

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年4月5日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、有価証券報告書を提出いたしましたので、2018年10月12日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況

また、それ以外の訂正事項につきましては、＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部__は訂正部分を示し、＜更新後＞の記載事項は原届出書の更新後の内容を示します。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1 ファンドの性格

(3) ファンドの仕組み

< 更新後 >

委託会社の概況(2019年2月末現在)

・ 名称

野村アセットマネジメント株式会社

・ 本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

・ 資本金の額

17,180百万円

・ 会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・ 大株主の状況

名称	住所	所有株式数	比率
野村ホールディングス株式会社	東京都中央区日本橋一丁目9番1号	5,150,693株	100%

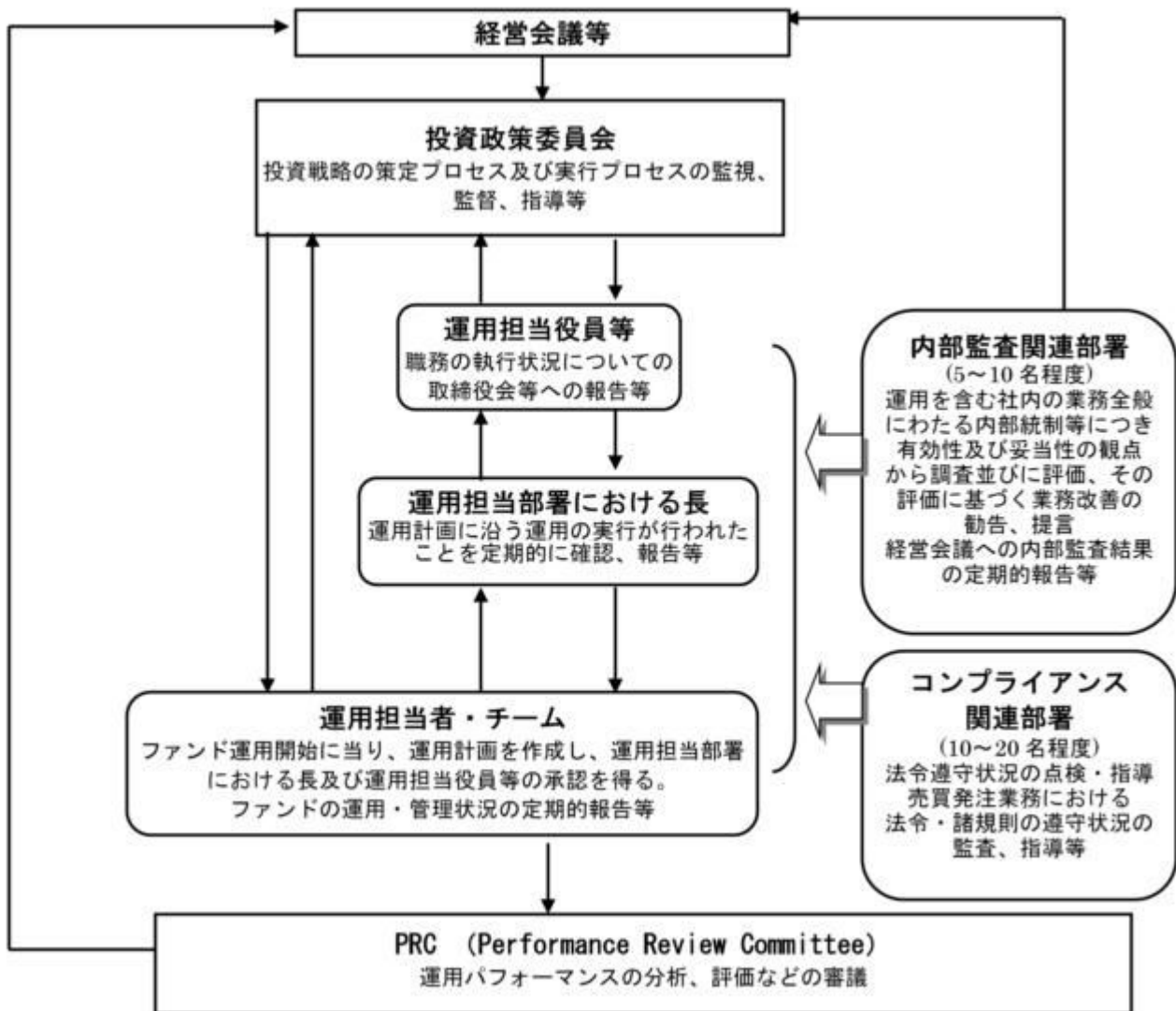
2 投資方針

(3) 運用体制

< 更新後 >

ファンドを含む委託会社における投資信託の内部管理及び意思決定を監督する組織等は以下の通りで

す。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

当社では、「受託会社」または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

運用の外部委託を行う場合、「運用の外部委託先」に対しては、外部委託先が行った日々の約定について、投資ガイドラインに沿ったものであるかを確認しています。また、コンプライアンスレポートの提出を義務付け、定期的に管理状況に関する報告を受けています。さらに、外部委託先の管理体制、コンプライアンス体制等について調査ならびに評価を行い、定期的に商品に関する委員会に報告しています。

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

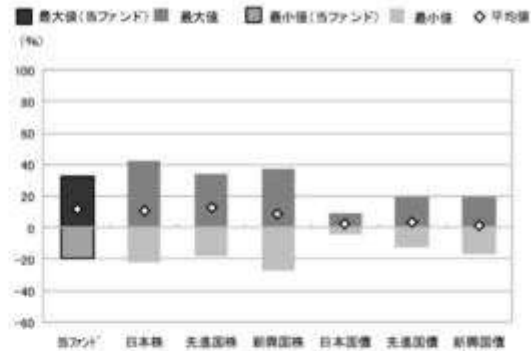
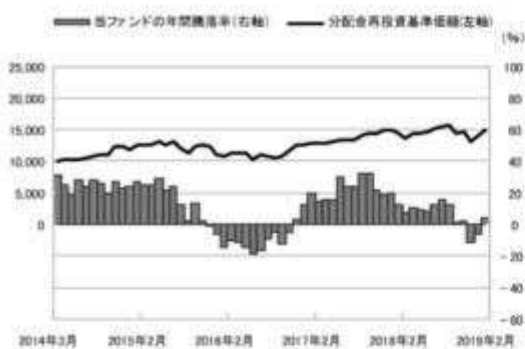
3 投資リスク

< 更新後 >

リスクの定量的比較

(2014年3月末～2019年2月末:月次)

〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉 〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	32.5	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値(%)	△19.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値(%)	11.5	10.9	12.3	8.1	2.0	3.4	1.5

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2014年3月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2014年3月から2019年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2014年3月から2019年2月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算しており、実際の基準価額と異なる場合があります。

＜代表的な資産クラスの指数＞

- 日本株:東証株価指数(TOPIX)(配当込み)
- 先進国株:MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)
- 新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)
- 日本国債:NOMURA-BPI国債
- 先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)
- 新興国債:JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)

■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、株東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income L.L.C.により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income L.L.C.の知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income L.L.C.が有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてはここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価値を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスは法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、「JPM」)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを予測するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国のJ.P. Morgan Securities L.L.C.(ここでは「JPM S.L.L.C.」)は、「指数スポンサー」は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての奨励、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPM S.L.L.C.はNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JP S.L. J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

(出所:株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income L.L.C. 他)

4 手数料等及び税金

(3) 信託報酬等

< 更新後 >

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年10,000分の41.04（税抜年10,000分の38）の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り（税抜）とします。

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
年10,000分の30	年10,000分の5	年10,000分の3

ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、年10,000分の41.8となります。

支払先の役務の内容

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
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	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	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

(5) 課税上の取扱い

< 更新後 >

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、20.315%（国税（所得税及び復興特別所得税）15.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれます。なお、確定申告により、申告分離課税もしくは総合課税のいずれかを選択することもできます。

なお、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）については、申告分離課税により20.315%（国税15.315%および地方税5%）の税率が適用され、源泉徴収口座を選択した場合は20.315%の税率により源泉徴収が行なわれます。

損益通算について

以下の所得間で損益通算が可能です。上場株式等の配当所得については申告分離課税を選択したものに限りです。

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(注2)	《配当所得》
<ul style="list-style-type: none"> ・ 特定公社債^(注1)の利子 ・ 公募公社債投資信託の収益分配金 	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の <ul style="list-style-type: none"> ・ 譲渡益 ・ 譲渡損 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 上場株式の配当 ・ 公募株式投資信託の収益分配金

(注1) 「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行され

た公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

（注2）株式等に係る譲渡所得等について、上場株式等に係る譲渡所得等とそれ以外の株式等に係る譲渡所得等に区分し、別々の分離課税制度とすることとされ、原則として、これら相互の通算等ができないこととされました。

法人の投資家に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金（解約）時および償還時の個別元本超過額については、15.315%（国税15.315%）の税率で源泉徴収が行なわれます。なお、地方税の源泉徴収はありません。

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の差益については、譲渡所得とみなして課税が行われます。

換金（解約）時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益を譲渡益として課税対象となります。

[法人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が源泉徴収の対象（配当所得）となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

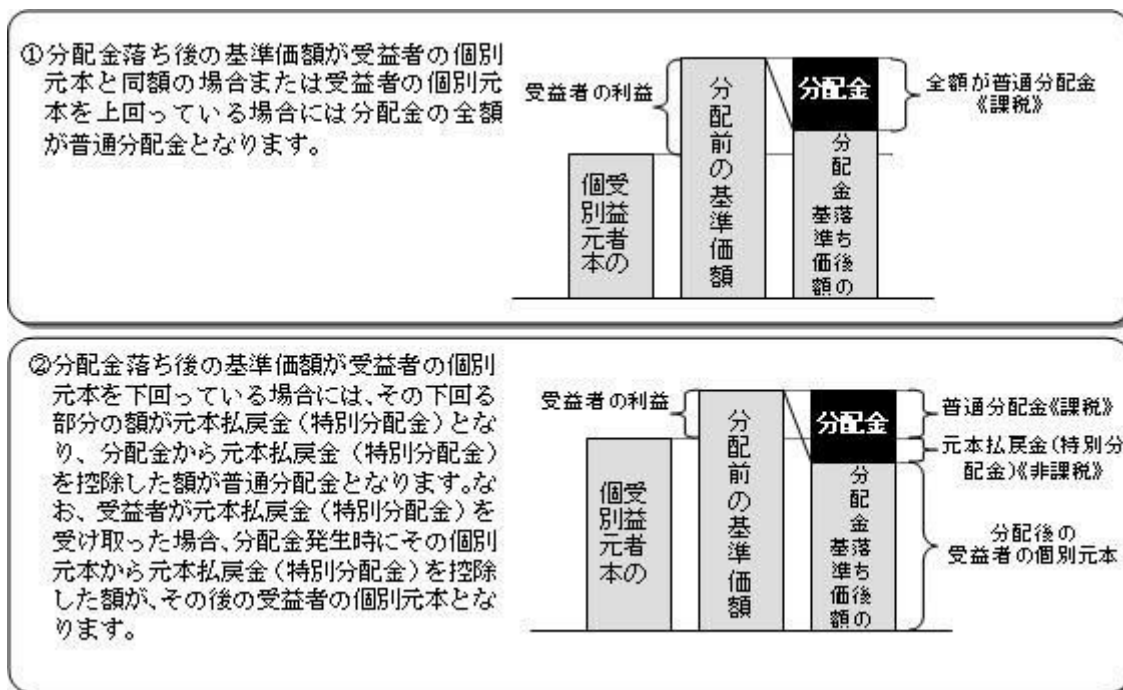
追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合や受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合などには、当該受益者の個別元本が変わりますので、詳しくは販売会社へお問い合わせください。

分配金の課税について

分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受

益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。



上図はあくまでもイメージ図であり、個別元本や基準価額、分配金の各水準等を示唆するものではありません。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2019年2月末現在）が変更になる場合があります。

5 運用状況

以下は2019年2月28日現在の運用状況であります。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

(1) 投資状況

野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	97,880,622,287	99.99
現金・預金・その他資産（負債控除後）		9,761,203	0.00
合計（純資産総額）		97,890,383,490	100.00

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	365,964,752,599	65.32
	カナダ	21,159,049,709	3.77
	ドイツ	17,903,168,066	3.19
	イタリア	4,764,225,979	0.85
	フランス	22,154,718,033	3.95

	オランダ	6,749,996,203	1.20
	スペイン	6,320,832,995	1.12
	ベルギー	1,986,910,584	0.35
	オーストリア	496,892,825	0.08
	ルクセンブルグ	200,353,354	0.03
	フィンランド	2,184,494,370	0.38
	アイルランド	1,129,204,795	0.20
	ポルトガル	320,105,566	0.05
	イギリス	35,087,746,213	6.26
	スイス	18,138,038,047	3.23
	スウェーデン	5,527,758,015	0.98
	ノルウェー	1,513,606,263	0.27
	デンマーク	3,636,963,063	0.64
	オーストラリア	13,356,672,760	2.38
	ニュージーランド	480,790,554	0.08
	香港	7,375,943,160	1.31
	シンガポール	2,514,889,581	0.44
	イスラエル	588,319,103	0.10
	小計	539,555,431,837	96.30
投資証券	アメリカ	11,336,723,554	2.02
	カナダ	116,189,297	0.02
	フランス	677,586,350	0.12
	イギリス	441,164,320	0.07
	オーストラリア	1,072,426,085	0.19
	香港	405,300,681	0.07
	シンガポール	255,394,565	0.04
	小計	14,304,784,852	2.55
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,403,657,188	1.14
合計（純資産総額）		560,263,873,877	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。
 評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	4,291,860,849	0.76
	買建	カナダ	258,298,857	0.04
	買建	ドイツ	735,939,411	0.13
	買建	イギリス	407,719,968	0.07
	買建	スイス	196,191,230	0.03
	買建	オーストラリア	121,608,382	0.02

（２）投資資産

投資有価証券の主要銘柄

野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	36,413,921,982	2.4734	90,066,194,631	2.6880	97,880,622,287	99.99

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

（参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	663,300	18,933.17	12,558,375,280	19,387.83	12,859,952,216	2.29
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,000,400	10,323.28	10,327,413,000	12,436.28	12,441,262,415	2.22
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	56,930	164,387.67	9,358,590,488	181,947.64	10,358,279,618	1.84
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	331,400	17,663.91	5,853,822,300	18,050.74	5,982,016,794	1.06
5	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	368,600	14,294.52	5,268,963,625	15,063.90	5,552,556,083	0.99
6	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	461,800	12,135.70	5,604,270,707	11,659.08	5,384,167,393	0.96
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	43,260	115,259.54	4,986,128,015	123,736.46	5,352,839,411	0.95
8	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	581,800	8,327.15	4,844,740,890	8,810.83	5,126,146,072	0.91
9	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	41,070	115,987.25	4,763,596,410	124,494.81	5,113,002,023	0.91
10	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,304,200	3,285.65	4,285,154,462	3,273.99	4,269,939,193	0.76
11	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	421,000	8,455.89	3,559,933,788	9,988.90	4,205,327,237	0.75
12	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	178,300	22,202.21	3,958,654,188	22,427.89	3,998,893,197	0.71

13	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	244,200	13,525.87	3,303,018,159	16,322.28	3,985,901,118	0.71
14	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	805,700	4,036.00	3,251,810,849	4,759.64	3,834,849,280	0.68
15	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	342,200	8,899.77	3,045,502,997	10,966.15	3,752,617,112	0.66
16	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	633,900	5,702.34	3,614,718,877	5,902.71	3,741,733,447	0.66
17	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	646,600	4,782.25	3,092,206,735	5,719.78	3,698,411,882	0.66
18	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	132,300	24,410.37	3,229,492,490	27,726.36	3,668,198,698	0.65
19	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	75,050	36,571.33	2,744,678,636	48,277.23	3,623,206,322	0.64
20	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	568,000	5,407.63	3,071,537,369	6,288.54	3,571,894,355	0.63
21	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	263,400	12,681.72	3,340,367,005	13,313.26	3,506,715,213	0.62
22	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	629,000	5,803.67	3,650,509,472	5,532.41	3,479,887,777	0.62
23	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	998,300	3,810.88	3,804,411,371	3,443.62	3,437,768,042	0.61
24	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	365,600	6,285.08	2,297,826,091	8,938.33	3,267,856,885	0.58
25	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	157,300	19,850.47	3,122,479,921	20,363.49	3,203,177,433	0.57
26	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	126,900	19,725.13	2,503,119,343	24,898.07	3,159,565,832	0.56
27	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	298,100	8,648.90	2,578,239,028	10,130.77	3,019,984,326	0.53
28	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	96,610	24,574.82	2,374,173,800	30,824.60	2,977,964,992	0.53
29	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	555,500	4,864.37	2,702,158,510	4,982.49	2,767,777,528	0.49
30	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	628,900	3,810.05	2,396,140,642	4,271.82	2,686,548,290	0.47

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.09
		メディア	1.18
		娯楽	1.44
		不動産管理・開発	0.59
		エネルギー設備・サービス	0.38
		石油・ガス・消耗燃料	6.07
		化学	2.33
		建設資材	0.27
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.49
		紙製品・林産品	0.09
		航空宇宙・防衛	2.38
		建設関連製品	0.38
		建設・土木	0.33
電気設備	0.73		

コングロマリット	1.44
機械	1.56
商社・流通業	0.30
商業サービス・用品	0.44
航空貨物・物流サービス	0.51
旅客航空輸送業	0.11
海運業	0.05
陸運・鉄道	1.08
運送インフラ	0.20
自動車部品	0.35
自動車	0.88
家庭用耐久財	0.38
レジャー用品	0.05
繊維・アパレル・贅沢品	1.45
ホテル・レストラン・レジャー	1.86
販売	0.07
インターネット販売・通信販売	2.37
複合小売り	0.47
専門小売り	1.64
食品・生活必需品小売り	1.50
飲料	1.89
食品	1.85
タバコ	0.97
家庭用品	1.28
パーソナル用品	0.69
ヘルスケア機器・用品	2.55
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.03
バイオテクノロジー	1.94
医薬品	5.70
銀行	8.33
各種金融サービス	0.97
保険	3.84
情報技術サービス	3.76
ソフトウェア	4.89
通信機器	0.99
コンピュータ・周辺機器	2.62
電子装置・機器・部品	0.49
半導体・半導体製造装置	2.94
各種電気通信サービス	2.08
無線通信サービス	0.30
電力	1.92
ガス	0.17
総合公益事業	1.08

	水道	0.08
	消費者金融	0.47
	資本市場	2.75
	各種消費者サービス	0.01
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11
	ヘルスケア・テクノロジー	0.08
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.74
	専門サービス	0.71
投資証券		2.55
合計		98.85

投資不動産物件

野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

評価にあたっては知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取引 所	E-mini S&P500株 価指数先物(2019 年03月限)	買建	277	米ドル	37,464,237.5	4,153,660,013	38,710,750	4,291,860,849	0.76
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2019年03 月限)	買建	16	カナダド ル	2,986,660	251,805,303	3,063,680	258,298,857	0.04
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指数 先物(2019年03月 限)	買建	178	ユーロ	5,652,480	712,721,203	5,836,620	735,939,411	0.13
	オース トラリア	シドニー先 物取引所	SPI200株価指数先 物(2019年03月限)	買建	10	豪ドル	1,476,700	117,161,376	1,532,750	121,608,382	0.02
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指数先 物(2019年03月限)	買建	39	英ポンド	2,717,050	401,172,433	2,761,395	407,719,968	0.07
	スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取引 所	SMI株価指数先物 (2019年03月限)	買建	19	スイスフ ラン	1,714,280	190,010,796	1,770,040	196,191,230	0.03

(3) 運用実績

純資産の推移

野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

2019年2月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第3計算期間 (2009年 7月21日)	101	101	0.6041	0.6041
第4計算期間 (2010年 1月20日)	103	103	0.7179	0.7179
第5計算期間 (2010年 7月20日)	172	172	0.6259	0.6259
第6計算期間 (2011年 1月20日)	320	320	0.7165	0.7165
第7計算期間 (2011年 7月20日)	495	495	0.7095	0.7095
第8計算期間 (2012年 1月20日)	590	590	0.6578	0.6578
第9計算期間 (2012年 7月20日)	669	669	0.6900	0.6900
第10計算期間 (2013年 1月21日)	915	915	0.8866	0.8866
第11計算期間 (2013年 7月22日)	1,129	1,131	1.0781	1.0801
第12計算期間 (2014年 1月20日)	1,674	1,683	1.2373	1.2443
第13計算期間 (2014年 7月22日)	4,376	4,405	1.2814	1.2899
第14計算期間 (2015年 1月20日)	19,379	19,555	1.4377	1.4507
第15計算期間 (2015年 7月21日)	30,765	31,072	1.5998	1.6158
第16計算期間 (2016年 1月20日)	27,855	28,039	1.2908	1.2993
第17計算期間 (2016年 7月19日)	30,864	31,086	1.3184	1.3279
第18計算期間 (2017年 1月17日)	34,920	35,262	1.4792	1.4937
第19計算期間 (2017年 7月18日)	43,954	44,394	1.5981	1.6141
第20計算期間 (2018年 1月17日)	90,683	91,590	1.7488	1.7663
第21計算期間 (2018年 7月17日)	89,508	90,377	1.7495	1.7665
第22計算期間 (2019年 1月17日)	88,691	89,544	1.5587	1.5737
2018年 2月末日	84,899		1.6658	
3月末日	81,611		1.5948	
4月末日	85,445		1.6657	
5月末日	84,090		1.6736	
6月末日	85,297		1.6863	
7月末日	89,668		1.7358	
8月末日	90,239		1.7728	
9月末日	94,301		1.8171	
10月末日	88,760		1.6567	
11月末日	95,301		1.6942	
12月末日	85,989		1.5172	
2019年 1月末日	91,485		1.5995	

2月末日	97,890	1.6949
------	--------	--------

分配の推移

野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

	計算期間	1口当たりの分配金
第3計算期間	2009年 1月21日～2009年 7月21日	0.0000円
第4計算期間	2009年 7月22日～2010年 1月20日	0.0000円
第5計算期間	2010年 1月21日～2010年 7月20日	0.0000円
第6計算期間	2010年 7月21日～2011年 1月20日	0.0000円
第7計算期間	2011年 1月21日～2011年 7月20日	0.0000円
第8計算期間	2011年 7月21日～2012年 1月20日	0.0000円
第9計算期間	2012年 1月21日～2012年 7月20日	0.0000円
第10計算期間	2012年 7月21日～2013年 1月21日	0.0000円
第11計算期間	2013年 1月22日～2013年 7月22日	0.0020円
第12計算期間	2013年 7月23日～2014年 1月20日	0.0070円
第13計算期間	2014年 1月21日～2014年 7月22日	0.0085円
第14計算期間	2014年 7月23日～2015年 1月20日	0.0130円
第15計算期間	2015年 1月21日～2015年 7月21日	0.0160円
第16計算期間	2015年 7月22日～2016年 1月20日	0.0085円
第17計算期間	2016年 1月21日～2016年 7月19日	0.0095円
第18計算期間	2016年 7月20日～2017年 1月17日	0.0145円
第19計算期間	2017年 1月18日～2017年 7月18日	0.0160円
第20計算期間	2017年 7月19日～2018年 1月17日	0.0175円
第21計算期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	0.0170円
第22計算期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	0.0150円

収益率の推移

野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

	計算期間	収益率
第3計算期間	2009年 1月21日～2009年 7月21日	24.9%
第4計算期間	2009年 7月22日～2010年 1月20日	18.8%
第5計算期間	2010年 1月21日～2010年 7月20日	12.8%
第6計算期間	2010年 7月21日～2011年 1月20日	14.5%
第7計算期間	2011年 1月21日～2011年 7月20日	1.0%
第8計算期間	2011年 7月21日～2012年 1月20日	7.3%
第9計算期間	2012年 1月21日～2012年 7月20日	4.9%
第10計算期間	2012年 7月21日～2013年 1月21日	28.5%

第11計算期間	2013年 1月22日～2013年 7月22日	21.8%
第12計算期間	2013年 7月23日～2014年 1月20日	15.4%
第13計算期間	2014年 1月21日～2014年 7月22日	4.3%
第14計算期間	2014年 7月23日～2015年 1月20日	13.2%
第15計算期間	2015年 1月21日～2015年 7月21日	12.4%
第16計算期間	2015年 7月22日～2016年 1月20日	18.8%
第17計算期間	2016年 1月21日～2016年 7月19日	2.9%
第18計算期間	2016年 7月20日～2017年 1月17日	13.3%
第19計算期間	2017年 1月18日～2017年 7月18日	9.1%
第20計算期間	2017年 7月19日～2018年 1月17日	10.5%
第21計算期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	1.0%
第22計算期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	10.0%

各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額。以下「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じて得た数を記載しております。なお、小数点以下2桁目を四捨五入し、小数点以下1桁目まで表示しております。

（４）設定及び解約の実績

野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第3計算期間	2009年 1月21日～2009年 7月21日	29,563,020	85,862,929	167,271,755
第4計算期間	2009年 7月22日～2010年 1月20日	31,862,517	55,616,896	143,517,376
第5計算期間	2010年 1月21日～2010年 7月20日	166,920,054	34,321,765	276,115,665
第6計算期間	2010年 7月21日～2011年 1月20日	199,657,055	28,311,747	447,460,973
第7計算期間	2011年 1月21日～2011年 7月20日	344,422,561	93,501,984	698,381,550
第8計算期間	2011年 7月21日～2012年 1月20日	305,196,802	105,145,763	898,432,589
第9計算期間	2012年 1月21日～2012年 7月20日	214,549,351	142,859,137	970,122,803
第10計算期間	2012年 7月21日～2013年 1月21日	182,347,396	119,514,863	1,032,955,336
第11計算期間	2013年 1月22日～2013年 7月22日	247,095,417	232,288,904	1,047,761,849
第12計算期間	2013年 7月23日～2014年 1月20日	771,602,797	466,433,853	1,352,930,793
第13計算期間	2014年 1月21日～2014年 7月22日	2,428,910,867	366,574,543	3,415,267,117
第14計算期間	2014年 7月23日～2015年 1月20日	11,092,390,466	1,027,711,408	13,479,946,175
第15計算期間	2015年 1月21日～2015年 7月21日	10,065,966,716	4,315,043,777	19,230,869,114
第16計算期間	2015年 7月22日～2016年 1月20日	6,646,649,840	4,297,586,510	21,579,932,444
第17計算期間	2016年 1月21日～2016年 7月19日	4,801,662,126	2,971,912,100	23,409,682,470
第18計算期間	2016年 7月20日～2017年 1月17日	3,050,852,716	2,852,508,102	23,608,027,084
第19計算期間	2017年 1月18日～2017年 7月18日	8,832,308,332	4,936,310,915	27,504,024,501
第20計算期間	2017年 7月19日～2018年 1月17日	28,947,136,031	4,597,877,613	51,853,282,919
第21計算期間	2018年 1月18日～2018年 7月17日	7,609,874,421	8,302,190,678	51,160,966,662
第22計算期間	2018年 7月18日～2019年 1月17日	11,034,575,392	5,295,867,203	56,899,674,851

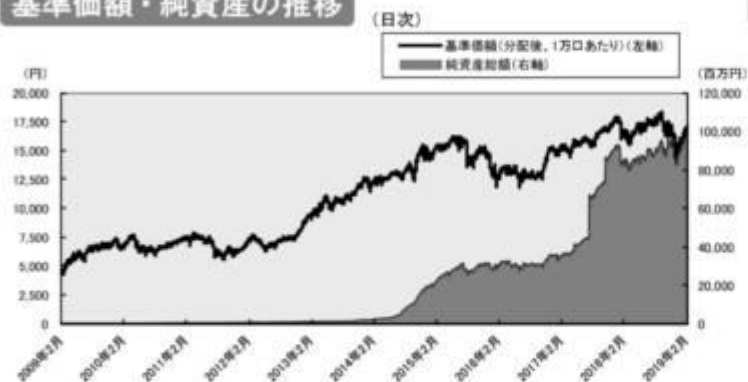
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

< 更新後 >

運用実績 (2019年2月28日現在)

基準価額・純資産の推移



分配の推移

(1万口あたり、課税前)

2019年1月	150 円
2018年7月	170 円
2018年1月	175 円
2017年7月	160 円
2017年1月	145 円
設定来累計	1,445 円

主要な資産の状況

実質的な銘柄別投資比率(上位)

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	2.3
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	2.2
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	1.8
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	1.1
5	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	1.0
6	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1.0
7	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.9
8	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.9
9	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.9
10	BANK OF AMERICA CORP	銀行	0.8

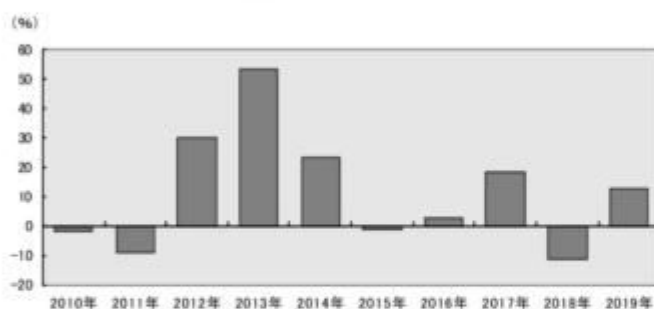
実質的な国/地域別投資比率(上位)

順位	国/地域 (通貨別)	投資比率 (%)
1	アメリカ	67.3
2	イギリス	6.3
3	フランス	4.1
4	カナダ	3.8
5	スイス	3.2

※ユーロについては発行国で記載しております。

年間収益率の推移

(暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・2019年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1 申込（販売）手続等

< 訂正前 >

申込期間中の各営業日に、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれ
ます。

取得申込の受付については、午後3時までに、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みにかかる販売会
社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

ファンドの申込(販売)手続についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

販売の単位は、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

なお、販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として、取得の申込みができません。（申込不可
日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）

購入のお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳し
くは販売会社にお問い合わせください。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情が
あるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込みの受付を中止するこ
と、および既に受付けた取得申込みの受付を取り消す場合があります。

< 申込手数料 >

なし。

取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振
替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載ま
たは記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該
取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託者は、追加信託により分割さ
れた受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の
振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振
法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託者は、追加信託
により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係
る信託を設定した旨の通知を行ないます。

< 訂正後 >

申込期間中の各営業日に、有価証券届出書の「第一部 証券情報」にしたがって受益権の募集が行なわれ
ます。

取得申込の受付については、午後3時までに、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みにかかる販売会

社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

ファンドの申込(販売)手続についてご不明な点がある場合には、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104(フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

インターネットホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

販売の単位は、1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。

なお、販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として、取得の申込みができません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）

購入のお申込みの方法ならびに単位等について、販売会社によっては上記と異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断でファンドの受益権の取得申込みの受付けを中止すること、および既に受付けた取得申込みの受付けを取り消す場合があります。

取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行なわれます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行なうことができます。委託者は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託者から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託者は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

第3【ファンドの経理状況】

(1)当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)(以下「財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)(以下「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第22期計算期間(2018年7月18日から2019年1月17日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1 財務諸表

野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）

(1) 貸借対照表

(単位：円)

	第21期 (2018年 7月17日現在)	第22期 (2019年 1月17日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	314,809,266	297,347,094
親投資信託受益証券	89,499,205,516	88,682,550,582
未収入金	869,882,638	927,462,198
流動資産合計	90,683,897,420	89,907,359,874
資産合計	90,683,897,420	89,907,359,874
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	869,736,433	853,495,122
未払解約金	130,642,395	173,792,228
未払受託者報酬	13,730,114	14,775,929
未払委託者報酬	160,184,614	172,385,770
未払利息	626	590
その他未払費用	1,372,947	1,477,533
流動負債合計	1,175,667,129	1,215,927,172
負債合計	1,175,667,129	1,215,927,172
純資産の部		
元本等		
元本	51,160,966,662	56,899,674,851
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	38,347,263,629	31,791,757,851
(分配準備積立金)	9,454,270,103	8,339,830,548
元本等合計	89,508,230,291	88,691,432,702
純資産合計	89,508,230,291	88,691,432,702
負債純資産合計	90,683,897,420	89,907,359,874

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	第21期 自 2018年 1月18日 至 2018年 7月17日	第22期 自 2018年 7月18日 至 2019年 1月17日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,099,359,191	9,603,521,132
営業収益合計	1,099,359,191	9,603,521,132
営業費用		
支払利息	69,096	69,006

	第21期 自 2018年 1月18日 至 2018年 7月17日	第22期 自 2018年 7月18日 至 2019年 1月17日
受託者報酬	13,730,114	14,775,929
委託者報酬	160,184,614	172,385,770
その他費用	1,372,947	1,477,533
営業費用合計	175,356,771	188,708,238
営業利益又は営業損失()	924,002,420	9,792,229,370
経常利益又は経常損失()	924,002,420	9,792,229,370
当期純利益又は当期純損失()	924,002,420	9,792,229,370
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	425,418,261	169,297,982
期首剰余金又は期首欠損金()	38,829,910,709	38,347,263,629
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,196,634,422	7,870,191,778
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,196,634,422	7,870,191,778
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,158,965,750	3,949,271,046
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,158,965,750	3,949,271,046
分配金	869,736,433	853,495,122
期末剰余金又は期末欠損金()	38,347,263,629	31,791,757,851

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年 7月18日から2019年 1月17日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第21期 2018年 7月17日現在	第22期 2019年 1月17日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 51,160,966,662口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 56,899,674,851口
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.7495円 (10,000口当たり純資産額) (17,495円)	2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 1口当たり純資産額 1.5587円 (10,000口当たり純資産額) (15,587円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第21期 自 2018年 1月18日 至 2018年 7月17日			第22期 自 2018年 7月18日 至 2019年 1月17日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	912,789,102円	費用控除後の配当等収益額	A	631,537,830円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	436,631,579円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円
収益調整金額	C	42,137,276,000円	収益調整金額	C	48,865,915,476円
分配準備積立金額	D	8,974,585,855円	分配準備積立金額	D	8,561,787,840円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	52,461,282,536円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	58,059,241,146円
当ファンドの期末残存口数	F	51,160,966,662口	当ファンドの期末残存口数	F	56,899,674,851口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	10,254円	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	10,203円
10,000口当たり分配金額	H	170円	10,000口当たり分配金額	H	150円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	869,736,433円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	853,495,122円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第21期 自 2018年 1月18日 至 2018年 7月17日		第22期 自 2018年 7月18日 至 2019年 1月17日	
1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。		1. 金融商品に対する取組方針 同左	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。		2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左	
3. 金融商品に係るリスク管理体制		3. 金融商品に係るリスク管理体制	

<p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	同左
---	----

(2)金融商品の時価等に関する事項

第21期 2018年 7月17日現在	第22期 2019年 1月17日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

(関連当事者との取引に関する注記)

第21期 自 2018年 1月18日 至 2018年 7月17日	第22期 自 2018年 7月18日 至 2019年 1月17日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

(その他の注記)

1 元本の移動

第21期 自 2018年 1月18日 至 2018年 7月17日	第22期 自 2018年 7月18日 至 2019年 1月17日
期首元本額 51,853,282,919円	期首元本額 51,160,966,662円

期中追加設定元本額	7,609,874,421円	期中追加設定元本額	11,034,575,392円
期中一部解約元本額	8,302,190,678円	期中一部解約元本額	5,295,867,203円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	第21期 自 2018年 1月18日 至 2018年 7月17日	第22期 自 2018年 7月18日 至 2019年 1月17日
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	1,289,472,795	9,446,455,670
合計	1,289,472,795	9,446,455,670

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年1月17日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年1月17日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	外国株式MSCI - KOKUSA I マザーファンド	35,890,789,017	88,682,550,582	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：100.0%	35,890,789,017	88,682,550,582 100.0%	
合計				88,682,550,582	

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 1月17日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	4,043,231,905
コール・ローン	399,093,921
株式	497,079,800,236
投資証券	13,303,032,012
派生商品評価勘定	250,810,058
未収入金	48,159,761
未収配当金	494,575,930
差入委託証拠金	1,284,201,163
流動資産合計	516,902,904,986
資産合計	516,902,904,986
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,178,521
未払解約金	1,079,706,077
未払利息	791
その他未払費用	1,834,700
流動負債合計	1,085,720,089
負債合計	1,085,720,089
純資産の部	
元本等	
元本	208,755,123,904
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	307,062,060,993
元本等合計	515,817,184,897
純資産合計	515,817,184,897
負債純資産合計	516,902,904,986

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
--------------------	---

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 1月17日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.4709円
(10,000口当たり純資産額)	(24,709円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 7月18日 至 2019年 1月17日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。

市場リスクの管理

市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。

信用リスクの管理

信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。

流動性リスクの管理

流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 1月17日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 1月17日現在	
期首	2018年 7月18日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	188,508,803,472円
同期中における追加設定元本額	28,175,479,697円
同期中における一部解約元本額	7,929,159,265円
期末元本額	208,755,123,904円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	51,328,761円
バランスセレクト50	159,961,350円
バランスセレクト70	168,213,274円
野村外国株式インデックスファンド	545,758,461円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,711,209,611円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	7,121,213,440円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,704,709,378円
野村資産設計ファンド2015	20,774,809円
野村資産設計ファンド2020	23,757,805円
野村資産設計ファンド2025	36,677,206円

野村資産設計ファンド2030	41,075,987円
野村資産設計ファンド2035	30,113,496円
野村資産設計ファンド2040	71,147,384円
野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	35,890,789,017円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	1,142,047,098円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	7,412,894,971円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	4,907,664,757円
野村資産設計ファンド2045	10,635,245円
野村インデックスファンド・外国株式	4,116,640,071円
マイ・ロード	1,539,083,928円
ネクストコア	16,390,678円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	109,615,003円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,183,339,111円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	584,983,254円
野村資産設計ファンド2050	16,044,679円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,287,555円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,947,541円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,348,454円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	874,530円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	197,463,080円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	298,060,381円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,563,975円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,302,612円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,244,375円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,895,793円
インデックス・ブレンド(タイプ)	17,615,312円
野村6資産均等バランス	205,228,634円
野村つみたて外国株投信	1,753,679,983円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	3,601,455,681円
世界6資産分散ファンド	66,348,910円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信	276,180,994円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	444,741,946円
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)	320,733,559円
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)	263,528,099円
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)	1,688,562,295円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,672,695,151円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,753,762円
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)	10,475,447円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	3,984,182円
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)	5,279,720円
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)	75,679,746円
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)	198,780,981円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	63,954,507円
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)	51,704,111円
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)	190,205,612円
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)	3,502,457,018円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	437,484,962円

野村MSCI - KOKUSA Iインデックスファンド(適格機関投資家専用)	114,916,757円
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)	749,847,122円
野村FOFs用・外国株式MSCI - KOKUSA Iインデックスファンド(適格機関投資家専用)	16,659,421,949円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,498,531円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	13,691,076円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	14,734,643円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSA I(確定拠出年金向け)	63,526,029,750円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,503,852,915円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	6,067,641,591円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,580,795,806円
マイバランスDC30	936,270,379円
マイバランスDC50	1,783,511,366円
マイバランスDC70	1,420,991,823円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSA I	18,753,442,928円
野村DC運用戦略ファンド	122,294,644円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	5,430,158円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	200,445,263円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	121,751,144円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	79,917,694円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	4,131,801円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	2,460,234円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	9,016,450円
野村資産設計ファンド(DC)2030	310,384円
野村資産設計ファンド(DC)2040	388,909円
野村資産設計ファンド(DC)2050	914,657円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	47,627,523円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	21,940,965円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	6,325,919円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	12,933,841円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式(2019年1月17日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES, A GE CO, LLC	68,100	23.15	1,576,515.00	
		HALLIBURTON CO	119,600	30.36	3,631,056.00	
		HELMERICH & PAYNE	14,600	52.90	772,340.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	50,600	29.36	1,485,616.00	

SCHLUMBERGER LTD	191,100	41.25	7,882,875.00
TECHNIPFMC PLC	61,000	23.03	1,404,830.00
ANADARKO PETE	71,300	46.79	3,336,127.00
ANTERO RESOURCES CORP	27,000	10.71	289,170.00
APACHE CORPORATION	54,100	31.21	1,688,461.00
CABOT OIL & GAS CORP	58,500	25.03	1,464,255.00
CHENIERE ENERGY INC	28,600	63.74	1,822,964.00
CHEVRON CORP	263,400	111.40	29,342,760.00
CIMAREX ENERGY CO	13,800	73.92	1,020,096.00
CONCHO RESOURCES INC	27,600	123.63	3,412,188.00
CONOCOPHILLIPS	158,600	65.66	10,413,676.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	13,900	46.95	652,605.00
DEVON ENERGY CORP	67,300	25.89	1,742,397.00
DIAMONDBACK ENERGY INC	21,600	105.64	2,281,824.00
EOG RESOURCES INC	80,000	98.67	7,893,600.00
EXXON MOBIL CORP	581,800	71.64	41,680,152.00
HESS CORP	36,600	51.28	1,876,848.00
HOLLYFRONTIER CORP	23,600	53.30	1,257,880.00
KINDER MORGAN INC	273,000	17.47	4,769,310.00
MARATHON OIL CORP	119,000	15.54	1,849,260.00
MARATHON PETROLEUM CORP	94,600	64.34	6,086,564.00
NOBLE ENERGY INC	64,400	22.98	1,479,912.00
OCCIDENTAL PETE CORP	105,700	65.14	6,885,298.00
ONEOK INC	56,000	61.17	3,425,520.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	37,000	18.98	702,260.00
PHILLIPS 66	61,000	92.99	5,672,390.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	23,200	143.54	3,330,128.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	19,000	23.61	448,590.00
TARGA RESOURCES CORP	29,900	42.83	1,280,617.00
VALERO ENERGY CORP	58,000	79.00	4,582,000.00
WILLIAMS COS	168,100	25.86	4,347,066.00
AIR PRODUCTS	30,400	154.62	4,700,448.00
ALBEMARLE CORP	14,800	73.93	1,094,164.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	29,200	24.87	726,204.00
CELANESE CORP-SERIES A	18,000	94.65	1,703,700.00

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	31,400	42.59	1,337,326.00
CHEMOURS CO/THE	23,400	33.65	787,410.00
DOWDUPONT INC	317,500	55.40	17,589,500.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	18,600	76.78	1,428,108.00
ECOLAB INC	36,000	150.26	5,409,360.00
FMC CORP	18,000	79.17	1,425,060.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	11,500	134.37	1,545,255.00
LINDE PLC	75,900	157.24	11,934,516.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	45,500	84.78	3,857,490.00
MOSAIC CO/THE	48,800	31.49	1,536,712.00
PPG INDUSTRIES	32,600	102.54	3,342,804.00
SHERWIN-WILLIAMS	11,650	386.94	4,507,851.00
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5,000	74.71	373,550.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	8,900	174.69	1,554,741.00
VULCAN MATERIALS CO	18,600	100.22	1,864,092.00
AVERY DENNISON CORP	12,200	93.33	1,138,626.00
BALL CORP	45,400	48.44	2,199,176.00
CROWN HOLDINGS INC	19,100	47.86	914,126.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	52,300	44.43	2,323,689.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	13,200	89.25	1,178,100.00
SEALED AIR CORP	21,900	36.77	805,263.00
WESTROCK CO	34,200	40.32	1,378,944.00
FREEMONT-MCMORAN INC	187,000	11.89	2,223,430.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	71,700	31.56	2,262,852.00
NUCOR CORP	42,700	56.87	2,428,349.00
STEEL DYNAMICS	33,400	33.35	1,113,890.00
ARCONIC INC	57,000	20.10	1,145,700.00
BOEING CO	75,050	352.06	26,422,103.00
GENERAL DYNAMICS	34,500	163.60	5,644,200.00
HARRIS CORP	16,000	136.57	2,185,120.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,660	195.57	1,106,926.20
L3 TECHNOLOGIES INC	10,900	175.25	1,910,225.00
LOCKHEED MARTIN	34,980	272.39	9,528,202.20
NORTHROP GRUMMAN CORP	22,890	255.74	5,853,888.60
RAYTHEON COMPANY	39,400	159.38	6,279,572.00

SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	14,600	77.45	1,130,770.00	
TEXTRON INC	33,500	48.03	1,609,005.00	
TRANSDIGM GROUP INC	6,350	348.67	2,214,054.50	
UNITED TECHNOLOGIES	112,800	110.87	12,506,136.00	
ALLEGION PLC	13,600	81.01	1,101,736.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	19,400	41.43	803,742.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	127,100	31.67	4,025,257.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,100	220.08	1,122,408.00	
MASCO CORP	42,800	30.77	1,316,956.00	
OWENS CORNING INC	14,200	46.35	658,170.00	
SMITH (A.O.) CORP	18,600	45.72	850,392.00	
FLUOR CORP	18,400	36.44	670,496.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17,900	59.68	1,068,272.00	
ACUITY BRANDS INC	5,000	117.34	586,700.00	
AMETEK INC	31,800	70.28	2,234,904.00	
EATON CORP PLC	60,100	70.10	4,213,010.00	
EMERSON ELEC	86,100	61.38	5,284,818.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	16,800	157.67	2,648,856.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	24,300	46.41	1,127,763.00	
3M CORP	80,800	189.48	15,309,984.00	
GENERAL ELEC CO	1,198,000	8.98	10,758,040.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	102,300	138.02	14,119,446.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	30,700	66.85	2,052,295.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	30,000	36.77	1,103,100.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	14,350	272.60	3,911,810.00	
CATERPILLAR INC DEL	81,100	131.66	10,677,626.00	
CUMMINS INC	21,600	141.37	3,053,592.00	
DEERE & COMPANY	42,200	157.41	6,642,702.00	
DOVER CORP	19,700	77.73	1,531,281.00	
FLOWSERVE CORP	17,200	41.55	714,660.00	
FORTIVE CORP	40,600	70.02	2,842,812.00	
IDEX CORP	10,300	135.84	1,399,152.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	41,800	129.97	5,432,746.00	
INGERSOLL-RAND PLC	33,400	93.78	3,132,252.00	

MIDDLEBY CORP	7,500	112.05	840,375.00	
PACCAR	47,800	60.06	2,870,868.00	
PARKER HANNIFIN CORP	18,100	155.82	2,820,342.00	
PENTAIR PLC	23,200	40.17	931,944.00	
SNAP-ON INC	7,400	162.45	1,202,130.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	21,100	129.63	2,735,193.00	
WABCO HOLDINGS INC	7,000	110.19	771,330.00	
WABTEC CORP	11,500	71.95	827,425.00	
XYLEM INC	23,900	68.97	1,648,383.00	
AERCAP HOLDINGS NV	16,900	45.40	767,260.00	
FASTENAL CO	38,700	54.12	2,094,444.00	
GRAINGER(W.W.) INC	6,430	288.81	1,857,048.30	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	22,900	38.88	890,352.00	
UNITED RENTALS INC	11,200	117.50	1,316,000.00	
CINTAS CORP	12,700	178.27	2,264,029.00	
COPART INC	27,900	49.32	1,376,028.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	30,800	74.42	2,292,136.00	
ROLLINS INC	21,000	38.15	801,150.00	
WASTE CONNECTIONS INC	36,800	78.36	2,883,648.00	
WASTE MANAGEMENT INC	59,300	92.70	5,497,110.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	18,300	85.02	1,555,866.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	23,000	67.03	1,541,690.00	
FEDEX CORPORATION	34,400	171.36	5,894,784.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	94,600	96.99	9,175,254.00	
XPO LOGISTICS INC	18,000	60.65	1,091,700.00	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,600	32.84	479,464.00	
DELTA AIR LINES INC	22,400	47.50	1,064,000.00	
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	49.78	985,644.00	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	9,200	86.36	794,512.00	
AMERCO	1,170	345.40	404,118.00	
CSX CORP	111,500	65.38	7,289,870.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	11,800	96.95	1,144,010.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	14,200	101.95	1,447,690.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,700	29.17	487,139.00	

NORFOLK SOUTHERN CORP	38,700	162.81	6,300,747.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,600	126.70	1,089,620.00	
UNION PAC CORP	101,800	151.97	15,470,546.00	
APTIV PLC	36,700	70.35	2,581,845.00	
AUTOLIV INC	11,900	77.64	923,916.00	
BORGWARNER INC	29,600	39.63	1,173,048.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	34,000	19.53	664,020.00	
LEAR CORP	9,300	149.27	1,388,211.00	
FORD MOTOR COMPANY	516,000	8.29	4,277,640.00	
GENERAL MOTORS CO	175,700	37.67	6,618,619.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	22,400	37.07	830,368.00	
TESLA INC	17,520	346.05	6,062,796.00	
DR HORTON INC	48,000	37.85	1,816,800.00	
GARMIN LTD	15,200	66.68	1,013,536.00	
LEGGETT & PLATT INC	18,900	38.40	725,760.00	
LENNAR CORP-A	40,700	45.36	1,846,152.00	
MOHAWK INDUSTRIES	8,700	123.10	1,070,970.00	
NEWELL BRANDS INC	67,000	20.55	1,376,850.00	
NVR INC	480	2,530.49	1,214,635.20	
PULTEGROUP INC	37,900	27.37	1,037,323.00	
WHIRLPOOL CORP	9,300	123.18	1,145,574.00	
HASBRO INC	15,800	87.08	1,375,864.00	
MATTEL INC	48,000	12.50	600,000.00	
POLARIS INDUSTRIES INC	8,300	84.44	700,852.00	
CAPRI HOLDINGS LTD	19,900	40.41	804,159.00	
HANESBRANDS INC	51,000	13.81	704,310.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	13,800	142.24	1,962,912.00	
NIKE INC-B	176,400	77.68	13,702,752.00	
PVH CORP	9,900	104.55	1,035,045.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	105.63	823,914.00	
TAPESTRY INC	38,300	35.30	1,351,990.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	24,000	19.61	470,640.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	25,000	17.77	444,250.00	
V F CORP	45,400	71.92	3,265,168.00	
ARAMARK	35,400	31.00	1,097,400.00	

CARNIVAL CORP	58,600	52.73	3,089,978.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,390	514.82	1,745,239.80	
DARDEN RESTAURANTS INC	16,600	106.79	1,772,714.00	
DOMINOS PIZZA INC	5,270	246.85	1,300,899.50	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	39,500	72.04	2,845,580.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	54,900	56.78	3,117,222.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	40,900	109.28	4,469,552.00	
MCDONALD'S CORP	106,700	179.35	19,136,645.00	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	20.42	694,280.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	70,000	27.48	1,923,600.00	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	30,200	45.85	1,384,670.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,700	105.66	2,398,482.00	
STARBUCKS CORP	185,900	63.77	11,854,843.00	
VAIL RESORTS INC	5,410	184.83	999,930.30	
WYNN RESORTS LTD	13,800	111.50	1,538,700.00	
YUM BRANDS INC	44,100	89.83	3,961,503.00	
GENUINE PARTS CO	19,600	96.05	1,882,580.00	
LKQ CORP	45,000	26.82	1,206,900.00	
AMAZON.COM INC	56,930	1,683.78	95,857,595.40	
BOOKING HOLDINGS INC	6,540	1,680.57	10,990,927.80	
EBAY INC	127,700	30.29	3,868,033.00	
EXPEDIA GROUP INC	17,300	116.00	2,006,800.00	
GRUBHUB INC	11,900	77.99	928,081.00	
MERCADOLIBRE INC	5,710	344.92	1,969,493.20	
QURATE RETAIL INC - A	58,000	21.36	1,238,880.00	
WAYFAIR INC - CLASS A	7,500	95.71	717,825.00	
DOLLAR GENERAL CORP	36,100	112.21	4,050,781.00	
DOLLAR TREE INC	32,400	93.86	3,041,064.00	
KOHL'S CORP	22,500	67.46	1,517,850.00	
MACYS INC	43,700	24.48	1,069,776.00	
NORDSTROM INC	15,000	45.01	675,150.00	
TARGET CORP	68,600	67.85	4,654,510.00	
ADVANCE AUTO PARTS	9,900	162.44	1,608,156.00	
AUTOZONE	3,680	832.96	3,065,292.80	
BEST BUY COMPANY INC	33,800	56.33	1,903,954.00	

BURLINGTON STORES INC	8,900	164.94	1,467,966.00
CARMAX INC	23,900	63.97	1,528,883.00
GAP INC	31,500	24.91	784,665.00
HOME DEPOT	157,300	177.04	27,848,392.00
L BRANDS, INC	30,300	26.70	809,010.00
LOWES COS INC	111,800	93.96	10,504,728.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,070	344.00	3,808,080.00
ROSS STORES INC	52,200	90.25	4,711,050.00
TIFFANY & CO	14,400	84.01	1,209,744.00
TJX COS INC	169,600	47.53	8,061,088.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	16,300	87.13	1,420,219.00
ULTA BEAUTY INC	7,890	282.01	2,225,058.90
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	60,400	210.18	12,694,872.00
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	9.75	438,750.00
KROGER CO	107,600	28.70	3,088,120.00
SYSCO CORP	67,800	62.25	4,220,550.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	116,400	72.00	8,380,800.00
WALMART INC	203,000	96.35	19,559,050.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	35,600	45.36	1,614,816.00
COCA COLA CO	555,500	46.92	26,064,060.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	29,200	45.90	1,340,280.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	22,800	159.88	3,645,264.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	25,600	61.26	1,568,256.00
MONSTER BEVERAGE CORP	55,900	53.81	3,007,979.00
PEPSICO INC	194,500	108.34	21,072,130.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	75,500	43.30	3,269,150.00
BUNGE LIMITED	19,100	52.37	1,000,267.00
CAMPBELL SOUP CO	24,800	35.28	874,944.00
CONAGRA BRANDS INC	66,700	21.17	1,412,039.00
GENERAL MILLS	80,500	42.27	3,402,735.00
HERSHEY CO/THE	19,000	106.70	2,027,300.00
HORMEL FOODS CORP	39,100	42.84	1,675,044.00
INGREDION INC	9,600	97.75	938,400.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,900	103.23	1,641,357.00
KELLOGG CO	35,600	59.12	2,104,672.00

KRAFT HEINZ CO/THE	84,700	46.84	3,967,348.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	19,300	70.18	1,354,474.00	
MCCORMICK & CO INC.	16,800	139.57	2,344,776.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	202,400	42.67	8,636,408.00	
TYSON FOODS INC-CL A	41,000	58.50	2,398,500.00	
ALTRIA GROUP INC	259,700	47.20	12,257,840.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	214,000	70.75	15,140,500.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	32,900	67.37	2,216,473.00	
CLOROX CO	17,700	151.90	2,688,630.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	112,700	62.13	7,002,051.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	48,100	114.74	5,518,994.00	
PROCTER & GAMBLE CO	342,200	91.37	31,266,814.00	
COTY INC-CL A	65,000	7.23	469,950.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	31,100	125.17	3,892,787.00	
ABBOTT LABORATORIES	241,500	69.82	16,861,530.00	
ABIOMED INC	5,870	324.13	1,902,643.10	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,200	206.79	2,109,258.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	69,600	68.26	4,750,896.00	
BECTON,DICKINSON	36,900	231.27	8,533,863.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	189,100	36.62	6,924,842.00	
DANAHER CORP	86,000	104.49	8,986,140.00	
DENTSPLY SIRONA INC	30,300	40.15	1,216,545.00	
DEXCOM INC	11,600	147.05	1,705,780.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	28,400	156.64	4,448,576.00	
HOLOGIC INC	37,000	42.97	1,589,890.00	
IDEXX LABORATORIES INC	12,100	197.24	2,386,604.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	15,540	515.93	8,017,552.20	
MEDTRONIC PLC	185,900	86.99	16,171,441.00	
RESMED INC	19,200	116.89	2,244,288.00	
STRYKER CORP	46,500	163.40	7,598,100.00	
TELEFLEX INC	6,320	248.64	1,571,404.80	
THE COOPER COMPANIES, INC.	6,580	272.15	1,790,747.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12,900	125.35	1,617,015.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	28,400	105.00	2,982,000.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	22,000	77.30	1,700,600.00	

ANTHEM INC	35,480	261.92	9,292,921.60
CARDINAL HEALTH INC	41,000	48.42	1,985,220.00
CENTENE CORP	27,900	126.46	3,528,234.00
CIGNA CORP	51,900	196.73	10,210,287.00
CVS HEALTH CORP	178,100	63.92	11,384,152.00
DAVITA INC	17,500	57.27	1,002,225.00
HCA HEALTHCARE INC	37,500	132.31	4,961,625.00
HENRY SCHEIN INC	20,500	79.98	1,639,590.00
HUMANA INC	19,070	293.30	5,593,231.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,200	132.03	1,874,826.00
MCKESSON CORP	27,000	123.60	3,337,200.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	19,100	84.27	1,609,557.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	132,300	261.46	34,591,158.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	11,800	129.64	1,529,752.00
WELLCARE HEALTH PLANS INC	7,050	261.57	1,844,068.50
ABBVIE INC	208,400	85.55	17,828,620.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	30,700	111.70	3,429,190.00
ALKERMES PLC	20,100	33.58	674,958.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,700	80.88	1,027,176.00
AMGEN INC	89,100	198.89	17,721,099.00
BEIGENE, LTD ADR	4,600	140.81	647,726.00
BIOGEN INC	27,510	332.03	9,134,145.30
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	24,100	95.71	2,306,611.00
CELGENE CORP	96,200	87.30	8,398,260.00
GILEAD SCIENCES INC	178,600	67.64	12,080,504.00
INCYTE CORP	24,900	76.56	1,906,344.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,040	404.54	4,466,121.60
SEATTLE GENETICS INC	15,400	71.67	1,103,718.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,300	113.62	715,806.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	35,000	186.15	6,515,250.00
ALLERGAN PLC	46,400	152.89	7,094,096.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	225,000	49.13	11,054,250.00
ELI LILLY & CO.	133,100	116.80	15,546,080.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,800	128.17	999,726.00
JOHNSON & JOHNSON	368,600	128.04	47,195,544.00

MERCK & CO INC	365,600	74.61	27,277,416.00
MYLAN NV	69,300	29.26	2,027,718.00
NEKTAR THERAPEUTICS	25,000	44.62	1,115,500.00
PERRIGO CO PLC	16,500	44.52	734,580.00
PFIZER INC	805,700	42.11	33,928,027.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	133,000	18.65	2,480,450.00
ZOETIS INC	66,000	83.21	5,491,860.00
BANK OF AMERICA CORP	1,304,200	28.45	37,104,490.00
BB&T CORPORATION	104,900	47.54	4,986,946.00
CIT GROUP INC	16,700	43.55	727,285.00
CITIGROUP	346,300	62.19	21,536,397.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	63,900	33.95	2,169,405.00
COMERICA INC	23,000	78.13	1,796,990.00
EAST WEST BANCORP INC	20,700	49.24	1,019,268.00
FIFTH THIRD BANCORP	90,300	26.26	2,371,278.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	22,600	95.60	2,160,560.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	154,000	13.27	2,043,580.00
JPMORGAN CHASE & CO	461,800	102.50	47,334,500.00
KEYCORP	146,000	16.75	2,445,500.00
M & T BANK CORP	18,900	154.42	2,918,538.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	50,000	15.73	786,500.00
PNC FINANCIAL	64,100	121.21	7,769,561.00
REGIONS FINANCIAL CORP	153,000	15.40	2,356,200.00
SIGNATURE BANK	7,600	112.46	854,696.00
SUNTRUST BKS INC.	63,500	57.36	3,642,360.00
SVB FINANCIAL GROUP	7,400	224.77	1,663,298.00
US BANCORP	211,200	49.11	10,372,032.00
WELLS FARGO CO	629,000	48.94	30,783,260.00
ZIONS BANCORP NA	27,500	45.75	1,258,125.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	31,000	18.70	579,700.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	178,300	198.41	35,376,503.00
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	42,000	19.87	834,540.00
VOYA FINANCIAL INC	21,700	44.32	961,744.00
AFLAC INC	105,300	46.81	4,929,093.00
ALLEGHANY CORP	2,100	620.00	1,302,000.00

ALLSTATE CORP	48,100	84.54	4,066,374.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	10,800	94.50	1,020,600.00
AMERICAN INTL GROUP	123,100	43.13	5,309,303.00
AON PLC	32,900	150.99	4,967,571.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,000	27.87	1,560,720.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,900	73.72	1,835,628.00
ASSURANT INC	7,600	94.41	717,516.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,400	43.39	928,546.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	13,900	35.03	486,917.00
CHUBB LTD	63,300	132.96	8,416,368.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	21,600	77.94	1,683,504.00
EVEREST RE GROUP LTD	5,600	212.72	1,191,232.00
FNF GROUP	37,200	34.25	1,274,100.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	48,200	45.33	2,184,906.00
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	57.30	1,713,270.00
LOEWS CORP	36,100	46.68	1,685,148.00
MARKEL CORP	1,860	1,055.30	1,962,858.00
MARSH & MCLENNAN COS	69,100	82.00	5,666,200.00
METLIFE INC	115,900	44.87	5,200,433.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	38,000	48.27	1,834,260.00
PROGRESSIVE CO	80,800	62.60	5,058,080.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	57,200	90.48	5,175,456.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	9,000	148.01	1,332,090.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,900	131.50	775,850.00
TORCHMARK CORP	14,000	81.26	1,137,640.00
TRAVELERS COS INC/THE	36,700	122.30	4,488,410.00
UNUM GROUP	31,200	33.24	1,037,088.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	17,800	156.92	2,793,176.00
WR BERKLEY CORP	13,000	74.89	973,570.00
ACCENTURE PLC-CL A	88,300	147.88	13,057,804.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	22,500	63.82	1,435,950.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,600	168.74	1,113,684.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	60,500	132.76	8,031,980.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	16,300	99.37	1,619,731.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	80,400	65.79	5,289,516.00

DXC TECHNOLOGY CO	37,800	61.31	2,317,518.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	45,100	103.67	4,675,517.00	
FIRST DATA CORP- CLASS A	74,000	21.24	1,571,760.00	
FISERV INC	56,200	72.57	4,078,434.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	12,100	191.31	2,314,851.00	
GARTNER INC	12,700	129.10	1,639,570.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	21,200	112.91	2,393,692.00	
GODADDY INC - CLASS A	22,700	63.42	1,439,634.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	125,700	121.62	15,287,634.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	10,600	130.05	1,378,530.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	20,000	55.28	1,105,600.00	
MASTERCARD INC	126,900	197.77	25,097,013.00	
PAYCHEX INC	45,000	68.48	3,081,600.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	154,900	90.55	14,026,195.00	
SABRE CORP	36,000	22.47	808,920.00	
SQUARE INC - A	41,800	65.90	2,754,620.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	22,200	86.40	1,918,080.00	
VERISIGN INC	14,700	161.63	2,375,961.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	244,200	137.34	33,538,428.00	
WESTERN UNION CO	59,000	17.75	1,047,250.00	
WIX.COM LTD	5,700	101.57	578,949.00	
WORLDPAY INC - CL A	40,700	81.91	3,333,737.00	
ADOBE INC	67,400	241.95	16,307,430.00	
ANSYS INC	11,500	157.13	1,806,995.00	
AUTODESK INC.	30,000	135.30	4,059,000.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	37,800	45.37	1,714,986.00	
CDK GLOBAL INC	16,700	49.93	833,831.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	17,200	104.43	1,796,196.00	
CITRIX SYSTEMS INC	18,500	107.05	1,980,425.00	
FORTINET INC	19,900	72.34	1,439,566.00	
INTUIT INC	33,700	209.99	7,076,663.00	
MICROSOFT CORP	1,000,400	105.38	105,422,152.00	
ORACLE CORPORATION	410,800	48.06	19,743,048.00	
PTC INC	14,700	87.42	1,285,074.00	

RED HAT INC	24,300	175.33	4,260,519.00
SALESFORCE.COM INC	99,000	148.54	14,705,460.00
SERVICENOW INC	24,100	189.59	4,569,119.00
SPLUNK INC	19,700	116.79	2,300,763.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	30,600	47.91	1,466,046.00
SYMANTEC CORP	83,000	19.74	1,638,420.00
SYNOPSYS INC	20,700	88.95	1,841,265.00
VMWARE INC - CLASS A	10,000	144.20	1,442,000.00
WORKDAY INC-CLASS A	19,900	165.34	3,290,266.00
ARISTA NETWORKS INC	7,400	221.24	1,637,176.00
CISCO SYSTEMS	646,600	43.96	28,424,536.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22,800	18.98	432,744.00
F5 NETWORKS INC	8,100	161.86	1,311,066.00
JUNIPER NETWORKS INC	46,700	28.07	1,310,869.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22,100	114.55	2,531,555.00
PALO ALTO NETWORKS INC	12,600	201.30	2,536,380.00
APPLE INC	663,300	154.94	102,771,702.00
DELL TECHNOLOGIES-C	20,790	42.62	886,069.80
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	200,000	14.32	2,864,000.00
HP INC	219,000	21.05	4,609,950.00
NETAPP INC	35,200	62.10	2,185,920.00
SEAGATE TECHNOLOGY	37,800	39.72	1,501,416.00
WESTERN DIGITAL CORP	38,300	37.83	1,448,889.00
XEROX CORP	28,900	23.11	667,879.00
AMPHENOL CORP-CL A	41,300	81.35	3,359,755.00
ARROW ELECTRS INC	12,100	73.28	886,688.00
CDW CORPORATION	21,100	80.53	1,699,183.00
COGNEX CORP	24,800	41.40	1,026,720.00
CORNING INC	112,700	30.07	3,388,889.00
FLEX LTD	76,000	7.93	602,680.00
FLIR SYSTEMS INC	17,800	44.10	784,980.00
IPG PHOTONICS CORP	4,730	128.34	607,048.20
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	25,200	69.05	1,740,060.00
TE CONNECTIVITY LTD	47,900	78.49	3,759,671.00
TRIMBLE INC	34,900	35.17	1,227,433.00

ADVANCED MICRO DEVICES	126,000	19.73	2,485,980.00
ANALOG DEVICES INC	51,000	87.00	4,437,000.00
APPLIED MATERIALS	136,300	33.64	4,585,132.00
BROADCOM INC	59,450	251.70	14,963,565.00
INTEL CORP	633,900	48.13	30,509,607.00
KLA TENCOR CORP	21,900	90.96	1,992,024.00
LAM RESEARCH	21,200	138.75	2,941,500.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	86,000	16.64	1,431,040.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	37,400	52.06	1,947,044.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	33,000	75.08	2,477,640.00
MICRON TECHNOLOGY	160,600	33.58	5,392,948.00
NVIDIA CORP	79,600	148.84	11,847,664.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	46,800	78.34	3,666,312.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	59,000	17.63	1,040,170.00
QORVO INC	17,600	61.41	1,080,816.00
QUALCOMM INC	193,800	55.27	10,711,326.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	23,800	68.80	1,637,440.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	133,900	97.17	13,011,063.00
XILINX INC	34,900	90.49	3,158,101.00
AT & T INC	998,300	30.56	30,508,048.00
CENTURYLINK INC	136,000	15.99	2,174,640.00
VERIZON COMMUNICATIONS	568,000	57.08	32,421,440.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	26,400	25.69	678,216.00
SPRINT CORP	109,000	6.05	659,450.00
T-MOBILE US INC	47,200	66.69	3,147,768.00
ALLIANT ENERGY CORP	31,000	42.39	1,314,090.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	68,300	75.72	5,171,676.00
DUKE ENERGY CORP	97,300	85.27	8,296,771.00
EDISON INTERNATIONAL	45,000	54.18	2,438,100.00
ENTERGY CORP	25,400	86.40	2,194,560.00
EVERGY INC	37,200	56.29	2,093,988.00
EVERSOURCE ENERGY	44,200	66.66	2,946,372.00
EXELON CORPORATION	132,200	45.80	6,054,760.00
FIRSTENERGY CORP	65,800	38.48	2,531,984.00
NEXTERA ENERGY INC	65,000	174.68	11,354,200.00

OGE ENERGY CORP	28,600	39.99	1,143,714.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	15,400	84.77	1,305,458.00
PPL CORPORATION	97,600	29.68	2,896,768.00
SOUTHERN CO.	140,200	46.87	6,571,174.00
XCEL ENERGY INC	70,800	50.25	3,557,700.00
ATMOS ENERGY CORP	15,600	94.36	1,472,016.00
UGI CORP	22,700	54.73	1,242,371.00
AMEREN CORPORATION	32,800	66.67	2,186,776.00
CENTERPOINT ENERGY INC	65,300	29.52	1,927,656.00
CMS ENERGY CORP	37,800	50.54	1,910,412.00
CONSOLIDATED EDISON INC	42,300	76.38	3,230,874.00
DOMINION ENERGY INC	102,439	68.97	7,065,217.83
DTE ENERGY COMPANY	25,100	111.73	2,804,423.00
NISOURCE INC	47,600	26.45	1,259,020.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	69,500	51.45	3,575,775.00
SEMPRA ENERGY	37,100	112.66	4,179,686.00
WEC ENERGY GROUP INC	43,500	70.29	3,057,615.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24,700	91.79	2,267,213.00
ALLY FINANCIAL INC	57,400	25.64	1,471,736.00
AMERICAN EXPRESS CO	99,900	99.41	9,931,059.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	65,600	83.62	5,485,472.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	46,300	64.36	2,979,868.00
SYNCHRONY FINANCIAL	96,200	26.38	2,537,756.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	7,500	107.15	803,625.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,200	118.26	2,270,592.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	136,800	50.43	6,898,824.00
BLACKROCK INC	16,540	413.04	6,831,681.60
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,000	92.97	1,394,550.00
CME GROUP INC	48,800	182.29	8,895,752.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	49.34	1,726,900.00
EATON VANCE CORP	16,400	38.27	627,628.00
FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	30.99	1,344,966.00
GOLDMAN SACHS GROUP	49,500	197.08	9,755,460.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	78,500	74.51	5,849,035.00
INVESCO LTD	58,000	18.31	1,061,980.00

MOODYS CORP	23,500	155.40	3,651,900.00
MORGAN STANLEY	178,900	44.49	7,959,261.00
MSCI INC	12,000	160.25	1,923,000.00
NASDAQ INC	15,400	82.96	1,277,584.00
NORTHERN TRUST CORP	28,400	88.42	2,511,128.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,700	79.97	1,415,469.00
S&P GLOBAL INC	34,400	185.00	6,364,000.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	166,200	46.70	7,761,540.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	48.13	919,283.00
STATE STREET CORP	52,200	70.47	3,678,534.00
T ROWE PRICE GROUP INC	33,900	95.27	3,229,653.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	37,900	54.38	2,061,002.00
H & R BLOCK INC	27,900	25.03	698,337.00
AES CORP	91,000	15.51	1,411,410.00
NRG ENERGY INC	40,000	40.69	1,627,600.00
VISTRA ENERGY CORP	48,200	24.25	1,168,850.00
CERNER CORP	40,600	53.64	2,177,784.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	16,700	101.67	1,697,889.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,400	70.03	3,109,332.00
ILLUMINA INC	20,110	305.63	6,146,219.30
IQVIA HOLDINGS INC	22,400	124.74	2,794,176.00
METTLER-TOLEDO INTL	3,420	580.15	1,984,113.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	55,500	234.63	13,021,965.00
WATERS CORP	10,600	198.74	2,106,644.00
COSTAR GROUP INC	5,130	367.28	1,884,146.40
EQUIFAX INC	16,100	98.41	1,584,401.00
IHS MARKIT LTD	54,700	51.11	2,795,717.00
MANPOWERGROUP INC	8,000	72.02	576,160.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	47,200	25.16	1,187,552.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	58.79	1,005,309.00
TRUNSON	25,300	57.67	1,459,051.00
VERISK ANALYTICS INC	21,900	112.98	2,474,262.00
CBRE GROUP INC	45,500	42.98	1,955,590.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	161,000	6.95	1,118,950.00
JONES LANG LASALLE INC	6,300	137.46	865,998.00
CBS CORP-CL B	47,000	47.81	2,247,070.00

CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	22,200	293.81	6,522,582.00	
COMCAST CORP-CL A	628,900	35.90	22,577,510.00	
DISCOVERY INC - A	19,300	27.11	523,223.00	
DISCOVERY INC - C	39,800	25.19	1,002,562.00	
DISH NETWORK CORP-A	31,900	28.55	910,745.00	
INTERPUBRIC GROUP	50,000	22.21	1,110,500.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	13,900	75.37	1,047,643.00	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	69,500	21.62	1,502,590.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	22.27	534,480.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	22,400	38.69	866,656.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	38.47	496,263.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	12.38	680,900.00	
OMNICOM GROUP	30,300	74.67	2,262,501.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	218,000	6.02	1,312,360.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	100,400	47.13	4,731,852.00	
DISNEY (WALT) CO	204,600	110.91	22,692,186.00	
ELECTRONIC ARTS	42,400	89.92	3,812,608.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	29,300	31.26	915,918.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	20,800	52.52	1,092,416.00	
NETFLIX INC	59,920	351.39	21,055,288.80	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	15,700	105.93	1,663,101.00	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	144,100	48.36	6,968,676.00	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	59,400	48.05	2,854,170.00	
VIACOM INC-CLASS B	50,200	29.59	1,485,418.00	
ALPHABET INC-CL A	41,070	1,089.51	44,746,175.70	
ALPHABET INC-CL C	43,260	1,080.97	46,762,762.20	
FACEBOOK INC-A	331,400	147.54	48,894,756.00	
IAC/INTERACTIVE CORP	10,400	190.12	1,977,248.00	
TRIPADVISOR INC	14,600	56.90	830,740.00	
TWITTER INC	94,200	32.47	3,058,674.00	
ZILLOW GROUP INC - C	16,000	33.56	536,960.00	
小計銘柄数：593			3,086,030,561.63	
			(336,284,750,300)	
組入時価比率：65.2%				67.6%

カナダドル	ARC RESOURCES LTD	50,000	9.78	489,000.00	
	CAMECO CORP	56,000	16.44	920,640.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	167,700	36.59	6,136,143.00	
	CENOVUS ENERGY INC	140,000	10.58	1,481,200.00	
	ENBRIDGE INC	275,900	47.22	13,027,998.00	
	ENCANA CORP	126,000	9.12	1,149,120.00	
	HUSKY ENERGY INC	52,000	15.53	807,560.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	36.61	1,372,875.00	
	INTER PIPELINE LTD	52,000	21.14	1,099,280.00	
	KEYERA CORP	28,500	27.79	792,015.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	70,600	44.19	3,119,814.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	31,000	19.57	606,670.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	37,000	10.81	399,970.00	
	SUNCOR ENERGY INC	222,200	40.77	9,059,094.00	
	TOURMALINE OIL CORP	33,000	18.55	612,150.00	
	TRANSCANADA CORP	125,700	54.67	6,872,019.00	
	VERMILION ENERGY INC	18,500	32.29	597,365.00	
	METHANEX CORP	8,600	73.81	634,766.00	
	NUTRIEN LTD	85,400	65.78	5,617,612.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	21,200	52.62	1,115,544.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	33,100	52.11	1,724,841.00	
	BARRICK GOLD	236,600	15.73	3,721,718.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	101,000	12.57	1,269,570.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	25,400	91.69	2,328,926.00	
	GOLDCORP INC	121,000	13.68	1,655,280.00	
	KINROSS GOLD CORP	174,000	4.15	722,100.00	
	LUNDIN MINING CORP	95,000	5.99	569,050.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	68,000	30.03	2,042,040.00	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	126,000	2.11	265,860.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63,000	25.36	1,597,680.00	
	WEST FRASER TIMBER	8,400	70.00	588,000.00	
	BOMBARDIER B SHEARS	262,000	2.02	529,240.00	
CAE INC	36,000	26.37	949,320.00		
SNC-LAVALIN GROUP INC	25,200	48.20	1,214,640.00		
WSP GLOBAL INC	13,200	63.13	833,316.00		

FINNING INTERNATIONAL INC	24,000	25.49	611,760.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	100,100	108.63	10,873,863.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	19,800	256.69	5,082,462.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	45,600	66.67	3,040,152.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	27,800	42.89	1,192,342.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	32,000	74.99	2,399,680.00
STARS GROUP INC/THE	23,000	23.51	540,730.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	144.77	1,245,022.00
DOLLARAMA INC	41,800	34.14	1,427,052.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	59,600	71.46	4,259,016.00
EMPIRE CO LTD A	26,000	30.21	785,460.00
LOBLAW COMPANIES	26,100	64.18	1,675,098.00
METRO INC	33,400	49.21	1,643,614.00
WESTON(GEORGE)LTD	10,700	93.40	999,380.00
SAPUTO INC	32,100	39.10	1,255,110.00
AURORA CANNABIS INC	97,000	9.72	942,840.00
BAUSCH HEALTH COS INC	42,500	29.65	1,260,125.00
CANOPY GROWTH CORP	27,500	55.68	1,531,200.00
BANK OF MONTREAL	87,600	94.89	8,312,364.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	168,200	72.27	12,155,814.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	61,500	107.93	6,637,695.00
NATIONAL BANK OF CANADA	46,000	59.83	2,752,180.00
ROYAL BANK OF CANADA	198,300	97.84	19,401,672.00
TORONTO DOMINION BANK	251,500	70.63	17,763,445.00
ONEX CORPORATION	10,900	75.31	820,879.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,880	631.22	2,449,133.60
GREAT-WEST LIFECO INC	42,000	28.71	1,205,820.00
IA FINANCIAL CORP INC	14,700	47.03	691,341.00
INTACT FINANCIAL CORP	18,900	101.23	1,913,247.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	275,000	20.94	5,758,500.00
POWER CORPORATION OF CANADA	46,000	25.52	1,173,920.00
POWER FINANCIAL CORP	32,500	26.89	873,925.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	83,800	47.81	4,006,478.00
CGI GROUP INC - CLASS A	33,800	86.39	2,919,982.00

	SHOIFY INC - CLASS A	12,200	209.11	2,551,142.00	
	BLACKBERRY LTD	71,000	10.14	719,940.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,720	918.37	2,497,966.40	
	OPEN TEXT CORP	35,400	45.76	1,619,904.00	
	BCE INC	19,800	55.53	1,099,494.00	
	TELUS CORP	29,300	45.51	1,333,443.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	50,200	71.69	3,598,838.00	
	EMERA INC	7,600	44.96	341,696.00	
	FORTIS INC	58,300	45.98	2,680,634.00	
	HYDRO ONE LTD	42,000	20.29	852,180.00	
	ALTAGAS LTD	33,800	13.80	466,440.00	
	ATCO LTD CL1	9,600	39.69	381,024.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	15,700	32.82	515,274.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	116,800	54.51	6,366,768.00	
	CI FINANCIAL CORP	33,600	17.74	596,064.00	
	IGM FINANCIAL INC	10,300	32.81	337,943.00	
	THOMSON REUTERS CORP	28,247	66.81	1,887,182.07	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	25,000	20.15	503,750.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	63,000	26.37	1,661,310.00	
小計	銘柄数：88			235,534,710.07	
				(19,358,597,820)	
	組入時価比率：3.8%			3.9%	
ユ-口	TENARIS SA	60,000	10.25	615,300.00	
	ENAGAS	30,400	24.75	752,400.00	
	ENI SPA	352,000	14.28	5,026,560.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	67,000	14.19	951,065.00	
	NESTE OYJ	17,600	78.92	1,388,992.00	
	OMV AG	21,000	41.25	866,250.00	
	REPSOL SA	183,000	14.65	2,680,950.00	
	REPSOL SA-RTS	183,000	0.41	76,598.31	
	SNAM SPA	298,000	4.11	1,227,462.00	
	TOTAL SA	330,000	47.05	15,526,500.00	
	VOPAK	9,000	43.66	392,940.00	
	AIR LIQUIDE	59,200	103.95	6,153,840.00	
	AKZO NOBEL	34,900	70.54	2,461,846.00	
	ARKEMA	9,900	81.58	807,642.00	

BASF SE	125,400	62.87	7,883,898.00
COVESTRO AG	27,000	46.25	1,248,750.00
EVONIK INDUSTRIES AG	22,700	22.86	518,922.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	40.70	427,350.00
KONINKLIJKE DSM NV	24,700	78.00	1,926,600.00
LANXESS	12,000	47.19	566,280.00
SOLVAY SA	10,300	93.10	958,930.00
SYMRISE AG	16,300	70.38	1,147,194.00
UMICORE	28,000	35.87	1,004,360.00
CRH PLC	113,600	24.73	2,809,328.00
HEIDELBERGCEMENT AG	20,300	58.56	1,188,768.00
IMERYS	3,800	43.80	166,440.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,000	24.40	780,800.00
ARCELORMITTAL	88,500	19.28	1,706,280.00
THYSSENKRUPP AG	62,000	15.86	983,320.00
VOESTALPINE AG	16,500	27.84	459,360.00
STORA ENSO OYJ-R	73,000	11.69	853,370.00
UPM-KYMMENE OYJ	73,300	25.09	1,839,097.00
AIRBUS SE	80,400	92.54	7,440,216.00
DASSAULT AVIATION SA	330	1,254.00	413,820.00
LEONARDO SPA	55,000	7.62	419,210.00
MTU AERO ENGINES AG	6,900	178.60	1,232,340.00
SAFRAN SA	45,700	108.35	4,951,595.00
THALES SA	14,100	99.10	1,397,310.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	66,900	29.00	1,940,100.00
KINGSPAN GROUP PLC	22,200	37.92	841,824.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,600	34.14	1,181,244.00
BOUYGUES	31,400	29.88	938,232.00
EIFFAGE SA	10,800	76.44	825,552.00
FERROVIAL SA	66,511	18.86	1,254,730.01
HOCHTIEF AG	2,600	121.10	314,860.00
VINCI	70,200	73.82	5,182,164.00
LEGRAND SA	37,000	50.58	1,871,460.00
OSRAM LICHT AG	14,300	36.64	523,952.00
PRYSMIAN SPA	30,900	18.22	563,152.50

SCHNEIDER ELECTRIC SE	75,400	58.54	4,413,916.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	30,000	11.09	332,700.00
SIEMENS AG	105,400	97.59	10,285,986.00
ALSTOM	20,500	35.66	731,030.00
ANDRITZ AG	9,200	43.32	398,544.00
CNH INDUSTRIAL NV	141,000	8.67	1,223,598.00
GEA GROUP AG	24,200	22.95	555,390.00
KION GROUP AG	9,900	44.83	443,817.00
KONE OYJ	45,600	43.33	1,975,848.00
METSO OYJ	16,200	25.08	406,296.00
WARTSILA OYJ	63,000	14.32	902,475.00
BRENNTAG AG	20,600	39.86	821,116.00
REXEL SA	45,000	9.86	444,060.00
EDENRED	32,800	35.76	1,172,928.00
SOCIETE BIC SA	3,800	91.45	347,510.00
BOLLORE	106,000	3.61	382,660.00
DEUTSCHE POST AG-REG	137,100	25.03	3,431,613.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	31,000	20.42	633,020.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	87,000	6.92	602,388.00
ADP	3,900	164.50	641,550.00
AENA SME SA	9,300	142.50	1,325,250.00
ATLANTIA SPA	70,000	19.67	1,377,250.00
FRAPORT AG	6,300	62.58	394,254.00
GETLINK	62,000	11.98	742,760.00
CONTINENTAL AG	15,400	129.85	1,999,690.00
FAURECIA	10,500	35.98	377,790.00
MICHELIN (CGDE)	23,800	88.72	2,111,536.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	15,800	28.59	451,722.00
PIRELLI & C. SPA	53,000	6.02	319,060.00
VALEO SA	33,100	25.88	856,628.00
BAYER MOTOREN WERK	44,900	71.53	3,211,697.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	7,800	62.60	488,280.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	125,700	49.85	6,266,145.00
FERRARI NV	17,100	99.26	1,697,346.00

FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	150,000	14.60	2,191,200.00	
PEUGEOT CITROEN	82,000	21.32	1,748,240.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	20,300	55.94	1,135,582.00	
RENAULT SA	25,500	56.88	1,450,440.00	
VOLKSWAGEN AG	4,500	147.10	661,950.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	25,200	144.90	3,651,480.00	
SEB SA	3,000	127.60	382,800.00	
ADIDAS AG	25,800	198.10	5,110,980.00	
ESSILORLUXOTTICA	29,752	111.95	3,330,736.40	
HERMES INTERNATIONAL	4,430	488.90	2,165,827.00	
HUGO BOSS AG	9,300	57.28	532,704.00	
KERING SA	10,500	397.00	4,168,500.00	
LUXOTTICA GROUP SPA	22,000	51.68	1,136,960.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	38,280	248.95	9,529,806.00	
MONCLER SPA	25,200	29.97	755,244.00	
PUMA SE	1,061	456.00	483,816.00	
ACCOR SA	26,200	37.87	992,194.00	
PADDY POWER PLC	12,600	70.50	888,300.00	
SODEXO	12,100	93.54	1,131,834.00	
DELIVERY HERO SE	11,900	32.78	390,082.00	
ZALANDO SE	13,400	26.10	349,740.00	
INDITEX SA	148,000	23.08	3,415,840.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	80,000	16.02	1,281,600.00	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	8,300	35.47	294,401.00	
COLRUYT SA	8,700	62.86	546,882.00	
JERONIMO MARTINS	31,000	11.73	363,630.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	171,100	22.33	3,821,518.50	
METRO AG	25,000	13.51	337,750.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	105,200	61.83	6,504,516.00	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	76,000	7.61	578,740.00	
HEINEKEN HOLDING NV	16,000	73.00	1,168,000.00	
HEINEKEN NV	35,700	75.12	2,681,784.00	
PERNOD RICARD SA	29,100	137.20	3,992,520.00	
REMY COINTREAU	3,000	99.05	297,150.00	
DANONE	84,400	61.47	5,188,068.00	

KERRY GROUP PLC-A	22,100	90.65	2,003,365.00	
HENKEL AG & CO KGAA	14,400	85.65	1,233,360.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,600	94.20	2,317,320.00	
BEIERSDORF AG	13,700	88.34	1,210,258.00	
LOREAL-ORD	34,430	195.25	6,722,457.50	
UNILEVER NV-CVA	212,700	46.03	9,791,644.50	
BIOMERIEUX	5,900	60.00	354,000.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	131,800	31.17	4,108,206.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	4,500	114.10	513,450.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,900	34.62	688,938.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	29,400	60.80	1,787,520.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	57,600	42.94	2,473,344.00	
GRIFOLS SA	40,100	24.20	970,420.00	
BAYER AG-REG	127,300	65.08	8,284,684.00	
IPSEN	5,500	120.25	661,375.00	
MERCK KGAA	17,300	90.60	1,567,380.00	
ORION OYJ	13,000	31.29	406,770.00	
RECORDATI SPA	14,100	30.68	432,588.00	
SANOFI	155,100	74.31	11,525,481.00	
UCB SA	16,500	77.70	1,282,050.00	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	58,100	22.55	1,310,155.00	
AIB GROUP PLC	125,000	3.80	475,000.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	923,000	5.11	4,716,530.00	
BANCO DE SABADELL SA	790,000	1.07	845,300.00	
BANCO SANTANDER SA	2,242,000	4.30	9,652,931.00	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	133,000	5.39	717,535.00	
BANKIA SA	151,000	2.63	397,583.00	
BANKINTER S.A.	88,000	7.09	624,624.00	
BNP PARIBAS	155,400	43.08	6,694,632.00	
CAIXABANK	505,000	3.36	1,697,305.00	
COMMERZBANK AG	135,000	6.64	897,615.00	
CREDIT AGRICOLE SA	154,000	10.34	1,593,284.00	
ERSTE GROUP BANK AG	40,000	30.39	1,215,600.00	
ING GROEP NV	538,000	10.29	5,538,172.00	
INTESA SANPAOLO	2,062,000	2.03	4,185,860.00	

IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	34,600	61.12	2,114,752.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	88,000	7.83	689,568.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	23.78	477,978.00	
SOCIETE GENERALE	104,300	30.21	3,150,903.00	
UNICREDIT SPA	271,000	10.64	2,885,608.00	
EURAZEO SE	5,670	64.15	363,730.50	
EXOR NV	15,100	53.64	809,964.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	11,000	80.40	884,400.00	
WENDEL	3,400	106.80	363,120.00	
AEGON NV	246,000	4.46	1,098,636.00	
AGEAS	25,800	40.47	1,044,126.00	
ALLIANZ SE-REG	59,200	180.40	10,679,680.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	162,000	15.23	2,467,260.00	
AXA	265,000	20.05	5,313,250.00	
CNP ASSURANCES	21,200	19.42	411,704.00	
HANNOVER RUECK SE	7,900	123.50	975,650.00	
MAPFRE SA	163,000	2.45	400,817.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	20,700	191.45	3,963,015.00	
NN GROUP NV	42,900	36.69	1,574,001.00	
POSTE ITALIANE SPA	77,000	7.35	566,258.00	
SAMPO OYJ-A SHS	61,200	40.38	2,471,256.00	
SCOR SE	23,200	41.60	965,120.00	
AMADEUS IT GROUP SA	59,500	62.20	3,700,900.00	
ATOS SE	13,600	70.58	959,888.00	
CAPGEMINI SA	21,900	93.66	2,051,154.00	
WIRECARD AG	15,900	139.15	2,212,485.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	17,800	107.65	1,916,170.00	
SAP SE	135,400	89.47	12,114,238.00	
NOKIA OYJ	781,000	5.17	4,039,332.00	
INGENICO GROUP	8,100	51.48	416,988.00	
ASML HOLDING NV	56,000	139.10	7,789,600.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	155,000	18.33	2,841,150.00	
STMICROELECTRONICS NV	97,000	12.55	1,217,350.00	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	460,000	14.67	6,750,500.00	

ELISA OYJ	19,500	37.94	739,830.00
ILIAD SA	3,900	103.20	402,480.00
KONINKLIJKE KPN NV	446,000	2.47	1,101,620.00
ORANGE SA	277,000	13.40	3,711,800.00
PROXIMUS	21,600	22.32	482,112.00
TELECOM ITALIA SPA	1,530,000	0.51	789,174.00
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.44	392,128.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	97,000	3.04	295,268.00
TELEFONICA SA	640,000	7.61	4,875,520.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	35.50	596,400.00
1&1 DRILLISCH AG	8,000	37.94	303,520.00
ELECTRICITE DE FRANCE	82,000	13.70	1,123,400.00
ENDESA S.A.	44,400	20.67	917,748.00
ENEL SPA	1,124,000	5.21	5,865,032.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	361,000	3.06	1,106,104.00
FORTUM OYJ	60,000	18.75	1,125,000.00
IBERDROLA SA	840,000	6.91	5,811,120.00
IBERDROLA SA-RTS	840,000	0.15	128,940.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	59,000	19.27	1,137,225.00
TERNA SPA	185,000	5.31	982,350.00
VERBUND AG	9,000	41.70	375,300.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	49,300	23.09	1,138,337.00
E.ON SE	307,000	9.01	2,766,377.00
ENGIE	251,000	13.50	3,388,500.00
INNOGY SE	19,500	40.49	789,555.00
RWE AG	72,000	19.76	1,423,080.00
SUEZ	52,000	11.41	593,320.00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	71,000	17.98	1,276,935.00
AMUNDI SA	8,200	49.51	405,982.00
DEUTSCHE BANK AG-REG	275,000	8.11	2,231,350.00
DEUTSCHE BOERSE AG	26,900	111.85	3,008,765.00
NATIXIS	128,000	4.47	573,184.00
UNIPER SE	26,200	24.04	629,848.00
EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,430	333.40	476,762.00
QIAGEN NV	31,400	32.00	1,004,800.00

	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,100	89.25	365,925.00	
	BUREAU VERITAS SA	34,200	18.77	641,934.00	
	RANDSTAD NV	17,400	41.51	722,274.00	
	TELEPERFORMANCE	7,700	140.30	1,080,310.00	
	WOLTERS KLUWER	39,000	52.80	2,059,200.00	
	AROUNDTOWN SA	107,000	7.43	795,010.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	48,400	41.30	1,998,920.00	
	VONOVIA SE	66,400	41.52	2,756,928.00	
	AXEL SPRINGER SE	5,900	50.50	297,950.00	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	24,100	17.41	419,581.00	
	JC DECAUX SA	9,300	25.58	237,894.00	
	PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	34,000	15.31	520,540.00	
	PUBLICIS GROUPE	29,200	52.56	1,534,752.00	
	RTL GROUP	5,400	47.94	258,876.00	
	SES FDR	48,000	17.00	816,000.00	
	TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	39.92	267,464.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	11,100	78.20	868,020.00	
	VIVENDI SA	143,700	21.76	3,126,912.00	
小計	銘柄数：241			480,430,466.22	
				(59,640,638,076)	
	組入時価比率：11.6%			12.0%	
英債券	WOOD GROUP (JOHN) PLC	86,000	5.67	488,136.00	
	BP PLC	2,749,000	5.16	14,184,840.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	632,300	23.30	14,735,751.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	515,600	23.51	12,121,756.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	17,200	48.22	829,384.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	26,700	29.49	787,383.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	143,300	17.84	2,556,472.00	
	ANTOFAGASTA PLC	59,000	8.23	485,688.00	
	BHP GROUP PLC	289,000	15.97	4,615,330.00	
	FRESNILLO PLC	26,000	8.92	231,972.00	
	GLENCORE PLC	1,579,000	2.87	4,545,941.00	
	RIO TINTO PLC-REG	162,000	38.79	6,283,980.00	
	MONDI PLC	49,400	18.17	897,845.00	
	BAE SYSTEMS PLC	441,000	5.05	2,228,814.00	

MEGGITT PLC	111,000	4.99	553,890.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	228,000	8.86	2,020,080.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	680,000	1.65	1,126,420.00
DCC PLC	12,800	64.55	826,240.00
SMITHS GROUP PLC	54,000	14.28	771,390.00
WEIR GROUP PLC	37,000	13.97	517,075.00
ASHTED GROUP PLC	68,000	19.08	1,297,440.00
BUNZLE	44,400	24.07	1,068,708.00
FERGUSON PLC	32,500	52.72	1,713,400.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	39,000	5.47	213,564.00
G4S PLC	219,000	2.07	455,301.00
ROYAL MAIL PLC	136,000	2.87	390,728.00
EASYJET PLC	21,000	11.93	250,530.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	145,000	5.18	751,100.00
PERSIMMON PLC	42,600	23.20	988,320.00
TAYLOR WIMPEY PLC	450,000	1.64	738,000.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	17,100	38.00	649,800.00
BURBERRY GROUP PLC	55,000	17.58	966,900.00
CARNIVAL PLC	22,900	40.57	929,053.00
COMPASS GROUP PLC	215,000	16.31	3,506,650.00
GVC HOLDINGS PLC	71,000	6.73	477,830.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	23,750	43.60	1,035,618.75
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	89,000	3.36	299,218.00
TUI AG-DI	60,000	11.60	696,300.00
WHITBREAD PLC	24,500	47.73	1,169,385.00
MARKS & SPENCER PLC	208,000	2.87	596,960.00
NEXT PLC	19,800	46.74	925,452.00
KINGFISHER PLC	273,000	2.25	614,523.00
MORRISON SUPERMARKETS	315,000	2.20	695,205.00
SAINSBURY	255,000	2.73	696,150.00
TESCO PLC	1,362,000	2.20	3,001,848.00
COCA-COLA HBC AG-DI	29,000	25.24	731,960.00
DIAGEO PLC	339,100	27.18	9,218,433.50
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49,400	21.78	1,075,932.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	316,200	24.72	7,816,464.00

IMPERIAL BRANDS PLC	129,500	23.93	3,099,582.50	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	92,800	59.90	5,558,720.00	
UNILEVER PLC	154,500	39.99	6,178,455.00	
CONVATEC GROUP PLC-WI	210,000	1.38	290,220.00	
SMITH & NEPHEW PLC	123,000	14.46	1,778,580.00	
NMC HEALTH PLC	13,300	27.92	371,336.00	
ASTRAZENECA PLC	174,500	54.96	9,590,520.00	
GLAXOSMITHKLINE PLC	683,000	14.84	10,138,452.00	
BARCLAYS PLC	2,370,000	1.61	3,825,180.00	
HSBC HOLDINGS PLC	2,738,000	6.47	17,720,336.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,730,000	0.56	5,461,449.00	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	650,000	2.33	1,519,700.00	
STANDARD CHARTERED PLC	383,000	6.11	2,343,194.00	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	323,000	2.70	872,100.00	
ADMIRAL GROUP PLC	27,000	20.72	559,440.00	
AVIVA PLC	542,000	4.12	2,234,666.00	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	183,000	3.24	594,384.00	
LEGAL & GENERAL	808,000	2.53	2,046,664.00	
PRUDENTIAL PLC	355,000	14.67	5,207,850.00	
RSA INSURANCE GROUP PLC	140,000	5.34	748,720.00	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	58,000	15.03	871,740.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	143,000	5.93	847,990.00	
BT GROUP PLC	1,145,000	2.27	2,608,310.00	
VODAFONE GROUP PLC	3,650,000	1.48	5,409,300.00	
SSE PLC	137,000	11.64	1,595,365.00	
CENTRICA PLC	780,000	1.35	1,054,170.00	
NATIONAL GRID PLC	471,000	8.00	3,769,884.00	
SEVERN TRENT PLC	32,400	19.00	615,600.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	96,000	7.93	762,048.00	
3I GROUP PLC	132,000	8.37	1,105,896.00	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	40,100	18.12	726,612.00	
INVESTEC PLC	92,000	4.86	447,580.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	42,600	44.14	1,880,364.00	
SCHRODERS PLC	15,800	25.71	406,218.00	
ST JAMES S PLACE PLC	70,000	9.70	679,000.00	

	EXPERIAN PLC	126,200	18.74	2,365,619.00	
	INTERTEK GROUP PLC	21,600	49.56	1,070,496.00	
	RELX PLC	271,000	16.36	4,434,915.00	
	INFORMA PLC	173,000	6.54	1,132,112.00	
	ITV PLC	500,000	1.37	686,250.00	
	PEARSON	109,000	9.18	1,000,838.00	
	WPP PLC	169,000	8.76	1,481,792.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	138,000	4.47	617,550.00	
小計	銘柄数：92			229,488,358.25	
				(32,208,691,080)	
	組入時価比率：6.2%			6.5%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	25,900	19.39	502,201.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	493.80	602,436.00	
	GIVAUDAN-REG	1,247	2,375.00	2,961,625.00	
	SIKA AG-REG	18,000	127.30	2,291,400.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	67,000	45.99	3,081,330.00	
	GEBERIT AG-REG	5,000	365.70	1,828,500.00	
	ABB LTD	250,000	18.95	4,737,500.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	200.20	600,600.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,500	204.60	1,125,300.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	7,300	131.95	963,235.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	71,600	67.22	4,812,952.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,120	301.70	1,243,004.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	59.55	440,670.00	
	DUFREY AG-REG	4,400	98.74	434,456.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	300	1,521.00	456,300.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	140	5,820.00	814,800.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	15	69,800.00	1,047,000.00	
	NESTLE SA-REG	421,000	83.12	34,993,520.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	7,600	178.45	1,356,220.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,450	675.50	979,475.00	
	NOVARTIS-REG	298,100	87.38	26,047,978.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	96,610	257.05	24,833,600.50	
	VIFOR PHARMA AG	5,700	125.15	713,355.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	5,800	77.75	450,950.00	
	BALOISE HOLDING AG	6,600	150.80	995,280.00	

	SWISS LIFE HOLDING AG	4,550	410.20	1,866,410.00	
	SWISS RE LTD	41,400	93.36	3,865,104.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	20,710	306.10	6,339,331.00	
	TEMENOS AG-REG	8,400	124.90	1,049,160.00	
	SWISSCOM AG-REG	3,510	483.50	1,697,085.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	347,000	12.10	4,198,700.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	31,000	40.09	1,242,790.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,430	656.00	1,594,080.00	
	UBS GROUP AG	533,000	13.34	7,112,885.00	
	LONZA AG-REG	10,390	273.50	2,841,665.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	21,500	50.10	1,077,150.00	
	SGS SA-REG	746	2,304.00	1,718,784.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	10,100	84.65	854,965.00	
小計	銘柄数：38			153,771,796.50	
				(16,917,973,050)	
	組入時価比率：3.3%			3.4%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	24,800	254.10	6,301,680.00	
	BOLIDEN AB	36,300	211.05	7,661,115.00	
	ASSA ABLOY AB-B	136,000	162.15	22,052,400.00	
	SKANSKA AB-B SHS	45,000	154.25	6,941,250.00	
	ALFA LAVAL AB	38,900	194.45	7,564,105.00	
	ATLAS COPCO AB-A	94,000	223.85	21,041,900.00	
	ATLAS COPCO AB-B	52,900	206.95	10,947,655.00	
	EPIROC AB - A	92,000	84.17	7,743,640.00	
	EPIROC AB - B	58,000	78.49	4,552,420.00	
	SANDVIK AB	158,000	135.15	21,353,700.00	
	SKF AB-B SHARES	55,000	145.80	8,019,000.00	
	VOLVO AB-B SHS	214,000	122.00	26,108,000.00	
	SECURITAS AB-B SHS	45,000	142.10	6,394,500.00	
	ELECTROLUX AB-B	34,000	203.10	6,905,400.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	55,000	70.40	3,872,000.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	118,000	133.70	15,776,600.00	
	ICA GRUPPEN AB	10,500	325.90	3,421,950.00	
	SWEDISH MATCH AB	23,400	386.70	9,048,780.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	81,700	222.50	18,178,250.00	

	NORDEA BANK ABP	413,000	80.72	33,337,360.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	221,000	90.82	20,071,220.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	212,000	100.15	21,231,800.00	
	SWEDBANK AB	126,000	211.80	26,686,800.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	182.75	4,568,750.00	
	INVESTOR AB-B SHS	61,700	392.60	24,223,420.00	
	KINNEVIK AB - B	33,700	227.40	7,663,380.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	9,200	275.80	2,537,360.00	
	ERICSSON LM-B	417,000	75.76	31,591,920.00	
	HEXAGON AB-B SHS	36,100	429.60	15,508,560.00	
	TELIA CO AB	396,000	41.74	16,529,040.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	9,700	622.00	6,033,400.00	
	TELE 2 AB-B SHS	69,000	111.05	7,662,450.00	
小計	銘柄数：32			431,529,805.00	
				(5,225,825,938)	
	組入時価比率：1.0%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	AKER AB ASA	14,100	263.20	3,711,120.00	
	EQUINOR ASA	161,000	189.70	30,541,700.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	23,200	357.40	8,291,680.00	
	NORSK HYDRO	184,000	41.55	7,645,200.00	
	MOWI ASA	56,800	183.25	10,408,600.00	
	ORKLA ASA	115,000	69.18	7,955,700.00	
	DNB ASA	135,000	152.70	20,614,500.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,000	135.20	3,380,000.00	
	TELENOR ASA	102,000	165.60	16,891,200.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	290.00	3,741,000.00	
小計	銘柄数：10			113,180,700.00	
				(1,444,185,732)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	13,700	615.80	8,436,460.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	31,100	293.90	9,140,290.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	26,800	505.40	13,544,720.00	
	ISS A/S	21,800	186.05	4,055,890.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	520	8,220.00	4,274,400.00	

	A P MOLLER-MAERSK A/S	880	8,796.00	7,740,480.00	
	DSV A/S	26,500	500.00	13,250,000.00	
	PANDORA A/S	16,200	266.60	4,318,920.00	
	CARLSBERG B	14,500	722.00	10,469,000.00	
	COLOPLAST-B	16,400	604.60	9,915,440.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	13,000	209.80	2,727,400.00	
	GENMAB A/S	8,400	1,037.00	8,710,800.00	
	H LUNDBECK A/S	10,500	298.40	3,133,200.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	250,300	307.50	76,967,250.00	
	DANSKE BANK AS	97,000	128.75	12,488,750.00	
	TRYG A/S	16,000	164.00	2,624,000.00	
	ORSTED A/S	25,400	444.10	11,280,140.00	
小計	銘柄数：17			203,077,140.00	
				(3,377,172,838)	
	組入時価比率：0.7%			0.7%	
豪ドル	WORLEYPARSONS LTD	47,000	13.71	644,370.00	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	33,300	26.45	880,785.00	
	OIL SEARCH LTD	179,000	7.60	1,360,400.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	239,000	7.12	1,701,680.00	
	SANTOS LTD.	255,000	5.98	1,524,900.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	25.99	441,830.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	127,000	33.52	4,257,040.00	
	INCITEC PIVOT LTD	233,000	3.52	820,160.00	
	ORICA LTD	50,000	17.45	872,500.00	
	BORAL LTD	153,000	5.10	780,300.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	58,000	14.87	862,460.00	
	AMCOR	155,000	13.40	2,077,000.00	
	ALUMINA LTD	350,000	2.29	801,500.00	
	BHP GROUP LIMITED	406,300	32.93	13,379,459.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	80,000	11.88	950,400.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	223,000	4.47	996,810.00	
	NEWCREST MINING	103,000	23.44	2,414,320.00	
	RIO TINTO LTD	51,200	79.64	4,077,568.00	
	SOUTH32 LTD	700,000	3.33	2,331,000.00	
	CIMIC GROUP LTD	11,700	44.46	520,182.00	

BRAMBLES LTD	218,000	10.58	2,306,440.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	273,000	4.40	1,201,200.00	
SYDNEY AIRPORT	144,000	6.64	956,160.00	
TRANSURBAN GROUP	356,000	11.91	4,239,960.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	76,000	23.90	1,816,400.00	
CROWN RESORTS LTD	55,000	12.08	664,400.00	
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	8,500	43.38	368,730.00	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	7,300	43.23	315,579.00	
TABCORP HOLDINGS	247,000	4.61	1,138,670.00	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	97,117	3.21	311,745.57	
WESFARMERS LIMITED	154,000	32.29	4,972,660.00	
COLES GROUP LTD	161,000	11.88	1,912,680.00	
WOOLWORTHS GROUP LTD	181,000	30.02	5,433,620.00	
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	8.23	633,710.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	100,000	14.68	1,468,000.00	
COCHLEAR LTD	8,100	186.45	1,510,245.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20,500	57.20	1,172,600.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	62,000	22.25	1,379,500.00	
CSL LIMITED	61,800	197.29	12,192,522.00	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	393,000	25.75	10,119,750.00	
BANK OF QUEENSLAND LTD	56,000	10.34	579,040.00	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	67,000	11.07	741,690.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	242,400	72.55	17,586,120.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	378,000	24.80	9,374,400.00	
WESTPAC BANKING CORP	469,000	26.00	12,194,000.00	
AMP LIMITED	390,000	2.56	998,400.00	
CHALLENGER LIMITED	80,000	9.25	740,000.00	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	308,000	7.18	2,211,440.00	
MEDIBANK PRIVATE LTD	350,000	2.65	927,500.00	
QBE INSURANCE	179,000	10.84	1,940,360.00	
SUNCORP GROUP LTD	181,000	12.55	2,271,550.00	
COMPUTERSHARE LTD	63,000	17.72	1,116,360.00	
TELSTRA CORP LTD	590,000	2.93	1,728,700.00	
TPG TELECOM LTD	52,000	6.72	349,440.00	
AUSNET SERVICES	230,000	1.61	370,300.00	

	APA GROUP	159,000	9.01	1,432,590.00	
	AGL ENERGY LTD	93,000	21.12	1,964,160.00	
	ASX LTD	26,300	63.11	1,659,793.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	43,900	116.00	5,092,400.00	
	SEEK LTD	48,000	17.50	840,000.00	
	REA GROUP LTD	6,900	75.50	520,950.00	
小計	銘柄数：61			160,448,428.57	
				(12,532,626,755)	
	組入時価比率：2.4%			2.5%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	112,627	4.94	556,377.38	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,000	7.23	939,900.00	
	A2 MILK CO LTD	106,000	12.10	1,282,600.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	74,000	14.05	1,039,700.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	11.15	646,700.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	260,000	4.05	1,053,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	159,000	3.58	569,220.00	
小計	銘柄数：7			6,087,497.38	
				(449,074,681)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	371,040	78.55	29,145,192.00	
	NWS HOLDINGS LTD	220,500	17.26	3,805,830.00	
	MTR CORP	201,000	42.25	8,492,250.00	
	MINTH GROUP LTD	112,000	28.30	3,169,600.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	195,000	46.00	8,970,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	97,000	25.15	2,439,550.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	333,000	47.70	15,884,100.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	124,000	13.70	1,698,800.00	
	SANDS CHINA LTD	336,000	36.00	12,096,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	160,333	10.20	1,635,396.60	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	6.95	1,876,500.00	
	WYNN MACAU LTD	228,000	16.94	3,862,320.00	
	WH GROUP LIMITED	1,170,000	6.81	7,967,700.00	
	BANK OF EAST ASIA	167,060	25.50	4,260,030.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	495,000	29.60	14,652,000.00	

	HANG SENG BANK	105,800	175.50	18,567,900.00	
	AIA GROUP LTD	1,663,000	69.70	115,911,100.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	38,000	75.40	2,865,200.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	519,600	11.90	6,183,240.00	
	PCCW LTD	550,000	4.76	2,618,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	89,000	61.30	5,455,700.00	
	CLP HLDGS	227,000	91.30	20,725,100.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	191,000	54.45	10,399,950.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,290,317	16.72	21,574,100.24	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	162,400	238.60	38,748,640.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	361,040	62.80	22,673,312.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	103,000	21.35	2,199,050.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	251,000	15.74	3,950,740.00	
	HENDERSON LAND	185,858	43.10	8,010,479.80	
	HYSAN DEVELOPMENT	83,000	37.60	3,120,800.00	
	KERRY PROPERTIES	79,000	28.50	2,251,500.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	839,666	11.62	9,756,918.92	
	SINO LAND CO.LTD	480,000	14.40	6,912,000.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	217,000	123.50	26,799,500.00	
	SWIRE PACIFIC-A	64,000	89.60	5,734,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	28.20	4,878,600.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	164,000	48.55	7,962,200.00	
	WHARF(HOLDING)	174,000	22.70	3,949,800.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	117,000	47.65	5,575,050.00	
小計	銘柄数：39			476,778,549.56	
				(6,622,454,053)	
	組入時価比率：1.3%			1.3%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	198,000	3.64	720,720.00	
	KEPPEL CORP.	202,000	6.24	1,260,480.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	140,040	2.68	375,307.20	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	380,000	1.29	490,200.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,040	9.76	751,910.40	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	310,000	2.13	660,300.00	
	SATS LTD	77,000	4.90	377,300.00	

	GENTING SINGAPORE LTD	870,000	1.08	939,600.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	36.99	517,860.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	940,020	0.27	253,805.40	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	247,000	3.25	802,750.00	
	DBS GROUP HLDGS	249,000	25.17	6,267,330.00	
	OCBC-ORD	433,000	11.77	5,096,410.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	185,000	26.58	4,917,300.00	
	VENTURE CORP LTD	35,000	15.30	535,500.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,110,000	3.06	3,396,600.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	111,000	7.42	823,620.00	
	CAPITALAND LIMITED	330,000	3.30	1,089,000.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	51,000	8.85	451,350.00	
	UOL GROUP LIMITED	65,000	6.65	432,250.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	240,000	2.54	609,600.00	
	小計 銘柄数：21			30,769,193.00	
				(2,475,689,268)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
新シケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	91,000	20.93	1,904,630.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	458.00	1,648,800.00	
	BANK HAPOALIM BM	141,000	23.39	3,297,990.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	214,000	23.05	4,932,700.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,000	64.74	1,100,580.00	
	NICE LTD	8,600	383.80	3,300,680.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	280,000	3.31	929,040.00	
	AZRIELI GROUP	6,500	188.50	1,225,250.00	
	小計 銘柄数：8			18,339,670.00	
				(542,120,645)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				497,079,800,236	
				(497,079,800,236)	

(注1)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券(2019年1月17日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	71,000	1,276,580.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,400	1,755,360.00	
		AMERICAN TOWER CORP	60,200	9,859,556.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	176,000	1,791,680.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,200	3,497,472.00	
		BOSTON PROPERTIES	20,700	2,480,481.00	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	25,000	438,750.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,100	1,196,947.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	56,800	6,096,344.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	27,800	2,972,932.00	
		DUKE REALTY CORP	47,800	1,339,356.00	
		EQUINIX INC	10,930	4,165,532.30	
		EQUITY RESIDENTIAL	51,300	3,543,804.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,030	2,317,639.80	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	17,900	1,646,979.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,800	1,225,294.00	
		HCP INC	66,100	1,962,509.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	100,000	1,747,000.00	
		INVITATION HOMES INC	45,000	933,750.00	
		IRON MOUNTAIN INC	38,300	1,342,032.00	
		KIMCO REALTY CORP	58,000	947,720.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	19,800	867,438.00	
		MACERICH CO /THE	14,200	647,804.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,000	1,490,700.00	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,000	1,100,440.00	
		PROLOGIS INC	86,300	5,483,502.00	
		PUBLIC STORAGE	21,500	4,392,665.00	
		REALTY INCOME CORP	39,300	2,540,745.00	
		REGENCY CENTERS CORP	21,000	1,284,570.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	16,000	2,761,120.00	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	42,300	7,313,247.00	
		SL GREEN REALTY CORP	12,500	1,106,000.00	
UDR INC	36,700	1,514,976.00			

小計	VENTAS INC	49,200	2,984,472.00	
	VEREIT INC	125,000	963,750.00	
	VORNADO REALTY TRUST	24,200	1,577,114.00	
	WELLTOWER INC	51,700	3,752,903.00	
	WEYERHAEUSER CO	106,000	2,584,280.00	
	WP CAREY INC	21,500	1,497,690.00	
	銘柄数：39	1,662,560	96,401,134.10	(10,504,831,582)
組入時価比率：2.0%			79.1%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	20,000	440,000.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	541,640.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	352,880.00	
	銘柄数：3	53,000	1,334,520.00	(109,684,198)
組入時価比率：0.0%			0.8%	
ユーロ	COVIVIO	6,600	571,230.00	
	GECINA SA	6,400	772,480.00	
	ICADE	5,100	362,100.00	
	KLEPIERRE	28,000	788,760.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	19,100	2,778,286.00	
	銘柄数：5	65,200	5,272,856.00	(654,572,343)
組入時価比率：0.1%			4.9%	
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	717,568.00	
	HAMMERSON PLC	108,000	376,704.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	99,000	856,152.00	
	SEGRO PLC	145,000	907,700.00	
	銘柄数：4	480,000	2,858,124.00	(401,137,703)
組入時価比率：0.1%			3.0%	
豪ドル	DEXUS	140,000	1,545,600.00	
	GOODMAN GROUP	227,000	2,608,230.00	
	GPT GROUP	256,000	1,415,680.00	
	LENDLEASE GROUP	77,000	928,620.00	
	MIRVAC GROUP	490,000	1,127,000.00	
	SCENTRE GROUP	723,000	2,971,530.00	

小計	STOCKLAND TRUST GROUP	348,000	1,298,040.00	
	VICINITY CENTRES	480,000	1,272,000.00	
	銘柄数：8	2,741,000	13,166,700.00	(1,028,450,937)
	組入時価比率：0.2%			7.7%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	370,000	3,034,000.00	
	LINK REIT	288,000	23,054,400.00	
小計	銘柄数：2	658,000	26,088,400.00	(362,367,876)
	組入時価比率：0.1%			2.7%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	380,000	1,041,200.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	369,972	677,048.76	
	CAPITALAND MALL TRUST	310,000	722,300.00	
	SUNTEC REIT	300,000	567,000.00	
小計	銘柄数：4	1,359,972	3,007,548.76	(241,987,373)
	組入時価比率：0.0%			1.8%
合計			13,303,032,012	(13,303,032,012)

(注1)投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2)外貨建有価証券については、通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(注4)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 1月17日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	5,025,434,158	-	5,275,415,279	249,981,121
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	114,135,084	-	114,408,000	272,916
米ドル	114,135,084	-	114,408,000	272,916
売建	841,873,500	-	845,496,000	3,622,500

米ドル	650,814,000	-	653,760,000	2,946,000
ユーロ	37,109,100	-	37,242,000	132,900
英ポンド	83,620,800	-	84,204,000	583,200
豪ドル	70,329,600	-	70,290,000	39,600
合計	-	-	-	246,631,537

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

先物の評価においては、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。

2 為替予約取引

1) 計算日において対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については以下のように評価しております。

計算日において為替予約の受渡日(以下「当該日」といいます)の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

計算日において当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- ・ 計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

2) 計算日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算日の対顧客相場の仲値で評価しております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2 ファンドの現況

純資産額計算書

野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)

2019年2月28日現在

資産総額	98,056,859,464円
負債総額	166,475,974円
純資産総額(-)	97,890,383,490円
発行済口数	57,754,389,217口
1口当たり純資産額(/)	1.6949円

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

2019年2月28日現在

資産総額	561,676,691,935円
負債総額	1,412,818,058円
純資産総額(-)	560,263,873,877円
発行済口数	208,434,169,861口
1口当たり純資産額(/)	2.6880円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1 委託会社等の概況

< 更新後 >

(1) 資本金の額

2019年2月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2) 会社の機構

(a) 会社の意思決定機構

当社は監査等委員会設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表取締役および監査等委員会を設けております。各機関の権限は以下のとおりです。

株主総会

株主により構成され、取締役・会計監査人の選任・解任、剰余金の配当の承認、定款変更・合併等の重要事項の承認等を行います。

取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また代表取締役等を選任し、取締役の職務の執行を監督します。

代表取締役・業務執行取締役

代表取締役を含む各業務執行取締役は、当社の業務の執行を行います。代表取締役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表取締役を含む業務執行取締役で構成される経営会議が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役員が含まれます。

監査等委員会

監査等委員である取締役3名以上（但し、過半数は社外取締役）で構成され、取締役の職務執行の適法性および妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容や監査等委員である取締役以外の取締役の選任・解任・辞任および報酬等についての監査等委員会としての意見を決定します。

(b)投資信託の運用体制



2 事業の内容及び営業の概況

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託者は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業に係る業務の一部及び投資助言業務を行っています。

委託者の運用する証券投資信託は2019年1月31日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	1,023	26,947,656
単位型株式投資信託	141	718,198
追加型公社債投資信託	14	5,129,412
単位型公社債投資信託	409	1,742,040
合計	1,587	34,537,305

3 委託会社等の経理状況

< 更新後 >

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

委託会社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号、以下「中間財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第38条及び第57条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。

2. 財務諸表及び中間財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2017年4月1日から2018年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2018年4月1日から2018年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けている新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日に名称を変更し、EY新日本有限責任監査法人となりました。

(1) 貸借対照表

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(2017年3月31日)	(2018年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		127	919
金銭の信託		52,247	47,936
有価証券		15,700	22,600
前払金		33	0
前払費用		2	26

未収入金			495		464
未収委託者報酬			16,287		24,059
未収運用受託報酬			7,481		6,764
繰延税金資産			1,661		2,111
その他			42		181
貸倒引当金			11		15
流動資産計			94,066		105,048
固定資産					
有形固定資産			1,001		874
建物	2	377		348	
器具備品	2	624		525	
無形固定資産			7,185		7,157
ソフトウェア		7,184		7,156	
その他		0		0	
投資その他の資産			13,165		13,825
投資有価証券		1,233		1,184	
関係会社株式		8,124		9,033	
従業員長期貸付金		-		36	
長期差入保証金		44		54	
長期前払費用		37		36	
前払年金費用		2,594		2,350	
繰延税金資産		960		962	
その他		170		168	
貸倒引当金		-		0	
固定資産計			21,353		21,857
資産合計			115,419		126,906

区分	注記 番号	前事業年度 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			98		133
未払金	1		10,401		17,853
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		31		31	
未払手数料		5,242		7,884	
関係会社未払金		4,438		7,930	
その他未払金		687		2,005	
未払費用	1		9,461		12,441
未払法人税等			714		2,241
前受収益			39		33
賞与引当金			4,339		4,626
流動負債計			25,055		37,329
固定負債					
退職給付引当金			2,947		2,938
時効後支払損引当金			538		548
固定負債計			3,485		3,486
負債合計			28,540		40,816
(純資産の部)					

株主資本			86,837		86,078
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			55,927		55,168
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,242		54,483	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,635		29,876	
評価・換算差額等			41		11
その他有価証券評価差額金			41		11
純資産合計			86,878		86,090
負債・純資産合計			115,419		126,906

(2) 損益計算書

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業収益					
委託者報酬			96,594		115,907
運用受託報酬			28,466		26,200
その他営業収益			266		338
営業収益計			125,327		142,447
営業費用					
支払手数料			39,785		45,252
広告宣伝費			1,011		1,079
公告費			0		0
調査費			26,758		30,516
調査費		5,095		5,830	
委託調査費		21,662		24,685	
委託計算費			1,290		1,376
営業雑経費			4,408		5,464
通信費		162		125	
印刷費		940		966	
協会費		76		79	
諸経費		3,228		4,293	
営業費用計			73,254		83,689
一般管理費					
給料			11,269		11,716
役員報酬	2	301		425	
給料・手当		6,923		6,856	
賞与		4,044		4,433	
交際費			126		132
旅費交通費			469		482
租税公課			898		1,107

不動産賃借料		1,222	1,221
退職給付費用		1,223	1,119
固定資産減価償却費		2,730	2,706
諸経費		8,118	9,122
一般管理費計		26,059	27,609
営業利益		26,012	31,148

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業外収益			
受取配当金	1	7,397	4,031
受取利息		0	4
金銭の信託運用益		684	-
その他		379	362
営業外収益計		8,461	4,398
営業外費用			
支払利息		17	2
金銭の信託運用損		-	312
時効後支払損引当金繰入額		16	13
為替差損		33	46
その他		9	31
営業外費用計		77	405
経常利益		34,397	35,141
特別利益			
投資有価証券等売却益		26	20
関係会社清算益		41	-
株式報酬受入益		59	75
特別利益計		126	95
特別損失			
投資有価証券等評価損		6	2
固定資産除却損	3	9	58
特別損失計		15	60
税引前当期純利益		34,507	35,176
法人税、住民税及び事業税		7,147	10,775
法人税等調整額		1,722	439
当期純利益		25,637	24,840

(3) 株主資本等変動計算書

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本			
	資本剰余金		利益剰余金	
			その他利益剰余金	

	資本金	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	株主資本合計
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606
当期変動額									
剰余金の配当							38,407	38,407	38,407
当期純利益							25,637	25,637	25,637
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	12,769	12,769	12,769
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	5,349	5,349	104,956
当期変動額			
剰余金の配当			38,407
当期純利益			25,637
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	5,308	5,308	5,308
当期変動額合計	5,308	5,308	18,078
当期末残高	41	41	86,878

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837
当期変動額									
剰余金の配当							25,598	25,598	25,598
当期純利益							24,840	24,840	24,840

株主資本以外 の項目の当期 変動額（純 額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	758	758	758
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	41	41	86,878
当期変動額			
剰余金の配当			25,598
当期純利益			24,840
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）	29	29	29
当期変動額合計	29	29	788
当期末残高	11	11	86,090

[重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 38～50年 附属設備 8～15年 構築物 20年 器具備品 4～15年 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p>
5. 消費税等の会計処理方法	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理していません。
6. 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

【未適用の会計基準等】

- ・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）
- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成30年2月16日）

日）

(1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異の取扱いが見直され、また（分類1）に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

(2) 適用予定日

2019年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[表示方法の変更に関する注記]

(貸借対照表)

前事業年度において、流動負債の「その他未払金」に含めて表示していた「関係会社未払金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より区分掲記しております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「その他未払金」に表示していた4,438百万円は、「関係会社未払金」4,438百万円として組み替えております。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2017年3月31日)	当事業年度末 (2018年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 938百万円	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,781百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 681百万円 器具備品 3,331 合計 4,013	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 708百万円 器具備品 3,491 合計 4,200

損益計算書関係

前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

<p>1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 5,252百万円 支払利息 17</p> <p>2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されております。</p> <p>3. 固定資産除却損</p> <p>建物 -百万円 器具備品 0 ソフトウェア 9 ア 合計 9</p>	<p>1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。</p> <p>受取配当金 4,026百万円 支払利息 2</p> <p>2. 役員報酬の範囲額 (同左)</p> <p>3. 固定資産除却損</p> <p>建物 4百万円 器具備品 0 ソフトウェア 53 ア 合計 58</p>
---	--

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2016年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 34,973百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 6,790円

基準日 2016年3月31日

効力発生日 2016年6月24日

配当財産が金銭以外である場合における当該財産の総額

2016年10月27日開催の臨時株主総会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当財産の種類 株式会社野村総合研究所の株式

配当財産の帳簿価額 3,064百万円

1株当たり配当額 594円87銭

効力発生日 2016年10月27日

配当財産の種類 株式会社ジャフコの株式

配当財産の帳簿価額 282百万円

1株当たり配当額 54円93銭

効力発生日 2016年10月27日

配当財産の種類 朝日火災海上保険株式会社の株式

配当財産の帳簿価額	87百万円
1株当たり配当額	16円89銭
効力発生日	2016年10月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,598百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,970円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23日

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,598百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,970円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25日

金融商品関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的と

して、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

２．金融商品の時価等に関する事項

2017年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	127	127	-
(2)金銭の信託	52,247	52,247	-
(3)未収委託者報酬	16,287	16,287	-
(4)未収運用受託報酬	7,481	7,481	-
(5)有価証券及び投資有価証券	15,700	15,700	-
その他有価証券	15,700	15,700	-
資産計	91,843	91,843	-
(6)未払金	10,401	10,401	-

未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	5,242	5,242	-
関係会社未払金	4,438	4,438	-
その他未払金	687	687	-
(7)未払費用	9,461	9,461	-
(8)未払法人税等	714	714	-
負債計	20,578	20,578	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,233百万円、関係会社株式8,124百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	127	-	-	-
金銭の信託	52,247	-	-	-
未収委託者報酬	16,287	-	-	-
未収運用受託報酬	7,481	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	15,700	-	-	-
合計	91,843	-	-	-

当事業年度（自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合

は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2018年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	919	919	-
(2)金銭の信託	47,936	47,936	-
(3)未収委託者報酬	24,059	24,059	-
(4)未収運用受託報酬	6,764	6,764	-
(5)有価証券及び投資有価証券	22,600	22,600	-
その他有価証券	22,600	22,600	-
資産計	102,279	102,279	-
(6)未払金	17,853	17,853	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	7,884	7,884	-
関係会社未払金	7,930	7,930	-
その他未払金	2,005	2,005	-
(7)未払費用	12,441	12,441	-
(8)未払法人税等	2,241	2,241	-
負債計	32,536	32,536	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,184百万円、関係会社株式9,033百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	919	-	-	-
金銭の信託	47,936	-	-	-
未収委託者報酬	24,059	-	-	-
未収運用受託報酬	6,764	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	22,600	-	-	-
合計	102,279	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

1．売買目的有価証券(2017年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2017年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2017年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2017年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	15,700	15,700	-
小計	15,700	15,700	-
合計	15,700	15,700	-

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2016年 4月 1日 至 2017年 3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月31日）

1．売買目的有価証券(2018年 3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2018年 3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2018年 3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2018年 3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	22,600	22,600	-
小計	22,600	22,600	-
合計	22,600	22,600	-

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月31日）

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	18,692 百万円
勤務費用	889
利息費用	125
数理計算上の差異の発生額	464
退職給付の支払額	634
その他	8
退職給付債務の期末残高	19,546
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	15,764 百万円
期待運用収益	394
数理計算上の差異の発生額	468
事業主からの拠出額	507
退職給付の支払額	562
年金資産の期末残高	16,572
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	16,578 百万円
年金資産	16,572
	5
非積立型制度の退職給付債務	2,967
未積立退職給付債務	2,973
未認識数理計算上の差異	2,992
未認識過去勤務費用	371
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352
退職給付引当金	2,947
前払年金費用	2,594
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	889 百万円
利息費用	125
期待運用収益	394
数理計算上の差異の費用処理額	412
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	993
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	49%
株式	39%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として確定給付型企業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	19,546 百万円
勤務費用	929
利息費用	167
数理計算上の差異の発生額	1,415
退職給付の支払額	660
その他	0
退職給付債務の期末残高	21,398

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	16,572 百万円
期待運用収益	414
数理計算上の差異の発生額	395
事業主からの拠出額	510
退職給付の支払額	518
年金資産の期末残高	17,373

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	18,163 百万円
年金資産	17,373
	790
非積立型制度の退職給付債務	3,235
未積立退職給付債務	4,025
未認識数理計算上の差異	3,768
未認識過去勤務費用	331
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588
退職給付引当金	2,938
前払年金費用	2,350
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	929 百万円
利息費用	167
期待運用収益	414
数理計算上の差異の費用処理額	244
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	887
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	47%
株式	41%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%
3. 確定拠出制度	
当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。	

税効果会計関係

前事業年度末 (2017年3月31日)	当事業年度末 (2018年3月31日)
------------------------	------------------------

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳		1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	
繰延税金資産	百万円	繰延税金資産	百万円
賞与引当金	1,345	賞与引当金	1,434
退職給付引当金	913	退職給付引当金	910
投資有価証券評価減	417	投資有価証券評価減	417
未払事業税	110	未払事業税	409
関係会社株式評価減	247	関係会社株式評価減	247
ゴルフ会員権評価減	212	ゴルフ会員権評価減	207
減価償却超過額	171	減価償却超過額	171
時効後支払損引当金	166	時効後支払損引当金	169
子会社株式売却損	148	子会社株式売却損	148
未払子会社役務提供費用	-	未払子会社役務提供費用	121
未払社会保険料	85	未払社会保険料	107
関係会社株式譲渡益	88	関係会社株式譲渡益	-
その他	274	その他	197
繰延税金資産小計	4,183	繰延税金資産小計	4,543
評価性引当額	739	評価性引当額	735
繰延税金資産合計	3,444	繰延税金資産合計	3,808
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	18	その他有価証券評価差額金	5
前払年金費用	804	前払年金費用	728
繰延税金負債合計	822	繰延税金負債合計	733
繰延税金資産の純額	2,621	繰延税金資産の純額	3,074
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳		2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	
法定実効税率	31.0%	法定実効税率	31.0%
(調整)		(調整)	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	6.2%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	3.4%
タックスヘイブン税制	0.7%	タックスヘイブン税制	1.8%
外国税額控除	0.2%	外国税額控除	0.2%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.5%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%
その他	0.2%	その他	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.7%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.3%

セグメント情報等

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域

ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

（３）主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

（１）製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

（２）地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

（３）主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

関連当事者情報

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. 関連当事者との取引

（ア）親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借 及び購入等 役員の兼任	資金の借入 (*1)	24,500	短期借入金	-
							資金の返済	24,500		
							借入金利息の支払	17	未払費用	-

（イ）子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	-	サービス・製品の購入	自社利用ソフトウェア開発の委託等(*2)	787	未払費用	-

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*3)	33,019	未払手数料	4,486

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

(注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

(*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。

(*2) ソフトウェア開発については、調査・研究に要する費用や開発工数等を勘案し、総合的に決定しております。なお、株式会社野村総合研究所は、2016年10月27日より関連当事者に該当しないこととなったため、取引金額は関連当事者であった期間について、期末残高は関連当事者でなくなった時点について記載しております。

(*3) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス(株)(東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、ニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
----	--------	-----	-----	-------	--------------------	-----------	-------	---------------	----	---------------

親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借 及び購入等 役員の兼任	資金の借入 (*1)	3,000	短期借入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息 の支払	2	未払費用	-

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等 の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*2)	37,482	未払手数料	6,691

(エ) 役員及び個人主要株主等
該当はありません。

- (注) 1. 上記の金額のうち、取引金額には消費税等が含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。
2. 取引条件及び取引条件の決定方針等
(*1) 資金の借入については、市場金利を勘案して利率を合理的に決定しております。
(*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス(株)(東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、
ニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1 株当たり情報

前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,867円41銭	1株当たり純資産額	16,714円33銭
1株当たり当期純利益	4,977円49銭	1株当たり当期純利益	4,822円68銭

潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
1株当たり当期純利益の算定上の基礎	1株当たり当期純利益の算定上の基礎
損益計算書上の当期純利益 25,637百万円	損益計算書上の当期純利益 24,840百万円
普通株式に係る当期純利益 25,637百万円	普通株式に係る当期純利益 24,840百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。
普通株式の期中平均株式数 5,150,693株	普通株式の期中平均株式数 5,150,693株

【重要な後発事象】

当社は、2018年4月6日付で、香港の金融持株会社である8 Limited(エイト・リミテッド、以下「エイト・リミテッド」)の株式の14.9%を取得するとともに、同社の子会社であったエイト証券株式会社(以下「エイト証券」)の株式の78.3%を取得しました。当社のエイト・リミテッド及びエイト証券に対する出資額は、それぞれ約11億円及び約16億円であり、いずれも4月上旬に払込みを行っております。

中間財務諸表

中間貸借対照表

		2018年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		948
金銭の信託		43,002
有価証券		6,700
未収委託者報酬		25,448
未収運用受託報酬		6,582
その他		726
貸倒引当金		16
流動資産計		83,392
固定資産		
有形固定資産	1	793
無形固定資産		6,661
ソフトウェア		6,660
その他		0
投資その他の資産		18,807
投資有価証券		2,582
関係会社株式		11,477
前払年金費用		2,191
繰延税金資産		2,108
その他		448
固定資産計		26,262
資産合計		109,654

		2018年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
未払収益分配金		0
未払償還金		25
未払手数料		8,085
その他未払金	2	4,704
未払費用		11,109

未払法人税等		1,588
賞与引当金		2,349
その他		149
流動負債計		28,014
固定負債		
退職給付引当金		3,087
時効後支払損引当金		557
固定負債計		3,644
負債合計		31,658
(純資産の部)		
株主資本		77,899
資本金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		46,989
利益準備金		685
その他利益剰余金		46,303
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		21,697
評価・換算差額等		97
その他有価証券評価差額金		97
純資産合計		77,996
負債・純資産合計		109,654

中間損益計算書

区分	注記 番号	自 2018年4月 1日 至 2018年9月30日 金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		60,780
運用受託報酬		11,904
その他営業収益		172
営業収益計		72,858
営業費用		
支払手数料		22,197
調査費		16,153
その他営業費用		3,849
営業費用計		42,200
一般管理費	1	14,475
営業利益		16,181
営業外収益	2	6,812
営業外費用	3	183
経常利益		22,810
特別利益	4	38
特別損失	5	153

税引前中間純利益		22,695
法人税、住民税及び事業税		5,121
法人税等調整額		927
中間純利益		16,646

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当中間期変動額									
剰余金の配当							24,826	24,826	24,826
中間純利益							16,646	16,646	16,646
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	8,179	8,179	8,179
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	21,697	46,989	77,899

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	11	11	86,090
当中間期変動額			
剰余金の配当			24,826
中間純利益			16,646
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	85	85	85
当中間期変動額合計	85	85	8,094
当中間期末残高	97	97	77,996

[重要な会計方針]

1 有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式...移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの... 中間決算日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの... 移動平均法による原価法
2 運用目的の金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法によっております。
3 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法によっております。 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
4 引当金の計上基準	(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。 (2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。 (3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。
5 消費税等の会計処理	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。
6 連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

[表示方法の変更]

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

[注記事項]

中間貸借対照表関係

2018年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	3,847百万円
2 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。	

中間損益計算書関係

		自 2018年4月 1日	至 2018年9月30日
1 減価償却実施額			
有形固定資産		80百万円	
無形固定資産		1,318百万円	
2 営業外収益のうち主要なもの			
受取配当金		6,538百万円	
3 営業外費用のうち主要なもの			
支払利息		1百万円	
金銭信託運用損		121百万円	
時効後支払損引当金繰入		38百万円	
為替差損		17百万円	
4 特別利益の内訳			
投資有価証券等売却益		0百万円	
株式報酬受入益		37百万円	
5 特別損失の内訳			
固定資産除却損		153百万円	

中間株主資本等変動計算書関係

		自 2018年4月 1日	至 2018年9月30日			
1 発行済株式に関する事項						
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末	
	普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株	

2 配当に関する事項

配当金支払額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(1) 配当金の総額	24,826百万円
(2) 1株当たり配当額	4,820円
(3) 基準日	2018年3月31日
(4) 効力発生日	2018年6月25日

金融商品関係

当中間会計期間（自 2018年4月1日 至 2018年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

2018年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	948	948	-
(2)金銭の信託	43,002	43,002	-
(3)未収委託者報酬	25,448	25,448	-
(4)未収運用受託報酬	6,582	6,582	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	6,700	6,700	-
資産計	82,682	82,682	-
(6)未払金	12,817	12,817	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	8,085	8,085	-
その他未払金	4,704	4,704	-
(7)未払費用	11,109	11,109	-
(8)未払法人税等	1,588	1,588	-
負債計	25,515	25,515	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

これらの時価について、株式は取引所の価格によっております。また、譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

注2：非上場株式等（中間貸借対照表計上額：投資有価証券2,582百万円、関係会社株式11,477百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5) 有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

有価証券関係

当中間会計期間末（2018年9月30日）

1．満期保有目的の債券(2018年9月30日)

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式(2018年9月30日)

該当事項はありません。

3．その他有価証券(2018年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの			
譲渡性預金	6,700	6,700	-
小計	6,700	6,700	-
合計	6,700	6,700	-

セグメント情報等

当中間会計期間(自 2018年4月1日 至 2018年9月30日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

当社の製品・サービス区分の決定方法は、中間損益計算書の営業収益の区分と同一であることから、製品・サービスごとの営業収益の記載を省略しております。

(2) 地域ごとの情報

売上高

本邦の外部顧客からの営業収益に区分した金額が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益の記載を省略しております。

有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

(3) 主要な顧客ごとの情報

外部顧客からの営業収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、主要な顧客ごとの営業収益の記載を省略しております。

1 株当たり情報

		自 2018年4月 1日 至 2018年9月30日
1 株当たり純資産額	15,142円86銭	
1 株当たり中間純利益	3,231円95銭	
(注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。		
2. 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。		
中間純利益	16,646百万円	
普通株主に帰属しない金額	-	
普通株式に係る中間純利益	16,646百万円	
期中平均株式数	5,150千株	

第2【その他の関係法人の概況】

1 名称、資本金の額及び事業の内容

< 更新後 >

(1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額 [*]	(c) 事業の内容
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

* 2019年1月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村証券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

*2019年1月末現在

独立監査人の監査報告書

2019年3月8日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井純子
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊藤志保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）の2018年7月18日から2019年1月17日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村外国株インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）の2019年1月17日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2018年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森 重 俊 寛指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 櫻 井 雄 一 郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津 村 健 二 郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2017年4月1日から2018年3月31日までの第59期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2018年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は2018年4月6日付でエイト・リミテッドの株式を取得するとともに、同社の子会社であったエイト証券株式会社の株式を取得している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年11月21日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 亀井純子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 櫻井雄一郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津村健二郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の中間会計期間（2018年4月1日から2018年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的な手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監

査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2018年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2018年4月1日から2018年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

-
- (注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。