

【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】	2018年7月18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兼執行役社長 渡邊 国夫
【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】	インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ）
【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】	インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 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】

インデックス・ブレンド(タイプ)
 インデックス・ブレンド(タイプ)
 インデックス・ブレンド(タイプ)
 インデックス・ブレンド(タイプ)
 インデックス・ブレンド(タイプ)

これらを総称して「インデックス・ブレンド」または「各ファンド」、「各タイプ」という場合、あるいは個別に「ファンド」という場合があります。なお、ファンドの愛称を「My Funds-i」とします。）

ファンドの名称については、正式名称ではなく略称で記載する場合があります。

正式名称	略称
インデックス・ブレンド(タイプ)	タイプ

(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。)

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】

各ファンドにつき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。

「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1万口当た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】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.16% (税抜2.0%) 以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

(6) 【申込単位】

1万口以上1口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位

なお、販売会社や申込形態によっては、申込単位が上記と異なる場合等があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

(7) 【申込期間】

2018年7月19日から2019年7月17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】

販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。

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、「委託者」(または「委託会社」といいます。)の指定する口座を経由して、「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。

(1 0) 【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/>

(1 1) 【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

(1 2) 【その他】

該当事項はありません。

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】

国内外（新興国を含む）の株式、債券、不動産投資信託証券（REIT）等を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を目的に運用を行なうことを基本とします。

「実質的な主要投資対象」とは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「米国株式配当貴族インデックスマザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド」、「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」、「海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド」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

信託金限度額は、各ファンドにつき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。

(インデックス・ブレイド(タイプ))
 (インデックス・ブレイド(タイプ))
 (インデックス・ブレイド(タイプ))
 (インデックス・ブレイド(タイプ))
 (インデックス・ブレイド(タイプ))

《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 債券
	海外	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 年2回 年4回	グローバル (日本を含む) 日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月) 年12回 (毎月) 日々	北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり (部分ヘッジ)
不動産投信	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				

各ファンドは、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の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]

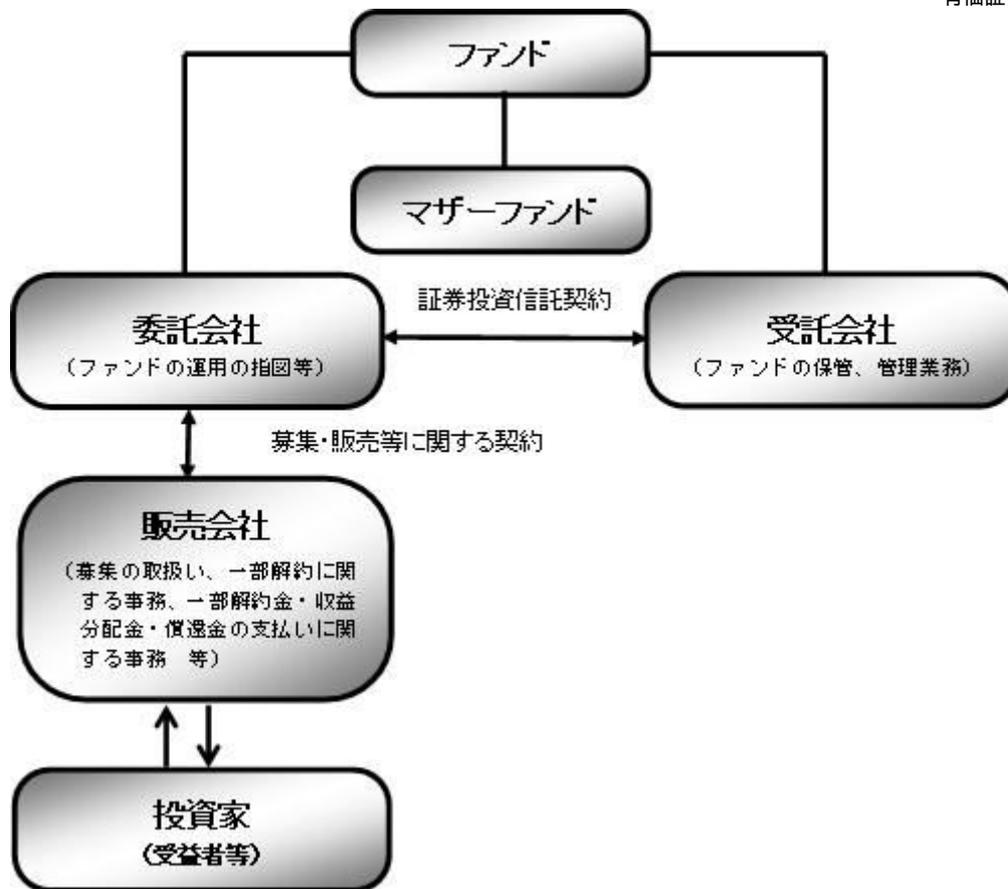
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定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】

2017年1月10日

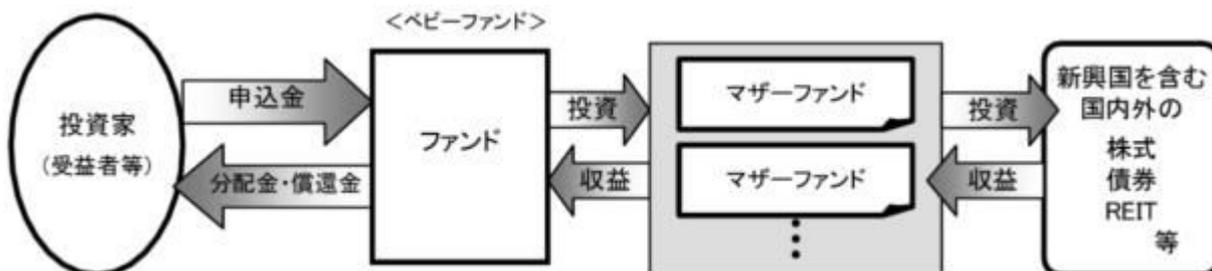
信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(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	インデックス・ブレンド (タイプ)	インデックス・ブレンド (タイプ)	インデックス・ブレンド (タイプ)	インデックス・ブレンド (タイプ)	インデックス・ブレンド (タイプ)
マザーファンド (親投資信託)	国内株式マザーファンド				
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド				
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド				
	新興国株式マザーファンド				
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド				
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド				
	外国債券マザーファンド				
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド				

	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド
	新興国債券マザーファンド
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド
	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
	海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社(受託者)	野村信託銀行株式会社

上記マザーファンドは2018年7月18日現在のものであり、変更する場合があります。

委託会社の概況(2018年5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 野村證券投資信託委託株式会社として設立
 1997年10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更
 2000年11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更
 2003年6月27日 委員会等設置会社へ移行

・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】

「インデックス・ブレンド」は、リスク性資産 への投資比率が低い順に「タイプ 」、 「タイプ 」、 「タイプ 」、 「タイプ 」、 「タイプ 」の5つのファンドで構成されています。

当ファンドにおいて、投資対象とするマザーファンドが連動することを目指すインデックス等（インデックス）の過去の値動きや特性などを勘案し、相対的に大きな値動きが想定されるものをリスク性資産とします。

投資対象とする各マザーファンドは、各々以下の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。

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数	リスク性資産
国内株式マザーファンド	わが国の株式	東証株価指数（TOPIX）	

外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジなし) ・MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が円換算した ものです。	
外国株式為替ヘッジ型 マザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI指数(円ベース・為替ヘッジあり)	
新興国株式マザーファンド	新興国の株式(DR (預託証券) ^{*1} を 含みます。)	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) ・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。	
米国株式配当貴族インデックス マザーファンド	米国の株式	S&P 500配当貴族指数(配当込み・円換算ペー (注1) ス) ・S&P 500配当貴族指数(配当込み・米ドル建て)をも とに、委託会社が円換算したものです。	
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI総合	
外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジな し・円ベース)	
外国債券為替ヘッジ型 マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッ ジ・円ベース)	
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	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) ・JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルペー ス)をもとに、委託会社が円換算したものです。	
新興国債券マザーファンド	新興国の公社債	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) (注1) ・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。	(注2)
米国ハイ・イールド債券イン デックスマザーファンド	米ドル建てのハイ・ イールド社債	ブルームバーグ・パークレイズ米国ハイイールド 社債高流動性インデックス(ヘッジなし・円換算 ベース) (注1) ・ブルームバーグ・パークレイズ米国ハイイールド社 債高流動性インデックス(USドルベース)をもとに、 委託会社が円換算したものです。	
J-REITインデックス マザーファンド	J-REIT ^{*2}	東証REIT指数(配当込み)	
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 ^{*3}	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換 算ベース) ・S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルペー ス)をもとに、委託会社が円換算したものです。	
海外REITインデックス為替ヘッ ジ型マザーファンド	日本を除く世界各国 のREIT ^{*3}	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円 ヘッジ)	

上記は2018年7月18日現在のものであり、変更する場合があります。

*1 Depositary 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。

- *2 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。
- *3 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、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。
- （注1） マザーファンドでは原則として為替ヘッジを行いませんが、ファンドにおいて為替ヘッジを行なうことで、実質的に為替ヘッジを行なった当該対象指数へ連動する投資効果を得ることを目指して運用を行なう場合があります。
- （注2） 「新興国債券マザーファンド」への投資にあたっては為替ヘッジを行なうことを原則としており、当ファンドにおいて為替ヘッジ後の当該マザーファンドへの投資についてはリスク性資産とみなしておりません。

各ファンドのリスク性資産への投資比率の合計は、信託財産の純資産総額に対してそれぞれ以下の比率を中心とすることを原則とします。

タイプ	タイプ	タイプ	タイプ	タイプ
30%	43%	55%	65%	80%

・上記はリスク性資産とみなしたマザーファンドへの投資比率の合計とします。

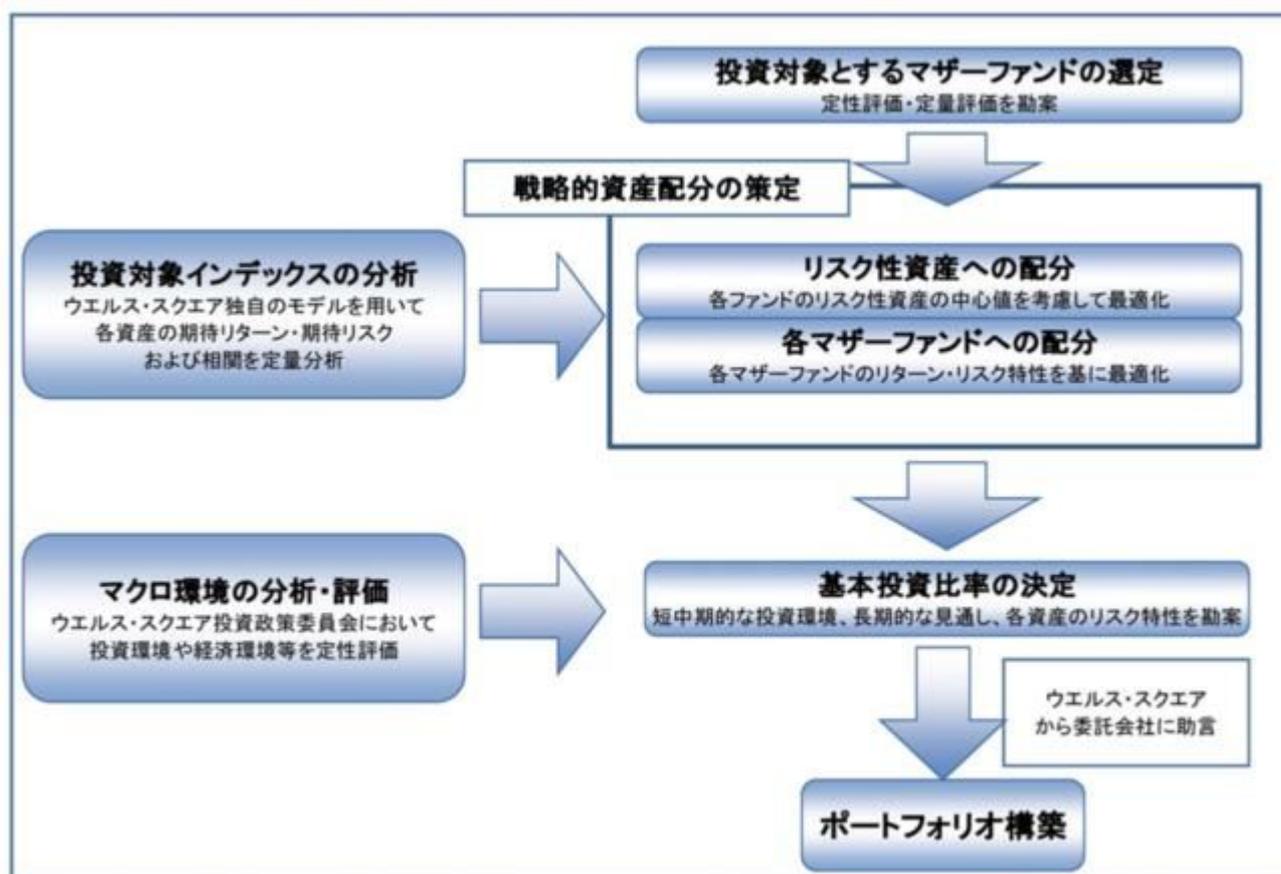
株式会社ウエルス・スクエア(ウエルス・スクエア) による以下のプロセスに従った助言に基づいて投資対象とするマザーファンドおよび各マザーファンドへの投資比率を決定します。

ウエルス・スクエア独自のモデルを用いてインデックスを定量的な手法により分析し、リスク性資産への配分および各マザーファンドへの配分を含む戦略的資産配分等を策定します。なお、分析において為替ヘッジを行なう場合と為替ヘッジを行なわない場合では異なるインデックスとして扱います。

戦略的資産配分に各種情報や分析を基とした定性的な判断による短期、中期、長期の視点を取り入れ、リスク特性などを勘案して最終的な投資比率（基本投資比率）を決定します。なお、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。

投資対象とするマザーファンドについては、定性評価・定量評価等を勘案し、適宜見直しを行いません。なお、投資対象とするマザーファンドは各種金融指標の動きを捉えることを目的とするマザーファンドから選定することを基本とします。

ポートフォリオ構築プロセス



* 上記のポートフォリオ構築プロセスは、今後変更となる場合があります。

組入マザーファンドとファンド全体のリスク特性の状況をモニターし、基本投資比率の見直しを定期的に行なうことを基本とします。なお、市況見通しの変化等によっては、適宜リバランスや基本投資比率の見直しを行なう場合があります。また、投資対象とするマザーファンドは適宜見直しを行ないます。

基本投資比率の決定において為替ヘッジを行なうこととした実質組入外貨建資産については、マザーファンドもしくはファンドにおいて為替ヘッジを行ない、為替変動リスクの低減を図ります。

投資対象とするマザーファンドにおいて効率的な運用を行なうため、先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め実質的に活用する場合があります。

(参考) ウエルス・スクエアについて

ウエルス・スクエアの概要

株式会社ウエルス・スクエアは、野村グループの資産運用会社で、主にファンドラップの投資運用サービス等の提供を行ないます。

各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について

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。

「MSCI-KOKUSAI指数」、「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」

MSCI-KOKUSAI指数、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

本ファンドは、MSCI Inc.、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、参加もしていません。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との関係を一切主張することはできません。

S&P 500配当貴族指数

「S&P 500 Dividend Aristocrats Index」（S&P 500配当貴族指数）（「当インデックス」）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが野村アセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's^(R) およびS&P^(R) はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones^(R) はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが野村アセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社（総称して「S&P Dow Jones Indices」）によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの所有者またはいかなる一般人に対して、株式全般または具体的に当ファンドへの投資の妥当性、あるいは全般的な市場のパフォーマンスを追跡するS&P 500 Dividend Aristocrats Indexの能力に関して、明示または黙示を問わず、いかなる表明または保証もしません。S&P 500 Dividend Aristocrats Indexに関して、S&P Dow Jones Indicesと野村アセットマネジメント株式会社との間にある唯一の関係は、当インデックスとS&P Dow Jones Indicesまたはそのライセンサーの特定の商標、サービスマーク、および商標名のライセンス供与です。S&P 500 Dividend Aristocrats Indexは野村アセットマネジメント株式会社または当ファンドに関係なく、S&P Dow Jones Indicesによって決定、構成、計算されます。S&P Dow Jones Indicesは、S&P 500 Dividend Aristocrats Indexの決定、構成または計算において野村アセットマネジメント株式会社または当ファンドの所有者の要求を考慮する義務を負いません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの価格または数量、あるいは当ファンドの発行または販売のタイミングの決定、当ファンドが将来換金、譲渡、または償還される計算式の決定または計算に関して責任を負わず、またこれに関与したことはありません。S&P Dow Jones Indicesは、当ファンドの管理、マーケティング、または取引に関して、いかなる義務または責任も負いません。S&P 500 Dividend Aristocrats Indexに基づく投資商品が、インデックスのパフォーマンスを正確に追跡する、あるいはプラスの投資収益を提供する保証はありません。S&P Dow Jones Indices LLCは投資顧問会社ではありません。インデックスに証券が含まれることは、S&P Dow Jones Indicesがかかる証券の売り、買い、またはホルドの推奨を意味するものではなく、投資アドバイスとして見なしてはなりません。

S&P DOW JONES INDICESは、当インデックスまたはその関連データ、あるいは口頭または書面の通信（電子通信も含む）を含むがこれに限定されないあらゆる通信について、その妥当性、正確性、適時性、または完全性を保証しません。S&P DOW JONES INDICESは、これに含まれる誤り、欠落または中断に対して、いかなる義務または責任も負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESは、明示的または黙示的を問わず、いかなる保証もせず、当インデックスまたはそれに関連するデータの商品性、特定の目的または使用への適合性、それらを使用することによって野村アセットマネジメント株式会社、当ファンドの所有者、またはその他の人物や組織が得られる結果について、一切の保証を明示的に否認します。上記を制限することなく、いかなる場合においても、S&P DOW JONES INDICESは、利益の逸失、営業損失、時間または信用の喪失を含むがこれらに限定されない、間接的、特別、懲罰的、または派生的損害に対して、たとえその可能性について知らされていたとしても、契約の記述、不法行為、または厳格責任の有無を問わず、一切の責任を負わないものとします。S&P DOW JONES INDICESのライセンサーを除き、S&P DOW JONES INDICESと野村アセットマネジメント株式会社との間の契約または取り決めの第三者受益者は存在しません。

NOMURA-BPI総合

NOMURA-BPI総合は、野村証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証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、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。

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、円ヘッジ・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）」、「FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・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・ディパーシファイド」、

「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」

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まれますが、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。

ブルームバーグ・パークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス

ブルームバーグは、ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーの商標およびサービスマークです。パークレイズは、ライセンスに基づき使用されているパークレイズ・バンク・ピーエルシーの商標およびサービスマークです。ブルームバーグ・ファイナンス・エル・ピーおよびその関係会社（以下「ブルームバーグ」と総称します。）またはブルームバーグのライセンサーは、ブルームバーグ・パークレイズ・インデックスに対する一切の独占的権利を有しています。

東証REIT指数（配当込み）

東証REIT指数（配当込み）の指数値及び東証REIT指数（配当込み）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、利用など東証REIT指数（配当込み）に関するすべての権利及び東証REIT指数（配当込み）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（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数（配当込み）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、東証REIT指数（配当込み）の商標の使用もしくは東証REIT指数（配当込み）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、東証REIT指数（配当込み）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（配当込み）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（配当込み）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（配当込み）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（配当込み）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。

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、参加もしていません。

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。

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】

各マザーファンドへの投資を通じて、国内外（新興国を含む）の株式、債券、不動産投資信託証券（REIT）等を実質的な主要投資対象とします。なお、投資対象とするマザーファンドにおいて効率的な運用を行なうため、先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。

各マザーファンドの主要投資対象

マザーファンド名	主要投資対象
----------	--------

国内株式マザーファンド	わが国の株式
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	外国の株式
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。）
米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	米国の株式
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	わが国の公社債
外国債券マザーファンド	外国の公社債
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	外国の公社債
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
新興国債券マザーファンド	新興国の公社債
米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	米ドル建てのハイ・イールド社債
J-REITインデックスマザーファンド	J-REIT
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
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	日本を除く世界各国のREIT

上記は2018年7月18日現在の組入マザーファンドであり、変更する場合があります。

投資の対象とする資産の種類（信託約款）

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。

- 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」、及び「」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。）

- 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す資産

- ・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
- ・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等（信託約款）

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別に定める親投資信託証券（以下「各マザーファンド」といいます。）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。

- 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す。）

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。）

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等(信託約款)

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・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
10. 流動性のある外国の者に対する貸付債権

その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引
3. クレジットデリバティブ取引
4. 金利先渡取引

「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。

5. 為替先渡取引

「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。）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。）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。

6. 直物為替先渡取引

「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。

（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。

（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。

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。

（外国株式為替ヘッジ型マザーファンド）

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-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）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

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・為替ヘッジあり）の動きに連動す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・為替ヘッジあり）の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、株価指数先物取引等のデリバティブ取引ならびに為替予約取引をヘッジ目的外の利用も含め活用する場合があります。

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。

外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

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。

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。

（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いません。

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。

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。

（米国株式配当貴族インデックスマザーファンド）

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、S&P 500配当貴族指数（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。

2. 運用方法

(1) 投資対象

米国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

株式の組入比率は、原則として高位を基本とします。

S&P 500配当貴族指数（配当込み・円換算ベース）の動きを効率的に捉える投資成果を目指すため、株価指数先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用も含め活用する場合があります。また、効率的な運用を行なうため、上場投資信託証券（ETF）を活用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。

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。

同一銘柄の株式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。

外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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。

同一銘柄の上場投資信託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。

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NOMURA-BPI総合 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総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）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

主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合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

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。

（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

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。

（外国債券為替ヘッジ型マザーファンド）

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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）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。

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、円ヘッジ・円ベース）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。

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す。

効率的な運用を行なうため、債券先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。

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・ディバースファイド（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・ディバースファイド（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。

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。

（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ないます。

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。

（米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド）

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、ブルームバーグ・バークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・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

米ドル建てのハイ・イールド社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

米ドル建てのハイ・イールド社債を主要投資対象とし、ブルームバーグ・バークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・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、米国国債に投資する場合があります。

ブルームバーグ・バークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・円換算ベース）の動きを効率的に捉える投資成果を目指すため、債券先物取引等のデリバティブ取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。また、効率的な運用を行なうため、上場投資信託証券

（ETF）を活用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

株式への投資は、優先証券のうち株券または新株引受権証券の性質を有するものまたは転換社債を転換、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、）を行使したものおよび社債権者割当等により取得したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の30%以内とします。

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。

外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

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。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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ないます。

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。

（海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド）

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、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）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

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

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、円ヘッジ）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。

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す。

効率的な運用を行なうため、REIT指数先物取引、株価指数先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引をヘッジ目的外の利用を含め活用する場合があります。

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

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）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。

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。

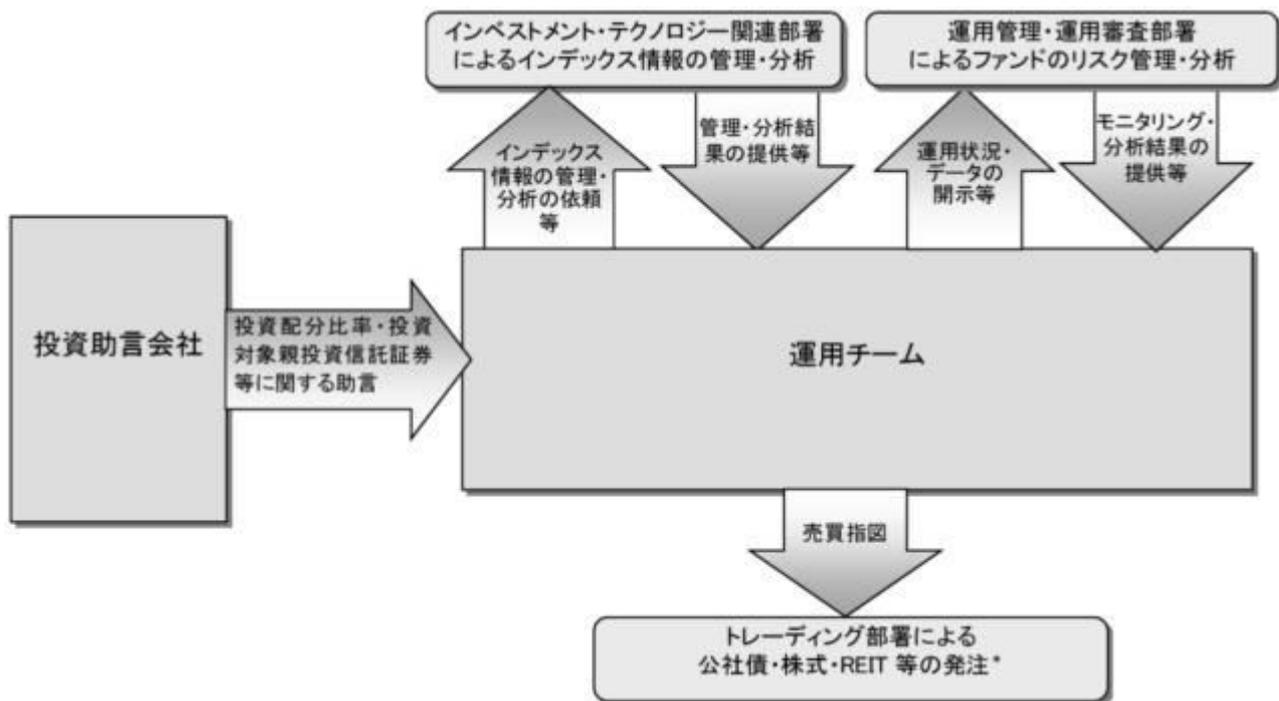
外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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。

（３）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。

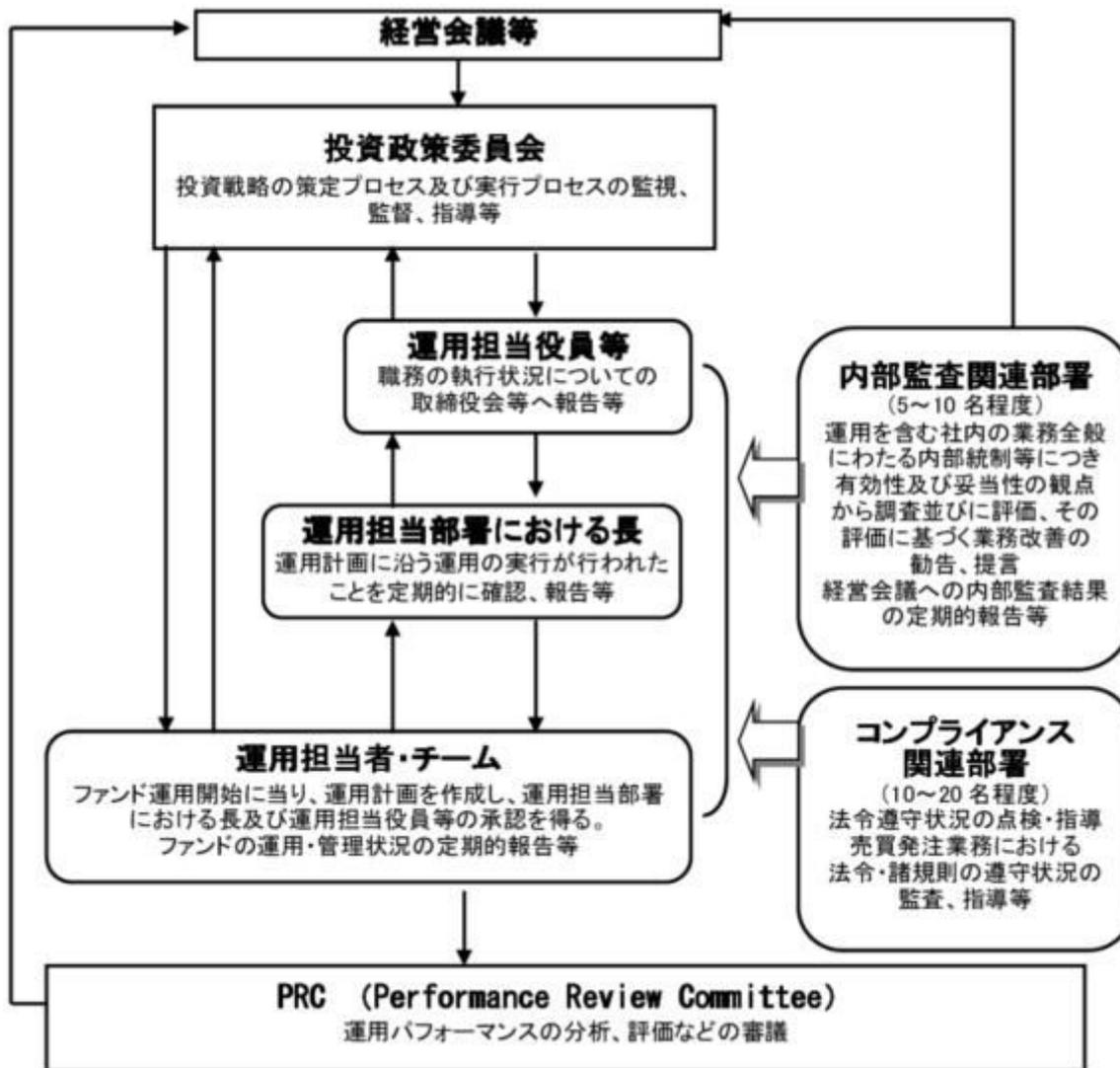


*一部のマザーファンドにおける公社債等の発注業務（発注に伴う裁量権は付与しないものとします。）の一部をノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッドに代行させます。

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いません。

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（評価益を含みません。）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。

* 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4月22日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

(5) 【投資制限】

運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限 (信託約款)

- ・ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への実質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。
- ・ 外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 投資信託証券（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。
- ・ 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。

投資する株式等の範囲(信託約款)

- () 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。

信用取引の指図範囲(信託約款)

- () 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ます。)の行使により取得可能な株券

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。

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

先物取引等の運用指図(信託約款)

- ()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ならびに有価証券店頭デリバティブ取引(金融商品取引法第28条第8項第4号イからニに掲げるものをいいます。以下同じ。)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。
- ()上記()の店頭デリバティブ取引の評価は、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、上記()の店頭デリバティブ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。

スワップ取引の運用指図(信託約款)

- ()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。

クレジットデリバティブ取引の運用指図(信託約款)

- ()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、クレジットデリバティブ取引

(金融商品取引法第2条第21項第5号イ、同条第22項第6号イに掲げるものおよび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いいます。以下同じ。)を行なうことの指図をすることができます。

- ()クレジットデリバティブ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。
- ()クレジットデリバティブ取引(金融商品取引法第2条第22項第6号イに掲げるものに限りです。)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、クレジットデリバティブ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。

有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- ()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。

公社債の借入れ(信託約款)

- ()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。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

- ()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。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券(外国通貨表示の有価証券をいいます。以下同じ。)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。

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

- ()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。

資金の借入れ(信託約款)

- ()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。

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。また、ファンドが実質的に投資を行なうハイ・イールド社債等の格付けの低い債券については、格付けの高い債券に比べ、価格が大きく変動する可能性や組入債券の元利金の支払遅延および支払不履行などが生じるリスクが高いと想定されます。

[為替変動リスク]

ファンドは、基本投資比率の決定において為替ヘッジを行なうこととした実質組入外貨建資産については、マザーファンドもしくはファンドにおいて為替ヘッジを行ない為替変動リスクの低減を図りますが、その他の実質組入外貨建資産については、為替変動の影響を受けます。なお、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図る場合においても、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。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。また、投資対象に含まれる一部のマザーファンドにおいてはベビーファンドの換金等に伴ない、マザーファンドの換金を行なう場合には、原則として当該マザーファンドの信託財産に信託財産留保額を繰り入れます。

ファンドが実質的な投資対象とするREITの中には、流動性の低いものもあり、こうしたREITへの投資は、流動性の高い株式等に比べて制約を受けることが想定されます。

REITに関する法律（税制度、会計制度等）、不動産を取り巻く規制が変更となった場合、REITの価格や配

当に影響が及ぶことが想定されます。

ファンドが投資対象とするマザーファンドについては、適宜見直しを行いません。マザーファンドの増減および入替を行なう際には、一時的にマザーファンドへの投資比率が低下する場合があります。

ファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国においては、政治、経済、社会情勢の変化が金融市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、当局による海外からの投資規制などが緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により、金融市場が著しい悪影響を被る可能性や運用上の制約を大きく受ける可能性があります。

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、投資信託約款の規定に従い、委託会社の判断でファンドの購入（スイッチングによる購入を含みます。）・換金の各受け付けを中止すること、およびすでに受け付けた購入（スイッチングによる購入を含みます。）・換金の各受け付けを取り消す場合があります。

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。

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

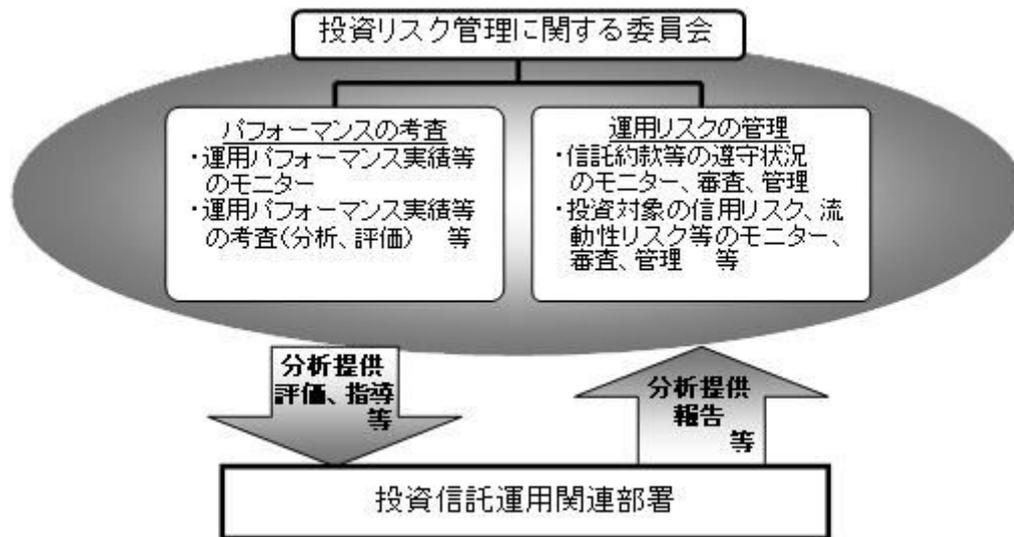
パフォーマンスの考査

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。

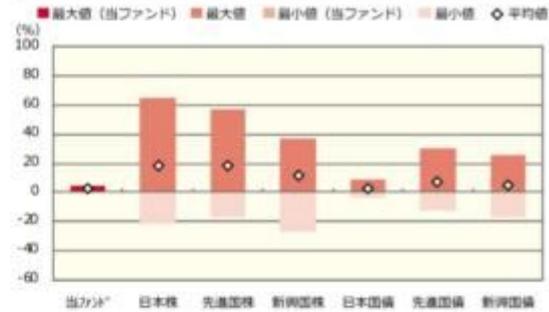
■ リスクの定量的比較（2013年6月末～2018年5月末：月次）

タイプⅠ

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 (%)	4.7	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	26.1
最小値 (%)	1.5	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.6	18.8	18.8	12.1	2.2	7.2	4.5

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2018年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

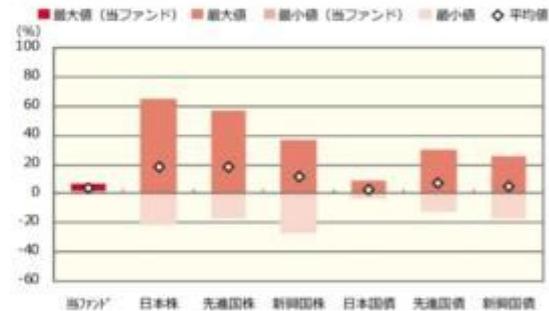
- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2013年6月から2018年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2018年5月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

タイプⅡ

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 (%)	7.1	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	26.1
最小値 (%)	2.5	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	4.1	18.8	18.8	12.1	2.2	7.2	4.5

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2018年5月の各月末における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。
- * 2013年6月から2018年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2018年5月）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。

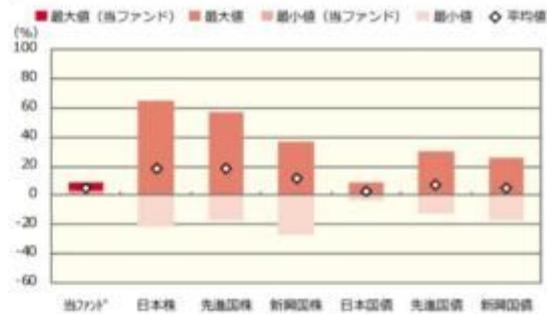
タイプⅢ

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



2013年6月 2014年5月 2015年5月 2016年5月 2017年5月 2018年5月

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	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4
最小値 (%)	3.6	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3
平均値 (%)	5.4	18.8	18.8	12.1	2.2	7.2

- * 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。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2018年5月の各月末における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。
- * 2013年6月から2018年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2018年5月）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。

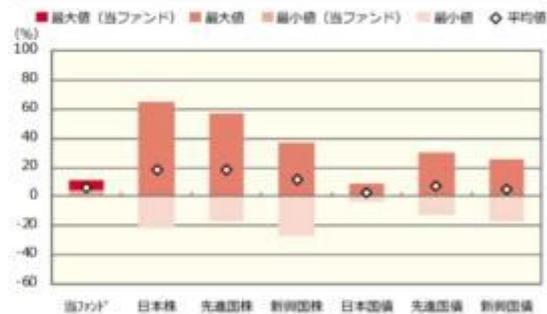
タイプⅣ

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



2013年6月 2014年5月 2015年5月 2016年5月 2017年5月 2018年5月

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 (%)	11.1	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4
最小値 (%)	4.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3
平均値 (%)	6.5	18.8	18.8	12.1	2.2	7.2

- * 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。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2018年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

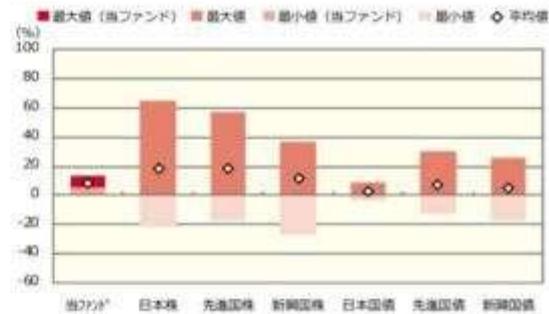
- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2013年6月から2018年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2018年5月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

タイプV

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 (%)	13.7	65.0	57.1	37.2	9.3	30.4	26.1
最小値 (%)	5.6	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	8.2	18.8	18.8	12.1	2.2	7.2	4.5

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2018年1月から2018年5月の各月末における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。
- * 2013年6月から2018年5月の5年間(当ファンドは2018年1月から2018年5月)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・ディバーシファイド〔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、東京証券取引所が有しています。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、知的所有権その他一切の権利はMSCI に帰属します。またMSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス〔除く日本、ヘッジなし、円ベース〕・・・FTSE 世界国債インデックス〔除く日本、ヘッジなし、円ベース〕は、FTSE Fixed Income 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・ディバーシファイド〔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・ディバーシファイド〔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、投資戦略や税金に会計アドバイザー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ており、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国JP Morgan Securities LLC (ここでは「JPMSLLC」と呼びます)〔指数スポンサー〕は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての奨励、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推薦の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は使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 NASD, NYSE, SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, 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】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.16%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）（税抜2.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせ下さい。販売会社については、「サポートダイヤル」までお問い合わせ下さい。

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

購入時手数料は、商品及び関連する投資環境の説明および情報提供等、ならびに購入に関する事務コストの対価として、購入時に頂戴するものです。

（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下記の信託報酬率を乗じて得た額とします。信託報酬は、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。

信託報酬率の配分については次の通り(税抜)とします。

ファンド	信託報酬率	< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
タイプ	年0.5184% (税抜年0.48%)	年0.25%	年0.20%	年0.03%
タイプ	年0.5292% (税抜年0.49%)	年0.26%	年0.20%	年0.03%
タイプ	年0.54% (税抜年0.50%)	年0.27%	年0.20%	年0.03%
タイプ	年0.5508% (税抜年0.51%)	年0.28%	年0.20%	年0.03%
タイプ	年0.5616% (税抜年0.52%)	年0.29%	年0.20%	年0.03%

支払先の役務の内容

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等

（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、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。

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、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。

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ファンドから支払われます。

<タイプ 、タイプ 、タイプ >

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.15%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

<タイプ 、タイプ >

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.20%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資家との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、クローズド期間の有無に関係なく、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、信託財産に繰り入れられます。

* 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。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

< 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税 >

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

損益通算について

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

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^(注2)	《配当所得》
--------	---------------------------------	--------

・特定公社債 ^(注1) の利子 ・公募公社債投資信託の収益 分配金	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株 式、公募株式投資信託の ・譲渡益 ・譲渡損	・上場株式の配当 ・公募株式投資信託の収益 分配金
--	--	---------------------------------

(注1)「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

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

上場株式、公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

[個人の投資家の場合]

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

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

[法人の投資家の場合]

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

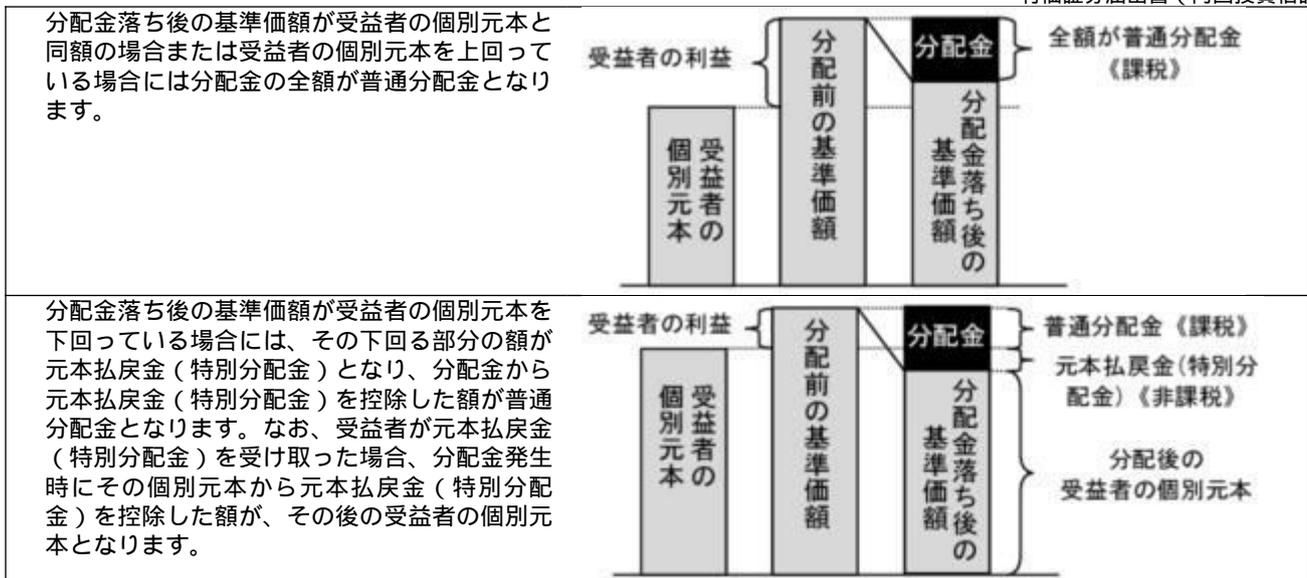
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

分配金の課税について

分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払戻しに相当する部分）があります。



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

* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(2018年5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2018年5月31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】

インデックス・ブレード(タイプ)

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	67,922,604	95.12
現金・預金・その他資産(負債控除後)		3,480,307	4.87
合計(純資産総額)		71,402,911	100.00

インデックス・ブレード(タイプ)

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	91,334,386	99.17
現金・預金・その他資産(負債控除後)		756,098	0.82
合計(純資産総額)		92,090,484	100.00

インデックス・ブレード(タイプ)

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	183,182,465	99.20
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,460,580	0.79
合計（純資産総額）		184,643,045	100.00

インデックス・ブレンド（タイプ ）

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	31,428,824	98.77
現金・預金・その他資産（負債控除後）		390,913	1.22
合計（純資産総額）		31,819,737	100.00

インデックス・ブレンド（タイプ ）

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	124,898,827	66.17
現金・預金・その他資産（負債控除後）		63,843,934	33.82
合計（純資産総額）		188,742,761	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	367,583,152,590	97.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,874,278,676	2.09
合計（純資産総額）		375,457,431,266	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	7,850,250,000	2.09

（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	305,141,259,264	63.22
	カナダ	17,769,775,114	3.68
	ドイツ	17,951,079,935	3.71

	イタリア	4,363,761,637	0.90
	フランス	19,489,346,797	4.03
	オランダ	6,281,713,049	1.30
	スペイン	5,525,455,458	1.14
	ベルギー	1,933,911,713	0.40
	オーストリア	457,332,198	0.09
	ルクセンブルグ	114,304,504	0.02
	フィンランド	1,942,862,906	0.40
	アイルランド	916,401,485	0.18
	ポルトガル	292,121,522	0.06
	イギリス	33,223,188,116	6.88
	スイス	14,092,650,399	2.92
	スウェーデン	4,830,811,705	1.00
	ノルウェー	1,285,765,778	0.26
	デンマーク	3,167,642,159	0.65
	オーストラリア	11,665,071,964	2.41
	ニュージーランド	336,555,034	0.06
	香港	6,118,287,380	1.26
	シンガポール	2,292,124,626	0.47
	イスラエル	517,666,874	0.10
	小計	459,709,089,617	95.25
投資信託受益証券	アメリカ	16,321,848	0.00
投資証券	アメリカ	8,612,361,958	1.78
	カナダ	74,210,539	0.01
	フランス	686,298,774	0.14
	イギリス	413,268,850	0.08
	オーストラリア	938,561,890	0.19
	香港	278,972,240	0.05
	シンガポール	197,594,710	0.04
	小計	11,201,268,961	2.32
現金・預金・その他資産（負債控除後）		11,681,613,973	2.42
合計（純資産総額）		482,608,294,399	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	7,848,058,470	1.62
	買建	カナダ	447,891,752	0.09
	買建	ドイツ	1,500,498,399	0.31
	買建	イギリス	829,900,879	0.17
	買建	スイス	359,099,746	0.07

買建	オーストラリア	308,555,151	0.06
----	---------	-------------	------

(参考) 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	26,837,749,484	62.34
	カナダ	1,559,743,405	3.62
	ドイツ	1,577,152,114	3.66
	イタリア	384,332,309	0.89
	フランス	1,715,191,925	3.98
	オランダ	552,023,751	1.28
	スペイン	486,201,341	1.12
	ベルギー	169,402,094	0.39
	オーストリア	41,428,165	0.09
	ルクセンブルグ	10,030,869	0.02
	フィンランド	171,056,543	0.39
	アイルランド	82,021,178	0.19
	ポルトガル	25,250,446	0.05
	イギリス	2,927,636,596	6.80
	スイス	1,242,134,900	2.88
	スウェーデン	426,312,211	0.99
	ノルウェー	114,215,195	0.26
	デンマーク	276,683,344	0.64
	オーストラリア	1,026,556,884	2.38
	ニュージーランド	28,979,710	0.06
香港	539,248,492	1.25	
シンガポール	202,511,713	0.47	
イスラエル	43,217,541	0.10	
	小計	40,439,080,210	93.94
投資信託受益証券	アメリカ	2,308,788	0.00
投資証券	アメリカ	768,587,068	1.78
	カナダ	7,761,143	0.01
	フランス	61,036,589	0.14
	イギリス	34,410,481	0.07
	オーストラリア	80,398,469	0.18
	香港	24,108,695	0.05
	シンガポール	15,801,666	0.03
	小計	992,104,111	2.30
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,611,326,825	3.74
合計(純資産総額)		43,044,819,934	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	355,383,778	0.82
	買建	カナダ	15,996,134	0.03
	買建	ドイツ	69,387,206	0.16
	買建	イギリス	44,261,380	0.10
	買建	スイス	18,899,986	0.04
	買建	オーストラリア	24,684,412	0.05

(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	4,202,446,561	12.76
	メキシコ	816,752,760	2.48
	ブラジル	1,971,269,077	5.98
	チリ	182,807,304	0.55
	コロンビア	81,165,804	0.24
	ギリシャ	92,637,779	0.28
	トルコ	249,080,209	0.75
	チェコ	57,898,694	0.17
	ハンガリー	84,127,019	0.25
	ポーランド	352,351,101	1.07
	香港	7,800,416,876	23.69
	マレーシア	734,873,082	2.23
	タイ	746,645,217	2.26
	フィリピン	305,091,492	0.92
	インドネシア	640,942,648	1.94
	韓国	4,821,549,018	14.64
	台湾	3,678,622,648	11.17
	インド	2,656,935,315	8.06
	パキスタン	22,401,698	0.06
	カタール	259,663,901	0.78
	エジプト	40,773,838	0.12
南アフリカ	1,960,150,437	5.95	
アラブ首長国連邦	176,024,714	0.53	
小計		31,934,627,192	96.99
投資証券	メキシコ	24,418,076	0.07
	トルコ	5,991,000	0.01
	南アフリカ	100,645,863	0.30
	小計		131,054,939

現金・預金・その他資産(負債控除後)		859,635,563	2.61
合計(純資産総額)		32,925,317,694	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	828,080,941	2.51

(参考) 米国株式配当貴族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(%)
株式	アメリカ	4,515,740,068	97.01
投資信託受益証券	アメリカ	13,277,402	0.28
投資証券	アメリカ	92,004,136	1.97
現金・預金・その他資産(負債控除後)		33,534,354	0.72
合計(純資産総額)		4,654,555,960	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	29,615,314	0.63

(参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 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	533,866,436,350	80.17
地方債証券	日本	43,474,179,967	6.52
特殊債券	日本	55,957,893,381	8.40
社債券	日本	27,280,552,890	4.09
現金・預金・その他資産(負債控除後)		5,327,099,066	0.79
合計(純資産総額)		665,906,161,654	100.00

(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	262,660,375,095	43.52
	カナダ	12,981,452,195	2.15

	メキシコ	4,676,006,571	0.77
	ドイツ	38,779,574,798	6.42
	イタリア	57,594,244,681	9.54
	フランス	59,878,130,987	9.92
	オランダ	12,162,211,509	2.01
	スペイン	40,023,701,102	6.63
	ベルギー	14,639,518,816	2.42
	オーストリア	8,067,837,730	1.33
	フィンランド	3,070,792,416	0.50
	アイルランド	6,135,633,660	1.01
	イギリス	42,322,577,641	7.01
	スイス	1,060,499,576	0.17
	スウェーデン	2,358,029,474	0.39
	ノルウェー	1,821,877,271	0.30
	デンマーク	3,626,222,593	0.60
	ポーランド	3,744,455,962	0.62
	オーストラリア	13,059,879,594	2.16
	シンガポール	2,483,395,665	0.41
	マレーシア	2,956,950,303	0.48
	南アフリカ	3,804,125,869	0.63
	小計	597,907,493,508	99.07
現金・預金・その他資産（負債控除後）		5,598,421,620	0.92
合計（純資産総額）		603,505,915,128	100.00

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

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	15,169,810,132	42.23
	カナダ	706,714,775	1.96
	メキシコ	241,120,197	0.67
	ドイツ	2,372,606,726	6.60
	イタリア	3,229,954,392	8.99
	フランス	3,567,900,814	9.93
	オランダ	677,194,872	1.88
	スペイン	2,170,112,262	6.04
	ベルギー	910,081,687	2.53
	オーストリア	502,247,094	1.39
	フィンランド	204,947,311	0.57
	アイルランド	342,546,925	0.95
	イギリス	2,458,651,948	6.84
	スイス	49,962,920	0.13

	スウェーデン	134,856,810	0.37
	ノルウェー	78,907,077	0.21
	デンマーク	192,404,185	0.53
	ポーランド	199,339,567	0.55
	オーストラリア	754,022,198	2.09
	シンガポール	280,419,353	0.78
	南アフリカ	215,980,087	0.60
	小計	34,459,781,332	95.95
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,454,410,391	4.04
合計（純資産総額）		35,914,191,723	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	48,927,920	0.67
	メキシコ	694,650,880	9.61
	ブラジル	685,865,685	9.49
	チリ	183,499,728	2.54
	コロンビア	544,364,025	7.53
	ペルー	193,836,299	2.68
	ウルグアイ	12,851,020	0.17
	トルコ	414,728,563	5.74
	チェコ	295,697,058	4.09
	ハンガリー	326,551,725	4.52
	ポーランド	612,987,526	8.48
	ロシア	537,809,667	7.44
	ルーマニア	196,287,064	2.71
	マレーシア	407,532,387	5.64
	タイ	578,518,214	8.01
	フィリピン	20,588,258	0.28
	インドネシア	668,604,354	9.25
南アフリカ	609,832,670	8.44	
	小計	7,033,133,043	97.38
現金・預金・その他資産（負債控除後）		188,828,463	2.61
合計（純資産総額）		7,221,961,506	100.00

（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	14,209,995,018	97.77
現金・預金・その他資産（負債控除後）		323,647,913	2.22

合計（純資産総額）	14,533,642,931	100.00
-----------	----------------	--------

（参考）米国ハイ・イールド債券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（％）
社債券	アメリカ	2,005,362,750	97.80
現金・預金・その他資産（負債控除後）		45,025,380	2.19
合計（純資産総額）		2,050,388,130	100.00

（参考）J - R E I T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	32,352,569,360	97.36
現金・預金・その他資産（負債控除後）		875,205,090	2.63
合計（純資産総額）		33,227,774,450	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	735,216,000	2.21

（参考）海外R E I T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	14,498,280,776	70.30
	カナダ	374,907,492	1.81
	ドイツ	52,065,880	0.25
	イタリア	22,810,551	0.11
	フランス	904,793,715	4.38
	オランダ	92,260,834	0.44
	スペイン	206,139,778	0.99
	ベルギー	156,020,648	0.75
	アイルランド	53,826,540	0.26

	シンガポール	6,494,912	0.03
	イギリス	1,195,080,749	5.79
	オーストラリア	1,669,922,862	8.09
	ニュージーランド	89,685,519	0.43
	香港	445,312,609	2.15
	シンガポール	682,483,823	3.30
	イスラエル	12,546,424	0.06
	小計	20,462,633,112	99.22
現金・預金・その他資産（負債控除後）		159,483,975	0.77
合計（純資産総額）		20,622,117,087	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	121,113,540	0.58
	買建	フランス	19,662,791	0.09

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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	3,269,403,169	68.73
	カナダ	84,844,625	1.78
	ドイツ	12,146,858	0.25
	イタリア	5,397,123	0.11
	フランス	203,979,145	4.28
	オランダ	20,819,470	0.43
	スペイン	46,436,532	0.97
	ベルギー	35,649,860	0.74
	アイルランド	12,298,006	0.25
	シンガポール	1,425,713	0.02
	イギリス	269,020,214	5.65
	オーストラリア	377,208,569	7.93
	ニュージーランド	20,709,370	0.43

	香港	100,315,550	2.10
	シンガポール	154,834,094	3.25
	イスラエル	2,016,389	0.04
	小計	4,616,504,687	97.06
現金・預金・その他資産（負債控除後）		139,752,102	2.93
合計（純資産総額）		4,756,256,789	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	80,742,360	1.69
	買建	フランス	8,426,911	0.17

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

インデックス・ブレンド（タイプ）

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	国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド	25,265,724	1.3099	33,095,572	1.3133	33,181,475	46.47
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファン ド	9,809,324	1.1186	10,973,010	1.1174	10,960,938	15.35
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	2,920,532	1.7035	4,975,127	1.7009	4,967,532	6.95
4	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	1,786,669	2.5663	4,585,129	2.5961	4,638,371	6.49
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	1,933,382	1.7732	3,428,273	1.7538	3,390,765	4.74
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,224,130	2.2348	2,735,796	2.1890	2,679,620	3.75
7	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファン ド	1,112,597	1.7992	2,001,785	1.8341	2,040,614	2.85
8	日本	親投資信託 受益証券	J - R E I Tインデックス マ ザーファンド	675,067	1.9843	1,339,536	2.0135	1,359,247	1.90
9	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデッ クスマザーファンド	1,181,469	1.1390	1,345,694	1.1355	1,341,558	1.87
10	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,019,898	1.3266	1,352,997	1.2793	1,304,755	1.82
11	日本	親投資信託 受益証券	海外R E I Tインデックス マ ザーファンド	479,800	2.0355	976,647	2.1617	1,037,183	1.45
12	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマ ザーファンド	918,336	1.0899	1,000,895	1.1113	1,020,546	1.42

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	95.12
合計	95.12

インデックス・ブレンド(タイプ)

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	国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド	26,001,354	1.3101	34,065,400	1.3133	34,147,578	37.08
2	日本	親投資信託受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	10,333,713	1.1185	11,558,952	1.1174	11,546,890	12.53
3	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	4,338,989	2.5665	11,136,394	2.5961	11,264,449	12.23
4	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	6,032,288	1.7065	10,294,100	1.7009	10,260,318	11.14
5	日本	親投資信託受益証券	新興国債券マザーファンド	3,385,948	1.7723	6,000,916	1.7538	5,938,275	6.44
6	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,649,096	2.2351	3,685,946	2.1890	3,609,871	3.91
7	日本	親投資信託受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1,748,225	1.8004	3,147,628	1.8341	3,206,419	3.48
8	日本	親投資信託受益証券	新興国株式マザーファンド	2,404,432	1.3263	3,189,107	1.2793	3,075,989	3.34
9	日本	親投資信託受益証券	J - R E I T インデックス マザーファンド	1,153,746	1.9861	2,291,541	2.0135	2,323,067	2.52
10	日本	親投資信託受益証券	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	2,061,206	1.0909	2,248,570	1.1113	2,290,618	2.48
11	日本	親投資信託受益証券	海外 R E I T インデックス マザーファンド	861,885	2.0442	1,761,898	2.1617	1,863,136	2.02
12	日本	親投資信託受益証券	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1,592,053	1.1403	1,815,419	1.1355	1,807,776	1.96

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.17
合計	99.17

インデックス・ブレンド(タイプ)

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	国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド	38,655,810	1.3101	50,642,977	1.3133	50,766,675	27.49
2	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	12,262,615	2.5617	31,414,122	2.5961	31,834,974	17.24
3	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	14,971,212	1.7035	25,503,737	1.7009	25,464,534	13.79

4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	14,870,090	1.1187	16,636,155	1.1174	16,615,838	8.99
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	6,272,913	1.7722	11,117,333	1.7538	11,001,434	5.95
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	4,170,462	2.2337	9,315,774	2.1890	9,129,141	4.94
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	7,016,008	1.3266	9,307,859	1.2793	8,975,579	4.86
8	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	4,501,695	1.8000	8,103,142	1.8341	8,256,558	4.47
9	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	2,576,336	2.0352	5,243,360	2.1617	5,569,265	3.01
10	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックス マザーファンド	4,945,487	1.0896	5,388,770	1.1113	5,495,919	2.97
11	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデ ックスマザーファンド	4,825,835	1.1375	5,489,862	1.1355	5,479,735	2.96
12	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	2,281,010	1.9840	4,525,524	2.0135	4,592,813	2.48

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.20
合計	99.20

インデックス・ブレンド(タイプ)

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	2,577,524	2.5613	6,601,914	2.5961	6,691,510	21.02
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA-BPI 総合マザーファンド	4,877,508	1.3101	6,390,117	1.3133	6,405,631	20.13
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	2,901,717	1.7031	4,942,176	1.7009	4,935,530	15.51
4	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,672,507	1.3269	2,219,375	1.2793	2,139,638	6.72
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザー ファンド	1,863,501	1.1187	2,084,743	1.1174	2,082,276	6.54
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	1,082,317	1.7722	1,918,183	1.7538	1,898,167	5.96
7	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザー ファンド	862,548	1.7999	1,552,501	1.8341	1,581,999	4.97
8	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	712,006	2.2340	1,590,682	2.1890	1,558,581	4.89
9	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	520,945	2.0354	1,060,380	2.1617	1,126,126	3.53
10	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	557,947	1.9841	1,107,060	2.0135	1,123,426	3.53
11	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックス マザーファンド	854,238	1.0897	930,864	1.1113	949,314	2.98
12	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデ ックスマザーファンド	824,858	1.1375	938,343	1.1355	936,626	2.94

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	98.77
合 計	98.77

インデックス・ブレンド(タイプ)

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	13,105,514	2.5654	33,621,175	2.5961	34,023,224	18.02
2	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	14,581,695	1.7059	24,874,914	1.7009	24,802,005	13.14
3	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA-BPI総 合マザーファンド	10,216,572	1.3101	13,384,731	1.3133	13,417,424	7.10
4	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	8,576,001	1.3270	11,380,354	1.2793	10,971,278	5.81
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	2,999,768	2.2340	6,701,482	2.1890	6,566,492	3.47
6	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファ ンド	3,444,759	1.8014	6,205,389	1.8341	6,318,032	3.34
7	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマ ザーファンド	5,645,791	1.0907	6,157,865	1.1113	6,274,167	3.32
8	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	2,367,328	2.0396	4,828,403	2.1617	5,117,452	2.71
9	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	2,520,393	1.9857	5,004,745	2.0135	5,074,811	2.68
10	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	4,019,547	1.1183	4,495,060	1.1174	4,491,441	2.37
11	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデッ クスマザーファンド	3,571,623	1.1374	4,062,365	1.1355	4,055,577	2.14
12	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	2,159,268	1.7725	3,827,303	1.7538	3,786,924	2.00

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	66.17
合 計	66.17

(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	1,788,800	7,591.91	13,580,419,400	6,921.00	12,380,284,800	3.29
2	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	10,160,300	718.99	7,305,174,500	655.80	6,663,124,740	1.77
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	1,036,200	5,265.98	5,456,618,000	5,106.00	5,290,837,200	1.40
4	日本	株式	ソニー	電気機器	985,000	5,109.01	5,032,380,000	5,160.00	5,082,600,000	1.35
5	日本	株式	ソフトバンクグルー プ	情報・通 信業	653,700	8,354.90	5,461,602,700	7,765.00	5,075,980,500	1.35

6	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,098,500	4,491.99	4,934,459,900	4,503.00	4,946,545,500	1.31
7	日本	株式	キーエンス	電気機器	72,200	67,690.00	4,887,218,000	66,830.00	4,825,126,000	1.28
8	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,324,100	3,549.98	4,700,528,600	3,447.00	4,564,172,700	1.21
9	日本	株式	任天堂	その他製品	90,600	45,500.00	4,122,300,000	45,000.00	4,077,000,000	1.08
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,300,200	2,884.01	3,749,790,400	2,945.50	3,829,739,100	1.02
11	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	19,718,700	198.09	3,906,252,910	189.70	3,740,637,390	0.99
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,084,700	2,771.01	3,005,720,450	3,030.00	3,286,641,000	0.87
13	日本	株式	ファナック	電気機器	139,800	23,030.00	3,219,594,000	23,270.00	3,253,146,000	0.86
14	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,017,000	3,186.98	3,241,159,650	3,031.00	3,082,527,000	0.82
15	日本	株式	花王	化学	361,800	7,663.00	2,772,473,400	8,442.00	3,054,315,600	0.81
16	日本	株式	日本電産	電気機器	177,100	16,929.87	2,998,280,000	16,885.00	2,990,333,500	0.79
17	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	131,800	21,350.87	2,814,045,000	22,510.00	2,966,818,000	0.79
18	日本	株式	キヤノン	電気機器	792,100	3,789.98	3,002,049,600	3,714.00	2,941,859,400	0.78
19	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	607,500	4,762.00	2,892,920,900	4,821.00	2,928,757,500	0.78
20	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,036,800	2,792.50	2,895,265,900	2,818.00	2,921,702,400	0.77
21	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	546,800	5,248.98	2,870,145,700	5,240.00	2,865,232,000	0.76
22	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	264,300	10,709.96	2,830,643,000	10,755.00	2,842,546,500	0.75
23	日本	株式	日立製作所	電気機器	3,533,000	864.30	3,053,571,900	796.60	2,814,387,800	0.74
24	日本	株式	信越化学工業	化学	256,600	11,270.00	2,891,882,000	10,890.00	2,794,374,000	0.74
25	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	913,700	2,993.98	2,735,608,550	2,936.00	2,682,623,200	0.71
26	日本	株式	小松製作所	機械	710,500	3,581.99	2,545,008,300	3,587.00	2,548,563,500	0.67
27	日本	株式	ダイキン工業	機械	200,900	13,119.64	2,635,737,500	12,580.00	2,527,322,000	0.67
28	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,512,200	1,655.50	2,503,448,600	1,664.50	2,517,056,900	0.67
29	日本	株式	パナソニック	電気機器	1,681,000	1,561.99	2,625,708,400	1,489.50	2,503,849,500	0.66
30	日本	株式	村田製作所	電気機器	154,400	14,440.00	2,229,536,000	16,185.00	2,498,964,000	0.66

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	0.10
		鉱業	0.29
		建設業	3.06
		食料品	4.33
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.37
		医薬品	4.52
		石油・石炭製品	0.67
		ゴム製品	0.80
		ガラス・土石製品	0.99
		鉄鋼	1.03
		非鉄金属	0.82

	金属製品	0.64
	機械	5.19
	電気機器	13.29
	輸送用機器	8.32
	精密機器	1.67
	その他製品	2.22
	電気・ガス業	1.70
	陸運業	4.21
	海運業	0.19
	空運業	0.60
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	7.23
	卸売業	4.70
	小売業	4.89
	銀行業	6.69
	証券、商品先物取引業	0.91
	保険業	2.23
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.39
	サービス業	4.39
合 計		97.90

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	605,500	18,237.38	11,042,735,577	20,381.25	12,340,846,875	2.55
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	864,400	9,918.52	8,573,573,260	10,755.86	9,297,369,706	1.92
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	48,310	157,234.22	7,595,985,242	176,625.54	8,532,779,982	1.76
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インター ネットソ フトウェ ア・サー ビス	281,400	17,364.18	4,886,280,456	20,399.72	5,740,483,741	1.18
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	409,400	11,951.25	4,892,844,507	11,777.64	4,821,767,863	0.99
6	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	500,100	8,108.28	4,054,954,888	8,859.05	4,430,410,905	0.91
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インター ネットソ フトウェ ア・サー ビス	37,120	112,127.37	4,162,168,326	116,069.85	4,308,513,203	0.89
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	317,000	13,925.19	4,414,287,955	13,149.43	4,168,372,163	0.86

9	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インターネットソフトウェア・サービス	35,200	112,707.99	3,967,321,575	117,120.98	4,122,658,813	0.85
10	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,169,500	3,259.22	3,811,657,909	3,205.56	3,748,905,929	0.77
11	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	552,600	5,656.19	3,125,611,960	6,052.41	3,344,565,082	0.69
12	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	552,300	5,695.71	3,145,741,575	5,894.80	3,255,698,592	0.67
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	149,900	21,678.57	3,249,617,981	21,098.67	3,162,690,633	0.65
14	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	224,300	12,393.58	2,779,880,490	13,604.89	3,051,577,276	0.63
15	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	114,430	23,272.06	2,663,022,637	26,624.97	3,046,696,233	0.63
16	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	367,400	8,321.12	3,057,183,046	8,282.36	3,042,940,166	0.63
17	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	214,100	13,001.55	2,783,632,801	14,200.56	3,040,341,609	0.62
18	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	137,900	19,366.09	2,670,584,350	20,336.68	2,804,428,586	0.58
19	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	703,900	3,857.16	2,715,060,001	3,918.63	2,758,327,176	0.57
20	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	583,800	4,659.83	2,720,412,031	4,657.79	2,719,220,721	0.56
21	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	66,830	35,634.94	2,381,483,650	38,935.25	2,602,042,958	0.53
22	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	487,100	5,197.13	2,531,522,836	5,282.82	2,573,261,622	0.53
23	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	724,900	3,874.37	2,808,531,190	3,540.35	2,566,406,239	0.53
24	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	2,362,000	961.90	2,272,010,366	1,049.21	2,478,249,326	0.51
25	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	299,600	8,615.10	2,581,085,596	8,140.54	2,438,906,683	0.50
26	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	111,000	19,035.51	2,112,942,535	20,844.31	2,313,718,632	0.47
27	アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	312,300	7,338.07	2,291,679,885	7,248.11	2,263,586,627	0.46
28	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	478,100	4,720.15	2,256,705,681	4,688.23	2,241,443,241	0.46
29	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	262,700	8,501.60	2,233,372,812	8,200.92	2,154,383,260	0.44
30	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	188,700	10,284.60	1,940,704,733	11,197.18	2,112,909,187	0.43

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	不動産管理・開発	0.53
		エネルギー設備・サービス	0.54
		石油・ガス・消耗燃料	6.47
		化学	2.60
		建設資材	0.31
		容器・包装	0.27
		金属・鉱業	1.61
		紙製品・林産品	0.12

航空宇宙・防衛	2.33
建設関連製品	0.38
建設・土木	0.33
電気設備	0.77
コングロマリット	1.49
機械	1.58
商社・流通業	0.33
商業サービス・用品	0.37
航空貨物・物流サービス	0.58
旅客航空輸送業	0.12
海運業	0.06
陸運・鉄道	1.01
運送インフラ	0.20
自動車部品	0.46
自動車	0.98
家庭用耐久財	0.41
レジャー用品	0.05
繊維・アパレル・贅沢品	1.36
ホテル・レストラン・レジャー	1.84
メディア	2.01
販売	0.06
インターネット販売・通信販売	2.54
複合小売り	0.41
専門小売り	1.57
食品・生活必需品小売り	1.59
飲料	1.88
食品	1.70
タバコ	1.04
家庭用品	1.09
パーソナル用品	0.72
ヘルスケア機器・用品	2.23
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.97
バイオテクノロジー	2.06
医薬品	4.95
銀行	8.89
各種金融サービス	0.94
保険	3.84
インターネットソフトウェア・サービス	3.31
情報技術サービス	3.25
ソフトウェア	4.49
通信機器	0.91
コンピュータ・周辺機器	2.89

	電子装置・機器・部品	0.43
	半導体・半導体製造装置	3.17
	各種電気通信サービス	1.89
	無線通信サービス	0.31
	電力	1.69
	ガス	0.14
	総合公益事業	0.95
	水道	0.07
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.01
	消費者金融	0.49
	資本市場	2.98
	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	0.06
	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	0.58
	専門サービス	0.66
投資信託受益証券		0.00
投資証券		2.32
合計		97.57

(参考) 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

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	53,360	20,366.03	1,086,731,468	20,381.25	1,087,543,500	2.52
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	76,220	10,537.37	803,158,951	10,755.86	819,812,030	1.90
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット 販売・通 信販 売	4,261	174,789.60	744,778,486	176,625.54	752,601,439	1.74
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インター ネット ソフト ウェア・ サービス	24,840	19,855.14	493,201,727	20,399.72	506,729,268	1.17
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	36,160	12,327.66	445,768,439	11,777.64	425,879,643	0.98
6	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消 耗燃 料	44,190	8,688.39	383,939,999	8,859.05	391,481,420	0.90
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インター ネット ソフト ウェア・ サービス	3,281	117,696.01	386,160,616	116,069.86	380,825,211	0.88
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	28,020	13,425.53	376,183,547	13,149.43	368,447,281	0.85
9	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インター ネット ソフト ウェア・ サービス	3,112	118,368.86	368,363,908	117,120.98	364,480,518	0.84
10	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	103,400	3,339.26	345,279,897	3,205.56	331,455,214	0.77

11	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	48,900	5,906.75	288,840,466	6,052.41	295,963,142	0.68
12	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	48,900	5,843.71	285,757,517	5,894.80	288,255,769	0.66
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	13,270	21,725.86	288,302,282	21,098.67	279,979,351	0.65
14	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	19,850	13,991.86	277,738,500	13,604.89	270,057,106	0.62
15	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	10,130	24,915.12	252,390,236	26,624.97	269,711,027	0.62
16	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	32,530	8,517.86	277,086,311	8,282.36	269,425,268	0.62
17	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	18,960	14,222.30	269,654,959	14,200.56	269,242,769	0.62
18	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	12,220	20,257.33	247,544,597	20,336.68	248,514,266	0.57
19	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	62,400	3,822.97	238,553,890	3,918.63	244,522,824	0.56
20	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	51,700	5,004.54	258,735,132	4,657.79	240,808,002	0.55
21	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	5,930	37,447.14	222,061,599	38,935.25	230,886,050	0.53
22	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	43,200	5,041.50	217,793,059	5,282.82	228,217,824	0.53
23	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	64,300	3,413.18	219,467,474	3,540.35	227,645,084	0.52
24	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	209,400	1,040.10	217,798,867	1,049.21	219,705,931	0.51
25	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	26,600	7,866.61	209,252,066	8,140.54	216,538,444	0.50
26	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	9,840	20,721.48	203,899,373	20,844.31	205,108,030	0.47
27	アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	27,700	7,820.96	216,640,730	7,248.11	200,772,813	0.46
28	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	42,400	4,541.48	192,559,006	4,688.23	198,780,994	0.46
29	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	23,320	8,550.88	199,406,638	8,200.92	191,245,594	0.44
30	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	16,750	10,998.26	184,220,955	11,197.18	187,552,882	0.43

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	不動産管理・開発	0.51
		エネルギー設備・サービス	0.53
		石油・ガス・消耗燃料	6.34
		化学	2.56
		建設資材	0.31
		容器・包装	0.26
		金属・鉱業	1.58
		紙製品・林産品	0.11
		航空宇宙・防衛	2.28
		建設関連製品	0.38
		建設・土木	0.32
		電気設備	0.76
		コングロマリット	1.49
		機械	1.59

商社・流通業	0.34
商業サービス・用品	0.35
航空貨物・物流サービス	0.56
旅客航空輸送業	0.12
海運業	0.07
陸運・鉄道	0.99
運送インフラ	0.20
自動車部品	0.46
自動車	0.97
家庭用耐久財	0.42
レジャー用品	0.05
繊維・アパレル・贅沢品	1.36
ホテル・レストラン・レジャー	1.83
メディア	1.99
販売	0.06
インターネット販売・通信販売	2.51
複合小売り	0.42
専門小売り	1.52
食品・生活必需品小売り	1.54
飲料	1.82
食品	1.69
タバコ	1.03
家庭用品	1.07
パーソナル用品	0.71
ヘルスケア機器・用品	2.19
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.94
バイオテクノロジー	2.01
医薬品	4.89
銀行	8.76
各種金融サービス	0.94
保険	3.78
インターネットソフトウェア・サービス	3.28
情報技術サービス	3.18
ソフトウェア	4.45
通信機器	0.90
コンピュータ・周辺機器	2.86
電子装置・機器・部品	0.41
半導体・半導体製造装置	3.14
各種電気通信サービス	1.90
無線通信サービス	0.29
電力	1.65
ガス	0.14

	総合公益事業	0.90
	水道	0.07
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.01
	消費者金融	0.45
	資本市場	2.95
	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	0.07
	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	0.59
	専門サービス	0.66
投資信託受益証券		0.00
投資証券		2.30
合 計		96.25

(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	インター ネットソフト ウェア・ サービス	309,300	5,465.21	1,690,389,453	5,470.75	1,692,102,975	5.13
2	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネットソフト ウェア・ サービス	62,700	21,243.24	1,331,951,210	21,520.42	1,349,330,710	4.09
3	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュ ータ・周辺機 器	261,180	5,145.98	1,344,029,668	5,004.45	1,307,062,251	3.96
4	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	1,336,000	830.79	1,109,935,440	800.02	1,068,826,720	3.24
5	南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	23,740	26,669.35	633,130,452	26,187.21	621,684,479	1.88
6	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	5,254,000	111.94	588,165,758	108.30	569,044,978	1.72
7	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インター ネットソフト ウェア・ サービス	14,900	28,402.22	423,193,123	26,265.18	391,351,197	1.18
8	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,743,000	93.76	350,960,524	88.77	332,297,926	1.00
9	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信 サービス	331,000	1,018.66	337,178,943	971.57	321,592,153	0.97
10	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	31,350	8,431.74	264,335,049	9,604.50	301,101,075	0.91
11	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	280,500	1,065.75	298,944,979	1,058.14	296,808,270	0.90
12	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・ 機器・部品	903,812	296.99	268,425,590	316.38	285,955,271	0.86
13	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	170,421	1,465.79	249,801,823	1,476.87	251,690,872	0.76
14	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵 当・不動産 金融	84,540	3,074.19	259,892,276	2,901.09	245,258,656	0.74
15	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,268,000	57.61	245,905,088	56.23	239,993,908	0.72

16	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	586,300	388.05	227,518,992	387.44	227,158,912	0.68
17	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	152,970	1,582.25	242,037,395	1,484.08	227,020,024	0.68
18	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	173,294	1,387.03	240,364,583	1,253.72	217,263,297	0.65
19	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	93,480	1,896.53	177,287,998	1,962.95	183,496,940	0.55
20	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	45,960	4,099.60	188,417,846	3,942.90	181,215,684	0.55
21	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガス・消耗燃料	954,000	187.25	178,638,408	178.38	170,182,152	0.51
22	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガス・消耗燃料	23,120	7,265.50	167,978,545	7,304.64	168,883,277	0.51
23	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インターネット販売・通信販売	39,200	4,032.90	158,089,989	3,891.46	152,545,232	0.46
24	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PREF	銀行	179,213	956.48	171,414,420	850.88	152,490,352	0.46
25	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信サービス	1,796,800	92.12	165,525,169	84.54	151,912,253	0.46
26	ブラジル	株式	AMBEV SA	飲料	251,356	639.11	160,645,314	574.35	144,368,153	0.43
27	韓国	株式	POSCO	金属・鉱業	4,170	35,435.55	147,766,244	34,576.20	144,182,754	0.43
28	香港	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	石油・ガス・消耗燃料	1,404,900	109.13	153,327,976	100.13	140,680,364	0.42
29	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	283,700	495.67	140,622,146	491.65	139,481,133	0.42
30	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	24,450	5,652.66	138,207,684	5,692.84	139,189,987	0.42

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	不動産管理・開発	2.58
		エネルギー設備・サービス	0.09
		石油・ガス・消耗燃料	6.86
		化学	2.44
		建設資材	1.10
		容器・包装	0.05
		金属・鉱業	3.25
		紙製品・林産品	0.55
		航空宇宙・防衛	0.16
		建設関連製品	0.03
		建設・土木	0.80
		電気設備	0.17
		コングロマリット	1.48
		機械	0.76
		商社・流通業	0.04
商業サービス・用品	0.09		

航空貨物・物流サービス	0.06
旅客航空輸送業	0.30
海運業	0.09
陸運・鉄道	0.23
運送インフラ	0.84
自動車部品	0.63
自動車	2.06
家庭用耐久財	0.39
レジャー用品	0.08
繊維・アパレル・贅沢品	0.63
ホテル・レストラン・レジャー	0.73
メディア	2.27
販売	0.04
インターネット販売・通信販売	0.85
複合小売り	0.57
専門小売り	0.45
食品・生活必需品小売り	1.83
飲料	1.14
食品	1.59
タバコ	0.55
家庭用品	0.42
パーソナル用品	0.82
ヘルスケア機器・用品	0.10
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.47
バイオテクノロジー	0.64
医薬品	1.53
銀行	15.50
各種金融サービス	1.15
保険	3.35
インターネットソフトウェア・サービス	11.75
情報技術サービス	1.63
ソフトウェア	0.34
通信機器	0.05
コンピュータ・周辺機器	5.44
電子装置・機器・部品	2.72
半導体・半導体製造装置	5.29
各種電気通信サービス	1.24
無線通信サービス	2.84
電力	0.98
ガス	0.57
総合公益事業	0.05
水道	0.21

		貯蓄・抵当・不動産金融	0.86
		消費者金融	0.22
		資本市場	1.25
		各種消費者サービス	0.57
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.53
		ヘルスケア・テクノロジー	0.04
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.26
		専門サービス	0.04
	投資証券		0.39
	合計		97.38

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

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	LOWES COS INC	専門小売り	9,375	9,211.46	86,357,525	10,589.55	99,277,069	2.13
2	アメリカ	株式	T ROWE PRICE GROUP INC	資本市場	7,280	12,015.55	87,473,227	13,292.92	96,772,479	2.07
3	アメリカ	株式	AUTOMATIC DATA PROCESS	情報技術 サービス	6,753	12,963.22	87,540,689	14,199.48	95,889,095	2.06
4	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテ クノロジー	8,487	10,298.83	87,406,211	11,197.18	95,030,526	2.04
5	アメリカ	株式	CLOROX CO	家庭用品	6,888	12,631.08	87,002,898	13,705.98	94,406,811	2.02
6	アメリカ	株式	SYSCO CORP	食品・生活 必需品小売 り	12,890	6,716.88	86,580,604	7,179.63	92,545,495	1.98
7	アメリカ	株式	GRAINGER(W.W.) INC	商社・流通 業	2,764	31,647.40	87,473,433	33,420.90	92,375,373	1.98
8	アメリカ	株式	MEDTRONIC PLC	ヘルスケア 機器・用品	9,882	8,804.79	87,008,978	9,336.24	92,260,753	1.98
9	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST		7,090	12,222.99	86,661,003	12,976.60	92,004,136	1.97
10	アメリカ	株式	KIMBERLY-CLARK CORP	家庭用品	8,026	10,995.56	88,250,371	11,459.15	91,971,170	1.97
11	アメリカ	株式	CINTAS CORP	商業サー ビス・用品	4,568	18,968.28	86,647,106	19,908.40	90,941,594	1.95
12	アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア 機器・用品	13,440	6,474.92	87,023,003	6,747.00	90,679,801	1.94
13	アメリカ	株式	BROWN-FORMAN CORP-CL B	飲料	14,370	5,989.51	86,069,367	6,278.51	90,222,218	1.93
14	アメリカ	株式	DOVER CORP	機械	10,525	8,294.65	87,301,244	8,561.21	90,106,756	1.93
15	アメリカ	株式	V F CORP	繊維・アバ レル・贅沢 品	10,125	8,485.28	85,913,497	8,886.22	89,973,028	1.93
16	アメリカ	株式	PRAXAIR INC	化学	5,259	16,523.41	86,896,661	17,010.46	89,458,025	1.92
17	アメリカ	株式	HORMEL FOODS CORP	食品	22,110	3,865.27	85,461,190	4,040.37	89,332,780	1.91
18	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	資本市場	4,117	21,048.80	86,657,926	21,687.82	89,288,771	1.91
19	アメリカ	株式	TARGET CORP	複合小売り	11,145	7,690.85	85,714,589	7,986.18	89,006,076	1.91
20	アメリカ	株式	GENUINE PARTS CO	販売	8,906	9,628.15	85,748,364	9,966.70	88,763,457	1.90
21	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	10,832	7,995.57	86,608,074	8,140.54	88,178,362	1.89
22	アメリカ	株式	EMERSON ELEC	電気設備	11,310	7,657.21	86,603,094	7,788.35	88,086,295	1.89
23	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗燃 料	9,938	8,595.71	85,424,198	8,859.05	88,041,239	1.89

24	アメリカ	株式	NUCOR CORP	金属・鉱業	12,580	6,912.01	86,953,207	6,967.67	87,653,289	1.88
25	アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	ホテル・レストラン・レジャー	4,974	17,346.40	86,280,999	17,589.83	87,491,834	1.87
26	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	6,399	13,368.78	85,546,883	13,604.89	87,057,704	1.87
27	アメリカ	株式	STANLEY BLACK & DECKER INC	機械	5,551	15,628.82	86,755,623	15,654.97	86,900,761	1.86
28	アメリカ	株式	ROPER TECHNOLOGIES INC	コングロマリット	2,854	30,453.31	86,913,775	30,292.51	86,454,841	1.85
29	アメリカ	株式	AFLAC INC	保険	17,456	4,918.78	85,862,350	4,952.37	86,448,606	1.85
30	アメリカ	株式	MCCORMICK & CO INC.	食品	7,620	11,227.55	85,554,004	11,306.97	86,159,142	1.85

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	石油・ガス・消耗燃料	3.76
		化学	9.07
		金属・鉱業	1.88
		航空宇宙・防衛	1.66
		建設関連製品	1.83
		電気設備	1.89
		コングロマリット	3.55
		機械	7.31
		商社・流通業	1.98
		商業サービス・用品	1.95
		家庭用耐久財	1.80
		繊維・アパレル・贅沢品	1.93
		ホテル・レストラン・レジャー	1.87
		販売	1.90
		複合小売り	1.91
		専門小売り	2.13
		食品・生活必需品小売り	5.60
		飲料	5.58
		食品	5.56
		家庭用品	7.68
		ヘルスケア機器・用品	5.70
		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.55
		バイオテクノロジー	2.04
医薬品	1.76		
保険	3.56		
情報技術サービス	2.06		
各種電気通信サービス	1.72		
総合公益事業	1.81		
資本市場	5.84		
投資信託受益証券			0.28

投資証券		1.97
合計		99.27

(参考) 国内債券 NOMURA - BPI 総合 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 2回	9,800,000,000	100.39	9,838,612,000	100.37	9,836,554,000	0.1	2019/12/20	1.47
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	7,300,000,000	100.44	7,332,193,000	100.42	7,330,952,000	0.1	2020/3/20	1.10
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	7,200,000,000	100.54	7,239,096,000	100.55	7,239,888,000	0.1	2020/9/20	1.08
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	6,800,000,000	100.91	6,862,220,000	100.94	6,863,988,000	0.1	2026/12/20	1.03
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	6,800,000,000	100.78	6,853,108,000	100.81	6,855,284,000	0.1	2027/6/20	1.02
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	6,200,000,000	100.70	6,243,958,000	100.72	6,244,640,000	0.1	2021/6/20	0.93
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 2回	6,000,000,000	100.90	6,054,000,000	100.91	6,054,960,000	0.1	2022/6/20	0.90
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	6,000,000,000	100.65	6,039,180,000	100.66	6,039,600,000	0.1	2021/3/20	0.90
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	5,900,000,000	101.02	5,960,652,000	101.04	5,961,891,000	0.1	2026/6/20	0.89
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	5,800,000,000	100.97	5,856,492,000	100.99	5,857,884,000	0.1	2026/9/20	0.87
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	5,800,000,000	100.85	5,849,300,000	100.88	5,851,040,000	0.1	2027/3/20	0.87
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,400,000,000	103.96	5,613,894,000	103.85	5,607,954,000	0.6	2023/12/20	0.84
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	104.71	5,549,842,000	104.62	5,545,019,000	0.8	2023/6/20	0.83
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	5,500,000,000	100.75	5,541,525,000	100.78	5,543,395,000	0.1	2027/9/20	0.83
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	5,500,000,000	100.64	5,535,205,000	100.68	5,537,565,000	0.1	2028/3/20	0.83
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	5,500,000,000	100.59	5,532,890,000	100.61	5,533,825,000	0.1	2020/12/20	0.83
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 0回	5,500,000,000	100.48	5,526,565,000	100.45	5,524,750,000	0.2	2019/9/20	0.82
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	5,300,000,000	101.07	5,356,710,000	101.09	5,358,035,000	0.1	2026/3/20	0.80
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,000,000,000	103.51	5,175,700,000	103.47	5,173,800,000	0.6	2023/3/20	0.77

20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	5,100,000,000	100.49	5,125,398,000	100.49	5,125,143,000	0.1	2020/6/20	0.76
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	4,950,000,000	103.59	5,127,754,500	103.42	5,119,290,000	1.2	2020/12/20	0.76
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 3回	5,000,000,000	100.96	5,048,200,000	100.97	5,048,650,000	0.1	2022/9/20	0.75
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	5,000,000,000	100.80	5,040,050,000	100.82	5,041,050,000	0.1	2021/12/20	0.75
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	4,700,000,000	102.63	4,823,610,000	102.65	4,824,691,000	0.3	2025/12/20	0.72
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	4,500,000,000	103.33	4,649,940,000	103.33	4,650,120,000	0.4	2025/9/20	0.69
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,400,000,000	104.10	4,580,576,000	103.95	4,574,108,000	0.8	2022/9/20	0.68
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	4,200,000,000	104.10	4,372,284,000	103.99	4,367,664,000	0.6	2024/3/20	0.65
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	4,100,000,000	104.24	4,274,004,000	104.13	4,269,535,000	0.6	2024/6/20	0.64
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 05回	4,100,000,000	102.45	4,200,614,000	102.24	4,192,209,000	1.3	2019/12/20	0.62
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	4,000,000,000	100.87	4,035,000,000	100.85	4,034,360,000	0.1	2022/3/20	0.60

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.17
地方債証券	6.52
特殊債券	8.40
社債券	4.09
合計	99.20

(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	51,800,000	11,079.33	5,739,094,124	11,095.46	5,747,451,713	3.625	2020/2/15	0.95
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,600,000	10,870.00	5,717,620,000	10,904.81	5,735,934,109	2.625	2020/11/15	0.95
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,800,000	11,018.18	5,597,239,776	11,030.07	5,603,279,144	3.375	2019/11/15	0.92
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,300,000	10,342.63	5,202,345,074	10,460.67	5,261,720,038	2.25	2025/11/15	0.87
5	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000	15,676.50	5,188,921,831	15,803.23	5,230,869,461	3.5	2026/4/25	0.86
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	39,200,000	13,160.34	5,158,854,338	13,274.13	5,203,461,887	6	2026/2/15	0.86
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,600,000	10,317.15	5,117,310,528	10,404.62	5,160,695,550	1.75	2023/5/15	0.85
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,200,000	11,071.26	5,114,924,232	11,092.06	5,124,536,225	3.5	2020/5/15	0.84

9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,800,000	11,149.39	5,106,421,855	11,185.90	5,123,146,494	3.625	2021/2/15	0.84
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	47,100,000	10,530.73	4,959,976,858	10,631.36	5,007,374,665	2.375	2024/8/15	0.82
11	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000	15,537.73	4,863,310,006	15,611.86	4,886,514,903	4.25	2023/10/25	0.80
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,007.20	4,689,068,117	11,050.45	4,707,495,238	3.125	2021/5/15	0.78
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000	18,879.41	4,625,455,855	19,014.56	4,658,569,454	5.5	2029/4/25	0.77
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,700,000	10,239.87	4,577,225,977	10,348.57	4,625,814,877	2	2025/2/15	0.76
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,400,000	10,448.78	4,012,334,400	10,517.57	4,038,748,395	1.75	2022/4/30	0.66
16	イギリス	国債証券	UK TREASURY	20,100,000	19,281.41	3,875,563,973	19,978.19	4,015,616,592	3.5	2045/1/22	0.66
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	10,587.20	3,906,680,247	10,848.76	4,003,195,656	3	2044/11/15	0.66
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,200,000	10,753.65	3,892,823,550	10,789.32	3,905,735,269	2.125	2020/8/31	0.64
19	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	20,300,000	18,409.71	3,737,172,348	19,054.45	3,868,054,081	3.25	2044/1/22	0.64
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000	13,702.93	4,001,256,935	13,226.17	3,862,043,523	4.25	2020/3/1	0.63
21	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000	19,566.98	3,795,995,142	19,840.46	3,849,050,910	6.5	2027/7/4	0.63
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,000,000	10,647.92	3,726,775,206	10,760.44	3,766,157,488	2.625	2025/3/31	0.62
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,000,000	10,680.62	3,631,412,142	10,732.42	3,649,024,846	2.125	2021/6/30	0.60
24	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,700,000	13,589.25	3,628,331,859	13,575.31	3,624,609,799	2.5	2020/10/25	0.60
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,200,000	10,430.10	3,567,095,618	10,532.01	3,601,947,555	2.25	2024/11/15	0.59
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,700,000	10,575.32	3,563,883,117	10,638.16	3,585,060,751	2	2022/2/15	0.59
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	32,400,000	11,033.47	3,574,845,553	11,040.69	3,577,184,434	3.625	2019/8/15	0.59
28	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000	17,941.55	3,552,428,674	18,043.76	3,572,665,808	6	2025/10/25	0.59
29	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000	20,314.48	3,555,035,663	20,385.66	3,567,490,687	4.5	2041/4/25	0.59
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,400,000	10,248.37	3,525,439,925	10,334.99	3,555,237,126	1.625	2023/5/31	0.58

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.07
合計	99.07

(参考) 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

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	4,400,000	10,760.62	473,467,290	10,729.45	472,095,983	1.25	2019/8/31	1.31
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,637.20	425,488,318	10,608.86	424,354,583	1.375	2020/9/15	1.18
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,700,000	11,258.15	416,551,836	11,185.90	413,878,648	3.625	2021/2/15	1.15
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,660,000	10,850.19	397,117,220	10,796.11	395,137,907	1.625	2019/6/30	1.10
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	10,366.45	393,925,227	10,337.53	392,826,504	2.25	2027/8/15	1.09

6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,700,000	10,628.02	393,237,069	10,515.87	389,087,374	1.375	2021/4/30	1.08
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,600,000	10,672.25	384,201,269	10,671.70	384,181,462	0.75	2019/8/15	1.06
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,580,000	10,781.61	385,981,641	10,721.38	383,825,633	2	2021/2/28	1.06
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,520,000	10,651.34	374,927,189	10,655.57	375,076,129	1	2019/11/30	1.04
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	2,680,000	13,968.70	374,361,272	13,870.28	371,723,760	6.5	2026/11/15	1.03
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	11,029.77	375,012,453	10,884.43	370,070,839	2.75	2024/2/15	1.03
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	10,403.77	364,132,263	10,430.95	365,083,358	2	2024/4/30	1.01
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	10,641.76	361,820,060	10,589.75	360,051,747	1.375	2020/10/31	1.00
14	イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,580,000	22,218.45	351,051,645	22,772.53	359,806,083	4.25	2046/12/7	1.00
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,340,000	10,714.90	357,877,980	10,460.67	349,386,578	2.25	2025/11/15	0.97
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,300,000	10,579.83	349,134,441	10,433.07	344,291,508	1.625	2022/8/15	0.95
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	10,220.68	347,503,156	9,967.28	338,887,527	1.625	2026/2/15	0.94
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,280,000	10,591.55	347,403,081	10,302.72	337,929,278	2	2025/8/15	0.94
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	10,060.70	342,064,133	9,938.40	337,905,811	1.625	2026/5/15	0.94
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000	12,752.22	357,062,408	11,861.92	332,133,984	0.95	2023/3/15	0.92
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,110,000	10,573.65	328,840,608	10,554.93	328,258,620	2	2023/2/15	0.91
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	10,743.14	333,037,560	10,536.25	326,623,943	1.875	2022/8/31	0.90
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	11,001.09	330,032,881	10,835.18	325,055,437	2.375	2020/12/31	0.90
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	10,780.40	323,412,223	10,824.56	324,737,000	2.375	2021/4/15	0.90
25	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,450,000	12,384.53	303,421,021	12,429.79	304,529,915	0.25	2026/11/25	0.84
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	10,884.76	304,773,296	10,789.32	302,101,070	2.125	2020/8/31	0.84
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,700,000	10,854.39	293,068,652	10,658.54	287,780,681	2.125	2022/6/30	0.80
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,600,000	10,730.07	278,981,931	10,649.62	276,890,303	1.5	2020/8/15	0.77
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,540,000	11,064.51	281,038,659	10,856.41	275,752,877	3	2045/5/15	0.76
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,560,000	10,757.46	275,391,196	10,590.60	271,119,518	2.875	2045/8/15	0.75

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	95.95
合計	95.95

(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	6,790,000,000	4.73	321,553,930	4.78	324,633,797	9.85	2027/6/28	4.49
2	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	5,470,000,000	4.02	220,405,674	4.01	219,730,228	7.75	2021/4/14	3.04
3	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	430,000	3,048.54	131,096,268	2,994.72	128,773,235	10	2023/1/1	1.78
4	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	23,000,000	526.81	121,167,484	526.08	120,999,491	6.5	2022/6/9	1.67
5	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	67,000,000	182.33	122,162,775	179.88	120,521,275	7.6	2022/7/20	1.66

6	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	66,000,000	185.04	122,130,960	181.13	119,545,965	7.75	2026/9/16	1.65
7	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	381,000	3,008.59	114,634,203	2,900.69	110,516,440	10	2025/1/1	1.53
8	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,400,000	2,420.91	106,520,370	2,408.80	105,987,571		2020/7/1	1.46
9	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,700,000	2,539.49	93,961,260	2,531.96	93,682,520		2020/1/1	1.29
10	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	12,050,000,000	0.80	96,621,720	0.76	92,580,150	7	2027/5/15	1.28
11	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,510,000	2,659.56	93,350,766	2,634.04	92,454,853		2019/7/1	1.28
12	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	19,900,000	471.49	93,826,658	461.68	91,875,385	1	2026/6/26	1.27
13	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	18,300,000	497.88	91,113,687	496.32	90,826,743	1.5	2019/10/29	1.25
14	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,200,000	995.71	91,605,389	969.20	89,167,003	10.5	2026/12/21	1.23
15	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,000,000	376.58	86,614,534	369.30	84,939,739	3.85	2025/12/12	1.17
16	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	266,000	3,063.14	81,486,008	3,106.61	82,635,925	10	2021/1/1	1.14
17	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,100,000	839.53	84,793,088	809.75	81,785,521	8.75	2048/2/28	1.13
18	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	10,180,000,000	0.81	82,706,052	0.78	79,860,573	7	2022/5/15	1.10
19	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,450,000	651.90	81,161,883	633.31	78,847,207	6.5	2041/2/28	1.09
20	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,900,000	486.00	77,275,230	485.98	77,270,866	5.75	2026/3/5	1.06
21	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,230,000,000	0.85	79,212,539	0.82	76,133,655	8.375	2024/3/15	1.05
22	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,400,000,000	0.85	80,475,720	0.80	75,996,180	8.25	2036/5/15	1.05
23	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	22,000,000	340.67	74,948,311	337.48	74,246,926	1.875	2022/6/17	1.02
24	チリ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS	420,000,000	17.56	73,789,863	17.45	73,320,407	5	2035/3/1	1.01
25	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	15,500,000	470.32	72,900,700	467.11	72,402,755	0.45	2023/10/25	1.00
26	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,850,000	553.67	71,147,843	553.76	71,158,844	8	2020/6/11	0.98
27	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	2,769.21	71,999,651	2,730.05	70,981,366	4.181	2024/7/15	0.98
28	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	40,500,000	175.15	70,938,787	174.05	70,492,275	6.4	2020/5/27	0.97
29	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,900,000	525.37	67,773,841	528.73	68,206,997	5	2019/12/11	0.94
30	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	19,500,000	347.60	67,782,084	344.30	67,139,867	2.55	2020/6/26	0.92

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.38
合計	97.38

(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	3,000,000	10,038.16	301,145,045	10,412.74	312,382,277	5.25	2047/6/23	2.14
2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	2,500,000	10,774.88	269,372,188	10,900.00	272,500,030	7.5	2026/4/22	1.87
3	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	2,200,000	10,975.98	241,471,615	11,057.50	243,265,165	6.875	2021/4/22	1.67
4	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,900,000	11,197.44	212,751,509	11,154.25	211,930,759	4.2	2024/1/21	1.45
5	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,710,000	11,771.81	201,297,996	11,913.52	203,721,192	6.05	2040/1/11	1.40
6	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	1,800,000	10,662.05	191,917,024	10,764.77	193,766,011	5.75	2024/3/22	1.33
7	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,750,000	10,906.68	190,867,009	10,928.42	191,247,459	4	2023/10/2	1.31
8	アメリカ	国債証券	RUSSIA	1,557,500	12,037.60	187,485,636	12,110.53	188,621,640	7.5	2030/3/31	1.29
9	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000	8,210.43	180,629,616	8,461.47	186,152,554	4.875	2043/4/16	1.28
10	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	1,750,000	10,516.72	184,042,688	10,560.31	184,805,490	5.625	2022/1/26	1.27
11	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,630,000	11,201.53	182,585,021	11,147.18	181,699,116	4.875	2021/1/22	1.25
12	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,700,000	10,571.07	179,708,275	10,614.55	180,447,435	5	2045/6/15	1.24
13	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000	10,643.76	170,300,290	10,750.43	172,006,880	4.15	2027/3/28	1.18
14	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,600,000	10,425.03	166,800,584	10,551.03	168,816,491	6	2027/3/25	1.16
15	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	1,600,000	10,312.91	165,006,600	10,448.78	167,180,600	6.875	2027/1/26	1.15
16	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000	10,027.68	160,442,938	10,190.62	163,050,000	4.75	2044/3/8	1.12
17	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,400,000	11,122.72	155,718,185	11,343.24	158,805,461	4.875	2023/9/16	1.09
18	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,400,000	10,810.01	151,340,271	10,997.88	153,970,398	4.75	2026/5/27	1.05
19	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,400,000	10,652.40	149,133,661	10,803.39	151,247,594	4.125	2025/1/15	1.04
20	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000	11,204.25	145,655,283	11,345.56	147,492,313	5.55	2045/1/21	1.01
21	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,400,000	10,519.44	147,272,195	10,508.57	147,120,015	4.25	2025/1/7	1.01
22	アメリカ	国債証券	RUSSIA FOREIGN BOND	1,300,000	11,088.03	144,144,396	11,149.63	144,945,200	5	2020/4/29	0.99
23	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	1,250,000	11,388.31	142,353,928	11,530.97	144,137,151	7.375	2025/2/5	0.99
24	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,300,000	11,086.31	144,122,069	11,074.13	143,963,802	4	2021/1/15	0.99
25	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,600,000	9,212.32	147,397,200	8,940.57	143,049,200	5	2045/1/27	0.98
26	アメリカ	国債証券	UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,300,000	10,381.93	134,965,181	10,751.51	139,769,721	7.75	2026/9/1	0.96
27	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	1,400,000	9,742.23	136,391,325	9,766.80	136,735,251	7.125	2036/7/6	0.94
28	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,200,000	10,883.58	130,603,050	11,288.50	135,462,071	5.625	2042/4/4	0.93
29	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000	10,996.65	131,959,888	11,158.57	133,902,922	4.75	2026/1/8	0.92
30	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000	11,099.90	133,198,806	11,110.49	133,325,985	6.25	2022/9/26	0.91

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.77
合計	97.77

(参考) 米国ハイ・イールド債券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)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	社債券	INTERNATIONAL GAME TECH	200,000	11,243.65	22,487,312	11,114.57	22,229,150	5.625	2020/2/15	1.08
2	アメリカ	社債券	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE	200,000	11,046.63	22,093,275	10,951.52	21,903,050	4.5	2020/4/15	1.06
3	アメリカ	社債券	JAGUAR LAND ROVER AUTOMO	200,000	10,829.23	21,658,475	10,845.54	21,691,085	3.5	2020/3/15	1.05
4	アメリカ	社債券	ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000	10,842.82	21,685,650	10,788.47	21,576,950	4.25	2022/9/15	1.05
5	アメリカ	社債券	NUMERICABLE-SFR SA	200,000	10,639.01	21,278,025	10,611.83	21,223,675	7.375	2026/5/1	1.03
6	アメリカ	社債券	ALTICE SA	200,000	10,503.24	21,006,492	10,475.96	20,951,925	7.75	2022/5/15	1.02
7	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	10,639.01	21,278,025	10,353.67	20,707,350	5.5	2027/4/15	1.00
8	アメリカ	社債券	BARCLAYS PLC	200,000	10,386.06	20,772,135	10,260.07	20,520,147	4.836	2028/5/9	1.00
9	アメリカ	社債券	VIRGIN MEDIA SECURED FIN	200,000	10,543.90	21,087,800	10,244.97	20,489,950	5.25	2026/1/15	0.99
10	アメリカ	社債券	ASHTAD CAPITAL INC	200,000	10,503.13	21,006,275	10,217.80	20,435,600	4.125	2025/8/15	0.99
11	アメリカ	社債券	DEUTSCHE BANK AG	200,000	10,520.28	21,040,572	9,989.77	19,979,545	4.5	2025/4/1	0.97
12	アメリカ	社債券	INTESA SANPAOLO SPA	200,000	10,927.54	21,855,085	9,891.39	19,782,796	5.71	2026/1/15	0.96
13	アメリカ	社債券	ZIGGO SECURED FINANCE BV	150,000	10,312.91	15,469,369	10,353.67	15,530,513	5.5	2027/1/15	0.75
14	アメリカ	社債券	TENET HEALTHCARE CORP	140,000	10,591.45	14,828,039	10,455.58	14,637,814	4.625	2024/7/15	0.71
15	アメリカ	社債券	VALEANT PHARMACEUTICALS	120,000	11,331.97	13,598,370	11,348.28	13,617,936	6.5	2022/3/15	0.66
16	アメリカ	社債券	T-MOBILE USA INC	120,000	11,386.32	13,663,590	11,331.97	13,598,370	6	2024/4/15	0.66
17	アメリカ	社債券	VRX ESCROW CORP	130,000	10,021.59	13,028,075	10,258.56	13,336,131	5.875	2023/5/15	0.65
18	アメリカ	社債券	SPRINT CORP	120,000	11,182.51	13,419,015	10,937.93	13,125,525	7.125	2024/6/15	0.64
19	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	130,000	10,190.62	13,247,812	10,064.96	13,084,458	5	2028/2/1	0.63
20	アメリカ	社債券	TENET HEALTHCARE CORP	120,000	10,800.10	12,960,127	10,842.82	13,011,390	6.75	2023/6/15	0.63
21	アメリカ	社債券	INTELSAT JACKSON HLDG	110,000	10,727.33	11,800,064	11,236.86	12,360,549	9.75	2025/7/15	0.60
22	アメリカ	社債券	1011778 BC / NEW RED FIN	120,000	10,530.31	12,636,375	10,285.73	12,342,885	4.25	2024/5/15	0.60
23	アメリカ	社債券	DYNEGY INC	100,000	11,766.77	11,766,775	11,703.07	11,703,077	7.625	2024/11/1	0.57
24	アメリカ	社債券	DELL INT LLC/EMC CORP	100,000	11,646.36	11,646,365	11,682.33	11,682,335	7.125	2024/6/15	0.56
25	アメリカ	社債券	FIRST DATA CORPORATION	100,000	11,430.89	11,430,892	11,415.67	11,415,674	7	2023/12/1	0.55
26	アメリカ	社債券	CHENIERE CORP CHRISTI HD	100,000	11,372.73	11,372,738	11,399.91	11,399,913	5.875	2025/3/31	0.55
27	アメリカ	社債券	T-MOBILE USA INC	100,000	11,590.13	11,590,137	11,331.97	11,331,975	6.5	2026/1/15	0.55
28	アメリカ	社債券	NAVIENT CORP	100,000	11,324.63	11,324,638	11,318.38	11,318,388	6.625	2021/7/26	0.55

29	アメリカ	社債券	BOMBARDIER INC	100,000	11,440.67	11,440,675	11,277.62	11,277,625	7.5	2025/3/15	0.55
30	アメリカ	社債券	NCR CORP	100,000	11,304.80	11,304,800	11,250.45	11,250,450	6.375	2023/12/15	0.54

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	97.80
合計	97.80

(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	3,851	577,997	2,225,866,447	610,000	2,349,110,000	7.06
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	3,957	556,672	2,202,754,863	571,000	2,259,447,000	6.79
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	11,769	155,119	1,825,603,043	152,400	1,793,595,600	5.39
4	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,509	212,760	1,597,615,290	197,400	1,482,276,600	4.46
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	8,771	165,082	1,447,938,519	166,800	1,463,002,800	4.40
6	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	7,890	168,316	1,328,014,975	171,900	1,356,291,000	4.08
7	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,300	237,656	1,259,580,139	227,000	1,203,100,000	3.62
8	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	4,627	269,169	1,245,447,831	256,600	1,187,288,200	3.57
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	3,682	283,180	1,042,671,006	284,900	1,049,001,800	3.15
10	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	8,256	120,413	994,134,516	121,600	1,003,929,600	3.02
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	2,511	402,481	1,010,630,443	395,500	993,100,500	2.98
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	11,478	79,574	913,355,996	81,200	932,013,600	2.80
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	1,799	488,440	878,704,945	484,500	871,615,500	2.62
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	1,227	624,333	766,056,873	675,000	828,225,000	2.49
15	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	9,964	70,320	700,668,978	71,400	711,429,600	2.14
16	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	1,321	474,929	627,382,212	490,500	647,950,500	1.95
17	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,353	476,761	645,058,512	449,000	607,497,000	1.82
18	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,272	140,997	602,342,516	140,000	598,080,000	1.79
19	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	2,649	228,693	605,810,167	224,600	594,965,400	1.79
20	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	4,619	124,450	574,836,212	121,600	561,670,400	1.69
21	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	858	579,198	496,952,261	637,000	546,546,000	1.64
22	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	10,907	50,734	553,361,845	50,000	545,350,000	1.64

23	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,561	133,379	474,964,684	145,000	516,345,000	1.55
24	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	3,776	121,838	460,062,893	123,000	464,448,000	1.39
25	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	2,701	176,615	477,039,626	171,100	462,141,100	1.39
26	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,842	176,641	502,014,944	161,700	459,551,400	1.38
27	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,666	138,442	369,087,065	149,300	398,033,800	1.19
28	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	4,473	82,951	371,041,299	87,400	390,940,200	1.17
29	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	1,507	241,039	363,246,993	258,500	389,559,500	1.17
30	日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	3,592	116,653	419,018,402	107,700	386,858,400	1.16

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.36
合計	97.36

(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	52,120	16,983.37	885,173,743	17,564.83	915,479,096	4.43
2	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	89,330	6,345.19	566,816,465	7,043.76	629,219,081	3.05
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	25,110	22,371.15	561,739,729	23,069.40	579,272,659	2.80
4	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	61,750	7,192.03	444,108,448	6,937.23	428,374,199	2.07
5	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,160	20,540.70	475,722,615	18,028.98	417,551,223	2.02
6	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	34,460	12,151.95	418,756,228	11,741.77	404,621,532	1.96
7	フランス	投資証券	UNIBAIL RODAMCO-NA	16,660	28,725.88	478,573,184	24,186.42	402,945,765	1.95
8	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	62,120	7,640.33	474,617,452	6,254.59	388,535,628	1.88
9	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	59,800	7,006.10	418,965,345	5,957.84	356,279,251	1.72
10	香港	投資証券	LINK REIT	364,100	887.74	323,227,345	954.95	347,700,025	1.68
11	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	25,900	13,503.09	349,730,152	13,275.53	343,836,253	1.66
12	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	893,000	337.79	301,646,914	345.04	308,126,524	1.49
13	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	122,300	2,024.61	247,610,230	2,371.83	290,075,298	1.40
14	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,010	28,261.24	311,156,293	26,229.30	288,784,703	1.40
15	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	47,400	5,947.79	281,925,515	5,840.45	276,837,377	1.34
16	アメリカ	投資証券	GGP INC	106,100	2,488.78	264,060,127	2,243.56	238,042,565	1.15
17	オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	318,800	694.48	221,402,700	727.97	232,078,111	1.12
18	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,010	13,061.39	222,174,289	13,623.37	231,733,541	1.12
19	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	21,180	8,353.39	176,925,001	10,537.37	223,181,666	1.08
20	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	29,060	8,088.10	235,040,195	7,548.12	219,348,600	1.06
21	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	267,500	685.57	183,391,421	765.85	204,866,213	0.99
22	アメリカ	投資証券	HCP INC	78,400	3,219.24	252,388,574	2,605.53	204,274,258	0.99
23	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,970	11,370.56	215,699,704	10,216.71	193,811,046	0.93

24	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	59,600	3,048.09	181,666,396	3,078.38	183,471,686	0.88
25	アメリカ	投資証券	UDR INC	44,800	4,280.98	191,788,214	3,961.02	177,454,054	0.86
26	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	47,000	3,694.65	173,649,011	3,641.45	171,148,150	0.82
27	イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	125,500	1,512.30	189,793,983	1,349.75	169,394,468	0.82
28	イギリス	投資証券	BRITISH LAND	166,100	917.85	152,456,118	974.91	161,932,990	0.78
29	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	15,210	11,356.49	172,732,214	10,571.07	160,786,051	0.77
30	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,320	13,449.86	165,702,324	12,976.60	159,871,786	0.77

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.22
合計	99.22

(参考) 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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	11,780	17,561.90	206,879,286	17,564.83	206,913,733	4.35
2	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	20,200	6,940.25	140,193,194	7,043.76	142,283,952	2.99
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	5,625	22,315.94	125,527,181	23,069.40	129,765,381	2.72
4	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	13,890	6,955.41	96,610,690	6,937.23	96,358,180	2.02
5	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	5,210	19,110.75	99,567,058	18,028.98	93,930,996	1.97
6	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	7,750	12,195.16	94,512,508	11,741.77	90,998,748	1.91
7	フランス	投資証券	UNIBAIL RODAMCO-NA	3,760	26,444.33	99,430,710	24,186.42	90,940,941	1.91
8	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	13,990	6,968.98	97,496,150	6,254.59	87,501,826	1.83
9	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	13,480	6,511.32	87,772,598	5,957.84	80,311,778	1.68
10	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	5,840	13,430.68	78,435,181	13,275.53	77,529,101	1.63
11	香港	投資証券	LINK REIT	81,000	943.21	76,400,370	954.95	77,351,558	1.62
12	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	202,300	337.51	68,279,440	345.04	69,802,907	1.46
13	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,509	26,569.94	66,663,993	26,229.31	65,809,339	1.38
14	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	27,480	2,120.55	58,272,939	2,371.83	65,177,998	1.37
15	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	10,810	5,951.97	64,340,899	5,840.45	63,135,275	1.32
16	アメリカ	投資証券	GGP INC	23,600	2,417.22	57,046,402	2,243.56	52,948,205	1.11
17	オーストラリア	投資証券	WESTFIELD CORP	71,300	714.08	50,914,310	727.97	51,904,546	1.09
18	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	3,800	13,685.76	52,005,906	13,623.37	51,768,810	1.08
19	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,740	9,166.12	43,447,455	10,537.37	49,947,172	1.05
20	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	6,510	8,040.60	52,344,322	7,548.12	49,138,313	1.03
21	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	59,900	697.24	41,764,804	765.85	45,874,715	0.96
22	アメリカ	投資証券	HCP INC	17,530	2,807.62	49,217,730	2,605.53	45,675,099	0.96
23	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	4,250	10,792.84	45,869,584	10,216.71	43,421,030	0.91
24	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	13,350	2,989.47	39,909,455	3,078.38	41,096,426	0.86
25	アメリカ	投資証券	UDR INC	10,030	4,084.77	40,970,248	3,961.02	39,729,111	0.83
26	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	10,540	4,064.56	42,840,529	3,641.45	38,380,883	0.80
27	イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	28,000	1,401.30	39,236,664	1,349.75	37,793,188	0.79

28	イギリス	投資証券	BRITISH LAND	37,100	933.63	34,637,798	974.91	36,169,259	0.76
29	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	3,380	10,831.26	36,609,659	10,571.07	35,730,233	0.75
30	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	2,740	13,629.58	37,345,059	12,976.60	35,555,900	0.74

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.06
合計	97.06

【投資不動産物件】

インデックス・ブレンド(タイプ)

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)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)外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

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)米国株式配当貴族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)国内債券NOMURA - BPI総合マザーファンド

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）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

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）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米国ハイ・イールド債券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）J - R E I T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R E I T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R E I Tインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

インデックス・ブレンド（タイプ ）

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(2018年06月限)	買建	450	日本円	7,990,900,572	7,850,250,000	2.09

（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(2018年06月限)	買建	530	米ドル	70,600,950	7,674,323,264	72,199,250	7,848,058,470	1.62
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2018年06月限)	買建	28	カナダドル	5,164,240	435,603,644	5,309,920	447,891,752	0.09
	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(2018年06月限)	買建	346	ユーロ	11,744,290	1,488,353,874	11,840,120	1,500,498,399	0.31
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200株価指数先物(2018年06月限)	買建	25	豪ドル	3,682,575	303,260,051	3,746,875	308,555,151	0.06
	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(2018年06月限)	買建	75	英ポンド	5,504,710	795,760,878	5,740,875	829,900,879	0.17
	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(2018年06月限)	買建	38	スイスフラン	3,300,890	363,262,941	3,263,060	359,099,746	0.07

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

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(2018年06月限)	買建	24	米ドル	3,266,200	355,035,941	3,269,400	355,383,778	0.82
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2018年06月限)	買建	1	カナダドル	188,180	15,872,983	189,640	15,996,134	0.03
	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(2018年06月限)	買建	16	ユーロ	564,970	71,598,648	547,520	69,387,206	0.16

オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2018年06月限)	買建		2豪ドル	302,500	24,910,875	299,750	24,684,412	0.05
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(2018年06月限)	買建		4英ポンド	310,255	44,850,463	306,180	44,261,380	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(2018年06月限)	買建		2スイスフラン	179,550	19,759,477	171,740	18,899,986	0.04

(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GINGマーケット株価指数先物(2018年06月限)	買建	136	米ドル	7,734,995	840,793,951	7,618,040	828,080,941	2.51

(参考) 米国株式配当貴族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	シカゴマーカントイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2018年06月限)	買建	2	米ドル	267,150	29,039,204	272,450	29,615,314	0.63

(参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 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) 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

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）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）米国ハイ・イールド債券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）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(2018年06月限)	買建	424	日本円	701,002,592	735,216,000	2.21

（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(2018年06月限)	買建	36	米ドル	1,083,800	117,809,060	1,114,200	121,113,540	0.58
	フラン ス	Euronext	FTSE EPRA/NAREIT 欧州指数先物(2018 年06月限)	買建	7	ユーロ	152,150	19,281,969	155,155	19,662,791	0.09

（参考）海外R E I Tインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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(2018年06月限)	買建	24	米ドル	710,850	77,269,395	742,800	80,742,360	1.69
	フランス	Euronext	FTSE EPRA/NAREIT 欧州指数先物(2018 年06月限)	買建	3	ユーロ	62,355	7,902,249	66,495	8,426,911	0.17

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

インデックス・ブレンド(タイプ)

2018年5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	(2017年 4月24日)	1	1	1.0002	1.0002
第2計算期間	(2018年 4月23日)	67	67	1.0242	1.0242
	2017年 5月末日	3		1.0100	
	6月末日	6		1.0119	
	7月末日	8		1.0137	
	8月末日	20		1.0183	
	9月末日	39		1.0244	
	10月末日	46		1.0329	
	11月末日	59		1.0364	
	12月末日	59		1.0428	
	2018年 1月末日	63		1.0392	
	2月末日	65		1.0263	
	3月末日	67		1.0213	
	4月末日	71		1.0266	
	5月末日	71		1.0248	

インデックス・ブレンド(タイプ)

2018年5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	(2017年 4月24日)	1	1	0.9998	0.9998
第2計算期間	(2018年 4月23日)	78	78	1.0402	1.0402
	2017年 5月末日	1		1.0154	
	6月末日	1		1.0199	
	7月末日	8		1.0224	
	8月末日	10		1.0266	
	9月末日	19		1.0383	
	10月末日	19		1.0510	
	11月末日	38		1.0551	
	12月末日	43		1.0649	
	2018年 1月末日	46		1.0633	
	2月末日	51		1.0436	
	3月末日	76		1.0332	
	4月末日	86		1.0439	
	5月末日	92		1.0411	

インデックス・ブレード（タイプ ）

2018年5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	(2017年 4月24日)	2	2	0.9986	0.9986
第2計算期間	(2018年 4月23日)	182	182	1.0534	1.0534
	2017年 5月末日	3		1.0187	
	6月末日	5		1.0269	
	7月末日	23		1.0287	
	8月末日	52		1.0320	
	9月末日	84		1.0490	
	10月末日	88		1.0652	
	11月末日	125		1.0712	
	12月末日	134		1.0847	
	2018年 1月末日	143		1.0840	
	2月末日	156		1.0578	
	3月末日	178		1.0427	
	4月末日	182		1.0586	
	5月末日	184		1.0552	

インデックス・ブレード（タイプ ）

2018年5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 (2017年 4月24日)	3	3	0.9989	0.9989
第2計算期間 (2018年 4月23日)	31	31	1.0646	1.0646
2017年 5月末日	4		1.0225	
6月末日	7		1.0313	
7月末日	10		1.0367	
8月末日	10		1.0395	
9月末日	9		1.0613	
10月末日	13		1.0804	
11月末日	18		1.0868	
12月末日	21		1.1027	
2018年 1月末日	27		1.1018	
2月末日	34		1.0702	
3月末日	30		1.0519	
4月末日	31		1.0706	
5月末日	31		1.0666	

インデックス・ブレード（タイプ ）

2018年5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 (2017年 4月24日)	2	2	0.9965	0.9965
第2計算期間 (2018年 4月23日)	114	114	1.0820	1.0820
2017年 5月末日	4		1.0259	
6月末日	6		1.0371	
7月末日	7		1.0432	
8月末日	11		1.0424	
9月末日	17		1.0712	
10月末日	23		1.0962	
11月末日	54		1.1040	
12月末日	62		1.1243	
2018年 1月末日	91		1.1293	
2月末日	94		1.0902	
3月末日	109		1.0649	
4月末日	121		1.0897	
5月末日	188		1.0830	

【分配の推移】

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0000円
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	0.0000円

【収益率の推移】

インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	2.4%

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。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.0%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	4.0%

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

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.1%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	5.5%

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。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.1%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	6.6%

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。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.4%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	8.6%

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】

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	1,871,229	22,136	1,849,093
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	84,588,270	20,341,137	66,096,226

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	1,140,737		1,140,737
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	81,863,323	7,157,724	75,846,336

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	2,616,123	11,615	2,604,508
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	222,742,777	52,396,644	172,950,641

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	3,911,186	6,532	3,904,654
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	40,547,035	15,185,160	29,266,529

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	2,529,296	151,621	2,377,675
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	107,829,976	4,387,951	105,819,700

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（2018年5月31日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）

— 基準価額（分配後、1万口あたり）（左軸） — 純資産総額（右軸）

■ タイプⅠ



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

■ タイプⅠ

2018年4月	0 円
2017年4月	0 円
--	--
--	--
設定来累計	0 円

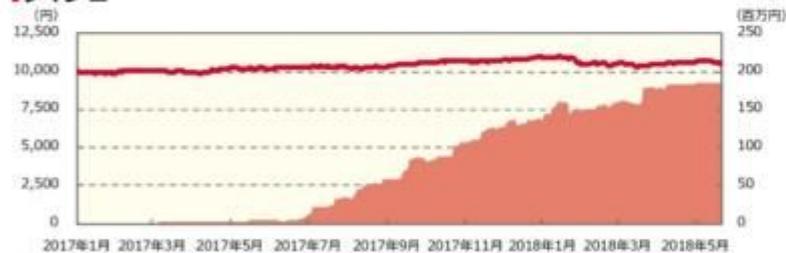
■ タイプⅡ



■ タイプⅡ

2018年4月	0 円
2017年4月	0 円
--	--
--	--
設定来累計	0 円

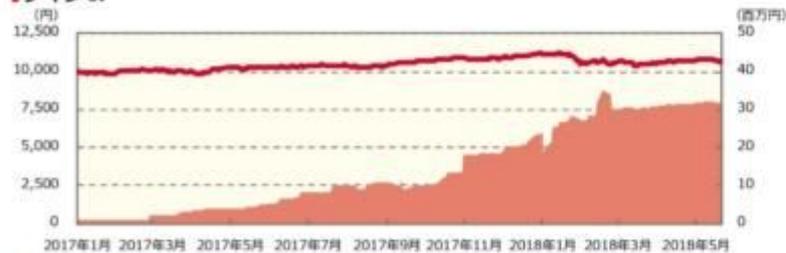
■ タイプⅢ



■ タイプⅢ

2018年4月	0 円
2017年4月	0 円
--	--
--	--
設定来累計	0 円

■ タイプⅣ



■ タイプⅣ

2018年4月	0 円
2017年4月	0 円
--	--
--	--
設定来累計	0 円

■ タイプⅤ



■ タイプⅤ

2018年4月	0 円
2017年4月	0 円
--	--
--	--
設定来累計	0 円

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

	投資比率 (%)				
	タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
国内株式マザーファンド	7.0	11.1	13.8	15.5	13.1
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	6.5	12.2	17.2	21.0	18.0
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	2.9	3.5	4.5	5.0	3.3
新興国株式マザーファンド	1.8	3.3	4.9	6.7	5.8
米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	1.4	2.5	3.0	3.0	3.3
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	46.5	37.1	27.5	20.1	7.1
外国債券マザーファンド	3.8	3.9	4.9	4.9	3.5
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	15.4	12.5	9.0	6.5	2.4
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	—	—	—	—	—
新興国債券マザーファンド	4.7	6.4	6.0	6.0	2.0
米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1.9	2.0	3.0	2.9	2.1
J-REITインデックスマザーファンド	1.9	2.5	2.5	3.5	2.7
海外REITインデックスマザーファンド	1.5	2.0	3.0	3.5	2.7
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	—	—	—	—	—

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 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.2	0.4	0.5	0.5	0.4
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.1	0.2	0.2	0.3	0.2
3	日本電信電話	情報・通信業	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2
4	ソニー	電気機器	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2

・「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 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.2	0.3	0.4	0.5	0.5
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.1	0.2	0.3	0.4	0.3
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.1	0.2	0.3	0.4	0.3
4	FACEBOOK INC-A	インターネットソフトウェア・サービス	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
5	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2

・「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1
4	FACEBOOK INC-A	インターネットソフトウェア・サービス	0.0	0.0	0.1	0.1	0.0
5	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

・「新興国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 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	TENCENT HOLDINGS LTD	インターネットソフトウェア・サービス	0.1	0.2	0.2	0.3	0.3
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネットソフトウェア・サービス	0.1	0.1	0.2	0.3	0.2
3	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.1	0.1	0.2	0.3	0.2
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
5	NASPERS LTD-N SHS	メディア	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1

・「米国株式配当貴族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	業種	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	LOWES COS INC	専門小売り	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1
2	T ROWE PRICE GROUP INC	資本市場	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1
3	AUTOMATIC DATA PROCESS	情報技術サービス	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1
4	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1
5	CLOROX CO	家庭用品	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1

・「国内債券NOMURA-BPI総合 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 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	国庫債券 利付（5年）第122回	国債証券	0.7	0.5	0.4	0.3	0.1
2	国庫債券 利付（5年）第123回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1
3	国庫債券 利付（5年）第125回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1
4	国庫債券 利付（10年）第345回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1
5	国庫債券 利付（10年）第347回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1

・「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 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
5	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

・「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.2	0.1	0.1	0.0
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1	0.0
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1	0.0
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1	0.0
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1	0.0

・「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 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.0
2	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.0
3	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.0
4	REPUBLIC OF PHILIPPINES	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.0
5	UNITED MEXICAN STATES	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.0

・「米国ハイ・イールド債券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 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	INTERNATIONAL GAME TECH	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
2	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3	JAGUAR LAND ROVER AUTOMO	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
4	ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
5	NUMERICABLE-SFR SA	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じた投資銘柄

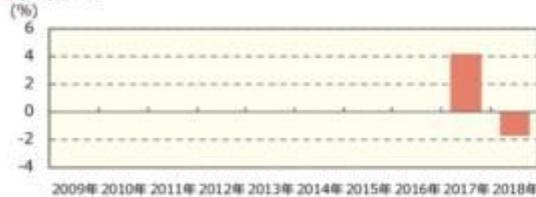
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.2	0.2
3	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.1
4	日本リートファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.1
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.1

・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じた投資銘柄

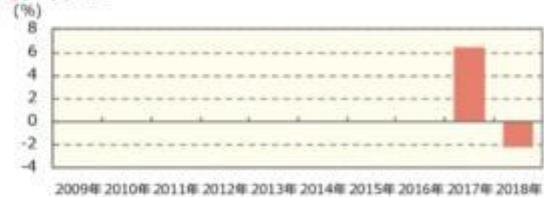
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.1
2	PROLOGIS INC	投資証券	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1
4	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1

■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)

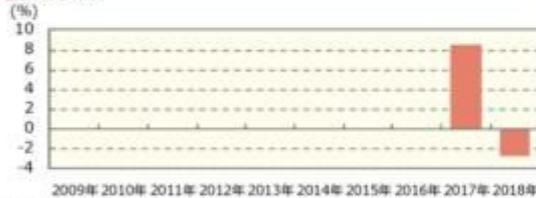
■ タイプⅠ



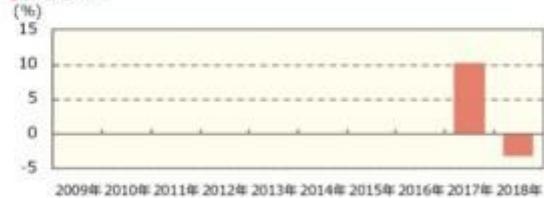
■ タイプⅡ



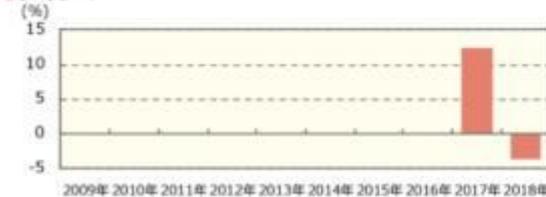
■ タイプⅢ



■ タイプⅣ



■ タイプⅤ



- ・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。
- ・2017年は設定日（2017年1月10日）から年末までの収益率。
- ・2018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。●グラフの縦軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

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。
- ・ 販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則として取得およびスイッチングの申込みができません。

申込日当日あるいは申込日の翌営業日が以下のいずれかの休業日と同日の場合

- ・ ロンドン証券取引所
- ・ ロンドンの銀行
- ・ ニューヨーク証券取引所
- ・ ニューヨークの銀行

申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 販売の単位は、1万口以上1口単位（当初元本1口＝1円）または1万円以上1円単位とします。
- ・ 販売会社によっては、一部のファンドのみのお取扱いとなる場合があります。

積立方式

販売会社によっては、「定時定額購入サービス」等に関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込の単位でお申込みいただけます。

当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあります。

- ・ 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。
- ・ 販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。
詳しくは販売会社にお問い合わせください。

- ・ 「インデックス・ブレンド」を構成する各ファンド間でスイッチングができます。

スイッチングの方法等は、購入、換金の場合と同様です。

販売会社によっては、一部または全部のスイッチングのお取扱いを行わない場合があります。

なお、スイッチングの際には、換金時と同様の費用・税金がかかりますのでご留意下さい。（詳しくは「第1 ファンドの状況 4 手数料等及び税金」をご覧ください。）

スイッチングとは、「インデックス・ブレンド」を構成するいずれかのファンドをご換金した場合の手取金をもって、そのご換金のお申込み日の午後3時まで、「インデックス・ブレンド」を構成する他のファンドの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いいます。

- ・ 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、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。）、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、受益権の取得申込の受付け（スイッチングの申込みを含みます。）を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付け（スイッチングの申込みを含みます。）を取り消す場合があります。

購入およびスイッチング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。

2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、委託者に1口単位または1円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けについては、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け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。
- ただし、販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として受益権の一部解約の実行の請求ができません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）
- ・換金価額は、換金申込日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額となります。

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/>

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金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7営業日目から販売会社において支払います。
 - ・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、一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消す場合があります。
- また、一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受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。

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したが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1万口当た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(2017年1月10日設定)。

（４）【計算期間】

原則として、毎年4月23日から翌年4月22日までとします。

なお、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。ただし、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、信託契約締結日から3年を経過した日以降において、信託契約の一部を解約することにより各ファンドにつき受益権の口数が30億口を下回った場合、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、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發します。

（ ）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な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

各ファンドにつき、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、
- () 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れ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、知れ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つても、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」にしたがい、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、
- () 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の請求を行な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。

なお、運用の外部委託を行なう場合は、委託者と運用の委託先との間で締結する「運用指図に関する権限の委託契約」は、契約終了の3ヵ月前までに当事者の一方から更新しない旨を書面によって通知がない限り、1年毎に自動的に更新されるものとします。但し、当該契約はファンドの償還日に終了するものとします。

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、決算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(当該収益分配金にかかる決算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、当該収益分配金にかかる決算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します。)に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取りください。

累積投資契約を結んでいる場合には、税金を差引いた後、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します。)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

受益者は、一部解約の実行を請求することができます。詳しくは、前述の「2 換金(解約)手続

等」をご参照下さい。

第3【ファンドの経理状況】

インデックス・ブレード(タイプ)

インデックス・ブレード(タイプ)

インデックス・ブレード(タイプ)

インデックス・ブレード(タイプ)

インデックス・ブレード(タイプ)

(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2期計算期間(2017年4月25日から2018年4月23日まで)の財務諸表について、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】

【インデックス・ブレード（タイプ ）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 (2017年 4月24日現在)	第2期 (2018年 4月23日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,754	628,906
親投資信託受益証券	1,824,925	67,263,135
派生商品評価勘定	593	310
未収入金	-	29,306
流動資産合計	1,853,272	67,921,657
資産合計	1,853,272	67,921,657
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,421	67,931
未払受託者報酬	169	9,786
未払委託者報酬	2,208	146,711
未払利息	-	1
その他未払費用	73	911
流動負債合計	3,871	225,340
負債合計	3,871	225,340
純資産の部		
元本等		
元本	1,849,093	66,096,226
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	308	1,600,091
（分配準備積立金）	6,878	481,093
元本等合計	1,849,401	67,696,317
純資産合計	1,849,401	67,696,317
負債純資産合計	1,853,272	67,921,657

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期		第2期	
	自	2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	自	2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
営業収益				
有価証券売買等損益		4,925		118,210
為替差損益		4,412		68,471
営業収益合計		9,337		186,681
営業費用				
支払利息		1		297
受託者報酬		169		12,156
委託者報酬		2,208		182,135
その他費用		73		14,110
営業費用合計		2,451		208,698
営業利益又は営業損失 ()		6,886		22,017
経常利益又は経常損失 ()		6,886		22,017
当期純利益又は当期純損失 ()		6,886		22,017
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 ()		8		228,033
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		308
剰余金増加額又は欠損金減少額		79		2,260,601
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		79		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		-		2,260,601
剰余金減少額又は欠損金増加額		6,649		410,768
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		410,768
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		6,649		-
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		308		1,600,091

(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、2017年4月25日から2018年4月23日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年4月24日現在	第2期 2018年4月23日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,849,093口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 66,096,226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 1.0002円 (10,000口当たり純資産額) (10,002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 1.0242円 (10,000口当たり純資産額) (10,242円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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>6,871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>7円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,158円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>0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>8,036円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,849,093口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	6,871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	7円	収益調整金額	C	1,158円	分配準備積立金額	D	0円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,036円	当ファンドの期末残存口数	F	1,849,093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>477,052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>1,118,998円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>4,041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>1,600,091円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>66,096,226口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	477,052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	1,118,998円	分配準備積立金額	D	4,041円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,600,091円	当ファンドの期末残存口数	F	66,096,226口
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	6,871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	7円																																									
収益調整金額	C	1,158円																																									
分配準備積立金額	D	0円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,036円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	1,849,093口																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	477,052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	1,118,998円																																									
分配準備積立金額	D	4,041円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,600,091円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	66,096,226口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	43円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	242円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

2. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
<p>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。</p> <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。</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>これらは、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。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに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>	<p>1. 金融商品に対する取組方針 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 同左</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 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	同左
---	----

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年 4月24日現在	第2期 2018年 4月23日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日		第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	
期首元本額	- 円	期首元本額	1,849,093円
期中追加設定元本額	1,871,229円	期中追加設定元本額	84,588,270円
期中一部解約元本額	22,136円	期中一部解約元本額	20,341,137円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	第1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	4,975	51,937
合計	4,975	51,937

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1期(2017年 4月24日現在)				第2期(2018年 4月23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	125,135	-	125,963	828	3,600,231	-	3,667,852	67,621
米ドル	125,135	-	125,963	828	3,600,231	-	3,667,852	67,621
合計	125,135	-	125,963	828	3,600,231	-	3,667,852	67,621

（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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2018年4月23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	3,020,241	5,143,772	
		外国債券マザーファンド	1,203,696	2,689,297	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,327,275	3,390,922	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	24,864,901	32,575,506	
		J-REITインデックスマザーファンド	669,940	1,328,758	
		海外REITインデックスマザーファンド	496,947	1,010,740	
		外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1,515,437	2,727,635	
		新興国株式マザーファンド	1,261,547	1,674,325	
		新興国債券マザーファンド	2,287,392	4,055,088	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	9,491,565	10,620,112	
		米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	605,424	686,671	
		米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	1,248,334	1,360,309	
	小計	銘柄数: 12 組入時価比率: 99.4%	47,992,699	67,263,135 100.0%	
合計			67,263,135		

(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。

【インデックス・ブレード(タイプ)】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第1期 (2017年 4月24日現在)	第2期 (2018年 4月23日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	17,085	626,620
親投資信託受益証券	1,125,552	78,439,331
派生商品評価勘定	636	2,849
未収入金	-	23,582
流動資産合計	1,143,273	79,092,382
資産合計	1,143,273	79,092,382
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,107	72,270
未払受託者報酬	104	7,633
未払委託者報酬	1,458	116,875
未払利息	-	1
その他未払費用	73	709
流動負債合計	2,742	197,488
負債合計	2,742	197,488
純資産の部		
元本等		
元本	1,140,737	75,846,336
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	206	3,048,558
(分配準備積立金)	5,312	394,440
元本等合計	1,140,531	78,894,894
純資産合計	1,140,531	78,894,894
負債純資産合計	1,143,273	79,092,382

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,448	2,221
為替差損益	4,125	86,796
営業収益合計	1,677	84,575
営業費用		
支払利息	1	283
受託者報酬	104	8,816
委託者報酬	1,458	135,004
その他費用	73	13,824
営業費用合計	1,636	157,927
営業利益又は営業損失（ ）	41	73,352
経常利益又は経常損失（ ）	41	73,352
当期純利益又は当期純損失（ ）	41	73,352
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（ ）	-	130,940
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	206
剰余金増加額又は欠損金減少額	-	3,501,168
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	3,501,168
剰余金減少額又は欠損金増加額	247	248,112
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	248,112
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	247	-
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	206	3,048,558

(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、2017年 4月25日から2018年 4月23日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年 4月24日現在	第2期 2018年 4月23日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,140,737口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 75,846,336口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 206円	
3. 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 0.9998円 (10,000口当たり純資産額) (9,998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 1.0402円 (10,000口当たり純資産額) (10,402円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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>5,312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> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	5,312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	<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>390,412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> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	390,412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
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	5,312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																	
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	390,412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	213円
分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,525円
当ファンドの期末残存口数	F	1,140,737口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	48円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円

収益調整金額	C	2,654,118円
分配準備積立金額	D	4,028円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,048,558円
当ファンドの期末残存口数	F	75,846,336口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	401円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円

2. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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>これらは、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。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに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>	<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>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	同左
---	----

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年 4月24日現在	第2期 2018年 4月23日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日		第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	
期首元本額	- 円	期首元本額	1,140,737円
期中追加設定元本額	1,140,737円	期中追加設定元本額	81,863,323円
期中一部解約元本額	0円	期中一部解約元本額	7,157,724円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	第1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	2,038	48,015
合計	2,038	48,015

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1期(2017年 4月24日現在)				第2期(2018年 4月23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	106,877	-	107,348	471	5,287,628	-	5,357,049	69,421
米ドル	106,877	-	107,348	471	5,287,628	-	5,357,049	69,421
合計	106,877	-	107,348	471	5,287,628	-	5,357,049	69,421

（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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2018年4月23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	5,359,776	9,128,234	
		外国債券マザーファンド	1,400,024	3,127,933	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	3,245,001	8,290,328	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	22,076,483	28,922,400	
		J-REITインデックスマザーファンド	994,030	1,971,559	
		海外REITインデックスマザーファンド	768,217	1,562,476	
		外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1,974,008	3,553,016	
		新興国株式マザーファンド	2,355,597	3,126,348	
		新興国債券マザーファンド	3,305,389	5,859,793	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	8,706,723	9,741,952	
		米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	695,924	789,317	
		米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	2,171,217	2,365,975	
	小計	銘柄数:12 組入時価比率:99.4%	53,052,389	78,439,331 100.0%	
合計			78,439,331		

(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。

【インデックス・ブレード（タイプ ）】

（ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 (2017年 4月24日現在)	第2期 (2018年 4月23日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	38,774	1,735,202
親投資信託受益証券	2,561,385	181,164,275
派生商品評価勘定	4,749	3,843
未収入金	-	93,468
流動資産合計	2,604,908	182,996,788
資産合計	2,604,908	182,996,788
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,346	127,514
未払解約金	-	301,462
未払受託者報酬	154	22,942
未払委託者報酬	2,450	359,321
未払利息	-	3
その他未払費用	73	2,229
流動負債合計	4,023	813,471
負債合計	4,023	813,471
純資産の部		
元本等		
元本	2,604,508	172,950,641
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,623	9,232,676
（分配準備積立金）	10,821	1,422,353
元本等合計	2,600,885	182,183,317
純資産合計	2,600,885	182,183,317
負債純資産合計	2,604,908	182,996,788

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	自	2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
営業収益				
有価証券売買等損益		14,615		764,890
為替差損益		8,443		258,820
営業収益合計		6,172		1,023,710
営業費用				
支払利息		2		1,139
受託者報酬		154		28,057
委託者報酬		2,450		439,489
その他費用		73		15,694
営業費用合計		2,679		484,379
営業利益又は営業損失（ ）		8,851		539,331
経常利益又は経常損失（ ）		8,851		539,331
当期純利益又は当期純損失（ ）		8,851		539,331
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（ ）		99		1,305,039
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		3,623
剰余金増加額又は欠損金減少額		5,129		12,653,873
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		25		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,104		12,653,873
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		2,651,866
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		2,651,866
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,623		9,232,676

(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、2017年4月25日から2018年4月23日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年4月24日現在	第2期 2018年4月23日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,604,508口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 172,950,641口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 3,623円	
3. 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 0.9986円 (10,000口当たり純資産額) (9,986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 1.0534円 (10,000口当たり純資産額) (10,534円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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>10,821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> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	10,821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	<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>1,416,709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> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,416,709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
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	10,821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																	
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	1,416,709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	3,898円
分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,719円
当ファンドの期末残存口数	F	2,604,508口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	56円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円

収益調整金額	C	7,810,323円
分配準備積立金額	D	5,644円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,232,676円
当ファンドの期末残存口数	F	172,950,641口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	533円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円

2. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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>これらは、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。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに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>	<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>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	同左
---	----

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年 4月24日現在	第2期 2018年 4月23日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日		第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	
期首元本額	- 円	期首元本額	2,604,508円
期中追加設定元本額	2,616,123円	期中追加設定元本額	222,742,777円
期中一部解約元本額	11,615円	期中一部解約元本額	52,396,644円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	第1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	13,569	122,361
合計	13,569	122,361

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1期(2017年 4月24日現在)				第2期(2018年 4月23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	235,777	-	232,374	3,403	11,273,540	-	11,397,211	123,671
米ドル	235,777	-	232,374	3,403	11,273,540	-	11,397,211	123,671
合計	235,777	-	232,374	3,403	11,273,540	-	11,397,211	123,671

（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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2018年4月23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	15,022,993	25,585,659	
		外国債券マザーファンド	4,017,892	8,976,774	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	10,689,896	27,310,546	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	37,827,958	49,558,407	
		J-REITインデックスマザーファンド	2,321,418	4,604,300	
		海外REITインデックスマザーファンド	2,652,342	5,394,598	
		外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	5,561,593	10,010,311	
		新興国株式マザーファンド	7,823,285	10,383,063	
		新興国債券マザーファンド	7,143,412	12,663,840	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	14,451,833	16,170,155	
		米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	3,188,052	3,615,888	
		米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	6,323,515	6,890,734	
	小計	銘柄数:12 組入時価比率:99.4%	117,024,189	181,164,275 100.0%	
合計			181,164,275		

(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。

【インデックス・ブレード（タイプ ）】

（ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 (2017年 4月24日現在)	第2期 (2018年 4月23日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	58,209	288,343
親投資信託受益証券	3,841,196	30,935,771
派生商品評価勘定	4,883	938
未収入金	-	17,260
流動資産合計	3,904,288	31,242,312
資産合計	3,904,288	31,242,312
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	1,067	18,922
未払受託者報酬	174	3,930
未払委託者報酬	2,680	62,905
その他未払費用	73	328
流動負債合計	3,994	86,085
負債合計	3,994	86,085
純資産の部		
元本等		
元本	3,904,654	29,266,529
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,360	1,889,698
（分配準備積立金）	11,585	278,678
元本等合計	3,900,294	31,156,227
純資産合計	3,900,294	31,156,227
負債純資産合計	3,904,288	31,242,312

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位 : 円)

	第1期		第2期	
	自	2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	自	2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
営業収益				
有価証券売買等損益		21,804		103,425
為替差損益		7,695		49,162
営業収益合計		14,109		54,263
営業費用				
支払利息		2		117
受託者報酬		174		5,191
委託者報酬		2,680		83,040
その他費用		73		13,431
営業費用合計		2,929		101,779
営業利益又は営業損失 ()		17,038		156,042
経常利益又は経常損失 ()		17,038		156,042
当期純利益又は当期純損失 ()		17,038		156,042
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 ()		41		223,080
期首剰余金又は期首欠損金 ()		-		4,360
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,719		3,097,726
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1		-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,718		3,097,726
剰余金減少額又は欠損金増加額		-		824,546
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		-		824,546
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金 ()		4,360		1,889,698

(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、2017年 4月25日から2018年 4月23日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年 4月24日現在	第2期 2018年 4月23日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 3,904,654口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 29,266,529口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 4,360円	
3. 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 0.9989円 (10,000口当たり純資産額) (9,989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 1.0646円 (10,000口当たり純資産額) (10,646円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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>11,585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> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	11,585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	<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>274,039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> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	274,039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
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	11,585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																	
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	274,039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	5,525円
分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,110円
当ファンドの期末残存口数	F	3,904,654口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	43円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

2. その他費用

該当事項はありません。

3. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

収益調整金額	C	1,611,020円
分配準備積立金額	D	4,639円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,889,698円
当ファンドの期末残存口数	F	29,266,529口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	645円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

2. その他費用

その他費用のうち12,960円は、L E I 取得費用であります。

(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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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>これらは、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。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに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>	<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>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	同左
---	----

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年 4月24日現在	第2期 2018年 4月23日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日		第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	
期首元本額	- 円	期首元本額	3,904,654円
期中追加設定元本額	3,911,186円	期中追加設定元本額	40,547,035円
期中一部解約元本額	6,532円	期中一部解約元本額	15,185,160円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	第1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	20,394	235,466
合計	20,394	235,466

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1期(2017年 4月24日現在)				第2期(2018年 4月23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	317,220	-	313,404	3,816	1,926,642	-	1,944,626	17,984
米ドル	317,220	-	313,404	3,816	1,926,642	-	1,944,626	17,984
合計	317,220	-	313,404	3,816	1,926,642	-	1,944,626	17,984

（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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2018年4月23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	2,924,990	4,981,550	
		外国債券マザーファンド	687,800	1,536,682	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,247,109	5,740,914	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	4,702,784	6,161,117	
		J-REITインデックスマザーファンド	547,542	1,085,994	
		海外REITインデックスマザーファンド	526,561	1,070,972	
		外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1,030,543	1,854,874	
		新興国株式マザーファンド	1,878,464	2,493,097	
		新興国債券マザーファンド	1,221,005	2,164,597	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1,780,091	1,991,743	
		米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	546,944	620,343	
		米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	1,132,319	1,233,888	
	小計	銘柄数: 12 組入時価比率: 99.3%	19,226,152	30,935,771 100.0%	
合計			30,935,771		

(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。

【インデックス・ブレード（タイプ ）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第1期 (2017年 4月24日現在)	第2期 (2018年 4月23日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	65,100	1,023,678
親投資信託受益証券	2,336,750	113,695,290
派生商品評価勘定	1,071	3,638
未収入金	-	20,435
流動資産合計	2,402,921	114,743,041
資産合計	2,402,921	114,743,041
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	985	41,001
未払解約金	29,542	1,962
未払受託者報酬	172	11,922
未払委託者報酬	2,696	194,635
未払利息	-	1
その他未払費用	73	1,129
流動負債合計	33,468	250,650
負債合計	33,468	250,650
純資産の部		
元本等		
元本	2,377,675	105,819,700
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,222	8,672,691
（分配準備積立金）	12,419	793,208
元本等合計	2,369,453	114,492,391
純資産合計	2,369,453	114,492,391
負債純資産合計	2,402,921	114,743,041

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期		第2期	
	自	2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	自	2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
営業収益				
有価証券売買等損益		10,250		1,045,460
為替差損益		3,897		78,753
営業収益合計		6,353		966,707
営業費用				
支払利息		1		348
受託者報酬		172		13,315
委託者報酬		2,696		217,417
その他費用		73		14,243
営業費用合計		2,942		245,323
営業利益又は営業損失（ ）		9,295		1,212,030
経常利益又は経常損失（ ）		9,295		1,212,030
当期純利益又は当期純損失（ ）		9,295		1,212,030
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（ ）		843		87,486
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		-		8,222
剰余金増加額又は欠損金減少額		266		10,219,239
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		266		10,219,239
剰余金減少額又は欠損金増加額		36		238,810
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		36		238,810
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,222		8,672,691

(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、2017年 4月25日から2018年 4月23日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 2017年 4月24日現在	第2期 2018年 4月23日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,377,675口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 105,819,700口
2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10号に規定する額 元本の欠損 8,222円	
3. 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 0.9965円 (10,000口当たり純資産額) (9,965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 1.0820円 (10,000口当たり純資産額) (10,820円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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>12,419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> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	12,419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	<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>782,644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> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	782,644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
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	12,419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																	
項目																			
費用控除後の配当等収益額	A	782,644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	3,205円
分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,624円
当ファンドの期末残存口数	F	2,377,675口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	65円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

収益調整金額	C	7,879,483円
分配準備積立金額	D	10,564円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	8,672,691円
当ファンドの期末残存口数	F	105,819,700口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	819円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円

2. 追加情報

2016年1月29日の日本銀行による「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」の導入発表後、国内短期金融市場では利回り水準が低下しております。この影響により、利息に相当する額を当ファンドが実質的に負担する場合には受取利息のマイナスまたは支払利息として表示しております。

(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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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>これらは、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。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに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>	<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>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	同左
---	----

(2)金融商品の時価等に関する事項

第1期 2017年 4月24日現在	第2期 2018年 4月23日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日		第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	
期首元本額	- 円	期首元本額	2,377,675円
期中追加設定元本額	2,529,296円	期中追加設定元本額	107,829,976円
期中一部解約元本額	151,621円	期中一部解約元本額	4,387,951円

2 有価証券関係 売買目的有価証券

種類	第1期 自 2017年 1月10日 至 2017年 4月24日	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
	損益に含まれた評価差額（円）	
親投資信託受益証券	8,802	768,909
合計	8,802	768,909

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1期(2017年 4月24日現在)				第2期(2018年 4月23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	122,817	-	122,731	86	4,092,946	-	4,130,309	37,363
米ドル	122,817	-	122,731	86	4,092,946	-	4,130,309	37,363
合計	122,817	-	122,731	86	4,092,946	-	4,130,309	37,363

（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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券(2018年4月23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	13,399,946	22,821,448	
		外国債券マザーファンド	2,658,911	5,940,538	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	10,665,374	27,247,897	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	9,110,278	11,935,375	
		J-REITインデックスマザーファンド	2,312,532	4,586,675	
		海外REITインデックスマザーファンド	2,205,459	4,485,683	
		外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	3,777,557	6,799,224	
		新興国株式マザーファンド	8,647,370	11,476,789	
		新興国債券マザーファンド	2,569,565	4,555,324	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	3,538,162	3,958,849	
		米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	2,257,991	2,561,013	
		米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	6,723,388	7,326,475	
	小計	銘柄数:12 組入時価比率:99.3%	67,866,533	113,695,290 100.0%	
合計			113,695,290		

(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）

「インデックス・ブレンド(タイプ)」、「インデックス・ブレンド(タイプ)」、「インデックス・ブレンド(タイプ)」、「インデックス・ブレンド(タイプ)」、「インデックス・ブレンド(タイプ)」は「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド」、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「米国株式配当貴族インデックスマザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」および「海外REITインデックスマザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
(2018年 4月23日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	17,574,935,157
株式	361,367,344,570
派生商品評価勘定	170,275,701
未収入金	1,944,912
未収配当金	3,225,336,353
未収利息	1,173,651
その他未収収益	69,484,526
流動資産合計	382,410,494,870
資産合計	382,410,494,870
負債の部	
流動負債	
前受金	9,287,797
未払金	9,910,316
未払解約金	1,741,801,100
未払利息	31,808
有価証券貸借取引受入金	13,387,390,483
流動負債合計	15,148,421,504
負債合計	15,148,421,504
純資産の部	
元本等	
元本	215,644,608,041
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	151,617,465,325
元本等合計	367,262,073,366
純資産合計	367,262,073,366
負債純資産合計	382,410,494,870

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 受取配当金は、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。 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)

2018年 4月23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	1.7031円
(10,000口当たり純資産額)	(17,031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	12,742,705,940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 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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。

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

2018年 4月23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。
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

2018年 4月23日現在	
期首	2017年 4月25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	223,152,690,363円
同期中における追加設定元本額	34,479,832,796円
同期中における一部解約元本額	41,987,915,118円
期末元本額	215,644,608,041円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	161,038,747円
バランスセレクト50	368,044,864円
バランスセレクト70	462,567,163円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,360,882,283円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	3,466,594,609円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	6,813,739,615円

野村資産設計ファンド2015	54,640,502円
野村資産設計ファンド2020	64,492,337円
野村資産設計ファンド2025	93,750,153円
野村資産設計ファンド2030	99,066,173円
野村資産設計ファンド2035	74,853,366円
野村資産設計ファンド2040	187,676,351円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)	75,587,224,718円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	2,441,723,184円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	5,551,932,077円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	1,604,774,961円
野村資産設計ファンド2045	24,560,706円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,583,999,705円
マイ・ロード	3,465,085,267円
ネクストコア	123,060,024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	655,342,537円
野村日本株インデックス(野村SMA・EW向け)	1,249,985,393円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,107,820,565円
野村資産設計ファンド2050	36,220,264円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	12,858,770円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	3,888,396円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,638,440円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,537,985円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	217,315,834円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	173,798,212円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,020,241円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,359,776円
インデックス・ブレンド(タイプ)	15,022,993円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,924,990円
インデックス・ブレンド(タイプ)	13,399,946円
野村6資産均等バランス	53,032,413円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	159,481,886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)	513,826,326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)	464,998,631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)	1,214,564,359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)	824,940,933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)	3,860,509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)	15,850,355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)	2,640,887円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,334,659,861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)	126,693,342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)	828,707,699円
野村日本株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	911,006,500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)	1,561,984,450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)	305,634,175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)	118,487,021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)	297,831,961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)	4,868,482,022円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	669,255,448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)	513,191,201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)	1,731,380,472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)	1,066,166,963円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,081,082,228円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,096,426円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	29,644,638円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	38,867,396円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	102,695,532円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,114,953,174円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,738,350,489円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	17,354,227,936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)	31,872,138,469円
マイバランスDC30	2,704,634,905円
マイバランスDC50	3,659,982,029円
マイバランスDC70	3,551,961,146円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	9,500,345,528円
野村DC運用戦略ファンド	756,459,750円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	22,567,400円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	341,566,920円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	27,314,759円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	53,637,655円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	577,315円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	552,660円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	3,228,261円
野村資産設計ファンド(DC)2030	404,201円
野村資産設計ファンド(DC)2040	596,426円
野村資産設計ファンド(DC)2050	1,186,509円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	1,532,114円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	650,057円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	306,583円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	528,974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(2018年4月23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	6,400	3,705.00	23,712,000	貸付有価証券 2,000株
		日本水産	182,100	583.00	106,164,300	

マルハニチロ	30,700	3,695.00	113,436,500	
カネコ種苗	5,500	1,598.00	8,789,000	
サカタのタネ	23,900	3,950.00	94,405,000	貸付有価証券 500株(300株)
ホクト	16,500	1,964.00	32,406,000	
ホクリヨウ	2,300	1,286.00	2,957,800	貸付有価証券 100株(100株)
住石ホールディングス	42,300	170.00	7,191,000	貸付有価証券 14,900株(14,800株)
日鉄鉱業	4,500	6,910.00	31,095,000	
三井松島産業	8,200	1,544.00	12,660,800	貸付有価証券 300株
国際石油開発帝石	786,900	1,406.00	1,106,381,400	貸付有価証券 8,300株
日本海洋掘削	5,700	2,156.00	12,289,200	貸付有価証券 2,600株(300株)
石油資源開発	25,600	2,747.00	70,323,200	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
K & Oエナジーグループ	9,500	1,699.00	16,140,500	
ショーボンドホールディングス	15,300	8,180.00	125,154,000	貸付有価証券 1,100株
ミライト・ホールディングス	49,800	1,693.00	84,311,400	貸付有価証券 23,400株(16,700株)
タマホーム	12,100	1,111.00	13,443,100	貸付有価証券 1,400株(1,400株)
サンヨーホームズ	2,800	848.00	2,374,400	貸付有価証券 1,300株
ファーストコーポレーション	5,400	1,188.00	6,415,200	貸付有価証券 800株
ベストセラ	2,200	1,599.00	3,517,800	貸付有価証券 1,000株
TATERU	14,200	2,137.00	30,345,400	貸付有価証券 3,500株(3,500株)
ダイセキ環境ソリューション	3,800	1,102.00	4,187,600	貸付有価証券 1,700株
第一カッター興業	1,600	2,258.00	3,612,800	
安藤・間	125,900	861.00	108,399,900	貸付有価証券 10,700株
東急建設	62,200	1,147.00	71,343,400	
コムシスホールディングス	56,900	2,943.00	167,456,700	貸付有価証券 100株

ミサワホーム	13,500	949.00	12,811,500	貸付有価証券 100株
ピーアールホールディングス	16,000	402.00	6,432,000	
高松コンストラクショングループ	10,500	2,949.00	30,964,500	
東建コーポレーション	6,000	10,780.00	64,680,000	貸付有価証券 2,800株
ソネック	2,000	776.00	1,552,000	
ヤマウラ	7,600	884.00	6,718,400	貸付有価証券 700株
大成建設	161,100	5,610.00	903,771,000	
大林組	485,300	1,185.00	575,080,500	
清水建設	495,000	994.00	492,030,000	貸付有価証券 4,400株
飛島建設	147,200	174.00	25,612,800	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
長谷工コーポレーション	188,800	1,670.00	315,296,000	貸付有価証券 1,100株
松井建設	17,800	839.00	14,934,200	
銭高組	2,300	5,310.00	12,213,000	
鹿島建設	711,000	1,004.00	713,844,000	
不動テトラ	122,400	183.00	22,399,200	
大末建設	5,200	1,014.00	5,272,800	
鉄建建設	9,800	3,085.00	30,233,000	
西松建設	37,400	2,893.00	108,198,200	
三井住友建設	116,700	640.00	74,688,000	
大豊建設	59,000	632.00	37,288,000	
前田建設工業	115,400	1,304.00	150,481,600	
佐田建設	10,400	476.00	4,950,400	
ナカノフドー建設	12,400	617.00	7,650,800	
奥村組	26,600	4,445.00	118,237,000	貸付有価証券 800株
東鉄工業	19,400	3,185.00	61,789,000	
イチケン	2,900	2,491.00	7,223,900	
浅沼組	57,000	393.00	22,401,000	
戸田建設	188,000	864.00	162,432,000	貸付有価証券 9,000株
熊谷組	25,400	3,530.00	89,662,000	貸付有価証券

				700株
青木あすなる建設	10,600	1,045.00	11,077,000	
北野建設	34,000	386.00	13,124,000	
植木組	2,000	2,623.00	5,246,000	
三井ホーム	21,000	727.00	15,267,000	
矢作建設工業	22,000	813.00	17,886,000	
ピーエス三菱	19,200	692.00	13,286,400	
日本ハウスホールディングス	30,900	600.00	18,540,000	貸付有価証券 2,300株(1,200株)
大東建託	58,600	18,370.00	1,076,482,000	
新日本建設	19,300	1,178.00	22,735,400	
N I P P O	37,500	2,392.00	89,700,000	
東亜道路工業	3,300	3,865.00	12,754,500	
前田道路	50,700	2,268.00	114,987,600	貸付有価証券 500株
日本道路	4,400	5,270.00	23,188,000	
東亜建設工業	13,100	2,655.00	34,780,500	貸付有価証券 300株
若築建設	8,700	1,661.00	14,450,700	
東洋建設	50,800	516.00	26,212,800	貸付有価証券 100株(100株)
五洋建設	192,400	826.00	158,922,400	
世紀東急工業	21,700	693.00	15,038,100	
福田組	5,200	6,870.00	35,724,000	
住友林業	103,400	1,764.00	182,397,600	貸付有価証券 900株
日本基礎技術	18,000	394.00	7,092,000	
日成ビルド工業	23,900	1,322.00	31,595,800	
ヤマダ・エスバイエルホーム	73,000	73.00	5,329,000	貸付有価証券 34,000株
巴コーポレーション	20,100	566.00	11,376,600	貸付有価証券 400株
大和ハウス工業	478,000	3,984.00	1,904,352,000	貸付有価証券 1,800株
ライト工業	31,100	1,135.00	35,298,500	
積水ハウス	526,500	1,944.50	1,023,779,250	
日特建設	13,800	606.00	8,362,800	
北陸電気工事	9,000	1,217.00	10,953,000	
ユアテック	25,500	894.00	22,797,000	

西部電気工業	2,700	2,816.00	7,603,200	
四電工	2,500	2,541.00	6,352,500	
中電工	20,900	2,985.00	62,386,500	
関電工	64,400	1,249.00	80,435,600	
きんでん	107,600	1,882.00	202,503,200	
東京エネシス	18,400	1,263.00	23,239,200	
トーエネック	4,600	3,395.00	15,617,000	
住友電設	12,800	2,287.00	29,273,600	
日本電設工業	24,800	2,246.00	55,700,800	
協和エクシオ	58,100	2,777.00	161,343,700	
新日本空調	12,500	1,620.00	20,250,000	
N D S	2,500	4,385.00	10,962,500	
九電工	31,900	5,310.00	169,389,000	
三機工業	34,300	1,207.00	41,400,100	
日揮	139,400	2,633.00	367,040,200	貸付有価証券 3,400株
中外炉工業	4,900	2,962.00	14,513,800	
ヤマト	13,300	779.00	10,360,700	
太平電業	10,900	2,809.00	30,618,100	
高砂熱学工業	44,500	2,012.00	89,534,000	
三晃金属工業	1,800	3,525.00	6,345,000	
朝日工業社	3,400	3,530.00	12,002,000	
明星工業	29,300	737.00	21,594,100	貸付有価証券 200株（200株）
大気社	20,500	3,650.00	74,825,000	貸付有価証券 100株
ダイダン	10,800	2,603.00	28,112,400	
日比谷総合設備	18,100	2,066.00	37,394,600	
東芝プラントシステム	35,000	2,251.00	78,785,000	
OSJBホールディングス	71,400	302.00	21,562,800	貸付有価証券 7,400株
東洋エンジニアリング	19,000	1,146.00	21,774,000	貸付有価証券 8,900株（8,600株）
千代田化工建設	105,100	1,098.00	115,399,800	貸付有価証券 24,400株（1,400株）
新興プランテック	31,200	986.00	30,763,200	
日本製粉	48,100	1,750.00	84,175,000	
日清製粉グループ本社	177,400	2,282.00	404,826,800	貸付有価証券

				800株
日東富士製粉	1,100	4,700.00	5,170,000	
昭和産業	13,300	2,848.00	37,878,400	
鳥越製粉	12,800	958.00	12,262,400	
中部飼料	17,700	2,234.00	39,541,800	
フィード・ワン	97,400	239.00	23,278,600	
東洋精糖	2,400	1,207.00	2,896,800	
日本甜菜製糖	8,200	2,393.00	19,622,600	
三井製糖	11,400	4,265.00	48,621,000	
塩水港精糖	17,300	264.00	4,567,200	
日新製糖	6,900	2,047.00	14,124,300	
森永製菓	34,000	5,230.00	177,820,000	
中村屋	3,800	4,770.00	18,126,000	
江崎グリコ	40,500	5,680.00	230,040,000	貸付有価証券 1,900株
名糖産業	7,000	1,731.00	12,117,000	
井村屋グループ	5,700	3,300.00	18,810,000	貸付有価証券 1,000株
不二家	9,300	2,624.00	24,403,200	
山崎製パン	118,500	2,323.00	275,275,500	
第一屋製パン	2,500	1,213.00	3,032,500	
モロゾフ	2,500	6,540.00	16,350,000	
亀田製菓	9,000	5,290.00	47,610,000	貸付有価証券 100株
寿スピリッツ	14,000	5,060.00	70,840,000	貸付有価証券 2,000株
カルビー	66,000	3,690.00	243,540,000	貸付有価証券 31,000株
森永乳業	29,000	4,695.00	136,155,000	
六甲バター	7,200	2,813.00	20,253,600	貸付有価証券 2,900株
ヤクルト本社	86,800	7,690.00	667,492,000	貸付有価証券 800株
明治ホールディングス	95,900	8,590.00	823,781,000	
雪印メグミルク	34,900	3,165.00	110,458,500	
プリマハム	102,000	618.00	63,036,000	
日本ハム	62,700	4,730.00	296,571,000	貸付有価証券 500株
林兼産業	5,200	841.00	4,373,200	

丸大食品	77,000	517.00	39,809,000	
S Foods	10,100	4,575.00	46,207,500	
伊藤ハム米久ホールディングス	93,300	989.00	92,273,700	
サッポロホールディングス	53,000	3,030.00	160,590,000	貸付有価証券 10,800株
アサヒグループホールディングス	303,600	5,438.00	1,650,976,800	貸付有価証券 19,500株
麒麟ホールディングス	696,800	3,070.00	2,139,176,000	貸付有価証券 31,600株
宝ホールディングス	108,500	1,280.00	138,880,000	貸付有価証券 5,000株
オエノンホールディングス	41,200	457.00	18,828,400	
養命酒製造	4,400	2,430.00	10,692,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	101,800	4,655.00	473,879,000	貸付有価証券 2,900株（200株）
サントリー食品インターナショナル	110,900	5,330.00	591,097,000	貸付有価証券 5,000株
ダイドーグループホールディングス	7,400	6,590.00	48,766,000	
伊藤園	48,000	4,265.00	204,720,000	貸付有価証券 20,200株（2,500株）
キーコーヒー	14,200	2,150.00	30,530,000	
ユニカフェ	4,400	1,102.00	4,848,800	
ジャパンフーズ	2,100	1,500.00	3,150,000	
日清オイリオグループ	17,100	3,160.00	54,036,000	
不二製油グループ本社	39,300	3,470.00	136,371,000	
かどや製油	1,600	6,350.00	10,160,000	
J - オイルミルズ	7,500	3,725.00	27,937,500	
キッコーマン	113,200	4,475.00	506,570,000	貸付有価証券 2,000株
味の素	333,400	1,953.00	651,130,200	貸付有価証券 3,100株
キューピー	80,700	2,493.00	201,185,100	貸付有価証券 200株
ハウス食品グループ本社	55,300	3,765.00	208,204,500	
カゴメ	58,100	3,835.00	222,813,500	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
焼津水産化学工業	7,000	1,226.00	8,582,000	

アリアケジャパン	13,200	9,050.00	119,460,000	
ピエトロ	1,900	1,648.00	3,131,200	貸付有価証券 700株
エバラ食品工業	3,200	2,097.00	6,710,400	
ニチレイ	69,000	3,155.00	217,695,000	貸付有価証券 600株
東洋水産	79,600	4,195.00	333,922,000	
イトアンド	4,000	2,031.00	8,124,000	貸付有価証券 600株
大冷	1,600	2,007.00	3,211,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	2,200	913.00	2,008,600	貸付有価証券 1,000株
日清食品ホールディングス	63,200	7,610.00	480,952,000	
永谷園ホールディングス	15,000	1,442.00	21,630,000	
一正蒲鉾	5,600	1,324.00	7,414,400	貸付有価証券 800株
フジッコ	15,700	2,434.00	38,213,800	
ロック・フィールド	15,600	2,160.00	33,696,000	貸付有価証券 7,300株
日本たばこ産業	896,900	2,863.00	2,567,824,700	貸付有価証券 153,000株
ケンコーマヨネーズ	9,600	3,735.00	35,856,000	
わらべや日洋ホールディングス	9,500	2,676.00	25,422,000	貸付有価証券 600株
なとり	8,100	1,919.00	15,543,900	貸付有価証券 100株（100株）
イフジ産業	2,500	786.00	1,965,000	
ピクルスコーポレーション	2,200	2,000.00	4,400,000	貸付有価証券 200株
北の達人コーポレーション	41,800	841.00	35,153,800	貸付有価証券 19,600株（400株）
ユーグレナ	55,900	1,024.00	57,241,600	貸付有価証券 26,200株（2,700株）
ミヨシ油脂	5,500	1,418.00	7,799,000	
理研ビタミン	5,500	4,205.00	23,127,500	
片倉工業	17,400	1,400.00	24,360,000	貸付有価証券 7,200株
グンゼ	11,300	6,620.00	74,806,000	
東洋紡	55,900	2,143.00	119,793,700	

ユニチカ	44,000	724.00	31,856,000	貸付有価証券 2,500株
富士紡ホールディングス	8,400	4,170.00	35,028,000	
倉敷紡績	153,000	359.00	54,927,000	
シキボウ	7,600	1,374.00	10,442,400	
日本毛織	42,700	1,106.00	47,226,200	
ダイトウボウ	22,900	101.00	2,312,900	貸付有価証券 10,700株(100株)
トーア紡コーポレーショ ン	6,400	570.00	3,648,000	
ダイドーリミテッド	16,900	459.00	7,757,100	貸付有価証券 300株
帝国繊維	15,800	2,161.00	34,143,800	貸付有価証券 300株
帝人	124,300	2,074.00	257,798,200	
東レ	1,097,400	1,023.00	1,122,640,200	
サカイオーベックス	3,900	2,391.00	9,324,900	
住江織物	3,800	2,837.00	10,780,600	貸付有価証券 600株
日本フェルト	8,000	514.00	4,112,000	
イチカワ	10,000	370.00	3,700,000	
日東製網	1,600	1,937.00	3,099,200	貸付有価証券 400株
アツギ	10,100	1,222.00	12,342,200	
ダイニック	5,700	1,055.00	6,013,500	
セーレン	34,800	2,051.00	71,374,800	貸付有価証券 1,200株
ソトー	5,600	1,002.00	5,611,200	
東海染工	2,100	1,461.00	3,068,100	
小松精練	23,200	1,056.00	24,499,200	
ワコールホールディング ス	41,800	3,220.00	134,596,000	貸付有価証券 200株
ホギメディカル	19,100	4,400.00	84,040,000	
レナウン	40,900	167.00	6,830,300	貸付有価証券 9,800株(6,900株)
クラウディアホールディ ングス	3,500	554.00	1,939,000	
T S Iホールディングス	52,200	869.00	45,361,800	
マツオカコーポレーショ ン	2,700	3,380.00	9,126,000	貸付有価証券

ン				300株
三陽商会	7,900	2,698.00	21,314,200	貸付有価証券 2,500株(1,900株)
ナイガイ	5,500	571.00	3,140,500	貸付有価証券 100株(100株)
オンワードホールディングス	90,400	854.00	77,201,600	貸付有価証券 14,400株(5,600株)
ルックホールディングス	26,000	348.00	9,048,000	貸付有価証券 12,000株(2,000株)
キムラタン	69,100	39.00	2,694,900	貸付有価証券 32,100株(600株)
ゴールドウイン	8,500	6,860.00	58,310,000	貸付有価証券 600株
デサント	34,500	1,864.00	64,308,000	
キング	7,500	579.00	4,342,500	
ヤマトインターナショナル	10,000	603.00	6,030,000	
特種東海製紙	8,300	4,160.00	34,528,000	
王子ホールディングス	637,000	742.00	472,654,000	
日本製紙	67,800	2,056.00	139,396,800	貸付有価証券 4,800株
三菱製紙	21,500	683.00	14,684,500	
北越紀州製紙	84,500	686.00	57,967,000	貸付有価証券 9,200株(7,000株)
中越パルプ工業	6,000	1,935.00	11,610,000	
巴川製紙所	23,000	287.00	6,601,000	
大王製紙	60,300	1,529.00	92,198,700	貸付有価証券 26,600株(9,200株)
阿波製紙	3,600	636.00	2,289,600	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
レンゴー	145,900	936.00	136,562,400	
トーモク	8,700	2,079.00	18,087,300	貸付有価証券 400株(400株)
ザ・パック	10,700	4,025.00	43,067,500	
クラレ	254,600	1,809.00	460,571,400	
旭化成	943,500	1,495.50	1,411,004,250	
共和レザー	8,800	969.00	8,527,200	
昭和電工	100,700	3,890.00	391,723,000	
住友化学	1,114,000	638.00	710,732,000	
住友精化	6,300	5,200.00	32,760,000	

日産化学工業	88,000	4,870.00	428,560,000	貸付有価証券 400株
ラサ工業	5,300	2,256.00	11,956,800	
クレハ	13,100	7,400.00	96,940,000	
多木化学	2,100	4,525.00	9,502,500	
テイカ	11,500	2,813.00	32,349,500	
石原産業	27,200	1,271.00	34,571,200	貸付有価証券 200株
片倉コープアグリ	3,600	1,244.00	4,478,400	
日東エフシー	8,800	734.00	6,459,200	貸付有価証券 800株
日本曹達	105,000	626.00	65,730,000	
東ソー	218,700	2,014.00	440,461,800	
トクヤマ	43,900	3,435.00	150,796,500	貸付有価証券 300株
セントラル硝子	30,800	2,627.00	80,911,600	貸付有価証券 7,200株
東亜合成	88,800	1,285.00	114,108,000	
大阪ソーダ	13,900	3,005.00	41,769,500	貸付有価証券 6,000株
関東電化工業	36,100	1,045.00	37,724,500	貸付有価証券 14,500株（3,100株）
デンカ	55,600	4,050.00	225,180,000	
信越化学工業	251,900	10,670.00	2,687,773,000	貸付有価証券 800株
日本カーバイド工業	4,800	2,200.00	10,560,000	
堺化学工業	10,400	2,813.00	29,255,200	
エア・ウォーター	124,800	2,096.00	261,580,800	
大陽日酸	116,500	1,652.00	192,458,000	貸付有価証券 300株
日本化学工業	5,600	3,525.00	19,740,000	
東邦アセチレン	2,100	1,362.00	2,860,200	
日本パーカライジング	77,300	1,687.00	130,405,100	
高压ガス工業	22,400	947.00	21,212,800	
チタン工業	1,600	2,693.00	4,308,800	貸付有価証券 700株
四国化成工業	21,800	1,608.00	35,054,400	
戸田工業	3,000	3,845.00	11,535,000	貸付有価証券 1,400株

ステラ ケミファ	7,700	3,570.00	27,489,000	貸付有価証券 3,600株
保土谷化学工業	4,900	4,835.00	23,691,500	貸付有価証券 2,200株
日本触媒	23,800	7,240.00	172,312,000	
大日精化学工業	11,700	4,550.00	53,235,000	
カネカ	204,000	1,067.00	217,668,000	
三菱瓦斯化学	124,700	2,622.00	326,963,400	
三井化学	137,500	3,385.00	465,437,500	
J S R	152,100	2,373.00	360,933,300	貸付有価証券 2,000株
東京応化工業	26,300	3,825.00	100,597,500	貸付有価証券 3,800株
大阪有機化学工業	9,800	1,511.00	14,807,800	
三菱ケミカルホールディングス	1,013,200	1,050.50	1,064,366,600	
K H ネオケム	23,100	3,335.00	77,038,500	
ダイセル	204,000	1,254.00	255,816,000	貸付有価証券 3,000株
住友ベークライト	122,000	994.00	121,268,000	貸付有価証券 1,000株
積水化学工業	314,200	1,915.00	601,693,000	貸付有価証券 3,300株
日本ゼオン	127,600	1,570.00	200,332,000	
アイカ工業	42,400	4,005.00	169,812,000	
宇部興産	76,200	3,375.00	257,175,000	
積水樹脂	23,300	2,308.00	53,776,400	
タキロンシーアイ	30,600	688.00	21,052,800	
旭有機材	8,900	1,805.00	16,064,500	
日立化成	74,800	2,540.00	189,992,000	貸付有価証券 4,300株
ニチバン	7,400	3,375.00	24,975,000	
リケンテクノス	32,600	526.00	17,147,600	貸付有価証券 2,200株
大倉工業	36,000	614.00	22,104,000	
積水化成品工業	19,000	1,270.00	24,130,000	貸付有価証券 100株（100株）
群栄化学工業	3,600	3,550.00	12,780,000	
タイガースポリマー	7,400	847.00	6,267,800	

ミライアル	5,000	1,581.00	7,905,000	貸付有価証券 1,400株
ダイキアクシス	5,000	1,497.00	7,485,000	貸付有価証券 2,200株
ダイキョーニシカワ	29,800	1,942.00	57,871,600	貸付有価証券 100株
竹本容器	1,700	2,602.00	4,423,400	
森六ホールディングス	5,700	2,902.00	16,541,400	貸付有価証券 500株
日本化薬	98,200	1,349.00	132,471,800	貸付有価証券 2,500株
カーリットホールディングス	14,000	1,031.00	14,434,000	貸付有価証券 6,100株
日本精化	12,500	1,250.00	15,625,000	
扶桑化学工業	10,700	2,777.00	29,713,900	
トリケミカル研究所	2,600	4,730.00	12,298,000	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
A D E K A	65,100	1,972.00	128,377,200	貸付有価証券 100株
日油	58,400	3,215.00	187,756,000	
新日本理化	23,900	260.00	6,214,000	貸付有価証券 10,400株
ハリマ化成グループ	11,700	846.00	9,898,200	
花王	355,200	7,760.00	2,756,352,000	貸付有価証券 66,400株
第一工業製薬	29,000	865.00	25,085,000	
日華化学	4,800	1,265.00	6,072,000	
ニイタカ	2,200	1,807.00	3,975,400	
三洋化成工業	9,500	5,160.00	49,020,000	
有機合成薬品工業	9,900	303.00	2,999,700	
大日本塗料	17,300	1,537.00	26,590,100	
日本ペイントホールディングス	116,700	4,295.00	501,226,500	貸付有価証券 54,800株
関西ペイント	158,900	2,457.00	390,417,300	貸付有価証券 17,700株（5,300株）
神東塗料	11,100	244.00	2,708,400	
中国塗料	43,400	1,076.00	46,698,400	貸付有価証券 6,500株（3,300株）
日本特殊塗料	9,500	2,217.00	21,061,500	
藤倉化成	19,100	667.00	12,739,700	

太陽ホールディングス	11,600	4,660.00	54,056,000	
D I C	59,700	3,760.00	224,472,000	
サカタインクス	30,900	1,639.00	50,645,100	貸付有価証券 700株
東洋インキ S C ホール ディングス	150,000	680.00	102,000,000	
T & K T O K A	10,100	1,317.00	13,301,700	
富士フイルムホールディ ングス	300,000	4,335.00	1,300,500,000	
資生堂	269,100	6,863.00	1,846,833,300	貸付有価証券 400株
ライオン	201,200	2,277.00	458,132,400	貸付有価証券 8,700株
高砂香料工業	9,000	3,365.00	30,285,000	
マンダム	28,100	3,865.00	108,606,500	
ミルボン	19,300	4,655.00	89,841,500	
ファンケル	35,100	4,035.00	141,628,500	
コーセー	24,500	20,280.00	496,860,000	貸付有価証券 100株(100株)
コタ	6,900	1,676.00	11,564,400	
シーズ・ホールディング ス	19,600	5,180.00	101,528,000	貸付有価証券 1,600株
シーボン	1,700	3,105.00	5,278,500	貸付有価証券 300株
ポーラ・オルビスホール ディングス	61,700	4,665.00	287,830,500	
ノエビアホールディング ス	9,200	7,700.00	70,840,000	
アジュバンコスメジャパ ン	3,200	975.00	3,120,000	貸付有価証券 200株
エステー	10,300	2,402.00	24,740,600	
アグロ カネショウ	5,900	2,681.00	15,817,900	
コニシ	23,700	1,771.00	41,972,700	
長谷川香料	19,200	2,161.00	41,491,200	貸付有価証券 1,700株
星光 P M C	8,300	1,195.00	9,918,500	貸付有価証券 3,900株(900株)
小林製薬	40,500	8,770.00	355,185,000	
荒川化学工業	13,000	1,972.00	25,636,000	
メック	9,900	1,819.00	18,008,100	貸付有価証券

				2,600株
日本高純度化学	4,000	2,592.00	10,368,000	
タカラバイオ	37,800	2,031.00	76,771,800	貸付有価証券 800株(700株)
J C U	17,700	2,547.00	45,081,900	
新田ゼラチン	9,900	832.00	8,236,800	
O A T アグリオ	2,200	3,700.00	8,140,000	
デクセリアルズ	37,100	1,192.00	44,223,200	
アース製薬	10,900	5,700.00	62,130,000	貸付有価証券 100株
北興化学工業	14,800	692.00	10,241,600	貸付有価証券 500株
大成ラミック	4,400	3,135.00	13,794,000	貸付有価証券 100株
クミアイ化学工業	65,700	668.00	43,887,600	貸付有価証券 21,700株
日本農薬	37,700	681.00	25,673,700	貸付有価証券 7,800株
アキレス	11,000	2,252.00	24,772,000	
有沢製作所	24,200	1,042.00	25,216,400	
日東電工	109,100	8,432.00	919,931,200	
レック	8,600	3,790.00	32,594,000	貸付有価証券 4,000株
きもと	24,600	312.00	7,675,200	貸付有価証券 4,800株
藤森工業	12,100	3,715.00	44,951,500	
前澤化成工業	9,900	1,187.00	11,751,300	
J S P	8,500	3,420.00	29,070,000	貸付有価証券 300株
エフピコ	11,900	6,640.00	79,016,000	貸付有価証券 5,500株
天馬	11,200	2,033.00	22,769,600	
信越ポリマー	29,600	1,105.00	32,708,000	
東リ	36,000	374.00	13,464,000	
ニフコ	53,000	3,780.00	200,340,000	貸付有価証券 2,100株
日本バルカー工業	11,700	3,045.00	35,626,500	
ユニ・チャーム	306,300	2,991.50	916,296,450	
協和発酵キリン	181,000	2,335.00	422,635,000	貸付有価証券 1,300株

武田薬品工業	532,100	4,923.00	2,619,528,300	
アステラス製薬	1,484,400	1,574.00	2,336,445,600	
大日本住友製薬	107,100	2,016.00	215,913,600	貸付有価証券 35,900株
塩野義製薬	206,600	5,510.00	1,138,366,000	
田辺三菱製薬	176,200	2,078.00	366,143,600	
わかもと製薬	17,200	290.00	4,988,000	
あすか製薬	16,400	1,680.00	27,552,000	
日本新薬	37,800	8,240.00	311,472,000	貸付有価証券 700株
ピオフェルミン製薬	2,500	2,831.00	7,077,500	
中外製薬	150,600	5,780.00	870,468,000	貸付有価証券 100株
科研製薬	26,100	6,380.00	166,518,000	
エーザイ	172,900	7,151.00	1,236,407,900	
ロート製薬	79,300	3,055.00	242,261,500	貸付有価証券 200株
小野薬品工業	341,100	2,489.00	848,997,900	貸付有価証券 18,000株
久光製薬	42,700	7,870.00	336,049,000	貸付有価証券 10,300株(100株)
持田製薬	10,100	7,320.00	73,932,000	
参天製薬	273,700	1,756.00	480,617,200	貸付有価証券 800株
扶桑薬品工業	5,100	2,875.00	14,662,500	
日本ケミファ	1,900	4,510.00	8,569,000	
ツムラ	51,600	3,860.00	199,176,000	
日医工	38,100	1,685.00	64,198,500	貸付有価証券 16,300株
キッセイ薬品工業	26,800	3,020.00	80,936,000	
生化学工業	28,000	1,831.00	51,268,000	
栄研化学	23,400	2,465.00	57,681,000	貸付有価証券 300株(200株)
日水製薬	6,100	1,384.00	8,442,400	
鳥居薬品	9,000	2,721.00	24,489,000	
JCRファーマ	10,200	5,640.00	57,528,000	貸付有価証券 100株
東和薬品	6,900	6,930.00	47,817,000	
富士製薬工業	4,900	4,545.00	22,270,500	

沢井製薬	29,000	4,740.00	137,460,000	貸付有価証券 800株
ゼリア新薬工業	31,000	2,194.00	68,014,000	貸付有価証券 600株（600株）
第一三共	413,300	3,680.00	1,520,944,000	貸付有価証券 2,500株
キョーリン製薬ホールディングス	40,300	2,070.00	83,421,000	
大幸薬品	7,600	2,032.00	15,443,200	
ダイト	8,400	3,770.00	31,668,000	
大塚ホールディングス	300,200	5,188.00	1,557,437,600	
大正製薬ホールディングス	32,300	10,170.00	328,491,000	貸付有価証券 200株
ペプチドリーム	66,000	4,550.00	300,300,000	貸付有価証券 27,400株
日本コークス工業	122,000	114.00	13,908,000	
昭和シェル石油	135,200	1,492.00	201,718,400	
ニチレキ	18,500	1,194.00	22,089,000	
ユシロ化学工業	8,100	1,781.00	14,426,100	
ビーピー・カストロール	6,200	1,673.00	10,372,600	貸付有価証券 1,300株
富士石油	35,100	462.00	16,216,200	
MORESCO	5,200	1,899.00	9,874,800	貸付有価証券 200株
出光興産	121,300	4,085.00	495,510,500	
JXTGホールディングス	2,305,200	713.40	1,644,529,680	
コスモエネルギーホールディングス	41,800	3,705.00	154,869,000	
横浜ゴム	83,600	2,543.00	212,594,800	貸付有価証券 500株
東洋ゴム工業	85,500	1,862.00	159,201,000	
ブリヂストン	478,100	4,552.00	2,176,311,200	貸付有価証券 46,700株
住友ゴム工業	148,700	1,965.00	292,195,500	
藤倉ゴム工業	12,600	766.00	9,651,600	
オカモト	50,000	1,068.00	53,400,000	
フコク	6,300	988.00	6,224,400	
ニッタ	14,900	4,075.00	60,717,500	
住友理工	28,000	1,146.00	32,088,000	

三ツ星ベルト	35,000	1,215.00	42,525,000	
バンドー化学	27,500	1,283.00	35,282,500	
日東紡績	21,500	2,392.00	51,428,000	
旭硝子	147,600	4,460.00	658,296,000	
日本板硝子	73,000	876.00	63,948,000	貸付有価証券 30,700株（3,400株）
石塚硝子	2,000	2,567.00	5,134,000	
日本山村硝子	60,000	187.00	11,220,000	
日本電気硝子	62,500	3,180.00	198,750,000	
オハラ	5,700	2,525.00	14,392,500	貸付有価証券 2,600株（800株）
住友大阪セメント	281,000	483.00	135,723,000	貸付有価証券 73,000株
太平洋セメント	91,200	3,935.00	358,872,000	
日本ヒューム	14,500	829.00	12,020,500	
日本コンクリート工業	31,100	447.00	13,901,700	貸付有価証券 700株（700株）
三谷セキサン	7,600	2,444.00	18,574,400	
アジアパイルホールディングス	18,600	645.00	11,997,000	
東海カーボン	131,100	1,460.00	191,406,000	貸付有価証券 7,400株
日本カーボン	7,400	4,970.00	36,778,000	貸付有価証券 600株（300株）
東洋炭素	9,400	3,175.00	29,845,000	
ノリタケカンパニーリミテド	8,500	4,445.00	37,782,500	
TOTO	111,100	6,030.00	669,933,000	貸付有価証券 200株
日本碍子	176,300	1,900.00	334,970,000	
日本特殊陶業	123,900	2,576.00	319,166,400	貸付有価証券 700株
ダントーホールディングス	10,800	142.00	1,533,600	貸付有価証券 4,000株
MARUWA	5,000	8,180.00	40,900,000	
品川リフラクトリーズ	3,800	2,965.00	11,267,000	
黒崎播磨	2,900	4,935.00	14,311,500	
ヨータイ	8,600	793.00	6,819,800	貸付有価証券 4,000株
イソライト工業	7,400	840.00	6,216,000	貸付有価証券

				3,300株(100株)
東京窯業	18,400	421.00	7,746,400	貸付有価証券 8,600株
ニッカー	4,900	1,106.00	5,419,400	貸付有価証券 2,100株
フジインコーポレー テッド	12,900	2,325.00	29,992,500	貸付有価証券 200株
エーアンドエーマテリア ル	3,100	1,304.00	4,042,400	貸付有価証券 100株
ニチアス	79,000	1,358.00	107,282,000	
ニチハ	21,800	4,295.00	93,631,000	
新日鐵住金	639,300	2,436.00	1,557,334,800	
神戸製鋼所	261,400	1,171.00	306,099,400	
中山製鋼所	19,800	762.00	15,087,600	
合同製鐵	7,700	2,268.00	17,463,600	貸付有価証券 3,600株
ジェイ エフ イー ホールディングス	385,800	2,322.50	896,020,500	
日新製鋼	39,400	1,356.00	53,426,400	貸付有価証券 700株
東京製鐵	76,500	850.00	65,025,000	貸付有価証券 32,800株
共英製鋼	16,100	2,084.00	33,552,400	貸付有価証券 7,200株(100株)
大和工業	30,300	3,165.00	95,899,500	貸付有価証券 100株
東京鐵鋼	5,900	1,687.00	9,953,300	
大阪製鐵	9,500	2,324.00	22,078,000	
淀川製鋼所	20,900	3,050.00	63,745,000	
東洋鋼鈹	36,200	716.00	25,919,200	貸付有価証券 4,600株
丸一鋼管	50,600	3,505.00	177,353,000	貸付有価証券 11,500株
モリ工業	4,700	3,300.00	15,510,000	
大同特殊鋼	25,300	5,650.00	142,945,000	貸付有価証券 200株
日本高周波鋼業	5,300	843.00	4,467,900	貸付有価証券 2,300株
日本冶金工業	118,100	315.00	37,201,500	
山陽特殊製鋼	16,500	2,813.00	46,414,500	貸付有価証券 7,700株

愛知製鋼	8,000	4,705.00	37,640,000	
日立金属	153,900	1,399.00	215,306,100	貸付有価証券 1,400株
日本金属	3,600	2,433.00	8,758,800	貸付有価証券 1,300株
大平洋金属	8,800	3,975.00	34,980,000	貸付有価証券 4,100株(100株)
新日本電工	85,500	373.00	31,891,500	貸付有価証券 40,100株(300株)
栗本鐵工所	7,200	2,075.00	14,940,000	
虹技	2,100	2,021.00	4,244,100	
日本鑄鉄管	15,000	170.00	2,550,000	
三菱製鋼	10,600	2,670.00	28,302,000	
日亜鋼業	20,900	353.00	7,377,700	
日本精線	2,300	4,800.00	11,040,000	貸付有価証券 200株
シンニッタン	22,200	481.00	10,678,200	
新家工業	3,300	2,061.00	6,801,300	
大紀アルミニウム工業所	23,500	786.00	18,471,000	貸付有価証券 11,000株
日本軽金属ホールディングス	417,000	289.00	120,513,000	
三井金属鉱業	38,500	4,920.00	189,420,000	
東邦亜鉛	7,900	5,350.00	42,265,000	貸付有価証券 200株
三菱マテリアル	94,300	3,400.00	320,620,000	
住友金属鉱山	182,600	4,877.00	890,540,200	
DOWAホールディングス	36,100	4,160.00	150,176,000	
古河機械金属	23,600	2,203.00	51,990,800	貸付有価証券 100株
大阪チタニウムテクノロジーズ	14,900	2,239.00	33,361,100	貸付有価証券 6,800株
東邦チタニウム	25,600	1,448.00	37,068,800	貸付有価証券 4,200株
UACJ	21,700	2,859.00	62,040,300	貸付有価証券 10,100株(100株)
古河電気工業	47,500	5,300.00	251,750,000	貸付有価証券 400株
住友電気工業	534,100	1,670.00	891,947,000	貸付有価証券

				400株
フジクラ	172,500	746.00	128,685,000	
昭和電線ホールディングス	18,000	940.00	16,920,000	
東京特殊電線	1,800	3,255.00	5,859,000	
タツタ電線	28,300	671.00	18,989,300	
カナレ電気	2,400	2,345.00	5,628,000	
平河ヒューテック	7,100	1,435.00	10,188,500	貸付有価証券 200株
リョービ	17,600	2,845.00	50,072,000	
アーレスティ	17,500	1,000.00	17,500,000	
アサヒホールディングス	24,500	2,007.00	49,171,500	
稲葉製作所	8,000	1,386.00	11,088,000	
宮地エンジニアリンググループ	4,000	2,075.00	8,300,000	貸付有価証券 300株(300株)
トーカロ	39,700	1,285.00	51,014,500	
アルファC o	5,000	1,786.00	8,930,000	
SUMCO	131,500	2,594.00	341,111,000	
川田テクノロジーズ	2,900	6,110.00	17,719,000	貸付有価証券 800株
RS Technologies	2,200	6,700.00	14,740,000	貸付有価証券 300株
東洋製罐グループホールディングス	97,700	1,647.00	160,911,900	貸付有価証券 100株
ホッカンホールディングス	36,000	383.00	13,788,000	
コロナ	7,900	1,257.00	9,930,300	
横河ブリッジホールディングス	26,600	2,264.00	60,222,400	
駒井ハルテック	3,100	2,472.00	7,663,200	
高田機工	1,300	3,410.00	4,433,000	
三和ホールディングス	137,000	1,379.00	188,923,000	貸付有価証券 400株
文化シャッター	42,100	1,032.00	43,447,200	
三協立山	19,800	1,572.00	31,125,600	貸付有価証券 1,400株
アルインコ	10,400	1,069.00	11,117,600	
東洋シャッター	3,700	653.00	2,416,100	
LIXILグループ	210,600	2,427.00	511,126,200	貸付有価証券

				3,400株
日本ファイルコン	10,900	628.00	6,845,200	
ノーリツ	31,900	1,949.00	62,173,100	
長府製作所	16,100	2,530.00	40,733,000	貸付有価証券 1,600株
リンナイ	25,500	10,450.00	266,475,000	
ダイニチ工業	7,700	833.00	6,414,100	
日東精工	19,700	797.00	15,700,900	
三洋工業	1,700	2,100.00	3,570,000	
岡部	28,900	1,053.00	30,431,700	
ジーテクト	15,800	2,057.00	32,500,600	
中国工業	2,100	762.00	1,600,200	貸付有価証券 900株
東ブレ	26,600	3,225.00	85,785,000	
高周波熱錬	27,500	1,096.00	30,140,000	
東京製綱	10,200	2,334.00	23,806,800	貸付有価証券 3,100株
サンコール	8,000	724.00	5,792,000	
モリテック スチール	8,300	756.00	6,274,800	貸付有価証券 3,900株
パイオラックス	21,100	3,005.00	63,405,500	
エイチワン	10,500	1,387.00	14,563,500	貸付有価証券 100株
日本発條	142,300	1,181.00	168,056,300	貸付有価証券 4,000株
中央発條	1,700	3,495.00	5,941,500	
アドバネクス	2,200	2,510.00	5,522,000	貸付有価証券 200株
立川ブラインド工業	6,300	1,531.00	9,645,300	貸付有価証券 200株
三益半導体工業	11,100	1,882.00	20,890,200	
日本ドライケミカル	1,900	2,494.00	4,738,600	
日本製鋼所	46,600	3,565.00	166,129,000	
三浦工業	61,800	3,330.00	205,794,000	貸付有価証券 600株
タクマ	48,400	1,193.00	57,741,200	
ツガミ	38,000	1,368.00	51,984,000	貸付有価証券 1,000株
オークマ	16,700	6,260.00	104,542,000	貸付有価証券

				100株
東芝機械	81,000	734.00	59,454,000	
アマダホールディングス	220,400	1,325.00	292,030,000	
アイダエンジニアリング	36,300	1,276.00	46,318,800	貸付有価証券 800株
滝澤鉄工所	4,400	1,919.00	8,443,600	
F U J I	42,800	2,020.00	86,456,000	貸付有価証券 14,200株(14,200株)
牧野フライス製作所	73,000	1,007.00	73,511,000	
オーエスジー	65,800	2,431.00	159,959,800	貸付有価証券 24,400株(23,400株)
ダイジェット工業	1,700	1,968.00	3,345,600	貸付有価証券 100株(100株)
旭ダイヤモンド工業	42,500	1,077.00	45,772,500	
D M G 森精機	79,100	1,978.00	156,459,800	貸付有価証券 7,600株(2,200株)
ソディック	31,200	1,383.00	43,149,600	貸付有価証券 14,600株(9,100株)
ディスコ	19,300	21,580.00	416,494,000	
日東工器	8,800	2,909.00	25,599,200	
日進工具	3,800	3,075.00	11,685,000	貸付有価証券 300株
パンチ工業	11,900	1,192.00	14,184,800	
富士ダイス	5,400	1,052.00	5,680,800	
豊和工業	7,900	1,108.00	8,753,200	貸付有価証券 3,600株(2,400株)
O K K	5,500	1,140.00	6,270,000	貸付有価証券 300株
東洋機械金属	11,100	849.00	9,423,900	
津田駒工業	34,000	254.00	8,636,000	貸付有価証券 15,000株(9,000株)
エンシュウ	37,000	162.00	5,994,000	貸付有価証券 4,000株
島精機製作所	18,100	6,860.00	124,166,000	貸付有価証券 2,700株
オプトラン	10,400	3,065.00	31,876,000	貸付有価証券 4,800株
N C ホールディングス	4,600	796.00	3,661,600	
フリーー	10,200	929.00	9,475,800	貸付有価証券 200株

ヤマシンフィルタ	21,700	1,299.00	28,188,300	貸付有価証券 10,100株（6,500株）
日阪製作所	20,600	1,146.00	23,607,600	
やまびこ	27,700	1,479.00	40,968,300	
平田機工	4,000	9,790.00	39,160,000	貸付有価証券 1,800株
ペガサスミシン製造	13,400	775.00	10,385,000	貸付有価証券 1,200株
ナプテスコ	78,600	3,965.00	311,649,000	
三井海洋開発	15,200	2,815.00	42,788,000	貸付有価証券 3,100株（1,700株）
レオン自動機	12,700	2,051.00	26,047,700	
S M C	45,300	42,600.00	1,929,780,000	
新川	11,700	965.00	11,290,500	貸付有価証券 5,400株
ホソカワミクロン	5,400	7,160.00	38,664,000	
ユニオンツール	6,500	3,700.00	24,050,000	
オイレス工業	18,500	2,331.00	43,123,500	貸付有価証券 200株（200株）
日精エー・エス・ピー機 械	4,800	6,490.00	31,152,000	貸付有価証券 300株
サトーホールディングス	18,800	3,055.00	57,434,000	
技研製作所	7,300	2,537.00	18,520,100	貸付有価証券 3,200株
日本エアーテック	4,900	855.00	4,189,500	
日精樹脂工業	12,000	1,451.00	17,412,000	
オカダアイヨン	4,800	1,441.00	6,916,800	貸付有価証券 400株
ワイエイシイホールディ ングス	4,800	1,030.00	4,944,000	貸付有価証券 2,200株
小松製作所	697,400	3,790.00	2,643,146,000	
住友重機械工業	82,700	4,175.00	345,272,500	貸付有価証券 300株
日立建機	67,500	4,275.00	288,562,500	貸付有価証券 1,000株
日工	3,900	2,385.00	9,301,500	
巴工業	6,100	2,183.00	13,316,300	
井関農機	14,400	2,109.00	30,369,600	貸付有価証券 200株（200株）
T O W A	11,200	1,432.00	16,038,400	貸付有価証券

				1,500株
丸山製作所	3,200	1,875.00	6,000,000	
北川鉄工所	6,900	2,810.00	19,389,000	
ローツェ	7,100	2,169.00	15,399,900	貸付有価証券 3,300株
タカキタ	5,000	795.00	3,975,000	貸付有価証券 400株
クボタ	774,700	1,845.00	1,429,321,500	貸付有価証券 176,600株(4,400株)
荏原実業	4,200	2,350.00	9,870,000	
三菱化工機	5,000	2,254.00	11,270,000	
月島機械	28,600	1,512.00	43,243,200	
帝国電機製作所	10,100	1,656.00	16,725,600	
東京機械製作所	5,700	522.00	2,975,400	貸付有価証券 2,400株
新東工業	34,300	1,159.00	39,753,700	
澁谷工業	12,600	3,725.00	46,935,000	
アイチ コーポレーショ ン	24,900	725.00	18,052,500	貸付有価証券 11,400株
小森コーポレーション	36,300	1,375.00	49,912,500	
鶴見製作所	12,200	2,066.00	25,205,200	
住友精密工業	24,000	381.00	9,144,000	
酒井重工業	2,700	4,620.00	12,474,000	貸付有価証券 1,000株
荏原製作所	59,400	4,225.00	250,965,000	
石井鐵工所	2,200	1,996.00	4,391,200	
西島製作所	14,700	1,028.00	15,111,600	
北越工業	16,200	1,181.00	19,132,200	
ダイキン工業	197,200	12,690.00	2,502,468,000	貸付有価証券 1,100株
オルガノ	5,200	3,190.00	16,588,000	
トーヨーカネツ	6,100	3,325.00	20,282,500	貸付有価証券 1,100株
栗田工業	78,200	3,460.00	270,572,000	
椿本チエイン	86,000	929.00	79,894,000	
大同工業	5,500	1,477.00	8,123,500	
木村化工機	12,000	505.00	6,060,000	
アネスト岩田	24,300	1,176.00	28,576,800	
ダイフク	73,500	6,050.00	444,675,000	

サムコ	4,000	1,268.00	5,072,000	貸付有価証券 500株
加藤製作所	6,800	2,521.00	17,142,800	貸付有価証券 500株
油研工業	2,800	2,906.00	8,136,800	
タダノ	69,700	1,698.00	118,350,600	貸付有価証券 3,100株
フジテック	46,300	1,534.00	71,024,200	貸付有価証券 600株
C K D	40,200	2,264.00	91,012,800	貸付有価証券 200株
キトー	10,900	2,068.00	22,541,200	
平和	44,800	2,161.00	96,812,800	
理想科学工業	14,300	2,141.00	30,616,300	
S A N K Y O	36,200	3,790.00	137,198,000	貸付有価証券 1,500株
日本金銭機械	13,300	1,201.00	15,973,300	貸付有価証券 5,700株（900株）
マースエンジニアリング	9,200	2,384.00	21,932,800	貸付有価証券 100株（100株）
福島工業	8,900	4,745.00	42,230,500	
オーイズミ	6,100	569.00	3,470,900	貸付有価証券 800株
ダイコク電機	6,600	1,751.00	11,556,600	貸付有価証券 1,300株（100株）
竹内製作所	24,200	2,481.00	60,040,200	
アマノ	44,700	2,855.00	127,618,500	
J U K I	21,400	1,529.00	32,720,600	
サンデンホールディングス	17,600	1,594.00	28,054,400	貸付有価証券 1,800株
蛇の目マシン工業	13,100	727.00	9,523,700	
マックス	22,200	1,403.00	31,146,600	
グローリー	43,100	3,785.00	163,133,500	
新晃工業	14,600	1,763.00	25,739,800	
大和冷機工業	23,200	1,262.00	29,278,400	
セガサミーホールディングス	143,300	1,702.00	243,896,600	貸付有価証券 2,800株
日本ピストンリング	5,300	2,266.00	12,009,800	
リケン	6,700	6,130.00	41,071,000	

T P R	16,200	3,235.00	52,407,000	
ツバキ・ナカシマ	14,500	2,594.00	37,613,000	貸付有価証券 100株
ホシザキ	45,500	9,750.00	443,625,000	
大豊工業	11,800	1,570.00	18,526,000	
日本精工	296,700	1,440.00	427,248,000	貸付有価証券 11,800株
N T N	334,300	470.00	157,121,000	
ジェイテクト	153,900	1,650.00	253,935,000	
不二越	134,000	567.00	75,978,000	貸付有価証券 24,000株（1,000株）
日本トムソン	46,100	800.00	36,880,000	貸付有価証券 300株
T H K	90,000	3,900.00	351,000,000	貸付有価証券 7,800株（7,800株）
ユーシン精機	12,800	1,569.00	20,083,200	貸付有価証券 3,900株（200株）
前澤給装工業	5,700	1,912.00	10,898,400	
イーグル工業	17,900	1,897.00	33,956,300	
前澤工業	10,600	488.00	5,172,800	
日本ピラー工業	14,600	1,516.00	22,133,600	
キッツ	64,400	901.00	58,024,400	貸付有価証券 500株
マキタ	188,400	4,750.00	894,900,000	
日立造船	114,500	580.00	66,410,000	貸付有価証券 3,100株
三菱重工業	242,100	4,218.00	1,021,177,800	貸付有価証券 5,300株
I H I	111,000	3,720.00	412,920,000	
スター精密	23,100	1,983.00	45,807,300	貸付有価証券 5,500株（5,500株）
日清紡ホールディングス	88,200	1,511.00	133,270,200	貸付有価証券 2,400株
イビデン	88,400	1,741.00	153,904,400	貸付有価証券 15,200株
コニカミノルタ	338,100	957.00	323,561,700	貸付有価証券 5,900株
ブラザー工業	176,400	2,455.00	433,062,000	
ミネベアミツミ	268,100	2,198.00	589,283,800	貸付有価証券 600株

日立製作所	3,468,000	801.50	2,779,602,000	
三菱電機	1,444,400	1,726.00	2,493,034,400	
富士電機	435,000	725.00	315,375,000	貸付有価証券 3,000株
東洋電機製造	5,700	1,738.00	9,906,600	貸付有価証券 2,600株
安川電機	167,400	4,780.00	800,172,000	貸付有価証券 40,600株
シンフォニアテクノロ ジー	94,000	382.00	35,908,000	貸付有価証券 44,000株（20,000株）
明電舎	122,000	414.00	50,508,000	
オリジン電気	4,200	1,741.00	7,312,200	
山洋電気	7,000	8,170.00	57,190,000	
デンヨー	13,300	1,911.00	25,416,300	
東芝テック	103,000	625.00	64,375,000	
芝浦メカトロニクス	21,000	437.00	9,177,000	貸付有価証券 1,000株
マブチモーター	40,300	5,420.00	218,426,000	貸付有価証券 18,500株
日本電産	173,800	16,660.00	2,895,508,000	
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	5,300	2,728.00	14,458,400	貸付有価証券 2,400株
東光高岳	7,300	1,734.00	12,658,200	貸付有価証券 2,400株
ダブル・スコープ	21,000	1,585.00	33,285,000	貸付有価証券 9,800株（800株）
ダイヘン	79,000	833.00	65,807,000	
田淵電機	20,000	294.00	5,880,000	貸付有価証券 9,400株
ヤーマン	20,900	2,449.00	51,184,100	貸付有価証券 9,800株
JVCケンウッド	106,000	386.00	40,916,000	貸付有価証券 400株
ミマキエンジニアリング	12,900	837.00	10,797,300	
第一精工	6,700	2,106.00	14,110,200	貸付有価証券 500株
日新電機	33,800	1,077.00	36,402,600	貸付有価証券 1,500株
大崎電気工業	30,900	773.00	23,885,700	
オムロン	153,500	5,970.00	916,395,000	

日東工業	23,100	1,757.00	40,586,700	貸付有価証券 200株(100株)
I D E C	17,900	2,466.00	44,141,400	貸付有価証券 2,800株
不二電機工業	1,600	1,376.00	2,201,600	貸付有価証券 400株
ジーエス・ユアサコー ポレーション	260,000	582.00	151,320,000	貸付有価証券 13,000株(6,000株)
サクサホールディングス	3,600	2,131.00	7,671,600	貸付有価証券 1,500株
メルコホールディングス	7,000	3,625.00	25,375,000	貸付有価証券 200株
テクノメディカ	3,500	2,064.00	7,224,000	
日本電気	186,900	2,941.00	549,672,900	
富士通	1,485,000	659.50	979,357,500	
沖電気工業	58,700	1,448.00	84,997,600	貸付有価証券 8,200株(5,500株)
岩崎通信機	6,300	800.00	5,040,000	
電気興業	8,200	3,140.00	25,748,000	
サンケン電気	84,000	722.00	60,648,000	
ナカヨ	2,800	1,926.00	5,392,800	
アイホン	8,200	1,798.00	14,743,600	
ルネサスエレクトロニクス	74,800	1,110.00	83,028,000	貸付有価証券 35,100株(15,600株)
セイコーエプソン	215,100	2,033.00	437,298,300	
ワコム	112,000	539.00	60,368,000	貸付有価証券 36,100株
アルバック	33,200	5,940.00	197,208,000	貸付有価証券 300株
アクセル	6,000	915.00	5,490,000	貸付有価証券 900株(800株)
E I Z O	13,300	5,070.00	67,431,000	
ジャパンディスプレイ	296,700	146.00	43,318,200	貸付有価証券 139,800株(18,800株)
日本信号	39,800	1,006.00	40,038,800	
京三製作所	33,800	685.00	23,153,000	
能美防災	19,100	2,327.00	44,445,700	
ホーチキ	10,500	2,126.00	22,323,000	
エレコム	12,600	2,341.00	29,496,600	

パナソニック	1,650,100	1,580.00	2,607,158,000	
シャープ	100,600	3,345.00	336,507,000	貸付有価証券 46,500株（8,100株）
アンリツ	105,300	1,321.00	139,101,300	
富士通ゼネラル	44,100	1,918.00	84,583,800	貸付有価証券 20,700株
ソニー	965,400	5,350.00	5,164,890,000	貸付有価証券 900株
T D K	75,500	9,490.00	716,495,000	貸付有価証券 200株
帝国通信工業	6,400	1,280.00	8,192,000	
タムラ製作所	55,700	806.00	44,894,200	貸付有価証券 400株
アルプス電気	124,400	2,576.00	320,454,400	貸付有価証券 6,800株
池上通信機	46,000	169.00	7,774,000	貸付有価証券 13,000株
パイオニア	240,700	182.00	43,807,400	貸付有価証券 113,100株
日本電波工業	13,000	681.00	8,853,000	貸付有価証券 6,000株（2,500株）
鈴木	6,100	1,048.00	6,392,800	
日本トリム	3,100	5,230.00	16,213,000	
ローランド ディー . ジー .	7,400	2,503.00	18,522,200	
フォスター電機	16,900	2,643.00	44,666,700	貸付有価証券 1,700株（1,300株）
クラリオン	76,000	347.00	26,372,000	
S M K	37,000	456.00	16,872,000	
ヨコオ	9,400	2,124.00	19,965,600	貸付有価証券 4,400株
ティアック	104,000	42.00	4,368,000	貸付有価証券 48,000株（3,000株）
ホシデン	36,400	1,379.00	50,195,600	
ヒロセ電機	24,500	14,990.00	367,255,000	貸付有価証券 400株
日本航空電子工業	37,000	1,617.00	59,829,000	貸付有価証券 14,000株
T O A	15,500	1,252.00	19,406,000	
マクセルホールディング ス	28,700	2,175.00	62,422,500	貸付有価証券 2,500株（2,400株）

古野電気	17,200	842.00	14,482,400	
ユニデンホールディングス	40,000	272.00	10,880,000	
アルパイン	34,400	2,050.00	70,520,000	貸付有価証券 16,100株(16,100株)
スミダコーポレーション	14,800	1,497.00	22,155,600	貸付有価証券 6,500株
アイコム	8,000	2,748.00	21,984,000	
リオン	6,100	2,525.00	15,402,500	
本多通信工業	11,200	1,093.00	12,241,600	貸付有価証券 4,400株
船井電機	14,600	771.00	11,256,600	貸付有価証券 6,800株
横河電機	144,600	2,383.00	344,581,800	貸付有価証券 1,100株
新電元工業	5,100	6,850.00	34,935,000	
アズビル	43,300	5,040.00	218,232,000	貸付有価証券 700株
東亜ディーケーケー	7,100	1,301.00	9,237,100	貸付有価証券 100株
日本光電工業	60,400	2,961.00	178,844,400	
チノー	5,000	1,520.00	7,600,000	
共和電業	16,400	432.00	7,084,800	
日本電子材料	5,700	824.00	4,696,800	
堀場製作所	28,600	7,810.00	223,366,000	
アドバンテスト	80,500	2,306.00	185,633,000	貸付有価証券 6,800株
小野測器	6,200	887.00	5,499,400	
エスベック	12,800	2,549.00	32,627,200	
キーエンス	70,900	63,720.00	4,517,748,000	
日置電機	7,500	4,315.00	32,362,500	
シスメックス	112,400	9,290.00	1,044,196,000	貸付有価証券 200株
日本マイクロニクス	25,100	1,136.00	28,513,600	貸付有価証券 11,000株
メガチップス	11,400	3,590.00	40,926,000	貸付有価証券 5,300株
OBARA GROUP	8,400	6,380.00	53,592,000	
澤藤電機	1,600	2,005.00	3,208,000	貸付有価証券 600株(600株)

コーセル	20,000	1,414.00	28,280,000	
イリソ電子工業	12,100	6,480.00	78,408,000	
新日本無線	8,800	796.00	7,004,800	貸付有価証券 4,000株
オブテックスグループ	23,500	3,135.00	73,672,500	貸付有価証券 2,600株（1,200株）
千代田インテグレ	6,700	2,487.00	16,662,900	
アイ・オー・データ機器	6,000	1,134.00	6,804,000	貸付有価証券 1,400株（900株）
レーザーテック	29,600	3,855.00	114,108,000	貸付有価証券 2,900株
スタンレー電気	110,500	4,030.00	445,315,000	
岩崎電気	5,600	1,698.00	9,508,800	
ウシオ電機	87,700	1,511.00	132,514,700	貸付有価証券 600株（600株）
岡谷電機産業	7,700	658.00	5,066,600	貸付有価証券 3,600株
ヘリオス テクノ ホールディング	12,300	939.00	11,549,700	貸付有価証券 5,700株（5,200株）
日本セラミック	14,700	2,833.00	41,645,100	
遠藤照明	7,300	1,068.00	7,796,400	貸付有価証券 300株
古河電池	10,300	973.00	10,021,900	貸付有価証券 4,800株
双信電機	6,300	581.00	3,660,300	貸付有価証券 2,900株
山一電機	10,500	1,833.00	19,246,500	貸付有価証券 4,800株
図研	9,400	1,530.00	14,382,000	
日本電子	53,000	923.00	48,919,000	貸付有価証券 1,000株
カシオ計算機	116,200	1,756.00	204,047,200	貸付有価証券 14,600株（700株）
ファナック	137,300	26,235.00	3,602,065,500	貸付有価証券 300株
日本シイエムケイ	25,500	840.00	21,420,000	貸付有価証券 11,800株
エンプラス	6,500	3,005.00	19,532,500	
大真空	5,300	1,319.00	6,990,700	
ローム	64,800	9,690.00	627,912,000	
浜松ホトニクス	105,200	4,260.00	448,152,000	

三井ハイテック	19,000	1,616.00	30,704,000	貸付有価証券 8,900株
新光電気工業	54,600	794.00	43,352,400	
京セラ	237,100	6,159.00	1,460,298,900	
太陽誘電	64,800	1,908.00	123,638,400	貸付有価証券 10,200株（2,200株）
村田製作所	151,500	14,035.00	2,126,302,500	貸付有価証券 300株
ユーシン	21,700	743.00	16,123,100	貸付有価証券 10,100株（5,200株）
双葉電子工業	23,600	2,225.00	52,510,000	
北陸電気工業	5,800	1,494.00	8,665,200	
ニチコン	45,500	1,225.00	55,737,500	
日本ケミコン	11,700	2,567.00	30,033,900	
K O A	20,000	2,284.00	45,680,000	
市光工業	21,600	1,180.00	25,488,000	貸付有価証券 9,900株（3,900株）
小糸製作所	86,500	7,420.00	641,830,000	
ミツバ	26,600	1,555.00	41,363,000	貸付有価証券 4,600株（3,300株）
S C R E E Nホールディングス	27,300	8,690.00	237,237,000	貸付有価証券 100株
キャノン電子	13,200	2,485.00	32,802,000	
キャノン	777,600	3,860.00	3,001,536,000	貸付有価証券 149,700株
リコー	434,300	1,099.00	477,295,700	貸付有価証券 3,000株
象印マホービン	26,900	1,427.00	38,386,300	貸付有価証券 12,600株
M U T O Hホールディングス	2,000	2,452.00	4,904,000	貸付有価証券 200株（200株）
東京エレクトロン	96,300	19,650.00	1,892,295,000	
トヨタ紡織	42,100	2,415.00	101,671,500	貸付有価証券 200株
芦森工業	3,000	2,501.00	7,503,000	貸付有価証券 1,400株
ユニプレス	27,900	2,613.00	72,902,700	
豊田自動織機	116,900	6,390.00	746,991,000	貸付有価証券 8,100株
モリタホールディングス	23,100	2,111.00	48,764,100	

三櫻工業	18,300	789.00	14,438,700	
デンソー	320,500	5,880.00	1,884,540,000	
東海理化電機製作所	38,000	2,187.00	83,106,000	貸付有価証券 2,900株
三井E & Sホールディング グス	52,200	1,866.00	97,405,200	貸付有価証券 18,400株（5,900株）
川崎重工業	112,400	3,570.00	401,268,000	
名村造船所	43,300	677.00	29,314,100	貸付有価証券 4,000株（1,800株）
サノヤスホールディング ス	17,500	270.00	4,725,000	貸付有価証券 7,900株
日本車輛製造	53,000	333.00	17,649,000	貸付有価証券 4,000株
三菱ロジスネクスト	17,200	914.00	15,720,800	貸付有価証券 2,400株
近畿車輛	2,200	2,532.00	5,570,400	貸付有価証券 300株
日産自動車	1,703,500	1,135.00	1,933,472,500	貸付有価証券 126,100株
いすゞ自動車	418,500	1,646.50	689,060,250	貸付有価証券 2,300株
トヨタ自動車	1,755,900	6,970.00	12,238,623,000	貸付有価証券 8,100株
日野自動車	206,100	1,385.00	285,448,500	貸付有価証券 3,100株
三菱自動車工業	534,600	774.00	413,780,400	貸付有価証券 80,400株（80,400株）
エフテック	9,200	1,377.00	12,668,400	
レシップホールディング ス	5,200	801.00	4,165,200	
G M B	2,300	1,755.00	4,036,500	
ファルテック	2,500	1,314.00	3,285,000	
武蔵精密工業	15,400	3,860.00	59,444,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
日産車体	56,400	1,195.00	67,398,000	
新明和工業	62,800	1,141.00	71,654,800	貸付有価証券 12,800株（1,900株）
極東開発工業	26,800	1,683.00	45,104,400	貸付有価証券 900株（900株）
日信工業	29,400	1,886.00	55,448,400	貸付有価証券 100株（100株）

トピー工業	11,900	3,215.00	38,258,500	
ティラド	5,200	3,875.00	20,150,000	
曙ブレーキ工業	67,100	284.00	19,056,400	貸付有価証券 31,500株（600株）
タチエス	24,500	1,954.00	47,873,000	
N O K	77,600	2,212.00	171,651,200	
フタバ産業	44,200	899.00	39,735,800	貸付有価証券 20,400株（20,400株）
K Y B	15,000	5,330.00	79,950,000	
大同メタル工業	18,100	1,342.00	24,290,200	貸付有価証券 100株
プレス工業	76,700	639.00	49,011,300	
ミクニ	18,300	632.00	11,565,600	
太平洋工業	30,200	1,452.00	43,850,400	貸付有価証券 1,800株
ケーヒン	33,200	2,194.00	72,840,800	貸付有価証券 6,300株
河西工業	17,700	1,505.00	26,638,500	
アイシン精機	118,900	5,890.00	700,321,000	
マツダ	453,300	1,478.00	669,977,400	
今仙電機製作所	13,400	1,204.00	16,133,600	
本田技研工業	1,299,700	3,675.00	4,776,397,500	
スズキ	286,300	5,725.00	1,639,067,500	貸付有価証券 5,800株（100株）
S U B A R U	448,400	3,542.00	1,588,232,800	貸付有価証券 11,500株
安永	7,000	2,367.00	16,569,000	貸付有価証券 3,200株（1,500株）
ヤマハ発動機	204,000	3,455.00	704,820,000	貸付有価証券 19,800株
ショーワ	37,500	1,657.00	62,137,500	
T B K	17,200	525.00	9,030,000	
エクセディ	17,400	3,555.00	61,857,000	
豊田合成	52,500	2,567.00	134,767,500	貸付有価証券 1,800株
愛三工業	25,400	1,165.00	29,591,000	
盟和産業	2,200	1,310.00	2,882,000	
日本プラスト	5,900	1,027.00	6,059,300	貸付有価証券 2,600株

ヨロズ	14,600	1,829.00	26,703,400	貸付有価証券 200株(200株)
エフ・シー・シー	23,600	3,085.00	72,806,000	
シマノ	58,200	14,050.00	817,710,000	
テイ・エス テック	33,500	4,405.00	147,567,500	
ジャムコ	7,200	2,421.00	17,431,200	貸付有価証券 3,300株(100株)
テルモ	221,400	5,950.00	1,317,330,000	貸付有価証券 14,200株
クリエートメディック	4,800	1,179.00	5,659,200	
日機装	50,000	1,184.00	59,200,000	
島津製作所	172,600	3,025.00	522,115,000	貸付有価証券 2,600株
JMS	13,300	623.00	8,285,900	
クボテック	3,100	531.00	1,646,100	
長野計器	11,300	1,292.00	14,599,600	
ブイ・テクノロジー	3,400	28,850.00	98,090,000	
東京計器	9,200	1,179.00	10,846,800	貸付有価証券 3,400株
愛知時計電機	1,900	3,965.00	7,533,500	
インターアクション	5,700	1,415.00	8,065,500	貸付有価証券 2,600株
オーバル	14,100	305.00	4,300,500	貸付有価証券 6,200株
東京精密	26,100	4,150.00	108,315,000	
マニー	17,600	4,325.00	76,120,000	
ニコン	251,700	1,897.00	477,474,900	
トプコン	77,600	2,095.00	162,572,000	
オリンパス	215,100	3,965.00	852,871,500	貸付有価証券 1,600株
理研計器	13,800	2,372.00	32,733,600	
タムロン	11,600	2,252.00	26,123,200	
H O Y A	290,800	5,706.00	1,659,304,800	
シード	1,500	7,490.00	11,235,000	貸付有価証券 700株
ノーリツ鋼機	14,600	2,799.00	40,865,400	貸付有価証券 6,800株(100株)
エー・アンド・デイ	13,200	658.00	8,685,600	
シチズン時計	172,400	813.00	140,161,200	貸付有価証券

				2,500株
リズム時計工業	5,500	2,320.00	12,760,000	
大研医器	12,900	731.00	9,429,900	貸付有価証券 4,500株(400株)
メニコン	19,800	2,838.00	56,192,400	
シンシア	1,200	716.00	859,200	貸付有価証券 500株
松風	7,000	1,448.00	10,136,000	
セイコーホールディングス	22,300	2,862.00	63,822,600	貸付有価証券 6,500株(1,700株)
ニプロ	100,000	1,546.00	154,600,000	貸付有価証券 10,000株(2,100株)
中本パックス	2,700	1,986.00	5,362,200	
スノーピーク	4,400	1,442.00	6,344,800	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	15,200	5,330.00	81,016,000	
トランザクション	6,500	1,017.00	6,610,500	貸付有価証券 3,000株
S H O - B I	4,800	432.00	2,073,600	貸付有価証券 1,900株
ニホンフラッシュ	6,700	2,692.00	18,036,400	貸付有価証券 100株(100株)
前田工織	14,500	1,662.00	24,099,000	
永大産業	18,900	553.00	10,451,700	
アートネイチャー	15,400	706.00	10,872,400	
バンダイナムコホールディングス	149,300	3,675.00	548,677,500	
アイフィスジャパン	3,200	692.00	2,214,400	
共立印刷	24,000	368.00	8,832,000	
S H O E I	6,500	4,175.00	27,137,500	貸付有価証券 2,700株
フランスベッドホールディングス	17,100	972.00	16,621,200	
パイロットコーポレーション	25,200	5,900.00	148,680,000	
萩原工業	8,000	1,863.00	14,904,000	
トッパン・フォームズ	30,900	1,191.00	36,801,900	
フジシールインターナショナル	32,400	4,025.00	130,410,000	
タカラトミー	60,500	1,089.00	65,884,500	

廣濟堂	13,400	534.00	7,155,600	
A s - m e エステール	4,200	902.00	3,788,400	
アーク	73,500	120.00	8,820,000	貸付有価証券 34,500株
タカノ	6,300	969.00	6,104,700	
プロネクサス	13,500	1,352.00	18,252,000	
ホクシン	10,200	184.00	1,876,800	
ウッドワン	4,900	1,458.00	7,144,200	
大建工業	11,300	2,668.00	30,148,400	
凸版印刷	408,000	895.00	365,160,000	
大日本印刷	189,000	2,324.00	439,236,000	貸付有価証券 8,500株（7,700株）
図書印刷	9,700	1,013.00	9,826,100	貸付有価証券 3,600株
共同印刷	4,400	3,295.00	14,498,000	
N I S S H A	29,600	2,932.00	86,787,200	貸付有価証券 5,300株
光村印刷	1,300	2,442.00	3,174,600	
宝印刷	7,500	1,965.00	14,737,500	
アシックス	143,500	2,071.00	297,188,500	貸付有価証券 66,200株（1,900株）
ツツミ	4,500	2,035.00	9,157,500	
小松ウオール工業	4,900	2,344.00	11,485,600	
ヤマハ	97,300	4,975.00	484,067,500	貸付有価証券 700株
河合楽器製作所	4,800	3,620.00	17,376,000	
クリナップ	13,400	876.00	11,738,400	
ピジョン	87,300	4,940.00	431,262,000	
兼松サステック	1,100	2,022.00	2,224,200	
キングジム	12,000	1,094.00	13,128,000	
リンテック	34,300	3,165.00	108,559,500	貸付有価証券 100株（100株）
イトーキ	30,400	737.00	22,404,800	
任天堂	88,900	46,300.00	4,116,070,000	
三菱鉛筆	23,800	2,409.00	57,334,200	貸付有価証券 100株
タカラスタンダード	29,800	1,818.00	54,176,400	貸付有価証券 13,300株
コクヨ	69,300	2,071.00	143,520,300	

ナカバヤシ	14,200	617.00	8,761,400	
グロープライド	6,500	2,961.00	19,246,500	
オカムラ	50,400	1,499.00	75,549,600	貸付有価証券 2,400株
美津濃	14,300	3,395.00	48,548,500	
東京電力ホールディングス	1,153,100	467.00	538,497,700	貸付有価証券 18,800株
中部電力	441,900	1,684.50	744,380,550	貸付有価証券 3,500株
関西電力	589,400	1,481.50	873,196,100	
中国電力	199,700	1,335.00	266,599,500	貸付有価証券 69,100株
北陸電力	141,500	1,021.00	144,471,500	貸付有価証券 66,500株（100株）
東北電力	338,300	1,468.00	496,624,400	貸付有価証券 2,000株
四国電力	130,100	1,365.00	177,586,500	
九州電力	319,000	1,287.00	410,553,000	貸付有価証券 108,800株（108,800株）
北海道電力	144,800	693.00	100,346,400	貸付有価証券 68,000株（200株）
沖縄電力	23,300	3,170.00	73,861,000	
電源開発	114,900	2,893.00	332,405,700	
エフオン	7,200	1,463.00	10,533,600	貸付有価証券 3,300株
イーレックス	22,800	848.00	19,334,400	貸付有価証券 10,700株
レノバ	3,700	2,904.00	10,744,800	貸付有価証券 1,700株
東京瓦斯	308,100	2,831.00	872,231,100	貸付有価証券 1,900株
大阪瓦斯	280,300	2,259.00	633,197,700	
東邦瓦斯	71,500	3,385.00	242,027,500	貸付有価証券 200株
北海道瓦斯	39,000	298.00	11,622,000	
広島ガス	29,700	372.00	11,048,400	貸付有価証券 100株（100株）
西部瓦斯	17,500	2,714.00	47,495,000	
静岡ガス	41,000	953.00	39,073,000	

メタウォーター	8,100	3,285.00	26,608,500	
SBSホールディングス	14,200	1,364.00	19,368,800	貸付有価証券 500株
東武鉄道	154,300	3,300.00	509,190,000	
相鉄ホールディングス	46,200	2,985.00	137,907,000	
東京急行電鉄	392,300	1,761.00	690,840,300	貸付有価証券 1,200株
京浜急行電鉄	197,900	1,900.00	376,010,000	貸付有価証券 8,900株
小田急電鉄	214,800	2,266.00	486,736,800	
京王電鉄	80,700	4,820.00	388,974,000	貸付有価証券 500株(100株)
京成電鉄	100,500	3,405.00	342,202,500	貸付有価証券 1,200株
富士急行	19,700	2,905.00	57,228,500	貸付有価証券 400株
新京成電鉄	3,700	2,207.00	8,165,900	
東日本旅客鉄道	259,400	10,145.00	2,631,613,000	
西日本旅客鉄道	130,300	7,554.00	984,286,200	貸付有価証券 700株
東海旅客鉄道	129,300	20,615.00	2,665,519,500	貸付有価証券 100株
西武ホールディングス	184,100	1,812.00	333,589,200	
鴻池運輸	20,400	1,838.00	37,495,200	
西日本鉄道	40,000	2,929.00	117,160,000	貸付有価証券 1,500株
ハマキョウレックス	10,200	3,755.00	38,301,000	
サカイ引越センター	7,600	5,790.00	44,004,000	貸付有価証券 100株
近鉄グループホールディングス	136,800	4,280.00	585,504,000	
阪急阪神ホールディングス	182,400	4,100.00	747,840,000	貸付有価証券 200株
南海電気鉄道	64,800	2,780.00	180,144,000	貸付有価証券 1,400株
京阪ホールディングス	60,900	3,400.00	207,060,000	貸付有価証券 200株
神戸電鉄	3,300	3,930.00	12,969,000	貸付有価証券 200株
名古屋鉄道	108,100	2,731.00	295,221,100	貸付有価証券 1,300株

山陽電気鉄道	10,500	2,769.00	29,074,500	
日本通運	53,700	7,670.00	411,879,000	貸付有価証券 700株
ヤマトホールディングス	239,800	2,885.00	691,823,000	貸付有価証券 2,000株
山九	35,100	5,190.00	182,169,000	
丸運	7,800	337.00	2,628,600	
丸全昭和運輸	48,000	517.00	24,816,000	
センコーグループホールディングス	82,300	831.00	68,391,300	貸付有価証券 3,400株
トナミホールディングス	3,300	6,470.00	21,351,000	
ニッコンホールディングス	52,000	2,900.00	150,800,000	
日本石油輸送	1,600	3,155.00	5,048,000	
福山通運	20,000	4,675.00	93,500,000	貸付有価証券 100株（100株）
セイノーホールディングス	102,400	1,957.00	200,396,800	
神奈川中央交通	3,400	3,785.00	12,869,000	
日立物流	30,100	2,929.00	88,162,900	
丸和運輸機関	7,200	3,080.00	22,176,000	貸付有価証券 3,300株（3,200株）
C & F ロジホールディングス	15,000	1,504.00	22,560,000	
九州旅客鉄道	114,800	3,440.00	394,912,000	
S Gホールディングス	96,900	2,437.00	236,145,300	貸付有価証券 2,400株
日本郵船	114,400	2,333.00	266,895,200	貸付有価証券 1,900株
商船三井	86,600	3,380.00	292,708,000	貸付有価証券 600株
川崎汽船	63,200	2,583.00	163,245,600	貸付有価証券 28,800株（200株）
N S ユナイテッド海運	6,400	2,353.00	15,059,200	
明治海運	14,500	441.00	6,394,500	
飯野海運	69,700	542.00	37,777,400	
共栄タンカー	1,000	1,908.00	1,908,000	貸付有価証券 400株
乾汽船	10,500	867.00	9,103,500	
日本航空	253,800	4,246.00	1,077,634,800	

ANAホールディングス	268,100	4,226.00	1,132,990,600	貸付有価証券 40,400株（38,600株）
パスコ	13,000	320.00	4,160,000	貸付有価証券 1,000株
トランコム	3,800	7,800.00	29,640,000	
日新	11,800	2,753.00	32,485,400	
三菱倉庫	47,300	2,405.00	113,756,500	貸付有価証券 5,400株
三井倉庫ホールディングス	78,000	345.00	26,910,000	
住友倉庫	95,000	740.00	70,300,000	
澁澤倉庫	7,500	1,811.00	13,582,500	
東陽倉庫	24,700	371.00	9,163,700	
日本トランスシティ	33,100	493.00	16,318,300	
ケイヒン	2,600	1,627.00	4,230,200	
中央倉庫	8,300	1,099.00	9,121,700	
川西倉庫	2,800	1,853.00	5,188,400	貸付有価証券 700株
安田倉庫	12,300	1,001.00	12,312,300	
東洋埠頭	4,200	1,711.00	7,186,200	
宇徳	11,700	451.00	5,276,700	
上組	84,400	2,356.00	198,846,400	
サンリツ	3,500	765.00	2,677,500	
キムラユニティー	3,700	1,095.00	4,051,500	
キューソー流通システム	4,000	2,817.00	11,268,000	貸付有価証券 100株
近鉄エクスプレス	25,800	2,014.00	51,961,200	
東海運	7,800	388.00	3,026,400	貸付有価証券 400株
エーアイティー	9,700	1,202.00	11,659,400	
内外トランスライン	4,800	1,797.00	8,625,600	
日本コンセプト	2,600	1,454.00	3,780,400	
NEC ネットエスアイ	15,600	2,853.00	44,506,800	
システナ	11,400	4,305.00	49,077,000	
デジタルアーツ	7,000	4,325.00	30,275,000	貸付有価証券 3,200株（2,900株）
新日鉄住金ソリューションズ	21,200	3,115.00	66,038,000	
キューブシステム	8,200	803.00	6,584,600	

エイジア	2,100	1,496.00	3,141,600	貸付有価証券 900株
コア	6,000	1,351.00	8,106,000	貸付有価証券 900株
ソリトンシステムズ	4,600	1,486.00	6,835,600	貸付有価証券 2,100株
ソフトクリエイトホールディングス	6,800	1,635.00	11,118,000	
T I S	47,200	4,240.00	200,128,000	
ネオス	4,200	400.00	1,680,000	
電算システム	5,000	2,089.00	10,445,000	
グリー	76,000	620.00	47,120,000	
コーエーテクモホールディングス	24,200	2,119.00	51,279,800	貸付有価証券 100株
三菱総合研究所	6,100	3,215.00	19,611,500	
ボルテージ	2,800	929.00	2,601,200	貸付有価証券 1,100株（200株）
電算	1,600	2,339.00	3,742,400	
A G S	8,000	868.00	6,944,000	
ファインデックス	11,700	702.00	8,213,400	貸付有価証券 5,400株（2,800株）
ヒト・コミュニケーションズ	3,200	1,912.00	6,118,400	貸付有価証券 1,400株（200株）
ブレインパッド	3,000	2,787.00	8,361,000	貸付有価証券 1,400株（100株）
K L a b	27,500	1,928.00	53,020,000	貸付有価証券 12,500株
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	10,300	1,823.00	18,776,900	貸付有価証券 3,200株
イーブクイニシアティブジャパン	2,200	1,270.00	2,794,000	
ネクソン	316,600	1,561.00	494,212,600	貸付有価証券 1,200株
アイスタイル	36,000	1,407.00	50,652,000	貸付有価証券 16,300株
エムアップ	4,700	1,878.00	8,826,600	貸付有価証券 2,200株（1,800株）
エイチーム	9,700	2,268.00	21,999,600	貸付有価証券 3,900株（3,400株）
テクノスジャパン	12,800	940.00	12,032,000	貸付有価証券 4,400株

e n i s h	4,800	1,099.00	5,275,200	貸付有価証券 2,100株(200株)
コロブラ	46,200	826.00	38,161,200	貸付有価証券 1,100株
モバイルクリエイト	11,400	368.00	4,195,200	貸付有価証券 500株
オルトプラス	6,900	861.00	5,940,900	貸付有価証券 3,100株(100株)
ブロードリーフ	70,200	528.00	37,065,600	
ハーツユニテッドグループ	7,500	1,831.00	13,732,500	貸付有価証券 3,000株
メディアドゥホールディングス	4,600	1,668.00	7,672,800	貸付有価証券 2,100株
ブイキューブ	8,700	604.00	5,254,800	貸付有価証券 3,900株(1,000株)
サイバーリンクス	2,200	1,156.00	2,543,200	
ディー・エル・イー	9,100	459.00	4,176,900	貸付有価証券 4,100株(800株)
フィックスターズ	12,000	1,394.00	16,728,000	貸付有価証券 5,600株(100株)
VOYAGE GROUP	6,900	1,276.00	8,804,400	
オブティム	2,500	2,472.00	6,180,000	貸付有価証券 1,100株
セレス	4,400	1,866.00	8,210,400	貸付有価証券 2,000株
ベリサーブ	1,900	3,045.00	5,785,500	貸付有価証券 700株
ティーガイア	14,200	3,040.00	43,168,000	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
セック	1,400	2,604.00	3,645,600	貸付有価証券 500株
日本アジアグループ	14,900	554.00	8,254,600	
豆蔵ホールディングス	10,500	1,282.00	13,461,000	貸付有価証券 100株
テクマトリックス	7,800	1,554.00	12,121,200	貸付有価証券 3,500株
プロシップ	2,000	2,580.00	5,160,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	384,300	372.00	142,959,600	貸付有価証券 177,200株
GMOペイメントゲートウェイ	10,000	10,850.00	108,500,000	貸付有価証券 4,700株

ザッパラス	6,700	389.00	2,606,300	
システムリサーチ	1,400	2,359.00	3,302,600	
インターネットイニシア ティブ	23,000	2,056.00	47,288,000	貸付有価証券 4,400株
さくらインターネット	16,900	780.00	13,182,000	貸付有価証券 7,900株
ヴィンクス	3,000	2,025.00	6,075,000	貸付有価証券 1,400株（1,200株）
GMOクラウド	3,100	2,346.00	7,272,600	貸付有価証券 1,400株（500株）
S R Aホールディングス	7,500	3,085.00	23,137,500	
M i n o r i ソリュ ーションズ	2,800	1,575.00	4,410,000	
システムインテグレータ	2,000	1,089.00	2,178,000	貸付有価証券 300株（100株）
朝日ネット	12,900	515.00	6,643,500	
e B A S E	2,800	1,333.00	3,732,400	貸付有価証券 200株
アドソル日進	5,400	1,301.00	7,025,400	貸付有価証券 1,000株
フリービット	9,400	1,131.00	10,631,400	貸付有価証券 4,300株（4,200株）
コムチュア	7,200	3,755.00	27,036,000	貸付有価証券 3,300株（2,900株）
サイバーコム	2,500	2,253.00	5,632,500	貸付有価証券 1,100株
メディカル・データ・ビ ジョン	5,400	3,380.00	18,252,000	貸付有価証券 2,500株（1,600株）
g u m i	16,300	1,033.00	16,837,900	貸付有価証券 6,500株
ショーケース・ティー ビー	2,700	1,495.00	4,036,500	貸付有価証券 1,200株
モバイルファクトリー	2,600	1,428.00	3,712,800	貸付有価証券 1,200株
デジタル・インフォメー ション・テクノロジ	4,700	1,234.00	5,799,800	貸付有価証券 1,800株（800株）
P C Iホールディングス	2,400	3,060.00	7,344,000	
パイプドHD	2,200	1,078.00	2,371,600	貸付有価証券 600株
アイビーシー	1,500	1,330.00	1,995,000	貸付有価証券 600株（500株）

ネオジャパン	2,500	1,298.00	3,245,000	貸付有価証券 1,100株
オープンドア	5,600	2,103.00	11,776,800	貸付有価証券 300株
マイネット	2,800	1,230.00	3,444,000	貸付有価証券 1,300株(1,000株)
アカツキ	2,800	4,885.00	13,678,000	貸付有価証券 1,300株(100株)
Ubicomホールディングス	1,500	932.00	1,398,000	貸付有価証券 700株(100株)
LINE	42,800	4,035.00	172,698,000	貸付有価証券 20,100株(17,500株)
シンクロ・フード	3,600	1,156.00	4,161,600	
オークネット	4,500	1,558.00	7,011,000	貸付有価証券 1,800株
AOI TYO Holdings	11,600	1,600.00	18,560,000	
マクロミル	13,300	2,914.00	38,756,200	貸付有価証券 4,600株
ソルクシーズ	5,400	1,086.00	5,864,400	貸付有価証券 2,500株(2,400株)
フェイス	5,000	1,154.00	5,770,000	
ハイマックス	1,900	1,662.00	3,157,800	
野村総合研究所	90,000	5,090.00	458,100,000	
サイバネットシステム	11,600	857.00	9,941,200	貸付有価証券 200株
CEホールディングス	4,000	814.00	3,256,000	貸付有価証券 1,600株
日本システム技術	1,700	1,329.00	2,259,300	
インタージホールディングス	16,600	1,189.00	19,737,400	
東邦システムサイエンス	4,700	866.00	4,070,200	
ソースネクスト	19,900	820.00	16,318,000	貸付有価証券 9,300株(7,800株)
フォーカスシステムズ	8,000	954.00	7,632,000	貸付有価証券 500株
クレスコ	3,200	3,690.00	11,808,000	
フジ・メディア・ホールディングス	148,400	1,815.00	269,346,000	貸付有価証券 56,000株
オービック	44,700	8,790.00	392,913,000	貸付有価証券 700株

ジャストシステム	23,000	2,565.00	58,995,000	
TDCソフト	6,200	1,297.00	8,041,400	
ヤフー	1,021,900	442.00	451,679,800	貸付有価証券 470,000株（5,100株）
トレンドマイクロ	69,200	6,470.00	447,724,000	貸付有価証券 1,500株
インフォメーション・ ディベロプメント	4,500	1,472.00	6,624,000	貸付有価証券 1,800株
日本オラクル	23,000	8,760.00	201,480,000	
アルファシステムズ	4,700	2,308.00	10,847,600	
フューチャー	19,200	1,231.00	23,635,200	
C A C H o l d i n g s	10,600	1,075.00	11,395,000	
ソフトバンク・テクノロ ジー	5,900	1,877.00	11,074,300	
トーセ	3,800	1,220.00	4,636,000	貸付有価証券 1,700株（1,600株）
オービックビジネスコン サルタント	7,200	6,730.00	48,456,000	貸付有価証券 800株
伊藤忠テクノソリュー ションズ	64,600	2,182.00	140,957,200	
アイティフォー	17,200	868.00	14,929,600	貸付有価証券 700株（700株）
東計電算	2,500	3,220.00	8,050,000	
エックスネット	2,200	885.00	1,947,000	
大塚商会	85,200	4,865.00	414,498,000	
サイボウズ	18,900	532.00	10,054,800	貸付有価証券 300株（300株）
ソフトブレーン	11,100	439.00	4,872,900	貸付有価証券 5,200株（100株）
電通国際情報サービス	8,800	2,852.00	25,097,600	貸付有価証券 100株
デジタルガレージ	25,500	3,560.00	90,780,000	貸付有価証券 8,600株
E Mシステムズ	9,800	1,290.00	12,642,000	貸付有価証券 1,600株
ウェザーニューズ	4,800	3,375.00	16,200,000	貸付有価証券 2,200株（200株）
C I J	11,100	718.00	7,969,800	
東洋ビジネスエンジニア リング	1,400	1,825.00	2,555,000	

日本エンタープライズ	14,600	222.00	3,241,200	貸付有価証券 2,000株
WOWOW	6,800	3,375.00	22,950,000	貸付有価証券 3,100株
スカラ	11,400	838.00	9,553,200	
イマジカ・ロボット ホールディングス	12,000	1,250.00	15,000,000	貸付有価証券 2,300株(2,000株)
ネットワンシステムズ	57,800	1,545.00	89,301,000	
システムソフト	33,500	142.00	4,757,000	貸付有価証券 15,400株(200株)
アルゴグラフィックス	6,500	3,475.00	22,587,500	
マーベラス	24,000	932.00	22,368,000	貸付有価証券 11,000株(5,200株)
エイベックス	26,300	1,543.00	40,580,900	貸付有価証券 200株
日本ユニシス	39,300	2,261.00	88,857,300	
兼松エレクトロニクス	9,000	3,290.00	29,610,000	
東京放送ホールディング ス	78,300	2,345.00	183,613,500	
日本テレビホールディン グス	130,100	1,863.00	242,376,300	貸付有価証券 6,100株
朝日放送グループホール ディングス	14,100	874.00	12,323,400	
テレビ朝日ホールディン グス	38,900	2,534.00	98,572,600	貸付有価証券 10,300株
スカパーJ S A Tホール ディングス	108,200	496.00	53,667,200	貸付有価証券 12,500株(12,500株)
テレビ東京ホールディン グス	11,600	2,866.00	33,245,600	
日本BS放送	4,800	1,388.00	6,662,400	貸付有価証券 100株(100株)
ビジョン	3,600	2,967.00	10,681,200	貸付有価証券 1,100株
USEN-NEXT H OLDINGS	3,700	911.00	3,370,700	貸付有価証券 1,700株
ワイレスゲート	6,600	1,494.00	9,860,400	貸付有価証券 2,900株
コネクシオ	10,000	2,376.00	23,760,000	
日本通信	127,800	118.00	15,080,400	貸付有価証券 44,600株(2,600株)
クロップス	3,000	898.00	2,694,000	貸付有価証券

				1,300株(200株)
日本電信電話	1,017,100	5,173.00	5,261,458,300	
K D D I	1,276,200	2,866.50	3,658,227,300	貸付有価証券 900株
光通信	17,100	17,380.00	297,198,000	
N T T ドコモ	1,049,200	2,773.50	2,909,956,200	貸付有価証券 39,400株
エムティーアイ	19,100	657.00	12,548,700	貸付有価証券 7,100株(4,900株)
G M O インターネット	51,600	1,919.00	99,020,400	貸付有価証券 24,200株(200株)
アイドママーケティング コミュニケーション	2,300	690.00	1,587,000	
カドカワ	41,300	1,172.00	48,403,600	貸付有価証券 11,900株(2,100株)
学研ホールディングス	4,800	4,785.00	22,968,000	
ゼンリン	25,700	2,182.00	56,077,400	貸付有価証券 5,800株(3,700株)
昭文社	6,500	813.00	5,284,500	
インプレスホールディン グス	11,700	214.00	2,503,800	貸付有価証券 5,400株
アイネット	8,000	1,627.00	13,016,000	
松竹	9,400	15,980.00	150,212,000	貸付有価証券 100株
東宝	93,200	3,610.00	336,452,000	
東映	5,300	11,800.00	62,540,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	440,300	1,158.00	509,867,400	貸付有価証券 2,000株
ピー・シー・エー	2,100	1,729.00	3,630,900	
ビジネスブレイン太田昭 和	2,400	2,411.00	5,786,400	
D T S	14,700	3,875.00	56,962,500	
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	65,900	4,520.00	297,868,000	
シーイーシー	8,400	3,325.00	27,930,000	
カプコン	60,700	2,141.00	129,958,700	貸付有価証券 4,700株(4,200株)
アイ・エス・ピー	2,700	1,663.00	4,490,100	貸付有価証券 100株
ジャステック	8,200	1,218.00	9,987,600	

S C S K	32,700	4,625.00	151,237,500	
日本システムウエア	4,700	2,850.00	13,395,000	
アイネス	18,000	1,129.00	20,322,000	貸付有価証券 100株（100株）
T K C	13,200	4,110.00	54,252,000	
富士ソフト	19,600	4,180.00	81,928,000	
N S D	23,300	2,213.00	51,562,900	
コナミホールディングス	57,900	5,320.00	308,028,000	
福井コンピュータホールディングス	4,100	2,144.00	8,790,400	貸付有価証券 1,600株（400株）
J B C C ホールディングス	11,200	1,100.00	12,320,000	
ミロク情報サービス	12,500	3,165.00	39,562,500	
ソフトバンクグループ	641,700	8,180.00	5,249,106,000	
ハウスイ	1,100	1,165.00	1,281,500	
高千穂交易	5,500	1,127.00	6,198,500	
伊藤忠食品	3,500	6,080.00	21,280,000	
エレマテック	6,600	2,508.00	16,552,800	
J A L U X	4,000	3,090.00	12,360,000	
あらた	7,000	6,220.00	43,540,000	貸付有価証券 100株（100株）
トーメンデバイス	2,100	2,757.00	5,789,700	貸付有価証券 900株（200株）
東京エレクトロン デバイス	5,200	2,074.00	10,784,800	
フィールズ	10,900	1,167.00	12,720,300	貸付有価証券 3,100株
双日	841,800	355.00	298,839,000	
アルフレッサ ホールディングス	158,100	2,317.00	366,317,700	
横浜冷凍	35,500	1,101.00	39,085,500	貸付有価証券 15,300株（12,100株）
神栄	2,000	1,428.00	2,856,000	貸付有価証券 400株
ラサ商事	6,300	906.00	5,707,800	貸付有価証券 200株
ラクーン	8,300	674.00	5,594,200	貸付有価証券 2,500株（100株）
アルコニックス	15,100	2,090.00	31,559,000	貸付有価証券 2,300株

神戸物産	9,200	5,110.00	47,012,000	貸付有価証券 4,300株
ペッパーフードサービス	7,600	5,900.00	44,840,000	貸付有価証券 3,200株(2,700株)
あいホールディングス	22,800	2,875.00	65,550,000	
ディー・ブイエックス	5,100	1,296.00	6,609,600	
ダイワボウホールディングス	12,100	4,990.00	60,379,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	27,200	1,872.00	50,918,400	
ラクト・ジャパン	2,000	5,180.00	10,360,000	貸付有価証券 900株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	26,800	1,069.00	28,649,200	貸付有価証券 8,800株(8,800株)
八洲電機	11,000	914.00	10,054,000	
メディアスホールディングス	7,900	986.00	7,789,400	貸付有価証券 300株
U K Cホールディングス	9,200	2,280.00	20,976,000	貸付有価証券 200株
ジューテックホールディングス	3,200	1,136.00	3,635,200	貸付有価証券 700株
大光	3,600	874.00	3,146,400	貸付有価証券 600株
O C H Iホールディングス	4,100	1,449.00	5,940,900	
T O K A Iホールディングス	75,200	1,105.00	83,096,000	
C o m i n i x	2,200	924.00	2,032,800	
三洋貿易	7,800	2,067.00	16,122,600	
ビューティガレージ	1,900	2,515.00	4,778,500	貸付有価証券 800株
ウイン・パートナーズ	10,300	1,438.00	14,811,400	貸付有価証券 200株(200株)
ミタチ産業	3,300	1,114.00	3,676,200	貸付有価証券 1,000株
シップヘルスケアホールディングス	29,600	3,775.00	111,740,000	
明治電機工業	4,900	1,770.00	8,673,000	
デリカフーズホールディングス	2,800	1,591.00	4,454,800	
スターティアホールディングス	3,200	888.00	2,841,600	貸付有価証券

ングス				100株
コメダホールディングス	26,300	2,200.00	57,860,000	
富士興産	5,500	612.00	3,366,000	
協栄産業	1,700	1,938.00	3,294,600	貸付有価証券 700株
小野建	12,400	1,893.00	23,473,200	
佐鳥電機	10,500	1,064.00	11,172,000	
エコートレーディング	3,200	711.00	2,275,200	貸付有価証券 800株
伯東	8,700	1,634.00	14,215,800	貸付有価証券 200株
コンドーテック	11,300	908.00	10,260,400	貸付有価証券 100株
中山福	8,200	753.00	6,174,600	
ナガイレーベン	18,900	3,145.00	59,440,500	
三菱食品	15,600	3,130.00	48,828,000	
松田産業	10,400	1,824.00	18,969,600	
第一興商	21,200	5,580.00	118,296,000	
メディカルホールディングス	142,600	2,227.00	317,570,200	
S P K	3,000	2,846.00	8,538,000	
萩原電気ホールディングス	5,000	3,035.00	15,175,000	貸付有価証券 100株
アズワン	11,100	7,000.00	77,700,000	
スズデン	4,900	1,617.00	7,923,300	
尾家産業	4,200	1,311.00	5,506,200	
シモジマ	8,700	1,166.00	10,144,200	
ドウシシャ	15,100	2,563.00	38,701,300	
小津産業	3,100	2,348.00	7,278,800	
高速	8,500	1,364.00	11,594,000	
たけびし	5,000	1,638.00	8,190,000	
リックス	3,200	2,098.00	6,713,600	
丸文	12,600	971.00	12,234,600	
ハビネット	9,700	1,553.00	15,064,100	
橋本総業ホールディングス	2,900	1,836.00	5,324,400	
日本ライフライン	40,500	3,145.00	127,372,500	貸付有価証券 6,900株
エクセル	5,700	2,895.00	16,501,500	貸付有価証券

				200株
マルカキカイ	4,600	2,116.00	9,733,600	
I D O M	43,100	828.00	35,686,800	貸付有価証券 17,400株(14,000株)
日本エム・ディ・エム	9,500	1,003.00	9,528,500	貸付有価証券 200株
進和	8,400	2,470.00	20,748,000	貸付有価証券 2,900株
エスケイジャパン	3,400	599.00	2,036,600	貸付有価証券 1,500株
ダイトロン	6,500	2,069.00	13,448,500	
シークス	18,100	2,220.00	40,182,000	貸付有価証券 7,600株(6,600株)
田中商事	4,400	692.00	3,044,800	
オーハシテクニカ	8,000	1,707.00	13,656,000	
白銅	5,100	2,214.00	11,291,400	
伊藤忠商事	1,044,000	2,162.50	2,257,650,000	貸付有価証券 16,700株
丸紅	1,169,100	809.50	946,386,450	
高島	2,500	2,160.00	5,400,000	
長瀬産業	85,700	1,893.00	162,230,100	
蝶理	9,100	2,094.00	19,055,400	
豊田通商	158,800	3,835.00	608,998,000	
三共生興	24,200	499.00	12,075,800	
兼松	60,600	1,634.00	99,020,400	貸付有価証券 300株
ツカモトコーポレーション	2,600	1,285.00	3,341,000	
三井物産	1,208,500	1,920.50	2,320,924,250	
日本紙パルプ商事	7,400	4,420.00	32,708,000	
日立ハイテクノロジーズ	49,400	4,700.00	232,180,000	
カメイ	18,500	1,477.00	27,324,500	
東都水産	2,200	1,961.00	4,314,200	
O U Gホールディングス	2,200	2,675.00	5,885,000	
スターゼン	5,600	5,610.00	31,416,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
山善	55,600	1,095.00	60,882,000	
椿本興業	3,200	3,255.00	10,416,000	
住友商事	897,300	1,938.00	1,738,967,400	貸付有価証券

				79,200株
内田洋行	6,500	2,942.00	19,123,000	
三菱商事	998,300	2,977.50	2,972,438,250	
第一実業	6,500	3,230.00	20,995,000	
キャノンマーケティング ジャパン	40,700	2,824.00	114,936,800	貸付有価証券 4,300株
西華産業	8,800	2,768.00	24,358,400	
佐藤商事	12,700	1,165.00	14,795,500	
菱洋エレクトロ	13,200	1,747.00	23,060,400	貸付有価証券 300株
東京産業	14,100	556.00	7,839,600	
ユアサ商事	13,500	3,470.00	46,845,000	
神鋼商事	3,200	3,770.00	12,064,000	
小林産業	9,400	364.00	3,421,600	貸付有価証券 100株
阪和興業	26,600	4,660.00	123,956,000	
正栄食品工業	7,800	4,365.00	34,047,000	貸付有価証券 2,000株(100株)
カナデン	13,600	1,360.00	18,496,000	
菱電商事	10,200	1,783.00	18,186,600	
フルサト工業	7,800	1,804.00	14,071,200	
岩谷産業	31,600	4,075.00	128,770,000	貸付有価証券 1,900株(700株)
すてきナイスグループ	6,100	1,467.00	8,948,700	
昭光通商	51,000	112.00	5,712,000	貸付有価証券 2,000株
ニチモウ	2,200	1,805.00	3,971,000	
極東貿易	20,000	506.00	10,120,000	
イワキ	20,000	399.00	7,980,000	貸付有価証券 200株
三愛石油	38,200	1,659.00	63,373,800	
稲畑産業	34,200	1,649.00	56,395,800	
G S Iクレオス	3,800	1,655.00	6,289,000	貸付有価証券 500株
明和産業	13,100	528.00	6,916,800	
ワキタ	30,300	1,160.00	35,148,000	
東邦ホールディングス	42,100	2,591.00	109,081,100	貸付有価証券 19,700株(19,700株)
サンゲツ	47,400	2,230.00	105,702,000	

ミツウロコグループホールディングス	20,600	861.00	17,736,600	
シナネンホールディングス	5,900	2,745.00	16,195,500	
伊藤忠エネクス	31,400	1,065.00	33,441,000	
サンリオ	39,900	2,008.00	80,119,200	貸付有価証券 18,700株（7,500株）
サンワテクノス	9,200	1,631.00	15,005,200	貸付有価証券 3,900株
リョーサン	17,900	3,850.00	68,915,000	貸付有価証券 500株
新光商事	15,600	1,888.00	29,452,800	
トーホー	6,400	2,548.00	16,307,200	
三信電気	13,100	2,155.00	28,230,500	貸付有価証券 600株
東陽テクニカ	16,400	964.00	15,809,600	
モスフードサービス	18,700	3,285.00	61,429,500	貸付有価証券 200株
加賀電子	12,900	2,725.00	35,152,500	
ソーダニッカ	14,700	733.00	10,775,100	貸付有価証券 100株
立花エレテック	9,600	2,051.00	19,689,600	
フォーバル	6,200	851.00	5,276,200	
PALTAC	20,000	5,420.00	108,400,000	
三谷産業	15,400	441.00	6,791,400	貸付有価証券 3,400株
太平洋興発	5,900	1,056.00	6,230,400	貸付有価証券 100株（100株）
西本Wismettac ホールディングス	2,900	4,650.00	13,485,000	貸付有価証券 1,300株
ヤマシタヘルスケアホールディングス	1,100	1,556.00	1,711,600	貸付有価証券 100株
ヤマタネ	7,100	1,924.00	13,660,400	
丸紅建材リース	14,000	234.00	3,276,000	
日鉄住金物産	11,100	6,090.00	67,599,000	
泉州電業	4,700	3,145.00	14,781,500	貸付有価証券 100株
トラスコ中山	29,600	2,745.00	81,252,000	貸付有価証券 900株（900株）
オートバックスセブン	56,500	2,028.00	114,582,000	貸付有価証券

				900株(900株)
モリト	11,400	1,004.00	11,445,600	貸付有価証券 100株(100株)
加藤産業	22,200	3,940.00	87,468,000	
イノテック	12,300	1,283.00	15,780,900	
イエローハット	13,400	3,205.00	42,947,000	
J Kホールディングス	14,300	934.00	13,356,200	
日伝	11,800	2,161.00	25,499,800	
北沢産業	11,700	289.00	3,381,300	貸付有価証券 5,200株
杉本商事	7,700	1,959.00	15,084,300	
因幡電機産業	18,800	4,775.00	89,770,000	
バイテックホールディングス	6,400	2,498.00	15,987,200	貸付有価証券 1,600株
東テク	4,700	2,499.00	11,745,300	貸付有価証券 600株
ミスミグループ本社	165,200	3,055.00	504,686,000	
アルテック	12,200	372.00	4,538,400	貸付有価証券 5,700株
タキヒヨー	4,700	2,412.00	11,336,400	
蔵王産業	2,300	1,690.00	3,887,000	
スズケン	64,900	4,475.00	290,427,500	貸付有価証券 800株
ジェコス	9,800	1,190.00	11,662,000	
ルネサスイーストン	13,000	676.00	8,788,000	貸付有価証券 200株(200株)
ローソン	36,000	7,190.00	258,840,000	貸付有価証券 16,800株(100株)
サンエー	10,800	5,920.00	63,936,000	貸付有価証券 400株
カワチ薬品	11,000	2,710.00	29,810,000	貸付有価証券 1,400株
エービーシー・マート	25,900	7,130.00	184,667,000	貸付有価証券 700株
ハードオフコーポレーション	6,300	1,106.00	6,967,800	
アスクル	12,400	3,415.00	42,346,000	貸付有価証券 5,800株(400株)
ゲオホールディングス	26,000	1,719.00	44,694,000	貸付有価証券 6,200株

アダストリア	21,900	1,953.00	42,770,700	貸付有価証券 10,200株(200株)
ジーフット	8,600	779.00	6,699,400	貸付有価証券 600株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	1,800	751.00	1,351,800	
くらコーポレーション	8,400	7,700.00	64,680,000	貸付有価証券 3,900株
キャンドウ	6,800	1,795.00	12,206,000	貸付有価証券 400株
パルグループホールディ ングス	7,300	2,958.00	21,593,400	
エディオン	55,300	1,268.00	70,120,400	貸付有価証券 5,100株
サーラコーポレーション	24,400	674.00	16,445,600	
ワッツ	5,600	1,116.00	6,249,600	
ハローズ	5,300	2,649.00	14,039,700	貸付有価証券 2,100株
あみやき亭	3,100	5,250.00	16,275,000	
ひらまつ	19,600	500.00	9,800,000	貸付有価証券 9,200株
大黒天物産	3,400	5,500.00	18,700,000	
ハニーズホールディ ングス	13,800	1,043.00	14,393,400	貸付有価証券 2,200株
ファーマライズホール ディングス	3,200	713.00	2,281,600	貸付有価証券 1,500株(100株)
アルペン	10,900	2,328.00	25,375,200	
ハブ	2,700	1,021.00	2,756,700	
クオール	15,700	2,289.00	35,937,300	
ジーンズ	9,700	5,820.00	56,454,000	貸付有価証券 4,500株
ビックカメラ	84,000	1,710.00	143,640,000	
D C Mホールディングス	76,700	1,062.00	81,455,400	貸付有価証券 36,000株(600株)
M o n o t a R O	50,600	3,950.00	199,870,000	貸付有価証券 23,900株(5,900株)
東京一番フーズ	3,500	694.00	2,429,000	貸付有価証券 1,600株(800株)
D Dホールディングス	3,200	2,916.00	9,331,200	貸付有価証券 1,500株
きちり	3,800	726.00	2,758,800	

アークランドサービス ホールディングス	11,900	2,347.00	27,929,300	
J.フロント リテイ リング	169,900	1,757.00	298,514,300	
ドトール・日レスホー ルディングス	25,000	2,307.00	57,675,000	
マツモトキヨシホー ルディングス	58,800	4,650.00	273,420,000	
ブロンコビリー	7,400	4,310.00	31,894,000	
スタートトゥデイ	139,800	3,140.00	438,972,000	
トレジャー・ファクト リー	4,100	764.00	3,132,400	
物語コーポレーション	4,000	11,490.00	45,960,000	貸付有価証券 300株
ココカラファイン	14,800	7,660.00	113,368,000	
三越伊勢丹ホー ルディン グス	266,000	1,203.00	319,998,000	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
H a m e e	3,600	1,532.00	5,515,200	貸付有価証券 1,700株（100株）
ウエルシアホー ルディン グス	37,600	5,440.00	204,544,000	
クリエイトSDホー ルディン グス	21,000	3,045.00	63,945,000	
丸善C H Iホー ルディン グス	16,600	354.00	5,876,400	貸付有価証券 7,500株
ミサワ	2,600	423.00	1,099,800	貸付有価証券 200株
ティーライフ	1,900	1,252.00	2,378,800	
エー・ピーカン ニー	2,700	793.00	2,141,100	貸付有価証券 1,100株（100株）
チムニー	4,300	2,859.00	12,293,700	
シュッピン	8,600	1,199.00	10,311,400	貸付有価証券 800株（400株）
ネクステージ	15,000	1,020.00	15,300,000	貸付有価証券 7,000株
ジョイフル本田	20,800	3,685.00	76,648,000	
鳥貴族	5,200	2,884.00	14,996,800	貸付有価証券 2,100株（500株）
キリン堂ホー ルディン グス	5,100	2,843.00	14,499,300	
ホットランド	8,300	1,363.00	11,312,900	貸付有価証券

				3,900株
すかいらーく	88,400	1,568.00	138,611,200	貸付有価証券 41,500株
綿半ホールディングス	5,300	3,845.00	20,378,500	貸付有価証券 1,400株
ヨシックス	2,300	3,390.00	7,797,000	貸付有価証券 800株
ユナイテッド・スーパー マーケット・ホール	47,200	1,410.00	66,552,000	
ブックオフコーポレー ション	8,100	832.00	6,739,200	貸付有価証券 700株(700株)
ゴルフダイジェスト・オ ンライン	5,700	1,149.00	6,549,300	
B E E N O S	2,200	1,993.00	4,384,600	貸付有価証券 400株
あさひ	10,600	1,286.00	13,631,600	
日本調剤	5,000	3,500.00	17,500,000	貸付有価証券 1,000株
コスモス薬品	7,200	23,470.00	168,984,000	
トーエル	6,900	1,103.00	7,610,700	貸付有価証券 3,200株
一六堂	3,000	427.00	1,281,000	
オンリー	2,100	1,028.00	2,158,800	
セブン & アイ・ホール ディングス	596,300	4,741.00	2,827,058,300	貸付有価証券 36,900株
薬王堂	6,200	3,600.00	22,320,000	貸付有価証券 1,700株
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	38,200	1,224.00	46,756,800	貸付有価証券 200株
ツルハホールディングス	30,800	15,120.00	465,696,000	
サンマルクホールディ ングス	10,200	3,090.00	31,518,000	
フェリシモ	3,600	1,361.00	4,899,600	
トリドールホールディ ングス	17,500	3,720.00	65,100,000	
T O K Y O B A S E	9,500	1,053.00	10,003,500	貸付有価証券 4,400株(200株)
ウイルプラスホールディ ングス	1,300	1,140.00	1,482,000	
サツドラホールディ ングス	2,300	2,350.00	5,405,000	貸付有価証券 1,000株

ダイユー・リックホールディングス	6,600	1,004.00	6,626,400	
パロックジャパンリミテッド	11,400	1,142.00	13,018,800	貸付有価証券 5,300株（2,300株）
クスリのアオキホールディングス	11,300	7,710.00	87,123,000	貸付有価証券 2,600株
スシローグローバルホールディングス	13,700	5,200.00	71,240,000	
LIXILピバ	13,500	2,028.00	27,378,000	
メディカルシステムネットワーク	16,400	560.00	9,184,000	貸付有価証券 7,300株
総合メディカル	12,400	2,898.00	35,935,200	貸付有価証券 700株（700株）
はるやまホールディングス	6,700	1,063.00	7,122,100	
ノジマ	25,000	2,516.00	62,900,000	
カッパ・クリエイト	17,700	1,304.00	23,080,800	貸付有価証券 1,900株（200株）
ライトオン	12,000	1,014.00	12,168,000	貸付有価証券 5,400株
ジーンズメイト	4,300	861.00	3,702,300	貸付有価証券 2,000株（2,000株）
良品計画	18,900	36,900.00	697,410,000	
三城ホールディングス	17,600	499.00	8,782,400	
アドヴァン	14,500	976.00	14,152,000	貸付有価証券 100株
アルピス	3,400	3,550.00	12,070,000	貸付有価証券 300株（200株）
コナカ	18,200	589.00	10,719,800	
ハウス オブ ローゼ	1,700	1,757.00	2,986,900	貸付有価証券 100株
G - 7ホールディングス	4,200	2,433.00	10,218,600	
イオン北海道	14,300	798.00	11,411,400	貸付有価証券 600株
コジマ	24,500	466.00	11,417,000	貸付有価証券 1,400株
ヒマラヤ	3,900	1,156.00	4,508,400	貸付有価証券 300株（300株）
コーナン商事	20,200	2,812.00	56,802,400	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
エコス	5,700	1,826.00	10,408,200	貸付有価証券

				2,500株
ワタミ	16,800	1,464.00	24,595,200	貸付有価証券 2,500株（500株）
マルシェ	3,700	808.00	2,989,600	貸付有価証券 1,700株
ドンキホーテホールディングス	92,200	5,830.00	537,526,000	
西松屋チェーン	31,200	1,307.00	40,778,400	貸付有価証券 2,300株
ゼンショーホールディングス	73,800	2,492.00	183,909,600	貸付有価証券 700株
幸楽苑ホールディングス	9,000	1,885.00	16,965,000	貸付有価証券 4,000株
ハークスレイ	3,500	1,059.00	3,706,500	
サイゼリヤ	21,100	2,522.00	53,214,200	貸付有価証券 6,500株
V Tホールディングス	48,200	513.00	24,726,600	貸付有価証券 14,600株（1,100株）
魚力	3,900	1,415.00	5,518,500	
ポプラ	3,700	917.00	3,392,900	
フジ・コーポレーション	2,500	2,614.00	6,535,000	貸付有価証券 1,100株
ユナイテッドアローズ	17,600	4,075.00	71,720,000	
ハイデイ日高	18,700	2,854.00	53,369,800	貸付有価証券 600株（600株）
京都きもの友禅	9,000	755.00	6,795,000	貸付有価証券 3,700株
コロワイド	47,300	2,759.00	130,500,700	貸付有価証券 700株
ピーシーデポコーポレーション	21,200	719.00	15,242,800	貸付有価証券 1,600株
壱番屋	10,000	4,535.00	45,350,000	
トップカルチャー	5,100	504.00	2,570,400	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
P L A N T	3,300	1,358.00	4,481,400	貸付有価証券 600株
スギホールディングス	31,200	6,380.00	199,056,000	
ヴィア・ホールディングス	12,700	722.00	9,169,400	貸付有価証券 5,900株
スクロール	21,900	430.00	9,417,000	
ヨンドシーホールディング	14,500	2,734.00	39,643,000	

グス				
ユニー・ファミリーマー トホールディングス	45,500	10,040.00	456,820,000	貸付有価証券 7,200株（200株）
木曽路	17,400	2,801.00	48,737,400	
S R S ホールディングス	16,800	965.00	16,212,000	貸付有価証券 7,300株
千趣会	25,800	576.00	14,860,800	貸付有価証券 1,800株
タカキュー	11,000	209.00	2,299,000	貸付有価証券 600株
ケーヨー	26,300	564.00	14,833,200	貸付有価証券 9,800株（1,400株）
上新電機	16,800	4,335.00	72,828,000	
日本瓦斯	26,100	5,260.00	137,286,000	貸付有価証券 2,400株
ロイヤルホールディング ス	25,200	2,925.00	73,710,000	
東天紅	1,000	1,958.00	1,958,000	貸付有価証券 400株
いなげや	15,900	1,770.00	28,143,000	
島忠	34,400	3,500.00	120,400,000	貸付有価証券 2,200株（1,300株）
チヨダ	16,800	2,567.00	43,125,600	貸付有価証券 200株
ライフコーポレーション	10,800	2,710.00	29,268,000	貸付有価証券 300株
リンガーハット	17,500	2,634.00	46,095,000	貸付有価証券 900株
さが美グループホール ディングス	13,000	119.00	1,547,000	貸付有価証券 6,000株
M r M a x H D	17,800	740.00	13,172,000	貸付有価証券 200株
テナライド	13,100	473.00	6,196,300	貸付有価証券 300株
A O K I ホールディング ス	28,500	1,606.00	45,771,000	
オークワ	20,000	1,189.00	23,780,000	
コメリ	22,000	2,880.00	63,360,000	
青山商事	27,300	4,120.00	112,476,000	
しまむら	16,600	13,670.00	226,922,000	
はせがわ	7,500	485.00	3,637,500	貸付有価証券

				400株(400株)
高島屋	223,000	939.00	209,397,000	貸付有価証券 25,000株(13,000株)
松屋	28,700	1,424.00	40,868,800	貸付有価証券 12,900株(1,700株)
エイチ・ツー・オー テイリング	67,400	2,049.00	138,102,600	
近鉄百貨店	5,400	3,895.00	21,033,000	
パルコ	13,700	1,340.00	18,358,000	
丸井グループ	136,200	2,237.00	304,679,400	貸付有価証券 3,800株
アクシアル リテイリング	11,800	4,330.00	51,094,000	
井筒屋	7,700	357.00	2,748,900	
イオン	547,400	2,100.00	1,149,540,000	貸付有価証券 106,000株
イズミ	25,700	6,970.00	179,129,000	貸付有価証券 1,200株
東武ストア	1,700	3,040.00	5,168,000	
平和堂	28,900	2,555.00	73,839,500	
フジ	17,000	2,367.00	40,239,000	
ヤオコー	16,100	5,980.00	96,278,000	
ゼビオホールディングス	19,300	2,032.00	39,217,600	貸付有価証券 500株(500株)
ケーズホールディングス	120,600	1,573.00	189,703,800	
Olympicグループ	8,400	559.00	4,695,600	
日産東京販売ホールディングス	20,900	395.00	8,255,500	
Genky Drugs tores	5,600	4,085.00	22,876,000	貸付有価証券 2,500株
アインホールディングス	19,100	7,830.00	149,553,000	貸付有価証券 8,900株(1,800株)
元気寿司	3,600	2,822.00	10,159,200	
ヤマダ電機	476,800	565.00	269,392,000	貸付有価証券 224,000株(69,400 株)
アークランドサカモト	24,100	1,683.00	40,560,300	
ニトリホールディングス	56,500	18,360.00	1,037,340,000	
グルメ杵屋	10,000	1,161.00	11,610,000	
愛眼	11,300	451.00	5,096,300	貸付有価証券

				5,100株(3,500株)
ケーユーホールディングス	7,400	1,132.00	8,376,800	
吉野家ホールディングス	46,700	2,012.00	93,960,400	貸付有価証券 100株
松屋フーズ	6,800	3,765.00	25,602,000	貸付有価証券 200株
サガミチェーン	19,000	1,389.00	26,391,000	
関西スーパーマーケット	10,700	1,198.00	12,818,600	貸付有価証券 1,500株(1,300株)
王将フードサービス	10,400	5,420.00	56,368,000	
プレナス	15,900	1,856.00	29,510,400	貸付有価証券 6,700株
ミニストップ	10,500	2,179.00	22,879,500	貸付有価証券 800株
アークス	26,700	2,868.00	76,575,600	
バローホールディングス	33,100	2,986.00	98,836,600	
藤久	1,100	1,497.00	1,646,700	
ベルク	6,300	5,830.00	36,729,000	
大庄	7,600	1,693.00	12,866,800	貸付有価証券 200株(100株)
ファーストリテイリング	23,800	47,100.00	1,120,980,000	貸付有価証券 1,000株
サンドラッグ	60,200	5,450.00	328,090,000	貸付有価証券 100株
サックスパーホールディングス	13,400	1,140.00	15,276,000	貸付有価証券 2,800株
ヤマザワ	2,900	1,781.00	5,164,900	
やまや	2,900	3,480.00	10,092,000	貸付有価証券 900株
ベルーナ	34,900	1,257.00	43,869,300	
島根銀行	3,000	1,337.00	4,011,000	
じもとホールディングス	96,300	190.00	18,297,000	
めぶきフィナンシャルグループ	740,200	422.00	312,364,400	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	19,200	2,899.00	55,660,800	
九州フィナンシャルグループ	233,800	536.00	125,316,800	貸付有価証券 34,200株
ゆうちょ銀行	403,600	1,493.00	602,574,800	貸付有価証券 77,000株

富山第一銀行	36,200	495.00	17,919,000	貸付有価証券 16,400株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	866,100	618.00	535,249,800	貸付有価証券 25,200株
西日本フィナンシャルホールディングス	96,600	1,283.00	123,937,800	貸付有価証券 500株
関西みらいフィナンシャルグループ	62,300	838.00	52,207,400	貸付有価証券 1,100株
三十三フィナンシャルグループ	12,000	2,273.00	27,276,000	
新生銀行	123,300	1,659.00	204,554,700	貸付有価証券 32,800株
あおぞら銀行	84,900	4,320.00	366,768,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	9,973,400	730.40	7,284,571,360	
りそなホールディングス	1,563,400	607.10	949,140,140	
三井住友トラスト・ホールディングス	280,100	4,578.00	1,282,297,800	
三井住友フィナンシャルグループ	1,078,300	4,595.00	4,954,788,500	
第四銀行	17,500	4,895.00	85,662,500	
北越銀行	14,300	2,410.00	34,463,000	
千葉銀行	504,600	855.00	431,433,000	貸付有価証券 8,400株
群馬銀行	289,400	624.00	180,585,600	貸付有価証券 1,300株
武蔵野銀行	22,700	3,540.00	80,358,000	
千葉興業銀行	39,100	507.00	19,823,700	
筑波銀行	59,200	378.00	22,377,600	
七十七銀行	44,700	2,643.00	118,142,100	
青森銀行	11,000	3,350.00	36,850,000	貸付有価証券 900株（500株）
秋田銀行	9,100	2,968.00	27,008,800	
山形銀行	16,000	2,407.00	38,512,000	貸付有価証券 6,500株（1,600株）
岩手銀行	10,000	4,345.00	43,450,000	
東邦銀行	127,400	419.00	53,380,600	貸付有価証券 1,900株（1,200株）
東北銀行	7,200	1,456.00	10,483,200	
みちのく銀行	9,100	1,784.00	16,234,400	貸付有価証券

				2,000株(2,000株)
ふくおかフィナンシャルグループ	578,000	588.00	339,864,000	貸付有価証券 5,000株
静岡銀行	376,100	1,080.00	406,188,000	貸付有価証券 5,300株
十六銀行	19,100	2,845.00	54,339,500	貸付有価証券 200株
スルガ銀行	145,700	1,334.00	194,363,800	
八十二銀行	257,900	572.00	147,518,800	
山梨中央銀行	88,000	455.00	40,040,000	
大垣共立銀行	22,500	2,734.00	61,515,000	
福井銀行	12,200	2,447.00	29,853,400	貸付有価証券 500株
北國銀行	16,100	4,350.00	70,035,000	
清水銀行	4,800	3,035.00	14,568,000	
富山銀行	2,700	3,940.00	10,638,000	
滋賀銀行	134,000	549.00	73,566,000	貸付有価証券 6,000株(6,000株)
南都銀行	16,700	3,025.00	50,517,500	
百五銀行	136,800	505.00	69,084,000	
京都銀行	54,400	6,370.00	346,528,000	貸付有価証券 7,000株
紀陽銀行	53,600	1,749.00	93,746,400	貸付有価証券 300株
ほくほくフィナンシャルグループ	94,800	1,582.00	149,973,600	貸付有価証券 700株(300株)
広島銀行	210,300	819.00	172,235,700	
山陰合同銀行	84,500	1,013.00	85,598,500	貸付有価証券 300株
中国銀行	98,500	1,256.00	123,716,000	
鳥取銀行	4,500	1,724.00	7,758,000	
伊予銀行	203,300	841.00	170,975,300	貸付有価証券 2,500株
百十四銀行	151,000	366.00	55,266,000	
四国銀行	21,800	1,594.00	34,749,200	
阿波銀行	114,000	720.00	82,080,000	貸付有価証券 5,000株
大分銀行	8,200	4,000.00	32,800,000	貸付有価証券 3,700株
宮崎銀行	9,500	3,535.00	33,582,500	

佐賀銀行	8,600	2,410.00	20,726,000	
十八銀行	88,000	287.00	25,256,000	
沖縄銀行	13,900	4,545.00	63,175,500	
琉球銀行	27,600	1,654.00	45,650,400	
セブン銀行	534,300	362.00	193,416,600	貸付有価証券 251,100株
みずほフィナンシャルグループ	19,356,000	197.50	3,822,810,000	貸付有価証券 485,600株
高知銀行	5,200	1,311.00	6,817,200	
山口フィナンシャルグループ	133,000	1,388.00	184,604,000	貸付有価証券 62,000株
長野銀行	4,700	1,841.00	8,652,700	貸付有価証券 2,100株（300株）
名古屋銀行	11,500	4,020.00	46,230,000	貸付有価証券 5,400株（900株）
北洋銀行	214,700	360.00	77,292,000	貸付有価証券 300株
愛知銀行	4,800	5,270.00	25,296,000	
中京銀行	5,900	2,323.00	13,705,700	
大光銀行	4,900	2,328.00	11,407,200	
愛媛銀行	19,900	1,306.00	25,989,400	貸付有価証券 7,200株（300株）
トマト銀行	5,500	1,526.00	8,393,000	
京葉銀行	126,000	489.00	61,614,000	
栃木銀行	73,700	412.00	30,364,400	貸付有価証券 800株
北日本銀行	4,400	2,849.00	12,535,600	
東和銀行	25,000	1,475.00	36,875,000	
福島銀行	13,400	814.00	10,907,600	貸付有価証券 4,400株
大東銀行	6,800	1,303.00	8,860,400	
トモニホールディングス	117,500	479.00	56,282,500	貸付有価証券 6,300株（1,900株）
フィデアホールディングス	138,300	195.00	26,968,500	
池田泉州ホールディングス	151,200	428.00	64,713,600	貸付有価証券 600株（600株）
F P G	49,700	1,330.00	66,101,000	貸付有価証券 1,200株
マーキュリアインベスト	2,900	1,099.00	3,187,100	貸付有価証券

メント				1,300株
SBIホールディングス	161,100	2,817.00	453,818,700	貸付有価証券 55,000株(48,300株)
日本アジア投資	12,800	355.00	4,544,000	貸付有価証券 4,100株
ジャフコ	20,400	5,010.00	102,204,000	
大和証券グループ本社	1,219,000	675.60	823,556,400	貸付有価証券 42,000株
野村ホールディングス	2,450,900	642.50	1,574,703,250	
岡三証券グループ	121,000	634.00	76,714,000	
丸三証券	45,300	1,038.00	47,021,400	貸付有価証券 20,900株
東洋証券	51,000	292.00	14,892,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	157,700	788.00	124,267,600	
光世証券	3,400	1,437.00	4,885,800	貸付有価証券 1,500株
水戸証券	41,200	425.00	17,510,000	貸付有価証券 6,400株
いちよし証券	29,900	1,305.00	39,019,500	
松井証券	69,800	1,030.00	71,894,000	貸付有価証券 1,600株
だいこう証券ビジネス	6,900	649.00	4,478,100	
マネックスグループ	151,000	575.00	86,825,000	貸付有価証券 68,200株(31,800株)
カブドットコム証券	91,100	407.00	37,077,700	
極東証券	19,100	1,611.00	30,770,100	貸付有価証券 600株
岩井コスモホールディングス	14,600	1,484.00	21,666,400	
藍澤証券	26,700	790.00	21,093,000	
マネーパートナーズグループ	18,200	440.00	8,008,000	貸付有価証券 8,400株
小林洋行	4,100	284.00	1,164,400	貸付有価証券 300株
かんぽ生命保険	53,800	2,666.00	143,430,800	
SOMPOホールディングス	279,400	4,421.00	1,235,227,400	貸付有価証券 5,000株
アニコムホールディングス	9,700	3,595.00	34,871,500	貸付有価証券 4,500株
MS&ADインシュアラ	372,500	3,619.00	1,348,077,500	

ンスグループホール				
ソニーフィナンシャル ホールディングス	117,100	2,007.00	235,019,700	貸付有価証券 4,400株
第一生命ホールディングス	805,900	2,150.50	1,733,087,950	
東京海上ホールディングス	536,700	5,019.00	2,693,697,300	貸付有価証券 1,300株
アドバンテッジリスクマ ネジメント	3,500	1,407.00	4,924,500	貸付有価証券 1,500株
T & Dホールディングス	440,600	1,811.50	798,146,900	
アドバンスクリエイト	3,300	1,952.00	6,441,600	
全国保証	40,100	4,470.00	179,247,000	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
イントラスト	2,200	700.00	1,540,000	
アルヒ	12,100	1,584.00	19,166,400	
クレディセゾン	108,100	1,898.00	205,173,800	貸付有価証券 400株
アクリーティブ	7,800	339.00	2,644,200	貸付有価証券 1,300株（200株）
芙蓉総合リース	16,300	7,040.00	114,752,000	
興銀リース	26,800	2,959.00	79,301,200	貸付有価証券 2,700株
東京センチュリー	28,700	6,430.00	184,541,000	貸付有価証券 100株
日本証券金融	58,300	705.00	41,101,500	
アイフル	239,100	352.00	84,163,200	貸付有価証券 112,300株
リコーリース	11,200	3,605.00	40,376,000	貸付有価証券 2,100株
イオンフィナンシャル サービス	101,100	2,527.00	255,479,700	
アコム	286,300	480.00	137,424,000	貸付有価証券 134,500株（2,900株）
ジャックス	17,300	2,407.00	41,641,100	
オリエントコーポレー ション	308,200	171.00	52,702,200	貸付有価証券 144,800株
日立キャピタル	39,200	2,846.00	111,563,200	
アプラスフィナンシャル	68,400	120.00	8,208,000	貸付有価証券 32,100株
オリックス	950,300	1,896.50	1,802,243,950	
三菱UFJリース	361,600	671.00	242,633,600	貸付有価証券

				2,700株
九州リースサービス	6,100	793.00	4,837,300	
日本取引所グループ	408,900	1,997.00	816,573,300	
イー・ギャランティ	7,600	2,089.00	15,876,400	
アサックス	2,000	1,839.00	3,678,000	
NECキャピタルソリューション	5,800	2,079.00	12,058,200	
いちご	203,600	443.00	90,194,800	貸付有価証券 37,500株
日本駐車場開発	171,900	173.00	29,738,700	
ヒューリック	297,300	1,160.00	344,868,000	
三栄建築設計	5,700	1,859.00	10,596,300	貸付有価証券 2,000株
スター・マイカ	5,200	2,409.00	12,526,800	貸付有価証券 200株（100株）
野村不動産ホールディングス	94,800	2,641.00	250,366,800	
三重交通グループホールディングス	28,900	523.00	15,114,700	貸付有価証券 1,700株（500株）
サムティ	12,100	2,119.00	25,639,900	貸付有価証券 3,400株（3,000株）
ディア・ライフ	14,300	600.00	8,580,000	貸付有価証券 400株
コーセーアールイー	2,400	945.00	2,268,000	貸付有価証券 1,100株
エー・ディー・ワークス	188,800	40.00	7,552,000	貸付有価証券 73,500株
日本商業開発	8,000	1,755.00	14,040,000	貸付有価証券 3,700株（500株）
プレサンスコーポレーション	19,500	1,644.00	32,058,000	
ユニゾホールディングス	16,600	2,597.00	43,110,200	貸付有価証券 100株
THEグローバル社	6,700	982.00	6,579,400	貸付有価証券 3,000株
日本管理センター	9,400	1,584.00	14,889,600	貸付有価証券 1,300株
サンセイランディック	4,100	1,235.00	5,063,500	貸付有価証券 100株
エストラスト	1,900	1,021.00	1,939,900	貸付有価証券 100株

フージャースホールディングス	34,600	775.00	26,815,000	貸付有価証券 1,300株
オープンハウス	23,200	5,990.00	138,968,000	
東急不動産ホールディングス	344,900	822.00	283,507,800	
飯田グループホールディングス	118,800	2,083.00	247,460,400	
イーグランド	1,700	1,200.00	2,040,000	貸付有価証券 100株
ムゲンエステート	8,700	1,355.00	11,788,500	
ピーロット	2,200	2,025.00	4,455,000	
ファーストブラザーズ	3,900	1,397.00	5,448,300	貸付有価証券 700株
ハウズドゥ	2,300	3,880.00	8,924,000	貸付有価証券 900株
シーアールイー	2,300	1,792.00	4,121,600	
ケイアイスター不動産	5,100	2,910.00	14,841,000	
パーク24	79,000	3,090.00	244,110,000	貸付有価証券 7,800株
パラカ	4,600	2,311.00	10,630,600	貸付有価証券 200株
三井不動産	711,400	2,721.50	1,936,075,100	貸付有価証券 7,600株
三菱地所	1,060,400	1,892.50	2,006,807,000	
平和不動産	25,200	2,464.00	62,092,800	
東京建物	155,700	1,581.00	246,161,700	
ダイビル	36,700	1,270.00	46,609,000	
京阪神ビルディング	23,600	899.00	21,216,400	
住友不動産	342,000	4,036.00	1,380,312,000	
大京	22,700	2,301.00	52,232,700	貸付有価証券 5,900株
テーオーシー	49,100	943.00	46,301,300	貸付有価証券 800株
東京楽天地	2,300	5,340.00	12,282,000	
レオパレス21	170,000	976.00	165,920,000	
スターツコーポレーション	19,400	2,890.00	56,066,000	
フジ住宅	18,200	932.00	16,962,400	
空港施設	14,300	628.00	8,980,400	
明和地所	7,800	756.00	5,896,800	

ゴールドクレスト	11,200	2,306.00	25,827,200	
日本エスリード	5,500	2,029.00	11,159,500	
日神不動産	18,900	789.00	14,912,100	
日本エスコン	25,600	965.00	24,704,000	貸付有価証券 4,100株
タカラレーベン	66,700	438.00	29,214,600	貸付有価証券 15,900株
サンヨーハウジング名古屋	7,300	1,212.00	8,847,600	
イオンモール	91,800	2,149.00	197,278,200	貸付有価証券 10,700株（5,100株）
ファースト住建	5,300	1,655.00	8,771,500	貸付有価証券 2,400株
カチタス	14,500	3,695.00	53,577,500	貸付有価証券 6,800株
トーセイ	17,400	1,389.00	24,168,600	
穴吹興産	1,600	3,045.00	4,872,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	88,600	1,259.00	111,547,400	
サンフロンティア不動産	17,200	1,279.00	21,998,800	貸付有価証券 4,300株
エフ・ジェー・ネクスト	10,900	830.00	9,047,000	
インテリックス	4,000	1,062.00	4,248,000	
ランドビジネス	8,400	330.00	2,772,000	貸付有価証券 3,300株
グランディハウス	12,400	443.00	5,493,200	
日本空港ビルデング	41,700	4,405.00	183,688,500	
日本工営	9,300	3,265.00	30,364,500	貸付有価証券 100株
L I F U L L	47,900	912.00	43,684,800	貸付有価証券 10,100株
ジェイエシーリクルートメント	11,100	2,219.00	24,630,900	貸付有価証券 4,500株
日本M&Aセンター	95,500	3,305.00	315,627,500	
メンバーズ	3,400	1,221.00	4,151,400	貸付有価証券 1,100株
中広	1,400	747.00	1,045,800	
タケエイ	14,300	1,333.00	19,061,900	貸付有価証券 200株
トラスト・テック	6,300	3,500.00	22,050,000	貸付有価証券

				600株
コシダカホールディングス	7,200	5,990.00	43,128,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
パソナグループ	13,100	1,861.00	24,379,100	貸付有価証券 6,200株（1,600株）
C D S	3,700	1,407.00	5,205,900	貸付有価証券 200株
リンクアンドモチベーション	25,400	1,139.00	28,930,600	貸付有価証券 11,900株（200株）
G C A	15,700	948.00	14,883,600	貸付有価証券 2,200株（1,300株）
エス・エム・エス	27,300	4,330.00	118,209,000	貸付有価証券 7,100株
パーソルホールディングス	127,400	2,775.00	353,535,000	
リニカル	8,900	1,743.00	15,512,700	貸付有価証券 2,500株
クックパッド	43,300	638.00	27,625,400	貸付有価証券 20,200株（1,000株）
エスクリ	4,800	832.00	3,993,600	
アイ・ケイ・ケイ	8,100	840.00	6,804,000	貸付有価証券 3,800株
学情	6,300	1,372.00	8,643,600	貸付有価証券 2,100株（500株）
スタジオアリス	6,900	2,383.00	16,442,700	
シミックホールディングス	7,600	2,520.00	19,152,000	貸付有価証券 800株
N J S	3,400	1,600.00	5,440,000	
総合警備保障	54,900	5,260.00	288,774,000	貸付有価証券 500株
カカクコム	103,900	2,078.00	215,904,200	貸付有価証券 5,300株（5,300株）
セントケア・ホールディング	5,800	785.00	4,553,000	貸付有価証券 2,700株
サイネックス	2,000	832.00	1,664,000	貸付有価証券 100株
ルネサンス	6,700	1,854.00	12,421,800	
ディップ	19,500	2,540.00	49,530,000	貸付有価証券 9,100株
オプトホールディング	9,600	1,581.00	15,177,600	貸付有価証券 4,500株
新日本科学	16,800	544.00	9,139,200	貸付有価証券

				7,700株
ツクイ	32,500	833.00	27,072,500	
キャリアデザインセンター	3,200	1,971.00	6,307,200	
エムスリー	145,200	4,575.00	664,290,000	貸付有価証券 4,800株
ツカダ・グローバルホールディング	11,000	641.00	7,051,000	貸付有価証券 1,100株
プラス	800	917.00	733,600	貸付有価証券 300株
アウトソーシング	41,200	1,847.00	76,096,400	貸付有価証券 14,800株
ウェルネット	13,900	1,167.00	16,221,300	貸付有価証券 6,500株(1,300株)
ワールドホールディングス	4,600	4,220.00	19,412,000	貸付有価証券 2,100株(500株)
ディー・エヌ・エー	74,400	2,112.00	157,132,800	貸付有価証券 10,300株
博報堂DYホールディングス	191,800	1,481.00	284,055,800	
ぐるなび	21,800	1,512.00	32,961,600	貸付有価証券 10,200株
エスアールジータカミヤ	16,300	660.00	10,758,000	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	17,100	859.00	14,688,900	貸付有価証券 5,000株
ファンコミュニケーションズ	38,400	689.00	26,457,600	貸付有価証券 200株
ライク	5,400	1,966.00	10,616,400	貸付有価証券 2,500株
ビジネス・ブレークスルー	6,400	459.00	2,937,600	貸付有価証券 1,100株
WDBホールディングス	6,300	3,535.00	22,270,500	貸付有価証券 200株
ティア	7,200	1,035.00	7,452,000	貸付有価証券 500株(500株)
CDG	1,300	1,880.00	2,444,000	貸付有価証券 400株
バリューコマース	12,400	1,371.00	17,000,400	貸付有価証券 1,000株(300株)
インフォマート	69,800	1,035.00	72,243,000	貸付有価証券 8,900株

J Pホールディングス	43,300	318.00	13,769,400	貸付有価証券 15,700株
E P Sホールディングス	20,800	2,210.00	45,968,000	
レグス	3,400	978.00	3,325,200	
プレステージ・インター ナショナル	28,600	1,291.00	36,922,600	貸付有価証券 1,500株
アミューズ	9,200	3,220.00	29,624,000	貸付有価証券 100株
ドリームインキュベータ	4,600	2,943.00	13,537,800	
クイック	8,600	1,772.00	15,239,200	
T A C	8,300	311.00	2,581,300	貸付有価証券 3,700株（3,700株）
ケネディクス	182,800	621.00	113,518,800	
電通	168,100	5,150.00	865,715,000	
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	6,400	1,174.00	7,513,600	貸付有価証券 2,800株（200株）
ぴあ	4,600	5,960.00	27,416,000	貸付有価証券 1,000株
イオンファンタジー	4,400	5,580.00	24,552,000	貸付有価証券 800株（800株）
シーティーエス	13,600	774.00	10,526,400	貸付有価証券 200株
ネクシィーズグループ	5,400	1,640.00	8,856,000	貸付有価証券 1,900株（1,500株）
みらかホールディングス	41,100	4,255.00	174,880,500	
アルプス技研	12,100	2,530.00	30,613,000	貸付有価証券 1,500株
ダイオーズ	2,700	1,328.00	3,585,600	
日本空調サービス	14,400	774.00	11,145,600	
オリエンタルランド	163,100	10,770.00	1,756,587,000	貸付有価証券 1,400株（1,300株）
ダスキン	37,100	2,704.00	100,318,400	
明光ネットワークジャ パン	17,500	1,228.00	21,490,000	
ファルコホールディン グス	7,100	1,796.00	12,751,600	
秀英予備校	3,000	479.00	1,437,000	貸付有価証券 200株
田谷	2,500	676.00	1,690,000	
ラウンドワン	42,800	1,605.00	68,694,000	

リゾートトラスト	58,400	2,216.00	129,414,400	
ビー・エム・エル	17,800	2,746.00	48,878,800	
ワタベウェディング	2,200	549.00	1,207,800	
りらいあコミュニケーションズ	21,800	1,359.00	29,626,200	
リソー教育	23,400	848.00	19,843,200	貸付有価証券 8,500株
早稲田アカデミー	2,000	1,669.00	3,338,000	
ユー・エス・エス	168,600	2,248.00	379,012,800	
東京個別指導学院	4,900	1,122.00	5,497,800	貸付有価証券 2,200株
サイバーエージェント	90,700	5,460.00	495,222,000	貸付有価証券 2,100株
楽天	707,700	767.20	542,947,440	貸付有価証券 118,700株
クリーク・アンド・リバー社	7,100	1,175.00	8,342,500	貸付有価証券 3,300株
テー・オー・ダブリュー	13,200	983.00	12,975,600	
セントラルスポーツ	5,100	3,745.00	19,099,500	
フルキャストホールディングス	12,100	2,413.00	29,197,300	貸付有価証券 3,500株
リソルホールディングス	1,500	4,350.00	6,525,000	
テクノプロ・ホールディングス	26,000	6,320.00	164,320,000	貸付有価証券 4,100株
アトラ	2,300	1,014.00	2,332,200	
インターワークス	3,100	1,030.00	3,193,000	
KeepPer 技研	4,400	1,349.00	5,935,600	
ファーストロジック	2,100	921.00	1,934,100	貸付有価証券 900株（600株）
三機サービス	1,600	1,827.00	2,923,200	貸付有価証券 100株
Gunosy	6,200	1,641.00	10,174,200	貸付有価証券 2,900株（100株）
デザインワン・ジャパン	2,700	1,495.00	4,036,500	貸付有価証券 1,200株
イー・ガーディアン	7,000	3,575.00	25,025,000	貸付有価証券 3,000株（2,300株）
リブセンス	8,800	495.00	4,356,000	貸付有価証券 3,900株（2,900株）
ジャパンマテリアル	37,700	1,301.00	49,047,700	貸付有価証券

				17,600株(600株)
ベクトル	16,600	1,941.00	32,220,600	貸付有価証券 3,500株
ウチヤマホールディングス	6,800	632.00	4,297,600	
ライクキッズネクスト	2,800	1,014.00	2,839,200	貸付有価証券 600株
キャリアリンク	4,500	550.00	2,475,000	貸付有価証券 1,500株
I B J	11,100	966.00	10,722,600	貸付有価証券 1,000株(600株)
アサンテ	5,000	1,945.00	9,725,000	
N・フィールド	7,700	1,956.00	15,061,200	貸付有価証券 2,500株
バリューHR	3,100	1,979.00	6,134,900	貸付有価証券 1,200株
M&Aキャピタルパートナーズ	2,800	8,160.00	22,848,000	貸付有価証券 1,200株(100株)
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,700	1,056.00	6,019,200	貸付有価証券 2,500株
E R Iホールディングス	3,900	1,184.00	4,617,600	貸付有価証券 1,200株
アビスト	2,000	4,685.00	9,370,000	貸付有価証券 600株(600株)
シグマクシス	5,500	2,122.00	11,671,000	貸付有価証券 2,500株
ウィルグループ	6,000	1,362.00	8,172,000	貸付有価証券 2,800株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	18,900	413.00	7,805,700	貸付有価証券 8,800株(100株)
日本ビューホテル	4,400	1,554.00	6,837,600	貸付有価証券 2,000株
リクルートホールディングス	1,064,800	2,550.00	2,715,240,000	貸付有価証券 300株
エラン	3,400	1,873.00	6,368,200	貸付有価証券 1,500株(1,200株)
土木管理総合試験所	4,400	573.00	2,521,200	貸付有価証券 2,000株(200株)
日本郵政	783,200	1,333.00	1,044,005,600	貸付有価証券 3,900株
ベルシステム24ホールディングス	23,100	1,722.00	39,778,200	

鎌倉新書	1,900	3,800.00	7,220,000	貸付有価証券 800株
一蔵	1,700	988.00	1,679,600	
LITALICO	2,400	1,627.00	3,904,800	貸付有価証券 1,100株(400株)
グローバルグループ	1,500	1,279.00	1,918,500	貸付有価証券 600株
エポラブルアジア	2,900	2,050.00	5,945,000	貸付有価証券 1,300株(600株)
ストライク	1,300	7,230.00	9,399,000	貸付有価証券 600株(400株)
ソラスト	8,300	2,899.00	24,061,700	貸付有価証券 100株
セラク	2,300	830.00	1,909,000	貸付有価証券 900株
インソース	1,700	4,415.00	7,505,500	貸付有価証券 200株
キャリアインデックス	1,400	2,839.00	3,974,600	貸付有価証券 500株
MS - Japan	1,000	6,720.00	6,720,000	貸付有価証券 100株
船場	2,000	1,337.00	2,674,000	
リログループ	75,400	2,485.00	187,369,000	
東祥	8,600	3,920.00	33,712,000	貸付有価証券 700株(700株)
エイチ・アイ・エス	21,500	3,810.00	81,915,000	貸付有価証券 9,200株(2,300株)
ラックランド	2,600	2,615.00	6,799,000	
共立メンテナンス	24,600	5,050.00	124,230,000	貸付有価証券 400株(400株)
イチネンホールディングス	15,500	1,464.00	22,692,000	
建設技術研究所	9,500	1,491.00	14,164,500	
スペース	8,900	1,493.00	13,287,700	
長大	4,100	763.00	3,128,300	貸付有価証券 1,800株(200株)
燦ホールディングス	3,300	2,882.00	9,510,600	
スバル興業	1,000	6,940.00	6,940,000	
東京テアトル	5,700	1,441.00	8,213,700	
タナベ経営	2,600	2,076.00	5,397,600	
ナガワ	2,800	4,640.00	12,992,000	

よみうりランド	3,000	4,705.00	14,115,000	
東京都競馬	10,300	4,120.00	42,436,000	貸付有価証券 100株
常磐興産	5,500	1,917.00	10,543,500	貸付有価証券 2,000株
カナモト	21,000	3,590.00	75,390,000	
東京ドーム	55,900	1,037.00	57,968,300	貸付有価証券 900株（500株）
西尾レントオール	12,600	3,240.00	40,824,000	貸付有価証券 800株（800株）
トランス・コスモス	15,300	2,928.00	44,798,400	
乃村工藝社	32,300	2,301.00	74,322,300	貸付有価証券 5,400株
藤田観光	5,500	3,255.00	17,902,500	貸付有価証券 2,500株
KNT - CTホールディングス	8,600	1,723.00	14,817,800	
日本管財	14,800	2,078.00	30,754,400	
トーカイ	13,300	2,241.00	29,805,300	
白洋舎	1,600	3,265.00	5,224,000	
セコム	146,500	8,150.00	1,193,975,000	貸付有価証券 300株（200株）
セントラル警備保障	6,600	3,960.00	26,136,000	貸付有価証券 800株
丹青社	28,200	1,302.00	36,716,400	
メイテック	16,100	6,070.00	97,727,000	
応用地質	14,800	1,543.00	22,836,400	
船井総研ホールディングス	28,700	2,468.00	70,831,600	貸付有価証券 400株
進学会ホールディングス	6,300	615.00	3,874,500	
オオバ	10,800	621.00	6,706,800	貸付有価証券 5,000株
いであ	2,800	1,045.00	2,926,000	
学究社	3,700	1,812.00	6,704,400	貸付有価証券 100株
ベネッセホールディングス	50,500	4,025.00	203,262,500	
イオンディライト	17,000	3,825.00	65,025,000	貸付有価証券 1,900株（200株）
ナック	9,200	925.00	8,510,000	貸付有価証券

					200株
	ニチイ学館	26,200	1,230.00	32,226,000	貸付有価証券 1,300株
	ダイセキ	23,100	3,265.00	75,421,500	貸付有価証券 400株
	ステップ	5,000	1,714.00	8,570,000	
	小計 銘柄数：2,051 組入時価比率：98.4%			361,367,344,570 100.0%	
	合計			361,367,344,570	

(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證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(2018年4月23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	2018年 4月23日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	5,716,281,003	-	5,886,720,000	170,275,701
合計	5,716,281,003	-	5,886,720,000	170,275,701

(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。

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2018年 4月23日現在)

資産の部

流動資産

(2018年 4月23日現在)

預金	5,333,570,663
コール・ローン	200,122,336
株式	455,171,167,825
投資信託受益証券	18,113,884
投資証券	10,782,816,750
派生商品評価勘定	161,939,804
未収入金	2,328,170
未収配当金	590,113,101
差入委託証拠金	1,509,852,292
流動資産合計	473,770,024,825
資産合計	473,770,024,825
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,116,137
未払解約金	183,047,818
未払利息	362
その他未払費用	3,551,000
流動負債合計	193,715,317
負債合計	193,715,317
純資産の部	
元本等	
元本	185,370,875,367
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	288,205,434,141
元本等合計	473,576,309,508
純資産合計	473,576,309,508
負債純資産合計	473,770,024,825

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>投資信託受益証券</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>市場価格のない有価証券については基準価額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	<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 （株式、投資証券） 受取配当金は、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） 受取配当金は、投資信託受益証券の収益分配金を、原則として収益分配金落の売買が行なわれる日において、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）

2018年 4月23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	2.5548円
(10,000口当たり純資産額)	(25,548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 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
<p>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。</p> <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、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。</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

2018年 4月23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。	
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

2018年 4月23日現在	
期首	2017年 4月25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	157,420,554,632円
同期中における追加設定元本額	50,738,484,592円
同期中における一部解約元本額	22,788,163,857円
期末元本額	185,370,875,367円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	53,596,706円
バランスセレクト50	165,351,735円
バランスセレクト70	170,714,883円
野村外国株式インデックスファンド	546,034,919円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,757,778,739円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	7,024,929,459円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,602,611,944円
野村資産設計ファンド2015	22,145,399円

野村資産設計ファンド2020	26,138,219円
野村資産設計ファンド2025	37,996,196円
野村資産設計ファンド2030	40,150,805円
野村資産設計ファンド2035	30,337,509円
野村資産設計ファンド2040	76,063,681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)	33,058,112,526円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	1,032,520,025円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	6,110,454,880円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	4,471,287,374円
野村資産設計ファンド2045	9,954,279円
野村インデックスファンド・外国株式	3,616,961,746円
マイ・ロード	1,529,107,674円
ネクストコア	62,177,227円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	98,175,857円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	884,822,112円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	847,762,993円
野村資産設計ファンド2050	14,679,811円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,211,637円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,585,978円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,074,998円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	623,310円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	165,644,169円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	231,736,935円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,327,275円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,245,001円
インデックス・ブレンド(タイプ)	10,689,896円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,247,109円
インデックス・ブレンド(タイプ)	10,665,374円
野村6資産均等バランス	35,822,757円
野村つみたて外国株投信	543,228,022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)	1,960,029,081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	210,293,641円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	287,494,556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)	347,083,488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)	314,088,327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)	2,458,042,630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)	2,782,534,013円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,606,942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)	13,082,049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)	3,923,368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)	34,230,525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)	373,172,049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)	406,294,489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)	154,823,409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)	53,341,634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)	201,182,939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)	3,758,019,705円

野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	455,536,277円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	67,455,911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)	599,406,401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)	7,587,332,513円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,351,459円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	13,279,103円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	14,482,390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)	60,365,043,471円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,382,505,114円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,717,911,330円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,484,723,211円
マイバランスDC30	911,560,887円
マイバランスDC50	1,654,040,423円
マイバランスDC70	1,320,320,928円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	16,569,304,983円
野村DC運用戦略ファンド	380,742,340円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	11,120,311円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	129,881,436円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	11,879,436円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	22,190,621円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	1,169,860円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,119,863円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	2,180,655円
野村資産設計ファンド(DC)2030	163,821円
野村資産設計ファンド(DC)2040	241,727円
野村資産設計ファンド(DC)2050	480,884円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	667,296円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	257,148円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	115,052円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	198,512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(2018年4月23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	47,300	33.99	1,607,727.00	
		HALLIBURTON CO	102,300	51.96	5,315,508.00	
		HELMERICH & PAYNE	12,800	72.33	925,824.00	

NATIONAL OILWELL VARCO INC	44,200	38.25	1,690,650.00	
SCHLUMBERGER LTD	164,000	69.23	11,353,720.00	
TECHNIPFMC PLC	51,600	32.88	1,696,608.00	
ANADARKO PETE	65,200	66.49	4,335,148.00	
ANDEAVOR	17,700	117.81	2,085,237.00	
ANTERO RESOURCES CORP	27,000	19.76	533,520.00	
APACHE CORPORATION	43,900	41.45	1,819,655.00	
CABOT OIL & GAS CORP	53,300	23.08	1,230,164.00	
CHENIERE ENERGY INC	24,300	57.75	1,403,325.00	
CHEVRON CORP	224,300	122.31	27,434,133.00	
CIMAREX ENERGY CO	10,600	100.61	1,066,466.00	
CONCHO RESOURCES INC	17,200	156.36	2,689,392.00	
CONOCOPHILLIPS	141,700	65.79	9,322,443.00	
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	11,400	63.83	727,662.00	
DEVON ENERGY CORP	57,300	35.40	2,028,420.00	
DIAMONDBACK ENERGY INC	10,400	128.40	1,335,360.00	
EOG RESOURCES INC	67,600	113.97	7,704,372.00	
EQT CORP	30,700	47.36	1,453,952.00	
EXXON MOBIL CORP	500,100	79.00	39,507,900.00	
HESS CORP	34,600	57.81	2,000,226.00	
HOLLYFRONTIER CORP	19,700	58.26	1,147,722.00	
KINDER MORGAN INC	233,000	16.47	3,837,510.00	
MARATHON OIL CORP	99,000	18.02	1,783,980.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	58,200	79.76	4,642,032.00	
NEWFIELD EXPLORATION CO	22,900	27.91	639,139.00	
NOBLE ENERGY INC	55,900	33.77	1,887,743.00	
OCCIDENTAL PETE CORP	89,600	76.47	6,851,712.00	
ONEOK INC	45,900	59.54	2,732,886.00	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	26,100	30.39	793,179.00	
PHILLIPS 66	51,700	110.99	5,738,183.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	19,800	194.95	3,860,010.00	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	19,000	25.02	475,380.00	
RANGE RESOURCES CORP	31,000	13.69	424,390.00	
TARGA RESOURCES CORP	24,900	47.59	1,184,991.00	
VALERO ENERGY CORP	52,000	108.55	5,644,600.00	

WILLIAMS COS	97,600	25.51	2,489,776.00
AIR PRODUCTS	26,000	166.27	4,323,020.00
ALBEMARLE CORP	13,500	97.75	1,319,625.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	24,900	30.96	770,904.00
CELANESE CORP-SERIES A	15,500	111.70	1,731,350.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	26,400	38.72	1,022,208.00
CHEMOURS CO/THE	20,600	51.92	1,069,552.00
DOWDUPONT INC	276,500	66.04	18,260,060.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	17,100	107.34	1,835,514.00
ECOLAB INC	30,300	148.55	4,501,065.00
FMC CORP	16,400	82.31	1,349,884.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	9,600	141.60	1,359,360.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	39,900	107.68	4,296,432.00
MONSANTO CO	51,500	125.00	6,437,500.00
MOSAIC CO/THE	39,400	25.68	1,011,792.00
PPG INDUSTRIES	29,900	108.87	3,255,213.00
PRAXAIR INC	34,000	150.68	5,123,120.00
SHERWIN-WILLIAMS	10,030	392.39	3,935,671.70
WR GRACE & CO	8,300	66.98	555,934.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7,500	196.72	1,475,400.00
VULCAN MATERIALS CO	15,300	113.75	1,740,375.00
AVERY DENNISON CORP	9,900	107.12	1,060,488.00
BALL CORP	39,700	40.67	1,614,599.00
CROWN HOLDINGS INC	16,700	51.29	856,543.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	47,100	53.41	2,515,611.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	10,900	116.13	1,265,817.00
SEALED AIR CORP	21,900	44.02	964,038.00
WESTROCK CO	29,200	66.27	1,935,084.00
FREEMONT-MCMORAN INC	165,000	19.36	3,194,400.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	63,900	41.35	2,642,265.00
NUCOR CORP	36,600	63.55	2,325,930.00
STEEL DYNAMICS	27,100	46.68	1,265,028.00
ARCONIC INC	51,600	23.26	1,200,216.00
BOEING CO	66,830	338.67	22,633,316.10
GENERAL DYNAMICS	30,110	223.11	6,717,842.10

HARRIS CORP	14,300	168.00	2,402,400.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,120	263.56	1,349,427.20	
L3 TECHNOLOGIES INC	9,000	215.09	1,935,810.00	
LOCKHEED MARTIN	30,550	351.99	10,753,294.50	
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,340	355.92	6,883,492.80	
RAYTHEON COMPANY	34,280	227.35	7,793,558.00	
ROCKWELL COLLINS INC	19,200	133.04	2,554,368.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	13,200	80.51	1,062,732.00	
TEXTRON INC	31,300	65.59	2,052,967.00	
TRANSDIGM GROUP INC	6,090	327.70	1,995,693.00	
UNITED TECHNOLOGIES	89,800	123.08	11,052,584.00	
ALLEGION PLC	10,800	84.75	915,300.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	17,100	57.10	976,410.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	108,600	34.27	3,721,722.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,500	197.08	886,860.00	
MASCO CORP	35,700	39.24	1,400,868.00	
OWENS CORNING INC	12,400	77.21	957,404.00	
SMITH (A.O.) CORP	16,500	65.27	1,076,955.00	
FLUOR CORP	16,400	58.58	960,712.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	14,100	60.00	846,000.00	
ACUITY BRANDS INC	5,000	127.93	639,650.00	
AMETEK INC	26,800	75.81	2,031,708.00	
EATON CORP PLC	52,500	79.06	4,150,650.00	
EMERSON ELEC	76,300	70.20	5,356,260.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	15,400	172.83	2,661,582.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	19,400	54.11	1,049,734.00	
3M CORP	70,410	217.75	15,331,777.50	
GENERAL ELEC CO	1,025,000	14.54	14,903,500.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	85,600	150.57	12,888,792.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	25,500	61.96	1,579,980.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	26,600	38.28	1,018,248.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	11,940	282.14	3,368,751.60	
AGCO CORP	7,800	66.30	517,140.00	
CATERPILLAR INC DEL	70,400	153.25	10,788,800.00	

CUMMINS INC	18,900	168.77	3,189,753.00
DEERE & COMPANY	32,500	146.96	4,776,200.00
DOVER CORP	18,100	96.02	1,737,962.00
FLOWSERVE CORP	15,000	47.31	709,650.00
FORTIVE CORP	36,900	76.74	2,831,706.00
IDEX CORP	9,300	144.64	1,345,152.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	36,600	158.29	5,793,414.00
INGERSOLL-RAND PLC	29,300	83.56	2,448,308.00
MIDDLEBY CORP	6,500	127.70	830,050.00
PACCAR	41,500	69.18	2,870,970.00
PARKER HANNIFIN CORP	15,700	176.39	2,769,323.00
PENTAIR PLC	20,500	70.45	1,444,225.00
SNAP-ON INC	6,700	146.84	983,828.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	18,100	144.21	2,610,201.00
WABCO HOLDINGS INC	6,000	133.92	803,520.00
WABTEC CORP	10,300	87.54	901,662.00
XYLEM INC	20,600	79.27	1,632,962.00
AERCAP HOLDINGS NV	14,900	52.70	785,230.00
FASTENAL CO	34,100	50.49	1,721,709.00
GRAINGER(W.W.) INC	6,200	288.40	1,788,080.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	22,900	39.35	901,115.00
UNITED RENTALS INC	10,100	163.22	1,648,522.00
CINTAS CORP	10,700	173.12	1,852,384.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	27,600	65.55	1,809,180.00
ROLLINS INC	12,000	52.16	625,920.00
STERICYCLE INC	10,800	60.36	651,888.00
WASTE CONNECTIONS INC	30,300	73.72	2,233,716.00
WASTE MANAGEMENT INC	51,700	82.48	4,264,216.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	16,900	93.68	1,583,192.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	21,300	64.20	1,367,460.00
FEDEX CORPORATION	29,770	247.12	7,356,762.40
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	81,400	108.55	8,835,970.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,600	46.78	682,988.00
DELTA AIR LINES INC	20,100	55.40	1,113,540.00
SOUTHWEST AIRLINES	17,600	54.77	963,952.00

UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	9,200	71.75	660,100.00	
AMERCO	680	339.90	231,132.00	
CSX CORP	100,900	60.04	6,058,036.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	10,700	119.59	1,279,613.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	11,800	112.00	1,321,600.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,700	43.47	725,949.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	33,500	136.75	4,581,125.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	6,900	148.51	1,024,719.00	
UNION PAC CORP	93,100	135.66	12,629,946.00	
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	9,500	38.71	367,745.00	
APTIV PLC	31,900	86.31	2,753,289.00	
AUTOLIV INC	10,500	150.23	1,577,415.00	
BORGWARNER INC	23,600	52.76	1,245,136.00	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	28,300	27.01	764,383.00	
LEAR CORP	7,700	191.40	1,473,780.00	
FORD MOTOR COMPANY	441,000	10.82	4,771,620.00	
GENERAL MOTORS CO	149,800	37.61	5,633,978.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	19,400	41.04	796,176.00	
TESLA INC	15,610	290.24	4,530,646.40	
DR HORTON INC	42,000	43.01	1,806,420.00	
GARMIN LTD	13,300	58.94	783,902.00	
LEGGETT & PLATT INC	15,900	42.90	682,110.00	
LENNAR CORP-A	32,600	54.62	1,780,612.00	
MOHAWK INDUSTRIES	7,260	235.57	1,710,238.20	
NEWELL BRANDS INC	56,500	26.44	1,493,860.00	
NVR INC	433	3,058.36	1,324,269.88	
PULTEGROUP INC	29,300	28.54	836,222.00	
TOLL BROTHERS INC	18,500	41.37	765,345.00	
WHIRLPOOL CORP	8,200	149.37	1,224,834.00	
HASBRO INC	12,600	82.81	1,043,406.00	
MATTEL INC	40,000	12.96	518,400.00	
POLARIS INDUSTRIES INC	7,100	119.64	849,444.00	
HANESBRANDS INC	43,300	17.21	745,193.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	12,100	96.31	1,165,351.00	

MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	17,900	65.01	1,163,679.00
NIKE INC-B	155,300	66.09	10,263,777.00
PVH CORP	9,000	159.48	1,435,320.00
RALPH LAUREN CORPORATION	6,800	106.27	722,636.00
TAPESTRY INC	33,000	53.03	1,749,990.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	18,400	16.10	296,240.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	18,700	13.99	261,613.00
V F CORP	39,300	77.50	3,045,750.00
ARAMARK	28,600	37.75	1,079,650.00
CARNIVAL CORP	41,100	65.88	2,707,668.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,890	331.95	959,335.50
DARDEN RESTAURANTS INC	14,300	91.05	1,302,015.00
DOMINOS PIZZA INC	5,270	238.93	1,259,161.10
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	34,200	82.33	2,815,686.00
LAS VEGAS SANDS CORP	46,500	73.89	3,435,885.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	36,200	137.48	4,976,776.00
MCDONALD'S CORP	94,200	158.77	14,956,134.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	28,300	31.41	888,903.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	53,500	35.44	1,896,040.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	24,500	55.65	1,363,425.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,600	119.09	2,453,254.00
STARBUCKS CORP	168,500	58.00	9,773,000.00
VAIL RESORTS INC	4,950	231.36	1,145,232.00
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	11,900	114.74	1,365,406.00
WYNN RESORTS LTD	11,700	192.51	2,252,367.00
YUM BRANDS INC	37,700	86.29	3,253,133.00
CBS CORP-CL B	40,000	49.33	1,973,200.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	22,120	310.94	6,877,992.80
COMCAST CORP-CL A	551,100	33.21	18,302,031.00
DISCOVERY INC - A	19,300	23.16	446,988.00
DISCOVERY INC - C	35,331	21.46	758,203.26
DISH NETWORK CORP-A	28,000	37.23	1,042,440.00
DISNEY (WALT) CO	178,500	100.24	17,892,840.00
INTERPUBRIC GROUP	44,300	23.99	1,062,757.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	12,400	82.87	1,027,588.00

LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	64,600	30.45	1,967,070.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	31.78	762,720.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,400	30.52	683,648.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	19,700	41.46	816,762.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	9,870	41.66	411,184.20
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	16,100	39.25	631,925.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	46,000	16.17	743,820.00
OMNICOM GROUP	26,800	73.74	1,976,232.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	182,000	6.31	1,148,420.00
TIME WARNER INC	92,200	96.24	8,873,328.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	122,500	36.68	4,493,300.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	51,000	36.18	1,845,180.00
VIACOM INC-CLASS B	41,300	30.66	1,266,258.00
GENUINE PARTS CO	17,200	87.75	1,509,300.00
LKQ CORP	36,300	38.25	1,388,475.00
AMAZON.COM INC	48,310	1,527.49	73,793,041.90
BOOKING HOLDINGS INC	5,770	2,131.37	12,298,004.90
EXPEDIA GROUP INC	14,400	109.77	1,580,688.00
NETFLIX INC	51,160	327.77	16,768,713.20
QURATE RETAIL GROUP INC QVC GROUP	53,200	25.23	1,342,236.00
TRIPADVISOR INC	12,300	41.62	511,926.00
DOLLAR GENERAL CORP	32,700	96.34	3,150,318.00
DOLLAR TREE INC	28,000	97.56	2,731,680.00
KOHL'S CORP	19,600	58.38	1,144,248.00
MACYS INC	35,900	29.96	1,075,564.00
NORDSTROM INC	15,000	46.78	701,700.00
TARGET CORP	61,500	70.32	4,324,680.00
ADVANCE AUTO PARTS	8,300	103.76	861,208.00
AUTONATION INC	7,100	45.57	323,547.00
AUTOZONE	3,240	595.84	1,930,521.60
BEST BUY COMPANY INC	31,900	72.30	2,306,370.00
CARMAX INC	22,200	61.16	1,357,752.00
GAP INC	27,100	28.44	770,724.00
HOME DEPOT	137,900	177.01	24,409,679.00

L BRANDS, INC	27,000	34.37	927,990.00
LOWES COS INC	98,500	83.62	8,236,570.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,880	221.48	2,188,222.40
ROSS STORES INC	46,000	77.32	3,556,720.00
TIFFANY & CO	15,100	98.84	1,492,484.00
TJX COS INC	74,000	82.48	6,103,520.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	14,900	60.33	898,917.00
ULTA BEAUTY INC	7,000	235.05	1,645,350.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	51,700	193.56	10,007,052.00
CVS HEALTH CORP	120,100	65.12	7,820,912.00
KROGER CO	105,700	24.12	2,549,484.00
SYSCO CORP	57,400	61.15	3,510,010.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	99,900	63.92	6,385,608.00
WALMART INC	176,600	86.98	15,360,668.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	30,900	54.49	1,683,741.00
COCA COLA CO	478,100	43.74	20,912,094.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	26,700	40.55	1,082,685.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	20,490	227.58	4,663,114.20
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	21,100	120.32	2,538,752.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	22,000	70.38	1,548,360.00
MONSTER BEVERAGE CORP	45,400	56.50	2,565,100.00
PEPSICO INC	168,000	102.48	17,216,640.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	66,900	45.50	3,043,950.00
BUNGE LIMITED	17,200	73.73	1,268,156.00
CAMPBELL SOUP CO	21,600	40.36	871,776.00
CONAGRA BRANDS INC	47,200	36.43	1,719,496.00
GENERAL MILLS	67,900	43.41	2,947,539.00
HERSHEY CO/THE	16,600	92.48	1,535,168.00
HORMEL FOODS CORP	32,800	35.45	1,162,760.00
INGREDION INC	8,400	126.21	1,060,164.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	13,500	114.92	1,551,420.00
KELLOGG CO	30,200	60.27	1,820,154.00
KRAFT HEINZ CO/THE	72,500	58.22	4,220,950.00
MCCORMICK & CO INC.	13,900	103.24	1,435,036.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	177,200	40.11	7,107,492.00

TYSON FOODS INC-CL A	34,900	69.20	2,415,080.00	
ALTRIA GROUP INC	225,600	57.23	12,911,088.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	183,500	84.27	15,463,545.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	28,700	45.84	1,315,608.00	
CLOROX CO	15,000	114.88	1,723,200.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	98,900	67.52	6,677,728.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	40,900	100.03	4,091,227.00	
PROCTER & GAMBLE CO	299,600	73.80	22,110,480.00	
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	2,600	97.66	253,916.00	
COTY INC-CL A	55,000	16.76	921,800.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	26,200	148.73	3,896,726.00	
ABBOTT LABORATORIES	205,900	59.19	12,187,221.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	8,860	247.07	2,189,040.20	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	57,100	67.05	3,828,555.00	
BECTON,DICKINSON	30,970	232.88	7,212,293.60	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	161,100	28.84	4,646,124.00	
DANAHER CORP	73,200	101.34	7,418,088.00	
DENTSPLY SIRONA INC	27,200	49.34	1,342,048.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,900	137.09	3,413,541.00	
HOLOGIC INC	31,100	38.30	1,191,130.00	
IDEXX LABORATORIES INC	10,200	196.75	2,006,850.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	13,120	456.27	5,986,262.40	
MEDTRONIC PLC	160,100	79.90	12,791,990.00	
RESMED INC	16,900	98.80	1,669,720.00	
STRYKER CORP	39,400	164.25	6,471,450.00	
TELEFLEX INC	5,360	271.03	1,452,720.80	
THE COOPER COMPANIES, INC.	5,630	225.12	1,267,425.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,700	126.50	1,353,550.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	23,900	110.32	2,636,648.00	
AETNA INC	38,100	176.92	6,740,652.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,200	89.87	1,725,504.00	
ANTHEM INC	30,460	226.07	6,886,092.20	
CARDINAL HEALTH INC	36,300	62.07	2,253,141.00	
CENTENE CORP	19,800	110.63	2,190,474.00	
CIGNA CORP	29,300	169.94	4,979,242.00	

DAVITA INC	17,500	63.75	1,115,625.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	14,900	37.41	557,409.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	66,100	73.49	4,857,689.00
HCA HEALTHCARE INC	33,300	97.45	3,245,085.00
HENRY SCHEIN INC	19,100	69.07	1,319,237.00
HUMANA INC	16,660	294.12	4,900,039.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	11,800	165.17	1,949,006.00
MCKESSON CORP	24,900	146.25	3,641,625.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	16,500	98.16	1,619,640.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	114,430	235.06	26,897,915.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	9,800	120.52	1,181,096.00
ABBVIE INC	188,700	92.60	17,473,620.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26,300	107.78	2,834,614.00
ALKERMES PLC	17,400	46.02	800,748.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	9,900	97.48	965,052.00
AMGEN INC	79,700	171.56	13,673,332.00
BIOGEN INC	24,720	263.02	6,501,854.40
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	20,200	82.30	1,662,460.00
CELGENE CORP	93,300	88.95	8,299,035.00
GILEAD SCIENCES INC	154,600	73.70	11,394,020.00
INCYTE CORP	21,200	68.43	1,450,716.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,250	314.25	2,906,812.50
SEATTLE GENETICS INC	13,400	49.68	665,712.00
TESARO INC	3,700	51.58	190,846.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	5,200	114.06	593,112.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	29,600	158.15	4,681,240.00
ALLERGAN PLC	39,500	158.51	6,261,145.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	193,600	51.17	9,906,512.00
ELI LILLY & CO.	117,400	79.06	9,281,644.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,000	157.95	1,105,650.00
JOHNSON & JOHNSON	317,000	126.66	40,151,220.00
MERCK & CO INC	322,000	58.83	18,943,260.00
MYLAN NV	52,400	40.72	2,133,728.00
PERRIGO CO PLC	14,200	81.54	1,157,868.00
PFIZER INC	703,900	36.63	25,783,857.00

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	105,000	17.82	1,871,100.00
ZOETIS INC	56,700	85.45	4,845,015.00
BANK OF AMERICA CORP	1,169,500	30.26	35,389,070.00
BB&T CORPORATION	93,800	52.71	4,944,198.00
CIT GROUP INC	16,400	52.97	868,708.00
CITIGROUP	312,300	70.00	21,861,000.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	57,800	41.98	2,426,444.00
COMERICA INC	20,400	95.49	1,947,996.00
EAST WEST BANCORP INC	16,200	65.54	1,061,748.00
FIFTH THIRD BANCORP	81,300	31.42	2,554,446.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	18,500	92.99	1,720,315.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	126,000	14.75	1,858,500.00
JPMORGAN CHASE & CO	409,400	111.47	45,635,818.00
KEYCORP	124,000	19.86	2,462,640.00
M & T BANK CORP	15,700	181.53	2,850,021.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	41,000	18.22	747,020.00
PNC FINANCIAL	56,400	144.12	8,128,368.00
REGIONS FINANCIAL CORP	137,000	18.89	2,587,930.00
SIGNATURE BANK	6,500	129.30	840,450.00
SUNTRUST BKS INC.	56,700	66.84	3,789,828.00
SVB FINANCIAL GROUP	6,400	250.83	1,605,312.00
US BANCORP	196,500	50.43	9,909,495.00
WELLS FARGO CO	552,300	52.56	29,028,888.00
ZIONS BANCORPORATION	22,600	53.80	1,215,880.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	149,900	200.13	29,999,487.00
LEUCADIA NATIONAL CORP	36,600	24.02	879,132.00
VOYA FINANCIAL INC	21,700	52.51	1,139,467.00
AFLAC INC	92,400	45.28	4,183,872.00
ALLEGHANY CORP	1,720	587.44	1,010,396.80
ALLSTATE CORP	42,700	98.31	4,197,837.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8,400	114.03	957,852.00
AMERICAN INTL GROUP	105,200	55.43	5,831,236.00
AON PLC	29,800	144.04	4,292,392.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	15,900	81.05	1,288,695.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21,400	69.97	1,497,358.00

ASSURANT INC	6,300	93.41	588,483.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	18,900	49.34	932,526.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	10,500	56.48	593,040.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	10,200	51.53	525,606.00
CHUBB LTD	55,000	137.68	7,572,400.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	18,400	75.27	1,384,968.00
EVEREST RE GROUP LTD	5,010	246.99	1,237,419.90
FNF GROUP	29,900	38.05	1,137,695.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	42,400	52.03	2,206,072.00
LINCOLN NATIONAL CORP	25,800	71.58	1,846,764.00
LOEWS CORP	33,300	51.57	1,717,281.00
MARKEL CORP	1,630	1,153.08	1,879,520.40
MARSH & MCLENNAN COS	60,700	82.90	5,032,030.00
METLIFE INC	106,400	47.49	5,052,936.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	33,400	60.89	2,033,726.00
PROGRESSIVE CO	67,700	61.05	4,133,085.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	49,700	107.03	5,319,391.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	7,200	155.45	1,119,240.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,000	138.04	690,200.00
TORCHMARK CORP	12,500	87.18	1,089,750.00
TRAVELERS COS INC/THE	32,600	136.84	4,460,984.00
UNUM GROUP	27,300	48.88	1,334,424.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	14,800	151.41	2,240,868.00
WR BERKLEY CORP	11,500	74.74	859,510.00
XL GROUP LTD	30,900	55.55	1,716,495.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	19,100	71.30	1,361,830.00
ALPHABET INC-CL A	35,200	1,077.32	37,921,664.00
ALPHABET INC-CL C	37,120	1,072.96	39,828,275.20
EBAY INC	115,700	42.20	4,882,540.00
FACEBOOK INC-A	281,400	166.28	46,791,192.00
IAC/INTERACTIVE CORP	9,100	161.80	1,472,380.00
MERCADOLIBRE INC	4,980	324.49	1,615,960.20
TWITTER INC	74,100	31.91	2,364,531.00
VERISIGN INC	10,100	124.79	1,260,379.00
ZILLOW GROUP INC - C	13,300	47.18	627,494.00

ACCENTURE PLC-CL A	72,700	152.41	11,080,207.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,960	209.32	1,247,547.20
AUTOMATIC DATA PROCESS	52,600	116.84	6,145,784.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	14,100	109.85	1,548,885.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	70,000	81.77	5,723,900.00
DXC TECHNOLOGY CO	33,300	103.51	3,446,883.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	39,800	96.01	3,821,198.00
FIRST DATA CORP- CLASS A	56,000	15.12	846,720.00
FISERV INC	49,700	71.34	3,545,598.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,800	208.95	2,256,660.00
GARTNER INC	11,000	117.72	1,294,920.00
GLOBAL PAYMENTS INC	18,900	111.28	2,103,192.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	104,000	144.90	15,069,600.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,800	121.43	1,068,584.00
LEIDOS HOLDINGS INC	16,100	66.13	1,064,693.00
MASTERCARD INC	111,000	177.08	19,655,880.00
PAYCHEX INC	37,400	60.34	2,256,716.00
PAYPAL HOLDINGS INC	135,200	78.73	10,644,296.00
SABRE CORP	26,000	20.28	527,280.00
SQUARE INC - A	31,900	51.46	1,641,574.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	19,500	87.28	1,701,960.00
VISA INC-CLASS A SHARES	214,100	124.20	26,591,220.00
WESTERN UNION CO	52,800	19.08	1,007,424.00
WORLDPAY INC - CL A	35,000	81.20	2,842,000.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	84,000	66.30	5,569,200.00
ADOBE SYSTEMS INC.	58,310	225.24	13,133,744.40
ANSYS INC	9,900	163.78	1,621,422.00
AUTODESK INC.	23,600	130.09	3,070,124.00
CA INC	38,300	34.58	1,324,414.00
CADENCE DESIGN SYS INC	32,100	37.02	1,188,342.00
CDK GLOBAL INC	14,600	65.21	952,066.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	15,300	102.23	1,564,119.00
CITRIX SYSTEMS INC	17,300	96.57	1,670,661.00
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	23,300	72.67	1,693,211.00

ELECTRONIC ARTS	36,100	120.89	4,364,129.00
FORTINET INC	17,000	57.15	971,550.00
INTUIT INC	28,900	178.13	5,147,957.00
MICROSOFT CORP	864,400	95.00	82,118,000.00
ORACLE CORPORATION	369,900	46.23	17,100,477.00
RED HAT INC	21,100	159.28	3,360,808.00
SALESFORCE.COM INC	81,300	122.82	9,985,266.00
SERVICENOW INC	20,200	168.90	3,411,780.00
SPLUNK INC	16,200	104.49	1,692,738.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	25,500	50.37	1,284,435.00
SYMANTEC CORP	71,300	27.71	1,975,723.00
SYNOPSYS INC	18,000	83.01	1,494,180.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	13,500	98.38	1,328,130.00
VMWARE INC - CLASS A	8,400	136.05	1,142,820.00
WORKDAY INC-CLASS A	16,500	130.53	2,153,745.00
ARISTA NETWORKS INC	5,640	260.65	1,470,066.00
CISCO SYSTEMS	583,800	44.09	25,739,742.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22,800	40.86	931,608.00
F5 NETWORKS INC	7,300	156.96	1,145,808.00
JUNIPER NETWORKS INC	42,400	24.35	1,032,440.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19,000	110.57	2,100,830.00
PALO ALTO NETWORKS INC	10,700	192.07	2,055,149.00
APPLE INC	605,500	165.72	100,343,460.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	186,000	17.29	3,215,940.00
HP INC	194,200	21.53	4,181,126.00
NETAPP INC	32,200	68.66	2,210,852.00
SEAGATE TECHNOLOGY	34,300	59.64	2,045,652.00
WESTERN DIGITAL CORP	34,200	89.56	3,062,952.00
XEROX CORP	24,400	31.54	769,576.00
AMPHENOL CORP-CL A	35,900	85.21	3,059,039.00
ARROW ELECTRS INC	10,500	77.85	817,425.00
AVNET	15,000	41.39	620,850.00
CDW CORPORATION	18,200	71.53	1,301,846.00
COGNEX CORP	19,200	50.90	977,280.00
CORNING INC	104,000	27.55	2,865,200.00

FLEX LTD	62,000	17.22	1,067,640.00
FLIR SYSTEMS INC	15,600	52.58	820,248.00
IPG PHOTONICS CORP	4,200	232.13	974,946.00
TE CONNECTIVITY LTD	41,300	100.26	4,140,738.00
TRIMBLE INC	28,400	36.57	1,038,588.00
ADVANCED MICRO DEVICES	101,000	9.99	1,008,990.00
ANALOG DEVICES INC	43,300	89.76	3,886,608.00
APPLIED MATERIALS	126,500	51.09	6,462,885.00
BROADCOM INC	48,280	237.12	11,448,153.60
INTEL CORP	552,600	51.53	28,475,478.00
KLA TENCOR CORP	18,300	101.48	1,857,084.00
LAM RESEARCH	18,800	191.91	3,607,908.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	46,500	20.54	955,110.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32,900	54.40	1,789,760.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	28,100	85.68	2,407,608.00
MICRON TECHNOLOGY	136,800	50.62	6,924,816.00
NVIDIA CORP	71,630	228.71	16,382,497.30
NXP SEMICONDUCTORS NV	38,600	105.15	4,058,790.00
QORVO INC	14,200	69.88	992,296.00
QUALCOMM INC	174,600	51.44	8,981,424.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	21,100	91.18	1,923,898.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	116,600	99.96	11,655,336.00
XILINX INC	30,200	64.15	1,937,330.00
AT & T INC	724,900	34.67	25,132,283.00
CENTURYLINK INC	116,000	17.61	2,042,760.00
VERIZON COMMUNICATIONS	487,100	47.90	23,332,090.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	22,200	37.25	826,950.00
SPRINT CORP	90,000	6.00	540,000.00
T-MOBILE US INC	33,400	63.09	2,107,206.00
ALLIANT ENERGY CORP	28,300	41.54	1,175,582.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	57,300	68.46	3,922,758.00
DUKE ENERGY CORP	81,900	77.68	6,361,992.00
EDISON INTERNATIONAL	39,100	64.12	2,507,092.00
ENTERGY CORP	21,000	78.98	1,658,580.00
EVERSOURCE ENERGY	36,300	59.22	2,149,686.00

EXELON CORPORATION	114,300	38.60	4,411,980.00
FIRSTENERGY CORP	52,000	34.44	1,790,880.00
NEXTERA ENERGY INC	55,700	160.79	8,956,003.00
OGE ENERGY CORP	22,500	32.47	730,575.00
PG&E CORP	61,600	45.73	2,816,968.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	12,400	78.02	967,448.00
PPL CORPORATION	81,500	27.89	2,273,035.00
SOUTHERN CO.	119,300	45.22	5,394,746.00
WESTAR ENERGY INC	15,800	51.86	819,388.00
XCEL ENERGY INC	60,000	45.10	2,706,000.00
ATMOS ENERGY CORP	13,000	83.90	1,090,700.00
UGI CORP	20,400	46.33	945,132.00
AMEREN CORPORATION	28,700	56.27	1,614,949.00
CENTERPOINT ENERGY INC	49,800	26.68	1,328,664.00
CMS ENERGY CORP	33,000	45.19	1,491,270.00
CONSOLIDATED EDISON INC	35,900	77.60	2,785,840.00
DOMINION ENERGY INC	76,500	65.33	4,997,745.00
DTE ENERGY COMPANY	20,600	102.73	2,116,238.00
NISOURCE INC	38,200	23.75	907,250.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	59,700	49.51	2,955,747.00
SCANA CORP	17,100	35.92	614,232.00
SEMPRA ENERGY	27,900	109.81	3,063,699.00
WEC ENERGY GROUP INC	37,900	62.15	2,355,485.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20,800	83.67	1,740,336.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	56,000	12.64	707,840.00
ALLY FINANCIAL INC	52,700	27.66	1,457,682.00
AMERICAN EXPRESS CO	87,400	100.79	8,809,046.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	57,600	97.98	5,643,648.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	42,800	73.32	3,138,096.00
SYNCHRONY FINANCIAL	92,000	35.20	3,238,400.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	6,500	171.38	1,113,970.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	17,300	143.69	2,485,837.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	119,700	55.42	6,633,774.00
BLACKROCK INC	14,260	524.42	7,478,229.20
CBOE GLOBAL MARKETS INC	12,200	110.16	1,343,952.00

CME GROUP INC	39,800	165.08	6,570,184.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	30,700	60.48	1,856,736.00
EATON VANCE CORP	13,800	55.22	762,036.00
FRANKLIN RESOURCES INC	39,700	34.04	1,351,388.00
GOLDMAN SACHS GROUP	42,410	251.96	10,685,623.60
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	68,500	74.37	5,094,345.00
INVESCO LTD	46,900	31.06	1,456,714.00
MOODYS CORP	20,200	164.02	3,313,204.00
MORGAN STANLEY	160,600	54.46	8,746,276.00
MSCI INC	10,400	149.59	1,555,736.00
NASDAQ INC	14,000	87.42	1,223,880.00
NORTHERN TRUST CORP	25,900	107.65	2,788,135.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	14,900	87.80	1,308,220.00
S&P GLOBAL INC	30,300	192.96	5,846,688.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	143,100	54.99	7,869,069.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	15,000	70.29	1,054,350.00
STATE STREET CORP	43,500	99.66	4,335,210.00
T ROWE PRICE GROUP INC	28,500	108.44	3,090,540.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	33,400	61.23	2,045,082.00
H & R BLOCK INC	23,500	27.10	636,850.00
AES CORP	74,000	11.62	859,880.00
VISTRA ENERGY CORP	43,000	21.88	940,840.00
CERNER CORP	34,200	58.23	1,991,466.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	14,100	72.85	1,027,185.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	38,600	67.55	2,607,430.00
ILLUMINA INC	17,000	244.60	4,158,200.00
IQVIA HOLDINGS INC	15,500	97.27	1,507,685.00
METTLER-TOLEDO INTL	3,010	576.76	1,736,047.60
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	47,500	215.89	10,254,775.00
WATERS CORP	9,300	208.21	1,936,353.00
COSTAR GROUP INC	4,110	376.93	1,549,182.30
EQUIFAX INC	13,900	118.88	1,652,432.00
IHS MARKIT LTD	46,900	49.27	2,310,763.00
MANPOWERGROUP INC	8,000	101.47	811,760.00
NIelsen HOLDINGS PLC	42,700	33.04	1,410,808.00

	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	15,100	58.56	884,256.00	
	TRUNSION	21,800	66.84	1,457,112.00	
	VERISK ANALYTICS INC	18,400	107.38	1,975,792.00	
	CBRE GROUP INC	35,500	47.43	1,683,765.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	143,000	7.03	1,005,290.00	
	JONES LANG LASALLE INC	5,400	175.47	947,538.00	
小計	銘柄数：600			2,754,754,517.84	
				(297,072,727,203)	
	組入時価比率：62.7%			65.3%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	20,800	25.45	529,360.00	
	ARC RESOURCES LTD	40,000	14.01	560,400.00	
	CAMECO CORP	48,000	13.48	647,040.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	130,600	44.98	5,874,388.00	
	CENOVUS ENERGY INC	117,000	12.28	1,436,760.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	65,000	10.79	701,350.00	
	ENBRIDGE INC	193,400	39.77	7,691,518.00	
	ENCANA CORP	117,000	16.23	1,898,910.00	
	HUSKY ENERGY INC	43,000	19.06	819,580.00	
	IMPERIAL OIL	34,400	37.49	1,289,656.00	
	INTER PIPELINE LTD	46,000	23.89	1,098,940.00	
	KEYERA CORP	24,500	35.30	864,850.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	60,600	41.17	2,494,902.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	24,600	30.88	759,648.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	29,000	17.54	508,660.00	
	SUNCOR ENERGY INC	196,300	48.80	9,579,440.00	
	TOURMALINE OIL CORP	26,500	22.90	606,850.00	
	TRANSCANADA CORP	103,700	55.31	5,735,647.00	
	VERMILION ENERGY INC	12,000	45.90	550,800.00	
	METHANEX CORP	10,300	85.07	876,221.00	
	NUTRIEN LTD	76,800	59.63	4,579,584.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	15,500	62.67	971,385.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	28,100	56.28	1,581,468.00	
	BARRICK GOLD	134,000	16.76	2,245,840.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	80,000	18.84	1,507,200.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	22,200	90.77	2,015,094.00	

GOLDCORP INC	101,000	18.24	1,842,240.00
KINROSS GOLD CORP	140,000	4.93	690,200.00
LUNDIN MINING CORP	73,000	8.49	619,770.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	66,500	33.99	2,260,335.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	126,000	4.04	509,040.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	51,200	27.13	1,389,056.00
WEST FRASER TIMBER	8,400	92.35	775,740.00
BOMBARDIER B SHEARS	232,000	4.00	928,000.00
CAE INC	31,000	24.74	766,940.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	19,700	55.70	1,097,290.00
FINNING INTERNATIONAL INC	19,600	31.75	622,300.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	88,500	96.21	8,514,585.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	17,300	223.48	3,866,204.00
LINAMAR CORP	6,500	73.20	475,800.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	41,200	75.21	3,098,652.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	24,100	37.15	895,315.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	25,900	69.70	1,805,230.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	52,000	26.62	1,384,240.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	7,700	169.71	1,306,767.00
DOLLARAMA INC	12,800	148.36	1,899,008.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	50,600	52.84	2,673,704.00
EMPIRE CO LTD A	21,000	23.96	503,160.00
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	9,400	24.60	231,240.00
LOBLAW COMPANIES	24,000	65.45	1,570,800.00
METRO INC	26,700	42.13	1,124,871.00
WESTON(GEORGE)LTD	5,900	104.73	617,907.00
SAPUTO INC	23,900	41.04	980,856.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	38,000	21.94	833,720.00
BANK OF MONTREAL	77,000	95.57	7,358,890.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	142,100	76.86	10,921,806.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	51,900	110.35	5,727,165.00
NATIONAL BANK OF CANADA	39,200	59.23	2,321,816.00
ROYAL BANK OF CANADA	172,400	97.28	16,771,072.00
	218,600	70.19	15,343,534.00

	TORONTO DOMINION BANK				
	ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	49,000	5.02	245,980.00	
	ONEX CORPORATION	9,200	92.55	851,460.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,240	671.00	2,174,040.00	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	33,200	33.38	1,108,216.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	12,100	52.86	639,606.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	16,300	96.85	1,578,655.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	236,000	23.99	5,661,640.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	40,900	29.37	1,201,233.00	
	POWER FINANCIAL CORP	27,800	32.55	904,890.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	72,100	51.82	3,736,222.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	10,400	161.86	1,683,344.00	
	CGI GROUP INC - CLASS A	30,000	73.70	2,211,000.00	
	BLACKBERRY LTD	60,000	13.54	812,400.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,400	882.42	2,117,808.00	
	OPEN TEXT CORP	32,500	45.02	1,463,150.00	
	BCE INC	17,400	53.45	930,030.00	
	TELUS CORP	19,300	45.09	870,237.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	43,600	61.34	2,674,424.00	
	EMERA INC	7,600	40.27	306,052.00	
	FORTIS INC	49,000	42.50	2,082,500.00	
	HYDRO ONE LTD	35,000	20.70	724,500.00	
	ATCO LTD CL1	9,600	41.42	397,632.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	15,700	34.87	547,459.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	100,100	49.21	4,925,921.00	
	CI FINANCIAL CORP	33,600	26.78	899,808.00	
	IGM FINANCIAL INC	10,300	37.43	385,529.00	
	THOMSON REUTERS CORP	34,100	50.58	1,724,778.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	18,000	20.13	362,340.00	
小計	銘柄数：88			202,373,598.00	
				(17,094,497,823)	
	組入時価比率：3.6%			3.8%	
ユーロ	TENARIS SA	53,000	15.29	810,370.00	
	ENAGAS	26,700	23.02	614,634.00	
	ENI SPA	302,000	15.95	4,817,504.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	57,000	15.95	909,150.00	

NESTE OYJ	14,600	54.70	798,620.00
OMV AG	17,100	50.96	871,416.00
REPSOL SA	150,000	15.72	2,358,750.00
SNAM SPA	274,000	3.85	1,055,996.00
TOTAL SA	283,900	50.64	14,376,696.00
VOPAK	9,000	40.15	361,350.00
AIR LIQUIDE	50,100	104.70	5,245,470.00
AKZO NOBEL	29,700	78.54	2,332,638.00
ARKEMA	7,700	111.25	856,625.00
BASF SE	108,700	86.69	9,423,203.00
COVESTRO AG	18,800	81.10	1,524,680.00
EVONIK INDUSTRIES AG	19,500	29.99	584,805.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	8,200	43.96	360,472.00
K+S AG	23,400	23.42	548,028.00
KONINKLIJKE DSM NV	20,900	86.44	1,806,596.00
LANXESS	10,300	62.94	648,282.00
LINDE AG - TENDER	22,090	175.00	3,865,750.00
SOLVAY SA	8,700	115.60	1,005,720.00
SYMRISE AG	15,100	67.08	1,012,908.00
UMICORE	24,700	43.70	1,079,390.00
CRH PLC	99,600	28.92	2,880,432.00
HEIDELBERGCEMENT AG	17,300	81.40	1,408,220.00
IMERYS	3,800	80.75	306,850.00
ARCELORMITTAL	79,600	28.43	2,263,426.00
THYSSENKRUPP AG	51,800	22.71	1,176,378.00
VOESTALPINE AG	14,300	45.23	646,789.00
STORA ENSO OYJ-R	67,000	16.72	1,120,240.00
UPM-KYMMENE OYJ	64,000	30.09	1,925,760.00
AIRBUS SE	68,800	94.17	6,478,896.00
DASSAULT AVIATION SA	270	1,683.00	454,410.00
LEONARDO SPA	47,000	9.92	466,522.00
MTU AERO ENGINES AG	5,800	137.80	799,240.00
SAFRAN SA	39,700	90.08	3,576,176.00
THALES SA	12,400	103.40	1,282,160.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	58,300	44.00	2,565,491.50

ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	28,272	34.29	969,446.88
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	9,602	24.24	232,752.48
BOUYGUES	25,700	42.82	1,100,474.00
EIFFAGE SA	8,700	97.10	844,770.00
FERROVIAL SA	59,000	17.75	1,047,250.00
HOCHTIEF AG	2,000	151.00	302,000.00
VINCI	59,400	84.50	5,019,300.00
LEGRAND SA	31,900	65.20	2,079,880.00
OSRAM LICHT AG	11,600	58.00	672,800.00
PRYSMIAN SPA	23,000	24.80	570,400.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	66,300	75.36	4,996,368.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	30,000	13.63	408,900.00
SIEMENS AG	90,500	108.30	9,801,150.00
ALSTOM	18,100	38.03	688,343.00
ANDRITZ AG	9,200	46.20	425,040.00
CNH INDUSTRIAL NV	121,000	10.17	1,230,570.00
GEA GROUP AG	20,700	33.83	700,281.00
KION GROUP AG	8,000	77.98	623,840.00
KONE OYJ	40,700	40.75	1,658,525.00
MAN SE	3,700	96.40	356,680.00
METSO OYJ	12,400	27.11	336,164.00
WARTSILA OYJ	52,500	18.91	992,775.00
BRENNTAG AG	18,600	48.22	896,892.00
REXEL SA	35,000	14.07	492,625.00
EDENRED	25,300	28.35	717,255.00
SOCIETE BIC SA	3,800	80.85	307,230.00
BOLLORE	106,000	4.41	467,884.00
DEUTSCHE POST AG-REG	113,800	37.71	4,291,398.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	26,700	26.19	699,273.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	75,000	6.99	524,250.00
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	80,900	18.28	1,479,256.50
ADP	3,400	182.70	621,180.00
AENA SME SA	8,000	168.30	1,346,400.00
ATLANTIA SPA	53,200	27.11	1,442,252.00

FRAPORT AG	4,900	81.04	397,096.00
GETLINK	53,000	11.62	615,860.00
CONTINENTAL AG	12,820	220.20	2,822,964.00
FAURECIA	8,500	68.70	583,950.00
MICHELIN (CGDE)	20,000	117.25	2,345,000.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,400	33.32	446,488.00
SCHAEFFLER AG	21,000	13.22	277,620.00
VALEO SA	27,600	55.16	1,522,416.00
BAYER MOTOREN WERK	39,400	91.02	3,586,188.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	6,400	79.75	510,400.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	114,000	65.12	7,423,680.00
FERRARI NV	14,300	99.80	1,427,140.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	129,000	19.27	2,486,346.00
PEUGEOT CITROEN	67,400	20.78	1,400,572.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	18,600	71.82	1,335,852.00
RENAULT SA	22,700	94.12	2,136,524.00
VOLKSWAGEN AG	3,810	169.70	646,557.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	21,600	171.10	3,695,760.00
SEB SA	2,450	154.70	379,015.00
ADIDAS AG	22,370	212.20	4,746,914.00
HERMES INTERNATIONAL	3,800	517.60	1,966,880.00
HUGO BOSS AG	7,600	76.88	584,288.00
KERING SA	9,020	431.00	3,887,620.00
LUXOTTICA GROUP SPA	20,300	52.54	1,066,562.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	33,010	279.25	9,218,042.50
ACCOR SA	21,400	45.51	973,914.00
PADDY POWER PLC	10,100	83.15	839,815.00
SODEXO	11,100	82.14	911,754.00
ALTICE NV - A	64,000	8.29	530,816.00
AXEL SPRINGER SE	5,900	67.40	397,660.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	20,000	17.99	359,900.00
JC DECAUX SA	9,300	29.62	275,466.00
LAGARDERE S.C.A	14,800	23.35	345,580.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	28,700	29.63	850,381.00
PUBLICIS GROUPE	23,900	59.40	1,419,660.00

RTL GROUP	3,900	71.35	278,265.00
SES FDR	43,000	13.50	580,500.00
TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	53.00	355,100.00
VIVENDI SA	120,900	21.09	2,549,781.00
ZALANDO SE	13,400	43.44	582,096.00
INDITEX SA	127,000	24.49	3,110,230.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	67,400	16.46	1,109,741.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	5,900	42.44	250,396.00
COLRUYT SA	7,300	45.71	333,683.00
JERONIMO MARTINS	31,000	14.20	440,200.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	149,500	19.46	2,909,569.00
METRO AG	18,200	13.02	237,055.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	90,200	85.49	7,711,198.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	65,000	6.14	399,425.00
HEINEKEN HOLDING NV	13,500	85.10	1,148,850.00
HEINEKEN NV	30,300	88.56	2,683,368.00
PERNOD RICARD SA	25,300	139.00	3,516,700.00
REMY COINTREAU	3,000	113.50	340,500.00
DANONE	71,700	66.38	4,759,446.00
KERRY GROUP PLC-A	19,300	87.55	1,689,715.00
HENKEL AG & CO KGAA	12,300	96.50	1,186,950.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	20,800	104.00	2,163,200.00
BEIERSDORF AG	11,800	92.38	1,090,084.00
LOREAL-ORD	29,470	191.40	5,640,558.00
UNILEVER NV-CVA	192,800	45.25	8,725,164.00
BIOMERIEUX	4,600	64.40	296,240.00
ESSILOR INTERNATIONAL	24,200	114.45	2,769,690.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	112,000	32.93	3,688,160.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	17,400	32.70	568,980.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	25,500	84.88	2,164,440.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	48,400	65.70	3,179,880.00
GRIFOLS SA	36,600	23.41	856,806.00
BAYER AG-REG	97,900	99.00	9,692,100.00
IPSEN	4,700	127.30	598,310.00
MERCK KGAA	15,100	82.02	1,238,502.00

ORION OYJ	13,000	25.83	335,790.00
RECORDATI SPA	11,200	29.84	334,208.00
SANOFI	134,500	65.28	8,780,160.00
UCB SA	15,100	65.28	985,728.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	48,900	25.39	1,241,571.00
AIB GROUP PLC	105,000	5.15	540,750.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	791,000	6.57	5,203,198.00
BANCO DE SABADELL SA	625,000	1.74	1,088,437.50
BANCO SANTANDER SA	1,908,000	5.50	10,509,264.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	119,000	7.39	879,410.00
BANKIA SA	151,000	3.66	552,660.00
BANKINTER S.A.	75,000	8.61	645,750.00
BNP PARIBAS	133,000	63.21	8,406,930.00
CAIXABANK	413,000	4.00	1,654,065.00
COMMERZBANK AG	124,000	10.79	1,338,952.00
CREDIT AGRICOLE SA	137,000	13.58	1,861,145.00
ERSTE GROUP BANK AG	35,300	40.53	1,430,709.00
ING GROEP NV	461,000	14.25	6,572,016.00
INTESA SANPAOLO	1,578,000	3.13	4,947,030.00
INTESA SANPAOLO-RSP	118,000	3.27	386,568.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	30,000	72.96	2,188,800.00
MEDIOBANCA S.P.A.	77,000	10.17	783,090.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	16,900	28.22	476,918.00
SOCIETE GENERALE	91,200	45.59	4,158,264.00
UNICREDIT SPA	235,000	17.98	4,225,300.00
EURAZEO SE	5,400	74.65	403,110.00
EXOR NV	13,400	61.24	820,616.00
GROUPE BRUXELLES LAM	8,900	94.96	845,144.00
WENDEL	3,400	123.40	419,560.00
AEGON NV	208,000	6.00	1,248,000.00
AGEAS	21,300	43.54	927,402.00
ALLIANZ SE-REG	52,770	193.54	10,213,105.80
ASSICURAZIONI GENERALI	147,000	16.71	2,457,105.00
AXA	230,400	23.41	5,394,816.00

CNP ASSURANCES	21,200	21.26	450,712.00
HANNOVER RUECK SE	7,100	116.80	829,280.00
MAPFRE SA	126,000	2.82	355,572.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	18,460	195.80	3,614,468.00
NN GROUP NV	37,100	38.33	1,422,043.00
POSTE ITALIANE SPA	64,000	7.79	498,560.00
SAMPO OYJ-A SHS	52,700	43.62	2,298,774.00
SCOR SE	20,600	35.15	724,090.00
UNIPOLSAI SPA	107,000	2.13	228,231.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	14,400	53.58	771,552.00
AMADEUS IT GROUP SA	51,100	61.46	3,140,606.00
ATOS SE	11,200	110.35	1,235,920.00
CAPGEMINI SA	19,000	105.00	1,995,000.00
WIRECARD AG	14,000	110.15	1,542,100.00
DASSAULT SYSTEMES SA	15,000	108.35	1,625,250.00
SAP SE	116,300	86.52	10,062,276.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,700	79.10	767,270.00
NOKIA OYJ	680,000	4.86	3,306,840.00
INGENICO GROUP	6,700	70.58	472,886.00
ASML HOLDING NV	46,000	158.05	7,270,300.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	132,400	21.10	2,793,640.00
STMICROELECTRONICS NV	75,300	17.58	1,324,150.50
DEUTSCHE TELEKOM-REG	390,000	14.04	5,477,550.00
ELISA OYJ	17,200	35.52	610,944.00
ILIAD SA	3,150	174.55	549,832.50
KONINKLIJKE KPN NV	400,000	2.41	967,600.00
ORANGE SA	234,000	14.76	3,453,840.00
PROXIMUS	18,400	25.75	473,800.00
TELECOM ITALIA SPA	1,360,000	0.87	1,191,632.00
TELECOM ITALIA-RNC	680,000	0.75	514,488.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	97,000	3.83	372,189.00
TELEFONICA SA	555,000	8.24	4,578,195.00
1&1 DRILLISCH AG	5,900	58.30	343,970.00
ELECTRICITE DE FRANCE	67,000	11.46	768,155.00
ENDESA S.A.	35,600	18.81	669,636.00

	ENEL SPA	966,000	5.17	4,994,220.00	
	ENERGIAS DE PORTUGAL	291,000	3.20	932,655.00	
	FORTUM OYJ	50,000	18.13	906,500.00	
	IBERDROLA SA	681,000	6.27	4,273,956.00	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	48,200	16.43	791,926.00	
	TERNA SPA	163,000	4.87	794,625.00	
	GAS NATURAL SDG	41,200	20.67	851,604.00	
	E.ON SE	260,000	8.93	2,323,880.00	
	ENGIE	213,000	14.13	3,010,755.00	
	INNOGY SE	17,100	37.76	645,696.00	
	RWE AG	62,800	21.36	1,341,408.00	
	SUEZ	45,000	11.85	533,475.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	56,900	19.30	1,098,454.50	
	AMUNDI SA	6,700	67.28	450,776.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	241,000	11.57	2,789,334.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	23,100	111.55	2,576,805.00	
	NATIXIS	111,000	6.59	731,712.00	
	UNIPER SE	22,400	23.85	534,240.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,430	435.40	622,622.00	
	QIAGEN NV	24,500	26.64	652,680.00	
	BUREAU VERITAS SA	30,100	21.46	645,946.00	
	RANDSTAD NV	13,500	55.50	749,250.00	
	RELX NV	116,000	17.62	2,044,500.00	
	TELEPERFORMANCE	7,100	131.20	931,520.00	
	WOLTERS KLUWER	35,100	44.47	1,560,897.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	41,300	38.08	1,572,704.00	
	VONOVIA SE	58,000	40.33	2,339,140.00	
小計	銘柄数：240			473,881,415.66	
				(62,703,988,920)	
	組入時価比率：13.2%			13.8%	
英債券	WOOD GROUP (JOHN) PLC	73,000	5.51	402,522.00	
	BP PLC	2,338,000	5.18	12,115,516.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	537,000	24.97	13,408,890.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	442,800	25.48	11,282,544.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	15,500	45.87	710,985.00	

JOHNSON MATTHEY PLC	21,800	32.65	711,770.00
ANGLO AMERICAN PLC	155,400	17.67	2,746,228.80
ANTOFAGASTA PLC	48,000	9.52	457,344.00
BHP BILLITON PLC	251,000	15.34	3,851,344.00
FRESNILLO PLC	26,000	12.98	337,480.00
GLENCORE PLC	1,451,000	3.80	5,523,231.50
RANDGOLD RESOURCES LTD	10,900	57.42	625,878.00
RIO TINTO PLC-REG	143,700	39.87	5,729,319.00
MONDI PLC	44,800	20.14	902,272.00
BAE SYSTEMS PLC	372,000	6.01	2,235,720.00
COBHAM PLC	254,000	1.16	294,640.00
MEGGITT PLC	95,000	4.62	438,995.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	199,000	8.66	1,723,738.00
DCC PLC	11,000	68.25	750,750.00
SMITHS GROUP PLC	47,000	16.18	760,695.00
IMI PLC	32,000	10.68	341,760.00
WEIR GROUP PLC	26,600	22.01	585,466.00
ASHTED GROUP PLC	59,000	20.71	1,221,890.00
BUNZLE	40,500	21.30	862,650.00
FERGUSON PLC	29,100	56.30	1,638,330.00
TRAVIS PERKINS PLC	30,200	13.15	397,130.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	25,900	7.44	192,851.40
G4S PLC	179,000	2.58	462,715.00
ROYAL MAIL PLC	108,000	5.60	604,800.00
EASYJET PLC	16,300	16.03	261,289.00
GKN PLC	209,000	4.67	977,911.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	113,000	5.59	632,348.00
PERSIMMON PLC	35,500	27.17	964,535.00
TAYLOR WIMPEY PLC	366,000	1.94	710,040.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	14,800	39.66	586,968.00
BURBERRY GROUP PLC	50,400	17.35	874,440.00
CARNIVAL PLC	22,000	46.73	1,028,060.00
COMPASS GROUP PLC	184,300	15.03	2,770,029.00
GVC HOLDINGS PLC	63,000	9.61	605,745.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	21,300	43.70	930,810.00

PLC				
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	89,000	3.46	308,118.00	
TUI AG-DI	53,900	16.24	875,336.00	
WHITBREAD PLC	20,600	42.35	872,410.00	
ITV PLC	400,000	1.44	579,800.00	
PEARSON	91,000	7.84	713,440.00	
SKY PLC	121,000	13.12	1,587,520.00	
WPP PLC	151,000	11.46	1,731,215.00	
MARKS & SPENCER PLC	181,000	2.80	507,886.00	
NEXT PLC	17,900	52.20	934,380.00	
KINGFISHER PLC	246,000	3.09	760,140.00	
MORRISON SUPERMARKETS	246,000	2.34	576,378.00	
SAINSBURY	199,000	2.63	525,161.00	
TESCO PLC	1,161,000	2.39	2,779,434.00	
COCA-COLA HBC AG-CDI	22,300	24.96	556,608.00	
DIAGEO PLC	295,400	24.65	7,281,610.00	
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,200	26.31	1,110,282.00	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	271,100	37.00	10,030,700.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	111,100	24.02	2,669,177.50	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	78,200	56.25	4,398,750.00	
UNILEVER PLC	146,000	38.72	5,653,850.00	
CONVATEC GROUP PLC-WI	157,000	2.17	340,690.00	
SMITH & NEPHEW PLC	102,000	13.52	1,379,040.00	
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	37,500	6.90	258,975.00	
SHIRE PLC	107,900	38.21	4,123,398.50	
ASTRAZENECA PLC	149,800	49.76	7,454,048.00	
GLAXOSMITHKLINE PLC	582,000	14.30	8,322,600.00	
BARCLAYS PLC	2,024,000	2.15	4,361,720.00	
HSBC HOLDINGS PLC	2,362,000	7.01	16,562,344.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,530,000	0.65	5,604,210.00	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	425,000	2.74	1,165,350.00	
STANDARD CHARTERED PLC	383,000	7.64	2,927,652.00	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	311,000	3.67	1,141,681.00	
ADMIRAL GROUP PLC	22,900	19.97	457,313.00	
AVIVA PLC	479,000	5.22	2,500,380.00	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	157,000	3.72	585,139.00	

	LEGAL & GENERAL	704,000	2.75	1,937,408.00	
	OLD MUTUAL PLC	574,000	2.42	1,392,524.00	
	PRUDENTIAL PLC	306,500	18.75	5,746,875.00	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	124,000	6.53	809,720.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	119,000	3.43	408,170.00	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	51,600	12.98	670,026.00	
	SAGE GROUP PLC (THE)	129,000	6.30	813,732.00	
	BT GROUP PLC	993,000	2.41	2,401,074.00	
	VODAFONE GROUP PLC	3,160,000	2.10	6,636,000.00	
	SSE PLC	122,000	13.27	1,619,550.00	
	CENTRICA PLC	650,000	1.46	950,300.00	
	NATIONAL GRID PLC	397,000	8.12	3,227,213.00	
	SEVERN TRENT PLC	27,700	18.81	521,175.50	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	76,000	7.17	545,072.00	
	3I GROUP PLC	114,000	9.17	1,046,292.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	30,300	17.36	526,008.00	
	INVESTEC PLC	75,000	5.83	437,700.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	36,300	42.50	1,542,750.00	
	SCHRODERS PLC	13,300	32.83	436,639.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	62,000	11.09	687,890.00	
	CAPITA PLC	76,000	1.59	121,448.00	
	EXPERIAN PLC	106,700	16.06	1,714,135.50	
	INTERTEK GROUP PLC	19,700	49.26	970,422.00	
	RELX PLC	127,000	15.44	1,960,880.00	
小計	銘柄数：99			220,419,369.70	
				(33,298,754,180)	
	組入時価比率：7.0%			7.3%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	25,900	24.68	639,212.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	980	610.50	598,290.00	
	GIVAUDAN-REG	1,091	2,204.00	2,404,564.00	
	SIKA AG-BR	249	7,340.00	1,827,660.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	53,700	55.34	2,971,758.00	
	GEBERIT AG-REG	4,360	429.60	1,873,056.00	
	ABB LTD	215,900	23.68	5,112,512.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,450	198.90	487,305.00	

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,990	206.20	1,028,938.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	6,500	153.00	994,500.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	62,000	92.88	5,758,560.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,540	467.10	1,653,534.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,000	86.80	520,800.00	
	DUFREY AG-REG	4,400	134.60	592,240.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	230	1,797.00	413,310.00	
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	125	6,260.00	782,500.00	
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	12	74,500.00	894,000.00	
	NESTLE SA-REG	367,400	75.20	27,628,480.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	5,800	160.45	930,610.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,280	626.00	801,280.00	
	NOVARTIS-REG	262,700	76.08	19,986,216.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	83,000	215.65	17,898,950.00	
	VIFOR PHARMA AG	5,700	147.40	840,180.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	4,300	91.75	394,525.00	
	BALOISE HOLDING AG	5,800	154.50	896,100.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	3,860	356.70	1,376,862.00	
	SWISS RE LTD	37,500	97.56	3,658,500.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	17,720	313.70	5,558,764.00	
	SWISSCOM AG-REG	2,990	462.90	1,384,071.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	289,000	16.19	4,678,910.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	25,900	58.50	1,515,150.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,060	717.00	1,477,020.00	
	UBS GROUP AG	434,000	17.20	7,464,800.00	
	LONZA AG-REG	8,540	245.00	2,092,300.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	19,300	69.20	1,335,560.00	
	SGS SA-REG	647	2,416.00	1,563,152.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	8,100	92.20	746,820.00	
小計	銘柄数：37			130,780,989.00	
				(14,455,222,714)	
	組入時価比率：3.1%			3.2%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	21,700	237.80	5,160,260.00	
	BOLIDEN AB	32,700	307.20	10,045,440.00	
	ASSA ABLOY AB-B	118,400	179.00	21,193,600.00	

	SKANSKA AB-B SHS	38,200	161.00	6,150,200.00	
	ALFA LAVAL AB	35,000	209.00	7,315,000.00	
	ATLAS COPCO AB-A	78,300	361.70	28,321,110.00	
	ATLAS COPCO AB-B	45,000	327.00	14,715,000.00	
	SANDVIK AB	131,000	160.90	21,077,900.00	
	SKF AB-B SHARES	42,700	182.85	7,807,695.00	
	VOLVO AB-B SHS	182,000	161.00	29,302,000.00	
	SECURITAS AB-B SHS	39,000	139.90	5,456,100.00	
	ELECTROLUX AB-B	29,700	256.70	7,623,990.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	45,000	81.54	3,669,300.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	115,000	132.46	15,232,900.00	
	ICA GRUPPEN AB	10,500	298.00	3,129,000.00	
	SWEDISH MATCH AB	21,500	373.70	8,034,550.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	73,000	217.30	15,862,900.00	
	GETINGE AB-B SHS	26,800	95.58	2,561,544.00	
	NORDEA BANK AB	362,000	88.64	32,087,680.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	175,000	85.64	14,987,000.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	181,000	99.80	18,063,800.00	
	SWEDBANK AB	106,900	185.75	19,856,675.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	20,600	187.75	3,867,650.00	
	INVESTOR AB-B SHS	53,900	382.50	20,616,750.00	
	KINNEVIK AB - B	26,600	311.00	8,272,600.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	4,600	590.50	2,716,300.00	
	ERICSSON LM-B	369,000	65.28	24,088,320.00	
	HEXAGON AB-B SHS	30,200	512.60	15,480,520.00	
	TELIA CO AB	330,000	41.29	13,625,700.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	8,200	563.00	4,616,600.00	
	TELE 2 AB-B SHS	42,000	105.05	4,412,100.00	
小計	銘柄数：31			395,350,184.00	
				(5,044,668,347)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	136,300	198.70	27,082,810.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	20,600	327.70	6,750,620.00	
	NORSK HYDRO	161,000	53.24	8,571,640.00	

	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	205.00	2,644,500.00	
	MARINE HARVEST ASA	46,700	169.65	7,922,655.00	
	ORKLA ASA	91,000	81.74	7,438,340.00	
	DNB ASA	117,000	149.30	17,468,100.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,000	134.20	3,355,000.00	
	TELENOR ASA	90,300	174.95	15,797,985.00	
小計	銘柄数：9			97,031,650.00	
				(1,334,185,187)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	11,400	566.20	6,454,680.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	27,100	308.80	8,368,480.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	25,200	411.00	10,357,200.00	
	ISS A/S	18,600	214.80	3,995,280.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	440	8,955.00	3,940,200.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	800	9,544.00	7,635,200.00	
	DSV A/S	22,100	488.50	10,795,850.00	
	PANDORA A/S	12,400	691.40	8,573,360.00	
	CARLSBERG B	12,600	684.20	8,620,920.00	
	COLOPLAST-B	14,200	521.00	7,398,200.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	13,000	235.80	3,065,400.00	
	GENMAB A/S	6,900	1,267.00	8,742,300.00	
	H LUNDBECK A/S	8,200	343.50	2,816,700.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	220,600	284.20	62,694,520.00	
	DANSKE BANK AS	88,100	223.80	19,716,780.00	
	TRYG A/S	16,000	140.70	2,251,200.00	
	TDC A/S	97,000	50.08	4,857,760.00	
	ORSTED A/S	21,800	386.80	8,432,240.00	
小計	銘柄数：18			188,716,270.00	
				(3,353,488,117)	
	組入時価比率：0.7%			0.7%	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	29,100	31.80	925,380.00	
	OIL SEARCH LTD	162,000	7.84	1,270,080.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	205,000	9.38	1,922,900.00	
	SANTOS LTD.	212,000	6.00	1,272,000.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	110,700	31.42	3,478,194.00	

INCITEC PIVOT LTD	196,000	3.71	727,160.00
ORICA LTD	42,000	19.05	800,100.00
BORAL LTD	133,000	7.58	1,008,140.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	52,000	23.80	1,237,600.00
AMCOR	134,000	13.96	1,870,640.00
ALUMINA LTD	290,000	2.83	820,700.00
BHP BILLITON LIMITED	380,500	30.86	11,742,230.00
BLUESCOPE STEEL LTD	67,000	16.66	1,116,220.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	187,000	4.63	865,810.00
NEWCREST MINING	89,000	19.99	1,779,110.00
RIO TINTO LTD	48,000	80.53	3,865,440.00
SOUTH32 LTD	614,000	3.93	2,413,020.00
CIMIC GROUP LTD	11,700	44.25	517,725.00
BRAMBLES LTD	189,000	9.64	1,821,960.00
AURIZON HOLDINGS LTD	239,000	4.46	1,065,940.00
SYDNEY AIRPORT	125,000	6.56	820,000.00
TRANSURBAN GROUP	267,000	11.24	3,001,080.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	63,000	25.53	1,608,390.00
CROWN RESORTS LTD	43,000	12.90	554,700.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	5,900	39.16	231,044.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	7,300	56.28	410,844.00
TABCORP HOLDINGS	218,400	4.34	947,856.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	3.52	186,560.00
WESFARMERS LIMITED	135,000	41.50	5,602,500.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	152,200	26.69	4,062,218.00
COCA-COLA AMATIL LTD	60,000	8.90	534,000.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	89,000	17.51	1,558,390.00
COCHLEAR LTD	6,700	185.50	1,242,850.00
HEALTHSCOPE LTD	230,000	2.03	466,900.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	15,800	63.47	1,002,826.00
SONIC HEALTHCARE LTD	49,000	23.08	1,130,920.00
CSL LIMITED	53,700	159.88	8,585,556.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	348,000	26.72	9,298,560.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	42,000	10.35	434,700.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	54,000	9.91	535,140.00

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	207,400	72.06	14,945,244.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	318,500	28.37	9,035,845.00	
	WESTPAC BANKING CORP	402,000	28.59	11,493,180.00	
	AMP LIMITED	344,000	4.30	1,479,200.00	
	CHALLENGER LIMITED	66,000	10.98	724,680.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	277,000	7.53	2,085,810.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	308,000	2.82	868,560.00	
	QBE INSURANCE	166,000	9.89	1,641,740.00	
	SUNCORP GROUP LTD	149,000	13.63	2,030,870.00	
	REA GROUP LTD	6,900	78.72	543,168.00	
	COMPUTERSHARE LTD	56,000	16.90	946,400.00	
	TELSTRA CORP LTD	487,000	3.08	1,499,960.00	
	TPG TELECOM LTD	35,964	5.12	184,135.68	
	AUSNET SERVICES	230,000	1.66	382,950.00	
	APA GROUP	144,000	7.94	1,143,360.00	
	AGL ENERGY LTD	79,000	20.27	1,601,330.00	
	ASX LTD	21,900	56.19	1,230,561.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	37,800	104.80	3,961,440.00	
	SEEK LTD	40,000	19.07	762,800.00	
	小計 銘柄数：59			139,296,616.68	
				(11,515,651,300)	
	組入時価比率：2.4%			2.5%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	92,000	6.15	565,800.00	
	FLETCHER BUILDING LTD RTS	20,627	1.35	27,846.45	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	108,000	6.19	668,520.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	64,000	12.04	770,560.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	45,000	10.45	470,250.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	229,000	3.35	767,150.00	
	MERCURY NZ LTD	88,000	3.13	275,440.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	159,000	2.81	447,585.00	
	小計 銘柄数：8			3,993,151.45	
				(310,267,867)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	322,040	93.00	29,949,720.00	

NWS HOLDINGS LTD	159,500	14.40	2,296,800.00
MTR CORP	181,000	43.40	7,855,400.00
MINTH GROUP LTD	82,000	36.35	2,980,700.00
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	156,000	44.35	6,918,600.00
LI & FUNG LTD	749,600	3.91	2,930,936.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	97,000	22.35	2,167,950.00
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	284,000	69.45	19,723,800.00
MGM CHINA HOLDINGS LTD	124,000	22.10	2,740,400.00
SANDS CHINA LTD	286,400	44.00	12,601,600.00
SHANGRI-LA ASIA LTD	160,333	14.82	2,376,135.06
SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	7.27	1,962,900.00
WYNN MACAU LTD	184,000	29.70	5,464,800.00
WH GROUP LIMITED	1,020,000	8.27	8,435,400.00
BANK OF EAST ASIA	140,060	33.40	4,678,004.00
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	445,000	38.95	17,332,750.00
HANG SENG BANK	92,000	194.30	17,875,600.00
FIRST PACIFIC CO	226,000	4.10	926,600.00
AIA GROUP LTD	1,428,000	68.10	97,246,800.00
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	38,000	108.60	4,126,800.00
HKT TRUST AND HKT LTD	449,600	10.32	4,639,872.00
PCCW LTD	550,000	4.80	2,640,000.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	75,000	62.00	4,650,000.00
CLP HLDGS	198,000	81.05	16,047,900.00
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	163,000	58.95	9,608,850.00
HONG KONG & CHINA GAS	960,289	16.16	15,518,270.24
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	138,000	260.20	35,907,600.00
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	450,000	3.86	1,737,000.00
CK ASSET HOLDINGS LTD	298,040	67.65	20,162,406.00
HANG LUNG GROUP LTD	103,000	24.50	2,523,500.00
HANG LUNG PROPERTIES LTD	251,000	18.22	4,573,220.00
HENDERSON LAND	132,599	50.25	6,663,099.75
HYSAN DEVELOPMENT	65,000	43.25	2,811,250.00
KERRY PROPERTIES	79,000	35.95	2,840,050.00
NEW WORLD DEVELOPMENT	679,666	11.32	7,693,819.12
SINO LAND CO.LTD	360,000	13.18	4,744,800.00

	SUN HUNG KAI PROPERTIES	173,000	123.10	21,296,300.00	
	SWIRE PACIFIC-A	53,500	77.30	4,135,550.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	146,000	27.45	4,007,700.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	147,000	54.10	7,952,700.00	
	WHARF(HOLDING)	134,000	25.45	3,410,300.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	98,000	56.30	5,517,400.00	
小計	銘柄数：42			439,673,282.17	
				(6,045,507,629)	
	組入時価比率：1.3%			1.3%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	198,000	3.65	722,700.00	
ド	KEPPEL CORP.	178,000	8.21	1,461,380.00	
ル	SEMBCORP INDUSTRIES	99,040	3.24	320,889.60	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	270,000	1.21	326,700.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	63,040	10.77	678,940.80	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	250,000	2.19	547,500.00	
	SATS LTD	77,000	5.39	415,030.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	720,000	1.19	856,800.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	187,000	2.69	503,030.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	10,000	35.24	352,400.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	940,020	0.35	329,007.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	175,000	3.21	561,750.00	
	DBS GROUP HLDGS	214,000	29.59	6,332,260.00	
	OCBC-ORD	367,000	13.73	5,038,910.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	160,000	29.69	4,750,400.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	965,000	3.41	3,290,650.00	
	STARHUB LTD	69,000	2.30	158,700.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	93,000	7.56	703,080.00	
	CAPITALAND LIMITED	285,000	3.73	1,063,050.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	51,000	12.66	645,660.00	
	UOL GROUP LIMITED	65,000	8.82	573,300.00	
小計	銘柄数：21			29,632,137.40	
				(2,427,761,017)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
新シケル	FRUTAROM	4,800	362.50	1,740,000.00	

	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	91,000	15.85	1,442,350.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,800	448.30	1,255,240.00	
	BANK HAPOALIM BM	125,000	24.83	3,103,750.00	
	BANK LEUMI LE- ISRAEL	178,000	21.78	3,876,840.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,000	67.35	1,144,950.00	
	NICE LTD	6,800	346.60	2,356,880.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	280,000	4.39	1,231,720.00	
	AZRIELI GROUP	4,100	169.10	693,310.00	
	小計 銘柄数：9			16,845,040.00	
				(514,447,521)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				455,171,167,825	
				(455,171,167,825)	

(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(2018年4月23日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	509,000	167,970.00	
		小計	509,000	167,970.00	
				(18,113,884)	
				0.2%	
	合計			18,113,884	
				(18,113,884)	
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	42,800	798,648.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	11,000	1,334,300.00	
		AMERICAN TOWER CORP	50,800	6,940,296.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	132,000	1,353,000.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,300	2,622,181.00	
		BOSTON PROPERTIES	17,700	2,101,875.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	37,000	521,330.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,500	890,085.00	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	59,000	335,120.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	48,300	4,956,546.00	

	DIGITAL REALTY TRUST INC	24,300	2,486,376.00	
	DUKE REALTY CORP	43,600	1,134,472.00	
	EQUINIX INC	9,120	3,703,267.20	
	EQUITY RESIDENTIAL	43,400	2,608,774.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	7,590	1,816,970.10	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	15,300	1,317,177.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,900	989,680.00	
	GGP INC	68,200	1,339,448.00	
	HCP INC	57,100	1,249,348.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	88,000	1,708,960.00	
	INVITATION HOMES INC	34,000	767,380.00	
	IRON MOUNTAIN INC	31,300	1,043,542.00	
	KIMCO REALTY CORP	51,000	679,830.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	16,900	663,325.00	
	MACERICH CO /THE	14,200	816,500.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,700	1,227,657.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	17,100	641,421.00	
	PROLOGIS INC	63,400	4,120,366.00	
	PUBLIC STORAGE	18,300	3,527,325.00	
	REALTY INCOME CORP	32,100	1,589,913.00	
	REGENCY CENTERS CORP	17,000	954,040.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	13,800	2,286,522.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	36,900	5,433,525.00	
	SL GREEN REALTY CORP	11,000	1,056,000.00	
	UDR INC	30,800	1,082,620.00	
	VENTAS INC	42,800	2,012,028.00	
	VEREIT INC	109,000	723,760.00	
	VORNADO REALTY TRUST	20,500	1,341,110.00	
	WELLTOWER INC	43,500	2,226,330.00	
	WEYERHAEUSER CO	88,200	3,198,132.00	
小計	銘柄数：40	1,496,410	75,599,179.30	
			(8,152,615,495)	
	組入時価比率：1.7%		75.4%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	278,936.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,900	393,770.00	

	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6,900	198,375.00	
小計	銘柄数：3	37,400	871,081.00	
			(73,580,212)	
	組入時価比率：0.0%		0.7%	
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS	4,000	355,000.00	
	GECINA SA	5,600	783,440.00	
	ICADE	3,700	293,225.00	
	KLEPIERRE	24,900	860,295.00	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	11,680	2,254,240.00	
小計	銘柄数：5	49,880	4,546,200.00	
			(601,553,184)	
	組入時価比率：0.1%		5.6%	
英ポンド	BRITISH LAND	114,000	759,240.00	
	HAMMERSON PLC	89,000	480,600.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	89,000	864,902.00	
	SEGRO PLC	118,000	741,276.00	
小計	銘柄数：4	410,000	2,846,018.00	
			(429,947,939)	
	組入時価比率：0.1%		4.0%	
豪ドル	DEXUS	126,000	1,156,680.00	
	GOODMAN GROUP	214,000	1,863,940.00	
	GPT GROUP	203,000	937,860.00	
	LENDLEASE GROUP	69,000	1,230,960.00	
	MIRVAC GROUP	430,000	928,800.00	
	SCENTRE GROUP	642,000	2,490,960.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	274,000	1,071,340.00	
	VICINITY CENTRES	373,000	884,010.00	
	WESTFIELD CORP	234,000	2,049,840.00	
小計	銘柄数：9	2,565,000	12,614,390.00	
			(1,042,831,621)	
	組入時価比率：0.2%		9.7%	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	260,000	1,895,400.00	
	LINK REIT	264,000	18,044,400.00	
小計	銘柄数：2	524,000	19,939,800.00	
			(274,172,250)	
	組入時価比率：0.1%		2.5%	

シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	282,000	764,220.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	299,972	545,949.04	
	CAPITALAND MALL TRUST	310,000	651,000.00	
	SUNTEC REIT	300,000	579,000.00	
小計	銘柄数：4	1,191,972	2,540,169.04	
	組入時価比率：0.0%		(208,116,049)	1.9%
合計			10,782,816,750	(10,782,816,750)
合計			10,800,930,634	(10,800,930,634)

(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	2018年 4月23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				
株値指数先物取引				
買建	7,140,901,831	-	7,295,639,298	154,737,467
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	26,550,200	-	26,464,000	86,200
ユーロ	26,550,200	-	26,464,000	86,200
合計	-	-	-	154,823,667

(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。

外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）	
(2018年 4月23日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	47,829,481
コール・ローン	271,966,975
株式	40,926,534,259
投資信託受益証券	2,562,278
投資証券	975,647,166
派生商品評価勘定	20,047,097
未収入金	191,203
未収配当金	53,462,497
差入委託証拠金	332,477,512
流動資産合計	42,630,718,468
資産合計	42,630,718,468
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	578,915,465
未払解約金	250,337,648
未払利息	492
その他未払費用	934,400
流動負債合計	830,188,005
負債合計	830,188,005
純資産の部	
元本等	
元本	23,223,525,846
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	18,577,004,617
元本等合計	41,800,530,463
純資産合計	41,800,530,463
負債純資産合計	42,630,718,468

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
--------------------	----

	<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>投資信託受益証券</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>市場価格のない有価証券については基準価額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	<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</p> <p>(株式、投資証券)</p> <p>受取配当金は、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)</p> <p>受取配当金は、投資信託受益証券の収益分配金を、原則として収益分配金落の売買が行なわれる日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>配当株式</p> <p>配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価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)

2018年 4月23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	1.7999円
(10,000口当たり純資産額)	(17,999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 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに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> <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

2018年 4月23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 （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>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>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。</p> <p>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。</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>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2018年 4月23日現在	
期首	2017年 4月25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	24,859,812,495円
同期中における追加設定元本額	11,406,081,666円
同期中における一部解約元本額	13,042,368,315円
期末元本額	23,223,525,846円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型	1,684,007,754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	618,967,022円
野村外国株インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	343,295,593円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,515,437円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,974,008円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,561,593円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,030,543円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,777,557円
野村外国株インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	1,913,525,313円
野村外国株（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）	1,206,880,323円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数（為替ヘッジあり）連動型上場投信	83,669,040円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	55,979,119円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	12,282,180,290円
野村外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA（適格機関投資家専用）	2,108,189,577円
ノムラ外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA（適格機関投資家専用）	1,317,288,996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）	1,595,683,681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(2018年4月23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	3,700	33.99	125,763.00	
		HALLIBURTON CO	9,000	51.96	467,640.00	
		HELMERICH & PAYNE	1,000	72.33	72,330.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	4,200	38.25	160,650.00	
		SCHLUMBERGER LTD	14,600	69.23	1,010,758.00	
		TECHNIPFMC PLC	5,200	32.88	170,976.00	

ANADARKO PETE	6,000	66.49	398,940.00
ANDEAVOR	1,760	117.81	207,345.60
ANTERO RESOURCES CORP	2,900	19.76	57,304.00
APACHE CORPORATION	4,500	41.45	186,525.00
CABOT OIL & GAS CORP	4,600	23.08	106,168.00
CHENIERE ENERGY INC	2,500	57.75	144,375.00
CHEVRON CORP	20,210	122.31	2,471,885.10
CIMAREX ENERGY CO	960	100.61	96,585.60
CONCHO RESOURCES INC	1,520	156.36	237,667.20
CONOCOPHILLIPS	12,700	65.79	835,533.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,180	63.83	75,319.40
DEVON ENERGY CORP	4,800	35.40	169,920.00
DIAMONDBACK ENERGY INC	890	128.40	114,276.00
EOG RESOURCES INC	6,300	113.97	718,011.00
EQT CORP	2,500	47.36	118,400.00
EXXON MOBIL CORP	44,700	79.00	3,531,300.00
HESS CORP	2,900	57.81	167,649.00
HOLLYFRONTIER CORP	1,600	58.26	93,216.00
KINDER MORGAN INC	21,900	16.47	360,693.00
MARATHON OIL CORP	8,300	18.02	149,566.00
MARATHON PETROLEUM CORP	4,900	79.76	390,824.00
NEWFIELD EXPLORATION CO	1,900	27.91	53,029.00
NOBLE ENERGY INC	5,000	33.77	168,850.00
OCCIDENTAL PETE CORP	7,900	76.47	604,113.00
ONEOK INC	3,780	59.54	225,061.20
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	1,800	30.39	54,702.00
PHILLIPS 66	4,750	110.99	527,202.50
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,860	194.95	362,607.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	2,000	25.02	50,040.00
RANGE RESOURCES CORP	1,840	13.69	25,189.60
TARGA RESOURCES CORP	1,900	47.59	90,421.00
VALERO ENERGY CORP	4,550	108.55	493,902.50
WILLIAMS COS	9,200	25.51	234,692.00
AIR PRODUCTS	2,450	166.27	407,361.50
ALBEMARLE CORP	1,080	97.75	105,570.00

AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,900	30.96	89,784.00
CELANESE CORP-SERIES A	1,480	111.70	165,316.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,400	38.72	92,928.00
CHEMOURS CO/THE	1,700	51.92	88,264.00
DOWDUPONT INC	24,970	66.04	1,649,018.80
EASTMAN CHEMICAL CO.	1,490	107.34	159,936.60
ECOLAB INC	2,630	148.55	390,686.50
FMC CORP	1,200	82.31	98,772.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	950	141.60	134,520.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,480	107.68	374,726.40
MONSANTO CO	4,750	125.00	593,750.00
MOSAIC CO/THE	3,660	25.68	93,988.80
PPG INDUSTRIES	2,850	108.87	310,279.50
PRAXAIR INC	3,140	150.68	473,135.20
SHERWIN-WILLIAMS	850	392.39	333,531.50
WR GRACE & CO	800	66.98	53,584.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	620	196.72	121,966.40
VULCAN MATERIALS CO	1,520	113.75	172,900.00
AVERY DENNISON CORP	810	107.12	86,767.20
BALL CORP	3,220	40.67	130,957.40
CROWN HOLDINGS INC	1,800	51.29	92,322.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	4,400	53.41	235,004.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	1,050	116.13	121,936.50
SEALED AIR CORP	1,500	44.02	66,030.00
WESTROCK CO	2,900	66.27	192,183.00
FREEMONT-MCMORAN INC	14,500	19.36	280,720.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	5,300	41.35	219,155.00
NUCOR CORP	3,300	63.55	209,715.00
STEEL DYNAMICS	2,100	46.68	98,028.00
ARCONIC INC	4,400	23.26	102,344.00
BOEING CO	6,030	338.67	2,042,180.10
GENERAL DYNAMICS	2,700	223.11	602,397.00
HARRIS CORP	1,300	168.00	218,400.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	540	263.56	142,322.40
L3 TECHNOLOGIES INC	860	215.09	184,977.40

LOCKHEED MARTIN	2,750	351.99	967,972.50
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,800	355.92	640,656.00
RAYTHEON COMPANY	3,110	227.35	707,058.50
ROCKWELL COLLINS INC	1,820	133.04	242,132.80
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	1,120	80.51	90,171.20
TEXTRON INC	2,800	65.59	183,652.00
TRANSDIGM GROUP INC	490	327.70	160,573.00
UNITED TECHNOLOGIES	7,960	123.08	979,716.80
ALLEGION PLC	810	84.75	68,647.50
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	1,740	57.10	99,354.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	9,500	34.27	325,565.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	320	197.08	63,065.60
MASCO CORP	3,300	39.24	129,492.00
OWENS CORNING INC	1,050	77.21	81,070.50
SMITH (A.O.) CORP	1,400	65.27	91,378.00
FLUOR CORP	1,400	58.58	82,012.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,270	60.00	76,200.00
ACUITY BRANDS INC	440	127.93	56,289.20
AMETEK INC	2,630	75.81	199,380.30
EATON CORP PLC	4,610	79.06	364,466.60
EMERSON ELEC	6,900	70.20	484,380.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,300	172.83	224,679.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,600	54.11	86,576.00
3M CORP	6,230	217.75	1,356,582.50
GENERAL ELEC CO	90,500	14.54	1,315,870.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	7,540	150.57	1,135,297.80
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,500	61.96	154,900.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,100	38.28	80,388.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,050	282.14	296,247.00
AGCO CORP	770	66.30	51,051.00
CATERPILLAR INC DEL	6,250	153.25	957,812.50
CUMMINS INC	1,760	168.77	297,035.20
DEERE & COMPANY	2,800	146.96	411,488.00
DOVER CORP	1,700	96.02	163,234.00

FLOWSERVE CORP	1,480	47.31	70,018.80
FORTIVE CORP	3,470	76.74	266,287.80
IDEX CORP	950	144.64	137,408.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	3,290	158.29	520,774.10
INGERSOLL-RAND PLC	2,830	83.56	236,474.80
MIDDLEBY CORP	660	127.70	84,282.00
PACCAR	3,890	69.18	269,110.20
PARKER HANNIFIN CORP	1,370	176.39	241,654.30
PENTAIR PLC	2,100	70.45	147,945.00
SNAP-ON INC	550	146.84	80,762.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,570	144.21	226,409.70
WABCO HOLDINGS INC	620	133.92	83,030.40
WABTEC CORP	860	87.54	75,284.40
XYLEM INC	2,150	79.27	170,430.50
AERCAP HOLDINGS NV	1,800	52.70	94,860.00
FASTENAL CO	2,900	50.49	146,421.00
GRAINGER(W.W.) INC	580	288.40	167,272.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,700	39.35	66,895.00
UNITED RENTALS INC	800	163.22	130,576.00
CINTAS CORP	900	173.12	155,808.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	2,400	65.55	157,320.00
ROLLINS INC	1,000	52.16	52,160.00
STERICYCLE INC	870	60.36	52,513.20
WASTE CONNECTIONS INC	3,100	73.72	228,532.00
WASTE MANAGEMENT INC	4,870	82.48	401,677.60
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	1,580	93.68	148,014.40
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	1,600	64.20	102,720.00
FEDEX CORPORATION	2,700	247.12	667,224.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	7,350	108.55	797,842.50
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	1,100	46.78	51,458.00
DELTA AIR LINES INC	1,700	55.40	94,180.00
SOUTHWEST AIRLINES	1,500	54.77	82,155.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	860	71.75	61,705.00
AMERCO	80	339.90	27,192.00
CSX CORP	8,700	60.04	522,348.00

HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	880	119.59	105,239.20
KANSAS CITY SOUTHERN	1,260	112.00	141,120.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	1,300	43.47	56,511.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	2,900	136.75	396,575.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	580	148.51	86,135.80
UNION PAC CORP	8,250	135.66	1,119,195.00
MACQUARIE INFRASTRUCTURE CORPORATION	890	38.71	34,451.90
APTIV PLC	2,950	86.31	254,614.50
AUTOLIV INC	980	150.23	147,225.40
BORGWARNER INC	2,600	52.76	137,176.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	2,800	27.01	75,628.00
LEAR CORP	810	191.40	155,034.00
FORD MOTOR COMPANY	40,900	10.82	442,538.00
GENERAL MOTORS CO	13,400	37.61	503,974.00
HARLEY-DAVIDSON INC	1,800	41.04	73,872.00
TESLA INC	1,370	290.24	397,628.80
DR HORTON INC	4,200	43.01	180,642.00
GARMIN LTD	1,600	58.94	94,304.00
LEGGETT & PLATT INC	1,400	42.90	60,060.00
LENNAR CORP-A	3,000	54.62	163,860.00
MOHAWK INDUSTRIES	660	235.57	155,476.20
NEWELL BRANDS INC	5,900	26.44	155,996.00
NVR INC	44	3,058.36	134,567.84
PULTEGROUP INC	2,800	28.54	79,912.00
TOLL BROTHERS INC	1,400	41.37	57,918.00
WHIRLPOOL CORP	700	149.37	104,559.00
HASBRO INC	1,110	82.81	91,919.10
MATTEL INC	3,400	12.96	44,064.00
POLARIS INDUSTRIES INC	640	119.64	76,569.60
HANESBRANDS INC	3,400	17.21	58,514.00
LULULEMON ATHLETICA INC	1,000	96.31	96,310.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	1,900	65.01	123,519.00
NIKE INC-B	14,000	66.09	925,260.00
PVH CORP	930	159.48	148,316.40

RALPH LAUREN CORPORATION	640	106.27	68,012.80
TAPESTRY INC	3,300	53.03	174,999.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,100	16.10	33,810.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	2,114	13.99	29,574.86
V F CORP	3,720	77.50	288,300.00
ARAMARK	3,000	37.75	113,250.00
CARNIVAL CORP	3,900	65.88	256,932.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	270	331.95	89,626.50
DARDEN RESTAURANTS INC	1,390	91.05	126,559.50
DOMINOS PIZZA INC	470	238.93	112,297.10
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,800	82.33	230,524.00
LAS VEGAS SANDS CORP	4,330	73.89	319,943.70
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	3,250	137.48	446,810.00
MCDONALD'S CORP	8,330	158.77	1,322,554.10
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,000	31.41	94,230.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	4,400	35.44	155,936.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,600	55.65	144,690.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,940	119.09	231,034.60
STARBUCKS CORP	15,300	58.00	887,400.00
VAIL RESORTS INC	340	231.36	78,662.40
WYNDHAM WORLDWIDE CORP	920	114.74	105,560.80
WYNN RESORTS LTD	1,150	192.51	221,386.50
YUM BRANDS INC	3,580	86.29	308,918.20
CBS CORP-CL B	3,700	49.33	182,521.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,980	310.94	615,661.20
COMCAST CORP-CL A	49,700	33.21	1,650,537.00
DISCOVERY INC - A	2,030	23.16	47,014.80
DISCOVERY INC - C	2,751	21.46	59,036.46
DISH NETWORK CORP-A	2,400	37.23	89,352.00
DISNEY (WALT) CO	15,820	100.24	1,585,796.80
INTERPUBRIC GROUP	3,600	23.99	86,364.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	1,340	82.87	111,045.80
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	5,300	30.45	161,385.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,300	31.78	73,094.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	1,900	30.52	57,988.00

LIBERTY SIRIUS GROUP-C	2,030	41.46	84,163.80
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	1,160	41.66	48,325.60
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,400	39.25	54,950.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	4,300	16.17	69,531.00
OMNICOM GROUP	2,620	73.74	193,198.80
SIRIUS XM HOLDINGS INC	17,000	6.31	107,270.00
TIME WARNER INC	8,220	96.24	791,092.80
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	11,500	36.68	421,820.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	4,700	36.18	170,046.00
VIACOM INC-CLASS B	3,600	30.66	110,376.00
GENUINE PARTS CO	1,560	87.75	136,890.00
LKQ CORP	2,800	38.25	107,100.00
AMAZON.COM INC	4,329	1,527.49	6,612,504.21
BOOKING HOLDINGS INC	518	2,131.37	1,104,049.66
EXPEDIA GROUP INC	1,170	109.77	128,430.90
NETFLIX INC	4,530	327.77	1,484,798.10
QURATE RETAIL GROUP INC QVC GROUP	5,100	25.23	128,673.00
TRIPADVISOR INC	1,300	41.62	54,106.00
DOLLAR GENERAL CORP	2,830	96.34	272,642.20
DOLLAR TREE INC	2,440	97.56	238,046.40
KOHL'S CORP	2,100	58.38	122,598.00
MACYS INC	3,700	29.96	110,852.00
NORDSTROM INC	1,600	46.78	74,848.00
TARGET CORP	5,400	70.32	379,728.00
ADVANCE AUTO PARTS	760	103.76	78,857.60
AUTONATION INC	650	45.57	29,620.50
AUTOZONE	260	595.84	154,918.40
BEST BUY COMPANY INC	2,700	72.30	195,210.00
CARMAX INC	1,700	61.16	103,972.00
GAP INC	2,400	28.44	68,256.00
HOME DEPOT	12,430	177.01	2,200,234.30
L BRANDS, INC	2,600	34.37	89,362.00
LOWES COS INC	8,760	83.62	732,511.20
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	880	221.48	194,902.40

ROSS STORES INC	3,880	77.32	300,001.60
TIFFANY & CO	1,370	98.84	135,410.80
TJX COS INC	6,760	82.48	557,564.80
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,000	60.33	60,330.00
ULTA BEAUTY INC	620	235.05	145,731.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	4,660	193.56	901,989.60
CVS HEALTH CORP	10,980	65.12	715,017.60
KROGER CO	9,500	24.12	229,140.00
SYSCO CORP	5,600	61.15	342,440.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,800	63.92	562,496.00
WALMART INC	15,610	86.98	1,357,757.80
BROWN-FORMAN CORP-CL B	3,000	54.49	163,470.00
COCA COLA CO	43,100	43.74	1,885,194.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,100	40.55	85,155.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,890	227.58	430,126.20
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	1,830	120.32	220,185.60
MOLSON COORS BREWING CO-B	1,960	70.38	137,944.80
MONSTER BEVERAGE CORP	3,900	56.50	220,350.00
PEPSICO INC	14,900	102.48	1,526,952.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	6,300	45.50	286,650.00
BUNGE LIMITED	1,700	73.73	125,341.00
CAMPBELL SOUP CO	2,000	40.36	80,720.00
CONAGRA BRANDS INC	4,600	36.43	167,578.00
GENERAL MILLS	6,000	43.41	260,460.00
HERSHEY CO/THE	1,510	92.48	139,644.80
HORMEL FOODS CORP	3,600	35.45	127,620.00
INGREDION INC	690	126.21	87,084.90
JM SMUCKER CO/THE-NEW	1,230	114.92	141,351.60
KELLOGG CO	2,530	60.27	152,483.10
KRAFT HEINZ CO/THE	6,560	58.22	381,923.20
MCCORMICK & CO INC.	1,100	103.24	113,564.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	16,000	40.11	641,760.00
TYSON FOODS INC-CL A	2,990	69.20	206,908.00
ALTRIA GROUP INC	19,900	57.23	1,138,877.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	16,570	84.27	1,396,353.90

CHURCH & DWIGHT CO INC	2,600	45.84	119,184.00
CLOROX CO	1,290	114.88	148,195.20
COLGATE PALMOLIVE CO.	8,980	67.52	606,329.60
KIMBERLY-CLARK CORP	3,790	100.03	379,113.70
PROCTER & GAMBLE CO	27,010	73.80	1,993,338.00
SPECTRUM BRANDS HOLDINGS INC	310	97.66	30,274.60
COTY INC-CL A	4,300	16.76	72,068.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,530	148.73	376,286.90
ABBOTT LABORATORIES	18,100	59.19	1,071,339.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	810	247.07	200,126.70
BAXTER INTERNATIONAL INC.	5,300	67.05	355,365.00
BECTON,DICKINSON	2,810	232.88	654,392.80
BOSTON SCIENTIFIC CORP	13,900	28.84	400,876.00
DANAHER CORP	6,800	101.34	689,112.00
DENTSPLY SIRONA INC	2,420	49.34	119,402.80
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,180	137.09	298,856.20
HOLOGIC INC	2,900	38.30	111,070.00
IDEXX LABORATORIES INC	900	196.75	177,075.00
INTUITIVE SURGICAL INC	1,200	456.27	547,524.00
MEDTRONIC PLC	14,110	79.90	1,127,389.00
RESMED INC	1,680	98.80	165,984.00
STRYKER CORP	3,640	164.25	597,870.00
TELEFLEX INC	510	271.03	138,225.30
THE COOPER COMPANIES, INC.	440	225.12	99,052.80
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,060	126.50	134,090.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,050	110.32	226,156.00
AETNA INC	3,510	176.92	620,989.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,650	89.87	148,285.50
ANTHEM INC	2,730	226.07	617,171.10
CARDINAL HEALTH INC	3,500	62.07	217,245.00
CENTENE CORP	2,010	110.63	222,366.30
CIGNA CORP	2,580	169.94	438,445.20
DAVITA INC	1,400	63.75	89,250.00
ENVISION HEALTHCARE CORP	1,300	37.41	48,633.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-	6,200	73.49	455,638.00

COMMON			
HCA HEALTHCARE INC	2,870	97.45	279,681.50
HENRY SCHEIN INC	1,480	69.07	102,223.60
HUMANA INC	1,460	294.12	429,415.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,050	165.17	173,428.50
MCKESSON CORP	2,090	146.25	305,662.50
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,360	98.16	133,497.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	10,310	235.06	2,423,468.60
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	870	120.52	104,852.40
ABBVIE INC	17,010	92.60	1,575,126.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,520	107.78	271,605.60
ALKERMES PLC	1,640	46.02	75,472.80
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	840	97.48	81,883.20
AMGEN INC	7,140	171.56	1,224,938.40
BIOGEN INC	2,240	263.02	589,164.80
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,680	82.30	138,264.00
CELGENE CORP	8,310	88.95	739,174.50
GILEAD SCIENCES INC	13,690	73.70	1,008,953.00
INCYTE CORP	1,820	68.43	124,542.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	890	314.25	279,682.50
SEATTLE GENETICS INC	1,100	49.68	54,648.00
TESARO INC	300	51.58	15,474.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	490	114.06	55,889.40
VERTEX PHARMACEUTICALS	2,720	158.15	430,168.00
ALLERGAN PLC	3,410	158.51	540,519.10
BRISTOL MYERS SQUIBB	17,000	51.17	869,890.00
ELI LILLY & CO.	10,450	79.06	826,177.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	550	157.95	86,872.50
JOHNSON & JOHNSON	28,330	126.66	3,588,277.80
MERCK & CO INC	28,600	58.83	1,682,538.00
MYLAN NV	4,800	40.72	195,456.00
PERRIGO CO PLC	1,130	81.54	92,140.20
PFIZER INC	63,400	36.63	2,322,342.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	9,800	17.82	174,636.00
ZOETIS INC	5,250	85.45	448,612.50
	104,400	30.26	3,159,144.00

BANK OF AMERICA CORP			
BB&T CORPORATION	8,100	52.71	426,951.00
CIT GROUP INC	1,000	52.97	52,970.00
CITIGROUP	28,160	70.00	1,971,200.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,300	41.98	222,494.00
COMERICA INC	1,800	95.49	171,882.00
EAST WEST BANCORP INC	1,900	65.54	124,526.00
FIFTH THIRD BANCORP	6,900	31.42	216,798.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,900	92.99	176,681.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	11,900	14.75	175,525.00
JPMORGAN CHASE & CO	36,610	111.47	4,080,916.70
KEYCORP	12,500	19.86	248,250.00
M & T BANK CORP	1,440	181.53	261,403.20
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	2,700	18.22	49,194.00
PNC FINANCIAL	5,020	144.12	723,482.40
REGIONS FINANCIAL CORP	12,300	18.89	232,347.00
SIGNATURE BANK	520	129.30	67,236.00
SUNTRUST BKS INC.	5,200	66.84	347,568.00
SVB FINANCIAL GROUP	630	250.83	158,022.90
US BANCORP	17,700	50.43	892,611.00
WELLS FARGO CO	49,700	52.56	2,612,232.00
ZIONS BANCORPORATION	2,300	53.80	123,740.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	13,490	200.13	2,699,753.70
LEUCADIA NATIONAL CORP	3,000	24.02	72,060.00
VOYA FINANCIAL INC	2,100	52.51	110,271.00
AFLAC INC	8,200	45.28	371,296.00
ALLEGHANY CORP	170	587.44	99,864.80
ALLSTATE CORP	3,710	98.31	364,730.10
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	630	114.03	71,838.90
AMERICAN INTL GROUP	9,200	55.43	509,956.00
AON PLC	2,640	144.04	380,265.60
ARCH CAPITAL GROUP LTD	1,330	81.05	107,796.50
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,700	69.97	118,949.00
ASSURANT INC	750	93.41	70,057.50
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,000	49.34	98,680.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,000	56.48	56,480.00

BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	890	51.53	45,861.70
CHUBB LTD	5,040	137.68	693,907.20
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,550	75.27	116,668.50
EVEREST RE GROUP LTD	440	246.99	108,675.60
FNF GROUP	2,400	38.05	91,320.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	4,100	52.03	213,323.00
LINCOLN NATIONAL CORP	2,200	71.58	157,476.00
LOEWS CORP	2,800	51.57	144,396.00
MARKEL CORP	144	1,153.08	166,043.52
MARSH & MCLENNAN COS	5,270	82.90	436,883.00
METLIFE INC	9,800	47.49	465,402.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,080	60.89	187,541.20
PROGRESSIVE CO	6,300	61.05	384,615.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,650	107.03	497,689.50
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	750	155.45	116,587.50
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	490	138.04	67,639.60
TORCHMARK CORP	1,230	87.18	107,231.40
TRAVELERS COS INC/THE	2,850	136.84	389,994.00
UNUM GROUP	2,700	48.88	131,976.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,310	151.41	198,347.10
WR BERKLEY CORP	990	74.74	73,992.60
XL GROUP LTD	2,400	55.55	133,320.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	1,800	71.30	128,340.00
ALPHABET INC-CL A	3,144	1,077.32	3,387,094.08
ALPHABET INC-CL C	3,316	1,072.96	3,557,935.36
EBAY INC	10,400	42.20	438,880.00
FACEBOOK INC-A	25,170	166.28	4,185,267.60
IAC/INTERACTIVE CORP	700	161.80	113,260.00
MERCADOLIBRE INC	450	324.49	146,020.50
TWITTER INC	6,700	31.91	213,797.00
VERISIGN INC	820	124.79	102,327.80
ZILLOW GROUP INC - C	1,120	47.18	52,841.60
ACCENTURE PLC-CL A	6,540	152.41	996,761.40
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	510	209.32	106,753.20
AUTOMATIC DATA PROCESS	4,540	116.84	530,453.60

BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	1,420	109.85	155,987.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	6,310	81.77	515,968.70
DXC TECHNOLOGY CO	3,240	103.51	335,372.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	3,380	96.01	324,513.80
FIRST DATA CORP- CLASS A	6,100	15.12	92,232.00
FISERV INC	4,700	71.34	335,298.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	950	208.95	198,502.50
GARTNER INC	920	117.72	108,302.40
GLOBAL PAYMENTS INC	1,850	111.28	205,868.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	9,200	144.90	1,333,080.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	670	121.43	81,358.10
LEIDOS HOLDINGS INC	1,800	66.13	119,034.00
MASTERCARD INC	10,020	177.08	1,774,341.60
PAYCHEX INC	3,400	60.34	205,156.00
PAYPAL HOLDINGS INC	12,160	78.73	957,356.80
SABRE CORP	1,900	20.28	38,532.00
SQUARE INC - A	3,200	51.46	164,672.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	1,600	87.28	139,648.00
VISA INC-CLASS A SHARES	19,290	124.20	2,395,818.00
WESTERN UNION CO	5,500	19.08	104,940.00
WORLDPAY INC - CL A	3,160	81.20	256,592.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	7,700	66.30	510,510.00
ADOBE SYSTEMS INC.	5,170	225.24	1,164,490.80
ANSYS INC	950	163.78	155,591.00
AUTODESK INC.	2,260	130.09	294,003.40
CA INC	2,800	34.58	96,824.00
CADENCE DESIGN SYS INC	2,800	37.02	103,656.00
CDK GLOBAL INC	1,430	65.21	93,250.30
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	1,570	102.23	160,501.10
CITRIX SYSTEMS INC	1,760	96.57	169,963.20
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	1,900	72.67	138,073.00
ELECTRONIC ARTS	3,190	120.89	385,639.10
FORTINET INC	1,500	57.15	85,725.00
INTUIT INC	2,650	178.13	472,044.50

MICROSOFT CORP	77,490	95.00	7,361,550.00
ORACLE CORPORATION	33,400	46.23	1,544,082.00
RED HAT INC	1,950	159.28	310,596.00
SALESFORCE.COM INC	7,320	122.82	899,042.40
SERVICENOW INC	1,900	168.90	320,910.00
SPLUNK INC	1,300	104.49	135,837.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,200	50.37	110,814.00
SYMANTEC CORP	6,700	27.71	185,657.00
SYNOPSYS INC	1,780	83.01	147,757.80
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	1,380	98.38	135,764.40
VMWARE INC - CLASS A	920	136.05	125,166.00
WORKDAY INC-CLASS A	1,560	130.53	203,626.80
ARISTA NETWORKS INC	560	260.65	145,964.00
CISCO SYSTEMS	52,600	44.09	2,319,134.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	1,600	40.86	65,376.00
F5 NETWORKS INC	760	156.96	119,289.60
JUNIPER NETWORKS INC	4,100	24.35	99,835.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,550	110.57	171,383.50
PALO ALTO NETWORKS INC	910	192.07	174,783.70
APPLE INC	54,320	165.72	9,001,910.40
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	16,500	17.29	285,285.00
HP INC	18,500	21.53	398,305.00
NETAPP INC	2,900	68.66	199,114.00
SEAGATE TECHNOLOGY	3,200	59.64	190,848.00
WESTERN DIGITAL CORP	3,040	89.56	272,262.40
XEROX CORP	2,500	31.54	78,850.00
AMPHENOL CORP-CL A	3,130	85.21	266,707.30
ARROW ELECTRS INC	750	77.85	58,387.50
AVNET	800	41.39	33,112.00
CDW CORPORATION	1,500	71.53	107,295.00
COGNEX CORP	1,640	50.90	83,476.00
CORNING INC	8,600	27.55	236,930.00
FLEX LTD	4,700	17.22	80,934.00
FLIR SYSTEMS INC	1,200	52.58	63,096.00
IPG PHOTONICS CORP	360	232.13	83,566.80

TE CONNECTIVITY LTD	3,810	100.26	381,990.60
TRIMBLE INC	2,500	36.57	91,425.00
ADVANCED MICRO DEVICES	7,600	9.99	75,924.00
ANALOG DEVICES INC	4,010	89.76	359,937.60
APPLIED MATERIALS	11,600	51.09	592,644.00
BROADCOM INC	4,280	237.12	1,014,873.60
INTEL CORP	49,800	51.53	2,566,194.00
KLA TENCOR CORP	1,610	101.48	163,382.80
LAM RESEARCH	1,680	191.91	322,408.80
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	4,700	20.54	96,538.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,800	54.40	152,320.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	2,660	85.68	227,908.80
MICRON TECHNOLOGY	12,300	50.62	622,626.00
NVIDIA CORP	6,340	228.71	1,450,021.40
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,300	105.15	346,995.00
QORVO INC	1,200	69.88	83,856.00
QUALCOMM INC	15,500	51.44	797,320.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,950	91.18	177,801.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	10,330	99.96	1,032,586.80
XILINX INC	2,640	64.15	169,356.00
AT & T INC	65,300	34.67	2,263,951.00
CENTURYLINK INC	9,185	17.61	161,747.85
VERIZON COMMUNICATIONS	43,300	47.90	2,074,070.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	1,800	37.25	67,050.00
SPRINT CORP	7,300	6.00	43,800.00
T-MOBILE US INC	2,800	63.09	176,652.00
ALLIANT ENERGY CORP	2,100	41.54	87,234.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,420	68.46	371,053.20
DUKE ENERGY CORP	7,460	77.68	579,492.80
EDISON INTERNATIONAL	3,760	64.12	241,091.20
ENTERGY CORP	1,800	78.98	142,164.00
EVERSOURCE ENERGY	3,300	59.22	195,426.00
EXELON CORPORATION	9,900	38.60	382,140.00
FIRSTENERGY CORP	4,300	34.44	148,092.00
NEXTERA ENERGY INC	4,970	160.79	799,126.30

OGE ENERGY CORP	2,700	32.47	87,669.00
PG&E CORP	5,900	45.73	269,807.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	1,150	78.02	89,723.00
PPL CORPORATION	7,300	27.89	203,597.00
SOUTHERN CO.	10,900	45.22	492,898.00
WESTAR ENERGY INC	1,300	51.86	67,418.00
XCEL ENERGY INC	5,700	45.10	257,070.00
ATMOS ENERGY CORP	1,100	83.90	92,290.00
UGI CORP	1,600	46.33	74,128.00
AMEREN CORPORATION	2,300	56.27	129,421.00
CENTERPOINT ENERGY INC	3,900	26.68	104,052.00
CMS ENERGY CORP	2,700	45.19	122,013.00
CONSOLIDATED EDISON INC	3,180	77.60	246,768.00
DOMINION ENERGY INC	6,890	65.33	450,123.70
DTE ENERGY COMPANY	1,800	102.73	184,914.00
NISOURCE INC	2,800	23.75	66,500.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	5,700	49.51	282,207.00
SCANA CORP	1,200	35.92	43,104.00
SEMPRA ENERGY	2,630	109.81	288,800.30
WEC ENERGY GROUP INC	3,700	62.15	229,955.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,660	83.67	138,892.20
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	6,100	12.64	77,104.00
ALLY FINANCIAL INC	5,400	27.66	149,364.00
AMERICAN EXPRESS CO	7,790	100.79	785,154.10
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,260	97.98	515,374.80
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,670	73.32	269,084.40
SYNCHRONY FINANCIAL	8,900	35.20	313,280.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	600	171.38	102,828.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,680	143.69	241,399.20
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	10,900	55.42	604,078.00
BLACKROCK INC	1,270	524.42	666,013.40
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,240	110.16	136,598.40
CME GROUP INC	3,670	165.08	605,843.60
E*TRADE FINANCIAL CORP	3,100	60.48	187,488.00
EATON VANCE CORP	1,600	55.22	88,352.00

FRANKLIN RESOURCES INC	3,400	34.04	115,736.00
GOLDMAN SACHS GROUP	3,760	251.96	947,369.60
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6,500	74.37	483,405.00
INVESCO LTD	4,400	31.06	136,664.00
MOODYS CORP	1,800	164.02	295,236.00
MORGAN STANLEY	14,300	54.46	778,778.00
MSCI INC	1,070	149.59	160,061.30
NASDAQ INC	1,430	87.42	125,010.60
NORTHERN TRUST CORP	2,220	107.65	238,983.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,300	87.80	114,140.00
S&P GLOBAL INC	2,790	192.96	538,358.40
SCHWAB(CHARLES)CORP	12,800	54.99	703,872.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,400	70.29	98,406.00
STATE STREET CORP	3,780	99.66	376,714.80
T ROWE PRICE GROUP INC	2,700	108.44	292,788.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	2,700	61.23	165,321.00
H & R BLOCK INC	1,800	27.10	48,780.00
AES CORP	6,100	11.62	70,882.00
VISTRA ENERGY CORP	4,600	21.88	100,648.00
CERNER CORP	3,190	58.23	185,753.70
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,500	72.85	109,275.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,590	67.55	242,504.50
ILLUMINA INC	1,590	244.60	388,914.00
IQVIA HOLDINGS INC	1,430	97.27	139,096.10
METTLER-TOLEDO INTL	300	576.76	173,028.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,220	215.89	911,055.80
WATERS CORP	810	208.21	168,650.10
COSTAR GROUP INC	370	376.93	139,464.10
EQUIFAX INC	1,220	118.88	145,033.60
IHS MARKIT LTD	4,500	49.27	221,715.00
MANPOWERGROUP INC	590	101.47	59,867.30
NIelsen HOLDINGS PLC	3,700	33.04	122,248.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	1,430	58.56	83,740.80
TRUNSONIC	2,300	66.84	153,732.00
VERISK ANALYTICS INC	1,720	107.38	184,693.60

	CBRE GROUP INC	3,000	47.43	142,290.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	10,200	7.03	71,706.00	
	JONES LANG LASALLE INC	470	175.47	82,470.90	
小計	銘柄数：600			247,612,574.04	
				(26,702,539,984)	
	組入時価比率：63.9%			65.3%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	1,500	25.45	38,175.00	
	ARC RESOURCES LTD	3,800	14.01	53,238.00	
	CAMECO CORP	5,000	13.48	67,400.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	11,400	44.98	512,772.00	
	CENOVUS ENERGY INC	9,400	12.28	115,432.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	6,700	10.79	72,293.00	
	ENBRIDGE INC	17,600	39.77	699,952.00	
	ENCANA CORP	9,700	16.23	157,431.00	
	HUSKY ENERGY INC	3,779	19.06	72,027.74	
	IMPERIAL OIL	2,900	37.49	108,721.00	
	INTER PIPELINE LTD	3,800	23.89	90,782.00	
	KEYERA CORP	2,020	35.30	71,306.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	5,200	41.17	214,084.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1,800	30.88	55,584.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	3,100	17.54	54,374.00	
	SUNCOR ENERGY INC	17,000	48.80	829,600.00	
	TOURMALINE OIL CORP	2,800	22.90	64,120.00	
	TRANSCANADA CORP	9,800	55.31	542,038.00	
	VERMILION ENERGY INC	1,410	45.90	64,719.00	
	METHANEX CORP	970	85.07	82,517.90	
	NUTRIEN LTD	6,600	59.63	393,558.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,450	62.67	90,871.50	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	2,100	56.28	118,188.00	
	BARRICK GOLD	12,400	16.76	207,824.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7,800	18.84	146,952.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	1,800	90.77	163,386.00	
	GOLDCORP INC	7,900	18.24	144,096.00	
	KINROSS GOLD CORP	10,000	4.93	49,300.00	
	LUNDIN MINING CORP	8,000	8.49	67,920.00	

TECK RESOURCES LTD-CLS B	6,100	33.99	207,339.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	8,740	4.04	35,309.60	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	4,000	27.13	108,520.00	
WEST FRASER TIMBER	780	92.35	72,033.00	
BOMBARDIER B SHEARS	19,500	4.00	78,000.00	
CAE INC	1,900	24.74	47,006.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	1,900	55.70	105,830.00	
FINNING INTERNATIONAL INC	2,000	31.75	63,500.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	8,140	96.21	783,149.40	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,600	223.48	357,568.00	
LINAMAR CORP	500	73.20	36,600.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	4,000	75.21	300,840.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,700	37.15	100,305.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	2,700	69.70	188,190.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	3,800	26.62	101,156.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	660	169.71	112,008.60	
DOLLARAMA INC	1,040	148.36	154,294.40	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	4,500	52.84	237,780.00	
EMPIRE CO LTD A	1,300	23.96	31,148.00	
JEAN COUTU GROUP INC-CLASS A	900	24.60	22,140.00	
LOBLAW COMPANIES	2,400	65.45	157,080.00	
METRO INC	2,300	42.13	96,899.00	
WESTON(GEORGE)LTD	390	104.73	40,844.70	
SAPUTO INC	1,800	41.04	73,872.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	3,900	21.94	85,566.00	
BANK OF MONTREAL	6,930	95.57	662,300.10	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	12,700	76.86	976,122.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	4,700	110.35	518,645.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	3,600	59.23	213,228.00	
ROYAL BANK OF CANADA	15,200	97.28	1,478,656.00	
TORONTO DOMINION BANK	19,400	70.19	1,361,686.00	
ELEMENT FLEET MANAGEMENT CORP	4,000	5.02	20,080.00	
ONEX CORPORATION	900	92.55	83,295.00	

	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	330	671.00	221,430.00	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	3,800	33.38	126,844.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	800	52.86	42,288.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,460	96.85	141,401.00	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	20,500	23.99	491,795.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	3,500	29.37	102,795.00	
	POWER FINANCIAL CORP	3,300	32.55	107,415.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	6,800	51.82	352,376.00	
	SHOIFY INC - CLASS A	1,040	161.86	168,334.40	
	CGI GROUP INC - CLASS A	3,000	73.70	221,100.00	
	BLACKBERRY LTD	4,500	13.54	60,930.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	240	882.42	211,780.80	
	OPEN TEXT CORP	3,100	45.02	139,562.00	
	BCE INC	1,200	53.45	64,140.00	
	TELUS CORP	2,600	45.09	117,234.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	4,200	61.34	257,628.00	
	EMERA INC	600	40.27	24,162.00	
	FORTIS INC	5,000	42.50	212,500.00	
	HYDRO ONE LTD	3,100	20.70	64,170.00	
	ATCO LTD CL1	900	41.42	37,278.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	1,090	34.87	38,008.30	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	9,400	49.21	462,574.00	
	CI FINANCIAL CORP	3,700	26.78	99,086.00	
	IGM FINANCIAL INC	600	37.43	22,458.00	
	THOMSON REUTERS CORP	2,700	50.58	136,566.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	1,100	20.13	22,143.00	
小計	銘柄数：88			18,205,651.44	
				(1,537,831,377)	
	組入時価比率：3.7%			3.8%	
ユ-口	TENARIS SA	5,400	15.29	82,566.00	
	ENAGAS	1,900	23.02	43,738.00	
	ENI SPA	27,300	15.95	435,489.60	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	5,800	15.95	92,510.00	
	NESTE OYJ	1,500	54.70	82,050.00	
	OMV AG	1,800	50.96	91,728.00	

REPSOL SA	14,300	15.72	224,867.50
SNAM SPA	23,000	3.85	88,642.00
TOTAL SA	25,100	50.64	1,271,064.00
VOPAK	700	40.15	28,105.00
AIR LIQUIDE	4,390	104.70	459,633.00
AKZO NOBEL	2,620	78.54	205,774.80
ARKEMA	850	111.25	94,562.50
BASF SE	9,640	86.69	835,691.60
COVESTRO AG	1,730	81.10	140,303.00
EVONIK INDUSTRIES AG	1,800	29.99	53,982.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	740	43.96	32,530.40
K+S AG	2,400	23.42	56,208.00
KONINKLIJKE DSM NV	1,890	86.44	163,371.60
LANXESS	970	62.94	61,051.80
LINDE AG - TENDER	2,040	175.00	357,000.00
SOLVAY SA	920	115.60	106,352.00
SYMRISE AG	1,540	67.08	103,303.20
UMICORE	2,400	43.70	104,880.00
CRH PLC	8,700	28.92	251,604.00
HEIDELBERGCEMENT AG	1,470	81.40	119,658.00
IMERYS	450	80.75	36,337.50
ARCELORMITTAL	6,400	28.43	181,984.00
THYSSENKRUPP AG	4,800	22.71	109,008.00
VOESTALPINE AG	1,400	45.23	63,322.00
STORA ENSO OYJ-R	4,900	16.72	81,928.00
UPM-KYMMENE OYJ	6,200	30.09	186,558.00
AIRBUS SE	6,140	94.17	578,203.80
DASSAULT AVIATION SA	26	1,683.00	43,758.00
LEONARDO SPA	4,200	9.92	41,689.20
MTU AERO ENGINES AG	520	137.80	71,656.00
SAFRAN SA	3,700	90.08	333,296.00
THALES SA	1,000	103.40	103,400.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	5,500	44.00	242,027.50
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,365	34.29	81,095.85
BOSKALIS WESTMINSTER-CVA	1,300	24.24	31,512.00
BOUYGUES	2,130	42.82	91,206.60

EIFFAGE SA	930	97.10	90,303.00
FERROVIAL SA	4,702	17.75	83,460.50
HOCHTIEF AG	160	151.00	24,160.00
VINCI	5,610	84.50	474,045.00
LEGRAND SA	2,860	65.20	186,472.00
OSRAM LICHT AG	821	58.00	47,618.00
PRYSMIAN SPA	2,800	24.80	69,440.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,140	75.36	462,710.40
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	1,800	13.63	24,534.00
SIEMENS AG	7,960	108.30	862,068.00
ALSTOM	2,100	38.03	79,863.00
ANDRITZ AG	700	46.20	32,340.00
CNH INDUSTRIAL NV	10,100	10.17	102,717.00
GEA GROUP AG	1,700	33.83	57,511.00
KION GROUP AG	970	77.98	75,640.60
KONE OYJ	3,800	40.75	154,850.00
MAN SE	430	96.40	41,452.00
METSO OYJ	800	27.11	21,688.00
WARTSILA OYJ	4,800	18.91	90,768.00
BRENNTAG AG	1,900	48.22	91,618.00
REXEL SA	4,100	14.07	57,707.50
EDENRED	1,830	28.35	51,880.50
SOCIETE BIC SA	300	80.85	24,255.00
BOLLORE	7,500	4.41	33,105.00
DEUTSCHE POST AG-REG	10,600	37.71	399,726.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	3,000	26.19	78,570.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	4,800	6.99	33,552.00
ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA	6,720	18.28	122,875.20
ADP	290	182.70	52,983.00
AENA SME SA	650	168.30	109,395.00
ATLANTIA SPA	5,300	27.11	143,683.00
FRAPORT AG	380	81.04	30,795.20
GETLINK	6,300	11.62	73,206.00
CONTINENTAL AG	1,120	220.20	246,624.00

FAURECIA	750	68.70	51,525.00
MICHELIN (CGDE)	1,930	117.25	226,292.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,100	33.32	36,652.00
SCHAEFFLER AG	1,300	13.22	17,186.00
VALEO SA	2,400	55.16	132,384.00
BAYER MOTOREN WERK	3,640	91.02	331,312.80
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	760	79.75	60,610.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	10,140	65.12	660,316.80
FERRARI NV	1,200	99.80	119,760.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	11,500	19.27	221,651.00
PEUGEOT CITROEN	6,900	20.78	143,382.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	1,600	71.82	114,912.00
RENAULT SA	2,020	94.12	190,122.40
VOLKSWAGEN AG	370	169.70	62,789.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,010	171.10	343,911.00
SEB SA	260	154.70	40,222.00
ADIDAS AG	1,940	212.20	411,668.00
HERMES INTERNATIONAL	340	517.60	175,984.00
HUGO BOSS AG	720	76.88	55,353.60
KERING SA	820	431.00	353,420.00
LUXOTTICA GROUP SPA	1,600	52.54	84,064.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	2,970	279.25	829,372.50
ACCOR SA	2,100	45.51	95,571.00
PADDY POWER PLC	890	83.15	74,003.50
SODEXO	1,110	82.14	91,175.40
ALTICE NV - A	5,400	8.29	44,787.60
AXEL SPRINGER SE	360	67.40	24,264.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,200	17.99	39,589.00
JC DECAUX SA	750	29.62	22,215.00
LAGARDERE S.C.A	960	23.35	22,416.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	2,700	29.63	80,001.00
PUBLICIS GROUPE	1,900	59.40	112,860.00
RTL GROUP	310	71.35	22,118.50
SES FDR	3,900	13.50	52,650.00
TELENET GROUP HOLDING NV	690	53.00	36,570.00

VIVENDI SA	11,400	21.09	240,426.00
ZALANDO SE	900	43.44	39,096.00
INDITEX SA	12,200	24.49	298,778.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	5,600	16.46	92,204.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	700	42.44	29,708.00
COLRUYT SA	400	45.71	18,284.00
JERONIMO MARTINS	2,000	14.20	28,400.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	13,500	19.46	262,737.00
METRO AG	1,700	13.02	22,142.50
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	8,030	85.49	686,484.70
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	5,500	6.14	33,797.50
HEINEKEN HOLDING NV	1,410	85.10	119,991.00
HEINEKEN NV	2,680	88.56	237,340.80
PERNOD RICARD SA	2,150	139.00	298,850.00
REMY COINTREAU	140	113.50	15,890.00
DANONE	6,450	66.38	428,151.00
KERRY GROUP PLC-A	1,870	87.55	163,718.50
HENKEL AG & CO KGAA	1,030	96.50	99,395.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,840	104.00	191,360.00
BEIERSDORF AG	940	92.38	86,837.20
LOREAL-ORD	2,720	191.40	520,608.00
UNILEVER NV-CVA	16,900	45.25	764,809.50
BIOMERIEUX	420	64.40	27,048.00
ESSILOR INTERNATIONAL	2,360	114.45	270,102.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	10,300	32.93	339,179.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,600	32.70	52,320.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	2,300	84.88	195,224.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,520	65.70	296,964.00
GRIFOLS SA	3,600	23.41	84,276.00
BAYER AG-REG	8,680	99.00	859,320.00
IPSEN	270	127.30	34,371.00
MERCK KGAA	1,260	82.02	103,345.20
ORION OYJ	1,000	25.83	25,830.00
RECORDATI SPA	1,100	29.84	32,824.00
SANOFI	11,950	65.28	780,096.00

UCB SA	1,300	65.28	84,864.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	4,400	25.39	111,716.00
AIB GROUP PLC	8,000	5.15	41,200.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	71,900	6.57	472,958.20
BANCO DE SABADELL SA	50,000	1.74	87,075.00
BANCO SANTANDER SA	168,000	5.50	925,344.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	11,500	7.39	84,985.00
BANKIA SA	12,250	3.66	44,835.00
BANKINTER S.A.	8,200	8.61	70,602.00
BNP PARIBAS	11,810	63.21	746,510.10
CAIXABANK	41,000	4.00	164,205.00
COMMERZBANK AG	11,400	10.79	123,097.20
CREDIT AGRICOLE SA	11,100	13.58	150,793.50
ERSTE GROUP BANK AG	2,900	40.53	117,537.00
ING GROEP NV	41,100	14.25	585,921.60
INTESA SANPAOLO	144,000	3.13	451,440.00
INTESA SANPAOLO-RSP	6,000	3.27	19,656.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	13,429	0.00	0.00
KBC GROEP NV	2,490	72.96	181,670.40
MEDIOBANCA S.P.A.	5,600	10.17	56,952.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	1,500	28.22	42,330.00
SOCIETE GENERALE	8,400	45.59	382,998.00
UNICREDIT SPA	20,300	17.98	364,994.00
EURAZEO SE	319	74.65	23,813.35
EXOR NV	1,300	61.24	79,612.00
GROUPE BRUXELLES LAM	940	94.96	89,262.40
WENDEL	260	123.40	32,084.00
AEGON NV	18,000	6.00	108,000.00
AGEAS	1,800	43.54	78,372.00
ALLIANZ SE-REG	4,650	193.54	899,961.00
ASSICURAZIONI GENERALI	13,000	16.71	217,295.00
AXA	20,900	23.41	489,373.50
CNP ASSURANCES	1,640	21.26	34,866.40
HANNOVER RUECK SE	530	116.80	61,904.00
MAPFRE SA	12,700	2.82	35,839.40

MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,680	195.80	328,944.00
NN GROUP NV	3,700	38.33	141,821.00
POSTE ITALIANE SPA	7,300	7.79	56,867.00
SAMPO OYJ-A SHS	4,900	43.62	213,738.00
SCOR SE	1,400	35.15	49,210.00
UNIPOLSAI SPA	8,000	2.13	17,064.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,500	53.58	80,370.00
AMADEUS IT GROUP SA	4,480	61.46	275,340.80
ATOS SE	890	110.35	98,211.50
CAPGEMINI SA	1,630	105.00	171,150.00
WIRECARD AG	1,150	110.15	126,672.50
DASSAULT SYSTEMES SA	1,410	108.35	152,773.50
SAP SE	10,240	86.52	885,964.80
UBISOFT ENTERTAINMENT	630	79.10	49,833.00
NOKIA OYJ	60,000	4.86	291,780.00
INGENICO GROUP	690	70.58	48,700.20
ASML HOLDING NV	4,100	158.05	648,005.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	12,400	21.10	261,640.00
STMICROELECTRONICS NV	6,000	17.58	105,510.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	36,000	14.04	505,620.00
ELISA OYJ	1,600	35.52	56,832.00
ILIAD SA	310	174.55	54,110.50
KONINKLIJKE KPN NV	39,000	2.41	94,341.00
ORANGE SA	21,700	14.76	320,292.00
PROXIMUS	1,550	25.75	39,912.50
TELECOM ITALIA SPA	112,000	0.87	98,134.40
TELECOM ITALIA-RNC	68,000	0.75	51,448.80
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	5,000	3.83	19,185.00
TELEFONICA SA	50,100	8.24	413,274.90
1&1 DRILLISCH AG	570	58.30	33,231.00
ELECTRICITE DE FRANCE	7,400	11.46	84,841.00
ENDESA S.A.	3,500	18.81	65,835.00
ENEL SPA	89,000	5.17	460,130.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	23,800	3.20	76,279.00
FORTUM OYJ	4,900	18.13	88,837.00

	IBERDROLA SA	62,400	6.27	391,622.40	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,200	16.43	69,006.00	
	TERNA SPA	18,000	4.87	87,750.00	
	GAS NATURAL SDG	4,500	20.67	93,015.00	
	E.ON SE	25,200	8.93	225,237.60	
	ENGIE	20,000	14.13	282,700.00	
	INNOGY SE	1,600	37.76	60,416.00	
	RWE AG	6,400	21.36	136,704.00	
	SUEZ	3,600	11.85	42,678.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	5,200	19.30	100,386.00	
	AMUNDI SA	600	67.28	40,368.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	20,900	11.57	241,896.60	
	DEUTSCHE BOERSE AG	2,040	111.55	227,562.00	
	NATIXIS	11,000	6.59	72,512.00	
	UNIPER SE	2,100	23.85	50,085.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	130	435.40	56,602.00	
	QIAGEN NV	2,176	26.64	57,968.64	
	BUREAU VERITAS SA	3,100	21.46	66,526.00	
	RANDSTAD NV	1,500	55.50	83,250.00	
	RELX NV	10,900	17.62	192,112.50	
	TELEPERFORMANCE	570	131.20	74,784.00	
	WOLTERS KLUWER	2,900	44.47	128,963.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	4,200	38.08	159,936.00	
	VONOVIA SE	4,900	40.33	197,617.00	
小計	銘柄数：240			42,623,948.04	
				(5,640,000,804)	
	組入時価比率：13.5%			13.8%	
英ポンド	WOOD GROUP (JOHN) PLC	6,500	5.51	35,841.00	
	BP PLC	207,000	5.18	1,072,674.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	47,600	24.97	1,188,572.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	39,100	25.48	996,268.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,500	45.87	68,805.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	1,700	32.65	55,505.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	14,500	17.67	256,244.00	
	ANTOFAGASTA PLC	5,400	9.52	51,451.20	

BHP BILLITON PLC	23,300	15.34	357,515.20
FRESNILLO PLC	2,700	12.98	35,046.00
GLENCORE PLC	130,000	3.80	494,845.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	1,090	57.42	62,587.80
RIO TINTO PLC-REG	13,300	39.87	530,271.00
MONDI PLC	3,900	20.14	78,546.00
BAE SYSTEMS PLC	35,200	6.01	211,552.00
COBHAM PLC	16,950	1.16	19,662.00
MEGGITT PLC	11,000	4.62	50,831.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	19,000	8.66	164,578.00
DCC PLC	820	68.25	55,965.00
SMITHS GROUP PLC	4,700	16.18	76,069.50
IMI PLC	3,600	10.68	38,448.00
WEIR GROUP PLC	2,800	22.01	61,628.00
ASHTED GROUP PLC	5,900	20.71	122,189.00
BUNZLE	3,000	21.30	63,900.00
FERGUSON PLC	2,690	56.30	151,447.00
TRAVIS PERKINS PLC	2,400	13.15	31,560.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	3,300	7.44	24,571.80
G4S PLC	16,100	2.58	41,618.50
ROYAL MAIL PLC	12,100	5.60	67,760.00
EASYJET PLC	1,900	16.03	30,457.00
GKN PLC	16,000	4.67	74,864.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	10,500	5.59	58,758.00
PERSIMMON PLC	2,800	27.17	76,076.00
TAYLOR WIMPEY PLC	34,300	1.94	66,542.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	1,400	39.66	55,524.00
BURBERRY GROUP PLC	4,800	17.35	83,280.00
CARNIVAL PLC	1,700	46.73	79,441.00
COMPASS GROUP PLC	17,600	15.03	264,528.00
GVC HOLDINGS PLC	5,800	9.61	55,767.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,723	43.70	75,295.10
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	6,200	3.46	21,464.40
TUI AG-DI	5,400	16.24	87,696.00
WHITBREAD PLC	1,700	42.35	71,995.00

ITV PLC	41,000	1.44	59,429.50
PEARSON	8,800	7.84	68,992.00
SKY PLC	10,100	13.12	132,512.00
WPP PLC	13,200	11.46	151,338.00
MARKS & SPENCER PLC	17,200	2.80	48,263.20
NEXT PLC	1,800	52.20	93,960.00
KINGFISHER PLC	25,000	3.09	77,250.00
MORRISON SUPERMARKETS	20,000	2.34	46,860.00
SAINSBURY	18,000	2.63	47,502.00
TESCO PLC	108,000	2.39	258,552.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	1,900	24.96	47,424.00
DIAGEO PLC	26,300	24.65	648,295.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,300	26.31	86,823.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	24,000	37.00	888,000.00
IMPERIAL BRANDS PLC	10,400	24.02	249,860.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	7,360	56.25	414,000.00
UNILEVER PLC	12,800	38.72	495,680.00
CONVATEC GROUP PLC-WI	9,000	2.17	19,530.00
SMITH & NEPHEW PLC	8,900	13.52	120,328.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	4,400	6.90	30,386.40
SHIRE PLC	9,800	38.21	374,507.00
ASTRAZENECA PLC	13,300	49.76	661,808.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	51,700	14.30	739,310.00
BARCLAYS PLC	184,000	2.15	396,520.00
HSBC HOLDINGS PLC	213,000	7.01	1,493,556.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	772,000	0.65	507,204.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	35,000	2.74	95,970.00
STANDARD CHARTERED PLC	35,600	7.64	272,126.40
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	26,797	3.67	98,371.78
ADMIRAL GROUP PLC	1,500	19.97	29,955.00
AVIVA PLC	44,100	5.22	230,202.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	12,000	3.72	44,724.00
LEGAL & GENERAL	62,000	2.75	170,624.00
OLD MUTUAL PLC	56,000	2.42	135,856.00
PRUDENTIAL PLC	27,800	18.75	521,250.00

	RSA INSURANCE GROUP PLC	12,100	6.53	79,013.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	7,000	3.43	24,010.00	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	3,900	12.98	50,641.50	
	SAGE GROUP PLC (THE)	13,500	6.30	85,158.00	
	BT GROUP PLC	84,000	2.41	203,112.00	
	VODAFONE GROUP PLC	285,000	2.10	598,500.00	
	SSE PLC	10,400	13.27	138,060.00	
	CENTRICA PLC	55,000	1.46	80,410.00	
	NATIONAL GRID PLC	37,500	8.12	304,837.50	
	SEVERN TRENT PLC	2,700	18.81	50,800.50	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,300	7.17	52,355.60	
	3I GROUP PLC	9,000	9.17	82,602.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	2,300	17.36	39,928.00	
	INVESTEC PLC	6,200	5.83	36,183.20	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	3,600	42.50	153,000.00	
	SCHRODERS PLC	1,100	32.83	36,113.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	6,200	11.09	68,789.00	
	CAPITA PLC	6,900	1.59	11,026.20	
	EXPERIAN PLC	10,400	16.06	167,076.00	
	INTERTEK GROUP PLC	1,500	49.26	73,890.00	
	RELX PLC	12,000	15.44	185,280.00	
	小計銘柄数：99			19,845,393.28	
				(2,998,043,562)	
	組入時価比率：7.2%			7.3%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,200	24.68	54,296.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	70	610.50	42,735.00	
	GIVAUDAN-REG	93	2,204.00	204,972.00	
	SIKA AG-BR	21	7,340.00	154,140.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	4,800	55.34	265,632.00	
	GEBERIT AG-REG	390	429.60	167,544.00	
	ABB LTD	19,800	23.68	468,864.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	140	198.90	27,846.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	390	206.20	80,418.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	630	153.00	96,390.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	5,670	92.88	526,629.60	

	THE SWATCH GROUP AG-B	340	467.10	158,814.00
	THE SWATCH GROUP AG-REG	550	86.80	47,740.00
	DUFREY AG-REG	280	134.60	37,688.00
	BARRY CALLEBAUT AG	22	1,797.00	39,534.00
	LINDT & SPRUENGLI AG-PC	14	6,260.00	87,640.00
	LINDT&SPRUENGLI AG-REG	1	74,500.00	74,500.00
	NESTLE SA-REG	33,080	75.20	2,487,616.00
	SONOVA HOLDING AG-REG	460	160.45	73,807.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	100	626.00	62,600.00
	NOVARTIS-REG	23,710	76.08	1,803,856.80
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	7,360	215.65	1,587,184.00
	VIFOR PHARMA AG	390	147.40	57,486.00
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	280	91.75	25,690.00
	BALOISE HOLDING AG	580	154.50	89,610.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	390	356.70	139,113.00
	SWISS RE LTD	3,470	97.56	338,533.20
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,640	313.70	514,468.00
	SWISSCOM AG-REG	260	462.90	120,354.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	26,000	16.19	420,940.00
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,500	58.50	146,250.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	170	717.00	121,890.00
	UBS GROUP AG	39,200	17.20	674,240.00
	LONZA AG-REG	840	245.00	205,800.00
	ADECCO GROUP AG-REG	1,910	69.20	132,172.00
	SGS SA-REG	57	2,416.00	137,712.00
	SWISS PRIME SITE-REG	740	92.20	68,228.00
小計	銘柄数：37			11,742,932.60
				(1,297,946,340)
	組入時価比率：3.1%			3.2%
スウェーデン ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	2,500	237.80	594,500.00
	BOLIDEN AB	2,600	307.20	798,720.00
	ASSA ABLOY AB-B	10,100	179.00	1,807,900.00
	SKANSKA AB-B SHS	3,100	161.00	499,100.00
	ALFA LAVAL AB	3,000	209.00	627,000.00
	ATLAS COPCO AB-A	6,900	361.70	2,495,730.00

	ATLAS COPCO AB-B	4,600	327.00	1,504,200.00	
	SANDVIK AB	11,200	160.90	1,802,080.00	
	SKF AB-B SHARES	4,600	182.85	841,110.00	
	VOLVO AB-B SHS	15,500	161.00	2,495,500.00	
	SECURITAS AB-B SHS	4,300	139.90	601,570.00	
	ELECTROLUX AB-B	2,600	256.70	667,420.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	4,600	81.54	375,084.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	9,200	132.46	1,218,632.00	
	ICA GRUPPEN AB	900	298.00	268,200.00	
	SWEDISH MATCH AB	2,300	373.70	859,510.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	6,500	217.30	1,412,450.00	
	GETINGE AB-B SHS	1,500	95.58	143,370.00	
	NORDEA BANK AB	33,700	88.64	2,987,168.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	15,200	85.64	1,301,728.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	17,100	99.80	1,706,580.00	
	SWEDBANK AB	10,100	185.75	1,876,075.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,000	187.75	375,500.00	
	INVESTOR AB-B SHS	5,100	382.50	1,950,750.00	
	KINNEVIK AB - B	2,300	311.00	715,300.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	400	590.50	236,200.00	
	ERICSSON LM-B	32,000	65.28	2,088,960.00	
	HEXAGON AB-B SHS	2,500	512.60	1,281,500.00	
	TELIA CO AB	32,000	41.29	1,321,280.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	570	563.00	320,910.00	
	TELE 2 AB-B SHS	4,200	105.05	441,210.00	
小計	銘柄数：31			35,615,237.00	
				(454,450,424)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	STATOIL ASA	11,500	198.70	2,285,050.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	1,700	327.70	557,090.00	
	NORSK HYDRO	14,200	53.24	756,008.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	900	205.00	184,500.00	
	MARINE HARVEST ASA	3,600	169.65	610,740.00	
	ORKLA ASA	10,200	81.74	833,748.00	

	DNB ASA	10,400	149.30	1,552,720.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,600	134.20	348,920.00	
	TELENOR ASA	8,700	174.95	1,522,065.00	
小計	銘柄数：9			8,650,841.00	
				(118,949,063)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,000	566.20	566,200.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,500	308.80	772,000.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,300	411.00	945,300.00	
	ISS A/S	1,900	214.80	408,120.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	51	8,955.00	456,705.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	79	9,544.00	753,976.00	
	DSV A/S	1,800	488.50	879,300.00	
	PANDORA A/S	1,290	691.40	891,906.00	
	CARLSBERG B	1,060	684.20	725,252.00	
	COLOPLAST-B	1,290	521.00	672,090.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	1,300	235.80	306,540.00	
	GENMAB A/S	540	1,267.00	684,180.00	
	H LUNDBECK A/S	700	343.50	240,450.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	19,600	284.20	5,570,320.00	
	DANSKE BANK AS	7,700	223.80	1,723,260.00	
	TRYG A/S	1,000	140.70	140,700.00	
	TDC A/S	8,200	50.08	410,656.00	
	ORSTED A/S	2,300	386.80	889,640.00	
小計	銘柄数：18			17,036,595.00	
				(302,740,293)	
	組入時価比率：0.7%			0.7%	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	3,200	31.80	101,760.00	
	OIL SEARCH LTD	14,000	7.84	109,760.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	17,000	9.38	159,460.00	
	SANTOS LTD.	24,000	6.00	144,000.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	9,444	31.42	296,730.48	
	INCITEC PIVOT LTD	17,000	3.71	63,070.00	
	ORICA LTD	2,800	19.05	53,340.00	
	BORAL LTD	14,000	7.58	106,120.00	

JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	5,200	23.80	123,760.00	
AMCOR	14,100	13.96	196,836.00	
ALUMINA LTD	26,200	2.83	74,146.00	
BHP BILLITON LIMITED	33,900	30.86	1,046,154.00	
BLUESCOPE STEEL LTD	7,300	16.66	121,618.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	15,000	4.63	69,450.00	
NEWCREST MINING	7,700	19.99	153,923.00	
RIO TINTO LTD	4,700	80.53	378,491.00	
SOUTH32 LTD	61,000	3.93	239,730.00	
CIMIC GROUP LTD	1,045	44.25	46,241.25	
BRAMBLES LTD	16,000	9.64	154,240.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	19,000	4.46	84,740.00	
SYDNEY AIRPORT	9,000	6.56	59,040.00	
TRANSURBAN GROUP	21,300	11.24	239,412.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	5,700	25.53	145,521.00	
CROWN RESORTS LTD	4,800	12.90	61,920.00	
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	500	39.16	19,580.00	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	800	56.28	45,024.00	
TABCORP HOLDINGS	18,320	4.34	79,508.80	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	5,540	3.52	19,500.80	
WESFARMERS LIMITED	11,700	41.50	485,550.00	
WOOLWORTHS GROUP LTD	13,600	26.69	362,984.00	
COCA-COLA AMATIL LTD	4,300	8.90	38,270.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	9,200	17.51	161,092.00	
COCHLEAR LTD	740	185.50	137,270.00	
HEALTHSCOPE LTD	12,000	2.03	24,360.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,900	63.47	120,593.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	4,900	23.08	113,092.00	
CSL LIMITED	4,810	159.88	769,022.80	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	31,500	26.72	841,680.00	
BANK OF QUEENSLAND LTD	4,126	10.35	42,704.10	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	3,700	9.91	36,667.00	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	18,200	72.06	1,311,492.00	
NATIONAL AUSTRALIA BANK	28,500	28.37	808,545.00	
WESTPAC BANKING CORP	35,800	28.59	1,023,522.00	

	AMP LIMITED	31,000	4.30	133,300.00	
	CHALLENGER LIMITED	6,000	10.98	65,880.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	28,000	7.53	210,840.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	30,000	2.82	84,600.00	
	QBE INSURANCE	16,400	9.89	162,196.00	
	SUNCORP GROUP LTD	13,700	13.63	186,731.00	
	REA GROUP LTD	600	78.72	47,232.00	
	COMPUTERSHARE LTD	3,700	16.90	62,530.00	
	TELSTRA CORP LTD	42,000	3.08	129,360.00	
	TPG TELECOM LTD	4,359	5.12	22,318.08	
	AUSNET SERVICES	25,264	1.66	42,064.56	
	APA GROUP	12,700	7.94	100,838.00	
	AGL ENERGY LTD	6,500	20.27	131,755.00	
	ASX LTD	2,000	56.19	112,380.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	3,420	104.80	358,416.00	
	SEEK LTD	3,800	19.07	72,466.00	
小計	銘柄数：59			12,592,826.87	
				(1,041,048,997)	
	組入時価比率：2.5%			2.5%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	6,000	6.15	36,900.00	
	FLETCHER BUILDING LTD RTS	1,345	1.35	1,815.75	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	13,000	6.19	80,470.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	5,400	12.04	65,016.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	3,000	10.45	31,350.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	18,200	3.35	60,970.00	
	MERCURY NZ LTD	8,600	3.13	26,918.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	15,300	2.81	43,069.50	
小計	銘柄数：8			346,509.25	
				(26,923,768)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	29,916	93.00	2,782,188.00	
	NWS HOLDINGS LTD	19,000	14.40	273,600.00	
	MTR CORP	13,000	43.40	564,200.00	
	MINTH GROUP LTD	10,000	36.35	363,500.00	

TECHTRONIC INDUSTRIES CO	12,000	44.35	532,200.00
LI & FUNG LTD	62,000	3.91	242,420.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	5,500	22.35	122,925.00
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	24,000	69.45	1,666,800.00
MGM CHINA HOLDINGS LTD	13,600	22.10	300,560.00
SANDS CHINA LTD	27,200	44.00	1,196,800.00
SHANGRI-LA ASIA LTD	7,000	14.82	103,740.00
SJM HOLDINGS LIMITED	24,000	7.27	174,480.00
WYNN MACAU LTD	18,000	29.70	534,600.00
WH GROUP LIMITED	106,000	8.27	876,620.00
BANK OF EAST ASIA	11,540	33.40	385,436.00
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	39,000	38.95	1,519,050.00
HANG SENG BANK	8,900	194.30	1,729,270.00
FIRST PACIFIC CO	32,000	4.10	131,200.00
AIA GROUP LTD	125,800	68.10	8,566,980.00
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	3,200	108.60	347,520.00
HKT TRUST AND HKT LTD	38,120	10.32	393,398.40
PCCW LTD	41,000	4.80	196,800.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	5,000	62.00	310,000.00
CLP HLDGS	17,000	81.05	1,377,850.00
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	14,500	58.95	854,775.00
HONG KONG & CHINA GAS	92,276	16.16	1,491,180.16
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	12,700	260.20	3,304,540.00
KINGSTON FINANCIAL GROUP LTD	50,000	3.86	193,000.00
CK ASSET HOLDINGS LTD	28,916	67.65	1,956,167.40
HANG LUNG GROUP LTD	10,000	24.50	245,000.00
HANG LUNG PROPERTIES LTD	22,000	18.22	400,840.00
HENDERSON LAND	14,749	50.25	741,137.25
HYSAN DEVELOPMENT	7,000	43.25	302,750.00
KERRY PROPERTIES	6,500	35.95	233,675.00
NEW WORLD DEVELOPMENT	73,333	11.32	830,129.56
SINO LAND CO.LTD	31,000	13.18	408,580.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	16,000	123.10	1,969,600.00
SWIRE PACIFIC-A	3,500	77.30	270,550.00
SWIRE PROPERTIES LTD	10,800	27.45	296,460.00

	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	10,200	54.10	551,820.00	
	WHARF(HOLDING)	10,200	25.45	259,590.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	8,000	56.30	450,400.00	
小計	銘柄数：42			39,452,331.77	
				(542,469,561)	
	組入時価比率：1.3%			1.3%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	18,000	3.65	65,700.00	
	KEPPEL CORP.	16,000	8.21	131,360.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	12,000	3.24	38,880.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	27,000	1.21	32,670.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	3,600	10.77	38,772.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	16,000	2.19	35,040.00	
	SATS LTD	8,000	5.39	43,120.00	
	GENTING SINGAPORE PLC	81,000	1.19	96,390.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	17,000	2.69	45,730.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	1,111	35.24	39,151.64	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	86,000	0.35	30,100.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	17,000	3.21	54,570.00	
	DBS GROUP HLDGS	18,300	29.59	541,497.00	
	OCBC-ORD	34,750	13.73	477,117.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	15,200	29.69	451,288.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	92,000	3.41	313,720.00	
	STARHUB LTD	8,000	2.30	18,400.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	6,000	7.56	45,360.00	
	CAPITALAND LIMITED	32,000	3.73	119,360.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	4,000	12.66	50,640.00	
	UOL GROUP LIMITED	3,000	8.82	26,460.00	
小計	銘柄数：21			2,695,326.14	
				(220,828,070)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
新シェケル	FRUTAROM	400	362.50	145,000.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	6,000	15.85	95,100.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	270	448.30	121,041.00	
	BANK HAPOALIM BM	9,000	24.83	223,470.00	

	BANK LEUMI LE- ISRAEL	13,000	21.78	283,140.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,100	67.35	74,085.00	
	NICE LTD	810	346.60	280,746.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	25,000	4.39	109,975.00	
	AZRIELI GROUP	400	169.10	67,640.00	
	小計 銘柄数：9			1,400,197.00	
				(42,762,016)	
				0.1%	
	組入時価比率：0.1%				
	合計			40,926,534,259	
				(40,926,534,259)	

(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(2018年4月23日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	HUTCHISON PORT HOLDINGS TRUST	72,000	23,760.00	
	小計	銘柄数：1	72,000	23,760.00	
				(2,562,278)	
				0.3%	
	合計			2,562,278	
				(2,562,278)	
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	3,400	63,444.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,030	124,939.00	
		AMERICAN TOWER CORP	4,550	621,621.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	11,400	116,850.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,560	250,957.20	
		BOSTON PROPERTIES	1,660	197,125.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	2,800	39,452.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	960	81,379.20	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	5,800	32,944.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,360	447,423.20	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,380	243,521.60	
		DUKE REALTY CORP	3,100	80,662.00	
		EQUINIX INC	860	349,211.60	

	EQUITY RESIDENTIAL	3,720	223,609.20	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	680	162,785.20	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,110	95,559.90	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	780	86,736.00	
	GGP INC	7,100	139,444.00	
	HCP INC	4,300	94,084.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	7,700	149,534.00	
	INVITATION HOMES INC	3,000	67,710.00	
	IRON MOUNTAIN INC	3,400	113,356.00	
	KIMCO REALTY CORP	5,000	66,650.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	1,400	54,950.00	
	MACERICH CO /THE	1,600	92,000.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,420	127,246.20	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,700	63,767.00	
	PROLOGIS INC	5,900	383,441.00	
	PUBLIC STORAGE	1,770	341,167.50	
	REALTY INCOME CORP	3,300	163,449.00	
	REGENCY CENTERS CORP	1,400	78,568.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,290	213,740.10	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	3,330	490,342.50	
	SL GREEN REALTY CORP	940	90,240.00	
	UDR INC	3,400	119,510.00	
	VENTAS INC	3,500	164,535.00	
	VEREIT INC	11,100	73,704.00	
	VORNADO REALTY TRUST	1,770	115,793.40	
	WELLTOWER INC	4,230	216,491.40	
	WEYERHAEUSER CO	8,300	300,958.00	
小計	銘柄数：40	137,000	6,938,901.20	
			(748,291,105)	
	組入時価比率：1.8%		76.5%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	1,200	24,612.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,986	46,273.80	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	700	20,125.00	
小計	銘柄数：3	3,886	91,010.80	
			(7,687,682)	

		組入時価比率：0.0%		0.8%
ユーロ	FONCIERE DES REGIONS		230	20,412.50
	GECINA SA		560	78,344.00
	ICADE		230	18,227.50
	KLEPIERRE		2,200	76,010.00
	UNIBAIL RODAMCO-NA		1,120	216,160.00
	小計	銘柄数：5	4,340	409,154.00
		組入時価比率：0.1%		5.5%
英ポンド	BRITISH LAND		9,100	60,606.00
	HAMMERSON PLC		8,600	46,440.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC		7,312	71,058.01
	SEGRO PLC		9,360	58,799.52
小計	銘柄数：4	34,372	236,903.53	(35,789,016)
		組入時価比率：0.1%		3.7%
豪ドル	DEXUS		13,200	121,176.00
	GOODMAN GROUP		17,000	148,070.00
	GPT GROUP		15,000	69,300.00
	LENDLEASE GROUP		6,600	117,744.00
	MIRVAC GROUP		36,000	77,760.00
	SCENTRE GROUP		54,000	209,520.00
	STOCKLAND TRUST GROUP		25,800	100,878.00
	VICINITY CENTRES		26,000	61,620.00
	WESTFIELD CORP		20,000	175,200.00
	小計	銘柄数：9	213,600	1,081,268.00
		組入時価比率：0.2%		9.1%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		30,000	218,700.00
	LINK REIT		22,000	1,503,700.00
小計	銘柄数：2	52,000	1,722,400.00	(23,683,000)
		組入時価比率：0.1%		2.4%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		18,000	48,780.00
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		22,154	40,320.28
	CAPITALAND MALL TRUST		27,800	58,380.00

	SUNTEC REIT	29,000	55,970.00
小計	銘柄数：4	96,954	203,450.28 (16,668,681)
	組入時価比率：0.0%		1.7%
合計			975,647,166 (975,647,166)
合計			978,209,444 (978,209,444)

(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	2018年 4月23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	488,667,461	-	495,674,949	7,007,488
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	40,955,447,244	-	41,521,323,100	565,875,856
米ドル	26,903,861,908	-	27,326,791,800	422,929,892
カナダドル	1,511,913,316	-	1,548,923,500	37,010,184
ユーロ	5,496,538,062	-	5,548,596,900	52,058,838
英ポンド	2,906,669,297	-	2,940,359,400	33,690,103
スイスフラン	1,310,131,776	-	1,298,962,500	11,169,276
スウェーデンクローナ	444,301,316	-	444,813,600	512,284
ノルウェークローネ	114,838,202	-	116,652,600	1,814,398
デンマーククローネ	314,840,385	-	318,083,000	3,242,615
豪ドル	1,104,969,892	-	1,119,784,800	14,814,908
ニュージーランドドル	27,585,986	-	27,939,600	353,614
香港ドル	553,244,574	-	561,282,400	8,037,826
シンガポールドル	225,294,210	-	227,598,600	2,304,390
新シェケル	41,258,320	-	41,534,400	276,080

合計	-	-	-	558,868,368
----	---	---	---	-------------

(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。

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2018年 4月23日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	553,722,720
コール・ローン	50,007,131
株式	32,547,256,165
投資証券	148,468,654
派生商品評価勘定	1,391,297
未収配当金	38,994,108
差入委託証拠金	110,616,257
流動資産合計	33,450,456,332
資産合計	
33,450,456,332	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,569,722
未払解約金	2,076,800
未払利息	90
その他未払費用	2,054,900
流動負債合計	13,701,512
負債合計	
13,701,512	
純資産の部	
元本等	
元本	25,194,047,349
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	8,242,707,471

(2018年 4月23日現在)

元本等合計	33,436,754,820
純資産合計	33,436,754,820
負債純資産合計	33,450,456,332

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>受取配当金は、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>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)

2018年 4月23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	1.3272円
(10,000口当たり純資産額)	(13,272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 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</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> <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

2018年 4月23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 （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>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。</p> <p>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。</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>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2018年 4月23日現在		2017年 4月25日
期首		
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		18,522,143,645円
同期中における追加設定元本額		8,354,278,212円
同期中における一部解約元本額		1,682,374,508円
期末元本額		25,194,047,349円
期末元本額の内訳*		
野村資産設計ファンド2015		27,856,017円
野村資産設計ファンド2020		32,877,081円
野村資産設計ファンド2025		47,793,860円
野村資産設計ファンド2030		50,504,490円
野村資産設計ファンド2035		38,160,605円
野村資産設計ファンド2040		95,677,522円
野村資産設計ファンド2045		12,521,196円
野村インデックスファンド・新興国株式		3,499,583,173円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		185,238,653円
野村資産設計ファンド2050		18,465,296円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		6,555,924円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		1,982,021円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		1,347,717円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		783,953円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,261,547円
インデックス・ブレンド(タイプ)		2,355,597円
インデックス・ブレンド(タイプ)		7,823,285円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,878,464円
インデックス・ブレンド(タイプ)		8,647,370円
野村つみたて外国株投信		156,878,391円
野村外国株(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)		243,990,431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)		565,920,616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)		97,332,458円
ノムラFOfs用インデックスファンド・新興国株式(適格機関投資家専用)		541,724,937円
野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け)		19,545,771,729円
野村資産設計ファンド(DC)2030		206,065円
野村資産設計ファンド(DC)2040		304,062円
野村資産設計ファンド(DC)2050		604,889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(2018年4月23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	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	14,600	21.94	320,324.00	

LUKOIL PJSC-SPON ADR	23,480	64.96	1,525,260.80
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	5,240	125.80	659,192.00
PJSC GAZPROM-ADR	299,600	4.63	1,387,148.00
ROSNEFT OJSC - GDR	61,750	5.45	336,537.50
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	73,300	4.71	345,389.60
TATNEFT-SPONSORED ADR	14,080	64.02	901,401.60
TRANSNEFT PJSC	21	2,916.04	61,236.95
PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	7,010	14.05	98,490.50
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	5,800	56.59	328,222.00
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	11,100	16.56	183,816.00
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	8,400	9.87	82,908.00
NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	6,020	24.90	149,898.00
PJSC ALROSA	140,000	1.43	201,044.20
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	34,849	17.16	598,008.84
POLYUS PJSC-REG S-GDR	2,700	30.70	82,890.00
SEVERSTAL-GDR REG S	11,380	15.48	176,162.40
SOUTHERN COPPER CORP	4,242	56.16	238,230.72
LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR	15,800	15.52	245,216.00
DP WORLD LTD	8,460	22.00	186,120.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	21,300	40.73	867,549.00
CTIP.COM INTERNATIONAL -ADR	21,400	42.65	912,710.00
JD.COM INC-ADR	36,800	37.44	1,377,792.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	21,800	15.70	342,260.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	20,570	19.01	391,035.70
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	4,000	28.38	113,520.00
BANCO DE CHILE-ADR	2,251	101.34	228,116.34
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	9,596	34.00	326,264.00
BANCOLOMBIA S.A. -SPONS ADR	6,400	49.11	314,304.00
CREDICORP LTD	3,800	230.94	877,572.00
ITAU CORPBANCA-ADR	5,466	15.30	83,629.80
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	594,900	3.50	2,087,135.26
STATE BANK OF INDIA-GDR	9,700	36.35	352,595.00
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	135,640	1.93	263,005.96
58.COM INC-ADR	5,000	84.03	420,150.00
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	63,700	179.11	11,409,307.00

	AUTOHOME INC-ADR	3,200	98.31	314,592.00	
	BAIDU INC - SPON ADR	15,100	232.50	3,510,750.00	
	MOMO INC-SPON ADR	5,500	36.33	199,815.00	
	NETEASE INC-ADR	4,400	266.30	1,171,720.00	
	SINA CORP	3,400	96.00	326,400.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	2,500	119.09	297,725.00	
	YY INC-ADR	2,400	92.89	222,936.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	28,650	10.11	289,651.50	
	ENEL AMERICAS S.A-ADR	31,741	11.65	369,782.65	
	ENEL CHILE SA-ADR	30,925	6.41	198,229.25	
	INTER RAO UES PJSC	1,669,000	0.06	106,315.30	
	PJSC RUSHYDRO	4,691,000	0.01	56,526.55	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	85,170	1.88	160,933.82	
	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	7,700	91.11	701,547.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	17,400	36.92	642,408.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	40,840	1.42	58,074.48	
小計	銘柄数：52			37,101,849.72	
				(4,001,063,473)	
	組入時価比率：12.0%			12.3%	
メキシコペソ	MEXICHEM SAB DE CV-*	60,458	59.20	3,579,113.60	
	CEMEX SAB - CPO	795,885	12.69	10,099,780.65	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	209,983	62.94	13,216,330.02	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	386.12	3,247,269.20	
	ALFA S.A.B. -A	172,100	23.54	4,051,234.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	20,700	64.08	1,326,456.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	11,200	326.45	3,656,240.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	21,400	194.67	4,165,938.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	12,900	187.55	2,419,395.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	137,100	65.71	9,008,841.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,800	130.90	1,413,720.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	292,300	49.80	14,556,540.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	26,100	128.22	3,346,542.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	25,995	121.78	3,165,671.10	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	106,000	178.76	18,948,560.00	
	GRUMA S.A.B. -B	10,500	227.75	2,391,375.00	

	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	90,500	43.26	3,915,030.00	
	GRUPO LALA SAB DE CV	32,300	24.85	802,655.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	79,500	33.81	2,687,895.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	93,100	27.51	2,561,181.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	141,700	115.31	16,339,427.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	140,200	30.42	4,264,884.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,855,200	17.85	33,115,320.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	26,100	84.07	2,194,227.00	
	GENTERA SAB DE CV	51,300	15.16	777,708.00	
小計	銘柄数：25			165,251,332.57	
				(961,762,755)	
	組入時価比率：2.9%			3.0%	
リアル	COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	9,100	38.05	346,255.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	168,100	24.43	4,106,683.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	220,600	22.36	4,932,616.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	19,600	63.35	1,241,660.00	
	BRASKEM SA-PREF A	8,400	47.10	395,640.00	
	KLABIN SA-UNIT	30,200	21.10	637,220.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	30,300	9.09	275,427.00	
	GERDAU SA PFD NPV	56,100	16.95	950,895.00	
	VALE SA	174,221	47.63	8,298,146.23	
	FIBRIA CELULOSE SA	14,873	67.00	996,491.00	
	SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	26,100	37.63	982,143.00	
	EMBRAER SA	33,500	23.50	787,250.00	
	WEG SA	31,480	22.91	721,206.80	
	LOCALIZA RENT A CAR	30,334	29.28	888,179.52	
	RUMO SA	58,100	14.29	830,249.00	
	CCR SA	69,000	11.91	821,790.00	
	LOJAS AMERICANAS S.A. (PREF)	38,792	19.04	738,599.68	
	LOJAS RENNER S.A.	40,250	33.07	1,331,067.50	
	ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,000	14.48	275,120.00	
	CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF	8,403	72.50	609,217.50	
	RAIA DROGASIL SA	13,500	68.22	920,970.00	
	AMBEV SA	263,956	23.43	6,184,489.08	
	BRF SA	22,700	25.37	575,899.00	

	JBS SA	48,400	9.17	443,828.00	
	M DIAS BRANCO SA	5,500	44.60	245,300.00	
	NATURA COSMETICOS SA	8,700	33.10	287,970.00	
	ODONTOPREV S.A.	10,600	15.16	160,696.00	
	QUALICORP SA	10,300	22.20	228,660.00	
	HYPERA SA	17,500	33.60	588,000.00	
	BANCO BRADESCO S.A.	55,176	32.05	1,768,390.80	
	BANCO BRADESCO SA - PEF	188,013	34.26	6,441,325.38	
	BANCO DO BRASIL SA	47,300	37.62	1,779,426.00	
	BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	38.86	948,184.00	
	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	177,094	50.89	9,012,313.66	
	ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	220,907	13.14	2,902,717.98	
	BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	36,800	27.48	1,011,264.00	
	PORTO SEGURO SA	4,900	45.10	220,990.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	9,149	22.00	201,278.00	
	CIELO SA	64,363	18.95	1,219,678.85	
	TELEFONICA BRASIL-PREF	25,105	48.90	1,227,634.50	
	TIM PARTICIPACOES SA	46,552	15.59	725,745.68	
	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	11,800	21.45	253,110.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	11,100	18.07	200,577.00	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	40,229	8.42	338,728.18	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	15,600	13.55	211,380.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,700	69.01	807,417.00	
	TRANSMISSORA ALIANCA DE-UNIT	12,700	21.14	268,478.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	19,000	34.29	651,510.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	115,233	25.70	2,961,488.10	
	KROTON EDUCACIONAL SA	83,456	13.50	1,126,656.00	
	ENGIE BRASIL SA	9,600	37.58	360,768.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	46,700	11.18	522,106.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,800	64.83	246,354.00	
小計	銘柄数：53			75,209,189.44	
				(2,375,858,294)	
	組入時価比率：7.1%			7.3%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	22,100	9,941.30	219,702,730.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	2,391.70	172,085,206.70	

	S.A.C.I. FALABELLA	38,600	5,957.50	229,959,500.00	
	CENCOSUD SA	80,738	1,846.70	149,098,864.60	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,400	3,069.90	47,276,460.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,223	45,466.00	101,070,918.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	8,972	7,355.30	65,991,751.60	
	AGUAS ANDINAS SA-A	125,600	402.16	50,511,296.00	
	AES GENER SA	121,560	168.03	20,425,726.80	
	COLBUN SA	471,000	151.40	71,309,400.00	
小計	銘柄数：10			1,127,431,853.70	
				(203,952,422)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
コロンビアペソ	CEMENTOS ARGOS SA	21,600	9,700.00	209,520,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	15,600	19,800.00	308,880,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	12,000	34,200.00	410,400,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PFD	205,700	1,245.00	256,096,500.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	38,400.00	499,200,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF	5,200	36,620.00	190,424,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	23,500	14,880.00	349,680,000.00	
小計	銘柄数：7			2,224,200,500.00	
				(86,966,239)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
ユーロ	TITAN CEMENT CO	2,570	21.75	55,897.50	
	OPAP SA	13,190	9.78	128,998.20	
	FF GROUP	2,030	17.24	34,997.20	
	JUMBO SA	5,202	15.44	80,318.88	
	ALPHA BANK A.E.	76,409	2.14	163,515.26	
	EUROBANK ERGASIAS SA	106,978	0.97	104,624.48	
	NATIONAL BANK OF GREECE	297,986	0.31	94,342.36	
	PIRAEUS BANK S.A.	13,081	3.17	41,466.77	
	HELLENIC TELECOM	12,860	11.68	150,204.80	
小計	銘柄数：9			854,365.45	
				(113,049,636)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	6,730	107.00	720,110.00	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	37,600	7.64	287,264.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	78,250	11.40	892,050.00	

	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	10,040	26.66	267,666.40	
	KOC HLDGS	40,504	14.82	600,269.28	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	42,345	4.89	207,067.05	
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,186	18.25	587,394.50	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,660	26.00	251,160.00	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	3,320	60.10	199,532.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	5,920	26.54	157,116.80	
	ARCELIK A.S	10,793	17.11	184,668.23	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	12,690	70.25	891,472.50	
	ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYI I	10,220	26.66	272,465.20	
	COCA-COLA ICECEK AS	4,510	35.14	158,481.40	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	8,970	21.30	191,061.00	
	AKBANK T.A.S	119,500	9.21	1,100,595.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	138,490	10.07	1,394,594.30	
	TURKIYE HALK BANKASI	32,890	9.20	302,588.00	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	6.42	589,356.00	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	41,720	6.33	264,087.60	
	YAPI VE KREDI BANKASI A.S.	43,660	4.28	186,864.80	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	47,880	10.15	485,982.00	
	TURK TELEKOMUNIKASYON AS	31,830	6.36	202,438.80	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	59,780	14.36	858,440.80	
小計	銘柄数：24			11,252,725.66	
				(298,309,757)	
	組入時価比率：0.9%			0.9%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	4,010	921.50	3,695,215.00	
	MONETA MONEY BANK AS	27,300	85.75	2,340,975.00	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	2,750	290.00	797,500.00	
	CEZ AS	9,530	536.00	5,108,080.00	
小計	銘柄数：4			11,941,770.00	
				(62,336,039)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	20,520	2,988.00	61,313,760.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	8,470	5,260.00	44,552,200.00	
	OTP BANK NYRT	12,760	11,280.00	143,932,800.00	
小計	銘柄数：3			249,798,760.00	

				(106,364,312)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
ズロチ	GRUPA LOTOS SA	4,709	55.00	258,995.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	17,050	87.90	1,498,695.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	97,770	6.03	589,553.10	
	GRUPA AZOTY SA	2,330	58.00	135,140.00	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	2,570	88.18	226,622.60	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	7,630	95.72	730,343.60	
	CCC SA	1,520	267.40	406,448.00	
	LPP SA	70	9,320.00	652,400.00	
	CYFROWY POLSAT SA	11,670	25.64	299,218.80	
	DINO POLSKA SA	2,410	90.90	219,069.00	
	ALIOR BANK SA	4,843	72.85	352,812.55	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	1,250	80.30	100,375.00	
	BANK MILLENNIUM SA	35,830	8.52	305,271.60	
	BANK PEKAO SA	8,920	121.55	1,084,226.00	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,030	372.40	755,972.00	
	MBANK	900	444.00	399,600.00	
	PKO BANK POLSKI SA	51,810	40.84	2,115,920.40	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	33,010	43.02	1,420,090.20	
	CD PROJEKT RED SA	4,080	119.50	487,560.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	5.63	220,414.50	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	5,600	32.18	180,208.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	43,880	10.39	455,913.20	
	TAURON POLSKA ENERGIA SA	55,440	2.42	134,164.80	
小計	銘柄数：23			13,029,013.35	
				(412,628,852)	
	組入時価比率：1.2%			1.3%	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	100,000	8.80	880,000.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,404,900	7.50	10,536,750.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	181,000	19.36	3,504,160.00	
	CNOOC LTD	1,002,000	12.92	12,945,840.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	186,000	6.36	1,182,960.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,140,000	5.87	6,691,800.00	
	YANZHOU COAL MINING-H	96,000	10.12	971,520.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	206,000	5.07	1,044,420.00	

ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	73,000	44.80	3,270,400.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	235,000	8.38	1,969,300.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	5.02	1,054,200.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	180,000	5.55	999,000.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	60,000	11.38	682,800.00	
ZIJIN MINING GROUP CO-H	347,000	3.63	1,259,610.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	8.61	671,580.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	77,000	11.74	903,980.00	
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	112,000	5.34	598,080.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	249,000	8.56	2,131,440.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	230,000	5.82	1,338,600.00	
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	96,000	8.77	841,920.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	101,250	9.80	992,250.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	126,000	2.74	345,240.00	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	28,500	38.05	1,084,425.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	27,000	39.65	1,070,550.00	
CITIC LTD	331,000	11.40	3,773,400.00	
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	133,940	16.68	2,234,119.20	
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	30,000	20.35	610,500.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	83,000	23.20	1,925,600.00	
CRRC CORP LTD-H	223,350	6.57	1,467,409.50	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	32,000	21.50	688,000.00	
WEICHAH POWER CO LTD-H	117,800	9.51	1,120,278.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	122,000	10.76	1,312,720.00	
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	9.30	948,600.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	7.09	751,540.00	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	11.08	1,085,840.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	70,000	17.16	1,201,200.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	6.49	661,980.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.42	708,560.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	64,000	7.87	503,680.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	24,800	28.25	700,600.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	43,000	11.96	514,280.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	160,000	13.64	2,182,400.00	

BYD CO LTD-H	35,500	58.60	2,080,300.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	136,000	8.30	1,128,800.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	275,000	21.90	6,022,500.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	166,500	7.53	1,253,745.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	109,922	13.56	1,490,542.32	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	66,000	26.45	1,745,700.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	62,000	44.55	2,762,100.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	40,000	81.90	3,276,000.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	580,000	0.93	539,400.00	
GOME RETAIL HODINGS LTD	523,360	0.83	434,388.80	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	127,000	9.09	1,154,430.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	87,333	34.60	3,021,721.80	
TSING TAO BREWERY CO-H	20,000	42.05	841,000.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.21	30,240.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	154,000	28.30	4,358,200.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	118,000	16.66	1,965,880.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	288,000	6.69	1,926,720.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	41,000	74.10	3,038,100.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	72,000	4.84	348,480.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	20.60	1,048,540.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	69,200	34.00	2,352,800.00	
3SBIO, INC	51,000	18.58	947,580.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	81,000	18.30	1,482,300.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	10.54	980,220.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	264,000	20.25	5,346,000.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	24,500	44.20	1,082,900.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	155,000	1.99	308,450.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	254,000	15.72	3,992,880.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,413,000	4.28	6,047,640.00	
BANK OF CHINA LTD-H	4,362,000	4.17	18,189,540.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	516,790	6.24	3,224,769.60	
CHINA CITIC BANK-H	488,000	5.44	2,654,720.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	4,664,000	8.06	37,591,840.00	

CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	134,000	3.85	515,900.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	210,192	32.35	6,799,711.20
CHINA MINSHENG BANKING-H	289,000	7.33	2,118,370.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	137,000	6.07	831,590.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,098,000	6.77	27,743,460.00
FAR EAST HORIZON LTD	106,000	7.82	828,920.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	403,000	21.75	8,765,250.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	143,400	34.05	4,882,770.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	88,872	24.75	2,199,582.00
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	47,400	34.90	1,654,260.00
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	423,000	3.63	1,535,490.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	260,280	13.80	3,591,864.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	285,500	81.50	23,268,250.00
TENCENT HOLDINGS LTD	314,600	400.20	125,902,920.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	48,000	22.35	1,072,800.00
KINGSOFT CORP LTD	46,000	24.75	1,138,500.00
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	33,000	12.02	396,660.00
ZTE CORP-H	33,852	25.60	866,611.20
LENOVO GROUP LTD	426,000	3.79	1,614,540.00
MEITU INC	63,000	8.69	547,470.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	41,000	121.30	4,973,300.00
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	32,000	33.30	1,065,600.00
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	39,000	142.50	5,557,500.00
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	724,200	0.98	709,716.00
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LTD	367,000	0.05	19,451.00
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	176,000	10.64	1,872,640.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	126,400	4.75	600,400.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	766,000	3.65	2,795,900.00
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	340,000	10.40	3,536,000.00
CHINA MOBILE LTD	336,500	73.10	24,598,150.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	100,000	28.45	2,845,000.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	52,000	28.30	1,471,600.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	44,000	69.60	3,062,400.00

BEIJING ENTERPRISES WATER GR	317,000	4.34	1,375,780.00	
GUANGDONG INVESTMENT	154,000	12.28	1,891,120.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	443,000	2.79	1,235,970.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	48,000	16.90	811,200.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	183,500	4.96	910,160.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	592,000	2.80	1,657,600.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	123,000	18.36	2,258,280.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	14.14	1,167,964.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	172,400	10.52	1,813,648.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	92,200	15.18	1,399,596.00	
CGN POWER CO LTD-H	627,000	2.11	1,322,970.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	159,000	6.76	1,074,840.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	108,000	14.44	1,559,520.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	4.93	1,173,340.00	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	226,000	3.08	696,080.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	156,000	3.97	619,320.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	16.16	1,519,040.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	176,000	24.90	4,382,400.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	300,000	4.36	1,308,000.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	210,000	26.05	5,470,500.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	156,444	28.60	4,474,298.40	
CHINA VANKE CO LTD-H	64,400	32.80	2,112,320.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	196,000	6.18	1,211,280.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	301,380	15.60	4,701,528.00	
FULLSHARE HOLDINGS LIMITED	390,000	3.85	1,501,500.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	50,400	18.50	932,400.00	
LONGFOR PROPERTIES	80,000	22.90	1,832,000.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	72,000	20.50	1,476,000.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	146,000	5.47	798,620.00	
SOHO CHINA LTD	106,000	4.06	430,360.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	140,000	32.40	4,536,000.00	
小計銘柄数：139			529,066,169.02	
			(7,274,659,824)	
組入時価比率：21.8%				22.5%

リンギ	DIALOG GROUP BHD	162,144	3.15	510,753.60
	SAPURA ENERGY BHD	207,500	0.75	156,662.50
	PETRONAS DAGANGAN BHD	14,500	27.60	400,200.00
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	138,200	8.48	1,171,936.00
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	64,300	5.11	328,573.00
	GAMUDA BERHAD	100,200	5.11	512,022.00
	IJM CORP	152,600	2.75	419,650.00
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	9.73	328,874.00
	SIME DARBY BERHAD	122,800	2.80	343,840.00
	AIRASIA GROUP BHD	86,600	3.80	329,080.00
	MISC BHD	67,260	7.20	484,272.00
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	41,660	9.00	374,940.00
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	3.40	174,760.00
	UMW HOLDINGS BHD	21,300	6.15	130,995.00
	GENTING BHD	124,000	8.86	1,098,640.00
	GENTING MALAYSIA BHD	163,200	5.17	843,744.00
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	69,300	1.94	134,442.00
	FELDA GLOBAL VENTURES	73,300	1.72	126,076.00
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,600	9.99	145,854.00
	IOI CORP	111,800	4.78	534,404.00
	KUALA LUMPUR KEPONG	28,000	25.50	714,000.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	3,600	148.00	532,800.00
	PPB GROUP BERHAD	23,800	19.02	452,676.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	5.52	796,536.00
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	7,800	24.86	193,908.00
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	74,400	6.30	468,720.00
	IHH HEALTHCARE BHD	124,900	6.12	764,388.00
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	54,800	4.48	245,504.00
	AMMB HOLDING	80,800	3.88	313,504.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	252,500	7.30	1,843,250.00
	HONG LEONG BANK	37,460	19.40	726,724.00
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	19.64	263,608.08
MALAYAN BANKING	241,600	10.72	2,589,952.00	
PUBLIC BANK BHD	162,460	24.20	3,931,532.00	
RHB BANK BHD	46,223	5.38	248,679.74	

	TELEKOM MALAYSIA	62,000	5.50	341,000.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	144,800	5.45	789,160.00	
	DIGI.COM BERHAD	175,400	4.53	794,562.00	
	MAXIS BHD	116,600	5.87	684,442.00	
	TENAGA NASIONAL	189,300	15.92	3,013,656.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	36,500	18.60	678,900.00	
	YTL CORPORATION	210,847	1.47	309,945.09	
	YTL POWER INTL	73,514	0.92	67,632.88	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	70,540	1.58	111,453.20	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	122,800	1.40	171,920.00	
	SP SETIA BHD	87,500	3.10	271,250.00	
	小計銘柄数：46			29,869,421.09	
				(826,486,881)	
	組入時価比率：2.5%			2.5%	
パーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	122,000	19.60	2,391,200.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	63,100	36.75	2,318,925.00	
	IRPC PCL - NVDR	527,900	7.45	3,932,855.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	75,500	136.50	10,305,750.00	
	PTT PCL-NVDR	58,300	588.00	34,280,400.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	60,300	93.00	5,607,900.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	84,867	59.50	5,049,586.50	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	128,294	103.00	13,214,282.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	5,200	486.00	2,527,200.00	
	SIAM CEMENT PUBLIC (F)	17,900	490.00	8,771,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	311,600	8.60	2,679,760.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	248,100	70.00	17,367,000.00	
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	7.70	3,442,670.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	116,200	39.50	4,589,900.00	
	ROBINSON PCL -NVDR	26,100	64.25	1,676,925.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	189,497	15.00	2,842,455.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	57,500	59.00	3,392,500.00	
	CP ALL PCL-NVDR	269,700	87.00	23,463,900.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	151,400	23.80	3,603,320.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	112,800	17.80	2,007,840.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	208,300	23.30	4,853,390.00	

	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	20,800	217.00	4,513,600.00	
	BANGKOK BANK(F)	13,500	216.00	2,916,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	36,500	197.50	7,208,750.00	
	KASIKORNBANK PCL(F)	65,200	203.00	13,235,600.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	184,250	18.30	3,371,775.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	107,100	138.50	14,833,350.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	649,400	2.54	1,649,476.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	21,000	72.75	1,527,750.00	
	KCE ELECTRONICS-NVDR	10,700	74.00	791,800.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	597,200	7.70	4,598,440.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	56,200	207.00	11,633,400.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	6,700	229.00	1,534,300.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	26,100	88.00	2,296,800.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	75,900	80.00	6,072,000.00	
小計	銘柄数：35			234,501,799.50	
				(806,686,190)	
	組入時価比率：2.4%			2.5%	
フィリピンペン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	100,500	68.65	6,899,325.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	218,900	13.14	2,876,346.00	
	DMCI HOLDINGS INC	178,000	12.10	2,153,800.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	173,700	61.05	10,604,385.00	
	SM INVESTMENTS CORP	13,415	901.00	12,086,915.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	26,960	93.35	2,516,716.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	24,400	291.00	7,100,400.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	50,800	138.00	7,010,400.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	46,949	106.00	4,976,594.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS-RIGHTS	6,650	16.50	109,725.00	
	BDO UNIBANK INC	106,298	134.00	14,243,932.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	47,545	82.90	3,941,480.50	
	SECURITY BANK CORP	12,000	225.00	2,700,000.00	
	AYALA CORPORATION	14,472	919.00	13,299,768.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	4,890	1,045.00	5,110,050.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	4.64	3,469,792.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,470	1,535.00	2,256,450.00	

	PLDT INC	4,970	1,395.00	6,933,150.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	11,000	321.60	3,537,600.00	
	ABOITIZ POWER CORP	76,700	39.70	3,044,990.00	
	AYALA LAND LTD	429,100	41.10	17,636,010.00	
	MEGAWORLD CORP	558,000	4.40	2,455,200.00	
	ROBINSONS LAND CO	92,868	19.10	1,773,778.80	
	SM PRIME HLDGS	460,575	33.00	15,198,975.00	
小計	銘柄数：24			151,935,782.30	
				(314,507,069)	
	組入時価比率：0.9%			1.0%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	2,230.00	1,871,416,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	99,150	36,850.00	3,653,677,500.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	101,200	18,425.00	1,864,610,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	148,900	10,125.00	1,507,612,500.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	258,500	2,430.00	628,155,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	75,300	5,775.00	434,857,500.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	113,559	4,470.00	507,608,730.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,102,900	7,575.00	8,354,467,500.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	345,500	2,680.00	925,940,000.00	
	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	142,800	11,000.00	1,570,800,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	119,600	8,400.00	1,004,640,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	266,200	7,100.00	1,890,020,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	410,500	3,800.00	1,559,900,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	75,800.00	2,213,360,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	485,300	4,030.00	1,955,759,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	89,100	51,125.00	4,555,237,500.00	
	KALBE FARMA PT	1,100,000	1,595.00	1,754,500,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	538,500	23,200.00	12,493,200,000.00	
	BANK DANAMON PT	165,196	6,800.00	1,123,332,800.00	
	BANK MANDIRI	1,022,700	8,000.00	8,181,600,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	413,600	8,725.00	3,608,660,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,114,500	3,660.00	11,399,070,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	208,000	3,690.00	767,520,000.00	
	TELEKOMUNIKASI	2,878,800	3,740.00	10,766,712,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	88,700	5,325.00	472,327,500.00	

	XL AXIATA TBK PT	138,200	2,490.00	344,118,000.00
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	593,500	2,320.00	1,376,920,000.00
	BUMI SERPONG DAMAI PT	428,300	1,840.00	788,072,000.00
	PAKUWON JATI TBK PT	920,000	630.00	579,600,000.00
小計	銘柄数：29			88,153,693,530.00 (687,598,809)
	組入時価比率：2.1%			2.1%
ウォン	GS HOLDINGS CORP	2,530	60,700.00	153,571,000.00
	S-OIL CORPORATION	2,690	117,000.00	314,730,000.00
	SK INNOVATION CO LTD	3,710	199,000.00	738,290,000.00
	HANWHA CHEMICAL CORP	6,330	29,500.00	186,735,000.00
	HYOSUNG CORPORATION	1,210	127,500.00	154,275,000.00
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	998	94,800.00	94,610,400.00
	LG CHEM LTD - PREFERRED	384	211,000.00	81,024,000.00
	LG CHEMICALS LTD	2,536	372,500.00	944,660,000.00
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	850	409,000.00	347,650,000.00
	OCI COMPANY LTD	860	161,500.00	138,890,000.00
	HYUNDAI STEEL CO	4,779	54,300.00	259,499,700.00
	KOREA ZINC CO LTD	460	441,000.00	202,860,000.00
	POSCO	4,170	349,500.00	1,457,415,000.00
	HANWHA TECHWIN CO LTD	1,430	26,200.00	37,466,000.00
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	3,370	45,200.00	152,324,000.00
	KCC CORP	309	375,000.00	115,875,000.00
	DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	1,600	82,800.00	132,480,000.00
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	9,690	6,280.00	60,853,200.00
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	2,888	37,150.00	107,289,200.00
	HYUNDAI DEVELOPMENT COMPANY	4,060	45,450.00	184,527,000.00
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	4,650	50,400.00	234,360,000.00
	DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	1,770	16,900.00	29,913,000.00
	CJ CORP	687	159,500.00	109,576,500.00
	HANWHA CORPORATION	2,470	41,250.00	101,887,500.00
	LG CORP	5,290	84,600.00	447,534,000.00
	LOTTE CORP	1,620	65,400.00	105,948,000.00
	SAMSUNG C&T CORP	4,248	136,500.00	579,852,000.00
	SK HOLDINGS CO LTD	1,692	294,000.00	497,448,000.00
	DOOSAN BOBCAT INC	1,430	32,300.00	46,189,000.00

HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1,917	121,500.00	232,915,500.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	597	411,000.00	245,367,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	29,197	7,530.00	219,853,410.00	
POSCO DAEWOO CORP	1,809	23,650.00	42,782,850.00	
SK NETWORKS CO LTD	4,820	5,510.00	26,558,200.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,340	49,750.00	66,665,000.00	
S-1 CORPORATION	820	97,400.00	79,868,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,140	175,000.00	199,500,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,576	33,350.00	85,909,600.00	
PAN OCEAN CO LTD	8,710	5,380.00	46,859,800.00	
CJ LOGISTICS	390	155,000.00	60,450,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD/NEW	3,923	48,850.00	191,638,550.00	
HANON SYSTEMS	8,590	11,150.00	95,778,500.00	
HYUNDAI MOBIS	3,790	243,500.00	922,865,000.00	
HYUNDAI WIA CORP	802	52,900.00	42,425,800.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	8,690	160,000.00	1,390,400,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	1,920	106,500.00	204,480,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,090	92,100.00	100,389,000.00	
KIA MOTORS CORP	14,000	31,350.00	438,900,000.00	
COWAY CO LTD	2,690	87,900.00	236,451,000.00	
HANSSEM CO LTD	560	120,000.00	67,200,000.00	
LG ELECTRONICS INC	6,045	109,000.00	658,905,000.00	
KANGWON LAND INC	6,200	28,750.00	178,250,000.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	3,320	19,050.00	63,246,000.00	
CJ E&M CORP	1,090	92,700.00	101,043,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	600	91,200.00	54,720,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	544	264,000.00	143,616,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	427	395,000.00	168,665,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,672	102,500.00	171,380,000.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	177,000.00	85,845,000.00	
DONGSUH COMPANIES INC	1,650	27,200.00	44,880,000.00	
E-MART CO	1,181	267,000.00	315,327,000.00	
GS RETAIL CO LTD	1,140	34,400.00	39,216,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	400	321,500.00	128,600,000.00	

ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,131	126,000.00	142,506,000.00	
OTTOGI CORPORATION	70	782,000.00	54,740,000.00	
KT & G CORP	6,250	99,300.00	620,625,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,830	338,000.00	618,540,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	410	173,000.00	70,930,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	142,500.00	216,600,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	519	1,278,000.00	663,282,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	740,000.00	76,960,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,043	86,900.00	177,536,700.00	
CELLTRION INC	4,510	269,000.00	1,213,190,000.00	
MEDY-TOX INC	220	688,000.00	151,360,000.00	
SILLAJEN INC	3,060	97,600.00	298,656,000.00	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	330	492,500.00	162,525,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	736	83,800.00	61,676,800.00	
YUHAN CORPORATION	420	240,500.00	101,010,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	12,887	10,350.00	133,380,450.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	8,359	11,700.00	97,800,300.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	16,525	44,000.00	727,100,000.00	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	15,040	16,050.00	241,392,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	21,800	60,500.00	1,318,900,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	23,240	45,400.00	1,055,096,000.00	
WOORI BANK	26,340	15,300.00	403,002,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	2,850	60,400.00	172,140,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	13,280	6,100.00	81,008,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,400	36,450.00	123,930,000.00	
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	1,610	37,650.00	60,616,500.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	1,680	269,000.00	451,920,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,000	111,500.00	446,000,000.00	
KAKAO CORP	2,610	115,000.00	300,150,000.00	
NAVER CORP	1,520	728,000.00	1,106,560,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,040	243,000.00	495,720,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,010	369,000.00	372,690,000.00	
NETMARBLE CORP	1,470	128,500.00	188,895,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS	5,350	2,581,000.00	13,808,350,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	950	2,105,000.00	1,999,750,000.00	

	LG INNOTEK CO LTD	860	132,500.00	113,950,000.00	
	LG.DISPLAY CO LTD	13,100	25,100.00	328,810,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	3,320	122,000.00	405,040,000.00	
	SAMSUNG SDI CO,LTD	3,185	186,000.00	592,410,000.00	
	SK HYNIX INC	31,960	84,400.00	2,697,424,000.00	
	KT CORP	880	26,950.00	23,716,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	1,080	225,000.00	243,000,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	13,740	35,800.00	491,892,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,599	50,000.00	79,950,000.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,360	35,000.00	47,600,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	2,250	82,600.00	185,850,000.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	18,677	9,390.00	175,377,030.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	14,800.00	114,404,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	36,200.00	129,053,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	890	506,000.00	450,340,000.00	
小計	銘柄数：113			49,462,036,490.00	
				(4,995,665,685)	
	組入時価比率：14.9%			15.3%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	72,360	119.50	8,647,020.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	168,998	109.00	18,420,782.00	
	FORMOSA PLASTIC	223,424	106.50	23,794,656.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	262,726	83.00	21,806,258.00	
	ASIA CEMENT	126,980	30.40	3,860,192.00	
	TAIWAN CEMENT	196,323	38.75	7,607,516.25	
	CHINA STEEL	691,544	23.65	16,355,015.60	
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	91,000	24.50	2,229,500.00	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	176,454	27.10	4,781,903.40	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	6,000	551.00	3,306,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	12,082	504.00	6,089,328.00	
	CHINA AIRLINES	133,561	10.50	1,402,390.50	
	EVA AIRWAYS CORP	88,197	15.45	1,362,643.65	
	EVERGREEN MARINE	82,138	14.95	1,227,963.10	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	101,000	23.05	2,328,050.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	107,036	47.90	5,127,024.40	

NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	271.00	1,897,000.00
GIANT MANUFACTURING	13,752	153.50	2,110,932.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	8,443	366.00	3,090,138.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	20,315	138.00	2,803,470.00
FORMOSA TAFFETA CO.	32,000	33.00	1,056,000.00
POU CHEN CORP	109,468	37.00	4,050,316.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	33,785	58.10	1,962,908.50
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	16,000	299.50	4,792,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	32,816	303.50	9,959,656.00
STANDARD FOODS CORP	27,079	67.50	1,827,832.50
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	258,836	71.40	18,480,890.40
TAIMED BIOLOGICS INC	8,000	273.50	2,188,000.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	280,948	17.10	4,804,210.80
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	710,789	10.75	7,640,981.75
CTBC FINANCIAL HOLDING	979,212	21.55	21,102,018.60
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	544,565	20.35	11,081,897.75
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	536,308	20.40	10,940,683.20
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	368,036	17.75	6,532,639.00
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	601,380	25.70	15,455,466.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	591,715	10.60	6,272,179.00
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	521,128	14.30	7,452,130.40
TAIWAN BUSINESS BANK	172,451	8.88	1,531,364.88
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	462,789	17.10	7,913,691.90
CHAILEASE HOLDING CO LTD	64,632	104.50	6,754,044.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	367,541	50.40	18,524,066.40
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	447,510	52.50	23,494,275.00
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	120,949	31.35	3,791,751.15
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	440,547	12.20	5,374,673.40
ACER INC	160,767	24.00	3,858,408.00
ADVANTECH CO.,LTD.	18,594	203.00	3,774,582.00
ASUSTEK COMPUTER INC	38,805	279.00	10,826,595.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	37,840	347.50	13,149,400.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	29,498	74.80	2,206,450.40
COMPAL ELECTRONICS	244,590	19.90	4,867,341.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	76.00	4,167,384.00

HTC CORPORATION	32,792	62.50	2,049,500.00
INVENTEC CO.,LTD	136,911	22.65	3,101,034.15
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	108,897	40.85	4,448,442.45
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	33,000	95.20	3,141,600.00
PEGATRON CORP	100,692	70.50	7,098,786.00
QUANTA COMPUTER INC	148,684	54.00	8,028,936.00
WISTRON CORP	151,993	23.90	3,632,632.70
AU OPTRONICS CORP	489,008	12.65	6,185,951.20
DELTA ELECTRONICS INC	107,681	119.00	12,814,039.00
GENERAL INTERFACE SOLUTION H	8,000	177.00	1,416,000.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	868,812	84.00	72,980,208.00
INNOLUX CORP	505,322	11.75	5,937,533.50
LARGAN PRECISION CO LTD	6,040	3,420.00	20,656,800.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	77,566	44.75	3,471,078.50
WPG HOLDINGS CO LTD	83,030	40.00	3,321,200.00
YAGEO CORPORATION	12,000	622.00	7,464,000.00
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	20,410	65.90	1,345,019.00
ADVANCED SEMICONDUCTOR ENGINEERING INC	383,317	44.50	17,057,606.50
GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	508.00	6,604,000.00
MACRONIX INTERNATIONAL	89,000	45.80	4,076,200.00
MEDIATEK INC	83,538	354.50	29,614,221.00
NANYA TECHNOLOGY CO	59,000	92.70	5,469,300.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	34,058	127.00	4,325,366.00
PHISON ELECTRONICS CORP	9,306	283.50	2,638,251.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	34,147	93.20	3,182,500.40
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	21,417	128.00	2,741,376.00
SILICONWARE PRECISION INDUSTRIES	104,220	51.00	5,315,220.00
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,361,000	229.00	311,669,000.00
UNITED MICROELECTRONICS CORP	702,500	15.60	10,959,000.00
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	46,000	62.80	2,888,800.00
WIN SEMICONDUCTORS CORP	21,000	297.50	6,247,500.00
WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	144,000	18.25	2,628,000.00
ASIA PACIFIC TELECOM CO LTD	108,000	8.92	963,360.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	209,065	113.50	23,728,877.50

	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	85,000	77.70	6,604,500.00
	TAIWAN MOBILE CO LTD	88,200	110.00	9,702,000.00
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	575,377	13.80	7,940,202.60
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	39,110	45.30	1,771,683.00
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	51,678	36.45	1,883,663.10
小計	銘柄数：90			1,019,185,007.53 (3,740,408,977)
	組入時価比率：11.2%			11.5%
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	44,705	371.40	16,603,437.00
	COAL INDIA LTD	33,740	292.05	9,853,767.00
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	299.05	10,281,339.00
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	57,580	160.10	9,218,558.00
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	73,910	182.35	13,477,488.50
	PETRONET LNG LTD	34,980	239.70	8,384,706.00
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	156,640	927.90	145,346,256.00
	ASIAN PAINTS LTD	17,000	1,159.35	19,708,950.00
	UPL LTD	19,540	765.75	14,962,755.00
	ACC LIMITED	1,840	1,561.65	2,873,436.00
	AMBUJA CEMENTS LTD	29,920	246.60	7,378,272.00
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,490	1,100.80	19,252,992.00
	SHREE CEMENT LIMITED	470	16,999.85	7,989,929.50
	ULTRATECH CEMENT LTD	5,220	4,080.90	21,302,298.00
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	59,450	262.10	15,581,845.00
	JSW STEEL LTD	46,500	322.85	15,012,525.00
	TATA STEEL LIMITED	18,606	606.20	11,278,957.20
	VEDANTA LTD	82,984	308.60	25,608,862.40
	LARSEN&TOUBRO LIMITED	27,545	1,365.05	37,600,302.25
	BHARAT HEAVY ELECTRICALS	35,970	89.35	3,213,919.50
	HAVELLS INDIA LTD	12,350	548.25	6,770,887.50
	SIEMENS INDIA LIMITED	3,220	1,072.05	3,452,001.00
	ASHOK LEYLAND LIMITED	60,650	155.55	9,434,107.50
	EICHER MOTORS LTD	700	31,148.70	21,804,090.00
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	2,212	1,344.60	2,974,255.20
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	39,379	381.15	15,009,305.85
	BHARAT FORGE LIMITED	12,700	762.95	9,689,465.00

BOSCH LTD	390	19,481.60	7,597,824.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	38,292	351.10	13,444,321.20	
BAJAJ AUTO LIMITED	4,300	2,852.70	12,266,610.00	
HERO MOTOCORP LTD	2,430	3,742.70	9,094,761.00	
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	39,840	799.50	31,852,080.00	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	5,880	9,025.00	53,067,000.00	
TATA MOTORS LTD	85,479	336.00	28,720,944.00	
TATA MOTORS LTD-A-DVR	21,960	190.80	4,189,968.00	
TITAN CO LTD	17,890	956.55	17,112,679.50	
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	27,550	587.70	16,191,135.00	
UNITED SPIRITS LIMITED	3,123	3,451.30	10,778,409.90	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,410	5,322.35	7,504,513.50	
NESTLE INDIA LIMITED	1,220	9,162.00	11,177,640.00	
ITC LTD	184,875	276.20	51,062,475.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	36,580	1,467.80	53,692,124.00	
DABUR INDIA LTD	28,756	355.15	10,212,693.40	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	13,450	1,119.55	15,057,947.50	
MARICO LIMITED	26,340	316.90	8,347,146.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	14,046	618.60	8,688,855.60	
CADILA HEALTHCARE LTD	8,880	385.15	3,420,132.00	
CIPLA LIMITED	20,980	589.05	12,358,269.00	
DR.REDDYS LABORATORIES	6,590	2,121.90	13,983,321.00	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	6,830	571.20	3,901,296.00	
LUPIN LTD	10,930	799.90	8,742,907.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	4,720	2,568.50	12,123,320.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	50,662	505.30	25,599,508.60	
AXIS BANK LIMITED	98,320	505.70	49,720,424.00	
ICICI BANK LTD	129,190	282.15	36,450,958.50	
IDFC BANK LTD	78,360	48.65	3,812,214.00	
YES BANK LTD	96,880	308.55	29,892,324.00	
POWER FINANCE CORPORATION	24,180	85.35	2,063,763.00	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	39,810	129.50	5,155,395.00	
BAJAJ FINSERV LTD	2,320	5,286.35	12,264,332.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	30,910	1,062.35	32,837,238.50	
INFOSYS LTD	95,360	1,178.45	112,376,992.00	

	TATA CONSULTANCY SVS LTD	25,870	3,402.45	88,021,381.50	
	TECH MAHINDRA LTD	26,970	700.50	18,892,485.00	
	VAKRANGEE LIMITED	20,780	135.80	2,821,924.00	
	WIPRO LTD	62,456	298.05	18,615,010.80	
	BHARTI INFRATEL LTD	16,510	331.10	5,466,461.00	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	78,330	402.00	31,488,660.00	
	IDEA CELLULAR LIMITED	114,350	70.85	8,101,697.50	
	TATA POWER COMPANY LIMITED	63,864	85.90	5,485,917.60	
	GAIL INDIA LTD	33,977	330.55	11,231,097.35	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	84,540	1,834.15	155,059,041.00	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	18,790	1,356.05	25,480,179.50	
	LIC HOUSING FINANCE	18,050	540.85	9,762,342.50	
	BAJAJ FINANCE LTD	10,330	1,880.40	19,424,532.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	15,160	504.60	7,649,736.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	8,940	1,572.25	14,055,915.00	
	NTPC LIMITED	86,000	174.35	14,994,100.00	
小計	銘柄数：78			1,655,376,710.35	
				(2,714,817,804)	
	組入時価比率：8.1%			8.3%	
パキスタンルビー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	31,900	164.18	5,237,342.00	
	LUCKY CEMENT	7,800	653.18	5,094,804.00	
	HABIB BANK LTD	35,600	197.44	7,028,864.00	
	MCB BANK LIMITED	21,900	211.20	4,625,280.00	
	UNITED BANK LTD	24,200	195.65	4,734,730.00	
小計	銘柄数：5			26,721,020.00	
				(25,117,758)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
カタールリヤル	QATAR GAS TRANSPORT CO NAKILAT	13,040	14.63	190,775.20	
	INDUSTRIES QATAR	7,930	111.00	880,230.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	11,790	35.65	420,313.50	
	DOHA BANK LTD	6,730	27.57	185,546.10	
	MASRAF AL RAYAN	21,160	36.32	768,531.20	
	QATAR ISLAMIC BANK	3,580	108.00	386,640.00	
	QATAR NATIONAL BANK	12,356	153.00	1,890,468.00	
	QATAR INSURANCE CO	10,001	37.50	375,037.50	

	OOREDOO QSC	4,310	83.50	359,885.00	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	1,500	201.00	301,500.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	4,990	35.80	178,642.00	
	EZDAN HOLDING GROUP	44,190	11.61	513,045.90	
小計	銘柄数：12			6,450,614.40	
				(191,454,235)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
エジプトポンド	EASTERN TOBACCO	2,290	597.83	1,369,030.70	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	63,181	89.68	5,666,072.08	
	GLOBAL TELECOM HOLDING	95,560	5.17	494,045.20	
小計	銘柄数：3			7,529,147.98	
				(46,078,385)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	13,110	111.90	1,467,009.00	
	SASOL LTD	31,360	429.97	13,483,859.20	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,960	317.10	938,616.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	21,570	110.00	2,372,700.00	
	GOLD FIELDS LTD	44,630	48.09	2,146,256.70	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,100	280.00	868,000.00	
	SIBANYE GOLD LTD	80,600	11.37	916,422.00	
	MONDI LTD	5,750	337.51	1,940,682.50	
	SAPPI LIMITED	32,090	80.00	2,567,200.00	
	BIDVEST GROUP LTD	18,030	243.50	4,390,305.00	
	STEINHOFF INTERNATIONAL H NV	147,310	2.61	384,479.10	
	NASPERS LTD-N SHS	24,280	3,040.00	73,811,200.00	
	IMPERIAL HOLDINGS LTD	9,010	244.42	2,202,224.20	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	50,960	64.25	3,274,180.00	
	MR PRICE GROUP LTD	13,990	280.00	3,917,200.00	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	11,300	216.00	2,440,800.00	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	22,670	103.91	2,355,639.70	
	BID CORP LTD	19,200	273.00	5,241,600.00	
	PICKN PAY STORES LTD	17,600	76.00	1,337,600.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	24,980	247.00	6,170,060.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	10,860	209.14	2,271,260.40	
	PIONEER FOODS LTD	7,240	120.00	868,800.00	
	TIGER BRANDS LTD	8,700	387.75	3,373,425.00	

	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	69,273	29.21	2,023,464.33	
	NETCARE LTD	50,580	30.21	1,528,021.80	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	21,630	265.33	5,739,087.90	
	BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	39,740	180.00	7,153,200.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,030	864.31	1,754,549.30	
	NEDBANK GROUP LTD	12,320	301.00	3,708,320.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	72,870	224.50	16,359,315.00	
	FIRSTRAND LTD	187,310	68.47	12,825,115.70	
	PSG GROUP LTD	8,660	226.45	1,961,057.00	
	REMGRO LTD	29,770	229.25	6,824,772.50	
	RMB HOLDINGS LTD	36,200	80.29	2,906,498.00	
	DISCOVERY LTD	19,790	173.95	3,442,470.50	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,360	128.73	818,722.80	
	MMI HOLDINGS LTD	56,462	22.74	1,283,945.88	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	41.45	1,672,507.50	
	SANLAM LIMITED	81,700	81.68	6,673,256.00	
	TELKOM SA SOC LTD	15,970	57.00	910,290.00	
	MTN GROUP LTD	92,340	118.72	10,962,604.80	
	VODACOM GROUP	33,890	152.77	5,177,375.30	
	BRAIT SE	15,140	41.52	628,612.80	
	CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,450	78.74	822,833.00	
	INVESTEC LTD	15,640	98.19	1,535,691.60	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	19,770	136.90	2,706,513.00	
	小計銘柄数：46			238,157,743.51	
				(2,124,367,072)	
	組入時価比率：6.4%			6.5%	
U A E ディルハム	DUBAI INVESTMENTS PJSC	80,000	2.09	167,200.00	
	DXB ENTERTAINMENTS PJSC	118,900	0.43	52,197.10	
	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	119,870	7.02	841,487.40	
	DUBAI ISLAMIC BANK	57,522	5.43	312,344.46	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	74,683	12.50	933,537.50	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	99,980	17.25	1,724,655.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	177,340	2.08	368,867.20	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	100,980	2.98	300,920.40	

		EMAAR MALLS PJSC	89,700	2.14	191,958.00	
		EMAAR PROPERTIES PJSC	201,630	5.60	1,129,128.00	
	小計	銘柄数：10			6,022,295.06	
					(177,115,697)	
		組入時価比率：0.5%			0.5%	
	合計				32,547,256,165	
					(32,547,256,165)	

(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(2018年4月23日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	163,100	5,030,004.00		
		小計	銘柄数：1	163,100	5,030,004.00	
			組入時価比率：0.1%		(29,274,623)	19.7%
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	106,400	262,808.00		
		小計	銘柄数：1	106,400	262,808.00	
			組入時価比率：0.0%		(6,967,040)	4.7%
	ランド	FORTRESS REIT LTD-A	59,650	1,014,050.00		
		FORTRESS REIT LTD-B	37,910	625,894.10		
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	161,350	4,727,555.00		
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	13,650	1,558,284.00		
		REDEFINE PROPERTIES LTD	303,590	3,637,008.20		
		RESILIENT REIT LTD	15,092	1,018,710.00		
		小計	銘柄数：6	591,242	12,581,501.30	
		組入時価比率：0.3%		(112,226,991)	75.6%	
	合計			148,468,654		
			(148,468,654)			

(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	2018年 4月23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	734,719,311	-	726,423,180	8,296,131
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	37,621,894	-	37,739,600	117,706
米ドル	37,621,894	-	37,739,600	117,706
合計	-	-	-	8,178,425

(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。

米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2018年 4月23日現在)

資産の部

流動資産

(2018年 4月23日現在)

預金	54,862,833
コール・ローン	17,901,203
株式	3,385,522,102
投資信託受益証券	139,597,828
投資証券	63,172,844
派生商品評価勘定	245,307
未収配当金	6,046,371
差入委託証拠金	5,455,841
流動資産合計	3,672,804,329
資産合計	3,672,804,329
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	633,021
未払金	50,924,928
未払利息	32
その他未払費用	218,800
流動負債合計	51,776,781
負債合計	51,776,781
純資産の部	
元本等	
元本	3,322,959,456
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	298,068,092
元本等合計	3,621,027,548
純資産合計	3,621,027,548
負債純資産合計	3,672,804,329

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>投資信託受益証券</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>市場価格のない有価証券については基準価額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	受取配当金

	<p>（株式、投資証券） 受取配当金は、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） 受取配当金は、投資信託受益証券の収益分配金を、原則として収益分配金落の売買が行なわれる日において、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）

2018年 4月23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	1.0897円
(10,000口当たり純資産額)	(10,897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 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日
<p>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。</p> <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。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</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

2018年 4月23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。
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

2018年 4月23日現在	
期首	2017年 4月25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	307,488,717円
同期中における追加設定元本額	3,374,055,091円
同期中における一部解約元本額	358,584,352円
期末元本額	3,322,959,456円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・米国株式配当貴族	2,123,792,218円
野村インデックスファンド・米国株式配当貴族・為替ヘッジ型	1,181,568,465円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,248,334円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,171,217円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,323,515円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,132,319円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,723,388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(2018年4月23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	CHEVRON CORP	4,940	122.31	604,211.40	
		EXXON MOBIL CORP	7,332	79.00	579,228.00	
		AIR PRODUCTS	3,800	166.27	631,826.00	
		ECOLAB INC	4,727	148.55	702,195.85	
		PPG INDUSTRIES	5,458	108.87	594,212.46	
		PRAXAIR INC	4,035	150.68	607,993.80	
		SHERWIN-WILLIAMS	1,512	392.39	593,293.68	
		NUCOR CORP	9,410	63.55	598,005.50	
		GENERAL DYNAMICS	2,960	223.11	660,405.60	
		SMITH (A.O.) CORP	9,720	65.27	634,424.40	
		EMERSON ELEC	8,940	70.20	627,588.00	
		3M CORP	2,621	217.75	570,722.75	
		ROPER TECHNOLOGIES INC	2,348	282.14	662,464.72	
		DOVER CORP	6,195	96.02	594,843.90	
		ILLINOIS TOOL WORKS INC	3,736	158.29	591,371.44	
		PENTAIR PLC	8,840	70.45	622,778.00	
		STANLEY BLACK & DECKER INC	3,805	144.21	548,719.05	
		GRAINGER(W.W.) INC	2,387	288.40	688,410.80	
		CINTAS CORP	3,935	173.12	681,227.20	
		LEGGETT & PLATT INC	13,710	42.90	588,159.00	
		V F CORP	8,017	77.50	621,317.50	
		MCDONALD'S CORP	3,686	158.77	585,226.22	
		GENUINE PARTS CO	6,088	87.75	534,222.00	
TARGET CORP	8,442	70.32	593,641.44			
LOWES COS INC	6,082	83.62	508,576.84			
SYSCO CORP	10,190	61.15	623,118.50			
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,390	63.92	536,288.80			

	WALMART INC	6,136	86.98	533,709.28	
	BROWN-FORMAN CORP-CL B	11,790	54.49	642,437.10	
	COCA COLA CO	13,570	43.74	593,551.80	
	PEPSICO INC	5,358	102.48	549,087.84	
	ARCHER DANIELS MIDLAND	15,150	45.50	689,325.00	
	HORMEL FOODS CORP	18,880	35.45	669,296.00	
	MCCORMICK & CO INC.	6,485	103.24	669,511.40	
	CLOROX CO	4,563	114.88	524,197.44	
	COLGATE PALMOLIVE CO.	8,450	67.52	570,544.00	
	KIMBERLY-CLARK CORP	5,422	100.03	542,362.66	
	PROCTER & GAMBLE CO	7,350	73.80	542,430.00	
	ABBOTT LABORATORIES	10,520	59.19	622,678.80	
	BECTON, DICKINSON	2,720	232.88	633,433.60	
	MEDTRONIC PLC	7,569	79.90	604,763.10	
	CARDINAL HEALTH INC	8,690	62.07	539,388.30	
	ABBVIE INC	6,152	92.60	569,675.20	
	JOHNSON & JOHNSON	4,569	126.66	578,709.54	
	AFLAC INC	14,681	45.28	664,755.68	
	CINCINNATI FINANCIAL CORP	8,404	75.27	632,569.08	
	AUTOMATIC DATA PROCESS	5,371	116.84	627,547.64	
	AT & T INC	17,530	34.67	607,765.10	
	CONSOLIDATED EDISON INC	8,173	77.60	634,224.80	
	FRANKLIN RESOURCES INC	14,260	34.04	485,410.40	
	S&P GLOBAL INC	3,545	192.96	684,043.20	
	T ROWE PRICE GROUP INC	5,515	108.44	598,046.60	
	小計 銘柄数：52			31,393,936.41	
				(3,385,522,102)	
	組入時価比率：93.5%			100.0%	
	合計			3,385,522,102	
				(3,385,522,102)	

(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(2018年4月23日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	PROSHARES S&P 500 DIV ARISTO CRATS ETF	20,775	1,294,490.25	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：3.9%	20,775	1,294,490.25 (139,597,828) 68.8%	
	合計			139,597,828 (139,597,828)	
投資証券	米ドル	FEDERAL REALTY INVS TRUST	5,268	585,801.60	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：1.7%	5,268	585,801.60 (63,172,844) 31.2%	
	合計			63,172,844 (63,172,844)	
合計				202,770,672 (202,770,672)	

(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	2018年 4月23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	29,232,189	-	28,809,456	422,733
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	13,950,532	-	13,985,551	35,019
米ドル	13,950,532	-	13,985,551	35,019
合計	-	-	-	387,714

(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。

国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2018年 4月23日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,605,671,940
国債証券	535,455,314,210
地方債証券	44,406,576,157
特殊債証券	56,313,306,479
社債証券	28,686,015,810
未収入金	1,003,760,000
未収利息	1,219,825,988
前払費用	6,124,511
流動資産合計	669,696,595,095
資産合計	669,696,595,095
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,114,361,296
未払利息	4,715
流動負債合計	1,114,366,011
負債合計	1,114,366,011
純資産の部	
元本等	
元本	510,311,647,515
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	158,270,581,569
元本等合計	668,582,229,084
純資産合計	668,582,229,084
負債純資産合計	669,696,595,095

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、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。
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）

2018年 4月23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	1.3101円
(10,000口当たり純資産額)	(13,101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 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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

2018年 4月23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、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

2018年 4月23日現在		2017年 4月25日
期首		2017年 4月25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		528,128,160,566円
同期中における追加設定元本額		64,529,213,858円
同期中における一部解約元本額		82,345,726,909円
期末元本額		510,311,647,515円
期末元本額の内訳*		
野村国内債券インデックスファンド		443,477,754円
野村世界6資産分散投信(安定コース)		20,792,957,319円
野村世界6資産分散投信(分配コース)		17,655,052,426円
野村世界6資産分散投信(成長コース)		2,478,674,778円
野村資産設計ファンド2015		417,426,916円
野村資産設計ファンド2020		322,143,459円
野村資産設計ファンド2025		258,629,493円
野村資産設計ファンド2030		170,137,146円
野村資産設計ファンド2035		87,364,535円
野村資産設計ファンド2040		145,082,177円
野村日本債券インデックスファンド		1,053,994,191円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)		248,074,589,968円
のむラップ・ファンド(保守型)		11,372,150,394円
のむラップ・ファンド(普通型)		6,472,230,191円
のむラップ・ファンド(積極型)		820,459,482円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)		11,490,663,934円
野村資産設計ファンド2045		13,402,244円
野村円債投資インデックスファンド		1,554,702,188円
野村インデックスファンド・国内債券		2,618,949,057円
マイ・ロード		37,978,129,114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		556,277,651円
野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)		37,642,351円
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)		5,016,014,379円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)		1,343,327,288円
野村資産設計ファンド2050		14,920,367円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型		11,459,175円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型		2,989,487円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型		2,012,878円

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,174,905円
のむラップ・ファンド(やや保守型)	595,090,109円
のむラップ・ファンド(やや積極型)	106,583,281円
インデックス・ブレンド(タイプ)	24,864,901円
インデックス・ブレンド(タイプ)	22,076,483円
インデックス・ブレンド(タイプ)	37,827,958円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,702,784円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,110,278円
野村6資産均等バランス	67,523,635円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信	121,896,600円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	2,450,992,699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)	785,076,793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)	236,816,578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)	3,866,117,478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)	1,575,536,985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)	18,019,879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)	17,935,905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)	1,344,772円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	5,519,118,251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)	129,046,222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)	703,419,316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)	778,287,580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)	402,230,534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)	379,195,376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)	885,530,827円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,684,466,343円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	917,370,236円
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券(適格機関投資家専用)	451,856,905円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	14,363,102,956円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	21,743,478,862円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	9,818,598,189円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合(確定拠出年金向け)	43,322,467,473円
マイバランスDC30	9,421,953,601円
マイバランスDC50	6,235,748,379円
マイバランスDC70	2,023,484,084円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	10,043,958,019円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	216,952,840円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	49,302,639円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	57,004,441円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	8,820,504円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	2,814,726円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	1,174,381円
野村資産設計ファンド(DC)2030	694,178円
野村資産設計ファンド(DC)2040	461,065円
野村資産設計ファンド(DC)2050	488,765円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	2,055,585円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	540,080円

マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	173,491円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	299,302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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2018年4月23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378回	1,000,000,000	1,002,930,000	
		国庫債券 利付(2年)第379回	2,000,000,000	2,006,280,000	
		国庫債券 利付(2年)第380回	5,000,000,000	5,016,700,000	
		国庫債券 利付(5年)第118回	4,000,000,000	4,015,240,000	
		国庫債券 利付(5年)第120回	5,500,000,000	5,525,520,000	
		国庫債券 利付(5年)第121回	3,500,000,000	3,511,305,000	
		国庫債券 利付(5年)第122回	9,800,000,000	9,836,554,000	
		国庫債券 利付(5年)第123回	7,300,000,000	7,330,587,000	
		国庫債券 利付(5年)第124回	5,100,000,000	5,123,664,000	
		国庫債券 利付(5年)第125回	7,200,000,000	7,237,296,000	
		国庫債券 利付(5年)第126回	5,500,000,000	5,531,460,000	
		国庫債券 利付(5年)第127回	6,000,000,000	6,036,660,000	
		国庫債券 利付(5年)第128回	6,200,000,000	6,242,160,000	
		国庫債券 利付(5年)第129回	6,000,000,000	6,043,020,000	
		国庫債券 利付(5年)第130回	5,000,000,000	5,037,600,000	
		国庫債券 利付(5年)第131回	4,000,000,000	4,031,320,000	
		国庫債券 利付(5年)第132回	7,000,000,000	7,058,380,000	
		国庫債券 利付(5年)第133回	5,000,000,000	5,043,100,000	
		国庫債券 利付(5年)第134回	1,000,000,000	1,009,350,000	
		国庫債券 利付(5年)第135回	1,000,000,000	1,009,600,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	1,960,000,000	2,829,338,400			

国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,255,734,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,261,917,000	
国庫債券 利付(40年)第4回	1,300,000,000	1,831,258,000	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,300,000,000	1,763,047,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	1,500,000,000	1,993,680,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,778,700,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,700,000,000	1,999,132,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	2,000,000,000	1,707,720,000	
国庫債券 利付(40年)第10回	1,800,000,000	1,818,324,000	
国庫債券 利付(10年)第301回	1,500,000,000	1,528,230,000	
国庫債券 利付(10年)第302回	700,000,000	712,369,000	
国庫債券 利付(10年)第303回	2,300,000,000	2,349,703,000	
国庫債券 利付(10年)第304回	1,000,000,000	1,020,200,000	
国庫債券 利付(10年)第305回	4,100,000,000	4,197,211,000	
国庫債券 利付(10年)第306回	3,000,000,000	3,087,180,000	
国庫債券 利付(10年)第307回	1,700,000,000	1,746,155,000	
国庫債券 利付(10年)第308回	1,700,000,000	1,752,105,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	3,000,000,000	3,078,990,000	
国庫債券 利付(10年)第310回	3,700,000,000	3,799,493,000	
国庫債券 利付(10年)第311回	1,800,000,000	1,839,726,000	
国庫債券 利付(10年)第312回	4,950,000,000	5,123,299,500	
国庫債券 利付(10年)第313回	3,200,000,000	3,331,328,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	2,200,000,000	2,277,462,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	3,600,000,000	3,749,796,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	1,400,000,000	1,453,830,000	

国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,874,754,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,321,984,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,932,140,000	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,642,555,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,337,856,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,493,984,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	2,700,000,000	2,812,590,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,320,096,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,400,000,000	4,574,196,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,178,036,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,229,704,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,000,000,000	5,169,800,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,542,740,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	3,980,462,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,969,597,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	5,400,000,000	5,605,362,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	4,200,000,000	4,365,438,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	4,100,000,000	4,265,804,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	3,700,000,000	3,830,758,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	1,700,000,000	1,761,829,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	1,700,000,000	1,739,134,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	3,400,000,000	3,503,530,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第339回	4,400,000,000	4,537,236,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	4,500,000,000	4,641,885,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	4,700,000,000	4,817,124,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	6,000,000,000	6,054,540,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	5,900,000,000	5,950,504,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,846,284,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	6,800,000,000	6,849,912,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	5,800,000,000	5,838,628,000	
国庫債券 利付(10年)第347回	6,800,000,000	6,843,384,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	5,500,000,000	5,533,495,000	
国庫債券 利付(10年)第349回	3,500,000,000	3,518,480,000	
国庫債券 利付(10年)第350回	1,500,000,000	1,506,645,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	130,300,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	252,870,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	201,014,400	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,205,406,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	188,808,000	
国庫債券 利付(30年)第6回	700,000,000	904,085,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	769,776,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	121,887,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	65,000,000	75,513,750	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	279,722,500	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	193,166,400	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	279,131,600	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	363,987,700	
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	1,054,976,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,203,201,000	

国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,225,917,000	
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,592,148,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	1,500,000,000	1,968,315,000	
国庫債券 利付(30年)第19回	1,600,000,000	2,103,168,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	1,900,000,000	2,563,860,000	
国庫債券 利付(30年)第21回	1,400,000,000	1,844,724,000	
国庫債券 利付(30年)第22回	600,000,000	812,520,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	840,000,000	1,139,510,400	
国庫債券 利付(30年)第24回	700,000,000	951,188,000	
国庫債券 利付(30年)第25回	500,000,000	662,610,000	
国庫債券 利付(30年)第26回	850,000,000	1,143,709,000	
国庫債券 利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,118,974,000	
国庫債券 利付(30年)第28回	1,200,000,000	1,644,816,000	
国庫債券 利付(30年)第29回	1,500,000,000	2,035,245,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	1,700,000,000	2,281,213,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	1,600,000,000	2,121,824,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	1,900,000,000	2,564,962,000	
国庫債券 利付(30年)第33回	2,100,000,000	2,712,801,000	
国庫債券 利付(30年)第34回	2,100,000,000	2,810,472,000	
国庫債券 利付(30年)第35回	2,300,000,000	2,988,436,000	
国庫債券 利付(30年)第36回	2,300,000,000	2,994,991,000	
国庫債券 利付(30年)第37回	2,300,000,000	2,952,211,000	
国庫債券 利付(30年)第38回	1,900,000,000	2,401,752,000	
国庫債券 利付(30年)第39回	1,600,000,000	2,061,328,000	
国庫債券 利付(30年)第40回	1,100,000,000	1,392,523,000	
国庫債券 利付(30年)第41回	1,500,000,000	1,864,755,000	
国庫債券 利付(30年)第42回	1,200,000,000	1,492,560,000	
国庫債券 利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,617,772,000	
国庫債券 利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,743,070,000	
国庫債券 利付(30年)第45回	1,900,000,000	2,274,642,000	
国庫債券 利付(30年)第46回	1,800,000,000	2,157,732,000	
国庫債券 利付(30年)第47回	1,900,000,000	2,324,631,000	
国庫債券 利付(30年)第48回	1,900,000,000	2,231,474,000	
国庫債券 利付(30年)第49回	1,800,000,000	2,113,974,000	
国庫債券 利付(30年)第50回	1,600,000,000	1,637,344,000	
国庫債券 利付(30年)第51回	1,800,000,000	1,611,702,000	

国庫債券	利付（30年）第52回	1,900,000,000	1,795,063,000
国庫債券	利付（30年）第53回	1,700,000,000	1,647,623,000
国庫債券	利付（30年）第54回	1,700,000,000	1,734,595,000
国庫債券	利付（30年）第55回	1,800,000,000	1,834,686,000
国庫債券	利付（30年）第56回	1,500,000,000	1,527,255,000
国庫債券	利付（30年）第57回	1,300,000,000	1,322,178,000
国庫債券	利付（20年）第43回	400,000,000	417,064,000
国庫債券	利付（20年）第44回	150,000,000	157,503,000
国庫債券	利付（20年）第45回	242,000,000	253,645,040
国庫債券	利付（20年）第46回	90,000,000	94,518,900
国庫債券	利付（20年）第47回	1,230,000,000	1,298,757,000
国庫債券	利付（20年）第48回	200,000,000	213,940,000
国庫債券	利付（20年）第49回	200,000,000	212,888,000
国庫債券	利付（20年）第50回	183,000,000	193,725,630
国庫債券	利付（20年）第51回	310,000,000	330,714,200
国庫債券	利付（20年）第52回	100,000,000	107,560,000
国庫債券	利付（20年）第53回	250,000,000	270,175,000
国庫債券	利付（20年）第54回	250,000,000	271,090,000
国庫債券	利付（20年）第55回	231,000,000	249,962,790
国庫債券	利付（20年）第56回	120,000,000	130,455,600
国庫債券	利付（20年）第57回	210,000,000	227,421,600
国庫債券	利付（20年）第58回	180,000,000	195,841,800
国庫債券	利付（20年）第59回	230,000,000	249,244,100
国庫債券	利付（20年）第60回	780,000,000	834,319,200
国庫債券	利付（20年）第61回	300,000,000	316,098,000
国庫債券	利付（20年）第62回	440,000,000	460,152,000
国庫債券	利付（20年）第63回	300,000,000	329,268,000
国庫債券	利付（20年）第64回	400,000,000	442,876,000
国庫債券	利付（20年）第65回	455,000,000	505,887,200
国庫債券	利付（20年）第66回	300,000,000	331,848,000
国庫債券	利付（20年）第67回	310,000,000	346,084,000
国庫債券	利付（20年）第68回	290,000,000	328,912,200
国庫債券	利付（20年）第69回	560,000,000	631,635,200
国庫債券	利付（20年）第70回	540,000,000	621,847,800
国庫債券	利付（20年）第71回	200,000,000	227,846,000
国庫債券	利付（20年）第72回	670,000,000	762,567,200

国庫債券 利付(20年)第73回	1,600,000,000	1,818,384,000	
国庫債券 利付(20年)第74回	1,300,000,000	1,486,121,000	
国庫債券 利付(20年)第75回	600,000,000	688,854,000	
国庫債券 利付(20年)第76回	910,000,000	1,032,167,500	
国庫債券 利付(20年)第77回	700,000,000	798,819,000	
国庫債券 利付(20年)第78回	800,000,000	911,008,000	
国庫債券 利付(20年)第79回	860,000,000	985,499,800	
国庫債券 利付(20年)第80回	900,000,000	1,037,790,000	
国庫債券 利付(20年)第81回	360,000,000	414,082,800	
国庫債券 利付(20年)第82回	820,000,000	949,273,000	
国庫債券 利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,592,666,100	
国庫債券 利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,385,832,000	
国庫債券 利付(20年)第85回	400,000,000	466,924,000	
国庫債券 利付(20年)第86回	1,400,000,000	1,656,382,000	
国庫債券 利付(20年)第87回	500,000,000	587,610,000	
国庫債券 利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,306,811,000	
国庫債券 利付(20年)第89回	470,000,000	554,529,500	
国庫債券 利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,775,880,000	
国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	298,080,000	
国庫債券 利付(20年)第92回	1,550,000,000	1,828,535,000	
国庫債券 利付(20年)第93回	300,000,000	352,464,000	
国庫債券 利付(20年)第94回	200,000,000	236,752,000	
国庫債券 利付(20年)第95回	700,000,000	844,662,000	
国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	475,364,000	
国庫債券 利付(20年)第97回	1,300,000,000	1,563,107,000	
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	357,906,000	
国庫債券 利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,514,834,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,841,069,600	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	307,730,000	
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	617,760,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	735,264,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	482,104,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,297,233,000	

回			
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	487,760,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	363,828,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,906,624,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,075,275,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,337,963,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	984,760,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,195,874,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,446,920,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	1,700,000,000	2,085,679,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	1,500,000,000	1,857,540,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,366,057,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,400,000,000	1,722,224,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	610,770,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	958,120,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	938,448,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	1,700,000,000	2,061,063,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,320,242,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	1,500,000,000	1,859,790,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,227,460,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,129,932,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,230,250,000	

国庫債券 利付(20年)第127回	800,000,000	974,104,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,300,000,000	1,585,259,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	800,000,000	965,280,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	1,600,000,000	1,934,208,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	956,664,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,557,114,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,696,604,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,699,516,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	839,741,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	830,298,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,201,490,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	939,264,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	700,000,000	831,446,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,767,567,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	1,700,000,000	2,047,021,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	1,250,000,000	1,523,900,000	
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,548,781,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,500,000,000	1,765,560,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,600,000,000	3,138,954,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	2,900,000,000	3,505,549,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	2,500,000,000	2,985,950,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,700,000,000	3,184,488,000	

	回			
	国庫債券 利付(20年)第149回	2,400,000,000	2,832,792,000	
	国庫債券 利付(20年)第150回	2,430,000,000	2,830,245,300	
	国庫債券 利付(20年)第151回	2,700,000,000	3,061,152,000	
	国庫債券 利付(20年)第152回	2,900,000,000	3,285,468,000	
	国庫債券 利付(20年)第153回	2,450,000,000	2,812,967,500	
	国庫債券 利付(20年)第154回	3,000,000,000	3,393,300,000	
	国庫債券 利付(20年)第155回	2,800,000,000	3,071,964,000	
	国庫債券 利付(20年)第156回	2,900,000,000	2,880,744,000	
	国庫債券 利付(20年)第157回	3,200,000,000	3,063,168,000	
	国庫債券 利付(20年)第158回	2,800,000,000	2,821,392,000	
	国庫債券 利付(20年)第159回	2,700,000,000	2,762,559,000	
	国庫債券 利付(20年)第160回	2,600,000,000	2,701,452,000	
	国庫債券 利付(20年)第161回	2,400,000,000	2,446,224,000	
	国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,728,526,000	
	国庫債券 利付(20年)第163回	1,900,000,000	1,928,823,000	
	メキシコ合衆国 第22回円貨社債(2016)	300,000,000	303,756,000	
	ポーランド共和国 第15回円貨債券(2013)	100,000,000	100,860,000	
	小計	銘柄数: 260 組入時価比率: 80.1%	489,721,000,000 535,455,314,210 80.5%	
	合計		535,455,314,210	
地方債証券	日本円	東京都 公募第671回	100,000,000	101,609,000
		東京都 公募第685回	100,000,000	102,369,000
		東京都 公募第690回	200,000,000	206,684,000

東京都 公募第703回	100,000,000	103,530,000	
東京都 公募第707回	100,000,000	103,273,000	
東京都 公募第708回	100,000,000	103,593,000	
東京都 公募第710回	100,000,000	103,261,000	
東京都 公募第712回	100,000,000	103,259,000	
東京都 公募第715回	100,000,000	103,396,000	
東京都 公募第716回	200,000,000	206,886,000	
東京都 公募第731回	100,000,000	103,358,000	
東京都 公募第745回	300,000,000	309,342,000	
東京都 公募第760回	100,000,000	99,210,000	
東京都 公募第761回	100,000,000	99,460,000	
東京都 公募第769回	500,000,000	502,025,000	
東京都 公募（30年）第7回	100,000,000	133,867,000	
東京都 公募第10回	200,000,000	261,662,000	
東京都 公募第1回	300,000,000	323,163,000	
東京都 公募（20年）第3回	200,000,000	225,828,000	
東京都 公募第7回	100,000,000	115,188,000	
東京都 公募（20年）第16回	200,000,000	237,164,000	
東京都 公募（20年）第17回	200,000,000	238,830,000	
東京都 公募第23回	100,000,000	122,049,000	
東京都 公募（20年）第26回	100,000,000	118,425,000	
北海道 公募平成21年度第6回	100,000,000	102,115,000	
北海道 公募平成21年度第10回	100,000,000	102,347,000	
北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	103,433,000	
北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	103,339,000	
北海道 公募平成25年度第1回	300,000,000	307,818,000	
北海道 公募（5年）平成26年度第8回	200,000,000	200,420,000	
北海道 公募（5年）平成26年度第10回	100,000,000	100,187,000	
北海道 公募平成27年度第7回	100,000,000	102,903,000	
北海道 公募平成28年度第13回	200,000,000	199,832,000	
北海道 公募平成29年度第5回	200,000,000	199,638,000	
北海道 公募平成29年度第6回	700,000,000	698,803,000	
宮城県 公募第32回2号	100,000,000	99,538,000	
神奈川県 公募第184回	100,000,000	103,134,000	
神奈川県 公募第188回	200,000,000	207,868,000	

神奈川県 公募第196回	100,000,000	103,074,000	
神奈川県 公募第200回	100,000,000	104,125,000	
神奈川県 公募第205回	100,000,000	103,467,000	
神奈川県 公募第206回	100,000,000	103,485,000	
神奈川県 公募第210回	200,000,000	204,710,000	
神奈川県 公募(30年)第3回	100,000,000	135,446,000	
神奈川県 公募第7回	300,000,000	353,943,000	
大阪府 公募第337回	200,000,000	205,674,000	
大阪府 公募第346回	100,000,000	103,373,000	
大阪府 公募第356回	100,000,000	103,766,000	
大阪府 公募第378回	104,000,000	107,594,240	
大阪府 公募第381回	100,000,000	103,484,000	
大阪府 公募第382回	100,000,000	103,479,000	
大阪府 公募第383回	100,000,000	103,618,000	
大阪府 公募第384回	100,000,000	103,487,000	
大阪府 公募第387回	300,000,000	307,965,000	
大阪府 公募第389回	100,000,000	102,752,000	
大阪府 公募第417回	102,000,000	102,603,840	
大阪府 公募第5回	100,000,000	121,427,000	
大阪府 公募第8回	100,000,000	118,726,000	
大阪府 公募(5年)第130回	600,000,000	599,436,000	
大阪府 公募(5年)第137回	1,024,000,000	1,022,074,880	
大阪府 公募(5年)第141回	230,000,000	229,510,100	
京都府 公募平成24年度第2回	100,000,000	103,633,000	
京都府 公募平成24年度第6回	100,000,000	103,410,000	
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	114,738,000	
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	206,038,000	
兵庫県 公募平成21年度第13回	100,000,000	101,786,000	
兵庫県 公募平成21年度第25回	100,000,000	102,382,000	
兵庫県 公募平成22年度第1回	100,000,000	102,831,000	
兵庫県 公募平成26年度第17回	100,000,000	102,378,000	
兵庫県 公募(30年)第2回	100,000,000	131,652,000	
兵庫県 公募(15年)第1回	300,000,000	336,825,000	
兵庫県 公募(15年)第3回	100,000,000	110,272,000	
兵庫県 公募(12年)第3回	300,000,000	309,351,000	
兵庫県 公募第2回	100,000,000	119,916,000	

兵庫県	公募第9回	100,000,000	121,810,000	
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	117,430,000	
静岡県	公募平成21年度第2回	100,000,000	101,898,000	
静岡県	公募平成21年度第7回	100,000,000	102,402,000	
静岡県	公募平成24年度第5回	100,060,000	103,508,067	
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	103,077,000	
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	105,608,630	
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	170,941,650	
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	103,027,000	
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	205,998,000	
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	115,164,584	
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	298,569,000	
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	118,335,000	
静岡県	公募(20年)第14回	100,000,000	118,212,000	
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	118,771,000	
愛知県	公募平成21年度第3回	114,000,000	116,181,960	
愛知県	公募平成21年度第17回	100,000,000	102,547,000	
愛知県	公募平成22年度第3回	100,000,000	102,793,000	
愛知県	公募平成22年度第9回	100,000,000	102,736,000	
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	103,720,000	
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	103,780,000	
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	117,528,000	
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	442,564,000	
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	119,795,000	
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	122,599,000	
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	113,337,000	
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	102,603,000	
広島県	公募平成22年度第6回	300,000,000	310,170,000	
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	103,535,000	
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	208,000,000	
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	111,344,092	
埼玉県	公募平成21年度第5回	100,000,000	101,965,000	
埼玉県	公募平成22年度第2回	200,000,000	205,596,000	
埼玉県	公募平成24年度第4回	300,000,000	310,257,000	
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	104,534,000	

埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	153,974,760
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	103,467,000
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	103,425,000
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	103,567,000
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	205,928,000
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	410,104,000
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	102,236,000
福岡県	公募平成22年度第5回	100,000,000	102,287,000
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	103,487,000
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	103,494,000
福岡県	公募平成26年度第4回	100,000,000	100,149,000
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	310,104,000
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	111,251,000
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	135,582,000
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	122,882,000
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	118,875,000
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	116,878,000
千葉県	公募平成21年度第11回	180,000,000	184,392,000
千葉県	公募平成24年度第1回	100,000,000	104,047,000
千葉県	公募平成24年度第2回	100,000,000	103,565,000
千葉県	公募平成24年度第7回	100,000,000	103,259,000
千葉県	公募平成24年度第8回	100,000,000	103,789,000
千葉県	公募平成25年度第3回	100,000,000	104,328,000
千葉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	104,531,000
千葉県	公募平成26年度第3回	200,000,000	206,544,000
千葉県	公募(20年)第8回	100,000,000	121,898,000
千葉県	公募(20年)第17回	100,000,000	113,938,000
新潟県	公募平成21年度第2回	150,000,000	153,639,000
群馬県	公募第8回	100,000,000	103,607,000
群馬県	公募第12回	100,000,000	102,891,000
群馬県	公募(20年)第3回	100,000,000	117,498,000
岐阜県	公募平成26年度第1回	186,670,000	192,212,232
大分県	公募平成23年度第1回	902,000,000	932,911,540

共同発行市場地方債 公募第74回	500,000,000	508,350,000	
共同発行市場地方債 公募第75回	310,000,000	315,849,700	
共同発行市場地方債 公募第82回	300,000,000	307,320,000	
共同発行市場地方債 公募第84回	500,000,000	512,960,000	
共同発行市場地方債 公募第85回	100,000,000	102,822,000	
共同発行市場地方債 公募第88回	100,000,000	102,565,000	
共同発行市場地方債 公募第89回	100,000,000	102,361,000	
共同発行市場地方債 公募第92回	110,000,000	112,847,900	
共同発行市場地方債 公募第93回	300,000,000	309,777,000	
共同発行市場地方債 公募第94回	300,000,000	310,005,000	
共同発行市場地方債 公募第96回	100,000,000	103,677,000	
共同発行市場地方債 公募第101回	300,000,000	310,260,000	
共同発行市場地方債 公募第102回	150,000,000	155,154,000	
共同発行市場地方債 公募第103回	100,000,000	103,416,000	
共同発行市場地方債 公募第104回	200,000,000	207,214,000	
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	207,596,000	
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	206,966,000	
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	207,118,000	
共同発行市場地方債 公募第112回	100,000,000	103,419,000	
共同発行市場地方債 公募第113回	800,000,000	825,296,000	
共同発行市場地方債 公募第114回	243,700,000	252,078,406	
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	103,418,000	
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	206,966,000	
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	103,765,000	
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	207,256,000	
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	309,273,000	

共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	102,606,000	
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	411,540,000	
共同発行市場地方債 公募第124回	100,000,000	104,479,000	
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	104,054,000	
共同発行市場地方債 公募第128回	300,000,000	309,852,000	
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	103,616,000	
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	103,929,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	103,453,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	206,544,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	205,994,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	159,499,650	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	552,771,000	
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,020,920,000	
共同発行市場地方債 公募第156回	100,000,000	99,678,000	
共同発行市場地方債 公募第157回	100,000,000	99,517,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	119,946,000	
堺市 公募平成22年度第2回	100,000,000	103,273,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	118,683,000	
島根県 公募平成22年度第1回	100,000,000	102,722,000	
島根県 公募平成28年度第3回	100,000,000	99,915,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	205,246,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,236,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	145,724,660	
栃木県 公募平成24年度第1回	100,000,000	103,447,000	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,236,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	241,770,100	

奈良県	公募平成28年度第1回	100,000,000	99,914,000	
浜松市	公募平成26年度第1回	100,000,000	101,576,000	
大阪市	公募平成21年度第6回	100,000,000	102,450,000	
大阪市	公募平成25年度第6回	100,000,000	103,498,000	
大阪市	公募平成26年度第5回	100,000,000	103,215,000	
大阪市	公募(5年)平成28年度第5回	100,000,000	99,914,000	
大阪市	公募(15年)第1回	100,000,000	113,119,000	
大阪市	公募(20年)第5回	100,000,000	122,843,000	
大阪市	公募(20年)第6回	100,000,000	120,539,000	
大阪市	公募(20年)第17回	100,000,000	118,218,000	
名古屋市	公募第469回	100,000,000	102,173,000	
名古屋市	公募第478回	100,000,000	103,985,000	
名古屋市	公募第481回	100,000,000	103,274,000	
名古屋市	公募第488回	300,000,000	309,711,000	
名古屋市	公募(12年)第1回	200,000,000	213,184,000	
名古屋市	公募(15年)第2回	100,000,000	106,938,000	
京都市	公募平成23年度第4回	100,000,000	103,817,000	
京都市	公募(20年)第2回	100,000,000	114,725,000	
京都市	公募(20年)第13回	100,000,000	113,306,000	
神戸市	公募平成21年度第7回	100,000,000	101,922,000	
神戸市	公募平成26年度第17回	300,000,000	303,627,000	
神戸市	公募平成28年度第1回	200,000,000	199,036,000	
横浜市	公募平成21年度第4回	200,000,000	203,722,000	
横浜市	公募平成22年度第5回	100,000,000	103,252,000	
横浜市	公募公債平成24年度2回	200,000,000	206,938,000	
横浜市	公募公債平成25年度1回	200,000,000	206,192,000	
横浜市	公募公債平成25年度5回	200,000,000	206,546,000	
横浜市	公募公債平成26年度5回	200,000,000	204,962,000	
横浜市	公募平成28年度第5回	300,000,000	301,302,000	
横浜市	公募(20年)第26回	100,000,000	119,020,000	
横浜市	公募(20年)第30回	100,000,000	113,548,000	
札幌市	公募平成22年度第4回	100,000,000	102,196,000	
札幌市	公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	119,372,000	
札幌市	公募平成26年度第4回	100,000,000	102,787,000	
札幌市	公募平成26年度第9回	200,000,000	204,432,000	

	川崎市 公募第82回	100,000,000	102,101,000	
	川崎市 公募第85回	100,000,000	103,162,000	
	川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	115,587,000	
	北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	118,322,000	
	福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	115,318,000	
	福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,874,000	
	福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	164,012,800	
	広島市 公募平成21年度第3回	100,000,000	102,191,000	
	広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	102,393,000	
	広島市 公募平成27年度第2回	500,000,000	512,875,000	
	千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	104,047,000	
	三重県 公募平成24年度第1回	140,660,000	145,474,791	
	鹿児島県 公募(5年)平成28年度第1回	100,000,000	99,916,000	
	福井県 公募平成22年度第2回	100,000,000	104,112,000	
	福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	102,032,000	
	福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	199,112,000	
	徳島県 公募平成22年度第1回	400,000,000	410,620,000	
	山梨県 公募平成21年度第1回	100,000,000	102,036,000	
	山梨県 公募平成24年度第1回	200,000,000	206,848,000	
	岡山県 公募平成21年度第2回	100,000,000	102,633,000	
	岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	169,195,575	
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	100,000,000	120,885,000	
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	300,000,000	365,265,000	
	福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	119,813,000	
	福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	104,801,000	
小計	銘柄数:254 組入時価比率:6.6%	42,285,240,000	44,406,576,157	6.7%
合計			44,406,576,157	
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	100,000,000	101,931,000
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	156,362,010

新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	199,805,100	
新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	108,033,000	
日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	111,355,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第26回	100,000,000	100,640,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	309,651,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	107,831,000	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	300,417,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第9回	141,000,000	144,478,470	
日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	105,753,600	
日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000	164,237,460	
日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	300,426,000	
道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	320,556,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第344回	200,000,000	207,262,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第4回	100,000,000	133,266,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第8回	200,000,000	235,632,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第17回	100,000,000	117,915,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回	200,000,000	239,524,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第33回	200,000,000	300,516,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第39回	100,000,000	121,388,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回	100,000,000	122,713,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第80回	100,000,000	103,821,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第84回	400,000,000	415,032,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	206,884,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第89回	100,000,000	117,247,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第102回	100,000,000	102,939,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第103回	350,000,000	411,456,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回	100,000,000	119,923,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第127回	300,000,000	300,567,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第130回	200,000,000	205,316,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第134回	200,000,000	204,936,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第136回	200,000,000	205,758,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第145回	300,000,000	344,997,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第149回	100,000,000	116,889,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第173回	100,000,000	84,479,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6回	100,000,000	105,498,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第9回	100,000,000	105,647,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	242,106,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	200,000,000	242,548,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第98回	300,000,000	307,086,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	200,000,000	244,750,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第100回	400,000,000	410,600,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	200,000,000	243,032,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	238,862,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	128,452,000	

券 政府保証債第 1 2 3 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 3 7 回	440,000,000	457,331,600	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 4 9 回	140,000,000	145,205,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 5 5 回	100,000,000	103,487,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 5 7 回	140,000,000	144,943,400	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 6 5 回	100,000,000	123,546,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 6 8 回	100,000,000	103,644,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 6 9 回	100,000,000	117,448,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 0 回	218,000,000	225,752,080	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 1 回	100,000,000	116,457,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 2 回	300,000,000	376,872,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 3 回	200,000,000	207,406,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 5 回	200,000,000	207,294,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 8 0 回	200,000,000	207,012,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 8 2 回	900,000,000	936,171,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 8 3 回	100,000,000	118,913,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 8 9 回	196,000,000	201,290,040	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 9 0 回	400,000,000	412,344,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 9 3 回	1,000,000,000	1,046,410,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 9 7 回	272,000,000	284,011,520	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 0 7 回	300,000,000	311,457,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 2 1 1 回	137,000,000	142,090,920	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	145,000,000	150,331,650	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回	100,000,000	115,689,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	100,000,000	121,708,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回	100,000,000	116,309,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	100,000,000	103,755,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	100,000,000	121,729,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	190,000,000	196,211,100	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	100,000,000	102,803,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第239回	500,000,000	556,035,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回	151,000,000	150,273,690	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第321回	500,000,000	501,385,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第335回	100,000,000	101,206,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	300,000,000	404,721,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回	100,000,000	136,747,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	137,033,000	
公営企業債券 政府保証15年第1回	300,000,000	310,584,000	
地方公営企業等金融機構債券(20年) 第1回	100,000,000	118,590,000	
地方公共団体金融機構債券 第1回	100,000,000	101,903,000	
地方公共団体金融機構債券 第2回	100,000,000	101,736,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保証第5回	200,000,000	203,660,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	120,338,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	115,867,000	

地方公共団体金融機構債券 20年 第6回	300,000,000	366,252,000	
地方公共団体金融機構債券 F24 回	100,000,000	107,865,000	
地方公共団体金融機構債券 第13 回	200,000,000	205,400,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保 証第16回	100,000,000	102,467,000	
地方公共団体金融機構債券 第16 回	100,000,000	102,731,000	
地方公共団体金融機構債券 第27 回	300,000,000	310,011,000	
地方公共団体金融機構債券 第28 回	500,000,000	517,275,000	
地方公共団体金融機構債券 F10 4回	100,000,000	108,025,000	
地方公共団体金融機構債券 F10 6回	100,000,000	106,714,000	
地方公共団体金融機構債券 第37 回	400,000,000	413,468,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回	194,000,000	201,005,340	
地方公共団体金融機構債券 F13 2回	500,000,000	533,980,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	103,520,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	104,707,710	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	105,690,360	
地方公共団体金融機構債券 第41 回	600,000,000	619,878,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 2回	100,000,000	105,797,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 4回	200,000,000	202,648,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 5回	200,000,000	212,638,000	
地方公共団体金融機構債券 F14 7回	100,000,000	109,496,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第42回	108,000,000	112,041,360	
地方公共団体金融機構債券 第42 回	100,000,000	103,375,000	

回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第43回	202,000,000	209,037,680	
政保 地方公共団体金融機構債券 第44回	145,000,000	150,795,650	
地方公共団体金融機構債券 第44 回	100,000,000	103,437,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第45回	223,000,000	231,835,260	
地方公共団体金融機構債券 F16 0回	100,000,000	107,840,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第49回	13,000,000	13,593,190	
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回	100,000,000	104,732,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (6年) 第10回	300,000,000	301,557,000	
地方公共団体金融機構債券 第51 回	600,000,000	623,808,000	
地方公共団体金融機構債券 第52 回	300,000,000	312,798,000	
地方公共団体金融機構債券(15 年) 第2回	200,000,000	218,162,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第56回	591,000,000	615,473,310	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	120,421,920	
政保 地方公共団体金融機構債券 (6年) 第14回	300,000,000	301,476,000	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第38回	100,000,000	114,758,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	103,212,000	
地方公共団体金融機構債券 第64 回	100,000,000	102,830,000	
地方公共団体金融機構債券(20 年) 第39回	100,000,000	113,794,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回	400,000,000	412,768,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	320,000,000	327,916,800	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	195,051,780	

地方公共団体金融機構債券 第74回	300,000,000	307,950,000	
地方公共団体金融機構債券 第77回	100,000,000	102,495,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	521,114,200	
地方公共団体金融機構債券 第79回	400,000,000	409,980,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	116,000,000	115,438,560	
公営企業債券(20年) 第2回財投機関債	100,000,000	106,434,000	
公営企業債券(20年) 第5回財投機関債	200,000,000	221,692,000	
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債	100,000,000	122,352,000	
首都高速道路社債 第13回	100,000,000	100,258,000	
首都高速道路 第17回	200,000,000	199,840,000	
首都高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	102,322,000	
阪神高速道路 第13回	100,000,000	100,183,000	
阪神高速道路 第15回	200,000,000	199,916,000	
阪神高速道路債券 政府保証第5回	100,000,000	102,530,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	103,513,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	205,962,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	107,720,000	
都市再生債券 財投機関債第109回	100,000,000	106,562,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	115,024,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	360,000,000	373,514,400	
東京交通債券 第342回	200,000,000	219,152,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	174,425,430	
関西国際空港社債 財投機関債第26回	300,000,000	308,007,000	
関西国際空港社債 財投機関債第32回	100,000,000	103,748,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	100,000,000	103,673,000	
中部国際空港債券 政府保証第18回	368,000,000	380,166,080	

預金保険機構債券 政府保証第209回	2,000,000,000	2,006,840,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	200,000,000	235,940,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	100,000,000	111,001,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第41回	100,000,000	102,456,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	100,000,000	112,268,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	119,159,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回	100,000,000	103,878,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	121,181,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	300,000,000	337,986,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	100,000,000	121,091,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回	100,000,000	103,531,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	206,906,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	200,000,000	223,738,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回	100,000,000	119,506,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	100,000,000	131,428,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第177回	250,000,000	256,030,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第223回	100,000,000	99,296,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	206,626,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	204,168,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第17回	100,000,000	103,694,000	
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	299,046,000	
農林債券 利付第773回い号	300,000,000	300,903,000	
農林債券 利付第777回い号	300,000,000	301,164,000	
農林債券 利付第781回い号	100,000,000	100,465,000	

しんきん中金債券 利付第302回	100,000,000	100,282,000	
しんきん中金債券 利付第308回	100,000,000	100,416,000	
しんきん中金債券 利付第316回	100,000,000	100,015,000	
しんきん中金債券 利付第317回	800,000,000	799,928,000	
しんきん中金債券 利付第335回	200,000,000	199,954,000	
商工債券 利付(3年)第202回	1,100,000,000	1,098,504,000	
商工債券 利付(3年)第203回	1,100,000,000	1,098,515,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関債	100,000,000	121,087,000	
東日本高速道路 第26回	100,000,000	100,318,000	
東日本高速道路 第27回	100,000,000	100,251,000	
東日本高速道路 第34回	100,000,000	100,551,000	
東日本高速道路 第36回	200,000,000	200,030,000	
中日本高速道路社債 第44回	100,000,000	100,685,000	
中日本高速道路社債 第61回	100,000,000	100,446,000	
中日本高速道路 第62回	200,000,000	200,864,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	102,837,000	
中日本高速道路 第66回	1,200,000,000	1,198,764,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	206,646,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	102,664,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	298,902,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第35回	200,000,000	205,430,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第62回	100,000,000	103,397,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第68回	200,000,000	205,684,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回	100,000,000	113,996,000	
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	11,752,000	12,000,084	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	39,657,000	40,752,722	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	72,660,000	75,176,215	
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	73,578,000	74,945,079	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	45,351,000	47,084,768	

貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	51,156,000	54,151,183	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	15,869,000	16,774,643	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	34,684,000	36,182,001	
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	39,620,000	41,816,136	
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	44,280,000	45,726,627	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	74,052,000	76,900,039	
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	76,325,000	79,961,123	
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	68,084,000	72,269,123	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	115,782,000	121,967,074	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	19,036,000	20,112,866	
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	29,086,000	31,585,069	
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	97,497,000	104,605,506	
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券	23,029,000	23,795,405	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	102,386,000	107,643,521	
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	46,808,000	48,467,811	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	126,282,000	134,350,156	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	90,992,000	95,951,064	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	53,628,000	58,112,373	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	118,794,000	126,811,407	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	130,578,000	136,459,233	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	170,574,000	178,214,009	
貸付債権担保第60回住宅金融支援	166,092,000	174,345,111	

機構債券			
貸付債権担保第6-1回住宅金融支援機構債券	106,990,000	111,952,196	
貸付債権担保第5-1回住宅金融支援機構債券	42,719,000	45,233,013	
貸付債権担保第4-3回住宅金融支援機構債券	99,600,000	105,474,408	
貸付債権担保第7-9回住宅金融支援機構債券	55,612,000	57,828,694	
貸付債権担保第8-1回住宅金融支援機構債券	119,154,000	123,980,928	
貸付債権担保第7-2回住宅金融支援機構債券	55,919,000	58,089,216	
貸付債権担保第2-2回住宅金融公庫債券	30,774,000	32,025,886	
貸付債権担保第7-0回住宅金融支援機構債券	163,788,000	171,471,295	
貸付債権担保第3-3回住宅金融支援機構債券	35,868,000	38,305,947	
貸付債権担保第3-4回住宅金融支援機構債券	37,531,000	40,064,717	
貸付債権担保第3-5回住宅金融支援機構債券	37,952,000	40,347,150	
貸付債権担保第4-6回住宅金融支援機構債券	42,099,000	44,890,584	
貸付債権担保第5-5回住宅金融支援機構債券	108,470,000	114,233,011	
貸付債権担保第5-6回住宅金融支援機構債券	156,081,000	164,368,901	
貸付債権担保第5-7回住宅金融支援機構債券	51,663,000	54,448,152	
貸付債権担保第7-6回住宅金融支援機構債券	105,586,000	110,417,615	
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	14,712,000	15,298,420	
貸付債権担保S種第1-4回住宅金融支援機構債券	102,715,000	105,648,540	
貸付債権担保S種第1-5回住宅金融支援機構債券	41,828,000	42,977,015	
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	42,224,000	42,504,367	
貸付債権担保第2-3回住宅金融支援機構債券	104,088,000	112,450,429	

貸付債権担保第 3 2 回住宅金融支援 機構債券	102,903,000	109,640,059	
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融支援 機構債券	207,105,000	217,456,107	
貸付債権担保第 5 8 回住宅金融支援 機構債券	109,444,000	115,204,037	
貸付債権担保第 6 4 回住宅金融支援 機構債券	177,009,000	184,524,802	
貸付債権担保第 7 1 回住宅金融支援 機構債券	159,834,000	165,917,282	
貸付債権担保第 7 3 回住宅金融支援 機構債券	122,468,000	128,893,895	
貸付債権担保第 7 5 回住宅金融支援 機構債券	106,044,000	111,180,771	
貸付債権担保第 8 3 回住宅金融支援 機構債券	248,764,000	258,527,987	
貸付債権担保第 8 4 回住宅金融支援 機構債券	440,293,000	456,940,478	
貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援 機構債券	65,402,000	67,611,933	
貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援 機構債券	68,161,000	70,551,406	
貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援 機構債券	68,654,000	70,756,872	
貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援 機構債券	141,936,000	145,223,237	
貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援 機構債券	148,202,000	150,368,713	
貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援 機構債券	78,566,000	80,662,926	
貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援 機構債券	82,412,000	84,323,958	
貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援 機構債券	243,993,000	251,012,678	
貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援 機構債券	248,517,000	256,770,249	
貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援 機構債券	166,614,000	171,933,985	
貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支 援機構債券	82,463,000	84,939,363	
貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支 援機構債券	82,950,000	85,705,599	
貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支	283,521,000	284,306,353	

		援機構債券			
		貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支 援機構債券	190,190,000	191,643,051	
		貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支 援機構債券	191,010,000	192,133,138	
		貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支 援機構債券	95,890,000	96,604,380	
		貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支 援機構債券	191,788,000	193,042,293	
		貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支 援機構債券	96,422,000	96,589,774	
		貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支 援機構債券	96,864,000	97,261,142	
		貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支 援機構債券	97,543,000	98,130,208	
		貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支 援機構債券	392,492,000	393,547,803	
		貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支 援機構債券	295,329,000	296,392,184	
		貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支 援機構債券	198,076,000	198,608,824	
		貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支 援機構債券	198,694,000	199,790,790	
	小計	銘柄数：287 組入時価比率：8.4%	53,459,558,000	56,313,306,479 8.5%	
	合計			56,313,306,479	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（B F C M）第 1 4 回円貨社債	200,000,000	202,688,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第 7 回円貨社債	100,000,000	100,560,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第 1 1 回円貨社債	100,000,000	100,782,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第 1 4 回円貨社債	100,000,000	100,456,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第 1 回非上位円貨社債	100,000,000	101,303,000	
		クレディ・アグリコル・エス・ エー 第 6 回円貨社債（2 0 1 4）	100,000,000	103,687,000	
		ザ・ホンコン・アンド・シャンハ イ・バンキング 第 2 回円貨社債	200,000,000	200,604,000	
		マラヤン・バンキング・ベルハッ ド 第 2 回円貨社債（2 0 1 5）	200,000,000	200,144,000	

スタンダード・チャータード 第2 回円貨社債(2015)	100,000,000	100,404,000	
スタンダード・チャータード 第3 回円貨社債(2015)	100,000,000	102,537,000	
エイチエスピーシー・ホールディン グス・ピーエルシー 第2回円	100,000,000	102,977,000	
エイチエスピーシー・ホールディン グス・ピーエルシー 第3回円	100,000,000	105,544,000	
ロイズ・バンキング・グループ・ ピーエルシー 第1回円貨社債	100,000,000	101,216,000	
ルノー 第19回円貨社債(201 7)	100,000,000	100,369,000	
パークレイズ・バンク・ピーエル シー 第7回円貨社債	100,000,000	100,372,000	
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回 円貨社債(2017)	100,000,000	103,163,000	
ナショナル・オーストラリア銀行 第11回円貨社債(2015)	200,000,000	200,314,000	
オーストラリア・ニューゼーランド 銀行 第10回円貨社債	200,000,000	200,038,000	
ラボバンク・ネーデルランド 第25 回円貨社債(2014)	100,000,000	100,310,000	
ソシエテ ジェネラル 第6回円貨 社債(2014)	200,000,000	201,080,000	
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上 位円貨社債(2017)	100,000,000	100,523,000	
大和ハウス工業 第5回特定社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,905,000	
森永乳業 第13回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	103,601,000	
明治ホールディングス 第8回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	100,010,000	
アサヒグループホールディングス 第7回特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,305,000	
アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,773,000	
キリンホールディングス 第10回 社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,580,000	
味の素 第24回特定社債間限定同 順位特約付	200,000,000	199,952,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,736,000	
野村不動産ホールディングス 第5	100,000,000	103,313,000	

回社債間限定同順位特約付			
森ヒルズリート投資法人 第17回 特定投資法人債間限定同順位特	200,000,000	197,070,000	
森ビル 第13回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,484,000	
東急不動産ホールディングス 第2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,864,000	
王子ホールディングス 第34回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	100,342,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,959,000	
住友化学 第43回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,818,000	
住友化学 第56回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,832,000	
クレハ 第5回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	100,310,000	
エア・ウォーター 第2回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,165,000	
三菱ケミカルホールディングス 第 14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,116,000	
宇部興産 第10回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,228,000	
花王 第4回特定社債間限定同順位 特約付	100,000,000	101,017,000	
武田薬品工業 第15回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,299,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,653,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	103,544,000	
JXホールディングス 第9回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	102,919,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,651,000	
ブリヂストン 第8回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	200,524,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	102,958,000	
住友大阪セメント 第14回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,327,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	103,320,000	

神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,117,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回(JFEス保証)	100,000,000	102,194,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	199,856,000	
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,238,000	
小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,236,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	218,594,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,785,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,292,000	
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,642,000	
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,196,000	
パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,068,000	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,305,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,004,000	
ソニー 第26回	100,000,000	102,241,000	
ソニー 第32回	200,000,000	200,426,000	
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,881,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,512,000	
明治安田生命2014基金特定目的会社 第1回特定社債	300,000,000	301,140,000	
J A三井リース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,770,000	
J A三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,608,000	
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第2回社債間限定	100,000,000	100,076,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	104,010,000	

アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,218,000	
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,811,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,673,000	
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,057,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,974,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,553,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,671,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	208,592,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,468,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,374,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,952,000	
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,956,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,144,000	
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,194,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,828,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,726,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,643,000	
あおぞら銀行 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	299,997,000	
あおぞら銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,941,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	100,000,000	102,618,000	
りそなホールディングス 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,645,000	
三井住友トラスト・ホールディング	200,000,000	205,382,000	

ス 第2回劣後特約付			
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,251,000	
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	102,644,000	
三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,849,000	
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,497,000	
三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,401,000	
三菱東京UFJ銀行 第159回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,722,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	300,000,000	306,333,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	102,472,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	100,000,000	106,540,000	
りそな銀行 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,027,000	
りそな銀行 第6回劣後特約付	300,000,000	310,746,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	100,000,000	104,371,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	300,000,000	315,210,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,342,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,888,000	
みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	200,000,000	205,402,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	104,259,000	
みずほ銀行 第38回特定社債間限定同順位特約付	1,000,000,000	1,003,040,000	
興銀リース 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,157,000	
NTTファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,116,000	
ホンダファイナンス 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,105,000	
トヨタファイナンス 第81回社債	100,000,000	99,768,000	

間限定同順位特約付			
リコーリース 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,434,000	
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,664,000	
オリエントコーポレーション 第2回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,328,000	
日立キャピタル 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,666,000	
日立キャピタル 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,953,000	
日立キャピタル 第57回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,746,000	
オリックス 第164回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,283,000	
三井住友ファイナンス&リース 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,096,000	
三菱UFJリース 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,103,000	
三菱UFJリース 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,863,000	
三菱UFJリース 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,804,000	
大和証券グループ本社 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,307,000	
大和証券グループ本社 第22回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,427,000	
大和証券グループ本社 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,970,000	
野村ホールディングス 第21回	100,000,000	103,285,000	
野村ホールディングス 第46回	100,000,000	100,402,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	109,143,000	
三菱地所 第98回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	102,114,000	
三菱地所 第110回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	100,557,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,118,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	99,390,000	
東京建物 第17回社債間限定同順位	100,000,000	101,937,000	

位特約付			
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,014,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,406,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,060,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,558,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,083,000	
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	103,853,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	101,610,000	
東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,268,000	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	203,608,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,291,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,952,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,060,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,933,000	
東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	106,101,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	217,442,000	
東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,335,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	118,382,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,827,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	119,071,000	
西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,860,000	
東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,616,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定	200,000,000	243,306,000	

同順位特約付			
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,948,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	118,004,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	99,686,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	100,615,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	101,826,000	
西武ホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,806,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,356,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,411,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,993,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,227,000	
A N Aホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,555,000	
三菱倉庫 第14回	100,000,000	100,809,000	
日本電信電話 第60回	100,000,000	103,067,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,555,000	
東京電力 第547回	100,000,000	103,801,000	
東京電力 第548回	100,000,000	116,017,000	
東京電力 第559回	100,000,000	101,811,000	
東京電力 第560回	100,000,000	114,348,000	
東京電力 第565回	300,000,000	306,945,000	
中部電力 第482回	200,000,000	205,014,000	
中部電力 第500回	200,000,000	207,370,000	
中部電力 第524回	100,000,000	100,043,000	
関西電力 第482回	100,000,000	102,515,000	
関西電力 第484回	100,000,000	102,262,000	
関西電力 第496回	100,000,000	103,798,000	
関西電力 第497回	200,000,000	209,106,000	
関西電力 第498回	200,000,000	201,660,000	
中国電力 第330回	100,000,000	105,855,000	
中国電力 第377回	200,000,000	209,342,000	

	中国電力 第378回	100,000,000	104,152,000	
	北陸電力 第301回	100,000,000	104,640,000	
	北陸電力 第304回	100,000,000	104,070,000	
	北陸電力 第307回	100,000,000	105,677,000	
	北陸電力 第308回	100,000,000	103,151,000	
	東北電力 第473回	100,000,000	101,431,000	
	東北電力 第475回	100,000,000	103,143,000	
	東北電力 第481回	200,000,000	206,774,000	
	四国電力 第281回	200,000,000	209,494,000	
	九州電力 第400回	100,000,000	103,414,000	
	九州電力 第409回	100,000,000	101,917,000	
	九州電力 第424回	300,000,000	315,642,000	
	九州電力 第451回	100,000,000	100,218,000	
	北海道電力 第316回	207,000,000	211,725,810	
	北海道電力 第323回	100,000,000	109,048,000	
	北海道電力 第338回	100,000,000	100,484,000	
	電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,567,000	
	電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,906,000	
	電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,706,000	
	電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,606,000	
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,942,000	
	東京電力パワーグリッド 第1回	100,000,000	100,363,000	
	東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	100,887,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	125,044,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,554,000	
	北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,954,000	
	ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,141,000	
小計	銘柄数：217 組入時価比率：4.3%	27,907,000,000	28,686,015,810	4.3%
合計			28,686,015,810	

合計		664,861,212,656
----	--	-----------------

(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。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2018年 4月23日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	687,747,458
コール・ローン	236,498,061
国債証券	609,174,224,941
派生商品評価勘定	345,408
未収入金	689,108,864
未収利息	6,818,963,245
前払費用	260,808,701
流動資産合計	617,867,696,678
資産合計	617,867,696,678
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	435,680
未払金	1,046,003,216
未払解約金	460,051,153
未払利息	428
その他未払費用	5,252,000
流動負債合計	1,511,742,477
負債合計	1,511,742,477
純資産の部	
元本等	
元本	275,873,817,039
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	340,482,137,162
元本等合計	616,355,954,201
純資産合計	616,355,954,201
負債純資産合計	617,867,696,678

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	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	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。
4. 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)

2018年 4月23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	2,2342円
(10,000口当たり純資産額)	(22,342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 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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> <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

2018年 4月23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

2018年 4月23日現在

	2017年 4月25日
期首	
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	303,540,433,925円
同期中における追加設定元本額	29,698,006,303円
同期中における一部解約元本額	57,364,623,189円
期末元本額	275,873,817,039円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	91,869,011円
バランスセレクト50	93,698,855円
バランスセレクト70	78,672,944円
野村外国債券インデックスファンド	288,210,512円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,045,471,060円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	26,052,353,397円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,463,190,775円
野村資産設計ファンド2015	33,672,186円
野村資産設計ファンド2020	39,892,587円
野村資産設計ファンド2025	48,146,449円
野村資産設計ファンド2030	42,592,689円
野村資産設計ファンド2035	28,832,223円
野村資産設計ファンド2040	61,961,604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）	157,007,873,777円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	5,346,711,852円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	8,534,842,546円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	1,874,521,239円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	1,152,404,122円
野村資産設計ファンド2045	6,504,355円
野村インデックスファンド・外国債券	762,023,831円
マイ・ロード	8,722,079,757円
ネクストコア	531,993,811円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	109,226,972円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	1,862,937,992円

野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	664,341,689円
野村資産設計ファンド2050	7,205,405円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,755,120円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,517,478円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,243,246円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	915,136円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	400,060,211円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	187,941,700円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,203,696円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,400,024円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,017,892円
インデックス・ブレンド(タイプ)	687,800円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,658,911円
野村6資産均等バランス	39,855,129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)	5,141,933,402円
NEXT FUNDS 外国債券・シティ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	287,406,420円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	224,640,986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)	11,485,174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)	1,853,532,879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)	559,194,536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)	3,194,709,052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)	1,549,906,905円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,901,404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)	15,883,309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)	793,912円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	5,429,331,215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)	171,402,626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)	622,862,714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)	172,285,028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)	207,783,724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)	223,850,868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)	2,090,932,919円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	997,841,067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)	1,716,360,064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)	926,669,431円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,992,476円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,419,511円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	6,488,249円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	545,790,526円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,321,785,728円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	3,206,225,683円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	2,924,034,975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)	13,184,316,506円
マイバランスDC30	1,524,923,135円
マイバランスDC50	915,721,001円
マイバランスDC70	591,549,906円
野村DC外国債券インデックスファンド	4,069,554,755円

野村DC運用戦略ファンド	3,273,913,075円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	215,793,795円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	58,153,029円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	7,452,768円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	10,596,387円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	867,828円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	4,153,802円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	693,234円
野村資産設計ファンド(DC)2030	173,784円
野村資産設計ファンド(DC)2040	196,901円
野村資産設計ファンド(DC)2050	236,037円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	329,960円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	118,815円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	51,202円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	88,353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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2018年4月23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	19,840,000.00	21,322,573.76	
		US TREASURY BOND	12,700,000.00	14,463,612.17	
		US TREASURY BOND	22,100,000.00	26,074,545.77	
		US TREASURY BOND	13,800,000.00	16,151,390.28	
		US TREASURY BOND	47,100,000.00	45,734,834.76	
		US TREASURY BOND	39,200,000.00	47,683,123.04	
		US TREASURY BOND	18,800,000.00	23,889,218.28	
		US TREASURY BOND	21,400,000.00	27,059,296.34	
		US TREASURY BOND	17,000,000.00	20,828,983.10	
		US TREASURY BOND	6,300,000.00	7,601,835.78	
		US TREASURY BOND	800,000.00	968,812.48	
		US TREASURY BOND	100,000.00	119,851.56	

US TREASURY BOND	25,300,000.00	24,210,913.43	
US TREASURY BOND	16,000,000.00	17,751,249.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	993,085.90	
US TREASURY N/B	18,200,000.00	18,095,491.96	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,062,363.23	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,453,652.30	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,949,218.50	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,532,093.22	
US TREASURY N/B	27,600,000.00	27,840,420.84	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,842,718.75	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,382,390.52	
US TREASURY N/B	23,600,000.00	23,399,952.24	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,076,456.90	
US TREASURY N/B	900,000.00	885,761.64	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,378,617.10	
US TREASURY N/B	7,900,000.00	7,838,281.25	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,876,843.75	
US TREASURY N/B	10,500,000.00	10,299,433.20	
US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,370,858.65	
US TREASURY N/B	600,000.00	592,804.68	
US TREASURY N/B	32,400,000.00	32,930,294.04	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,794,921.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,945,859.30	
US TREASURY N/B	26,750,000.00	26,491,902.62	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,941,992.00	
US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,333,788.60	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,269,363.08	
US TREASURY N/B	50,800,000.00	51,528,263.72	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,605,437.28	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,774,546.74	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,745,000.00	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,329,546.74	
US TREASURY N/B	600,000.00	589,382.76	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,963,906.20	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,290,312.50	

US TREASURY N/B	51,800,000.00	52,880,511.74	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,200,003.84	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,641,359.24	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,902,343.50	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,923,242.00	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,899,218.40	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	20,860,687.50	
US TREASURY N/B	600,000.00	588,726.54	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,076,109.32	
US TREASURY N/B	46,200,000.00	47,122,193.58	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,093,562.24	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,373,693.86	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,167,500.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,780,859.00	
US TREASURY N/B	13,400,000.00	13,244,014.62	
US TREASURY N/B	32,180,000.00	32,245,364.01	
US TREASURY N/B	36,200,000.00	35,852,139.72	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,921,250.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	293,261.70	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,568,624.96	
US TREASURY N/B	700,000.00	679,656.25	
US TREASURY N/B	52,600,000.00	52,659,585.28	
US TREASURY N/B	13,700,000.00	13,500,921.19	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	976,015.60	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,763,343.24	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,369,703.02	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,270,710.88	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,837,953.03	
US TREASURY N/B	45,800,000.00	47,070,230.94	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,966,562.40	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,398,242.00	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	11,677,389.74	
US TREASURY N/B	600,000.00	576,890.58	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,780,781.25	
US TREASURY N/B	38,400,000.00	38,947,499.52	

US TREASURY N/B	22,500,000.00	22,071,093.75	
US TREASURY N/B	300,000.00	288,703.11	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	33,455,466.20	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,573,445.07	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	24,859,225.93	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,141,167.33	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,706,249.60	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	16,410,186.24	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	24,711,972.34	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,779,374.40	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,580,038.97	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,151,030.32	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,801,249.60	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,651,874.40	
US TREASURY N/B	13,600,000.00	13,189,874.32	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	32,828,538.22	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,045,070.13	
US TREASURY N/B	500,000.00	484,570.30	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,542,671.38	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,258,664.03	
US TREASURY N/B	35,000,000.00	33,692,967.00	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	20,599,428.09	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,753,750.00	
US TREASURY N/B	27,100,000.00	26,443,670.52	
US TREASURY N/B	600,000.00	576,562.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	964,609.30	
US TREASURY N/B	10,300,000.00	9,829,257.04	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,915,468.60	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,673,437.00	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,415,827.63	
US TREASURY N/B	29,800,000.00	28,938,592.26	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	20,984,218.20	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,399,687.50	
US TREASURY N/B	24,200,000.00	22,787,702.52	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,196,100.49	

US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,345,155.70	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,725,390.50	
US TREASURY N/B	49,600,000.00	47,139,373.76	
US TREASURY N/B	34,400,000.00	32,470,373.28	
US TREASURY N/B	20,900,000.00	19,301,476.04	
US TREASURY N/B	19,400,000.00	19,095,357.92	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	12,902,023.09	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	16,729,124.16	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,045,125.00	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	26,651,343.08	
US TREASURY N/B	6,900,000.00	6,623,460.42	
US TREASURY N/B	30,100,000.00	29,483,889.12	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,569,531.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,732,812.20	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,387,374.72	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	32,888,108.52	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,338,945.05	
US TREASURY N/B	44,700,000.00	42,203,084.82	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,368,656.08	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,174,491.70	
US TREASURY N/B	24,500,000.00	23,020,427.85	
US TREASURY N/B	50,300,000.00	47,997,200.61	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,818,437.40	
US TREASURY N/B	800,000.00	724,937.44	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,788,125.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,073,750.00	
US TREASURY N/B	26,200,000.00	24,789,701.16	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,718,437.50	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,990,468.60	
US TREASURY N/B	11,100,000.00	13,924,429.41	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,640,624.80	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	6,427,343.50	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	5,484,726.45	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,069,687.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	118,453.12	

	US TREASURY N/B	100,000.00	122,453.12	
	US TREASURY N/B	100,000.00	120,570.31	
	US TREASURY N/B	100,000.00	124,585.93	
	US TREASURY N/B	13,500,000.00	16,301,250.00	
	US TREASURY N/B	200,000.00	225,406.24	
	US TREASURY N/B	12,800,000.00	15,208,999.68	
	US TREASURY N/B	14,000,000.00	17,802,968.40	
	US TREASURY N/B	6,700,000.00	8,111,710.77	
	US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,523,866.70	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,518,984.15	
	US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,416,679.35	
	US TREASURY N/B	9,200,000.00	8,635,062.04	
	US TREASURY N/B	17,600,000.00	16,491,749.12	
	US TREASURY N/B	24,200,000.00	24,222,687.50	
	US TREASURY N/B	15,400,000.00	16,746,295.72	
	US TREASURY N/B	13,200,000.00	14,358,092.76	
	US TREASURY N/B	18,900,000.00	19,723,920.93	
	US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,983,748.80	
	US TREASURY N/B	36,900,000.00	36,012,093.75	
	US TREASURY N/B	27,600,000.00	24,408,750.00	
	US TREASURY N/B	21,700,000.00	21,167,670.79	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,903,437.40	
	US TREASURY N/B	15,100,000.00	14,720,139.87	
	US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,286,562.20	
	US TREASURY N/B	10,700,000.00	9,421,015.09	
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	1,916,367.13	
	US TREASURY N/B	12,700,000.00	12,060,038.11	
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,126,601.39	
	US TREASURY N/B	900,000.00	831,867.12	
小計	銘柄数：181	2,365,070,000.00	2,374,332,517.41	
			(256,048,018,677)	
	組入時価比率：41.5%		42.0%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,634,640.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	396,168.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,600,000.00	8,788,340.00	

	CANADIAN GOVERNMENT	550,000.00	542,767.50
	CANADIAN GOVERNMENT	8,000,000.00	7,991,920.00
	CANADIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,055,069.00
	CANADIAN GOVERNMENT	16,300,000.00	16,177,750.00
	CANADIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	8,048,352.00
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,402,560.00
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	7,911,606.00
	CANADIAN GOVERNMENT	10,050,000.00	10,409,488.50
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	287,199.00
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,633,092.00
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,382,755.00
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,446,728.00
	CANADIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	8,014,471.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,396,836.00
	CANADIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,256,744.00
	CANADIAN GOVERNMENT	3,650,000.00	5,339,402.50
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,496,060.00
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	96,907.00
	CANADIAN GOVERNMENT	7,180,000.00	9,541,143.00
	CANADIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	5,694,760.00
	CANADIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	8,631,144.00
	CANADIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	4,959,240.00
	CANADIAN GOVERNMENT	9,800,000.00	11,855,354.00
	CANADIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,453,180.00
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	219,196.00
小計	銘柄数：28	140,230,000.00	151,062,872.50 (12,760,280,840)
	組入時価比率：2.1%		2.1%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	107,000,000.00	103,220,760.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	52,600,000.00	53,354,284.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	126,000,000.00	123,166,260.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	71,100,000.00	69,015,348.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	39,000,000.00	44,462,340.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,000,000.00	7,214,400.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	86,300,000.00	86,362,999.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	49,600,000.00	53,168,720.00

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,500,000.00	47,059,395.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,105,900.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	56,653,140.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	41,300,000.00	44,819,586.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	64,617,942.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	15,512,325.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	85,573,830.00	
	銘柄数：15	845,600,000.00	864,307,229.00	(5,030,268,072)
組入時価比率：0.8%			0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	3,800,000.00	3,992,128.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,800,000.00	6,392,348.20	
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,007,040.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,800,000.00	5,592,936.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	7,628,160.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	5,561,400.00	
	BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	7,990,500.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,025,400.00	
	BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	11,026,806.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,033,266.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,013,458.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	993,800.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	992,523.00	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,837,367.50	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,004,800.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,012,350.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,086,812.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,400,000.00	8,371,144.80	
	BELGIUM KINGDOM	5,500,000.00	8,175,343.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	994,426.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,350,583.20	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,084,182.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	10,900,000.00	15,880,111.90	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	10,000,000.00	15,818,880.00	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,200,000.00	1,238,959.20	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,700,000.00	9,253,668.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,900,000.00	12,745,257.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,800,000.00	3,916,302.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	25,250,000.00	27,427,812.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	206,336.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,900,000.00	12,289,292.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,600,000.00	3,617,532.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,900,000.00	12,750,482.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,900,000.00	6,061,081.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,550,000.00	17,752,484.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,250,000.00	5,314,995.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,900,000.00	11,067,621.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,400,000.00	8,996,905.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,900,000.00	17,301,760.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,700,000.00	7,976,350.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	510,093.45
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	951,138.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,600,000.00	19,825,213.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,455,075.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,445,068.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,400,000.00	25,540,340.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,166,457.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	12,807,960.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,096,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	429,800.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	8,128,404.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,400,000.00	12,422,659.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	12,432,841.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	1,698,439.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,500,000.00	4,320,925.00
BUNDESobligation	1,000,000.00	1,012,770.00
BUNDESobligation	800,000.00	808,832.00
BUNDESobligation	3,000,000.00	3,055,800.00
BUNDESobligation	1,600,000.00	1,619,680.00
BUNDESobligation	900,000.00	905,040.00

BUNDESobligation	1,000,000.00	1,001,100.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	524,945.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,700,000.00	7,144,143.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,419,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,173,810.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,370,650.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	7,814,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	9,134,160.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,300,000.00	15,506,920.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	7,034,300.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,364,000.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,596,760.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,604,040.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,600,000.00	12,823,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,400,000.00	20,811,560.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	5,150,777.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,623,780.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,300,000.00	10,839,926.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,500,000.00	10,692,150.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,310,904.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	303,303.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	965,520.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	686,182.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000.00	29,902,772.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	996,080.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	8,878,800.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	990,100.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	4,797,060.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	10,575,370.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	8,346,281.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,800,000.00	12,291,349.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,800,000.00	7,244,284.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	11,221,224.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	12,411,381.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000.00	5,635,172.40	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	8,395,634.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	8,072,834.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	2,985,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,800,000.00	6,831,620.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	5,249,634.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,842,570.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,630,000.00	16,607,500.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	408,588.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,100,000.00	8,787,771.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000.00	31,645,208.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,820,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,200,000.00	17,776,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,037,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	12,621,510.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000,000.00	11,113,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,946,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,400,000.00	16,610,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,550,000.00	2,564,522.25	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,496,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	19,808,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	309,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	830,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000.00	9,005,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,186,473.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,100,000.00	24,556,170.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	711,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,307,925.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	8,821,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	16,866,720.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	19,127,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,149,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,678,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	8,565,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,900,000.00	18,646,351.70	

BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,050,118.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,136,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	12,923,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,200,000.00	17,796,140.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,500,000.00	23,476,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,300,000.00	8,022,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,700,000.00	26,374,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	26,401,410.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	471,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	11,385,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,073,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,900,000.00	12,105,780.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	6,302,580.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000.00	1,380,449.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	11,128,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,300,000.00	18,473,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,600,000.00	15,871,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	5,826,820.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,122,796.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	3,026,560.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,964.60	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	107,652.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,018,915.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,228,064.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,438,556.80	
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,285,730.40	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,383,524.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,900,000.00	3,202,905.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,254,500.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,032,144.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	1,998,512.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,700,000.00	3,234,311.10	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	680,661.10	
FINNISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,067,624.00	
FRANCE (GOVT OF)	7,600,000.00	7,728,447.60	

FRANCE (GOVT OF)	10,300,000.00	10,471,587.70	
FRANCE (GOVT OF)	2,800,000.00	2,825,524.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,110,463.20	
FRANCE (GOVT OF)	2,700,000.00	2,725,415.10	
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	2,988,000.00	
FRANCE (GOVT OF)	7,000,000.00	7,055,363.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,056,236.00	
FRANCE (GOVT OF)	12,000,000.00	14,111,676.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,005,148.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	99,070.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,125,162.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,167,380.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	100,000.00	104,865.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	500,000.00	568,669.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,500,000.00	5,857,357.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	15,985,480.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,700,000.00	28,651,770.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,032,600.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	13,248,450.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,100,000.00	16,947,469.90	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,500,000.00	16,332,220.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,422,532.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	10,252,764.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000.00	38,387,885.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,281,385.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	28,037,710.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,239,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	40,977,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,200,000.00	10,923,160.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000.00	36,509,949.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,000,000.00	9,500,256.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,100,000.00	26,263,930.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,300,000.00	11,311,963.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,300,000.00	7,832,870.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000.00	28,092,925.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,700,000.00	24,290,842.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,200,000.00	8,455,532.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,700,000.00	6,175,374.00	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	100,000.00	105,560.00	
IRISH GOVERNMENT	400,000.00	437,720.00	
IRISH GOVERNMENT	680,000.00	747,102.40	
IRISH GOVERNMENT	500,000.00	567,190.00	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,236,031.00	
IRISH GOVERNMENT	600,000.00	595,080.00	
IRISH TSY 0.8% 2022	3,600,000.00	3,721,320.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	1,800,000.00	1,851,840.00	
IRISH TSY 1% 2026	3,000,000.00	3,073,080.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	4,600,000.00	5,249,888.00	
IRISH TSY 2% 2045	3,500,000.00	3,724,882.00	
IRISH TSY 2022	1,800,000.00	1,793,160.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,600,000.00	7,787,604.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	6,236,300.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,900,000.00	2,943,221.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,800,000.00	5,232,480.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,350,000.00	7,082,790.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	403,022.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,650,900.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,950,450.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	5,838,170.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,524,405.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	990,663.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	14,985,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	990,923.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	3,998,400.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,021,808.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	10,649,240.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,000,900.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,400,000.00	5,332,531.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	6,011,032.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,200,000.00	9,535,221.80	

	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,900,000.00	5,308,602.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,401,972.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	102,910.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	505,900.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,521,375.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,255,200.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,451,200.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000.00	5,791,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	1,986,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,550,000.00	2,775,532.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,200,000.00	4,562,460.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,371,240.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,230,600.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,024,600.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	6,100,000.00	9,169,391.90	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,182,800.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,700,000.00	8,535,328.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,492,500.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,002,100.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	755,370.00	
	REPUBLIC OF IRELAND	6,150,000.00	7,285,290.00	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,512,016.00	
	SPANISH GOVERNMENT	12,500,000.00	19,055,000.00	
	SPANISH GOVERNMENT	3,000,000.00	4,084,665.00	
小計	銘柄数：259	1,570,790,000.00	1,936,263,811.10	
			(256,206,427,484)	
	組入時価比率：41.6%		42.1%	
英ポンド	UK TREASURY	3,580,000.00	3,624,893.20	
	UK TREASURY	500,000.00	520,615.00	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,074,010.00	
	UK TREASURY	19,890,000.00	20,405,151.00	
	UK TREASURY	7,050,000.00	7,537,860.00	
	UK TREASURY	3,300,000.00	3,354,945.00	
	UK TREASURY	7,540,000.00	9,190,355.20	
	UK TREASURY	670,000.00	732,879.50	

	UK TREASURY	4,250,000.00	4,739,557.50	
	UK TREASURY	9,200,000.00	8,990,148.00	
	UK TREASURY	10,100,000.00	10,400,576.00	
	UK TREASURY	2,100,000.00	2,055,228.00	
	UK TREASURY	5,100,000.00	5,391,057.00	
	UK TREASURY	10,250,000.00	11,200,482.50	
	UK TREASURY	11,850,000.00	14,734,527.00	
	UK TREASURY	10,030,000.00	12,501,993.80	
	UK TREASURY	6,100,000.00	8,744,960.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	7,680,750.00	
	UK TREASURY	5,750,000.00	7,545,150.00	
	UK TREASURY	6,600,000.00	9,107,340.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	3,966,040.00	
	UK TREASURY	800,000.00	782,960.00	
	UK TREASURY	2,300,000.00	3,438,730.00	
	UK TREASURY	5,800,000.00	8,220,340.00	
	UK TREASURY	2,800,000.00	4,015,200.00	
	UK TREASURY	5,900,000.00	8,909,590.00	
	UK TREASURY	20,100,000.00	26,739,030.00	
	UK TREASURY	6,400,000.00	9,704,320.00	
	UK TREASURY	4,300,000.00	3,922,460.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,398,965.00	
	UK TREASURY	8,750,000.00	13,062,875.00	
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,504,050.00	
	UK TREASURY	400,000.00	504,440.00	
	UK TREASURY	4,750,000.00	7,645,125.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	20,300,000.00	25,799,270.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT	7,100,000.00	11,949,300.00	
小計	銘柄数：36	230,010,000.00	288,095,173.70	
			(43,522,537,890)	
	組入時価比率：7.1%		7.1%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	4,800,000.00	5,187,360.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,150,000.00	4,372,515.00	
小計	銘柄数：2	7,950,000.00	9,559,875.00	
			(1,056,652,983)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	

スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	9,700,000.00	11,106,500.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	48,850,000.00	56,187,270.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	28,300,000.00	30,458,327.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	33,750,000.00	38,772,000.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,444,528.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	14,100,000.00	14,108,756.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	17,800,000.00	24,670,444.00	
小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.4%	164,500,000.00	187,747,825.90 (2,395,662,258) 0.4%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	21,200,000.00	22,045,880.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	27,600,000.00	29,774,880.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	16,000,000.00	16,407,200.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	48,453,835.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,717,390.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,605,060.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,483,840.00	
小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.3%	128,700,000.00	135,488,085.00 (1,862,961,168) 0.3%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	10,300,000.00	11,047,265.00	
	KINGDOM OF DENMARK	5,000,000.00	5,091,750.00	
	KINGDOM OF DENMARK	37,100,000.00	41,401,745.00	
	KINGDOM OF DENMARK	32,470,000.00	35,043,247.50	
	KINGDOM OF DENMARK	31,400,000.00	34,712,700.00	
	KINGDOM OF DENMARK	12,200,000.00	12,072,510.00	
	KINGDOM OF DENMARK	42,000,000.00	69,708,240.00	
小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.6%	170,470,000.00	209,077,457.50 (3,715,306,419) 0.6%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	2,400,000.00	2,368,452.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,700,000.00	2,765,016.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	7,500,000.00	7,965,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,500,000.00	6,501,300.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	30,700,000.00	33,450,720.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	15,239,475.00	

	POLAND GOVERNMENT BOND	700,000.00	703,150.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	11,469,550.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,400,000.00	3,418,700.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	13,453,125.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	19,700,000.00	20,202,350.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	9,500,000.00	9,176,525.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,112,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,748,520.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,609,830.00	
小計	銘柄数：15	126,800,000.00	135,183,713.00	
			(4,281,268,190)	
	組入時価比率：0.7%		0.7%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	303,072.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,850,000.00	13,444,196.85	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,300,000.00	12,168,660.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	11,366,225.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,044,710.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	9,980,960.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	297,225.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,247,518.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,257,600.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,500,000.00	11,928,260.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	14,132,124.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,700,000.00	13,531,389.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,187,776.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,500,000.00	10,898,550.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,192,448.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	10,496,071.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	8,850,487.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,711,593.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,843,507.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,392,020.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,140,580.00	
小計	銘柄数：21	146,730,000.00	155,414,976.75	
			(12,848,156,127)	

	組入時価比率：2.1%		2.1%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,500,000.00	2,520,515.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,000,000.00	4,122,104.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,980,000.00	2,999,966.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	973,800.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	296,370.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,461,880.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,078,000.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,286,900.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,219,312.50
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,462,400.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	850,000.00	922,832.25
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,300,000.00	3,250,500.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	786,200.00
	小計	銘柄数：13	28,630,000.00
	組入時価比率：0.4%		0.4%
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	804,903.20
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	402,655.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,406,751.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,732,854.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,600,000.00	6,593,505.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,418,943.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,099,156.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,796,918.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,526,367.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	498,955.50
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,000,000.00	12,795,263.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,861,085.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	597,025.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	8,971,767.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,581,778.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,751,189.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,895,007.50
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,762,853.90
			4,400,000.00

	MALAYSIAN GOVERNMENT			
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,524,948.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	371,008.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	859,551.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	9,813,441.50	
小計	銘柄数：23	107,500,000.00	107,384,942.80	
			(2,971,341,367)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,300,000.00	9,348,439.05	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	20,300,000.00	20,089,574.26	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,700,000.00	26,955,174.57	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	71,300,000.00	82,152,950.89	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	28,000,000.00	27,141,128.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	26,493,000.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,400,000.00	45,127,020.64	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,800,000.00	6,878,061.96	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,100,000.00	29,497,877.25	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00	30,985,600.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,800,000.00	8,883,387.92	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,600,000.00	23,506,044.84	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	71,100,000.00	69,742,573.02	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	50,200,000.00	49,272,730.70	
小計	銘柄数：14	469,600,000.00	456,073,563.10	
			(4,068,176,182)	
	組入時価比率：0.7%		0.7%	
合計			609,174,224,941	
			(609,174,224,941)	

(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	2018年 4月23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	256,713,728	-	256,804,000	90,272
米ドル	150,512,320	-	150,948,000	435,680
ユーロ	106,201,408	-	105,856,000	345,408
合計	256,713,728	-	256,804,000	90,272

(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。

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2018年 4月23日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	281,466,138
コール・ローン	253,755,417
国債証券	33,991,810,718
派生商品評価勘定	5,997,188
未収利息	159,236,053
前払費用	135,064,277
差入委託証拠金	297,388
流動資産合計	34,827,627,179
資産合計	
34,827,627,179	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	293,426,579
未払金	246,183,850
未払解約金	8,319,970
未払利息	459
その他未払費用	506,500
流動負債合計	548,437,358
負債合計	
548,437,358	
純資産の部	
元本等	

(2018年 4月23日現在)

元本	30,636,789,232
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,642,400,589
元本等合計	34,279,189,821
純資産合計	34,279,189,821
負債純資産合計	34,827,627,179

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>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)

2018年 4月23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	1.1189円
(10,000口当たり純資産額)	(11,189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 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに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

2018年 4月23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

2018年 4月23日現在

	2017年 4月25日
期首	
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	12,866,590,641円
同期中における追加設定元本額	60,409,707,138円
同期中における一部解約元本額	42,639,508,547円
期末元本額	30,636,789,232円
期末元本額の内訳*	
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	645,898,927円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	866,426,353円
野村ターゲットデートファンド2016 - 2026 - 2028年目標型	13,309,737円
野村ターゲットデートファンド2016 - 2029 - 2031年目標型	3,471,873円

野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	2,337,376円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,364,489円
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	769,434,424円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,491,565円
インデックス・ブレンド(タイプ)	8,706,723円
インデックス・ブレンド(タイプ)	14,451,833円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,780,091円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,538,162円
野村外国債券インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	11,106,954,529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)	5,940,707,069円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	950,323,522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)	10,298,592,559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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2018年4月23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	70,000.00	81,927.34	
		US TREASURY BOND	210,000.00	255,445.30	
		US TREASURY BOND	2,680,000.00	3,405,484.30	
		US TREASURY BOND	280,000.00	343,065.60	
		US TREASURY BOND	20,000.00	24,132.81	
		US TREASURY BOND	80,000.00	96,881.24	
		US TREASURY BOND	1,810,000.00	1,732,085.10	
		US TREASURY BOND	1,850,000.00	2,052,488.23	
		US TREASURY N/B	300,000.00	297,457.02	
		US TREASURY N/B	3,660,000.00	3,631,406.25	
		US TREASURY N/B	200,000.00	196,414.06	
		US TREASURY N/B	970,000.00	985,876.08	
		US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,526,171.56	
		US TREASURY N/B	4,400,000.00	4,334,859.32	

US TREASURY N/B	430,000.00	436,164.43	
US TREASURY N/B	2,520,000.00	2,464,284.31	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,473,456.90	
US TREASURY N/B	2,140,000.00	2,184,638.90	
US TREASURY N/B	1,130,000.00	1,099,984.37	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,173,937.44	
US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,407,546.04	
US TREASURY N/B	3,150,000.00	3,085,523.28	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,030,312.50	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,540,382.78	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,773,093.68	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,946,015.60	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,301,187.50	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,983,827.90	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,802,616.91	
US TREASURY N/B	3,580,000.00	3,520,146.69	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,565,875.00	
US TREASURY N/B	2,450,000.00	2,407,316.34	
US TREASURY N/B	200,000.00	194,828.12	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,447,617.15	
US TREASURY N/B	200,000.00	192,781.24	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,307,937.44	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,634,609.24	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,153,125.00	
US TREASURY N/B	3,300,000.00	3,149,179.44	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	2,988,109.22	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,081,499.84	
US TREASURY N/B	500,000.00	481,093.75	
US TREASURY N/B	2,650,000.00	2,520,398.30	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,194,671.76	
US TREASURY N/B	3,110,000.00	3,000,178.12	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,359,765.50	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,165,452.96	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,381,140.54	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,380,859.25	

	US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,538,624.96	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	944,140.60	
	US TREASURY N/B	3,280,000.00	3,081,918.50	
	US TREASURY N/B	3,340,000.00	3,187,090.45	
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,091,343.58	
	US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,174,812.32	
	US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,829,375.00	
	US TREASURY N/B	1,740,000.00	2,236,715.53	
	US TREASURY N/B	1,260,000.00	1,535,723.40	
	US TREASURY N/B	300,000.00	355,359.36	
	US TREASURY N/B	950,000.00	1,183,566.33	
	US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,848,331.16	
	US TREASURY N/B	700,000.00	619,062.50	
	US TREASURY N/B	2,240,000.00	2,185,049.88	
	US TREASURY N/B	2,560,000.00	2,436,399.87	
	US TREASURY N/B	1,720,000.00	1,676,731.16	
	US TREASURY N/B	830,000.00	731,307.77	
	US TREASURY N/B	930,000.00	774,878.88	
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,709,296.74	
	US TREASURY N/B	1,220,000.00	1,128,023.34	
小計	銘柄数：69	134,690,000.00	133,061,002.98	
			(14,349,298,561)	
	組入時価比率：41.9%		42.2%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	980,000.00	967,113.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	900,000.00	893,250.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,070,000.00	1,032,368.10	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,222,507.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	580,008.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	560,000.00	568,114.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	482,740.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	484,535.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	120,000.00	159,462.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	284,738.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	680,000.00	864,688.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	440,000.00	469,304.00	

小計	銘柄数：12 組入時価比率：2.0%	7,680,000.00	8,008,828.00 (676,505,701) 2.0%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	900,000.00	868,212.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,000,000.00	3,043,020.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,200,000.00	8,993,092.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	4,509,000.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,100,000.00	6,104,453.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,100,000.00	3,132,829.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,000,000.00	3,694,770.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	5,426,100.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	1,300,000.00	1,344,401.50
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	7,300,000.00	7,526,373.00
	小計	銘柄数：10 組入時価比率：0.8%	43,900,000.00
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	630,336.00
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	330,638.70
	BELGIUM KINGDOM	340,000.00	392,768.00
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	357,570.00
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	200,280.00
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	262,545.00
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	706,723.50
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	103,326.60
	BELGIUM KINGDOM	850,000.00	855,719.65
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	595,513.80
	BELGIUM KINGDOM	250,000.00	345,526.25
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	101,235.00
	BELGIUM KINGDOM	220,000.00	239,098.64
	BELGIUM KINGDOM	750,000.00	1,114,819.50
	BELGIUM KINGDOM	70,000.00	75,892.74
	BELGIUM KINGDOM GOVT	270,000.00	427,109.76
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	340,713.78
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,470,000.00	1,514,990.82
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	722,176.00
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	420,000.00	473,532.36

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	502,435.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,230,000.00	1,263,581.46	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	890,000.00	1,085,890.78	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	700,000.00	706,650.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	840,000.00	1,021,270.32	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,220,000.00	1,452,410.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	381,254.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,320,000.00	1,417,914.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,019,133.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,900,000.00	1,940,732.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	30,000.00	41,316.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	209,650.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	644,700.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	600,000.00	887,332.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	850,000.00	962,449.05	
BUNDESobligation	1,200,000.00	1,215,324.00	
BUNDESobligation	1,200,000.00	1,214,760.00	
BUNDESobligation	700,000.00	707,700.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	350,000.00	367,461.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	323,400.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	799,275.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	921,740.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,190,420.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,310,000.00	1,411,787.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	910,000.00	997,278.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	463,064.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,200,000.00	1,213,212.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	193,104.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,370,000.00	1,342,956.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	747,060.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	787,385.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	945,488.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	310,000.00	496,939.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	30,000.00	51,714.09	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,250,000.00	1,806,145.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	410,000.00	533,848.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	99,514.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	400,000.00	403,496.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,535,475.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,736,499.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	184,235.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	505,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	360,000.00	395,028.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,833,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	188,215.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,011,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	11,535.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	450,000.00	452,562.75	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,330,000.00	1,380,540.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,978,238.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,600,000.00	1,625,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	178,353.45	
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	259,488.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	240,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	850,000.00	1,063,718.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES	230,000.00	240,442.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,220,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,368,080.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,300,000.00	1,362,270.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	690,000.00	878,646.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	600,000.00	565,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	470,000.00	481,515.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,110,000.00	1,509,822.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	195,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	680,000.00	840,344.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	208,665.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,180,000.00	1,614,476.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	560,000.00	615,664.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	9,458.00	
FINNISH GOVERNMENT	50,000.00	53,826.00	

FINNISH GOVERNMENT	90,000.00	91,702.35	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	301,237.50	
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	160,716.30	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	220,890.00	
FINNISH GOVERNMENT	310,000.00	309,769.36	
FINNISH GOVERNMENT	240,000.00	287,494.32	
FINNISH GOVERNMENT	60,000.00	77,535.90	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,016,901.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	508,329.50	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	504,756.00	
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	403,660.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,194,152.30	
FRANCE (GOVT OF)	1,310,000.00	1,469,791.18	
FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	898,187.40	
FRANCE (GOVT OF)	1,850,000.00	1,795,741.35	
FRANCE (GOVT OF)	420,000.00	493,908.66	
FRANCE (GOVT OF)	1,350,000.00	1,337,445.00	
FRANCE (GOVT OF)	350,000.00	371,903.35	
FRANCE (GOVT OF)	1,180,000.00	1,278,754.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	200,000.00	227,467.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,296,120.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	914,670.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,140,000.00	1,279,935.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,620,000.00	1,824,703.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,010,000.00	1,114,588.53	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	700,000.00	765,656.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,410,000.00	1,745,580.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,300,000.00	1,543,490.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	200,000.00	298,040.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,040,000.00	1,097,807.36	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	990,000.00	1,534,088.16	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	520,000.00	834,761.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	500,706.00	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	170,000.00	179,452.00	
IRISH GOVERNMENT	200,000.00	218,860.00	

	IRISH GOVERNMENT	300,000.00	329,604.00	
	IRISH GOVERNMENT	200,000.00	198,360.00	
	IRISH TSY 0.8% 2022	300,000.00	310,110.00	
	IRISH TSY 1.7% 2037	250,000.00	257,200.00	
	IRISH TSY 1% 2026	350,000.00	358,526.00	
	IRISH TSY 2% 2045	50,000.00	53,212.60	
	IRISH TSY 3.4% 2024	600,000.00	707,964.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	105,700.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	405,961.60	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	900,000.00	1,003,860.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	250,000.00	275,150.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	530,000.00	625,495.40	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	326,658.30	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,200,000.00	1,199,520.00	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	202,180.80	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	350,000.00	424,178.65	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	510,000.00	784,348.89	
	NETHERLANDS GOVERNMENT	150,000.00	204,177.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	10,000.00	8,801.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	202,360.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	1,035,360.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	520,000.00	565,990.88	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	708,610.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	295,290.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	390,324.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	194,665.38	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	416,250.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	130,000.00	218,218.00	
	REPUBLIC OF IRELAND	80,000.00	94,768.00	
	SPANISH GOVERNMENT	90,000.00	132,255.09	
	SPANISH GOVERNMENT	410,000.00	558,237.55	
小計	銘柄数：156	98,060,000.00	108,997,424.99 (14,422,539,274)	
	組入時価比率：42.1%		42.5%	
英債券	UK TREASURY	300,000.00	303,762.00	

	UK TREASURY	60,000.00	62,473.80	
	UK TREASURY	1,280,000.00	1,313,152.00	
	UK TREASURY	700,000.00	711,655.00	
	UK TREASURY	420,000.00	468,379.80	
	UK TREASURY	600,000.00	617,856.00	
	UK TREASURY	600,000.00	587,208.00	
	UK TREASURY	250,000.00	264,267.50	
	UK TREASURY	400,000.00	437,092.00	
	UK TREASURY	1,720,000.00	1,731,386.40	
	UK TREASURY	90,000.00	129,024.00	
	UK TREASURY	400,000.00	539,000.00	
	UK TREASURY	960,000.00	1,312,896.00	
	UK TREASURY	950,000.00	929,765.00	
	UK TREASURY	1,150,000.00	1,736,615.00	
	UK TREASURY	1,480,000.00	2,244,124.00	
	UK TREASURY	640,000.00	1,004,736.00	
	UK TREASURY	800,000.00	1,194,320.00	
	UK TREASURY	130,000.00	209,235.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	230,000.00	387,090.00	
小計	銘柄数：20	13,160,000.00	16,184,037.50	
			(2,444,922,545)	
	組入時価比率：7.1%		7.2%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	80,000.00	86,456.00	
	SWITZERLAND GOVERNMENT	80,000.00	111,048.00	
小計	銘柄数：2	160,000.00	197,504.00	
			(21,830,117)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	600,000.00	687,000.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	3,500,000.00	4,025,700.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,183,892.60	
	SWEDISH GOVERNMENT	250,000.00	287,200.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,074,088.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,000,621.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,524,578.00	
小計	銘柄数：7	9,550,000.00	10,783,079.60	
			(137,592,095)	

	組入時価比率：0.4%		0.4%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,050,000.00	1,132,740.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,948,355.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	750,000.00	809,362.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,665,660.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	350,000.00	345,765.00	
	小計	銘柄数：5	5,750,000.00	5,901,882.50
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	450,000.00	482,647.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,550,000.00	1,578,442.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,500,000.00	1,673,925.00	
	KINGDOM OF DENMARK	650,000.00	701,512.50	
	KINGDOM OF DENMARK	1,400,000.00	1,547,700.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,300,000.00	1,286,415.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,300,000.00	3,817,356.00	
小計	銘柄数：7	9,150,000.00	11,087,998.50	(197,033,733)
	組入時価比率：0.6%		0.6%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	169,920.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	900,000.00	900,180.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	400,000.00	402,560.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,650,000.00	1,643,400.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	150,000.00	169,327.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	160,000.00	160,720.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,506,750.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	965,950.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	950,000.00	912,000.00	
小計	銘柄数：9	6,770,000.00	6,830,807.50	(216,331,673)
	組入時価比率：0.6%		0.6%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	680,000.00	686,963.88	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	70,000.00	73,236.87	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	811,244.04	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	890,243.10	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	136,104.00	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	495,375.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	570,834.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	352,661.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,120,000.00	1,238,496.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	138,783.48	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	697,326.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,120,000.00	1,061,424.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	295,020.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	370,000.00	436,624.05	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	162,319.65	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	119,316.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	249,399.00	
小計	銘柄数：17	8,200,000.00	8,415,371.17	
			(695,698,734)	
	組入時価比率：2.0%		2.0%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	930,000.00	905,634.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	900,000.00	923,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	380,000.00	411,112.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	411,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	610,000.00	625,860.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	187,220.00	
小計	銘柄数：6	3,420,000.00	3,464,626.50	
			(283,856,849)	
	組入時価比率：0.8%		0.8%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	791,707.36	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	504,778.55	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,900,000.00	3,341,424.37	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,650,000.00	3,538,039.90	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,800,000.00	2,472,680.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,500,000.00	3,540,178.95	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,800,000.00	4,647,840.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,250,000.00	4,171,496.12	
小計	銘柄数：8	23,200,000.00	23,008,145.25	
			(205,232,655)	
	組入時価比率：0.6%		0.6%	
合計			33,991,810,718	

(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	2018年 4月23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	172,127,319	-	171,853,000	274,319
米ドル	75,152,000	-	75,481,000	329,000
ユーロ	66,480,475	-	66,160,000	320,475
英ポンド	30,494,844	-	30,212,000	282,844
売建	34,523,425,569	-	34,810,580,641	287,155,072
米ドル	14,518,072,025	-	14,671,856,430	153,784,405
カナダドル	677,743,189	-	692,415,230	14,672,041
メキシコペソ	268,312,734	-	268,297,020	15,714
ユーロ	14,639,477,570	-	14,730,975,600	91,498,030
英ポンド	2,537,664,311	-	2,552,207,796	14,543,485
スイスフラン	24,796,667	-	24,542,100	254,567
スウェーデンクローナ	141,730,181	-	141,457,360	272,821
ノルウェークローネ	82,966,885	-	83,937,660	970,775
デンマーククローネ	200,039,599	-	201,426,504	1,386,905
ズロチ	216,335,188	-	219,328,480	2,993,292
豪ドル	708,591,508	-	717,124,720	8,533,212
シンガポールドル	290,063,744	-	292,300,461	2,236,717
ランド	217,631,968	-	214,711,280	2,920,688
合計	-	-	-	287,429,391

(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)

(2018年 4月23日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	107,145,392
コール・ローン	35,836,077
国債証券	13,959,140,269
派生商品評価勘定	82,006
未収利息	151,115,480
前払費用	20,764,837
流動資産合計	14,274,084,061
資産合計	
	14,274,084,061
負債の部	
流動負債	
未払金	24,290,960
未払解約金	5,021,744
未払利息	64
その他未払費用	266,800
流動負債合計	29,579,568
負債合計	
	29,579,568
純資産の部	
元本等	
元本	8,034,951,314
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	6,209,553,179
元本等合計	14,244,504,493
純資産合計	14,244,504,493
負債純資産合計	14,274,084,061

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 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。 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	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。
4.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)

2018年 4月23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	1.7728円
(10,000口当たり純資産額)	(17,728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 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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

2018年 4月23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

2018年 4月23日現在	
期首	2017年 4月25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	4,948,646,954円
同期中における追加設定元本額	4,082,724,822円
同期中における一部解約元本額	996,420,462円
期末元本額	8,034,951,314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	1,459,700,350円
ネクストコア	64,789,904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	410,256,776円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,287,392円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,305,389円
インデックス・ブレンド(タイプ)	7,143,412円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,221,005円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,569,565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)	745,635,753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)	1,284,092,055円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	94,879,876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)	72,602,371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)	3,500,246円
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	218,705,389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)	3,256,892,865円
野村DC運用戦略ファンド	396,140,908円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	11,228,058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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2018年4月23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	984,342.78	
		ARGENT-GLOBAL	420,000.00	630,664.69	
		ARGENT-GLOBAL	1,600,000.00	1,068,000.00	
		BRAZIL GLOBAL	350,000.00	380,625.00	
		BRAZIL GLOBAL	650,000.00	822,250.00	
		BRAZIL GLOBAL	820,000.00	1,028,493.20	
		BRAZIL GLOBAL	700,000.00	807,107.00	
		COLOMBIA GLOBAL	250,000.00	306,937.50	
		COLOMBIA GLOBAL	620,000.00	796,080.00	
		CROATIA	600,000.00	643,434.00	
		CROATIA	500,000.00	539,975.00	
		CROATIA	800,000.00	857,008.00	
		CROATIA	600,000.00	661,026.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,230,000.00	1,275,510.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	600,000.00	566,700.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,400,000.00	1,387,750.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	900,000.00	981,900.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	850,000.00	818,125.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,600,000.00	1,395,200.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,200,000.00	1,140,612.00	
		HUNGARY	800,000.00	863,192.00	
		HUNGARY	750,000.00	827,306.25	
		HUNGARY	900,000.00	978,084.00	
		INDONESIA GLOBAL	800,000.00	876,265.60	
		MEXICO GLOBAL	99,000.00	129,690.00	
		MEXICO GLOBAL	380,000.00	464,196.60	
		PANAMA GLOBAL	300,000.00	364,125.00	
		PANAMA GLOBAL	250,000.00	359,375.00	
		PANAMA GLOBAL	750,000.00	943,125.00	

PERU GLOBAL	700,000.00	866,250.00	
PERU GLOBAL	820,000.00	1,044,270.00	
PHILIPPINES GLOBAL	650,000.00	968,891.30	
PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	676,150.00	
PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	617,902.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	900,000.00	824,850.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,200,000.00	2,328,425.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,350,000.00	1,374,300.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,500,000.00	2,671,250.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,600,000.00	1,632,016.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	800,000.00	793,200.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,400,000.00	1,374,800.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,350,000.00	1,346,625.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	700,000.00	721,875.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000.00	570,825.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	1,105,225.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	1,026,875.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	900,000.00	876,375.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,020,000.00	1,164,330.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	900,000.00	976,500.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,700,000.00	1,705,950.00	
REPUBLIC OF CROATIA	300,000.00	316,611.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	720,000.00	759,441.60	
REPUBLIC OF HUNGARY	1,000,000.00	1,085,072.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	450,000.00	648,450.90	
REPUBLIC OF INDONESIA	500,000.00	521,222.50	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,201,946.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	900,000.00	880,775.10	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,400,000.00	1,406,057.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,246,580.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	706,216.70	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	389,307.60	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	812,106.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	629,506.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	195,042.80	

REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	1,007,363.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	825,544.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	922,556.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	842,403.20	
REPUBLIC OF PANAMA	850,000.00	884,850.00	
REPUBLIC OF PANAMA	400,000.00	401,000.00	
REPUBLIC OF PANAMA	900,000.00	897,750.00	
REPUBLIC OF PANAMA	500,000.00	497,500.00	
REPUBLIC OF PERU	600,000.00	624,300.00	
REPUBLIC OF PERU	700,000.00	830,550.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,300,000.00	1,332,084.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,900,000.00	1,975,158.30	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	300,000.00	337,934.40	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	761,721.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	600,000.00	669,138.60	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,200,000.00	1,182,872.40	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,100,000.00	1,039,671.60	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	650,000.00	675,965.55	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000.00	934,312.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	250,000.00	268,357.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	300,000.00	300,956.10	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	950,000.00	1,007,133.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	694,715.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	900,000.00	835,794.90	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	188,452.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	447,132.50	
REPUBLIC OF TURKEY	800,000.00	828,280.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	609,920.40	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,267,323.60	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	364,086.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,223,679.60	
REPUBLIC OF TURKEY	1,600,000.00	1,617,016.00	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	407,280.00	
REPUBLIC OF TURKEY	900,000.00	843,467.40	
REPUBLIC OF TURKEY	2,000,000.00	1,615,070.00	

REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	1,088,532.50	
REPUBLIC OF TURKEY	1,400,000.00	1,244,894.00	
ROMANIA	400,000.00	443,400.00	
ROMANIA	800,000.00	820,744.00	
ROMANIA	700,000.00	735,105.00	
ROMANIA	400,000.00	476,806.00	
RUSSIA	1,557,500.00	1,743,741.17	
RUSSIA FOREIGN BOND	1,300,000.00	1,329,198.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,012,460.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,444,730.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,411,706.80	
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	968,565.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,200,000.00	1,250,904.00	
RUSSIAN FEDERATION	400,000.00	430,076.00	
RUSSIAN FEDERATION	2,800,000.00	2,694,876.80	
TURKEY GLOBAL	650,000.00	687,924.25	
TURKEY GLOBAL	1,800,000.00	1,844,146.80	
TURKEY GLOBAL	1,250,000.00	1,384,587.50	
TURKEY GLOBAL	450,000.00	666,738.90	
UKRAINE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,131,000.00	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	765,000.00	800,993.25	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	409,000.00	427,664.71	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	509,000.00	527,171.30	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	716,017.40	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	800,000.00	812,300.00	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,300,000.00	1,302,730.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,107,700.00	
UNITED MEXICAN STATES	900,000.00	914,400.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,110,912.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,750,000.00	1,781,281.25	
UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,177,200.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,000,000.00	1,006,250.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,400,000.00	1,397,200.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,110,000.00	1,242,922.50	
UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,530,400.00	

		UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,402,713.00	
		UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,216,150.00	
		UNITED MEXICAN STATES	700,000.00	635,264.00	
	小計	銘柄数：137	124,569,500.00	129,443,066.30	
		組入時価比率：98.0%		(13,959,140,269)	
				100.0%	
	合計			13,959,140,269	
				(13,959,140,269)	

(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	2018年 4月23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	25,795,594	-	25,877,600	82,006
米ドル	25,795,594	-	25,877,600	82,006
合計	25,795,594	-	25,877,600	82,006

(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。

貸借対照表

(単位：円)

(2018年 4月23日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	30,278,104
コール・ローン	24,399,183
社債券	1,923,469,554
派生商品評価勘定	59,850
未収利息	24,642,121
前払費用	2,034,890
流動資産合計	2,004,883,702
資産合計	2,004,883,702
負債の部	
流動負債	
未払金	40,654,580
未払解約金	557,815
未払利息	44
流動負債合計	41,212,439
負債合計	41,212,439
純資産の部	
元本等	
元本	1,731,304,452
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	232,366,811
元本等合計	1,963,671,263
純資産合計	1,963,671,263
負債純資産合計	2,004,883,702

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	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。 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. 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	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。
4. 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）

2018年 4月23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	1.1342円
(10,000口当たり純資産額)	(11,342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 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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> <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

2018年 4月23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> 社債券</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

2018年 4月23日現在	
期首	2017年 4月25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	1,182,823,996円
同期中における追加設定元本額	833,816,537円
同期中における一部解約元本額	285,336,081円
期末元本額	1,731,304,452円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・米国ハイ・イールド債券	881,751,611円
野村インデックスファンド・米国ハイ・イールド債券・為替ヘッジ型	341,734,203円
インデックス・ブレンド(タイプ)	605,424円
インデックス・ブレンド(タイプ)	695,924円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,188,052円
インデックス・ブレンド(タイプ)	546,944円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,257,991円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	150,468,279円
米国ハイ・イールド債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	350,056,024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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2018年4月23日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	1011778 BC / NEW RED FIN	120,000.00	116,250.00	
		ACRISURE LLC / FIN INC	50,000.00	47,875.00	
		ADT CORP	100,000.00	105,375.00	
		AECOM	50,000.00	52,625.00	
		AES CORP/VA	70,000.00	74,375.00	
		AIRCASTLE LTD	50,000.00	49,312.50	
		ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	50,000.00	44,062.50	
		ALCOA INC	50,000.00	51,968.75	
		ALERIS INTL INC	50,000.00	52,000.00	

ALLY FINANCIAL INC	100,000.00	103,875.00	
ALTICE SA	200,000.00	193,252.00	
AMC ENTERTAINMENT INC	50,000.00	49,190.00	
AMC NETWORKS INC	50,000.00	49,875.50	
AMERICAN AIRLINES GROUP	50,000.00	50,500.00	
AMERICAN AXLE & MFG INC	50,000.00	50,562.50	
AMERIGAS PART/FIN CORP	50,000.00	49,437.50	
ANTERO RESOURCES FINANCE	50,000.00	50,500.00	
ARAMARK SERVICES INC	50,000.00	50,812.50	
ARCELORMITTAL	50,000.00	54,643.00	
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000.00	199,500.00	
ARGOS MERGER SUB INC	50,000.00	29,250.00	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	50,000.00	50,500.00	
ASCENT RESOURCES/ARU FIN	50,000.00	53,985.00	
ASHTeAD CAPITAL INC	200,000.00	193,250.00	
AVANTOR INC	70,000.00	70,263.20	
B&G FOODS INC	50,000.00	46,500.00	
BALL CORP	60,000.00	61,425.00	
BERRY PLASTICS CORP	50,000.00	50,625.00	
BLUE CUBE SPINCO INC	50,000.00	58,000.00	
BLUE RACER MID LLC/FINAN	50,000.00	51,625.00	
BLUELINE RENTAL CRP / LL	50,000.00	53,546.50	
BOMBARDIER INC	30,000.00	31,800.00	
BOMBARDIER INC	100,000.00	105,250.00	
BOYD GAMING CORP	50,000.00	52,875.00	
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	50,000.00	50,437.50	
BUILDING MATERIALS CORP	50,000.00	50,875.00	
BWAY HOLDING CO	50,000.00	50,610.00	
CALIFORNIA RESOURCES CRP	50,000.00	42,865.00	
CALPINE CORP	50,000.00	46,375.00	
CALPINE CORP	50,000.00	48,437.50	
CALUMET SPECIALTY PROD	20,000.00	19,850.00	
CARRIZO OIL & GAS INC	50,000.00	51,750.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	100,000.00	100,970.00	
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	100,000.00	102,875.00	

CCO HLDGS LLC/CAP CORP	130,000.00	121,875.00	
CDK GLOBAL INC	50,000.00	48,750.00	
CDW LLC/CDW FINANCE	50,000.00	51,268.00	
CENTENE CORP	50,000.00	51,125.00	
CENTENE CORP	50,000.00	52,406.25	
CENTURYLINK INC	70,000.00	71,575.00	
CEQUEL COM HLDG 1/CAP CP	50,000.00	50,302.50	
CF INDUSTRIES INC	100,000.00	95,875.00	
CHANGE HEALTH / FIN INC	50,000.00	49,187.50	
CHEMOURS CO	70,000.00	75,775.00	
CHENIERE CORP CHRISTI HD	100,000.00	104,625.00	
CHENIERE ENERGY PARTNERS	50,000.00	49,875.00	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	38,000.00	40,422.50	
CHESAPEAKE ENERGY CORP	60,000.00	58,800.00	
CHOBANI LLC/FINANCE CORP	12,000.00	12,240.00	
CHS/COMMUNITY HEALTH	90,000.00	50,625.00	
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	80,000.00	73,700.00	
CIT GROUP INC	50,000.00	50,437.50	
CLIFFS NATURAL RESOURCES	50,000.00	48,937.50	
CNO FINANCIAL GROUP INC	70,000.00	70,875.00	
COMMSCOPE TECH FINANCE L	50,000.00	52,250.00	
COMMUNICATIONS SALES & L	50,000.00	48,187.50	
CONSOL ENERGY INC	40,000.00	40,400.00	
CONTINENTAL RESOURCES	30,000.00	29,700.00	
CORTES NP ACQUISITION	50,000.00	51,625.00	
COTT HOLDINGS INC	50,000.00	49,890.00	
CRC ESCROW ISSUER LLC	50,000.00	48,562.50	
CRESTWOOD MIDSTREAM PART	50,000.00	51,125.00	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	195,750.00	
DAKOTA MERGER SUB INC	20,000.00	22,500.00	
DAVITA HEALTHCARE PARTNE	100,000.00	96,300.00	
DELL INT LLC/EMC CORP	100,000.00	107,142.27	
DEUTSCHE BANK AG	200,000.00	193,565.52	
DIAMOND 1 FIN/DIAMOND 2	70,000.00	71,901.28	
DISH DBS CORP	50,000.00	45,562.50	

DISH DBS CORP	100,000.00	96,375.00	
DJO FINCO INC/DJO FINANC	30,000.00	30,300.00	
DYNEGY INC	100,000.00	108,250.00	
ELDORADA RESORTS INC	20,000.00	20,050.00	
ENDEAVOR ENERGY RESOURCE	50,000.00	50,500.00	
ENDO FIN LLC/ENDO FINCO	100,000.00	73,250.00	
ENERGY TRANSFER EQUITY	50,000.00	50,250.00	
ENSCO PLC	50,000.00	41,937.50	
EP ENER/EVEREST ACQ FIN	50,000.00	38,500.00	
EP ENER/EVEREST ACQ FIN	16,000.00	16,560.00	
EQUINIX INC	50,000.00	52,625.00	
ESH HOSPITALITY INC	50,000.00	49,625.00	
EXELA INTERMED/EXELA FIN	20,000.00	20,325.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE	200,000.00	203,250.00	
FIRST DATA CORPORATION	50,000.00	51,250.00	
FIRST DATA CORPORATION	100,000.00	105,160.00	
FIRST DATA CORPORATION	50,000.00	51,312.50	
FIRST QUALITY FINANCE CO	100,000.00	100,125.00	
FMG RESOURCES AUG 2006	50,000.00	49,562.50	
FREEPORT MCMORAN	50,000.00	54,062.50	
FREEPORT-MCMORAN INC	50,000.00	48,875.00	
FRESH MARKET INC	20,000.00	11,300.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS	30,000.00	26,400.00	
FRONTIER COMMUNICATIONS	110,000.00	85,456.25	
FRONTIER COMMUNICATIONS	40,000.00	39,300.00	
GANNETT CO INC	54,000.00	54,405.00	
GARTNER INC	50,000.00	50,485.00	
GENESIS ENERGY LP/GENESI	50,000.00	51,250.00	
GLP CAPITAL LP / FIN II	50,000.00	50,985.00	
GOLDEN NUGGET INC	50,000.00	51,187.50	
GOODYEAR TIRE & RUBBER	100,000.00	98,625.00	
GRAY TELEVISION INC	100,000.00	97,750.00	
GRIFFON CORPORATION	50,000.00	50,625.00	
GRINDING MED/MC GRINDING	50,000.00	53,125.00	
GULFPORT ENERGY CORP	50,000.00	47,812.50	

GW HONOS SECURITY CORP	20,000.00	21,050.00	
HANESBRANDS INC	50,000.00	49,250.00	
HARLAND CLARKE HOLDINGS	50,000.00	51,250.00	
HCA INC	70,000.00	70,612.50	
HCA INC	100,000.00	102,250.00	
HCA INC	70,000.00	72,100.00	
HCA INC	50,000.00	48,468.75	
HERC RENTALS INC	58,000.00	62,930.00	
HERTZ CORP	50,000.00	42,000.00	
HILTON WORLDWIDE FIN LLC	100,000.00	98,750.00	
HOWARD HUGHES CORP	50,000.00	50,500.00	
HUGHES SATELLITE SYSTEMS	50,000.00	50,750.00	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	100,000.00	101,875.00	
INCEPTION MRGR/RACKSPACE	50,000.00	50,000.00	
INFOR SOFTWARE PARENT	50,000.00	50,875.00	
INFOR US INC	70,000.00	72,095.10	
INTELSAT JACKSON HLDG	40,000.00	42,500.00	
INTELSAT JACKSON HLDG	110,000.00	108,556.25	
INTERNATIONAL GAME TECH	200,000.00	206,875.00	
INTESA SANPAOLO SPA	200,000.00	201,058.74	
IRON MOUNTAIN INC	80,000.00	77,000.00	
ITALICS MERGER SUB	16,000.00	16,120.00	
JAGUAR LAND ROVER AUTOMO	200,000.00	199,250.00	
JBS USA LLC/JBS USA FINA	50,000.00	47,600.00	
KAR AUCTION SERVICES INC	50,000.00	49,750.00	
KFC HLD/PIZZA HUT/TACO	100,000.00	101,000.00	
KINDRED HEALTHCARE INC	50,000.00	51,625.00	
KLX INC	50,000.00	52,062.50	
LAMB WESTON HLD	50,000.00	50,125.00	
LENNAR CORP	50,000.00	49,250.00	
LEVEL 3 FINANCING INC	70,000.00	69,475.00	
LEVEL 3 FINANCING INC	50,000.00	48,750.00	
LIFEPOINT HEALTH INC	50,000.00	50,250.00	
LPL HOLDINGS INC	50,000.00	49,125.00	
MALLINCKRODT FIN/SB	100,000.00	83,500.00	

MATTEL INC	50,000.00	48,000.00	
MDC PARTNERS INC	50,000.00	49,187.50	
MEG ENERGY CORP	50,000.00	49,812.50	
MEREDITH CORP	50,000.00	51,375.00	
MGM GROWTH/MGM FINANCE	50,000.00	51,875.00	
MGM RESORTS INTL	20,000.00	19,237.50	
MICRON TECHNOLOGY INC	27,000.00	28,316.25	
MOSS CREEK RESOURCES HLD	40,000.00	40,650.00	
MPT OPER PARTNERSP/FINL	100,000.00	98,250.00	
MSCI INC	100,000.00	105,875.00	
MURPHY OIL CORP	50,000.00	50,375.00	
NABORS INDUSTRIES INC	30,000.00	29,541.00	
NAVIENT CORP	50,000.00	52,062.50	
NAVIENT CORP	50,000.00	51,437.50	
NAVISTAR INTL CORP	26,000.00	27,170.00	
NCR CORP	100,000.00	104,000.00	
NETFLIX INC	100,000.00	96,261.00	
NEW AMETHYST CORP	50,000.00	52,687.50	
NEWFIELD EXPLORATION CO	30,000.00	31,650.00	
NEXSTAR ESCROW CORP	70,000.00	69,825.00	
NEXTERA ENERGY OPERATING	50,000.00	49,250.00	
NFP CORP	20,000.00	20,000.00	
NGL ENRGY PART LP/FIN CO	50,000.00	47,750.00	
NGPL PIPECO LLC	50,000.00	50,375.00	
NIELSEN FINANCE LLC/CO	100,000.00	101,000.00	
NOBLE HOLDING INTL LTD	50,000.00	50,812.50	
NOKIA OYJ	50,000.00	48,902.50	
NOVELIS CORP	70,000.00	70,525.00	
NRG ENERGY INC	100,000.00	103,250.00	
NRG YIELD OPERATING LLC	50,000.00	50,500.00	
NUMERICABLE-SFR SA	200,000.00	195,750.00	
NUSTAR LOGISTICS LP	50,000.00	48,062.50	
OASIS PETROLEUM INC	30,000.00	30,825.00	
ONEMAIN FIN HOLDINGS INC	24,000.00	24,915.00	
OPEN TEXT CORP	100,000.00	104,250.00	

ORTHO-CLINICAL DIAGNOSTI	50,000.00	49,610.00	
OWENS-BROCKWAY	50,000.00	51,812.50	
PARK AEROSPACE HOLDINGS	70,000.00	69,825.00	
PARSLEY ENERGY LLC/FINAN	50,000.00	51,375.00	
PBF HOLDING CO LLC	30,000.00	31,200.00	
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP	50,000.00	48,812.50	
PETSMART INC	30,000.00	22,050.00	
PILGRIM'S PRIDE CORP	50,000.00	47,937.50	
PLATFORM SPECIALTY PROD	50,000.00	49,187.50	
POST HOLDINGS INC	100,000.00	94,625.00	
POST HOLDINGS INC	50,000.00	48,062.50	
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	50,000.00	54,125.00	
PROJECT HOMESTAKE MERGER	12,000.00	11,475.00	
PULTE GROUP INC	50,000.00	49,937.50	
QCP SNF WEST/CENTRAL/EAS	18,000.00	18,540.00	
QUICKEN LOANS INC	40,000.00	39,800.00	
QUINTILES TRANSNATIONAL	50,000.00	51,125.00	
RANGE RESOURCES CORP	50,000.00	48,750.00	
RESOLUTE FOREST PRODUCTS	50,000.00	51,000.00	
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	100,000.00	101,345.00	
RITE AID CORP	70,000.00	71,575.00	
ROWAN COMPANIES INC	50,000.00	48,250.00	
SANCHEZ ENERGY CORP	50,000.00	38,375.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	50,000.00	48,479.50	
SCIENTIFIC GAMES INTERNA	60,000.00	65,100.00	
SELECT MEDICAL CORP	50,000.00	50,937.50	
SENSATA TECHNOLOGIES BV	50,000.00	49,875.00	
SERVICE CORP INTL	30,000.00	29,550.00	
SEVEN GENERATIONS ENERGY	50,000.00	48,750.00	
SIRIUS XM RADIO INC	100,000.00	103,250.00	
SIX FLAGS ENTERTAINMENT	50,000.00	50,125.00	
SM ENERGY CO	50,000.00	49,500.00	
SOFTBANK CORP	200,000.00	204,500.00	
SOLERA LLC / SOLERA FINA	50,000.00	55,875.00	
SOUTHWESTERN ENERGY CO	50,000.00	48,500.00	

SPECTRUM BRANDS INC	60,000.00	62,287.80	
SPECTRUM BRANDS INC	100,000.00	102,750.00	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	60,000.00	65,775.00	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	60,000.00	62,010.00	
SPRINT CORP	60,000.00	63,282.00	
SPRINT CORP	120,000.00	123,450.00	
SPRINT CORP	50,000.00	52,375.00	
SPRINT CORP	50,000.00	52,187.50	
STANDARD INDUSTRIES INC	50,000.00	47,510.00	
STAPLES INC	30,000.00	28,725.00	
STARWOOD PROPERTY TRUST	50,000.00	51,375.00	
SUBURBAN PROPANE PARTNRS	50,000.00	48,625.00	
SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	50,000.00	52,125.00	
SUNOCO LP/FINANCE CORP	30,000.00	29,587.50	
SUNOCO LP/FINANCE CORP	20,000.00	19,575.00	
SYMANTEC CORP	50,000.00	50,529.81	
T-MOBILE USA INC	120,000.00	125,700.00	
T-MOBILE USA INC	100,000.00	106,625.00	
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	20,000.00	17,525.00	
TALLGRASS NRG PRTNR/FIN	50,000.00	51,250.00	
TARGA RESOURCES PARTNERS	50,000.00	50,250.00	
TARGA RESOURCES PARTNERS	50,000.00	47,250.00	
TEMPUR SEALY INTL INC	50,000.00	47,940.50	
TENET HEALTHCARE CORP	50,000.00	53,000.00	
TENET HEALTHCARE CORP	80,000.00	79,180.00	
TENET HEALTHCARE CORP	140,000.00	136,412.50	
TENN MERGER SUB INC	20,000.00	17,650.00	
TENNECO INC	50,000.00	47,375.00	
TERRAFORM POWER OPERATIN	50,000.00	48,500.00	
TESLA INC	50,000.00	44,812.50	
TIBCO SOFTWARE INC	50,000.00	54,604.25	
TRANSDIGM INC	50,000.00	51,005.00	
TRANSDIGM INC	50,000.00	51,500.00	
TRANSOCEAN INC	50,000.00	53,937.50	
TRIBUNE MEDIA CO	100,000.00	102,375.00	

	ULTRA RESOURCES INC	30,000.00	23,062.50	
	UNITED RENTALS NORTH AM	70,000.00	68,544.00	
	UNITED RENTALS NORTH AM	100,000.00	101,500.00	
	UNITED STATES STEEL CORP	30,000.00	30,225.00	
	UNIVISION COMMUNICATIONS	100,000.00	96,438.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS	120,000.00	125,100.00	
	VALEANT PHARMACEUTICALS	30,000.00	30,591.00	
	VECTOR GROUP LTD	50,000.00	49,937.50	
	VERISIGN INC	50,000.00	48,812.50	
	VIDEOTRON LTD / LTEE	50,000.00	49,500.00	
	VIKING CRUISES LTD	20,000.00	19,600.00	
	VIRGIN MEDIA SECURED FIN	200,000.00	194,000.00	
	VOC ESCROW LTD	20,000.00	19,500.00	
	VRX ESCROW CORP	130,000.00	119,853.50	
	VRX ESCROW CORP	100,000.00	89,375.00	
	WAYNE MERGER SUB LLC	16,000.00	16,800.00	
	WEATHERFORD BERMUDA	50,000.00	46,250.00	
	WELLCARE HEALTH PLANS	50,000.00	50,875.00	
	WEST CORP	50,000.00	48,750.00	
	WHITING PETROLEUM CORP	50,000.00	51,000.00	
	WILLIAMS COMPANIES INC	50,000.00	50,562.50	
	WINDSTREAM SRVC / FIN	20,000.00	18,600.00	
	WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	50,000.00	50,250.00	
	XPO LOGISTICS INC	100,000.00	103,909.00	
	ZAYO GROUP LLC/ZAYO CAP	50,000.00	52,000.00	
	ZAYO GROUP LLC/ZAYO CAP	50,000.00	50,375.00	
	ZIGGO SECURED FINANCE BV	150,000.00	142,312.50	
小計	銘柄数：281	17,947,000.00	17,836,327.47	
			(1,923,469,554)	
	組入時価比率：98.0%		100.0%	
合計			1,923,469,554	
			(1,923,469,554)	

(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	2018年 4月23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	22,584,450	-	22,644,300	59,850
米ドル	22,584,450	-	22,644,300	59,850
合計	22,584,450	-	22,644,300	59,850

(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いません。

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)

(2018年 4月23日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	502,747,492
投資証券	31,026,361,843
派生商品評価勘定	23,613,408
未収入金	706,650
未収配当金	238,136,282
流動資産合計	31,791,565,675
資産合計	31,791,565,675
負債の部	
流動負債	
前受金	8,183,200
未払解約金	23,123,348
未払利息	909

(2018年 4月23日現在)

流動負債合計	31,307,457
負債合計	31,307,457
純資産の部	
元本等	
元本	16,013,377,983
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,746,880,235
元本等合計	31,760,258,218
純資産合計	31,760,258,218
負債純資産合計	31,791,565,675

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。</p> <p>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 受取配当金は、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>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>
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。</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)

2018年 4月23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	1.9834円
(10,000口当たり純資産額)	(19,834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 2017年 4月25日

至 2018年 4月23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、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

2018年 4月23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

2018年 4月23日現在

期首	2017年 4月25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	14,854,078,449円
同期中における追加設定元本額	8,457,269,781円
同期中における一部解約元本額	7,297,970,247円
期末元本額	16,013,377,983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)	1,165,229,966円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,968,210,235円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	833,465,305円
野村資産設計ファンド2015	23,392,458円
野村資産設計ファンド2020	21,238,621円
野村資産設計ファンド2025	22,297,740円
野村資産設計ファンド2030	25,644,314円
野村資産設計ファンド2035	20,028,766円
野村資産設計ファンド2040	34,434,535円
野村資産設計ファンド2045	3,338,042円
野村インデックスファンド・J-REIT ネクストコア	3,008,622,128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	146,283,177円
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	561,124,861円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	479,409,120円
野村資産設計ファンド2050	696,312,935円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,560,720円
インデックス・ブレンド(タイプ)	669,940円
インデックス・ブレンド(タイプ)	994,030円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,321,418円
インデックス・ブレンド(タイプ)	547,542円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,312,532円
野村6資産均等バランス	45,408,006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)	48,817,381円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	19,805,033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)	1,228,475,022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)	1,989,636,034円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,736,638,152円
野村DC運用戦略ファンド	895,628,488円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	26,805,578円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	494,321円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	473,236円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	394,881円
野村資産設計ファンド(DC)2030	104,632円
野村資産設計ファンド(DC)2040	109,432円
野村資産設計ファンド(DC)2050	149,402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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2018年4月23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	日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,284	609,258,000	
		M C U B S M i d C i t y 投資法 人 投資証券	4,312	349,272,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,152	580,034,400	
		産業ファンド投資法人 投資証券	4,488	543,048,000	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,578	996,473,000	
		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	1,966	312,004,200	
		アクティブ・プロパティーズ投資 法人 投資証券	1,748	850,402,000	
		G L P 投資法人 投資証券	8,023	930,668,000	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	1,465	363,613,000	
		日本プロロジスリート投資法人 投 資証券	5,151	1,195,032,000	
		星野リゾート・リート投資法人 投 資証券	587	325,785,000	
		星野リゾート・リート投資法人 投 資証券（権利落ち）	4	2,171,048	
		O n e リート投資法人 投資証券	422	103,854,200	
		イオンリート投資法人 投資証券	3,670	415,444,000	
		ヒューリックリート投資法人 投資 証券	2,625	436,800,000	
		日本リート投資法人 投資証券	1,038	335,793,000	
		インベスコ・オフィス・ジェイリー ト投資法人 投資証券	17,130	243,417,300	
		インベスコ・オフィス・ジェイリー ト投資法人 投資証券（権利落	3,005	41,526,095	
		日本ヘルスケア投資法人 投資証券	187	33,286,000	
		積水ハウス・リート投資法人 投資 証券	2,424	344,935,200	
トーセイ・リート投資法人 投資証 券	621	71,290,800			
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,405	325,538,500			

ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	476	50,075,200	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	671	63,275,300	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	11,436	1,725,692,400	
いちごホテルリート投資法人 投資 証券	605	77,742,500	
ラサールロジポート投資法人 投資 証券	2,915	326,771,500	
スターアジア不動産投資法人 投資 証券	906	94,586,400	
マリモ地方創生リート投資法人 投 資証券	309	35,349,600	
三井不動産ロジスティクスパーク投 資法人 投資証券	731	260,601,500	
大江戸温泉リート投資法人 投資証 券	649	57,436,500	
さくら総合リート投資法人 投資証 券	929	86,954,400	
投資法人みらい 投資証券	492	92,348,400	
森トラスト・ホテルリート投資法 人 投資証券	837	119,774,700	
三菱地所物流リート投資法人 投資 証券	358	94,297,200	
C R E ロジスティクスファンド投資 法人 投資証券	387	43,614,900	
ザイマックス・リート投資法人 投 資証券	356	40,406,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証 券	3,742	2,290,104,000	
ジャパンリアルエステイト投資法 人 投資証券	3,848	2,189,512,000	
日本リテールファンド投資法人 投 資証券	7,297	1,495,155,300	
オリックス不動産投資法人 投資証 券	7,668	1,272,121,200	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,440	945,500,000	
プレミア投資法人 投資証券	3,491	380,519,000	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,591	376,990,500	

	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,482	263,092,000	
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,523	1,428,454,800	
	森トラスト総合リート投資法人 投 資証券	2,762	445,234,400	
	インヴィンシブル投資法人 投資証 券	10,599	516,171,300	
	フロンティア不動産投資法人 投資 証券	1,315	582,545,000	
	平和不動産リート投資法人 投資証 券	2,407	243,829,100	
	日本ロジスティクスファンド投資法 人 投資証券	2,574	572,715,000	
	福岡リート投資法人 投資証券	1,999	333,033,400	
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,130	760,490,000	
	積水ハウス・レジデンシャル投資法 人 投資証券	2,930	342,810,000	
	いちごオフィスリート投資法人 投 資証券	2,992	244,147,200	
	大和証券オフィス投資法人 投資証 券	833	524,790,000	
	阪急リート投資法人 投資証券	1,687	231,625,100	
	スターツプロシード投資法人 投資 証券	609	101,885,700	
	大和ハウスリート投資法人 投資証 券	4,497	1,171,468,500	
	ジャパン・ホテル・リート投資法 人 投資証券	11,154	883,396,800	
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	4,347	365,582,700	
	ジャパンエクセレント投資法人 投 資証券	3,461	486,616,600	
小計	銘柄数：62	188,720	31,026,361,843	
	組入時価比率：97.7%		100.0%	
合計			31,026,361,843	

(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	2018年 4月23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				
REIT指数先物取引				
買建	700,956,800	-	724,616,000	23,613,408
合計	700,956,800	-	724,616,000	23,613,408

（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）

（2018年 4月23日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	119,122,417
コール・ローン	13,492,173
投資証券	19,774,628,801
派生商品評価勘定	800,378
未収入金	597,411
未収配当金	22,878,725
差入委託証拠金	21,408,841
流動資産合計	19,952,928,746
資産合計	19,952,928,746
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,209,642
未払金	9,085,145
未払解約金	6,984,677
未払利息	24
その他未払費用	612,700
流動負債合計	18,892,188
負債合計	18,892,188
純資産の部	
元本等	
元本	9,801,038,849
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,132,997,709
元本等合計	19,934,036,558
純資産合計	19,934,036,558
負債純資産合計	19,952,928,746

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</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>受取配当金は、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>配当株式</p> <p>配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価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）

2018年 4月23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	2.0339円
(10,000口当たり純資産額)	(20,339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 2017年 4月25日 至 2018年 4月23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、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

2018年 4月23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

2018年 4月23日現在

期首	2017年 4月25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	9,029,804,781円
同期中における追加設定元本額	2,976,331,378円
同期中における一部解約元本額	2,205,097,310円
期末元本額	9,801,038,849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）	1,124,756,459円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,865,107,673円

野村世界6資産分散投信(成長コース)	804,498,002円
野村資産設計ファンド2015	22,579,931円
野村資産設計ファンド2020	20,500,886円
野村資産設計ファンド2025	21,523,220円
野村資産設計ファンド2030	24,753,590円
野村資産設計ファンド2035	19,332,987円
野村資産設計ファンド2040	33,238,422円
野村資産設計ファンド2045	3,222,094円
野村インデックスファンド・外国REIT ネクストコア	1,446,822,611円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	240,245,367円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	525,052,033円
野村資産設計ファンド2050	4,402,310円
インデックス・ブレンド(タイプ)	496,947円
インデックス・ブレンド(タイプ)	768,217円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,652,342円
インデックス・ブレンド(タイプ)	526,561円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,205,459円
野村6資産均等バランス	43,830,793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	440,177,992円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	103,894,888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)	351,793,864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)	1,506,341,083円
野村DC運用戦略ファンド	159,894,819円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	4,742,605円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	477,140円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	456,766円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	381,162円
野村資産設計ファンド(DC)2030	100,999円
野村資産設計ファンド(DC)2040	105,632円
野村資産設計ファンド(DC)2050	144,213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(2018年4月23日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2018年4月23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	14,000	317,100.00	
		AGREE REALTY CORP	5,400	259,686.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	11,800	268,450.00	
		ALEXANDERS INC	620	240,727.40	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,280	2,096,064.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,900	226,320.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	23,300	886,798.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	43,300	854,309.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	8,400	166,740.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	26,700	1,051,980.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	35,700	637,602.00	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	7,600	101,840.00	
		ASHFORD HOSPITALITY PRIME INC	4,800	49,680.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,600	107,952.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	23,640	3,802,966.80	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	36,540.00	
		BOSTON PROPERTIES	26,460	3,142,125.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	30,100	467,152.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	52,500	739,725.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	15,750	1,335,127.50	
		CARETRUST REIT INC ACQUIRES	13,500	174,555.00	
		CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	28,400	112,180.00	
		CEDAR REALTY TRUST INC	12,000	42,840.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	7,400	142,376.00	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	10,000	293,400.00	
		CITY OFFICE REIT INC	6,300	70,686.00	
		CLIPPER REALTY INC	2,400	18,624.00	
		COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	91,700	520,856.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	20,900	430,122.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,900	74,066.00	
		CORECIVIC INC	20,600	417,356.00	
		CORESITE REALTY CORP	5,830	613,316.00	
		CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17,400	466,320.00	
COUSINS PROPERTIES INC	71,500	600,600.00			
CUBESMART	31,200	860,808.00			

CYRUSONE INC	16,600	852,742.00	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	16,040	912,515.60	
DDR CORP	53,100	358,425.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,500	370,510.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	35,190	3,600,640.80	
DOUGLAS EMMETT INC	27,300	986,622.00	
DUKE REALTY CORP	60,800	1,582,016.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	7,400	148,888.00	
EASTGROUP PROPERTIES	5,830	493,451.20	
EDUCATION REALTY TRUST INC	13,200	423,060.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	21,700	358,267.00	
EPR PROPERTIES	10,900	581,515.00	
EQUITY COMMONWEALTH	21,200	641,936.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	15,060	1,310,671.80	
EQUITY RESIDENTIAL	63,020	3,788,132.20	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,260	2,695,531.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	21,570	1,856,961.30	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	43,175.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,450	1,384,440.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	20,700	605,475.00	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	45,700	925,425.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,300	230,411.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	17,700	135,228.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	33,900	1,161,075.00	
GEO GROUP INC/THE	21,600	462,888.00	
GETTY REALTY CORP	5,500	136,290.00	
GGP INC	107,700	2,115,228.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,700	80,558.00	
GLADSTONE LAND CORP	1,600	19,856.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	3,000	23,280.00	
GLOBAL NET LEASE INC	11,900	209,202.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	16,300	201,305.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	27,700	621,311.00	
HCP INC	80,300	1,756,964.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	21,300	571,266.00	

HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	35,300	867,321.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6,600	126,918.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,800	755,610.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	28,000	698,600.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	125,300	2,433,326.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	26,700	831,171.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	14,400	134,928.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	3,500	72,730.00	
INFREIT INC	6,200	127,782.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	22,000	115,280.00	
INVITATION HOMES INC	49,000	1,105,930.00	
IRON MOUNTAIN INC	47,900	1,596,986.00	
ISTAR INC	11,300	113,113.00	
JBG SMITH PROPERTIES	15,900	550,776.00	
KILROY REALTY CORP	16,770	1,158,471.60	
KIMCO REALTY CORP	73,100	974,423.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	13,700	196,184.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	19,200	592,704.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	38,200	292,230.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	25,400	996,950.00	
LIFE STORAGE INC	7,930	676,825.50	
LTC PROPERTIES INC	6,500	228,410.00	
MACERICH CO /THE	18,580	1,068,350.00	
MACK-CALI REALTY CORP	15,800	263,860.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	165,990	154,370.70	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	5,600	55,664.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	62,300	775,012.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,350	1,733,953.50	
MONMOUTH REIT-CLASS A	13,700	207,144.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	26,100	979,011.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,700	219,066.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	7,140	468,598.20	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	15,000	123,600.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3,200	82,880.00	

NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	9,500	133,665.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	34,000	862,240.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,800	64,400.00	
PARAMOUNT GROUP INC	35,100	490,347.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	34,200	978,120.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	11,500	410,205.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	12,700	114,046.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	31,200	452,400.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	23,100	398,706.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	6,800	96,492.00	
PROLOGIS INC	91,030	5,916,039.70	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,450	396,750.00	
PUBLIC STORAGE	25,590	4,932,472.50	
QTS REALTY TRUST INC CL A	8,600	295,066.00	
QUALITY CARE PROPERTIES	16,500	338,745.00	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	14,200	163,868.00	
REALTY INCOME CORP	48,400	2,397,252.00	
REGENCY CENTERS CORP	25,280	1,418,713.60	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	19,700	327,414.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	39,600	432,432.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	13,700	396,341.00	
RLJ LODGING TRUST	29,700	601,722.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,850	697,822.50	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	30,700	528,040.00	
SAUL CENTERS INC	2,070	101,926.80	
SELECT INCOME REIT	10,500	196,770.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	40,500	611,550.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	4,600	164,542.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	53,200	7,833,700.00	
SL GREEN REALTY CORP	15,370	1,475,520.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	78,900	620,154.00	
STAG INDUSTRIAL INC	16,100	382,697.00	
STORE CAPITAL CORP	28,200	685,260.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	18,300	267,729.00	

	SUN COMMUNITIES INC	13,480	1,230,858.80	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	38,900	611,897.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	16,400	352,928.00	
	TAUBMAN CENTERS INC	10,370	569,831.50	
	TERRENO REALTY CORP	9,600	336,576.00	
	TIER REIT INC	8,200	153,832.00	
	UDR INC	45,600	1,602,840.00	
	UMH PROPERTIES INC	5,000	64,900.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,290	137,010.70	
	URBAN EDGE PROPERTIES	18,400	370,208.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	5,000	96,950.00	
	VENTAS INC	60,700	2,853,507.00	
	VEREIT INC	167,300	1,110,872.00	
	VORNADO REALTY TRUST	29,510	1,930,544.20	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	30,400	182,096.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	13,600	374,272.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	20,300	534,499.00	
	WELLTOWER INC	63,100	3,229,458.00	
	WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,250	4,562.50	
	WHITESTONE REIT	7,700	81,158.00	
	WP CAREY INC	18,360	1,125,284.40	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	18,200	372,918.00	
小計	銘柄数：160	4,017,360	126,560,581.70 (13,648,293,130)	
	組入時価比率：68.5%		68.9%	
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN	3,200	35,712.00	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,500	311,550.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	12,700	172,974.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,600	161,640.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,700	443,196.00	
	CAN REAL ESTATE INVEST TRUST	6,300	318,465.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	7,000	83,930.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	14,500	183,425.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	6,700	83,147.00	

	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,900	65,170.00
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	14,100	197,823.00
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	6,600	67,254.00
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,400	150,784.00
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,900	195,741.00
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	24,300	498,393.00
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,300	73,438.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6,300	89,523.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	45,804.00
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4,300	57,190.00
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	4,500	114,300.00
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	9,100	102,284.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	27,200	633,760.00
	SLATE OFFICE REIT	5,900	44,958.00
	SLATE RETAIL REIT	4,300	52,073.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,400	327,750.00
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	6,000	49,860.00
小計	銘柄数 : 26	223,000	4,560,144.00 (385,195,363)
	組入時価比率 : 1.9%		1.9%
ユーロ	AEDIFICA	3,150	236,880.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	23,700	302,175.00
	ALTAREA	670	142,710.00
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	2,200	37,224.00
	BEFIMMO S.C.A.	3,840	203,136.00
	BENI STABILI SPA	177,000	134,077.50
	COFINIMMO	3,290	355,320.00
	CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE	82,000	50,020.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	8,300	284,690.00
	FONCIERE DES REGIONS	9,140	811,175.00
	GECINA SA	8,190	1,145,781.00
	GREEN REIT PLC	116,000	174,696.00
	HAMBORNER REIT AG	14,100	135,360.00

	HIBERNIA REIT PLC	115,000	167,670.00	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	18,900	332,073.00	
	ICADE	7,790	617,357.50	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	9,500	74,651.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	54,300	510,963.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	2,700	63,990.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	64,000	87,424.00	
	KLEPIERRE	35,300	1,219,615.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	15,100	139,675.00	
	MERCIALYS	9,300	146,475.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	57,100	708,040.00	
	NSI NV	3,300	118,635.00	
	RETAIL ESTATES	1,080	75,168.00	
	RETAIL ESTATES - RTS	1,080	885.70	
	UNIBAIL RODAMCO-NA	17,010	3,282,930.00	
	VASTNED RETAIL NV	2,700	113,130.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,750	283,250.00	
	WERELDHAVE NV	7,000	230,020.00	
小計	銘柄数：31	875,490	12,185,196.70	
			(1,612,345,227)	
	組入時価比率：8.1%		8.2%	
英ボンド	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	15,000	14,325.00	
	ASSURA PLC	407,000	235,653.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	25,200	226,800.00	
	BRITISH LAND	169,100	1,126,206.00	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	93,000	48,360.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	29,000	29,290.00	
	DERWENT LONDON PLC	19,100	594,201.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	93,857	79,309.16	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	47,200	327,945.60	
	HAMMERSON PLC	134,500	726,300.00	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	70,000	90,720.00	
	INTU PROPERTIES PLC	150,000	303,450.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	127,900	1,242,932.20	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	114,000	210,786.00	
	LXI REIT PLC	39,000	39,975.00	

	NEWRIVER REIT PLC	54,000	159,840.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	108,000	118,152.00	
	RDI REIT PLC	230,000	81,075.00	
	REGIONAL REIT LTD	46,000	46,000.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	35,400	187,620.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	102,000	60,078.00	
	SEGRO PLC	169,100	1,062,286.20	
	SHAFTESBURY PLC	42,400	421,880.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	237,000	350,997.00	
	UNITE GROUP PLC	45,700	366,285.50	
	WORKSPACE GROUP PLC	20,900	212,762.00	
小計	銘柄数：26	2,624,357	8,363,228.66 (1,263,432,953)	
	組入時価比率：6.3%		6.4%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	54,000	188,460.00	
	ARENA REIT	43,220	95,516.20	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	9,800	0.00	
	BWP TRUST	81,000	243,000.00	
	CHARTER HALL GROUP	76,000	427,120.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	27,702	109,699.92	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	55,000	210,650.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	282,000	301,740.00	
	DEXUS	173,100	1,589,058.00	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	42,000	115,500.00	
	GDI PROPERTY GROUP	96,000	120,960.00	
	GOODMAN GROUP	272,900	2,376,959.00	
	GPT GROUP	309,000	1,427,580.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	46,000	153,640.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	22,680	70,308.00	
	INDUSTRIA REIT	20,000	50,200.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,000	107,250.00	
	INVESTA OFFICE FUND	82,000	350,140.00	
	MIRVAC GROUP	629,000	1,358,640.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	89,000	141,510.00	
	PROPERTYLINK GROUP	66,000	68,310.00	

小計	RURAL FUNDS GROUP	40,000	86,800.00	
	SCENTRE GROUP	907,000	3,519,160.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	121,000	277,090.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	414,000	1,618,740.00	
	VICINITY CENTRES	553,000	1,310,610.00	
	VIVA ENERGY REIT	80,000	157,600.00	
	WESTFIELD CORP	326,000	2,855,760.00	
	銘柄数：28	4,956,402	19,332,001.12	(1,598,176,532)
組入時価比率：8.0%			8.1%	
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	138,000	139,380.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	175,000	235,375.00	
	INVESTORE PROPERTY LTD	32,000	44,480.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	237,000	314,025.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	177,000	222,135.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	56,000	96,320.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	61,000	126,270.00	
	銘柄数：7	876,000	1,177,985.00	(91,529,434)
組入時価比率：0.5%			0.5%	
香港ドル	CHAMPION REIT	353,000	1,941,500.00	
	FORTUNE REIT	228,000	2,120,400.00	
	LINK REIT	370,600	25,330,510.00	
	PROSPERITY REIT	180,000	579,600.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	170,000	555,900.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	174,000	925,680.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	194,000	1,014,620.00	
	銘柄数：7	1,669,600	32,468,210.00	(446,437,887)
組入時価比率：2.2%			2.3%	
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	94,000	131,600.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	129,000	105,780.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	411,000	1,113,810.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	221,000	249,730.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	180,860	148,305.20	

	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	448,964	817,114.48	
	CAPITALAND MALL TRUST	460,000	966,000.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	96,000	148,800.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	128,000	218,880.00	
	ESR REIT	239,800	129,492.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	142,000	95,140.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	91,000	126,490.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	94,000	210,560.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	104,000	151,840.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	180,000	194,400.00	
	KEPPEL DC REIT	119,756	171,251.08	
	KEPPEL REIT	315,000	384,300.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	340,000	110,500.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	332,025	534,560.25	
	MAPLETREE GREATER CHINA COMM	306,000	358,020.00	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	211,000	424,110.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	349,000	439,740.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	200,043	164,035.26	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	62,000	172,360.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	133,764	57,518.52	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	106,700	70,422.00	
	SPH REIT	121,000	120,395.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	247,000	176,605.00	
	SUNTEC REIT	380,000	733,400.00	
小計	銘柄数 : 29	6,242,912	8,725,158.79	
			(714,852,259)	
	組入時価比率 : 3.6%		3.6%	
新シケル	REIT 1 LTD	32,000	470,400.00	
小計	銘柄数 : 1	32,000	470,400.00	
			(14,366,016)	
	組入時価比率 : 0.1%		0.1%	
合計			19,774,628,801	
			(19,774,628,801)	

(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	2018年 4月23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				
REIT指数先物取引				
買建	141,093,415	-	139,681,001	1,412,414
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	1,075,150	-	1,078,300	3,150
米ドル	1,075,150	-	1,078,300	3,150
合計	-	-	-	1,409,264

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2018年5月31日現在

資産総額	74,618,347円
負債総額	3,215,436円
純資産総額（ - ）	71,402,911円
発行済口数	69,675,235口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0248円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2018年5月31日現在

資産総額	97,444,263円
負債総額	5,353,779円
純資産総額（ - ）	92,090,484円
発行済口数	88,458,969口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0411円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2018年5月31日現在

資産総額	194,666,811円
負債総額	10,023,766円
純資産総額（ - ）	184,643,045円
発行済口数	174,984,125口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0552円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2018年5月31日現在

資産総額	33,553,832円
負債総額	1,734,095円
純資産総額（ - ）	31,819,737円
発行済口数	29,833,261口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0666円

インデックス・ブレンド（タイプ ）

2018年5月31日現在

資産総額	193,839,885円
負債総額	5,097,124円
純資産総額（ - ）	188,742,761円
発行済口数	174,276,203口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0830円

（参考）国内株式マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	407,205,888,253円
負債総額	31,748,456,987円
純資産総額（ - ）	375,457,431,266円
発行済口数	220,736,199,224口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7009円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	484,522,640,018円
負債総額	1,914,345,619円
純資産総額（ - ）	482,608,294,399円
発行済口数	185,900,056,903口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5961円

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	85,084,664,022円
負債総額	42,039,844,088円
純資産総額（ - ）	43,044,819,934円
発行済口数	23,468,813,339口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8341円

（参考）新興国株式マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	33,041,791,480円
負債総額	116,473,786円
純資産総額（ - ）	32,925,317,694円
発行済口数	25,736,553,225口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2793円

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	4,830,922,392円
負債総額	176,366,432円
純資産総額（ - ）	4,654,555,960円
発行済口数	4,188,259,555口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1113円

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	676,211,810,408円
負債総額	10,305,648,754円
純資産総額（ - ）	665,906,161,654円
発行済口数	507,055,036,196口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3133円

（参考）外国債券マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	605,342,550,242円
負債総額	1,836,635,114円
純資産総額（ - ）	603,505,915,128円
発行済口数	275,693,761,638口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1890円

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	72,384,734,602円
------	-----------------

負債総額	36,470,542,879円
純資産総額（ - ）	35,914,191,723円
発行済口数	32,139,676,450口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1174円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	7,277,077,294円
負債総額	55,115,788円
純資産総額（ - ）	7,221,961,506円
発行済口数	5,566,442,332口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2974円

（参考）新興国債券マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	14,695,017,952円
負債総額	161,375,021円
純資産総額（ - ）	14,533,642,931円
発行済口数	8,287,150,655口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7538円

（参考）米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	2,085,046,439円
負債総額	34,658,309円
純資産総額（ - ）	2,050,388,130円
発行済口数	1,805,662,772口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1355円

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	34,327,167,950円
負債総額	1,099,393,500円
純資産総額（ - ）	33,227,774,450円
発行済口数	16,502,543,058口

1口当たり純資産額（ / ）	2.0135円
----------------	---------

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	20,770,382,429円
負債総額	148,265,342円
純資産総額（ - ）	20,622,117,087円
発行済口数	9,539,681,600口
1口当たり純資産額（ / ）	2.1617円

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

2018年5月31日現在

資産総額	9,324,297,792円
負債総額	4,568,041,003円
純資産総額（ - ）	4,756,256,789円
発行済口数	3,461,474,586口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3741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。

委託者は、上記の振替について、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扱い

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、約款の規定によるほか、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

2018年5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

当社は指名委員会等設置会社であり、会社の機関として株主総会、取締役会のほか代表執行役ならびに執行役、指名委員会、監査委員会および報酬委員会をおきますが、代表取締役および監査役会は設けません。各機関の権限は以下のとおりであります。

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。また執行役・代表執行役、各委員会の委員等を選任し、取締役および執行役の職務の執行を監督します。

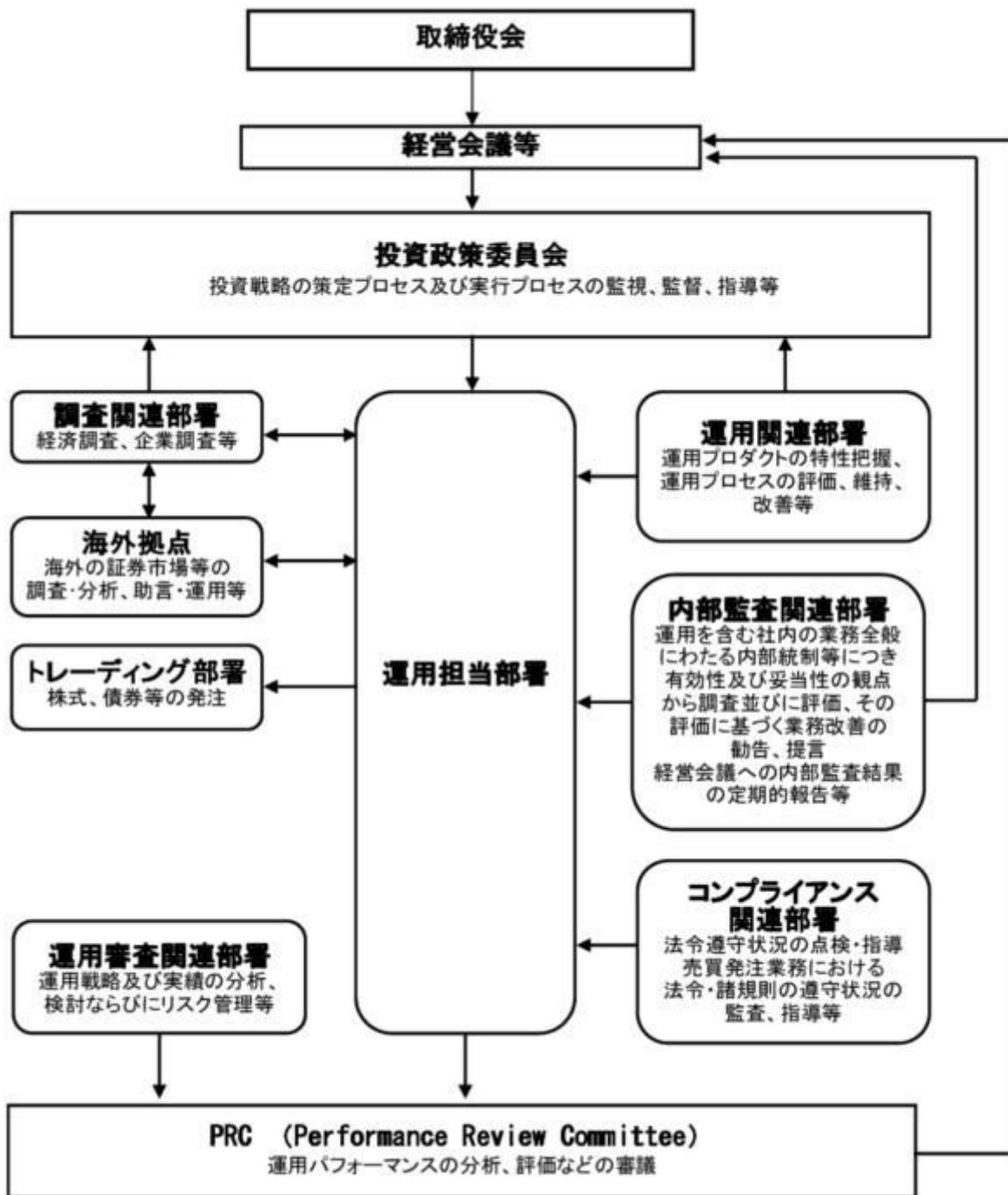
代表執行役・執行役

各執行役は、当社の業務の執行を行います。代表執行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、代表執行役および執行役で構成される経営会議および執行役会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会で選定された執行役員が含まれます。

委員会

取締役3名以上（但し、各委員につき過半数は社外取締役であって執行役でない者）で構成され、イ）指名委員会は、株主総会に提出する取締役の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定し、ロ）報酬委員会は取締役・執行役が受ける個人別の報酬の決定に関する方針を定め、かつそれに従って各報酬の内容を決定し、ハ）監査委員会は取締役・執行役の職務執行の適法性ならびに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2018年4月27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	1,001	27,009,474
単位型株式投資信託	113	613,633
追加型公社債投資信託	14	5,455,344
単位型公社債投資信託	385	1,772,937
合計	1,513	34,851,389

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。
2. 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)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(2017年3月31日)	(2018年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		127	919
金銭の信託		52,247	47,936
有価証券		15,700	22,600
前払金		33	0
前払費用		2	26
未収入金		495	464
未収委託者報酬		16,287	24,059
未収運用受託報酬		7,481	6,764
繰延税金資産		1,661	2,111
その他		42	181
貸倒引当金		11	15
流動資産計		94,066	105,048
固定資産			
有形固定資産			
建物	2	377	348
器具備品	2	624	525
無形固定資産			
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	当事業年度
		(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	(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	当事業年度
		(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	(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
經常利益			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								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	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。</p> <table style="margin-left: 40px;"> <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>(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いません。</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）

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行手数料の支払(*3)	33,019	未払手数料	4,486

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱（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。

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。

* 2018年4月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
株式会社SBI証券	48,323百万円	「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。
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
山和証券株式会社	585百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
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んでいます。
株式会社 京葉銀行	49,759百万円	
株式会社 百五銀行	20,000百万円	
株式会社 北越銀行	24,538百万円	

* 2018年4月末現在

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・連絡等を行いません。

(2) 販売会社

ファンドの取扱販売会社として、募集の取扱いを行ない、信託契約の一部解約に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行いません。

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」と称して使用することがあります。
- (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

2018年6月15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	伊藤志保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重俊寛

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」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2017年4月25日から2018年4月23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、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2018年4月23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。

独立監査人の監査報告書

2018年6月15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	伊藤志保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重俊寛

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」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2017年4月25日から2018年4月23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、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2018年4月23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。

独立監査人の監査報告書

2018年6月15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	伊藤志保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重俊寛

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」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2017年4月25日から2018年4月23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、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2018年4月23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。

独立監査人の監査報告書

2018年6月15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	伊藤志保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重俊寛

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」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2017年4月25日から2018年4月23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、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2018年4月23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。

独立監査人の監査報告書

2018年6月15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	伊藤志保
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重俊寛

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」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2017年4月25日から2018年4月23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、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2018年4月23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。