

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年5月9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D C運用戦略ファンド
【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】	1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

野村DC運用戦略ファンド

（以下「ファンド」といいます。また、ファンドの愛称を「ネクスト10」とします。）

ファンドは、「確定拠出年金法」に基づいて、個人又は事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。ファンドを購入できる投資者については、後述の「(12)その他 申込みの方法」をご参照ください。

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権（以下「受益権」といいます。）

なお、当初元本は1口当たり1円です。

信用格付

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付はありません。また、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。以下同じ。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託者である野村アセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

なお、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。

「基準価額」とは、純資産総額をその時の受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの基準価額について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/>

(5) 【申込手数料】

ありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位（当初元本1口＝1円）とします。

(7) 【申込期間】

2019年5月10日から2020年5月12日まで

*なお、申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8) 【申込取扱場所】

ファンドの申込取扱場所(以下「販売会社」といいます。)について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/>

(9) 【払込期日】

取得申込日の翌々営業日までに申込金額を申込みの販売会社にお支払いください。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に取得申込代金をお支払いいただく場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

各取得申込日の発行価額の総額は、各販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、野村アセットマネジメント株式会社(「委託者」または「委託会社」といいます。)の指定する口座を經由して、野村信託銀行株式会社(「受託者」または「受託会社」といいます。)の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

申込代金は申込みの販売会社にお支払いください。払込取扱場所についてご不明の場合は、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/>

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

申込みの方法

受益権の申込みを行なう投資者は、販売会社所定の方法で申込みを行ないます。

受益権の申込みを行なう投資者は、確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会（以下「連合会」といいます。）等に限るものとします。

購入、換金の各お申込みの方法ならびに単位、および分配金のお取扱い等について、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。

取得申込みの受付の中止、既に受付けた取得申込みの受付の取り消し

金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があります。取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、その他やむを得ない事情等があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11)振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

(参考)

投資信託振替制度（「振替制度」と称する場合があります。）とは、

ファンドの受益権の発生、消滅、移転をコンピュータシステムにて管理します。

- ・ファンドの設定、解約、償還等がコンピュータシステム上の帳簿（「振替口座簿」といいます。）への記載・記録によって行なわれますので、受益証券は発行されません。

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】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

「確定拠出年金法」に基づいて、個人又は事業主が拠出した資金を運用するためのファンドです。

国内および外国（新興国を含む）の株式、国内および外国（新興国を含む）の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とし、また為替予約取引等を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行なうことを基本とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」、「海外REITインデックスマザーファンド」、「野村マネーマザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。

信託金の限度額

受益権の信託金限度額は5,000億円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

<商品分類>

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類は以下の通りです。

なお、ファンドに該当する商品分類及び属性区分は下記の表中に網掛け表示しております。

（野村DC運用戦略ファンド）

《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型	国内	株式
	海外	債券
		不動産投信
追加型	内外	その他資産 ()
		資産複合

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	日本 北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり (適時ヘッジ)
不動産投信	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ファンズ	なし
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券、 不動産投信) 資産配分変更型))				
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型				

ファンドは、ファミリーファンド方式で運用されます。このため、組入れている資産を示す属性区分上の投資対象資産（その他資産（投資信託証券））と収益の源泉となる資産を示す商品分類上の投資対象資産（資産複合）とが異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

《一般社団法人投資信託協会インターネットホームページアドレス》 <http://www.toushin.or.jp/>

一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」に基づくファンドの商品分類及び属性区分は以下の通りです。（2013年2月21日現在）

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1)単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいう。
- (2)追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

- (1)国内...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2)海外...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)内外...目論見書又は投資信託約款において、国内及び海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

〔投資対象資産による区分〕

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2) 債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3) 不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4) その他資産...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に上記(1)から(3)に掲げる資産以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、その他資産と併記して具体的な収益の源泉となる資産の名称記載も可とする。
- (5) 資産複合...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)に掲げる資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいう。

〔独立した区分〕

- (1) MMF(マネー・マネージメント・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMMFをいう。
- (2) MRF(マネー・リザーブ・ファンド)...「MMF等の運営に関する規則」に定めるMRFをいう。
- (3) ETF...投資信託及び投資法人に関する法律施行令(平成12年政令480号)第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法(昭和32年法律第26号)第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいう。

〔補足分類〕

- (1) インデックス型...目論見書又は投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 特殊型...目論見書又は投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。なお、下記の属性区分で特殊型の小分類において「条件付運用型」に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記するものとし、それ以外の小分類に該当する場合には当該小分類を括弧書きで付記できるものとする。

<属性区分表定義>

〔投資対象資産による属性区分〕

株式

- (1) 一般...次の大型株、中小型株属性にあてはまらないすべてのものをいう。
- (2) 大型株...目論見書又は投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいう。
- (3) 中小型株...目論見書又は投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいう。

債券

- (1) 一般...次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらないすべてのものをいう。
- (2) 公債...目論見書又は投資信託約款において、日本国又は各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含む。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (3) 社債...目論見書又は投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (4) その他債券...目論見書又は投資信託約款において、公債又は社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいう。
- (5) 格付等クレジットによる属性...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(4)の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記(1)から(4)に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記することも可とする。

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

資産複合...以下の小分類に該当する場合には当該小分類を併記することができる。

- (1) 資産配分固定型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。
- (2) 資産配分変更型...目論見書又は投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行なう旨の記載があるもの若しくは固定的とする旨の記載がないものをいう。なお、組み合わせている資産を列挙するものとする。

〔決算頻度による属性区分〕

- (1) 年1回...目論見書又は投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいう。
- (2) 年2回...目論見書又は投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいう。
- (3) 年4回...目論見書又は投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいう。
- (4) 年6回(隔月)...目論見書又は投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいう。
- (5) 年12回(毎月)...目論見書又は投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいう。
- (6) 日々...目論見書又は投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいう。
- (7) その他...上記属性にあてはまらないすべてのものをいう。

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

[投資形態による属性区分]

- (1)ファミリーファンド...目論見書又は投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除く。)を投資対象として投資するものをいう。
- (2)ファンド・オブ・ファンズ...「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいう。

[為替ヘッジによる属性区分]

- (1)為替ヘッジあり...目論見書又は投資信託約款において、為替のフルヘッジ又は一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいう。
- (2)為替ヘッジなし...目論見書又は投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるもの又は為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいう。

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

- (1)日経225
- (2)TOPIX
- (3)その他の指数...上記指数にあてはまらないすべてのものをいう。

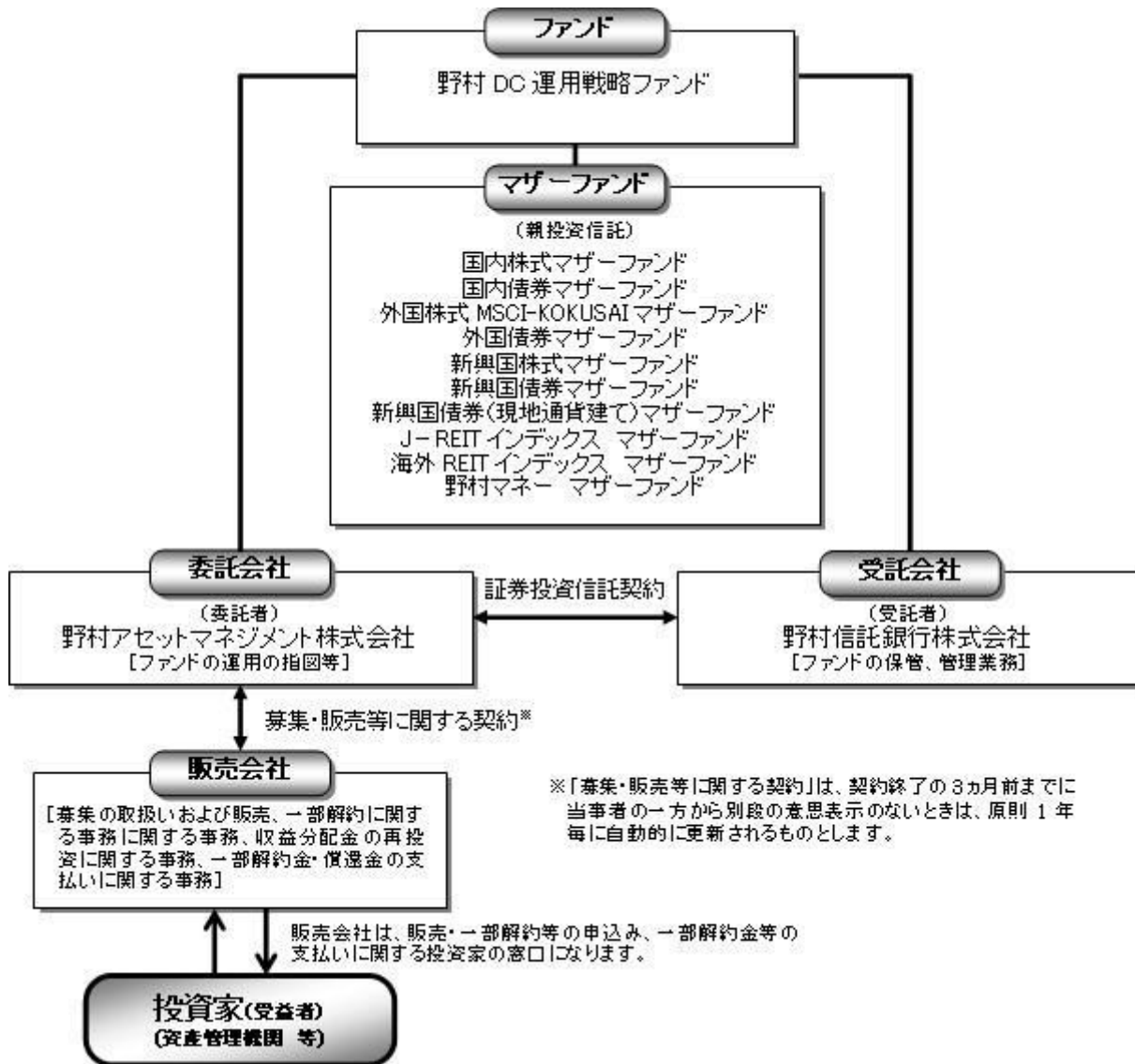
[特殊型]

- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいう。
- (4)その他型...目論見書又は投資信託約款において、上記(1)から(3)に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいう。

(2) 【ファンドの沿革】

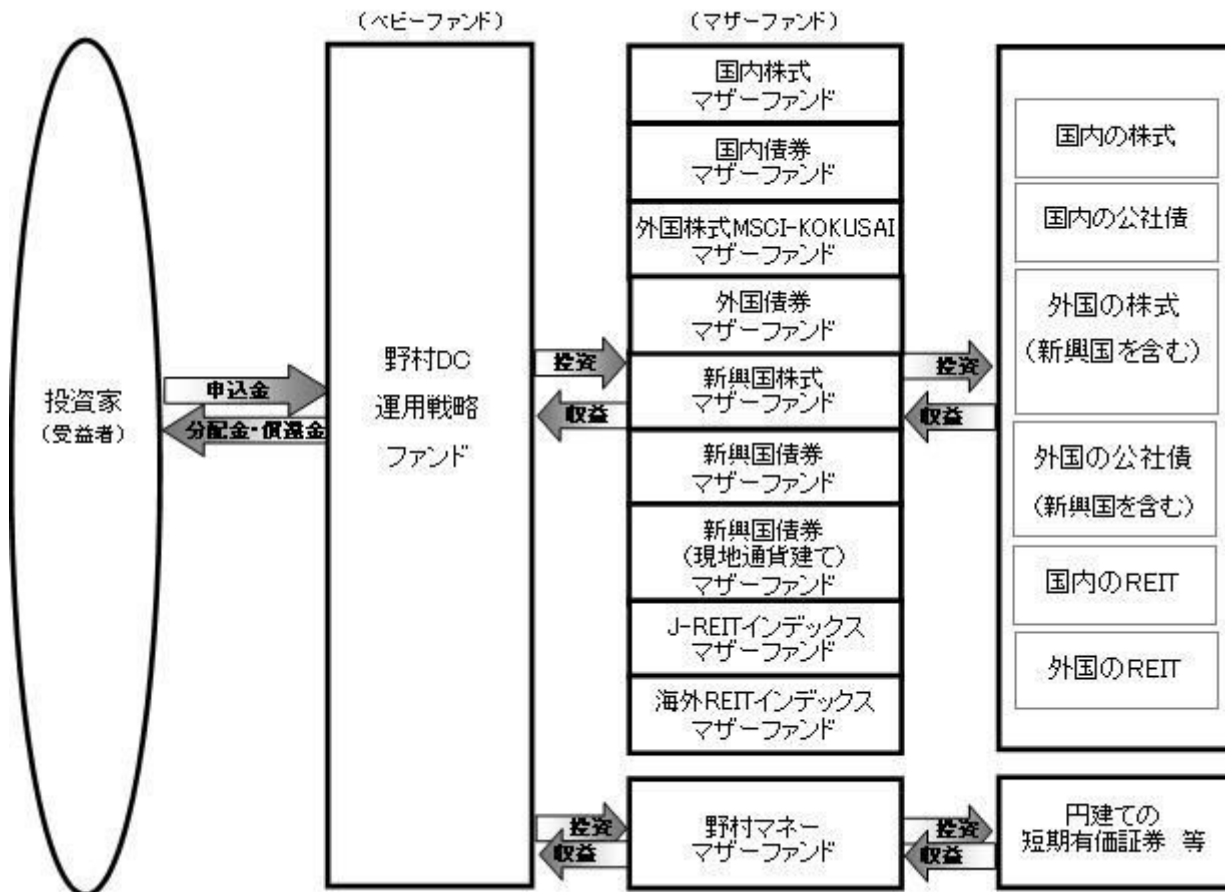
2012年2月28日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



《ファミリーファンド方式について》

ファンドは「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」、「野村マネー マザーファンド」を親投資信託（マザーファンド）とするファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



ファンドは、各マザーファンドへの投資を行なうと共に、為替予約取引等を活用します。

* マザーファンドの運用の方針等については、「第1 ファンドの状況 2 投資方針（参考）各マザーファンドの概要」をご参照ください。

委託会社の概況(2019年3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】

（１）【投資方針】

[1] 運用にあたっては、世界の様々な指標の動きを計量的なアプローチを用いて分析し、リスク水準¹を一定範囲内程度に抑えつつ効率的に収益を獲得することを目指して、各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジション²を決定します。

- 1 リスク水準とは、推定されるポートフォリオの価格の変動の大きさのことです。ファンドでは、推定される基準価額の「振れ幅」（上下変動の程度）を表しています。リスク水準の調整にあたっては、基準価額の目標変動リスク値を、当年度5%程度以下となることを目指して、リスク水準の異なる資産の配分比率や実質的な外貨のエクスポージャーを変更します。

基準価額の変動の方向は、上昇することも下落することもあり得ます。変動リスクの大きさは、必ずしもファンドの運用成績の良さを意味するものではありません。実際の運用成績は、マイナスとなる可能性があります。

ファンドで組入れる各資産と為替の過去の価格の変動リスク等の統計値から、それらを組み合わせた将来の価格の変動リスク値を推定し、資産配分と通貨配分により目標変動リスク値を調整します。ただし、目標変動リスク値はあくまでも推定に基づく統計的な目安ですので、実際の基準価額の変動リスクは、推定値からはずれることがあります。したがって、基準価額が目標変動リスク値で示される範囲より小さくしか値動きをしない場合もあれば、目標変動リスク値で示される範囲を超えて大きく値下がりする場合もあります。

変動リスク値は、「ボラティリティ」や「標準偏差」と呼ばれることもあります。

- 2 マザーファンドを通じて実質的に投資を行なう内外の株式およびREITへの投資比率、ファンドが投資する外貨建資産と為替予約取引等を加味した実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、以下の範囲内となります。

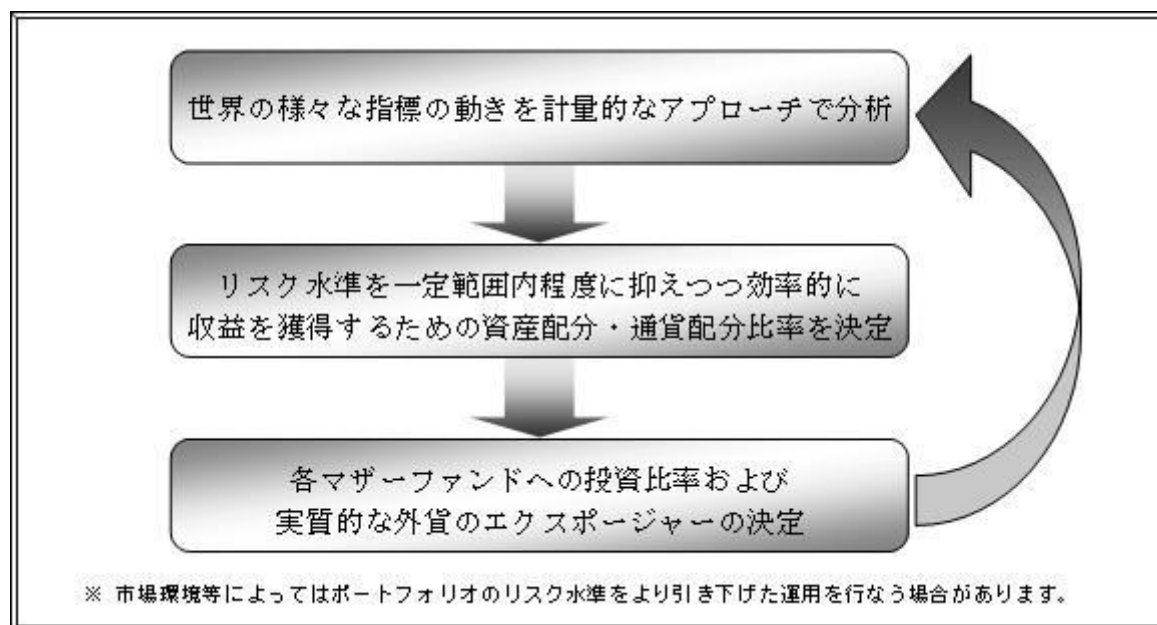
実質的な内外の株式 およびREITへの投資比率	実質的な外貨の エクスポージャー
純資産総額の50%以内	純資産総額の50%以内

各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジションは適宜見直しを行ないます。

一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

内外の株式およびREITをそれぞれ主な投資対象とする「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」への投資比率の合計は、原則として、信託財産の純資産総額の50%以内とします。

運用プロセスについて



[2] 為替予約取引等の利用については、外貨建資産の為替変動リスクを回避する目的（ヘッジ目的。代替ヘッジを含みます。）のほか、効率的に収益を獲得する目的（ヘッジ目的外）で活用します。

為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額は信託財産の純資産総額の100%以内とします。

実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、信託財産の純資産総額の50%以内となるように調整を行ないます。

各マザーファンドの投資方針等について

[国内株式マザーファンド]

- ・わが国の株式を主要投資対象とし、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
- ・主として東京証券取引所第一部上場株式に投資することにより、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指します。
- ・非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。

「東証株価指数（TOPIX）」は、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした指数です。新規上場銘柄や有償増資などに対しては、修正を加えることで指数の連続性を維持しています。

[国内債券 マザーファンド]

- ・わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI 国債指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

「NOMURA-BPI 国債指数」は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

[外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド]

- ・主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI 指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的

な動きを概ね捉える投資成果を目指します。

- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

「MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）」は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

MSCI-KOKUSAI指数は、MSCIが開発した、日本を除く先進国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[外国債券マザーファンド]

- ・主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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 LLC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 LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

[新興国株式マザーファンド]

- ・新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

Depository Receipt（預託証券）の略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）」は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[新興国債券マザーファンド]

- ・新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
- ・投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）は、JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus) は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、エマージング諸国が発行する米ドル建のプレディ債、ローン、ユーロボンドを対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]

- ・現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、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・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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・ディバーシファイド（円換算ベース）は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

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・ディバーシファイドは、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数であり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

[J-REITインデックス マザーファンド]

- ・J-REIT を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
- ・J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

「東証REIT指数(配当込み)」は、東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄に投資した場合の投資成果（市場における価格の変動と配当金の受け取りを合わせた投資成果）を表す指数です。
東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄を対象とした時価総額加重平均を、2003年3月31日を1,000として指数化したものです。

[海外REITインデックス マザーファンド]

- ・日本を除く世界各国のREIT を主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
- ・REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

世界の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。なお、国によっては、「不動産投資信託証券」について、「REIT」という表記を用いていない場合もありますが、当ファンドにおいては、こうした場合も含め、全て「REIT」といいます。

「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルベース)をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。

S&P先進国REIT指数は、S&Pの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数から、REIT及びREITと同様の制度に基づく銘柄を抽出して算出するインデックスで、先進国に上場する不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて毎日算出されます。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[野村マネー マザーファンド]

- ・本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。
- ・残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

国内および外国（新興国を含む）の株式、国内および外国（新興国を含む）の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とし、為替予約取引等を主要取引対象とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」および「野村マネー マザーファンド」の各受益証券への投資を通じて、実質的に国内および外国（新興国を含む）の株式、国内および外国（新興国を含む）の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券（REIT）に投資を行ないます。

各マザーファンドの主要投資対象

国内株式マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式を主要投資対象とします。
外国債券マザーファンド	外国の公社債を主要投資対象とします。
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。
新興国債券マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。
J-REITインデックス マザーファンド	J-REITを主要投資対象とします。
海外REITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とします。
野村マネー マザーファンド	円建ての短期有価証券等を主要投資対象とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

投資の対象とする資産の種類(約款第15条)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「（5）投資制限」、および「」に定めるものに限ります。）に係る権利
 - ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形
 - ロ．次に掲げるものをすべてみたま資産
 - ・ リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するもの
 - ・ 流動性に考慮し、時価の取得が可能なもの
 - ・ 前号または本号イに掲げるものに該当しないもの

有価証券の指図範囲(約款第16条第1項)

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である国内株式マザーファンド、国内債券マザーファンド、外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド、外国債券マザーファンド、新興国株式マザーファンド、新興国債券マザーファンド、新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド、J-REITインデックスマザーファンド、海外REITインデックスマザーファンドおよび野村マネーマザーファンド（以下「各マザーファンド」といいます。）の受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みません。）
6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
9. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
10. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券および新株予約権証券
13. 外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するプ

リファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの

14. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の性質を有するもの
15. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
16. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。）
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、第1号の証券または証書ならびに第13号、第14号、第19号および第20号の証券または証書のうち第1号の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、第2号から第7号までの証券ならびに第13号、第14号、第19号および第20号の証券または証書のうち第2号から第7号までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、第15号および第16号の証券ならびに第19号の証券または証書のうち第15号および第16号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲(約款第16条第2項)

委託者は、信託金を、上記 に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記 に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
7. 日本の会社に類似した性質を有しない外国の者が発行する債務証券または証書（上記 に定める証券または証書を除きます。）
8. 流動性のあるプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの（上記 第13号に定める証券または証書を除きます。なお、上記 第13号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。）
9. リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティー・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記 各号以外のもの

その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引

3. 金利先渡取引¹4. 為替先渡取引²5. 直物為替先渡取引³

- 1 「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」という。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」という。）までの期間に係る国内又は海外において代表的利率として公表される預金契約又は金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」という。）の数値を取り決め、その取決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額及び当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- 2 「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引及び当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいう。以下この項において同じ。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいう。以下この項において同じ。）を取り決め、その取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭又はその取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
- 3 「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

(参考)各マザーファンドの概要

(国内株式マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として東京証券取引所第一部上場株式に投資することにより、東証株価指数(TOPIX)の動きに連動する投資成果を目指します。

非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（国内債券マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI国債指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主としてわが国の国債に投資することにより、NOMURA-BPI国債指数の動きに連動する投資成果を目指します。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該

比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

この投資信託は、MSCI-KOKUSAI 指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

2．運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI 指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債 への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

転換社債型新株予約権付社債とは、新株予約権付社債のうち会社法第236 条第1 項第3 号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの(会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。)をいいます。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場

合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（外国債券マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

2．運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（新興国株式マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

この投資信託は、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

2.運用方法

(1)投資対象

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2)投資態度

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行います。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行いません。

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（新興国債券マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

この投資信託は、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行いません。

2．運用方法

(1) 投資対象

新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド）

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、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・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、現地通貨建て以外の通貨建ての新興国の公社債および償還金額等が新興国の債券や債券指数の価格に連動する効果を有するリンク債等に投資する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(J-REITインデックス マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

この投資信託は、東証REIT指数(配当込み)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。

2.運用方法

(1)投資対象

わが国の不動産投資信託証券（以下「J-REIT」といいます。）を主要投資対象とします。

わが国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

(2)投資態度

J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は行ないません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、東証REIT指数(配当込み)における時価の構成割合が30%を超えるJ-REITがある場合には、当該J-REITへ東証REIT指数(配当込み)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポー

ジャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(海外REITインデックス マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

この投資信託は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルベース)を委託会社において円換算した指数です。

2.運用方法

(1)投資対象

日本を除く世界各国の不動産投資信託証券(以下「REIT」といいます。)を主要投資対象とします。

海外の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。)とします。

(2)投資態度

REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)における時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、当該REITをS&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。

前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(野村マネー マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

この投資信託は、本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。

2.運用方法

(1)投資対象

本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。

(2)投資態度

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

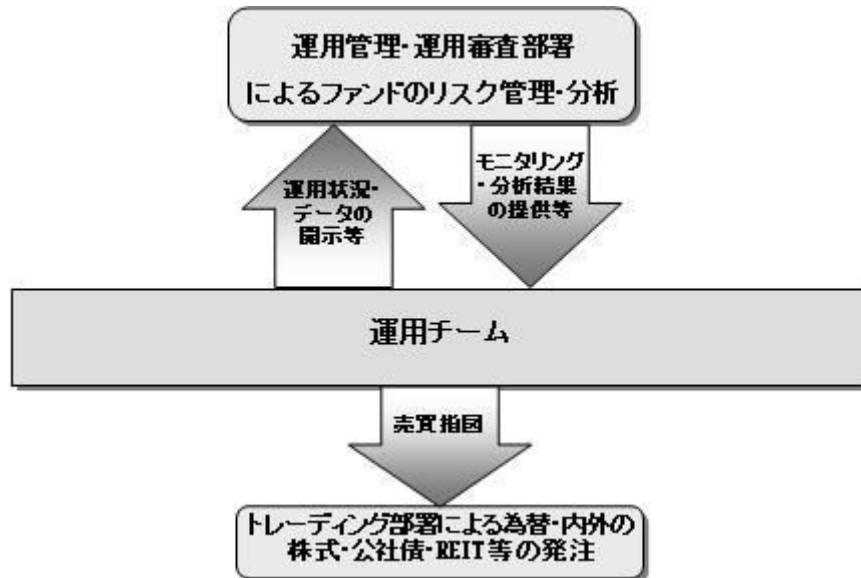
スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(3)【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。

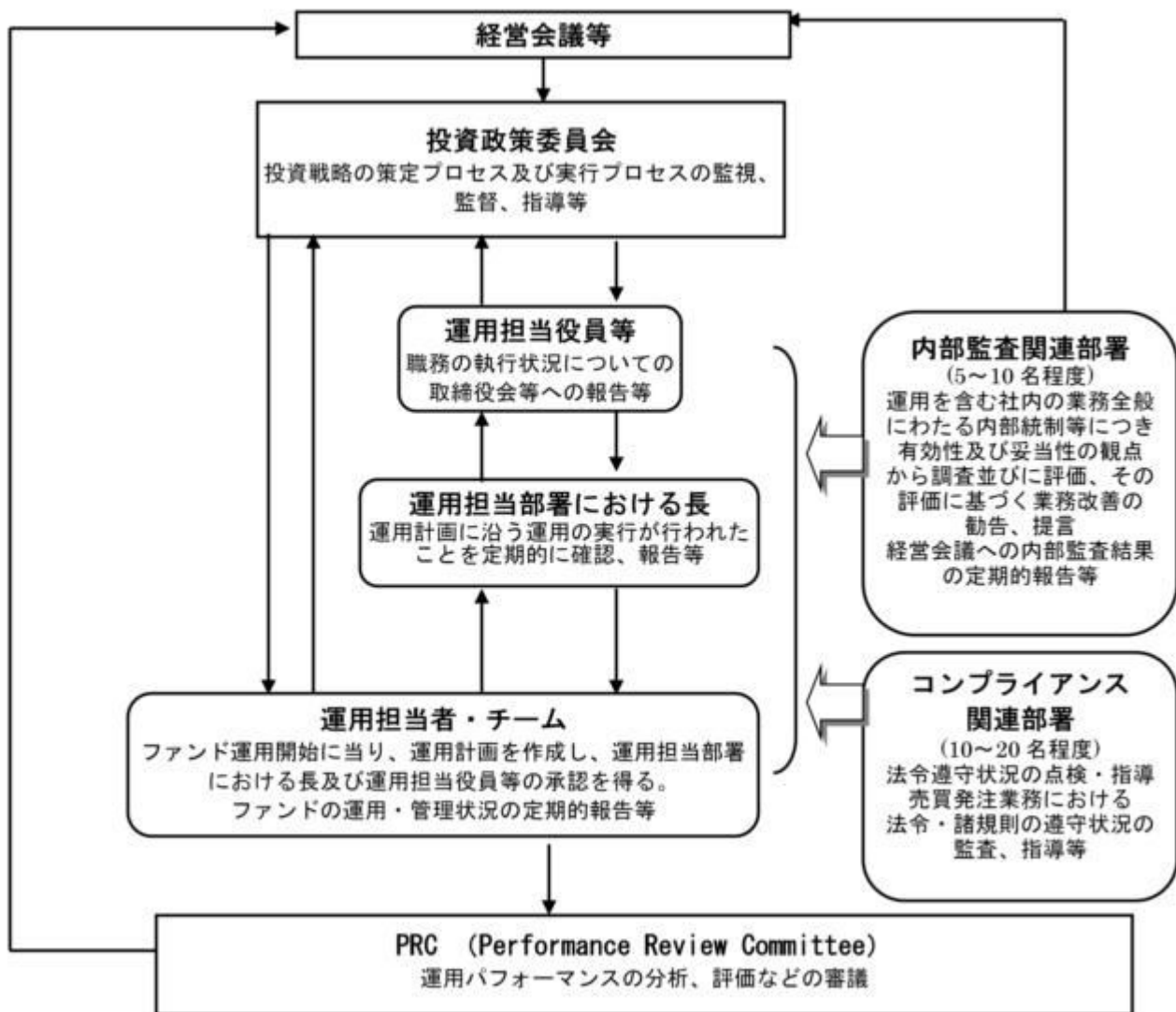


運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

当社では、ファンドの運用に関する社内規程として、運用担当者に関する規程並びにスワップ取引、信用リスク管理、資金の借入、外国為替の予約取引等、信用取引等に関して各々、取扱い基準を設けております。

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。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

収益分配金額は、上記の範囲内で、基準価額水準等を勘案し、委託者が決定します。

留保益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行いません。

利子・配当等収益とは、配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

売買益とは、売買損益に評価損益を加減した利益金額で、諸経費、監査費用、当該監査費用に係る消費税等に相当する金額、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。毎計算期末において、信託財産につき生じた損失は、次期に繰り越します。

* 委託会社の判断により分配を行わない場合もあります。また、将来の分配金の支払いおよびその金額について示唆、保証するものではありません。

ファンドの決算日

原則として**毎年2月17日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

分配金のお支払い

分配金は、原則、無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(5) 【投資制限】

(1) 株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

株式への実質投資割合には制限を設けません。

(2) 外貨建資産への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

(3) デリバティブの利用(運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限)

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。

(4) 外国為替予約取引等の利用(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

外国為替予約取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。

(5) 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。

(6) 同一銘柄の株式への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。

(7) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

- (8) 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)
- 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- (9) 投資信託証券への投資割合(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)
- 投資信託証券(マザーファンド受益証券、上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- (10) 投資する株式等の範囲(約款第19条)
- () 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- () 上記()の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。
- (11) 先物取引等の運用指図(約款第22条)
- () 委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)
- () 委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- () 委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- (12) スワップ取引の運用指図(約款第23条)
- () 委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引および有価証券店頭指数等スワップ取引(金融商品取引法第28条第8項第4号ホに掲げるものをいいます。以下同じ。)(これらを総称して以下「スワップ取引」といいます。)を行なうことの指図をすることができます。
- () スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- () スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- () 委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。
- (13) 信用取引の指図範囲(約款第21条)

- ()委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。
- ()上記()の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売り出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券
- (14) 有価証券の貸付の指図および範囲(約款第25条)
- ()委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- ()上記()に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ()委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。
- (15) 公社債の借入れ(約款第26条)
- ()委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行なうものとします。
- ()上記()の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ()信託財産の一部解約等の事由により、上記()の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ()上記()の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。
- (16) 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第27条)
- ()委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ()金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ()金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会

社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

()委託者は、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(17) 特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28条)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

(18) 直物為替先渡取引の運用指図(約款第31条)

()委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、直物為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。

()直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。

()直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

()委託者は、直物為替先渡取引を行なうにあたり、担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

(19) 資金の借入れ(約款第37条)

()委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

()一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。

()収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

()借入金の利息は信託財産中より支弁します。

(20) 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。(運用の基本方針 2 運用方法 (3)投資制限)

(21) 同一の法人の発行する株式への投資制限(投資信託及び投資法人に関する法律第9条)

同一の法人の発行する株式について、次の()の数が()の数を超えることとなる場合には、当該株式を信託財産で取得することを受託会社に指図しないものとします。

()委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数

()当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

ファンドの基準価額は、投資を行なっている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資者の皆様に帰属します。

したがって、ファンドにおいて、投資者の皆様の投資元金は保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被り、投資元金が割り込むことがあります。なお、投資信託は預貯金と異なります。

[株価変動リスク]

ファンドは実質的に株式に投資を行ないますので、株価変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の株価変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。

[REITの価格変動リスク]

REITは、保有不動産の状況、市場金利の変動、不動産市況や株式市場の動向等により、価格が変動します。ファンドは実質的にREITに投資を行ないますので、これらの影響を受けます。

[債券価格変動リスク]

債券（公社債等）は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行ないますので、これらの影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の債券価格の変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。

[為替変動リスク]

ファンドは、為替変動リスクの低減を図る目的（ヘッジ目的）のほか、効率的に収益を追求する目的（ヘッジ目的外）で為替予約取引等を活用しますので、為替変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

資金動向、市況動向等によっては、また、不慮の出来事等が起きた場合には、投資方針に沿った運用ができない場合があります。

ファンドが実質的に組み入れる有価証券の発行体において、利払いや償還金の支払いが滞る可能性があります。

有価証券への投資等ファンドにかかる取引にあたっては、取引の相手方の倒産等により契約が不履行になる可能性があります。

投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の一部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。

分配金は、預貯金の利息とは異なりファンドの純資産から支払われますので、分配金支払い後の純資産はその相当額が減少することとなり、基準価額が下落する要因となります。計算期間中に運用収益があった場合においても、当該運用収益を超えて分配を行なった場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べて下落することになります。

各マザーファンド（「野村マネー マザーファンド」を除く）が対象とするインデックスの著作権等について

国内株式マザーファンドについて

「東証株価指数（TOPIX）」

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額とTOPIXの指数値の動向が乖離することがあります。

本ファンドは、(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ありません。

(株)東京証券取引所は、本ファンドの購入者又は公衆に対し、本ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

(株)東京証券取引所は、野村アセットマネジメント株式会社又は本ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

国内債券マザーファンドについて

「NOMURA-BPI国債指数」

「NOMURA-BPI国債指数」は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドについて

新興国株式マザーファンドについて

「MSCI-KOKUSA I 指数」

「MSCI エマージング・マーケット・インデックス」

本ファンドは、MSCI Inc. (MSCI)、MSCI の関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI 指数は、MSCI が独占的に所有しています。MSCI 及びMSCI 指数は、MSCI 及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的の為にその使用を許諾されています。MSCI、MSCI の関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI 指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI 指数は、本ファンドまたは本ファンドの発行会社あるいは所有者に関わらず、MSCI により決定、作成、及び計算されています。MSCI、MSCI の関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI 指数の決定、作成、あるいは計算において、本ファンドの発行者または所有者の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI、MSCI の関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、本ファンドを現金に償還する方程式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしておりません。MSCI、MSCI の関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCI は、自らが信頼できると考える情報源から本件指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI、MSCI の関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性及び/または完全性について保証するものではありません。MSCI、MSCI の関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、本件ファンドの発行会社、本件ファンドの所有者その他の個人・法人が、本契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連して本件指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証をおこなうものではありません。MSCI、MSCI の関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数及びそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。本件指数及びそれに含まれるデータに関し、MSCI、MSCI の関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI、MSCI の関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害（逸失利益を含む。）につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI、MSCI の関連会社及びMSCI 指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

本証券の購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI に問い合わせることなく、本証券を保証、推奨、売買、又は宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、又はサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI の書面による許諾を得ることなくMSCI との関係は一切主張することはできません。

「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 LLC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 LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

新興国債券マザーファンドについて

新興国債券(現地通貨建て)マザーファンドについて

「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス」

「JP 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・ディバーシファイド」

本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品(インデックスのレベルも含みますが、これに限られません。)(以下、「本インデックス」といいます。)に関する情報(以下、「当情報」といいます。)は、情報の提供のみを目的として作成したものであり、金融商品の募集・勧誘若しくはその一部を構成し、又は本インデックスが参照する取引又は商品の価値若しくは価格を公式に確認するものではありません。当情報は、いかなる投資戦略の採用を推奨するものでもなく、法令、税務又は会計上の助言を行うものではありません。当情報に含まれる市場価格、データその他の情報は、信頼できると思われるものですが、その完全性及び正確性を保証するものではありません。当情報の内容については、今後予告なく変更されることがあります。当情報に含まれる実績は過去のものであって将来の運用成果を示すものではなく、将来の運用成績は変化します。JPモルガン、その関係会社又はそれらの従業員は、本インデックスの発行体のデータに係る金融商品について自己のポジション(ロング若しくはショート)を有し、取引を行い、又はそのマーケット・メイカーとして行為している可能性があるほか、かかる発行体の引受人、販売代理人、アドバイザー又は貸主となっている可能性があります。

ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・エルエルシー(以下、「JPMSL」又は「インデックス・スポンサー」といいます。)は、本インデックスにおいて参照する証券、金融関連商品又は取引(以下「該当商品」といいます。)を、賛助し、支持し、又はその他の方法で勧誘するものではありません。インデックス・スポンサーは、証券や金融関連商品一般に投資すること若しくは個別の該当商品に投資することの有用性について、又は金融市場における投資機会を追跡記録し、若しくは目的を達成するための本インデックスの有用性について、明示黙示を問わず、何らの表明又は保証をするものではありません。インデックス・スポンサーは、該当商品の管理、マーケティング又は取引に関連して、何らの責任又は義務を負いません。本インデックスは、信頼できると思われる情報に基づいて作成されたものですが、インデックス・スポンサーは、その完全性及び正確性並びに本インデックスに関連して提供されるその他の情報に責任を負うものではありません。

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。

JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド(英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員)及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。

当情報の著作権は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・アンド・カンパニーに帰属します。

J-REITインデックスマザーファンドについて

「東証REIT指数」

東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有します。

(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができるものとします。

(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の商標の使用もしくは東証REIT指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。

(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また(株)東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

本ファンドは、東証REIT指数の指数値に連動した投資成果を目標として運用しますが、本ファンドの基準価額と東証REIT指数の指数値の動向が乖離することがあります。

本ファンドは、(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ありません。

(株)東京証券取引所は、本ファンドの購入者又は公衆に対し、本ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。

(株)東京証券取引所は、野村アセットマネジメント株式会社又は本ファンドの購入者のニーズを、東証REIT指数の指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は本ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

海外REITインデックスマザーファンドについて

「S&P先進国REIT指数」

本ファンドは、スタンダード&プアーズ及びその関連会社（以下、S&P）により、何ら支援、推奨、販売または販促されるものではありません。

S&Pは、ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、証券への全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいはS&P先進国REIT指数（除く日本）の一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックする能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。

S&Pは、被許諾者とは、S&PおよびS&P先進国REIT指数（除く日本）の特定のトレードマークとトレードネームのライセンス使用を与えているのみの関係であり、S&P先進国REIT指数（除く日本）は、被許諾者あるいは本ファンドに関係なくS&Pにより決定、作成、および計算されています。

S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）の決定、作成、および計算において、被許諾者あるいは本ファンドの所有者の要求を考慮に入れる義務を一切負いません。

S&Pは、本ファンドの発行価格および発行数量の決定、あるいは本ファンドの発行または販売のタイミングや本ファンドを換金する際の方程式の決定または計算について、責任を負うものではなく、参加もしておりません。

S&Pは、本ファンドの管理、マーケティングまたは売買に関連するいかなる義務または責任も負いません。

S&Pは、S&P先進国REIT指数（除く日本）またはそこに含まれるデータの正確性および/または完全性について保証するものではなく、それに関連する過誤、省略または中断に対して責任を負うことはありません。

S&Pは、被許諾者、ファンドの所有者またはその他のいかなる個人・法人がS&P先進国REIT指数（除く日本）またはそこに含まれるデータを使用することによって得られる結果について、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の保証を行いません。

S&Pは、明示的あるいは黙示的保証を行なうものではなく、かつ、S&P先進国REIT指数（除く日本）またはそこに含まれるデータに関連して、特定の目的あるいは使用のための市場性または適切性について何ら保証を行なうものではないことを明記します。

前記事項を制限することなく、S&Pは、たとえ特別の損害、懲罰的損害、間接的損害あるいは結果的損害（逸失利益を含む）につき、その可能性について通知を受けていたとしても、かかる損害について責任を負いません。

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

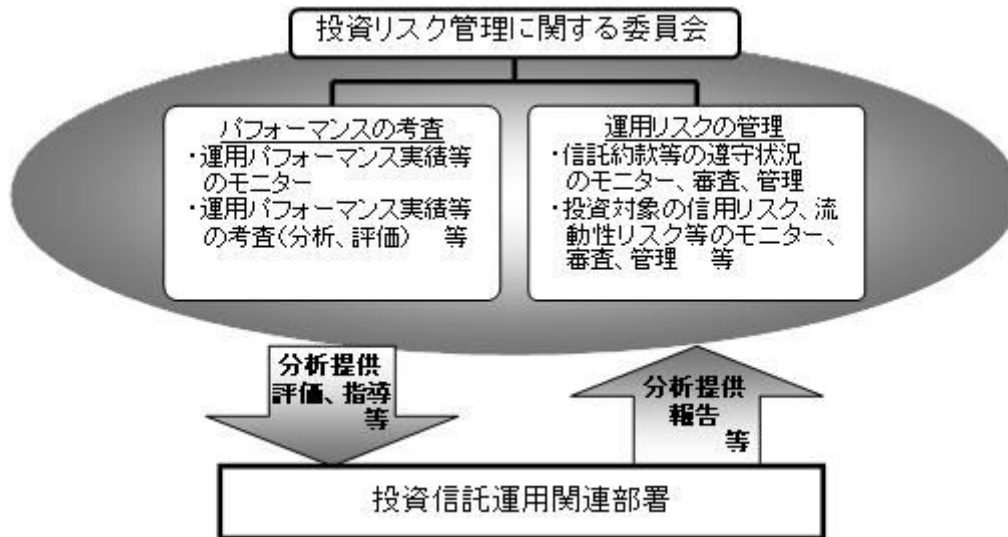
パフォーマンスの考査

投資信託の信託財産についてパフォーマンスに基づいた定期的な考査（分析、評価）の結果の報告、審議を行いません。

運用リスクの管理

投資信託の信託財産の運用リスクを把握、管理し、その結果に基づき運用部門その他関連部署への是正勧告を行なうことにより、適切な管理を行いません。

リスク管理体制図

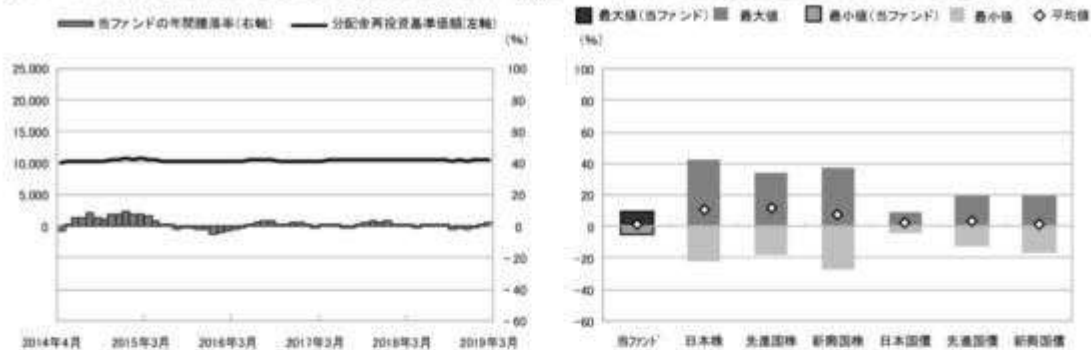


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

リスクの定量的比較

(2014年4月末～2019年3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(%)	9.2	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値(%)	△ 4.9	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値(%)	1.3	10.5	12.0	7.9	2.0	3.2	1.4

- ＊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4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4月から2019年3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4月から2019年3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(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、東京証券取引所に有しています。なお、本商品は、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、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、知的財産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 LLC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 LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLC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格や値段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を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示唆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、または買主になっている可能性もあります。米国のJ.P. Morgan Securities LLC(ここでは「JPMSLLC」と呼びます)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)についての開示、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、或いは伝達または承認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。JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPMS, 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 LLC 他)

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

(2) 【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年0.864%^{*}（税抜年0.80%）以内（2019年5月9日現在年0.864%^{*}（税抜年0.80%））の率（「信託報酬率」といいます。）を乗じて得た額とします。

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、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および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。

信託報酬率の配分は下記の通り（税抜）とします。

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
年0.40%	年0.35%	年0.05%

上記配分は、2019年5月9日現在の信託報酬率における配分です。

* 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、年0.88%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	口座内でのファンドの管理および事務手続き、購入後の情報提供、各種書類の送付等	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

(4) 【その他の手数料等】

ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息はファンドから支払われます。

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用および受託者の立替えた立替金の利息および信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用（債権回収に要する弁護士費用等を含む。）等は、受益者の負担とし、ファンドから支払われます。

監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用および当該監査費用に係る消費税等に相当する金額は、信託報酬支払いのときに信託財産から支払われます。

ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用はファンドから支払われます。

これらの費用等の中には、運用状況等により変動するものがあり、事前に料率、上限額等を表示することができないものがあります。

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは以下の通りです。

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(所得税及び復興特別所得税)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。

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。

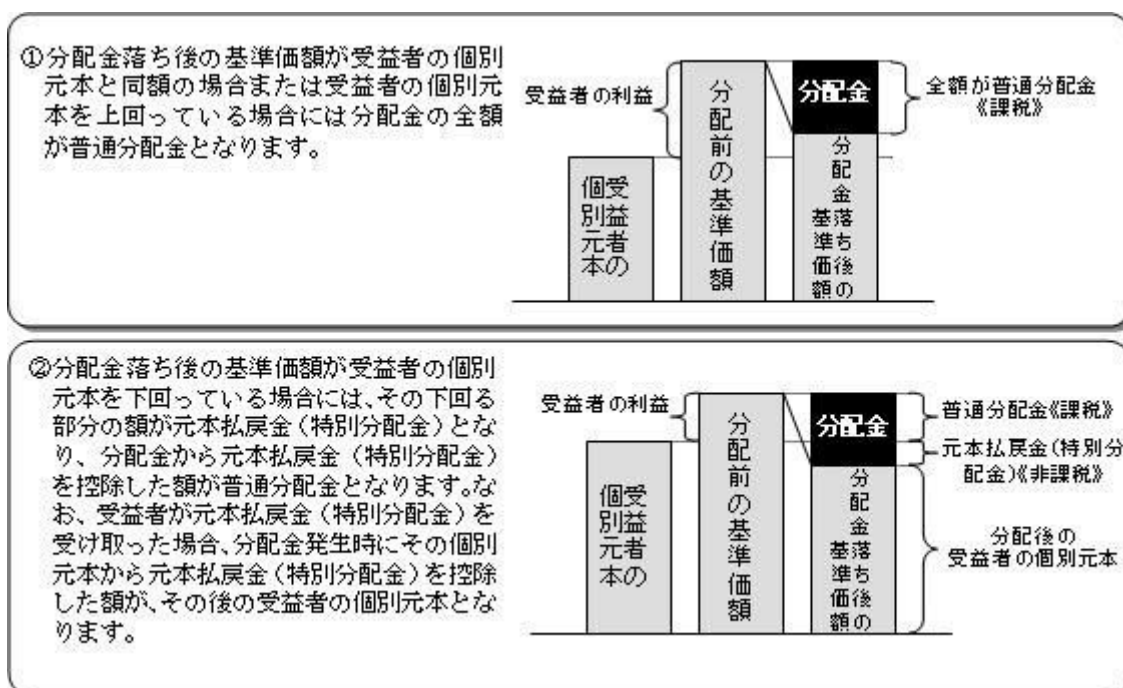
換金(解約)時および償還時の課税について

換金(解約)時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

詳しくは販売会社に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3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3月29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DC運用戦略ファンド

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	18,863,031,221	82.77
現金・預金・その他資産(負債控除後)		3,924,631,289	17.22
合計(純資産総額)		22,787,662,510	100.00

(参考)国内株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	386,153,910,365	97.00
現金・預金・その他資産(負債控除後)		11,906,026,800	2.99
合計(純資産総額)		398,059,937,165	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	日本	11,892,240,000	2.98

(参考)国内債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	28,986,174,570	99.65
現金・預金・その他資産(負債控除後)		99,104,082	0.34
合計(純資産総額)		29,085,278,652	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	364,936,191,076	64.99
	カナダ	20,759,923,975	3.69
	ドイツ	17,509,243,560	3.11
	イタリア	4,833,784,474	0.86
	フランス	22,097,989,248	3.93
	オランダ	6,814,732,110	1.21
	スペイン	6,137,824,660	1.09
	ベルギー	2,058,081,212	0.36
	オーストリア	484,986,317	0.08
	ルクセンブルグ	196,414,928	0.03
	フィンランド	2,112,229,689	0.37
	アイルランド	1,108,713,543	0.19
	ポルトガル	325,661,996	0.05
	イギリス	34,778,243,842	6.19
	スイス	18,294,301,941	3.25
	スウェーデン	5,475,048,254	0.97
	ノルウェー	1,502,636,466	0.26
	デンマーク	3,677,830,996	0.65
	オーストラリア	13,201,543,883	2.35
	ニュージーランド	498,947,475	0.08
香港	7,339,720,693	1.30	
シンガポール	2,467,378,535	0.43	
イスラエル	579,425,991	0.10	
小計		537,190,854,864	95.66
投資証券	アメリカ	11,880,467,149	2.11
	カナダ	118,720,624	0.02
	フランス	683,386,108	0.12
	イギリス	431,388,569	0.07
	オーストラリア	1,126,636,746	0.20
	香港	413,657,216	0.07
	シンガポール	271,198,488	0.04
小計		14,925,454,900	2.65
現金・預金・その他資産（負債控除後）		9,400,366,072	1.67
合計（純資産総額）		561,516,675,836	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	6,387,296,913	1.13

買建	カナダ	349,762,228	0.06
買建	ドイツ	1,094,024,179	0.19
買建	イギリス	602,283,162	0.10
買建	スイス	308,704,280	0.05
買建	オーストラリア	218,273,184	0.03

(参考) 外国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	285,273,596,398	46.05
	カナダ	12,302,233,350	1.98
	メキシコ	4,892,810,657	0.78
	ドイツ	36,497,491,363	5.89
	イタリア	54,782,323,565	8.84
	フランス	58,998,767,499	9.52
	オランダ	10,367,504,472	1.67
	スペイン	41,218,222,863	6.65
	ベルギー	14,685,663,900	2.37
	オーストリア	8,687,037,687	1.40
	フィンランド	3,286,626,698	0.53
	アイルランド	5,968,085,793	0.96
	イギリス	42,553,885,265	6.87
	スウェーデン	2,225,624,643	0.35
	ノルウェー	1,421,536,390	0.22
	デンマーク	3,196,631,327	0.51
	ポーランド	3,816,639,430	0.61
	オーストラリア	12,953,424,882	2.09
	シンガポール	2,487,463,264	0.40
	マレーシア	2,862,067,246	0.46
南アフリカ	3,362,863,518	0.54	
	小計	611,840,500,210	98.77
現金・預金・その他資産(負債控除後)		7,558,704,628	1.22
合計(純資産総額)		619,399,204,838	100.00

(参考) 新興国株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	4,923,580,857	13.18
	メキシコ	938,948,746	2.51
	ブラジル	2,614,353,872	6.99

	チリ	188,660,204	0.50
	コロンビア	90,521,473	0.24
	ギリシャ	80,195,679	0.21
	イギリス	12,445,083	0.03
	トルコ	198,589,419	0.53
	チェコ	58,164,767	0.15
	ハンガリー	115,880,876	0.31
	ポーランド	417,450,841	1.11
	香港	8,576,609,755	22.96
	マレーシア	804,642,087	2.15
	タイ	858,215,341	2.29
	フィリピン	401,632,750	1.07
	インドネシア	798,670,664	2.13
	韓国	4,766,179,683	12.76
	台湾	4,105,639,497	10.99
	インド	3,299,433,102	8.83
	パキスタン	13,068,206	0.03
	カタール	332,781,998	0.89
	エジプト	44,152,192	0.11
	南アフリカ	2,024,291,683	5.41
	アラブ首長国連邦	238,836,072	0.63
	小計	35,902,944,847	96.12
投資信託受益証券	アメリカ	296,210,112	0.79
投資証券	メキシコ	31,825,502	0.08
	南アフリカ	88,362,776	0.23
	小計	120,188,278	0.32
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,030,010,368	2.75
合計（純資産総額）		37,349,353,605	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	993,945,416	2.66

（参考）新興国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	18,791,063,508	97.99
現金・預金・その他資産（負債控除後）		383,812,531	2.00
合計（純資産総額）		19,174,876,039	100.00

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アルゼンチン	36,436,909	0.43
	メキシコ	829,011,171	9.90
	ブラジル	816,272,577	9.75
	チリ	274,228,993	3.27
	コロンビア	579,642,578	6.92
	ペルー	270,088,281	3.22
	ウルグアイ	11,550,000	0.13
	トルコ	313,680,278	3.74
	チェコ	350,107,795	4.18
	ハンガリー	378,694,503	4.52
	ポーランド	758,925,915	9.06
	ロシア	608,789,570	7.27
	ルーマニア	218,162,815	2.60
	マレーシア	491,138,998	5.86
	タイ	707,622,984	8.45
	フィリピン	21,005,670	0.25
	インドネシア	807,899,011	9.65
南アフリカ	657,197,177	7.85	
	小計	8,130,455,225	97.14
現金・預金・その他資産（負債控除後）		239,148,006	2.85
合計（純資産総額）		8,369,603,231	100.00

（参考）J-REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	38,932,254,620	96.86
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,259,564,539	3.13
合計（純資産総額）		40,191,819,159	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（％）
REIT指数先物取引	買建	日本	904,869,000	2.25

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	18,865,201,354	72.20
	カナダ	491,271,578	1.88
	ドイツ	72,854,148	0.27
	イタリア	8,083,944	0.03
	フランス	1,061,807,946	4.06
	オランダ	78,883,101	0.30
	スペイン	174,387,301	0.66
	ベルギー	227,482,519	0.87
	アイルランド	61,065,789	0.23
	イギリス	1,365,025,395	5.22
	オーストラリア	1,792,295,796	6.86
	ニュージーランド	116,131,032	0.44
	香港	650,112,093	2.48
	シンガポール	916,177,458	3.50
	イスラエル	16,599,357	0.06
	小計	25,897,378,811	99.12
現金・預金・その他資産（負債控除後）		228,334,895	0.87
合計（純資産総額）		26,125,713,706	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	145,128,297	0.55

（参考）野村マネー マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
地方債証券	日本	430,908,674	3.81
特殊債券	日本	1,770,827,754	15.67
社債券	日本	5,044,315,657	44.66
コマーシャルペーパー	日本	499,994,056	4.42
現金・預金・その他資産（負債控除後）		3,548,801,701	31.41
合計（純資産総額）		11,294,847,842	100.00

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

野村DC運用戦略ファンド

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	外国債券マザーファンド	3,494,296,787	2.2444	7,842,770,571	2.2878	7,994,252,189	35.08
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券マザーファンド	3,317,993,652	1.3660	4,532,491,228	1.3754	4,563,568,468	20.02
3	日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,146,222,774	2.1908	2,511,243,291	2.2957	2,631,383,622	11.54
4	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	484,677,428	1.8533	898,267,532	1.8803	911,338,967	3.99
5	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	565,674,716	1.5885	898,587,885	1.5856	896,933,829	3.93
6	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックス マザーファンド	364,115,520	2.3719	863,656,609	2.4497	891,973,789	3.91
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券（現地通貨建て）マ ザーファンド	405,893,810	1.3281	539,106,223	1.3184	535,130,399	2.34
8	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	129,881,261	2.6516	344,393,151	2.7065	351,523,632	1.54
9	日本	親投資信託 受益証券	野村マネー マザーファンド	85,180,134	1.0206	86,934,844	1.0205	86,926,326	0.38

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	82.77
合計	82.77

(参考)国内株式マザーファンド

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	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,886,400	7,490.67	14,130,405,897	6,487.00	12,237,076,800	3.07
2	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	694,200	8,389.30	5,823,855,136	10,745.00	7,459,179,000	1.87
3	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,477,900	4,542.62	6,713,545,104	4,521.00	6,681,585,900	1.67
4	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	11,493,400	708.92	8,147,901,128	550.00	6,321,370,000	1.58
5	日本	株式	キーエンス	電気機器	83,100	66,590.81	5,533,697,126	68,970.00	5,731,407,000	1.43
6	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,136,100	5,196.51	5,903,762,610	4,703.00	5,343,078,300	1.34
7	日本	株式	ソニー	電気機器	1,135,700	5,201.30	5,907,120,458	4,645.00	5,275,326,500	1.32
8	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	1,176,800	4,462.39	5,251,344,974	3,876.00	4,561,276,800	1.14
9	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,428,000	3,507.41	5,008,588,380	2,995.00	4,276,860,000	1.07
10	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	151,600	21,445.61	3,251,155,918	25,710.00	3,897,636,000	0.97

11	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	22,687,400	196.82	4,465,378,266	171.30	3,886,351,620	0.97
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,158,800	2,800.02	3,244,673,740	3,161.00	3,662,966,800	0.92
13	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,170,000	3,176.98	3,717,075,664	3,074.00	3,596,580,000	0.90
14	日本	株式	花王	化学	411,000	7,708.25	3,168,091,129	8,718.00	3,583,098,000	0.90
15	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,463,800	2,868.86	4,199,441,668	2,385.00	3,491,163,000	0.87
16	日本	株式	任天堂	その他製品	104,200	44,122.96	4,597,612,779	31,560.00	3,288,552,000	0.82
17	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	605,200	5,259.57	3,183,095,581	5,362.00	3,245,082,400	0.81
18	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	301,000	10,621.47	3,197,062,711	10,680.00	3,214,680,000	0.80
19	日本	株式	ファナック	電気機器	160,900	22,665.64	3,646,902,666	18,880.00	3,037,792,000	0.76
20	日本	株式	ダイキン工業	機械	231,100	13,093.83	3,025,985,502	12,970.00	2,997,367,000	0.75
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	532,800	4,945.64	2,635,041,607	5,512.00	2,936,793,600	0.73
22	日本	株式	キヤノン	電気機器	911,300	3,730.24	3,399,368,437	3,213.00	2,928,006,900	0.73
23	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	698,800	4,762.09	3,327,750,209	4,176.00	2,918,188,800	0.73
24	日本	株式	日本電産	電気機器	203,700	16,660.93	3,393,833,393	14,025.00	2,856,892,500	0.71
25	日本	株式	日立製作所	電気機器	762,100	4,222.05	3,217,628,122	3,585.00	2,732,128,500	0.68
26	日本	株式	信越化学工業	化学	292,200	11,082.49	3,238,305,932	9,280.00	2,711,616,000	0.68
27	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	981,100	2,979.01	2,922,710,638	2,745.00	2,693,119,500	0.67
28	日本	株式	資生堂	化学	336,400	7,317.14	2,461,489,018	7,987.00	2,686,826,800	0.67
29	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,560,800	1,661.00	2,592,492,625	1,658.50	2,588,586,800	0.65
30	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	1,051,700	2,779.68	2,923,389,456	2,451.50	2,578,242,550	0.64

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	国内	水産・農林業	0.12
		鉱業	0.27
		建設業	2.90
		食料品	4.23
		繊維製品	0.61
		パルプ・紙	0.29
		化学	7.16
		医薬品	5.73
		石油・石炭製品	0.59
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.87
		鉄鋼	0.94
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.54
		機械	4.78
		電気機器	12.60
輸送用機器	7.54		
精密機器	1.99		

	その他製品	1.98
	電気・ガス業	1.88
	陸運業	4.80
	海運業	0.14
	空運業	0.58
	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	8.04
	卸売業	4.81
	小売業	4.62
	銀行業	5.89
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	2.12
	その他金融業	1.10
	不動産業	2.44
	サービス業	4.85
合 計		97.00

(参考) 国内債券マザーファンド

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)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	580,000,000	100.65	583,791,100	100.64	583,746,800	0.1	2021/6/20	2.00
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	500,000,000	100.59	502,959,000	100.48	502,415,000	0.1	2020/12/20	1.72
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	470,000,000	103.12	484,704,800	103.65	487,173,800	0.4	2025/3/20	1.67
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	440,000,000	103.13	453,810,200	103.84	456,909,200	0.4	2025/6/20	1.57
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 4回	440,000,000	100.96	444,224,400	101.16	445,112,800	0.1	2022/12/20	1.53
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	430,000,000	101.37	435,925,800	102.19	439,421,300	0.1	2026/3/20	1.51
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	410,000,000	103.52	424,464,700	103.90	425,990,000	0.5	2024/9/20	1.46
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	420,000,000	100.79	423,342,000	100.88	423,696,000	0.1	2022/3/20	1.45
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	400,000,000	102.65	410,625,200	103.47	413,904,000	0.3	2025/12/20	1.42
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	380,000,000	100.51	381,950,000	100.41	381,569,400	0.1	2020/9/20	1.31
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	350,000,000	104.54	365,904,700	104.27	364,969,500	0.8	2023/6/20	1.25

12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	350,000,000	103.83	363,427,900	103.83	363,429,500	0.6	2023/12/20	1.24
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	350,000,000	101.21	354,265,500	102.31	358,099,000	0.1	2026/9/20	1.23
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	350,000,000	101.48	355,186,000	102.27	357,952,000	0.1	2026/6/20	1.23
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	335,000,000	103.32	346,125,800	104.00	348,403,350	0.4	2025/9/20	1.19
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第39 6回	340,000,000	100.51	341,752,700	100.49	341,672,800	0.1	2021/1/1	1.17
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	330,000,000	103.84	342,678,600	103.49	341,533,500	0.8	2022/9/20	1.17
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	330,000,000	100.79	332,626,800	102.38	337,877,100	0.1	2027/3/20	1.16
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 2回	320,000,000	100.91	322,929,800	100.97	323,110,400	0.1	2022/6/20	1.11
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	320,000,000	100.64	322,054,500	100.72	322,304,000	0.1	2021/9/20	1.10
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	320,000,000	100.47	321,520,000	100.34	321,094,400	0.1	2020/6/20	1.10
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 5回	290,000,000	101.13	293,291,100	101.24	293,596,000	0.1	2023/3/20	1.00
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 36回	270,000,000	103.80	280,284,000	104.08	281,016,000	0.5	2024/12/20	0.96
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	260,000,000	101.26	263,281,300	102.37	266,182,800	0.1	2027/6/20	0.91
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	260,000,000	101.57	264,097,600	102.35	266,115,200	0.1	2026/12/20	0.91
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 13回	210,000,000	122.19	256,614,900	122.69	257,661,600	2.1	2029/9/20	0.88
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	250,000,000	101.35	253,379,100	102.00	255,022,500	0.1	2028/9/20	0.87
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 26回	240,000,000	103.70	248,892,000	103.39	248,140,800	0.7	2022/12/20	0.85
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 49回	240,000,000	101.00	242,400,000	102.29	245,517,600	0.1	2027/12/20	0.84
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 27回	230,000,000	104.09	239,411,200	103.76	238,664,100	0.8	2022/12/20	0.82

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.65
合計	99.65

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAI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	648,800	18,952.65	12,296,480,877	20,946.03	13,589,786,081	2.42
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	997,000	10,334.27	10,303,276,063	12,978.06	12,939,126,518	2.30
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	56,820	164,613.70	9,353,350,922	196,831.88	11,183,987,751	1.99
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	328,300	17,682.92	5,805,304,868	18,374.39	6,032,313,714	1.07
5	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	366,500	14,309.94	5,244,593,267	15,414.29	5,649,337,725	1.00
6	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	42,990	115,384.09	4,960,362,205	129,690.70	5,575,403,412	0.99
7	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	40,850	116,112.18	4,743,182,900	130,110.24	5,315,003,602	0.94
8	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	578,400	8,335.34	4,821,165,862	8,961.33	5,183,234,776	0.92
9	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	454,400	12,147.85	5,519,985,539	11,177.80	5,079,193,638	0.90
10	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	418,400	8,505.98	3,558,903,204	10,615.75	4,441,630,637	0.79
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	240,400	13,539.67	3,254,936,692	17,166.82	4,126,904,321	0.73
12	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	176,800	22,225.74	3,929,512,158	22,271.25	3,937,557,601	0.70
13	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	340,300	8,909.16	3,031,789,632	11,493.01	3,911,072,834	0.69
14	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,273,500	3,288.63	4,188,075,016	3,033.35	3,862,979,757	0.68
15	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	792,400	4,040.03	3,201,324,526	4,693.76	3,719,341,050	0.66
16	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	564,300	5,412.98	3,054,545,912	6,557.28	3,700,278,296	0.65
17	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・ 半導体製 造装置	625,600	5,708.21	3,571,059,742	5,894.67	3,687,711,120	0.65
18	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	616,300	4,786.99	2,950,227,298	5,922.42	3,649,991,390	0.65
19	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	261,900	12,695.03	3,324,829,981	13,653.98	3,575,979,929	0.63
20	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	131,380	24,436.66	3,210,489,482	26,885.10	3,532,165,450	0.62
21	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気 通信サー ビス	993,800	3,814.72	3,791,074,997	3,441.79	3,420,460,741	0.60
22	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	612,900	5,809.21	3,560,468,854	5,448.49	3,339,385,098	0.59
23	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術 サービス	125,900	19,746.23	2,486,050,470	26,067.11	3,281,849,325	0.58
24	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	356,400	6,290.91	2,242,081,465	9,171.10	3,268,581,359	0.58

25	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	154,800	19,871.64	3,076,131,358	21,094.75	3,265,468,755	0.58
26	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	296,000	8,701.12	2,575,533,089	10,633.59	3,147,543,706	0.56
27	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	73,950	36,610.05	2,707,313,309	41,559.09	3,073,295,120	0.54
28	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	245,928	10,800.43	2,656,129,846	12,287.70	3,021,890,199	0.53
29	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	95,900	24,722.88	2,370,924,393	30,258.23	2,901,765,072	0.51
30	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	552,000	4,869.13	2,687,760,477	5,169.91	2,853,792,638	0.50

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	3.16
		メディア	1.25
		娯楽	1.33
		不動産管理・開発	0.60
		エネルギー設備・サービス	0.37
		石油・ガス・消耗燃料	6.02
		化学	2.28
		建設資材	0.27
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.46
		紙製品・林産品	0.08
		航空宇宙・防衛	2.24
		建設関連製品	0.39
		建設・土木	0.33
		電気設備	0.71
		コングロマリット	1.40
		機械	1.52
		商社・流通業	0.28
		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	0.09
		海運業	0.05
		陸運・鉄道	1.07
		運送インフラ	0.21
		自動車部品	0.32
		自動車	0.82
家庭用耐久財	0.37		
レジャー用品	0.05		
繊維・アパレル・贅沢品	1.43		
ホテル・レストラン・レジャー	1.83		
販売	0.07		
インターネット販売・通信販売	2.47		

複合小売り	0.48
専門小売り	1.67
食品・生活必需品小売り	1.47
飲料	1.96
食品	1.95
タバコ	1.01
家庭用品	1.33
パーソナル用品	0.73
ヘルスケア機器・用品	2.60
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.91
バイオテクノロジー	1.84
医薬品	5.71
銀行	7.81
各種金融サービス	0.96
保険	3.78
情報技術サービス	3.89
ソフトウェア	4.97
通信機器	0.97
コンピュータ・周辺機器	2.72
電子装置・機器・部品	0.47
半導体・半導体製造装置	2.91
各種電気通信サービス	2.11
無線通信サービス	0.29
電力	1.97
ガス	0.17
総合公益事業	1.09
水道	0.08
消費者金融	0.47
資本市場	2.67
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	0.75
専門サービス	0.71
投資証券	2.65
合計	98.32

(参考) 外国債券マザーファンド

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)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
----	------	----	-----	----	-----------------	-----------------	-----------------	-----------------	-----------	------	-----------------

1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,660.07	7,494,033,844	11,073.85	7,784,918,656	2.25	2025/11/15	1.25
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,699.69	7,521,888,246	10,953.32	7,700,187,914	1.75	2022/4/30	1.24
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	57,900,000	11,284.59	6,533,783,038	11,238.17	6,506,900,639	3.5	2020/5/15	1.05
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,600,000	11,099.00	5,838,074,000	11,156.22	5,868,176,277	2.625	2020/11/15	0.94
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	40,400,000	13,324.88	5,383,253,954	13,820.85	5,583,625,620	5.25	2028/11/15	0.90
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,300,000	10,534.06	5,193,292,024	10,902.16	5,374,767,786	1.75	2023/5/15	0.86
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	39,200,000	13,437.59	5,267,536,733	13,709.86	5,374,267,274	6	2026/2/15	0.86
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,200,000	11,381.61	5,372,123,112	11,377.34	5,370,105,345	3.625	2021/2/15	0.86
9	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,405.62	5,253,319,246	15,638.50	5,332,731,228	3.5	2026/4/25	0.86
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	47,100,000	10,752.58	5,064,469,471	11,177.90	5,264,793,783	2.375	2024/8/15	0.84
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	10,584.22	5,069,845,815	10,915.17	5,228,367,777	1.75	2023/1/31	0.84
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,900,000	10,472.48	4,911,595,133	10,941.18	5,131,416,018	2	2025/2/15	0.82
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	18,571.88	5,014,407,996	18,982.94	5,125,394,880	5.5	2029/4/25	0.82
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,000,000	10,677.43	4,911,620,336	11,035.70	5,076,422,084	2.125	2024/9/30	0.81
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	35,600,000	13,397.97	4,769,678,003	13,876.35	4,939,980,776	5.25	2029/2/15	0.79
16	イギリス	国債証券	UK TREASURY	24,000,000	19,282.53	4,627,809,589	20,476.97	4,914,474,048	3.5	2045/1/22	0.79
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,800,000	9,808.94	4,590,588,251	10,492.02	4,910,266,969	2.5	2045/2/15	0.79
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,239.09	4,787,853,452	11,303.20	4,815,164,837	3.125	2021/5/15	0.77
19	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	22,900,000	18,516.64	4,240,311,539	19,544.75	4,475,748,620	3.25	2044/1/22	0.72
20	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,300,000	15,271.05	4,474,419,408	15,099.16	4,424,054,818	4.25	2023/10/25	0.71
21	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	30,400,000	14,905.85	4,531,380,448	14,338.10	4,358,782,887	5.5	2022/11/1	0.70
22	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,600,000	20,293.85	4,180,534,362	20,977.44	4,321,354,400	5.75	2032/10/25	0.69
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	10,810.25	3,988,982,895	11,534.28	4,256,152,402	3	2044/11/15	0.68
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,700,000	10,830.35	4,083,043,967	10,950.72	4,128,422,955	1.375	2020/8/31	0.66
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,200,000	10,980.20	3,974,834,276	11,070.38	4,007,479,210	2.125	2020/8/31	0.64
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,000,000	10,872.25	3,805,287,765	11,326.18	3,964,163,735	2.625	2025/3/31	0.64
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	28,300,000	13,585.47	3,844,689,036	14,003.81	3,963,079,886	5.5	2028/8/15	0.63
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,300,000	11,020.63	3,890,283,523	11,071.25	3,908,152,132	2.125	2021/1/31	0.63
29	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	21,200,000	17,072.38	3,619,344,904	18,333.91	3,886,789,274	3.25	2045/5/25	0.62

30	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000	17,225.46	3,858,504,686	17,130.59	3,837,254,351	5.9	2026/7/30	0.61
----	------	------	--------------------------	------------	-----------	---------------	-----------	---------------	-----	-----------	------

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.77
合計	98.77

(参考)新興国株式マザーファンド

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	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	356,500	5,459.39	1,946,273,711	5,005.56	1,784,482,140	4.77
2	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	81,060	20,828.09	1,688,325,639	19,726.25	1,599,010,044	4.28
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	1,537,000	825.06	1,268,123,278	868.78	1,335,314,860	3.57
4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	298,820	4,902.62	1,465,001,482	4,395.30	1,313,403,546	3.51
5	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	27,510	22,664.64	623,504,396	25,110.32	690,785,013	1.84
6	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,036,000	111.65	673,944,690	96.43	582,080,453	1.55
7	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信サービス	383,500	1,043.60	400,221,190	1,135.44	435,442,007	1.16
8	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	325,500	1,083.17	352,574,848	1,212.50	394,670,378	1.05
9	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	179,500	1,608.97	288,810,855	2,189.60	393,033,200	1.05
10	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,374,000	93.27	408,001,159	82.01	358,720,488	0.96
11	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	103,000	3,057.78	314,951,357	3,130.56	322,448,144	0.86
12	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラクティブ・メディアおよびサービス	17,440	27,833.61	485,418,197	18,214.56	317,662,082	0.85
13	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガス・消耗燃料	30,750	7,708.81	237,045,915	9,997.97	307,437,860	0.82
14	アメリカ	投資信託受益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF		96,000	2,945.80	282,796,970	3,085.52	296,210,112	0.79
15	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	299,291	901.52	269,817,381	969.12	290,049,493	0.77
16	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	195,921	1,440.50	282,224,301	1,401.10	274,506,089	0.73
17	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	36,810	8,038.72	295,905,422	7,085.40	260,813,574	0.69
18	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	216,500	967.64	209,495,283	1,187.85	257,171,257	0.68

19	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PREF	銀行	212,513	952.10	202,334,849	1,199.89	254,992,734	0.68
20	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,923,000	57.60	283,591,143	50.76	249,904,280	0.66
21	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	673,400	389.65	262,391,791	367.39	247,402,816	0.66
22	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガス・消耗燃料	1,109,000	190.74	211,530,842	202.48	224,555,643	0.60
23	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	817,649	351.50	287,406,854	257.76	210,758,841	0.56
24	ブラジル	株式	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	石油・ガス・消耗燃料	244,000	706.78	172,454,889	797.46	194,581,509	0.52
25	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	52,280	3,906.30	204,221,763	3,577.00	187,005,560	0.50
26	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	57,200	2,854.89	163,300,222	3,220.48	184,211,628	0.49
27	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信サービス	2,142,000	94.08	201,521,442	78.61	168,394,615	0.45
28	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	331,700	508.44	168,651,194	502.56	166,700,054	0.44
29	ブラジル	株式	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	石油・ガス・消耗燃料	185,700	779.00	144,660,995	879.88	163,394,310	0.43
30	カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	28,320	4,799.64	135,925,806	5,512.46	156,113,150	0.41

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	6.50
		メディア	2.19
		娯楽	0.76
		不動産管理・開発	2.58
		エネルギー設備・サービス	0.08
		石油・ガス・消耗燃料	7.87
		化学	2.28
		建設資材	1.07
		容器・包装	0.05
		金属・鉱業	3.25
		紙製品・林産品	0.38
		航空宇宙・防衛	0.14
		建設関連製品	0.02
		建設・土木	0.73
		電気設備	0.17
		コングロマリット	1.41
		機械	0.67
		商社・流通業	0.04
		商業サービス・用品	0.14
		航空貨物・物流サービス	0.16
旅客航空輸送業	0.26		

海運業	0.08
陸運・鉄道	0.28
運送インフラ	0.91
自動車部品	0.54
自動車	1.75
家庭用耐久財	0.35
レジャー用品	0.08
繊維・アパレル・贅沢品	0.78
ホテル・レストラン・レジャー	0.73
インターネット販売・通信販売	5.33
複合小売り	0.57
専門小売り	0.37
食品・生活必需品小売り	1.58
飲料	1.07
食品	1.63
タバコ	0.62
家庭用品	0.43
パーソナル用品	0.70
ヘルスケア機器・用品	0.08
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.41
バイオテクノロジー	0.46
医薬品	1.21
銀行	16.30
各種金融サービス	0.88
保険	3.72
情報技術サービス	1.84
ソフトウェア	0.08
通信機器	0.06
コンピュータ・周辺機器	4.91
電子装置・機器・部品	2.07
半導体・半導体製造装置	5.19
各種電気通信サービス	1.49
無線通信サービス	2.84
電力	0.96
ガス	0.64
総合公益事業	0.06
水道	0.25
貯蓄・抵当・不動産金融	0.96
消費者金融	0.24
資本市場	1.23
各種消費者サービス	0.54
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.49

		ヘルスケア・テクノロジー	0.07
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.24
		専門サービス	0.02
投資信託受益証券			0.79
投資証券			0.32
合 計			97.24

(参考) 新興国債券マザーファンド

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)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	3,200,000	10,258.50	328,272,193	11,223.37	359,148,013	5.25	2047/6/23	1.87
2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	3,500,000	10,642.35	372,482,440	9,343.97	327,038,972	7.5	2026/4/22	1.70
3	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,110,000	12,013.04	253,475,354	12,687.71	267,710,699	6.05	2040/1/11	1.39
4	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,300,000	10,925.27	251,281,360	11,313.54	260,211,504	4.15	2027/3/28	1.35
5	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,200,000	10,785.95	237,291,071	11,601.78	255,239,263	5	2045/6/15	1.33
6	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	2,400,000	11,159.58	267,829,968	10,136.71	243,281,200	6.875	2021/4/22	1.26
7	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,000,000	11,400.29	228,005,869	11,657.50	233,150,034	4.875	2023/9/16	1.21
8	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,000,000	10,762.42	215,248,456	11,288.79	225,775,858	4.25	2025/1/7	1.17
9	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,930,000	11,431.48	220,627,586	11,454.16	221,065,442	4.875	2021/1/22	1.15
10	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,900,000	11,123.38	211,344,383	11,454.16	217,629,192	4	2024/2/26	1.13
11	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	2,250,000	10,539.98	237,149,559	9,511.84	214,016,468	5.625	2022/1/26	1.11
12	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	10,551.55	200,479,571	11,196.11	212,726,208	4.625	2028/1/13	1.10
13	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000	10,563.62	221,836,157	10,031.99	210,671,950	6	2027/3/25	1.09
14	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,800,000	10,400.32	187,205,923	11,292.65	203,267,797	3.7	2042/2/2	1.06
15	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,800,000	10,177.88	183,201,870	10,977.02	197,586,396	4.75	2044/3/8	1.03
16	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000	9,092.25	209,121,809	8,442.17	194,170,069	5.875	2028/1/11	1.01
17	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,650,000	11,114.84	183,394,882	11,446.12	188,861,001	4	2023/10/2	0.98
18	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000	9,968.11	179,425,991	10,330.02	185,940,504	4.3	2028/10/12	0.96
19	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000	11,211.45	190,594,803	10,847.30	184,404,236	6.25	2022/9/26	0.96
20	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000	11,086.61	177,385,861	11,459.02	183,344,470	4.75	2026/5/27	0.95
21	アメリカ	国債証券	RUSSIA	1,452,500	12,291.03	178,527,248	12,402.95	180,152,920	7.5	2030/3/31	0.93
22	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000	8,383.40	184,434,969	8,119.70	178,633,544	4.875	2043/4/16	0.93
23	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000	10,687.26	170,996,300	11,105.89	177,694,280	4.25	2027/6/23	0.92

24	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	2,100,000	9,674.62	203,167,195	8,456.05	177,577,063	7.125	2036/7/6	0.92
25	アメリカ	国債証券	COLOMBIA GLOBAL	1,220,000	13,831.44	168,743,647	14,553.56	177,553,478	7.375	2037/9/18	0.92
26	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF HUNGARY	1,500,000	11,894.13	178,411,985	11,830.81	177,462,188	6.375	2021/3/29	0.92
27	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,500,000	10,946.42	164,196,386	11,565.15	173,477,370	3.875	2028/3/17	0.90
28	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000	10,107.72	161,723,529	10,778.62	172,458,038	4.6	2048/2/10	0.89
29	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,200,000	12,845.24	154,142,913	14,212.26	170,547,234	5.625	2050/11/18	0.88
30	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	1,900,000	10,315.06	195,986,142	8,913.88	169,363,803	6.875	2027/1/26	0.88

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.99
合計	97.99

(参考)新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

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)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	10,340,000,000	4.31	445,945,872	4.32	446,934,345	9.85	2027/6/28	5.33
2	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	6,900,000	2,605.72	179,794,766	2,593.65	178,962,383		2020/7/1	2.13
3	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	490,000	3,062.91	150,094,771	3,079.15	150,878,663	10	2023/1/1	1.80
4	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,740,000	3,149.83	149,301,976	3,143.45	148,999,767	4	2023/10/25	1.78
5	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	6,200,000	2,306.00	142,972,512	2,277.69	141,217,194		2022/1/1	1.68
6	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	451,000	3,078.45	138,844,946	3,083.76	139,077,646	10	2025/1/1	1.66
7	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	456,000	3,024.37	137,919,765	3,038.54	138,557,576	10	2021/1/1	1.65
8	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	3,640,000,000	3.64	132,659,396	3.64	132,708,233	7.75	2021/4/14	1.58
9	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,230,000	3,073.81	130,022,370	3,064.17	129,614,741	5.25	2020/10/25	1.54
10	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	21,150,000	544.17	115,093,668	557.86	117,987,673	7.5	2027/6/3	1.40
11	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	21,100,000	546.13	115,234,536	552.82	116,646,005	6.5	2022/6/9	1.39
12	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	17,000,000	676.76	115,049,396	683.19	116,143,591	8.75	2048/2/28	1.38
13	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	67,000,000	169.52	113,584,698	169.97	113,882,580	7.6	2022/7/20	1.36
14	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,500,000	828.95	111,909,390	836.28	112,898,526	10.5	2026/12/21	1.34
15	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	24,100,000	457.30	110,210,699	455.58	109,797,130	0.45	2023/10/25	1.31
16	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	23,900,000	458.79	109,651,971	457.55	109,355,432	1	2026/6/26	1.30
17	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000	2,859.19	108,649,597	2,859.98	108,679,240	2.5	2027/7/25	1.29

18	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	59,000,000	168.10	99,179,914	168.87	99,638,964	7.75	2026/9/16	1.19
19	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	12,500,000,000	0.68	85,608,900	0.70	88,391,550	6.125	2028/5/15	1.05
20	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	11,000,000,000	0.77	85,507,422	0.79	87,178,806	8.25	2036/5/15	1.04
21	チリ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS	490,000,000	17.57	86,139,670	17.63	86,425,967	5	2035/3/1	1.03
22	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	22,500,000	370.28	83,314,687	376.50	84,713,971	3.4	2036/6/17	1.01
23	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,580,000	3,206.44	82,726,299	3,195.71	82,449,395	5.75	2021/10/25	0.98
24	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000	371.25	80,562,372	371.80	80,682,742	3.625	2023/6/16	0.96
25	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,000,000	348.30	80,109,316	349.26	80,330,066	1.875	2022/6/17	0.95
26	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	13,500,000	568.73	76,779,478	578.25	78,064,345	8	2023/12/7	0.93
27	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	48,000,000	160.52	77,052,942	161.22	77,389,128	6.5	2024/2/28	0.92
28	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000	2,724.52	76,286,623	2,733.81	76,546,885	3.62	2021/11/30	0.91
29	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,230,000,000	0.79	73,392,123	0.81	75,546,184	8.375	2024/3/15	0.90
30	ハンガリー	国債証券	HUNGARY GOVERNMENT BOND	182,000,000	39.69	72,238,038	40.66	74,017,263	3	2027/10/27	0.88

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.14
合計	97.14

(参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

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	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,988	630,268	2,513,510,020	750,000	2,991,000,000	7.44
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,119	575,443	2,370,253,259	653,000	2,689,707,000	6.69
3	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,814	153,432	1,966,087,514	163,200	2,091,244,800	5.20
4	日本	投資証券	日本リートファンド投資法人 投資証券	7,784	203,327	1,582,702,505	222,700	1,733,496,800	4.31
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,084	171,340	1,556,460,372	174,900	1,588,791,600	3.95
6	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	8,206	174,202	1,429,509,161	190,100	1,559,960,600	3.88
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,526	260,112	1,437,384,382	245,700	1,357,738,200	3.37
8	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,524	230,240	1,271,850,013	235,800	1,302,559,200	3.24
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	4,014	286,166	1,148,672,933	308,500	1,238,319,000	3.08
10	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	10,206	118,091	1,205,246,849	118,700	1,211,452,200	3.01

11	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,607	410,173	1,069,321,740	456,000	1,188,792,000	2.95
12	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,257	81,153	1,075,846,514	89,300	1,183,850,100	2.94
13	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,164	477,909	1,034,196,266	460,000	995,440,000	2.47
14	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,274	682,355	869,320,664	769,000	979,706,000	2.43
15	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	10,626	70,910	753,492,847	83,700	889,396,200	2.21
16	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	14,209	49,486	703,160,072	54,200	770,127,800	1.91
17	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,369	496,999	680,392,753	562,000	769,378,000	1.91
18	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	951	649,039	617,236,402	788,000	749,388,000	1.86
19	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,723	139,009	656,542,529	148,800	702,782,400	1.74
20	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,401	448,417	628,233,267	464,500	650,764,500	1.61
21	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,691	222,178	597,881,401	234,900	632,115,900	1.57
22	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,329	167,410	557,310,353	188,800	628,515,200	1.56
23	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	4,798	119,247	572,149,600	123,700	593,512,600	1.47
24	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,688	144,820	534,097,856	160,900	593,399,200	1.47
25	日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,329	331,632	440,739,127	427,000	567,483,000	1.41
26	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,228	123,214	520,949,257	130,600	552,176,800	1.37
27	日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	3,916	109,753	429,793,022	139,600	546,673,600	1.36
28	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,708	266,987	456,015,094	303,500	518,378,000	1.28
29	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,944	160,082	471,282,880	172,200	506,956,800	1.26
30	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,761	150,270	414,897,761	179,300	495,047,300	1.23

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.86
合計	96.86

(参考) 海外REITインデックス マザーファンド

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	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	59,760	18,596.64	1,111,335,334	20,351.12	1,216,183,314	4.65
2	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	121,390	7,271.09	882,637,941	8,004.59	971,678,248	3.71
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	28,950	23,867.06	690,951,508	24,306.81	703,682,150	2.69
4	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	74,500	6,713.87	500,183,430	8,721.59	649,758,768	2.48
5	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	71,260	7,213.27	514,017,787	8,394.17	598,168,818	2.28
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,740	18,905.76	505,540,282	22,300.11	596,304,963	2.28
7	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	39,930	12,221.65	488,010,721	13,278.84	530,224,225	2.02

8	香港	投資証券	LINK REIT	407,100	1,045.93	425,800,464	1,290.98	525,558,772	2.01
9	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	69,000	6,167.34	425,546,759	7,242.09	499,704,728	1.91
10	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26,470	23,206.74	614,282,545	18,168.32	480,915,473	1.84
11	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	58,580	6,143.25	359,872,167	8,198.83	480,287,538	1.83
12	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	29,720	13,611.39	404,530,758	14,828.26	440,696,006	1.68
13	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,720	26,848.20	341,509,193	32,205.96	409,659,917	1.56
14	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,730	14,062.27	305,573,256	15,897.09	345,443,933	1.32
15	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,027,000	324.65	333,415,888	323.99	332,744,714	1.27
16	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	309,500	759.49	235,064,653	1,058.49	327,604,017	1.25
17	アメリカ	投資証券	HCP INC	92,100	2,776.94	255,756,921	3,517.27	323,940,853	1.23
18	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	143,200	2,382.30	341,146,633	2,105.48	301,504,779	1.15
19	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	24,430	10,738.61	262,344,477	11,405.33	278,632,271	1.06
20	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	31,100	7,491.80	232,995,158	8,692.73	270,344,114	1.03
21	アメリカ	投資証券	UDR INC	53,200	4,218.53	224,425,998	5,050.04	268,662,394	1.02
22	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,980	10,767.71	236,674,343	12,166.72	267,424,589	1.02
23	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	33,420	7,903.01	264,118,796	7,494.04	250,450,977	0.95
24	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	32,700	6,744.71	220,552,225	7,552.86	246,978,833	0.94
25	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	69,200	3,164.81	219,005,357	3,421.82	236,790,062	0.90
26	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,320	10,313.19	178,624,465	12,777.16	221,300,564	0.84
27	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,280	13,501.43	192,800,507	15,399.86	219,910,036	0.84
28	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	16,670	10,854.82	180,949,882	13,165.63	219,471,115	0.84
29	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	55,400	3,821.50	211,711,649	3,954.57	219,083,383	0.83
30	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	18,630	10,147.56	189,049,211	11,285.46	210,248,179	0.80

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.12
合計	99.12

(参考)野村マネー マザーファンド

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)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	日本	社債券	デンソー 第9回社債間限定同順位特約付	600,000,000	100.04	600,268,380	100.04	600,268,380	0.203	2019/6/20	5.31
2	日本	社債券	三菱電機 第4回社債間限定同順位特約付	500,000,000	100.05	500,257,964	100.05	500,257,964	0.27	2019/6/5	4.42
3	日本	社債券	みずほ銀行 第3回特定社債間限定同順位特約付	500,000,000	100.02	500,133,172	100.02	500,133,172	0.3	2019/4/26	4.42
4	日本	社債券	三井住友銀行 第5回社債間限定同順位特約付	500,000,000	100.02	500,106,316	100.02	500,106,316	0.254	2019/4/19	4.42
5	日本	社債券	三菱東京UFJ銀行 第154回特定社債間限定同順位特約付	500,000,000	100.01	500,083,052	100.01	500,083,052	0.255	2019/4/22	4.42

6	日本	社債券	九州電力 第408回	400,000,000	100.39	401,582,688	100.39	401,582,688	1.672	2019/6/25	3.55
7	日本	社債券	トヨタ自動車 第10回社債間限定同等特約付	300,000,000	100.37	301,133,580	100.37	301,133,580	1.772	2019/6/20	2.66
8	日本	社債券	三菱地所 第108回担保提供制限等財務上特約無	300,000,000	100.10	300,309,795	100.10	300,309,795	0.631	2019/5/31	2.65
9	日本	社債券	三菱UFJリース 第29回社債間限定同順位特約付	300,000,000	100.05	300,170,272	100.05	300,170,272	0.304	2019/6/12	2.65
10	日本	特殊債券	東日本高速道路 第49回	300,000,000	100.00	300,003,000	100.00	300,003,000	0.001	2019/6/20	2.65
11	日本	特殊債券	地方公営企業等金融機構債券 第3回	250,000,000	100.12	250,311,120	100.12	250,311,120	1.65	2019/4/26	2.21
12	日本	地方債証券	千葉市 公募平成21年度第1回	200,000,000	100.11	200,234,820	100.11	200,234,820	1.59	2019/4/26	1.77
13	日本	特殊債券	農林債券 利付第767回い号	200,000,000	100.02	200,053,523	100.02	200,053,523	0.3	2019/4/26	1.77
14	日本	社債券	三井住友信託銀行 第7回社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.01	200,034,000	100.01	200,034,000	0.269	2019/4/26	1.77
15	日本	社債券	東京センチュリーリース 第15回社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.00	200,015,320	100.00	200,015,320	0.11	2019/4/12	1.77
16	日本	特殊債券	商工債券 利付(3年)第195回	200,000,000	100.00	200,008,000	100.00	200,008,000	0.03	2019/4/26	1.77
17	日本	社債券	トヨタファイナンス 第69回社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.00	200,000,000	100.00	200,000,000	0.02	2019/4/26	1.77
18	日本	社債券	トヨタファイナンス 第71回社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.00	200,000,000	100.00	200,000,000	0.001	2019/6/14	1.77
19	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,998,487		199,998,487			1.77
20	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,996,317		199,996,317			1.77
21	日本	地方債証券	愛知県 公募平成21年度第3回	100,000,000	100.39	100,394,250	100.39	100,394,250	1.66	2019/6/26	0.88
22	日本	地方債証券	北海道 公募平成21年度第2回	100,000,000	100.27	100,274,156	100.27	100,274,156	1.66	2019/5/29	0.88
23	日本	特殊債券	日本政策投資銀行社債 財投機関債第26回	100,000,000	100.12	100,126,580	100.12	100,126,580	0.573	2019/6/20	0.88
24	日本	社債券	関西電力 第473回	100,000,000	100.11	100,112,520	100.11	100,112,520	1.665	2019/4/25	0.88
25	日本	社債券	三井住友信託銀行 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100.07	100,073,174	100.07	100,073,174	0.234	2019/7/22	0.88
26	日本	特殊債券	東日本高速道路 第26回	100,000,000	100.06	100,069,250	100.06	100,069,250	0.305	2019/6/20	0.88
27	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第295回	100,000,000	100.05	100,059,674	100.05	100,059,674	0.25	2019/6/27	0.88
28	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第294回	100,000,000	100.03	100,038,400	100.03	100,038,400	0.25	2019/5/27	0.88

29	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第293回	100,000,000	100.02	100,024,248	100.02	100,024,248	0.25	2019/4/26	0.88
30	日本	社債券	中国電力 第390回	100,000,000	100.02	100,023,660	100.02	100,023,660	0.14	2019/5/24	0.88

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
地方債証券	3.81
特殊債券	15.67
社債券	44.66
コマーシャルペーパー	4.42
合 計	68.58

【投資不動産物件】

野村DC運用戦略ファンド

該当事項はありません。

(参考)国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

(参考)外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)J-REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

(参考)海外REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）野村マネー 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DC運用戦略ファンド

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

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	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2019年06月限)	買建	747	日本円	11,934,525,642	11,892,240,000	2.98

（参考）国内債券マザーファンド

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06月限)	買建	408	米ドル	57,336,135	6,363,737,624	57,548,400	6,387,296,913	1.13
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2019年06 月限)	買建	22	カナダド ル	4,213,700	348,220,168	4,232,360	349,762,228	0.06
	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06月 限)	買建	271	ユーロ	8,818,140	1,098,387,518	8,783,110	1,094,024,179	0.19
	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06月限)	買建	18	豪ドル	2,771,100	217,919,304	2,775,600	218,273,184	0.03
	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06月限)	買建	58	英ポンド	4,126,400	598,245,474	4,154,250	602,283,162	0.10
	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06月限)	買建	30	スイスフ ラン	2,768,970	308,767,844	2,768,400	308,704,280	0.05

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

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	インターコンチネンタル取引所	E-mini MSCIエマージングマーケット株価指数先物(2019年06月限)	買建	171	米ドル	9,009,435	999,957,190	8,955,270	993,945,416	2.66

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - R E I Tインデックス 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	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
REIT指数先物取引	大阪取引所	REIT指数先物(2019年06月限)	買建	477	日本円	878,550,786	904,869,000	2.25

（参考）海外R E I Tインデックス 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	シカゴボード オブトレード	ダウ・ジョーンズ米国不動産指数先物(2019年06月限)	買建	38	米ドル	1,277,230	141,759,753	1,307,580	145,128,297	0.55
----------	------	---------------	------------------------------	----	----	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

(参考) 野村マネー マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

野村DC運用戦略ファンド

2019年3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1計算期間	(2013年 2月18日)	49	49	1.0455	1.0460
第2計算期間	(2014年 2月17日)	1,930	1,931	1.0180	1.0185
第3計算期間	(2015年 2月17日)	2,707	2,708	1.0970	1.0975
第4計算期間	(2016年 2月17日)	3,631	3,633	1.0481	1.0486
第5計算期間	(2017年 2月17日)	6,788	6,791	1.0678	1.0683
第6計算期間	(2018年 2月19日)	19,147	19,156	1.0770	1.0775
第7計算期間	(2019年 2月18日)	21,964	21,974	1.0850	1.0855
	2018年 3月末日	19,583		1.0792	
	4月末日	19,672		1.0807	
	5月末日	20,050		1.0768	
	6月末日	20,296		1.0804	
	7月末日	20,582		1.0838	
	8月末日	20,684		1.0818	
	9月末日	21,026		1.0883	
	10月末日	20,920		1.0696	
	11月末日	21,301		1.0777	
	12月末日	21,431		1.0701	
	2019年 1月末日	21,959		1.0835	
	2月末日	22,246		1.0865	
	3月末日	22,787		1.0996	

【分配の推移】

野村DC運用戦略ファンド

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2012年 2月28日～2013年 2月18日	0.0005円
第2計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月17日	0.0005円
第3計算期間	2014年 2月18日～2015年 2月17日	0.0005円
第4計算期間	2015年 2月18日～2016年 2月17日	0.0005円
第5計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	0.0005円
第6計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	0.0005円
第7計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.0005円

【収益率の推移】

野村DC運用戦略ファンド

	計算期間	収益率
第1計算期間	2012年 2月28日～2013年 2月18日	4.6%
第2計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月17日	2.6%
第3計算期間	2014年 2月18日～2015年 2月17日	7.8%
第4計算期間	2015年 2月18日～2016年 2月17日	4.4%
第5計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	1.9%
第6計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	0.9%
第7計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	0.8%

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DC運用戦略ファンド

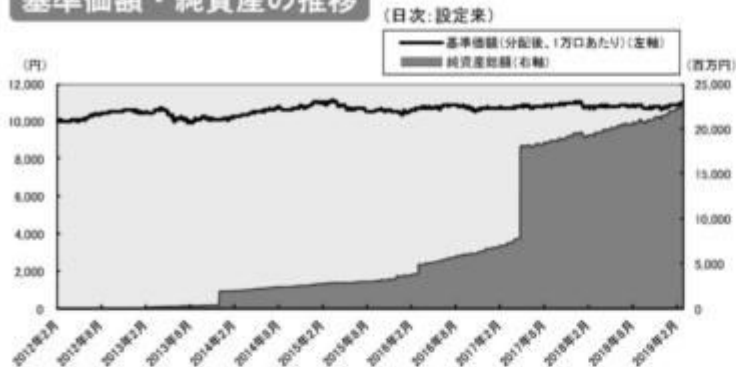
	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2012年 2月28日～2013年 2月18日	47,323,294		47,323,294
第2計算期間	2013年 2月19日～2014年 2月17日	2,003,508,647	154,192,604	1,896,639,337
第3計算期間	2014年 2月18日～2015年 2月17日	999,136,243	427,656,828	2,468,118,752
第4計算期間	2015年 2月18日～2016年 2月17日	1,637,926,200	641,423,568	3,464,621,384
第5計算期間	2016年 2月18日～2017年 2月17日	3,774,359,201	881,664,759	6,357,315,826
第6計算期間	2017年 2月18日～2018年 2月19日	14,660,535,474	3,240,163,547	17,777,687,753
第7計算期間	2018年 2月20日～2019年 2月18日	4,903,455,488	2,438,304,551	20,242,838,690

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

運用実績 (2019年3月29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2月	5円
2018年2月	5円
2017年2月	5円
2016年2月	5円
2015年2月	5円
設定来累計	35円

主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

銘柄	投資比率 (%)
国内株式マザーファンド	3.9
国内債券マザーファンド	20.0
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1.5
外国債券マザーファンド	35.1
新興国株式マザーファンド	—
新興国債券マザーファンド	4.0
新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	2.3
J-REITインデックス マザーファンド	11.5
海外REITインデックス マザーファンド	3.9
野村マネー マザーファンド	0.4

実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.1
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.1
3	武田薬品工業	医薬品	0.1
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.1
5	キーエンス	電気機器	0.1

・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	国庫債券 利付(5年)第128回	国債証券	0.4
2	国庫債券 利付(5年)第126回	国債証券	0.3
3	国庫債券 利付(10年)第338回	国債証券	0.3
4	国庫債券 利付(10年)第339回	国債証券	0.3
5	国庫債券 利付(5年)第134回	国債証券	0.3

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.0
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.0
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.0
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.0
5	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	0.0

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.4
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.4
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.4
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.3
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.3

・「新興国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.1
2	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.1
3	UNITED MEXICAN STATES	国債証券	0.1
4	UNITED MEXICAN STATES	国債証券	0.1
5	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1

・「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1
2	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.0
3	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.0
4	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.0
5	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.0

・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.9
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.8
3	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.6
4	日本リテールファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.5
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	投資証券	0.5

・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

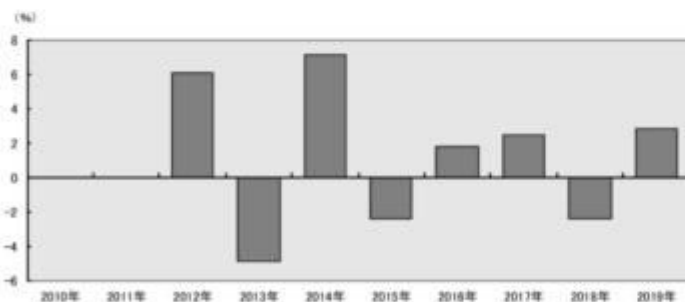
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.2
2	PROLOGIS INC	投資証券	0.1
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.1
4	WELLTOWER INC	投資証券	0.1
5	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	0.1

・「野村マネー マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	デンソー 第9回社債間限定同順位特約付	社債券	0.0
2	三菱電機 第44回社債間限定同順位特約付	社債券	0.0
3	みずほ銀行 第36回特定社債間限定同順位特約付	社債券	0.0
4	三井住友銀行 第59回社債間限定同順位特約付	社債券	0.0
5	三菱東京UFJ銀行 第154回特定社債間限定同順位特約付	社債券	0.0

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。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2012年は設定日(2012年2月28日)から年末までの収益率。
- ・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】

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。

取得申込みの受付については、午後3時までに取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。

ファンドの申込(販売)手続き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。

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（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）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の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付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この信託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せん。

2【換金（解約）手続等】

受益者は、委託者に1口単位で一部解約の実行を請求することができます。

受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。

一部解約の実行の請求の受付については、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込み分とします。

換金価額は、解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額となります。

当ファンドは、買取りは行いません。

ファンドの基準価額について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/>

信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口解約には制限を設ける場合があります。

解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

ただし、金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）により、有価証券の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、信託約款の規定に従い、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして信託約款の規定に準じて計算された価額とします。

換金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。

換金の請求を行なう受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託者が行なうのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行なうものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行なわれます。

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

<基準価額の計算方法>

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) 価格情報会社の提供する価額
REIT (不動産投資信託)	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行いません。

1 外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日とします。

2 残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法(アキュムレーションまたはアモチゼーション)による評価を適用することができます。

ファンドの基準価額について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/>

(2) 【保管】

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、受益証券を発行しませんので、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

無期限とします(2012年2月28日設定)。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年2月18日から翌年2月17日までとします。

また、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日のとき、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。なお、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

(5) 【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が30億口を下回った場合、またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(b) 信託期間の終了

- () 委託者は、上記「(a)ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- () 上記()の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- () 上記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- () 上記()から()までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記()から()までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。
- () 委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- () 委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d)信託約款の変更等()」の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(c) 運用報告書

ファンドの決算時および償還時に交付運用報告書を作成し、知っている受益者に対して交付します。

(d) 信託約款の変更等

- () 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- () 委託者は、上記()の事項（上記()の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- () 上記()の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しない

ときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- () 上記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- () 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- () 上記()から()までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- () 上記()から()の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

委託者が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行ない、次のアドレスに掲載します。

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

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

- () 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、上記「(d)信託約款の変更等」に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行なう場合を除き、受託者を解任することはできないものとします。
- () 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

この信託は、受益者が一部解約の実行の請求を行なったときは、委託者が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託契約の解約または重大な約款の変更等を行なう場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所
2. 他の受益者が有する受益権の内容

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

委託者と販売会社との間で締結する「募集・販売等に関する契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から別段の意思表示のないときは、原則1年毎に自動的に更新されるものとします。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

収益分配金は、原則、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として、）に、原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

換金(解約)の単位

受益者は、受益権を1口単位で換金できます。

換金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。

換金(解約)代金の支払い開始日

一部解約金は、受益者の解約申込みの受付日から起算して、原則として、6営業日目から受益者にお支払いします。

ただし、金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、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（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）により、有価証券の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、信託約款の規定に従い、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

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7期計算期間(2018年2月20日から2019年2月18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DC運用戦略ファンド】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第6期 (2018年 2月19日現在)	第7期 (2019年 2月18日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	4,061,018,977	4,627,196,142
親投資信託受益証券	14,687,221,169	17,424,665,781
派生商品評価勘定	256,666,031	71,766,230
未収入金	267,064,346	-
流動資産合計	19,271,970,523	22,123,628,153
資産合計		
	19,271,970,523	22,123,628,153
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	-	37,610,692
未払金	557,599	-
未払収益分配金	8,888,843	10,121,419
未払解約金	31,601,306	18,742,895
未払受託者報酬	5,201,814	5,774,671
未払委託者報酬	78,027,249	86,619,955
未払利息	5,086	7,954
その他未払費用	312,047	346,426
流動負債合計	124,593,944	159,224,012
負債合計		
	124,593,944	159,224,012
純資産の部		
元本等		
元本	17,777,687,753	20,242,838,690
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,369,688,826	1,721,565,451
(分配準備積立金)	403,386,048	623,893,515
元本等合計	19,147,376,579	21,964,404,141
純資産合計		
	19,147,376,579	21,964,404,141
負債純資産合計		
	19,271,970,523	22,123,628,153

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第6期		第7期	
	自 2017年 2月18日	至 2018年 2月19日	自 2018年 2月20日	至 2019年 2月18日
営業収益				
有価証券売買等損益		276,938,925		450,194,612
為替差損益		70,150,195		100,270,235
営業収益合計		206,788,730		349,924,377
営業費用				
支払利息		987,753		2,808,483
受託者報酬		8,509,489		11,035,066
委託者報酬		127,642,294		165,525,820
その他費用		521,240		672,792
営業費用合計		137,660,776		180,042,161
営業利益又は営業損失（ ）		69,127,954		169,882,216
経常利益又は経常損失（ ）		69,127,954		169,882,216
当期純利益又は当期純損失（ ）		69,127,954		169,882,216
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（ ）		31,650,346		2,716,444
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		431,026,584		1,369,688,826
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,146,667,135		383,249,176
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,146,667,135		383,249,176
剰余金減少額又は欠損金増加額		236,593,658		188,416,904
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		236,593,658		188,416,904
分配金		8,888,843		10,121,419
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,369,688,826		1,721,565,451

（ 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。 為替予約取引 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。
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。 為替差損益 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。 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。
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 2月20日から2019年 2月18日までとなっております。

（ 貸借対照表に関する注記 ）

第6期 2018年 2月19日現在	第7期 2019年 2月18日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 17,777,687,753口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 20,242,838,690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 1.0770円 (10,000口当たり純資産額) (10,770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 1.0850円 (10,000口当たり純資産額) (10,850円)

（ 損益及び剰余金計算書に関する注記 ）

第6期 自 2017年 2月18日 至 2018年 2月19日	第7期 自 2018年 2月20日 至 2019年 2月18日																																										
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																										
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>254,454,771円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,132,247,863円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>157,820,120円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>2,544,522,754円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>17,777,687,753口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	254,454,771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	2,132,247,863円	分配準備積立金額	D	157,820,120円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,544,522,754円	当ファンドの期末残存口数	F	17,777,687,753口	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>279,469,201円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填 後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,540,695,781円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>354,545,733円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>3,174,710,715円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>20,242,838,690口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	279,469,201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	2,540,695,781円	分配準備積立金額	D	354,545,733円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,174,710,715円	当ファンドの期末残存口数	F	20,242,838,690口
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	254,454,771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	2,132,247,863円																																									
分配準備積立金額	D	157,820,120円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,544,522,754円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	17,777,687,753口																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	279,469,201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	2,540,695,781円																																									
分配準備積立金額	D	354,545,733円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,174,710,715円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	20,242,838,690口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,431円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,568円
10,000口当たり分配金額	H	5円	10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	8,888,843円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	10,121,419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6期 自 2017年 2月18日 至 2018年 2月19日	第7期 自 2018年 2月20日 至 2019年 2月18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、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>当ファンドは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、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が、主要投資対象である親投資信託受益証券の保有状況によっては、市場リスクの内容は変動する場合があります。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <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</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</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>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第6期 2018年 2月19日現在	第7期 2019年 2月18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 ん。</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>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係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6期 自 2017年 2月18日 至 2018年 2月19日	第7期 自 2018年 2月20日 至 2019年 2月18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6期 自 2017年 2月18日 至 2018年 2月19日	第7期 自 2018年 2月20日 至 2019年 2月18日
期首元本額 6,357,315,826円	期首元本額 17,777,687,753円
期中追加設定元本額 14,660,535,474円	期中追加設定元本額 4,903,455,488円
期中一部解約元本額 3,240,163,547円	期中一部解約元本額 2,438,304,551円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第6期 自 2017年 2月18日 至 2018年 2月19日	第7期 自 2018年 2月20日 至 2019年 2月18日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	171,106,064	422,497,159

合計	171,106,064	422,497,159
----	-------------	-------------

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第6期(2018年 2月19日現在)				第7期(2019年 2月18日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	8,812,981,031	-	8,556,315,000	256,666,031	8,770,095,538	-	8,735,940,000	34,155,538
米ドル	4,862,108,324	-	4,680,639,000	181,469,324	4,445,556,075	-	4,466,350,000	20,793,925
カナダドル	218,846,175	-	212,075,000	6,771,175	210,972,800	-	208,650,000	2,322,800
ユーロ	2,869,121,782	-	2,813,941,000	55,180,782	3,297,335,465	-	3,248,648,000	48,687,465
英ポンド	604,455,560	-	597,000,000	7,455,560	597,694,818	-	599,046,000	1,351,182
豪ドル	258,449,190	-	252,660,000	5,789,190	218,536,380	-	213,246,000	5,290,380
合計	8,812,981,031	-	8,556,315,000	256,666,031	8,770,095,538	-	8,735,940,000	34,155,538

(注) 時価の算定方法

1 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。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年2月18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2月18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	国内株式マザーファンド	287,304,166	453,452,165	
		国内債券マザーファンド	2,900,279,104	3,961,491,228	
		外国債券マザーファンド	3,749,578,651	8,414,054,492	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	129,881,261	344,393,151	
		野村マネー マザーファンド	85,180,134	86,934,844	
		J-REITインデックス マザーファンド	1,052,188,949	2,299,243,291	
		海外REITインデックス マザーファンド	376,812,065	893,722,855	
		新興国債券マザーファンド	330,522,079	611,267,532	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	271,552,842	360,106,223	
	小計	銘柄数：9 組入時価比率：79.3%	9,183,299,251	17,424,665,781 100.0%	
合計			17,424,665,781		

(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

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

（参考）

当ファンドは、当該計算期間末現在、主要投資対象である親投資信託受益証券のうち、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」および「野村マネー マザーファンド」受益証券に投資しており、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。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2019年 2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	27,207,768,670
株式	387,375,566,700
派生商品評価勘定	242,402,186
未収配当金	606,118,078
未収利息	968,205
その他未収収益	22,320,542
差入委託証拠金	159,496,000

流動資産合計	415,614,640,381
資産合計	415,614,640,381
負債の部	
流動負債	
未払解約金	402,740,320
未払利息	46,774
有価証券貸借取引受入金	18,996,764,061
流動負債合計	19,399,551,155
負債合計	19,399,551,155
純資産の部	
元本等	
元本	251,040,771,991
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	145,174,317,235
元本等合計	396,215,089,226
純資産合計	396,215,089,226
負債純資産合計	415,614,640,381

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	株式 原則として時価で評価しております。 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。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 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。 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。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 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。 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。

(貸借対照表に関する注記)

2019年 2月18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	1.5783円

(10,000口当たり純資産額)	(15,783円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	
	18,224,880,440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 2月20日 至 2019年 2月18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>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <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っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>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っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>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っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>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っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 2月18日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>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。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>（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>派生商品評価勘定</p> <p>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。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>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>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 2月18日現在		2018年 2月20日
期首		2018年 2月20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		209,906,785,574円
同期中における追加設定元本額		62,891,339,579円
同期中における一部解約元本額		21,757,353,162円
期末元本額		251,040,771,991円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		171,883,102円
バランスセレクト50		392,471,390円
バランスセレクト70		495,230,017円
野村世界6資産分散投信(安定コース)		2,023,626,421円
野村世界6資産分散投信(分配コース)		3,716,111,011円
野村世界6資産分散投信(成長コース)		7,617,523,553円
野村資産設計ファンド2015		54,692,599円
野村資産設計ファンド2020		63,364,114円
野村資産設計ファンド2025		98,195,269円
野村資産設計ファンド2030		111,991,689円
野村資産設計ファンド2035		81,838,291円
野村資産設計ファンド2040		193,007,707円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)		99,373,769,399円
のむらっぴ・ファンド(保守型)		2,987,220,352円
のむらっぴ・ファンド(普通型)		7,450,973,592円
のむらっぴ・ファンド(積極型)		2,150,456,340円
野村資産設計ファンド2045		29,094,410円
野村インデックスファンド・TOPIX		1,936,238,568円
マイ・ロード		3,953,105,631円
ネクストコア		38,049,262円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型		921,752,248円
野村日本株インデックス(野村SMA・EW向け)		1,705,329,370円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)		336,099,478円
野村資産設計ファンド2050		46,210,086円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型		14,255,522円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型		5,479,107円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型		3,880,950円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型		2,412,179円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)		281,795,019円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)		245,763,902円
インデックス・ブレンド(タイプ)		7,573,344円
インデックス・ブレンド(タイプ)		5,216,926円
インデックス・ブレンド(タイプ)		15,540,324円
インデックス・ブレンド(タイプ)		4,378,908円
インデックス・ブレンド(タイプ)		23,218,947円
野村6資産均等バランス		368,454,636円
世界6資産分散ファンド		110,822,032円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式		299,864,388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)		496,428,620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)		398,952,077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)		829,745,548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)	826,433,767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)	5,020,169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)	12,500,729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)	2,924,854円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,786,968,845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)	20,686,405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)	174,561,007円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	797,992,596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)	117,207,136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)	121,177,398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)	299,197,594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)	4,902,834,213円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	682,697,193円
ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	393,606,014円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	2,453,551,730円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	141,147,448円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,058,094,741円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,950,096円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	33,608,365円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	43,159,642円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	120,588,546円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,859,288,901円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	14,734,297,034円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	19,460,294,338円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	33,179,166,561円
マイバランスDC30	3,145,844,574円
マイバランスDC50	4,392,894,784円
マイバランスDC70	4,250,016,901円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,256,733,728円
野村DC運用戦略ファンド	287,304,166円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	12,257,731円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	583,227,562円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	320,783,286円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	219,042,416円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	2,332,665円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,791,609円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	15,736,448円
野村資産設計ファンド(DC)2030	1,200,981円
野村資産設計ファンド(DC)2040	1,139,296円
野村資産設計ファンド(DC)2050	2,476,912円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	119,924,565円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	64,541,006円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	22,363,471円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	44,188,240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2月18日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	7,500	2,963.00	22,222,500	
		日本水産	229,900	732.00	168,286,800	貸付有価証券 100株
		マルハニチロ	33,200	3,705.00	123,006,000	
		カネコ種苗	7,000	1,324.00	9,268,000	
		サカタのタネ	28,000	3,725.00	104,300,000	貸付有価証券 800株
		ホクト	19,300	1,935.00	37,345,500	貸付有価証券 2,700株
		ホクリヨウ	3,100	621.00	1,925,100	
		住石ホールディングス	49,500	101.00	4,999,500	貸付有価証券 900株
		日鉄鉱業	5,300	4,595.00	24,353,500	
		三井松島ホールディングス	9,600	1,566.00	15,033,600	
		国際石油開発帝石	922,300	1,142.00	1,053,266,600	
		石油資源開発	33,000	2,359.00	77,847,000	貸付有価証券 900株
		K & Oエナジーグループ	11,200	1,524.00	17,068,800	
		ヒノキヤグループ	4,800	2,276.00	10,924,800	貸付有価証券 200株
		ショーボンドホールディングス	16,400	8,090.00	132,676,000	
		ミライト・ホールディングス	64,700	1,669.00	107,984,300	貸付有価証券 23,500株(15,200株)
		タマホーム	11,100	1,098.00	12,187,800	貸付有価証券 1,200株
		サンヨーホームズ	3,300	856.00	2,824,800	貸付有価証券 1,500株
日本アクア	5,500	510.00	2,805,000	貸付有価証券 2,500株		

ファーストコーポレーション	7,000	733.00	5,131,000	貸付有価証券 100株
ベステラ	4,400	1,335.00	5,874,000	貸付有価証券 1,600株
TATERU	28,000	268.00	7,504,000	貸付有価証券 13,100株（10,200株）
スペースバリューホールディングス	28,000	891.00	24,948,000	貸付有価証券 200株
ダイセキ環境ソリューション	4,400	650.00	2,860,000	
第一カッター興業	2,800	1,798.00	5,034,400	貸付有価証券 1,100株
安藤・間	147,000	765.00	112,455,000	貸付有価証券 700株
東急建設	67,300	967.00	65,079,100	
コムシスホールディングス	81,500	2,839.00	231,378,500	
ミサワホーム	18,100	729.00	13,194,900	貸付有価証券 300株
ビーアールホールディングス	18,800	357.00	6,711,600	貸付有価証券 300株
高松コンストラクショングループ	14,300	2,718.00	38,867,400	
東建コーポレーション	7,100	6,570.00	46,647,000	
ソネック	2,400	708.00	1,699,200	
ヤマウラ	8,900	978.00	8,704,200	貸付有価証券 700株
大成建設	188,800	4,970.00	938,336,000	
大林組	568,800	1,054.00	599,515,200	
清水建設	580,200	935.00	542,487,000	
飛鳥建設	16,200	1,505.00	24,381,000	
長谷工コーポレーション	237,100	1,334.00	316,291,400	貸付有価証券 200株
松井建設	20,900	741.00	15,486,900	
銭高組	2,300	5,300.00	12,190,000	
鹿島建設	444,600	1,595.00	709,137,000	貸付有価証券 400株
不動テトラ	13,000	1,588.00	20,644,000	
大未建設	6,700	958.00	6,418,600	
鉄建建設	11,500	2,705.00	31,107,500	

西松建設	40,900	2,461.00	100,654,900	
三井住友建設	136,800	698.00	95,486,400	貸付有価証券 400株
大豊建設	12,800	3,010.00	38,528,000	
前田建設工業	135,300	1,124.00	152,077,200	
佐田建設	12,200	367.00	4,477,400	
ナカノフード建設	14,500	522.00	7,569,000	
奥村組	31,200	3,350.00	104,520,000	
東鉄工業	22,800	3,000.00	68,400,000	
イチケン	3,400	1,962.00	6,670,800	
富士ピー・エス	5,900	516.00	3,044,400	貸付有価証券 100株
浅沼組	6,700	2,647.00	17,734,900	貸付有価証券 100株
戸田建設	220,500	708.00	156,114,000	貸付有価証券 100株
熊谷組	27,100	3,205.00	86,855,500	
青木あすなろ建設	9,300	1,031.00	9,588,300	
北野建設	4,000	3,125.00	12,500,000	
植木組	2,300	2,292.00	5,271,600	
矢作建設工業	25,800	749.00	19,324,200	
ピーエス三菱	20,000	626.00	12,520,000	貸付有価証券 1,400株
日本ハウスホールディングス	36,200	440.00	15,928,000	貸付有価証券 900株
大東建託	67,600	15,580.00	1,053,208,000	
新日本建設	22,600	990.00	22,374,000	
N I P P O	50,200	2,122.00	106,524,400	
東亜道路工業	3,600	3,080.00	11,088,000	
前田道路	59,400	2,161.00	128,363,400	貸付有価証券 1,100株
日本道路	5,100	6,580.00	33,558,000	
東亜建設工業	16,600	1,586.00	26,327,600	
若築建設	9,500	1,504.00	14,288,000	
東洋建設	69,400	422.00	29,286,800	
五洋建設	225,500	541.00	121,995,500	貸付有価証券 4,400株
世紀東急工業	27,600	630.00	17,388,000	

福田組	6,100	4,360.00	26,596,000	
住友林業	134,400	1,421.00	190,982,400	貸付有価証券 1,200株
日本基礎技術	19,500	369.00	7,195,500	
巴コーポレーション	23,600	387.00	9,133,200	
大和ハウス工業	525,200	3,333.00	1,750,491,600	貸付有価証券 12,300株
ライト工業	36,500	1,488.00	54,312,000	
積水ハウス	580,800	1,616.00	938,572,800	貸付有価証券 57,600株
日特建設	16,200	616.00	9,979,200	貸付有価証券 2,200株（800株）
北陸電気工事	9,200	938.00	8,629,600	
ユアテック	30,400	882.00	26,812,800	
四電工	2,900	2,676.00	7,760,400	
中電工	24,400	2,363.00	57,657,200	
関電工	86,300	1,030.00	88,889,000	貸付有価証券 5,400株
きんでん	126,100	1,813.00	228,619,300	貸付有価証券 100株
東京エネシス	19,600	1,020.00	19,992,000	
トーエネック	5,300	3,290.00	17,437,000	
住友電設	13,100	1,872.00	24,523,200	貸付有価証券 200株
日本電設工業	32,300	2,291.00	73,999,300	貸付有価証券 200株
協和エクシオ	74,300	2,809.00	208,708,700	貸付有価証券 100株
新日本空調	15,900	1,992.00	31,672,800	
九電工	37,400	3,830.00	143,242,000	貸付有価証券 200株
三機工業	42,800	1,172.00	50,161,600	
日揮	163,400	1,740.00	284,316,000	貸付有価証券 10,300株
中外炉工業	5,300	1,732.00	9,179,600	
ヤマト	17,000	464.00	7,888,000	
太平電業	12,800	2,468.00	31,590,400	
高砂熱学工業	47,800	1,794.00	85,753,200	
三晃金属工業	2,300	2,978.00	6,849,400	

朝日工業社	3,900	2,948.00	11,497,200	
明星工業	34,300	726.00	24,901,800	
大気社	25,800	3,200.00	82,560,000	貸付有価証券 200株
ダイダン	12,700	2,443.00	31,026,100	
日比谷総合設備	18,100	1,883.00	34,082,300	
東芝プラントシステム	41,100	2,067.00	84,953,700	
OSJBホールディングス	83,700	283.00	23,687,100	
千代田化工建設	136,800	301.00	41,176,800	貸付有価証券 64,200株（29,700株）
新興プランテック	34,100	1,218.00	41,533,800	貸付有価証券 100株
日本製粉	56,400	1,893.00	106,765,200	
日清製粉グループ本社	192,000	2,345.00	450,240,000	貸付有価証券 100株
日東富士製粉	1,200	6,290.00	7,548,000	
昭和産業	15,600	3,005.00	46,878,000	
鳥越製粉	15,100	780.00	11,778,000	
中部飼料	20,800	1,110.00	23,088,000	
フィード・ワン	114,100	180.00	20,538,000	貸付有価証券 200株
東洋精糖	2,600	1,022.00	2,657,200	
日本甜菜製糖	9,700	1,815.00	17,605,500	
三井製糖	13,400	2,919.00	39,114,600	
塩水港精糖	18,400	222.00	4,084,800	
日新製糖	8,000	2,059.00	16,472,000	
森永製菓	42,700	4,940.00	210,938,000	
中村屋	4,400	4,255.00	18,722,000	
江崎グリコ	51,100	5,710.00	291,781,000	貸付有価証券 1,000株
名糖産業	8,200	1,367.00	11,209,400	
井村屋グループ	7,200	2,493.00	17,949,600	
不二家	9,500	2,335.00	22,182,500	
山崎製パン	138,900	1,905.00	264,604,500	貸付有価証券 300株
第一屋製パン	2,900	1,038.00	3,010,200	
モロゾフ	2,900	4,995.00	14,485,500	

亀田製菓	10,600	5,190.00	55,014,000	
寿スピリッツ	18,000	4,365.00	78,570,000	
カルビー	77,400	3,160.00	244,584,000	貸付有価証券 1,400株
森永乳業	34,000	3,445.00	117,130,000	
六甲バター	12,400	1,966.00	24,378,400	
ヤクルト本社	125,900	7,390.00	930,401,000	
明治ホールディングス	120,400	8,760.00	1,054,704,000	
雪印メグミルク	40,900	2,725.00	111,452,500	
プリマハム	23,900	2,146.00	51,289,400	
日本ハム	73,400	4,350.00	319,290,000	
林兼産業	5,600	595.00	3,332,000	
丸大食品	18,100	1,931.00	34,951,100	
S Foods	15,300	4,065.00	62,194,500	貸付有価証券 7,000株(100株)
伊藤ハム米久ホールディングス	109,400	661.00	72,313,400	貸付有価証券 100株
サッポロホールディングス	62,100	2,388.00	148,294,800	貸付有価証券 2,500株
アサヒグループホールディングス	355,800	4,769.00	1,696,810,200	貸付有価証券 78,100株
キリンホールディングス	768,600	2,577.50	1,981,066,500	貸付有価証券 175,000株
宝ホールディングス	127,200	1,221.00	155,311,200	
オエノンホールディングス	48,300	377.00	18,209,100	
養命酒製造	5,200	2,102.00	10,930,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	130,100	3,000.00	390,300,000	貸付有価証券 5,200株
サントリー食品インターナショナル	113,700	4,760.00	541,212,000	貸付有価証券 1,600株
ダイドーグループホールディングス	9,600	5,390.00	51,744,000	貸付有価証券 3,600株
伊藤園	51,600	5,090.00	262,644,000	
キーコーヒー	16,700	2,072.00	34,602,400	
ユニカフェ	5,100	1,015.00	5,176,500	
ジャパンフーズ	2,400	1,242.00	2,980,800	貸付有価証券 100株
日清オイリオグループ	21,900	3,420.00	74,898,000	

不二製油グループ本社	41,400	3,620.00	149,868,000	
かどや製油	1,900	4,980.00	9,462,000	
J - オイルミルズ	8,800	4,080.00	35,904,000	
キッコーマン	112,100	5,470.00	613,187,000	貸付有価証券 800株
味の素	375,200	1,662.50	623,770,000	
キュービー	94,600	2,553.00	241,513,800	貸付有価証券 500株
ハウス食品グループ本社	64,800	4,345.00	281,556,000	
カゴメ	68,100	2,976.00	202,665,600	
焼津水産化学工業	8,200	1,143.00	9,372,600	
アリアケジャパン	15,500	5,940.00	92,070,000	
ピエトロ	2,200	1,642.00	3,612,400	
エバラ食品工業	4,100	2,131.00	8,737,100	
ニチレイ	88,200	2,739.00	241,579,800	
東洋水産	87,400	4,140.00	361,836,000	
イトアンド	5,900	1,682.00	9,923,800	貸付有価証券 1,300株
大冷	1,900	1,734.00	3,294,600	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,600	659.00	3,031,400	貸付有価証券 2,100株
日清食品ホールディングス	72,200	7,600.00	548,720,000	
永谷園ホールディングス	9,100	2,409.00	21,921,900	
一正蒲鉾	6,600	1,080.00	7,128,000	貸付有価証券 500株
フジッコ	18,400	2,328.00	42,835,200	
ロック・フィールド	18,300	1,610.00	29,463,000	貸付有価証券 100株
日本たばこ産業	981,100	2,800.00	2,747,080,000	貸付有価証券 360,700株
ケンコーマヨネーズ	9,500	2,251.00	21,384,500	貸付有価証券 800株
わらべや日洋ホールディングス	11,100	1,949.00	21,633,900	貸付有価証券 4,900株
なとり	9,500	1,692.00	16,074,000	
イフジ産業	3,000	697.00	2,091,000	
ピックルスコーポレーション	4,000	1,981.00	7,924,000	貸付有価証券 200株

北の達人コーポレーション	66,700	424.00	28,280,800	貸付有価証券 31,300株(3,600株)
ユーグレナ	72,400	637.00	46,118,800	貸付有価証券 34,000株(5,000株)
ミヨシ油脂	6,500	1,048.00	6,812,000	
理研ビタミン	8,000	3,560.00	28,480,000	
片倉工業	20,400	1,211.00	24,704,400	貸付有価証券 9,400株(8,300株)
グンゼ	11,200	5,110.00	57,232,000	
東洋紡	70,200	1,641.00	115,198,200	
ユニチカ	48,600	500.00	24,300,000	
富士紡ホールディングス	8,600	2,875.00	24,725,000	
倉敷紡績	15,800	2,295.00	36,261,000	
シキボウ	8,700	1,053.00	9,161,100	
日本毛織	54,500	891.00	48,559,500	貸付有価証券 700株
ダイトウボウ	26,800	81.00	2,170,800	貸付有価証券 900株(800株)
トーア紡コーポレーション	7,000	457.00	3,199,000	
ダイドーリミテッド	19,800	346.00	6,850,800	
帝国繊維	18,600	2,447.00	45,514,200	
帝人	135,300	1,870.00	253,011,000	
東レ	1,286,200	796.90	1,024,972,780	貸付有価証券 8,200株
サカイオーベックス	4,100	1,871.00	7,671,100	
住江織物	4,800	2,659.00	12,763,200	貸付有価証券 200株
日本フェルト	9,400	458.00	4,305,200	
イチカワ	2,300	1,395.00	3,208,500	
日東製網	1,900	1,313.00	2,494,700	
アツギ	13,700	959.00	13,138,300	
ダイニック	6,700	748.00	5,011,600	
セーレン	40,800	1,932.00	78,825,600	貸付有価証券 200株
ソトー	6,600	982.00	6,481,200	
東海染工	2,300	1,018.00	2,341,400	
小松マテーレ	27,200	835.00	22,712,000	
ワコールホールディング	48,300	2,849.00	137,606,700	

ス				
ホギメディカル	20,600	3,835.00	79,001,000	
レナウン	47,900	101.00	4,837,900	貸付有価証券 10,400株（6,900株）
クラウディアホールディングス	4,100	479.00	1,963,900	
T S I ホールディングス	61,200	699.00	42,778,800	貸付有価証券 4,600株
マツオカコーポレーション	5,200	3,135.00	16,302,000	貸付有価証券 1,800株
ワールド	16,300	2,085.00	33,985,500	貸付有価証券 100株
三陽商会	10,000	1,710.00	17,100,000	貸付有価証券 300株
ナイガイ	6,000	547.00	3,282,000	
オンワードホールディングス	99,600	671.00	66,831,600	貸付有価証券 600株
ルックホールディングス	6,000	1,339.00	8,034,000	貸付有価証券 400株（400株）
ゴールドウイン	15,000	13,110.00	196,650,000	貸付有価証券 6,900株
デサント	40,400	2,529.00	102,171,600	貸付有価証券 18,900株（13,800株）
キング	8,800	597.00	5,253,600	
ヤマトインターナショナル	10,900	420.00	4,578,000	
特種東海製紙	10,500	3,960.00	41,580,000	
王子ホールディングス	746,400	662.00	494,116,800	
日本製紙	79,400	2,024.00	160,705,600	
三菱製紙	27,000	553.00	14,931,000	
北越コーポレーション	110,000	636.00	69,960,000	貸付有価証券 400株
中越パルプ工業	7,000	1,373.00	9,611,000	
巴川製紙所	5,500	1,024.00	5,632,000	
大王製紙	80,800	1,302.00	105,201,600	貸付有価証券 25,100株（10,300株）
阿波製紙	4,300	448.00	1,926,400	
レンゴー	171,000	908.00	155,268,000	
トーモク	10,200	1,638.00	16,707,600	
ザ・パック	12,600	3,270.00	41,202,000	

クラレ	279,800	1,540.00	430,892,000	貸付有価証券 28,500株
旭化成	1,179,500	1,171.50	1,381,784,250	
共和レザー	10,300	776.00	7,992,800	
昭和電工	110,200	3,885.00	428,127,000	貸付有価証券 51,700株
住友化学	1,305,100	560.00	730,856,000	
住友精化	8,100	4,295.00	34,789,500	
日産化学	101,800	5,600.00	570,080,000	
ラサ工業	5,800	1,434.00	8,317,200	
クレハ	15,300	7,030.00	107,559,000	
多木化学	4,800	5,590.00	26,832,000	貸付有価証券 2,200株
テイカ	13,500	2,090.00	28,215,000	貸付有価証券 600株
石原産業	31,800	1,122.00	35,679,600	貸付有価証券 1,000株
片倉コープアグリ	4,800	1,151.00	5,524,800	
日東エフシー	10,400	769.00	7,997,600	
日本曹達	26,200	2,969.00	77,787,800	
東ソー	256,300	1,649.00	422,638,700	
トクヤマ	47,800	2,872.00	137,281,600	貸付有価証券 4,500株
セントラル硝子	36,100	2,552.00	92,127,200	貸付有価証券 200株
東亜合成	104,100	1,228.00	127,834,800	貸付有価証券 800株
大阪ソーダ	17,800	2,790.00	49,662,000	貸付有価証券 2,800株
関東電化工業	39,300	893.00	35,094,900	貸付有価証券 3,500株
デンカ	65,200	3,490.00	227,548,000	
信越化学工業	292,200	9,497.00	2,775,023,400	貸付有価証券 5,500株
日本カーバイド工業	5,600	1,566.00	8,769,600	
堺化学工業	11,000	2,460.00	27,060,000	
第一稀元素化学工業	13,500	906.00	12,231,000	
エア・ウォーター	135,800	1,809.00	245,662,200	貸付有価証券 600株
大陽日酸	136,600	1,581.00	215,964,600	貸付有価証券

				13,600株
日本化学工業	5,600	2,379.00	13,322,400	
東邦アセチレン	2,500	1,388.00	3,470,000	
日本パーカラライジング	90,600	1,449.00	131,279,400	
高压ガス工業	26,300	814.00	21,408,200	
チタン工業	2,100	2,417.00	5,075,700	貸付有価証券 900株
四国化成工業	27,900	1,318.00	36,772,200	
戸田工業	3,500	2,249.00	7,871,500	貸付有価証券 1,400株
ステラ ケミファ	9,700	3,135.00	30,409,500	貸付有価証券 4,500株
保土谷化学工業	5,700	2,846.00	16,222,200	貸付有価証券 100株
日本触媒	27,900	7,560.00	210,924,000	
大日精化工業	13,700	3,115.00	42,675,500	
カネカ	44,100	4,490.00	198,009,000	
三菱瓦斯化学	170,500	1,800.00	306,900,000	貸付有価証券 100株
三井化学	150,500	2,799.00	421,249,500	
J S R	166,400	1,894.00	315,161,600	貸付有価証券 200株
東京応化工業	28,400	3,420.00	97,128,000	貸付有価証券 400株
大阪有機化学工業	15,300	1,202.00	18,390,600	
三菱ケミカルホールディングス	1,108,300	821.00	909,914,300	貸付有価証券 700株
K Hネオケム	25,200	2,950.00	74,340,000	
ダイセル	257,500	1,131.00	291,232,500	
住友ベークライト	28,700	4,245.00	121,831,500	
積水化学工業	362,400	1,749.00	633,837,600	貸付有価証券 300株
日本ゼオン	149,500	1,174.00	175,513,000	貸付有価証券 100株
アイカ工業	49,700	3,865.00	192,090,500	貸付有価証券 2,400株
宇部興産	83,700	2,601.00	217,703,700	
積水樹脂	27,400	2,160.00	59,184,000	
タキロンシーアイ	35,900	616.00	22,114,400	
旭有機材	11,400	1,670.00	19,038,000	

日立化成	76,700	2,040.00	156,468,000	貸付有価証券 18,000株
ニチバン	8,700	2,282.00	19,853,400	
リケンテクノス	45,200	475.00	21,470,000	貸付有価証券 1,000株
大倉工業	8,500	1,800.00	15,300,000	
積水化成工業	24,700	957.00	23,637,900	
群栄化学工業	4,300	2,798.00	12,031,400	
タイガースポリマー	8,700	603.00	5,246,100	
ミライアル	4,800	1,204.00	5,779,200	貸付有価証券 500株
ダイキアクシス	5,900	1,043.00	6,153,700	
ダイキョーニシカワ	35,000	1,313.00	45,955,000	貸付有価証券 400株
竹本容器	5,900	1,439.00	8,490,100	
森六ホールディングス	8,900	2,606.00	23,193,400	
日本化薬	105,500	1,299.00	137,044,500	
カーリットホールディングス	17,700	854.00	15,115,800	貸付有価証券 100株
日本精化	13,300	1,206.00	16,039,800	
扶桑化学工業	16,800	2,179.00	36,607,200	貸付有価証券 500株
トリケミカル研究所	3,700	5,150.00	19,055,000	貸付有価証券 1,700株
A D E K A	81,700	1,714.00	140,033,800	貸付有価証券 100株
日油	63,900	3,780.00	241,542,000	貸付有価証券 100株
新日本理化	30,000	186.00	5,580,000	貸付有価証券 14,100株
ハリマ化成グループ	13,700	1,109.00	15,193,300	
花王	411,000	8,212.00	3,375,132,000	貸付有価証券 61,800株
第一工業製薬	6,200	3,095.00	19,189,000	
石原ケミカル	4,200	1,811.00	7,606,200	貸付有価証券 700株
日華化学	5,600	958.00	5,364,800	
ニイタカ	2,600	1,485.00	3,861,000	
三洋化成工業	11,100	5,540.00	61,494,000	

有機合成薬品工業	12,700	196.00	2,489,200	
大日本塗料	18,700	1,121.00	20,962,700	
日本ペイントホールディングス	136,800	3,960.00	541,728,000	貸付有価証券 54,300株
関西ペイント	186,300	2,010.00	374,463,000	貸付有価証券 26,500株
神東塗料	13,000	173.00	2,249,000	
中国塗料	54,500	1,005.00	54,772,500	貸付有価証券 8,500株
日本特殊塗料	12,400	1,381.00	17,124,400	
藤倉化成	22,400	610.00	13,664,000	
太陽ホールディングス	13,700	3,790.00	51,923,000	
D I C	75,000	3,560.00	267,000,000	貸付有価証券 2,000株
サカタインクス	36,200	1,249.00	45,213,800	貸付有価証券 100株
東洋インキ S C ホールディングス	35,000	2,655.00	92,925,000	貸付有価証券 300株
T & K T O K A	12,800	1,017.00	13,017,600	
富士フイルムホールディングス	351,600	5,033.00	1,769,602,800	貸付有価証券 11,000株
資生堂	336,400	7,254.00	2,440,245,600	貸付有価証券 46,200株
ライオン	235,800	2,232.00	526,305,600	貸付有価証券 100株
高砂香料工業	11,700	3,615.00	42,295,500	
マンダム	38,100	2,730.00	104,013,000	
ミルボン	20,900	5,310.00	110,979,000	貸付有価証券 1,100株
ファンケル	75,400	2,487.00	187,519,800	貸付有価証券 100株
コーセー	28,700	18,590.00	533,533,000	貸付有価証券 900株
コタ	8,100	1,475.00	11,947,500	
シーズ・ホールディングス	5,100	5,880.00	29,988,000	貸付有価証券 1,900株（200株）
シーボン	2,000	2,660.00	5,320,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	72,300	3,365.00	243,289,500	貸付有価証券 2,000株
ノエビアホールディング	10,800	5,310.00	57,348,000	

ス				
アジュバンコスメジャパン	3,800	977.00	3,712,600	貸付有価証券 100株
エステー	12,100	1,893.00	22,905,300	
アグロ カネショウ	6,900	2,088.00	14,407,200	
コニシ	30,000	1,710.00	51,300,000	
長谷川香料	20,200	1,743.00	35,208,600	貸付有価証券 200株
星光PMC	11,300	837.00	9,458,100	貸付有価証券 1,200株（100株）
小林製薬	47,400	8,910.00	422,334,000	
荒川化学工業	15,200	1,358.00	20,641,600	
メック	11,600	1,145.00	13,282,000	貸付有価証券 200株
日本高純度化学	4,600	2,349.00	10,805,400	
タカラバイオ	44,300	2,366.00	104,813,800	
JCU	21,900	1,864.00	40,821,600	
新田ゼラチン	10,600	692.00	7,335,200	
OATアグリオ	2,300	1,768.00	4,066,400	貸付有価証券 1,100株
デクセリアルズ	43,600	788.00	34,356,800	
アース製薬	12,800	4,910.00	62,848,000	貸付有価証券 100株
北興化学工業	17,300	554.00	9,584,200	
大成ラミック	5,600	2,876.00	16,105,600	貸付有価証券 100株
クミアイ化学工業	70,000	717.00	50,190,000	貸付有価証券 1,100株
日本農薬	40,500	490.00	19,845,000	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
アキレス	12,300	2,086.00	25,657,800	
有沢製作所	26,600	825.00	21,945,000	
日東電工	127,900	6,016.00	769,446,400	
レック	18,100	1,689.00	30,570,900	貸付有価証券 5,100株
三光合成	14,500	374.00	5,423,000	貸付有価証券 1,200株
きもと	28,800	192.00	5,529,600	貸付有価証券 100株
藤森工業	15,200	3,035.00	46,132,000	

前澤化成工業	11,600	1,032.00	11,971,200	
未来工業	9,100	2,399.00	21,830,900	貸付有価証券 4,200株(4,200株)
ウェーブブロックホールディングス	3,500	839.00	2,936,500	貸付有価証券 800株
J S P	9,900	2,458.00	24,334,200	
エフピコ	14,000	6,430.00	90,020,000	貸付有価証券 100株
天馬	11,700	2,032.00	23,774,400	
信越ポリマー	30,400	829.00	25,201,600	貸付有価証券 100株
東リ	42,100	269.00	11,324,900	貸付有価証券 100株
ニフコ	67,800	2,802.00	189,975,600	貸付有価証券 8,900株
バルカー	13,800	2,303.00	31,781,400	
ユニ・チャーム	358,900	3,509.00	1,259,380,100	貸付有価証券 47,400株
協和発酵キリン	212,100	2,149.00	455,802,900	貸付有価証券 20,300株
武田薬品工業	1,073,100	4,508.00	4,837,534,800	
アステラス製薬	1,560,800	1,689.50	2,636,971,600	貸付有価証券 24,300株
大日本住友製薬	125,500	2,681.00	336,465,500	貸付有価証券 31,100株(10,600株)
塩野義製薬	221,500	6,954.00	1,540,311,000	貸付有価証券 5,500株
田辺三菱製薬	177,000	1,630.00	288,510,000	
わかもと製薬	20,100	284.00	5,708,400	
あすか製薬	20,900	1,223.00	25,560,700	
日本新薬	44,300	7,000.00	310,100,000	貸付有価証券 1,400株
ビオフェルミン製薬	2,900	2,391.00	6,933,900	
中外製薬	176,500	7,080.00	1,249,620,000	貸付有価証券 32,600株
科研製薬	30,600	5,380.00	164,628,000	
エーザイ	202,600	8,760.00	1,774,776,000	
ロート製薬	86,800	3,025.00	262,570,000	貸付有価証券 100株
小野薬品工業	399,800	2,273.50	908,945,300	貸付有価証券

				100株
久光製薬	50,000	5,640.00	282,000,000	貸付有価証券 600株
持田製薬	12,800	11,190.00	143,232,000	
参天製薬	320,900	1,559.00	500,283,100	貸付有価証券 1,300株
扶桑薬品工業	6,000	2,489.00	14,934,000	
日本ケミファ	2,200	2,932.00	6,450,400	
ツムラ	52,400	3,545.00	185,758,000	
日医工	43,500	1,599.00	69,556,500	貸付有価証券 2,700株
キッセイ薬品工業	30,000	2,932.00	87,960,000	
生化学工業	32,800	1,309.00	42,935,200	
栄研化学	29,700	2,530.00	75,141,000	貸付有価証券 2,500株
日水製薬	7,100	1,182.00	8,392,200	
鳥居薬品	9,100	2,257.00	20,538,700	貸付有価証券 200株
JCRファーマ	11,900	5,750.00	68,425,000	
東和薬品	8,100	8,820.00	71,442,000	貸付有価証券 2,300株（800株）
富士製薬工業	11,500	1,790.00	20,585,000	
沢井製薬	34,700	5,910.00	205,077,000	貸付有価証券 500株
ゼリア新薬工業	33,500	1,919.00	64,286,500	貸付有価証券 500株
第一三共	484,400	3,798.00	1,839,751,200	
キョーリン製薬ホールディングス	37,400	2,257.00	84,411,800	貸付有価証券 100株
大幸薬品	7,500	1,818.00	13,635,000	貸付有価証券 100株
ダイト	9,900	2,825.00	27,967,500	
大塚ホールディングス	322,500	4,447.00	1,434,157,500	貸付有価証券 73,700株
大正製薬ホールディングス	37,900	11,360.00	430,544,000	
ペプチドリーム	84,400	5,030.00	424,532,000	貸付有価証券 35,100株（9,800株）
日本コークス工業	143,000	100.00	14,300,000	
昭和シェル石油	156,700	1,726.00	270,464,200	

ニチレキ	21,600	1,143.00	24,688,800	
ユシロ化学工業	8,800	1,312.00	11,545,600	
ビーピー・カストロール	6,000	1,371.00	8,226,000	貸付有価証券 1,300株
富士石油	41,100	287.00	11,795,700	貸付有価証券 1,400株
MORESCO	6,100	1,629.00	9,936,900	貸付有価証券 2,800株
出光興産	131,200	4,090.00	536,608,000	
JXTGホールディングス	2,847,300	573.90	1,634,065,470	
コスモエネルギーホールディングス	49,000	2,466.00	120,834,000	貸付有価証券 19,900株
横浜ゴム	98,000	2,345.00	229,810,000	
TOYO TIRE	86,900	1,531.00	133,043,900	貸付有価証券 100株
ブリヂストン	520,300	4,402.00	2,290,360,600	貸付有価証券 149,700株
住友ゴム工業	152,100	1,427.00	217,046,700	貸付有価証券 10,800株(5,300株)
藤倉ゴム工業	14,800	438.00	6,482,400	
オカモト	11,800	5,880.00	69,384,000	貸付有価証券 200株
フコク	7,400	868.00	6,423,200	
ニッタ	19,100	3,810.00	72,771,000	
住友理工	32,800	1,070.00	35,096,000	
三ツ星ベルト	22,300	2,196.00	48,970,800	
バンドー化学	32,300	1,195.00	38,598,500	貸付有価証券 100株
日東紡績	25,200	1,979.00	49,870,800	貸付有価証券 500株
AGC	167,400	3,925.00	657,045,000	貸付有価証券 14,400株
日本板硝子	80,900	980.00	79,282,000	貸付有価証券 24,800株(3,600株)
石塚硝子	2,700	1,770.00	4,779,000	貸付有価証券 1,100株
日本山村硝子	7,000	1,505.00	10,535,000	
日本電気硝子	73,200	2,974.00	217,696,800	貸付有価証券 10,800株
オハラ	6,700	1,764.00	11,818,800	貸付有価証券

				3,000株(800株)
住友大阪セメント	34,200	4,745.00	162,279,000	貸付有価証券 6,800株
太平洋セメント	106,900	3,725.00	398,202,500	
日本ヒューム	17,000	813.00	13,821,000	
日本コンクリート工業	36,400	281.00	10,228,400	
三谷セキサン	7,900	2,793.00	22,064,700	
アジアパイルホールディングス	24,000	636.00	15,264,000	
東海カーボン	153,700	1,534.00	235,775,800	貸付有価証券 72,200株(500株)
日本カーボン	8,100	5,320.00	43,092,000	貸付有価証券 3,800株
東洋炭素	9,900	2,122.00	21,007,800	貸付有価証券 100株
ノリタケカンパニーリミテド	10,100	5,170.00	52,217,000	
TOTO	130,200	4,340.00	565,068,000	貸付有価証券 3,200株
日本碍子	206,600	1,670.00	345,022,000	貸付有価証券 600株
日本特殊陶業	142,700	2,364.00	337,342,800	貸付有価証券 6,700株
ダントーホールディングス	14,200	115.00	1,633,000	貸付有価証券 500株
MARUWA	5,900	6,420.00	37,878,000	
品川リフラクトリーズ	4,500	3,350.00	15,075,000	
黒崎播磨	3,400	5,740.00	19,516,000	貸付有価証券 300株(200株)
ヨータイ	14,800	603.00	8,924,400	貸付有価証券 200株
イソライト工業	8,700	586.00	5,098,200	貸付有価証券 4,000株(1,200株)
東京窯業	21,500	388.00	8,342,000	貸付有価証券 8,100株
ニッカトー	7,700	1,015.00	7,815,500	貸付有価証券 2,200株
フジインコーポレーテッド	15,100	2,341.00	35,349,100	
クニミネ工業	5,700	822.00	4,685,400	
エーアンドエーマテリア	3,300	1,097.00	3,620,100	貸付有価証券

ル				100株
ニチアス	46,300	2,057.00	95,239,100	
ニチハ	23,500	3,075.00	72,262,500	貸付有価証券 100株
新日鐵住金	777,900	2,059.00	1,601,696,100	
神戸製鋼所	306,400	882.00	270,244,800	貸付有価証券 200株
中山製鋼所	23,200	485.00	11,252,000	
合同製鐵	8,100	1,782.00	14,434,200	
ジェイ エフ イー ホールディングス	452,100	1,944.00	878,882,400	
東京製鐵	89,600	894.00	80,102,400	貸付有価証券 200株
共英製鋼	18,900	1,661.00	31,392,900	貸付有価証券 2,500株
大和工業	35,600	3,035.00	108,046,000	
東京鐵鋼	6,900	1,166.00	8,045,400	
大阪製鐵	11,100	1,828.00	20,290,800	
淀川製鋼所	22,600	2,231.00	50,420,600	
丸一鋼管	59,300	3,280.00	194,504,000	
モリ工業	5,000	2,547.00	12,735,000	
大同特殊鋼	27,400	4,595.00	125,903,000	貸付有価証券 800株
日本高周波鋼業	6,200	533.00	3,304,600	
日本冶金工業	138,500	241.00	33,378,500	貸付有価証券 58,800株
山陽特殊製鋼	21,100	2,486.00	52,454,600	
愛知製鋼	9,400	3,520.00	33,088,000	
日立金属	180,300	1,109.00	199,952,700	貸付有価証券 11,800株
日本金属	3,900	1,287.00	5,019,300	
大平洋金属	11,300	2,832.00	32,001,600	貸付有価証券 4,700株（500株）
新日本電工	100,300	237.00	23,771,100	貸付有価証券 46,500株（600株）
栗本鐵工所	8,500	1,504.00	12,784,000	
虹技	2,500	1,383.00	3,457,500	
日本鑄鉄管	1,700	864.00	1,468,800	
三菱製鋼	12,400	1,662.00	20,608,800	

日亜銅業	24,500	323.00	7,913,500	貸付有価証券 1,200株
日本精線	2,400	3,410.00	8,184,000	
エンビプロ・ホールディングス	4,700	543.00	2,552,100	貸付有価証券 1,600株
シンニッタン	26,000	341.00	8,866,000	
新家工業	3,800	1,623.00	6,167,400	
大紀アルミニウム工業所	27,500	624.00	17,160,000	貸付有価証券 12,400株(1,300株)
日本軽金属ホールディングス	456,100	244.00	111,288,400	貸付有価証券 300株
三井金属鉱業	45,200	2,659.00	120,186,800	
東邦亜鉛	9,300	3,165.00	29,434,500	
三菱マテリアル	110,600	3,070.00	339,542,000	
住友金属鉱山	229,300	3,035.00	695,925,500	
DOWAホールディングス	39,100	3,510.00	137,241,000	貸付有価証券 4,000株
古河機械金属	27,600	1,462.00	40,351,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,300	1,869.00	36,071,700	貸付有価証券 6,200株
東邦チタニウム	30,000	979.00	29,370,000	貸付有価証券 2,300株
UACJ	25,400	2,200.00	55,880,000	貸付有価証券 9,500株
CKサンエツ	3,100	3,035.00	9,408,500	
古河電気工業	48,300	3,560.00	171,948,000	
住友電気工業	625,900	1,530.00	957,627,000	
フジクラ	202,100	490.00	99,029,000	
昭和電線ホールディングス	19,400	710.00	13,774,000	
東京特殊電線	2,100	2,020.00	4,242,000	
タツタ電線	33,200	522.00	17,330,400	
カナレ電気	2,800	1,801.00	5,042,800	
平河ヒューテック	6,900	1,632.00	11,260,800	貸付有価証券 1,200株
リョービ	20,600	2,667.00	54,940,200	貸付有価証券 2,000株
アーレスティ	20,600	715.00	14,729,000	
アサヒホールディングス	31,400	2,174.00	68,263,600	

稲葉製作所	9,400	1,268.00	11,919,200	
宮地エンジニアリンググループ	5,100	2,070.00	10,557,000	
トーカロ	43,200	949.00	40,996,800	
アルファC o	5,900	1,380.00	8,142,000	
SUMCO	185,000	1,590.00	294,150,000	貸付有価証券 24,000株（5,500株）
川田テクノロジーズ	3,700	6,790.00	25,123,000	
RS Technologies	3,400	3,180.00	10,812,000	貸付有価証券 500株
東洋製罐グループホールディングス	106,600	2,223.00	236,971,800	貸付有価証券 500株
ホッカンホールディングス	8,500	1,789.00	15,206,500	
コロナ	9,300	1,063.00	9,885,900	
横河ブリッジホールディングス	31,100	1,961.00	60,987,100	
駒井ハルテック	3,100	1,904.00	5,902,400	
高田機工	1,500	2,722.00	4,083,000	
三和ホールディングス	172,900	1,293.00	223,559,700	
文化シャッター	49,300	803.00	39,587,900	貸付有価証券 1,300株
三協立山	23,200	1,425.00	33,060,000	
アルインコ	13,300	991.00	13,180,300	
東洋シャッター	4,000	704.00	2,816,000	
LIXILグループ	247,000	1,607.00	396,929,000	貸付有価証券 200株
日本ファイルコン	12,800	555.00	7,104,000	
ノーリツ	37,400	1,655.00	61,897,000	貸付有価証券 600株
長府製作所	17,000	2,238.00	38,046,000	
リンナイ	29,800	7,500.00	223,500,000	
ダイニチ工業	9,000	743.00	6,687,000	
日東精工	23,100	550.00	12,705,000	
三洋工業	2,200	1,899.00	4,177,800	
岡部	33,900	956.00	32,408,400	
ジーテクト	18,500	1,782.00	32,967,000	
中国工業	2,500	565.00	1,412,500	
東プレ	31,200	2,406.00	75,067,200	

高周波熱錬	32,200	898.00	28,915,600	
東京製綱	10,300	1,053.00	10,845,900	貸付有価証券 3,700株（3,700株）
サンコール	9,400	692.00	6,504,800	
モリテック スチール	13,000	441.00	5,733,000	貸付有価証券 5,300株（600株）
パイオラックス	26,800	2,417.00	64,775,600	
エイチワン	16,400	1,134.00	18,597,600	貸付有価証券 800株
日本発條	166,800	1,060.00	176,808,000	貸付有価証券 500株
中央発條	2,000	2,925.00	5,850,000	
アドバネクス	2,200	1,597.00	3,513,400	貸付有価証券 300株
立川ブラインド工業	7,400	1,177.00	8,709,800	貸付有価証券 200株
三益半導体工業	14,900	1,497.00	22,305,300	
日本ドライケミカル	4,500	1,232.00	5,544,000	
日本製鋼所	50,800	2,061.00	104,698,800	
三浦工業	72,400	2,577.00	186,574,800	
タクマ	61,100	1,474.00	90,061,400	貸付有価証券 1,600株
ツガミ	37,600	753.00	28,312,800	
オークマ	21,300	6,030.00	128,439,000	
東芝機械	18,900	2,321.00	43,866,900	貸付有価証券 1,000株
アマダホールディングス	258,300	1,180.00	304,794,000	貸付有価証券 100株
アイダエンジニアリング	46,400	827.00	38,372,800	
滝澤鉄工所	5,200	1,729.00	8,990,800	
F U J I	50,100	1,552.00	77,755,200	貸付有価証券 1,000株
牧野フライス製作所	19,600	4,470.00	87,612,000	
オーエスジー	82,500	2,265.00	186,862,500	貸付有価証券 1,500株
ダイジェット工業	1,900	1,634.00	3,104,600	
旭ダイヤモンド工業	43,900	785.00	34,461,500	
D M G 森精機	105,900	1,529.00	161,921,100	貸付有価証券 33,400株（9,700株）
ソディック	36,500	836.00	30,514,000	貸付有価証券

				16,900株(800株)
ディスコ	22,700	16,640.00	377,728,000	貸付有価証券 4,400株(400株)
日東工器	9,200	2,312.00	21,270,400	
日進工具	4,900	2,500.00	12,250,000	
パンチ工業	11,600	641.00	7,435,600	貸付有価証券 300株(200株)
富士ダイス	7,400	693.00	5,128,200	
豊和工業	9,200	884.00	8,132,800	貸付有価証券 200株
OKK	6,900	871.00	6,009,900	貸付有価証券 100株
東洋機械金属	12,000	608.00	7,296,000	
津田駒工業	3,600	1,966.00	7,077,600	貸付有価証券 900株
エンシュウ	4,300	1,243.00	5,344,900	貸付有価証券 1,700株
島精機製作所	23,100	3,710.00	85,701,000	貸付有価証券 9,100株(3,900株)
オプトラ	16,300	2,150.00	35,045,000	貸付有価証券 7,700株
NCホールディングス	5,400	484.00	2,613,600	
フリー	13,400	1,038.00	13,909,200	貸付有価証券 100株
ヤマシンフィルタ	29,100	684.00	19,904,400	貸付有価証券 13,600株(5,200株)
日阪製作所	20,600	894.00	18,416,400	
やまびこ	32,500	1,056.00	34,320,000	
平田機工	7,900	6,800.00	53,720,000	貸付有価証券 3,500株(700株)
ペガサスミシン製造	15,700	658.00	10,330,600	貸付有価証券 1,800株
マルマエ	4,600	732.00	3,367,200	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
タツモ	5,200	786.00	4,087,200	貸付有価証券 1,900株(100株)
ナプテスコ	92,100	3,145.00	289,654,500	貸付有価証券 25,600株
三井海洋開発	17,800	3,105.00	55,269,000	貸付有価証券 200株
レオン自動機	16,400	1,586.00	26,010,400	貸付有価証券

				4,100株(700株)
S M C	49,600	39,250.00	1,946,800,000	貸付有価証券 100株
新川	12,600	533.00	6,715,800	貸付有価証券 4,700株(500株)
ホソカワミクロン	5,900	4,845.00	28,585,500	
ユニオンツール	7,300	3,100.00	22,630,000	貸付有価証券 100株
オイレス工業	23,400	1,947.00	45,559,800	
日精エー・エス・ピー機 械	4,800	4,010.00	19,248,000	貸付有価証券 2,200株
サトーホールディングス	20,200	2,696.00	54,459,200	
技研製作所	11,700	3,280.00	38,376,000	貸付有価証券 5,400株
日本エアージェット	5,300	591.00	3,132,300	貸付有価証券 100株
カワタ	3,400	1,336.00	4,542,400	貸付有価証券 300株
日精樹脂工業	14,000	938.00	13,132,000	
オカダアイヨン	5,700	1,486.00	8,470,200	貸付有価証券 1,500株
ワイエイシーホールディ ングス	6,700	816.00	5,467,200	貸付有価証券 2,300株
小松製作所	766,500	2,764.50	2,118,989,250	貸付有価証券 173,100株
住友重機械工業	96,900	3,805.00	368,704,500	
日立建機	67,800	2,882.00	195,399,600	
日工	4,600	2,228.00	10,248,800	
巴工業	7,200	2,403.00	17,301,600	
井関農機	16,900	1,684.00	28,459,600	貸付有価証券 100株
T O W A	14,500	707.00	10,251,500	貸付有価証券 4,300株
丸山製作所	3,700	1,310.00	4,847,000	
北川鉄工所	7,600	2,438.00	18,528,800	
ローツェ	7,400	1,782.00	13,186,800	貸付有価証券 3,400株
タカキタ	5,900	617.00	3,640,300	貸付有価証券 2,300株
クボタ	906,900	1,532.50	1,389,824,250	貸付有価証券

				241,600株
荏原実業	4,900	2,194.00	10,750,600	
三菱化工機	5,800	1,559.00	9,042,200	
月島機械	33,600	1,412.00	47,443,200	
帝国電機製作所	11,800	1,240.00	14,632,000	
東京機械製作所	6,600	413.00	2,725,800	貸付有価証券 1,900株
新東工業	40,200	1,017.00	40,883,400	
澁谷工業	14,800	3,315.00	49,062,000	貸付有価証券 1,300株
アイチ コーポレーショ ン	29,200	716.00	20,907,200	貸付有価証券 2,200株(2,100株)
小森コーポレーション	45,800	1,180.00	54,044,000	
鶴見製作所	13,200	1,803.00	23,799,600	貸付有価証券 100株
住友精密工業	2,800	2,893.00	8,100,400	
酒井重工業	3,200	2,407.00	7,702,400	貸付有価証券 1,000株
荏原製作所	75,000	3,170.00	237,750,000	
石井鐵工所	2,600	1,809.00	4,703,400	
西島製作所	17,300	956.00	16,538,800	
北越工業	17,400	1,196.00	20,810,400	
ダイキン工業	231,100	12,090.00	2,793,999,000	貸付有価証券 3,500株
オルガノ	6,100	3,090.00	18,849,000	
トーヨーカネツ	6,400	2,412.00	15,436,800	貸付有価証券 1,100株
栗田工業	91,600	2,979.00	272,876,400	貸付有価証券 100株
椿本チエイン	22,100	4,125.00	91,162,500	
大同工業	8,000	920.00	7,360,000	貸付有価証券 400株
木村化工機	14,100	381.00	5,372,100	
アネスト岩田	26,300	1,067.00	28,062,100	
ダイフク	93,200	5,790.00	539,628,000	貸付有価証券 11,900株(100株)
サムコ	4,600	953.00	4,383,800	
加藤製作所	8,600	2,681.00	23,056,600	貸付有価証券 500株
油研工業	2,800	1,917.00	5,367,600	

タダノ	81,700	1,208.00	98,693,600	貸付有価証券 2,900株
フジテック	61,500	1,213.00	74,599,500	貸付有価証券 500株
C K D	47,100	1,094.00	51,527,400	
キトー	12,800	1,880.00	24,064,000	
平和	47,200	2,211.00	104,359,200	貸付有価証券 100株
理想科学工業	14,900	1,873.00	27,907,700	
S A N K Y O	42,400	4,070.00	172,568,000	
日本金銭機械	18,700	1,094.00	20,457,800	貸付有価証券 900株（900株）
マースグループホールディングス	10,700	2,171.00	23,229,700	
福島工業	10,400	3,925.00	40,820,000	
オーイズミ	7,100	356.00	2,527,600	
ダイコク電機	7,800	1,498.00	11,684,400	
竹内製作所	28,300	2,031.00	57,477,300	貸付有価証券 200株
アマノ	48,300	2,411.00	116,451,300	貸付有価証券 100株
J U K I	23,600	1,302.00	30,727,200	貸付有価証券 100株
サンデンホールディングス	20,700	851.00	17,615,700	貸付有価証券 2,700株
蛇の目ミシン工業	15,400	489.00	7,530,600	
マックス	26,000	1,479.00	38,454,000	
グローリー	46,900	2,700.00	126,630,000	貸付有価証券 100株
新晃工業	15,700	1,542.00	24,209,400	
大和冷機工業	24,500	1,248.00	30,576,000	
セガサミーホールディングス	167,900	1,291.00	216,758,900	貸付有価証券 300株
日本ピストンリング	6,200	1,725.00	10,695,000	
リケン	7,800	5,190.00	40,482,000	
T P R	22,800	2,469.00	56,293,200	
ツバキ・ナカシマ	25,600	1,933.00	49,484,800	貸付有価証券 200株
ホシザキ	49,500	7,350.00	363,825,000	貸付有価証券 100株

大豊工業	13,800	1,048.00	14,462,400	
日本精工	347,700	1,055.00	366,823,500	貸付有価証券 2,800株
NTN	363,800	353.00	128,421,400	貸付有価証券 53,100株
ジェイテクト	162,400	1,413.00	229,471,200	
不二越	15,700	4,470.00	70,179,000	貸付有価証券 4,000株
日本トムソン	50,200	584.00	29,316,800	貸付有価証券 1,300株
THK	105,500	2,873.00	303,101,500	貸付有価証券 300株
ユースン精機	13,100	1,053.00	13,794,300	貸付有価証券 2,800株
前澤給装工業	6,600	1,879.00	12,401,400	
イーグル工業	20,900	1,311.00	27,399,900	
前澤工業	11,300	358.00	4,045,400	
日本ピラー工業	17,100	1,425.00	24,367,500	
キッツ	68,600	881.00	60,436,600	貸付有価証券 600株
マキタ	206,000	4,025.00	829,150,000	貸付有価証券 1,200株
日立造船	134,200	358.00	48,043,600	貸付有価証券 39,800株（13,100株）
三菱重工業	283,700	4,307.00	1,221,895,900	貸付有価証券 100株
IHI	130,100	3,280.00	426,728,000	
スター精密	28,900	1,661.00	48,002,900	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
日清紡ホールディングス	94,000	956.00	89,864,000	貸付有価証券 3,400株
イビデン	103,600	1,567.00	162,341,200	貸付有価証券 600株
コニカミノルタ	369,900	1,079.00	399,122,100	
ブラザー工業	220,500	2,125.00	468,562,500	貸付有価証券 200株
ミネベアミツミ	314,200	1,811.00	569,016,200	貸付有価証券 7,500株
日立製作所	762,100	3,512.00	2,676,495,200	貸付有価証券 60,600株
三菱電機	1,692,800	1,444.50	2,445,249,600	貸付有価証券

				4,400株
富士電機	109,900	3,440.00	378,056,000	
東洋電機製造	6,700	1,328.00	8,897,600	貸付有価証券 400株
安川電機	196,200	3,265.00	640,593,000	貸付有価証券 44,600株
シンフォニアテクノロジー	23,500	1,419.00	33,346,500	
明電舎	33,500	1,638.00	54,873,000	
オリジン電気	4,600	2,311.00	10,630,600	
山洋電気	8,200	4,115.00	33,743,000	貸付有価証券 800株
デンヨー	15,600	1,426.00	22,245,600	
東芝テック	21,200	2,958.00	62,709,600	貸付有価証券 4,300株(4,200株)
芝浦メカトロニクス	3,000	3,485.00	10,455,000	
マブチモーター	46,800	3,865.00	180,882,000	貸付有価証券 1,100株
日本電産	203,700	13,540.00	2,758,098,000	貸付有価証券 3,100株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,100	1,844.00	16,780,400	貸付有価証券 3,000株
トレックス・セミコンダクター	5,700	1,152.00	6,566,400	貸付有価証券 1,400株
東光高岳	8,600	1,432.00	12,315,200	
ダブル・スコープ	24,700	1,314.00	32,455,800	貸付有価証券 6,000株(100株)
ダイヘン	18,500	2,805.00	51,892,500	貸付有価証券 600株
ヤーマン	24,500	1,358.00	33,271,000	貸付有価証券 11,500株(300株)
JVCケンウッド	129,300	266.00	34,393,800	貸付有価証券 100株
ミマキエンジニアリング	15,200	790.00	12,008,000	貸付有価証券 200株
第一精工	7,000	1,143.00	8,001,000	貸付有価証券 800株
日新電機	39,700	1,026.00	40,732,200	貸付有価証券 8,700株
大崎電気工業	33,700	717.00	24,162,900	
オムロン	179,900	4,935.00	887,806,500	

日東工業	27,100	2,268.00	61,462,800	
I D E C	22,700	2,071.00	47,011,700	
正興電機製作所	3,000	828.00	2,484,000	貸付有価証券 300株
不二電機工業	1,800	1,294.00	2,329,200	貸付有価証券 400株
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	60,900	2,268.00	138,121,200	貸付有価証券 1,900株
サクサホールディングス	4,300	1,845.00	7,933,500	貸付有価証券 500株
メルコホールディングス	7,000	4,010.00	28,070,000	
テクノメディカ	3,800	2,124.00	8,071,200	
日本電気	219,000	3,740.00	819,060,000	
富士通	163,200	7,741.00	1,263,331,200	
沖電気工業	73,300	1,304.00	95,583,200	貸付有価証券 1,400株
岩崎通信機	7,900	808.00	6,383,200	
電気興業	8,900	2,661.00	23,682,900	
サンケン電気	19,800	2,274.00	45,025,200	貸付有価証券 1,500株
ナカヨ	3,300	1,393.00	4,596,900	
アイホン	9,600	1,748.00	16,780,800	
ルネサスエレクトロニク ス	175,400	723.00	126,814,200	貸付有価証券 70,400株
セイコーエプソン	210,000	1,675.00	351,750,000	貸付有価証券 200株
ワコム	122,500	493.00	60,392,500	貸付有価証券 100株
アルバック	33,700	3,225.00	108,682,500	貸付有価証券 100株
アクセル	7,100	518.00	3,677,800	
E I Z O	15,500	4,745.00	73,547,500	
ジャパンディスプレイ	400,200	73.00	29,214,600	貸付有価証券 188,400株（10,100 株）
日本信号	43,100	992.00	42,755,200	貸付有価証券 100株
京三製作所	36,300	407.00	14,774,100	
能美防災	22,400	2,037.00	45,628,800	
ホーチキ	10,700	1,120.00	11,984,000	

星和電機	6,800	413.00	2,808,400	貸付有価証券 600株
エレコム	15,600	3,355.00	52,338,000	
パナソニック	1,933,900	1,042.00	2,015,123,800	
シャープ	167,900	1,325.00	222,467,500	貸付有価証券 48,700株（8,000株）
アンリツ	108,900	2,201.00	239,688,900	貸付有価証券 100株
富士通ゼネラル	51,700	1,486.00	76,826,200	貸付有価証券 4,800株（2,800株）
ソニー	1,135,300	5,080.00	5,767,324,000	
T D K	88,500	8,830.00	781,455,000	貸付有価証券 2,800株
帝国通信工業	7,500	1,226.00	9,195,000	
タムラ製作所	65,300	608.00	39,702,400	貸付有価証券 11,800株
アルプスアルパイン	176,200	2,346.00	413,365,200	
池上通信機	5,400	1,191.00	6,431,400	貸付有価証券 1,300株
パイオニア	282,100	66.00	18,618,600	貸付有価証券 23,600株
日本電波工業	15,300	373.00	5,706,900	貸付有価証券 6,400株（200株）
鈴木	9,100	652.00	5,933,200	貸付有価証券 1,300株
日本トリム	3,200	5,570.00	17,824,000	
ローランド ディー ジー	8,600	2,311.00	19,874,600	
フォスター電機	19,800	1,636.00	32,392,800	
クラリオン	14,900	2,500.00	37,250,000	貸付有価証券 2,200株（600株）
S M K	4,700	2,688.00	12,633,600	貸付有価証券 2,200株
ヨコオ	12,100	1,632.00	19,747,200	貸付有価証券 4,600株
ティアック	12,200	202.00	2,464,400	貸付有価証券 5,100株（300株）
ホシデン	49,800	917.00	45,666,600	
ヒロセ電機	24,300	11,990.00	291,357,000	貸付有価証券 1,400株
日本航空電子工業	38,800	1,499.00	58,161,200	貸付有価証券

				3,100株
TOA	18,200	1,064.00	19,364,800	
マクセルホールディングス	36,400	1,676.00	61,006,400	貸付有価証券 100株
古野電気	21,800	944.00	20,579,200	貸付有価証券 10,200株(6,400株)
ユニデンホールディングス	5,000	2,350.00	11,750,000	貸付有価証券 400株
スミダコーポレーション	14,400	1,497.00	21,556,800	貸付有価証券 2,200株
アイコム	9,400	2,175.00	20,445,000	
リオン	7,800	1,909.00	14,890,200	
本多通信工業	14,500	556.00	8,062,000	貸付有価証券 6,200株
船井電機	17,100	719.00	12,294,900	貸付有価証券 6,200株(600株)
横河電機	169,400	2,142.00	362,854,800	
新電元工業	6,000	4,670.00	28,020,000	
アズビル	109,300	2,436.00	266,254,800	
東亜ディーケーケー	8,400	826.00	6,938,400	
日本光電工業	74,600	3,470.00	258,862,000	
チノー	5,800	1,297.00	7,522,600	
共和電業	17,700	370.00	6,549,000	
日本電子材料	6,700	723.00	4,844,100	貸付有価証券 3,100株
堀場製作所	33,500	6,060.00	203,010,000	貸付有価証券 500株
アドバンテスト	115,400	2,711.00	312,849,400	貸付有価証券 1,500株(200株)
小野測器	7,900	611.00	4,826,900	
エスベック	15,000	2,062.00	30,930,000	
キーエンス	83,100	62,500.00	5,193,750,000	
日置電機	8,800	4,540.00	39,952,000	貸付有価証券 100株
シスメックス	131,900	6,670.00	879,773,000	貸付有価証券 800株
日本マイクロニクス	27,300	829.00	22,631,700	貸付有価証券 11,100株
メガチップス	13,300	2,281.00	30,337,300	貸付有価証券 6,200株

OBARA GROUP	9,900	4,095.00	40,540,500	
澤藤電機	2,000	1,598.00	3,196,000	
原田工業	5,100	965.00	4,921,500	貸付有価証券 2,300株
コーセル	21,500	1,169.00	25,133,500	貸付有価証券 8,400株
イリソ電子工業	15,500	4,945.00	76,647,500	貸付有価証券 300株
オブテックスグループ	29,700	2,240.00	66,528,000	貸付有価証券 10,400株（1,600株）
千代田インテグレ	7,100	2,143.00	15,215,300	
アイ・オー・データ機器	6,200	1,207.00	7,483,400	
レーザーテック	34,700	4,345.00	150,771,500	貸付有価証券 3,700株
スタンレー電気	119,700	3,270.00	391,419,000	貸付有価証券 500株
岩崎電気	6,600	1,375.00	9,075,000	
ウシオ電機	102,700	1,314.00	134,947,800	貸付有価証券 2,500株
岡谷電機産業	12,000	380.00	4,560,000	貸付有価証券 4,000株（500株）
ヘリオス テクノ ホールディング	15,600	708.00	11,044,800	貸付有価証券 3,200株
エノモト	3,500	891.00	3,118,500	
日本セラミック	17,200	2,741.00	47,145,200	
遠藤照明	8,500	729.00	6,196,500	
古河電池	12,100	736.00	8,905,600	貸付有価証券 4,300株
双信電機	8,200	446.00	3,657,200	貸付有価証券 3,800株（2,300株）
山一電機	12,300	1,218.00	14,981,400	貸付有価証券 3,300株（700株）
図研	11,000	1,627.00	17,897,000	
日本電子	33,400	1,774.00	59,251,600	
カシオ計算機	149,700	1,537.00	230,088,900	貸付有価証券 10,000株
ファナック	160,900	19,400.00	3,121,460,000	
日本シイエムケイ	43,100	713.00	30,730,300	貸付有価証券 6,200株
エンプラス	7,700	3,100.00	23,870,000	貸付有価証券

				300株
大真空	6,200	906.00	5,617,200	貸付有価証券 100株
ローム	81,800	7,770.00	635,586,000	
浜松ホトニクス	121,400	4,080.00	495,312,000	
三井ハイテック	18,700	1,058.00	19,784,600	貸付有価証券 4,800株
新光電気工業	56,800	860.00	48,848,000	
京セラ	258,000	6,246.00	1,611,468,000	
太陽誘電	75,300	2,384.00	179,515,200	貸付有価証券 1,700株
村田製作所	177,600	17,285.00	3,069,816,000	
ユーシン	26,600	983.00	26,147,800	貸付有価証券 1,300株
双葉電子工業	27,700	1,761.00	48,779,700	
北陸電気工業	6,300	1,063.00	6,696,900	貸付有価証券 100株
ニチコン	53,300	1,016.00	54,152,800	貸付有価証券 300株
日本ケミコン	12,000	2,162.00	25,944,000	
K O A	25,500	1,632.00	41,616,000	
市光工業	25,300	670.00	16,951,000	貸付有価証券 300株
小糸製作所	101,400	6,710.00	680,394,000	貸付有価証券 3,500株
ミツバ	31,100	725.00	22,547,500	
S C R E E Nホールディングス	29,400	4,750.00	139,650,000	貸付有価証券 700株
キャノン電子	15,500	1,871.00	29,000,500	
キャノン	911,300	3,198.00	2,914,337,400	貸付有価証券 254,900株
リコー	509,000	1,116.00	568,044,000	貸付有価証券 3,700株
象印マホービン	31,500	1,179.00	37,138,500	貸付有価証券 14,000株
M U T O Hホールディングス	2,300	1,826.00	4,199,800	
東京エレクトロン	112,900	15,895.00	1,794,545,500	
トヨタ紡織	59,200	1,825.00	108,040,000	
芦森工業	3,500	1,719.00	6,016,500	貸付有価証券

				1,200株
ユニプレス	32,800	2,067.00	67,797,600	
豊田自動織機	137,000	5,590.00	765,830,000	貸付有価証券 6,600株
モリタホールディングス	29,600	1,817.00	53,783,200	貸付有価証券 200株
三櫻工業	21,500	572.00	12,298,000	
デンソー	372,700	4,801.00	1,789,332,700	
東海理化電機製作所	44,600	2,017.00	89,958,200	
三井E & Sホールディングス	61,100	1,211.00	73,992,100	貸付有価証券 3,500株
川崎重工業	131,700	2,855.00	376,003,500	
名村造船所	50,800	444.00	22,555,200	貸付有価証券 10,700株(500株)
サノヤスホールディングス	22,300	180.00	4,014,000	貸付有価証券 8,200株
日本車輛製造	6,200	2,600.00	16,120,000	貸付有価証券 2,600株
三菱ロジスネクスト	20,100	1,389.00	27,918,900	
近畿車輛	2,500	2,049.00	5,122,500	貸付有価証券 300株
日産自動車	1,996,500	948.10	1,892,881,650	
いすゞ自動車	535,100	1,579.00	844,922,900	
トヨタ自動車	1,886,400	6,655.00	12,553,992,000	
日野自動車	211,400	1,032.00	218,164,800	
三菱自動車工業	626,600	640.00	401,024,000	
エフテック	11,800	1,041.00	12,283,800	
レシップホールディングス	6,100	729.00	4,446,900	
GMB	3,300	945.00	3,118,500	
ファルテック	3,000	886.00	2,658,000	
武蔵精密工業	41,100	1,553.00	63,828,300	貸付有価証券 5,000株
日産車体	33,100	995.00	32,934,500	貸付有価証券 100株
新明和工業	76,000	1,388.00	105,488,000	貸付有価証券 35,700株(6,400株)
極東開発工業	33,700	1,528.00	51,493,600	
日信工業	31,000	1,584.00	49,104,000	貸付有価証券 400株

トピー工業	13,900	2,398.00	33,332,200	
ティラド	6,100	2,331.00	14,219,100	
タチエス	28,700	1,662.00	47,699,400	
N O K	91,000	1,824.00	165,984,000	貸付有価証券 36,100株(4,000株)
フタバ産業	47,100	609.00	28,683,900	貸付有価証券 100株
K Y B	17,600	3,135.00	55,176,000	貸付有価証券 1,700株
大同メタル工業	27,500	796.00	21,890,000	
プレス工業	83,900	631.00	52,940,900	貸付有価証券 200株
ミクニ	21,500	503.00	10,814,500	
太平洋工業	35,400	1,673.00	59,224,200	
ケーヒン	38,900	1,951.00	75,893,900	貸付有価証券 100株
河西工業	20,800	880.00	18,304,000	
アイシン精機	139,400	4,365.00	608,481,000	貸付有価証券 100株
マツダ	531,300	1,283.50	681,923,550	
今仙電機製作所	15,700	1,041.00	16,343,700	
本田技研工業	1,428,000	3,003.00	4,288,284,000	貸付有価証券 700株
スズキ	309,700	5,738.00	1,777,058,600	貸付有価証券 7,600株
S U B A R U	525,500	2,853.00	1,499,251,500	
安永	8,200	1,574.00	12,906,800	貸付有価証券 2,700株(1,000株)
ヤマハ発動機	239,100	2,231.00	533,432,100	貸付有価証券 20,600株
ショーワ	40,000	1,540.00	61,600,000	
T B K	20,100	418.00	8,401,800	
エクセディ	23,000	2,719.00	62,537,000	貸付有価証券 1,500株
豊田合成	54,700	2,440.00	133,468,000	
愛三工業	26,500	757.00	20,060,500	貸付有価証券 100株
盟和産業	2,600	1,070.00	2,782,000	
日本プラスト	13,300	837.00	11,132,100	
ヨロズ	15,800	1,679.00	26,528,200	

エフ・シー・シー	30,400	2,631.00	79,982,400	
シマノ	68,200	16,840.00	1,148,488,000	貸付有価証券 9,900株
テイ・エス テック	39,300	3,350.00	131,655,000	
ジャムコ	8,500	2,579.00	21,921,500	貸付有価証券 2,700株
テルモ	239,500	6,699.00	1,604,410,500	貸付有価証券 18,400株
クリエートメディック	5,600	1,013.00	5,672,800	
日機装	54,700	1,139.00	62,303,300	貸付有価証券 1,700株
島津製作所	217,800	2,774.00	604,177,200	
JMS	15,600	659.00	10,280,400	
クボテック	3,600	360.00	1,296,000	貸付有価証券 1,700株
長野計器	13,300	791.00	10,520,300	
ブイ・テクノロジー	4,000	14,720.00	58,880,000	貸付有価証券 100株
東京計器	10,800	1,081.00	11,674,800	貸付有価証券 300株
愛知時計電機	2,200	3,815.00	8,393,000	
インターアクション	7,900	1,811.00	14,306,900	
オーバル	16,500	247.00	4,075,500	
東京精密	30,600	3,090.00	94,554,000	
マニー	20,600	4,985.00	102,691,000	
ニコン	295,000	1,754.00	517,430,000	
トプコン	90,900	1,533.00	139,349,700	貸付有価証券 100株
オリンパス	252,200	4,775.00	1,204,255,000	
理研計器	14,900	2,246.00	33,465,400	
タムロン	15,000	2,015.00	30,225,000	
H O Y A	340,800	6,790.00	2,314,032,000	貸付有価証券 300株
シード	7,200	1,281.00	9,223,200	貸付有価証券 2,800株
ノーリツ鋼機	13,300	2,151.00	28,608,300	貸付有価証券 1,700株（100株）
エー・アンド・デイ	15,400	747.00	11,503,800	
朝日インテック	71,800	5,440.00	390,592,000	貸付有価証券

				17,000株
シチズン時計	185,200	631.00	116,861,200	貸付有価証券 13,400株
リズム時計工業	5,700	1,649.00	9,399,300	
大研医器	13,400	590.00	7,906,000	貸付有価証券 2,800株
メニコン	23,200	2,949.00	68,416,800	
シンシア	2,500	474.00	1,185,000	貸付有価証券 1,000株
松風	8,300	1,272.00	10,557,600	
セイコーホールディングス	26,100	2,570.00	67,077,000	
ニプロ	117,100	1,487.00	174,127,700	貸付有価証券 600株
中本パックス	4,700	1,685.00	7,919,500	貸付有価証券 2,100株
スノーピーク	6,500	1,354.00	8,801,000	貸付有価証券 2,000株(1,000株)
パラマウントベッドホールディングス	19,500	5,120.00	99,840,000	
トランザクション	9,200	705.00	6,486,000	貸付有価証券 1,300株
S H O - B I	4,900	361.00	1,768,900	貸付有価証券 1,300株
ニホンフラッシュ	7,200	2,058.00	14,817,600	貸付有価証券 100株
前田工織	18,600	2,809.00	52,247,400	貸付有価証券 100株
永大産業	22,100	447.00	9,878,700	
アートネイチャー	18,100	632.00	11,439,200	
バンダイナムコホールディングス	175,000	4,845.00	847,875,000	貸付有価証券 400株
アイフィスジャパン	3,800	590.00	2,242,000	
共立印刷	28,100	227.00	6,378,700	
S H O E I	8,100	4,160.00	33,696,000	
フランスベッドホールディングス	23,900	878.00	20,984,200	
パイロットコーポレーション	29,500	5,270.00	155,465,000	
萩原工業	9,400	1,732.00	16,280,800	
トッパン・フォームズ	36,300	969.00	35,174,700	貸付有価証券

				200株
フジシールインターナショナル	37,900	4,140.00	156,906,000	貸付有価証券 2,400株
タカラトミー	70,900	1,117.00	79,195,300	貸付有価証券 8,500株(6,300株)
廣済堂	15,700	709.00	11,131,300	貸付有価証券 1,300株(200株)
エステールホールディングス	4,500	677.00	3,046,500	
アーク	64,600	95.00	6,137,000	貸付有価証券 3,000株
タカノ	6,600	841.00	5,550,600	
プロネクサス	14,500	1,230.00	17,835,000	
ホクシン	10,400	143.00	1,487,200	貸付有価証券 1,300株
ウッドワン	5,700	1,133.00	6,458,100	
大建工業	12,800	1,962.00	25,113,600	
凸版印刷	238,900	1,745.00	416,880,500	
大日本印刷	238,600	2,520.00	601,272,000	貸付有価証券 100株
図書印刷	15,900	940.00	14,946,000	
共同印刷	5,200	2,544.00	13,228,800	
N I S S H A	34,700	1,429.00	49,586,300	貸付有価証券 15,800株(4,400株)
光村印刷	1,500	2,190.00	3,285,000	
宝印刷	8,200	1,657.00	13,587,400	貸付有価証券 200株
アシックス	168,100	1,519.00	255,343,900	貸付有価証券 1,000株
ツツミ	5,300	1,970.00	10,441,000	
小松ウオール工業	5,200	1,898.00	9,869,600	
ヤマハ	100,700	5,290.00	532,703,000	貸付有価証券 1,800株
河合楽器製作所	5,200	3,305.00	17,186,000	
クリナップ	15,700	624.00	9,796,800	
ビジョン	102,300	4,755.00	486,436,500	貸付有価証券 38,000株(12,200株)
兼松サステック	1,100	1,572.00	1,729,200	
キングジム	14,100	817.00	11,519,700	
リンテック	40,200	2,526.00	101,545,200	

イトーキ	31,200	585.00	18,252,000	貸付有価証券 200株
任天堂	104,200	29,675.00	3,092,135,000	
三菱鉛筆	27,900	2,298.00	64,114,200	
タカスタンダード	35,000	1,719.00	60,165,000	
コクヨ	81,200	1,608.00	130,569,600	貸付有価証券 100株
ナカバヤシ	16,600	538.00	8,930,800	
グロープライド	8,200	2,837.00	23,263,400	
オカムラ	59,100	1,343.00	79,371,300	貸付有価証券 100株
美津濃	16,800	2,602.00	43,713,600	
東京電力ホールディングス	1,351,400	654.00	883,815,600	貸付有価証券 124,800株(14,000株)
中部電力	517,900	1,707.50	884,314,250	貸付有価証券 8,500株
関西電力	690,700	1,595.00	1,101,666,500	貸付有価証券 600株
中国電力	234,000	1,470.00	343,980,000	貸付有価証券 78,100株(48,000株)
北陸電力	165,800	892.00	147,893,600	貸付有価証券 2,900株
東北電力	396,500	1,441.00	571,356,500	貸付有価証券 400株
四国電力	152,400	1,450.00	220,980,000	貸付有価証券 3,200株
九州電力	348,900	1,320.00	460,548,000	貸付有価証券 13,200株
北海道電力	158,400	805.00	127,512,000	
沖縄電力	31,300	2,063.00	64,571,900	
電源開発	134,700	2,797.00	376,755,900	貸付有価証券 100株
エフオン	8,000	859.00	6,872,000	
イーレックス	29,400	791.00	23,255,400	貸付有価証券 13,300株(400株)
レノバ	20,700	1,028.00	21,279,600	貸付有価証券 5,400株(300株)
東京瓦斯	332,100	2,985.00	991,318,500	貸付有価証券 300株
大阪瓦斯	328,500	2,209.00	725,656,500	

東邦瓦斯	83,800	4,805.00	402,659,000	貸付有価証券 300株
北海道瓦斯	9,100	1,452.00	13,213,200	
広島ガス	34,800	346.00	12,040,800	
西部瓦斯	19,100	2,495.00	47,654,500	
静岡ガス	52,100	900.00	46,890,000	貸付有価証券 100株
メタウォーター	8,200	3,135.00	25,707,000	
S B S ホールディングス	16,700	1,973.00	32,949,100	貸付有価証券 700株
東武鉄道	178,500	3,090.00	551,565,000	
相鉄ホールディングス	58,000	3,260.00	189,080,000	
東京急行電鉄	459,800	1,810.00	832,238,000	
京浜急行電鉄	231,900	1,814.00	420,666,600	貸付有価証券 8,900株
小田急電鉄	271,100	2,457.00	666,092,700	貸付有価証券 14,800株(11,500株)
京王電鉄	94,600	6,250.00	591,250,000	貸付有価証券 200株
京成電鉄	126,900	3,715.00	471,433,500	
富士急行	23,100	3,925.00	90,667,500	貸付有価証券 7,700株
新京成電鉄	4,300	2,099.00	9,025,700	
東日本旅客鉄道	301,000	10,380.00	3,124,380,000	貸付有価証券 13,800株
西日本旅客鉄道	151,700	8,079.00	1,225,584,300	
東海旅客鉄道	151,600	24,080.00	3,650,528,000	貸付有価証券 4,100株
西武ホールディングス	215,800	1,965.00	424,047,000	
鴻池運輸	26,900	1,773.00	47,693,700	
西日本鉄道	46,900	2,677.00	125,551,300	貸付有価証券 500株
ハマキョウレックス	13,000	4,190.00	54,470,000	
サカイ引越センター	8,900	6,490.00	57,761,000	貸付有価証券 3,100株
近鉄グループホールディングス	160,300	4,860.00	779,058,000	
阪急阪神ホールディングス	213,800	4,035.00	862,683,000	貸付有価証券 200株
南海電気鉄道	71,500	2,946.00	210,639,000	

京阪ホールディングス	71,400	4,540.00	324,156,000	貸付有価証券 100株
神戸電鉄	4,100	3,945.00	16,174,500	貸付有価証券 1,900株
名古屋鉄道	128,400	3,015.00	387,126,000	貸付有価証券 3,200株
山陽電気鉄道	12,300	2,188.00	26,912,400	
日本通運	62,900	6,690.00	420,801,000	
ヤマトホールディングス	281,000	2,948.00	828,388,000	貸付有価証券 200株
山九	44,600	5,410.00	241,286,000	
丸運	9,100	309.00	2,811,900	
丸全昭和運輸	13,000	2,796.00	36,348,000	
センコーグループホールディングス	88,400	914.00	80,797,600	貸付有価証券 8,000株
トナミホールディングス	3,800	6,520.00	24,776,000	
ニッコンホールディングス	61,000	2,849.00	173,789,000	
日本石油輸送	1,900	2,923.00	5,553,700	
福山通運	20,500	4,390.00	89,995,000	
セイノーホールディングス	120,100	1,547.00	185,794,700	貸付有価証券 200株
エスライン	4,800	1,155.00	5,544,000	
神奈川中央交通	4,000	3,715.00	14,860,000	
日立物流	35,200	3,195.00	112,464,000	
丸和運輸機関	8,400	3,535.00	29,694,000	貸付有価証券 200株
C & F ロジホールディングス	16,200	1,272.00	20,606,400	
九州旅客鉄道	134,500	3,700.00	497,650,000	
S Gホールディングス	151,500	3,080.00	466,620,000	貸付有価証券 1,400株
日本郵船	134,100	1,797.00	240,977,700	
商船三井	95,100	2,634.00	250,493,400	
川崎汽船	49,400	1,600.00	79,040,000	貸付有価証券 23,200株(400株)
N S ユナイテッド海運	8,800	2,644.00	23,267,200	貸付有価証券 500株
明治海運	17,000	350.00	5,950,000	
飯野海運	75,900	405.00	30,739,500	貸付有価証券

				300株
共栄タンカー	1,400	1,541.00	2,157,400	
乾汽船	14,400	717.00	10,324,800	
日本航空	293,500	4,040.00	1,185,740,000	
A N Aホールディングス	293,100	4,092.00	1,199,365,200	貸付有価証券 3,000株
パスコ	3,100	921.00	2,855,100	
トランコム	4,500	6,880.00	30,960,000	
日新	13,900	1,965.00	27,313,500	
三菱倉庫	55,500	2,724.00	151,182,000	貸付有価証券 9,000株
三井倉庫ホールディングス	19,600	1,992.00	39,043,200	
住友倉庫	60,300	1,445.00	87,133,500	貸付有価証券 100株
澁澤倉庫	8,800	1,616.00	14,220,800	
東陽倉庫	28,900	321.00	9,276,900	
日本トランスシティ	35,300	439.00	15,496,700	
ケイヒン	3,100	1,379.00	4,274,900	
中央倉庫	9,800	1,049.00	10,280,200	
川西倉庫	3,300	1,225.00	4,042,500	
安田倉庫	13,200	910.00	12,012,000	
ファイズ	2,100	832.00	1,747,200	貸付有価証券 500株
東洋埠頭	4,900	1,479.00	7,247,100	
宇徳	13,700	543.00	7,439,100	
上組	98,900	2,546.00	251,799,400	貸付有価証券 100株
サンリツ	3,800	702.00	2,667,600	
キムラユニティー	4,300	1,112.00	4,781,600	
キューソー流通システム	4,000	2,020.00	8,080,000	
近鉄エクスプレス	30,300	1,833.00	55,539,900	
東海運	9,100	279.00	2,538,900	
エーアイティー	10,400	1,074.00	11,169,600	
内外トランスライン	5,100	1,500.00	7,650,000	
日本コンセプト	4,400	1,063.00	4,677,200	
N E C ネットスアイ	18,300	2,495.00	45,658,500	
クロスキャット	3,300	1,006.00	3,319,800	貸付有価証券

				800株
システナ	59,200	1,132.00	67,014,400	
デジタルアーツ	8,900	8,530.00	75,917,000	貸付有価証券 3,000株(2,600株)
新日鉄住金ソリューションズ	24,900	3,020.00	75,198,000	
キューブシステム	8,800	893.00	7,858,400	
エイジア	3,200	1,351.00	4,323,200	
コア	7,000	1,376.00	9,632,000	貸付有価証券 200株
ソリトンシステムズ	9,300	1,005.00	9,346,500	貸付有価証券 4,200株(100株)
ソフトクリエイティブホールディングス	7,200	1,495.00	10,764,000	
T I S	55,400	5,240.00	290,296,000	
ネオス	6,100	974.00	5,941,400	貸付有価証券 2,800株
電算システム	6,300	2,437.00	15,353,100	
グリー	114,600	467.00	53,518,200	貸付有価証券 200株
コーエーテクモホールディングス	34,000	1,848.00	62,832,000	
三菱総合研究所	6,500	3,300.00	21,450,000	
ボルテージ	3,000	588.00	1,764,000	貸付有価証券 900株
電算	1,800	2,174.00	3,913,200	
A G S	9,400	696.00	6,542,400	貸付有価証券 800株
ファインデックス	14,000	746.00	10,444,000	貸付有価証券 3,300株(2,900株)
ヒト・コミュニケーションズ	3,800	1,636.00	6,216,800	
ブレインパッド	3,200	5,050.00	16,160,000	貸付有価証券 1,500株
K L a b	29,700	819.00	24,324,300	貸付有価証券 13,900株(900株)
ポルトウウィン・ピットクルーホールディ	22,000	894.00	19,668,000	
イーブックイニシアティブジャパン	2,600	1,550.00	4,030,000	貸付有価証券 1,200株
ネクソン	423,000	1,652.00	698,796,000	貸付有価証券

				5,000株
アイスタイル	42,500	650.00	27,625,000	貸付有価証券 19,900株(900株)
エムアップ	5,700	2,232.00	12,722,400	貸付有価証券 1,900株(1,800株)
エイチーム	10,400	1,922.00	19,988,800	貸付有価証券 3,700株
テクノスジャパン	13,900	783.00	10,883,700	貸付有価証券 2,700株
e n i s h	5,700	470.00	2,679,000	貸付有価証券 2,600株(300株)
コロプラ	47,400	706.00	33,464,400	貸付有価証券 4,200株(2,900株)
オルトプラス	10,200	317.00	3,233,400	貸付有価証券 4,200株(100株)
ブロードリーフ	82,300	571.00	46,993,300	貸付有価証券 200株(200株)
クロス・マーケティング グループ	4,600	421.00	1,936,600	貸付有価証券 2,000株
デジタルハーツホール ディングス	7,500	1,358.00	10,185,000	貸付有価証券 3,500株(900株)
メディアドゥホールディ ングス	5,100	2,308.00	11,770,800	貸付有価証券 2,000株(600株)
じげん	17,600	676.00	11,897,600	貸付有価証券 5,000株
ブイキューブ	8,900	395.00	3,515,500	貸付有価証券 600株(200株)
サイバーリンクス	2,500	978.00	2,445,000	
ディー・エル・イー	11,800	136.00	1,604,800	貸付有価証券 5,500株(1,700株)
フィックスターズ	15,900	1,282.00	20,383,800	貸付有価証券 7,400株(1,300株)
C A R T A H O L D I N G S	8,800	1,018.00	8,958,400	
オブティム	3,600	4,055.00	14,598,000	貸付有価証券 1,600株(500株)
セレス	5,400	1,809.00	9,768,600	貸付有価証券 2,100株(400株)
ベリサーブ	1,600	6,680.00	10,688,000	貸付有価証券 600株
ティーガイア	16,600	1,983.00	32,917,800	
セック	2,700	3,695.00	9,976,500	貸付有価証券

				900株
日本アジアグループ	17,500	383.00	6,702,500	
豆蔵ホールディングス	11,300	1,023.00	11,559,900	貸付有価証券 100株
テクマトリックス	11,700	1,843.00	21,563,100	
プロシッパ	4,800	1,365.00	6,552,000	貸付有価証券 100株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	400,300	307.00	122,892,100	貸付有価証券 169,500株
GMOペイメントゲート ウェイ	27,300	6,530.00	178,269,000	貸付有価証券 11,700株
ザッパラス	8,600	381.00	3,276,600	
システムリサーチ	2,200	3,025.00	6,655,000	
インターネットイニシア ティブ	27,000	2,551.00	68,877,000	
さくらインターネット	19,800	493.00	9,761,400	
ヴィンクス	5,600	1,123.00	6,288,800	貸付有価証券 1,500株
GMOクラウド	3,700	3,455.00	12,783,500	貸付有価証券 200株
SRAホールディングス	8,800	2,684.00	23,619,200	
Minorityソリューションズ	3,200	1,616.00	5,171,200	
システムインテグレータ	4,700	711.00	3,341,700	貸付有価証券 1,400株
朝日ネット	13,500	515.00	6,952,500	
eBASE	5,000	1,748.00	8,740,000	貸付有価証券 200株
アバント	5,900	1,398.00	8,248,200	貸付有価証券 400株
アドソル日進	5,900	1,641.00	9,681,900	
フリービット	9,800	982.00	9,623,600	貸付有価証券 4,600株(4,300株)
コムチュア	9,300	3,065.00	28,504,500	貸付有価証券 3,100株(2,900株)
サイバーコム	3,000	2,451.00	7,353,000	貸付有価証券 1,400株(200株)
アステリア	8,300	835.00	6,930,500	貸付有価証券 300株
マークライNZ	5,700	1,454.00	8,287,800	貸付有価証券 500株

メディカル・データ・ビジョン	14,700	1,042.00	15,317,400	貸付有価証券 6,300株（3,600株）
gumi	21,200	594.00	12,592,800	貸付有価証券 7,900株（2,400株）
ショーケース・ティービー	3,600	788.00	2,836,800	貸付有価証券 1,400株
モバイルファクトリー	4,600	1,562.00	7,185,200	貸付有価証券 1,900株（300株）
テラスカイ	1,000	3,750.00	3,750,000	
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,300	1,536.00	11,212,800	貸付有価証券 3,300株（800株）
PCIホールディングス	2,900	2,257.00	6,545,300	
パイブドHD	2,600	808.00	2,100,800	
アイビーシー	2,700	1,185.00	3,199,500	貸付有価証券 1,100株（100株）
ネオジャパン	3,100	1,036.00	3,211,600	貸付有価証券 1,400株
PR TIMES	1,100	2,332.00	2,565,200	貸付有価証券 500株
ランドコンピュータ	1,900	1,160.00	2,204,000	
ダブルスタンダード	1,100	4,665.00	5,131,500	貸付有価証券 500株
オープンドア	8,200	3,125.00	25,625,000	貸付有価証券 300株
マイネット	5,300	1,127.00	5,973,100	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
アカツキ	5,800	5,380.00	31,204,000	貸付有価証券 2,600株
ベネフィットジャパン	900	829.00	746,100	貸付有価証券 100株
Ubicomホールディングス	3,000	1,305.00	3,915,000	貸付有価証券 1,000株（300株）
LINE	50,600	4,085.00	206,701,000	貸付有価証券 23,400株（3,500株）
カナミックネットワーク	2,500	1,989.00	4,972,500	貸付有価証券 1,100株
ノムラシステムコーポレーション	1,300	715.00	929,500	貸付有価証券 100株
チェンジ	2,200	3,650.00	8,030,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
シンクロ・フード	7,100	700.00	4,970,000	貸付有価証券 3,200株

オークネット	8,700	989.00	8,604,300	貸付有価証券 1,000株
A O I T Y O H o l d i n g s	18,100	846.00	15,312,600	
マクロミル	29,400	1,379.00	40,542,600	貸付有価証券 800株
ビーグリー	3,100	883.00	2,737,300	貸付有価証券 1,200株
オロ	1,600	4,595.00	7,352,000	貸付有価証券 700株
ソルクシーズ	7,000	640.00	4,480,000	貸付有価証券 500株
フェイス	6,500	747.00	4,855,500	
ハイマックス	2,000	1,827.00	3,654,000	
野村総合研究所	105,600	4,445.00	469,392,000	貸付有価証券 100株
サイバネットシステム	13,600	599.00	8,146,400	
C E ホールディングス	4,400	736.00	3,238,400	貸付有価証券 800株
日本システム技術	2,700	1,403.00	3,788,100	貸付有価証券 300株
インテージホールディング ス	21,200	859.00	18,210,800	
東邦システムサイエンス	4,900	920.00	4,508,000	貸付有価証券 400株
ソースネクスト	64,400	480.00	30,912,000	貸付有価証券 30,200株（17,000株）
インフォコム	6,800	3,910.00	26,588,000	
F I G	14,700	329.00	4,836,300	貸付有価証券 600株（300株）
アルテリア・ネットワー クス	13,800	1,278.00	17,636,400	
フォーカスシステムズ	11,100	1,017.00	11,288,700	
クレスコ	5,000	3,505.00	17,525,000	貸付有価証券 500株
フジ・メディア・ホール ディングス	172,300	1,644.00	283,261,200	
オービック	57,600	10,470.00	603,072,000	
ジャストシステム	23,600	2,560.00	60,416,000	
T D C ソフト	14,500	884.00	12,818,000	
ヤフー	1,083,000	312.00	337,896,000	貸付有価証券

				700株
トレンドマイクロ	88,500	5,260.00	465,510,000	貸付有価証券 16,700株
インフォメーション・ ディベロプメント	4,700	1,380.00	6,486,000	貸付有価証券 1,800株
日本オラクル	33,700	8,350.00	281,395,000	貸付有価証券 600株
アルファシステムズ	5,200	2,661.00	13,837,200	
フューチャー	22,500	1,727.00	38,857,500	
C A C H o l d i n g s	11,900	1,213.00	14,434,700	
ソフトバンク・テクノロ ジー	7,000	2,146.00	15,022,000	貸付有価証券 3,100株(900株)
トーセ	4,500	803.00	3,613,500	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
オービックビジネスコン サルタント	17,000	4,415.00	75,055,000	貸付有価証券 200株(200株)
伊藤忠テクノソリュー ションズ	75,700	2,660.00	201,362,000	
アイティフォー	20,100	836.00	16,803,600	貸付有価証券 900株
東計電算	2,500	3,075.00	7,687,500	貸付有価証券 500株
エックスネット	3,000	856.00	2,568,000	
大塚商会	89,900	4,165.00	374,433,500	貸付有価証券 300株
サイボウズ	19,400	641.00	12,435,400	
ソフトブレーン	13,000	487.00	6,331,000	貸付有価証券 6,100株(1,400株)
電通国際情報サービス	10,300	3,605.00	37,131,500	
デジタルガレージ	32,300	2,942.00	95,026,600	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
E Mシステムズ	13,500	1,249.00	16,861,500	貸付有価証券 4,100株(2,500株)
ウェザーニューズ	5,600	3,015.00	16,884,000	貸付有価証券 1,600株
C I J	13,000	815.00	10,595,000	
東洋ビジネスエンジニア リング	1,700	1,934.00	3,287,800	
日本エンタープライズ	17,100	178.00	3,043,800	貸付有価証券 7,200株

WOWOW	8,000	2,932.00	23,456,000	貸付有価証券 3,100株
スカラ	11,600	880.00	10,208,000	貸付有価証券 2,500株
I M A G I C A G R O U P	14,000	513.00	7,182,000	貸付有価証券 6,300株（2,000株）
ネットワンシステムズ	58,800	2,556.00	150,292,800	貸付有価証券 400株
システムソフト	39,300	101.00	3,969,300	貸付有価証券 600株（100株）
アルゴグラフィックス	7,000	4,835.00	33,845,000	
マーベラス	25,400	908.00	23,063,200	貸付有価証券 3,700株
エイベックス	28,500	1,419.00	40,441,500	貸付有価証券 3,600株（1,800株）
日本ユニシス	51,900	2,861.00	148,485,900	
兼松エレクトロニクス	9,000	3,355.00	30,195,000	
東京放送ホールディング ス	110,200	1,979.00	218,085,800	貸付有価証券 100株
日本テレビホールディン グス	152,500	1,765.00	269,162,500	貸付有価証券 2,500株
朝日放送グループホール ディングス	16,500	769.00	12,688,500	
テレビ朝日ホールディン グス	45,600	2,002.00	91,291,200	貸付有価証券 800株
スカパー J S A T ホール ディングス	126,800	500.00	63,400,000	貸付有価証券 1,500株
テレビ東京ホールディン グス	13,600	2,525.00	34,340,000	貸付有価証券 500株
日本 B S 放送	5,600	1,073.00	6,008,800	貸付有価証券 900株（100株）
ビジョン	5,100	4,620.00	23,562,000	
スマートバリュー	3,600	858.00	3,088,800	貸付有価証券 1,600株
U S E N - N E X T H O L D I N G S	6,300	913.00	5,751,900	貸付有価証券 2,900株
ワイヤレスゲート	7,300	409.00	2,985,700	貸付有価証券 3,200株（100株）
コネクシオ	11,800	1,437.00	16,956,600	
日本通信	143,300	123.00	17,625,900	貸付有価証券 67,300株（30,600株）

クロップス	3,000	676.00	2,028,000	貸付有価証券 600株
日本電信電話	1,136,100	4,623.00	5,252,190,300	貸付有価証券 500株
K D D I	1,463,800	2,680.00	3,922,984,000	
ソフトバンク	1,320,900	1,329.50	1,756,136,550	貸付有価証券 576,800株
光通信	19,600	20,000.00	392,000,000	
N T T ドコモ	1,192,700	2,588.00	3,086,707,600	
エムティーアイ	19,200	626.00	12,019,200	貸付有価証券 2,800株
G M O インターネット	60,500	1,753.00	106,056,500	貸付有価証券 11,500株
アйдママーケティング コミュニケーション	3,600	498.00	1,792,800	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
カドカワ	48,400	1,107.00	53,578,800	貸付有価証券 3,000株
学研ホールディングス	5,600	4,990.00	27,944,000	
ゼンリン	33,100	3,080.00	101,948,000	貸付有価証券 7,500株
昭文社	7,600	488.00	3,708,800	
インプレスホールディング ス	13,700	155.00	2,123,500	
アイネット	9,400	1,406.00	13,216,400	
松竹	11,000	11,290.00	124,190,000	貸付有価証券 5,200株
東宝	109,300	3,995.00	436,653,500	
東映	7,000	13,350.00	93,450,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	442,300	1,195.00	528,548,500	貸付有価証券 8,700株
ピー・シー・エー	2,100	2,018.00	4,237,800	
ビジネスブレイン太田昭 和	2,800	2,065.00	5,782,000	
D T S	18,600	4,180.00	77,748,000	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	77,300	3,215.00	248,519,500	
シーイーシー	17,800	2,290.00	40,762,000	
カブコン	71,200	2,287.00	162,834,400	
アイ・エス・ピー	3,200	1,999.00	6,396,800	
ジャステック	9,600	970.00	9,312,000	

S C S K	43,800	4,845.00	212,211,000	
日本システムウエア	5,500	1,980.00	10,890,000	
アイネス	21,000	1,310.00	27,510,000	貸付有価証券 300株
T K C	14,000	3,870.00	54,180,000	
富士ソフト	24,800	4,645.00	115,196,000	
N S D	27,300	2,450.00	66,885,000	
コナミホールディングス	67,900	4,515.00	306,568,500	
福井コンピュータホールディングス	5,400	1,993.00	10,762,200	
J B C C ホールディングス	13,100	1,690.00	22,139,000	
ミロク情報サービス	16,500	2,755.00	45,457,500	貸付有価証券 4,100株(1,100株)
ソフトバンクグループ	694,200	10,375.00	7,202,325,000	
ハウスイ	1,300	873.00	1,134,900	
高千穂交易	6,400	1,009.00	6,457,600	貸付有価証券 200株
伊藤忠食品	4,100	4,870.00	19,967,000	
エレマテック	7,800	1,884.00	14,695,200	
J A L U X	4,700	2,570.00	12,079,000	
あらた	9,200	4,390.00	40,388,000	貸付有価証券 900株
トーメンデバイス	2,500	2,409.00	6,022,500	
東京エレクトロン デバイス	6,000	1,864.00	11,184,000	
フィールズ	14,600	735.00	10,731,000	貸付有価証券 3,100株
双日	920,900	418.00	384,936,200	貸付有価証券 800株
アルフレッサ ホールディングス	185,300	3,095.00	573,503,500	
横浜冷凍	43,600	917.00	39,981,200	貸付有価証券 300株
神栄	2,300	776.00	1,784,800	
ラサ商事	8,800	853.00	7,506,400	貸付有価証券 200株
ラクーンホールディングス	7,900	688.00	5,435,200	貸付有価証券 500株
アルコニックス	17,700	1,113.00	19,700,100	貸付有価証券

				1,000株
神戸物産	25,200	3,605.00	90,846,000	貸付有価証券 1,600株
あい ホールディングス	23,800	1,946.00	46,314,800	貸付有価証券 3,300株
ディーブイエックス	6,500	1,146.00	7,449,000	貸付有価証券 2,500株
ダイワボウホールディングス	15,200	6,480.00	98,496,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	46,200	1,556.00	71,887,200	貸付有価証券 9,700株
ラクト・ジャパン	3,600	8,290.00	29,844,000	貸付有価証券 1,600株(900株)
パイタルケーエスケー・ホールディングス	31,400	1,109.00	34,822,600	貸付有価証券 10,300株(200株)
八洲電機	12,900	833.00	10,745,700	
メディアスホールディングス	9,400	739.00	6,946,600	
U K C ホールディングス	10,700	2,045.00	21,881,500	貸付有価証券 4,700株
ジューテックホールディングス	3,800	1,020.00	3,876,000	
大光	5,300	634.00	3,360,200	貸付有価証券 600株
O C H I ホールディングス	4,800	1,211.00	5,812,800	
T O K A I ホールディングス	88,100	921.00	81,140,100	貸付有価証券 100株
黒谷	2,800	464.00	1,299,200	貸付有価証券 1,300株(100株)
C o m i n i x	2,900	828.00	2,401,200	
三洋貿易	8,400	2,108.00	17,707,200	
ビューティガレージ	2,700	1,506.00	4,066,200	貸付有価証券 900株(900株)
ウイン・パートナーズ	10,800	1,150.00	12,420,000	
ミタチ産業	5,000	737.00	3,685,000	貸付有価証券 1,900株
シップヘルスケアホールディングス	34,700	4,240.00	147,128,000	貸付有価証券 800株
明治電機工業	5,200	1,815.00	9,438,000	
デリカフーズホールディ	2,900	1,352.00	3,920,800	

ングス				
スターティアホールディングス	3,200	597.00	1,910,400	貸付有価証券 300株
コメダホールディングス	38,500	2,118.00	81,543,000	貸付有価証券 100株
富士興産	6,400	658.00	4,211,200	
協栄産業	2,000	1,487.00	2,974,000	貸付有価証券 700株
小野建	14,700	1,599.00	23,505,300	
南陽	3,400	2,249.00	7,646,600	
佐鳥電機	12,300	977.00	12,017,100	
エコートレーディング	3,800	584.00	2,219,200	貸付有価証券 1,700株
伯東	11,400	1,227.00	13,987,800	
コンドーテック	12,900	1,034.00	13,338,600	
中山福	9,600	547.00	5,251,200	
ナガイレーベン	24,100	2,358.00	56,827,800	
三菱食品	18,300	2,912.00	53,289,600	
松田産業	12,200	1,417.00	17,287,400	
第一興商	24,800	5,540.00	137,392,000	
メディカルホールディングス	179,900	2,615.00	470,438,500	貸付有価証券 3,300株
S P K	3,600	2,273.00	8,182,800	
萩原電気ホールディングス	6,200	2,991.00	18,544,200	貸付有価証券 100株
アズワン	12,000	8,230.00	98,760,000	
スズデン	5,800	1,663.00	9,645,400	
尾家産業	5,400	1,198.00	6,469,200	
シモジマ	10,200	1,148.00	11,709,600	
ドウシシャ	15,700	1,694.00	26,595,800	
小津産業	3,700	1,870.00	6,919,000	
高速	9,900	1,160.00	11,484,000	
たけびし	5,800	1,434.00	8,317,200	
リックス	3,700	1,643.00	6,079,100	
丸文	14,700	732.00	10,760,400	
ハビネット	13,900	1,476.00	20,516,400	貸付有価証券 4,800株
橋本総業ホールディング	3,100	1,474.00	4,569,400	

ス				
日本ライフライン	52,300	1,704.00	89,119,200	貸付有価証券 10,200株
タカショー	8,100	427.00	3,458,700	貸付有価証券 800株
エクセル	6,200	2,290.00	14,198,000	
マルカキカイ	5,400	2,128.00	11,491,200	
I D O M	56,200	377.00	21,187,400	貸付有価証券 16,100株
日本エム・ディ・エム	9,700	1,092.00	10,592,400	貸付有価証券 300株
進和	9,800	2,182.00	21,383,600	
エスケイジャパン	4,000	673.00	2,692,000	貸付有価証券 1,800株（1,200株）
ダイトロン	7,600	1,638.00	12,448,800	
シークス	21,200	1,566.00	33,199,200	貸付有価証券 7,700株（5,800株）
田中商事	5,600	616.00	3,449,600	
オーハシテクニカ	9,400	1,429.00	13,432,600	
白銅	5,400	1,661.00	8,969,400	
伊藤忠商事	1,166,200	2,019.50	2,355,140,900	貸付有価証券 5,700株
丸紅	1,644,100	806.10	1,325,309,010	
高島	2,600	1,815.00	4,719,000	
長瀬産業	93,700	1,647.00	154,323,900	貸付有価証券 200株
蝶理	10,600	1,619.00	17,161,400	
豊田通商	186,100	3,570.00	664,377,000	
三共生興	28,400	437.00	12,410,800	
兼松	66,600	1,290.00	85,914,000	
ツカモトコーポレーション	3,000	1,029.00	3,087,000	
三井物産	1,373,600	1,777.50	2,441,574,000	貸付有価証券 600株
日本紙パルプ商事	9,500	4,165.00	39,567,500	
日立ハイテクノロジーズ	50,700	4,240.00	214,968,000	
カメイ	21,700	1,210.00	26,257,000	
東都水産	2,300	2,643.00	6,078,900	
O U Gホールディングス	2,600	2,500.00	6,500,000	

スターゼン	6,100	4,050.00	24,705,000	貸付有価証券 100株
山善	65,100	1,174.00	76,427,400	貸付有価証券 100株
椿本興業	3,800	3,685.00	14,003,000	
住友商事	986,100	1,627.50	1,604,877,750	貸付有価証券 300株
内田洋行	7,700	2,320.00	17,864,000	
三菱商事	1,170,000	3,191.00	3,733,470,000	貸付有価証券 116,700株
第一実業	7,600	3,400.00	25,840,000	
キャノンマーケティング ジャパン	47,600	2,098.00	99,864,800	
西華産業	9,400	1,511.00	14,203,400	
佐藤商事	14,900	932.00	13,886,800	
菱洋エレクトロ	16,900	1,550.00	26,195,000	貸付有価証券 200株
東京産業	16,600	542.00	8,997,200	
ユアサ商事	17,000	3,405.00	57,885,000	
神鋼商事	3,700	2,501.00	9,253,700	
小林産業	9,900	282.00	2,791,800	貸付有価証券 400株
阪和興業	28,900	3,240.00	93,636,000	
正栄食品工業	8,800	3,035.00	26,708,000	貸付有価証券 1,400株
カナデン	15,900	1,305.00	20,749,500	
菱電商事	13,200	1,455.00	19,206,000	
フルサト工業	9,200	1,679.00	15,446,800	
岩谷産業	37,000	3,645.00	134,865,000	貸付有価証券 9,100株（2,100株）
すてきナイスグループ	7,100	890.00	6,319,000	
昭光通商	5,900	630.00	3,717,000	
ニチモウ	2,600	1,654.00	4,300,400	
極東貿易	5,100	1,729.00	8,817,900	
イワキ	20,000	409.00	8,180,000	
三愛石油	44,800	985.00	44,128,000	
稲畑産業	40,000	1,554.00	62,160,000	
G S I クレオス	4,400	1,216.00	5,350,400	
明和産業	15,400	459.00	7,068,600	

ワキタ	35,500	1,214.00	43,097,000	
東邦ホールディングス	49,400	2,707.00	133,725,800	貸付有価証券 23,200株（22,400株）
サンゲツ	50,300	2,106.00	105,931,800	貸付有価証券 100株
ミツウロコグループホールディングス	24,200	836.00	20,231,200	
シナネンホールディングス	6,900	2,249.00	15,518,100	
伊藤忠エネクス	36,900	949.00	35,018,100	
サンリオ	51,500	2,340.00	120,510,000	貸付有価証券 9,100株（7,500株）
サンワテクノス	10,100	969.00	9,786,900	
リョーサン	18,400	3,090.00	56,856,000	
新光商事	15,700	1,924.00	30,206,800	
トーヨー	7,500	2,098.00	15,735,000	
三信電気	13,900	1,894.00	26,326,600	貸付有価証券 700株
東陽テクニカ	19,200	898.00	17,241,600	
モスフードサービス	21,900	2,711.00	59,370,900	貸付有価証券 10,000株
加賀電子	16,600	2,136.00	35,457,600	貸付有価証券 800株
ソーダニッカ	17,200	558.00	9,597,600	貸付有価証券 100株
立花エレテック	12,300	1,682.00	20,688,600	
フォーバル	7,300	843.00	6,153,900	
PALTA C	30,100	5,610.00	168,861,000	
三谷産業	19,500	284.00	5,538,000	貸付有価証券 3,400株
太平洋興発	6,500	773.00	5,024,500	
西本Wismettac ホールディングス	3,800	4,570.00	17,366,000	貸付有価証券 100株
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,300	1,202.00	1,562,600	
国際紙パルプ商事	29,200	280.00	8,176,000	貸付有価証券 5,200株
ヤマタネ	8,300	1,650.00	13,695,000	
丸紅建材リース	1,600	1,981.00	3,169,600	
日鉄住金物産	11,900	4,760.00	56,644,000	

泉州電業	5,500	2,632.00	14,476,000	
トラスコ中山	34,700	3,095.00	107,396,500	貸付有価証券 1,700株
オートバックスセブン	66,300	1,875.00	124,312,500	貸付有価証券 800株
モリト	12,100	787.00	9,522,700	
加藤産業	26,100	3,635.00	94,873,500	
北恵	3,200	901.00	2,883,200	
イノテック	9,900	1,065.00	10,543,500	貸付有価証券 100株
イエローハット	15,700	2,954.00	46,377,800	
J Kホールディングス	15,100	591.00	8,924,100	
日伝	13,800	1,514.00	20,893,200	
北沢産業	12,500	262.00	3,275,000	貸付有価証券 5,800株
杉本商事	9,000	1,798.00	16,182,000	
因幡電機産業	23,700	4,610.00	109,257,000	
バイテックホールディングス	7,600	2,026.00	15,397,600	貸付有価証券 1,500株
東テク	5,500	2,230.00	12,265,000	
ミスミグループ本社	208,700	2,758.00	575,594,600	貸付有価証券 50,500株(1,700株)
アルテック	12,200	233.00	2,842,600	貸付有価証券 2,600株
タキヒヨー	5,000	1,784.00	8,920,000	貸付有価証券 2,300株
蔵王産業	2,700	1,322.00	3,569,400	
スズケン	76,000	5,900.00	448,400,000	貸付有価証券 100株
ジェコス	11,500	1,048.00	12,052,000	
ルネサスイーストン	15,300	446.00	6,823,800	貸付有価証券 200株(200株)
ローソン	42,200	6,820.00	287,804,000	
サンエー	12,600	4,520.00	56,952,000	貸付有価証券 5,800株
カワチ薬品	12,900	2,076.00	26,780,400	貸付有価証券 100株
エービーシー・マート	26,000	6,370.00	165,620,000	
ハードオフコーポレーション	6,600	818.00	5,398,800	

アスクル	17,400	2,328.00	40,507,200	貸付有価証券 7,700株
ゲオホールディングス	25,400	1,634.00	41,503,600	貸付有価証券 11,900株（6,200株）
アダストリア	23,100	1,896.00	43,797,600	貸付有価証券 10,800株（1,300株）
ジーフット	10,100	682.00	6,888,200	貸付有価証券 4,700株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,100	767.00	1,610,700	貸付有価証券 900株
くらコーポレーション	9,800	5,550.00	54,390,000	貸付有価証券 100株（100株）
キャンドウ	7,900	1,583.00	12,505,700	
パルグループホールディ ングス	8,500	3,035.00	25,797,500	貸付有価証券 3,800株
エディオン	70,600	978.00	69,046,800	貸付有価証券 15,300株
サーラコーポレーション	33,800	580.00	19,604,000	貸付有価証券 4,400株
ワッツ	5,500	741.00	4,075,500	
ハローズ	6,300	2,157.00	13,589,100	貸付有価証券 2,900株
あみやき亭	3,600	3,695.00	13,302,000	貸付有価証券 1,600株
ひらまつ	33,200	345.00	11,454,000	貸付有価証券 13,500株
大黒天物産	4,000	4,040.00	16,160,000	
ハニーズホールディ ングス	14,700	968.00	14,229,600	貸付有価証券 200株
ファーマライズホール ディングス	3,900	535.00	2,086,500	貸付有価証券 300株
アルペン	12,800	1,664.00	21,299,200	貸付有価証券 100株
ハブ	5,300	963.00	5,103,900	
クオールホールディ ングス	24,500	1,433.00	35,108,500	貸付有価証券 2,100株
ジンズ	11,300	5,420.00	61,246,000	貸付有価証券 1,400株
ビックカメラ	89,000	1,260.00	112,140,000	貸付有価証券 41,800株
D C Mホールディングス	89,900	1,126.00	101,227,400	貸付有価証券 39,800株

ペッパーフードサービス	13,100	2,450.00	32,095,000	貸付有価証券 6,100株(2,700株)
MonotaRO	105,300	2,462.00	259,248,600	貸付有価証券 49,400株(3,400株)
東京一番フーズ	4,200	605.00	2,541,000	貸付有価証券 1,200株(500株)
DDホールディングス	3,700	2,126.00	7,866,200	貸付有価証券 1,700株(700株)
きちりホールディングス	4,400	718.00	3,159,200	貸付有価証券 1,900株
アークランドサービス ホールディングス	12,200	2,026.00	24,717,200	
J.フロント リテイ リング	213,300	1,263.00	269,397,900	
ドトール・日レスホール ディングス	29,300	2,175.00	63,727,500	貸付有価証券 13,700株
マツモトキヨシホール ディングス	68,900	3,885.00	267,676,500	
ブロンコビリー	8,700	2,662.00	23,159,400	貸付有価証券 2,200株
ZOZO	180,200	1,783.00	321,296,600	貸付有価証券 28,200株
トレジャー・ファクト リー	4,900	792.00	3,880,800	貸付有価証券 2,300株
物語コーポレーション	4,100	9,200.00	37,720,000	貸付有価証券 100株
ココカラファイン	18,700	4,990.00	93,313,000	
三越伊勢丹ホールディ ングス	311,900	1,099.00	342,778,100	貸付有価証券 1,200株
Hamee	5,100	827.00	4,217,700	貸付有価証券 1,900株
ウエルシアホールディ ングス	44,100	4,105.00	181,030,500	貸付有価証券 700株
クリエイトSDホール ディングス	24,600	2,901.00	71,364,600	
丸善CHIホールディ ングス	19,500	336.00	6,552,000	貸付有価証券 400株
ミサワ	3,000	422.00	1,266,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
ティーライフ	2,200	996.00	2,191,200	貸付有価証券 900株
エー・ピーカンパニー	3,100	468.00	1,450,800	貸付有価証券

				1,300株(100株)
チムニー	5,100	2,635.00	13,438,500	
シュッピン	11,300	763.00	8,621,900	貸付有価証券 500株(400株)
ネクステージ	25,600	986.00	25,241,600	貸付有価証券 12,000株(300株)
ジョイフル本田	48,800	1,441.00	70,320,800	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
鳥貴族	5,500	1,798.00	9,889,000	貸付有価証券 2,500株(600株)
キリン堂ホールディングス	6,600	1,534.00	10,124,400	貸付有価証券 3,100株
ホットランド	8,700	1,360.00	11,832,000	貸付有価証券 4,000株
すかいらーくホールディングス	155,400	1,665.00	258,741,000	貸付有価証券 29,200株(500株)
綿半ホールディングス	6,200	2,265.00	14,043,000	貸付有価証券 1,100株
ヨシックス	2,700	3,235.00	8,734,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	48,400	1,187.00	57,450,800	貸付有価証券 22,700株
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	623.00	4,174,100	貸付有価証券 2,200株(1,600株)
B E E N O S	3,900	1,175.00	4,582,500	
あさひ	13,800	1,464.00	20,203,200	貸付有価証券 6,400株(900株)
日本調剤	5,900	3,810.00	22,479,000	貸付有価証券 800株
コスモス薬品	7,400	21,370.00	158,138,000	貸付有価証券 700株(100株)
トーエル	8,000	703.00	5,624,000	
一六堂	1,000	512.00	512,000	
オンリー	2,800	970.00	2,716,000	
セブン & アイ・ホールディングス	698,800	4,956.00	3,463,252,800	
薬王堂	7,300	2,604.00	19,009,200	貸付有価証券 3,400株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	44,800	1,281.00	57,388,800	貸付有価証券 21,000株(1,200株)
ツルハホールディングス	36,200	10,060.00	364,172,000	貸付有価証券 200株

サンマルクホールディングス	13,200	2,570.00	33,924,000	
フェリシモ	3,700	1,129.00	4,177,300	
トリドールホールディングス	20,600	2,219.00	45,711,400	貸付有価証券 9,600株
TOKYO BASE	14,900	939.00	13,991,100	貸付有価証券 7,000株
ウイルプラスホールディングス	1,900	722.00	1,371,800	
ジャパンミート	6,300	1,752.00	11,037,600	
サツドラホールディングス	2,500	1,884.00	4,710,000	貸付有価証券 200株
デファクトスタンダード	1,100	391.00	430,100	
ダイユー・リックホールディングス	9,000	1,008.00	9,072,000	貸付有価証券 4,200株
バロックジャパンリミテッド	13,500	900.00	12,150,000	貸付有価証券 4,400株(600株)
クスリのアオキホールディングス	16,600	7,560.00	125,496,000	貸付有価証券 2,500株
力の源ホールディングス	4,700	780.00	3,666,000	貸付有価証券 200株(100株)
スシローグローバルホールディングス	18,300	7,280.00	133,224,000	
LIXILビバ	14,100	1,467.00	20,684,700	
メディカルシステムネットワーク	17,700	440.00	7,788,000	貸付有価証券 7,300株
はるやまホールディングス	7,800	854.00	6,661,200	
ノジマ	29,700	2,006.00	59,578,200	
カップ・クリエイト	23,400	1,382.00	32,338,800	
ライトオン	14,000	798.00	11,172,000	貸付有価証券 5,000株
ジーンズメイト	5,100	410.00	2,091,000	貸付有価証券 2,300株(1,500株)
良品計画	23,600	26,960.00	636,256,000	
三城ホールディングス	20,600	388.00	7,992,800	
アドヴァン	25,500	1,014.00	25,857,000	貸付有価証券 200株
アルビス	6,300	2,375.00	14,962,500	
コナカ	21,300	439.00	9,350,700	
ハウス オブ ローゼ	2,000	1,825.00	3,650,000	

G - 7ホールディングス	4,900	2,307.00	11,304,300	
イオン北海道	16,700	786.00	13,126,200	貸付有価証券 7,800株
コジマ	24,600	637.00	15,670,200	貸付有価証券 4,000株
ヒマラヤ	5,200	996.00	5,179,200	貸付有価証券 2,400株（300株）
コーナン商事	21,900	2,861.00	62,655,900	貸付有価証券 10,000株
エコス	6,100	1,701.00	10,376,100	貸付有価証券 2,800株
ワタミ	21,900	1,529.00	33,485,100	貸付有価証券 3,000株（1,500株）
マルシェ	4,400	774.00	3,405,600	貸付有価証券 2,000株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	99,800	6,910.00	689,618,000	貸付有価証券 17,100株
西松屋チェーン	36,600	910.00	33,306,000	貸付有価証券 17,200株
ゼンショーホールディン グス	78,600	2,480.00	194,928,000	貸付有価証券 100株
幸楽苑ホールディングス	10,600	2,295.00	24,327,000	
ハークスレイ	3,500	1,112.00	3,892,000	
サイゼリヤ	27,500	2,062.00	56,705,000	貸付有価証券 12,900株（5,200株）
V Tホールディングス	56,500	422.00	23,843,000	
魚力	4,600	1,435.00	6,601,000	貸付有価証券 100株
ポブラ	4,300	577.00	2,481,100	貸付有価証券 2,000株
フジ・コーポレーション	3,300	2,126.00	7,015,800	
ユナイテッドアローズ	19,100	3,690.00	70,479,000	
ハイデイ日高	21,900	2,252.00	49,318,800	
京都きもの友禅	10,600	440.00	4,664,000	貸付有価証券 4,300株
コロワイド	55,400	2,332.00	129,192,800	貸付有価証券 9,600株
ピーシーデポコーポレー ション	22,100	460.00	10,166,000	
壱番屋	11,700	4,770.00	55,809,000	貸付有価証券 5,400株

トップカルチャー	6,000	299.00	1,794,000	貸付有価証券 2,300株(2,200株)
P L A N T	3,800	1,013.00	3,849,400	貸付有価証券 600株
スギホールディングス	36,600	4,755.00	174,033,000	貸付有価証券 17,200株
ヴィア・ホールディングス	20,400	663.00	13,525,200	貸付有価証券 5,300株
スクロール	25,600	390.00	9,984,000	貸付有価証券 1,500株
ヨンドシーホールディングス	18,500	2,202.00	40,737,000	貸付有価証券 800株(400株)
ユニー・ファミリーマートホールディングス	46,600	12,640.00	589,024,000	貸付有価証券 5,800株
木曽路	20,400	2,530.00	51,612,000	
S R S ホールディングス	19,600	1,014.00	19,874,400	貸付有価証券 7,100株
千趣会	30,200	247.00	7,459,400	貸付有価証券 500株
タカキュー	12,900	187.00	2,412,300	貸付有価証券 6,000株
ケーヨー	30,800	536.00	16,508,800	貸付有価証券 10,100株(1,400株)
上新電機	19,700	2,345.00	46,196,500	
日本瓦斯	27,100	4,115.00	111,516,500	貸付有価証券 2,000株
ロイヤルホールディングス	29,100	2,650.00	77,115,000	貸付有価証券 300株
東天紅	1,200	1,314.00	1,576,800	貸付有価証券 500株
いなげや	18,600	1,376.00	25,593,600	貸付有価証券 200株
島忠	37,800	3,005.00	113,589,000	
チヨダ	17,500	1,907.00	33,372,500	貸付有価証券 7,200株
ライフコーポレーション	12,600	2,509.00	31,613,400	
リンガーハット	20,600	2,377.00	48,966,200	貸付有価証券 9,300株
MrMaxHD	22,900	509.00	11,656,100	貸付有価証券 1,300株
テンアライド	15,400	410.00	6,314,000	貸付有価証券 100株

AOKIホールディングス	33,300	1,279.00	42,590,700	貸付有価証券 400株
オークワ	23,800	1,049.00	24,966,200	貸付有価証券 11,100株
コメリ	25,700	2,842.00	73,039,400	
青山商事	29,100	2,770.00	80,607,000	
しまむら	19,400	9,260.00	179,644,000	貸付有価証券 8,600株
はせがわ	8,800	392.00	3,449,600	貸付有価証券 400株（400株）
高島屋	130,800	1,490.00	194,892,000	
松屋	33,600	1,097.00	36,859,200	貸付有価証券 2,600株（100株）
エイチ・ツー・オー リテイリング	85,500	1,564.00	133,722,000	
近鉄百貨店	6,400	3,450.00	22,080,000	貸付有価証券 3,000株
パルコ	16,000	1,110.00	17,760,000	貸付有価証券 7,500株
丸井グループ	141,100	2,017.00	284,598,700	貸付有価証券 400株
アクシアル リテイリング	13,800	3,570.00	49,266,000	
井筒屋	8,400	210.00	1,764,000	貸付有価証券 2,400株
イオン	641,600	2,336.50	1,499,098,400	貸付有価証券 400株（400株）
イズミ	33,900	5,340.00	181,026,000	貸付有価証券 100株
平和堂	33,800	2,500.00	84,500,000	貸付有価証券 15,800株（400株）
フジ	20,100	1,857.00	37,325,700	貸付有価証券 9,400株
ヤオコー	18,900	5,960.00	112,644,000	
ゼビオホールディングス	20,100	1,318.00	26,491,800	
ケーズホールディングス	173,300	995.00	172,433,500	貸付有価証券 100株
Olympicグループ	9,800	722.00	7,075,600	貸付有価証券 4,400株（4,200株）
日産東京販売ホールディングス	24,500	328.00	8,036,000	

Genky Drug Stores	8,100	2,614.00	21,173,400	貸付有価証券 2,300株
総合メディカルホールディングス	14,500	1,954.00	28,333,000	
ブックオフグループホールディングス	8,600	791.00	6,802,600	
アインホールディングス	22,300	7,410.00	165,243,000	
元気寿司	4,700	3,680.00	17,296,000	貸付有価証券 1,700株
ヤマダ電機	508,000	537.00	272,796,000	貸付有価証券 221,300株(8,200株)
アークランドサカモト	28,300	1,433.00	40,553,900	
ニトリホールディングス	72,200	14,145.00	1,021,269,000	貸付有価証券 100株
グルメ杵屋	11,900	1,179.00	14,030,100	
愛眼	13,300	306.00	4,069,800	貸付有価証券 5,300株
ケーユーホールディングス	8,700	830.00	7,221,000	
吉野家ホールディングス	58,200	1,840.00	107,088,000	貸付有価証券 27,300株(8,600株)
松屋フーズホールディングス	8,000	3,645.00	29,160,000	
サガミホールディングス	22,300	1,368.00	30,506,400	貸付有価証券 400株
関西スーパーマーケット	12,600	1,026.00	12,927,600	
王将フードサービス	12,200	7,180.00	87,596,000	
プレナス	18,700	1,823.00	34,090,100	貸付有価証券 8,000株
ミニストップ	12,300	1,903.00	23,406,900	
アークス	31,300	2,557.00	80,034,100	貸付有価証券 14,600株(200株)
バローホールディングス	36,000	2,786.00	100,296,000	
藤久	1,300	748.00	972,400	
ベルク	8,200	5,010.00	41,082,000	貸付有価証券 3,800株
大庄	8,900	1,578.00	14,044,200	貸付有価証券 4,100株
ファーストリテイリング	22,300	50,620.00	1,128,826,000	貸付有価証券 700株(100株)
サンドラッグ	62,700	3,555.00	222,898,500	

サックスパーホールディングス	14,100	1,126.00	15,876,600	
ヤマザワ	3,500	1,772.00	6,202,000	貸付有価証券 1,600株
やまや	2,900	2,402.00	6,965,800	
ペルーナ	40,900	889.00	36,360,100	
島根銀行	3,500	699.00	2,446,500	
じもとホールディングス	112,800	123.00	13,874,400	
めぶきフィナンシャルグループ	867,500	306.00	265,455,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,600	1,607.00	36,318,200	貸付有価証券 800株
九州フィナンシャルグループ	274,000	463.00	126,862,000	
ゆうちょ銀行	473,000	1,256.00	594,088,000	貸付有価証券 2,600株
富山第一銀行	39,800	386.00	15,362,800	貸付有価証券 200株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,063,400	454.00	482,783,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	107,000	1,014.00	108,498,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	78,400	839.00	65,777,600	貸付有価証券 16,600株
三十三フィナンシャルグループ	14,400	1,593.00	22,939,200	
第四北越フィナンシャルグループ	29,000	3,460.00	100,340,000	
新生銀行	122,500	1,516.00	185,710,000	貸付有価証券 54,900株
あおぞら銀行	93,300	3,215.00	299,959,500	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,627,800	585.10	6,803,425,780	
りそなホールディングス	1,832,200	515.40	944,315,880	
三井住友トラスト・ホールディングス	328,200	4,178.00	1,371,219,600	
三井住友フィナンシャルグループ	1,176,800	4,035.00	4,748,388,000	貸付有価証券 32,200株
千葉銀行	591,400	687.00	406,291,800	貸付有価証券 200株
群馬銀行	334,000	482.00	160,988,000	

武蔵野銀行	24,900	2,418.00	60,208,200	
千葉興業銀行	45,800	336.00	15,388,800	貸付有価証券 100株
筑波銀行	69,400	211.00	14,643,400	貸付有価証券 400株
七十七銀行	52,400	1,826.00	95,682,400	
青森銀行	12,900	2,802.00	36,145,800	
秋田銀行	10,700	2,192.00	23,454,400	
山形銀行	18,800	1,900.00	35,720,000	貸付有価証券 2,200株（2,100株）
岩手銀行	11,700	3,300.00	38,610,000	
東邦銀行	149,300	311.00	46,432,300	貸付有価証券 1,000株
東北銀行	8,500	1,090.00	9,265,000	
みちのく銀行	10,700	1,608.00	17,205,600	
ふくおかフィナンシャル グループ	135,600	2,471.00	335,067,600	
静岡銀行	420,300	888.00	373,226,400	
十六銀行	22,400	2,297.00	51,452,800	
スルガ銀行	170,800	532.00	90,865,600	貸付有価証券 80,200株
八十二銀行	302,200	467.00	141,127,400	貸付有価証券 200株
山梨中央銀行	20,700	1,440.00	29,808,000	
大垣共立銀行	26,400	2,268.00	59,875,200	
福井銀行	14,300	1,613.00	23,065,900	貸付有価証券 900株
北國銀行	17,700	3,405.00	60,268,500	貸付有価証券 200株
清水銀行	6,900	1,692.00	11,674,800	貸付有価証券 200株
富山銀行	3,200	3,120.00	9,984,000	
滋賀銀行	33,500	2,587.00	86,664,500	貸付有価証券 5,300株
南都銀行	19,500	2,233.00	43,543,500	
百五銀行	150,300	384.00	57,715,200	貸付有価証券 300株
京都銀行	59,800	4,695.00	280,761,000	貸付有価証券 300株
紀陽銀行	59,100	1,576.00	93,141,600	貸付有価証券

				100株
ほくほくフィナンシャルグループ	111,100	1,243.00	138,097,300	
広島銀行	246,500	648.00	159,732,000	
山陰合同銀行	99,000	830.00	82,170,000	
中国銀行	107,800	1,052.00	113,405,600	貸付有価証券 300株
鳥取銀行	5,700	1,381.00	7,871,700	
伊予銀行	221,200	621.00	137,365,200	貸付有価証券 600株
百十四銀行	17,700	2,511.00	44,444,700	
四国銀行	23,900	1,034.00	24,712,600	貸付有価証券 500株
阿波銀行	26,700	3,080.00	82,236,000	
大分銀行	10,200	3,425.00	34,935,000	貸付有価証券 1,000株
宮崎銀行	11,100	2,659.00	29,514,900	
佐賀銀行	10,100	1,781.00	17,988,100	
十八銀行	10,300	2,736.00	28,180,800	
沖縄銀行	15,300	3,360.00	51,408,000	
琉球銀行	38,500	1,165.00	44,852,500	
セブン銀行	564,100	338.00	190,665,800	貸付有価証券 8,100株
みずほフィナンシャルグループ	22,687,400	175.10	3,972,563,740	貸付有価証券 3,019,100株
高知銀行	6,100	740.00	4,514,000	
山口フィナンシャルグループ	208,400	1,070.00	222,988,000	貸付有価証券 4,000株（4,000株）
長野銀行	5,500	1,542.00	8,481,000	
名古屋銀行	13,500	3,395.00	45,832,500	貸付有価証券 200株
北洋銀行	251,700	307.00	77,271,900	貸付有価証券 100株
愛知銀行	6,000	3,490.00	20,940,000	
中京銀行	6,900	2,147.00	14,814,300	
大光銀行	5,700	1,678.00	9,564,600	貸付有価証券 100株
愛媛銀行	23,300	1,076.00	25,070,800	貸付有価証券 3,200株
トマト銀行	6,400	1,056.00	6,758,400	

京葉銀行	73,800	703.00	51,881,400	
栃木銀行	86,400	240.00	20,736,000	
北日本銀行	5,200	2,087.00	10,852,400	
東和銀行	29,300	719.00	21,066,700	
福島銀行	14,500	382.00	5,539,000	
大東銀行	8,000	620.00	4,960,000	
トモニホールディングス	129,100	407.00	52,543,700	貸付有価証券 100株
フィデアホールディングス	162,100	134.00	21,721,400	貸付有価証券 400株
池田泉州ホールディングス	177,200	299.00	52,982,800	
F P G	52,400	1,041.00	54,548,400	貸付有価証券 700株
マーキュリアインベストメント	6,400	654.00	4,185,600	貸付有価証券 1,200株
S B Iホールディングス	198,900	2,304.00	458,265,600	貸付有価証券 50,000株（33,000株）
日本アジア投資	14,100	197.00	2,777,700	貸付有価証券 1,700株
ジャフコ	27,400	3,890.00	106,586,000	貸付有価証券 2,300株
大和証券グループ本社	1,339,700	567.40	760,145,780	貸付有価証券 8,300株
野村ホールディングス	2,937,800	447.70	1,315,253,060	貸付有価証券 27,900株
岡三証券グループ	142,300	485.00	69,015,500	貸付有価証券 6,900株
丸三証券	49,600	813.00	40,324,800	貸付有価証券 7,800株
東洋証券	59,700	164.00	9,790,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	199,100	499.00	99,350,900	
光世証券	4,000	759.00	3,036,000	貸付有価証券 1,500株
水戸証券	48,300	268.00	12,944,400	
いちよし証券	35,000	855.00	29,925,000	
松井証券	81,800	1,175.00	96,115,000	貸付有価証券 1,500株
だいこう証券ビジネス	6,700	431.00	2,887,700	貸付有価証券 100株

マネックスグループ	155,900	404.00	62,983,600	貸付有価証券 48,600株（31,800株）
カブドットコム証券	124,600	560.00	69,776,000	貸付有価証券 58,500株（16,700株）
極東証券	22,400	1,203.00	26,947,200	
岩井コスモホールディングス	17,100	1,243.00	21,255,300	貸付有価証券 1,200株
藍澤証券	31,200	702.00	21,902,400	
マネーパートナーズグループ	19,500	291.00	5,674,500	貸付有価証券 5,500株
小林洋行	4,800	267.00	1,281,600	
かんぽ生命保険	63,100	2,447.00	154,405,700	貸付有価証券 29,600株
S O M P Oホールディングス	294,300	4,100.00	1,206,630,000	
アニコムホールディングス	13,600	3,015.00	41,004,000	貸付有価証券 6,300株
M S & A Dインシュアランスグループホール	436,500	3,325.00	1,451,362,500	貸付有価証券 200株
ソニーフィナンシャルホールディングス	137,200	2,080.00	285,376,000	貸付有価証券 10,100株
第一生命ホールディングス	944,600	1,713.00	1,618,099,800	
東京海上ホールディングス	605,200	5,484.00	3,318,916,800	貸付有価証券 500株
T & Dホールディングス	516,400	1,378.50	711,857,400	
アドバンスクリエイト	3,900	1,733.00	6,758,700	
全国保証	47,100	4,055.00	190,990,500	貸付有価証券 3,100株
ジェイリース	3,500	374.00	1,309,000	
イントラスト	4,700	435.00	2,044,500	貸付有価証券 2,000株
日本モーゲージサービス	2,300	1,302.00	2,994,600	貸付有価証券 1,000株
C a s a	5,600	1,086.00	6,081,600	
アルヒ	15,200	2,150.00	32,680,000	貸付有価証券 7,100株（5,600株）
プレミアグループ	3,400	3,280.00	11,152,000	
クレディセゾン	117,000	1,562.00	182,754,000	
芙蓉総合リース	19,100	5,540.00	105,814,000	
興銀リース	31,400	2,695.00	84,623,000	

東京センチュリー	33,600	5,140.00	172,704,000	
日本証券金融	73,600	614.00	45,190,400	
アイフル	254,700	305.00	77,683,500	貸付有価証券 119,700株（800株）
リコーリース	13,100	3,425.00	44,867,500	貸付有価証券 300株
イオンフィナンシャル サービス	106,700	2,213.00	236,127,100	貸付有価証券 3,000株
アコム	335,600	386.00	129,541,600	貸付有価証券 52,600株
ジャックス	18,400	1,900.00	34,960,000	貸付有価証券 8,000株（8,000株）
オリエントコーポレー ション	451,600	115.00	51,934,000	貸付有価証券 63,200株（28,200株）
日立キャピタル	39,400	2,522.00	99,366,800	
アプラスフィナンシャル	80,100	85.00	6,808,500	貸付有価証券 36,500株
オリックス	1,113,900	1,639.50	1,826,239,050	
三菱UFJリース	376,700	579.00	218,109,300	
九州リースサービス	8,200	706.00	5,789,200	貸付有価証券 200株
日本取引所グループ	451,000	1,972.00	889,372,000	貸付有価証券 400株
イー・ギャランティ	15,600	1,085.00	16,926,000	貸付有価証券 500株
アサックス	6,900	531.00	3,663,900	貸付有価証券 3,200株
NECキャピタルソ リューション	6,800	1,640.00	11,152,000	
いちご	212,300	383.00	81,310,900	貸付有価証券 2,300株
日本駐車場開発	201,400	158.00	31,821,200	貸付有価証券 1,000株
ヒューリック	348,500	1,000.00	348,500,000	貸付有価証券 3,800株
三栄建築設計	6,700	1,670.00	11,189,000	貸付有価証券 3,100株（900株）
スター・マイカ	7,700	1,357.00	10,448,900	貸付有価証券 3,600株
野村不動産ホールディン グス	111,200	2,087.00	232,074,400	貸付有価証券 100株

三重交通グループホールディングス	33,800	611.00	20,651,800	貸付有価証券 1,700株
サムティ	23,100	1,517.00	35,042,700	貸付有価証券 6,500株（3,900株）
ディア・ライフ	21,400	429.00	9,180,600	貸付有価証券 9,100株
コーセーアールイー	4,900	760.00	3,724,000	貸付有価証券 2,000株
エー・ディー・ワークス	257,300	34.00	8,748,200	貸付有価証券 2,000株
日本商業開発	10,400	1,517.00	15,776,800	貸付有価証券 4,800株
プレサンスコーポレーション	26,400	1,346.00	35,534,400	貸付有価証券 10,000株（10,000株）
ユニゾホールディングス	25,200	2,121.00	53,449,200	
THEグローバル社	8,500	491.00	4,173,500	貸付有価証券 3,500株
日本管理センター	11,000	772.00	8,492,000	貸付有価証券 2,000株（1,200株）
サンセイランディック	4,400	749.00	3,295,600	貸付有価証券 400株
エストラスト	2,300	789.00	1,814,700	貸付有価証券 200株
フージャースホールディングス	36,300	656.00	23,812,800	貸付有価証券 16,200株（12,800株）
オープンハウス	27,200	4,000.00	108,800,000	貸付有価証券 5,000株（1,700株）
東急不動産ホールディングス	449,100	618.00	277,543,800	貸付有価証券 300株
飯田グループホールディングス	139,300	1,984.00	276,371,200	貸付有価証券 16,400株
イーグランド	2,300	679.00	1,561,700	貸付有価証券 400株
ムゲンエステート	11,500	590.00	6,785,000	貸付有価証券 5,100株（100株）
ビーロッド	2,600	1,460.00	3,796,000	貸付有価証券 800株
ファーストブラザーズ	4,600	1,103.00	5,073,800	貸付有価証券 2,100株
ハウストゥ	9,200	1,454.00	13,376,800	貸付有価証券 4,200株（3,500株）
シーアールイー	5,500	908.00	4,994,000	貸付有価証券

				200株(200株)
プロパティエージェント	1,700	1,096.00	1,863,200	貸付有価証券 700株(400株)
ケイアイスター不動産	4,500	1,813.00	8,158,500	貸付有価証券 2,100株(1,900株)
アグレ都市デザイン	2,000	627.00	1,254,000	貸付有価証券 200株
グッドコムアセット	2,900	1,431.00	4,149,900	貸付有価証券 1,300株(200株)
ジェイ・エス・ビー	600	4,250.00	2,550,000	
テンポイノベーション	1,400	1,800.00	2,520,000	
グローバル・リンク・マ ネジメント	1,200	731.00	877,200	
パーク24	97,500	2,637.00	257,107,500	貸付有価証券 5,300株(1,200株)
パラカ	4,300	1,818.00	7,817,400	貸付有価証券 200株
三井不動産	885,800	2,680.00	2,373,944,000	貸付有価証券 21,200株
三菱地所	1,169,700	1,861.50	2,177,396,550	
平和不動産	31,600	2,014.00	63,642,400	
東京建物	182,400	1,302.00	237,484,800	貸付有価証券 30,700株
ダイビル	49,100	1,069.00	52,487,900	
京阪神ビルディング	29,800	908.00	27,058,400	
住友不動産	375,300	4,137.00	1,552,616,100	
テーオーシー	38,200	787.00	30,063,400	
東京楽天地	2,400	4,680.00	11,232,000	
レオパレス21	205,900	201.00	41,385,900	貸付有価証券 96,700株(46,300株)
スターツコーポレーショ ン	22,700	2,381.00	54,048,700	
フジ住宅	21,300	882.00	18,786,600	
空港施設	19,500	548.00	10,686,000	
明和地所	9,200	612.00	5,630,400	
ゴールドクレスト	13,200	1,591.00	21,001,200	
日本エスリード	6,500	1,634.00	10,621,000	
日神不動産	24,700	473.00	11,683,100	
日本エスコン	30,100	761.00	22,906,100	貸付有価証券 14,100株(13,800株)

タカラレーベン	78,200	355.00	27,761,000	貸付有価証券 34,900株（32,700株）
サンヨーハウジング名古屋	9,400	936.00	8,798,400	
イオンモール	83,700	1,866.00	156,184,200	貸付有価証券 39,300株
毎日コムネット	3,500	784.00	2,744,000	
ファースト住建	6,200	1,225.00	7,595,000	貸付有価証券 500株（500株）
カチタス	18,600	3,535.00	65,751,000	貸付有価証券 8,700株（300株）
トーセイ	23,000	1,050.00	24,150,000	
穴吹興産	1,800	2,788.00	5,018,400	
サンフロンティア不動産	23,100	1,208.00	27,904,800	
エフ・ジェー・ネクスト	14,600	891.00	13,008,600	
インテリックス	4,700	661.00	3,106,700	
ランドビジネス	8,400	779.00	6,543,600	貸付有価証券 1,400株
グランディハウス	14,600	440.00	6,424,000	
日本空港ビルデング	53,300	4,385.00	233,720,500	貸付有価証券 10,800株
日本工営	10,900	2,642.00	28,797,800	貸付有価証券 300株
L I F U L L	62,700	610.00	38,247,000	貸付有価証券 29,400株（19,900株）
ジェイエイシーリクルートメント	13,000	2,535.00	32,955,000	貸付有価証券 2,800株
日本M&Aセンター	120,600	2,980.00	359,388,000	貸付有価証券 11,300株（300株）
メンバーズ	5,400	1,475.00	7,965,000	貸付有価証券 2,100株
中広	1,700	573.00	974,100	
タケエイ	16,800	803.00	13,490,400	貸付有価証券 600株
E・Jホールディングス	2,000	1,048.00	2,096,000	貸付有価証券 100株
トラスト・テック	8,900	3,665.00	32,618,500	
コシダカホールディングス	43,300	1,509.00	65,339,700	
アルトナー	2,900	932.00	2,702,800	
パソナグループ	19,700	1,454.00	28,643,800	貸付有価証券

				6,200株
C D S	4,000	1,274.00	5,096,000	貸付有価証券 200株
リンクアンドモチベー ション	29,700	920.00	27,324,000	貸付有価証券 13,900株
G C A	16,400	876.00	14,366,400	貸付有価証券 900株
エス・エム・エス	59,400	1,888.00	112,147,200	
サニーサイドアップ	1,800	1,523.00	2,741,400	
パーソルホールディング ス	161,700	1,985.00	320,974,500	貸付有価証券 12,300株
リニカル	9,100	1,727.00	15,715,700	貸付有価証券 1,200株
クックパッド	50,800	290.00	14,732,000	貸付有価証券 23,800株(1,000株)
エスクリ	4,400	598.00	2,631,200	
アイ・ケイ・ケイ	7,900	742.00	5,861,800	貸付有価証券 1,000株
学情	6,500	1,324.00	8,606,000	貸付有価証券 2,700株(400株)
スタジオアリス	8,100	2,412.00	19,537,200	
シミックホールディング ス	9,000	1,565.00	14,085,000	
N J S	3,600	1,496.00	5,385,600	
総合警備保障	64,400	4,865.00	313,306,000	
カカクコム	121,800	2,107.00	256,632,600	貸付有価証券 1,300株
セントケア・ホールディ ング	8,800	565.00	4,972,000	
サイネックス	2,700	681.00	1,838,700	貸付有価証券 100株
ルネサンス	9,000	1,974.00	17,766,000	貸付有価証券 4,100株
ディップ	26,100	1,980.00	51,678,000	貸付有価証券 12,200株(100株)
オプトホールディング	9,900	1,744.00	17,265,600	貸付有価証券 4,600株
新日本科学	21,900	759.00	16,622,100	貸付有価証券 3,100株
ツクイ	38,100	717.00	27,317,700	貸付有価証券 200株

キャリアデザインセンター	4,100	1,217.00	4,989,700	貸付有価証券 900株
ベネフィット・ワン	22,400	4,120.00	92,288,000	貸付有価証券 10,500株
エムスリー	340,500	1,661.00	565,570,500	貸付有価証券 72,900株
ツカダ・グローバルホールディング	10,300	621.00	6,396,300	貸付有価証券 100株
プラス	1,200	588.00	705,600	
アウトソーシング	85,200	1,394.00	118,768,800	貸付有価証券 18,000株
ウェルネット	15,300	1,109.00	16,967,700	貸付有価証券 2,100株(1,300株)
ワールドホールディングス	4,500	2,312.00	10,404,000	
ディー・エヌ・エー	87,200	1,679.00	146,408,800	
博報堂D Yホールディングス	224,900	1,773.00	398,747,700	貸付有価証券 200株
ぐるなび	23,000	732.00	16,836,000	貸付有価証券 500株
エスアールジータカミヤ	16,700	695.00	11,606,500	貸付有価証券 900株(500株)
ジャパンベストレスキューシステム	12,800	1,233.00	15,782,400	貸付有価証券 400株(300株)
ファンコミュニケーションズ	44,500	545.00	24,252,500	貸付有価証券 3,100株
ライク	6,300	982.00	6,186,600	貸付有価証券 2,800株(100株)
ビジネス・ブレークスルー	6,700	357.00	2,391,900	貸付有価証券 100株
W D Bホールディングス	7,400	2,770.00	20,498,000	貸付有価証券 200株
ティア	8,200	678.00	5,559,600	貸付有価証券 800株
C D G	1,500	1,263.00	1,894,500	貸付有価証券 400株
パリュウコマース	10,900	1,976.00	21,538,400	貸付有価証券 5,100株(4,300株)
インフォマート	88,600	1,256.00	111,281,600	貸付有価証券 41,600株(4,000株)
J Pホールディングス	46,200	291.00	13,444,200	貸付有価証券 200株

E P S ホールディングス	24,300	1,806.00	43,885,800	貸付有価証券 300株
レグス	4,000	919.00	3,676,000	
プレステージ・インター ナショナル	30,200	1,265.00	38,203,000	貸付有価証券 300株
アミューズ	9,800	2,430.00	23,814,000	
ドリームインキュベータ	4,900	1,500.00	7,350,000	
クイック	10,000	1,597.00	15,970,000	貸付有価証券 100株
T A C	8,800	231.00	2,032,800	貸付有価証券 300株
ケネディクス	142,000	571.00	81,082,000	貸付有価証券 200株
電通	197,100	4,855.00	956,920,500	貸付有価証券 35,300株
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	6,200	1,837.00	11,389,400	
ぴあ	4,600	4,055.00	18,653,000	貸付有価証券 1,600株
イオンファンタジー	5,200	2,855.00	14,846,000	貸付有価証券 2,400株
シーティーエス	18,200	713.00	12,976,600	貸付有価証券 8,100株
ネクシィーズグループ	4,900	1,739.00	8,521,100	
みらかホールディングス	45,200	3,130.00	141,476,000	
アルプス技研	14,200	1,960.00	27,832,000	
ダイオーズ	3,700	1,397.00	5,168,900	
日本空調サービス	18,300	657.00	12,023,100	
オリエンタルランド	191,100	12,130.00	2,318,043,000	貸付有価証券 1,200株
ダスキン	43,500	2,665.00	115,927,500	
明光ネットワークジャ パン	20,500	952.00	19,516,000	貸付有価証券 9,600株（3,200株）
ファルコホールディング ス	8,900	1,456.00	12,958,400	
秀英予備校	3,500	490.00	1,715,000	貸付有価証券 200株
田谷	2,900	639.00	1,853,100	
ラウンドワン	50,200	1,402.00	70,380,400	
リゾートトラスト	68,400	1,557.00	106,498,800	貸付有価証券

				300株
ビー・エム・エル	20,800	3,465.00	72,072,000	
ワタベウェディング	2,600	678.00	1,762,800	
りらいあコミュニケーションズ	29,200	969.00	28,294,800	
リソー教育	82,100	486.00	39,900,600	貸付有価証券 600株
早稲田アカデミー	2,300	1,649.00	3,792,700	
ユー・エス・エス	197,600	2,029.00	400,930,400	貸付有価証券 500株
東京個別指導学院	5,700	1,244.00	7,090,800	貸付有価証券 1,000株（500株）
サイバーエージェント	99,700	3,350.00	333,995,000	貸付有価証券 7,400株
楽天	754,000	799.00	602,446,000	貸付有価証券 28,300株
クリーク・アンド・リバー社	9,500	1,165.00	11,067,500	貸付有価証券 3,200株（1,500株）
テー・オー・ダブリュー	14,200	764.00	10,848,800	
セントラルスポーツ	6,000	3,440.00	20,640,000	
フルキャストホールディングス	16,200	2,201.00	35,656,200	貸付有価証券 100株
エン・ジャパン	17,600	3,665.00	64,504,000	貸付有価証券 700株
リソルホールディングス	1,800	4,215.00	7,587,000	
テクノプロ・ホールディングス	32,400	6,110.00	197,964,000	貸付有価証券 100株
アトラ	3,200	397.00	1,270,400	貸付有価証券 1,500株
インターワークス	3,100	739.00	2,290,900	
アイ・アールジャパンホールディングス	4,900	1,401.00	6,864,900	貸付有価証券 100株
Keepers 技研	5,900	1,143.00	6,743,700	貸付有価証券 100株
ファーストロジック	3,100	682.00	2,114,200	貸付有価証券 500株
三機サービス	3,400	1,501.00	5,103,400	貸付有価証券 200株
Gunosy	11,200	2,593.00	29,041,600	貸付有価証券 4,700株（300株）
デザインワン・ジャパン	3,200	333.00	1,065,600	貸付有価証券

				1,400株(100株)
イー・ガーディアン	7,700	2,083.00	16,039,100	貸付有価証券 2,700株
リブセンス	8,900	287.00	2,554,300	貸付有価証券 2,800株
ジャパンマテリアル	44,200	1,494.00	66,034,800	貸付有価証券 10,000株
ベクトル	19,700	1,323.00	26,063,100	貸付有価証券 1,800株
ウチヤマホールディングス	8,000	442.00	3,536,000	貸付有価証券 100株
チャーム・ケア・コーポレーション	3,900	1,640.00	6,396,000	
ライクキッズネクスト	3,900	825.00	3,217,500	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
キャリアリンク	5,900	391.00	2,306,900	
I B J	10,900	927.00	10,104,300	貸付有価証券 2,300株(700株)
アサンテ	6,500	2,231.00	14,501,500	
N・フィールド	10,400	892.00	9,276,800	貸付有価証券 4,500株(2,400株)
パリューHR	3,500	2,210.00	7,735,000	貸付有価証券 600株
M&Aキャピタルパートナーズ	4,100	5,520.00	22,632,000	貸付有価証券 900株(400株)
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,700	1,201.00	8,046,700	貸付有価証券 3,000株(1,800株)
E R Iホールディングス	4,500	794.00	3,573,000	
アビスト	2,500	3,265.00	8,162,500	
シグマクシス	7,700	927.00	7,137,900	貸付有価証券 200株
ウィルグループ	10,500	1,116.00	11,718,000	貸付有価証券 1,100株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	22,200	248.00	5,505,600	貸付有価証券 10,400株(200株)
日本ビューホテル	5,100	1,122.00	5,722,200	貸付有価証券 500株
リクルートホールディングス	1,158,800	2,962.00	3,432,365,600	貸付有価証券 32,500株
エラン	11,100	1,392.00	15,451,200	貸付有価証券 400株
土木管理総合試験所	7,000	515.00	3,605,000	

日本郵政	1,325,800	1,355.00	1,796,459,000	貸付有価証券 500株
ベルシステム24ホールディングス	27,100	1,515.00	41,056,500	
鎌倉新書	11,800	1,744.00	20,579,200	貸付有価証券 5,500株（100株）
一蔵	1,700	615.00	1,045,500	
LITALICO	3,700	1,899.00	7,026,300	貸付有価証券 1,700株
グローバルグループ	1,900	880.00	1,672,000	貸付有価証券 600株
エボラブルアジア	4,700	2,515.00	11,820,500	貸付有価証券 2,100株（600株）
アトラエ	3,100	2,912.00	9,027,200	貸付有価証券 1,000株
ストライク	4,100	2,111.00	8,655,100	貸付有価証券 1,900株（800株）
ソラスト	39,300	1,149.00	45,155,700	貸付有価証券 8,100株
セラク	3,600	615.00	2,214,000	貸付有価証券 1,500株
インソース	5,300	2,252.00	11,935,600	貸付有価証券 400株
ベイカレント・コンサルティング	8,600	3,220.00	27,692,000	貸付有価証券 1,800株
Orchestra Holdings	2,000	860.00	1,720,000	
アイモバイル	3,800	862.00	3,275,600	
キャリアインデックス	5,500	937.00	5,153,500	貸付有価証券 2,500株（300株）
MS - Japan	6,500	1,795.00	11,667,500	貸付有価証券 3,000株
船場	2,600	919.00	2,389,400	貸付有価証券 200株
グレイステクノロジー	4,400	2,365.00	10,406,000	貸付有価証券 1,900株
ジャパンエレベーターサービスホールディング	9,500	1,984.00	18,848,000	貸付有価証券 2,200株
フルテック	1,700	1,123.00	1,909,100	貸付有価証券 700株
グリーンズ	4,600	1,403.00	6,453,800	
ツナグ・ソリューション	1,400	604.00	845,600	

ズ				
日総工産	4,000	2,442.00	9,768,000	貸付有価証券 1,700株(500株)
キュービーネットホールディングス	7,300	2,107.00	15,381,100	
スプリックス	4,500	2,683.00	12,073,500	貸付有価証券 1,200株
アドバンテッジリスクマネジメント	6,300	976.00	6,148,800	貸付有価証券 2,500株
リログループ	88,400	2,978.00	263,255,200	貸付有価証券 100株
東祥	10,100	3,480.00	35,148,000	貸付有価証券 2,900株(1,200株)
エイチ・アイ・エス	28,800	4,260.00	122,688,000	貸付有価証券 700株
ラックランド	3,200	1,947.00	6,230,400	
共立メンテナンス	24,700	5,200.00	128,440,000	貸付有価証券 6,500株(2,100株)
イチネンホールディングス	16,800	1,299.00	21,823,200	
建設技術研究所	11,200	1,506.00	16,867,200	
スペース	10,500	1,310.00	13,755,000	
長大	6,400	802.00	5,132,800	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
燦ホールディングス	3,500	2,505.00	8,767,500	
スバル興業	1,100	5,900.00	6,490,000	
東京テアトル	6,300	1,282.00	8,076,600	
タナベ経営	3,100	1,232.00	3,819,200	
ナガワ	4,500	5,560.00	25,020,000	貸付有価証券 2,000株(900株)
よみうりランド	3,500	4,155.00	14,542,500	貸付有価証券 200株
東京都競馬	10,600	3,580.00	37,948,000	
常磐興産	6,500	1,600.00	10,400,000	貸付有価証券 2,000株
カナモト	24,200	2,931.00	70,930,200	
東京ドーム	60,500	966.00	58,443,000	貸付有価証券 9,600株(300株)
西尾レントオール	16,400	3,415.00	56,006,000	
トランス・コスモス	18,000	2,176.00	39,168,000	

乃村工藝社	37,800	3,210.00	121,338,000	
藤田観光	6,400	2,698.00	17,267,200	貸付有価証券 3,000株
KNT-CTホールディングス	8,600	1,291.00	11,102,600	
日本管財	17,300	1,897.00	32,818,100	
トーカイ	15,600	2,849.00	44,444,400	
白洋舎	1,800	2,965.00	5,337,000	
セコム	171,700	9,298.00	1,596,466,600	
セントラル警備保障	7,800	4,090.00	31,902,000	貸付有価証券 3,600株（700株）
丹青社	30,500	1,187.00	36,203,500	
メイテック	20,500	4,965.00	101,782,500	
応用地質	17,400	1,160.00	20,184,000	貸付有価証券 1,800株
船井総研ホールディングス	33,400	2,454.00	81,963,600	
進学会ホールディングス	7,400	560.00	4,144,000	
オオバ	12,700	637.00	8,089,900	貸付有価証券 100株
いであ	3,300	980.00	3,234,000	
学究社	5,300	1,373.00	7,276,900	
ベネッセホールディングス	59,200	2,940.00	174,048,000	
イオンディライト	19,900	4,135.00	82,286,500	貸付有価証券 6,300株（600株）
ナック	10,200	1,047.00	10,679,400	
ニチイ学館	23,000	1,241.00	28,543,000	貸付有価証券 800株
ダイセキ	27,100	2,622.00	71,056,200	貸付有価証券 100株
ステップ	5,900	1,424.00	8,401,600	
小計 銘柄数：2,113			387,375,566,700	
組入時価比率：97.8%			100.0%	
合計			387,375,566,700	

(注1)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。

(注2)備考欄の貸付有価証券の()内は、委託者の利害関係人である野村証券株式会社に対する貸付で、内書であります。

(2)株式以外の有価証券(2019年2月18日現在)

該当事項はありません。

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 2月18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	8,571,526,000	-	8,814,195,000	242,402,186
合計	8,571,526,000	-	8,814,195,000	242,402,186

（注）時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

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。

国内債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2019年 2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	113,221,282
国債証券	26,349,042,170
未収利息	63,494,532
前払費用	6,894,485
流動資産合計	26,532,652,469
資産合計	26,532,652,469
負債の部	
流動負債	
未払解約金	950,578
未払利息	194
流動負債合計	950,772
負債合計	950,772
純資産の部	
元本等	
元本	19,423,740,506
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,107,961,191
元本等合計	26,531,701,697
純資産合計	26,531,701,697

(2019年 2月18日現在)

負債純資産合計 26,532,652,469

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	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等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。

(貸借対照表に関する注記)

2019年 2月18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	1.3659円
(10,000口当たり純資産額)	(13,659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 2月20日 至 2019年 2月18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、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、金利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>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <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っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>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っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>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っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>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っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 2月18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	
国債証券	
（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。	
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 2月18日現在	
期首	2018年 2月20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	14,851,070,619円
同期中における追加設定元本額	15,582,397,320円
同期中における一部解約元本額	11,009,727,433円
期末元本額	19,423,740,506円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	539,240,728円
バランスセレクト50	595,447,700円
バランスセレクト70	251,396,738円
ネクストコア	383,517,905円
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）	9,547,213,090円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	24,804,715円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	50,827,665円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	21,758,088円
野村日本国債インデックスファンド（確定拠出年金向け）	4,721,528,697円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	137,186,135円
野村DC運用戦略ファンド	2,900,279,104円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	250,539,941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2月18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2月18日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付(2年)第387回	450,000,000	451,503,000	
		国庫債券 利付(2年)第388回	100,000,000	100,358,000	
		国庫債券 利付(2年)第389回	80,000,000	80,296,800	
		国庫債券 利付(2年)第390回	50,000,000	50,197,500	
		国庫債券 利付(2年)第391回	100,000,000	100,413,000	
		国庫債券 利付(2年)第393回	120,000,000	120,553,200	
		国庫債券 利付(2年)第394回	170,000,000	170,810,900	
		国庫債券 利付(2年)第395回	120,000,000	120,600,000	
		国庫債券 利付(2年)第396回	150,000,000	150,786,000	
		国庫債券 利付(5年)第124回	320,000,000	321,216,000	
		国庫債券 利付(5年)第125回	380,000,000	381,687,200	
		国庫債券 利付(5年)第126回	500,000,000	502,570,000	
		国庫債券 利付(5年)第128回	580,000,000	583,799,000	
		国庫債券 利付(5年)第129回	320,000,000	322,323,200	
		国庫債券 利付(5年)第130回	160,000,000	161,275,200	
		国庫債券 利付(5年)第131回	420,000,000	423,641,400	
		国庫債券 利付(5年)第132回	100,000,000	100,938,000	
		国庫債券 利付(5年)第133回	120,000,000	121,233,600	
		国庫債券 利付(5年)第134回	440,000,000	444,840,000	
		国庫債券 利付(5年)第135回	40,000,000	40,460,000	
		国庫債券 利付(5年)第136回	130,000,000	131,588,600	
		国庫債券 利付(5年)第137回	50,000,000	50,647,000	
		国庫債券 利付(40年)第1回	30,000,000	44,527,500	
		国庫債券 利付(40年)第2回	30,000,000	43,165,500	
		国庫債券 利付(40年)第3回	60,000,000	86,969,400	
		国庫債券 利付(40年)第4回	75,000,000	109,490,250	
		国庫債券 利付(40年)第5回	100,000,000	140,976,000	
		国庫債券 利付(40年)第6回	60,000,000	83,247,000	
		国庫債券 利付(40年)第7回	80,000,000	106,583,200	
		国庫債券 利付(40年)第8回	100,000,000	124,095,000	
		国庫債券 利付(40年)第10回	120,000,000	129,354,000	
		国庫債券 利付(40年)第11回	20,000,000	20,837,400	

国庫債券 利付(10年)第306回	45,000,000	45,771,300	
国庫債券 利付(10年)第307回	30,000,000	30,481,800	
国庫債券 利付(10年)第308回	30,000,000	30,592,500	
国庫債券 利付(10年)第309回	130,000,000	132,220,400	
国庫債券 利付(10年)第310回	30,000,000	30,561,900	
国庫債券 利付(10年)第311回	190,000,000	192,956,400	
国庫債券 利付(10年)第312回	70,000,000	71,775,900	
国庫債券 利付(10年)第314回	30,000,000	30,801,300	
国庫債券 利付(10年)第315回	70,000,000	72,261,700	
国庫債券 利付(10年)第316回	130,000,000	133,894,800	
国庫債券 利付(10年)第317回	30,000,000	30,996,600	
国庫債券 利付(10年)第318回	80,000,000	82,449,600	
国庫債券 利付(10年)第319回	70,000,000	72,550,800	
国庫債券 利付(10年)第320回	90,000,000	93,023,100	
国庫債券 利付(10年)第321回	150,000,000	155,481,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	130,000,000	134,347,200	
国庫債券 利付(10年)第323回	70,000,000	72,533,300	
国庫債券 利付(10年)第324回	150,000,000	154,926,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	330,000,000	341,662,200	
国庫債券 利付(10年)第326回	240,000,000	248,150,400	
国庫債券 利付(10年)第327回	230,000,000	238,698,600	
国庫債券 利付(10年)第328回	230,000,000	237,323,200	

回			
国庫債券 利付(10年)第329回	350,000,000	364,892,500	
国庫債券 利付(10年)第330回	220,000,000	229,911,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	150,000,000	155,370,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	350,000,000	363,219,500	
国庫債券 利付(10年)第333回	80,000,000	83,176,800	
国庫債券 利付(10年)第334回	180,000,000	187,506,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	410,000,000	425,604,600	
国庫債券 利付(10年)第336回	270,000,000	280,737,900	
国庫債券 利付(10年)第337回	220,000,000	226,157,800	
国庫債券 利付(10年)第338回	390,000,000	403,653,900	
国庫債券 利付(10年)第339回	440,000,000	456,051,200	
国庫債券 利付(10年)第340回	335,000,000	347,713,250	
国庫債券 利付(10年)第341回	400,000,000	412,996,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	300,000,000	305,802,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	250,000,000	254,915,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	350,000,000	356,846,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	100,000,000	101,941,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	330,000,000	336,332,700	
国庫債券 利付(10年)第347回	230,000,000	234,257,300	
国庫債券 利付(10年)第348回	150,000,000	152,662,500	
国庫債券 利付(10年)第349回	240,000,000	244,058,400	

国庫債券 利付(10年)第350回	160,000,000	162,558,400	
国庫債券 利付(10年)第352回	60,000,000	60,807,600	
国庫債券 利付(30年)第3回	40,000,000	50,149,200	
国庫債券 利付(30年)第5回	10,000,000	12,571,000	
国庫債券 利付(30年)第6回	10,000,000	12,895,700	
国庫債券 利付(30年)第7回	15,000,000	19,263,750	
国庫債券 利付(30年)第8回	20,000,000	24,464,200	
国庫債券 利付(30年)第9回	20,000,000	23,387,800	
国庫債券 利付(30年)第10回	30,000,000	33,882,900	
国庫債券 利付(30年)第11回	10,000,000	12,149,000	
国庫債券 利付(30年)第12回	10,000,000	12,746,500	
国庫債券 利付(30年)第13回	10,000,000	12,629,300	
国庫債券 利付(30年)第14回	30,000,000	39,748,200	
国庫債券 利付(30年)第15回	70,000,000	94,019,100	
国庫債券 利付(30年)第16回	10,000,000	13,455,500	
国庫債券 利付(30年)第17回	20,000,000	26,670,600	
国庫債券 利付(30年)第18回	120,000,000	158,516,400	
国庫債券 利付(30年)第19回	10,000,000	13,237,300	
国庫債券 利付(30年)第20回	10,000,000	13,593,500	
国庫債券 利付(30年)第21回	60,000,000	79,739,400	
国庫債券 利付(30年)第22回	50,000,000	68,259,500	
国庫債券 利付(30年)第23回	40,000,000	54,723,200	
国庫債券 利付(30年)第24回	80,000,000	109,762,400	
国庫債券 利付(30年)第25回	50,000,000	66,983,500	
国庫債券 利付(30年)第26回	80,000,000	108,810,400	
国庫債券 利付(30年)第27回	100,000,000	138,238,000	
国庫債券 利付(30年)第28回	30,000,000	41,647,500	
国庫債券 利付(30年)第29回	120,000,000	164,934,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	80,000,000	108,858,400	
国庫債券 利付(30年)第31回	60,000,000	80,769,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	90,000,000	123,362,100	
国庫債券 利付(30年)第33回	130,000,000	170,985,100	
国庫債券 利付(30年)第34回	110,000,000	149,713,300	
国庫債券 利付(30年)第35回	122,000,000	161,426,740	
国庫債券 利付(30年)第36回	130,000,000	172,669,900	

国庫債券	利付(30年)第37回	130,000,000	170,370,200
国庫債券	利付(30年)第38回	90,000,000	116,269,200
国庫債券	利付(30年)第39回	80,000,000	105,323,200
国庫債券	利付(30年)第40回	120,000,000	155,514,000
国庫債券	利付(30年)第41回	100,000,000	127,493,000
国庫債券	利付(30年)第42回	60,000,000	76,557,000
国庫債券	利付(30年)第43回	90,000,000	115,057,800
国庫債券	利付(30年)第44回	110,000,000	140,738,400
国庫債券	利付(30年)第45回	90,000,000	110,970,900
国庫債券	利付(30年)第46回	100,000,000	123,498,000
国庫債券	利付(30年)第47回	110,000,000	138,637,400
国庫債券	利付(30年)第48回	110,000,000	133,386,000
国庫債券	利付(30年)第49回	120,000,000	145,550,400
国庫債券	利付(30年)第50回	110,000,000	116,893,700
国庫債券	利付(30年)第54回	160,000,000	169,728,000
国庫債券	利付(30年)第55回	80,000,000	84,798,400
国庫債券	利付(30年)第56回	80,000,000	84,730,400
国庫債券	利付(30年)第57回	110,000,000	116,408,600
国庫債券	利付(30年)第58回	110,000,000	116,310,700
国庫債券	利付(30年)第59回	30,000,000	30,902,400
国庫債券	利付(20年)第44回	10,000,000	10,290,400
国庫債券	利付(20年)第45回	10,000,000	10,279,500
国庫債券	利付(20年)第46回	5,000,000	5,159,450
国庫債券	利付(20年)第47回	15,000,000	15,567,900
国庫債券	利付(20年)第48回	30,000,000	31,480,500
国庫債券	利付(20年)第49回	40,000,000	41,908,400
国庫債券	利付(20年)第52回	25,000,000	26,481,000
国庫債券	利付(20年)第53回	10,000,000	10,649,200
国庫債券	利付(20年)第54回	10,000,000	10,677,600
国庫債券	利付(20年)第55回	10,000,000	10,675,600
国庫債券	利付(20年)第56回	10,000,000	10,730,600
国庫債券	利付(20年)第57回	10,000,000	10,697,100
国庫債券	利付(20年)第58回	10,000,000	10,750,200
国庫債券	利付(20年)第59回	30,000,000	32,170,500
国庫債券	利付(20年)第60回	10,000,000	10,607,700
国庫債券	利付(20年)第61回	10,000,000	10,482,700

国庫債券	利付（20年）第62回	10,000,000	10,425,500	
国庫債券	利付（20年）第63回	10,000,000	10,862,000	
国庫債券	利付（20年）第64回	10,000,000	10,956,200	
国庫債券	利付（20年）第65回	10,000,000	11,008,600	
国庫債券	利付（20年）第66回	20,000,000	21,919,800	
国庫債券	利付（20年）第67回	10,000,000	11,060,600	
国庫債券	利付（20年）第68回	10,000,000	11,214,300	
国庫債券	利付（20年）第69回	30,000,000	33,489,000	
国庫債券	利付（20年）第70回	40,000,000	45,530,800	
国庫債券	利付（20年）第71回	10,000,000	11,275,100	
国庫債券	利付（20年）第72回	20,000,000	22,559,200	
国庫債券	利付（20年）第73回	10,000,000	11,278,400	
国庫債券	利付（20年）第74回	10,000,000	11,337,300	
国庫債券	利付（20年）第75回	40,000,000	45,563,600	
国庫債券	利付（20年）第76回	17,000,000	19,155,770	
国庫債券	利付（20年）第77回	15,000,000	16,994,250	
国庫債券	利付（20年）第78回	10,000,000	11,321,200	
国庫債券	利付（20年）第79回	10,000,000	11,385,200	
国庫債券	利付（20年）第80回	10,000,000	11,449,200	
国庫債券	利付（20年）第81回	10,000,000	11,440,900	
国庫債券	利付（20年）第82回	15,000,000	17,261,250	
国庫債券	利付（20年）第83回	15,000,000	17,341,800	
国庫債券	利付（20年）第84回	50,000,000	57,461,000	
国庫債券	利付（20年）第85回	13,000,000	15,103,660	
国庫債券	利付（20年）第86回	10,000,000	11,761,400	
国庫債券	利付（20年）第88回	20,000,000	23,641,000	
国庫債券	利付（20年）第90回	20,000,000	23,596,200	
国庫債券	利付（20年）第91回	10,000,000	11,874,700	
国庫債券	利付（20年）第92回	30,000,000	35,307,900	
国庫債券	利付（20年）第93回	20,000,000	23,468,600	
国庫債券	利付（20年）第94回	20,000,000	23,632,000	
国庫債券	利付（20年）第95回	10,000,000	12,026,400	
国庫債券	利付（20年）第96回	15,000,000	17,787,300	
国庫債券	利付（20年）第97回	50,000,000	59,956,500	
国庫債券	利付（20年）第99回	30,000,000	35,833,500	
国庫債券	利付（20年）第100回	20,000,000	24,148,400	

回			
国庫債券 利付(20年)第101回	20,000,000	24,513,800	
国庫債券 利付(20年)第102回	20,000,000	24,605,400	
国庫債券 利付(20年)第103回	25,000,000	30,522,250	
国庫債券 利付(20年)第104回	10,000,000	12,021,300	
国庫債券 利付(20年)第105回	70,000,000	84,410,900	
国庫債券 利付(20年)第106回	10,000,000	12,154,900	
国庫債券 利付(20年)第107回	20,000,000	24,189,200	
国庫債券 利付(20年)第108回	80,000,000	95,179,200	
国庫債券 利付(20年)第109回	30,000,000	35,799,300	
国庫債券 利付(20年)第110回	90,000,000	109,215,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	10,000,000	12,279,200	
国庫債券 利付(20年)第112回	85,000,000	103,495,150	
国庫債券 利付(20年)第113回	210,000,000	256,401,600	
国庫債券 利付(20年)第114回	130,000,000	159,227,900	
国庫債券 利付(20年)第115回	50,000,000	61,782,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	110,000,000	136,358,200	
国庫債券 利付(20年)第117回	60,000,000	73,714,800	
国庫債券 利付(20年)第118回	40,000,000	48,843,600	
国庫債券 利付(20年)第119回	50,000,000	59,926,500	
国庫債券 利付(20年)第120回	110,000,000	129,356,700	
国庫債券 利付(20年)第121回	100,000,000	121,306,000	

国庫債券 利付(20年)第122回	130,000,000	156,200,200	
国庫債券 利付(20年)第123回	100,000,000	123,968,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	100,000,000	122,793,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	100,000,000	125,513,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	30,000,000	36,935,100	
国庫債券 利付(20年)第127回	120,000,000	146,304,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	100,000,000	122,149,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	50,000,000	60,464,500	
国庫債券 利付(20年)第130回	90,000,000	109,080,900	
国庫債券 利付(20年)第131回	35,000,000	41,985,300	
国庫債券 利付(20年)第132回	60,000,000	72,117,600	
国庫債券 利付(20年)第133回	150,000,000	182,193,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	70,000,000	85,198,400	
国庫債券 利付(20年)第135回	60,000,000	72,253,800	
国庫債券 利付(20年)第136回	30,000,000	35,740,500	
国庫債券 利付(20年)第137回	40,000,000	48,260,800	
国庫債券 利付(20年)第138回	50,000,000	59,015,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	60,000,000	71,604,600	
国庫債券 利付(20年)第140回	140,000,000	169,225,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	140,000,000	169,521,800	
国庫債券 利付(20年)第142回	100,000,000	122,443,000	
国庫債券 利付(20年)第143回	130,000,000	155,883,000	

	回			
	国庫債券 利付（20年）第144回	80,000,000	94,825,600	
	国庫債券 利付（20年）第145回	140,000,000	170,086,000	
	国庫債券 利付（20年）第146回	140,000,000	170,360,400	
	国庫債券 利付（20年）第147回	150,000,000	180,640,500	
	国庫債券 利付（20年）第148回	120,000,000	142,939,200	
	国庫債券 利付（20年）第149回	40,000,000	47,699,600	
	国庫債券 利付（20年）第150回	130,000,000	153,112,700	
	国庫債券 利付（20年）第151回	40,000,000	45,892,000	
	国庫債券 利付（20年）第153回	120,000,000	139,660,800	
	国庫債券 利付（20年）第155回	160,000,000	178,518,400	
	国庫債券 利付（20年）第157回	40,000,000	39,211,600	
	国庫債券 利付（20年）第158回	40,000,000	41,198,400	
	国庫債券 利付（20年）第160回	70,000,000	74,355,400	
	国庫債券 利付（20年）第161回	110,000,000	114,736,600	
	国庫債券 利付（20年）第162回	140,000,000	145,852,000	
	国庫債券 利付（20年）第163回	190,000,000	197,693,100	
	国庫債券 利付（20年）第164回	90,000,000	91,838,700	
	国庫債券 利付（20年）第166回	40,000,000	42,217,600	
小計	銘柄数：243	23,822,000,000	26,349,042,170	
	組入時価比率：99.3%		100.0%	
合計			26,349,042,170	

(注1)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。

外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2019年 2月18日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	3,216,131,821
コール・ローン	154,206,780
株式	532,392,636,972
投資証券	14,392,028,691
派生商品評価勘定	207,831,017
未収入金	33,769,212
未収配当金	661,686,303
差入委託証拠金	1,634,476,618
流動資産合計	552,692,767,414
資産合計	552,692,767,414
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	489,650
未払解約金	241,998,462
未払利息	265
その他未払費用	3,031,200
流動負債合計	245,519,577
負債合計	245,519,577
純資産の部	
元本等	
元本	208,348,489,022
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	344,098,758,815
元本等合計	552,447,247,837
純資産合計	552,447,247,837
負債純資産合計	552,692,767,414

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 2月18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	2.6516円
(10,000口当たり純資産額)	(26,516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 2月20日 至 2019年 2月18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。	
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、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。	
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。	
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。	
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。	
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。	

3.金融商品に係るリスク管理体制

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 2月18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 2月18日現在

期首	2018年 2月20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	178,486,420,771円
同期中における追加設定元本額	47,237,604,425円
同期中における一部解約元本額	17,375,536,174円
期末元本額	208,348,489,022円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	51,418,731円
バランスセレクト50	159,195,303円
バランスセレクト70	166,601,205円
野村外国株式インデックスファンド	541,236,602円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,697,473,815円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	6,789,901,302円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,639,458,889円
野村資産設計ファンド2015	19,653,237円
野村資産設計ファンド2020	22,833,579円

野村資産設計ファンド2025	35,529,721円
野村資産設計ファンド2030	40,272,393円
野村資産設計ファンド2035	29,482,006円
野村資産設計ファンド2040	69,656,303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)	36,466,072,900円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	1,100,777,160円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	7,295,488,548円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	4,863,902,252円
野村資産設計ファンド2045	10,517,092円
野村インデックスファンド・外国株式	4,132,525,416円
マイ・ロード	1,436,633,547円
ネクストコア	17,189,286円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	109,568,774円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,160,981,478円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	425,277,113円
野村資産設計ファンド2050	16,633,618円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,141,240円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,977,544円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,393,679円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	868,964円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	189,588,456円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	296,872,754円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,571,895円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,519,168円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,288,823円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,841,971円
インデックス・ブレンド(タイプ)	16,341,862円
野村6資産均等バランス	224,407,003円
野村つみたて外国株投信	1,917,636,674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)	3,717,617,279円
世界6資産分散ファンド	67,490,925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	279,909,060円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	504,180,209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)	302,326,394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)	242,968,657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)	1,516,811,232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)	2,517,928,592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)	3,057,094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)	9,305,302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)	3,919,046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)	5,038,800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)	70,872,091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)	168,363,883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)	53,538,848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)	49,197,659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)	182,196,736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)	3,412,388,109円

野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	414,416,329円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	117,966,454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)	769,229,865円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	16,602,791,548円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,420,327円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	13,579,805円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	14,585,463円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	63,819,918,660円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,469,252,584円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,953,913,603円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,532,937,540円
マイバランスDC30	953,940,977円
マイバランスDC50	1,781,231,739円
マイバランスDC70	1,420,057,342円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	18,749,987,173円
野村DC運用戦略ファンド	129,881,261円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	6,248,726円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	201,563,986円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	123,064,330円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	82,550,783円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	4,261,900円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,273,543円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	9,584,296円
野村資産設計ファンド(DC)2030	431,908円
野村資産設計ファンド(DC)2040	411,193円
野村資産設計ファンド(DC)2050	891,629円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	47,509,400円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	23,227,898円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	7,566,939円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	14,951,602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2月18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	25.83	1,759,023.00	
		HALLIBURTON CO	119,600	31.85	3,809,260.00	
		HELMERICH & PAYNE	14,600	57.40	838,040.00	

NATIONAL OILWELL VARCO INC	50,600	29.81	1,508,386.00
SCHLUMBERGER LTD	191,100	44.95	8,589,945.00
TECHNIPFMC PLC	61,000	23.54	1,435,940.00
ANADARKO PETE	71,300	45.23	3,224,899.00
ANTERO RESOURCES CORP	27,000	9.61	259,470.00
APACHE CORPORATION	54,100	33.30	1,801,530.00
CABOT OIL & GAS CORP	58,500	25.23	1,475,955.00
CHENIERE ENERGY INC	28,600	66.22	1,893,892.00
CHEVRON CORP	263,400	119.35	31,436,790.00
CIMAREX ENERGY CO	13,800	75.99	1,048,662.00
CONCHO RESOURCES INC	27,600	122.97	3,393,972.00
CONOCOPHILLIPS	158,600	70.18	11,130,548.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	13,900	46.93	652,327.00
DEVON ENERGY CORP	67,300	28.42	1,912,666.00
DIAMONDBACK ENERGY INC	21,600	105.50	2,278,800.00
EOG RESOURCES INC	80,000	100.25	8,020,000.00
EXXON MOBIL CORP	581,800	77.71	45,211,678.00
HESS CORP	36,600	57.58	2,107,428.00
HOLLYFRONTIER CORP	23,600	57.89	1,366,204.00
KINDER MORGAN INC	273,000	18.80	5,132,400.00
MARATHON OIL CORP	119,000	17.08	2,032,520.00
MARATHON PETROLEUM CORP	94,600	65.15	6,163,190.00
NOBLE ENERGY INC	64,400	22.64	1,458,016.00
OCCIDENTAL PETE CORP	105,700	67.19	7,101,983.00
ONEOK INC	56,000	67.71	3,791,760.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	37,000	18.73	693,010.00
PHILLIPS 66	61,000	95.99	5,855,390.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	23,200	145.35	3,372,120.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	19,000	24.22	460,180.00
TARGA RESOURCES CORP	29,900	45.51	1,360,749.00
VALERO ENERGY CORP	58,000	84.40	4,895,200.00
WILLIAMS COS	168,100	27.27	4,584,087.00
AIR PRODUCTS	30,400	174.08	5,292,032.00
ALBEMARLE CORP	14,800	81.37	1,204,276.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	29,200	26.68	779,056.00

CELANESE CORP-SERIES A	18,000	100.26	1,804,680.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	31,400	41.77	1,311,578.00
CHEMOURS CO/THE	23,400	37.75	883,350.00
DOWDUPONT INC	317,500	54.24	17,221,200.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	18,600	82.71	1,538,406.00
ECOLAB INC	36,000	163.48	5,885,280.00
FMC CORP	18,000	85.35	1,536,300.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	11,500	132.01	1,518,115.00
LINDE PLC	75,900	168.54	12,792,186.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	45,500	87.64	3,987,620.00
MOSAIC CO/THE	48,800	32.11	1,566,968.00
PPG INDUSTRIES	32,600	109.11	3,556,986.00
SHERWIN-WILLIAMS	11,650	439.18	5,116,447.00
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5,000	80.88	404,400.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	8,900	190.06	1,691,534.00
VULCAN MATERIALS CO	18,600	113.14	2,104,404.00
AVERY DENNISON CORP	12,200	104.90	1,279,780.00
BALL CORP	45,400	54.13	2,457,502.00
CROWN HOLDINGS INC	19,100	53.28	1,017,648.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	52,300	47.15	2,465,945.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	13,200	98.47	1,299,804.00
SEALED AIR CORP	21,900	42.15	923,085.00
WESTROCK CO	34,200	39.05	1,335,510.00
FREEMONT-MCMORAN INC	187,000	12.28	2,296,360.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	71,700	33.24	2,383,308.00
NUCOR CORP	42,700	59.50	2,540,650.00
STEEL DYNAMICS	33,400	37.09	1,238,806.00
ARCONIC INC	57,000	17.55	1,000,350.00
BOEING CO	75,050	417.97	31,368,648.50
GENERAL DYNAMICS	34,500	175.24	6,045,780.00
HARRIS CORP	16,000	164.80	2,636,800.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,660	219.70	1,243,502.00
L3 TECHNOLOGIES INC	10,900	212.24	2,313,416.00
LOCKHEED MARTIN	34,980	307.23	10,746,905.40
NORTHROP GRUMMAN CORP	22,890	286.98	6,568,972.20

RAYTHEON COMPANY	39,400	184.61	7,273,634.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	14,600	95.71	1,397,366.00
TEXTRON INC	33,500	54.82	1,836,470.00
TRANSDIGM GROUP INC	6,350	440.09	2,794,571.50
UNITED TECHNOLOGIES	112,800	127.76	14,411,328.00
ALLEGION PLC	13,600	91.56	1,245,216.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	19,400	47.40	919,560.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	127,100	35.10	4,461,210.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,100	246.71	1,258,221.00
MASCO CORP	42,800	37.46	1,603,288.00
OWENS CORNING INC	14,200	54.69	776,598.00
SMITH (A.O.) CORP	18,600	51.64	960,504.00
FLUOR CORP	18,400	36.31	668,104.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17,900	68.72	1,230,088.00
ACUITY BRANDS INC	5,000	131.09	655,450.00
AMETEK INC	31,800	79.01	2,512,518.00
EATON CORP PLC	60,100	78.73	4,731,673.00
EMERSON ELEC	86,100	68.31	5,881,491.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	16,800	177.39	2,980,152.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	24,300	49.27	1,197,261.00
3M CORP	80,800	208.86	16,875,888.00
GENERAL ELEC CO	1,198,000	10.09	12,087,820.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	102,300	153.32	15,684,636.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	30,700	70.51	2,164,657.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	30,000	38.63	1,158,900.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	14,350	311.96	4,476,626.00
CATERPILLAR INC DEL	81,100	136.20	11,045,820.00
CUMMINS INC	21,600	155.47	3,358,152.00
DEERE & COMPANY	42,200	158.99	6,709,378.00
DOVER CORP	19,700	91.20	1,796,640.00
FLOWSERVE CORP	17,200	47.78	821,816.00
FORTIVE CORP	40,600	81.80	3,321,080.00
IDEX CORP	10,300	144.12	1,484,436.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	41,800	144.21	6,027,978.00

INGERSOLL-RAND PLC	33,400	104.73	3,497,982.00
MIDDLEBY CORP	7,500	126.27	947,025.00
PACCAR	47,800	68.10	3,255,180.00
PARKER HANNIFIN CORP	18,100	173.66	3,143,246.00
PENTAIR PLC	23,200	42.72	991,104.00
SNAP-ON INC	7,400	157.78	1,167,572.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	21,100	136.39	2,877,829.00
WABCO HOLDINGS INC	7,000	116.77	817,390.00
WABTEC CORP	11,500	74.92	861,580.00
XYLEM INC	23,900	73.93	1,766,927.00
AERCAP HOLDINGS NV	16,900	48.07	812,383.00
FASTENAL CO	38,700	62.97	2,436,939.00
GRAINGER(W.W.) INC	6,430	316.62	2,035,866.60
HD SUPPLY HOLDINGS INC	22,900	43.81	1,003,249.00
UNITED RENTALS INC	11,200	134.86	1,510,432.00
CINTAS CORP	12,700	203.79	2,588,133.00
COPART INC	27,900	54.03	1,507,437.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	30,800	77.63	2,391,004.00
ROLLINS INC	21,000	40.11	842,310.00
WASTE CONNECTIONS INC	36,800	82.82	3,047,776.00
WASTE MANAGEMENT INC	59,300	99.06	5,874,258.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	18,300	91.45	1,673,535.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	23,000	73.64	1,693,720.00
FEDEX CORPORATION	34,400	179.30	6,167,920.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	94,600	110.87	10,488,302.00
XPO LOGISTICS INC	18,000	51.97	935,460.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,600	35.05	511,730.00
DELTA AIR LINES INC	22,400	51.08	1,144,192.00
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	57.70	1,142,460.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	9,200	88.31	812,452.00
AMERCO	1,170	376.42	440,411.40
CSX CORP	111,500	72.54	8,088,210.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	11,800	113.59	1,340,362.00
KANSAS CITY SOUTHERN	14,200	107.54	1,527,068.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	16,700	33.53	559,951.00

HOLDINGS INC			
NORFOLK SOUTHERN CORP	38,700	182.87	7,077,069.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,600	146.37	1,258,782.00
UNION PAC CORP	101,800	170.24	17,330,432.00
APTIV PLC	36,700	80.95	2,970,865.00
AUTOLIV INC	11,900	78.23	930,937.00
BORGWARNER INC	29,600	41.92	1,240,832.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	34,000	18.79	638,860.00
LEAR CORP	9,300	156.99	1,460,007.00
FORD MOTOR COMPANY	516,000	8.54	4,406,640.00
GENERAL MOTORS CO	175,700	39.09	6,868,113.00
HARLEY-DAVIDSON INC	22,400	37.30	835,520.00
TESLA INC	17,520	307.88	5,394,057.60
DR HORTON INC	48,000	39.97	1,918,560.00
GARMIN LTD	15,200	71.62	1,088,624.00
LEGGETT & PLATT INC	18,900	44.95	849,555.00
LENNAR CORP-A	40,700	48.90	1,990,230.00
MOHAWK INDUSTRIES	8,700	139.21	1,211,127.00
NEWELL BRANDS INC	67,000	17.16	1,149,720.00
NVR INC	480	2,662.85	1,278,168.00
PULTEGROUP INC	37,900	27.12	1,027,848.00
WHIRLPOOL CORP	9,300	139.36	1,296,048.00
HASBRO INC	15,800	86.40	1,365,120.00
MATTEL INC	48,000	13.82	663,360.00
POLARIS INDUSTRIES INC	8,300	86.78	720,274.00
CAPRI HOLDINGS LTD	19,900	44.49	885,351.00
HANESBRANDS INC	51,000	18.77	957,270.00
LULULEMON ATHLETICA INC	13,800	151.09	2,085,042.00
NIKE INC-B	176,400	85.38	15,061,032.00
PVH CORP	9,900	112.90	1,117,710.00
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	125.09	975,702.00
TAPESTRY INC	38,300	35.91	1,375,353.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	24,000	21.16	507,840.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	25,000	19.04	476,000.00
V F CORP	45,400	86.90	3,945,260.00

ARAMARK	35,400	31.80	1,125,720.00
CARNIVAL CORP	58,600	57.25	3,354,850.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,390	605.89	2,053,967.10
DARDEN RESTAURANTS INC	16,600	112.12	1,861,192.00
DOMINOS PIZZA INC	5,270	281.65	1,484,295.50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	39,500	81.75	3,229,125.00
LAS VEGAS SANDS CORP	54,900	60.31	3,311,019.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	40,900	121.05	4,950,945.00
MCDONALD'S CORP	106,700	179.97	19,202,799.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	21.74	739,160.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	70,000	28.21	1,974,700.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	30,200	53.03	1,601,506.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,700	117.97	2,677,919.00
STARBUCKS CORP	185,900	70.71	13,144,989.00
VAIL RESORTS INC	5,410	206.40	1,116,624.00
WYNN RESORTS LTD	13,800	124.51	1,718,238.00
YUM BRANDS INC	44,100	94.12	4,150,692.00
GENUINE PARTS CO	19,600	107.59	2,108,764.00
LKQ CORP	45,000	27.15	1,221,750.00
AMAZON.COM INC	56,930	1,607.95	91,540,593.50
BOOKING HOLDINGS INC	6,540	1,933.57	12,645,547.80
EBAY INC	127,700	36.58	4,671,266.00
EXPEDIA GROUP INC	17,300	127.09	2,198,657.00
GRUBHUB INC	11,900	83.21	990,199.00
MERCADOLIBRE INC	5,710	363.10	2,073,301.00
QURATE RETAIL INC - A	58,000	21.86	1,267,880.00
WAYFAIR INC - CLASS A	7,500	122.11	915,825.00
DOLLAR GENERAL CORP	36,100	119.00	4,295,900.00
DOLLAR TREE INC	32,400	98.85	3,202,740.00
KOHL'S CORP	22,500	65.93	1,483,425.00
MACYS INC	43,700	24.88	1,087,256.00
NORDSTROM INC	15,000	44.44	666,600.00
TARGET CORP	68,600	72.84	4,996,824.00
ADVANCE AUTO PARTS	9,900	169.99	1,682,901.00
AUTOZONE	3,680	919.75	3,384,680.00
BEST BUY COMPANY INC	33,800	60.18	2,034,084.00

BURLINGTON STORES INC	8,900	162.81	1,449,009.00	
CARMAX INC	23,900	62.06	1,483,234.00	
GAP INC	31,500	25.07	789,705.00	
HOME DEPOT	157,300	192.39	30,262,947.00	
L BRANDS, INC	30,300	27.34	828,402.00	
LOWES COS INC	111,800	104.24	11,654,032.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,070	388.00	4,295,160.00	
ROSS STORES INC	52,200	94.01	4,907,322.00	
TIFFANY & CO	14,400	90.83	1,307,952.00	
TJX COS INC	169,600	50.23	8,519,008.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	16,300	97.58	1,590,554.00	
ULTA BEAUTY INC	7,890	306.36	2,417,180.40	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	60,400	216.47	13,074,788.00	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	8.98	404,100.00	
KROGER CO	107,600	29.50	3,174,200.00	
SYSCO CORP	67,800	67.54	4,579,212.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	116,400	73.43	8,547,252.00	
WALMART INC	203,000	99.99	20,297,970.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	35,600	48.93	1,741,908.00	
COCA COLA CO	555,500	45.24	25,130,820.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	29,200	46.68	1,363,056.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	22,800	174.91	3,987,948.00	
MOLSON COORS BREWING CO-B	25,600	60.91	1,559,296.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	55,900	58.72	3,282,448.00	
PEPSICO INC	194,500	115.91	22,544,495.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	75,500	41.98	3,169,490.00	
BUNGE LIMITED	19,100	52.31	999,121.00	
CAMPBELL SOUP CO	24,800	34.79	862,792.00	
CONAGRA BRANDS INC	66,700	24.50	1,634,150.00	
GENERAL MILLS	80,500	45.04	3,625,720.00	
HERSHEY CO/THE	19,000	109.35	2,077,650.00	
HORMEL FOODS CORP	39,100	43.20	1,689,120.00	
INGREDION INC	9,600	93.77	900,192.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,900	103.38	1,643,742.00	
KELLOGG CO	35,600	56.79	2,021,724.00	

KRAFT HEINZ CO/THE	84,700	47.62	4,033,414.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	19,300	69.51	1,341,543.00	
MCCORMICK & CO INC.	16,800	128.47	2,158,296.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	202,400	48.16	9,747,584.00	
TYSON FOODS INC-CL A	41,000	62.61	2,567,010.00	
ALTRIA GROUP INC	259,700	48.74	12,657,778.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	214,000	83.46	17,860,440.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	32,900	64.69	2,128,301.00	
CLOROX CO	17,700	156.28	2,766,156.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	112,700	66.48	7,492,296.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	48,100	118.44	5,696,964.00	
PROCTER & GAMBLE CO	342,200	98.48	33,699,856.00	
COTY INC-CL A	65,000	11.04	717,600.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	31,100	155.01	4,820,811.00	
ABBOTT LABORATORIES	241,500	75.25	18,172,875.00	
ABIOMED INC	5,870	362.06	2,125,292.20	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,200	254.96	2,600,592.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	69,600	73.43	5,110,728.00	
BECTON,DICKINSON	36,900	248.34	9,163,746.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	189,100	40.01	7,565,891.00	
DANAHER CORP	86,000	111.24	9,566,640.00	
DENTSPLY SIRONA INC	30,300	43.58	1,320,474.00	
DEXCOM INC	11,600	148.49	1,722,484.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	28,400	177.78	5,048,952.00	
HOLOGIC INC	37,000	46.29	1,712,730.00	
IDEXX LABORATORIES INC	12,100	210.26	2,544,146.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	15,540	548.50	8,523,690.00	
MEDTRONIC PLC	185,900	92.27	17,152,993.00	
RESMED INC	19,200	100.45	1,928,640.00	
STRYKER CORP	46,500	186.83	8,687,595.00	
TELEFLEX INC	6,320	285.89	1,806,824.80	
THE COOPER COMPANIES, INC.	6,580	279.07	1,836,280.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12,900	132.74	1,712,346.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	28,400	123.65	3,511,660.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	22,000	86.66	1,906,520.00	

ANTHEM INC	35,480	311.58	11,054,858.40
CARDINAL HEALTH INC	41,000	55.48	2,274,680.00
CENTENE CORP	55,800	64.97	3,625,326.00
CIGNA CORP	51,900	197.87	10,269,453.00
CVS HEALTH CORP	178,100	69.53	12,383,293.00
DAVITA INC	17,500	59.10	1,034,250.00
HCA HEALTHCARE INC	37,500	144.26	5,409,750.00
HENRY SCHEIN INC	20,500	62.39	1,278,995.00
HUMANA INC	19,070	310.30	5,917,421.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,200	150.17	2,132,414.00
MCKESSON CORP	27,000	135.56	3,660,120.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	19,100	87.81	1,677,171.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	132,300	271.13	35,870,499.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	11,800	135.53	1,599,254.00
WELLCARE HEALTH PLANS INC	7,050	279.15	1,968,007.50
ABBVIE INC	208,400	80.85	16,849,140.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	30,700	129.42	3,973,194.00
ALKERMES PLC	20,100	32.54	654,054.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,700	83.53	1,060,831.00
AMGEN INC	89,100	188.34	16,781,094.00
BEIGENE, LTD ADR	4,600	132.22	608,212.00
BIOGEN INC	27,510	332.87	9,157,253.70
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	24,100	93.99	2,265,159.00
CELGENE CORP	96,200	90.69	8,724,378.00
GILEAD SCIENCES INC	178,600	67.59	12,071,574.00
INCYTE CORP	24,900	84.15	2,095,335.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,040	423.97	4,680,628.80
SEATTLE GENETICS INC	15,400	71.48	1,100,792.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,300	119.63	753,669.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	35,000	188.07	6,582,450.00
ALLERGAN PLC	46,400	139.07	6,452,848.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	225,000	51.67	11,625,750.00
ELI LILLY & CO.	133,100	122.48	16,302,088.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,800	125.93	982,254.00
JOHNSON & JOHNSON	368,600	136.38	50,269,668.00

MERCK & CO INC	365,600	79.81	29,178,536.00
MYLAN NV	69,300	31.84	2,206,512.00
NEKTAR THERAPEUTICS	25,000	41.69	1,042,250.00
PERRIGO CO PLC	16,500	48.95	807,675.00
PFIZER INC	805,700	42.40	34,161,680.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	133,000	17.98	2,391,340.00
ZOETIS INC	66,000	95.37	6,294,420.00
BANK OF AMERICA CORP	1,304,200	29.11	37,965,262.00
BB&T CORPORATION	104,900	50.70	5,318,430.00
CIT GROUP INC	16,700	50.77	847,859.00
CITIGROUP	346,300	64.27	22,256,701.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	63,900	36.70	2,345,130.00
COMERICA INC	23,000	86.37	1,986,510.00
EAST WEST BANCORP INC	20,700	53.93	1,116,351.00
FIFTH THIRD BANCORP	90,300	27.17	2,453,451.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	22,600	101.63	2,296,838.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	154,000	14.01	2,157,540.00
JPMORGAN CHASE & CO	461,800	105.55	48,742,990.00
KEYCORP	146,000	17.51	2,556,460.00
M & T BANK CORP	18,900	172.27	3,255,903.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	50,000	17.34	867,000.00
PNC FINANCIAL	64,100	124.15	7,958,015.00
REGIONS FINANCIAL CORP	153,000	16.00	2,448,000.00
SIGNATURE BANK	7,600	133.65	1,015,740.00
SUNTRUST BKS INC.	63,500	65.12	4,135,120.00
SVB FINANCIAL GROUP	7,400	246.95	1,827,430.00
US BANCORP	211,200	51.31	10,836,672.00
WELLS FARGO CO	629,000	49.22	30,959,380.00
ZIONS BANCORP NA	27,500	50.11	1,378,025.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	31,000	19.34	599,540.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	178,300	205.29	36,603,207.00
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	42,000	21.02	882,840.00
VOYA FINANCIAL INC	21,700	49.58	1,075,886.00
AFLAC INC	105,300	49.28	5,189,184.00
ALLEGHANY CORP	2,100	648.84	1,362,564.00

ALLSTATE CORP	48,100	94.38	4,539,678.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	10,800	98.10	1,059,480.00
AMERICAN INTL GROUP	123,100	42.32	5,209,592.00
AON PLC	32,900	171.97	5,657,813.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,000	31.50	1,764,000.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,900	79.84	1,988,016.00
ASSURANT INC	7,600	98.21	746,396.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,400	44.33	948,662.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	13,900	41.95	583,105.00
CHUBB LTD	63,300	133.21	8,432,193.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	21,600	85.48	1,846,368.00
EVEREST RE GROUP LTD	5,600	216.93	1,214,808.00
FNF GROUP	37,200	34.76	1,293,072.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	48,200	48.73	2,348,786.00
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	61.61	1,842,139.00
LOEWS CORP	36,100	46.70	1,685,870.00
MARKEL CORP	1,860	1,009.80	1,878,228.00
MARSH & MCLENNAN COS	69,100	91.16	6,299,156.00
METLIFE INC	115,900	44.86	5,199,274.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	38,000	50.79	1,930,020.00
PROGRESSIVE CO	80,800	71.26	5,757,808.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	57,200	94.15	5,385,380.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	9,000	144.36	1,299,240.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,900	142.17	838,803.00
TORCHMARK CORP	14,000	83.36	1,167,040.00
TRAVELERS COS INC/THE	36,700	128.74	4,724,758.00
UNUM GROUP	31,200	36.32	1,133,184.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	17,800	169.56	3,018,168.00
WR BERKLEY CORP	13,000	81.40	1,058,200.00
ACCENTURE PLC-CL A	88,300	159.23	14,060,009.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	22,500	70.09	1,577,025.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,600	173.21	1,143,186.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	60,500	149.67	9,055,035.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	16,300	100.35	1,635,705.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	80,400	73.56	5,914,224.00

DXC TECHNOLOGY CO	37,800	65.46	2,474,388.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	45,100	108.93	4,912,743.00	
FIRST DATA CORP- CLASS A	74,000	25.58	1,892,920.00	
FISERV INC	56,200	85.78	4,820,836.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	12,100	224.05	2,711,005.00	
GARTNER INC	12,700	143.35	1,820,545.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	21,200	123.30	2,613,960.00	
GODADDY INC - CLASS A	22,700	72.86	1,653,922.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	125,700	138.03	17,350,371.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	10,600	133.79	1,418,174.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	20,000	63.37	1,267,400.00	
MASTERCARD INC	126,900	222.11	28,185,759.00	
PAYCHEX INC	45,000	75.78	3,410,100.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	154,900	94.91	14,701,559.00	
SABRE CORP	36,000	22.53	811,080.00	
SQUARE INC - A	41,800	75.64	3,161,752.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	22,200	92.78	2,059,716.00	
VERISIGN INC	14,700	175.40	2,578,380.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	244,200	144.91	35,387,022.00	
WESTERN UNION CO	59,000	17.80	1,050,200.00	
WIX.COM LTD	5,700	121.40	691,980.00	
WORLDPAY INC - CL A	40,700	88.23	3,590,961.00	
ADOBE INC	67,400	259.45	17,486,930.00	
ANSYS INC	11,500	174.49	2,006,635.00	
AUTODESK INC.	30,000	160.35	4,810,500.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	37,800	52.58	1,987,524.00	
CDK GLOBAL INC	16,700	58.19	971,773.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	17,200	120.10	2,065,720.00	
CITRIX SYSTEMS INC	18,500	106.49	1,970,065.00	
FORTINET INC	19,900	83.11	1,653,889.00	
INTUIT INC	33,700	233.32	7,862,884.00	
MICROSOFT CORP	1,000,400	108.22	108,263,288.00	
ORACLE CORPORATION	410,800	51.72	21,246,576.00	
PALO ALTO NETWORKS INC	12,600	226.77	2,857,302.00	

PTC INC	14,700	91.93	1,351,371.00
RED HAT INC	24,300	180.98	4,397,814.00
SALESFORCE.COM INC	99,000	159.05	15,745,950.00
SERVICENOW INC	24,100	234.89	5,660,849.00
SPLUNK INC	19,700	136.25	2,684,125.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	30,600	59.86	1,831,716.00
SYMANTEC CORP	83,000	23.15	1,921,450.00
SYNOPSYS INC	20,700	101.65	2,104,155.00
VMWARE INC - CLASS A	10,000	169.68	1,696,800.00
WORKDAY INC-CLASS A	19,900	190.79	3,796,721.00
ARISTA NETWORKS INC	7,400	263.95	1,953,230.00
CISCO SYSTEMS	646,600	49.43	31,961,438.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22,800	22.68	517,104.00
F5 NETWORKS INC	8,100	171.28	1,387,368.00
JUNIPER NETWORKS INC	46,700	27.12	1,266,504.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22,100	138.63	3,063,723.00
APPLE INC	663,300	170.42	113,039,586.00
DELL TECHNOLOGIES-C	20,790	55.00	1,143,450.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	200,000	16.09	3,218,000.00
HP INC	219,000	23.28	5,098,320.00
NETAPP INC	35,200	64.03	2,253,856.00
SEAGATE TECHNOLOGY	37,800	45.71	1,727,838.00
WESTERN DIGITAL CORP	38,300	47.65	1,824,995.00
XEROX CORP	28,900	30.46	880,294.00
AMPHENOL CORP-CL A	41,300	92.69	3,828,097.00
ARROW ELECTRS INC	12,100	81.19	982,399.00
CDW CORPORATION	21,100	94.84	2,001,124.00
COGNEX CORP	24,800	50.73	1,258,104.00
CORNING INC	112,700	34.51	3,889,277.00
FLEX LTD	76,000	10.25	779,000.00
FLIR SYSTEMS INC	17,800	52.41	932,898.00
IPG PHOTONICS CORP	4,730	154.88	732,582.40
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	25,200	80.38	2,025,576.00
TE CONNECTIVITY LTD	47,900	82.14	3,934,506.00
TRIMBLE INC	34,900	39.21	1,368,429.00

ADVANCED MICRO DEVICES	126,000	23.68	2,983,680.00
ANALOG DEVICES INC	51,000	105.74	5,392,740.00
APPLIED MATERIALS	136,300	39.10	5,329,330.00
BROADCOM INC	59,450	281.93	16,760,738.50
INTEL CORP	633,900	51.66	32,747,274.00
KLA TENCOR CORP	21,900	108.19	2,369,361.00
LAM RESEARCH	21,200	181.09	3,839,108.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	86,000	18.83	1,619,380.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	37,400	55.85	2,088,790.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	33,000	91.10	3,006,300.00
MICRON TECHNOLOGY	160,600	41.99	6,743,594.00
NVIDIA CORP	79,600	157.34	12,524,264.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	46,800	93.04	4,354,272.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	59,000	22.97	1,355,230.00
QORVO INC	17,600	65.16	1,146,816.00
QUALCOMM INC	193,800	51.98	10,073,724.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	23,800	83.38	1,984,444.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	133,900	107.57	14,403,623.00
XILINX INC	34,900	119.31	4,163,919.00
AT & T INC	998,300	30.47	30,418,201.00
CENTURYLINK INC	136,000	13.74	1,868,640.00
VERIZON COMMUNICATIONS	568,000	55.16	31,330,880.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	26,400	25.71	678,744.00
SPRINT CORP	109,000	6.30	686,700.00
T-MOBILE US INC	47,200	72.05	3,400,760.00
ALLIANT ENERGY CORP	31,000	44.98	1,394,380.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	68,300	79.27	5,414,141.00
DUKE ENERGY CORP	97,300	87.51	8,514,723.00
EDISON INTERNATIONAL	45,000	60.50	2,722,500.00
ENTERGY CORP	25,400	89.86	2,282,444.00
EVERGY INC	37,200	58.77	2,186,244.00
EVERSOURCE ENERGY	44,200	70.20	3,102,840.00
EXELON CORPORATION	132,200	48.26	6,379,972.00
FIRSTENERGY CORP	65,800	39.59	2,605,022.00
NEXTERA ENERGY INC	65,000	184.04	11,962,600.00

OGE ENERGY CORP	28,600	41.88	1,197,768.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	15,400	89.96	1,385,384.00
PPL CORPORATION	97,600	30.46	2,972,896.00
SOUTHERN CO.	140,200	48.56	6,808,112.00
XCEL ENERGY INC	70,800	53.46	3,784,968.00
ATMOS ENERGY CORP	15,600	97.05	1,513,980.00
UGI CORP	22,700	53.44	1,213,088.00
AMEREN CORPORATION	32,800	69.68	2,285,504.00
CENTERPOINT ENERGY INC	65,300	30.89	2,017,117.00
CMS ENERGY CORP	37,800	52.77	1,994,706.00
CONSOLIDATED EDISON INC	42,300	78.51	3,320,973.00
DOMINION ENERGY INC	102,439	73.26	7,504,681.14
DTE ENERGY COMPANY	25,100	119.81	3,007,231.00
NISOURCE INC	47,600	27.08	1,289,008.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	69,500	56.32	3,914,240.00
SEMPRA ENERGY	37,100	115.26	4,276,146.00
WEC ENERGY GROUP INC	43,500	74.47	3,239,445.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24,700	98.05	2,421,835.00
ALLY FINANCIAL INC	57,400	27.01	1,550,374.00
AMERICAN EXPRESS CO	99,900	107.38	10,727,262.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	65,600	81.57	5,350,992.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	46,300	71.29	3,300,727.00
SYNCHRONY FINANCIAL	96,200	31.75	3,054,350.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	7,500	108.96	817,200.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,200	130.68	2,509,056.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	136,800	52.99	7,249,032.00
BLACKROCK INC	16,540	431.95	7,144,453.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,000	93.54	1,403,100.00
CME GROUP INC	48,800	175.40	8,559,520.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	47.46	1,661,100.00
EATON VANCE CORP	16,400	41.05	673,220.00
FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	32.45	1,408,330.00
GOLDMAN SACHS GROUP	49,500	198.50	9,825,750.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	78,500	75.50	5,926,750.00
INVESCO LTD	58,000	18.86	1,093,880.00

MOODYS CORP	23,500	169.26	3,977,610.00
MORGAN STANLEY	178,900	41.99	7,512,011.00
MSCI INC	12,000	175.17	2,102,040.00
NASDAQ INC	15,400	87.76	1,351,504.00
NORTHERN TRUST CORP	28,400	93.09	2,643,756.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,700	82.33	1,457,241.00
S&P GLOBAL INC	34,400	198.32	6,822,208.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	166,200	46.36	7,705,032.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	52.17	996,447.00
STATE STREET CORP	52,200	70.66	3,688,452.00
T ROWE PRICE GROUP INC	33,900	97.58	3,307,962.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	37,900	56.86	2,154,994.00
H & R BLOCK INC	27,900	24.10	672,390.00
AES CORP	91,000	16.92	1,539,720.00
NRG ENERGY INC	40,000	42.46	1,698,400.00
VISTRA ENERGY CORP	48,200	26.51	1,277,782.00
CERNER CORP	40,600	57.91	2,351,146.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	16,700	120.81	2,017,527.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,400	78.30	3,476,520.00
ILLUMINA INC	20,110	299.82	6,029,380.20
IQVIA HOLDINGS INC	22,400	141.85	3,177,440.00
METTLER-TOLEDO INTL	3,420	668.86	2,287,501.20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	55,500	252.49	14,013,195.00
WATERS CORP	10,600	234.69	2,487,714.00
COSTAR GROUP INC	5,130	411.03	2,108,583.90
EQUIFAX INC	16,100	109.31	1,759,891.00
IHS MARKIT LTD	54,700	53.42	2,922,074.00
MANPOWERGROUP INC	8,000	84.43	675,440.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	47,200	26.30	1,241,360.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	66.98	1,145,358.00
TRUNSIUNION	25,300	63.13	1,597,189.00
VERISK ANALYTICS INC	21,900	125.38	2,745,822.00
CBRE GROUP INC	45,500	50.04	2,276,820.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	161,000	7.11	1,144,710.00
JONES LANG LASALLE INC	6,300	164.96	1,039,248.00
CBS CORP-CL B	47,000	50.64	2,380,080.00

CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	22,200	349.06	7,749,132.00	
COMCAST CORP-CL A	628,900	37.77	23,753,553.00	
DISCOVERY INC - A	19,300	29.30	565,490.00	
DISCOVERY INC - C	39,800	27.65	1,100,470.00	
DISH NETWORK CORP-A	31,900	30.90	985,710.00	
INTERPUBRIC GROUP	50,000	23.38	1,169,000.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	13,900	89.05	1,237,795.00	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	69,500	24.82	1,724,990.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	25.66	615,840.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	22,400	40.74	912,576.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	40.73	525,417.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	12.75	701,250.00	
OMNICOM GROUP	30,300	75.00	2,272,500.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	229,000	6.03	1,380,870.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	100,400	44.60	4,477,840.00	
DISNEY (WALT) CO	204,600	112.59	23,035,914.00	
ELECTRONIC ARTS	42,400	106.84	4,530,016.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	29,300	31.43	920,899.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	20,800	56.34	1,171,872.00	
NETFLIX INC	59,920	356.87	21,383,650.40	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	15,700	93.30	1,464,810.00	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	144,100	50.40	7,262,640.00	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	59,400	50.02	2,971,188.00	
VIACOM INC-CLASS B	50,200	29.15	1,463,330.00	
ALPHABET INC-CL A	41,070	1,119.63	45,983,204.10	
ALPHABET INC-CL C	43,260	1,113.65	48,176,499.00	
FACEBOOK INC-A	331,400	162.50	53,852,500.00	
IAC/INTERACTIVE CORP	10,400	220.02	2,288,208.00	
TRIPADVISOR INC	14,600	56.81	829,426.00	
TWITTER INC	94,200	31.23	2,941,866.00	
ZILLOW GROUP INC - C	16,000	37.18	594,880.00	
小計銘柄数：593			3,276,844,302.34	
			(362,222,369,180)	
組入時価比率：65.6%				68.0%

カナダドル	ARC RESOURCES LTD	50,000	10.14	507,000.00	
	CAMECO CORP	56,000	16.32	913,920.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	167,700	36.87	6,183,099.00	
	CENOVUS ENERGY INC	140,000	11.48	1,607,200.00	
	ENBRIDGE INC	275,900	47.40	13,077,660.00	
	ENCANA CORP	206,000	9.14	1,882,840.00	
	HUSKY ENERGY INC	52,000	15.62	812,240.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	36.22	1,358,250.00	
	INTER PIPELINE LTD	52,000	21.32	1,108,640.00	
	KEYERA CORP	28,500	28.57	814,245.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	70,600	48.66	3,435,396.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	31,000	18.58	575,980.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	37,000	10.65	394,050.00	
	SUNCOR ENERGY INC	222,200	44.88	9,972,336.00	
	TOURMALINE OIL CORP	33,000	20.34	671,220.00	
	TRANSCANADA CORP	125,700	56.74	7,132,218.00	
	VERMILION ENERGY INC	18,500	32.58	602,730.00	
	METHANEX CORP	8,600	75.77	651,622.00	
	NUTRIEN LTD	85,400	70.76	6,042,904.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	21,200	59.38	1,258,856.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	33,100	57.16	1,891,996.00	
	BARRICK GOLD	236,600	17.12	4,050,592.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	101,000	14.01	1,415,010.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	25,400	101.12	2,568,448.00	
	GOLDCORP INC	121,000	14.33	1,733,930.00	
	KINROSS GOLD CORP	174,000	4.59	798,660.00	
	LUNDIN MINING CORP	95,000	6.51	618,450.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	68,000	28.66	1,948,880.00	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	126,000	2.25	283,500.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63,000	28.24	1,779,120.00	
	WEST FRASER TIMBER	8,400	71.38	599,592.00	
	BOMBARDIER B SHEARS	262,000	2.50	655,000.00	
CAE INC	36,000	27.83	1,001,880.00		
SNC-LAVALIN GROUP INC	25,200	33.88	853,776.00		
WSP GLOBAL INC	13,200	70.08	925,056.00		

FINNING INTERNATIONAL INC	24,000	26.38	633,120.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	100,100	111.38	11,149,138.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	19,800	270.72	5,360,256.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	45,600	68.81	3,137,736.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	27,800	45.66	1,269,348.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	32,000	85.68	2,741,760.00
STARS GROUP INC/THE	23,000	21.30	489,900.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	140.43	1,207,698.00
DOLLARAMA INC	41,800	35.69	1,491,842.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	59,600	72.99	4,350,204.00
EMPIRE CO LTD A	26,000	30.73	798,980.00
LOBLAW COMPANIES	26,100	66.72	1,741,392.00
METRO INC	33,400	48.57	1,622,238.00
WESTON(GEORGE)LTD	10,700	97.25	1,040,575.00
SAPUTO INC	32,100	41.63	1,336,323.00
AURORA CANNABIS INC	97,000	9.30	902,100.00
BAUSCH HEALTH COS INC	42,500	33.67	1,430,975.00
CANOPY GROWTH CORP	27,500	62.81	1,727,275.00
BANK OF MONTREAL	87,600	98.13	8,596,188.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	168,200	74.77	12,576,314.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	61,500	113.05	6,952,575.00
NATIONAL BANK OF CANADA	46,000	62.19	2,860,740.00
ROYAL BANK OF CANADA	198,300	101.41	20,109,603.00
TORONTO DOMINION BANK	251,500	75.36	18,953,040.00
ONEX CORPORATION	10,900	76.92	838,428.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,880	651.14	2,526,423.20
GREAT-WEST LIFECO INC	42,000	29.47	1,237,740.00
IA FINANCIAL CORP INC	14,700	50.01	735,147.00
INTACT FINANCIAL CORP	18,900	109.21	2,064,069.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	275,000	21.47	5,904,250.00
POWER CORPORATION OF CANADA	46,000	27.11	1,247,060.00
POWER FINANCIAL CORP	32,500	28.28	919,100.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	83,800	49.06	4,111,228.00
CGI INC	33,800	87.88	2,970,344.00

	SHOIFY INC - CLASS A	12,200	236.05	2,879,810.00	
	BLACKBERRY LTD	71,000	11.50	816,500.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,720	1,095.31	2,979,243.20	
	OPEN TEXT CORP	35,400	49.70	1,759,380.00	
	BCE INC	19,800	57.33	1,135,134.00	
	TELUS CORP	29,300	47.10	1,380,030.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	50,200	72.59	3,644,018.00	
	EMERA INC	7,600	46.45	353,020.00	
	FORTIS INC	58,300	46.58	2,715,614.00	
	HYDRO ONE LTD	42,000	20.72	870,240.00	
	ALTAGAS LTD	33,800	15.76	532,688.00	
	ATCO LTD CL1	9,600	41.78	401,088.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	15,700	33.32	523,124.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	116,800	58.29	6,808,272.00	
	CI FINANCIAL CORP	33,600	19.33	649,488.00	
	IGM FINANCIAL INC	10,300	34.12	351,436.00	
	THOMSON REUTERS CORP	28,247	70.13	1,980,962.11	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	25,000	21.82	545,500.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	63,000	26.96	1,698,480.00	
小計	銘柄数：88			247,183,432.51	
				(20,642,288,448)	
	組入時価比率：3.7%			3.9%	
ユ-口	TENARIS SA	60,000	11.80	708,000.00	
	ENAGAS	30,400	24.74	752,096.00	
	ENI SPA	352,000	15.12	5,322,240.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	67,000	14.38	963,795.00	
	NESTE OYJ	17,600	87.38	1,537,888.00	
	OMV AG	21,000	46.29	972,090.00	
	REPSOL SA	188,228	15.17	2,855,418.76	
	SNAM SPA	298,000	4.18	1,247,130.00	
	TOTAL SA	330,000	49.69	16,399,350.00	
	VOPAK	9,000	43.58	392,220.00	
	AIR LIQUIDE	59,200	106.85	6,325,520.00	
	AKZO NOBEL	31,022	81.08	2,515,263.76	
	ARKEMA	9,900	83.70	828,630.00	
	BASF SE	125,400	66.32	8,316,528.00	

COVESTRO AG	27,000	51.08	1,379,160.00
EVONIK INDUSTRIES AG	22,700	25.10	569,770.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	41.24	433,020.00
KONINKLIJKE DSM NV	24,700	94.40	2,331,680.00
LANXESS	12,000	48.71	584,520.00
SOLVAY SA	10,300	98.74	1,017,022.00
SYMRISE AG	16,300	77.44	1,262,272.00
UMICORE	28,000	35.40	991,200.00
CRH PLC	113,600	26.90	3,055,840.00
HEIDELBERGCEMENT AG	20,300	61.82	1,254,946.00
IMERYS	3,800	49.72	188,936.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,000	26.58	850,560.00
ARCELORMITTAL	88,500	20.15	1,783,275.00
THYSSENKRUPP AG	62,000	13.26	822,120.00
VOESTALPINE AG	16,500	25.79	425,535.00
STORA ENSO OYJ-R	73,000	12.14	886,585.00
UPM-KYMMENE OYJ	73,300	26.81	1,965,173.00
AIRBUS SE	80,400	110.98	8,922,792.00
DASSAULT AVIATION SA	330	1,321.00	435,930.00
LEONARDO SPA	55,000	8.90	489,720.00
MTU AERO ENGINES AG	6,900	195.80	1,351,020.00
SAFRAN SA	45,700	115.15	5,262,355.00
THALES SA	14,100	106.85	1,506,585.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	66,900	32.67	2,185,623.00
KINGSPAN GROUP PLC	22,200	37.96	842,712.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y S-RTS	34,580	0.48	16,930.36
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	34,600	37.21	1,287,466.00
BOUYGUES	31,400	31.00	973,400.00
EIFFAGE SA	10,800	82.46	890,568.00
FERROVIAL SA	66,511	19.81	1,317,915.46
HOCHTIEF AG	2,600	133.60	347,360.00
VINCI	70,200	80.52	5,652,504.00
LEGRAND SA	37,000	57.42	2,124,540.00
OSRAM LICHT AG	14,300	41.15	588,445.00
PRYSMIAN SPA	30,900	18.84	582,156.00

SCHNEIDER ELECTRIC SE	75,400	68.16	5,139,264.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	30,000	13.68	410,550.00	
SIEMENS AG	105,400	94.62	9,972,948.00	
ALSTOM	20,500	37.56	769,980.00	
ANDRITZ AG	9,200	44.06	405,352.00	
CNH INDUSTRIAL NV	141,000	9.42	1,328,220.00	
GEA GROUP AG	24,200	20.51	496,342.00	
KION GROUP AG	9,900	54.14	535,986.00	
KONE OYJ	45,600	44.55	2,031,480.00	
METSO OYJ	16,200	28.66	464,292.00	
WARTSILA OYJ	63,000	14.23	896,805.00	
BRENNTAG AG	20,600	43.43	894,658.00	
REXEL SA	45,000	10.90	490,725.00	
EDENRED	32,800	37.09	1,216,552.00	
SOCIETE BIC SA	3,800	83.95	319,010.00	
BOLLORE	106,000	3.70	392,624.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	137,100	26.75	3,667,425.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	31,000	22.37	693,470.00	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	87,000	7.57	658,938.00	
ADP	3,900	169.00	659,100.00	
AENA SME SA	9,300	153.55	1,428,015.00	
ATLANTIA SPA	70,000	20.96	1,467,200.00	
FRAPORT AG	6,300	70.44	443,772.00	
GETLINK	62,000	12.63	783,060.00	
CONTINENTAL AG	15,400	138.65	2,135,210.00	
FAURECIA	10,500	39.40	413,700.00	
MICHELIN (CGDE)	23,800	101.40	2,413,320.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	15,800	30.12	475,896.00	
PIRELLI & C. SPA	53,000	6.07	321,922.00	
VALEO SA	33,100	26.26	869,206.00	
BAYER MOTOREN WERK	44,900	70.77	3,177,573.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	7,800	61.85	482,430.00	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	125,700	50.61	6,361,677.00	
FERRARI NV	17,100	111.30	1,903,230.00	

FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	150,000	13.02	1,953,900.00
PEUGEOT CITROEN	82,000	21.29	1,745,780.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	20,300	56.04	1,137,612.00
RENAULT SA	25,500	59.63	1,520,565.00
VOLKSWAGEN AG	4,500	147.50	663,750.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	25,200	144.40	3,638,880.00
SEB SA	3,000	139.00	417,000.00
ADIDAS AG	25,800	199.15	5,138,070.00
ESSILORLUXOTTICA	39,900	105.80	4,221,420.00
HERMES INTERNATIONAL	4,430	540.80	2,395,744.00
HUGO BOSS AG	9,300	62.22	578,646.00
KERING SA	10,500	473.50	4,971,750.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	38,280	294.20	11,261,976.00
MONCLER SPA	25,200	34.35	865,620.00
PUMA SE	1,061	442.50	469,492.50
ACCOR SA	26,200	39.65	1,038,830.00
PADDY POWER PLC	12,600	70.60	889,560.00
SODEXO	12,100	94.04	1,137,884.00
DELIVERY HERO SE	11,900	35.80	426,020.00
ZALANDO SE	13,400	26.14	350,276.00
INDITEX SA	148,000	25.59	3,787,320.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	80,000	18.13	1,450,800.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	8,300	45.00	373,500.00
COLRUYT SA	8,700	62.50	543,750.00
JERONIMO MARTINS	31,000	12.74	395,095.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	171,100	22.97	3,930,167.00
METRO AG	25,000	15.25	381,250.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	105,200	68.45	7,200,940.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	76,000	8.19	622,820.00
HEINEKEN HOLDING NV	16,000	84.10	1,345,600.00
HEINEKEN NV	35,700	87.62	3,128,034.00
PERNOD RICARD SA	29,100	150.55	4,381,005.00
REMY COINTREAU	3,000	112.60	337,800.00
DANONE	84,400	65.69	5,544,236.00
KERRY GROUP PLC-A	22,100	92.05	2,034,305.00

HENKEL AG & CO KGAA	14,400	80.85	1,164,240.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,600	86.90	2,137,740.00	
BEIERSDORF AG	13,700	91.62	1,255,194.00	
LOREAL-ORD	34,430	221.80	7,636,574.00	
UNILEVER NV-CVA	212,700	48.93	10,408,474.50	
BIOMERIEUX	5,900	69.70	411,230.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	131,800	35.09	4,624,862.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	4,500	148.40	667,800.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,900	35.65	709,435.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	29,400	68.50	2,013,900.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	57,600	47.26	2,722,176.00	
GRIFOLS SA	40,100	23.80	954,380.00	
BAYER AG-REG	127,300	68.17	8,678,041.00	
IPSEN	5,500	125.10	688,050.00	
MERCK KGAA	17,300	96.92	1,676,716.00	
ORION OYJ	13,000	29.20	379,600.00	
RECORDATI SPA	14,100	33.83	477,003.00	
SANOFI	155,100	75.24	11,669,724.00	
UCB SA	16,500	78.80	1,300,200.00	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	58,100	20.49	1,190,469.00	
AIB GROUP PLC	125,000	3.88	486,000.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	923,000	5.19	4,794,062.00	
BANCO DE SABADELL SA	790,000	0.95	752,554.00	
BANCO SANTANDER SA	2,242,000	4.10	9,192,200.00	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	133,000	5.46	726,845.00	
BANKIA SA	151,000	2.54	384,748.00	
BANKINTER S.A.	88,000	6.91	608,256.00	
BNP PARIBAS	155,400	42.11	6,543,894.00	
CAIXABANK	505,000	3.01	1,520,555.00	
COMMERZBANK AG	135,000	6.66	899,910.00	
CREDIT AGRICOLE SA	154,000	10.19	1,570,184.00	
ERSTE GROUP BANK AG	40,000	32.00	1,280,000.00	
ING GROEP NV	538,000	11.04	5,940,596.00	
INTESA SANPAOLO	2,062,000	2.04	4,220,914.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	

KBC GROEP NV	34,600	61.64	2,132,744.00
MEDIOBANCA S.P.A.	88,000	8.30	730,928.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	22.51	452,451.00
SOCIETE GENERALE	104,300	24.54	2,560,043.50
UNICREDIT SPA	271,000	11.22	3,041,704.00
EURAZEO SE	5,670	63.85	362,029.50
EXOR NV	15,100	56.38	851,338.00
GROUPE BRUXELLES LAM	11,000	82.42	906,620.00
WENDEL	3,400	106.00	360,400.00
AEGON NV	246,000	4.56	1,123,482.00
AGEAS	25,800	41.47	1,069,926.00
ALLIANZ SE-REG	59,200	190.14	11,256,288.00
ASSICURAZIONI GENERALI	162,000	15.23	2,467,260.00
AXA	265,000	20.74	5,497,425.00
CNP ASSURANCES	21,200	20.18	427,816.00
HANNOVER RUECK SE	7,900	128.70	1,016,730.00
MAPFRE SA	163,000	2.45	399,350.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	20,700	204.20	4,226,940.00
NN GROUP NV	42,900	37.86	1,624,194.00
POSTE ITALIANE SPA	77,000	7.74	596,442.00
SAMPO OYJ-A SHS	61,200	42.40	2,594,880.00
SCOR SE	23,200	38.30	888,560.00
AMADEUS IT GROUP SA	59,500	68.32	4,065,040.00
ATOS SE	13,600	82.82	1,126,352.00
CAPGEMINI SA	21,900	102.55	2,245,845.00
WIRECARD AG	15,900	99.90	1,588,410.00
DASSAULT SYSTEMES SA	17,800	128.35	2,284,630.00
SAP SE	135,400	94.30	12,768,220.00
NOKIA OYJ	781,000	5.56	4,348,608.00
INGENICO GROUP	8,100	54.92	444,852.00
ASML HOLDING NV	56,000	163.08	9,132,480.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	155,000	19.98	3,097,675.00
STMICROELECTRONICS NV	97,000	14.69	1,425,415.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	460,000	14.26	6,559,600.00
ELISA OYJ	19,500	35.91	700,245.00

ILIAD SA	3,900	88.34	344,526.00
KONINKLIJKE KPN NV	446,000	2.72	1,214,012.00
ORANGE SA	277,000	13.42	3,718,725.00
PROXIMUS	21,600	21.96	474,336.00
TELECOM ITALIA SPA	1,530,000	0.51	785,808.00
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.44	389,840.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	97,000	2.98	289,739.00
TELEFONICA SA	640,000	7.50	4,800,000.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	32.87	552,216.00
1&1 DRILLISCH AG	8,000	34.14	273,120.00
ELECTRICITE DE FRANCE	82,000	13.99	1,147,180.00
ENDESA S.A.	44,400	21.51	955,044.00
ENEL SPA	1,124,000	5.23	5,885,264.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	361,000	3.24	1,172,528.00
FORTUM OYJ	60,000	19.66	1,179,900.00
IBERDROLA SA	858,666	7.25	6,225,328.50
RED ELECTRICA CORPORACION SA	59,000	19.37	1,142,830.00
TERNA SPA	185,000	5.35	990,120.00
VERBUND AG	9,000	42.84	385,560.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	49,300	23.64	1,165,452.00
E.ON SE	307,000	9.64	2,959,480.00
ENGIE	251,000	14.12	3,544,120.00
INNOGY SE	19,500	40.55	790,725.00
RWE AG	72,000	22.34	1,608,480.00
SUEZ	52,000	11.09	576,940.00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	71,000	19.09	1,355,390.00
AMUNDI SA	8,200	54.42	446,244.00
DEUTSCHE BANK AG-REG	275,000	7.72	2,123,550.00
DEUTSCHE BOERSE AG	26,900	111.30	2,993,970.00
NATIXIS	128,000	4.41	565,120.00
UNIPER SE	26,200	25.72	673,864.00
EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,430	341.00	487,630.00
QIAGEN NV	31,400	34.05	1,069,170.00
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,100	102.10	418,610.00
BUREAU VERITAS SA	34,200	19.64	671,859.00

	RANDSTAD NV	17,400	46.82	814,668.00	
	TELEPERFORMANCE	7,700	155.60	1,198,120.00	
	WOLTERS KLUWER	39,000	56.00	2,184,000.00	
	AROUNDTOWN SA	107,000	7.58	811,595.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	48,400	42.60	2,061,840.00	
	VONOVIA SE	66,400	44.20	2,934,880.00	
	AXEL SPRINGER SE	5,900	53.30	314,470.00	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	24,100	17.68	426,088.00	
	JC DECAUX SA	9,300	27.12	252,216.00	
	PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	34,000	15.50	527,000.00	
	PUBLICIS GROUPE	29,200	47.67	1,391,964.00	
	RTL GROUP	5,400	46.96	253,584.00	
	SES FDR	48,000	17.98	863,040.00	
	TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	38.30	256,610.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	11,100	67.10	744,810.00	
	VIVENDI SA	143,700	24.01	3,450,237.00	
小計	銘柄数：239			504,038,386.84	
				(62,969,515,667)	
	組入時価比率：11.4%			11.8%	
英ポンド	WOOD GROUP (JOHN) PLC	86,000	5.23	449,952.00	
	BP PLC	2,749,000	5.43	14,940,815.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	632,300	24.24	15,326,952.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	515,600	24.43	12,598,686.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	17,200	51.58	887,176.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	26,700	30.95	826,365.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	143,300	19.51	2,796,069.60	
	ANTOFAGASTA PLC	59,000	8.73	515,188.00	
	BHP GROUP PLC	289,000	17.92	5,181,192.00	
	FRESNILLO PLC	26,000	9.69	252,096.00	
	GLENCORE PLC	1,579,000	3.03	4,794,633.50	
	RIO TINTO PLC-REG	162,000	43.98	7,124,760.00	
	MONDI PLC	49,400	18.95	936,130.00	
	BAE SYSTEMS PLC	441,000	5.27	2,324,070.00	
	MEGGITT PLC	111,000	5.55	616,050.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	228,000	9.71	2,214,792.00	

MELROSE INDUSTRIES PLC	680,000	1.70	1,156,000.00
DCC PLC	12,800	67.95	869,760.00
SMITHS GROUP PLC	54,000	14.91	805,410.00
WEIR GROUP PLC	37,000	15.67	579,975.00
ASHTED GROUP PLC	68,000	20.33	1,382,440.00
BUNZLE	44,400	24.88	1,104,672.00
FERGUSON PLC	32,500	54.73	1,778,725.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	39,000	5.52	215,436.00
G4S PLC	219,000	2.05	449,388.00
ROYAL MAIL PLC	136,000	2.79	379,712.00
EASYJET PLC	21,000	12.78	268,485.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	145,000	5.63	817,220.00
PERSIMMON PLC	42,600	24.05	1,024,530.00
TAYLOR WIMPEY PLC	450,000	1.64	738,675.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	17,100	38.21	653,391.00
BURBERRY GROUP PLC	55,000	19.53	1,074,150.00
CARNIVAL PLC	22,900	43.38	993,402.00
COMPASS GROUP PLC	215,000	17.43	3,748,525.00
GVC HOLDINGS PLC	71,000	6.40	454,755.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	23,750	46.39	1,101,762.50
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	89,000	3.53	314,437.00
TUI AG-DI	60,000	8.09	485,400.00
WHITBREAD PLC	24,500	49.65	1,216,425.00
MARKS & SPENCER PLC	208,000	2.85	593,840.00
NEXT PLC	19,800	47.24	935,352.00
KINGFISHER PLC	273,000	2.25	615,615.00
MORRISON SUPERMARKETS	315,000	2.37	748,755.00
SAINSBURY	255,000	2.86	729,810.00
TESCO PLC	1,362,000	2.24	3,053,604.00
COCA-COLA HBC AG-DI	29,000	25.62	742,980.00
DIAGEO PLC	339,100	30.64	10,391,719.50
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49,400	22.66	1,119,404.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	316,200	28.59	9,040,158.00
IMPERIAL BRANDS PLC	129,500	26.51	3,433,692.50
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	92,800	60.17	5,583,776.00

UNILEVER PLC	154,500	42.49	6,564,705.00
CONVATEC GROUP PLC-WI	210,000	1.18	248,955.00
SMITH & NEPHEW PLC	123,000	14.51	1,784,730.00
NMC HEALTH PLC	13,300	27.74	368,942.00
ASTRAZENECA PLC	174,500	62.41	10,890,545.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	683,000	15.81	10,798,230.00
BARCLAYS PLC	2,370,000	1.59	3,780,150.00
HSBC HOLDINGS PLC	2,738,000	6.65	18,232,342.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,730,000	0.58	5,686,212.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	650,000	2.47	1,608,750.00
STANDARD CHARTERED PLC	383,000	6.37	2,443,157.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	323,000	2.33	755,012.50
ADMIRAL GROUP PLC	27,000	21.44	578,880.00
AVIVA PLC	542,000	4.23	2,294,286.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	183,000	3.50	640,866.00
LEGAL & GENERAL	808,000	2.66	2,152,512.00
PRUDENTIAL PLC	355,000	15.32	5,440,375.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	140,000	5.36	750,400.00
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	58,000	16.80	974,400.00
SAGE GROUP PLC (THE)	143,000	6.59	942,370.00
BT GROUP PLC	1,145,000	2.31	2,647,240.00
VODAFONE GROUP PLC	3,650,000	1.41	5,153,800.00
SSE PLC	137,000	11.98	1,641,945.00
CENTRICA PLC	780,000	1.37	1,072,890.00
NATIONAL GRID PLC	471,000	8.42	3,966,762.00
SEVERN TRENT PLC	32,400	19.45	630,180.00
UNITED UTILITIES GROUP PLC	96,000	8.17	784,320.00
3I GROUP PLC	132,000	9.47	1,250,040.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	40,100	16.65	667,665.00
INVESTEC PLC	92,000	4.92	453,468.00
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	42,600	46.85	1,995,810.00
SCHRODERS PLC	15,800	26.98	426,284.00
ST JAMES S PLACE PLC	70,000	9.49	664,440.00
EXPERIAN PLC	126,200	20.27	2,558,074.00
INTERTEK GROUP PLC	21,600	51.88	1,120,608.00

	RELX PLC	271,000	17.20	4,661,200.00
	INFORMA PLC	173,000	7.04	1,218,958.00
	ITV PLC	500,000	1.33	665,500.00
	PEARSON	109,000	9.20	1,003,454.00
	WPP PLC	169,000	8.46	1,430,078.00
	AUTO TRADER GROUP PLC	138,000	4.54	626,796.00
小計	銘柄数：92			241,961,640.10 (34,520,667,193)
	組入時価比率：6.2%			6.5%
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	25,900	20.66	535,094.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	554.50	676,490.00
	GIVAUDAN-REG	1,247	2,453.00	3,058,891.00
	SIKA AG-REG	18,000	130.30	2,345,400.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	67,000	47.92	3,210,640.00
	GEBERIT AG-REG	5,000	394.80	1,974,000.00
	ABB LTD	250,000	19.77	4,943,750.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	217.40	652,200.00
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,500	223.60	1,229,800.00
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	7,300	138.40	1,010,320.00
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	71,600	72.26	5,173,816.00
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,120	284.50	1,172,140.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	55.15	408,110.00
	DUFREY AG-REG	4,400	99.72	438,768.00
	BARRY CALLEBAUT AG	300	1,707.00	512,100.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	140	6,280.00	879,200.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	15	72,100.00	1,081,500.00
	NESTLE SA-REG	421,000	89.10	37,511,100.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	7,600	189.35	1,439,060.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,450	738.50	1,070,825.00
	NOVARTIS-REG	298,100	90.08	26,852,848.00
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	96,610	272.55	26,331,055.50
	VIFOR PHARMA AG	5,700	128.00	729,600.00
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	5,800	78.95	457,910.00
	BALOISE HOLDING AG	6,600	157.20	1,037,520.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,550	415.10	1,888,705.00
	SWISS RE LTD	41,400	97.12	4,020,768.00

	ZURICH INSURANCE GROUP AG	20,710	322.10	6,670,691.00	
	TEMENOS AG-REG	8,400	140.90	1,183,560.00	
	SWISSCOM AG-REG	3,510	447.50	1,570,725.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	347,000	11.75	4,077,250.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	31,000	40.81	1,265,110.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,430	704.00	1,710,720.00	
	UBS GROUP AG	533,000	12.99	6,926,335.00	
	LONZA AG-REG	10,390	292.40	3,038,036.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	21,500	52.90	1,137,350.00	
	SGS SA-REG	746	2,483.00	1,852,318.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	10,100	84.60	854,460.00	
小計	銘柄数：38			160,928,165.50	
				(17,721,409,584)	
	組入時価比率：3.2%				3.3%
スウェーデン ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	24,800	298.40	7,400,320.00	
	BOLIDEN AB	36,300	238.90	8,672,070.00	
	ASSA ABLOY AB-B	136,000	188.95	25,697,200.00	
	SKANSKA AB-B SHS	45,000	162.60	7,317,000.00	
	ALFA LAVAL AB	38,900	198.90	7,737,210.00	
	ATLAS COPCO AB-A	94,000	251.55	23,645,700.00	
	ATLAS COPCO AB-B	52,900	233.75	12,365,375.00	
	EPIROC AB - A	92,000	90.53	8,328,760.00	
	EPIROC AB - B	58,000	84.92	4,925,360.00	
	SANDVIK AB	158,000	151.15	23,881,700.00	
	SKF AB-B SHARES	55,000	156.30	8,596,500.00	
	VOLVO AB-B SHS	214,000	135.25	28,943,500.00	
	SECURITAS AB-B SHS	45,000	144.50	6,502,500.00	
	ELECTROLUX AB-B	34,000	237.60	8,078,400.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	55,000	75.30	4,141,500.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	118,000	136.38	16,092,840.00	
	ICA GRUPPEN AB	10,500	351.30	3,688,650.00	
	SWEDISH MATCH AB	23,400	452.60	10,590,840.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	81,700	258.50	21,119,450.00	
	NORDEA BANK ABP	413,000	84.90	35,063,700.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	221,000	98.16	21,693,360.00	

	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	212,000	102.65	21,761,800.00	
	SWEDBANK AB	126,000	209.60	26,409,600.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	187.35	4,683,750.00	
	INVESTOR AB-B SHS	61,700	412.00	25,420,400.00	
	KINNEVIK AB - B	33,700	217.50	7,329,750.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	9,200	288.20	2,651,440.00	
	ERICSSON LM-B	417,000	86.68	36,145,560.00	
	HEXAGON AB-B SHS	36,100	471.40	17,017,540.00	
	TELIA CO AB	396,000	39.73	15,733,080.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	9,700	565.00	5,480,500.00	
	TELE 2 AB-B SHS	69,000	118.45	8,173,050.00	
小計	銘柄数：32			465,288,405.00	
				(5,550,890,671)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
ノルウェーク ローネ	AKER AB ASA	14,100	292.40	4,122,840.00	
	EQUINOR ASA	161,000	200.30	32,248,300.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	23,200	340.20	7,892,640.00	
	NORSK HYDRO	184,000	34.68	6,381,120.00	
	MOWI ASA	56,800	197.80	11,235,040.00	
	ORKLA ASA	115,000	67.68	7,783,200.00	
	DNB ASA	135,000	162.80	21,978,000.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,000	152.10	3,802,500.00	
	TELENOR ASA	102,000	162.70	16,595,400.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	297.00	3,831,300.00	
小計	銘柄数：10			115,870,340.00	
				(1,484,299,055)	
	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	657.60	9,009,120.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	31,100	298.50	9,283,350.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	26,800	554.00	14,847,200.00	
	ISS A/S	21,800	193.60	4,220,480.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	520	8,470.00	4,404,400.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	880	9,044.00	7,958,720.00	
	DSV A/S	26,500	535.60	14,193,400.00	

	PANDORA A/S	16,200	334.70	5,422,140.00
	CARLSBERG B	14,500	797.40	11,562,300.00
	COLOPLAST-B	16,400	627.40	10,289,360.00
	WILLIAM DEMANT HOLDING	13,000	219.60	2,854,800.00
	GENMAB A/S	8,400	1,014.00	8,517,600.00
	H LUNDBECK A/S	10,500	282.80	2,969,400.00
	NOVO NORDISK A/S-B	250,300	330.70	82,774,210.00
	DANSKE BANK AS	97,000	124.40	12,066,800.00
	TRYG A/S	16,000	172.80	2,764,800.00
	ORSTED A/S	25,400	474.30	12,047,220.00
小計	銘柄数：17			215,185,300.00 (3,602,201,922)
	組入時価比率：0.7%			0.7%
豪ドル	WORLEYPARSONS LTD	47,000	15.28	718,160.00
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	33,300	28.06	934,398.00
	OIL SEARCH LTD	179,000	8.11	1,451,690.00
	ORIGIN ENERGY LTD	239,000	7.50	1,792,500.00
	SANTOS LTD.	255,000	6.71	1,711,050.00
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	28.90	491,300.00
	WOODSIDE PETROLEUM	127,000	36.06	4,579,620.00
	INCITEC PIVOT LTD	233,000	3.28	764,240.00
	ORICA LTD	50,000	18.20	910,000.00
	BORAL LTD	153,000	4.88	746,640.00
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	58,000	17.50	1,015,000.00
	AMCOR	155,000	14.74	2,284,700.00
	ALUMINA LTD	350,000	2.62	917,000.00
	BHP GROUP LIMITED	406,300	36.47	14,817,761.00
	BLUESCOPE STEEL LTD	80,000	12.12	969,600.00
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	223,000	6.27	1,398,210.00
	NEWCREST MINING	103,000	24.88	2,562,640.00
	RIO TINTO LTD	51,200	91.30	4,674,560.00
	SOUTH32 LTD	700,000	3.81	2,667,000.00
	CIMIC GROUP LTD	11,700	49.81	582,777.00
	BRAMBLES LTD	218,000	11.24	2,450,320.00
	AURIZON HOLDINGS LTD	273,000	4.62	1,261,260.00

SYDNEY AIRPORT	144,000	6.90	993,600.00
TRANSURBAN GROUP	356,000	12.18	4,336,080.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	76,000	24.76	1,881,760.00
CROWN RESORTS LTD	55,000	12.12	666,600.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	8,500	46.23	392,955.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	7,300	43.13	314,849.00
TABCORP HOLDINGS	247,000	4.64	1,146,080.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	97,117	3.56	345,736.52
WESFARMERS LIMITED	154,000	33.30	5,128,200.00
COLES GROUP LTD	161,000	12.60	2,028,600.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	181,000	30.03	5,435,430.00
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	8.41	647,570.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	100,000	16.19	1,619,000.00
COCHLEAR LTD	8,100	197.48	1,599,588.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20,500	58.55	1,200,275.00
SONIC HEALTHCARE LTD	62,000	23.67	1,467,540.00
CSL LIMITED	61,800	185.00	11,433,000.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	393,000	26.81	10,536,330.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	56,000	9.95	557,200.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	67,000	9.87	661,290.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	242,400	70.81	17,164,344.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	378,000	24.22	9,155,160.00
WESTPAC BANKING CORP	469,000	26.24	12,306,560.00
AMP LIMITED	390,000	2.18	850,200.00
CHALLENGER LIMITED	80,000	7.29	583,200.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	308,000	7.48	2,303,840.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	350,000	2.84	994,000.00
QBE INSURANCE	179,000	11.24	2,011,960.00
SUNCORP GROUP LTD	181,000	13.10	2,371,100.00
COMPUTERSHARE LTD	63,000	18.25	1,149,750.00
TELSTRA CORP LTD	590,000	3.18	1,876,200.00
TPG TELECOM LTD	52,000	6.73	349,960.00
AUSNET SERVICES	230,000	1.74	400,200.00
APA GROUP	159,000	9.22	1,465,980.00
AGL ENERGY LTD	93,000	22.05	2,050,650.00

	ASX LTD	26,300	67.84	1,784,192.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	43,900	124.22	5,453,258.00	
	SEEK LTD	48,000	17.14	822,720.00	
	REA GROUP LTD	6,900	78.02	538,338.00	
小計	銘柄数：61			165,723,721.52	
				(13,097,145,711)	
	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	5.22	587,912.94	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,000	7.50	975,000.00	
	A2 MILK CO LTD	106,000	12.70	1,346,200.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	74,000	13.51	999,740.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	11.23	651,340.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	260,000	4.06	1,056,900.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	159,000	3.75	596,250.00	
小計	銘柄数：7			6,213,342.94	
				(472,524,730)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	371,040	79.70	29,571,888.00	
	NWS HOLDINGS LTD	220,500	19.20	4,233,600.00	
	MTR CORP	201,000	43.80	8,803,800.00	
	MINIH GROUP LTD	112,000	29.55	3,309,600.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	195,000	47.00	9,165,000.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	97,000	25.80	2,502,600.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	333,000	51.70	17,216,100.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	124,000	14.58	1,807,920.00	
	SANDS CHINA LTD	336,000	36.00	12,096,000.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	160,333	10.30	1,651,429.90	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	8.06	2,176,200.00	
	WYNN MACAU LTD	228,000	17.88	4,076,640.00	
	WH GROUP LIMITED	1,170,000	7.39	8,646,300.00	
	BANK OF EAST ASIA	167,060	27.70	4,627,562.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	495,000	30.70	15,196,500.00	
HANG SENG BANK	105,800	182.70	19,329,660.00		
AIA GROUP LTD	1,663,000	73.20	121,731,600.00		

	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	38,000	87.00	3,306,000.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	519,600	11.92	6,193,632.00	
	PCCW LTD	550,000	4.76	2,618,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	89,000	63.35	5,638,150.00	
	CLP HLDGS	227,000	94.00	21,338,000.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	191,000	53.05	10,132,550.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,290,317	17.56	22,657,966.52	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	162,400	251.00	40,762,400.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	361,040	64.25	23,196,820.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	103,000	23.60	2,430,800.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	251,000	18.02	4,523,020.00	
	HENDERSON LAND	185,858	44.70	8,307,852.60	
	HYSAN DEVELOPMENT	83,000	42.00	3,486,000.00	
	KERRY PROPERTIES	79,000	32.95	2,603,050.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	839,666	12.52	10,512,618.32	
	SINO LAND CO.LTD	480,000	14.52	6,969,600.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	217,000	132.40	28,730,800.00	
	SWIRE PACIFIC-A	64,000	91.10	5,830,400.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	31.00	5,363,000.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	164,000	54.30	8,905,200.00	
	WHARF(HOLDING)	174,000	24.30	4,228,200.00	
	WHEELOK & COMPANY LTD	117,000	51.50	6,025,500.00	
小計	銘柄数：39			499,901,959.34	
				(7,038,619,587)	
	組入時価比率：1.3%			1.3%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	198,000	3.71	734,580.00	
	KEPPEL CORP.	202,000	6.08	1,228,160.00	
	SEBACORP INDUSTRIES	140,040	2.57	359,902.80	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	380,000	1.40	532,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,040	9.76	751,910.40	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	310,000	2.40	744,000.00	
	SATS LTD	77,000	5.06	389,620.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	870,000	1.08	939,600.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	36.10	505,400.00	

	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	940,020	0.26	244,405.20	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	247,000	3.30	815,100.00	
	DBS GROUP HLDGS	249,000	24.79	6,172,710.00	
	OCBC-ORD	433,000	11.52	4,988,160.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	185,000	25.68	4,750,800.00	
	VENTURE CORP LTD	35,000	16.10	563,500.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,110,000	2.99	3,318,900.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	111,000	7.79	864,690.00	
	CAPITALAND LIMITED	330,000	3.36	1,108,800.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	51,000	9.41	479,910.00	
	UOL GROUP LIMITED	65,000	6.60	429,000.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	240,000	2.48	595,200.00	
小計	銘柄数：21			30,516,348.40	
				(2,487,997,885)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
新シケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	91,000	20.35	1,851,850.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	476.50	1,715,400.00	
	BANK HAPOALIM BM	141,000	24.55	3,461,550.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	214,000	23.88	5,110,320.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,000	67.70	1,150,900.00	
	NICE LTD	8,600	417.20	3,587,920.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	280,000	3.23	904,400.00	
	AZRIELI GROUP	6,500	198.70	1,291,550.00	
小計	銘柄数：8			19,073,890.00	
				(582,707,339)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				532,392,636,972	
				(532,392,636,972)	

(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2月18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	1,251,020.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,400	1,941,984.00	
		AMERICAN TOWER CORP	60,200	10,704,764.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	176,000	1,793,440.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,200	3,764,544.00	
		BOSTON PROPERTIES	20,700	2,765,934.00	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	25,000	500,250.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,100	1,292,970.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	56,800	6,823,384.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	27,800	3,197,834.00	
		DUKE REALTY CORP	47,800	1,423,484.00	
		EQUINIX INC	10,930	4,605,792.70	
		EQUITY RESIDENTIAL	51,300	3,755,673.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,030	2,517,744.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	17,900	1,784,988.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,800	1,327,704.00	
		HCP INC	66,100	2,038,524.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	100,000	1,864,000.00	
		INVITATION HOMES INC	45,000	1,058,400.00	
		IRON MOUNTAIN INC	38,300	1,345,096.00	
		KIMCO REALTY CORP	58,000	1,030,080.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	19,800	941,292.00	
		MACERICH CO /THE	14,200	620,398.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,000	1,562,700.00	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,000	1,156,540.00	
		PROLOGIS INC	86,300	6,143,697.00	
		PUBLIC STORAGE	21,500	4,466,410.00	
		REALTY INCOME CORP	39,300	2,754,537.00	
		REGENCY CENTERS CORP	21,000	1,392,720.00	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	16,000	2,968,000.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	42,300	7,756,128.00			
SL GREEN REALTY CORP	12,500	1,145,000.00			
UDR INC	36,700	1,636,453.00			

小計	VENTAS INC	49,200	3,208,332.00	
	VEREIT INC	125,000	1,033,750.00	
	VORNADO REALTY TRUST	24,200	1,664,960.00	
	WELLTOWER INC	51,700	4,012,437.00	
	WEYERHAEUSER CO	106,000	2,707,240.00	
	WP CAREY INC	21,500	1,616,800.00	
	銘柄数：39	1,662,560	103,575,004.30	(11,449,180,975)
組入時価比率：2.1%				
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	20,000	449,400.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	552,860.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	369,930.00	
	銘柄数：3	53,000	1,372,190.00	(114,591,586)
組入時価比率：0.0%				
ユーロ	COVIVIO	6,600	571,890.00	
	GECINA SA	6,400	807,680.00	
	ICADE	5,100	378,420.00	
	KLEPIERRE	28,000	841,120.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	19,100	2,771,792.00	
	銘柄数：5	65,200	5,370,902.00	(670,986,786)
組入時価比率：0.1%				
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	750,592.00	
	HAMMERSON PLC	108,000	410,724.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	99,000	879,516.00	
	SEGRO PLC	145,000	928,000.00	
	銘柄数：4	480,000	2,968,832.00	(423,563,261)
組入時価比率：0.1%				
豪ドル	DEXUS	140,000	1,688,400.00	
	GOODMAN GROUP	227,000	2,914,680.00	
	GPT GROUP	256,000	1,507,840.00	
	LENDLEASE GROUP	77,000	1,043,350.00	
	MIRVAC GROUP	490,000	1,259,300.00	
	SCENTRE GROUP	723,000	2,877,540.00	

小計	STOCKLAND TRUST GROUP	348,000	1,294,560.00	
	VICINITY CENTRES	480,000	1,228,800.00	
	銘柄数：8	2,741,000	13,814,470.00	(1,091,757,564)
	組入時価比率：0.2%			7.6%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	370,000	2,982,200.00	
	LINK REIT	288,000	24,940,800.00	
小計	銘柄数：2	658,000	27,923,000.00	(393,155,840)
	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	1,048,800.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	369,972	691,847.64	
	CAPITALAND MALL TRUST	310,000	740,900.00	
	SUNTEC REIT	300,000	570,000.00	
小計	銘柄数：4	1,359,972	3,051,547.64	(248,792,679)
	組入時価比率：0.0%			1.7%
合計			14,392,028,691	(14,392,028,691)

(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 2月18日現在			
	契約額等(円)	うち1年超	時価(円)	評価損益(円)
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	5,153,945,472	-	5,361,496,229	207,550,757
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	145,574,310	-	145,783,700	209,390
米ドル	98,599,110	-	98,371,700	227,410
豪ドル	46,975,200	-	47,412,000	436,800

合計	-	-	-	207,341,367
----	---	---	---	-------------

(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。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,365,267,691
コール・ローン	336,785,791
国債証券	601,913,272,146
派生商品評価勘定	106,430
未収入金	915,967,695
未収利息	5,198,685,413
前払費用	212,099,191
流動資産合計	609,942,184,357
資産合計	
609,942,184,357	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,603,900
未払解約金	1,221,070,075
未払利息	578
その他未払費用	3,624,800
流動負債合計	1,227,299,353
負債合計	
1,227,299,353	
純資産の部	
元本等	
元本	271,259,590,671
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	337,455,294,333

(2019年 2月18日現在)

元本等合計	608,714,885,004
純資産合計	608,714,885,004
負債純資産合計	609,942,184,357

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>国債証券</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、価格情報会社の提供する価額等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	<p>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。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<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>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 2月18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	2.2440円
(10,000口当たり純資産額)	(22,440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 2月20日 至 2019年 2月18日	
1. 金融商品に対する取組方針	<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>
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、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。

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。

これらは、金利変動リスク、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。

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。

3.金融商品に係るリスク管理体制

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 2月18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	
国債証券	
(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 2月18日現在	
期首	2018年 2月20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	277,408,148,803円
同期中における追加設定元本額	34,534,089,819円
同期中における一部解約元本額	40,682,647,951円
期末元本額	271,259,590,671円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	89,694,303円
バランスセレクト50	90,754,291円
バランスセレクト70	76,677,973円
野村外国債券インデックスファンド	287,535,214円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,807,742,525円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	25,780,160,933円

野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,509,880,951円
野村資産設計ファンド2015	30,733,393円
野村資産設計ファンド2020	35,532,912円
野村資産設計ファンド2025	48,486,407円
野村資産設計ファンド2030	44,766,043円
野村資産設計ファンド2035	29,232,840円
野村資産設計ファンド2040	60,005,220円
野村外国債券インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	142,586,085,533円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	5,815,252,158円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	10,370,659,742円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	2,125,695,298円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	923,565,082円
野村資産設計ファンド2045	7,357,312円
野村インデックスファンド・外国債券	808,759,594円
マイ・ロード	8,982,602,455円
ネクストコア	495,775,672円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	124,804,492円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	4,288,960,362円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,475,814,861円
野村資産設計ファンド2050	8,899,543円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,135,051円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,672,225円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,360,776円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,053,718円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	469,914,656円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	239,524,158円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,396,676円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,452,026円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,007,241円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,202,364円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,541,842円
野村6資産均等バランス	255,611,725円
野村外国債券(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)	8,434,498,135円
世界6資産分散ファンド	76,881,696円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	350,891,144円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	706,774,976円
野村外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	11,443,783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)	1,653,083,926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)	442,826,377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)	2,014,697,836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)	1,433,326,093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)	3,482,547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)	11,563,013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)	811,636円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,378,620,917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)	25,830,205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)	121,099,983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)	60,983,491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)	196,153,181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)	207,539,095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)	1,943,596,047円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	944,235,223円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,336,948,280円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	902,271,801円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	4,136,963円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,770,898円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	6,652,894円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	554,563,080円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,513,346,231円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	3,391,471,873円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	3,026,611,938円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	14,254,797,497円
マイバランスDC30	1,632,090,117円
マイバランスDC50	1,011,409,942円
マイバランスDC70	658,767,382円
野村DC外国債券インデックスファンド	4,657,003,528円
野村DC運用戦略ファンド	3,749,578,651円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	350,283,237円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	93,154,046円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	87,907,380円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	40,718,178円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	3,236,496円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	12,429,113円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	3,119,145円
野村資産設計ファンド(DC)2030	480,064円
野村資産設計ファンド(DC)2040	354,205円
野村資産設計ファンド(DC)2050	477,030円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	24,023,308円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	11,080,608円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	3,447,655円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	6,812,260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2月18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2月18日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	12,700,000.00	13,840,518.42	
		US TREASURY BOND	24,200,000.00	27,692,928.78	
		US TREASURY BOND	13,800,000.00	15,975,115.98	
		US TREASURY BOND	47,100,000.00	46,735,709.76	
		US TREASURY BOND	39,200,000.00	47,707,623.04	
		US TREASURY BOND	18,300,000.00	23,281,031.25	
		US TREASURY BOND	23,000,000.00	29,188,437.50	
		US TREASURY BOND	18,300,000.00	22,601,929.23	
		US TREASURY BOND	28,300,000.00	34,510,522.73	
		US TREASURY BOND	35,600,000.00	43,554,375.00	
		US TREASURY BOND	100,000.00	123,101.56	
		US TREASURY BOND	27,500,000.00	27,018,750.00	
		US TREASURY BOND	16,000,000.00	18,171,249.60	
		US TREASURY N/B	100,000.00	98,929.68	
		US TREASURY N/B	200,000.00	197,656.24	
		US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,456,109.24	
		US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,054,195.21	
		US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,664,773.37	
		US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,940,820.00	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,992.10	
		US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,258,847.28	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,938,437.20	
		US TREASURY N/B	19,400,000.00	19,155,982.92	
		US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,492,089.75	
		US TREASURY N/B	600,000.00	592,875.00	
		US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,670,202.54	
		US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,607,875.00	
		US TREASURY N/B	9,300,000.00	9,280,745.28	
		US TREASURY N/B	57,900,000.00	58,549,111.11	
		US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,808,045.90	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,202,761.08			
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,998,828.00			
US TREASURY N/B	500,000.00	493,183.55			

US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,423,964.10	
US TREASURY N/B	10,400,000.00	10,272,436.72	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,199,296.80	
US TREASURY N/B	20,800,000.00	20,496,935.68	
US TREASURY N/B	13,400,000.00	13,294,264.62	
US TREASURY N/B	8,900,000.00	8,782,491.52	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,014,647.50	
US TREASURY N/B	32,180,000.00	32,211,423.77	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,083,199.15	
US TREASURY N/B	36,200,000.00	35,965,264.72	
US TREASURY N/B	37,700,000.00	37,034,357.49	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,948,437.20	
US TREASURY N/B	300,000.00	295,535.13	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,578,874.88	
US TREASURY N/B	700,000.00	686,437.50	
US TREASURY N/B	52,600,000.00	52,653,420.56	
US TREASURY N/B	13,700,000.00	13,571,562.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	984,140.60	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,779,546.28	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,380,312.50	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,277,452.04	
US TREASURY N/B	35,300,000.00	35,026,975.68	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,107,796.56	
US TREASURY N/B	47,200,000.00	48,208,527.12	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,979,375.00	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,792,445.02	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	11,734,546.58	
US TREASURY N/B	600,000.00	584,671.86	
US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,268,214.20	
US TREASURY N/B	10,800,000.00	10,738,405.44	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,098,281.04	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	43,164,113.46	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,002,304.60	
US TREASURY N/B	22,500,000.00	22,247,752.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	292,500.00	

US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,002,773.40	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	33,707,810.80	
US TREASURY N/B	800,000.00	775,187.44	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,105,331.90	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,642,406.25	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,676,202.84	
US TREASURY N/B	24,600,000.00	24,372,255.66	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,716,062.16	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,848,748.80	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	16,584,750.00	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,838,398.39	
US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,166,018.63	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	983,398.40	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,626,288.97	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,274,061.88	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,892,500.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,775,000.00	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	13,751,718.40	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	33,226,093.75	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,142,593.75	
US TREASURY N/B	900,000.00	883,828.08	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,681,890.13	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,276,335.84	
US TREASURY N/B	70,300,000.00	68,701,771.68	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	20,898,959.34	
US TREASURY N/B	11,100,000.00	10,843,312.50	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,667,195.27	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,832,257.74	
US TREASURY N/B	27,100,000.00	26,786,656.25	
US TREASURY N/B	600,000.00	585,890.58	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,754,281.04	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	979,453.10	
US TREASURY N/B	10,300,000.00	9,999,046.36	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	19,582,812.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,948,437.40	

US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,473,515.55	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,043,750.00	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	27,821,062.50	
US TREASURY N/B	47,900,000.00	46,556,553.49	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,671,952.70	
US TREASURY N/B	24,200,000.00	23,273,592.54	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,365,912.99	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,572,889.80	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,825,781.00	
US TREASURY N/B	49,300,000.00	47,813,294.41	
US TREASURY N/B	24,000,000.00	23,148,748.80	
US TREASURY N/B	13,700,000.00	12,981,819.97	
US TREASURY N/B	19,400,000.00	19,400,000.00	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	13,234,319.27	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	4,946,906.12	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	14,418,750.00	
US TREASURY N/B	15,600,000.00	15,773,061.72	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,043,312.04	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,965,312.50	
US TREASURY N/B	27,500,000.00	27,811,522.75	
US TREASURY N/B	6,900,000.00	6,771,702.78	
US TREASURY N/B	30,100,000.00	30,074,132.06	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,798,437.00	
US TREASURY N/B	46,000,000.00	45,029,685.20	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,516,000.00	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	33,673,638.06	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,422,890.45	
US TREASURY N/B	44,700,000.00	43,338,044.64	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,438,250.00	
US TREASURY N/B	35,000,000.00	35,147,654.50	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	30,546,093.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,336,484.05	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,055,078.00	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	26,086,638.60	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	19,702,498.56	

US TREASURY N/B	70,300,000.00	68,888,502.54	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,878,125.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	749,062.48	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,851,250.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,451,562.50	
US TREASURY N/B	22,300,000.00	21,709,397.88	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,375,281.18	
US TREASURY N/B	500,000.00	504,101.55	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	5,634,234.06	
US TREASURY N/B	15,500,000.00	19,703,162.90	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	3,338,507.61	
US TREASURY N/B	200,000.00	263,546.86	
US TREASURY N/B	100,000.00	125,070.31	
US TREASURY N/B	300,000.00	329,835.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	121,320.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	125,281.25	
US TREASURY N/B	100,000.00	123,312.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	127,367.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	123,351.56	
US TREASURY N/B	200,000.00	230,765.62	
US TREASURY N/B	5,800,000.00	7,042,921.44	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	6,744,156.12	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	8,286,015.29	
US TREASURY N/B	700,000.00	793,734.34	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,692,968.75	
US TREASURY N/B	500,000.00	514,335.90	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,020,859.30	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,047,093.54	
US TREASURY N/B	17,600,000.00	16,940,000.00	
US TREASURY N/B	24,200,000.00	24,823,905.04	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	15,580,468.40	
US TREASURY N/B	12,700,000.00	14,148,593.75	
US TREASURY N/B	18,900,000.00	20,225,952.18	
US TREASURY N/B	24,000,000.00	24,626,248.80	
US TREASURY N/B	36,900,000.00	37,035,489.42	

	US TREASURY N/B	46,800,000.00	42,679,405.08	
	US TREASURY N/B	21,700,000.00	21,776,288.52	
	US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,683,748.80	
	US TREASURY N/B	14,400,000.00	14,455,124.64	
	US TREASURY N/B	30,500,000.00	27,716,875.00	
	US TREASURY N/B	21,600,000.00	19,608,750.00	
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,204,984.34	
	US TREASURY N/B	14,200,000.00	13,892,702.06	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,703,453.04	
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,190,031.25	
	US TREASURY N/B	100,000.00	95,187.50	
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,000,000.00	
	US TREASURY N/B	200,000.00	204,937.50	
小計	銘柄数：186	2,494,780,000.00	2,525,035,946.62	
			(279,117,473,539)	
	組入時価比率：45.9%		46.3%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,667,200.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	15,800,000.00	15,753,706.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	7,968,714.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,600,000.00	3,598,848.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,446,415.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,505,670.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,715,334.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	7,250,224.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,050,000.00	10,379,137.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	292,425.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,694,272.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,518,363.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,597,184.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,543,834.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,109,647.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,634,560.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	8,173,577.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,532,138.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,341,872.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	4,750,000.00	6,962,692.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	186,646.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	100,905.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	13,656,182.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	6,136,620.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	4,881,414.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	10,858,604.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,900,000.00	12,575,277.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	339,420.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	579,168.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	236,952.00	
小計	銘柄数：30	133,180,000.00	148,237,001.40	
			(12,379,271,986)	
	組入時価比率：2.0%		2.1%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	52,600,000.00	52,476,390.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	103,000,000.00	99,384,700.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	54,600,000.00	53,320,984.08	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	108,100,000.00	102,939,306.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	43,296,800.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	47,700,000.00	41,328,711.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	86,300,000.00	81,959,110.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	49,600,000.00	49,801,872.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,500,000.00	43,697,445.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	9,225,000.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	62,753,669.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,300,000.00	39,250,991.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	57,563,004.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	13,740,276.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	82,382,480.00	
小計	銘柄数：15	857,200,000.00	833,120,738.08	
			(4,790,444,243)	
	組入時価比率：0.8%		0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,800,000.00	1,923,537.60	
	BELGIUM KINGDOM	5,700,000.00	6,400,245.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,800,000.00	2,047,293.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,800,000.00	5,599,680.00	

BELGIUM KINGDOM	7,900,000.00	8,761,100.00
BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,946,980.00
BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,560,000.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,027,117.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,042,900.00
BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	10,943,427.60
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,053,486.00
BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,061,564.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,021,800.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,022,027.50
BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,522,754.55
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,840,944.50
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	515,250.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,024,408.00
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	546,587.00
BELGIUM KINGDOM	5,400,000.00	8,294,227.20
BELGIUM KINGDOM	5,500,000.00	8,135,083.00
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	2,691,818.73
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,329,300.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,065,710.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,630,679.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	17,243,924.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	100,000.00	101,618.92
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,050,000.00	18,974,286.35
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,042,395.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,900,000.00	11,848,883.15
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,600,000.00	3,615,764.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,900,000.00	17,878,041.09
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,900,000.00	6,030,974.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,003,323.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,550,000.00	17,092,830.75
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,350,000.00	5,425,649.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,500,000.00	16,321,452.75
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,800,000.00	5,720,437.92
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,900,000.00	13,277,290.00

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	9,153,300.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	506,661.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	955,305.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,600,000.00	19,529,172.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,467,080.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,466,548.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	30,506,112.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,188,970.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,039,524.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,069,500.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	12,602,430.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,100,150.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,400,000.00	3,636,300.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,400,000.00	6,482,559.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,400,000.00	12,122,166.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,100,000.00	12,534,579.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,407,736.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,099,608.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,500,000.00	4,143,951.35	
BUNDES OblIGATION	100,000.00	100,659.00	
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	2,026,900.00	
BUNDES OblIGATION	1,600,000.00	1,619,088.00	
BUNDES OblIGATION	3,300,000.00	3,354,219.00	
BUNDES OblIGATION	1,900,000.00	1,934,124.00	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,018,700.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	104,916.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	104,364.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,079,513.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,800,000.00	5,235,456.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,400,000.00	6,857,920.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,300,000.00	15,351,479.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	7,000,110.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,358,200.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	3,238,080.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,000,000.00	11,918,720.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,600,000.00	6,217,568.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,900,000.00	18,430,844.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,200,000.00	2,436,940.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,647,615.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,300,000.00	11,061,788.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,829,600.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,849,658.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,800,000.00	9,238,856.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,012,060.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	720,405.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000.00	30,168,358.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,047,710.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	9,036,660.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,200,000.00	3,346,368.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,300,000.00	9,103,122.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	10,835,370.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	8,637,834.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,800,000.00	12,951,759.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,500,000.00	7,248,474.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	10,674,298.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	13,348,543.68	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000.00	6,163,899.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	8,301,128.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	10,456,056.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,600,000.00	6,383,216.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	100,000.00	100,747.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	104,071.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	24,200,000.00	25,198,492.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,014,070.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,800,594.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000.00	7,589,736.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000.00	3,984,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,006,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	12,106,230.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	98,400.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	12,000,000.00	12,771,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	99,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,541,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,400,000.00	15,756,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	413,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	541,387.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	103,010.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	18,688,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	300,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	401,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	394,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000.00	8,441,180.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,105,556.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,400,000.00	34,774,560.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	97,690.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,227,602.09	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	565,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	24,803,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	17,865,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	997,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	871,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,700,000.00	6,490,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	19,504,598.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	5,068,390.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,885,765.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,959,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	13,123,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,100,000.00	21,525,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,500,000.00	20,129,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	8,556,330.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,700,000.00	23,903,980.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	23,780,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	429,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	14,008,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	4,154,400.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	11,100,000.00	13,447,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,634,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	464,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,720,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,300,000.00	16,086,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,800,000.00	17,511,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	5,042,950.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	2,701,440.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	1,809,060.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	104,489.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,013,450.00	
FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	651,525.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,517,683.50	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,427,196.80	
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,289,590.80	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	404,210.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,900,000.00	3,224,075.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,531,320.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,840.90	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,060,932.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,047,169.50	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	815,786.40	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,581,942.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,367,096.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	100,527.46	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,006,571.50	
FRANCE (GOVT OF)	5,700,000.00	5,753,181.00	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,079,200.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	3,028,050.00	
FRANCE (GOVT OF)	5,970,000.00	6,478,524.60	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	100,395.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,500,000.00	3,935,239.70	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,316,279.70	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,838,700.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	2,635,728.00	

FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,040,446.00	
FRANCE (GOVT OF)	12,000,000.00	14,369,904.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,036,364.80	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	101,830.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	108,852.70	
FRANCE (GOVT OF)	5,100,000.00	5,651,116.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,284,797.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,900,000.00	26,159,691.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,100,000.00	1,114,344.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	12,886,190.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,350,320.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	10,525,525.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,900,000.00	2,932,931.24	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,264,009.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	9,852,372.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,300,000.00	35,432,490.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,308,817.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	27,621,415.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,357,300.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	42,304,460.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	8,677,440.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,311,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	14,636,308.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	28,813,905.12	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,300,000.00	11,417,010.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,000,000.00	5,993,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000.00	28,403,900.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	21,200,000.00	29,624,275.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,200,000.00	8,534,146.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,200,000.00	5,384,646.40	
IRISH GOVERNMENT	680,000.00	719,440.00	
IRISH GOVERNMENT	500,000.00	545,500.00	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,183,980.40	
IRISH GOVERNMENT	6,000,000.00	6,093,600.00	
IRISH TSY 0.8% 2022	2,500,000.00	2,581,025.00	

IRISH TSY 1.3% 2033	1,400,000.00	1,413,006.00	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,070,440.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	1,300,000.00	1,357,720.00	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,793,660.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	4,600,000.00	5,310,700.00	
IRISH TSY 2% 2045	2,800,000.00	3,040,979.20	
IRISH TSY 2022	2,000,000.00	2,010,800.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	5,200,000.00	6,076,356.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,800,000.00	4,017,626.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,350,000.00	6,934,060.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,300,000.00	2,332,285.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,639,306.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,600,000.00	1,863,960.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,300,000.00	8,262,450.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,530,368.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	101,273.70	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,142,950.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,023,609.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,151,600.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,214,908.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	10,802,540.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,050,080.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,600,000.00	5,854,420.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	6,316,134.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,200,000.00	8,582,333.76	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,400,000.00	6,571,791.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,596,790.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,800,000.00	1,908,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,206,600.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,384,150.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,600,000.00	1,619,680.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	6,600,000.00	7,539,180.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,021,800.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,550,000.00	1,696,665.65	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	5,284,800.00	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,404,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,222,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,090,600.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,435,241.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,225,300.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,100,000.00	6,321,769.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,700,000.00	8,271,545.31	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,605,450.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	811,035.00	
	REPUBLIC OF IRELAND	6,750,000.00	7,854,705.00	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,083,600.00	
	SPANISH GOVERNMENT	13,900,000.00	20,811,080.00	
	SPANISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,677,640.00	
小計	銘柄数：262	1,525,830,000.00	1,863,325,031.27	
			(232,785,196,156)	
	組入時価比率：38.2%		38.7%	
英債券	UK TREASURY	200,000.00	208,362.00	
	UK TREASURY	490,000.00	498,888.60	
	UK TREASURY	1,850,000.00	1,936,117.50	
	UK TREASURY	5,500,000.00	5,581,455.00	
	UK TREASURY	740,000.00	863,269.20	
	UK TREASURY	670,000.00	721,154.50	
	UK TREASURY	6,150,000.00	6,755,160.00	
	UK TREASURY	11,100,000.00	11,008,536.00	
	UK TREASURY	7,900,000.00	8,173,261.00	
	UK TREASURY	21,900,000.00	21,842,841.00	
	UK TREASURY	3,800,000.00	4,044,910.00	
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,207,908.00	
	UK TREASURY	9,350,000.00	10,307,253.00	
	UK TREASURY	11,850,000.00	14,715,804.00	
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,283,844.00	
	UK TREASURY	700,000.00	726,593.00	
	UK TREASURY	9,630,000.00	12,200,824.80	
	UK TREASURY	200,000.00	208,468.00	
	UK TREASURY	6,500,000.00	9,418,175.00	

	UK TREASURY	5,700,000.00	7,864,290.00	
	UK TREASURY	5,250,000.00	7,074,375.00	
	UK TREASURY	6,600,000.00	9,364,740.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	4,076,820.00	
	UK TREASURY	200,000.00	204,580.00	
	UK TREASURY	4,100,000.00	6,301,290.00	
	UK TREASURY	5,200,000.00	7,588,880.00	
	UK TREASURY	3,800,000.00	5,618,680.00	
	UK TREASURY	5,900,000.00	9,194,560.00	
	UK TREASURY	23,800,000.00	32,815,440.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	10,503,590.00	
	UK TREASURY	2,800,000.00	2,686,040.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,680,375.00	
	UK TREASURY	8,750,000.00	13,538,000.00	
	UK TREASURY	3,000,000.00	3,133,800.00	
	UK TREASURY	200,000.00	260,940.00	
	UK TREASURY	3,850,000.00	6,382,145.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	21,800,000.00	28,712,780.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	6,800,000.00	11,789,840.00	
小計	銘柄数：38	223,630,000.00	287,493,989.60	
			(41,016,767,496)	
	組入時価比率：6.7%		6.8%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,700,000.00	1,866,600.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	50,750,000.00	56,994,787.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	29,900,000.00	32,188,405.47	
	SWEDISH GOVERNMENT	34,350,000.00	39,540,285.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,717,984.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	15,300,000.00	15,839,894.16	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,000,000.00	10,232,950.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,500,000.00	15,202,425.00	
小計	銘柄数：8	164,500,000.00	184,583,331.13	
			(2,202,079,140)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
ノルウェークロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	20,600,000.00	21,811,280.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	11,700,000.00	12,065,625.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	48,635,680.00	

小計	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,801,285.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,710,340.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,744,288.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,421,760.00	
	銘柄数：7 組入時価比率：0.2%	103,400,000.00	109,190,258.00 (1,398,727,204) 0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	5,000,000.00	5,074,750.00	
	KINGDOM OF DENMARK	34,100,000.00	37,407,700.00	
	KINGDOM OF DENMARK	16,070,000.00	17,509,068.50	
	KINGDOM OF DENMARK	36,600,000.00	41,389,110.00	
	KINGDOM OF DENMARK	12,200,000.00	12,716,670.00	
	KINGDOM OF DENMARK	42,000,000.00	74,899,154.40	
	銘柄数：6 組入時価比率：0.5%	145,970,000.00	188,996,452.90 (3,163,800,621) 0.5%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,005,760.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	22,200,000.00	23,554,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	600,000.00	606,600.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000.00	3,820,140.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	14,964,075.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,824,300.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	11,343,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	14,400,000.00	15,650,640.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,100,000.00	1,113,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	22,900,000.00	24,082,785.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,500,000.00	11,505,750.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,183,944.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,212,474.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,200,000.00	11,726,596.00	
	銘柄数：14 組入時価比率：0.6%	119,400,000.00	128,593,464.40 (3,709,921,447) 0.6%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,750,000.00	7,990,011.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,200,000.00	5,199,941.24	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,100,000.00	12,076,502.52	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,146,919.49	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	8,501,625.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,550,500.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,346,449.87	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,400,000.00	6,702,720.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,200,000.00	14,280,025.32	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	14,720,004.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,700,000.00	14,108,901.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,375,852.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,800,000.00	17,986,900.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,268,313.96	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	11,155,991.36	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,480,220.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	518,449.35	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,300,000.00	9,292,812.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,893,340.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	5,960,298.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,554,000.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,542,598.05	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	4,135,170.00	
小計	銘柄数：23	146,430,000.00	160,787,547.26	
			(12,707,039,859)	
	組入時価比率：2.1%		2.1%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,447,448.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,480,000.00	2,498,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	983,300.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,800,000.00	1,791,180.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,457,120.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	297,810.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,099,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,000,700.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,123,650.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	703,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,307,550.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	319,950.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,557,200.00	

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	850,000.00	956,160.75	
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	781,292.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,120,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	828,336.00	
	銘柄数：17	28,130,000.00	29,272,796.75	(2,386,611,119)
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,110,228.13	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	404,560.32	
	MALAYSIA GOVERNMENT	600,000.00	624,162.30	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	415,073.52	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,302,910.23	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,413,431.84	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	601,712.22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,081,979.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,800,169.19	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,559,819.92	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	501,577.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,000,000.00	12,880,814.70	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,205,254.48	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,912,862.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	603,822.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	9,076,037.52	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,397,147.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,815,253.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,772,737.38	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,980,902.33	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,942,674.65	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,443,454.84	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,063,491.14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	762,983.68	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	884,628.72	
MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	10,051,732.67		
小計	銘柄数：26	102,500,000.00	103,609,422.18	(2,810,923,623)

		組入時価比率：0.5%		0.5%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,900,000.00		5,857,815.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	63,200,000.00		62,741,395.52
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	59,300,000.00		64,680,573.64
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	34,000,000.00		30,808,739.60
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00		24,651,000.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,400,000.00		41,732,981.28
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,800,000.00		6,317,564.48
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,100,000.00		27,190,419.33
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00		28,380,800.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000.00		10,848,911.74
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,600,000.00		21,343,086.90
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	77,500,000.00		69,042,022.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	50,200,000.00		44,701,855.04
	小計	銘柄数：13	485,800,000.00	
		組入時価比率：0.6%		0.6%
合計				601,913,272,146 (601,913,272,146)

(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。

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 2月18日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	923,189,530	-	925,687,000	2,497,470
米ドル	413,850,000	-	414,487,500	637,500
カナダドル	10,064,280	-	10,020,000	44,280
ユーロ	367,516,550	-	368,543,500	1,026,950
英ポンド	84,805,200	-	85,596,000	790,800
シンガポールドル	40,625,500	-	40,760,000	134,500

ランド	6,328,000	-	6,280,000	48,000
合計	923,189,530	-	925,687,000	2,497,470

(注) 時価の算定方法

1 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。

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	18,510,131
コール・ローン	26,502,236
国債証券	18,125,224,378
派生商品評価勘定	141,120
未収入金	45,295,975
未収利息	229,122,421
前払費用	17,290,132
流動資産合計	18,462,086,393
資産合計	
18,462,086,393	
負債の部	
流動負債	
未払解約金	23,864,048
未払利息	45
その他未払費用	219,400
流動負債合計	24,083,493
負債合計	
24,083,493	
純資産の部	
元本等	
元本	9,969,921,649
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,468,081,251
元本等合計	18,438,002,900
純資産合計	
18,438,002,900	
負債純資産合計	
18,462,086,393	

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>国債証券</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、価格情報会社の提供する価額等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	<p>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。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<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>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 2月18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	1.8494円
(10,000口当たり純資産額)	(18,494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 2月20日 至 2019年 2月18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、金利変動リスク、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 2月18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	
国債証券	
(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 2月18日現在	
期首	2018年 2月20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	7,196,127,378円
同期中における追加設定元本額	4,932,355,915円
同期中における一部解約元本額	2,158,561,644円
期末元本額	9,969,921,649円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	1,336,668,980円
ネクストコア	43,732,054円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	517,346,262円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,736,831円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,563,665円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,050,555円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,103,543円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,576,798円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	1,209,878,937円
野村外国債券(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)	2,155,150,534円
NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット	
・ボンド・インデックス・プラス(為替ヘッジなし)連動型上場投信	150,434,585円

ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	247,804,838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)	25,003,952円
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,479,493円
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	267,897,804円
野村新興国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	3,655,930,110円
野村DC運用戦略ファンド	330,522,079円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	14,040,629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2月18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2月18日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	ARGENT-GLOBAL	640,000.00	786,047.55	
		ARGENT-GLOBAL	420,000.00	503,766.27	
		ARGENT-GLOBAL	1,900,000.00	1,113,875.00	
		BRAZIL GLOBAL	650,000.00	810,875.00	
		BRAZIL GLOBAL	1,070,000.00	1,367,203.20	
		BRAZIL GLOBAL	900,000.00	1,059,084.00	
		COLOMBIA GLOBAL	250,000.00	297,812.50	
		COLOMBIA GLOBAL	1,220,000.00	1,537,517.20	
		CROATIA	1,000,000.00	1,044,040.00	
		CROATIA	500,000.00	526,250.00	
		CROATIA	800,000.00	859,000.00	
		CROATIA	800,000.00	885,440.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,930,000.00	1,991,760.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,100,000.00	1,058,200.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,800,000.00	1,815,750.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	900,000.00	986,850.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,700,000.00	1,695,342.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,200,000.00	1,210,500.00	

FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,600,000.00	1,469,000.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,482,187.50	
HUNGARY	1,100,000.00	1,178,578.50	
HUNGARY	750,000.00	822,924.75	
HUNGARY	1,100,000.00	1,196,269.80	
INDONESIA GLOBAL	1,200,000.00	1,308,236.40	
MEXICO GLOBAL	880,000.00	1,043,900.00	
PANAMA GLOBAL	300,000.00	359,235.00	
PANAMA GLOBAL	250,000.00	357,875.00	
PANAMA GLOBAL	950,000.00	1,206,500.00	
PERU GLOBAL	900,000.00	1,109,250.00	
PERU GLOBAL	670,000.00	873,345.00	
PHILIPPINES GLOBAL	1,000,000.00	968,255.00	
PHILIPPINES GLOBAL	750,000.00	1,136,251.50	
PHILIPPINES GLOBAL	800,000.00	1,105,889.60	
PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	632,678.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	900,000.00	690,525.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,400,000.00	2,298,600.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,250,000.00	2,039,062.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	600,000.00	514,875.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	3,500,000.00	3,061,187.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,900,000.00	1,582,937.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,800,000.00	1,409,850.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,500,000.00	1,224,375.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,100,000.00	1,647,187.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,350,000.00	1,094,006.25	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,300,000.00	984,750.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	1,126,125.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000.00	577,725.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,600,000.00	1,613,200.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	1,028,875.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	984,260.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,020,000.00	1,152,600.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	1,192,400.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,200,000.00	2,208,800.00	

REPUBLIC OF HUNGARY	1,500,000.00	1,593,397.50	
REPUBLIC OF HUNGARY	600,000.00	877,068.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,031,176.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,508,281.50	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,285,781.90	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,212,728.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,246,794.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	710,518.90	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	392,000.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	382,046.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	697,522.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	900,000.00	1,206,132.30	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,262,128.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	784,058.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	1,001,058.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	832,044.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	919,036.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	844,023.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	663,435.50	
REPUBLIC OF PANAMA	1,100,000.00	1,113,200.00	
REPUBLIC OF PANAMA	1,300,000.00	1,316,913.00	
REPUBLIC OF PANAMA	500,000.00	506,130.00	
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	799,600.00	
REPUBLIC OF PERU	600,000.00	635,400.00	
REPUBLIC OF PERU	1,200,000.00	1,464,000.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,600,000.00	1,630,512.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	838,122.40	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	908,334.40	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,039,606.40	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	924,928.80	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,200,000.00	1,230,613.20	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,600,000.00	1,575,478.40	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	203,369.60	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	750,000.00	784,031.25	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	698,153.40	

REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,350,000.00	1,407,485.70	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	491,973.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,662,834.60	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	368,054.80	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	441,721.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	658,238.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	300,000.00	302,347.20	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	1,109,614.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	590,816.40	
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,721,950.40	
REPUBLIC OF TURKEY	200,000.00	181,534.40	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	349,620.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,165,256.30	
REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000.00	2,003,034.60	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	985,341.50	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	1,043,647.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	565,834.80	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,038,428.40	
REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000.00	1,680,775.80	
REPUBLIC OF TURKEY	1,400,000.00	1,297,518.60	
REPUBLIC OF TURKEY	1,600,000.00	1,335,008.00	
ROMANIA	900,000.00	978,964.20	
ROMANIA	300,000.00	307,359.00	
ROMANIA	500,000.00	526,490.00	
ROMANIA	600,000.00	680,479.80	
ROMANIA	600,000.00	600,618.00	
RUSSIA	1,452,500.00	1,608,447.66	
RUSSIA FOREIGN BOND	1,100,000.00	1,123,199.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,200,000.00	1,226,660.40	
RUSSIAN FEDERATION	1,800,000.00	1,857,281.40	
RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,409,998.80	
RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,358,614.60	
RUSSIAN FEDERATION	800,000.00	774,500.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,486,499.00	
RUSSIAN FEDERATION	800,000.00	875,928.00	

	RUSSIAN FEDERATION	3,200,000.00	3,118,163.20	
	TURKEY GLOBAL	850,000.00	872,418.75	
	TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,470,315.00	
	TURKEY GLOBAL	1,200,000.00	1,251,930.00	
	TURKEY GLOBAL	650,000.00	884,157.30	
	UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	529,458.00	
	UKRAINE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,182,603.80	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	965,000.00	943,287.50	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	409,000.00	393,756.57	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	709,000.00	663,198.60	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	651,420.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	800,000.00	731,204.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,063,800.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,273,675.00	
	UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	401,302.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,102,761.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,650,000.00	1,665,584.25	
	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,171,800.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,000,000.00	996,875.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,200,000.00	2,164,800.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,045,550.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,910,000.00	2,098,135.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,800,000.00	1,696,500.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,368,250.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,500,000.00	1,381,875.00	
	UNITED MEXICAN STATES	900,000.00	805,275.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,477,000.00	
小計	銘柄数：150	163,845,500.00	163,969,824.30	
			(18,125,224,378)	
	組入時価比率：98.3%		100.0%	
合計			18,125,224,378	
			(18,125,224,378)	

(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。

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 2月18日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	20,966,880	-	20,998,800	31,920
米ドル	20,966,880	-	20,998,800	31,920
売建	23,320,500	-	23,211,300	109,200
米ドル	23,320,500	-	23,211,300	109,200
合計	-	-	-	141,120

(注) 時価の算定方法

1 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。

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	77,250,300
コール・ローン	154,706,864
国債証券	7,741,160,101
未収利息	113,369,709
前払費用	14,218,445
流動資産合計	8,100,705,419
資産合計	8,100,705,419
負債の部	
流動負債	

(2019年 2月18日現在)

派生商品評価勘定	3,266
未払解約金	153,913,857
未払利息	265
その他未払費用	400,300
流動負債合計	154,317,688
負債合計	154,317,688
純資産の部	
元本等	
元本	5,992,467,619
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,953,920,112
元本等合計	7,946,387,731
純資産合計	7,946,387,731
負債純資産合計	8,100,705,419

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>国債証券</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、価格情報会社の提供する価額等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	<p>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。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<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>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 2月18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	1.3261円
(10,000口当たり純資産額)	(13,261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 2月20日

至 2019年 2月18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。

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、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。

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。

これらは、金利変動リスク、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。

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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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っております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2019年 2月18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

国債証券

（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 2月18日現在

期首	2018年 2月20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	5,088,965,742円
同期中における追加設定元本額	2,334,814,912円
同期中における一部解約元本額	1,431,313,035円
期末元本額	5,992,467,619円
期末元本額の内訳*	

野村資産設計ファンド2015	12,214,915円
野村資産設計ファンド2020	14,275,729円
野村資産設計ファンド2025	19,695,649円
野村資産設計ファンド2030	18,181,439円
野村資産設計ファンド2035	11,871,206円
野村資産設計ファンド2040	24,383,987円
野村資産設計ファンド2045	2,980,601円
野村インデックスファンド・新興国債券 ネクストコア	698,107,270円 35,913,200円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	211,466,533円
野村資産設計ファンド2050	3,569,529円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	2,089,610円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	703,945円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	552,497円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	422,875円
世界6資産分散ファンド	130,302,049円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券(適格機関投資家専用)	4,158,917,759円
野村DC新興国債券(現地通貨建て)インデックスファンド	363,203,605円
野村DC運用戦略ファンド	271,552,842円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	11,532,387円
野村資産設計ファンド(DC)2030	194,950円
野村資産設計ファンド(DC)2040	143,839円
野村資産設計ファンド(DC)2050	191,203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2月18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2月18日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アルゼンチンペソ	REPUBLIC OF ARGENTINA	5,300,000.00	4,856,125.00	
		REPUBLIC OF ARGENTINA	13,300,000.00	12,069,750.00	
	小計	銘柄数: 2	18,600,000.00	16,925,875.00	
		組入時価比率: 0.6%		(48,408,002)	0.6%
	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,250,000.00	12,221,212.50	

	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,700,000.00	10,324,430.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,000,000.00	8,789,173.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	17,900,000.00	17,045,454.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,500,000.00	8,118,150.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,500,000.00	9,097,515.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	21,150,000.00	20,086,155.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,200,000.00	1,204,884.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,900,000.00	7,423,867.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,200,000.00	5,719,500.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,009,501.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,400,000.00	6,233,408.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,700,000.00	8,697,214.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,500,000.00	5,038,101.20	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	13,500,000.00	13,399,560.00	
小計	銘柄数：15	142,100,000.00	136,408,124.90	
			(784,346,718)	
	組入時価比率：9.9%		10.1%	
リアル	LETRA TESOURO NACIONAL	6,900,000.00	6,326,346.42	
	LETRA TESOURO NACIONAL	5,700,000.00	4,623,292.23	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	406,000.00	4,321,719.78	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	370,000.00	3,990,048.92	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	451,000.00	4,885,466.06	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	220,000.00	2,389,296.14	
小計	銘柄数：6	14,047,000.00	26,536,169.55	
			(792,370,022)	
	組入時価比率：10.0%		10.2%	
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	170,000,000.00	176,910,500.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	180,000,000.00	188,235,000.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	490,000,000.00	530,743,500.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	265,000,000.00	322,293,000.00	
	REPUBLIC OF CHILE	300,000,000.00	308,429,010.00	
小計	銘柄数：5	1,405,000,000.00	1,526,611,010.00	
			(254,180,733)	
	組入時価比率：3.2%		3.3%	
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,940,000,000.00	3,068,919,000.00	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	9,940,000,000.00	12,282,410,700.00	

小計	銘柄数：2 組入時価比率：6.8%	12,880,000,000.00	15,351,329,700.00 (541,901,938) 7.0%	
ソル	BONOS DE TESORERIA	1,400,000.00	1,463,734.58	
	BONOS DE TESORERIA	900,000.00	925,312.59	
	BONOS DE TESORERIA	1,300,000.00	1,344,152.16	
	PERU BONO SOBERANO	800,000.00	947,600.32	
	PERU BONO SOBERANO	1,100,000.00	1,213,677.08	
	PERU BONO SOBERANO	620,000.00	672,948.00	
	REPUBLIC OF PERU	800,000.00	849,675.76	
小計	銘柄数：7 組入時価比率：3.1%	6,920,000.00	7,417,100.49 (246,470,249) 3.2%	
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	3,558,000.00	
小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.2%	4,000,000.00	3,558,000.00 (12,061,620) 0.2%	
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	950,000.00	845,500.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	886,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,110,200.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,550,000.00	2,152,200.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,052,400.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,390,000.00	1,125,900.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,164,800.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,270,000.00	1,695,690.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,160,000.00	917,560.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	435,240.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,610,000.00	1,266,265.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	746,334.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,075,100.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	835,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	1,694,700.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	900,000.00	810,000.00	
小計	銘柄数：16 組入時価比率：4.7%	21,570,000.00	17,812,889.00 (373,892,540) 4.8%	

チェココルナ	CZECH REPUBLIC	5,000,000.00	4,913,244.50	
	CZECH REPUBLIC	6,700,000.00	6,902,273.00	
	CZECH REPUBLIC	20,800,000.00	19,700,803.20	
	CZECH REPUBLIC	20,700,000.00	19,678,463.28	
	CZECH REPUBLIC	16,900,000.00	15,091,700.00	
小計	銘柄数：5 組入時価比率：4.1%	70,100,000.00	66,286,483.98 (322,815,176) 4.2%	
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	58,000,000.00	58,663,160.40	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	81,000,000.00	90,894,150.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	120,000,000.00	124,610,400.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	50,000,000.00	59,216,330.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	122,000,000.00	122,992,091.80	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	92,138,200.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	65,000,000.00	68,200,626.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	74,563,650.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	30,000,000.00	30,120,060.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	182,000,000.00	185,845,223.20	
小計	銘柄数：10 組入時価比率：4.5%	848,000,000.00	907,243,891.40 (356,183,951) 4.6%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	2,230,000.00	2,233,211.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,230,000.00	1,305,030.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	900,000.00	909,900.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,809,540.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,080,000.00	1,197,126.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,229,700.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,580,000.00	1,792,194.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	400,000.00	409,240.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,240,000.00	4,608,244.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	1,998,135.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,050,000.00	2,051,025.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	1,886,133.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	1,910,773.00	
小計	銘柄数：13	23,410,000.00	24,340,252.00	

			(702,216,270)	
	組入時価比率：8.8%		9.1%	
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	40,500,000.00	39,884,400.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	8,000,000.00	7,952,480.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	67,000,000.00	66,423,800.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,000,000.00	35,878,900.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	40,000,000.00	37,549,800.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	59,000,000.00	57,999,950.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	21,000,000.00	19,463,010.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	35,000,000.00	35,616,700.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,500,000.00	35,628,750.00	
	小計	銘柄数：9	345,000,000.00	336,397,790.00
組入時価比率：7.1%			(561,784,309)	7.3%
レイ	ROMANIA	2,290,000.00	2,281,744.55	
	ROMANIA	300,000.00	315,277.50	
	ROMANIA	500,000.00	502,552.50	
	ROMANIA	400,000.00	395,354.00	
	ROMANIA	1,500,000.00	1,477,852.50	
	ROMANIA	250,000.00	266,361.25	
	ROMANIA	1,100,000.00	1,052,557.00	
	ROMANIA	920,000.00	942,503.20	
	ROMANIA	1,010,000.00	1,097,213.50	
	小計	銘柄数：9	8,270,000.00	8,331,416.00
組入時価比率：2.8%			(219,782,754)	2.8%
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,594,502.04	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,000,000.00	1,037,683.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,707,704.99	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	620,000.00	628,471.24	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,804,655.28	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	700,000.00	701,101.03	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,650,593.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,004,245.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,265,164.43	
	小計	銘柄数：9	17,320,000.00	17,394,121.61

			(471,902,519)	
	組入時価比率：5.9%		6.1%	
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,536,678.95	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,900,000.00	18,798,563.89	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,000,000.00	22,953,958.60	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	13,991,005.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000.00	23,083,774.28	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	2,600,000.00	2,627,532.96	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,394,998.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	18,900,000.00	18,544,483.44	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,334,287.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	15,098,000.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,453,686.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	5,200,000.00	5,763,837.56	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	22,500,000.00	23,872,403.25	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	8,405,618.40	
小計	銘柄数：14	178,800,000.00	186,858,827.33	
			(661,480,248)	
	組入時価比率：8.3%		8.5%	
フィリピンペソ	REPUBLIC OF PHILIPPINES	10,000,000.00	9,992,600.00	
小計	銘柄数：1	10,000,000.00	9,992,600.00	
			(21,084,386)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	4,100,000,000.00	4,373,607,760.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,700,000,000.00	1,897,350,280.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	7,780,000,000.00	7,679,733,694.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	7,100,000,000.00	6,588,587,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	9,230,000,000.00	9,409,246,600.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,300,000,000.00	2,331,236,070.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,580,000,000.00	6,436,530,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,150,000,000.00	5,740,348,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	12,500,000,000.00	10,975,500,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,030,000,000.00	4,286,534,083.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,000,000,000.00	3,050,414,100.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,287,080,298.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,645,633,040.00	

	INDONESIA GOVERNMENT	4,100,000,000.00	4,106,354,180.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	2,988,704,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,258,198,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,280,000,000.00	4,314,313,616.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	11,000,000,000.00	10,962,490,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	900,000,000.00	824,463,000.00	
小計	銘柄数：19	95,360,000,000.00	94,156,324,221.00	
			(734,419,328)	
	組入時価比率：9.2%		9.5%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	440,000.00	436,854.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,000,000.00	7,941,948.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,500,000.00	14,724,919.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,700,000.00	5,164,994.58	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,760,000.00	5,554,692.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,000,000.00	6,295,923.90	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	3,716,214.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,700,000.00	4,067,858.01	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,800,000.00	7,804,720.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,100,000.00	2,850,137.83	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	3,103,814.92	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,600,000.00	4,097,978.08	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	17,000,000.00	15,138,078.40	
小計	銘柄数：13	89,050,000.00	80,898,134.72	
			(635,859,338)	
	組入時価比率：8.0%		8.2%	
合計			7,741,160,101	
			(7,741,160,101)	

(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。

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 2月18日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
	うち1年超		
			評価損益(円)

市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	2,207,134	-	2,210,400	3,266
米ドル	2,207,134	-	2,210,400	3,266
合計	2,207,134	-	2,210,400	3,266

(注) 時価の算定方法

1 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。

J - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	366,573,433
投資証券	36,754,168,420
派生商品評価勘定	15,240,828
未収入金	14,320,439
未収配当金	319,585,485
流動資産合計	37,469,888,605
資産合計	37,469,888,605
負債の部	
流動負債	
前受金	5,586,600
未払金	26,512,134
未払解約金	28,038,247
未払利息	630
流動負債合計	60,137,611
負債合計	60,137,611
純資産の部	
元本等	
元本	17,119,807,358
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	20,289,943,636

元本等合計	37,409,750,994
純資産合計	37,409,750,994
負債純資産合計	37,469,888,605

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>投資証券 原則として時価で評価しております。 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。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。</p>
2. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 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。 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。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>
3. 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。 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 2月18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	2.1852円
(10,000口当たり純資産額)	(21,852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 2月20日 至 2019年 2月18日	
1. 金融商品に対する取組方針	<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>
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、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。

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。

これらは、REITの価格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。

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、REIT指数先物取引を行っております。

3.金融商品に係るリスク管理体制

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っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 2月18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	
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 2月18日現在	
期首	2018年 2月20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	15,468,104,967円
同期中における追加設定元本額	6,420,704,809円
同期中における一部解約元本額	4,769,002,418円
期末元本額	17,119,807,358円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,413,500,156円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,595,697,063円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	760,118,185円
野村資産設計ファンド2015	19,101,338円
野村資産設計ファンド2020	18,441,550円
野村資産設計ファンド2025	20,173,429円

野村資産設計ファンド2030	22,349,542円
野村資産設計ファンド2035	18,243,794円
野村資産設計ファンド2040	32,455,907円
野村資産設計ファンド2045	3,277,833円
野村インデックスファンド・J-REIT	2,713,147,373円
ネクストコア	139,199,766円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	643,842,324円
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	1,858,824,402円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	879,525,371円
野村資産設計ファンド2050	4,817,609円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,311,746円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,149,808円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,407,403円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,020,418円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,658,177円
野村6資産均等バランス	257,365,040円
野村世界REITインデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	83,448,439円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	42,729,614円
ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT(適格機関投資家専用)	982,749,646円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	1,775,316,857円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,721,095,110円
野村DC運用戦略ファンド	1,052,188,949円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	43,509,938円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	1,629,378円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,251,436円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	1,570,270円
野村資産設計ファンド(DC)2030	239,681円
野村資産設計ファンド(DC)2040	191,580円
野村資産設計ファンド(DC)2050	258,226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2月18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2月18日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	----	------	-----	----

投資証券	日本円	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	271	27,127,100	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,355	739,830,000	
		M C U B S M i d C i t y 投資法 人 投資証券	4,596	416,397,600	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,677	658,989,300	
		産業ファンド投資法人 投資証券	4,752	562,161,600	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,975	1,208,400,000	
		ケネディクス・レジデンシャル・ネ クスト投資法人 投資証券	2,436	444,082,800	
		アクティブ・プロパティーズ投資 法人 投資証券	2,143	984,708,500	
		G L P 投資法人 投資証券	10,106	1,189,476,200	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	1,691	473,649,100	
		日本プロロジスリート投資法人 投 資証券	5,471	1,284,590,800	
		星野リゾート・リート投資法人 投 資証券	621	327,888,000	
		O n e リート投資法人 投資証券	594	160,677,000	
		イオンリート投資法人 投資証券	4,186	527,854,600	
		ヒューリックリート投資法人 投資 証券	3,297	575,656,200	
		日本リート投資法人 投資証券	1,317	503,752,500	
		インベスコ・オフィス・ジェイリー ト投資法人 投資証券	24,176	380,046,720	
		日本ヘルスケア投資法人 投資証券	187	31,546,900	
		積水ハウス・リート投資法人 投資 証券	10,523	815,532,500	
		トーセイ・リート投資法人 投資証 券	785	86,664,000	
		ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,495	386,906,000	
		ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	854	94,964,800	
		サムティ・レジデンシャル投資法 人 投資証券	816	77,030,400	
野村不動産マスターファンド投資法 人 投資証券	12,088	1,890,563,200			
いちごホテルリート投資法人 投資	713	94,543,800			

証券			
ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,077	328,315,900	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	1,266	131,284,200	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	351	37,241,100	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	990	323,730,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	658	53,429,600	
さくら総合リート投資法人 投資証券	882	72,853,200	
投資法人みらい 投資証券	1,098	203,349,600	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	957	129,577,800	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	432	105,667,200	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	408	41,697,600	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	376	43,728,800	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	610	56,547,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	631	55,023,200	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,949	2,843,280,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,078	2,565,062,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,708	1,707,322,000	
オリックス不動産投資法人 投資証券	8,126	1,487,870,600	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,582	1,110,260,000	
プレミア投資法人 投資証券	3,878	495,220,600	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,734	441,541,000	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,608	314,003,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人	8,995	1,552,537,000	

投資証券				
	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,915	495,841,500	
	インヴィンシブル投資法人 投資証券	14,070	652,144,500	
	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,387	623,456,500	
	平和不動産リート投資法人 投資証券	2,540	305,054,000	
	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,691	599,554,800	
	福岡リート投資法人 投資証券	2,109	358,530,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,262	921,260,000	
	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,384	338,738,400	
	大和証券オフィス投資法人 投資証券	941	692,576,000	
	阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,835	259,652,500	
	スタートプロシード投資法人 投資証券	643	107,702,500	
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,106	1,304,583,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,128	1,092,249,600	
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	4,587	389,436,300	
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,652	570,807,600	
小計	銘柄数：62	219,769	36,754,168,420	
	組入時価比率：98.2%		100.0%	
合計			36,754,168,420	

(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

種類	2019年 2月18日現在		
	契約額等（円）	時価（円）	評価損益（円）
市場取引			

REIT指数先物取引				
買建	637,741,400	-	653,021,000	15,240,828
合計	637,741,400	-	653,021,000	15,240,828

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

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。

海外REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	82,851,491
コール・ローン	26,800,896
投資証券	24,923,961,798
派生商品評価勘定	7,933,456
未収入金	831,222
未収配当金	59,176,593
差入委託証拠金	33,266,058
流動資産合計	25,134,821,514
資産合計	25,134,821,514
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	143,410
未払金	5,725,640
未払解約金	62,679,299
未払利息	46
その他未払費用	484,600
流動負債合計	69,032,995
負債合計	69,032,995
純資産の部	
元本等	
元本	10,568,270,267
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	14,497,518,252
元本等合計	25,065,788,519
純資産合計	25,065,788,519
負債純資産合計	25,134,821,514

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	投資証券
-------------------	------

	<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 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 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	<p>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。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 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 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 約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益 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 2月18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	2,3718円
(10,000口当たり純資産額)	(23,718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 2月20日 至 2019年 2月18日	
1. 金融商品に対する取組方針	
<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>	
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、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。

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。

これらは、REITの価格変動リスク、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。

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、REIT指数先物取引を行っております。

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。

3.金融商品に係るリスク管理体制

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っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 2月18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

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 2月18日現在

期首	2018年 2月20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	9,816,865,095円
同期中における追加設定元本額	3,894,943,092円
同期中における一部解約元本額	3,143,537,920円
期末元本額	10,568,270,267円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,354,299,810円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,486,985,095円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	728,283,156円
野村資産設計ファンド2015	18,301,347円

野村資産設計ファンド2020	17,669,190円
野村資産設計ファンド2025	19,324,360円
野村資産設計ファンド2030	21,409,792円
野村資産設計ファンド2035	17,479,720円
野村資産設計ファンド2040	31,089,774円
野村資産設計ファンド2045	3,139,878円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,373,947,341円
ネクストコア	49,744,949円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	240,795,172円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	853,957,673円
野村資産設計ファンド2050	4,614,826円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,788,891円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,224,522円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,973,440円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,394,377円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,061,734円
野村6資産均等バランス	246,574,707円
NEXT FUNDS 外国REIT・S&P先進国REIT指数(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	565,280,454円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	359,037,716円
ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA(適格機関投資家専用)	339,753,617円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT(適格機関投資家専用)	1,424,448,107円
野村DC運用戦略ファンド	376,812,065円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	15,953,623円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	1,560,795円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,199,024円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	1,504,503円
野村資産設計ファンド(DC)2030	229,641円
野村資産設計ファンド(DC)2040	183,557円
野村資産設計ファンド(DC)2050	247,411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2月18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2月18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	ACADIA REALTY TRUST	15,300	451,044.00	

AGREE REALTY CORP	6,500	426,725.00	
ALEXANDERS INC	750	277,012.50	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	20,730	2,795,647.80	
AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,600	334,780.00	
AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	26,100	1,190,943.00	
AMERICAN FINANCE TRUST INC	10,000	110,300.00	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	49,500	1,137,015.00	
AMERICOLD REALTY TRUST	11,000	316,250.00	
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	30,100	1,493,261.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	40,700	665,852.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,600	84,084.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,580	5,211,540.60	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	43,806.00	
BOSTON PROPERTIES	29,720	3,971,186.40	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,000	71,340.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	34,800	555,756.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	56,900	1,020,786.00	
BRT APARTMENTS CORP	1,600	21,056.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	17,970	1,773,639.00	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	16,200	363,204.00	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	31,000	70,060.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	16,000	56,800.00	
CHATHAM LODGING TRUST	9,500	199,215.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	11,600	339,416.00	
CITY OFFICE REIT INC	8,000	96,960.00	
CLIPPER REALTY INC	2,400	30,480.00	
COLONY CAPITAL INC	96,000	585,600.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	22,200	506,604.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,500	121,275.00	
CORECIVIC INC	23,500	477,990.00	
CORESITE REALTY CORP	6,940	712,876.80	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	20,500	536,280.00	
COUSINS PROPERTIES INC	79,500	753,660.00	
CUBESMART	35,800	1,117,318.00	
CYRUSONE INC	20,100	1,153,740.00	

DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	41,400	446,706.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	39,690	4,565,540.70	
DOUGLAS EMMETT INC	30,700	1,185,020.00	
DUKE REALTY CORP	69,200	2,060,776.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	12,200	219,112.00	
EASTGROUP PROPERTIES	6,820	733,968.40	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	26,300	408,965.00	
EPR PROPERTIES	14,120	1,066,201.20	
EQUITY COMMONWEALTH	23,200	757,944.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,320	1,887,533.60	
EQUITY RESIDENTIAL	70,850	5,186,928.50	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	6,500	107,705.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,720	3,546,590.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	24,430	2,436,159.60	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	30,910.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,280	1,934,654.40	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	24,200	820,622.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	12,700	353,822.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	20,100	143,313.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,000	113,000.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	38,800	1,442,972.00	
GEO GROUP INC/THE	23,700	534,435.00	
GETTY REALTY CORP	6,400	214,464.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,400	112,806.00	
GLADSTONE LAND CORP	2,500	31,225.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,000	52,250.00	
GLOBAL NET LEASE INC	15,100	287,806.00	
HCP INC	92,100	2,840,364.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	23,700	777,123.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	39,800	1,134,300.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6,600	123,024.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	19,800	928,224.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	31,200	855,816.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	143,200	2,669,248.00	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	29,700	1,001,781.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	18,500	196,100.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	12,500	267,625.00	
INFREIT INC	8,000	169,120.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,000	129,980.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,200	132,242.00	
INVITATION HOMES INC	56,400	1,326,528.00	
IRON MOUNTAIN INC	54,600	1,917,552.00	
JBG SMITH PROPERTIES	20,600	843,982.00	
KILROY REALTY CORP	19,170	1,418,004.90	
KIMCO REALTY CORP	81,200	1,442,112.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	17,000	287,300.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	41,300	397,719.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	28,500	1,354,890.00	
LIFE STORAGE INC	8,840	884,000.00	
LTC PROPERTIES INC	7,600	360,392.00	
MACERICH CO /THE	20,100	878,169.00	
MACK-CALI REALTY CORP	16,900	356,252.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	225,007	195,756.09	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	5,600	60,480.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	69,400	1,274,184.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,980	2,289,876.40	
MONMOUTH REIT-CLASS A	18,000	247,140.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	30,700	1,613,899.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,800	308,016.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,060	681,634.20	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	15,000	86,400.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	4,100	157,317.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	9,700	167,325.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	9,250	289,062.50	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	38,700	1,411,002.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,800	77,728.00	
PARAMOUNT GROUP INC	38,500	562,870.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	38,200	1,156,314.00	

PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	24,200	801,020.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	11,500	77,855.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	34,400	642,248.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	25,100	520,574.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	8,000	125,760.00	
PROLOGIS INC	120,960	8,611,142.40	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,880	572,610.40	
PUBLIC STORAGE	28,830	5,989,144.20	
QTS REALTY TRUST INC CL A	9,600	426,720.00	
REALTY INCOME CORP	56,790	3,980,411.10	
REGENCY CENTERS CORP	32,700	2,168,664.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,400	399,168.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	42,000	535,920.00	
RETAIL VALUE INC	2,680	82,999.60	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	17,500	612,850.00	
RLJ LODGING TRUST	33,100	632,541.00	
RPT REALTY	15,700	209,752.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,830	832,994.20	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	34,100	681,659.00	
SAFETY INCOME & GROWTH INC	1,500	28,560.00	
SAUL CENTERS INC	2,400	137,568.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	46,200	652,806.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	5,300	231,875.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	59,410	10,893,417.60	
SITE CENTERS CORP	28,700	384,580.00	
SL GREEN REALTY CORP	16,440	1,505,904.00	
SPIRIT MTA REIT	7,210	56,382.20	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	16,200	655,614.00	
STAG INDUSTRIAL INC	21,200	609,288.00	
STORE CAPITAL CORP	36,000	1,170,360.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	20,300	230,811.00	
SUN COMMUNITIES INC	16,670	1,909,548.50	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	43,500	637,275.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	18,400	399,832.00	

	TAUBMAN CENTERS INC	11,900	600,950.00	
	TERRENO REALTY CORP	11,600	480,704.00	
	TIER REIT INC	10,300	250,187.00	
	UDR INC	53,200	2,372,188.00	
	UMH PROPERTIES INC	7,200	98,568.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,630	199,722.20	
	URBAN EDGE PROPERTIES	22,400	451,584.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	6,000	129,360.00	
	VENTAS INC	68,600	4,473,406.00	
	VEREIT INC	186,500	1,542,355.00	
	VICI PROPERTIES INC	69,400	1,483,772.00	
	VORNADO REALTY TRUST	33,420	2,299,296.00	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	37,000	207,570.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	15,400	413,028.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	23,200	693,448.00	
	WELLTOWER INC	72,230	5,605,770.30	
	WHITESTONE REIT	7,400	106,486.00	
	WP CAREY INC	31,100	2,338,720.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	22,000	419,760.00	
小計	銘柄数：157	4,305,007	164,600,513.69 (18,194,940,783)	
	組入時価比率：72.6%		72.9%	
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN	3,200	45,408.00	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	9,600	457,536.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	14,700	157,878.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,200	171,024.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	13,500	642,870.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	26,200	351,080.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16,500	195,030.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	8,200	112,750.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,500	127,395.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	17,300	224,727.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	9,000	98,460.00	

	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,200	147,312.00
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,400	270,468.00
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	26,400	593,208.00
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,000	152,350.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,200	146,288.00
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,500	28,785.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	57,156.00
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	5,800	156,832.00
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	9,400	100,392.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,600	718,718.00
	SLATE OFFICE REIT	5,900	39,117.00
	SLATE RETAIL REIT	4,300	55,685.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	13,700	460,731.00
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	8,000	88,080.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,000	32,050.00
小計	銘柄数：26	273,600	5,631,330.00
			(470,272,368)
	組入時価比率：1.9%		1.9%
ユ-口	AEDIFICA	3,630	301,290.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	30,800	404,712.00
	ALTAREA	680	120,632.00
	BEFIMMO S.C.A.	4,300	206,400.00
	COFINIMMO	4,030	464,659.00
	COVIVIO	12,020	1,041,533.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	7,600	198,056.00
	GECINA SA	10,580	1,335,196.00
	GREEN REIT PLC	126,000	180,180.00
	HAMBORNER REIT AG	15,400	135,520.00
	HIBERNIA REIT PLC	140,000	174,160.00
	ICADE	8,560	635,152.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,000	61,640.00
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	51,900	453,606.00
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	4,114	87,628.20
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	70,000	105,280.00

	KLEPIERRE	39,500	1,186,580.00
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,000	114,800.00
	MERCIALYS	10,400	130,520.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	70,300	791,226.50
	MONTEA	1,200	78,240.00
	NSI NV	3,800	141,550.00
	RETAIL ESTATES	1,500	115,050.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26,470	3,841,326.40
	VASTNED RETAIL NV	3,100	101,370.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,420	448,704.00
	WERELDHAVE NV	7,700	197,120.00
小計	銘柄数：27	681,004	13,052,131.10
			(1,630,602,738)
	組入時価比率：6.5%		6.5%
英債券	ASSURA PLC	444,000	257,964.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	29,500	275,235.00
	BRITISH LAND	188,000	1,102,432.00
	CAPITAL & REGIONAL PLC	93,000	29,760.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	122,000	121,512.00
	DERWENT LONDON PLC	21,600	682,992.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	108,000	106,056.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	54,900	398,738.70
	HAMMERSON PLC	147,000	559,041.00
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	82,000	76,506.00
	INTU PROPERTIES PLC	162,000	190,674.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	144,900	1,287,291.60
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	129,000	241,617.00
	LXI REIT PLC	64,000	78,720.00
	NEWRIVER REIT PLC	63,000	135,135.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	104,000	92,456.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	151,000	176,368.00
	RDI REIT PLC	56,000	82,320.00
	REGIONAL REIT LTD	56,000	56,896.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	38,900	223,675.00
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	110,000	64,240.00

小計	SEGR0 PLC	194,700	1,246,080.00
	SHAFTESBURY PLC	43,400	373,240.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	63,000	64,575.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	290,000	392,950.00
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	125,000	108,500.00
	UNITE GROUP PLC	49,600	434,000.00
	WORKSPACE GROUP PLC	24,900	236,674.50
	銘柄数：28	3,159,400	9,095,648.80 (1,297,676,214)
	組入時価比率：5.2%		5.2%
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	60,000	221,400.00
	ARENA REIT	52,000	141,440.00
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	9,800	0.00
	BWP TRUST	89,000	333,750.00
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	42,000	141,120.00
	CHARTER HALL GROUP	90,000	773,100.00
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	40,444	183,615.76
	CHARTER HALL RETAIL REIT	66,000	302,280.00
	CROMWELL PROPERTY GROUP	304,000	329,840.00
	DEXUS	194,700	2,348,082.00
	GDI PROPERTY GROUP	90,000	129,150.00
	GOODMAN GROUP	305,900	3,927,756.00
	GPT GROUP	346,000	2,037,940.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	56,000	223,440.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	27,000	84,510.00
	INDUSTRIA REIT	20,000	58,000.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,000	122,070.00
	MIRVAC GROUP	713,000	1,832,410.00
	NATIONAL STORAGE REIT	130,000	243,100.00
	PROPERTYLINK GROUP	80,000	92,400.00
	RURAL FUNDS GROUP	60,000	133,200.00
	SCENTRE GROUP	1,027,000	4,087,460.00
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	176,000	438,240.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	463,000	1,722,360.00
	VICINITY CENTRES	611,000	1,564,160.00
	VIVA ENERGY REIT	80,000	194,400.00

小計	銘柄数：26 組入時価比率：6.8%	5,171,844	21,665,223.76 (1,712,202,633) 6.9%
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	160,000	199,200.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	190,000	313,500.00
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	290,000	417,600.00
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	201,000	309,540.00
	STRIDE STAPLED GROUP	69,000	136,620.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	64,000	134,080.00
小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.5%	974,000	1,510,540.00 (114,876,567) 0.5%
香港ドル	CHAMPION REIT	386,000	2,296,700.00
	FORTUNE REIT	263,000	2,527,430.00
	LINK REIT	409,100	35,428,060.00
	PROSPERITY REIT	220,000	706,200.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	195,000	1,099,800.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	268,000	1,452,560.00
小計	銘柄数：6 組入時価比率：2.4%	1,741,100	43,510,750.00 (612,631,360) 2.5%
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	112,000	154,560.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	150,000	127,500.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	491,000	1,355,160.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	227,000	256,510.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	209,860	150,049.90
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	543,964	1,017,212.68
	CAPITALAND MALL TRUST	538,000	1,285,820.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	128,000	183,040.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	145,000	229,100.00
	ESR REIT	390,000	208,650.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	162,000	103,680.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	120,000	126,000.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	106,000	241,680.00
FRASERS COMMERCIAL TRUST	139,000	207,110.00	

	FRASERS HOSPITALITY TRUST	140,000	102,200.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	299,000	331,890.00	
	KEPPEL DC REIT	190,956	276,886.20	
	KEPPEL REIT	340,000	414,800.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	340,000	79,900.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	371,025	664,134.75	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	236,000	469,640.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	444,000	617,160.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	402,000	502,500.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	220,043	157,330.74	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	72,000	201,600.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	133,764	56,849.70	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	136,700	82,020.00	
	SPH REIT	124,000	126,480.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	260,000	180,700.00	
	SUNTEC REIT	429,000	815,100.00	
小計	銘柄数：30	7,600,312	10,725,263.97	(874,430,771)
	組入時価比率：3.5%			3.5%
新シエケル	REIT 1 LTD	34,000	534,480.00	
小計	銘柄数：1	34,000	534,480.00	(16,328,364)
	組入時価比率：0.1%			0.1%
合計			24,923,961,798	(24,923,961,798)

(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 2月18日現在		
	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引			

REIT指数先物取引					
買建	117,896,436	-	125,829,892	7,933,456	
市場取引以外の取引					
為替予約取引					
買建	4,443,400	-	4,421,200	22,200	
米ドル	4,443,400	-	4,421,200	22,200	
売建	46,755,090	-	46,876,300	121,210	
米ドル	17,659,680	-	17,684,800	25,120	
ユーロ	3,737,070	-	3,747,900	10,830	
英ポンド	8,480,340	-	8,559,600	79,260	
香港ドル	16,878,000	-	16,884,000	6,000	
合計	-	-	-	7,790,046	

(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。

野村マネー マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 2月18日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,483,132,262
地方債証券	431,576,900
特殊債券	2,191,239,432
社債券	3,543,570,692

(2019年 2月18日現在)

コマーシャル・ペーパー	1,999,996,289
未収利息	3,760,751
前払費用	4,329,134
流動資産合計	11,657,605,460
資産合計	11,657,605,460
負債の部	
流動負債	
未払金	390,292,800
未払解約金	699,000
未払利息	5,988
流動負債合計	390,997,788
負債合計	390,997,788
純資産の部	
元本等	
元本	11,039,670,818
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	226,936,854
元本等合計	11,266,607,672
純資産合計	11,266,607,672
負債純資産合計	11,657,605,460

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	地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 コマーシャル・ペーパー 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等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。

(貸借対照表に関する注記)

2019年 2月18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	1.0206円
(10,000口当たり純資産額)	(10,206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 2月20日

至 2019年 2月18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。

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、附属明細表に記載しております。

これらは、金利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。

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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っております。

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2019年 2月18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

地方債証券、特殊債券、社債券

（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。

コマーシャル・ペーパー

（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。

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 2月18日現在

期首	2018年 2月20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	17,480,842,737円
同期中における追加設定元本額	560,997,975円
同期中における一部解約元本額	7,002,169,894円
期末元本額	11,039,670,818円
期末元本額の内訳*	
野村米国ハイ・イールド債券投信（マネープールファンド）年2回決算型	7,149,673円
野村日本ブランド株投資（マネープールファンド）年2回決算型	114,791,204円

野村新米国ハイ・イールド債券投信(マネープールファンド)年2回決算型	5,452,422円
野村ピクテ・ヘルスケア マネープール・ファンド	3,546,551円
野村・グリーン・テクノロジー マネープール・ファンド	1,019,915円
野村新興国消費関連株投信 マネープール・ファンド	2,409,432円
野村世界業種別投資シリーズ(マネープール・ファンド)	13,467,689円
ノムラ・アジア・シリーズ(マネープール・ファンド)	65,375,723円
野村新エマージング債券投信(マネープールファンド)年2回決算型	2,515,073円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(マネープールファンド)年2回決算型	1,230,043円
野村グローバルC B投信(マネープールファンド)年2回決算型	839,641円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(マネープールファンド)年2回決算型	13,356,799円
ネクストコア	19,922,154円
野村世界高金利通貨投信	151,953,753円
野村新世界高金利通貨投信	982,608円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(欧州通貨コース)	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(円コース)	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド(豪ドルコース)	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ユーロコース)年2回決算型	9,826円
野村米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260円
野村米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,261円
野村日本ブランド株投資(円コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)毎月分配型	982,608円
野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261円
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	982,607円
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260円
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円

野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260円
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Aコース	982,608円
野村PIMCO・グローバル・アドバンテージ債券投信 Bコース	98,260円
野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信(中国元コース)毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260円
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826円
野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	98,261円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834円
野村高金利国際機関債投信(毎月分配型)	49,354,623円
野村アジアCB投信(毎月分配型)	982,608円
野村グローバルCB投信(円コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルCB投信(円コース)年2回決算型	984,543円
野村グローバルCB投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543円
野村グローバルCB投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543円
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	984,252円
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	982,609円
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	982,609円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型	982,607円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	982,607円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	982,608円

野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	98,261円
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98,261円
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768円
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768円
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672円
野村テンブルトン・トータル・リターン Aコース	983,381円
野村テンブルトン・トータル・リターン Bコース	98,261円
野村テンブルトン・トータル・リターン Cコース	983,381円
野村テンブルトン・トータル・リターン Dコース	983,381円
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,262円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261円
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	983,091円
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898円
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801円
野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401円
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,608円
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,415円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,029円
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547円

野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547円
野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信（ユーロコース）毎月分配型	1,963円
野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）毎月分配型	457,265円
野村通貨選択日本株投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）毎月分配型	123,377円
野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信（中国元コース）毎月分配型	58,906円
野村通貨選択日本株投信（インドネシアルピアコース）毎月分配型	80,956円
野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）毎月分配型	568,479円
野村通貨選択日本株投信（ロシアルーブルコース）毎月分配型	48,092円
野村通貨選択日本株投信（米ドルコース）年2回決算型	981,451円
野村通貨選択日本株投信（ユーロコース）年2回決算型	4,908円
野村通貨選択日本株投信（豪ドルコース）年2回決算型	434,099円
野村通貨選択日本株投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型	406,687円
野村通貨選択日本株投信（トルコリラコース）年2回決算型	52,622円
野村通貨選択日本株投信（メキシコペソコース）年2回決算型	981,451円
野村通貨選択日本株投信（中国元コース）年2回決算型	57,201円
野村通貨選択日本株投信（インドネシアルピアコース）年2回決算型	36,702円
野村通貨選択日本株投信（インドルピーコース）年2回決算型	220,902円
野村通貨選択日本株投信（ロシアルーブルコース）年2回決算型	13,741円
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451円
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451円
ノムラ THE USA Aコース	981,258円
ノムラ THE USA Bコース	981,258円
ノムラ THE EUROPE Aコース	98,117円
ノムラ THE EUROPE Bコース	98,117円
野村日本ブランド株投資（米ドルコース）毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資（メキシコペソコース）毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資（米ドルコース）年2回決算型	9,809円
野村日本ブランド株投資（メキシコペソコース）年2回決算型	9,809円
野村アジアハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	9,808円
野村アジアハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型	9,808円
野村米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）毎月分配型	9,808円
野村米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）年2回決算型	9,808円
野村米国ブランド株投資（米ドルコース）毎月分配型	9,807円
野村米国ブランド株投資（米ドルコース）年2回決算型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（米ドルコース）毎月分配型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信（米ドルコース）年2回決算型	9,807円
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（メキシコペソコース）毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型	9,805円

野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805円
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803円
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803円
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803円
野村新興国高配当株トリプルウイング ブラジルリアル毎月分配型	9,803円
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)	9,803円
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)	9,803円
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)	9,803円
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801円
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801円
ノムラ THE ASIA Aコース	97,992円
ノムラ THE ASIA Bコース	979,912円
グローバル・ストック Aコース	97,953円
グローバル・ストック Bコース	979,528円
グローバル・ストック Cコース	97,953円
グローバル・ストック Dコース	979,528円
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795円
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795円
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797円
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797円
第1回 野村短期公社債ファンド	3,037,421円
第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169円
第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897円
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981円
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729円
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981円
第7回 野村短期公社債ファンド	686,093円
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831円
第10回 野村短期公社債ファンド	1,959,728円
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757円
第12回 野村短期公社債ファンド	6,664,982円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	5,129,840,665円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)	2,050,866,611円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプライス(適格機関投資家専用)	3,161,244,481円

野村DC運用戦略ファンド	85,180,134円
野村DCテンプレート・トータル・リターン Aコース	9,818円
野村DCテンプレート・トータル・リターン Bコース	9,818円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405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2月18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2月18日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
地方債証券	日本円	北海道 公募平成21年度第2回	100,000,000	100,447,472	
		京都府 公募(5年)平成26年度第1回	30,000,000	30,012,000	
		愛知県 公募平成21年度第3回	100,000,000	100,563,900	
		千葉市 公募平成21年度第1回	200,000,000	200,553,528	
	小計	銘柄数:4 組入時価比率:3.8%	430,000,000	431,576,900	5.3%
	合計			431,576,900	
特殊債券	日本円	地方公営企業等金融機構債券 第3回	250,000,000	250,744,449	
		日本政策金融公庫債券 政府保証第27回	60,000,000	60,124,980	
		日本学生支援債券 財投機関債第46回	190,000,000	190,009,700	
		商工債券 利付第765回い号	900,000,000	900,062,809	
		農林債券 利付第766回い号	100,000,000	100,028,913	
		農林債券 利付第767回い号	200,000,000	200,111,126	
		しんきん中金債券 利付第293回	100,000,000	100,045,425	
		しんきん中金債券 利付第294回	100,000,000	100,063,750	
		東日本高速道路 第27回	60,000,000	60,048,280	

		鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第97回	230,000,000	230,000,000		
	小計	銘柄数：10 組入時価比率：19.4%	2,190,000,000	2,191,239,432	26.8%	
	合計			2,191,239,432		
社債券	日本円	三菱電機 第44回社債間限定同順位特約付	500,000,000	500,383,427		
		トヨタ自動車 第10回社債間限定同等特約付	300,000,000	301,664,760		
		三菱東京UFJ銀行 第154回特定社債間限定同順位特約付	500,000,000	500,209,880		
		三井住友銀行 第59回社債間限定同順位特約付	500,000,000	500,220,040		
		みずほ銀行 第36回特定社債間限定同順位特約付	500,000,000	500,276,848		
		東京センチュリーリース 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,019,368		
		トヨタファイナンス 第69回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,000,000		
		トヨタファイナンス 第71回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,000,000		
		三菱UFJリース 第29回社債間限定同順位特約付	300,000,000	300,247,804		
		三菱地所 第108回担保提供制限等財務上特約無	300,000,000	300,497,814		
		中国電力 第390回	100,000,000	100,033,800		
		四国電力 第288回	40,000,000	40,016,951		
		小計	銘柄数：12 組入時価比率：31.5%	3,540,000,000	3,543,570,692	43.4%
		合計			3,543,570,692	
コマーシャル・ペーパー	日本円	ホンダファイナンス	500,000,000	500,000,144		
		三井住友F&L	200,000,000	199,999,480		
		三井住友F&L	200,000,000	199,997,165		
		三井住友F&L	100,000,000	99,999,340		
		日産Fサービス	1,000,000,000	1,000,000,160		
		小計	銘柄数：5 組入時価比率：17.8%	2,000,000,000	1,999,996,289	24.5%
		合計			1,999,996,289	
合計			8,166,383,313			

(注1)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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

野村DC運用戦略ファンド

2019年3月29日現在

資産総額	31,098,158,949円
負債総額	8,310,496,439円
純資産総額（ - ）	22,787,662,510円
発行済口数	20,724,442,787口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0996円

（参考）国内株式マザーファンド

2019年3月29日現在

資産総額	485,043,125,242円
負債総額	86,983,188,077円
純資産総額（ - ）	398,059,937,165円
発行済口数	251,042,165,705口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5856円

（参考）国内債券マザーファンド

2019年3月29日現在

資産総額	29,339,193,838円
負債総額	253,915,186円
純資産総額（ - ）	29,085,278,652円
発行済口数	21,146,645,978口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3754円

（参考）外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

2019年3月29日現在

資産総額	564,611,079,121円
負債総額	3,094,403,285円
純資産総額（ - ）	561,516,675,836円
発行済口数	207,466,062,347口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7065円

（参考）外国債券マザーファンド

2019年3月29日現在

資産総額	620,303,840,462円
負債総額	904,635,624円
純資産総額（ - ）	619,399,204,838円
発行済口数	270,745,577,815口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2878円

（参考）新興国株式マザーファンド

2019年3月29日現在

資産総額	37,749,103,168円
負債総額	399,749,563円
純資産総額（ - ）	37,349,353,605円
発行済口数	29,912,214,442口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2486円

（参考）新興国債券マザーファンド

2019年3月29日現在

資産総額	19,261,644,667円
負債総額	86,768,628円
純資産総額（ - ）	19,174,876,039円
発行済口数	10,197,709,008口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8803円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2019年3月29日現在

資産総額	8,396,853,888円
負債総額	27,250,657円
純資産総額（ - ）	8,369,603,231円
発行済口数	6,348,122,906口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3184円

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2019年3月29日現在

資産総額	41,385,117,191円
負債総額	1,193,298,032円
純資産総額（ - ）	40,191,819,159円
発行済口数	17,507,313,909口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2957円

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2019年3月29日現在

資産総額	26,211,002,660円
負債総額	85,288,954円
純資産総額（ - ）	26,125,713,706円
発行済口数	10,665,005,723口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4497円

（参考）野村マネー マザーファンド

2019年3月29日現在

資産総額	11,499,414,414円
負債総額	204,566,572円
純資産総額（ - ）	11,294,847,842円
発行済口数	11,067,455,698口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0205円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または

記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託者は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(5) 受益権の再分割

委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、この約款によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

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】

(1)資本金の額

2019年3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】

「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2月28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	1,025	27,667,769
単位型株式投資信託	152	792,514
追加型公社債投資信託	14	5,163,236
単位型公社債投資信託	413	1,739,695
合計	1,604	35,363,214

3【委託会社等の経理状況】

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 (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)	
(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							
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金		株主 資本 合計
		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		
						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	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	<p>(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</p> <p>(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</p>								
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	<p>(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。 <table style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> </p> <p>(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。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
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>5 . 消費税等の会計処理方法</p> <p>6 . 連結納税制度の適用</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业年金について、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 確定給付型企业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业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> <p>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あります。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p>
---	---

【 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）

(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)
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。 受取配当金 5,252百万円 支払利息 17	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。 受取配当金 4,026百万円 支払利息 2
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。	2. 役員報酬の範囲額 (同左)

3. 固定資産除却損		3. 固定資産除却損	
建物	-百万円	建物	4百万円
器具備品	0	器具備品	0
ソフトウェア	9	ソフトウェア	53
ア		ア	
合計	9	合計	58

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	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上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 hands 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 hands 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㈱（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㈱（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

区分	注記 番号	2018年9月30日現在
		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		
資本金		77,899
資本剰余金		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

		自 2018年4月 1日 至 2018年9月30日
区分	注記 番号	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。

	<p>(3) 退職給付引当金</p> <p>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。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法</p> <p>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。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法</p> <p>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。</p> <p>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</p> <p>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	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
	普通株式	5,150,693株	-	-
				当中間会計期間末 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 |

4【利害関係人との取引制限】

委託者は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)又は子法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託者の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記 に掲げるもののほか、委託者の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

(1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

委託者およびファンドに重要な影響を与えた事実、または与えると予想される事実はありません。

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】

(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2月末現在

(2) 販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	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。
株式会社SBI証券	48,323百万円	
損保ジャパン日本興亜DC証券株式会社	3,000百万円	
株式会社 大垣共立銀行	46,773百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社 山陰合同銀行	20,705百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社 南都銀行	37,900百万円	
株式会社 西日本シティ銀行	85,745百万円	
株式会社 八十二銀行	52,243百万円	
株式会社 百五銀行	20,000百万円	
株式会社 広島銀行	54,573百万円	
株式会社 北洋銀行	121,101百万円	
株式会社 北陸銀行	140,409百万円	
株式会社 みずほ銀行	1,404,065百万円	
株式会社 三井住友銀行	1,770,996百万円	
株式会社 武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社 山梨中央銀行	15,400百万円	
富国生命保険相互会社	116,000百万円 ¹	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
三井住友海上火災保険株式会社	139,595百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

* 2019年2月末現在

1 富国生命保険相互会社の資本金の額の箇所には「基金」および「基金償却積立金」の合計額を記載しています。

2 【関係業務の概要】

(1) 受託者

ファンドの受託会社(受託者)として、信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡等を行ないます。

(2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いおよび販売を行ない、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、一部解約金・償還金の支払いに関する事務等を行ないます。

3 【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙にロゴ・マークや図案を採用すること、またファンドの形態などの記載をすることがあります。
- (2) 目論見書の巻末に約款を掲載する場合があります。
- (3) 届出書本文「第一部 証券情報」、「第二部 ファンド情報」に記載の内容について、投資者の理解を助けるため、当該内容を説明した図表等を付加して目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (4) 目論見書は電子媒体等として使用されるほか、インターネットなどに掲載されることがあります。
- (5) 目論見書は目論見書の別称として「投資信託説明書」と称して使用する場合があります。
- (6) 目論見書の表紙裏等にインターネットホームページに加え、他のインターネットのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含む）も掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨を記載する場合があります。
- (7) 目論見書に当該委託会社の金融商品取引業者登録番号、当該委託会社が運用する投資信託財産の合計純資産総額および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
- (8) 目論見書に投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨を記載する場合があります。

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。

独立監査人の監査報告書

2019年3月29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 公認会計士 亀井純子
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

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DC運用戦略ファンドの2018年2月20日から2019年2月18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DC運用戦略ファンドの2019年2月18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。

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。