年5月12日～2016年5月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 円 | % | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料 |
| (株 式) | 0 | 0.002 | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| 合 計 | (0) | (0.002) | |
| 期中の平均基準価額は、13,820円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月12日～2016年5月10日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|----|---------------------------|---------------------------|--------------|------------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 内 | 上場 | 千株 63,159 (△ 4,994) | 千円 81,654,860 (-) | 千株 10,748 | 千円 14,893,941 |

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

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

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 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 71,254 | 百万円 69,304 | 百万円 - | 百万円 - |

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年5月12日～2016年5月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|---------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 96,548,801千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 273,880,605千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.35 |

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月12日～2016年5月10日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|-----|-----------|---------------------------|--------------------|-----------|---------------------------|--------------------|
| | 百万円 | うち利害関係人 との取引状況B 百万円 | $\frac{B}{A}$ % | 百万円 | うち利害関係人 との取引状況D 百万円 | $\frac{D}{C}$ % |
| 株式 | 81,654 | 652 | 0.8 | 14,893 | 62 | 0.4 |
| 貸株 | 83,949 | 13,049 | 15.5 | 97,775 | 11,630 | 11.9 |
| 預金 | 586,031 | 586,031 | 100.0 | 586,031 | 586,031 | 100.0 |

利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|------------|--------------|
| 株式 | 百万円 454 | 百万円 168 | 百万円 1,208 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|---------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 4,596千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 1千円 |
| (B) / (A) | 0.0% |

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

(2016年5月10日現在)

○組入資産の明細

国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業 (0.1%) | | | | |
| 極洋 | 52 | 66 | 17,292 | |
| 日本水産 | 150 | 178.4 | 112,035 | |
| マルハニチロ | 24.9 | 31.6 | 80,896 | |
| サカタのタネ | 19.6 | 22.9 | 62,906 | |
| ホクト | 13.5 | 15.7 | 33,095 | |
| ホクリヨウ | — | 1.4 | 1,523 | |
| 鉱業 (0.3%) | | | | |
| 住石ホールディングス | 33.9 | 45.5 | 4,277 | |
| 日鉄鉱業 | 34 | 43 | 18,232 | |
| 三井松島産業 | 80 | 101 | 11,413 | |
| 国際石油開発帝石 | 643 | 815.8 | 673,606 | |
| 日本海洋掘削 | 3.7 | 4.6 | 11,251 | |
| 石油資源開発 | 17.4 | 24.5 | 58,800 | |
| K&Oエナジーグループ | 8.2 | 10.4 | 13,561 | |
| 建設業 (3.2%) | | | | |
| ショーボンドホールディングス | 11.8 | 16.2 | 77,841 | |
| ミライト・ホールディングス | 37.5 | 47.6 | 48,837 | |
| タマホーム | 9.1 | 11.6 | 5,150 | |
| サンヨーホームズ | 1.7 | 3.2 | 1,600 | |
| ダイセキ環境ソリューション | 1.4 | 3.6 | 4,172 | |
| 安藤・間 | 81.4 | 103.3 | 56,608 | |
| 東急建設 | 43.3 | 50.4 | 45,712 | |
| コムシスホールディングス | 54.3 | 66.6 | 118,481 | |
| ミサワホーム | 14.4 | 18.3 | 13,834 | |
| ビーアールホールディングス | — | 6.1 | 2,690 | |
| 高松コンストラクショングループ | 9.2 | 11.7 | 28,442 | |
| 東建コーポレーション | 4.6 | 6.4 | 56,832 | |
| ソネック | — | 1.7 | 952 | |
| ヤマウラ | 5.7 | 7.2 | 3,772 | |
| 大成建設 | 634 | 804 | 599,784 | |
| 大林組 | 366 | 464.4 | 499,230 | |
| 清水建設 | 373 | 474 | 465,468 | |
| 飛鳥建設 | 82.1 | 124.3 | 22,622 | |
| 長谷工コーポレーション | 152.6 | 180.7 | 183,410 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|---------------|---------|-------|---------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 松井建設 | 13 | 17.1 | 13,423 | |
| 銭高組 | 17 | 22 | 10,098 | |
| 鹿島建設 | 536 | 726 | 506,022 | |
| 不動テトラ | 92.3 | 109.4 | 14,878 | |
| 大末建設 | 4.7 | 5.9 | 5,068 | |
| 鉄建建設 | 74 | 94 | 26,038 | |
| 日鉄住金テックスエンジ | 23 | — | — | |
| 西松建設 | 132 | 179 | 81,982 | |
| 三井住友建設 | 495.2 | 593.4 | 57,559 | |
| 大豊建設 | 33 | 60 | 28,560 | |
| 前田建設工業 | 81 | 95 | 79,610 | |
| 佐田建設 | 42 | 10.7 | 4,472 | |
| ナカノフード建設 | 9.3 | 11.8 | 6,112 | |
| 奥村組 | 116 | 147 | 87,612 | |
| 大和小田急建設 | 6.6 | — | — | |
| 東鉄工業 | 14.7 | 18.6 | 59,613 | |
| イチケン | 13 | 17 | 4,573 | |
| 浅沼組 | 39 | 50 | 12,500 | |
| 戸田建設 | 153 | 180 | 92,520 | |
| 熊谷組 | 153 | 227 | 67,192 | |
| 青木あすなろ建設 | 8 | 10.1 | 6,797 | |
| 北野建設 | 25 | 32 | 8,480 | |
| 植木組 | 15 | 19 | 4,237 | |
| 三井ホーム | 16 | 20 | 9,700 | |
| 矢作建設工業 | 15.1 | 21.1 | 18,757 | |
| ビーエス三菱 | 12.8 | 18.3 | 7,631 | |
| 日本ハウスホールディングス | 20.2 | 31.6 | 11,439 | |
| 大東建託 | 45.6 | 57 | 945,345 | |
| 新日本建設 | 14.5 | 18.4 | 9,384 | |
| N I P P O | 28 | 36 | 66,024 | |
| 東亜道路工業 | 23 | 29 | 10,672 | |
| 前田道路 | 38 | 48 | 97,248 | |
| 日本道路 | 36 | 46 | 22,632 | |
| 東亜建設工業 | 91 | 135 | 23,085 | |
| 若築建設 | 70 | 89 | 13,350 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東洋建設 | 36.6 | 48.6 | 23,473 |
| 五洋建設 | 135.4 | 171.8 | 86,243 |
| 大林道路 | 14 | 18.1 | 13,719 |
| 世紀東急工業 | 17.8 | 24.3 | 11,542 |
| 福田組 | 18 | 25 | 32,750 |
| 住友林業 | 90 | 106.6 | 134,849 |
| 日本基礎技術 | 14.6 | 17.2 | 7,206 |
| 日成ビルド工業 | 34 | 43 | 18,662 |
| ヤマダ・エスバイエルホーム | 55 | 79 | 7,189 |
| 巴コーポレーション | 15.2 | 19.2 | 6,720 |
| パナホーム | 46 | 58 | 50,518 |
| 大和ハウス工業 | 357.4 | 457.5 | 1,387,597 |
| ライト工業 | 19.6 | 29.8 | 34,657 |
| 積水ハウス | 379.7 | 517.7 | 997,090 |
| 日特建設 | 16.3 | 17 | 7,106 |
| 北陸電気工事 | 6 | 7.5 | 6,390 |
| ユアテック | 19 | 24 | 19,008 |
| 西部電気工業 | 10 | 13 | 5,681 |
| 四電工 | 10 | 12 | 4,884 |
| 中電工 | 17.6 | 22.4 | 49,750 |
| 関電工 | 56 | 62 | 54,560 |
| きんでん | 81 | 93.6 | 123,084 |
| 東京エネシス | 14 | 18 | 19,476 |
| トーエネック | 17 | 22 | 13,090 |
| 住友電設 | 9.6 | 12.2 | 17,385 |
| 日本電設工業 | 19.9 | 25.2 | 50,349 |
| 協和エクシオ | 51.8 | 60.7 | 88,015 |
| 新日本空調 | 10.3 | 13 | 13,338 |
| NDS | 20 | 24 | 7,008 |
| 九電工 | 22 | 28.3 | 91,975 |
| 三機工業 | 24.8 | 34.3 | 30,595 |
| 日揮 | 123 | 156 | 288,912 |
| 中外炉工業 | 37 | 47 | 9,306 |
| ヤマト | 11 | 13.9 | 6,588 |
| 太平電業 | 17 | 23 | 21,574 |
| 高砂熱学工業 | 33.6 | 46.2 | 63,432 |
| 三晃金属工業 | 12 | 15 | 4,560 |
| 朝日工業社 | 14 | 18 | 7,956 |
| 明星工業 | 20.1 | 28 | 14,028 |
| 大氣社 | 17.4 | 18.9 | 46,853 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ダイダシ | 16 | 21 | 16,191 |
| 日比谷総合設備 | 15.7 | 18.6 | 29,536 |
| 東芝プラントシステム | 19.8 | 25.1 | 34,512 |
| OSJBホールディングス | 16.6 | 31.5 | 8,158 |
| 東洋エンジニアリング | 59 | 83 | 24,402 |
| 千代田化工建設 | 88 | 112 | 92,624 |
| 新興ブランテック | 25.1 | 31.8 | 27,538 |
| 食料品 (5.2%) | | | |
| 日本製粉 | 75 | 99 | 84,645 |
| 日清製粉グループ本社 | 133.8 | 169.8 | 314,809 |
| 日東富士製粉 | 10 | 12 | 4,008 |
| 昭和産業 | 50 | 64 | 32,000 |
| 鳥越製粉 | 9.7 | 12.3 | 7,810 |
| 中部飼料 | 11.7 | 14.3 | 12,169 |
| フィード・ワン | 73.4 | 93.2 | 11,556 |
| 東洋精糖 | 18 | 23 | 2,438 |
| 日本甜菜製糖 | 62 | 79 | 14,931 |
| 三井製糖 | 48 | 61 | 31,415 |
| 塩水港精糖 | 13 | 16.5 | 4,339 |
| 日新製糖 | — | 6.6 | 9,154 |
| 森永製菓 | 110 | 140 | 76,580 |
| 中村屋 | 28 | 36 | 16,452 |
| 江崎グリコ | 28.2 | 35.8 | 202,270 |
| 名糖産業 | 5.4 | 6.8 | 9,078 |
| 不二家 | 70 | 89 | 17,088 |
| 山崎製パン | 89 | 113 | 308,264 |
| 第一屋製パン | 16 | 24 | 2,616 |
| モロゾフ | 19 | 24 | 10,272 |
| 亀田製菓 | 6.8 | 8.6 | 38,313 |
| 寿スピリッツ | 2.9 | 11 | 25,410 |
| カルビー | 45.2 | 57.4 | 245,098 |
| 森永乳業 | 109 | 139 | 85,346 |
| 六甲バター | 5.4 | 6.9 | 13,427 |
| ヤクルト本社 | 65.4 | 83 | 432,430 |
| 明治ホールディングス | 36.1 | 91.7 | 810,628 |
| 雪印メグミルク | 28.7 | 36.4 | 102,320 |
| プリマハム | 68 | 98 | 29,792 |
| 日本ハム | 90 | 114 | 299,706 |
| 伊藤ハム | 67 | — | — |
| 林兼産業 | 39 | 50 | 4,850 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 丸大食品 | 63 | 80 | 36,800 |
| 米久 | 3.9 | — | — |
| S Foods | 7.6 | 9.7 | 28,071 |
| 伊藤ハム米久ホールディングス | — | 92.5 | 78,347 |
| サッポロホールディングス | 200 | 237 | 144,333 |
| アサヒグループホールディングス | 245.3 | 290.5 | 1,039,118 |
| キリンホールディングス | 494.6 | 627.6 | 1,119,638 |
| 宝ホールディングス | 95.7 | 112.1 | 108,064 |
| オエノンホールディングス | 31 | 42 | 9,240 |
| 養命酒製造 | 8 | 4.8 | 9,254 |
| コカ・コーラウエスト | 41.3 | 52.5 | 168,000 |
| コカ・コーライーストジャパン | 37.1 | 54.8 | 117,436 |
| サントリー食品インターナショナル | 73.2 | 106.1 | 564,452 |
| ダイドードリンコ | 6.2 | 7.8 | 43,680 |
| 伊藤園 | 36.2 | 45.9 | 162,256 |
| キーコーヒー | 10.7 | 13.6 | 25,486 |
| ユニカフェ | 3.3 | 4.2 | 3,767 |
| ジャパンフーズ | 1.6 | 2 | 2,410 |
| 日清オイリオグループ | 59 | 82 | 38,950 |
| 不二製油グループ本社 | 32.6 | 41.3 | 85,408 |
| かどや製油 | 1.2 | 1.5 | 4,182 |
| J-オイルミルズ | 51 | 65 | 22,945 |
| キッコーマン | 100 | 117 | 425,295 |
| 味の素 | 281 | 325.7 | 848,774 |
| キュービー | 62.1 | 78.8 | 234,036 |
| ハウス食品グループ本社 | 45.2 | 52.9 | 113,311 |
| カゴメ | 47.2 | 55.6 | 137,220 |
| 焼津水産化学工業 | 5.7 | 7.3 | 7,278 |
| アリアケジャパン | 11.1 | 12.7 | 80,899 |
| ピエトロ | — | 1.4 | 2,716 |
| エバラ食品工業 | 2 | 3.7 | 7,263 |
| ニチレイ | 130 | 165 | 163,020 |
| 東洋水産 | 63.8 | 76.1 | 308,205 |
| イートアンド | 1.3 | 1.7 | 3,626 |
| 日清食品ホールディングス | 51.6 | 65.5 | 347,150 |
| 永谷園ホールディングス | 12 | 15 | 16,575 |
| 一正蒲鉾 | 4.2 | 5.4 | 5,470 |
| フジッコ | 12 | 15 | 36,105 |
| ロック・フィールド | 6.3 | 16.1 | 27,241 |
| 日本たばこ産業 | 676.5 | 915.5 | 4,204,891 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ケンコーマヨネーズ | 4 | 5 | 11,650 |
| わらべや日洋 | 7.2 | 8.3 | 17,413 |
| なとり | 5.6 | 7.7 | 13,151 |
| 北の達人コーポレーション | — | 2.8 | 1,422 |
| ユーグレナ | 40.8 | 49.6 | 77,326 |
| ミヨシ油脂 | 42 | 53 | 6,890 |
| 理研ビタミン | 3.6 | 4.6 | 19,527 |
| 繊維製品 (0.7%) | | | |
| 片倉工業 | 14.3 | 18.1 | 21,792 |
| グンゼ | 92 | 117 | 36,036 |
| 東洋紡 | 452 | 573 | 106,578 |
| ユニチカ | 332 | 421 | 22,734 |
| 富士紡ホールディングス | 55 | 70 | 15,750 |
| 日清紡ホールディングス | 73 | — | — |
| 倉敷紡績 | 117 | 148 | 28,860 |
| シキボウ | 66 | 88 | 9,504 |
| 日本毛織 | 36 | 44.5 | 33,953 |
| 大東紡織 | 17 | 21 | 1,323 |
| トーア紡コーポレーション | 51 | 6.1 | 2,958 |
| ダイドーリミテッド | 12.8 | 16.2 | 7,549 |
| 帝国繊維 | 11.9 | 15.1 | 22,755 |
| 帝人 | 466 | 592 | 217,264 |
| 東レ | 883 | 1,050 | 962,640 |
| サカイオーベックス | 30 | 38 | 6,460 |
| 住江織物 | 29 | 36 | 9,612 |
| 日本フェルト | 6 | 7.7 | 3,418 |
| イチカワ | 8 | 10 | 2,750 |
| 日本バイリーン | 16 | — | — |
| 日東製網 | 13 | 16 | 2,208 |
| 芦森工業 | 25 | 31 | 4,898 |
| アツギ | 95 | 111 | 12,543 |
| ダイニック | 22 | 27 | 4,050 |
| セーレン | 28.4 | 36.1 | 39,710 |
| 東海染工 | 16 | 20 | 2,660 |
| 小松精練 | 19 | 22.2 | 13,786 |
| ワコールホールディングス | 68 | 86 | 102,770 |
| ホギメディカル | 7.2 | 9.1 | 56,784 |
| レナウン | 27.4 | 39.1 | 4,692 |
| クラウディア | 2.9 | 3.3 | 1,716 |
| T S I ホールディングス | 50.9 | 64.6 | 44,832 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三陽商会 | 60 | 81 | 20,331 |
| ナイガイ | 42 | 53 | 2,544 |
| オンワードホールディングス | 82 | 94 | 71,440 |
| ルック | 19 | 26 | 4,108 |
| キムラタン | 508 | 610 | 4,270 |
| ゴールドウィン | 26 | 6.1 | 26,474 |
| デサント | 26 | 33 | 47,586 |
| キング | 5.7 | 7.2 | 2,671 |
| ヤマトインターナショナル | 7.4 | 8.9 | 3,488 |
| パルプ・紙 (0.3%) | | | |
| 特種東海製紙 | 66 | 84 | 29,988 |
| 王子ホールディングス | 468 | 594 | 258,984 |
| 日本製紙 | 55 | 74.8 | 157,678 |
| 三菱製紙 | 174 | 221 | 17,901 |
| 北越紀州製紙 | 70.8 | 89.8 | 60,525 |
| 中越パルプ工業 | 43 | 57 | 11,742 |
| 巴川製紙所 | 18 | 22 | 4,268 |
| 大王製紙 | 51 | 64.1 | 72,368 |
| レンゴー | 101 | 128 | 73,984 |
| トーモク | 36 | 46 | 13,570 |
| ザ・バック | 8.1 | 10.2 | 26,662 |
| 化学 (6.2%) | | | |
| クラレ | 194.2 | 228.4 | 324,784 |
| 旭化成 | 712 | 903 | 681,223 |
| 共和レザー | 7.5 | 9.5 | 7,809 |
| コープケミカル | 17 | — | — |
| 昭和電工 | 760 | 964 | 106,040 |
| 住友化学 | 840 | 1,066 | 524,472 |
| 日本化成 | 21 | 27 | 2,997 |
| 住友精化 | 24 | 30 | 15,900 |
| 日産化学工業 | 74.8 | 87 | 256,824 |
| ラサ工業 | 43 | 55 | 5,885 |
| クレハ | 80 | 109 | 40,875 |
| 多木化学 | 7 | 9 | 5,688 |
| テイカ | 19 | 24 | 11,880 |
| 石原産業 | 191 | 260 | 19,240 |
| 片倉コープアグリ | 7 | 17 | 3,672 |
| 日東エフシー | — | 8.5 | 7,718 |
| 日本曹達 | 73 | 94 | 54,520 |
| 東ソー | 285 | 391 | 199,410 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| トクヤマ | 177 | 240 | 42,000 |
| セントラル硝子 | 116 | 157 | 99,852 |
| 東亜合成 | 143 | 90.6 | 91,777 |
| 大阪ソーダ | 45 | 62 | 25,606 |
| 関東電化工業 | 27 | 35 | 27,090 |
| デンカ | 236 | 300 | 137,400 |
| 信越化学工業 | 204.6 | 259.6 | 1,613,414 |
| 日本カーバイド工業 | 39 | 49 | 7,987 |
| 堺化学工業 | 46 | 59 | 18,408 |
| エア・ウォーター | 101 | 119 | 193,851 |
| 大陽日酸 | 146.5 | 111.5 | 112,615 |
| 日本化学工業 | 42 | 54 | 11,772 |
| 日本パーカライジング | 53.8 | 74 | 72,372 |
| 高圧ガス工業 | 17 | 21 | 13,356 |
| チタン工業 | 13 | 17 | 3,213 |
| 四国化成工業 | 16 | 21 | 17,850 |
| 戸田工業 | 23 | 29 | 8,903 |
| ステラ ケミファ | 5.8 | 7.4 | 21,837 |
| 保土谷化学工業 | 34 | 43 | 9,933 |
| 日本触媒 | 90 | 21 | 110,040 |
| 大日精化工業 | 47 | 56 | 25,760 |
| カネカ | 154 | 195 | 177,840 |
| 三菱瓦斯化学 | 196 | 249 | 144,420 |
| 三井化学 | 519 | 614 | 227,794 |
| J S R | 112.7 | 135.8 | 210,354 |
| 東京応化工業 | 23.6 | 29 | 89,320 |
| 大阪有機化学工業 | 8.1 | 10.3 | 6,695 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 713.3 | 969.6 | 554,611 |
| 日本合成化学工業 | 27 | 34 | 22,712 |
| ダイセル | 160.5 | 203.6 | 270,788 |
| 住友ベークライト | 107 | 135 | 59,535 |
| 積水化学工業 | 264 | 328.6 | 452,153 |
| 日本ゼオン | 98 | 122 | 96,868 |
| アイカ工業 | 34.3 | 43.5 | 106,879 |
| 宇部興産 | 575 | 775 | 168,175 |
| 積水樹脂 | 17.6 | 22.3 | 34,386 |
| タキロン | 24 | 34 | 18,768 |
| 旭有機材 | 40 | 47 | 9,494 |
| 日立化成 | 56.4 | 71.5 | 140,855 |
| ニチバン | 11 | 14 | 8,988 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| リケンテクノス | 18.4 | 31.2 | 13,572 |
| 大倉工業 | 27 | 35 | 9,905 |
| 積水化成成品工業 | 32 | 37 | 13,172 |
| 群栄化学工業 | 30 | 39 | 11,622 |
| タイガースポリマー | 5.6 | 7.1 | 4,331 |
| ミライアル | 4.1 | 5.2 | 3,858 |
| ダイキアクシス | 1.7 | 2.7 | 2,370 |
| ダイキョーニシカワ | 3.7 | 18.6 | 27,602 |
| 日本化薬 | 74 | 94 | 110,356 |
| カーリットホールディングス | 9.1 | 13.4 | 6,525 |
| 日本精化 | 9.4 | 12 | 9,156 |
| 扶桑化学工業 | — | 9.1 | 15,451 |
| ADEKA | 52.6 | 71.2 | 109,078 |
| 日油 | 93 | 109 | 98,754 |
| 新日本理化 | 18 | 22.8 | 4,218 |
| ハリマ化成グループ | 9.7 | 12.3 | 6,605 |
| 花王 | 306.8 | 389.3 | 2,375,508 |
| 第一工業製薬 | 25 | 32 | 10,752 |
| ニイタカ | — | 2.1 | 2,944 |
| 三洋化成工業 | 36 | 45 | 37,665 |
| 大日本塗料 | 65 | 83 | 16,268 |
| 日本ペイントホールディングス | 98.7 | 111.7 | 304,605 |
| 関西ペイント | 138 | 163.8 | 324,651 |
| 神東塗料 | 8 | 11 | 1,837 |
| 中国塗料 | 33 | 41 | 28,618 |
| 日本特殊塗料 | 8.8 | 10.1 | 8,746 |
| 藤倉化成 | 15.5 | 19.7 | 9,712 |
| 太陽ホールディングス | 9.3 | 10.6 | 36,411 |
| D I C | 457 | 572 | 144,144 |
| サカタインクス | 23.3 | 29.6 | 36,733 |
| 東洋インキＳＣホールディングス | 113 | 143 | 62,348 |
| T&K TOKA | 3.8 | 10.5 | 9,250 |
| 富士フイルムホールディングス | 261.1 | 331.3 | 1,520,335 |
| 資生堂 | 202.9 | 274.7 | 671,778 |
| ライオン | 132 | 167 | 258,516 |
| 高砂香料工業 | 37 | 9.5 | 24,795 |
| マンダム | 11.4 | 13.5 | 68,310 |
| ミルボン | 6.7 | 8.5 | 41,012 |
| ファンケル | 26.5 | 33.6 | 51,508 |
| コーセー | 18.4 | 23.4 | 210,600 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| コタ | 3.9 | 4.9 | 5,355 |
| シーズ・ホールディングス | 7.7 | 18.2 | 39,730 |
| シーボン | 1.3 | 1.6 | 3,734 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 13.6 | 14.7 | 137,004 |
| ノエビアホールディングス | 7.2 | 9.1 | 28,255 |
| アジュバンコスメジャパン | 2.1 | 2.7 | 2,624 |
| エステー | 7.8 | 9.9 | 11,563 |
| アグロ カネショウ | 3.1 | 5.6 | 5,717 |
| コニシ | 8.9 | 22.7 | 32,143 |
| 長谷川香料 | 14.4 | 18.3 | 33,525 |
| 星光PMC | 6.2 | 7.9 | 9,456 |
| 小林製薬 | 18.7 | 21.9 | 193,158 |
| 荒川化学工業 | 9.6 | 12.3 | 11,783 |
| メック | 8.8 | 11.2 | 8,668 |
| 日本高純度化学 | 3.2 | 4.1 | 8,355 |
| タカラバイオ | — | 31 | 44,175 |
| J C U | 3.1 | 4.2 | 14,637 |
| 新田ゼラチン | 6.8 | 9.5 | 6,982 |
| OATアグリオ | — | 1.7 | 2,548 |
| デクセリアルズ | — | 43.3 | 38,147 |
| アース製薬 | 8.2 | 10.4 | 50,752 |
| イハラケミカル工業 | 17.5 | 22.3 | 31,286 |
| 北興化学工業 | 12 | 15 | 4,830 |
| 大成ラミック | 3.2 | 4.1 | 11,164 |
| クミアイ化学工業 | 23.5 | 29.9 | 28,345 |
| 日本農薬 | 26.1 | 33.1 | 18,933 |
| アキレス | 97 | 118 | 16,402 |
| 有沢製作所 | 19.2 | 21.4 | 11,812 |
| 日東電工 | 88.2 | 111.9 | 765,396 |
| レック | 3.9 | 4.5 | 6,012 |
| きもと | 20.4 | 23.5 | 3,830 |
| 藤森工業 | 9.8 | 12.4 | 31,954 |
| 前澤化成工業 | 8 | 10.1 | 10,211 |
| J S P | 8.5 | 9.4 | 20,257 |
| エフビコ | 10.1 | 12.8 | 62,080 |
| 天馬 | 8.8 | 11.1 | 18,858 |
| 信越ポリマー | 22.4 | 28.4 | 19,226 |
| 東リ | 29 | 37 | 12,506 |
| ニフコ | 25.5 | 27.7 | 147,918 |
| 日本バルカー工業 | 47 | 56 | 16,072 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ユニ・チャーム | 231 | 293.1 | 675,155 |
| 医薬品 (5.9%) | | | |
| 協和発酵キリン | 136 | 173.2 | 350,903 |
| 武田薬品工業 | 427.5 | 576.5 | 3,049,108 |
| アステラス製薬 | 1,299.4 | 1,620.9 | 2,396,500 |
| 大日本住友製薬 | 80.7 | 102.5 | 145,345 |
| 塩野義製薬 | 178.1 | 211 | 1,178,224 |
| 田辺三菱製薬 | 132.9 | 168.7 | 335,713 |
| わかもと製薬 | 13 | 16 | 4,064 |
| あすか製薬 | 13.4 | 18.4 | 26,404 |
| 日本新薬 | 26 | 33.2 | 168,324 |
| ピオフェルミン製薬 | 1.8 | 2.3 | 7,969 |
| 中外製薬 | 113.6 | 144.1 | 530,288 |
| 科研製薬 | 39 | 24.9 | 149,898 |
| エーザイ | 150.5 | 178.2 | 1,183,248 |
| ロート製薬 | 51.9 | 70.9 | 133,575 |
| 小野薬品工業 | 51.8 | 328.7 | 1,712,527 |
| 久光製薬 | 32.2 | 44.9 | 245,603 |
| 有機合成薬品工業 | 7 | 9 | 2,268 |
| 持田製薬 | 7.9 | 9.9 | 80,685 |
| 参天製薬 | 209.7 | 266.6 | 431,892 |
| 扶桑薬品工業 | 38 | 49 | 12,985 |
| 日本ケミファ | 14 | 20 | 9,440 |
| ツムラ | 35.9 | 45.6 | 131,601 |
| 日医工 | 26.7 | 33.8 | 89,603 |
| キッセイ薬品工業 | 21.2 | 25.6 | 65,971 |
| 生化学工業 | 21.8 | 27.7 | 48,281 |
| 栄研化学 | 9.6 | 12.1 | 23,800 |
| 日水製薬 | 4.6 | 5.8 | 6,699 |
| 鳥居薬品 | 7.8 | 9.9 | 25,967 |
| JCRファーマ | 8.8 | 11.1 | 30,536 |
| 東和薬品 | 5.8 | 6.6 | 32,901 |
| 富士製薬工業 | 3.2 | 4.7 | 9,207 |
| 沢井製薬 | 18.1 | 24.6 | 178,104 |
| ゼリア新薬工業 | 23.4 | 29.6 | 41,262 |
| 第一三共 | 383.7 | 486.8 | 1,333,345 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 30.4 | 38.6 | 83,800 |
| 大幸薬品 | 5.1 | 7.1 | 10,543 |
| ダイト | 5.1 | 8.1 | 23,571 |
| 大塚ホールディングス | 226.4 | 311.2 | 1,345,940 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 大正製薬ホールディングス | 27.4 | 34.8 | 320,856 |
| バブチドリーム | — | 24.1 | 160,747 |
| 石油・石炭製品 (0.5%) | | | |
| 日本コークス工業 | 102.3 | 116.8 | 8,760 |
| 昭和シェル石油 | 102 | 145.6 | 161,616 |
| コスモ石油 | 315 | — | — |
| ニチレキ | 14 | 17.7 | 13,151 |
| 東燃ゼネラル石油 | 172 | 218 | 217,128 |
| ユシロ化学工業 | 6.1 | 7.8 | 9,695 |
| ビービー・カストロール | 4.7 | 5.9 | 7,605 |
| 富士石油 | 26.4 | 33.6 | 11,491 |
| MORESCO | 2.9 | 4.6 | 5,179 |
| 出光興産 | 54.1 | 75.5 | 170,856 |
| JXホールディングス | 1,266.1 | 1,713.5 | 767,133 |
| コスモエネルギーホールディングス | — | 43.7 | 59,082 |
| ゴム製品 (1.0%) | | | |
| 横浜ゴム | 126 | 87.3 | 165,870 |
| 東洋ゴム工業 | 51.6 | 65.5 | 106,830 |
| ブリヂストン | 357.5 | 488.5 | 2,021,413 |
| 住友ゴム工業 | 89 | 135.5 | 232,653 |
| 藤倉ゴム工業 | 9.5 | 12.1 | 5,360 |
| オカモト | 39 | 45 | 40,995 |
| フコク | 4.8 | 5.3 | 4,626 |
| ニッタ | 11.3 | 15.6 | 42,666 |
| 住友理工 | 21.1 | 31.3 | 29,234 |
| 三ツ星ベルト | 28 | 35 | 30,135 |
| バンドー化学 | 42 | 53 | 27,613 |
| ガラス・土石製品 (0.9%) | | | |
| 日東紡績 | 84 | 96 | 32,352 |
| 旭硝子 | 562 | 764 | 514,936 |
| 日本板硝子 | 550 | 698 | 60,726 |
| 石塚硝子 | 15 | 20 | 3,600 |
| 日本山村硝子 | 45 | 57 | 9,291 |
| 日本電気硝子 | 219 | 299 | 154,284 |
| オハラ | 4.3 | 5.5 | 2,805 |
| 住友大阪セメント | 212 | 287 | 133,168 |
| 太平洋セメント | 712 | 903 | 258,258 |
| デイ・シイ | 11.7 | 13.4 | 4,743 |
| 日本ヒューム | 11.9 | 13.9 | 8,214 |
| 日本コンクリート工業 | 19.5 | 29.8 | 8,791 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三谷セキサン | 5.7 | 7.2 | 12,160 |
| アジアバイルホールディングス | 15.2 | 17.8 | 7,458 |
| 東海カーボン | 99 | 125 | 36,000 |
| 日本カーボン | 60 | 71 | 15,975 |
| 東洋炭素 | 6.3 | 8 | 11,072 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 64 | 82 | 20,172 |
| TOTO | 168 | 106.3 | 408,192 |
| 日本碍子 | 144 | 183 | 438,285 |
| 日本特殊陶業 | 98.3 | 124.7 | 243,414 |
| ダントーホールディングス | 15 | 17 | 3,094 |
| MARUWA | 3.3 | 5.3 | 16,562 |
| 品川リフラクトリーズ | 29 | 36 | 6,804 |
| 黒崎播磨 | 25 | 31 | 7,812 |
| ヨータイ | 6 | 8 | 2,288 |
| イソライト工業 | 5.6 | 7.1 | 1,576 |
| 東京窯業 | 14 | 17.6 | 2,956 |
| ニッカトー | 4 | 5.1 | 1,902 |
| フジミインコーポレーテッド | 11 | 12.7 | 18,923 |
| ユーアンドユーマテリアル | 24 | 30 | 2,430 |
| ニチアス | 51 | 74 | 58,756 |
| ニチハ | 15.1 | 19.2 | 31,795 |
| 鉄鋼 (1.2%) | | | |
| 新日鐵住金 | 4,821 | 652.5 | 1,431,258 |
| 神戸製鋼所 | 1,972 | 2,658 | 271,116 |
| 中山製鋼所 | 85 | 162 | 10,206 |
| 合同製鐵 | 58 | 81 | 15,309 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 290.9 | 395.5 | 579,012 |
| 日新製鋼 | 48.3 | 66 | 97,284 |
| 東京製鐵 | 57.7 | 79.9 | 50,496 |
| 共英製鋼 | 12.1 | 15.4 | 24,609 |
| 大和工業 | 26 | 31.9 | 79,431 |
| 東京鐵鋼 | 22 | 30 | 10,200 |
| 大阪製鐵 | 7.2 | 9.1 | 16,589 |
| 淀川製鋼所 | 79 | 21.5 | 52,954 |
| 東洋鋼板 | 27.3 | 34.6 | 12,213 |
| 丸一鋼管 | 35 | 48.4 | 158,026 |
| モリ工業 | 18 | 23 | 6,877 |
| 大同特殊鋼 | 191 | 242 | 87,846 |
| 日本高周波鋼業 | 45 | 57 | 4,446 |
| 日本冶金工業 | 89.1 | 106.4 | 16,704 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 山陽特殊製鋼 | 68 | 86 | 39,388 |
| 愛知製鋼 | 67 | 85 | 36,465 |
| 日立金属 | 116 | 165.7 | 193,703 |
| 日本金属 | 29 | 37 | 3,626 |
| 大太平洋金属 | 73 | 101 | 33,532 |
| 新日本電工 | 69.5 | 81.9 | 13,841 |
| 栗本鐵工所 | 59 | 69 | 11,661 |
| 虹技 | 16 | 20 | 3,260 |
| 日本鑄鉄管 | 11 | 16 | 2,464 |
| 三菱製鋼 | 74 | 101 | 17,978 |
| 日亜鋼業 | 15.8 | 20 | 4,540 |
| 日本精線 | 9 | 10 | 4,530 |
| シンニッタン | 11.8 | 13 | 8,047 |
| 新家工業 | 22 | 29 | 3,683 |
| 非鉄金属 (0.8%) | | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 19 | 22 | 6,006 |
| 日本軽金属ホールディングス | 276.6 | 327.5 | 62,552 |
| 三井金属鉱業 | 310 | 369 | 70,479 |
| 東邦亜鉛 | 64 | 76 | 21,660 |
| 三菱マテリアル | 712 | 903 | 301,602 |
| 住友金属鉱山 | 315 | 399 | 453,663 |
| DOWAホールディングス | 136 | 186 | 125,922 |
| 古河機械金属 | 178 | 226 | 36,386 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 11.2 | 14.2 | 19,397 |
| 東邦チタニウム | 19.3 | 24.5 | 18,007 |
| UACJ | 130 | 202 | 43,430 |
| 古河電気工業 | 335 | 455 | 119,210 |
| 住友電気工業 | 429.7 | 579.2 | 756,145 |
| フジクラ | 159 | 201 | 105,324 |
| 昭和電線ホールディングス | 125 | 172 | 11,180 |
| 東京特殊電線 | 1.6 | 2 | 1,732 |
| タツタ電線 | 21.4 | 30.1 | 10,203 |
| 神電線 | 12 | 17 | 3,281 |
| カナレ電気 | 1.8 | 2.3 | 4,471 |
| 平河ヒューテック | 2.7 | 6.8 | 5,950 |
| リョービ | 64 | 88 | 36,080 |
| アールスティ | 13.2 | 16.8 | 13,876 |
| アサヒホールディングス | 17.2 | 21.8 | 32,198 |
| 金属製品 (0.7%) | | | |
| 稲葉製作所 | 6.1 | 7.7 | 10,248 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 33 | 45 | 7,065 |
| トーカロ | 7.5 | 10.2 | 18,727 |
| アルファC o | 3.8 | 4.8 | 4,824 |
| SUMCO | 88.8 | 113.3 | 81,122 |
| 川田テクノロジーズ | 2.2 | 2.7 | 9,531 |
| 東洋製織グループホールディングス | 81 | 102.8 | 221,945 |
| ホッカンホールディングス | 27 | 38 | 12,084 |
| コロナ | 6 | 7.6 | 8,360 |
| 横河ブリッジホールディングス | 21.6 | 27.4 | 27,564 |
| 駒井ハルテック | 20 | 26 | 6,422 |
| 高田機工 | 10 | 12 | 2,352 |
| 三和ホールディングス | 107.3 | 143.6 | 125,650 |
| 文化シャッター | 31.7 | 40.3 | 37,358 |
| 三協立山 | 14.9 | 19 | 28,918 |
| アルインコ | 4.8 | 10.8 | 10,681 |
| 東洋シャッター | 2.8 | 3.6 | 1,951 |
| L I X I Lグループ | 169.4 | 201.5 | 434,434 |
| 日本フィルコン | 8.2 | 10.5 | 4,557 |
| ノーリツ | 22.3 | 28.3 | 52,553 |
| 長府製作所 | 12.2 | 15.4 | 39,809 |
| リンナイ | 21.2 | 26.9 | 267,117 |
| ダイニチ工業 | 5.8 | 7.4 | 4,536 |
| 日東精工 | 16 | 21 | 5,901 |
| 三洋工業 | 14 | 18 | 3,006 |
| 岡部 | 22.4 | 30 | 22,260 |
| ジーテクト | 10.4 | 15.1 | 20,143 |
| 中国工業 | 1.7 | 2.2 | 1,689 |
| 東プレ | 21.9 | 27.8 | 61,076 |
| 高周波熱錬 | 19.7 | 26.9 | 19,583 |
| 東京製綱 | 77 | 98 | 14,406 |
| サンコール | 7 | 7.7 | 3,672 |
| モリテック スチール | 5.7 | 7.3 | 1,810 |
| パイオラックス | 5.8 | 7.3 | 42,340 |
| 日本発條 | 99.1 | 136.2 | 133,067 |
| 中央発條 | 15 | 18 | 5,400 |
| アドバネクス | 21 | 2.7 | 3,337 |
| 立川ブラインド工業 | — | 6 | 4,218 |
| 三益半導体工業 | 8.4 | 10.7 | 11,042 |
| 機械 (4.7%) | | | |
| 日本ドライケミカル | 1.6 | 1.8 | 4,087 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日本製鋼所 | 163 | 239 | 99,663 |
| 三浦工業 | 50.9 | 64.5 | 129,645 |
| タクマ | 36 | 53 | 48,813 |
| ツガミ | 33 | 42 | 17,850 |
| オークマ | 74 | 94 | 76,140 |
| 東芝機械 | 62 | 79 | 27,334 |
| アマダホールディングス | 169.9 | 210.9 | 228,193 |
| アイダエンジニアリング | 24.9 | 37.9 | 38,013 |
| 滝澤鉄工所 | 36 | 45 | 5,580 |
| 富士機械製造 | 37.2 | 47.2 | 52,864 |
| 牧野フライス製作所 | 57 | 72 | 47,952 |
| オーエスジー | 51.9 | 65.9 | 127,846 |
| ダイジェット工業 | 13 | 17 | 2,346 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 31.2 | 38.9 | 40,806 |
| DMG森精機 | 71.9 | 79.9 | 96,758 |
| ソディック | 21.7 | 36.7 | 31,488 |
| ディスコ | 13.3 | 18.4 | 176,456 |
| 日東工器 | 6.6 | 8.4 | 18,085 |
| パンチ工業 | 4 | 5.7 | 4,138 |
| 豊和工業 | 6.4 | 8.1 | 4,284 |
| OKK | 44 | 56 | 6,160 |
| 東洋機械金属 | 7.7 | 10.7 | 4,237 |
| 津田駒工業 | 28 | 35 | 4,305 |
| エンシュウ | 28 | 35 | 2,520 |
| 島精機製作所 | 16.1 | 20.4 | 45,838 |
| NCホールディングス | — | 4.7 | 5,785 |
| フリュー | — | 2.8 | 7,596 |
| ヤマシンフィルタ | — | 2.8 | 1,265 |
| 日阪製作所 | 14.4 | 18.3 | 14,365 |
| やまびこ | 4.5 | 26.5 | 20,458 |
| ペガサスミシン製造 | 10 | 14.9 | 7,941 |
| ナプテスコ | 69.4 | 75.2 | 192,662 |
| 三井海洋開発 | 11.4 | 16.9 | 31,146 |
| レオン自動機 | 8.6 | 12.2 | 7,246 |
| SMC | 34.2 | 43.4 | 1,173,753 |
| 新川 | 9.5 | 12.9 | 5,650 |
| ホソカワミクロン | 19 | 24 | 13,488 |
| ユニオンツール | 5.6 | 6.2 | 17,825 |
| オイレス工業 | 13.5 | 18.7 | 32,799 |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 4.2 | 4.6 | 9,834 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| サトーホールディングス | 14.2 | 19.5 | 44,206 |
| 日本エアータック | 3.4 | 5.1 | 3,182 |
| 日精樹脂工業 | 8.3 | 10.5 | 6,426 |
| オカダアイヨン | — | 2.8 | 2,321 |
| ワイエイシイ | 4.6 | 5.8 | 6,478 |
| 小松製作所 | 558.9 | 709.1 | 1,280,634 |
| 住友重機械工業 | 312 | 422 | 198,762 |
| 日立建機 | 50.9 | 64.6 | 111,887 |
| 日工 | 16 | 22 | 7,128 |
| 巴工業 | 4.3 | 5.9 | 8,743 |
| 井関農機 | 117 | 148 | 35,372 |
| TOWA | 9.3 | 14 | 10,248 |
| 丸山製作所 | 24 | 30 | 4,920 |
| 北川鉄工所 | 52 | 66 | 12,870 |
| タカキタ | — | 4.8 | 2,654 |
| クボタ | 548 | 694.5 | 1,143,841 |
| 荏原実業 | 3.4 | 4.3 | 5,486 |
| 三菱化工機 | 37 | 48 | 10,608 |
| 月島機械 | 20.1 | 27.4 | 25,893 |
| 帝国電機製作所 | 7.6 | 10.5 | 8,043 |
| 東京機械製作所 | 43 | 54 | 2,268 |
| 新東工業 | 26.8 | 32.8 | 30,110 |
| 澁谷工業 | 9.5 | 12.1 | 16,201 |
| アイチ コーポレーション | 16.1 | 20.5 | 16,666 |
| 小森コーポレーション | 27.7 | 35.2 | 44,387 |
| 鶴見製作所 | 8.5 | 10.7 | 15,825 |
| 住友精密工業 | 18 | 23 | 7,544 |
| 酒井重工業 | 22 | 27 | 4,995 |
| 荏原製作所 | 236 | 320 | 156,800 |
| 石井鐵工所 | 17 | 21 | 3,150 |
| 西島製作所 | 11.1 | 15.4 | 16,170 |
| 北越工業 | 11.2 | 15.5 | 10,276 |
| ダイキン工業 | 158.6 | 201.3 | 1,775,868 |
| オルガノ | 22 | 25 | 10,375 |
| トーヨーカネツ | 66 | 77 | 17,171 |
| 栗田工業 | 64.5 | 86.9 | 225,418 |
| 椿本チエイン | 58 | 82 | 59,450 |
| 大同工業 | 22 | 28 | 5,348 |
| 日本コンベヤ | 35 | — | — |
| 木村化工機 | 10.5 | 12.4 | 4,600 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アネスト岩田 | 17 | 23.3 | 24,767 |
| ダイフク | 53.8 | 74.3 | 146,742 |
| サムコ | 1.6 | 3.5 | 3,262 |
| 加藤製作所 | 24 | 33 | 13,596 |
| 油研工業 | 21 | 27 | 4,860 |
| タダノ | 53 | 66.7 | 67,700 |
| フジテック | 31.7 | 40.2 | 44,300 |
| C K D | 30.5 | 38.4 | 33,369 |
| キトー | 11.9 | 17.4 | 13,572 |
| 平和 | 23.6 | 42.8 | 97,840 |
| 理想科学工業 | 13.2 | 15.3 | 23,256 |
| SANKYO | 30.3 | 38.5 | 157,657 |
| 日本金銭機械 | 10 | 12.7 | 11,010 |
| マースエンジニアリング | 6.1 | 7.8 | 15,319 |
| 福島工業 | 6 | 8.5 | 21,666 |
| オーイズミ | 3.8 | 5.8 | 2,697 |
| ダイコク電機 | 4.5 | 5.7 | 7,791 |
| 竹内製作所 | 4.6 | 27.3 | 46,082 |
| アマノ | 36.3 | 42.8 | 78,538 |
| J U K I | 81 | 20.5 | 21,422 |
| サンデンホールディングス | 66 | 84 | 26,964 |
| 蛇の目ミシン工業 | 106 | 13.4 | 7,946 |
| マックス | 17 | 21 | 26,670 |
| グローリー | 34.8 | 47.1 | 172,150 |
| 新晃工業 | 7.6 | 9.6 | 14,323 |
| 大和冷機工業 | 15.7 | 22.2 | 20,845 |
| セガサミーホールディングス | 117.1 | 148.5 | 178,051 |
| 日本ピストンリング | 42 | 5.7 | 8,327 |
| リケン | 47 | 64 | 23,232 |
| T P R | 12.2 | 17 | 47,583 |
| ツバキ・ナカシマ | — | 17.1 | 25,051 |
| ホシザキ電機 | 23.9 | 30.3 | 303,000 |
| 大豊工業 | 8.8 | 11.1 | 13,153 |
| 日本精工 | 223.7 | 283.9 | 272,260 |
| NTN | 252 | 343 | 116,963 |
| ジェイテクト | 116.1 | 147.3 | 208,282 |
| 不二越 | 101 | 128 | 44,672 |
| 日本トムソン | 37 | 47.3 | 18,872 |
| T H K | 72.4 | 91.9 | 195,838 |
| ユーション精機 | 4.8 | 5.4 | 9,925 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 前澤給装工業 | 4.1 | 5.6 | 7,991 |
| イーグル工業 | 15.1 | 17.1 | 24,555 |
| 前澤工業 | 8 | 10.1 | 2,979 |
| 日本ビラー工業 | 11.9 | 14 | 13,160 |
| キッツ | 48.9 | 61.6 | 30,676 |
| 日立工機 | 29.1 | 37 | 27,232 |
| マキタ | 71 | 90.1 | 624,393 |
| 日立造船 | 85.2 | 109.6 | 61,266 |
| 三菱重工業 | 1,826 | 2,461 | 992,275 |
| I H I | 785 | 1,062 | 251,694 |
| 電気機器 (11.3%) | | | |
| 日清紡ホールディングス | — | 76.7 | 90,966 |
| イビデン | 71.4 | 84.6 | 111,756 |
| コニカミノルタ | 259.6 | 345.1 | 326,464 |
| ブラザー工業 | 140.8 | 178.7 | 223,911 |
| ミネベア | 162 | 222.7 | 194,639 |
| 日立製作所 | 2,616 | 3,526 | 1,693,185 |
| 東芝 | 2,293 | 2,910 | 641,946 |
| 三菱電機 | 1,089 | 1,474 | 1,825,549 |
| 富士電機 | 303 | 416 | 195,936 |
| 東洋電機製造 | 21 | 27 | 8,532 |
| 安川電機 | 132.9 | 171.7 | 216,170 |
| シンフォニアテクノロジー | 76 | 89 | 13,261 |
| 明電舎 | 100 | 127 | 57,023 |
| オリジン電気 | 16 | 20 | 5,480 |
| 山洋電気 | 24 | 36 | 19,980 |
| デンヨー | 9.3 | 12.8 | 15,283 |
| 東芝テック | 78 | 99 | 39,699 |
| 芝浦メカトロニクス | 18 | 22 | 4,774 |
| マブチモーター | 33.3 | 39.6 | 222,156 |
| 日本電産 | 119.4 | 166.3 | 1,360,334 |
| ユー・エム・シー・エレクトロニクス | — | 1.6 | 3,040 |
| 東光高岳 | 5.5 | 7.7 | 13,552 |
| ダブル・スコープ | — | 5.5 | 32,725 |
| ダイヘン | 60 | 81 | 44,307 |
| 田淵電機 | 12.3 | 15.6 | 7,332 |
| ヤーマン | 1.4 | 1.8 | 3,756 |
| JVCケンウッド | 79.9 | 101.4 | 27,479 |
| ミマキエンジニアリング | 6.5 | 12.4 | 6,634 |
| 第一精工 | 4 | 5.7 | 6,663 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日新電機 | 25.5 | 32.4 | 38,167 |
| 大崎電気工業 | 20 | 25 | 19,000 |
| オムロン | 117.6 | 156.1 | 518,252 |
| 日東工業 | 17.5 | 22.1 | 36,907 |
| I D E C | 12.9 | 18 | 18,288 |
| 不二電機工業 | 1 | 1.3 | 1,856 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 210 | 266 | 119,434 |
| サクサホールディングス | 27 | 35 | 7,350 |
| メルコホールディングス | 6 | 7.6 | 16,400 |
| テクノメディカ | 2.4 | 3.1 | 6,429 |
| 日本電気 | 1,410 | 1,900 | 488,300 |
| 富士通 | 1,050 | 1,333 | 517,737 |
| 神電気工業 | 383 | 599 | 92,845 |
| 岩崎通信機 | 48 | 65 | 4,680 |
| 電気興業 | 31 | 36 | 17,316 |
| サンケン電気 | 55 | 75 | 23,550 |
| ナカヨ | 11 | 13 | 4,095 |
| アイホン | 6.3 | 7.8 | 12,979 |
| ルネサスエレクトロニクス | 56.4 | 71.5 | 46,189 |
| セイコーエプソン | 148.7 | 205.8 | 377,437 |
| ワコム | 85.8 | 108.8 | 48,633 |
| アルバック | 18.4 | 25.4 | 85,217 |
| アクセル | 5 | 6.2 | 5,245 |
| E I Z O | 10 | 13.7 | 41,100 |
| ジャパンディスプレイ | 223.7 | 258.1 | 54,717 |
| 日本信号 | 30 | 38.1 | 34,937 |
| 京三製作所 | 26 | 32 | 11,328 |
| 能美防災 | 14.4 | 15.7 | 22,199 |
| ホーチキ | 7.9 | 10 | 12,660 |
| エレコム | 4.5 | 12 | 24,468 |
| 日本無線 | 23 | 40 | 10,600 |
| パナソニック | 1,327.5 | 1,579.1 | 1,503,934 |
| シャープ | 921 | 1,168 | 155,344 |
| アンリツ | 65.4 | 83 | 49,966 |
| 富士通ゼネラル | 33 | 42 | 83,370 |
| 日立国際電気 | 28 | 31.6 | 37,730 |
| ソニー | 712.2 | 975.2 | 2,614,998 |
| T D K | 65.7 | 83.4 | 495,396 |
| 帝国通信工業 | 26 | 33 | 5,577 |
| ミツミ電機 | 38.5 | 52.6 | 27,246 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| タムラ製作所 | 42 | 53 | 16,112 |
| アルプス電気 | 86 | 119.1 | 217,357 |
| 池上通信機 | 37 | 44 | 5,280 |
| パイオニア | 163.7 | 223.6 | 65,514 |
| 日本電波工業 | 9.8 | 12.5 | 9,037 |
| 鈴木 | 1.4 | 5.3 | 3,042 |
| 日本トリム | 2.6 | 3.7 | 27,713 |
| ローランド ディー. ジー. | 4.4 | 6.8 | 14,171 |
| フォスター電機 | 12.8 | 17.3 | 33,492 |
| クラリオン | 57 | 73 | 22,046 |
| SMK | 32 | 41 | 18,532 |
| ヨコオ | 8.5 | 9.8 | 4,900 |
| 東光 | 26 | — | — |
| ティアック | 59 | 99 | 3,960 |
| ホシデン | 33 | 41.9 | 28,324 |
| ヒロセ電機 | 18.5 | 22.3 | 284,325 |
| 日本航空電子工業 | 31 | 40 | 53,240 |
| TOA | 11.7 | 16.3 | 15,925 |
| 日立マクセル | 21.6 | 22.9 | 36,823 |
| 古野電気 | 12.9 | 16.4 | 9,659 |
| ユニデンホールディングス | 30 | 43 | 5,375 |
| アルパイン | 26 | 32.9 | 40,105 |
| スミダコーポレーション | 9.7 | 11.3 | 7,616 |
| アイコム | 6 | 7.6 | 15,792 |
| リオン | 4.1 | 5.3 | 8,983 |
| 本多通信工業 | — | 3.6 | 3,351 |
| 船井電機 | 11 | 14 | 12,684 |
| 横河電機 | 109 | 138.3 | 159,598 |
| 新電元工業 | 42 | 49 | 19,453 |
| アズビル | 35.6 | 45.1 | 124,881 |
| 東亜ディーケーケー | 4.5 | 7.7 | 3,780 |
| 日本光電工業 | 46.4 | 57.8 | 166,521 |
| チノー | 3.9 | 4.9 | 4,968 |
| 共和電業 | 13.3 | 16.9 | 6,253 |
| 日本電子材料 | 4.7 | 5.5 | 2,387 |
| 堀場製作所 | 20.1 | 25.6 | 103,424 |
| アドバンテラスト | 74.2 | 94.2 | 100,699 |
| 小野測器 | 5.3 | 6.7 | 5,460 |
| エスベック | 12.1 | 14.3 | 21,450 |
| パナソニック デバイスSUNX | 9.5 | 12.1 | 6,909 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| キーエンス | 24.7 | 31.3 | 2,070,495 |
| 日置電機 | 5.7 | 7.2 | 16,999 |
| シスメックス | 84.4 | 107.3 | 773,633 |
| 日本マイクロニクス | — | 25.8 | 24,871 |
| メガチップス | 11.4 | 13.8 | 16,297 |
| OBARA GROUP | 7.1 | 8.1 | 30,010 |
| 澤藤電機 | 7 | 7 | 1,211 |
| コーセル | 15.8 | 19.2 | 20,678 |
| 新日本無線 | 8 | 10.1 | 4,353 |
| オブテックス | 7.5 | 10.2 | 31,416 |
| 千代田インテグレ | 5.7 | 7.3 | 16,315 |
| アイ・オー・データ機器 | — | 4.3 | 2,704 |
| レーザーテック | 11.2 | 16.2 | 20,493 |
| スタンレー電気 | 78.2 | 98.8 | 225,362 |
| 岩崎電気 | 37 | 47 | 8,930 |
| ウシオ電機 | 66.1 | 83.9 | 123,333 |
| 岡谷電機産業 | 5.8 | 7.4 | 2,775 |
| ヘリオス テクノ ホールディング | 10 | 11.7 | 4,200 |
| 日本セラミック | 6.2 | 7.9 | 15,278 |
| 遠藤照明 | 5 | 7 | 7,504 |
| 日本デジタル研究所 | 9.2 | 11.7 | 17,620 |
| 古河電池 | 8 | 10 | 6,750 |
| 双信電機 | 5.3 | 6.7 | 1,949 |
| 山一電機 | 12.6 | 12 | 6,480 |
| 図研 | 7.9 | 10 | 10,640 |
| 日本電子 | 46 | 55 | 25,905 |
| カシオ計算機 | 109.2 | 138.5 | 270,629 |
| ファナック | 113.4 | 141.4 | 2,290,680 |
| 日本シイエムケイ | 27.7 | 29.8 | 12,545 |
| エンプラス | 4.9 | 7 | 21,420 |
| 大真空 | 20 | 25 | 6,000 |
| ローム | 53.7 | 68.1 | 286,360 |
| 浜松ホトニクス | 85 | 107.8 | 301,301 |
| 三井ハイテック | 14.4 | 20 | 13,740 |
| 新光電気工業 | 41.1 | 52.2 | 30,693 |
| 京セラ | 178.8 | 226.9 | 1,197,351 |
| 太陽誘電 | 57.1 | 67.2 | 70,022 |
| 村田製作所 | 114.3 | 145.756 | 1,877,337 |
| ユーション | 15.2 | 18.3 | 12,736 |
| 双葉電子工業 | 18.6 | 22.6 | 37,267 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 北陸電気工業 | 47 | 56 | 7,392 |
| ニチコン | 34.3 | 43.5 | 31,668 |
| 日本ケミコン | 88 | 112 | 16,128 |
| KOA | 15.1 | 19.1 | 14,687 |
| 市光工業 | 26 | 33 | 8,151 |
| 小糸製作所 | 65.3 | 82.8 | 404,064 |
| ミツバ | 20 | 23.5 | 37,224 |
| スター精密 | 20.7 | 26.2 | 31,806 |
| SCREENホールディングス | 103 | 142 | 118,996 |
| キャノン電子 | 10 | 12.7 | 20,167 |
| キャノン | 631.6 | 744.1 | 2,288,107 |
| リコー | 327.5 | 447.5 | 433,627 |
| MUTOHホールディングス | 15 | 16 | 3,712 |
| 東京エレクトロン | 91.6 | 113.4 | 810,810 |
| 輸送用機器 (9.4%) | | | |
| トヨタ紡織 | 38.1 | 48.3 | 108,240 |
| 鬼怒川ゴム工業 | 25 | 32 | 24,672 |
| ユニプレス | 20.9 | 28.7 | 56,826 |
| 豊田自動織機 | 99.2 | 125.8 | 589,373 |
| モリタホールディングス | 19 | 24.2 | 33,976 |
| 三櫻工業 | 13.8 | 17.5 | 10,045 |
| デンソー | 269.1 | 341.5 | 1,407,663 |
| 東海理化電機製作所 | 28.7 | 40.4 | 77,810 |
| 三井造船 | 422 | 535 | 89,880 |
| 川崎重工業 | 791 | 1,076 | 337,864 |
| 名村造船所 | 30.3 | 41.5 | 32,868 |
| サノヤスホールディングス | 13.2 | 16.8 | 3,645 |
| 日本車輛製造 | 40 | 57 | 14,820 |
| ニチユ三菱フォークリフト | 12.5 | 15.9 | 8,299 |
| 近畿車輛 | 16 | 21 | 6,447 |
| 日産自動車 | 1,529 | 1,928.9 | 1,936,615 |
| いすゞ自動車 | 344.4 | 400.5 | 465,381 |
| トヨタ自動車 | 1,502.9 | 1,719 | 9,758,763 |
| 日野自動車 | 155.5 | 197.3 | 207,165 |
| 三菱自動車工業 | 399.2 | 548.8 | 265,619 |
| エフテック | 6.2 | 7.3 | 7,489 |
| レシップホールディングス | 3.6 | 4.5 | 3,217 |
| GMB | 1.6 | 2.2 | 1,647 |
| ファルテック | 1.6 | 2.4 | 3,007 |
| 武蔵精密工業 | 11.6 | 14.7 | 30,752 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 日産車体 | 47.9 | 67.5 | 73,440 |
| 新明和工業 | 44 | 60 | 44,220 |
| 極東開発工業 | 20.2 | 27.5 | 28,297 |
| 日信工業 | 19.9 | 30.9 | 46,720 |
| トビー工業 | 90 | 114 | 22,230 |
| ティラド | 42 | 54 | 9,504 |
| 曙ブレーキ工業 | 46 | 70 | 18,760 |
| タチエス | 17.3 | 21.9 | 32,740 |
| NOK | 52.7 | 66.9 | 122,828 |
| フタバ産業 | 33.2 | 42.1 | 22,734 |
| KYB | 122 | 155 | 57,350 |
| シロキ工業 | 24 | — | — |
| 大同メタル工業 | 15.2 | 19.3 | 15,748 |
| プレス工業 | 54 | 73.4 | 28,479 |
| ミクニ | 10.4 | 17.5 | 6,177 |
| カルソニックカンセイ | 83 | 106 | 82,998 |
| 太平洋工業 | 22.2 | 30.7 | 33,708 |
| ケーヒン | 25 | 31.8 | 50,975 |
| 河西工業 | 13.4 | 17 | 19,516 |
| アイシン精機 | 99.7 | 141.7 | 610,018 |
| 富士機工 | 12.6 | 16 | 6,464 |
| マツダ | 324.6 | 437.6 | 766,018 |
| ダイハツ工業 | 130 | 165 | 244,695 |
| 今仙電機製作所 | 9.3 | 12.6 | 12,448 |
| 本田技研工業 | 980.3 | 1,243.8 | 3,787,371 |
| スズキ | 227.7 | 252.9 | 740,617 |
| 富士重工業 | 370.7 | 436.8 | 1,634,942 |
| 安永 | 3.6 | 4.6 | 2,203 |
| ヤマハ発動機 | 165.7 | 195.2 | 356,044 |
| ショーワ | 25.7 | 35.9 | 28,289 |
| TBK | 13.9 | 16.4 | 6,215 |
| エクセディ | 14.8 | 18.8 | 48,616 |
| 豊田合成 | 35.2 | 50.2 | 102,508 |
| 愛三工業 | 16.9 | 24.2 | 21,247 |
| 盟和産業 | 9 | 2.3 | 2,362 |
| ヨロズ | 10.2 | 12.9 | 28,870 |
| エフ・シー・シー | 16 | 22.6 | 42,872 |
| シマノ | 47 | 55.7 | 927,405 |
| タカタ | 19.7 | 25 | 7,875 |
| テイ・エス テック | 23 | 32.1 | 92,319 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ジャムコ | 4.1 | 8.1 | 21,829 |
| 精密機器 (1.6%) | | | |
| テルモ | 167 | 211.9 | 900,575 |
| クリエートメディック | 3.6 | 4.6 | 3,942 |
| 日機装 | 35.3 | 49.8 | 42,529 |
| 島津製作所 | 130 | 178 | 299,040 |
| JMS | 20 | 25 | 7,350 |
| クボテック | 2.3 | 3 | 1,479 |
| モリテックス | 2.4 | — | — |
| 長野計器 | 7 | 8.3 | 5,170 |
| ブイ・テクノロジー | 2.1 | 3.3 | 15,460 |
| 東京計器 | 38 | 44 | 6,908 |
| 愛知時計電機 | 14 | 18 | 5,598 |
| オーバル | 10.6 | 13.5 | 3,159 |
| 東京精密 | 19.6 | 26.7 | 62,745 |
| マニー | 3.3 | 18.4 | 31,776 |
| ニコン | 203.4 | 258.1 | 403,410 |
| トプコン | 32.9 | 46.4 | 49,091 |
| オリンパス | 162.3 | 205.9 | 859,632 |
| 理研計器 | 9.6 | 11.2 | 11,737 |
| タムロン | 8.4 | 11.1 | 17,449 |
| HOYA | 259.2 | 312.5 | 1,262,812 |
| ノーリツ鋼機 | 9.8 | 12.4 | 7,675 |
| エー・アンド・デイ | 9.9 | 12.5 | 4,800 |
| シチズンホールディングス | 134.1 | 170.1 | 107,503 |
| リズム時計工業 | 48 | 60 | 8,940 |
| 大研医器 | 7.5 | 10.9 | 9,570 |
| メニコン | — | 9.3 | 35,340 |
| 松風 | 5.3 | 6.7 | 9,132 |
| セイコーホールディングス | 77 | 89 | 36,223 |
| ニプロ | 69.6 | 103 | 112,270 |
| その他製品 (1.6%) | | | |
| スノーピーク | — | 1.5 | 5,467 |
| パラマウントベッドホールディングス | 11.5 | 14.6 | 59,568 |
| トランザクシオン | 0.8 | 2.8 | 2,032 |
| SHO-B I | 3.6 | 4.6 | 1,830 |
| ニホンフラッシュ | — | 5.4 | 6,264 |
| 前田工織 | 12 | 13.8 | 14,986 |
| 永大産業 | 15 | 20 | 8,480 |
| アートネイチャー | 7.8 | 14.8 | 13,660 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ダンロップスポーツ | 6.9 | 8.7 | 8,830 |
| バンダイナムコホールディングス | 120.1 | 142.9 | 327,526 |
| アイフィスジャパン | — | 3.1 | 1,491 |
| 共立印刷 | 19.7 | 23 | 6,371 |
| SHOE I | — | 6.2 | 9,982 |
| フランスベッドホールディングス | 76 | 19.3 | 19,049 |
| パイロットコーポレーション | 9.5 | 24.1 | 118,572 |
| 萩原工業 | 2.3 | 3.8 | 9,906 |
| トッパン・フォームズ | 19.4 | 24.7 | 28,553 |
| フジシールインターナショナル | 13.2 | 16.8 | 62,076 |
| タカラトミー | 39.1 | 45.5 | 34,807 |
| 廣済堂 | 10.1 | 12.8 | 4,390 |
| A s - m e エステール | 2.9 | 3.7 | 2,305 |
| アーク | 34.4 | 58.1 | 4,938 |
| タカノ | 4.8 | 6.1 | 3,928 |
| プロネクス | 11.1 | 12.9 | 12,345 |
| ホクシン | 8.6 | 11 | 1,463 |
| ウッドワン | 18 | 25 | 6,300 |
| 大建工業 | 44 | 54 | 16,740 |
| 凸版印刷 | 308 | 390 | 367,770 |
| 大日本印刷 | 332 | 409 | 420,043 |
| 図書印刷 | 18 | 26 | 14,066 |
| 共同印刷 | 34 | 46 | 14,628 |
| 日本写真印刷 | 18.3 | 23.2 | 38,999 |
| 光村印刷 | 10 | 14 | 2,814 |
| 宝印刷 | 5.7 | 6.7 | 9,313 |
| アシックス | 108.2 | 128.7 | 303,989 |
| ツツミ | 5.4 | 6.9 | 16,021 |
| 小松ウオール工業 | 3.3 | 4.7 | 7,957 |
| ヤマハ | 80.1 | 101.6 | 314,452 |
| 河合楽器製作所 | 3.8 | 5.1 | 9,878 |
| クリナップ | 9.9 | 16.2 | 12,619 |
| ビジョン | 61.7 | 78.3 | 227,148 |
| 兼松日産農林 | 14 | 14 | 2,044 |
| キングジム | 9.1 | 11.5 | 9,855 |
| リンテック | 25.9 | 32.9 | 72,281 |
| T A S A K I | 2 | 2.6 | 4,100 |
| イトーキ | 22.9 | 29.1 | 18,245 |
| 任天堂 | 67.1 | 85.1 | 1,290,967 |
| 三菱鉛筆 | 9 | 10.3 | 55,208 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|---------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| タカラスタANDARD | 45 | 57 | 54,777 |
| コクヨ | 56.6 | 71.8 | 105,976 |
| ナカバヤシ | 23 | 28 | 7,784 |
| グローブライド | 53 | 6.7 | 8,984 |
| 岡村製作所 | 41.8 | 48.2 | 48,730 |
| 美津濃 | 58 | 74 | 41,884 |
| アデランス | 12.6 | 24 | 13,344 |
| 電気・ガス業 (2.0%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 924 | 1,172.4 | 630,751 |
| 中部電力 | 333.3 | 422.9 | 631,601 |
| 関西電力 | 444.5 | 564 | 573,306 |
| 中国電力 | 150.6 | 191.1 | 271,553 |
| 北陸電力 | 106.7 | 135.4 | 191,184 |
| 東北電力 | 272.1 | 345.3 | 485,491 |
| 四国電力 | 98.1 | 124.5 | 167,079 |
| 九州電力 | 240.6 | 305.2 | 342,129 |
| 北海道電力 | 101.9 | 129.3 | 124,774 |
| 沖縄電力 | 7.1 | 14.7 | 44,011 |
| 電源開発 | 79 | 117.8 | 365,769 |
| ファーストエスコ | — | 5.6 | 2,973 |
| イーレックス | — | 4.1 | 7,703 |
| 東京瓦斯 | 1,324 | 1,543 | 680,771 |
| 大阪瓦斯 | 1,127 | 1,431 | 584,849 |
| 東邦瓦斯 | 277 | 348 | 270,396 |
| 北海道瓦斯 | 23 | 34 | 9,554 |
| 広島ガス | 17.2 | 24.1 | 8,386 |
| 西部瓦斯 | 123 | 156 | 42,744 |
| 静岡ガス | 30.9 | 39.2 | 29,635 |
| メタウォーター | 6.8 | 8.9 | 26,557 |
| 陸運業 (4.6%) | | | |
| SBSホールディングス | 10.7 | 13.6 | 9,452 |
| 東武鉄道 | 582 | 739 | 416,057 |
| 相鉄ホールディングス | 187 | 237 | 160,449 |
| 東京急行電鉄 | 592 | 804 | 781,488 |
| 京浜急行電鉄 | 298 | 379 | 379,000 |
| 小田急電鉄 | 349 | 443 | 519,639 |
| 京王電鉄 | 304 | 386 | 360,524 |
| 京成電鉄 | 163 | 207 | 301,392 |
| 富士急行 | 30 | 38 | 54,910 |
| 新京成電鉄 | 14 | 18 | 7,560 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 東日本旅客鉄道 | 199.6 | 252.7 | 2,488,084 |
| 西日本旅客鉄道 | 104.8 | 133 | 886,844 |
| 東海旅客鉄道 | 97.5 | 123.8 | 2,407,910 |
| 西武ホールディングス | 86.8 | 146.8 | 323,253 |
| 鴻池運輸 | 13.5 | 19.5 | 24,160 |
| 西日本鉄道 | 141 | 179 | 103,104 |
| ハマキョウレックス | 3.4 | 10.6 | 23,404 |
| サカイ引越センター | 1.9 | 5.4 | 15,930 |
| 近鉄グループホールディングス | 1,096 | 1,391 | 627,341 |
| 阪急阪神ホールディングス | 731 | 928 | 633,824 |
| 南海電気鉄道 | 244 | 310 | 174,530 |
| 京阪ホールディングス | 244 | 310 | 233,740 |
| 神戸電鉄 | 27 | 34 | 12,308 |
| 名糖運輸 | 4.5 | — | — |
| 名古屋鉄道 | 397 | 503 | 274,135 |
| 山陽電気鉄道 | 40 | 50 | 25,400 |
| 日本通運 | 421 | 535 | 252,520 |
| ヤマトホールディングス | 191.5 | 247.1 | 537,689 |
| 山九 | 132 | 182 | 98,462 |
| 丸運 | 5.9 | 7.5 | 1,830 |
| 丸全昭和運輸 | 37 | 46 | 18,768 |
| センコー | 48 | 62.2 | 42,669 |
| トナミホールディングス | 22 | 28 | 7,672 |
| ニッコンホールディングス | 35.6 | 43.9 | 100,970 |
| 日本石油輸送 | 12 | 16 | 3,728 |
| 福山通運 | 66 | 84 | 46,284 |
| セイノーホールディングス | 84.3 | 98 | 110,250 |
| 神奈川中央交通 | 13 | 16 | 9,312 |
| 日立物流 | 22.7 | 28.8 | 52,732 |
| 丸和運輸機関 | — | 4.1 | 11,463 |
| C&Fロジホールディングス | — | 13.2 | 10,969 |
| 海運業 (0.2%) | | | |
| 日本郵船 | 920 | 1,241 | 251,923 |
| 商船三井 | 571 | 673 | 154,117 |
| 川崎汽船 | 477 | 605 | 128,260 |
| N Sユナイテッド海運 | 47 | 62 | 9,238 |
| 明治海運 | 9.7 | 12.4 | 4,699 |
| 飯野海運 | 56.4 | 71.5 | 27,885 |
| 共栄タンカー | 9 | 11 | 1,617 |
| 第一中央汽船 | 126 | — | — |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 乾汽船 | — | 10.9 | 9,929 |
| 空運業 (0.7%) | | | |
| 日本航空 | 208.6 | 264.6 | 1,070,042 |
| ANAホールディングス | 2,141 | 2,565 | 854,658 |
| バスコ | 10 | 13 | 5,044 |
| 倉庫・運輸関連業 (0.2%) | | | |
| トランコム | 3.1 | 4 | 25,360 |
| 日新 | 41 | 57 | 18,867 |
| 三菱倉庫 | 71 | 98 | 145,040 |
| 三井倉庫ホールディングス | 63 | 80 | 23,280 |
| 住友倉庫 | 80 | 101 | 54,439 |
| 滋澤倉庫 | 28 | 36 | 9,900 |
| 東陽倉庫 | 19 | 24 | 5,400 |
| 乾汽船 | 7.3 | — | — |
| 日本トランスシティ | 25 | 32 | 11,040 |
| ケイヒン | 20 | 25 | 3,575 |
| 中央倉庫 | 6.3 | 8 | 7,208 |
| 安田倉庫 | 8.5 | 10.7 | 7,500 |
| 東洋埠頭 | 34 | 40 | 5,920 |
| 宇徳 | 8.8 | 11.2 | 3,505 |
| 上組 | 130 | 165 | 162,195 |
| サンリツ | 2.6 | 3.4 | 1,655 |
| キムラユニティー | 2.8 | 3.5 | 3,776 |
| キューソー流通システム | 3 | 3.8 | 9,861 |
| 郵船ロジスティクス | 10 | 12.7 | 13,944 |
| 近鉄エクスプレス | 9.7 | 24.7 | 33,937 |
| 東海運 | 5.9 | 7.4 | 1,983 |
| エーアイティー | 5 | 8.5 | 7,735 |
| 内外トランスライン | 1.2 | 4.6 | 4,439 |
| 情報・通信業 (8.7%) | | | |
| NECネットエスアイ | 13.5 | 17.1 | 31,635 |
| システナ | 10.5 | 13.3 | 23,966 |
| デジタルアーツ | 5.7 | 6.7 | 15,101 |
| 新日鉄住金ソリューションズ | 9 | 22.7 | 39,611 |
| キューブシステム | 4.7 | 5.9 | 3,610 |
| コア | 4.5 | 5.7 | 7,404 |
| ソフトクリエイトホールディングス | 3.5 | 6.5 | 5,980 |
| I Tホールディングス | 35.6 | 45.2 | 117,565 |
| ネオス | 2.9 | 4 | 2,240 |
| 電算システム | 3.7 | 4.7 | 7,242 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| グリーン | 65.1 | 82.8 | 54,068 |
| コーエーテクモホールディングス | 24.3 | 32.4 | 60,264 |
| 三菱総合研究所 | 4.2 | 5.3 | 17,993 |
| ボルテージ | 1.9 | 2.7 | 3,177 |
| 電算 | 1.2 | 1.5 | 3,601 |
| AGS | 1.7 | 3.1 | 3,087 |
| ファイナデックス | 6.2 | 8.9 | 16,215 |
| ヒト・コミュニケーションズ | 1.2 | 3.1 | 6,373 |
| ブレインパッド | 1.6 | 2 | 1,560 |
| KL a b | 11.4 | 21.1 | 12,343 |
| ポルトゥウィン・ビットクルーホールディ | 7.1 | 9 | 8,271 |
| イーブックイニシアティブジャパン | 2.4 | 3 | 2,250 |
| ネクソン | 102.3 | 130.7 | 201,931 |
| アイスタイル | 4.6 | 20.8 | 18,512 |
| エムアップ | 3 | 3.5 | 1,890 |
| エイチーム | 3.9 | 7.5 | 12,330 |
| テクノスジャパン | — | 3.9 | 11,992 |
| e n i s h | 2.8 | 4 | 2,560 |
| コロブラ | 29.5 | 37.9 | 80,461 |
| モバイルクリエイト | 6.3 | 8.9 | 4,005 |
| オルトプラス | 3.9 | 5 | 2,100 |
| ブロードリーフ | 8.9 | 13.7 | 14,768 |
| ハーツユニテッドグループ | 3.2 | 4.1 | 10,561 |
| メディアドゥ | — | 2.9 | 5,889 |
| ブイキューブ | — | 8.9 | 11,988 |
| サイバーリンクス | — | 2.1 | 2,284 |
| VOYAGE GROUP | — | 4.6 | 5,754 |
| オプティム | — | 1.1 | 6,083 |
| ベリサーブ | 1.2 | 1.6 | 8,080 |
| ティーガイア | 10.7 | 13.6 | 18,632 |
| 日本アジアグループ | — | 15.4 | 7,746 |
| 豆蔵ホールディングス | 8.4 | 10.8 | 7,948 |
| テクマトリックス | 4.6 | 5.8 | 11,866 |
| ガンホー・オンライン・エンターテイメント | — | 317.8 | 88,348 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 9.3 | 11.2 | 79,408 |
| ザップラス | 6 | 7.6 | 3,078 |
| インターネットイニシアティブ | 17.4 | 22.1 | 49,813 |
| さくらインターネット | — | 8.9 | 11,614 |
| GMOクラウド | 2.4 | 3 | 3,753 |
| ビットアイル | 12.2 | — | — |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| S R Aホールディングス | 5.7 | 7.8 | 19,858 |
| M i n o r iソリューションズ | — | 2.6 | 2,376 |
| システムインテグレータ | 1.5 | 1.9 | 1,356 |
| パイブドビッツ | 1.4 | — | — |
| 朝日ネット | 11 | 12.4 | 5,914 |
| コムチュア | 1.8 | 2.3 | 6,239 |
| g u m i | 10.8 | 14 | 12,600 |
| パイブドHD | — | 1.7 | 2,286 |
| パナソニック インフォメーションシステム | 2.5 | — | — |
| フェイス | 3.2 | 3.6 | 4,845 |
| ハイマックス | 1.4 | 1.8 | 2,070 |
| 野村総合研究所 | 60.9 | 95.6 | 382,878 |
| サイバネットシステム | 8.8 | 11.1 | 8,924 |
| C Eホールディングス | 1.6 | 2.1 | 1,902 |
| インターージホールディングス | 6.1 | 7.1 | 10,011 |
| 東邦システムサイエンス | 3.2 | 4 | 2,428 |
| ソースネクスト | 5.4 | 6.8 | 3,556 |
| ティー・ワイ・オー | 14.8 | 26.8 | 4,582 |
| フォーカスシステムズ | — | 5.2 | 3,062 |
| クレスコ | 2.4 | 3.1 | 5,877 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 112 | 142 | 178,920 |
| オービック | 37.1 | 47 | 280,590 |
| ジャストシステム | 19.6 | 24.8 | 23,386 |
| T D Cソフトウェアエンジニアリング | 2.3 | 5.9 | 3,722 |
| ヤフー | 770.5 | 977.6 | 493,688 |
| トレンドマイクロ | 56.9 | 66.2 | 276,054 |
| インフォメーション・ディベロプメント | 2 | 2.6 | 2,568 |
| 日本オラクル | 17.2 | 21.9 | 134,247 |
| アルファシステムズ | 3.5 | 4.5 | 7,924 |
| フューチャー | 11.3 | 16.4 | 12,021 |
| C A C H o l d i n g s | 7.3 | 10.2 | 8,262 |
| ソフトバンク・テクノロジー | 2.9 | 3.7 | 6,563 |
| トーセ | 2.9 | 3.7 | 2,504 |
| オービックビジネスコンサルタント | 6.8 | 6.9 | 32,395 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 24.4 | 30.9 | 77,960 |
| アイティフォー | 12.9 | 17.7 | 9,062 |
| 東計電算 | 1.9 | 2.4 | 4,646 |
| エクスネット | 1 | 1.2 | 1,860 |
| 大塚商会 | 28.9 | 36.7 | 201,850 |
| サイボウズ | 14.3 | 18.1 | 6,280 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ソフトブレーン | 14.7 | 19.9 | 3,383 |
| 電通国際情報サービス | 6.6 | 8.4 | 16,917 |
| EMシステムズ | 1.7 | 4.6 | 5,639 |
| ウエザーニューズ | 3.2 | 4.6 | 18,032 |
| C I J | 9.7 | 12.3 | 6,199 |
| 東洋ビジネスエンジニアリング | 1.1 | 1.4 | 1,916 |
| 日本エンタープライズ | 9.5 | 13.9 | 3,586 |
| WOWOW | 5.1 | 6.5 | 15,951 |
| フュージョンパートナー | 6.1 | 8.5 | 4,658 |
| 日本コロムビア | 3.7 | 4.6 | 1,987 |
| イマジカ・ロボット ホールディングス | 7.5 | 11.5 | 4,577 |
| ネットワンシステムズ | 43.6 | 59.1 | 36,346 |
| アルゴグラフィックス | 4.4 | 6.2 | 10,707 |
| マーベラス | 18.1 | 23 | 19,619 |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 21.3 | 25.1 | 35,867 |
| 日本ユニシス | 29.7 | 37.6 | 49,932 |
| 兼松エレクトロニクス | 6.8 | 8.6 | 16,804 |
| 東京放送ホールディングス | 64.4 | 81.7 | 125,327 |
| 日本テレビホールディングス | 98.2 | 124.5 | 226,714 |
| 朝日放送 | 10.6 | 13.5 | 8,640 |
| テレビ朝日ホールディングス | 29.4 | 37.3 | 69,825 |
| スカパー J S A Tホールディングス | 81.6 | 103.5 | 63,963 |
| テレビ東京ホールディングス | 8.8 | 12.4 | 24,589 |
| 日本BS放送 | 1.8 | 3.1 | 3,121 |
| U-NEXT | — | 4.2 | 4,363 |
| ワイヤレスゲート | — | 4 | 9,232 |
| コネクシオ | 7.6 | 12 | 16,776 |
| 日本通信 | — | 96.6 | 21,252 |
| クロップス | 1.3 | 2.5 | 1,287 |
| 日本電信電話 | 420.7 | 1,054.4 | 5,306,795 |
| K D D I | 1,092.2 | 1,385.7 | 4,536,781 |
| 光通信 | 9.7 | 16.4 | 138,088 |
| N T T ドコモ | 829.2 | 1,019.3 | 2,854,040 |
| エムティーアイ | 13.6 | 20.7 | 17,408 |
| GMOインターネット | 35.9 | 49.8 | 67,977 |
| カドカワ | 26.4 | 42.6 | 68,032 |
| 学研ホールディングス | 36 | 45 | 11,340 |
| ゼンリン | 14.2 | 18 | 46,692 |
| 昭文社 | 6.4 | 7.4 | 4,610 |
| インプレスホールディングス | 7.6 | 11.2 | 1,657 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アイネット | 5.5 | 7.6 | 8,572 |
| 松竹 | 71 | 90 | 95,040 |
| 東宝 | 76.7 | 97.3 | 281,683 |
| 東映 | 40 | 51 | 43,401 |
| AOI Pro. | 5 | 6.9 | 6,182 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 66.4 | 84.3 | 484,725 |
| ピー・シー・エー | 1.4 | 1.7 | 2,213 |
| ビジネスブレイン太田昭和 | — | 2.1 | 1,965 |
| DTS | 11.1 | 15.2 | 33,440 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 41.3 | 57.7 | 161,617 |
| シーイーシー | 7 | 8.9 | 14,275 |
| カプコン | 27.5 | 34.9 | 84,702 |
| アイ・エス・ピー | 1.1 | 2.2 | 1,973 |
| ジャステック | 6.2 | 8.6 | 8,376 |
| SCSK | 25.6 | 32.4 | 130,248 |
| 日本システムウェア | 4 | 5.1 | 5,395 |
| アイネス | 14.6 | 19.3 | 22,156 |
| TKC | 9.9 | 12.6 | 38,430 |
| 富士ソフト | 14.8 | 20.2 | 50,257 |
| NSD | 25.1 | 28.9 | 49,881 |
| コナミホールディングス | 43.7 | 61.6 | 214,368 |
| 福井コンピュータホールディングス | 2.9 | 3.9 | 6,360 |
| JBCホールディングス | 9 | 11.4 | 7,843 |
| ミロク情報サービス | 7.1 | 10.1 | 11,847 |
| ソフトバンクグループ | 568.5 | 772.9 | 4,631,216 |
| 卸売業 (4.1%) | | | |
| ハウスイ | 9 | 11 | 1,320 |
| 高千穂交易 | 4.1 | 5.2 | 4,711 |
| 伊藤忠食品 | 2.6 | 3.4 | 13,379 |
| エレマテック | 5 | 6.4 | 12,563 |
| JALUX | 3 | 4.4 | 8,720 |
| あらた | 24 | 6.1 | 15,079 |
| トーマンデバイス | 1.6 | 2 | 3,534 |
| 東京エレクトロン デバイス | 2.8 | 4.9 | 7,394 |
| フィールズ | — | 11.9 | 18,921 |
| 双日 | 719.6 | 859.3 | 201,076 |
| アルフレッサ ホールディングス | 127.2 | 171.5 | 363,065 |
| 横浜冷凍 | 26.6 | 33.8 | 36,673 |
| 神栄 | 16 | 19 | 2,071 |
| 山下医科器械 | 0.9 | 1.1 | 2,075 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ラサ商事 | 5 | 6.4 | 3,296 |
| ラクーン | — | 5.8 | 3,126 |
| アルコニックス | 6.1 | 7.7 | 12,035 |
| 神戸物産 | 3.5 | 8.8 | 21,700 |
| あい ホールディングス | 17.2 | 24.3 | 79,947 |
| ディーブイエックス | 3.1 | 4.8 | 5,433 |
| ダイワボウホールディングス | 98 | 124 | 26,660 |
| マクニカ・富士エレホールディングス | 19.3 | 24.6 | 28,609 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 20.2 | 23.6 | 22,750 |
| 八洲電機 | 8.3 | 10.5 | 5,817 |
| UKCホールディングス | 6.9 | 8.8 | 16,676 |
| OCHIホールディングス | 2.8 | 3.9 | 4,067 |
| TOKAIホールディングス | 52.5 | 59.9 | 36,658 |
| 三洋貿易 | 5.9 | 7.5 | 10,747 |
| ウイン・パートナーズ | 3.5 | 4.9 | 7,389 |
| ミタチ産業 | 2.5 | 3.5 | 2,268 |
| シップヘルスケアホールディングス | 19.7 | 27.7 | 77,920 |
| 明治電機工業 | 3.1 | 4.3 | 4,523 |
| デリカフーズ | 1.8 | 2.9 | 2,728 |
| スターティア | 1.2 | 2.6 | 2,020 |
| 富士興産 | 4.1 | 5.3 | 2,210 |
| 協栄産業 | 13 | 18 | 2,268 |
| 小野建 | 9.3 | 11.9 | 13,447 |
| 佐島電機 | 8.5 | 10.8 | 8,100 |
| エコートレーディング | 2.5 | 3.1 | 1,760 |
| 伯東 | 7.3 | 10.4 | 9,630 |
| コンドレーテック | 7.8 | 10.8 | 9,525 |
| 中山福 | 6.2 | 8.5 | 6,315 |
| ナガイレーベン | 15.5 | 19.7 | 44,068 |
| 三菱食品 | 11.8 | 15 | 40,365 |
| 松田産業 | 7.8 | 9.9 | 11,731 |
| 第一興商 | — | 24.1 | 115,198 |
| メディパルホールディングス | 107.5 | 136.4 | 238,563 |
| アドヴァン | 5.5 | 13.9 | 14,692 |
| SPK | 2.3 | 3.1 | 6,147 |
| 萩原電気 | 3 | 4.6 | 8,956 |
| アズワン | 7.7 | 10.7 | 43,014 |
| スズデン | 3.5 | 4.4 | 4,496 |
| 尾家産業 | 3.4 | 4.4 | 3,779 |
| シモジマ | 6.6 | 9.4 | 9,268 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ドウシシャ | 13.9 | 16 | 35,120 |
| 小津産業 | 2.1 | 3 | 6,483 |
| 高速 | 6.4 | 8.1 | 7,119 |
| たけびし | 3.8 | 4.8 | 4,780 |
| 黒田電気 | 18.7 | 25.4 | 42,113 |
| 丸文 | 9.5 | 12 | 7,824 |
| ハビネット | 6.5 | 12.4 | 11,135 |
| 橋本総業ホールディングス | 2 | 2.8 | 4,172 |
| エクセル | 4.9 | 6.6 | 9,028 |
| マルカキカイ | 3.5 | 4.4 | 5,592 |
| ガリバーインターナショナル | 32.5 | 36.7 | 40,810 |
| 日本エム・ディ・エム | 9 | 11.4 | 8,504 |
| 進和 | 6.3 | 8 | 11,664 |
| エスケイジャパン | 2.5 | 3.3 | 996 |
| ダイトエレクトロン | 4.9 | 6.2 | 4,048 |
| シークス | 6.8 | 8.7 | 29,797 |
| 田中商事 | 3.3 | 4.2 | 2,637 |
| オーハシテクニカ | 6.6 | 7.7 | 9,147 |
| 白銅 | 3.5 | 3.9 | 3,962 |
| 伊藤忠商事 | 899.9 | 1,070.4 | 1,479,292 |
| 丸紅 | 940.5 | 1,342.5 | 712,330 |
| 高島 | 20 | 25 | 4,275 |
| 長瀬産業 | 60.3 | 82 | 96,924 |
| 蝶理 | 6.8 | 8.7 | 13,685 |
| 豊田通商 | 119.8 | 151.9 | 364,104 |
| 三共生興 | 18.3 | 20.6 | 7,642 |
| 兼松 | 214 | 290 | 51,330 |
| ツカモトコーポレーション | 19 | 24 | 2,616 |
| 三井物産 | 911.4 | 1,233.5 | 1,584,430 |
| 日本紙パルプ商事 | 56 | 71 | 22,933 |
| 日立ハイテクノロジーズ | 37.3 | 47.3 | 140,906 |
| カメイ | 14 | 17.7 | 16,691 |
| 東都水産 | 18 | 22 | 3,850 |
| OUGホールディングス | 17 | 20 | 4,600 |
| スターゼン | 42 | 4.9 | 16,292 |
| 山善 | 41.3 | 52.4 | 45,326 |
| 椿本興業 | 12 | 15 | 4,365 |
| 住友商事 | 634.5 | 858.7 | 933,836 |
| 内田洋行 | 26 | 34 | 15,776 |
| 三菱商事 | 823.9 | 1,023.6 | 1,840,432 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 第一実業 | 26 | 31 | 15,345 |
| キヤノンマーケティングジャパン | 30.7 | 38.9 | 79,122 |
| 西華産業 | 35 | 44 | 9,504 |
| 佐藤商事 | 9.6 | 12.2 | 7,856 |
| 菱洋エレクトロ | 12.4 | 15.4 | 20,097 |
| 東京産業 | 10.7 | 13.5 | 5,035 |
| ユアサ商事 | 9.4 | 12.9 | 31,734 |
| 神鋼商事 | 27 | 30 | 5,610 |
| 小林産業 | 7.8 | 9 | 1,674 |
| 阪和興業 | 107 | 136 | 65,416 |
| カナデン | 9.2 | 13 | 10,868 |
| 菱電商事 | 17 | 22 | 14,014 |
| フルサト工業 | 5.9 | 7.5 | 11,122 |
| 岩谷産業 | 119 | 162 | 102,708 |
| すてきなイスグループ | 46 | 58 | 7,714 |
| 昭光通商 | 38 | 48 | 3,600 |
| ニチモウ | 17 | 21 | 3,759 |
| 極東貿易 | 12 | 20 | 4,320 |
| イワキ | 16 | 21 | 4,284 |
| 三菱石油 | 28 | 33.5 | 25,091 |
| 稲畑産業 | 25.8 | 32.7 | 35,250 |
| G S I クレオス | 28 | 36 | 4,140 |
| 明和産業 | 8.5 | 12.6 | 4,636 |
| ワキタ | 22.9 | 29 | 22,069 |
| 東邦ホールディングス | 37.1 | 43.7 | 109,555 |
| サンゲツ | 37.6 | 47.5 | 94,002 |
| ミツウロコグループホールディングス | 17.3 | 21.9 | 11,475 |
| シナネンホールディングス | 23 | 29 | 12,180 |
| 伊藤忠エネクス | 23.7 | 35.1 | 33,309 |
| サンリオ | 30.1 | 42 | 91,224 |
| サンワテクノス | 6.8 | 8.7 | 6,394 |
| リョーサン | 18.1 | 21.6 | 57,456 |
| 新光商事 | 12.6 | 16 | 17,440 |
| トーホー | 24 | 6.1 | 14,658 |
| 三信電気 | 14.9 | 18.8 | 16,788 |
| 東陽テクニカ | 15.7 | 18.1 | 19,511 |
| モスフードサービス | 14.1 | 17.9 | 54,058 |
| 加賀電子 | 9.7 | 12.3 | 16,334 |
| ソーダニッカ | 11.1 | 14 | 6,538 |
| 立花エレテック | 7.9 | 10.1 | 11,887 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| フォーバル | 2.1 | 7.1 | 5,523 |
| PALTAC | 17.2 | 21.8 | 41,223 |
| 三谷産業 | 11.4 | 14.5 | 5,278 |
| 太平洋興発 | 42 | 57 | 4,218 |
| ヤマタネ | 54 | 63 | 9,450 |
| 丸紅建材リース | 9 | 12 | 2,256 |
| 日鉄住金物産 | 71 | 120 | 45,960 |
| トラスコ中山 | 13.4 | 15.6 | 74,334 |
| オートバックスセブン | 39.6 | 52.2 | 103,251 |
| 加藤産業 | 16.8 | 21.3 | 58,788 |
| イノテック | 9.9 | 12.5 | 5,375 |
| イエローハット | 10.1 | 12.9 | 29,786 |
| J Kホールディングス | 10.8 | 13.7 | 6,247 |
| 日伝 | 4.4 | 5.6 | 16,772 |
| 北沢産業 | 8.9 | 11.2 | 1,803 |
| 杉本商事 | 5.8 | 7.8 | 9,180 |
| 因幡電機産業 | 16 | 19.1 | 67,136 |
| バイテックホールディングス | 3.6 | 5.6 | 5,476 |
| ミスミグループ本社 | 40.2 | 153.2 | 240,064 |
| アルテック | 7.9 | 11.6 | 1,705 |
| タキヒヨー | 18 | 23 | 9,821 |
| 蔵王産業 | 1.4 | 2.2 | 2,895 |
| スズケン | 48.9 | 62.1 | 232,254 |
| ジェコス | 7.4 | 9.4 | 11,129 |
| ルネサスイーストン | 5.3 | 11.3 | 4,734 |
| 小売業 (5.0%) | | | |
| ローソン | 40.7 | 51.7 | 450,307 |
| サンエー | 8.1 | 9.3 | 48,267 |
| ダイユーエイト | 2.5 | 3.6 | 2,466 |
| カワチ薬品 | 8.3 | 10.5 | 26,617 |
| エービーシー・マート | 15.3 | 17.7 | 130,449 |
| ハードオフコーポレーション | 5.2 | 6.6 | 9,768 |
| アスクル | 11.2 | 16.6 | 70,965 |
| ゲオホールディングス | 20.2 | 22.8 | 41,176 |
| アダストリア | 9.1 | 25.1 | 90,862 |
| ジーフット | — | 8.2 | 6,379 |
| シー・ヴィ・エス・ベイエリア | 14 | 20 | 1,820 |
| くらコーポレーション | 6.3 | 8 | 38,520 |
| キャンドウ | 5.1 | 7.2 | 11,664 |
| バル | 6.3 | 7.9 | 21,053 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| エディオン | 49.2 | 57.7 | 51,468 |
| サーラコーポレーション | 9.2 | 11.7 | 6,563 |
| ワッツ | 4.2 | 5.8 | 5,347 |
| ハローズ | — | 4.4 | 10,282 |
| あみやき亭 | 1.9 | 2.6 | 11,349 |
| ひらまつ | 14.8 | 18.8 | 13,235 |
| ゲンキー | 1.1 | 2.7 | 9,342 |
| サッポロドラッグストア | 0.9 | 1.8 | 3,853 |
| 大黒天物産 | 2.6 | 3.2 | 15,456 |
| ハニーズ | 9.4 | 12 | 13,968 |
| ファーマライズホールディングス | 2.4 | 3.1 | 1,717 |
| アルペン | 9.6 | 12.2 | 22,008 |
| クオール | 10.9 | 13.8 | 22,066 |
| ジェイアイエス | 7.3 | 9.3 | 36,735 |
| ビックカメラ | 52.8 | 78.3 | 84,955 |
| DCMホールディングス | 52 | 67.1 | 53,210 |
| Monotaro | 21 | 48.2 | 166,531 |
| 東京一番フーズ | — | 3.4 | 1,662 |
| ダイヤモンドダイニング | — | 2.8 | 2,842 |
| きちり | 2.9 | 3.6 | 2,343 |
| アークランドサービス | 1.3 | 4.3 | 13,889 |
| J. フロント リテイリング | 136 | 172.6 | 221,445 |
| ドトール・日レスホールディングス | 18.8 | 23.9 | 45,242 |
| マツモトキヨシホールディングス | 24 | 28.1 | 156,236 |
| ブロンコビリー | 1.9 | 7.1 | 22,116 |
| スタートトゥデイ | 33.5 | 41.5 | 216,630 |
| トレジャー・ファクトリー | 1.3 | 3.8 | 4,335 |
| 物語コーポレーション | 3 | 3.6 | 18,900 |
| ココカラファイン | 11.2 | 14.2 | 72,704 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 213.7 | 271.3 | 306,297 |
| ウエルシアホールディングス | 9.2 | 11.8 | 69,620 |
| クリエイトSDホールディングス | 5.3 | 20.1 | 53,667 |
| 丸善CHIホールディングス | 12.5 | 15.9 | 5,883 |
| ミサワ | — | 2.1 | 1,081 |
| エー・ピーカンパニー | 1.5 | 2.2 | 2,428 |
| チムニー | 2.6 | 3.3 | 9,873 |
| シュッピン | — | 5.1 | 6,828 |
| ネクステージ | 1.4 | 2.2 | 1,419 |
| ジョイフル本田 | 7.9 | 22.1 | 53,437 |
| キリン堂ホールディングス | 3.4 | 4.4 | 4,721 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ホットランド | — | 4.7 | 4,714 |
| すかいらく | 52.5 | 41.7 | 56,545 |
| 綿半ホールディングス | — | 5.1 | 7,502 |
| ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール | 35.3 | 45.2 | 47,369 |
| ブックオフコーポレーション | 6.1 | 7.7 | 6,475 |
| ゴルフダイジェスト・オンライン | — | 3.8 | 3,765 |
| あさひ | 7.1 | 10.1 | 16,887 |
| 日本調剤 | 1.4 | 3.4 | 13,311 |
| コスモス薬品 | 5.4 | 6.9 | 131,583 |
| トーエル | 5.7 | 6.6 | 5,115 |
| 一六堂 | 2.6 | 3.3 | 1,102 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 449.7 | 570.6 | 2,717,767 |
| 薬王堂 | 1.5 | 2.5 | 9,750 |
| クリエイト・レストランツ・ホールディング | 7.5 | 36.6 | 37,112 |
| ツルハホールディングス | 23 | 31.3 | 344,613 |
| サンマルクホールディングス | 7.7 | 10.8 | 30,996 |
| フェリシモ | 2.7 | 3.9 | 3,966 |
| トリドール | 11.5 | 16.7 | 34,134 |
| クスリのアオキ | 4.2 | 12.1 | 73,689 |
| メディカルシステムネットワーク | 9.7 | 15.4 | 9,809 |
| 総合メディカル | 5.2 | 6.6 | 21,417 |
| はるやま商事 | 4.5 | 5.7 | 4,326 |
| カッパ・クリエイト | 16.8 | 19.1 | 23,645 |
| ライトオン | 8 | 10.2 | 14,994 |
| ジーンズメイト | 3.4 | 4.3 | 786 |
| 良品計画 | 13.3 | 15.7 | 406,316 |
| 三城ホールディングス | 13.3 | 16.8 | 7,442 |
| アルビス | 2.4 | 3.6 | 7,502 |
| コナカ | 12.6 | 17.4 | 8,926 |
| ハウス オブ ローゼ | 1.2 | 1.7 | 2,429 |
| G-7ホールディングス | 2.3 | 4 | 4,940 |
| イオン北海道 | 6.8 | 9.1 | 4,713 |
| コジマ | 15.8 | 20.1 | 4,964 |
| ヒマラヤ | 3.3 | 4.2 | 4,263 |
| コーナン商事 | 16.4 | 19.3 | 37,615 |
| エコス | 3.7 | 5.2 | 7,311 |
| ワタミ | 12.7 | 16.1 | 15,939 |
| マルシェ | 2.6 | 3.3 | 2,745 |
| ドンキホーテホールディングス | 34.7 | 88.2 | 343,539 |
| 西松屋チェーン | 21.2 | 26.9 | 34,109 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ゼンショーホールディングス | 55.3 | 70.2 | 99,543 |
| 幸楽苑ホールディングス | 6.7 | 8.6 | 12,882 |
| ハークスレイ | 3 | 3.8 | 3,944 |
| サイゼリヤ | 17.7 | 22.4 | 45,248 |
| V Tホールディングス | — | 46.1 | 26,784 |
| 魚力 | 3 | 4.2 | 5,422 |
| ポプラ | 2.7 | 3.4 | 1,570 |
| ユナイテッドアローズ | 14.1 | 19.5 | 72,735 |
| ハイデイ日高 | 8.1 | 12.4 | 32,574 |
| 京都きもの友禅 | 6.3 | 9.3 | 8,388 |
| コロワイド | 35.6 | 45.2 | 85,156 |
| ピーシーデポコーポレーション | — | 15.1 | 18,271 |
| 巷番屋 | 4.9 | 6.2 | 44,764 |
| トップカルチャー | 4.3 | 4.9 | 2,263 |
| P L A N T | 2.4 | 3.1 | 3,782 |
| スギホールディングス | 19.3 | 24.5 | 137,935 |
| スクロール | 13.9 | 20.6 | 9,620 |
| ヨンドシーホールディングス | 8.2 | 10.4 | 28,184 |
| ファミリーマート | 36.3 | 41.9 | 249,305 |
| 木曽路 | 13.1 | 16.7 | 37,508 |
| サトレストランシステムズ | 10 | 16 | 12,944 |
| 千趣会 | 19.3 | 26.9 | 20,417 |
| タカキュー | 7.4 | 10.5 | 1,974 |
| ケーヨー | 20.1 | 23 | 12,075 |
| 上新電機 | 23 | 32 | 28,384 |
| 日本瓦斯 | 17.2 | 20.8 | 52,748 |
| ベスト電器 | 34.6 | 43.9 | 5,092 |
| ロイヤルホールディングス | 17.9 | 22.6 | 47,505 |
| 東天紅 | 8 | 10 | 1,300 |
| いなげや | 12 | 15.2 | 22,496 |
| 島忠 | 27.8 | 35.3 | 88,567 |
| チヨダ | 12.7 | 16.1 | 45,997 |
| ライフコーポレーション | 6.8 | 8.6 | 26,015 |
| リンガーハット | 10.4 | 12.3 | 28,400 |
| さが美 | 8 | 11 | 979 |
| M r M a x | 10.7 | 11.9 | 3,712 |
| テンアライド | 9 | 12.5 | 4,600 |
| A O K Iホールディングス | 24.7 | 31.1 | 38,626 |
| オークワ | 17 | 21 | 24,822 |
| コメリ | 18.4 | 21 | 58,926 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 青山商事 | 27 | 26.1 | 109,098 |
| しまむら | 12.5 | 15.8 | 238,896 |
| C F S コーポレーション | 7 | — | — |
| はせがわ | 3.8 | 6.4 | 2,675 |
| 高島屋 | 156 | 198 | 156,024 |
| 松屋 | 21.6 | 27.4 | 23,646 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 50.8 | 69.8 | 124,662 |
| 近鉄百貨店 | 41 | 52 | 16,120 |
| 丸栄 | 18 | 28 | 2,744 |
| ニッセンホールディングス | 22.5 | 20 | 2,360 |
| パルコ | 10.3 | 13.1 | 12,209 |
| 丸井グループ | 113.1 | 167.4 | 286,923 |
| アクシアル リテイリング | 8.3 | 10.5 | 37,695 |
| 井筒屋 | 58 | 74 | 3,922 |
| イオン | 443.4 | 561.3 | 939,896 |
| ユニーグループ・ホールディングス | 102.9 | 130.6 | 107,222 |
| イズミ | 24 | 27.1 | 117,343 |
| 東武ストア | 14 | 16 | 4,944 |
| 平和堂 | 21.8 | 27.6 | 64,777 |
| フジ | 11.9 | 15.1 | 36,723 |
| ヤオコー | 12.2 | 15.5 | 76,415 |
| ゼビオホールディングス | 14.6 | 18.5 | 31,542 |
| ケーズホールディングス | 24.8 | 28.8 | 108,432 |
| O l y m p i c グループ | 6.3 | 8 | 4,584 |
| 日産東京販売ホールディングス | 18 | 22.9 | 5,976 |
| アインホールディングス | 12.9 | 16.4 | 92,332 |
| 元気寿司 | 3.3 | 3.8 | 8,097 |
| ヤマダ電機 | 425 | 414.8 | 230,628 |
| アークランドサカモト | 7.7 | 23.1 | 26,726 |
| ニトリホールディングス | 46.4 | 58.9 | 628,463 |
| グルメ杵屋 | 8 | 10 | 9,990 |
| 愛眼 | 8.6 | 10.9 | 2,343 |
| ケーユーホールディングス | 5.6 | 7.1 | 5,246 |
| 吉野家ホールディングス | 30.3 | 50.3 | 72,532 |
| 松屋フーズ | 5.2 | 6.5 | 18,317 |
| サガミチェーン | 14 | 18.2 | 22,386 |
| 関西スーパーマーケット | 8 | 11.1 | 10,245 |
| 王将フードサービス | 7.9 | 10 | 35,850 |
| ブレナス | 12 | 15.2 | 30,217 |
| ミニストップ | 7.9 | 10.1 | 18,079 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|----------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| アークス | 18.7 | 25.5 | 65,050 |
| パローホールディングス | 23.2 | 29.4 | 83,995 |
| 藤久 | 0.8 | 1.1 | 1,912 |
| ペルク | 4.8 | 6.7 | 29,212 |
| 大庄 | 5 | 7.3 | 10,650 |
| ファーストリテイリング | 21.5 | 22.8 | 658,806 |
| サンドラッグ | 22.7 | 28.8 | 228,672 |
| サックスパー ホールディングス | 8.1 | 12.8 | 17,088 |
| ヤマザワ | 2.2 | 2.8 | 4,628 |
| やまや | 1.8 | 2.8 | 5,549 |
| ペルーナ | 26.8 | 34 | 19,380 |
| 銀行業 (7.4%) | | | |
| 島根銀行 | 2.3 | 2.9 | 3,320 |
| じもとホールディングス | 77.1 | 97.9 | 13,803 |
| 足利ホールディングス | 67.6 | 100.1 | 31,931 |
| 東京ＴＹフィナンシャルグループ | 13.8 | 18.8 | 52,602 |
| 九州フィナンシャルグループ | — | 208.8 | 116,510 |
| ゆうちょ銀行 | — | 349.5 | 463,087 |
| 富山第一銀行 | — | 34.7 | 18,391 |
| コンソルディア・フィナンシャルグループ | — | 950.3 | 462,796 |
| 新生銀行 | 1,023 | 1,180 | 186,440 |
| あおぞら銀行 | 726 | 863 | 335,707 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 8,626.2 | 10,944.9 | 5,568,765 |
| りそなホールディングス | 1,257.7 | 1,595.8 | 616,617 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 2,376 | 2,848 | 954,080 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 813.1 | 1,092.3 | 3,667,943 |
| 第四銀行 | 136 | 173 | 65,048 |
| 北越銀行 | 116 | 147 | 27,783 |
| 西日本シティ銀行 | 377 | 444 | 86,136 |
| 千葉銀行 | 415 | 526 | 285,092 |
| 横浜銀行 | 721 | — | — |
| 常陽銀行 | 389 | 493 | 187,340 |
| 群馬銀行 | 255 | 303 | 131,199 |
| 武蔵野銀行 | 17.2 | 21.8 | 60,233 |
| 千葉興業銀行 | 22.3 | 37.4 | 17,615 |
| 筑波銀行 | 44.7 | 56.7 | 15,762 |
| 七十七銀行 | 181 | 214 | 81,320 |
| 青森銀行 | 84 | 99 | 32,274 |
| 秋田銀行 | 71 | 89 | 25,810 |
| 山形銀行 | 65 | 77 | 30,954 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------|----------|----------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 岩手銀行 | 7.5 | 9.5 | 39,235 |
| 東邦銀行 | 96 | 122 | 45,140 |
| 東北銀行 | 58 | 69 | 9,867 |
| みちのく銀行 | 54 | 68 | 12,036 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 436 | 590 | 211,220 |
| 静岡銀行 | 315 | 400 | 318,000 |
| 十六銀行 | 135 | 171 | 54,891 |
| スルガ銀行 | 113.5 | 129.5 | 284,900 |
| 八十二銀行 | 194 | 246.8 | 116,242 |
| 山梨中央銀行 | 67 | 84 | 34,104 |
| 大垣共立銀行 | 134 | 182 | 60,606 |
| 福井銀行 | 92 | 117 | 25,272 |
| 北國銀行 | 120 | 145 | 45,095 |
| 清水銀行 | 3.7 | 4.6 | 10,465 |
| 富山銀行 | — | 2.6 | 9,139 |
| 滋賀銀行 | 108 | 128 | 60,928 |
| 南都銀行 | 104 | 132 | 41,580 |
| 百五銀行 | 103 | 123 | 49,323 |
| 京都銀行 | 205 | 260 | 187,200 |
| 紀陽銀行 | 42.2 | 53.5 | 70,299 |
| 三重銀行 | 48 | 61 | 12,078 |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 731 | 928 | 128,064 |
| 広島銀行 | 317 | 402 | 157,986 |
| 山陰合同銀行 | 65 | 82 | 57,072 |
| 中国銀行 | 76.2 | 96.7 | 106,950 |
| 鳥取銀行 | 34 | 43 | 7,181 |
| 伊予銀行 | 115 | 145.9 | 105,485 |
| 百十四銀行 | 118 | 150 | 48,000 |
| 四国銀行 | 83 | 105 | 22,050 |
| 阿波銀行 | 88 | 109 | 60,931 |
| 鹿児島銀行 | 75 | — | — |
| 大分銀行 | 66 | 78 | 25,038 |
| 宮崎銀行 | 72 | 91 | 26,299 |
| 肥後銀行 | 88 | — | — |
| 佐賀銀行 | 65 | 83 | 17,845 |
| 十八銀行 | 66 | 84 | 21,252 |
| 沖縄銀行 | 8.5 | 10.4 | 38,428 |
| 琉球銀行 | 22.1 | 28.1 | 35,883 |
| セブン銀行 | 362.5 | 511.1 | 241,239 |
| みずほフィナンシャルグループ | 14,990.1 | 19,335.1 | 3,205,759 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|---------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 高知銀行 | 42 | 53 | 5,830 |
| 山口フィナンシャルグループ | 107 | 128 | 135,936 |
| 長野銀行 | 35 | 45 | 8,460 |
| 名古屋銀行 | 97 | 114 | 41,382 |
| 北洋銀行 | 162 | 205.5 | 57,334 |
| 愛知銀行 | 3.9 | 4.6 | 22,862 |
| 第三銀行 | 61 | 77 | 11,704 |
| 中京銀行 | 44 | 56 | 11,984 |
| 東日本銀行 | 47 | — | — |
| 大光銀行 | 38 | 48 | 9,504 |
| 愛媛銀行 | 63 | 80 | 18,400 |
| トマト銀行 | 41 | 53 | 7,685 |
| みなと銀行 | 97 | 123 | 19,434 |
| 京葉銀行 | 89 | 112 | 45,248 |
| 関西アーバン銀行 | 15 | 19 | 19,703 |
| 栃木銀行 | 54 | 71 | 30,104 |
| 北日本銀行 | 3.3 | 4.2 | 11,155 |
| 東和銀行 | 151 | 255 | 22,950 |
| 福島銀行 | 132 | 168 | 14,448 |
| 大東銀行 | 69 | 82 | 14,432 |
| トモニホールディングス | 82.5 | 104.7 | 32,980 |
| フィデアホールディングス | 63.8 | 111.3 | 19,032 |
| 池田泉州ホールディングス | 102.5 | 144.7 | 60,195 |
| 証券・商品先物取引業 (1.0%) | | | |
| F P G | 31.8 | 48.6 | 56,084 |
| S B I ホールディングス | 129.1 | 163.8 | 200,982 |
| 日本アジア投資 | 78 | 9.2 | 2,465 |
| ジャフコ | 14.7 | 22.8 | 71,364 |
| 大和証券グループ本社 | 1,006 | 1,276 | 800,945 |
| 野村ホールディングス | 2,197.9 | 2,624.7 | 1,208,149 |
| 岡三証券グループ | 92 | 116 | 66,004 |
| 丸三証券 | 34.2 | 40.5 | 40,257 |
| 東洋証券 | 41 | 52 | 12,740 |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 123.4 | 156.5 | 86,388 |
| 光世証券 | 26 | 33 | 4,290 |
| 水戸証券 | 33.3 | 42.2 | 12,027 |
| いちよし証券 | 22.5 | 30.5 | 27,999 |
| 松井証券 | 54.6 | 66.8 | 64,595 |
| だいこう証券ビジネス | 5.2 | 6.6 | 4,870 |
| マネックスグループ | 126.5 | 158.5 | 45,965 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| カブドットコム証券 | 47.7 | 116.3 | 40,821 |
| 極東証券 | 14.4 | 18.3 | 24,046 |
| 岩井コスモホールディングス | 11 | 12.9 | 13,119 |
| 藍澤證券 | 15.1 | 25.5 | 15,121 |
| マネースクウェアHD | 4.4 | 4.7 | 4,939 |
| マネーパートナーズグループ | 11 | 12.7 | 8,496 |
| 小林洋行 | 3.1 | 3.9 | 943 |
| 保険業 (2.3%) | | | |
| かんぽ生命保険 | — | 55.5 | 135,253 |
| 損保ジャパン日本興亜ホールディングス | 238.8 | 303 | 871,428 |
| アニコム ホールディングス | 6 | 9.2 | 26,394 |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 342.7 | 407.7 | 1,206,588 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 103 | 130.7 | 176,445 |
| 第一生命保険 | 688.8 | 874 | 1,173,782 |
| 東京海上ホールディングス | 435.6 | 552.7 | 2,052,175 |
| T&Dホールディングス | 391.8 | 497.2 | 516,839 |
| その他金融業 (1.4%) | | | |
| 全国保証 | 27.9 | 35.5 | 133,302 |
| クレディセゾン | 87.8 | 103.5 | 214,452 |
| アクリーティブ | 7.3 | 11.2 | 5,902 |
| 芙蓉総合リース | 11.3 | 15.6 | 75,582 |
| 興銀リース | 20.2 | 25.6 | 48,512 |
| 東京センチュリーリース | 25.2 | 32 | 119,680 |
| 日本証券金融 | 47.4 | 60.1 | 25,963 |
| アイフル | 179.9 | 228.4 | 90,446 |
| ポケットカード | 8 | 13.6 | 7,629 |
| リコーリース | 8.5 | 10.7 | 33,812 |
| イオンフィナンシャルサービス | 70.5 | 89.5 | 226,614 |
| アコム | 216 | 274 | 173,168 |
| ジャックス | 59 | 75 | 34,125 |
| オリエントコーポレーション | 248.5 | 589.8 | 134,474 |
| 日立キャピタル | 21.1 | 32.1 | 74,664 |
| アプラスフィナンシャル | 51.6 | 65.4 | 6,801 |
| オリックス | 761.1 | 966 | 1,546,083 |
| 三菱UFJ F リース | 272.7 | 346 | 161,928 |
| 日本取引所グループ | 157.9 | 400.6 | 659,387 |
| イー・ギャランティ | 3.1 | 4.4 | 10,696 |
| アサックス | 1.9 | 2.4 | 3,290 |
| NECキャピタルソリューション | 4.4 | 5.5 | 8,481 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 不動産業 (2.9%) | | | |
| いちごグループホールディングス | — | 151 | 73,537 |
| 日本駐車場開発 | 116.8 | 164 | 20,336 |
| ヒューリック | 199.6 | 284.4 | 316,821 |
| 東京建物不動産販売 | 5.6 | — | — |
| 三栄建築設計 | 4.3 | 5.5 | 7,111 |
| 野村不動産ホールディングス | 64.6 | 90.5 | 180,547 |
| 三重交通グループホールディングス | 19.1 | 24.2 | 14,253 |
| サムティ | — | 9.8 | 11,162 |
| ディア・ライフ | — | 9.2 | 3,744 |
| エー・ディー・ワークス | — | 124.9 | 5,620 |
| 日本商業開発 | 3.4 | 6 | 13,944 |
| プレサンスコーポレーション | 3.6 | 4.6 | 18,561 |
| ユニゾホールディングス | 5.9 | 8.5 | 47,515 |
| 日本管理センター | 6.9 | 8.9 | 15,833 |
| サンセイランディック | 1.6 | 3.1 | 3,007 |
| エストラスト | 1.5 | 2.4 | 1,315 |
| フージャースホールディングス | 16 | 19 | 9,462 |
| オープンハウス | 7.8 | 19.7 | 52,165 |
| 東急不動産ホールディングス | 281.8 | 330 | 246,840 |
| 飯田グループホールディングス | 69.7 | 126.4 | 271,128 |
| ムゲンエステート | — | 2 | 4,510 |
| パーク24 | 54.1 | 68.9 | 216,001 |
| バラカ | 3.7 | 3.9 | 5,775 |
| 三井不動産 | 570 | 723 | 1,972,705 |
| 三菱地所 | 799 | 1,014 | 2,180,100 |
| 平和不動産 | 20.3 | 25.8 | 35,423 |
| 東京建物 | 234 | 149 | 212,176 |
| ダイビル | 27.7 | 35.1 | 36,153 |
| 京阪神ビルディング | 17.8 | 22.6 | 13,379 |
| 住友不動産 | 258 | 327 | 1,048,689 |
| 大京 | 171 | 253 | 44,528 |
| テーオーシー | 37 | 52.9 | 46,869 |
| 東京楽天地 | 18 | 22 | 10,604 |
| レオパレス21 | 117.6 | 160.7 | 113,936 |
| スターツコーポレーション | 12.3 | 15.6 | 34,039 |
| フジ住宅 | 13.7 | 17.4 | 11,832 |
| 空港施設 | 13 | 16.5 | 7,953 |
| 明和地所 | 6.2 | 7.5 | 4,725 |
| 住友不動産販売 | 7.7 | 9.8 | 21,471 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ゴールドクレスト | 9.7 | 10.7 | 16,884 |
| 日本エスリード | 4.2 | 5.3 | 5,331 |
| 日神不動産 | 14.3 | 18.1 | 6,606 |
| タカラレーベン | 47.6 | 59.5 | 44,863 |
| サンヨーハウジング名古屋 | 6 | 7 | 6,825 |
| イオンモール | 69.4 | 88 | 129,272 |
| ファースト住建 | 4 | 5.1 | 6,609 |
| トーセイ | 14.7 | 20.7 | 16,435 |
| 穴吹興産 | 10 | 15 | 3,840 |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 66.8 | 84.7 | 89,697 |
| サンフロンティア不動産 | 11.6 | 16.5 | 17,985 |
| エフ・ジェー・ネクスト | 8.2 | 11.9 | 6,045 |
| ランドビジネス | 7.2 | 8 | 2,072 |
| グランディハウス | 9.4 | 11.9 | 4,188 |
| 日本空港ビルデング | 37.1 | 43.5 | 158,340 |
| サービス業 (3.9%) | | | |
| 日本工営 | 38 | 48 | 16,944 |
| ネクスト | 13.4 | 40.8 | 51,163 |
| ジェイエイシーリクルートメント | — | 8.9 | 12,549 |
| 日本M&Aセンター | 17.6 | 22.3 | 147,403 |
| ノバレーゼ | 2.9 | 3.7 | 3,074 |
| アコーディア・ゴルフ | 42.8 | 40 | 42,160 |
| 中広 | — | 1.4 | 882 |
| タケエイ | 11.1 | 12.6 | 12,511 |
| トラスト・テック | 2 | 5.8 | 7,934 |
| パソナグループ | 8.5 | 12.5 | 8,912 |
| CDS | 2.6 | 3.3 | 2,890 |
| リンクアンドモチベーション | 15.3 | 29.1 | 4,103 |
| GCAサヴィアン | 9 | 12.8 | 13,017 |
| エス・エム・エス | 12.8 | 18 | 40,752 |
| テンブホールディングス | 22.4 | 101.2 | 164,854 |
| リニカル | 2.9 | 8.5 | 19,133 |
| クックパッド | 7.2 | 32.2 | 54,385 |
| エスクリ | 4 | 6.1 | 3,800 |
| アイ・ケイ・ケイ | 6.1 | 7.7 | 4,835 |
| 学情 | 4.2 | 5.3 | 5,830 |
| スタジオアリス | 5.2 | 6.6 | 18,585 |
| シミックホールディングス | 5.1 | 7.3 | 11,986 |
| NJS | 2.5 | 2.9 | 3,497 |
| 総合警備保障 | 38 | 48.2 | 288,718 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| カカココム | 75 | 103.6 | 212,690 |
| ルネサンス | 5.8 | 7.3 | 8,927 |
| ディップ | 2.5 | 16 | 45,168 |
| オプトホールディング | 5.1 | 9 | 6,669 |
| 新日本科学 | 10.8 | 13.7 | 7,630 |
| ツクイ | 13.5 | 17.1 | 23,341 |
| 総合臨床ホールディングス | 5.8 | — | — |
| キャリアデザインセンター | 3.1 | 3 | 2,949 |
| エムスリー | 98.5 | 125 | 400,625 |
| ツカダ・グローバルホールディング | 8.3 | 10.5 | 7,486 |
| アウトソーシング | 4.3 | 6.7 | 25,493 |
| ウエルネット | 4 | 5.4 | 21,384 |
| ディー・エヌ・エー | 56.1 | 64.7 | 118,789 |
| 博報堂DYホールディングス | 157.7 | 200.1 | 255,327 |
| ぐるなび | 13.2 | 16.7 | 45,874 |
| エスアールジータカミヤ | 9.2 | 15.6 | 8,018 |
| 一休 | 8.9 | — | — |
| ジャパンバストレスキューシステム | 12.9 | 17.9 | 4,099 |
| ファンコムコミュニケーションズ | 26.2 | 33.3 | 26,540 |
| ジェイコムホールディングス | 2.7 | 2.9 | 7,693 |
| PGMホールディングス | 16 | — | — |
| WDBホールディングス | 4.1 | 5.2 | 4,815 |
| ティア | 4.8 | 6.9 | 4,629 |
| バリューコマース | 9.3 | 13.3 | 4,788 |
| インフォマート | — | 27.8 | 27,327 |
| J Pホールディングス | 28.2 | 35.8 | 12,422 |
| E P Sホールディングス | 10.4 | 17.9 | 25,006 |
| レッグス | — | 2.8 | 1,968 |
| プレステージ・インターナショナル | 8.7 | 12.1 | 15,379 |
| アミューズ | 3.5 | 8 | 19,984 |
| ドリームインキュベータ | 3.7 | 4.8 | 11,433 |
| クイック | 5.2 | 7.4 | 5,727 |
| TAC | 5.6 | 7.9 | 1,532 |
| ケネディクス | 161.7 | 193.8 | 93,217 |
| 電通 | 126.8 | 160.9 | 921,957 |
| テイクアンドギヴ・ニーズ | 4.4 | 6.7 | 3,122 |
| びあ | 3.3 | 4.4 | 9,152 |
| イオンファンタジー | 3.7 | 5.1 | 13,132 |
| シーティーエス | — | 4.3 | 3,237 |
| ネクシィーズグループ | 4.1 | 5.2 | 14,034 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| みらかホールディングス | 29 | 36.9 | 170,478 |
| アルプス技研 | 4.6 | 5.3 | 11,559 |
| ダイオーズ | 2.4 | 2.6 | 2,805 |
| 日本空調サービス | 5.6 | 12.7 | 6,781 |
| オリエンタルランド | 123 | 156.1 | 1,150,613 |
| ダスキン | 32.2 | 37 | 74,185 |
| 明光ネットワークジャパン | 13.2 | 17.9 | 21,873 |
| ファルコホールディングス | 5.4 | 6.3 | 8,864 |
| 秀英予備校 | 2.3 | 2.6 | 1,089 |
| 田谷 | 1.9 | 2.4 | 1,672 |
| ラウンドワン | 32.3 | 45.1 | 31,028 |
| リゾートトラスト | 43 | 60.5 | 142,659 |
| ビー・エム・エル | 6.7 | 8.5 | 39,737 |
| ワタベウエディング | 3.7 | 4.3 | 2,029 |
| りらいあコミュニケーションズ | 21.2 | 23.9 | 26,624 |
| リゾー教育 | 17.6 | 26.8 | 11,068 |
| 早稲田アカデミー | 1.7 | 1.9 | 1,630 |
| ユー・エス・エス | 137.7 | 174.8 | 288,944 |
| 東京個別指導学院 | 5.5 | 7 | 4,900 |
| サイバーエージェント | 27.8 | 38 | 196,840 |
| 楽天 | 494.8 | 675.5 | 846,739 |
| テー・オー・ダブリュー | 3.4 | 11.6 | 8,212 |
| セントラルスポーツ | 3.9 | 4.9 | 11,191 |
| フルキャストホールディングス | 11.7 | 13.2 | 9,662 |
| リゾートソリューション | 11 | 14 | 4,298 |
| テクノプロ・ホールディングス | 16.1 | 23.4 | 74,295 |
| インターワークス | — | 2.5 | 2,350 |
| Keeper 技研 | — | 1.6 | 3,116 |
| ファーストロジック | — | 0.7 | 1,808 |
| リブセンス | 6.6 | 9.6 | 4,771 |
| ジャパンマテリアル | 4.7 | 6 | 16,812 |
| ベクトル | 2.5 | 4.5 | 14,062 |
| ウチヤマホールディングス | 6.6 | 7.4 | 4,269 |
| サクセスホールディングス | 1.2 | 1.3 | 1,991 |
| キャリアリンク | 1.5 | 1.9 | 3,484 |
| I B J | — | 11.2 | 6,574 |
| アサンテ | 3.8 | 5.3 | 7,250 |
| N・フィールド | — | 6.8 | 12,981 |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 0.4 | 1.8 | 3,477 |
| ライドオン・エクスプレス | — | 3.1 | 4,854 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| E R I ホールディングス | 2.9 | 3.7 | 3,259 |
| アビスト | 1.2 | 2.2 | 4,738 |
| ウィルグループ | 1.3 | 3.3 | 3,329 |
| 日本ビューホテル | — | 2.1 | 3,444 |
| リクルートホールディングス | 172.1 | 291.1 | 1,014,483 |
| エラン | — | 1.6 | 2,217 |
| 日本郵政 | — | 424.5 | 609,582 |
| ベルシステム24ホールディングス | — | 28.2 | 27,269 |
| リロ・ホールディング | 3.9 | 5.4 | 79,704 |
| 東祥 | 2.4 | 4.3 | 17,522 |
| エイチ・アイ・エス | 18.5 | 23.5 | 66,246 |
| ラックランド | — | 2 | 3,414 |
| 共立メンテナンス | 6.8 | 10.9 | 95,157 |
| イチネンホールディングス | 11.9 | 15.1 | 15,432 |
| 建設技術研究所 | 6.7 | 8.5 | 7,607 |
| スペース | 6.1 | 7.8 | 10,241 |
| 燦ホールディングス | 2.3 | 2.9 | 3,987 |
| スバル興業 | 8 | 10 | 3,800 |
| 東京テアトル | 43 | 55 | 6,545 |
| ナガワ | — | 2.6 | 8,073 |
| よみうりランド | 23 | 29 | 14,442 |
| 東京都競馬 | 78 | 99 | 21,978 |
| 常磐興産 | 42 | 53 | 8,056 |
| カナモト | 15.9 | 20.1 | 53,144 |
| 東京ドーム | 78 | 115 | 51,980 |
| 西尾レントオール | 9.2 | 11.6 | 32,294 |
| トランス・コスモス | 14.9 | 16.8 | 51,912 |
| 乃村工藝社 | 22.3 | 30.9 | 55,496 |
| 藤田観光 | 41 | 52 | 26,780 |
| 日本管財 | 5.6 | 12.4 | 19,046 |
| トーカイ | 5 | 6.4 | 20,768 |
| 白洋舎 | 12 | 15 | 3,825 |
| セコム | 110.5 | 150.2 | 1,274,296 |
| セントラル警備保障 | 5 | 6.4 | 13,600 |
| 丹青社 | 13.1 | 27 | 23,949 |
| メイテック | 15.2 | 17.5 | 66,937 |
| アサツー ディ・ケイ | 21.4 | 25.3 | 69,524 |
| 応用地質 | 11.9 | 13.6 | 15,544 |
| 船井総研ホールディングス | 12.3 | 20.1 | 33,245 |
| 進学会 | 4.7 | 6.9 | 3,836 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|--------------|---------|------|-------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| オオバ | — | 10.5 | — | 4,987 |
| 学究社 | — | 2.1 | — | 2,499 |
| ベネッセホールディングス | 41.6 | 48.4 | — | 118,628 |
| イオンディライト | — | 11 | — | 42,464 |
| ナック | — | 7.6 | — | 8,078 |
| ニチイ学館 | — | 22.2 | — | 17,795 |
| ダイセキ | — | 18.3 | — | 56,042 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|------|-----------|---------|---------|-------------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| ステップ | 3.8 | — | 4.8 | 5,083 |
| 合 計 | 株 数 ・ 金 額 | 182,431 | 229,846 | 273,159,048 |
| | 銘柄数<比率> | 1,866 | 1,937 | <97.7%> |

*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいています。

*銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

*評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別 | 当 期 末 | |
|----|--------|-------|-------|
| | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 | 株式先物取引 | TOPIX | |
| | | 百万円 | 百万円 |
| | | 6,324 | — |

*単位未満は切り捨て。

○有価証券の貸付及び借入の状況

2016年5月10日現在における貸付株式の総株数は20,484,900株（うち野村證券株式会社への貸付は2,867,700株）です。

○投資信託財産の構成

(2016年5月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 | % |
| | 273,159,048 | 89.6 |
| コール・ローン等、その他 | 31,767,343 | 10.4 |
| 投資信託財産総額 | 304,926,391 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | 円 |
|-----------------|------------------|---|
| (A) 資産 | 304,877,753,055 | |
| コール・ローン等 | 25,676,445,531 | |
| 株式(評価額) | 273,159,048,910 | |
| 未収入金 | 2,902,546,302 | |
| 未収配当金 | 2,755,194,960 | |
| 未収利息 | 698,546 | |
| その他未収収益 | 2,242,816 | |
| 差入委託証拠金 | 381,575,990 | |
| (B) 負債 | 25,385,543,691 | |
| 未払金 | 154,972 | |
| 未払解約金 | 3,275,021,197 | |
| 未払利息 | 45,549 | |
| 受入担保金 | 22,110,321,973 | |
| (C) 純資産総額(A-B) | 279,492,209,364 | |
| 元本 | 224,682,172,660 | |
| 次期繰越損益金 | 54,810,036,704 | |
| (D) 受益権総口数 | 224,682,172,660口 | |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,439円 | |

(注) 期首元本額は178,095,641,491円、期中追加設定元本額は75,955,719,903円、期中一部解約元本額は29,369,188,734円、1口当たり純資産額は1.2439円です。

○損益の状況 (2015年5月12日～2016年5月10日)

| 項 目 | 当 期 | 円 |
|------------------|-----------------|---|
| (A) 配当等収益 | 5,624,735,002 | |
| 受取配当金 | 5,554,570,420 | |
| 受取利息 | 9,926,919 | |
| その他収益金 | 65,058,265 | |
| 支払利息 | △ 4,820,602 | |
| (B) 有価証券売買損益 | △48,465,869,243 | |
| 売買益 | 10,531,425,228 | |
| 売買損 | △58,997,294,471 | |
| (C) 先物取引等取引損益 | △ 669,146,971 | |
| 取引益 | 1,098,586,801 | |
| 取引損 | △ 1,767,733,772 | |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △43,510,281,212 | |
| (E) 前期繰越損益金 | 81,819,660,427 | |
| (F) 追加信託差損益金 | 28,007,913,062 | |
| (G) 解約差損益金 | △11,507,255,573 | |
| (H) 計(D+E+F+G) | 54,810,036,704 | |
| 次期繰越損益金(H) | 54,810,036,704 | |

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 | 円 |
|------------------------------------|----------------|---|
| | 元本額 | |
| 野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け) | 77,277,849,552 | |
| 野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け) | 31,998,627,541 | |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 17,327,003,764 | |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 12,778,491,507 | |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 9,260,029,578 | |
| 野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX | 8,533,816,104 | |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 7,641,562,531 | |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 6,463,310,792 | |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 5,311,571,751 | |
| グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 4,855,577,506 | |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 4,313,238,920 | |
| のむらっぴ・ファンド(普通型) | 3,844,336,574 | |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 3,330,219,910 | |
| マイバランスDC50 | 3,022,781,736 | |
| マイ・ロード | 2,939,611,705 | |
| マイバランスDC70 | 2,740,408,083 | |
| マイバランスDC30 | 2,320,362,707 | |
| 野村・国内株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用) | 2,320,011,299 | |
| のむらっぴ・ファンド(保守型) | 1,688,102,560 | |

| ファンド名 | 当期末 |
|-------------------------------------|---------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村インデックスファンド・TOPIX | 1,580,532,805 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 1,523,794,516 |
| 野村日本株式インデックスファンド(適格機関投資家専用) | 1,281,554,849 |
| グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 1,260,205,192 |
| 野村日本株インデックス(野村SMA・EW向け) | 1,248,594,557 |
| のむらっぴ・ファンド(積極型) | 1,228,404,374 |
| 野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用) | 972,383,375 |
| グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 913,559,958 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 710,209,195 |
| ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用) | 558,570,457 |
| ノムラF0Fs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用) | 533,273,405 |
| バランスセレクト70 | 530,861,503 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用) | 504,787,804 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用) | 490,441,659 |
| バランスセレクト50 | 469,388,376 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 468,696,415 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用) | 419,192,654 |
| 野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型 | 329,004,882 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 314,083,726 |
| バランスセレクト30 | 202,918,016 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 134,620,850 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 128,079,526 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 109,239,024 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 100,629,740 |
| 国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け) | 97,794,485 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 93,518,788 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け) | 91,136,796 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用) | 79,240,330 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用) | 48,290,202 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 45,415,062 |
| バランスセレクト70(確定拠出年金向け) | 39,785,596 |
| バランスセレクト50(確定拠出年金向け) | 39,678,696 |
| 野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用) | 33,561,471 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 30,204,723 |
| ネクストコア | 28,959,499 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用) | 19,426,085 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 17,717,072 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用) | 15,307,770 |
| バランスセレクト30(確定拠出年金向け) | 10,136,612 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 7,217,593 |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け) | 1,503,377 |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け) | 988,801 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 783,143 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 472,950 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 433,737 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 343,932 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 314,962 |

○お知らせ

信託金限度額を、1兆円から2兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日:2016年4月15日>

外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日2016年3月31日）

作成対象期間（2015年4月1日～2016年3月31日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 投資信託 証券 組入比率 | 純資 産額 |
|-----------------|--------|-------|--------------------------------------|-------|------------|------------|--------------------|----------|
| | 期騰落率 | 中率 | MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし) | 期騰落率 | | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 10期(2012年4月2日) | 10,652 | 0.7 | 112.00 | 1.1 | 95.9 | 2.1 | 2.0 | 223,329 |
| 11期(2013年4月1日) | 13,577 | 27.5 | 143.46 | 28.1 | 95.4 | 2.2 | 2.3 | 248,694 |
| 12期(2014年3月31日) | 17,747 | 30.7 | 187.86 | 30.9 | 96.6 | 1.2 | 2.1 | 270,114 |
| 13期(2015年3月31日) | 22,274 | 25.5 | 236.44 | 25.9 | 95.4 | 2.1 | 2.4 | 331,520 |
| 14期(2016年3月31日) | 20,145 | △ 9.6 | 214.69 | △ 9.2 | 94.8 | 2.5 | 2.7 | 326,431 |

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし)は、基準価額への反映を考慮して、営業日前日のMSCI-KOKUSAI指数(米ドルベース)をもとに、営業日当日の米ドル為替レート(対顧客電信売買相場仲値)で当社が円換算しています。なお、設定時を100として再指数化しています。(以下同じ)

*MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。ここに記載されたいかなるファンドも、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者のいかなる者がその合法性および適合性に関して判断したのではなく、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。請求目録見書には、MSCIが野村アセットマネジメント株式会社およびその関連するファンドと有する限定的な関係について、より詳細な記述があります。

(出所) MSCI

○当期中の基準価額と市況等の推移

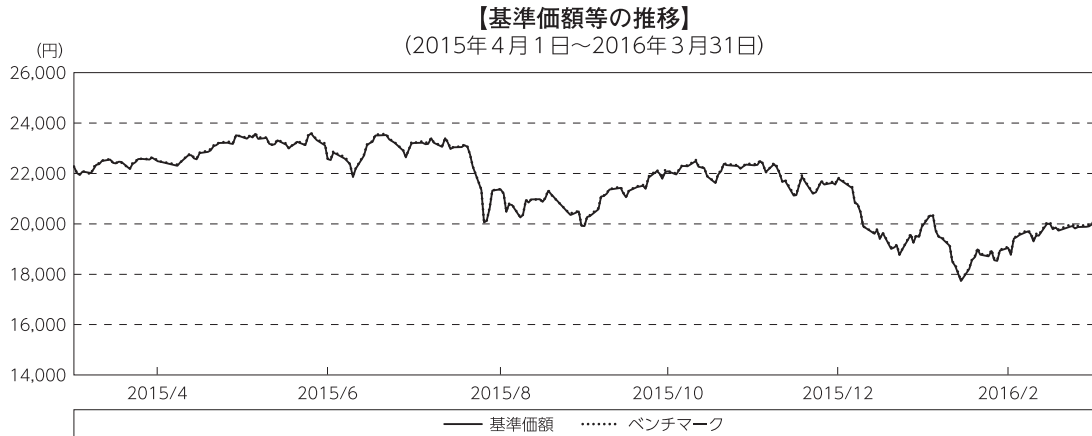
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 株式 組入比率 | 株式 先物比率 | 投資信託 証券 組入比率 |
|------------|--------|-------|--------------------------------------|-------|------------|------------|--------------------|
| | 騰落率 | 中率 | MSCI-KOKUSAI指数 (円ベース・ 為替ヘッジなし) | 騰落率 | | | |
| (期首) | 円 | % | | % | % | % | % |
| 2015年3月31日 | 22,274 | — | 236.44 | — | 95.4 | 2.1 | 2.4 |
| 4月末 | 22,487 | 1.0 | 239.12 | 1.1 | 96.1 | 1.4 | 2.3 |
| 5月末 | 23,500 | 5.5 | 249.44 | 5.5 | 95.8 | 1.7 | 2.3 |
| 6月末 | 22,572 | 1.3 | 239.69 | 1.4 | 95.9 | 1.8 | 2.3 |
| 7月末 | 23,208 | 4.2 | 246.51 | 4.3 | 95.2 | 2.4 | 2.3 |
| 8月末 | 21,367 | △ 4.1 | 227.01 | △ 4.0 | 95.6 | 1.9 | 2.4 |
| 9月末 | 19,912 | △10.6 | 211.50 | △10.6 | 95.7 | 1.6 | 2.5 |
| 10月末 | 22,085 | △ 0.8 | 234.56 | △ 0.8 | 95.1 | 1.4 | 2.5 |
| 11月末 | 22,329 | 0.2 | 237.53 | 0.5 | 96.0 | 1.4 | 2.5 |
| 12月末 | 21,802 | △ 2.1 | 231.74 | △ 2.0 | 95.4 | 1.9 | 2.5 |
| 2016年1月末 | 19,870 | △10.8 | 211.35 | △10.6 | 95.1 | 2.2 | 2.6 |
| 2月末 | 19,044 | △14.5 | 202.69 | △14.3 | 95.4 | 1.8 | 2.6 |
| (期末) | | | | | | | |
| 2016年3月31日 | 20,145 | △ 9.6 | 214.69 | △ 9.2 | 94.8 | 2.5 | 2.7 |

*騰落率は期首比です。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首22,274円から期末20,145円に2,129円の値下がりとなりました。

中国人民元の通貨切り下げをきっかけとした世界的な景気減速懸念や、原油価格の下落、米ドルが対円で下落（円高）したことを受けて、基準価額は下落しました。

○投資環境

期首より、米国の経済指標が改善し景気に対する不安感が後退したことや、ECB（欧州中央銀行）の金融緩和姿勢が維持されるとの見方が強まり、欧米の株式市場は上昇しました。

2015年6月以降は、米国の利上げに対する見方や、ギリシャの債務問題の進展状況などを巡り、一進一退の展開となり、8月に中国人民元の通貨切り下げをきっかけに世界的な景気減速懸念が高まり大幅な下落となりました。

10月になると、米企業業績が総じて市場予想を上回ったことや中国の追加金融緩和などを背景に上昇に転じましたが、12月には、ECBによる追加金融緩和が市場予想を下回る内容になったことや、原油など商品価格が一段と低下したことを受け、再び下落しました。さらに、2016年1月には、原油価格の下落が続いたことからリスク回避姿勢が強まり、世界の株式市場は大幅に下落しました。

2月中旬になると、原油価格が持ち直したことや市場予想を上回る米国経済指標の発表などを背景に上昇に転じました。その後も原油など商品価格の上昇やFOMC（米連邦公開市場委員会）声明で年内利上げペースの減速が示唆されたことなどを背景に世界の株式市場は上昇しました。

為替市場は、2015年5月中旬に米住宅着工件数が大幅に増加したことや、FRB（米連邦準備制度理事会）議長が年内の利上げ見通しを示したことから、米ドルは対円で上昇（円安）しました。その後、8月には、世界的な景気減速懸念からリスク回避姿勢が強まり、ドルが対円で下落（円高）しました。11月に入り、堅調な10月の米雇用統計などを受け米国の年内利上げ観測が高まり、米ドルは対円で上昇（円安）しましたが、12月以降は、原油価格や世界的な株式市場の下落を背景に、米ドルは対円で大幅に下落（円高）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

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

・期中の主な動き

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-9.6%となり、ベンチマークであるMSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の-9.2%を0.4ポイント下回りました。

主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

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

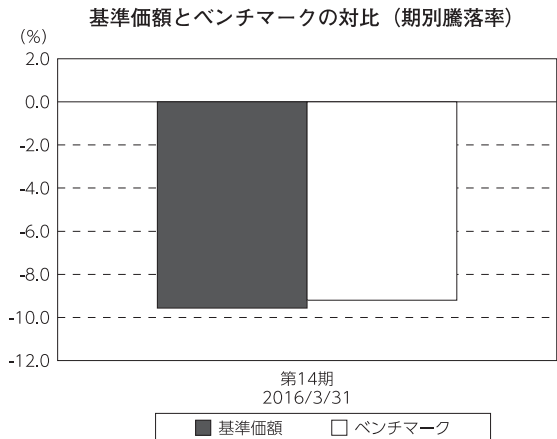
（その他、差異を生じた要因）

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

◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



（注）ベンチマークは、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）です。

○ 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 額 | | 売 付 額 | |
|------------------------------------|-----------------------|-------------------|---------------------|-------------------|
| | 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 ー 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 額 | | 売 付 額 | | |
|-----|-----------------------|----------------------|---------------------|-----------------|--------|
| | 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 | $\frac{B}{A}$ | 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 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 |
| ACUIITY 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 CORPORATTON | 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 |
| ENVISION HEALTHCARE HOLDINGS | — | 188 | 384 | 43,363 | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| EQUIFAX INC | 106 | 113 | 1,287 | 145,027 | 専門サービス |
| EVERSOURCE ENERGY | 278 | 309 | 1,804 | 203,303 | 電力 |
| EXELON CORPORATION | 745 | 894 | 3,167 | 356,907 | 電力 |
| EXPEDIA INC | 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 | ソフトウェア |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 31 | 35 | 2,129 | 239,994 | ヘルスケア機器・用品 |
| IONIS PHARMACEUTICALS INC | — | 121 | 467 | 52,669 | バイオテクノロジー |
| ISIS PHARMACEUTICALS INC | 99 | — | — | — | バイオテクノロジー |
| JPMORGAN CHASE & CO | 3,255 | 3,556 | 21,232 | 2,392,520 | 銀行 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 120 | 123 | 538 | 60,663 | 建設・土木 |
| JARDEN CORP | 156 | 200 | 1,177 | 132,646 | 家庭用耐久財 |
| JOHNSON & JOHNSON | 2,437 | 2,672 | 29,119 | 3,281,180 | 医薬品 |
| JOHNSON CONTROLS INC | 584 | 619 | 2,406 | 271,183 | 自動車部品 |
| JONES LANG LASALLE INC | — | 42 | 487 | 54,881 | 不動産管理・開発 |
| JOY GLOBAL INC | 91 | — | — | — | 機械 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 327 | 335 | 854 | 96,294 | 通信機器 |
| KLA TENCOR CORP | 142 | 150 | 1,088 | 122,640 | 半導体・半導体製造装置 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 97 | 108 | 926 | 104,413 | 陸運・鉄道 |
| KELLOGG CO | 235 | 257 | 1,974 | 222,490 | 食品 |
| KEURIG GREEN MOUNTAIN INC | 106 | — | — | — | 食品 |
| KEYCORP | 765 | 810 | 903 | 101,766 | 銀行 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 324 | 351 | 4,763 | 536,742 | 家庭用品 |
| KINDER MORGAN INC | 1,571 | 1,836 | 3,279 | 369,488 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| 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 | | 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 | |
| | 270,024 | 303,589 | 1,772,005 | 199,669,611 | |
| 銘 柄 数 < 比 率 > | 594 | 599 | — | < 61.2% > | |
| (カナダ) | | | 千カナダドル | | |
| ARC RESOURCES LTD | 263 | 335 | 621 | 53,904 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 186 | 206 | 981 | 85,210 | 金属・鉱業 |
| AGRIUM INC | 124 | 126 | 1,476 | 128,109 | 化学 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD-B | 364 | 401 | 2,321 | 201,473 | 食品・生活必需品小売り |
| ALTAGAS LTD | 121 | 141 | 455 | 39,563 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ATCO LTD CL1 | 68 | 68 | 267 | 23,252 | 総合公益事業 |
| BCE INC | 118 | 141 | 837 | 72,726 | 各種電気通信サービス |
| BANK OF MONTREAL | 565 | 618 | 4,883 | 423,833 | 銀行 |
| BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX | 1,062 | 1,162 | 7,384 | 640,901 | 銀行 |
| BARRICK GOLD | 1,015 | 1,130 | 2,013 | 174,765 | 金属・鉱業 |
| BAYTEX ENERGY CORP | 144 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| BLACKBERRY LTD | 439 | 509 | 528 | 45,854 | コンピュータ・周辺機器 |
| BOMBARDIER B SHEARS | 1,160 | 1,670 | 220 | 19,131 | 航空宇宙・防衛 |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 496 | 847 | 3,832 | 332,637 | 不動産管理・開発 |
| CAE INC | 212 | 260 | 390 | 33,870 | 航空宇宙・防衛 |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | — | 26 | 646 | 56,133 | 容器・包装 |
| CI FINANCIAL CORP | 205 | 226 | 652 | 56,646 | 資本市場 |
| CAMECO CORP | 346 | 386 | 654 | 56,784 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | 345 | 383 | 3,745 | 325,092 | 銀行 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 712 | 769 | 6,249 | 542,408 | 陸運・鉄道 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | 956 | 1,063 | 3,684 | 319,765 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CANADIAN OIL SANDS LTD | 420 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 149 | 140 | 2,432 | 211,116 | 陸運・鉄道 |
| CANADIAN TIRE CORP LTD A | 64 | 70 | 938 | 81,445 | 複合小売り |
| CANADIAN UTILITIES LTD A | 106 | 124 | 449 | 39,055 | 総合公益事業 |
| CATAMARAN CORP | 177 | — | — | — | ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス |
| CENOVUS ENERGY INC | 711 | 790 | 1,345 | 116,764 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| CONSTELLATION SOFTWARE | 15 | 17 | 966 | 83,891 | ソフトウェア |
| CRESCENT POINT ENERGY CORP | 355 | 488 | 876 | 76,109 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| DOLLARAMA INC | 108 | 115 | 1,022 | 88,739 | 複合小売り |
| ELDORADO GOLD CORPORATION | 628 | 628 | 254 | 22,128 | 金属・鉱業 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | | 業 種 等 |
|-------------------------------------|---------|-------|--------|---------|----------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (カナダ) | 百株 | 百株 | 千カナダドル | 千円 | |
| ELEMENT FINANCIAL CORP | — | 360 | 496 | 43,117 | 各種金融サービス |
| EMPIRE CO LTD A | 46 | 162 | 364 | 31,663 | 食品・生活必需品小売り |
| ENCANA CORP | 720 | 790 | 605 | 52,588 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ENBRIDGE INC | 738 | 883 | 4,422 | 383,867 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| ENERPLUS CORP | 187 | — | — | — | 石油・ガス・消耗燃料 |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 17 | 21 | 1,556 | 135,080 | 保険 |
| FINNING INTERNATIONAL INC | 149 | 149 | 283 | 24,634 | 商社・流通業 |
| FIRST CAPITAL REALTY INC | 77 | 113 | 233 | 20,281 | 不動産管理・開発 |
| FIRST QUANTUM MINERALS LTD | 510 | 704 | 475 | 41,242 | 金属・鉱業 |
| FORTIS INC | 235 | 273 | 1,104 | 95,888 | 電力 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 135 | 165 | 1,341 | 116,424 | 金属・鉱業 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 208 | 231 | 902 | 78,309 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| GOLDCORP INC | 707 | 800 | 1,700 | 147,612 | 金属・鉱業 |
| GREAT-WEST 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 | 金 額 | 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 銘柄 数 < 比 率 > | 14,380 38 | 16,053 39 | 100,859 — | 11,774,300 < 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 銘柄 数 < 比 率 > | 19,174 31 | 22,475 30 | 276,354 — | 3,827,514 < 1.2% > | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 |
|------------------------------|---------------------|-------------|-------------|--------------|-------------------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| (ノルウェー) | 百株 | 百株 | 千ノルウェークローネ | 千円 | |
| DNB ASA | 829 | 956 | 9,397 | 127,429 | 銀行 |
| TELENOR ASA | 656 | 719 | 10,037 | 136,104 | 各種電気通信サービス |
| SCHIBSTED ASA | — | 78 | 1,835 | 24,887 | メディア |
| SUBSEA 7 SA | 259 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| STATOIL ASA | 982 | 1,055 | 13,915 | 188,693 | 石油・ガス・消耗燃料 |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 157 | 168 | 5,409 | 73,354 | 化学 |
| SEADRILL LTD | 338 | — | — | — | エネルギー設備・サービス |
| NORSK HYDRO | 1,160 | 1,300 | 4,457 | 60,446 | 金属・鉱業 |
| ORKLA ASA | 688 | 800 | 6,056 | 82,119 | 食品 |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 172 | 197 | 2,791 | 37,852 | 保険 |
| SCHIBSTED ASA-B SHS | — | 91 | 2,026 | 27,480 | メディア |
| 小 計 | 株 数 銘柄 数 < 比 率 > | 5,241 9 | 5,364 9 | 55,926 — | 758,368 <0.2%> |
| (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 銘柄 数 < 比 率 > | 4,004 14 | 4,722 16 | 150,402 — | 2,577,901 <0.8%> |
| (ユーロ…ドイツ) | | | 千ユーロ | | |
| ADIDAS AG | 177 | 202 | 2,112 | 269,819 | 繊維・アパレル・贅沢品 |
| 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 | |
| BRENTAG 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 | 株数 | 当期 | | 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 | 株数 | 期末 | | 業種等 | |
|--|------------------|--------------|--------------|-------------|---------------------|--|
| | | | 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 銘柄数<比率> | 14,576 22 | 17,766 24 | 30,745 — | 3,926,239 <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 銘柄数<比率> | 55,276 28 | 51,327 25 | 32,311 — | 4,126,231 <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 銘柄数<比率> | 1,758 11 | 1,947 11 | 14,842 — | 1,895,353 <0.6%> | |
| (ユーロ…オーストリア) | | | | | | |
| OMV AG | 125 | 140 | 354 | 45,267 | 石油・ガス・消耗燃料 | |

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

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | | 業 種 等 | |
|--------------------------------------|--------------|--------|-----------|---------|----------------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (香港) | 百株 | 百株 | 千香港ドル | 千円 | | |
| LI & FUNG LTD | 4,936 | 5,636 | 2,570 | 37,342 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| MTR CORP | 1,305 | 1,395 | 5,335 | 77,530 | 陸運・鉄道 | |
| FIRST PACIFIC CO | 2,260 | 2,260 | 1,285 | 18,684 | 各種金融サービス | |
| HANG SENG BANK | 670 | 730 | 9,928 | 144,253 | 銀行 | |
| HENDERSON LAND | 936 | 1,110 | 5,389 | 78,314 | 不動産管理・開発 | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LTD | 1,170 | 1,350 | 10,692 | 155,354 | 電力 | |
| WHARF(HOLDING) | 1,330 | 1,330 | 5,685 | 82,613 | 不動産管理・開発 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 5,514 | 6,625 | 9,567 | 139,012 | ガス | |
| HUTCHISON WHAMPOA | 1,850 | — | — | — | コングロマリット | |
| HYSAN DEVELOPMENT | 540 | 650 | 2,135 | 31,025 | 不動産管理・開発 | |
| GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | 2,060 | 2,230 | 6,611 | 96,071 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| KERRY PROPERTIES | 570 | 570 | 1,199 | 17,433 | 不動産管理・開発 | |
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 3,145 | 3,635 | 8,305 | 120,685 | 銀行 | |
| NWS HOLDINGS LTD | 1,355 | 1,355 | 1,658 | 24,098 | コングロマリット | |
| PCCW LTD | 3,860 | 3,860 | 1,937 | 28,155 | 各種電気通信サービス | |
| YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG | 620 | 750 | 2,010 | 29,205 | 繊維・アパレル・贅沢品 | |
| NEW WORLD DEVELOPMENT | 4,666 | 5,166 | 3,864 | 56,153 | 不動産管理・開発 | |
| SHANGRI-LA ASIA LTD | 743 | 1,083 | 971 | 14,119 | ホテル・レストラン・レジャー | |
| SINO LAND CO.LTD | 2,560 | 2,860 | 3,540 | 51,446 | 不動産管理・開発 | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 1,490 | 1,680 | 16,077 | 233,607 | 不動産管理・開発 | |
| 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 | 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 | 期末 | | | 業種等 | |
|------------------------------|---------|-----------|-----------|-------------|-------------------------|--|
| | | 株数 | 評価額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| (オーストラリア) | 百株 | 百株 | 千豪ドル | 千円 | | |
| 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 | 株式先物取引 | | 百万円 | 百万円 |
| | | 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>

国内債券マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2016年5月10日）

作成対象期間（2015年5月12日～2016年5月10日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク NOMURA-BPI国債 | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-----|------------------------|-----|-------|--------|-------|
| | 騰落 | 率 | 騰落 | 率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 11期(2012年5月10日) | 11,945 | 3.1 | 349.929 | 3.1 | 99.2 | — | 5,536 |
| 12期(2013年5月10日) | 12,185 | 2.0 | 357.008 | 2.0 | 99.2 | — | 6,182 |
| 13期(2014年5月12日) | 12,400 | 1.8 | 363.350 | 1.8 | 99.1 | — | 6,349 |
| 14期(2015年5月11日) | 12,749 | 2.8 | 373.608 | 2.8 | 99.3 | — | 6,933 |
| 15期(2016年5月10日) | 13,701 | 7.5 | 401.668 | 7.5 | 99.5 | — | 8,223 |

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

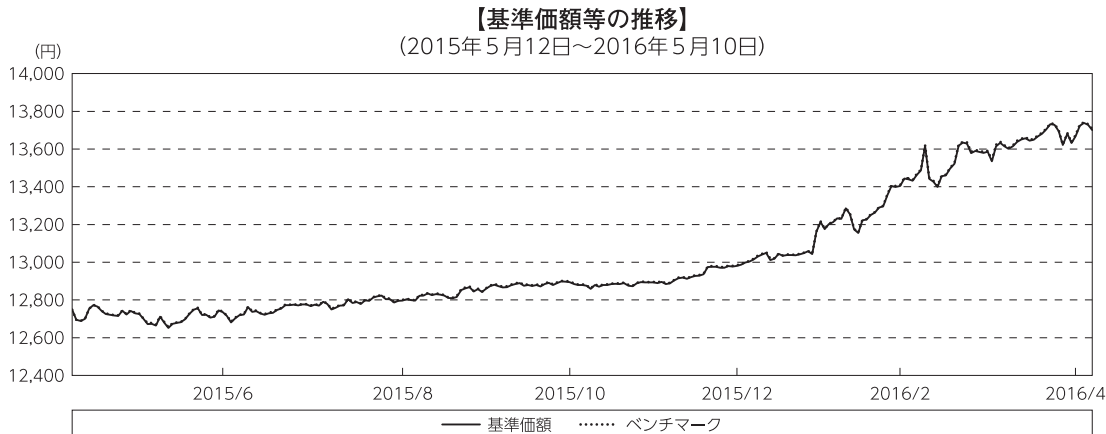
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク NOMURA-BPI国債 | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|--------|------|------------------------|------|-------|--------|
| | 騰落 | 率 | 騰落 | 率 | | |
| (期首) 2015年5月11日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 12,749 | — | 373.608 | — | 99.3 | — |
| 5月末 | 12,742 | △0.1 | 373.501 | △0.0 | 98.0 | — |
| 6月末 | 12,736 | △0.1 | 373.286 | △0.1 | 98.4 | — |
| 7月末 | 12,775 | 0.2 | 374.442 | 0.2 | 98.5 | — |
| 8月末 | 12,797 | 0.4 | 375.113 | 0.4 | 97.7 | — |
| 9月末 | 12,842 | 0.7 | 376.397 | 0.7 | 97.7 | — |
| 10月末 | 12,895 | 1.1 | 378.001 | 1.2 | 98.4 | — |
| 11月末 | 12,893 | 1.1 | 377.894 | 1.1 | 98.1 | — |
| 12月末 | 12,981 | 1.8 | 380.531 | 1.9 | 97.6 | — |
| 2016年1月末 | 13,161 | 3.2 | 385.751 | 3.2 | 97.2 | — |
| 2月末 | 13,405 | 5.1 | 392.964 | 5.2 | 99.1 | — |
| 3月末 | 13,535 | 6.2 | 396.850 | 6.2 | 99.6 | — |
| 4月末 | 13,669 | 7.2 | 400.751 | 7.3 | 99.5 | — |
| (期末) 2016年5月10日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 13,701 | 7.5 | 401.668 | 7.5 | 99.5 | — |

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首12,749円から期末13,701円に952円の値上がりとなりました。

世界的な株価下落に伴い世界経済の先行きに不透明感が高まりました。また日銀による国債買い入れの平均残存年限長期化やマイナス金利政策の導入などを背景に、国内債券利回りが低下（価格は上昇）したため、基準価額は上昇しました。

○投資環境

期首から2015年6月中旬にかけては、円安の進行や2015年1-3月期実質GDP（国内総生産）成長率が景気の拡大を示したことを受けて国内株式市場が上昇したことなどから、国内債券市場は軟調となりました。その後は8月中旬から9月下旬や2016年1月から2月中旬にかけては、世界的な株価下落に伴い世界経済の先行きに不透明感が高まりました。日銀が国債買い入れの平均残存年限長期化を発表したことや、マイナス金利政策の導入を決定したことなどを背景に、国内債券市場は堅調となり国内債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

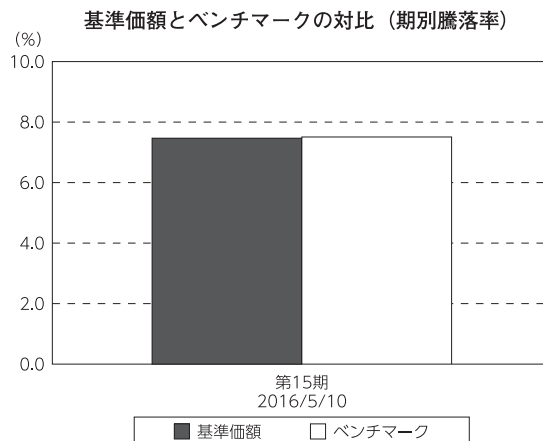
○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+7.5%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI国債の+7.5%とほぼ同水準となりました。主な差異要因は以下の通りです。

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



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI国債です。

◎今後の運用方針

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

今後とも引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2015年5月12日～2016年5月10日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2015年5月12日～2016年5月10日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|------|-----------|-----------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国内 | 国債証券 | 3,775,197 | 3,040,399 |

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月12日～2016年5月10日)

利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|-----|-----------|--------------------|---------------|-----------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 公社債 | 3,775 | 288 | 7.6 | 3,040 | 210 | 6.9 |
| 預金 | 1,919 | 1,919 | 100.0 | 1,919 | 1,919 | 100.0 |

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

○組入資産の明細

(2016年5月10日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

| 区分 | 当 期 末 | | | | | | |
|------|------------------------|------------------------|----------------|-----------------|----------------|--------------|--------------|
| | 額面金額 | 評価額 | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| 千円 | 千円 | % | % | % | % | % | |
| 国債証券 | 7,160,000 (10,000) | 8,184,897 (16,223) | 99.5 (0.2) | — (—) | 64.8 (0.2) | 23.8 (—) | 11.0 (—) |
| 合 計 | 7,160,000 (10,000) | 8,184,897 (16,223) | 99.5 (0.2) | — (—) | 64.8 (0.2) | 23.8 (—) | 11.0 (—) |

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 銘柄 | 当期末 | | |
|------|--------------|-----|---------|---------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 |
| | | % | 千円 | 千円 |
| 国債証券 | | | | |
| 国庫債券 | 利付(2年)第355回 | 0.1 | 60,000 | 60,284 |
| 国庫債券 | 利付(2年)第357回 | 0.1 | 100,000 | 100,544 |
| 国庫債券 | 利付(2年)第360回 | 0.1 | 130,000 | 130,799 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第105回 | 0.2 | 50,000 | 50,255 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第106回 | 0.2 | 40,000 | 40,253 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第107回 | 0.2 | 40,000 | 40,300 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第108回 | 0.1 | 60,000 | 60,353 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第110回 | 0.3 | 20,000 | 20,208 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第111回 | 0.4 | 40,000 | 40,492 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第112回 | 0.4 | 30,000 | 30,419 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第113回 | 0.3 | 50,000 | 50,593 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第114回 | 0.3 | 20,000 | 20,265 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第115回 | 0.2 | 60,000 | 60,654 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第116回 | 0.2 | 50,000 | 50,597 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第117回 | 0.2 | 80,000 | 81,034 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第118回 | 0.2 | 50,000 | 50,704 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第119回 | 0.1 | 40,000 | 40,438 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第120回 | 0.2 | 20,000 | 20,301 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第121回 | 0.1 | 40,000 | 40,467 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第122回 | 0.1 | 80,000 | 81,004 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第123回 | 0.1 | 170,000 | 172,247 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第124回 | 0.1 | 80,000 | 81,128 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第125回 | 0.1 | 70,000 | 71,032 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第126回 | 0.1 | 70,000 | 71,092 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第1回 | 2.4 | 10,000 | 16,223 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第2回 | 2.2 | 10,000 | 15,776 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第3回 | 2.2 | 20,000 | 31,825 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第4回 | 2.2 | 15,000 | 24,069 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第5回 | 2.0 | 28,000 | 43,479 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第6回 | 1.9 | 20,000 | 30,619 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第7回 | 1.7 | 30,000 | 44,127 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第8回 | 1.4 | 20,000 | 27,417 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第287回 | 1.9 | 50,000 | 51,204 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第288回 | 1.7 | 65,000 | 66,745 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第289回 | 1.5 | 100,000 | 102,850 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第290回 | 1.4 | 50,000 | 51,542 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第291回 | 1.3 | 20,000 | 20,579 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第292回 | 1.7 | 35,000 | 36,275 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第293回 | 1.8 | 30,000 | 31,305 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第294回 | 1.7 | 40,000 | 41,656 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第295回 | 1.5 | 25,000 | 25,929 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第296回 | 1.5 | 65,000 | 67,706 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第297回 | 1.4 | 40,000 | 41,727 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第298回 | 1.3 | 20,000 | 20,811 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第299回 | 1.3 | 45,000 | 46,998 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第300回 | 1.5 | 35,000 | 36,755 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第301回 | 1.5 | 45,000 | 47,458 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | |
|---------------------|-----|-----|---------|---------|------------|
| | 利 | 率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 国債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券 利付 (10年) 第302回 | | 1.4 | 40,000 | 42,059 | 2019/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第303回 | | 1.4 | 45,000 | 47,498 | 2019/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第304回 | | 1.3 | 30,000 | 31,564 | 2019/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第305回 | | 1.3 | 90,000 | 95,044 | 2019/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第306回 | | 1.4 | 45,000 | 47,871 | 2020/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第307回 | | 1.3 | 30,000 | 31,797 | 2020/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第308回 | | 1.3 | 30,000 | 31,916 | 2020/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第309回 | | 1.1 | 40,000 | 42,222 | 2020/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第310回 | | 1.0 | 30,000 | 31,631 | 2020/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第311回 | | 0.8 | 20,000 | 20,911 | 2020/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第312回 | | 1.2 | 70,000 | 74,679 | 2020/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第314回 | | 1.1 | 30,000 | 31,958 | 2021/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第315回 | | 1.2 | 50,000 | 53,708 | 2021/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第316回 | | 1.1 | 10,000 | 10,690 | 2021/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第317回 | | 1.1 | 30,000 | 32,173 | 2021/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第318回 | | 1.0 | 80,000 | 85,361 | 2021/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第319回 | | 1.1 | 30,000 | 32,275 | 2021/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第320回 | | 1.0 | 110,000 | 117,719 | 2021/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第321回 | | 1.0 | 40,000 | 42,932 | 2022/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第322回 | | 0.9 | 30,000 | 32,021 | 2022/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第323回 | | 0.9 | 20,000 | 21,399 | 2022/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第324回 | | 0.8 | 70,000 | 74,465 | 2022/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第325回 | | 0.8 | 70,000 | 74,652 | 2022/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第326回 | | 0.7 | 40,000 | 42,481 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第327回 | | 0.8 | 40,000 | 42,750 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第328回 | | 0.6 | 90,000 | 95,135 | 2023/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第329回 | | 0.8 | 70,000 | 75,100 | 2023/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第330回 | | 0.8 | 50,000 | 53,754 | 2023/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第331回 | | 0.6 | 60,000 | 63,608 | 2023/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第332回 | | 0.6 | 60,000 | 63,683 | 2023/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第333回 | | 0.6 | 20,000 | 21,251 | 2024/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第334回 | | 0.6 | 40,000 | 42,549 | 2024/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第335回 | | 0.5 | 50,000 | 52,818 | 2024/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第336回 | | 0.5 | 40,000 | 42,285 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第337回 | | 0.3 | 10,000 | 10,396 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第338回 | | 0.4 | 160,000 | 167,745 | 2025/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第339回 | | 0.4 | 50,000 | 52,442 | 2025/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第340回 | | 0.4 | 25,000 | 26,230 | 2025/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第341回 | | 0.3 | 40,000 | 41,592 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第342回 | | 0.1 | 20,000 | 20,398 | 2026/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第3回 | | 2.3 | 10,000 | 13,169 | 2030/5/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第5回 | | 2.2 | 10,000 | 13,185 | 2031/5/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第6回 | | 2.4 | 10,000 | 13,557 | 2031/11/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第7回 | | 2.3 | 15,000 | 20,235 | 2032/5/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第8回 | | 1.8 | 20,000 | 25,467 | 2032/11/22 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第9回 | | 1.4 | 20,000 | 24,168 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第10回 | | 1.1 | 10,000 | 11,599 | 2033/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第11回 | | 1.7 | 10,000 | 12,616 | 2033/6/20 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|--------------------|-----|--------|--------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券 利付 (30年) 第12回 | 2.1 | 10,000 | 13,321 | 2033/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第13回 | 2.0 | 10,000 | 13,173 | 2033/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第14回 | 2.4 | 30,000 | 41,701 | 2034/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第15回 | 2.5 | 10,000 | 14,105 | 2034/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第16回 | 2.5 | 10,000 | 14,148 | 2034/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第17回 | 2.4 | 10,000 | 13,997 | 2034/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第18回 | 2.3 | 20,000 | 27,681 | 2035/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第19回 | 2.3 | 10,000 | 13,864 | 2035/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第20回 | 2.5 | 10,000 | 14,273 | 2035/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第21回 | 2.3 | 10,000 | 13,909 | 2035/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第22回 | 2.5 | 10,000 | 14,323 | 2036/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第23回 | 2.5 | 10,000 | 14,348 | 2036/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第24回 | 2.5 | 10,000 | 14,400 | 2036/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第25回 | 2.3 | 20,000 | 28,090 | 2036/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第26回 | 2.4 | 20,000 | 28,551 | 2037/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第27回 | 2.5 | 20,000 | 29,153 | 2037/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第28回 | 2.5 | 30,000 | 43,987 | 2038/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第29回 | 2.4 | 20,000 | 29,074 | 2038/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第30回 | 2.3 | 30,000 | 43,202 | 2039/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第31回 | 2.2 | 30,000 | 42,769 | 2039/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第32回 | 2.3 | 40,000 | 58,263 | 2040/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第33回 | 2.0 | 20,000 | 27,908 | 2040/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第34回 | 2.2 | 40,000 | 58,048 | 2041/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第35回 | 2.0 | 42,000 | 59,244 | 2041/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第36回 | 2.0 | 30,000 | 42,594 | 2042/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第37回 | 1.9 | 20,000 | 28,022 | 2042/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第38回 | 1.8 | 20,000 | 27,662 | 2043/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第39回 | 1.9 | 20,000 | 28,269 | 2043/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第40回 | 1.8 | 20,000 | 27,795 | 2043/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第41回 | 1.7 | 20,000 | 27,313 | 2043/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第42回 | 1.7 | 20,000 | 27,338 | 2044/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第43回 | 1.7 | 10,000 | 13,699 | 2044/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第44回 | 1.7 | 20,000 | 27,461 | 2044/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第45回 | 1.5 | 40,000 | 52,855 | 2044/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第46回 | 1.5 | 10,000 | 13,239 | 2045/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第47回 | 1.6 | 20,000 | 27,068 | 2045/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第48回 | 1.4 | 20,000 | 26,006 | 2045/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第49回 | 1.4 | 30,000 | 39,079 | 2045/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第50回 | 0.8 | 20,000 | 22,677 | 2046/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第37回 | 3.1 | 30,000 | 31,378 | 2017/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第41回 | 1.5 | 30,000 | 31,509 | 2019/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第42回 | 2.6 | 10,000 | 10,819 | 2019/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第43回 | 2.9 | 10,000 | 11,061 | 2019/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第44回 | 2.5 | 10,000 | 11,059 | 2020/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第45回 | 2.4 | 10,000 | 11,020 | 2020/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第46回 | 2.2 | 5,000 | 5,504 | 2020/6/22 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第47回 | 2.2 | 15,000 | 16,605 | 2020/9/21 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第49回 | 2.1 | 40,000 | 44,558 | 2021/3/22 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---------------------|-----|---------|---------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券 利付 (20年) 第52回 | 2.1 | 25,000 | 28,162 | 2021/9/21 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第53回 | 2.1 | 10,000 | 11,323 | 2021/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第54回 | 2.2 | 10,000 | 11,380 | 2021/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第55回 | 2.0 | 10,000 | 11,324 | 2022/3/21 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第56回 | 2.0 | 10,000 | 11,377 | 2022/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第57回 | 1.9 | 10,000 | 11,315 | 2022/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第58回 | 1.9 | 10,000 | 11,370 | 2022/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第59回 | 1.7 | 30,000 | 33,862 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第60回 | 1.4 | 10,000 | 11,090 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第61回 | 1.0 | 10,000 | 10,849 | 2023/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第62回 | 0.8 | 10,000 | 10,732 | 2023/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第63回 | 1.8 | 10,000 | 11,450 | 2023/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第64回 | 1.9 | 10,000 | 11,568 | 2023/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第65回 | 1.9 | 10,000 | 11,613 | 2023/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第66回 | 1.8 | 20,000 | 23,072 | 2023/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第67回 | 1.9 | 10,000 | 11,657 | 2024/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第68回 | 2.2 | 10,000 | 11,896 | 2024/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第69回 | 2.1 | 30,000 | 35,449 | 2024/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第70回 | 2.4 | 10,000 | 12,107 | 2024/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第71回 | 2.2 | 10,000 | 11,943 | 2024/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第72回 | 2.1 | 20,000 | 23,819 | 2024/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第73回 | 2.0 | 30,000 | 35,624 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第74回 | 2.1 | 10,000 | 11,962 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第75回 | 2.1 | 40,000 | 48,011 | 2025/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第76回 | 1.9 | 17,000 | 20,100 | 2025/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第77回 | 2.0 | 15,000 | 17,869 | 2025/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第78回 | 1.9 | 10,000 | 11,865 | 2025/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第79回 | 2.0 | 10,000 | 11,957 | 2025/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第80回 | 2.1 | 10,000 | 12,049 | 2025/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第81回 | 2.0 | 10,000 | 12,000 | 2025/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第82回 | 2.1 | 15,000 | 18,143 | 2025/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第83回 | 2.1 | 15,000 | 18,201 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第84回 | 2.0 | 10,000 | 12,037 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第85回 | 2.1 | 13,000 | 15,822 | 2026/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第86回 | 2.3 | 10,000 | 12,370 | 2026/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第88回 | 2.3 | 20,000 | 24,862 | 2026/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第90回 | 2.2 | 20,000 | 24,750 | 2026/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第91回 | 2.3 | 10,000 | 12,479 | 2026/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第92回 | 2.1 | 30,000 | 36,957 | 2026/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第93回 | 2.0 | 20,000 | 24,514 | 2027/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第94回 | 2.1 | 20,000 | 24,733 | 2027/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第95回 | 2.3 | 10,000 | 12,631 | 2027/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第96回 | 2.1 | 15,000 | 18,612 | 2027/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第97回 | 2.2 | 10,000 | 12,563 | 2027/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第99回 | 2.1 | 140,000 | 174,939 | 2027/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第100回 | 2.2 | 20,000 | 25,321 | 2028/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第101回 | 2.4 | 20,000 | 25,797 | 2028/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第102回 | 2.4 | 20,000 | 25,889 | 2028/6/20 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | |
|---------------------|-----|-----|--------|---------|------------|
| | 利 | 率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 国債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券 利付 (20年) 第103回 | | 2.3 | 15,000 | 19,234 | 2028/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第104回 | | 2.1 | 10,000 | 12,580 | 2028/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第105回 | | 2.1 | 20,000 | 25,237 | 2028/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第106回 | | 2.2 | 10,000 | 12,742 | 2028/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第107回 | | 2.1 | 20,000 | 25,327 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第108回 | | 1.9 | 10,000 | 12,411 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第109回 | | 1.9 | 10,000 | 12,442 | 2029/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第110回 | | 2.1 | 20,000 | 25,399 | 2029/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第111回 | | 2.2 | 10,000 | 12,866 | 2029/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第112回 | | 2.1 | 35,000 | 44,574 | 2029/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第113回 | | 2.1 | 40,000 | 51,084 | 2029/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第114回 | | 2.1 | 30,000 | 38,442 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第115回 | | 2.2 | 10,000 | 12,949 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第116回 | | 2.2 | 10,000 | 12,994 | 2030/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第118回 | | 2.0 | 10,000 | 12,758 | 2030/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第119回 | | 1.8 | 10,000 | 12,477 | 2030/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第120回 | | 1.6 | 25,000 | 30,492 | 2030/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第122回 | | 1.8 | 20,000 | 25,007 | 2030/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第123回 | | 2.1 | 10,000 | 12,972 | 2030/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第124回 | | 2.0 | 20,000 | 25,655 | 2030/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第125回 | | 2.2 | 10,000 | 13,150 | 2031/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第126回 | | 2.0 | 30,000 | 38,568 | 2031/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第127回 | | 1.9 | 20,000 | 25,418 | 2031/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第128回 | | 1.9 | 20,000 | 25,490 | 2031/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第129回 | | 1.8 | 20,000 | 25,191 | 2031/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第130回 | | 1.8 | 20,000 | 25,238 | 2031/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第131回 | | 1.7 | 15,000 | 18,700 | 2031/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第132回 | | 1.7 | 10,000 | 12,497 | 2031/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第134回 | | 1.8 | 10,000 | 12,673 | 2032/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第135回 | | 1.7 | 15,000 | 18,775 | 2032/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第137回 | | 1.7 | 10,000 | 12,536 | 2032/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第138回 | | 1.5 | 10,000 | 12,219 | 2032/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第139回 | | 1.6 | 10,000 | 12,377 | 2032/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第140回 | | 1.7 | 80,000 | 100,520 | 2032/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第141回 | | 1.7 | 30,000 | 37,749 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第142回 | | 1.8 | 20,000 | 25,492 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第143回 | | 1.6 | 10,000 | 12,434 | 2033/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第144回 | | 1.5 | 10,000 | 12,269 | 2033/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第145回 | | 1.7 | 10,000 | 12,616 | 2033/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第146回 | | 1.7 | 70,000 | 88,431 | 2033/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第147回 | | 1.6 | 20,000 | 24,953 | 2033/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第148回 | | 1.5 | 10,000 | 12,315 | 2034/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第149回 | | 1.5 | 20,000 | 24,650 | 2034/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第150回 | | 1.4 | 20,000 | 24,314 | 2034/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第151回 | | 1.2 | 40,000 | 47,218 | 2034/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第152回 | | 1.2 | 30,000 | 35,418 | 2035/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第153回 | | 1.3 | 60,000 | 72,013 | 2035/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第154回 | | 1.2 | 50,000 | 59,098 | 2035/9/20 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|---------------------|-----|-----------|-----------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券 利付 (20年) 第155回 | 1.0 | 40,000 | 45,735 | 2035/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第156回 | 0.4 | 10,000 | 10,264 | 2036/3/20 |
| 合計 | | 7,160,000 | 8,184,897 | |

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年5月10日現在)

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 公社債 | 千円 8,184,897 | % 99.3 |
| コール・ローン等、その他 | 57,684 | 0.7 |
| 投資信託財産総額 | 8,242,581 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月10日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|-----------------|
| (A) 資産 | 8,242,581,016 円 |
| コール・ローン等 | 14,873,533 |
| 公社債(評価額) | 8,184,897,560 |
| 未収入金 | 20,265,000 |
| 未収利息 | 22,169,261 |
| 前払費用 | 375,662 |
| (B) 負債 | 19,079,240 |
| 未払解約金 | 19,079,214 |
| 未払利息 | 26 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 8,223,501,776 |
| 元本 | 6,001,927,033 |
| 次期繰越損益金 | 2,221,574,743 |
| (D) 受益権総口数 | 6,001,927,033口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,701円 |

(注) 期首元本額は5,438,368,348円、期中追加設定元本額は2,803,082,707円、期中一部解約元本額は2,239,524,022円、1口当たり純資産額は1.3701円です。

○損益の状況 (2015年5月12日～2016年5月10日)

| 項目 | 当期 |
|----------------|---------------|
| (A) 配当等収益 | 101,126,186 |
| 受取利息 | 101,128,106 |
| 支払利息 | △ 1,920 |
| (B) 有価証券売買損益 | 563,979,730 |
| 売買益 | 577,236,430 |
| 売買損 | △ 13,256,700 |
| (C) 当期損益金(A+B) | 665,105,916 |
| (D) 前期繰越損益金 | 1,495,210,650 |
| (E) 追加信託差損益金 | 811,634,715 |
| (F) 解約差損益金 | △ 750,376,538 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 2,221,574,743 |
| 次期繰越損益金(G) | 2,221,574,743 |

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 |
|----------------------------------|---------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け） | 3,929,439,417 |
| バランスセレクト50 | 572,334,158 |
| 野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用） | 529,127,742 |
| バランスセレクト30 | 507,631,703 |
| バランスセレクト70 | 215,604,730 |
| 国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け） | 88,512,814 |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け） | 48,371,723 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 41,300,927 |
| バランスセレクト30（確定拠出年金向け） | 25,311,797 |
| ネクストコア | 24,852,591 |
| バランスセレクト70（確定拠出年金向け） | 15,911,757 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 3,253,380 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 274,294 |

○お知らせ

該当事項はございません。

外国債券マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日2016年5月10日）

作成対象期間（2015年5月12日～2016年5月10日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

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

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------|--------|------|-------|--------|---------|
| | 円 | 騰落率 | | 騰落率 | | | |
| 11期(2012年5月10日) | 14,713 | 2.4 | 148.79 | 1.8 | 98.2 | — | 278,390 |
| 12期(2013年5月10日) | 19,680 | 33.8 | 196.85 | 32.3 | 98.1 | — | 309,517 |
| 13期(2014年5月12日) | 20,704 | 5.2 | 209.27 | 6.3 | 98.6 | — | 293,247 |
| 14期(2015年5月11日) | 23,251 | 12.3 | 236.29 | 12.9 | 98.9 | — | 526,058 |
| 15期(2016年5月10日) | 21,725 | △6.6 | 220.26 | △6.8 | 99.0 | — | 632,898 |

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

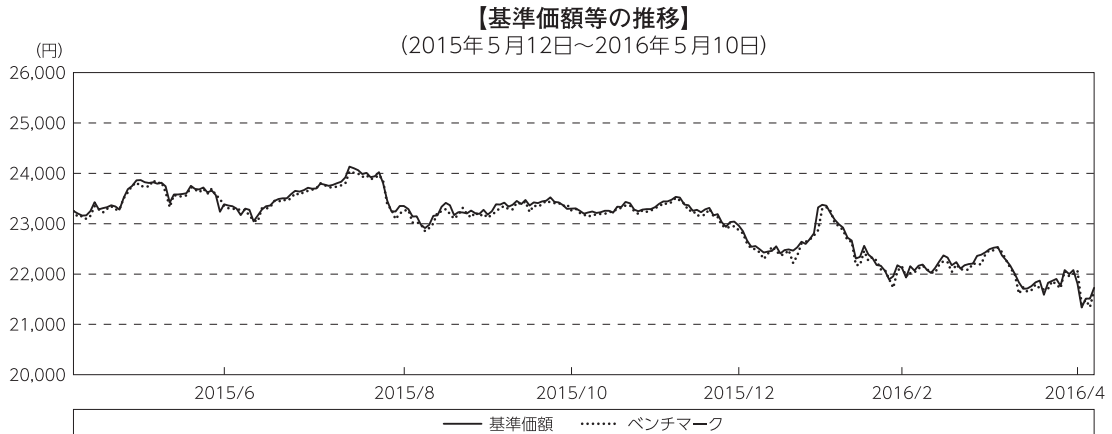
| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債券先物比率 |
|--------------------|--------|------|--------|------|-------|--------|
| | 円 | 騰落率 | | 騰落率 | | |
| (期首) 2015年5月11日 | 23,251 | — | 236.29 | — | 98.9 | — |
| 5月末 | 23,746 | 2.1 | 241.38 | 2.2 | 99.0 | — |
| 6月末 | 23,385 | 0.6 | 237.28 | 0.4 | 98.9 | — |
| 7月末 | 23,699 | 1.9 | 240.84 | 1.9 | 98.9 | — |
| 8月末 | 23,351 | 0.4 | 236.40 | 0.0 | 98.9 | — |
| 9月末 | 23,275 | 0.1 | 235.74 | △0.2 | 98.8 | — |
| 10月末 | 23,300 | 0.2 | 236.47 | 0.1 | 98.9 | — |
| 11月末 | 23,289 | 0.2 | 236.36 | 0.0 | 99.1 | — |
| 12月末 | 22,960 | △1.3 | 232.42 | △1.6 | 98.9 | — |
| 2016年1月末 | 23,322 | 0.3 | 232.41 | △1.6 | 98.5 | — |
| 2月末 | 22,124 | △4.8 | 225.09 | △4.7 | 99.0 | — |
| 3月末 | 22,522 | △3.1 | 228.36 | △3.4 | 99.0 | — |
| 4月末 | 21,808 | △6.2 | 224.19 | △5.1 | 98.9 | — |
| (期末) 2016年5月10日 | 21,725 | △6.6 | 220.26 | △6.8 | 99.0 | — |

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の変動要因

基準価額は、期首23,251円から期末21,725円へと下落し、値下がり額は1,526円となりました。

外国債券利回りが長期債を中心に低下（価格は上昇）したことはプラスに寄与しましたが、ECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和や米国の利上げペースの鈍化観測などを背景に主要通貨が対円で下落（円高）したことがマイナスに影響したため、基準価額は下落しました。

○投資環境

当運用期間では、米国の政策金利引上げに伴い米国の短期債券利回りは上昇（価格は下落）しましたが、商品価格下落に伴う低インフレの長期化観測やECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和、米国の利上げペースが緩やかなものにとどまるとの観測などを背景に、外国債券利回りは長期債を中心に低下（価格は上昇）しました。

為替市場は、ECBによる追加金融緩和や米国の利上げペースの鈍化観測などを背景に、主要通貨は対円で下落（円高）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

シティ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉えるため、通貨構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（通貨構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、為替ヘッジ（為替の売り予約）は行っておりません。

○当ファンドのベンチマークとの差異

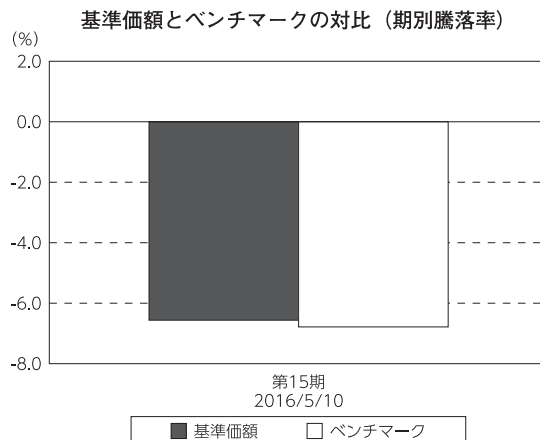
今期の基準価額の騰落率は-6.6%となり、ベンチマークの-6.8%を0.2ポイント上回りました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

（その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価に用いる為替レートや債券時価が異なること



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

◎今後の運用方針

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

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2015年5月12日～2016年5月10日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|--------|------------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) そ の 他 費 用 | 円 2 | % 0.011 | (a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 保 管 費 用 ） | (2) | (0.011) | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| （ そ の 他 ） | (0) | (0.000) | 信託事務の処理に要するその他の諸費用 |
| 合 計 | 2 | 0.011 | |
| 期中の平均基準価額は、23,065円です。 | | | |

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年5月12日～2016年5月10日)

公社債

| | | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|------|--------|---------|-----------------------|-----------------------|
| 外 国 | アメリカ | 国債証券 | 千米ドル 1,164,271 | 千米ドル 549,584 |
| | カナダ | 国債証券 | 千カナダドル 72,837 | 千カナダドル 42,081 |
| | イギリス | 国債証券 | 千英ポンド 110,916 | 千英ポンド 39,649 |
| | スイス | 国債証券 | 千スイスフラン 4,001 | 千スイスフラン - |
| | スウェーデン | 国債証券 | 千スウェーデンクローナ 81,361 | 千スウェーデンクローナ 23,206 |
| | ノルウェー | 国債証券 | 千ノルウェークローネ 49,712 | 千ノルウェークローネ 732 |
| | デンマーク | 国債証券 | 千デンマーククローネ 79,204 | 千デンマーククローネ 26,206 |
| | ユーロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | ドイツ | 国債証券 | 102,024 | 14,451 |
| | イタリア | 国債証券 | 266,332 | 128,788 |
| フランス | 国債証券 | 135,861 | 36,498 | |

| | | | 買付額 | 売付額 |
|---------|--------|-------|---------------------|--------------------|
| 外 | ユーロ | | 千ユーロ | 千ユーロ |
| | オランダ | 国債証券 | 24,619 | 7,810 |
| | スペイン | 国債証券 | 169,524 | 74,703 |
| | ベルギー | 国債証券 | 35,540 | 3,974 |
| | オーストリア | 国債証券 | 18,442 | 5,988 |
| | フィンランド | 国債証券 | 2,391 | — |
| | アイルランド | 国債証券 | 7,426 | — |
| | ポーランド | 国債証券 | 千ズロチ 60,022 | 千ズロチ 20,105 |
| | シンガポール | 国債証券 | 千シンガポールドル 11,142 | 千シンガポールドル 5,113 |
| | 国 | マレーシア | 国債証券 | 千リンギ 42,868 |
| オーストラリア | | 国債証券 | 千豪ドル 61,091 | 千豪ドル 18,091 |
| メキシコ | | 国債証券 | 千メキシコペソ 395,496 | 千メキシコペソ 118,842 |
| 南アフリカ | | 国債証券 | 千ランド 128,597 | 千ランド 7,431 |

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2015年5月12日～2016年5月10日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 公社債 | 百万円 283,335 | 百万円 7,530 | % 2.7 | 百万円 115,284 | 百万円 1,324 | % 1.1 |
| 為替直物取引 | 195,271 | 19,369 | 9.9 | 44,170 | 2,035 | 4.6 |
| 預金 | 20,359 | 20,359 | 100.0 | 20,359 | 20,359 | 100.0 |

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

(2016年5月10日現在)

○組入資産の明細

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

| 区 分 | 当 期 末 | | | | | | | |
|---------|------------------------|------------------------|-------------|------|-----------------|-----------|------|------|
| | 額面金額 | 評 価 額 | | 組入比率 | うちBB格以下 組入比率 | 残存期間別組入比率 | | |
| | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | 5年以上 | 2年以上 | 2年未満 |
| | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | % | % | % | % | % |
| アメリカ | 2,264,900 | 2,457,940 | 266,588,179 | 42.1 | — | 18.5 | 15.3 | 8.3 |
| カナダ | 千カナダドル 135,080 | 千カナダドル 155,553 | 13,002,750 | 2.1 | — | 1.1 | 0.6 | 0.4 |
| イギリス | 千英ポンド 260,000 | 千英ポンド 318,585 | 49,782,224 | 7.9 | — | 5.8 | 1.9 | 0.2 |
| スイス | 千スイスフラン 12,700 | 千スイスフラン 15,811 | 1,766,102 | 0.3 | — | 0.1 | 0.2 | — |
| スウェーデン | 千スウェーデンクローナ 197,900 | 千スウェーデンクローナ 236,699 | 3,143,364 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | 0.0 |
| ノルウェー | 千ノルウェークローネ 132,000 | 千ノルウェークローネ 146,577 | 1,933,359 | 0.3 | — | 0.2 | 0.1 | 0.0 |
| デンマーク | 千デンマーククローネ 194,400 | 千デンマーククローネ 258,674 | 4,293,992 | 0.7 | — | 0.6 | 0.1 | — |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | |
| ドイツ | 209,750 | 290,409 | 35,862,618 | 5.7 | — | 4.9 | 0.7 | — |
| イタリア | 468,000 | 576,919 | 71,243,836 | 11.3 | — | 6.2 | 3.6 | 1.4 |
| フランス | 356,800 | 467,118 | 57,684,422 | 9.1 | — | 6.4 | 2.4 | 0.3 |
| オランダ | 89,600 | 113,391 | 14,002,739 | 2.2 | — | 1.5 | 0.5 | 0.2 |
| スペイン | 298,700 | 357,246 | 44,116,372 | 7.0 | — | 3.1 | 2.7 | 1.2 |
| ベルギー | 96,900 | 128,719 | 15,895,550 | 2.5 | — | 2.0 | 0.4 | 0.1 |
| オーストリア | 56,400 | 72,337 | 8,932,926 | 1.4 | — | 1.0 | 0.3 | 0.1 |
| フィンランド | 22,200 | 26,026 | 3,214,047 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | 0.0 |
| アイルランド | 42,600 | 50,566 | 6,244,400 | 1.0 | — | 0.3 | 0.5 | 0.2 |
| ポーランド | 千ズロチ 120,500 | 千ズロチ 131,685 | 3,668,764 | 0.6 | — | 0.2 | 0.3 | 0.1 |
| シンガポール | 千シンガポールドル 26,480 | 千シンガポールドル 28,258 | 2,234,693 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | — |
| マレーシア | 千リンギ 107,000 | 千リンギ 108,117 | 2,895,398 | 0.5 | — | 0.3 | 0.1 | 0.1 |
| オーストラリア | 千豪ドル 127,400 | 千豪ドル 142,035 | 11,249,226 | 1.8 | — | 1.1 | 0.4 | 0.2 |
| メキシコ | 千メキシコペソ 887,300 | 千メキシコペソ 990,729 | 5,904,747 | 0.9 | — | 0.6 | 0.3 | 0.1 |
| 南アフリカ | 千ランド 420,500 | 千ランド 377,269 | 2,701,252 | 0.4 | — | 0.3 | 0.1 | 0.0 |
| 合 計 | — | — | 626,360,972 | 99.0 | — | 55.2 | 30.8 | 13.0 |

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

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 当 | 期 末 | | | 償還年月日 | |
|------|------------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | | 邦貨換算金額 |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 国債証券 | US TREASURY BOND | 8.875 | 10,500 | 12,829 | 1,391,507 | 2019/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 8.125 | 19,300 | 23,778 | 2,578,983 | 2019/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 8.75 | 12,700 | 16,743 | 1,815,963 | 2020/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 8.0 | 18,500 | 25,119 | 2,724,464 | 2021/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.25 | 19,400 | 25,744 | 2,792,238 | 2023/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 2.375 | 31,200 | 32,955 | 3,574,299 | 2024/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.0 | 42,000 | 58,189 | 6,311,253 | 2026/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.5 | 13,800 | 20,045 | 2,174,143 | 2026/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 6.125 | 17,700 | 25,532 | 2,769,227 | 2027/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.5 | 12,000 | 16,697 | 1,811,044 | 2028/8/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.25 | 5,000 | 6,850 | 742,951 | 2028/11/15 |
| | US TREASURY BOND | 5.25 | 2,800 | 3,850 | 417,571 | 2029/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 4.375 | 2,200 | 2,984 | 323,710 | 2038/2/15 |
| | US TREASURY BOND | 2.875 | 22,300 | 23,599 | 2,559,620 | 2043/5/15 |
| | US TREASURY BOND | 3.75 | 16,600 | 20,674 | 2,242,386 | 2043/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 7,200 | 7,223 | 783,443 | 2017/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 24,600 | 25,160 | 2,728,878 | 2017/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 8,500 | 8,504 | 922,378 | 2017/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 5,000 | 5,016 | 544,058 | 2017/6/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 9,000 | 9,193 | 997,149 | 2017/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 0.75 | 8,000 | 8,014 | 869,205 | 2017/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 16,900 | 16,954 | 1,838,845 | 2017/7/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 28,200 | 28,801 | 3,123,805 | 2017/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.5 | 3,400 | 3,395 | 368,288 | 2017/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.75 | 29,800 | 31,354 | 3,400,657 | 2017/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 21,900 | 22,251 | 2,413,408 | 2017/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 10,000 | 9,997 | 1,084,303 | 2017/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 34,500 | 35,080 | 3,804,867 | 2017/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 8,000 | 7,997 | 867,374 | 2017/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 1,000 | 1,003 | 108,794 | 2017/10/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 18,500 | 18,827 | 2,042,015 | 2017/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 49,600 | 52,291 | 5,671,502 | 2017/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 18,600 | 19,052 | 2,066,450 | 2017/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 17,000 | 17,574 | 1,906,120 | 2017/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.75 | 6,000 | 6,005 | 651,395 | 2017/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 16,900 | 17,463 | 1,894,049 | 2018/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 4,000 | 4,012 | 435,229 | 2018/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 41,000 | 43,006 | 4,664,512 | 2018/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 7,100 | 7,361 | 798,432 | 2018/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 0.75 | 2,000 | 2,001 | 217,114 | 2018/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.75 | 34,000 | 34,022 | 3,690,088 | 2018/4/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 8,000 | 8,303 | 900,590 | 2018/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 1,200 | 1,197 | 129,928 | 2018/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 3.875 | 11,300 | 12,026 | 1,304,447 | 2018/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 5,000 | 5,169 | 560,687 | 2018/5/31 |

| 銘柄 | 当 | 期 | 末 | | 償還年月日 | | |
|------|-----------------|-------|--------|--------|-----------|------------|--------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | | 評 価 額 | |
| | | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 1.0 | 13,500 | 13,574 | 1,472,331 | 2018/5/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 29,300 | 30,323 | 3,288,855 | 2018/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 8,500 | 8,616 | 934,550 | 2018/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 8,600 | 8,885 | 963,689 | 2018/7/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 3,400 | 3,446 | 373,834 | 2018/7/31 | |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 4,800 | 5,161 | 559,856 | 2018/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 20,600 | 20,954 | 2,272,677 | 2018/8/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 25,500 | 25,862 | 2,805,055 | 2018/9/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 7,000 | 7,166 | 777,281 | 2018/10/31 | |
| | US TREASURY N/B | 3.75 | 30,600 | 32,879 | 3,566,106 | 2018/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 5,000 | 5,056 | 548,400 | 2018/11/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 6,500 | 6,596 | 715,427 | 2018/12/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 5,500 | 5,598 | 607,248 | 2018/12/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 5,100 | 5,158 | 559,498 | 2019/1/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 2,000 | 2,036 | 220,851 | 2019/1/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 27,500 | 28,964 | 3,141,452 | 2019/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 4,500 | 4,567 | 495,410 | 2019/2/28 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 4,000 | 4,074 | 441,872 | 2019/2/28 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 4,000 | 4,075 | 442,025 | 2019/3/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 25,500 | 26,065 | 2,827,094 | 2019/3/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 5,600 | 5,725 | 620,947 | 2019/4/30 | |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 26,400 | 28,177 | 3,056,172 | 2019/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 10,600 | 10,799 | 1,171,277 | 2019/5/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 2,000 | 2,006 | 217,665 | 2019/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 7,900 | 8,080 | 876,447 | 2019/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 14,500 | 14,830 | 1,608,546 | 2019/7/31 | |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 37,000 | 40,237 | 4,364,159 | 2019/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 3,000 | 3,007 | 326,142 | 2019/8/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 8,800 | 9,000 | 976,184 | 2019/8/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 3,000 | 3,005 | 326,015 | 2019/9/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 8,700 | 8,932 | 968,813 | 2019/9/30 | |
| | US TREASURY N/B | 3.375 | 49,300 | 53,382 | 5,789,882 | 2019/11/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 8,800 | 8,810 | 955,566 | 2019/11/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 1,800 | 1,832 | 198,797 | 2019/11/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 12,000 | 12,055 | 1,307,569 | 2019/12/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 3,800 | 3,885 | 421,453 | 2019/12/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 2,000 | 2,026 | 219,758 | 2020/1/31 | |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 51,800 | 56,810 | 6,161,615 | 2020/2/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 2,700 | 2,722 | 295,301 | 2020/2/29 | |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 4,000 | 4,013 | 435,331 | 2020/3/31 | |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 20,500 | 20,757 | 2,251,396 | 2020/3/31 | |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 46,600 | 51,023 | 5,533,993 | 2020/5/15 | |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 14,500 | 14,959 | 1,622,553 | 2020/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 10,000 | 10,212 | 1,107,647 | 2020/6/30 | |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 11,000 | 11,402 | 1,236,681 | 2020/7/31 | |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 42,500 | 45,162 | 4,898,366 | 2020/8/15 | |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 7,000 | 7,292 | 790,952 | 2020/8/31 | |

| 銘柄 | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|------|-----------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| アメリカ | 国債証券 | | | | | |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 6,000 | 6,222 | 674,909 | 2020/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 1,600 | 1,641 | 178,009 | 2020/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 50,100 | 53,313 | 5,782,376 | 2020/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 6,800 | 7,167 | 777,400 | 2020/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 5,300 | 5,527 | 599,538 | 2021/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 44,200 | 49,169 | 5,332,874 | 2021/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 5,000 | 5,185 | 562,466 | 2021/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,800 | 1,889 | 204,882 | 2021/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 2,900 | 3,043 | 330,137 | 2021/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 36,400 | 39,755 | 4,311,895 | 2021/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 14,000 | 14,528 | 1,575,737 | 2021/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 8,700 | 9,081 | 985,031 | 2021/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 9,700 | 10,185 | 1,104,665 | 2021/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 26,800 | 27,968 | 3,033,443 | 2021/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 7,300 | 7,570 | 821,046 | 2021/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 16,000 | 16,695 | 1,810,739 | 2021/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 11,000 | 11,402 | 1,236,681 | 2021/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 8,000 | 8,240 | 893,812 | 2021/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 12,400 | 12,931 | 1,402,587 | 2021/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 5,000 | 5,040 | 546,663 | 2022/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 33,700 | 34,937 | 3,789,312 | 2022/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 7,300 | 7,456 | 808,706 | 2022/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 5,900 | 6,022 | 653,162 | 2022/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 5,000 | 5,102 | 553,400 | 2022/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 11,900 | 12,141 | 1,316,890 | 2022/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 9,700 | 9,967 | 1,081,075 | 2022/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 27,000 | 28,122 | 3,050,132 | 2022/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 18,500 | 18,732 | 2,031,748 | 2022/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 12,800 | 12,929 | 1,402,333 | 2022/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.125 | 13,000 | 13,528 | 1,467,260 | 2022/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 15,000 | 15,241 | 1,653,082 | 2023/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 17,000 | 17,563 | 1,904,896 | 2023/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 40,600 | 41,247 | 4,473,656 | 2023/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 16,300 | 17,396 | 1,886,816 | 2023/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 16,800 | 18,233 | 1,977,578 | 2023/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 27,300 | 29,637 | 3,214,490 | 2024/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 30,400 | 32,430 | 3,517,425 | 2024/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 24,300 | 25,412 | 2,756,237 | 2024/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 6.25 | 2,600 | 3,967 | 430,308 | 2030/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 5.375 | 300 | 429 | 46,631 | 2031/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 2,000 | 2,755 | 298,807 | 2036/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 5.0 | 1,000 | 1,467 | 159,181 | 2037/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 500 | 689 | 74,799 | 2038/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 1,500 | 1,792 | 194,414 | 2039/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 5,000 | 6,642 | 720,411 | 2039/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 5,500 | 7,565 | 820,508 | 2039/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 7,700 | 10,404 | 1,128,420 | 2039/11/15 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | | | 償還年月日 |
|------|---------------------|-------|--------|--------|-------------|------------|
| | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | |
| 国債証券 | US TREASURY N/B | 4.625 | 8,000 | 11,187 | 1,213,430 | 2040/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 8,000 | 10,811 | 1,172,655 | 2040/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.875 | 8,000 | 10,071 | 1,092,327 | 2040/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 7,800 | 10,369 | 1,124,635 | 2040/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.75 | 7,000 | 9,980 | 1,082,481 | 2041/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 7,000 | 9,480 | 1,028,209 | 2041/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 6,500 | 7,255 | 786,889 | 2041/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 3,200 | 3,569 | 387,175 | 2042/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 4,500 | 4,899 | 531,348 | 2042/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 9,300 | 9,650 | 1,046,739 | 2042/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 9,600 | 9,944 | 1,078,553 | 2042/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 18,200 | 20,231 | 2,194,347 | 2043/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 15,700 | 19,120 | 2,073,850 | 2043/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 23,200 | 28,195 | 3,058,056 | 2044/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.375 | 15,900 | 18,460 | 2,002,187 | 2044/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 18,600 | 20,611 | 2,235,482 | 2044/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 33,500 | 36,216 | 3,928,056 | 2044/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 13,200 | 12,880 | 1,396,998 | 2045/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 14,700 | 15,878 | 1,722,159 | 2045/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 5,000 | 5,398 | 585,556 | 2045/11/15 |
| | US TREASURY NOTE | 2.875 | 31,000 | 32,272 | 3,500,296 | 2018/3/31 |
| 小 計 | | | | | 266,588,179 | |
| カナダ | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| 国債証券 | CANADA GOVERNMENT | 2.75 | 4,600 | 5,109 | 427,133 | 2022/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 5,400 | 5,447 | 455,349 | 2017/8/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 13,800 | 13,974 | 1,168,122 | 2017/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 9,700 | 9,819 | 820,820 | 2018/2/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 3,200 | 3,242 | 271,005 | 2018/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4.25 | 3,700 | 3,981 | 332,841 | 2018/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 7,500 | 7,625 | 637,451 | 2018/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75 | 3,800 | 3,930 | 328,514 | 2019/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.75 | 7,100 | 7,784 | 650,719 | 2019/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75 | 4,000 | 4,155 | 347,349 | 2019/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 3,600 | 3,721 | 311,041 | 2020/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5 | 7,500 | 8,361 | 698,946 | 2020/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.75 | 2,500 | 2,511 | 209,959 | 2020/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.25 | 9,200 | 10,356 | 865,671 | 2021/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 3,900 | 4,034 | 337,244 | 2023/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5 | 5,700 | 6,306 | 527,120 | 2024/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 7,200 | 7,834 | 654,870 | 2025/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 8.0 | 2,200 | 3,678 | 307,492 | 2027/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 5,180 | 7,694 | 643,155 | 2029/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 3,000 | 4,710 | 393,774 | 2033/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0 | 7,000 | 10,671 | 891,989 | 2037/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0 | 6,400 | 8,940 | 747,340 | 2041/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5 | 7,100 | 9,533 | 796,907 | 2045/12/1 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | | | | |
|--------|-------|-------------------------|--------|-------------|-------------|-----------|------------|
| | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 | | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | | |
| カナダ | | % | 千カナダドル | 千カナダドル | 千円 | | |
| | 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,800 | 2,128 | 177,930 | 2048/12/1 |
| 小 | 計 | | | | | | 13,002,750 |
| イギリス | | | 千英ポンド | 千英ポンド | | | |
| | 国債証券 | UK TREASURY | 1.0 | 2,100 | 2,117 | 330,836 | 2017/9/7 |
| | | UK TREASURY | 5.0 | 5,700 | 6,193 | 967,725 | 2018/3/7 |
| | | UK TREASURY | 1.25 | 23,400 | 23,839 | 3,725,225 | 2018/7/22 |
| | | UK TREASURY | 4.5 | 4,000 | 4,462 | 697,357 | 2019/3/7 |
| | | UK TREASURY | 1.75 | 14,200 | 14,736 | 2,302,766 | 2019/7/22 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 3,000 | 3,323 | 519,314 | 2019/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.75 | 5,800 | 6,714 | 1,049,142 | 2020/3/7 |
| | | UK TREASURY | 2.0 | 13,500 | 14,212 | 2,220,892 | 2020/7/22 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 7,200 | 8,151 | 1,273,806 | 2020/9/7 |
| | | UK TREASURY | 8.0 | 5,300 | 7,200 | 1,125,079 | 2021/6/7 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 8,900 | 10,250 | 1,601,685 | 2021/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.0 | 4,650 | 5,480 | 856,381 | 2022/3/7 |
| | | UK TREASURY | 1.75 | 8,300 | 8,678 | 1,356,099 | 2022/9/7 |
| | | UK TREASURY | 2.25 | 7,200 | 7,745 | 1,210,239 | 2023/9/7 |
| | | UK TREASURY | 2.75 | 8,600 | 9,575 | 1,496,227 | 2024/9/7 |
| | | UK TREASURY | 5.0 | 12,800 | 16,741 | 2,615,967 | 2025/3/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 8,300 | 10,626 | 1,660,495 | 2027/12/7 |
| | | UK TREASURY | 6.0 | 3,750 | 5,625 | 878,962 | 2028/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.75 | 6,700 | 9,166 | 1,432,321 | 2030/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 7,250 | 9,522 | 1,488,044 | 2032/6/7 |
| | | UK TREASURY | 4.5 | 6,700 | 9,162 | 1,431,797 | 2034/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 6,900 | 9,236 | 1,443,270 | 2036/3/7 |
| | | UK TREASURY | 4.75 | 4,900 | 7,114 | 1,111,682 | 2038/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 4,200 | 5,743 | 897,479 | 2039/9/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 5,700 | 7,875 | 1,230,566 | 2040/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.5 | 6,100 | 8,848 | 1,382,691 | 2042/12/7 |
| | | UK TREASURY | 3.5 | 14,300 | 17,956 | 2,805,884 | 2045/1/22 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 5,950 | 8,573 | 1,339,672 | 2046/12/7 |
| | | UK TREASURY | 4.25 | 4,250 | 6,319 | 987,457 | 2049/12/7 |
| | | UK TREASURY | 3.75 | 7,250 | 10,134 | 1,583,659 | 2052/7/22 |
| | | UK TREASURY | 3.5 | 5,000 | 7,185 | 1,122,806 | 2068/7/22 |
| | | UK TSY 3 1/4% 2044 | 3.25 | 21,700 | 26,005 | 4,063,585 | 2044/1/22 |
| | | UNITED KINGDOM(GOVERNEM | 4.25 | 6,400 | 10,067 | 1,573,100 | 2055/12/7 |
| 小 | 計 | | | | | | 49,782,224 |
| スイス | | | | 千スイスフラン | 千スイスフラン | | |
| | 国債証券 | SWITZERLAND GOVERNMENT | 2.0 | 9,100 | 10,377 | 1,159,182 | 2021/4/28 |
| | | SWITZERLAND GOVERNMENT | 4.0 | 3,600 | 5,433 | 606,919 | 2028/4/8 |
| 小 | 計 | | | | | | 1,766,102 |
| スウェーデン | | | | 千スウェーデンクローナ | 千スウェーデンクローナ | | |
| | 国債証券 | SWEDISH GOVERNMENT | 3.75 | 7,000 | 7,384 | 98,071 | 2017/8/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 4.25 | 16,200 | 18,373 | 244,001 | 2019/3/12 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 5.0 | 49,400 | 61,241 | 813,282 | 2020/12/1 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 50,900 | 61,118 | 811,649 | 2022/6/1 |
| | | SWEDISH GOVERNMENT | 1.5 | 17,900 | 19,407 | 257,734 | 2023/11/13 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | | |
|--------------------------|----------------------|--------------------------|-------|-------------|-------------|-----------|------------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| スウェーデン | | | % | 千スウェーデンクローナ | 千スウェーデンクローナ | 千円 | | |
| 国債証券 | SWEDISH GOVERNMENT | | 2.5 | 40,200 | 47,202 | 626,853 | 2025/5/12 | |
| | SWEDISH GOVERNMENT | | 3.5 | 16,300 | 21,970 | 291,771 | 2039/3/30 | |
| 小 計 | | | | | | 3,143,364 | | |
| ノルウェー | | | | 千ノルウェークローネ | 千ノルウェークローネ | | | |
| 国債証券 | NORWEGIAN GOVERNMENT | | 4.25 | 21,900 | 22,728 | 299,787 | 2017/5/19 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | | 4.5 | 24,100 | 26,949 | 355,458 | 2019/5/22 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | | 3.75 | 27,600 | 31,505 | 415,556 | 2021/5/25 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | | 2.0 | 14,300 | 15,200 | 200,490 | 2023/5/24 | |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | | 3.0 | 44,100 | 50,194 | 662,067 | 2024/3/14 | |
| 小 計 | | | | | | 1,933,359 | | |
| デンマーク | | | | 千デンマーククローネ | 千デンマーククローネ | | | |
| 国債証券 | KINGDOM OF DENMARK | | 4.0 | 25,100 | 28,952 | 480,617 | 2019/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | | 3.0 | 52,100 | 61,134 | 1,014,826 | 2021/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | | 1.5 | 35,800 | 39,516 | 655,966 | 2023/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | | 7.0 | 14,500 | 22,976 | 381,413 | 2024/11/10 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | | 1.75 | 18,600 | 20,913 | 347,169 | 2025/11/15 | |
| | KINGDOM OF DENMARK | | 4.5 | 48,300 | 85,180 | 1,413,999 | 2039/11/15 | |
| 小 計 | | | | | | 4,293,992 | | |
| ユーロ | | | | 千ユーロ | 千ユーロ | | | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESobligation | | 0.25 | 1,700 | 1,744 | 215,380 | 2019/10/11 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 3.5 | 5,150 | 5,805 | 716,932 | 2019/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 3.25 | 8,700 | 9,900 | 1,222,571 | 2020/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 3.0 | 7,000 | 8,013 | 989,642 | 2020/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 2.25 | 3,100 | 3,466 | 428,106 | 2020/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 2.5 | 7,300 | 8,300 | 1,025,069 | 2021/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 3.25 | 7,000 | 8,319 | 1,027,375 | 2021/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 2.25 | 3,500 | 3,991 | 492,876 | 2021/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 2.0 | 20,000 | 22,672 | 2,799,765 | 2022/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 1.75 | 9,600 | 10,824 | 1,336,774 | 2022/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 1.5 | 5,000 | 5,574 | 688,333 | 2022/9/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 1.5 | 5,200 | 5,820 | 718,788 | 2023/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 1.5 | 4,200 | 4,713 | 582,089 | 2023/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 2.0 | 5,400 | 6,275 | 774,941 | 2023/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 6.25 | 14,100 | 21,087 | 2,604,152 | 2024/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 1.75 | 5,700 | 6,543 | 808,069 | 2024/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 1.5 | 1,500 | 1,695 | 209,361 | 2024/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 1.0 | 5,700 | 6,209 | 766,821 | 2024/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 6.5 | 26,900 | 45,814 | 5,657,661 | 2027/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 5.625 | 6,000 | 9,755 | 1,204,731 | 2028/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 4.75 | 3,400 | 5,244 | 647,601 | 2028/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 6.25 | 3,500 | 6,291 | 776,949 | 2030/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 5.5 | 5,300 | 9,142 | 1,128,974 | 2031/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 4.75 | 6,600 | 11,391 | 1,406,676 | 2034/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 4.0 | 9,400 | 15,490 | 1,912,956 | 2037/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 4.25 | 5,400 | 9,477 | 1,170,370 | 2039/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 4.75 | 5,200 | 9,823 | 1,213,087 | 2040/7/4 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | | 3.25 | 5,500 | 8,723 | 1,077,301 | 2042/7/4 | | |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|--------------------------|------|---------------------------|--------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 4,700 | 6,715 | 829,341 | 2044/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 8,000 | 11,579 | 1,429,915 | 2046/8/15 |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25 | 10,300 | 10,973 | 1,355,119 | 2017/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 18,900 | 19,894 | 2,456,820 | 2017/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.75 | 10,500 | 10,644 | 1,314,512 | 2018/1/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 26,900 | 29,009 | 3,582,382 | 2018/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 9,900 | 10,623 | 1,311,947 | 2018/6/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 23,800 | 26,184 | 3,233,556 | 2018/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 8,000 | 8,716 | 1,076,338 | 2018/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 17,000 | 18,958 | 2,341,172 | 2019/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 3,800 | 4,276 | 528,107 | 2019/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5 | 14,100 | 15,115 | 1,866,576 | 2019/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.5 | 500 | 522 | 64,505 | 2019/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 25,900 | 29,417 | 3,632,732 | 2019/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 10,300 | 11,950 | 1,475,712 | 2020/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.25 | 21,800 | 25,155 | 3,106,393 | 2020/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 12,600 | 14,592 | 1,801,973 | 2020/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 11,000 | 12,741 | 1,573,425 | 2021/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 7,000 | 8,124 | 1,003,343 | 2021/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 7,800 | 9,100 | 1,123,791 | 2021/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 10,400 | 12,692 | 1,567,354 | 2021/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 16,800 | 20,924 | 2,583,954 | 2022/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 9,600 | 12,378 | 1,528,588 | 2022/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.5 | 17,100 | 22,105 | 2,729,767 | 2022/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 4,600 | 5,702 | 704,165 | 2023/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 7,200 | 9,087 | 1,122,168 | 2023/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 9.0 | 10,700 | 16,769 | 2,070,808 | 2023/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 11,700 | 14,599 | 1,802,862 | 2024/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.75 | 2,300 | 2,744 | 338,901 | 2024/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 14,900 | 19,370 | 2,392,056 | 2025/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 8,500 | 10,817 | 1,335,803 | 2026/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 7.25 | 8,600 | 13,274 | 1,639,324 | 2026/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5 | 18,200 | 27,139 | 3,351,498 | 2027/11/1 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 7,300 | 9,644 | 1,190,941 | 2028/9/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.25 | 12,100 | 16,897 | 2,086,690 | 2029/11/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0 | 14,700 | 22,214 | 2,743,285 | 2031/5/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.75 | 6,400 | 9,625 | 1,188,665 | 2033/2/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 8,400 | 11,855 | 1,464,067 | 2034/8/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 5,700 | 7,191 | 888,031 | 2037/2/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 8,000 | 11,508 | 1,421,122 | 2039/8/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 14,600 | 20,972 | 2,589,943 | 2040/9/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 7,000 | 9,927 | 1,225,934 | 2044/9/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25 | 3,100 | 3,477 | 429,484 | 2046/9/1 | | |
| フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | 1.0 | 8,000 | 8,341 | 1,030,093 | 2019/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 8,500 | 8,756 | 1,081,364 | 2019/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.5 | 3,500 | 4,253 | 525,227 | 2030/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O. A. T | 4.25 | 9,700 | 10,373 | 1,280,993 | 2017/10/25 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|-------------------------|------|--------------------------|-------|---------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| フランス | 国債証券 | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 6,000 | 6,525 | 805,892 | 2018/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.0 | 4,500 | 4,632 | 572,089 | 2018/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 10,800 | 12,050 | 1,488,157 | 2018/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.0 | 6,600 | 6,839 | 844,606 | 2018/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 11,500 | 13,096 | 1,617,235 | 2019/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8.5 | 4,000 | 5,231 | 646,050 | 2019/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.75 | 10,800 | 12,349 | 1,525,070 | 2019/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.5 | 14,800 | 17,049 | 2,105,400 | 2020/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.5 | 17,300 | 19,442 | 2,400,967 | 2020/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.75 | 11,800 | 14,128 | 1,744,756 | 2021/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.25 | 15,100 | 17,919 | 2,212,931 | 2021/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.0 | 14,800 | 17,545 | 2,166,681 | 2022/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.25 | 17,600 | 20,207 | 2,495,449 | 2022/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 8.5 | 8,200 | 13,066 | 1,613,627 | 2023/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.25 | 28,500 | 37,369 | 4,614,722 | 2023/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.75 | 8,000 | 9,007 | 1,112,304 | 2024/11/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 6.0 | 19,800 | 30,253 | 3,736,018 | 2025/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.5 | 20,500 | 26,600 | 3,284,932 | 2026/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.75 | 7,200 | 8,875 | 1,096,028 | 2027/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.5 | 23,100 | 36,530 | 4,511,131 | 2029/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.75 | 16,600 | 28,664 | 3,539,826 | 2032/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.75 | 8,500 | 13,768 | 1,700,234 | 2035/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 9,800 | 14,978 | 1,849,733 | 2038/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.5 | 11,400 | 19,040 | 2,351,348 | 2041/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.25 | 10,400 | 14,791 | 1,826,592 | 2045/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 4,700 | 7,911 | 977,034 | 2055/4/25 |
| FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 3,800 | 6,496 | 802,256 | 2060/4/25 | | |
| FRENCH TREASURY NOTE | 1.0 | 1,000 | 1,017 | 125,663 | 2017/7/25 | | |
| オランダ | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.5 | 4,000 | 4,236 | 523,183 | 2017/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.25 | 4,500 | 4,632 | 572,083 | 2018/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 6,500 | 7,140 | 881,812 | 2018/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.25 | 2,500 | 2,616 | 323,165 | 2019/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 7,100 | 8,112 | 1,001,807 | 2019/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.25 | 2,000 | 2,051 | 253,350 | 2020/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.5 | 5,800 | 6,752 | 833,884 | 2020/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.25 | 5,900 | 6,989 | 863,072 | 2021/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.25 | 1,500 | 1,724 | 212,983 | 2022/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 5,900 | 7,430 | 917,645 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 7.5 | 4,300 | 6,493 | 801,926 | 2023/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 1.75 | 1,400 | 1,579 | 194,998 | 2023/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.0 | 13,500 | 15,580 | 1,924,017 | 2024/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5.5 | 6,300 | 9,948 | 1,228,597 | 2028/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5 | 3,700 | 4,752 | 586,856 | 2033/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 5,000 | 8,079 | 997,725 | 2037/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 5,200 | 8,648 | 1,068,048 | 2042/1/15 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.75 | 4,500 | 6,620 | 817,582 | 2047/1/15 | | |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5 | 28,700 | 28,941 | 3,573,933 | 2017/10/31 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | |
|----------------------|------|--------------------------|--------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.5 | 20,700 | 22,335 | 2,758,175 | 2018/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.25 | 1,300 | 1,307 | 161,484 | 2018/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.1 | 17,100 | 18,682 | 2,307,155 | 2018/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.75 | 17,100 | 18,706 | 2,310,075 | 2018/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.75 | 13,800 | 14,903 | 1,840,375 | 2019/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.6 | 9,100 | 10,411 | 1,285,718 | 2019/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.3 | 23,800 | 27,201 | 3,359,053 | 2019/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.0 | 19,900 | 22,808 | 2,816,602 | 2020/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.85 | 11,600 | 13,880 | 1,714,131 | 2020/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.5 | 7,500 | 9,348 | 1,154,417 | 2021/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.85 | 9,200 | 11,903 | 1,470,001 | 2022/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.4 | 14,600 | 18,897 | 2,333,664 | 2023/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.4 | 4,700 | 5,813 | 717,906 | 2023/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.8 | 7,100 | 9,006 | 1,112,194 | 2024/1/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.8 | 8,300 | 9,897 | 1,222,273 | 2024/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.65 | 13,700 | 17,427 | 2,152,138 | 2025/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.9 | 18,400 | 25,753 | 3,180,284 | 2026/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 4,800 | 6,523 | 805,609 | 2028/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9 | 4,900 | 6,852 | 846,216 | 2040/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7 | 4,400 | 6,015 | 742,839 | 2041/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 4,900 | 7,199 | 889,121 | 2044/10/31 |
| SPANISH GOVERNMENT | 5.5 | 10,400 | 11,114 | 1,372,507 | 2017/7/30 | | |
| SPANISH GOVERNMENT | 6.0 | 9,800 | 14,312 | 1,767,403 | 2029/1/31 | | |
| SPANISH GOVERNMENT | 5.75 | 7,300 | 10,877 | 1,343,290 | 2032/7/30 | | |
| SPANISH GOVERNMENT | 4.2 | 5,600 | 7,124 | 879,796 | 2037/1/31 | | |
| ベルギー | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM | 3.5 | 1,700 | 1,777 | 219,450 | 2017/6/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.25 | 4,000 | 4,150 | 512,488 | 2018/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.0 | 3,100 | 3,455 | 426,690 | 2019/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 7,000 | 8,255 | 1,019,513 | 2020/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 7,200 | 8,925 | 1,102,163 | 2021/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 5,000 | 6,222 | 768,428 | 2022/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 6,400 | 8,167 | 1,008,547 | 2022/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.25 | 5,000 | 5,781 | 713,930 | 2023/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.6 | 7,300 | 8,687 | 1,072,757 | 2024/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.5 | 6,400 | 8,918 | 1,101,358 | 2026/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 3,500 | 5,030 | 621,261 | 2032/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 6,800 | 10,920 | 1,348,629 | 2041/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 3,700 | 5,671 | 700,401 | 2045/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 2,000 | 2,165 | 267,405 | 2017/9/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4.0 | 2,500 | 2,711 | 334,812 | 2018/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 4.0 | 5,200 | 5,867 | 724,599 | 2019/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 10,600 | 16,324 | 2,015,850 | 2028/3/28 |
| BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.0 | 9,500 | 15,687 | 1,937,260 | 2035/3/28 | | |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.3 | 1,500 | 1,597 | 197,219 | 2017/9/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.65 | 3,000 | 3,260 | 402,623 | 2018/1/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.15 | 2,300 | 2,390 | 295,160 | 2018/10/19 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.35 | 2,500 | 2,839 | 350,649 | 2019/3/15 |

| 銘柄 | | | 当 期 末 | | | | 償還年月日 |
|---------------------|------------------------|------------------------|-------|-----------------------|--------|-----------|-------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ユーロ | | | % | 千ユーロ | 千ユーロ | 千円 | |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.95 | 1,700 | 1,824 | 225,363 | 2019/6/18 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.25 | 2,400 | 2,452 | 302,896 | 2019/10/18 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.9 | 4,600 | 5,422 | 669,622 | 2020/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.5 | 4,400 | 5,281 | 652,244 | 2021/9/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.65 | 3,300 | 4,046 | 499,738 | 2022/4/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.4 | 5,000 | 6,147 | 759,093 | 2022/11/22 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.75 | 2,300 | 2,598 | 320,939 | 2023/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.65 | 3,000 | 3,369 | 416,074 | 2024/10/21 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.85 | 5,400 | 7,729 | 954,456 | 2026/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 6.25 | 4,600 | 7,503 | 926,611 | 2027/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.15 | 5,900 | 9,304 | 1,148,961 | 2037/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.15 | 4,500 | 6,569 | 811,270 | 2044/6/20 |
| フィンランド | 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT | 3.875 | 2,000 | 2,118 | 261,649 | 2017/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.125 | 1,500 | 1,556 | 192,161 | 2018/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 4.375 | 1,300 | 1,498 | 184,997 | 2019/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 3.375 | 2,000 | 2,293 | 283,162 | 2020/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 3.5 | 2,000 | 2,370 | 292,786 | 2021/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.625 | 3,200 | 3,545 | 437,891 | 2022/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.5 | 2,200 | 2,429 | 299,975 | 2023/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 4.0 | 2,400 | 3,210 | 396,521 | 2025/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.75 | 3,500 | 4,387 | 541,777 | 2028/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.75 | 700 | 695 | 85,869 | 2031/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.625 | 1,400 | 1,921 | 237,253 | 2042/7/4 |
| | | アイルランド | 国債証券 | IRELAND (REPUBLIC OF) | 4.4 | 3,600 | 4,120 |
| IRISH GOVERNMENT | 5.5 | | | 7,500 | 8,136 | 1,004,809 | 2017/10/18 |
| IRISH GOVERNMENT | 4.5 | | | 5,600 | 6,260 | 773,091 | 2018/10/18 |
| IRISH GOVERNMENT | 5.9 | | | 3,400 | 4,109 | 507,507 | 2019/10/18 |
| IRISH GOVERNMENT | 4.5 | | | 5,300 | 6,258 | 772,849 | 2020/4/18 |
| IRISH GOVERNMENT | 5.0 | | | 3,500 | 4,278 | 528,402 | 2020/10/18 |
| IRISH GOVERNMENT | 5.4 | | | 6,000 | 8,360 | 1,032,482 | 2025/3/13 |
| IRISH TSY 2% 2045 | 2.0 | | | 1,500 | 1,556 | 192,230 | 2045/2/18 |
| IRISH TSY 2.4% 2030 | 2.4 | | | 1,500 | 1,713 | 211,564 | 2030/5/15 |
| IRISH TSY 3.4% 2024 | 3.4 | | | 1,300 | 1,574 | 194,494 | 2024/3/18 |
| REPUBLIC OF IRELAND | 3.9 | | | 3,400 | 4,196 | 518,183 | 2023/3/20 |
| 小 計 | | | | | | | 257,196,914 |
| ポーランド | | | | 千ズロチ | 千ズロチ | | |
| 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.25 | 7,500 | 7,906 | 220,272 | 2017/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.75 | 8,100 | 8,428 | 234,805 | 2018/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 9,500 | 9,666 | 269,301 | 2018/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 5,800 | 6,067 | 169,039 | 2019/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.5 | 11,100 | 12,420 | 346,046 | 2019/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 1.5 | 5,200 | 5,111 | 142,411 | 2020/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.25 | 29,900 | 33,906 | 944,637 | 2020/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 4,000 | 4,696 | 130,830 | 2021/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 9,400 | 11,209 | 312,296 | 2022/9/23 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 4.0 | 9,600 | 10,438 | 290,818 | 2023/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 3.25 | 16,700 | 17,166 | 478,267 | 2025/7/25 |

| 銘柄 | 柄 | | 当 期 末 | | | | |
|---------|------|------------------------|-------|-----------|-----------|-----------|------------|
| | | | 利 率 | 額面金額 | 評 価 額 | | 償還年月日 |
| | | | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | |
| ポーランド | | | % | 千ズロチ | 千ズロチ | 千円 | |
| | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.75 | 3,700 | 4,667 | 130,037 | 2029/4/25 |
| 小 | 計 | | | | | 3,668,764 | |
| シンガポール | | | | 千シンガポールドル | 千シンガポールドル | | |
| | 国債証券 | SINGAPORE GOVERNMENT | 4.0 | 1,600 | 1,707 | 135,043 | 2018/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.5 | 4,100 | 4,260 | 336,937 | 2019/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.25 | 4,000 | 4,304 | 340,360 | 2020/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.25 | 2,580 | 2,660 | 210,400 | 2021/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.125 | 1,200 | 1,294 | 102,392 | 2022/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 2,400 | 2,532 | 200,230 | 2023/7/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0 | 1,500 | 1,613 | 127,575 | 2024/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.5 | 3,300 | 3,724 | 294,497 | 2027/3/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 2,400 | 2,548 | 201,504 | 2030/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.375 | 500 | 565 | 44,722 | 2033/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 2,900 | 3,047 | 241,027 | 2042/4/1 |
| 小 | 計 | | | | | 2,234,693 | |
| マレーシア | | | | 千リンギ | 千リンギ | | |
| | 国債証券 | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.012 | 4,000 | 4,056 | 108,630 | 2017/9/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.24 | 8,200 | 8,363 | 223,985 | 2018/2/7 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.26 | 3,700 | 3,712 | 99,413 | 2018/3/1 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.58 | 3,000 | 3,018 | 80,834 | 2018/9/28 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.378 | 11,900 | 12,263 | 328,406 | 2019/11/29 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.492 | 10,000 | 9,996 | 267,714 | 2020/3/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.889 | 2,400 | 2,436 | 65,261 | 2020/7/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.16 | 6,000 | 6,144 | 164,541 | 2021/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.048 | 8,700 | 8,856 | 237,178 | 2021/9/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.418 | 4,600 | 4,506 | 120,683 | 2022/8/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.48 | 7,800 | 7,683 | 205,764 | 2023/3/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.181 | 5,800 | 5,907 | 158,192 | 2024/7/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.392 | 8,800 | 9,082 | 243,241 | 2026/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.502 | 4,000 | 3,765 | 100,849 | 2027/5/31 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.733 | 1,800 | 1,722 | 46,116 | 2028/6/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 5.248 | 2,700 | 2,959 | 79,254 | 2028/9/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.498 | 2,500 | 2,563 | 68,657 | 2030/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.232 | 4,400 | 4,417 | 118,301 | 2031/6/30 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.127 | 4,700 | 4,620 | 123,740 | 2032/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 3.844 | 400 | 378 | 10,129 | 2033/4/15 |
| | | MALAYSIAN GOVERNMENT | 4.935 | 1,600 | 1,661 | 44,500 | 2043/9/30 |
| 小 | 計 | | | | | 2,895,398 | |
| オーストラリア | | | | 千豪ドル | 千豪ドル | | |
| | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 5,000 | 5,154 | 408,224 | 2017/7/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5 | 9,400 | 10,014 | 793,122 | 2018/1/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 4,700 | 4,888 | 387,181 | 2018/10/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.25 | 11,400 | 12,566 | 995,274 | 2019/3/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 2,900 | 3,012 | 238,560 | 2019/10/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 13,100 | 14,527 | 1,150,593 | 2020/4/15 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.75 | 900 | 901 | 71,359 | 2020/11/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 9,400 | 11,177 | 885,274 | 2021/5/15 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | 償還年月日 |
|---------|--------------------------|------|---------|---------|-------------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 債還年月日 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| オーストラリア | | % | 千豪ドル | 千豪ドル | 千円 | |
| 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.75 | 7,900 | 9,639 | 763,423 | 2022/7/15 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 5.5 | 7,300 | 8,918 | 706,349 | 2023/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 8,200 | 8,529 | 675,547 | 2024/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 16,000 | 17,269 | 1,367,709 | 2025/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.25 | 9,500 | 10,720 | 849,083 | 2026/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.75 | 4,800 | 5,892 | 466,675 | 2027/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.25 | 6,100 | 6,569 | 520,339 | 2029/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.5 | 3,600 | 4,449 | 352,368 | 2033/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,800 | 1,753 | 138,838 | 2035/6/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 3.75 | 5,400 | 6,051 | 479,300 | 2037/4/21 |
| 小計 | | | | | 11,249,226 | |
| メキシコ | | | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | |
| 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.0 | 6,400 | 6,467 | 38,548 | 2017/6/15 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 60,800 | 64,276 | 383,090 | 2017/12/14 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 4.75 | 108,800 | 109,372 | 651,857 | 2018/6/14 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 94,500 | 103,307 | 615,712 | 2018/12/13 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.0 | 29,000 | 28,955 | 172,575 | 2019/12/11 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 60,700 | 67,014 | 399,408 | 2020/6/11 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 85,600 | 89,956 | 536,141 | 2021/6/10 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 6.5 | 27,400 | 28,748 | 171,339 | 2022/6/9 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 30,700 | 39,482 | 235,316 | 2024/12/5 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5 | 71,600 | 80,001 | 476,807 | 2027/6/3 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 47,100 | 56,799 | 338,523 | 2029/5/31 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 41,000 | 46,552 | 277,455 | 2031/5/29 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 10,000 | 11,373 | 67,786 | 2034/11/23 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 46,000 | 64,233 | 382,830 | 2036/11/20 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 30,500 | 37,504 | 223,523 | 2038/11/18 |
| | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 54,200 | 62,140 | 370,356 | 2042/11/13 |
| | MEXICAN FIXED RATE BONDS | 8.0 | 83,000 | 94,542 | 563,472 | 2023/12/7 |
| 小計 | | | | | 5,904,747 | |
| 南アフリカ | | | 千ランド | 千ランド | | |
| 国債証券 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.25 | 10,300 | 10,349 | 74,105 | 2017/9/15 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 23,800 | 23,668 | 169,466 | 2018/12/21 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.25 | 25,300 | 24,316 | 174,106 | 2020/1/15 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.75 | 26,100 | 24,158 | 172,976 | 2021/3/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.75 | 25,200 | 23,740 | 169,982 | 2023/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 10.5 | 61,900 | 67,588 | 483,934 | 2026/12/21 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.0 | 24,300 | 21,482 | 153,813 | 2030/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 7.0 | 30,000 | 23,853 | 170,787 | 2031/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.25 | 41,000 | 36,329 | 260,119 | 2032/3/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.25 | 47,100 | 32,950 | 235,927 | 2036/3/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.5 | 22,500 | 19,831 | 141,993 | 2037/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 6.5 | 24,600 | 17,062 | 122,168 | 2041/2/28 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 12,300 | 10,966 | 78,523 | 2044/1/31 |
| | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA | 8.75 | 46,100 | 40,970 | 293,346 | 2048/2/28 |
| 小計 | | | | | 2,701,252 | |
| 合計 | | | | | 626,360,972 | |

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

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年5月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 626,360,972 | % 98.3 |
| コール・ローン等、その他 | 11,133,784 | 1.7 |
| 投資信託財産総額 | 637,494,756 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産（631,449,795千円）の投資信託財産総額（637,494,756千円）に対する比率は99.1%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=108.46円、1カナダドル=83.59円、1英ポンド=156.26円、1スイスフラン=111.70円、1スウェーデンクローナ=13.28円、1ノルウェークローネ=13.19円、1デンマーククローネ=16.60円、1ユーロ=123.49円、1ズロチ=27.86円、1シンガポールドル=79.08円、1リンギ=26.78円、1豪ドル=79.20円、1メキシコペソ=5.96円、1ランド=7.16円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年5月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 639,133,070,846 |
| コール・ローン等 | 4,545,792,238 |
| 公社債(評価額) | 626,360,972,586 |
| 未収入金 | 1,823,000,886 |
| 未収利息 | 5,918,367,356 |
| 前払費用 | 484,937,780 |
| (B) 負債 | 6,235,070,181 |
| 前受収益 | 10,513 |
| 未払金 | 5,707,149,631 |
| 未払解約金 | 520,172,349 |
| 未払利息 | 3,488 |
| その他未払費用 | 7,734,200 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 632,898,000,665 |
| 元本 | 291,325,475,847 |
| 次期繰越損益金 | 341,572,524,818 |
| (D) 受益権総口数 | 291,325,475,847口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 21,725円 |

(注) 期首元本額は226,250,611,838円、期中追加設定元本額は93,884,664,448円、期中一部解約元本額は28,809,800,439円、1口当たり純資産額は2.1725円です。

○損益の状況 (2015年5月12日～2016年5月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 17,097,914,261 |
| 受取利息 | 17,098,505,784 |
| 支払利息 | △ 591,523 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 61,369,438,009 |
| 売買益 | 9,743,040,445 |
| 売買損 | △ 71,112,478,454 |
| (C) 保管費用等 | △ 66,787,725 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 44,338,311,473 |
| (E) 前期繰越損益金 | 299,807,870,946 |
| (F) 追加信託差損益金 | 123,857,945,032 |
| (G) 解約差損益金 | △ 37,754,979,687 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 341,572,524,818 |
| 次期繰越損益金(H) | 341,572,524,818 |

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|------------------------------------|-----------------|
| | 円 |
| 野村外国債券インデックス（野村投資一任口座向け） | 176,457,397,990 |
| 野村世界6資産分散投信（分配コース） | 30,422,937,991 |
| 野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け） | 12,220,623,842 |
| グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用） | 9,732,837,067 |
| マイ・ロード | 8,243,352,955 |
| 野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用） | 7,294,994,580 |
| のむらっぴ・ファンド（普通型） | 6,049,210,521 |
| のむらっぴ・ファンド（保守型） | 4,203,459,238 |
| グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用） | 2,511,358,868 |
| 野村DC外国債券インデックスファンド | 2,493,189,250 |
| マイバランス50（確定拠出年金向け） | 2,400,306,707 |
| マイバランス70（確定拠出年金向け） | 2,163,660,740 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用） | 2,115,180,803 |
| 野村外国債券インデックス（野村SMA・EW向け） | 2,018,404,437 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用） | 1,907,486,569 |
| マイバランス30（確定拠出年金向け） | 1,820,986,375 |
| グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用） | 1,804,312,476 |
| 野村世界6資産分散投信（安定コース） | 1,745,367,331 |
| 野村外国債券インデックス（野村SMA向け） | 1,689,490,286 |
| 野村世界6資産分散投信（成長コース） | 1,515,216,664 |
| のむらっぴ・ファンド（積極型） | 1,486,329,678 |
| 野村世界6資産分散投信（配分変更コース） | 1,421,173,277 |
| ノムラ外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用） | 1,251,940,876 |
| 野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用） | 1,112,958,024 |
| マイバランスDC30 | 1,012,111,671 |
| 野村DC運用戦略ファンド | 754,737,592 |
| グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用） | 650,873,984 |
| マイバランスDC50 | 586,652,515 |
| 野村インデックスファンド・外国債券 | 571,229,988 |
| 野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用） | 520,369,883 |
| 野村外国債券バッシブファンド（確定拠出年金向け） | 518,466,464 |
| ネクストコア | 483,317,021 |
| マイバランスDC70 | 354,395,352 |
| 野村外国債券インデックスファンド | 286,101,969 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用） | 240,094,682 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用） | 210,656,574 |
| ノムラFOfs用インデックスファンド・外国債券（適格機関投資家専用） | 197,213,360 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用） | 105,881,930 |
| バランスセレクト50 | 89,600,390 |
| バランスセレクト30 | 86,883,757 |
| 野村インデックスファンド・海外5資産バランス | 83,971,392 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 72,555,388 |
| バランスセレクト70 | 67,555,802 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 50,467,803 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 46,681,186 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 46,648,867 |
| 野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用） | 43,530,310 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 39,447,006 |
| ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用） | 36,879,283 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 25,922,484 |
| マイターゲット2050（確定拠出年金向け） | 11,597,920 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用） | 8,766,188 |
| バランスセレクト50（確定拠出年金向け） | 7,574,123 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 5,375,804 |

| ファンド名 | 当期末 |
|-----------------------------------|-----------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| バランスセレクト70 (確定拠出年金向け) | 5,063,000 |
| 野村DC運用戦略ファンドM | 5,055,226 |
| ワールド・インデックス・ファンドVA積極型 (適格機関投資家専用) | 4,450,812 |
| バランスセレクト30 (確定拠出年金向け) | 4,353,670 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 2,628,781 |
| 野村DC運用戦略ファンドA | 2,591,399 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 2,348,224 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 347,674 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 266,217 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 244,786 |
| マイターゲット2040 (確定拠出年金向け) | 218,042 |
| マイターゲット2030 (確定拠出年金向け) | 170,783 |

○お知らせ

信託金限度額を、1兆円から3兆円に変更する所要の約款変更を行いました。

<変更適用日：2016年4月15日>