

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年7月17日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	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
インデックス・ブレンド(タイプ )	タイプ
インデックス・ブレンド(タイプ )	タイプ
インデックス・ブレンド(タイプ )	タイプ
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%<sup>\*</sup> (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。

<sup>\*</sup> 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、2.2%となります。

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】

2019年7月18日から2020年7月15日まで

<sup>\*</sup> 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

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))

#### 《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
<b>追加型</b>	<b>内外</b>	その他資産 ( ) <b>資産複合</b>

## 《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]

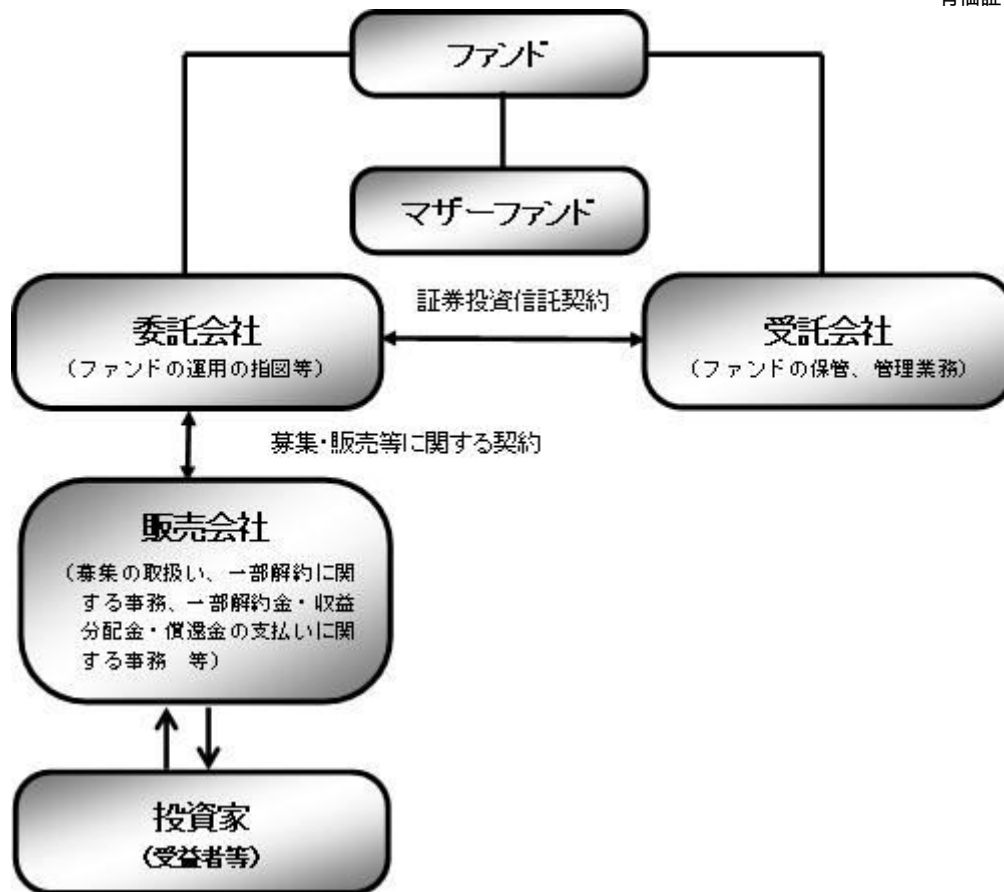
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定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

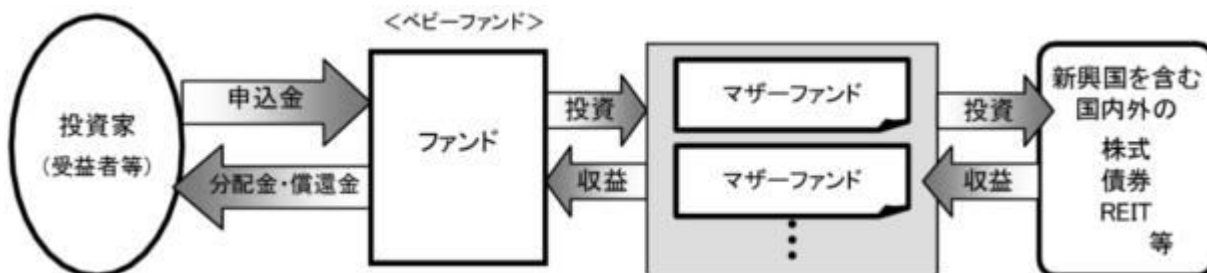
## (3)【ファンドの仕組み】





## 《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2019年7月17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(2019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

##### ・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-KOKUSA I マザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSA I 指数(円ベース・為替ヘッジなし) ・MSCI-KOKUSA I 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-KOKUSA I 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) <sup>*1</sup> 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・円換算ベー (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 <sup>*2</sup>	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 <sup>*3</sup>	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 <sup>*3</sup>	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円 ヘッジ)	

上記は2019年7月17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。

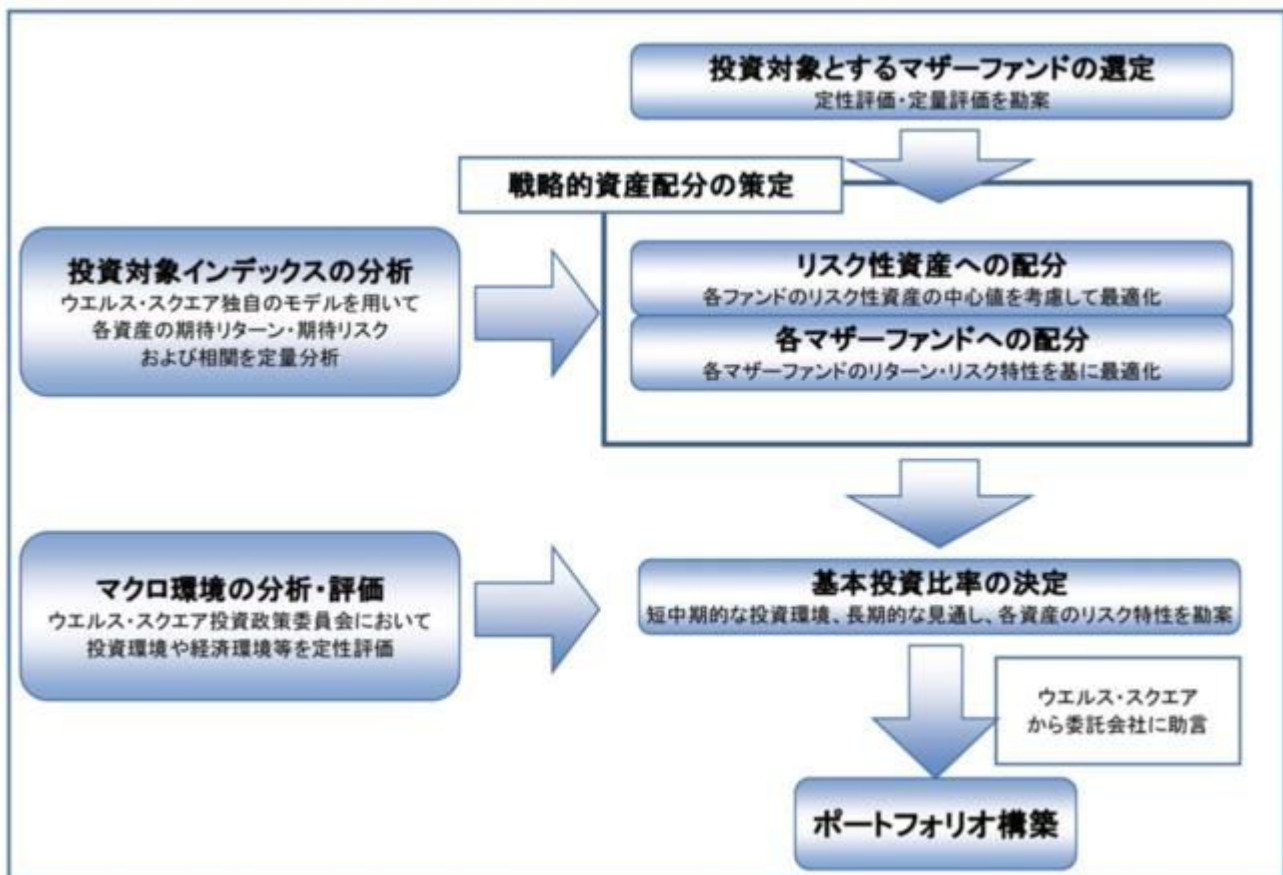
株式会社ウエルス・スクエア(ウエルス・スクエア)による以下のプロセスに従った助言に基づいて投資対象とするマザーファンドおよび各マザーファンドへの投資比率を決定します。

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<sup>(R)</sup> およびS&P<sup>(R)</sup> はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones<sup>(R)</sup> 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](mailto: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](http://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。

㈱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。

㈱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㈱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、㈱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。

㈱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。

㈱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、㈱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、参加もしておりません。

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

S&Pは、S&P先進国REIT指数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2019年7月17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、）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・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

## 2．運用方法

### (1) 投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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、米国内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。

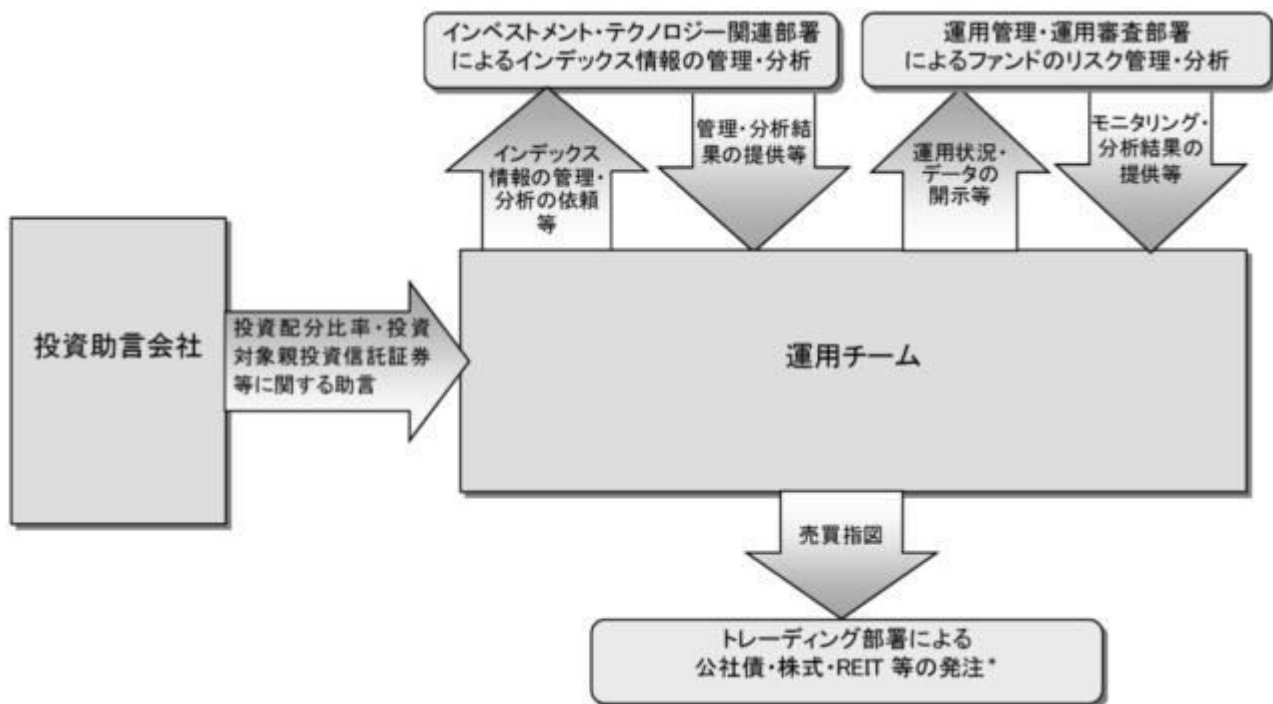
外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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。



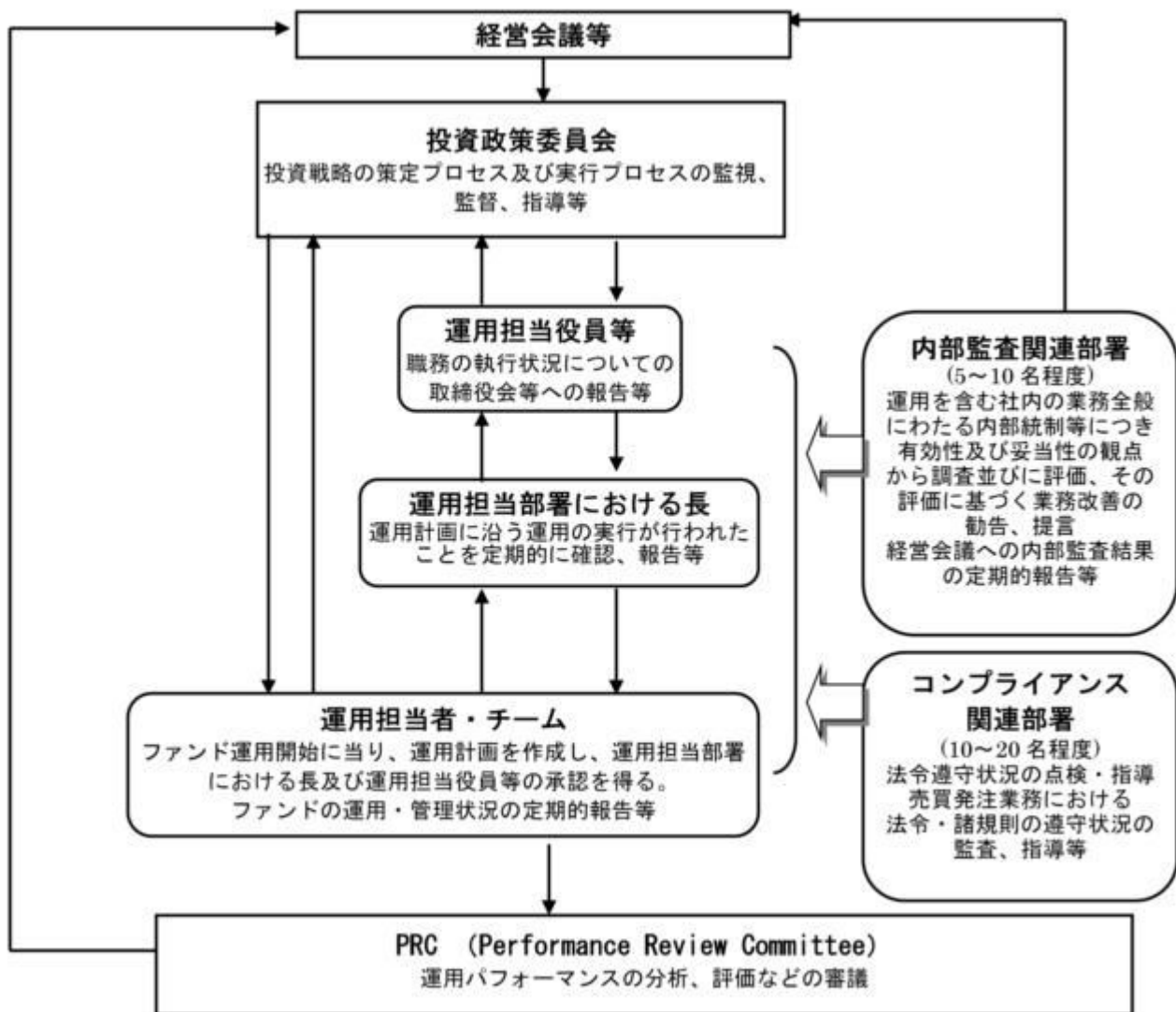
\*一部のマザーファンドにおける公社債等の発注業務（発注に伴う裁量権は付与しないものとします。）の一部をノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッドに代行させます。

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す。

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

ファンドの決算日

原則として**毎年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券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ます。)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。

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へ帰属します。

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。）・換金の各受付けを中止すること、およびすでに受付けた購入（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

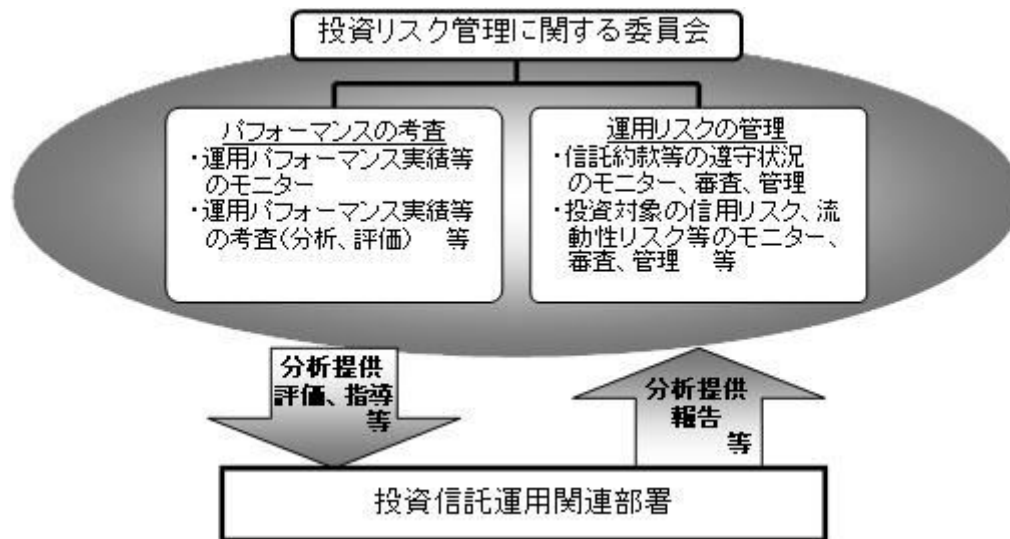
#### パフォーマンスの考査

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、審議を行ないます。

#### 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、適切な管理を行ないます。

## リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

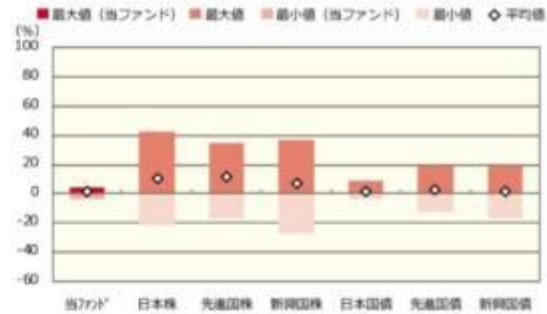
## ■ リスクの定量的比較 (2014年6月末～2019年5月末：月次)

### 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	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値 (%)	△ 3.6	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	1.0	10.0	11.4	7.6	2.0	3.0	1.4

- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。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2019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。

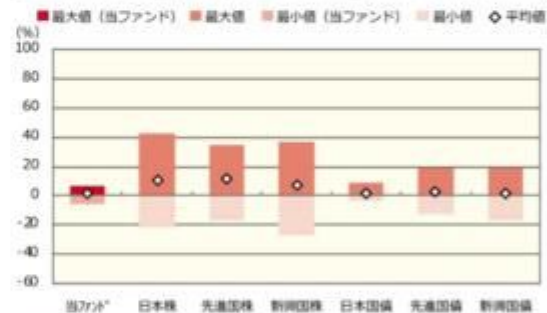
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2014年6月から2019年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2019年5月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

### 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	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値 (%)	△ 5.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	1.5	10.0	11.4	7.6	2.0	3.0	1.4

- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。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2019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。
- \* 2014年6月から2019年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2019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。

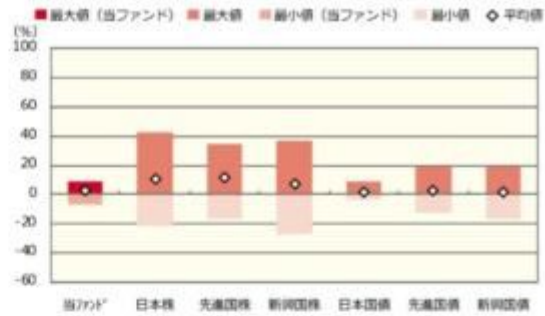
**タイプⅢ**

## 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



2014年6月 2015年5月 2016年5月 2017年5月 2018年5月 2019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	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値 (%)	△ 6.9	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.1	10.0	11.4	7.6	2.0	3.0	1.4

- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。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2019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。
- \* 2014年6月から2019年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2019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。

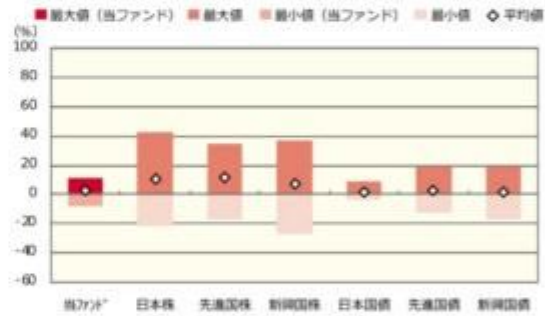
**タイプⅣ**

## 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



2014年6月 2015年5月 2016年5月 2017年5月 2018年5月 2019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	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値 (%)	△ 8.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.3	10.0	11.4	7.6	2.0	3.0	1.4

- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。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2019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。

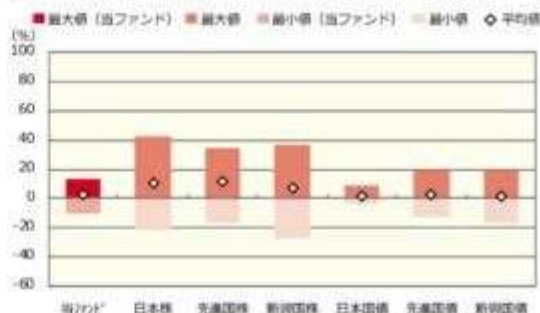
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2014年6月から2019年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2019年5月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 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	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値 (%)	△ 9.9	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	3.1	10.0	11.4	7.6	2.0	3.0	1.4

- \* 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。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2019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。
- \* 2014年6月から2019年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2019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・ディバースファイド（円ベース）

#### ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数額の公表、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、責任を負いません。
  - MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
  - NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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・ディバースファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「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）についての提供、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。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%<sup>\*</sup>（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。

\* 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、2.2%となります。

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。ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

信託報酬率の配分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% <sup>1</sup> (税抜年0.48%)	年0.25%	年0.20%	年0.03%
タイプ	年0.5292% <sup>2</sup> (税抜年0.49%)	年0.26%	年0.20%	年0.03%
タイプ	年0.54% <sup>3</sup> (税抜年0.50%)	年0.27%	年0.20%	年0.03%
タイプ	年0.5508% <sup>4</sup> (税抜年0.51%)	年0.28%	年0.20%	年0.03%
タイプ	年0.5616% <sup>5</sup> (税抜年0.52%)	年0.29%	年0.20%	年0.03%

\* 2019年10月1日以降消費税率が10%となった場合は、1が年0.528%、2が年0.539%、3が年0.55%、4が年0.561%、5が年0.572%となります。

### 支払先の役務の内容

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

## （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、

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 <sup>(注2)</sup>	《配当所得》
・特定公社債 <sup>(注1)</sup> 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

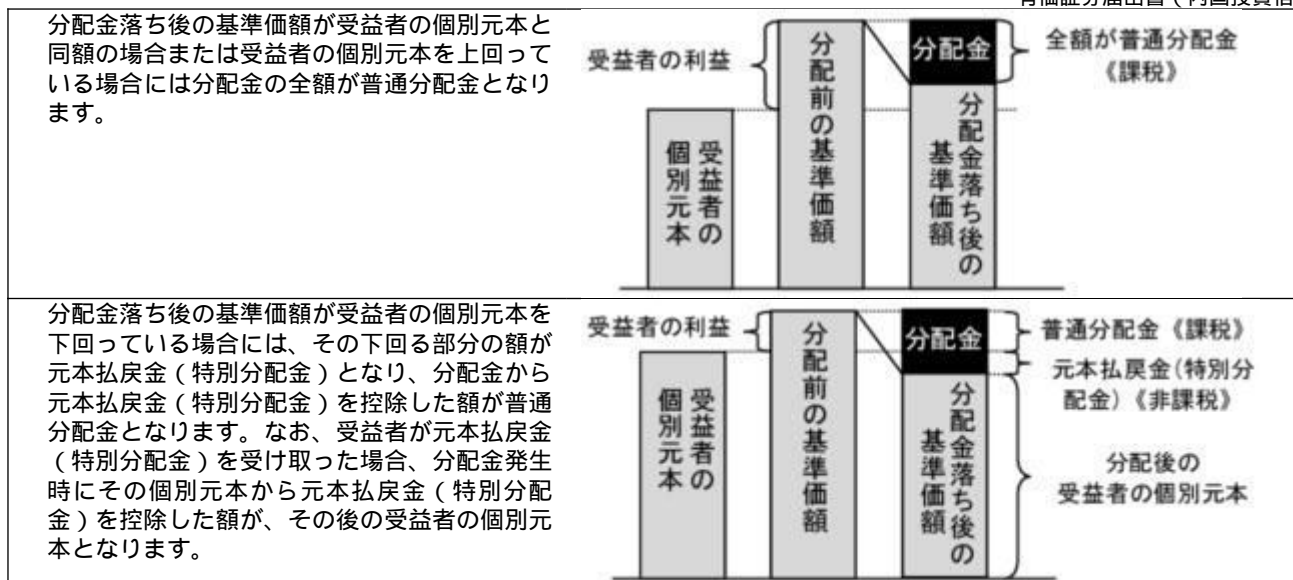
追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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(2019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2019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	162,884,310	99.37
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,029,642	0.62
合計(純資産総額)		163,913,952	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	83,675,808	99.34
現金・預金・その他資産(負債控除後)		548,459	0.65
合計(純資産総額)		84,224,267	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	215,090,756	99.34
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,417,563	0.65
合計（純資産総額）		216,508,319	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	54,081,069	99.34
現金・預金・その他資産（負債控除後）		357,834	0.65
合計（純資産総額）		54,438,903	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	190,267,821	97.83
現金・預金・その他資産（負債控除後）		4,218,371	2.16
合計（純資産総額）		194,486,192	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	376,640,196,540	97.37
現金・預金・その他資産（負債控除後）		10,166,440,326	2.62
合計（純資産総額）		386,806,636,866	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	10,150,440,000	2.62

## （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	356,652,214,482	65.19
	カナダ	20,149,394,571	3.68
	ドイツ	17,275,867,502	3.15

	イタリア	4,454,104,814	0.81
	フランス	21,346,141,450	3.90
	オランダ	6,600,978,208	1.20
	スペイン	6,037,910,276	1.10
	ベルギー	1,939,124,391	0.35
	オーストリア	449,796,064	0.08
	ルクセンブルグ	199,060,484	0.03
	フィンランド	1,975,718,460	0.36
	アイルランド	1,103,846,163	0.20
	ポルトガル	307,223,065	0.05
	イギリス	33,391,096,333	6.10
	スイス	18,150,737,648	3.31
	スウェーデン	5,141,961,786	0.93
	ノルウェー	1,329,596,632	0.24
	デンマーク	3,391,774,905	0.61
	オーストラリア	13,153,322,558	2.40
	ニュージーランド	485,031,667	0.08
	香港	6,830,077,574	1.24
	シンガポール	2,318,418,290	0.42
	イスラエル	647,874,272	0.11
	小計	523,331,271,595	95.66
投資証券	アメリカ	11,933,022,445	2.18
	カナダ	112,181,104	0.02
	フランス	639,730,917	0.11
	イギリス	345,440,041	0.06
	オーストラリア	1,096,552,665	0.20
	香港	422,214,720	0.07
	シンガポール	250,988,272	0.04
	小計	14,800,130,164	2.70
現金・預金・その他資産（負債控除後）		8,941,552,597	1.63
合計（純資産総額）		547,072,954,356	100.00

## その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	6,072,864,692	1.11
	買建	カナダ	327,380,592	0.05
	買建	ドイツ	1,028,477,774	0.18
	買建	イギリス	556,693,561	0.10
	買建	スイス	290,556,840	0.05
	買建	オーストラリア	229,329,696	0.04

## （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	29,449,079,208	64.03
	カナダ	1,664,836,320	3.61
	ドイツ	1,424,032,133	3.09
	イタリア	367,839,442	0.79
	フランス	1,764,811,115	3.83
	オランダ	551,624,103	1.19
	スペイン	498,258,319	1.08
	ベルギー	160,425,149	0.34
	オーストリア	37,861,019	0.08
	ルクセンブルグ	18,883,773	0.04
	フィンランド	161,790,599	0.35
	アイルランド	88,176,038	0.19
	ポルトガル	25,787,088	0.05
	イギリス	2,762,075,344	6.00
	スイス	1,499,979,236	3.26
	スウェーデン	424,272,211	0.92
	ノルウェー	109,359,575	0.23
	デンマーク	279,119,292	0.60
	オーストラリア	1,084,961,295	2.35
	ニュージーランド	40,734,458	0.08
香港	564,580,855	1.22	
シンガポール	191,177,152	0.41	
イスラエル	55,306,825	0.12	
	小計	43,224,970,549	93.98
投資証券	アメリカ	983,501,754	2.13
	カナダ	8,237,837	0.01
	フランス	49,553,353	0.10
	イギリス	23,964,010	0.05
	オーストラリア	92,645,066	0.20
	香港	34,431,103	0.07
	シンガポール	20,913,193	0.04
	小計	1,213,246,316	2.63
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,554,338,724	3.37
合計（純資産総額）		45,992,555,589	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	656,113,522	1.42
	買建	カナダ	31,179,104	0.06
	買建	ドイツ	112,930,892	0.24
	買建	イギリス	59,645,738	0.12
	買建	スイス	20,754,060	0.04
	買建	オーストラリア	12,069,984	0.02

## (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	4,537,404,815	12.64
	メキシコ	892,201,245	2.48
	ブラジル	2,611,165,641	7.27
	チリ	155,833,190	0.43
	コロンビア	74,073,805	0.20
	ギリシャ	105,826,135	0.29
	イギリス	11,320,534	0.03
	トルコ	168,198,916	0.46
	チェコ	54,534,099	0.15
	ハンガリー	110,294,045	0.30
	ポーランド	383,170,038	1.06
	香港	7,679,799,838	21.39
	マレーシア	755,677,371	2.10
	タイ	1,006,243,779	2.80
	フィリピン	394,635,020	1.09
	インドネシア	713,542,417	1.98
	韓国	4,190,306,459	11.67
	台湾	3,771,718,769	10.50
	インド	3,270,982,171	9.11
	パキスタン	11,433,604	0.03
カタール	311,318,729	0.86	
エジプト	51,735,526	0.14	
南アフリカ	1,948,923,242	5.42	
アラブ首長国連邦	240,454,263	0.66	
サウジアラビア	493,782,898	1.37	
	小計	33,944,576,549	94.57
新株予約権証券	タイ	0	0.00
投資信託受益証券	アメリカ	564,809,623	1.57
投資証券	メキシコ	29,635,687	0.08
	南アフリカ	64,144,923	0.17

	小計	93,780,610	0.26
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,290,248,329	3.59
合計（純資産総額）		35,893,415,111	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	1,251,854,841	3.48

## （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	13,035,593,886	96.22
投資信託受益証券	アメリカ	164,440,257	1.21
投資証券	アメリカ	241,571,132	1.78
現金・預金・その他資産（負債控除後）		105,623,488	0.77
合計（純資産総額）		13,547,228,763	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	91,550,724	0.67

## （参考）国内債券NOMURA - B P I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	528,071,334,060	79.69
地方債証券	日本	44,086,032,510	6.65
特殊債券	日本	57,014,563,064	8.60
社債券	日本	26,629,688,050	4.01
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,842,243,488	1.03
合計（純資産総額）		662,643,861,172	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	285,856,694,143	47.21

	カナダ	11,657,078,409	1.92
	メキシコ	4,883,577,280	0.80
	ドイツ	34,891,789,989	5.76
	イタリア	52,985,695,370	8.75
	フランス	58,119,110,122	9.59
	オランダ	9,377,795,861	1.54
	スペイン	38,855,689,769	6.41
	ベルギー	15,284,306,250	2.52
	オーストリア	7,833,469,886	1.29
	フィンランド	3,180,802,923	0.52
	アイルランド	5,496,656,730	0.90
	イギリス	38,806,590,878	6.40
	スウェーデン	2,112,955,686	0.34
	ノルウェー	1,469,260,098	0.24
	デンマーク	3,092,054,532	0.51
	ポーランド	3,554,845,339	0.58
	オーストラリア	12,122,375,608	2.00
	シンガポール	2,428,305,569	0.40
	マレーシア	2,746,761,394	0.45
	南アフリカ	3,292,254,321	0.54
	小計	598,048,070,157	98.77
現金・預金・その他資産（負債控除後）		7,440,051,841	1.22
	合計（純資産総額）	605,488,121,998	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	26,396,538,284	45.38
	カナダ	1,072,810,494	1.84
	メキシコ	434,788,115	0.74
	ドイツ	3,453,179,528	5.93
	イタリア	5,075,808,520	8.72
	フランス	5,611,800,050	9.64
	オランダ	1,109,661,878	1.90
	スペイン	3,434,042,583	5.90
	ベルギー	1,454,484,727	2.50
	オーストリア	885,118,795	1.52
	フィンランド	307,442,106	0.52
	アイルランド	602,055,274	1.03
	イギリス	3,767,080,312	6.47
	スウェーデン	194,957,635	0.33

	ノルウェー	98,237,198	0.16
	デンマーク	302,066,992	0.51
	ポーランド	373,667,025	0.64
	オーストラリア	1,188,655,454	2.04
	シンガポール	470,074,627	0.80
	南アフリカ	329,588,891	0.56
	小計	56,562,058,488	97.25
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,598,733,975	2.74
合計（純資産総額）		58,160,792,463	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	28,586,906	0.31
	メキシコ	858,263,935	9.55
	ブラジル	908,274,480	10.10
	チリ	295,801,986	3.29
	コロンビア	601,028,333	6.68
	ペルー	312,271,653	3.47
	ウルグアイ	10,491,103	0.11
	トルコ	321,786,595	3.58
	チェコ	393,721,897	4.38
	ハンガリー	392,318,678	4.36
	ポーランド	792,099,669	8.81
	ロシア	669,927,546	7.45
	ルーマニア	220,625,147	2.45
	マレーシア	518,174,600	5.76
	タイ	769,122,384	8.55
	フィリピン	20,892,476	0.23
	インドネシア	879,894,431	9.79
	南アフリカ	731,185,703	8.13
	小計	8,724,467,522	97.08
現金・預金・その他資産（負債控除後）		261,942,887	2.91
合計（純資産総額）		8,986,410,409	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	19,985,984,127	98.39
現金・預金・その他資産（負債控除後）		325,125,635	1.60
合計（純資産総額）		20,311,109,762	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	1,987,209,659	97.32
現金・預金・その他資産（負債控除後）		54,703,442	2.67
合計（純資産総額）		2,041,913,101	100.00

## （参考）J-REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	39,255,587,050	96.41
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,458,841,679	3.58
合計（純資産総額）		40,714,428,729	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	914,409,000	2.24

## （参考）海外REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	18,220,993,001	72.36
	カナダ	475,796,052	1.88
	ドイツ	67,489,369	0.26
	イタリア	7,389,618	0.02
	フランス	989,095,683	3.92
	オランダ	70,096,553	0.27
	スペイン	175,239,860	0.69
	ベルギー	234,011,171	0.92
	アイルランド	62,056,965	0.24
	イギリス	1,259,910,144	5.00
	オーストラリア	1,709,135,411	6.78
	ニュージーランド	116,155,257	0.46

	香港	657,925,343	2.61
	シンガポール	879,706,975	3.49
	韓国	3,523,446	0.01
	イスラエル	17,306,952	0.06
	小計	24,945,831,800	99.07
現金・預金・その他資産（負債控除後）		232,020,420	0.92
合計（純資産総額）		25,177,852,220	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	215,340,776	0.85

## （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	4,265,159,145	69.67
	カナダ	111,103,739	1.81
	ドイツ	15,912,635	0.25
	イタリア	1,625,716	0.02
	フランス	231,026,971	3.77
	オランダ	15,993,349	0.26
	スペイン	41,337,791	0.67
	ベルギー	54,937,610	0.89
	アイルランド	14,545,009	0.23
	イギリス	294,982,686	4.81
	オーストラリア	400,960,794	6.54
	ニュージーランド	27,611,212	0.45
	香港	153,265,978	2.50
	シンガポール	205,397,090	3.35
	イスラエル	3,817,710	0.06
	小計	5,837,677,435	95.36
現金・預金・その他資産（負債控除後）		283,914,285	4.63
合計（純資産総額）		6,121,591,720	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	159,649,196	2.60

## （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	67,932,648	1.3302	90,364,412	1.3404	91,056,921	55.55
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	13,496,316	1.1426	15,421,235	1.1601	15,657,076	9.55
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	6,887,370	1.6089	11,081,190	1.5075	10,382,710	6.33
4	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	4,285,194	1.9288	8,265,574	1.8615	7,976,888	4.86
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	3,237,950	2.2943	7,428,829	2.2633	7,328,452	4.47
6	日本	親投資信託 受益証券	外国株式M S C I - K O K U S A I マザーファンド	2,403,847	2.8199	6,778,637	2.6495	6,368,992	3.88
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	4,679,839	1.2717	5,951,516	1.1957	5,595,683	3.41
8	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	2,603,338	1.8904	4,921,351	1.8666	4,859,390	2.96
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	1,750,642	2.2781	3,988,139	2.3187	4,059,213	2.47
10	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	1,669,361	2.4279	4,053,042	2.3742	3,963,396	2.41
11	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,742,702	1.3115	3,597,054	1.1747	3,221,852	1.96
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	1,986,615	1.2520	2,487,242	1.2150	2,413,737	1.47

## 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	99.37
合 計	99.37

## 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	27,127,179	1.3300	36,079,304	1.3404	36,361,270	43.17
2	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	5,461,595	1.6094	8,790,261	1.5075	8,233,354	9.77
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式M S C I - K O K U S A I マザーファンド	2,806,759	2.8195	7,913,753	2.6495	7,436,507	8.82
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	5,491,311	1.1426	6,274,594	1.1601	6,370,469	7.56

5	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	2,882,080	1.9272	5,554,595	1.8615	5,364,991	6.36
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,668,803	2.2949	3,829,860	2.2633	3,777,001	4.48
7	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	1,548,664	2.4296	3,762,635	2.3742	3,676,838	4.36
8	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	1,788,836	1.8911	3,382,868	1.8666	3,339,041	3.96
9	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	2,747,917	1.2729	3,497,882	1.1957	3,285,684	3.90
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	1,082,732	2.2786	2,467,124	2.3187	2,510,530	2.98
11	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,767,127	1.3155	2,324,656	1.1747	2,075,844	2.46
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	1,024,098	1.2524	1,282,619	1.2150	1,244,279	1.47

## 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	99.34
合計	99.34

## 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-BPI総 合マザーファンド	50,432,522	1.3302	67,085,341	1.3404	67,599,752	31.22
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	12,343,751	2.8172	34,775,068	2.6495	32,704,768	15.10
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	16,921,894	1.6075	27,201,945	1.5075	25,509,755	11.78
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	5,768,247	2.2939	13,232,201	2.2633	13,055,273	6.02
5	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	6,869,996	1.9292	13,254,145	1.8615	12,788,497	5.90
6	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	10,439,005	1.1426	11,928,522	1.1601	12,110,289	5.59
7	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	4,906,732	2.4278	11,912,564	2.3742	11,649,563	5.38
8	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	9,703,137	1.2720	12,342,391	1.1957	11,602,040	5.35
9	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	4,637,192	1.8903	8,765,685	1.8666	8,655,782	3.99
10	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	7,327,494	1.3082	9,585,828	1.1747	8,607,607	3.97
11	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	2,806,463	2.2783	6,394,111	2.3187	6,507,345	3.00
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	3,539,165	1.2519	4,430,894	1.2150	4,300,085	1.98

## 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	99.34
合 計	99.34

## インデックス・ブレード(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 - BPI総 合 マザーファンド	9,021,200	1.3303	12,001,694	1.3404	12,092,016	22.21
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	3,955,318	2.8053	11,095,934	2.6495	10,479,615	19.25
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	4,792,106	1.6050	7,691,369	1.5075	7,224,099	13.27
4	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	1,677,741	2.4280	4,073,665	2.3742	3,983,292	7.31
5	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	2,913,217	1.2678	3,693,611	1.1957	3,483,333	6.39
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,446,333	2.2916	3,314,532	2.2633	3,273,485	6.01
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,526,755	1.3036	3,293,878	1.1747	2,968,179	5.45
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	1,435,665	1.9251	2,763,870	1.8615	2,672,490	4.90
9	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	1,308,291	1.8882	2,470,320	1.8666	2,442,055	4.48
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	1,903,644	1.1431	2,176,214	1.1601	2,208,417	4.05
11	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	938,307	2.2796	2,138,979	2.3187	2,175,652	3.99
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	887,602	1.2497	1,109,296	1.2150	1,078,436	1.98

## 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	99.34
合 計	99.34

## インデックス・ブレード(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	19,607,197	2.8128	55,151,704	2.6495	51,949,268	26.71
2	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	21,999,972	1.6085	35,387,297	1.5075	33,164,957	17.05
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	13,796,252	1.3300	18,349,513	1.3404	18,492,496	9.50
4	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	6,338,306	2.4293	15,397,647	2.3742	15,048,406	7.73
5	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	12,533,513	1.2717	15,938,869	1.1957	14,986,321	7.70

6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	11,387,737	1.3060	14,872,385	1.1747	13,377,174	6.87
7	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	5,549,387	2.2944	12,732,820	2.2633	12,559,927	6.45
8	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	4,153,561	2.2785	9,464,221	2.3187	9,630,861	4.95
9	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	4,066,778	1.9308	7,852,186	1.8615	7,570,307	3.89
10	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	2,573,724	1.8904	4,865,368	1.8666	4,804,113	2.47
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	3,928,551	1.2517	4,917,368	1.2150	4,773,189	2.45
12	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	3,371,091	1.1426	3,851,946	1.1601	3,910,802	2.01

## 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	97.83
合計	97.83

## (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	1,933,500	6,537.00	12,639,289,500	6,384.00	12,343,464,000	3.19
2	日本	株式	ソフトバンクグル ープ	情報・通 信業	711,500	10,925.00	7,773,137,500	10,250.00	7,292,875,000	1.88
3	日本	株式	ソニー	電気機器	1,164,200	5,408.00	6,295,993,600	5,257.00	6,120,199,400	1.58
4	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	11,780,500	523.50	6,167,091,750	501.10	5,903,208,550	1.52
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	1,164,500	4,745.00	5,525,552,500	4,866.00	5,666,457,000	1.46
6	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,514,800	4,291.00	6,500,006,800	3,669.00	5,557,801,200	1.43
7	日本	株式	キーエンス	電気機器	85,200	66,690.00	5,681,988,000	61,510.00	5,240,652,000	1.35
8	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	1,206,200	3,880.00	4,680,056,000	3,783.00	4,563,054,600	1.17
9	日本	株式	KDDI	情報・通 信業	1,500,400	2,561.00	3,842,524,400	2,788.50	4,183,865,400	1.08
10	日本	株式	リクルートホール ディングス	サービ ス業	1,187,700	3,286.00	3,902,782,200	3,468.00	4,118,943,600	1.06
11	日本	株式	本田技研工業	輸送用機 器	1,463,700	2,832.00	4,145,198,400	2,651.00	3,880,268,700	1.00
12	日本	株式	任天堂	その他製 品	99,300	37,000.00	3,674,100,000	38,700.00	3,842,910,000	0.99
13	日本	株式	みずほフィナン シャルグループ	銀行業	23,254,100	167.30	3,890,410,930	153.70	3,574,155,170	0.92
14	日本	株式	花王	化学	421,200	8,430.00	3,550,716,000	8,480.00	3,571,776,000	0.92
15	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	155,400	22,140.00	3,440,556,000	22,645.00	3,519,033,000	0.90
16	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,199,200	2,844.00	3,410,524,800	2,833.00	3,397,333,600	0.87
17	日本	株式	東京海上ホール ディングス	保険業	612,000	5,460.00	3,341,520,000	5,401.00	3,305,412,000	0.85
18	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	308,500	9,904.00	3,055,384,000	10,310.00	3,180,635,000	0.82
19	日本	株式	ダイキン工業	機械	236,800	13,625.00	3,226,400,000	13,230.00	3,132,864,000	0.80

20	日本	株式	ファナック	電気機器	164,900	19,150.00	3,157,835,000	18,475.00	3,046,527,500	0.78
21	日本	株式	日立製作所	電気機器	781,100	3,683.00	2,876,791,300	3,686.00	2,879,134,600	0.74
22	日本	株式	キヤノン	電気機器	934,000	3,051.00	2,849,634,000	3,065.00	2,862,710,000	0.74
23	日本	株式	日本電産	電気機器	208,800	14,900.00	3,111,120,000	13,590.00	2,837,592,000	0.73
24	日本	株式	信越化学工業	化学	299,500	9,469.00	2,835,965,500	9,047.00	2,709,576,500	0.70
25	日本	株式	資生堂	化学	344,800	8,430.00	2,906,664,000	7,833.00	2,700,818,400	0.69
26	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	1,078,000	2,412.50	2,600,675,000	2,495.50	2,690,149,000	0.69
27	日本	株式	H O Y A	精密機器	349,300	7,724.00	2,697,993,200	7,558.00	2,640,009,400	0.68
28	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	716,300	3,698.00	2,648,877,400	3,666.00	2,625,955,800	0.67
29	日本	株式	第一三共	医薬品	496,500	5,522.00	2,741,673,000	5,255.00	2,609,107,500	0.67
30	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	195,900	12,400.00	2,429,160,000	13,250.00	2,595,675,000	0.67

## 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	0.11
		鉱業	0.24
		建設業	2.78
		食料品	4.10
		繊維製品	0.62
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.12
		医薬品	5.39
		石油・石炭製品	0.59
		ゴム製品	0.74
		ガラス・土石製品	0.82
		鉄鋼	0.87
		非鉄金属	0.71
		金属製品	0.52
		機械	4.85
		電気機器	12.78
		輸送用機器	7.49
		精密機器	2.07
		その他製品	2.13
		電気・ガス業	1.68
		陸運業	4.78
		海運業	0.14
		空運業	0.54
倉庫・運輸関連業	0.19		
情報・通信業	8.90		
卸売業	4.82		
小売業	4.48		
銀行業	5.83		

	証券、商品先物取引業	0.73
	保険業	2.26
	その他金融業	1.07
	不動産業	2.40
	サービス業	5.18
合 計		97.37

## (参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	997,600	12,904.76	12,873,798,479	13,749.83	13,716,833,201	2.50
2	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	645,400	20,770.55	13,405,312,976	19,498.88	12,584,582,315	2.30
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	57,150	194,820.67	11,134,001,652	198,632.75	11,351,861,960	2.07
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	326,000	18,229.21	5,942,725,199	20,013.97	6,524,555,394	1.19
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	43,050	128,277.40	5,522,342,094	122,259.01	5,263,250,467	0.96
6	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	363,900	15,287.43	5,563,097,378	14,447.54	5,257,463,299	0.96
7	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	448,000	11,070.51	4,959,589,735	11,708.08	5,245,220,557	0.95
8	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	41,000	128,660.91	5,275,097,692	122,637.39	5,028,133,302	0.91
9	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	580,400	8,826.87	5,123,119,493	7,870.63	4,568,118,992	0.83
10	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	419,600	10,315.99	4,328,590,240	10,686.71	4,484,143,936	0.81
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	238,700	17,080.93	4,077,219,996	17,799.43	4,248,724,800	0.77
12	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	342,700	11,379.54	3,899,768,637	11,518.88	3,947,523,192	0.72
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	178,700	21,967.08	3,925,517,945	21,843.56	3,903,445,316	0.71
14	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,255,400	3,017.24	3,787,846,109	2,970.21	3,728,811,175	0.68
15	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	246,600	12,169.05	3,000,888,830	14,457.39	3,565,192,867	0.65
16	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	602,300	5,904.34	3,556,187,837	5,858.41	3,528,523,475	0.64
17	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	566,200	6,466.00	3,661,050,888	6,214.92	3,518,892,687	0.64
18	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア・プロ バイダー/ ヘルスケ ア・サー ビス	131,500	27,035.60	3,555,181,833	26,629.16	3,501,734,540	0.64



19	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	759,600	4,644.51	3,527,976,784	4,582.18	3,480,626,966	0.63
20	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気 通信サー ビス	998,200	3,430.24	3,424,074,507	3,484.20	3,477,938,023	0.63
21	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術 サービス	124,600	25,748.81	3,208,301,976	27,798.21	3,463,658,013	0.63
22	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	259,100	13,470.96	3,490,326,980	12,617.95	3,269,312,607	0.59
23	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売 り	154,800	20,984.68	3,248,429,852	20,896.50	3,234,779,562	0.59
24	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	352,500	9,095.47	3,206,153,598	8,713.80	3,071,616,192	0.56
25	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・ 半導体製 造装置	615,300	5,872.63	3,613,430,470	4,891.67	3,009,846,274	0.55
26	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	556,700	5,128.39	2,854,978,261	5,385.98	2,998,375,066	0.54
27	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	591,300	5,284.27	3,124,591,925	4,926.66	2,913,138,788	0.53
28	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	615,400	4,372.21	2,690,659,758	4,564.68	2,809,108,011	0.51
29	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品	297,200	9,158.76	2,721,985,703	9,444.72	2,806,972,924	0.51
30	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇 宙・防衛	73,130	41,712.09	3,050,405,229	38,261.78	2,798,084,205	0.51

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.27
		メディア	1.28
		娯楽	1.43
		不動産管理・開発	0.56
		エネルギー設備・サービス	0.30
		石油・ガス・消耗燃料	5.65
		化学	2.21
		建設資材	0.28
		容器・包装	0.27
		金属・鉱業	1.38
		紙製品・林産品	0.07
		航空宇宙・防衛	2.29
		建設関連製品	0.40
		建設・土木	0.33
		電気設備	0.68
		コングロマリット	1.34
		機械	1.53
		商社・流通業	0.25
		商業サービス・用品	0.49
		航空貨物・物流サービス	0.45
旅客航空輸送業	0.09		
海運業	0.04		
陸運・鉄道	1.11		
運送インフラ	0.21		

自動車部品	0.27
自動車	0.78
家庭用耐久財	0.37
レジャー用品	0.04
繊維・アパレル・贅沢品	1.42
ホテル・レストラン・レジャー	1.86
販売	0.06
インターネット販売・通信販売	2.57
複合小売り	0.48
専門小売り	1.63
食品・生活必需品小売り	1.46
飲料	2.08
食品	2.00
タバコ	0.90
家庭用品	1.38
パーソナル用品	0.75
ヘルスケア機器・用品	2.66
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.91
バイオテクノロジー	1.80
医薬品	5.35
銀行	7.82
各種金融サービス	0.97
保険	3.93
情報技術サービス	4.18
ソフトウェア	5.29
通信機器	0.95
コンピュータ・周辺機器	2.58
電子装置・機器・部品	0.51
半導体・半導体製造装置	2.70
各種電気通信サービス	2.11
無線通信サービス	0.29
電力	1.98
ガス	0.17
総合公益事業	1.08
水道	0.09
消費者金融	0.50
資本市場	2.77
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	0.10
ヘルスケア・テクノロジー	0.11
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.76
専門サービス	0.75

投資証券		2.70
合計		98.36

## (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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	82,370	13,724.68	1,130,501,892	13,749.83	1,132,573,728	2.46
2	アメリカ	株式	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	53,260	21,950.73	1,169,096,370	19,498.88	1,038,510,775	2.25
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	4,706	207,750.63	977,674,487	198,632.75	934,765,746	2.03
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	26,840	20,630.76	553,729,705	20,013.97	537,175,051	1.16
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3,582	127,117.87	455,336,235	122,259.01	437,931,781	0.95
6	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	36,970	12,305.18	454,922,771	11,708.08	432,847,777	0.94
7	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	29,940	15,171.51	454,235,093	14,447.54	432,559,635	0.94
8	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3,403	127,729.19	434,662,465	122,637.39	417,335,064	0.90
9	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	48,200	8,395.56	404,666,339	7,870.63	379,364,809	0.82
10	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	34,840	10,532.41	366,949,297	10,686.71	372,325,011	0.80
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	20,000	17,476.82	349,536,432	17,799.43	355,988,672	0.77
12	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	28,300	11,399.68	322,611,125	11,518.88	325,984,553	0.70
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	14,710	22,808.12	335,507,469	21,843.56	321,318,862	0.69
14	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	103,600	3,249.08	336,605,268	2,970.21	307,714,543	0.66
15	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	20,200	14,609.40	295,109,928	14,457.39	292,039,318	0.63
16	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	46,900	6,176.65	289,685,017	6,214.92	291,480,161	0.63
17	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	49,700	5,787.33	287,630,360	5,858.41	291,163,235	0.63
18	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	10,930	26,024.39	284,446,683	26,629.16	291,056,719	0.63
19	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	10,420	26,827.10	279,538,399	27,798.21	289,657,436	0.62
20	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	82,600	3,322.35	274,426,672	3,484.20	287,795,713	0.62
21	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	62,200	4,444.39	276,441,083	4,582.18	285,011,845	0.61
22	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	21,690	13,253.33	287,464,910	12,617.95	273,683,483	0.59
23	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	12,810	21,279.26	272,587,434	20,896.50	267,684,278	0.58
24	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	29,500	8,566.16	252,701,980	8,713.80	257,057,242	0.55

25	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	50,800	5,098.36	258,996,850	4,891.67	248,496,978	0.54
26	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	45,800	5,183.66	237,411,811	5,385.98	246,677,884	0.53
27	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	48,800	5,111.48	249,440,536	4,926.66	240,421,398	0.52
28	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	51,400	4,693.73	241,257,784	4,564.68	234,624,881	0.51
29	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	6,130	38,727.65	237,400,536	38,261.78	234,544,731	0.50
30	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品	24,610	8,876.43	218,449,075	9,444.72	232,434,736	0.50

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.22
		メディア	1.26
		娯楽	1.40
		不動産管理・開発	0.55
		エネルギー設備・サービス	0.30
		石油・ガス・消耗燃料	5.57
		化学	2.19
		建設資材	0.26
		容器・包装	0.26
		金属・鉱業	1.34
		紙製品・林産品	0.07
		航空宇宙・防衛	2.26
		建設関連製品	0.40
		建設・土木	0.31
		電気設備	0.66
		コングロマリット	1.34
		機械	1.49
		商社・流通業	0.25
		商業サービス・用品	0.47
		航空貨物・物流サービス	0.45
		旅客航空輸送業	0.09
		海運業	0.05
		陸運・鉄道	1.08
		運送インフラ	0.20
		自動車部品	0.29
		自動車	0.78
		家庭用耐久財	0.37
レジャー用品	0.04		
繊維・アパレル・贅沢品	1.39		
ホテル・レストラン・レジャー	1.85		
販売	0.06		
インターネット販売・通信販売	2.50		

複合小売り	0.48
専門小売り	1.60
食品・生活必需品小売り	1.43
飲料	2.02
食品	1.98
タバコ	0.89
家庭用品	1.35
パーソナル用品	0.75
ヘルスケア機器・用品	2.60
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.88
バイオテクノロジー	1.75
医薬品	5.28
銀行	7.68
各種金融サービス	0.93
保険	3.85
情報技術サービス	4.12
ソフトウェア	5.16
通信機器	0.95
コンピュータ・周辺機器	2.55
電子装置・機器・部品	0.48
半導体・半導体製造装置	2.62
各種電気通信サービス	2.07
無線通信サービス	0.29
電力	1.96
ガス	0.17
総合公益事業	1.07
水道	0.09
消費者金融	0.48
資本市場	2.71
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	0.10
ヘルスケア・テクノロジー	0.10
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.74
専門サービス	0.75
投資証券	2.63
合 計	96.62

(参考) 新興国株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	348,000	5,224.53	1,818,139,062	4,522.13	1,573,703,328	4.38
2	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネット販 売・通信販 売	86,810	19,452.49	1,688,671,339	16,521.01	1,434,189,330	3.99
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	1,501,000	886.08	1,330,009,257	799.26	1,199,689,260	3.34
4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュー タ・周辺機 器	291,700	3,901.50	1,138,068,609	3,910.34	1,140,647,636	3.17
5	南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インター ネット販 売・通信販 売	26,850	25,119.46	674,457,744	24,133.78	647,992,014	1.80
6	アメリカ	投資信託受 益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF		196,600	2,881.74	566,551,377	2,872.88	564,809,623	1.57
7	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	5,894,000	89.70	528,724,802	86.42	509,406,632	1.41
8	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	340,500	1,207.53	411,166,844	1,209.99	412,002,276	1.14
9	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガ ス・消耗燃 料	175,200	1,989.17	348,503,859	2,101.00	368,096,076	1.02
10	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信 サービス	374,000	1,014.25	379,329,596	976.49	365,209,878	1.01
11	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵 当・不動産 金融	98,900	3,025.06	299,179,225	3,451.35	341,338,713	0.95
12	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,005,000	76.74	307,346,001	78.06	312,646,320	0.87
13	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	298,591	894.79	267,176,314	962.94	287,527,009	0.80
14	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	195,521	1,332.59	260,549,433	1,372.77	268,406,243	0.74
15	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	657,500	386.16	253,904,957	391.24	257,242,308	0.71
16	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PREF	銀行	248,915	957.25	238,275,337	1,018.12	253,425,464	0.70

17	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術 サービス	215,700	1,139.19	245,724,782	1,159.00	249,998,241	0.69
18	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガ ス・消耗燃 料	328,900	543.03	178,603,235	709.96	233,507,528	0.65
19	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガ ス・消耗燃 料	25,470	8,786.44	223,790,704	8,759.73	223,110,476	0.62
20	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,906,000	48.80	239,415,814	45.30	222,266,330	0.61
21	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	17,140	17,138.75	293,758,214	12,228.63	209,598,807	0.58
22	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	33,760	6,948.09	234,567,724	6,056.21	204,457,650	0.56
23	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・ 機器・部品	772,649	289.59	223,752,902	253.96	196,225,031	0.54
24	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガ ス・消耗燃 料	1,070,000	185.95	198,976,772	182.05	194,800,348	0.54
25	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術 サービス	55,800	3,425.71	191,154,862	3,391.15	189,226,393	0.52
26	ブラジル	株式	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	石油・ガ ス・消耗燃 料	260,400	735.01	191,399,144	717.81	186,919,677	0.52
27	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信 サービス	2,090,000	76.02	158,896,939	79.01	165,145,948	0.46
28	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュ ータ・周辺機 器	51,100	3,188.24	162,919,447	3,165.95	161,780,300	0.45
29	カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	27,110	5,471.34	148,328,298	5,636.23	152,798,466	0.42
30	インド	株式	AXIS BANK LIMITED	銀行	118,400	1,162.17	137,601,276	1,275.92	151,069,994	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	インタラクティブ・メディアおよびサービス	5.75
		メディア	0.32
		娯楽	0.71
		不動産管理・開発	2.49
		エネルギー設備・サービス	0.07

石油・ガス・消耗燃料	7.75
化学	2.41
建設資材	1.17
容器・包装	0.04
金属・鉱業	3.17
紙製品・林産品	0.30
航空宇宙・防衛	0.13
建設関連製品	0.02
建設・土木	0.71
電気設備	0.16
コングロマリット	1.27
機械	0.63
商社・流通業	0.04
商業サービス・用品	0.13
航空貨物・物流サービス	0.16
旅客航空輸送業	0.24
海運業	0.08
陸運・鉄道	0.30
運送インフラ	0.94
自動車部品	0.50
自動車	1.84
家庭用耐久財	0.32
レジャー用品	0.08
繊維・アパレル・贅沢品	0.77
ホテル・レストラン・レジャー	0.66
インターネット販売・通信販売	6.80
複合小売り	0.55
専門小売り	0.47
食品・生活必需品小売り	1.65
飲料	1.10
食品	1.73
タバコ	0.56
家庭用品	0.43
パーソナル用品	0.64
ヘルスケア機器・用品	0.08
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.55



	バイオテクノロジー	0.43
	医薬品	1.16
	銀行	16.92
	各種金融サービス	0.88
	保険	3.75
	情報技術サービス	1.80
	ソフトウェア	0.14
	通信機器	0.05
	コンピュータ・周辺機器	4.46
	電子装置・機器・部品	1.77
	半導体・半導体製造装置	4.82
	各種電気通信サービス	1.56
	無線通信サービス	2.91
	電力	1.00
	ガス	0.59
	総合公益事業	0.06
	水道	0.24
	貯蓄・抵当・不動産金融	1.05
	消費者金融	0.26
	資本市場	1.20
	各種消費者サービス	0.51
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.58
	ヘルスケア・テクノロジー	0.06
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.26
	専門サービス	0.02
	その他の業種	0.00
新株予約権証券		0.00
投資信託受益証券		1.57
投資証券		0.26
合 計		96.40

（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	CINCINNATI FINANCIAL CORP	保険	25,560	9,560.89	244,376,359	10,759.93	275,023,821	2.03
2	アメリカ	株式	MEDTRONIC PLC	ヘルスケア 機器・用品	26,120	9,320.65	243,455,384	10,124.54	264,453,215	1.95
3	アメリカ	株式	SYSCO CORP	食品・生活 必需品小売 り	31,580	7,786.57	245,899,886	8,149.50	257,361,437	1.89
4	アメリカ	株式	AFLAC INC	保険	45,450	5,376.38	244,356,532	5,639.69	256,324,147	1.89
5	アメリカ	株式	CHUBB LTD	保険	16,040	15,242.25	244,485,796	15,942.50	255,717,713	1.88
6	アメリカ	株式	CINTAS CORP	商業サー ビス・用品	10,420	23,419.29	244,029,042	24,452.89	254,799,176	1.88
7	アメリカ	株式	BECTON,DICKINSON	ヘルスケア 機器・用品	9,750	25,074.40	244,475,494	25,940.19	252,916,872	1.86
8	アメリカ	株式	AIR PRODUCTS	化学	11,300	21,706.10	245,279,027	22,335.68	252,393,256	1.86
9	アメリカ	株式	KIMBERLY-CLARK CORP	家庭用品	17,700	13,545.09	239,748,113	14,240.85	252,063,208	1.86
10	アメリカ	株式	COLGATE PALMOLIVE CO.	家庭用品	32,210	7,596.17	244,672,922	7,748.15	249,568,105	1.84
11	アメリカ	株式	MCCORMICK & CO INC.	食品	14,690	16,880.75	247,978,229	16,978.14	249,408,877	1.84
12	アメリカ	株式	LINDE PLC	化学	12,400	19,735.34	244,718,251	20,057.71	248,715,698	1.83
13	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	46,110	5,208.12	240,146,639	5,385.98	248,347,538	1.83
14	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	21,550	11,590.39	249,772,915	11,518.88	248,232,054	1.83
15	アメリカ	株式	MCDONALD'S CORP	ホテル・レ ストラン・ レジャー	11,380	21,355.22	243,022,504	21,788.88	247,957,527	1.83
16	アメリカ	株式	CONSOLIDATED EDISON INC	総合公益事 業	26,400	9,165.31	241,964,370	9,322.94	246,125,616	1.81
17	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	17,490	13,904.59	243,191,301	14,064.78	245,993,170	1.81
18	アメリカ	株式	HORMEL FOODS CORP	食品	56,650	4,392.27	248,822,336	4,332.84	245,455,567	1.81
19	アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア 機器・用品	29,210	8,116.95	237,096,177	8,368.22	244,435,917	1.80
20	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	資本市場	10,200	23,728.67	242,032,490	23,748.61	242,235,900	1.78
21	アメリカ	株式	ECOLAB INC	化学	12,060	20,018.58	241,424,109	20,054.43	241,856,508	1.78
22	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST		16,910	14,447.63	244,309,474	14,285.69	241,571,132	1.78
23	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通 信サービス	69,200	3,488.30	241,390,856	3,484.20	241,107,304	1.77
24	アメリカ	株式	WALMART INC	食品・生活 必需品小売 り	21,570	11,261.51	242,910,869	11,175.49	241,055,500	1.77
25	アメリカ	株式	ROPER TECHNOLOGIES INC	コングロマ リット	6,330	38,244.04	242,084,802	37,974.16	240,376,473	1.77
26	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテ クノロジー	28,260	8,506.10	240,382,434	8,487.42	239,854,761	1.77
27	アメリカ	株式	TARGET CORP	複合小売	27,060	9,053.76	244,994,823	8,791.45	237,896,648	1.75
28	アメリカ	株式	AUTOMATIC DATA PROCESS	情報技術 サービス	13,470	17,746.15	239,040,652	17,597.11	237,033,174	1.74
29	アメリカ	株式	CLOROX CO	家庭用品	14,480	16,696.74	241,768,877	16,364.63	236,959,848	1.74
30	アメリカ	株式	BROWN-FORMAN CORP-CL B	飲料	42,050	5,770.59	242,653,360	5,580.64	234,665,946	1.73

## 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	3.24
		化学	8.77
		金属・鉱業	1.50
		航空宇宙・防衛	3.24

	建設関連製品	1.31
	電気設備	1.50
	コングロマリット	3.08
	機械	8.06
	商社・流通業	1.61
	商業サービス・用品	1.88
	家庭用耐久財	1.52
	繊維・アパレル・贅沢品	1.67
	ホテル・レストラン・レジャー	1.83
	販売	1.68
	複合小売り	1.75
	専門小売り	1.48
	食品・生活必需品小売り	5.38
	飲料	5.38
	食品	5.26
	家庭用品	7.28
	ヘルスケア機器・用品	5.62
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.67
	バイオテクノロジー	1.77
	医薬品	1.69
	銀行	1.62
	保険	5.80
	情報技術サービス	1.74
	各種電気通信サービス	1.77
	総合公益事業	1.81
	資本市場	5.16
投資信託受益証券		1.21
投資証券		1.78
合 計		99.22

## (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 (10年)第3 50回	8,250,000,000	102.10	8,423,823,000	102.18	8,430,015,000	0.1	2028/3/20	1.27
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	7,600,000,000	104.14	7,914,972,000	104.07	7,909,928,000	0.6	2024/6/20	1.19
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	7,500,000,000	100.47	7,535,475,000	100.42	7,531,950,000	0.1	2020/12/20	1.13
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	7,200,000,000	100.40	7,229,088,000	100.35	7,225,272,000	0.1	2020/9/20	1.09

5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	6,000,000,000	100.54	6,032,520,000	100.50	6,030,240,000	0.1	2021/3/20	0.91
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	5,500,000,000	102.27	5,624,850,000	102.22	5,622,100,000	0.1	2026/12/20	0.84
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,400,000,000	103.78	5,604,390,000	103.67	5,598,234,000	0.6	2023/12/20	0.84
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	5,400,000,000	102.26	5,522,148,000	102.21	5,519,502,000	0.1	2027/3/20	0.83
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	104.23	5,524,190,000	104.07	5,516,187,000	0.8	2023/6/20	0.83
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	5,400,000,000	102.19	5,518,584,000	102.14	5,515,776,000	0.1	2026/6/20	0.83
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	5,300,000,000	102.23	5,418,455,000	102.18	5,415,752,000	0.1	2026/9/20	0.81
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	5,200,000,000	100.62	5,232,396,000	100.57	5,229,900,000	0.1	2021/6/20	0.78
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 51回	5,100,000,000	102.00	5,202,000,000	102.15	5,209,752,000	0.1	2028/6/20	0.78
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,000,000,000	103.17	5,158,800,000	103.05	5,152,900,000	0.6	2023/3/20	0.77
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 49回	5,000,000,000	102.16	5,108,150,000	102.20	5,110,400,000	0.1	2027/12/20	0.77
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	4,950,000,000	102.36	5,067,265,500	102.12	5,055,237,000	1.2	2020/12/20	0.76
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	5,000,000,000	100.76	5,038,200,000	100.74	5,037,100,000	0.1	2021/12/20	0.76
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	4,800,000,000	100.84	4,840,488,000	100.82	4,839,744,000	0.1	2022/3/20	0.73
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	4,650,000,000	102.11	4,748,487,000	102.06	4,746,069,000	0.1	2026/3/20	0.71
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	4,500,000,000	102.23	4,600,440,000	102.22	4,600,305,000	0.1	2027/9/20	0.69
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,400,000,000	103.45	4,552,064,000	103.32	4,546,080,000	0.8	2022/9/20	0.68
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	4,400,000,000	102.24	4,498,632,000	102.24	4,498,736,000	0.1	2027/6/20	0.67
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	4,300,000,000	101.91	4,382,173,000	102.11	4,390,988,000	0.1	2028/9/20	0.66
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	4,200,000,000	103.95	4,366,278,000	103.87	4,362,624,000	0.6	2024/3/20	0.65
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	4,200,000,000	103.93	4,365,102,000	103.82	4,360,734,000	0.4	2025/9/20	0.65
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 6回	4,300,000,000	101.27	4,354,825,000	101.22	4,352,589,000	0.1	2023/6/20	0.65
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 53回	4,200,000,000	101.77	4,274,431,000	102.02	4,285,092,000	0.1	2028/12/20	0.64

28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 5回	4,000,000,000	101.18	4,047,390,000	101.14	4,045,880,000	0.1	2023/3/20	0.61
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 3回	4,000,000,000	101.03	4,041,200,000	100.99	4,039,840,000	0.1	2022/9/20	0.60
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	4,000,000,000	100.69	4,027,760,000	100.65	4,026,280,000	0.1	2021/9/20	0.60

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.69
地方債証券	6.65
特殊債券	8.60
社債券	4.01
合計	98.96

## (参考)外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,880.46	7,648,966,758	11,023.99	7,749,871,863	2.25	2025/11/15	1.27
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,787.33	7,583,498,757	10,851.41	7,628,545,871	1.75	2022/4/30	1.25
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	55,700,000	13,423.08	7,476,658,236	13,570.89	7,558,987,123	6	2026/2/15	1.24
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	55,800,000	10,986.83	6,130,653,875	11,008.19	6,142,572,254	2.625	2020/11/15	1.01
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	40,400,000	13,523.90	5,463,656,247	13,746.89	5,553,744,854	5.25	2028/11/15	0.91
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,300,000	10,728.38	5,289,094,595	10,817.24	5,332,900,110	1.75	2023/5/15	0.88
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,200,000	11,187.18	5,280,351,652	11,207.26	5,289,828,186	3.625	2021/2/15	0.87
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	47,100,000	10,987.26	5,175,000,637	11,105.16	5,230,533,046	2.375	2024/8/15	0.86
9	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,208.97	5,186,261,566	15,289.93	5,213,867,937	3.5	2026/4/25	0.86
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	10,747.18	5,147,900,325	10,830.05	5,187,597,543	1.75	2023/1/31	0.85
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,900,000	10,761.70	5,047,240,817	10,889.00	5,106,945,268	2	2025/2/15	0.84
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,400,000	11,123.27	5,049,965,245	11,152.58	5,063,272,730	3.125	2021/5/15	0.83
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,000,000	10,847.14	4,989,686,700	10,969.31	5,045,887,110	2.125	2024/9/30	0.83
14	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	18,425.34	4,974,844,230	18,534.91	5,004,427,050	5.5	2029/4/25	0.82
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,707.11	4,930,362,212	12,787.00	4,961,357,281	6.25	2023/8/15	0.81
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	35,600,000	13,581.14	4,834,887,620	13,807.55	4,915,489,260	5.25	2029/2/15	0.81

17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,600,000	10,212.34	4,656,828,910	10,648.07	4,855,522,111	2.5	2045/2/15	0.80
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	34,100,000	14,030.54	4,784,416,085	14,200.56	4,842,393,211	6.5	2026/11/15	0.79
19	イギリス	国債証券	UK TREASURY	24,000,000	19,093.58	4,582,459,872	19,665.53	4,719,728,592	3.5	2045/1/22	0.77
20	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,100,000	20,338.38	4,494,782,761	20,515.19	4,533,857,839	5.75	2032/10/25	0.74
21	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,300,000	14,700.10	4,307,130,765	14,718.36	4,312,481,238	4.25	2023/10/25	0.71
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	11,224.77	4,141,943,157	11,680.15	4,309,978,968	3	2044/11/15	0.71
23	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	22,900,000	18,229.45	4,174,544,370	18,780.73	4,300,787,490	3.25	2044/1/22	0.71
24	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	30,400,000	13,905.14	4,227,163,411	13,826.01	4,203,107,587	5.5	2022/11/1	0.69
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	37,700,000	10,803.57	4,072,946,494	10,820.65	4,079,388,481	1.375	2020/8/31	0.67
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,200,000	10,907.80	3,948,625,339	10,921.47	3,953,573,879	2.125	2020/8/31	0.65
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,000,000	11,126.52	3,894,283,682	11,258.09	3,940,334,686	2.625	2025/3/31	0.65
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	28,300,000	13,696.48	3,876,105,200	13,912.64	3,937,277,828	5.5	2028/8/15	0.65
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,300,000	10,906.09	3,849,852,101	10,933.43	3,859,503,121	2.125	2021/1/31	0.63
30	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	21,200,000	17,700.99	3,752,611,152	18,010.21	3,818,165,707	3.25	2045/5/25	0.63

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.77
合計	98.77

## (参考) 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	6,150,000	10,781.25	663,046,915	10,950.95	673,483,462	2.125	2021/8/15	1.15
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,000,000	10,385.46	623,127,812	10,766.83	646,009,992	1.625	2023/5/31	1.11
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	10,985.00	461,370,175	11,412.74	479,335,109	2.75	2028/2/15	0.82
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	10,797.11	453,478,737	11,138.48	467,816,437	2.5	2023/8/15	0.80
5	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,500,000	13,222.28	462,780,014	13,262.06	464,172,220	1.75	2023/5/25	0.79
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	3,450,000	12,236.29	422,152,018	13,171.04	454,401,052	3.75	2043/11/15	0.78
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	9,961.84	418,397,690	10,581.43	444,420,232	1.625	2026/5/15	0.76
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,864.68	434,587,344	11,035.96	441,438,464	2.25	2024/11/15	0.75
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,845.00	433,800,324	10,990.25	439,610,096	2.375	2021/4/15	0.75
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,663.02	426,521,060	10,817.66	432,706,724	1.375	2020/9/15	0.74
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,405.78	416,231,421	10,713.00	428,520,292	1.125	2021/8/31	0.73

12	イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,880,000	21,029.20	395,349,075	22,351.64	420,210,975	4.25	2046/12/7	0.72
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	10,381.50	394,497,373	10,990.68	417,645,840	2.25	2027/8/15	0.71
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,700,000	10,566.91	390,975,670	10,789.04	399,194,757	1.375	2021/4/30	0.68
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	9,875.10	375,253,879	10,468.65	397,808,951	1.5	2026/8/15	0.68
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,580,000	10,754.01	384,993,820	10,913.78	390,713,528	2	2021/2/28	0.67
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,600,000	10,700.61	385,222,284	10,839.88	390,235,766	1.5	2020/8/15	0.67
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	10,912.93	371,039,675	11,282.87	383,617,774	2.75	2024/2/15	0.65
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	10,762.56	376,689,657	10,950.52	383,268,344	2.125	2021/6/30	0.65
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	10,476.34	366,672,100	10,909.51	381,832,994	2	2024/4/30	0.65
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	2,680,000	13,844.29	371,027,039	14,200.56	380,575,184	6.5	2026/11/15	0.65
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000	11,597.45	359,521,107	12,109.47	375,393,812	2.2	2027/6/1	0.64
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	10,178.16	356,235,919	10,594.25	370,798,750	1.25	2023/7/31	0.63
24	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,000,000	12,303.04	369,091,332	12,316.07	369,482,117	0	2021/5/25	0.63
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	10,636.28	361,633,849	10,848.85	368,861,009	1.75	2022/5/31	0.63
26	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000	11,902.62	357,078,638	12,125.79	363,773,729	0.45	2021/6/1	0.62
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	9,845.71	334,754,377	10,622.44	361,163,099	2.5	2046/5/15	0.62
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,020,000	10,755.34	324,811,503	11,699.81	353,334,283	3	2045/11/15	0.60
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	10,761.25	344,360,114	10,854.83	347,354,691	1.75	2022/3/31	0.59
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,360,000	13,344.01	314,918,675	14,379.98	339,367,641	4.5	2038/5/15	0.58

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.25
合計	97.25

## (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	11,540,000,000	4.01	463,791,987	4.02	464,096,246	9.85	2027/6/28	5.16
2	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000	2,964.93	180,873,795	3,060.63	186,698,512	10	2023/1/1	2.07
3	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	6,900,000	2,516.78	173,658,209	2,511.58	173,299,523		2020/7/1	1.92
4	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	6,100,000	2,797.22	170,630,970	2,815.29	171,733,056	2.5	2027/7/25	1.91
5	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,740,000	3,082.48	146,110,003	3,070.00	145,518,308	4	2023/10/25	1.61
6	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	451,000	2,973.38	134,106,044	3,090.51	139,382,168	10	2025/1/1	1.55
7	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	6,200,000	2,227.30	138,092,731	2,236.04	138,634,684		2022/1/1	1.54
8	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,040,000,000	3.39	137,110,378	3.38	136,932,087	7.75	2021/4/14	1.52

9	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	456,000	2,921.14	133,212,441	2,991.97	136,433,838	10	2021/1/1	1.51
10	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	28,900,000	447.29	129,268,075	450.06	130,067,543	1	2026/6/26	1.44
11	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	19,500,000	659.32	128,568,132	661.08	128,912,391	8.75	2048/2/28	1.43
12	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,230,000	3,008.09	127,242,582	2,984.75	126,255,051	5.25	2020/10/25	1.40
13	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	26,900,000	446.05	119,988,616	447.89	120,484,034	0.45	2023/10/25	1.34
14	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	21,150,000	533.73	112,884,191	548.41	115,990,081	7.5	2027/6/3	1.29
15	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	21,100,000	535.65	113,022,354	542.77	114,526,495	6.5	2022/6/9	1.27
16	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	67,000,000	165.56	110,927,746	167.53	112,248,048	7.6	2022/7/20	1.24
17	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,500,000	804.96	108,669,909	820.11	110,714,904	10.5	2026/12/21	1.23
18	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	59,000,000	164.16	96,859,916	167.99	99,115,268	7.75	2026/9/16	1.10
19	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	61,700,000	156.24	96,401,067	159.63	98,496,011	7.05	2028/1/19	1.09
20	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	24,500,000	356.00	87,222,104	358.21	87,763,401	2.875	2028/12/17	0.97
21	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	20,200,000	421.06	85,055,375	432.96	87,458,808	0.95	2030/5/15	0.97
22	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	280,000	2,982.59	83,515,690	3,103.73	86,904,611	10	2027/1/1	0.96
23	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3,300,000	2,600.22	85,807,294	2,615.10	86,298,314	3.899	2027/11/16	0.96
24	チリ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS	490,000,000	16.69	81,787,574	17.44	85,459,093	5	2035/3/1	0.95
25	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,300,000	2,574.54	84,959,884	2,578.11	85,077,855	3.733	2028/6/15	0.94
26	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	12,500,000,000	0.66	83,413,800	0.67	84,178,341	6.125	2028/5/15	0.93
27	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	22,500,000	364.98	82,121,067	371.47	83,582,085	3.4	2036/6/17	0.93
28	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	11,000,000,000	0.75	83,314,924	0.74	82,480,604	8.25	2036/5/15	0.91
29	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,580,000	3,137.89	80,957,667	3,109.73	80,231,253	5.75	2021/10/25	0.89
30	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000	365.93	79,408,184	365.76	79,370,591	3.625	2023/6/16	0.88

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.08
合計	97.08

## (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	3,800,000	11,155.75	423,918,839	11,500.05	437,002,166	5.25	2047/6/23	2.15
2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	4,100,000	8,454.89	346,650,695	8,455.00	346,655,179	7.5	2026/4/22	1.70



3	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000	11,335.16	283,379,100	11,433.58	285,839,700	5	2045/6/15	1.40
4	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,110,000	12,494.38	263,631,418	12,576.50	265,364,348	6.05	2040/1/11	1.30
5	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	2,400,000	10,608.18	254,596,544	10,744.29	257,863,007	7.375	2025/2/5	1.26
6	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,300,000	11,076.96	254,770,196	11,190.26	257,376,026	4.15	2027/3/28	1.26
7	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000	11,121.29	255,789,760	11,184.90	257,252,778	4.25	2025/1/7	1.26
8	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,000,000	11,517.19	230,343,874	11,624.22	232,484,487	4.875	2023/9/16	1.14
9	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	2,650,000	8,743.33	231,698,298	8,650.37	229,234,964	5.625	2022/1/26	1.12
10	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	2,400,000	9,383.08	225,194,112	9,273.72	222,569,472	6.875	2021/4/22	1.09
11	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,930,000	11,291.52	217,926,516	11,302.46	218,137,581	4.875	2021/1/22	1.07
12	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000	10,505.39	210,107,900	10,762.39	215,247,820	4.6	2048/2/10	1.05
13	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,900,000	11,223.07	213,238,330	11,305.09	214,796,710	4	2024/2/26	1.05
14	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	11,020.86	209,396,404	11,081.01	210,539,216	4.625	2028/1/13	1.03
15	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	10,817.07	205,524,349	10,926.54	207,604,266	5.625	2047/2/21	1.02
16	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000	9,707.78	203,863,565	9,825.33	206,332,137	6	2027/3/25	1.01
17	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,800,000	11,164.54	200,961,729	11,347.27	204,250,862	3.7	2042/2/2	1.00
18	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,400,000	13,984.41	195,781,740	14,326.16	200,566,240	5.625	2050/11/18	0.98
19	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	1,800,000	10,877.06	195,787,187	10,989.22	197,806,059	3	2028/2/1	0.97
20	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,700,000	11,628.33	197,681,739	11,603.29	197,255,979	4.75	2026/1/8	0.97
21	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,800,000	10,673.64	192,125,616	10,908.66	196,355,880	4.75	2044/3/8	0.96
22	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000	11,291.42	191,954,140	11,373.44	193,348,480	3.75	2025/3/16	0.95
23	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,400,000	7,828.16	187,875,930	8,014.44	192,346,742	4.875	2043/4/16	0.94
24	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,800,000	10,618.96	191,141,376	10,668.17	192,027,192	2.625	2023/1/5	0.94
25	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,650,000	11,245.21	185,546,054	11,307.98	186,581,803	4	2023/10/2	0.91
26	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000	10,214.22	183,856,032	10,313.79	185,648,333	4.3	2028/10/12	0.91
27	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000	11,284.80	180,556,860	11,474.63	183,594,093	4.75	2026/5/27	0.90
28	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	10,463.34	177,876,883	10,668.17	181,359,015	4.6	2046/1/23	0.89
29	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000	10,502.51	178,542,820	10,634.99	180,794,958	6.25	2022/9/26	0.89
30	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,600,000	11,268.43	180,294,920	11,284.85	180,557,735	4.125	2025/1/15	0.88

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.39

合 計	98.39
-----	-------

## (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	11,465.74	22,931,480	11,400.78	22,801,560	6.25	2022/2/15	1.11
2	アメリカ	社債券	ALTICE SA	200,000	11,045.36	22,090,720	11,154.72	22,309,440	7.75	2022/5/15	1.09
3	アメリカ	社債券	ALTICE FINANCING SA	200,000	11,154.72	22,309,440	11,141.05	22,282,100	6.625	2023/2/15	1.09
4	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	11,260.69	22,521,380	11,141.05	22,282,100	5.5	2026/5/15	1.09
5	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	11,194.41	22,388,835	11,127.38	22,254,760	5.375	2023/7/15	1.08
6	アメリカ	社債券	ALTICE FRANCE SA	200,000	11,260.79	22,521,598	11,018.02	22,036,040	8.125	2027/2/1	1.07
7	アメリカ	社債券	ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000	11,018.02	22,036,040	10,922.33	21,844,660	4.25	2022/9/15	1.06
8	アメリカ	社債券	BARCLAYS PLC	200,000	10,991.29	21,982,583	10,861.17	21,722,343	4.836	2028/5/9	1.06
9	アメリカ	社債券	WIND TRE SPA	200,000	10,099.39	20,198,792	10,459.19	20,918,381	5	2026/1/20	1.02
10	アメリカ	社債券	INTESA SANPAOLO SPA	200,000	10,765.94	21,531,897	10,402.46	20,804,933	5.71	2026/1/15	1.01
11	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	160,000	10,894.99	17,431,984	10,865.57	17,384,915	5	2028/2/1	0.85
12	アメリカ	社債券	T-MOBILE USA INC	150,000	11,428.12	17,142,180	11,400.78	17,101,170	6	2024/4/15	0.83
13	アメリカ	社債券	NOVELIS CORP	150,000	11,387.11	17,080,665	11,264.08	16,896,120	6.25	2024/8/15	0.82
14	アメリカ	社債券	NETFLIX INC	150,000	10,771.96	16,157,940	10,758.29	16,137,435	4.375	2026/11/15	0.79
15	アメリカ	社債券	TENET HEALTHCARE CORP	120,000	11,127.38	13,352,856	10,990.68	13,188,816	6.75	2023/6/15	0.64
16	アメリカ	社債券	1011778 BC / NEW RED FIN	120,000	10,882.41	13,058,896	10,843.59	13,012,309	4.25	2024/5/15	0.63
17	アメリカ	社債券	CHENIERE CORP CHRISTI HD	100,000	11,851.89	11,851,890	11,783.54	11,783,540	5.875	2025/3/31	0.57
18	アメリカ	社債券	ADT CORP	100,000	11,551.15	11,551,150	11,510.14	11,510,140	6.25	2021/10/15	0.56
19	アメリカ	社債券	MSCI INC	100,000	11,510.14	11,510,140	11,428.12	11,428,120	5.75	2025/8/15	0.55
20	アメリカ	社債券	SIRIUS XM RADIO INC	100,000	11,378.36	11,378,361	11,318.76	11,318,760	6	2024/7/15	0.55
21	アメリカ	社債券	GRAY TELEVISION INC	100,000	11,346.10	11,346,100	11,291.42	11,291,420	5.875	2026/7/15	0.55
22	アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC	100,000	11,400.78	11,400,780	11,243.57	11,243,575	6.25	2026/3/15	0.55
23	アメリカ	社債券	UNITED RENTALS NORTH AM	100,000	11,139.30	11,139,300	11,154.72	11,154,720	4.625	2023/7/15	0.54
24	アメリカ	社債券	INMARSAT FINANCE PLC	100,000	11,072.70	11,072,700	11,059.03	11,059,030	4.875	2022/5/15	0.54
25	アメリカ	社債券	VIDEOTRON LTD / LTEE	100,000	11,158.00	11,158,000	11,045.36	11,045,360	5.125	2027/4/15	0.54
26	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	100,000	11,004.35	11,004,350	10,936.00	10,936,000	4	2023/3/1	0.53
27	アメリカ	社債券	BAUSCH HEALTH COS INC	100,000	10,908.66	10,908,660	10,744.62	10,744,620	6.125	2025/4/15	0.52
28	アメリカ	社債券	BOMBARDIER INC	100,000	11,291.42	11,291,420	10,717.28	10,717,280	7.875	2027/4/15	0.52
29	アメリカ	社債券	CALPINE CORP	100,000	10,894.99	10,894,990	10,676.27	10,676,270	5.5	2024/2/1	0.52
30	アメリカ	社債券	STAPLES INC	100,000	10,754.68	10,754,681	10,648.93	10,648,930	7.5	2026/4/15	0.52

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	97.32
合計	97.32

## (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	3,990	635,043	2,533,825,480	742,000	2,960,580,000	7.27
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,121	577,876	2,381,428,355	645,000	2,658,045,000	6.52
3	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,821	153,911	1,973,300,238	168,400	2,159,056,400	5.30
4	日本	投資証券	日本リートファンド投資法人 投資証券	7,788	203,923	1,588,157,541	218,600	1,702,456,800	4.18
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,088	171,717	1,560,571,911	179,000	1,626,752,000	3.99
6	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	8,210	175,195	1,438,353,248	194,600	1,597,666,000	3.92
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,529	259,770	1,436,270,154	256,600	1,418,741,400	3.48
8	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,527	230,726	1,275,225,476	236,100	1,304,924,700	3.20
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	4,016	287,464	1,154,455,504	314,000	1,261,024,000	3.09
10	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	10,211	118,257	1,207,531,212	120,800	1,233,488,800	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	2,608	412,108	1,074,778,107	464,000	1,210,112,000	2.97
12	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,264	81,549	1,081,678,138	88,100	1,168,558,400	2.87
13	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,165	477,383	1,033,534,498	469,500	1,016,467,500	2.49
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	1,275	685,773	874,361,314	747,000	952,425,000	2.33
15	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	10,632	71,451	759,671,178	81,100	862,255,200	2.11
16	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	14,216	49,772	707,566,144	57,800	821,684,800	2.01
17	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,369	500,537	685,235,153	573,000	784,437,000	1.92
18	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	951	654,846	622,759,192	751,000	714,201,000	1.75
19	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,726	139,503	659,292,501	149,500	706,537,000	1.73
20	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,057	120,230	608,006,852	130,100	657,915,700	1.61
21	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,692	223,132	600,672,663	241,800	650,925,600	1.59
22	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,402	449,135	629,687,284	458,500	642,817,000	1.57
23	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,331	168,125	560,026,706	179,800	598,913,800	1.47
24	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,690	145,597	537,254,701	161,200	594,828,000	1.46
25	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,230	123,778	523,584,662	136,000	575,280,000	1.41

26	日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,330	336,106	447,022,283	424,500	564,585,000	1.38
27	日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	3,918	111,208	435,713,649	138,500	542,643,000	1.33
28	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,709	268,433	458,752,646	297,500	508,427,500	1.24
29	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,945	160,562	472,856,768	172,500	508,012,500	1.24
30	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,763	151,654	419,020,775	177,100	489,327,300	1.20

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.41
合計	96.41

## (参考) 海外REITインデックス マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	59,280	18,362.73	1,088,542,830	17,831.14	1,057,030,453	4.19
2	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	120,970	7,209.90	872,182,092	8,018.27	969,970,751	3.85
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	28,810	23,562.17	678,826,267	25,509.31	734,923,325	2.91
4	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	73,910	6,696.43	494,933,647	8,831.91	652,766,734	2.59
5	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	70,820	7,164.62	507,399,014	8,291.67	587,216,438	2.33
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,520	18,785.55	498,192,859	22,024.01	584,076,756	2.31
7	香港	投資証券	LINK REIT	405,100	1,044.84	423,265,878	1,328.48	538,168,058	2.13
8	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	39,840	12,091.59	481,729,264	12,873.85	512,894,551	2.03
9	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	68,400	6,112.82	418,116,963	7,016.53	479,931,172	1.90
10	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	58,390	6,134.96	358,220,666	7,569.89	442,006,414	1.75
11	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26,450	22,429.70	593,265,709	16,428.81	434,542,104	1.72
12	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	29,700	13,480.12	400,359,732	14,305.38	424,869,834	1.68
13	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,630	26,716.68	337,431,691	31,217.90	394,282,148	1.56
14	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,510	13,942.22	299,897,239	15,916.25	342,358,632	1.35
15	アメリカ	投資証券	HCP INC	91,200	2,762.05	251,899,824	3,433.90	313,172,045	1.24
16	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	307,100	741.71	227,779,555	1,002.90	307,992,310	1.22
17	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,021,000	309.46	315,959,257	286.22	292,231,437	1.16
18	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	32,440	7,498.46	243,250,126	8,976.26	291,190,160	1.15
19	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	141,400	2,334.80	330,140,890	2,012.22	284,528,474	1.13
20	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	24,310	10,607.80	257,875,702	11,554.97	280,901,505	1.11
21	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	21,750	10,672.90	232,135,792	12,394.86	269,588,257	1.07
22	アメリカ	投資証券	UDR INC	52,700	4,191.34	220,884,125	4,835.89	254,851,888	1.01
23	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	33,300	7,758.89	258,371,119	7,266.97	241,990,168	0.96
24	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	32,100	6,677.04	214,333,089	7,141.20	229,232,777	0.91
25	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	68,700	3,128.24	214,910,554	3,280.80	225,390,960	0.89
26	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	16,580	10,852.20	179,929,588	13,510.33	224,001,344	0.88
27	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,190	10,300.12	177,059,198	12,901.19	221,771,614	0.88
28	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	18,560	10,060.50	186,723,019	11,176.59	207,437,548	0.82

29	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,280	13,349.98	190,637,722	14,285.69	203,999,750	0.81
30	イギリス	投資証券	SEGREO PLC	208,300	912.35	190,042,924	955.64	199,060,620	0.79

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.07
合計	99.07

## (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	13,860	19,750.59	273,743,186	17,831.14	247,139,711	4.03
2	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	28,280	7,360.24	208,147,762	8,018.27	226,756,823	3.70
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	6,750	23,364.82	157,712,553	25,509.31	172,187,867	2.81
4	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	17,260	7,515.64	129,720,030	8,831.91	152,438,829	2.49
5	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	16,530	7,473.85	123,542,802	8,291.67	137,061,391	2.23
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,190	20,197.67	125,023,601	22,024.01	136,328,624	2.22
7	香港	投資証券	LINK REIT	94,000	1,083.01	101,802,963	1,328.48	124,877,308	2.03
8	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,320	13,145.33	122,514,532	12,873.85	119,984,368	1.96
9	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	15,990	6,560.29	104,899,103	7,016.53	112,194,436	1.83
10	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	13,680	6,651.77	90,996,320	7,569.89	103,556,221	1.69
11	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,140	20,489.87	125,807,825	16,428.81	100,872,912	1.64
12	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	6,960	14,157.42	98,535,697	14,305.38	99,565,456	1.62
13	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,961	27,370.17	81,043,092	31,217.90	92,436,218	1.51
14	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,100	14,011.51	71,458,733	15,916.25	81,172,897	1.32
15	アメリカ	投資証券	HCP INC	21,200	2,976.18	63,095,217	3,433.90	72,798,765	1.18
16	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	72,500	824.14	59,750,818	1,002.90	72,710,656	1.18
17	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	7,580	7,492.83	56,795,655	8,976.26	68,040,118	1.11
18	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	236,500	309.14	73,112,091	286.22	67,691,219	1.10
19	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	32,900	2,233.91	73,495,900	2,012.22	66,202,170	1.08
20	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,650	10,147.20	57,331,691	11,554.97	65,285,623	1.06
21	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,060	11,234.17	56,844,949	12,394.86	62,718,004	1.02
22	アメリカ	投資証券	UDR INC	12,250	4,421.76	54,166,642	4,835.89	59,239,765	0.96
23	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	7,700	8,078.54	62,204,822	7,266.97	55,955,684	0.91
24	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	7,450	7,108.55	52,958,725	7,141.20	53,202,000	0.86
25	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	15,980	3,100.80	49,550,926	3,280.80	52,427,184	0.85
26	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	3,840	11,221.00	43,088,644	13,510.33	51,879,684	0.84
27	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,000	10,677.60	42,710,401	12,901.19	51,604,797	0.84
28	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,310	10,335.78	44,547,213	11,176.59	48,171,112	0.78
29	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,310	14,144.85	46,819,476	14,285.69	47,285,656	0.77
30	オーストラリア	投資証券	DEXUS	48,100	836.32	40,227,322	963.63	46,350,853	0.75

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	95.36
合 計	95.36

**【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。

インデックス・ブレンド(タイプ )

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド(タイプ )

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド(タイプ )

該当事項はありません。

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。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレンド（タイプ ）

該当事項はありません。

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(2019年06月限)	買建	674	日本円	10,421,132,390	10,150,440,000	2.62

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴマーカンタイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2019年06月限)	買建	398	米ドル	56,524,250	6,181,491,980	55,530,950	6,072,864,692	1.11
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2019年06月限)	買建	21	カナダドル	4,094,420	330,829,136	4,051,740	327,380,592	0.05
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2019年06月限)	買建	255	ユーロ	8,525,000	1,037,833,499	8,448,150	1,028,477,774	0.18
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200株価指数先物(2019年06月限)	買建	19	豪ドル	3,019,500	228,032,640	3,036,675	229,329,696	0.04
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2019年06月限)	買建	56	英ポンド	4,056,320	559,042,024	4,039,280	556,693,561	0.10
	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2019年06月限)	買建	28	スイスフラン	2,680,200	291,230,538	2,674,000	290,556,840	0.05

(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(2019年06月限)	買建	43	米ドル	6,101,112.5	667,217,663	5,999,575	656,113,522	1.42
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2019年06月限)	買建	2	カナダドル	389,300	31,455,440	385,880	31,179,104	0.06
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2019年06月限)	買建	28	ユーロ	927,530	112,917,502	927,640	112,930,892	0.24
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SPI200株価指数先物(2019年06月限)	買建	1	豪ドル	156,450	11,815,104	159,825	12,069,984	0.02
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2019年06月限)	買建	6	英ポンド	430,420	59,320,485	432,780	59,645,738	0.12



	スイス	ユーレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2019年06月限)	買建	2	スイスフラン	188,200	20,449,812	191,000	20,754,060	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(2019年06月限)	買建	230	米ドル	11,529,585	1,260,875,408	11,447,100	1,251,854,841	3.48

## (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	シカゴマーカンタイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2019年06月限)	買建	6	米ドル	866,087.5	94,715,329	837,150	91,550,724	0.67

## (参考)国内債券NOMURA - B P I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(2019年06月限)	買建	477	日本円	878,550,786	914,409,000	2.24

（参考）海外R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリ カ	シカゴ ボード オ ブ トレー ド	ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2019年06月限)	買建	58	米ドル	1,984,450	217,019,467	1,969,100	215,340,776	0.85

（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(2019年06月限)	買建	43	米ドル	1,459,260	159,584,684	1,459,850	159,649,196	2.60

（3）【運用実績】

【純資産の推移】

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019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
第3計算期間 (2019年 4月22日)	163	163	1.0487	1.0487
2018年 5月末日	71		1.0248	
6月末日	67		1.0264	
7月末日	67		1.0320	
8月末日	71		1.0302	
9月末日	72		1.0353	
10月末日	75		1.0138	
11月末日	80		1.0227	
12月末日	151		1.0056	
2019年 1月末日	157		1.0237	
2月末日	173		1.0361	
3月末日	168		1.0455	
4月末日	163		1.0488	
5月末日	163		1.0389	

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019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
第3計算期間 (2019年 4月22日)	90	90	1.0690	1.0690
2018年 5月末日	92		1.0411	
6月末日	59		1.0427	
7月末日	50		1.0534	
8月末日	54		1.0527	
9月末日	60		1.0631	
10月末日	62		1.0296	
11月末日	64		1.0415	
12月末日	61		1.0080	
2019年 1月末日	69		1.0336	
2月末日	84		1.0517	

3月末日	89		1.0612	
4月末日	84		1.0689	
5月末日	84		1.0497	

### インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019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
第3計算期間	(2019年 4月22日)	215	215	1.0904	1.0904
	2018年 5月末日	184		1.0552	
	6月末日	177		1.0570	
	7月末日	178		1.0716	
	8月末日	184		1.0730	
	9月末日	186		1.0877	
	10月末日	178		1.0421	
	11月末日	181		1.0572	
	12月末日	175		1.0102	
	2019年 1月末日	178		1.0435	
	2月末日	198		1.0676	
	3月末日	207		1.0771	
	4月末日	215		1.0897	
	5月末日	216		1.0604	

### インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019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
第3計算期間	(2019年 4月22日)	51	51	1.1052	1.1052
	2018年 5月末日	31		1.0666	
	6月末日	31		1.0678	
	7月末日	32		1.0858	
	8月末日	33		1.0884	
	9月末日	41		1.1059	
	10月末日	39		1.0515	
	11月末日	41		1.0689	

12月末日	42	1.0114
2019年 1月末日	45	1.0505
2月末日	48	1.0789
3月末日	49	1.0884
4月末日	52	1.1040
5月末日	54	1.0674

### インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019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
第3計算期間 (2019年 4月22日)	194	194	1.1290	1.1290
2018年 5月末日	188		1.0830	
6月末日	189		1.0849	
7月末日	195		1.1080	
8月末日	196		1.1135	
9月末日	199		1.1374	
10月末日	196		1.0678	
11月末日	195		1.0895	
12月末日	183		1.0133	
2019年 1月末日	195		1.0603	
2月末日	198		1.0961	
3月末日	209		1.1053	
4月末日	191		1.1273	
5月末日	194		1.0777	

### 【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
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22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
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22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
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22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
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22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
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22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%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22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	4.0%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	2.8%

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

#### 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	0.1%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	5.5%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	3.5%

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	0.1%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	6.6%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	3.8%

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

#### 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	0.4%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	8.6%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	4.3%

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・ブレンド（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
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	139,749,676	50,154,666	155,691,236

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
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	64,162,109	55,040,537	84,967,908

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
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	90,227,074	65,793,755	197,383,960

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
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	19,627,025	2,057,321	46,836,233

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
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	119,681,763	53,143,123	172,358,340

本邦外における設定及び解約の実績はありません。



## 参考情報



## 運用実績（2019年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

2019年4月	0 円
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

2019年4月	0 円
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

2019年4月	0 円
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

2019年4月	0 円
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

2019年4月	0 円
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	6.3	9.8	11.8	13.3	17.1
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	3.9	8.8	15.1	19.3	26.7
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	4.9	6.4	5.9	4.9	3.9
新興国株式マザーファンド	2.0	2.5	4.0	5.5	6.9
米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	3.4	3.9	5.4	6.4	7.7
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	55.6	43.2	31.2	22.2	9.5
外国債券マザーファンド	4.5	4.5	6.0	6.0	6.5
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	9.6	7.6	5.6	4.1	2.0
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	3.0	4.0	4.0	4.5	2.5
米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1.5	1.5	2.0	2.0	2.5
J-REITインデックス マザーファンド	2.5	3.0	3.0	4.0	5.0
海外REITインデックス マザーファンド	2.4	4.4	5.4	7.3	7.7
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	0.3	0.4	0.4	0.5
2	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.1	0.2	0.2	0.2	0.3
3	ソニー	電気機器	0.1	0.2	0.2	0.2	0.3
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.1	0.1	0.2	0.2	0.3
5	日本電信電話	情報・通信業	0.1	0.1	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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.1	0.2	0.4	0.5	0.7
2	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.1	0.2	0.3	0.4	0.6
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	0.6
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.0	0.1	0.2	0.2	0.3
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.0	0.1	0.1	0.2	0.3

・「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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.1	0.2	0.1	0.1	0.1
2	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	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	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.1	0.1	0.1	0.0
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.0	0.1	0.1	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	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.1	0.2	0.2	0.3
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	0.1	0.1	0.2	0.2	0.3
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2
4	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2
5	NASPERS LTD-N SHS	インターネット販売・通信販売	0.0	0.0	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	CINCINNATI FINANCIAL CORP	保険	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2
2	MEDTRONIC PLC	ヘルスケア機器・用品	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2
3	SYSCO CORP	食品・生活必需品小売り	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
4	AFLAC INC	保険	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
5	CHUBB LTD	保険	0.1	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（10年）第350回	国債証券	0.7	0.5	0.4	0.3	0.1
2	国庫債券 利付（10年）第334回	国債証券	0.7	0.5	0.4	0.3	0.1
3	国庫債券 利付（5年）第126回	国債証券	0.6	0.5	0.4	0.3	0.1
4	国庫債券 利付（5年）第125回	国債証券	0.6	0.5	0.3	0.2	0.1
5	国庫債券 利付（5年）第127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	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
3	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1

## ・「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	0.1	0.1	0.1	0.0	0.0
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.0	0.0
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	0.0
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	0.0
5	FRANCE (GOVT OF)	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	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	0.1
2	REPUBLIC OF ARGENTINA	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.0
3	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.0	0.1	0.1	0.1	0.0
4	UNITED MEXICAN STATES	国債証券	0.0	0.1	0.1	0.1	0.0
5	TURKEY GLOBAL	国債証券	0.0	0.0	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	ALTICE SA	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3	ALTICE FINANCING SA	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
4	CSC HOLDINGS LLC	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
5	CSC HOLDINGS LLC	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

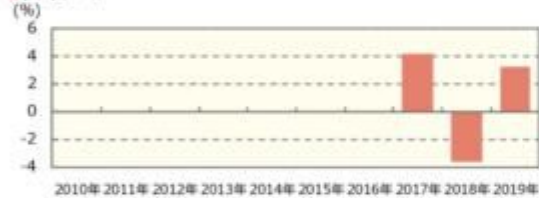
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)				
			タイプ I	タイプ II	タイプ III	タイプ IV	タイプ V
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.2	0.2	0.2	0.3	0.4
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.2	0.2	0.2	0.3	0.3
3	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.2	0.3
4	日本リートファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2

## ・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じた投資銘柄

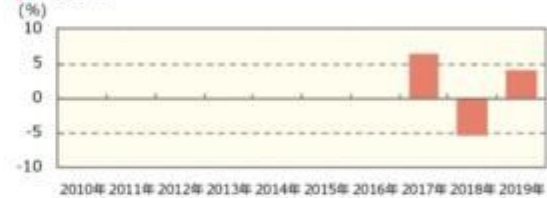
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)				
			タイプ I	タイプ II	タイプ III	タイプ IV	タイプ V
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.3	0.3
2	PROLOGIS INC	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.3	0.3
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
4	WELLTOWER INC	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2
5	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2

## ■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)

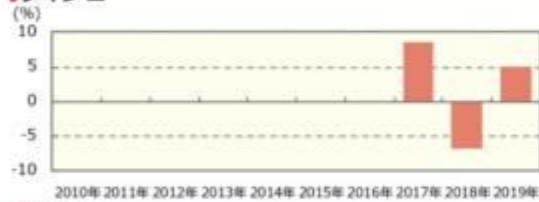
## ■ タイプ I



## ■ タイプ II



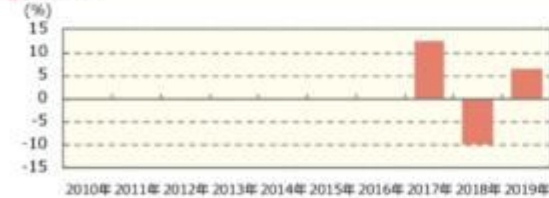
## ■ タイプ III



## ■ 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。
- ・2019年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。●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。
- ・ 取得申込みの受付けについては、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け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け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 <sup>1</sup> 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 <sup>1</sup> における以下のいずれかの価額で評価します。 <sup>2</sup> 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 <sup>1</sup> 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( )の変更事項にあっ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、併合事項にあっ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っても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

## (e) 公告

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

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

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

## (f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

- ( ) 受託者は、委託者の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託者がその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託者または受益者は、裁判所に受託者の解任を申立てることができます。受託者が辞任した場合、または裁判所が受託者を解任した場合、委託者は、上記「(d)信託約款の変更等」にしたがい、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3期計算期間(2018年4月24日から2019年4月22日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【インデックス・ブレード（タイプ ）】

## （ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 (2018年 4月23日現在)	第3期 (2019年 4月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	628,906	1,493,713
親投資信託受益証券	67,263,135	162,279,984
派生商品評価勘定	310	-
未収入金	29,306	-
流動資産合計	67,921,657	163,773,697
資産合計	67,921,657	163,773,697
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	67,931	42,843
未払解約金	-	100,643
未払受託者報酬	9,786	22,317
未払委託者報酬	146,711	334,648
未払利息	1	3
その他未払費用	911	2,167
流動負債合計	225,340	502,621
負債合計	225,340	502,621
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	66,096,226	155,691,236
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,600,091	7,579,840
（分配準備積立金）	481,093	3,780,655
元本等合計	67,696,317	163,271,076
純資産合計	67,696,317	163,271,076
負債純資産合計	67,921,657	163,773,697

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	自	2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		118,210		5,171,849
為替差損益		68,471		160,983
営業収益合計		186,681		5,010,866
営業費用				
支払利息		297		1,015
受託者報酬		12,156		33,686
委託者報酬		182,135		505,109
その他費用		14,110		14,047
営業費用合計		208,698		553,857
営業利益又は営業損失（ ）		22,017		4,457,009
経常利益又は経常損失（ ）		22,017		4,457,009
当期純利益又は当期純損失（ ）		22,017		4,457,009
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（ ）		228,033		544,071
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		308		1,600,091
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,260,601		3,202,067
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		3,202,067
剰余金減少額又は欠損金増加額		410,768		1,135,256
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		1,135,256
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,600,091		7,579,840

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年4月24日から2019年4月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年4月23日現在	第3期 2019年4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 66,096,226口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 155,691,236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 1.0242円 (10,000口当たり純資産額) (10,242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 1.0487円 (10,000口当たり純資産額) (10,487円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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>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	<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>1,661,159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>1,800,724円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,799,185円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>318,772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>7,579,840円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>155,691,236口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,661,159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	1,800,724円	収益調整金額	C	3,799,185円	分配準備積立金額	D	318,772円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,579,840円	当ファンドの期末残存口数	F	155,691,236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																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	1,661,159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	1,800,724円																																									
収益調整金額	C	3,799,185円																																									
分配準備積立金額	D	318,772円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,579,840円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	155,691,236口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	242円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	486円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	0円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項



第2期 2018年 4月23日現在	第3期 2019年 4月22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</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2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
期首元本額 1,849,093円	期首元本額 66,096,226円
期中追加設定元本額 84,588,270円	期中追加設定元本額 139,749,676円
期中一部解約元本額 20,341,137円	期中一部解約元本額 50,154,666円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	51,937	4,597,685

合計	51,937	4,597,685
----	--------	-----------

## 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2期(2018年 4月23日現在)				第3期(2019年 4月22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	3,600,231	-	3,667,852	67,621	4,330,645	-	4,373,488	42,843
米ドル	3,600,231	-	3,667,852	67,621	4,330,645	-	4,373,488	42,843
合計	3,600,231	-	3,667,852	67,621	4,330,645	-	4,373,488	42,843

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2019年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	6,579,955	10,610,835	

親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	3,165,886	7,266,341	
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,311,355	6,529,346	
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	63,994,344	85,112,477	
	J-REITインデックスマザーファンド	1,794,361	4,087,016	
	海外REITインデックスマザーファンド	1,637,043	3,977,359	
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	3,797,811	7,338,889	
	新興国株式マザーファンド	3,098,997	4,082,308	
	新興国債券マザーファンド	2,566,456	4,853,938	
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	17,748,122	20,279,004	
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1,945,861	2,437,580	
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	4,475,829	5,704,891	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：99.4%	113,116,020	162,279,984
合計			162,279,984	

(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2期 (2018年 4月23日現在)	第3期 (2019年 4月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	626,620	847,909
親投資信託受益証券	78,439,331	90,293,286
派生商品評価勘定	2,849	-
未収入金	23,582	-
流動資産合計	79,092,382	91,141,195
資産合計	79,092,382	91,141,195
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	72,270	43,396
未払解約金	-	77,840
未払受託者報酬	7,633	11,532
未払委託者報酬	116,875	176,806
未払利息	1	1
その他未払費用	709	1,094
流動負債合計	197,488	310,669
負債合計	197,488	310,669
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	75,846,336	84,967,908
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,048,558	5,862,618
（分配準備積立金）	394,440	2,065,074
元本等合計	78,894,894	90,830,526
純資産合計	78,894,894	90,830,526
負債純資産合計	79,092,382	91,141,195

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2017年 4月25日	自	2018年 4月24日
	至	2018年 4月23日	至	2019年 4月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,221		2,902,955
為替差損益		86,796		211,769
営業収益合計		84,575		2,691,186
営業費用				
支払利息		283		761
受託者報酬		8,816		22,229
委託者報酬		135,004		340,903
その他費用		13,824		12,908
営業費用合計		157,927		376,801
営業利益又は営業損失（ ）		73,352		2,314,385
経常利益又は経常損失（ ）		73,352		2,314,385
当期純利益又は当期純損失（ ）		73,352		2,314,385
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		184,147
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		206		3,048,558
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,501,168		2,932,806
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		2,932,806
剰余金減少額又は欠損金増加額		248,112		2,248,984
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		2,248,984
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		3,048,558		5,862,618

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年4月24日から2019年4月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年4月23日現在	第3期 2019年4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 75,846,336口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 84,967,908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 1.0402円 (10,000口当たり純資産額) (10,402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 1.0690円 (10,000口当たり純資産額) (10,690円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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>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> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,654,118円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>4,028円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>3,048,558円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>75,846,336口</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	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	<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>1,206,857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>660,635円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,797,544円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>197,582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>5,862,618円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>84,967,908口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,206,857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	660,635円	収益調整金額	C	3,797,544円	分配準備積立金額	D	197,582円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,862,618円	当ファンドの期末残存口数	F	84,967,908口
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	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																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	1,206,857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	660,635円																																									
収益調整金額	C	3,797,544円																																									
分配準備積立金額	D	197,582円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,862,618円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	84,967,908口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	401円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	689円
10,000口当たり分配金額	H	0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	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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>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>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年 4月23日現在	第3期 2019年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
期首元本額 1,140,737円	期首元本額 75,846,336円
期中追加設定元本額 81,863,323円	期中追加設定元本額 64,162,109円
期中一部解約元本額 7,157,724円	期中一部解約元本額 55,040,537円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	48,015	2,594,285



合計	48,015	2,594,285
----	--------	-----------

### 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2期(2018年 4月23日現在)				第3期(2019年 4月22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	5,287,628	-	5,357,049	69,421	3,195,499	-	3,238,895	43,396
米ドル	5,287,628	-	5,357,049	69,421	3,195,499	-	3,238,895	43,396
合計	5,287,628	-	5,357,049	69,421	3,195,499	-	3,238,895	43,396

#### (注) 時価の算定方法

##### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券(2019年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	5,631,908	9,082,014	

親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,758,716	4,036,604	
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,900,538	8,193,729	
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	27,389,911	36,428,581	
	J-REITインデックスマザーファンド	1,190,657	2,711,959	
	海外REITインデックスマザーファンド	1,648,167	4,004,386	
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	2,606,282	5,036,379	
	新興国株式マザーファンド	2,410,845	3,175,806	
	新興国債券マザーファンド	1,896,067	3,586,031	
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	7,853,301	8,973,181	
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1,092,684	1,368,805	
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	2,899,585	3,695,811	
小計	銘柄数：12 組入時価比率：99.4%	59,278,661	90,293,286	100.0%
合計			90,293,286	

(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2期 (2018年 4月23日現在)	第3期 (2019年 4月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,735,202	1,887,886
親投資信託受益証券	181,164,275	213,934,228
派生商品評価勘定	3,843	-
未収入金	93,468	-
流動資産合計	182,996,788	215,822,114
資産合計	182,996,788	215,822,114
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	127,514	78,979
未払解約金	301,462	2,548
未払受託者報酬	22,942	30,221
未払委託者報酬	359,321	473,413
未払利息	3	4
その他未払費用	2,229	2,959
流動負債合計	813,471	588,124
負債合計	813,471	588,124
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	172,950,641	197,383,960
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,232,676	17,850,030
（分配準備積立金）	1,422,353	5,817,435
元本等合計	182,183,317	215,233,990
純資産合計	182,183,317	215,233,990
負債純資産合計	182,996,788	215,822,114

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2017年 4月25日	自	2018年 4月24日
	至	2018年 4月23日	至	2019年 4月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		764,890		7,875,953
為替差損益		258,820		460,674
営業収益合計		1,023,710		7,415,279
営業費用				
支払利息		1,139		1,591
受託者報酬		28,057		59,808
委託者報酬		439,489		936,873
その他費用		15,694		16,665
営業費用合計		484,379		1,014,937
営業利益又は営業損失（ ）		539,331		6,400,342
経常利益又は経常損失（ ）		539,331		6,400,342
当期純利益又は当期純損失（ ）		539,331		6,400,342
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（ ）		1,305,039		95,806
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		3,623		9,232,676
剰余金増加額又は欠損金減少額		12,653,873		5,910,806
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		12,653,873		5,910,806
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,651,866		3,597,988
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		3,597,988
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		9,232,676		17,850,030

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年4月24日から2019年4月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第2期 2018年4月23日現在	第3期 2019年4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 172,950,641口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 197,383,960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 1.0534円 (10,000口当たり純資産額) (10,534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 1.0904円 (10,000口当たり純資産額) (10,904円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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>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> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>7,810,323円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>5,644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>9,232,676円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>172,950,641口</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	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	<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>3,597,172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>1,200,269円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>12,032,595円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,019,994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>17,850,030円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>197,383,960口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,597,172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	1,200,269円	収益調整金額	C	12,032,595円	分配準備積立金額	D	1,019,994円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,850,030円	当ファンドの期末残存口数	F	197,383,960口
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	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																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	3,597,172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	1,200,269円																																									
収益調整金額	C	12,032,595円																																									
分配準備積立金額	D	1,019,994円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,850,030円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	197,383,960口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	533円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	904円
10,000口当たり分配金額	H	0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	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年 4月23日現在	第3期 2019年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
期首元本額 2,604,508円	期首元本額 172,950,641円
期中追加設定元本額 222,742,777円	期中追加設定元本額 90,227,074円
期中一部解約元本額 52,396,644円	期中一部解約元本額 65,793,755円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	122,361	7,151,169

合計	122,361	7,151,169
----	---------	-----------

### 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2期(2018年 4月23日現在)				第3期(2019年 4月22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	11,273,540	-	11,397,211	123,671	7,617,651	-	7,696,630	78,979
米ドル	11,273,540	-	11,397,211	123,671	7,617,651	-	7,696,630	78,979
合計	11,273,540	-	11,397,211	123,671	7,617,651	-	7,696,630	78,979

#### (注) 時価の算定方法

##### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

#### (4) 【附属明細表】

##### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券(2019年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	15,889,205	25,622,931	



親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	5,581,669	12,811,046	
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	11,435,188	32,303,262	
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	47,355,859	62,983,292	
	J-REITインデックスマザーファンド	2,825,462	6,435,554	
	海外REITインデックスマザーファンド	4,771,088	11,591,835	
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	6,094,461	11,776,936	
	新興国株式マザーファンド	8,158,782	10,747,563	
	新興国債券マザーファンド	4,522,029	8,552,513	
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	13,082,918	14,948,542	
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	3,428,526	4,294,914	
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	9,309,462	11,865,840	
小計	銘柄数：12 組入時価比率：99.4%	132,454,649	213,934,228	100.0%
合計			213,934,228	

(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・ブレンド（タイプ ）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 (2018年 4月23日現在)	第3期 (2019年 4月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	288,343	456,065
親投資信託受益証券	30,935,771	51,446,390
派生商品評価勘定	938	-
未収入金	17,260	-
流動資産合計	31,242,312	51,902,455
資産合計	31,242,312	51,902,455
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	18,922	16,892
未払解約金	-	99
未払受託者報酬	3,930	7,231
未払委託者報酬	62,905	115,552
その他未払費用	328	660
流動負債合計	86,085	140,434
負債合計	86,085	140,434
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	29,266,529	46,836,233
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,889,698	4,925,788
（分配準備積立金）	278,678	1,370,908
元本等合計	31,156,227	51,762,021
純資産合計	31,156,227	51,762,021
負債純資産合計	31,242,312	51,902,455

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2017年 4月25日	自	2018年 4月24日
	至	2018年 4月23日	至	2019年 4月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		103,425		2,075,619
為替差損益		49,162		88,147
営業収益合計		54,263		1,987,472
営業費用				
支払利息		117		119
受託者報酬		5,191		12,685
委託者報酬		83,040		202,730
その他費用		13,431		11,918
営業費用合計		101,779		227,452
営業利益又は営業損失（ ）		156,042		1,760,020
経常利益又は経常損失（ ）		156,042		1,760,020
当期純利益又は当期純損失（ ）		156,042		1,760,020
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（ ）		223,080		29,859
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		4,360		1,889,698
剰余金増加額又は欠損金減少額		3,097,726		1,439,590
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,097,726		1,439,590
剰余金減少額又は欠損金増加額		824,546		133,661
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		133,661
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		1,889,698		4,925,788

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年 4月24日から2019年 4月22日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

第2期 2018年 4月23日現在	第3期 2019年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 29,266,529口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 46,836,233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 1.0646円 (10,000口当たり純資産額) (10,646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 1.1052円 (10,000口当たり純資産額) (11,052円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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>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> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,611,020円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>4,639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>1,889,698円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>29,266,529口</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	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	<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>842,121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>266,095円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,554,880円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>262,692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>4,925,788円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>46,836,233口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	842,121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	266,095円	収益調整金額	C	3,554,880円	分配準備積立金額	D	262,692円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,925,788円	当ファンドの期末残存口数	F	46,836,233口
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	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																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	842,121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	266,095円																																									
収益調整金額	C	3,554,880円																																									
分配準備積立金額	D	262,692円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,925,788円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	46,836,233口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	645円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	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。

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,051円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金額	$I=F \times H/10,000$	0円

## 2. その他費用

その他費用のうち10,800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2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年 4月23日現在	第3期 2019年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載して おります。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
期首元本額 3,904,654円	期首元本額 29,266,529円
期中追加設定元本額 40,547,035円	期中追加設定元本額 19,627,025円
期中一部解約元本額 15,185,160円	期中一部解約元本額 2,057,321円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	235,466	2,087,372

合計	235,466	2,087,372
----	---------	-----------

## 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2期(2018年 4月23日現在)				第3期(2019年 4月22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	1,926,642	-	1,944,626	17,984	2,064,475	-	2,081,367	16,892
米ドル	1,926,642	-	1,944,626	17,984	2,064,475	-	2,081,367	16,892
合計	1,926,642	-	1,944,626	17,984	2,064,475	-	2,081,367	16,892

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2019年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	4,290,574	6,918,979	

親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,343,626	3,083,890	
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	3,372,467	9,526,882	
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	8,125,369	10,806,740	
	J-REITインデックスマザーファンド	910,959	2,074,891	
	海外REITインデックスマザーファンド	1,571,658	3,818,500	
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1,201,266	2,321,326	
	新興国株式マザーファンド	2,752,865	3,626,349	
	新興国債券マザーファンド	1,224,782	2,316,430	
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	2,255,278	2,576,880	
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	820,537	1,027,886	
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	2,626,422	3,347,637	
小計	銘柄数：12 組入時価比率：99.4%	30,495,803	51,446,390	100.0%
合計			51,446,390	

(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・ブレンド（タイプ ）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第2期 (2018年 4月23日現在)	第3期 (2019年 4月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,023,678	17,122,558
親投資信託受益証券	113,695,290	193,451,179
派生商品評価勘定	3,638	-
未収入金	20,435	-
流動資産合計	114,743,041	210,573,737
資産合計	114,743,041	210,573,737
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	41,001	20,191
未払解約金	1,962	15,407,795
未払受託者報酬	11,922	31,399
未払委託者報酬	194,635	512,830
未払利息	1	37
その他未払費用	1,129	3,083
流動負債合計	250,650	15,975,335
負債合計	250,650	15,975,335
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	105,819,700	172,358,340
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	8,672,691	22,240,062
（分配準備積立金）	793,208	7,030,269
元本等合計	114,492,391	194,598,402
純資産合計	114,492,391	194,598,402
負債純資産合計	114,743,041	210,573,737

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期		第3期	
	自	2017年 4月25日	自	2018年 4月24日
	至	2018年 4月23日	至	2019年 4月22日
<b>営業収益</b>				
有価証券売買等損益		1,045,460		10,000,889
為替差損益		78,753		217,735
営業収益合計		966,707		9,783,154
<b>営業費用</b>				
支払利息		348		1,459
受託者報酬		13,315		60,471
委託者報酬		217,417		987,659
その他費用		14,243		16,735
営業費用合計		245,323		1,066,324
営業利益又は営業損失（ ）		1,212,030		8,716,830
経常利益又は経常損失（ ）		1,212,030		8,716,830
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,212,030		8,716,830
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（ ）		87,486		769,962
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		8,222		8,672,691
剰余金増加額又は欠損金減少額		10,219,239		9,958,634
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		10,219,239		9,958,634
剰余金減少額又は欠損金増加額		238,810		4,338,131
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		238,810		4,338,131
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		8,672,691		22,240,062

## ( 3 ) 【注記表】

## ( 重要な会計方針に係る事項に関する注記 )

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年 4月24日から2019年 4月22日までとなっております。

## ( 貸借対照表に関する注記 )

第2期 2018年 4月23日現在	第3期 2019年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 105,819,700口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 172,358,340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 1.0820円 (10,000口当たり純資産額) (10,820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 1.1290円 (10,000口当たり純資産額) (11,290円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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>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> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>7,879,483円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>10,564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>8,672,691円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>105,819,700口</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	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	<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>4,158,390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>2,243,692円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>15,209,793円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>628,187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>22,240,062円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>172,358,340口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	4,158,390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	2,243,692円	収益調整金額	C	15,209,793円	分配準備積立金額	D	628,187円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	22,240,062円	当ファンドの期末残存口数	F	172,358,340口
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	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																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	4,158,390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	2,243,692円																																									
収益調整金額	C	15,209,793円																																									
分配準備積立金額	D	628,187円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	22,240,062円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	172,358,340口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	819円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,290円
10,000口当たり分配金額	H	0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	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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>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>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第2期 2018年 4月23日現在	第3期 2019年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
期首元本額 2,377,675円	期首元本額 105,819,700円
期中追加設定元本額 107,829,976円	期中追加設定元本額 119,681,763円
期中一部解約元本額 4,387,951円	期中一部解約元本額 53,143,123円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第2期 自 2017年 4月25日 至 2018年 4月23日	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	768,909	9,089,918

合計	768,909	9,089,918
----	---------	-----------

## 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2期(2018年 4月23日現在)				第3期(2019年 4月22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	4,092,946	-	4,130,309	37,363	4,362,608	-	4,382,799	20,191
米ドル	4,092,946	-	4,130,309	37,363	4,362,608	-	4,382,799	20,191
合計	4,092,946	-	4,130,309	37,363	4,362,608	-	4,382,799	20,191

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2019年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	20,924,512	33,742,868	

親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	5,477,220	12,571,315	
	外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド	17,846,344	50,414,137	
	国内債券NOMURA - BPI総合マザーファンド	13,836,377	18,402,381	
	J - REITインデックスマザーファンド	4,303,010	9,800,965	
	海外REITインデックスマザーファンド	6,228,674	15,133,186	
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	4,020,374	7,768,970	
	新興国株式マザーファンド	12,556,656	16,540,882	
	新興国債券マザーファンド	2,561,661	4,844,869	
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	3,395,731	3,879,962	
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	3,867,392	4,844,681	
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	12,166,141	15,506,963	
小計	銘柄数：12 組入時価比率：99.4%	107,184,092	193,451,179	100.0%
合計			193,451,179	

(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 - 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)

(2019年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	57,366,806,497
株式	392,661,834,200

(2019年 4月22日現在)

派生商品評価勘定	148,809,156
未収入金	1,125,593
未収配当金	4,302,663,515
未収利息	2,917,783
その他未収収益	91,584,827
差入委託証拠金	186,420,600
流動資産合計	454,762,162,171
資産合計	454,762,162,171
負債の部	
流動負債	
未払解約金	612,838,987
未払利息	124,886
有価証券貸借取引受入金	50,885,086,862
流動負債合計	51,498,050,735
負債合計	51,498,050,735
純資産の部	
元本等	
元本	250,072,065,186
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	153,192,046,250
元本等合計	403,264,111,436
純資産合計	403,264,111,436
負債純資産合計	454,762,162,171

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。

(貸借対照表に関する注記)



2019年 4月22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	1.6126円
(10,000口当たり純資産額)	(16,126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	
	48,646,113,990円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>    市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>    信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>    流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 4月22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</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 4月22日現在	
期首	2018年 4月24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	215,644,608,041円
同期中における追加設定元本額	57,859,963,157円
同期中における一部解約元本額	23,432,506,012円
期末元本額	250,072,065,186円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	165,674,600円
バランスセレクト50	391,876,790円
バランスセレクト70	492,956,112円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,162,676,859円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,693,202,436円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	7,734,268,775円
野村資産設計ファンド2015	53,249,348円
野村資産設計ファンド2020	62,786,754円
野村資産設計ファンド2025	97,183,620円
野村資産設計ファンド2030	111,560,526円
野村資産設計ファンド2035	85,440,255円
野村資産設計ファンド2040	194,188,143円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	98,599,241,099円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	2,894,824,440円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	7,553,459,212円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	2,106,082,616円
野村資産設計ファンド2045	28,362,993円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,918,710,363円
マイ・ロード	3,849,774,612円
ネクストコア	71,656,144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	927,067,707円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,787,242,324円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	346,662,487円
野村資産設計ファンド2050	46,682,373円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	14,356,865円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	5,791,173円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	4,108,619円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	2,558,361円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）	276,911,849円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）	249,853,426円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	6,579,955円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,631,908円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	15,889,205円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,290,574円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	20,924,512円
野村6資産均等バランス	463,055,442円

世界6資産分散ファンド	127,943,227円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	411,567,220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)	487,280,863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)	383,979,592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)	772,795,476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)	816,503,987円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	5,246,643円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	12,352,988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)	2,809,383円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,679,120,645円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	20,064,627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)	165,732,749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)	458,283,440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)	72,080,577円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	121,233,457円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	299,690,931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)	4,917,016,800円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	672,875,110円
ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	393,389,604円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	2,544,787,726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)	103,399,728円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,057,789,388円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,914,250円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	32,898,347円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	43,049,913円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	118,484,734円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,829,453,698円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	14,753,436,835円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	19,619,012,247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)	32,510,596,092円
マイバランスDC30	3,160,206,973円
マイバランスDC50	4,490,895,843円
マイバランスDC70	4,350,887,827円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,046,116,487円
野村DC運用戦略ファンド	565,674,716円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	25,487,601円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	617,193,400円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	355,049,203円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	254,108,621円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	2,806,362円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,972,763円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	19,857,619円
野村資産設計ファンド(DC)2030	1,626,849円
野村資産設計ファンド(DC)2040	1,582,583円
野村資産設計ファンド(DC)2050	2,898,714円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	133,526,017円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	81,480,498円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	29,408,368円

マイターゲット2060(確定拠出年金向け)

45,711,988円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	7,500	2,783.00	20,872,500	
		日本水産	229,900	763.00	175,413,700	貸付有価証券 1,400株
		マルハニチロ	33,200	3,580.00	118,856,000	貸付有価証券 100株
		カネコ種苗	7,000	1,353.00	9,471,000	貸付有価証券 800株
		サカタのタネ	28,000	3,500.00	98,000,000	貸付有価証券 18,700株
		ホクト	19,300	1,924.00	37,133,200	貸付有価証券 2,700株
		ホクリヨウ	3,100	595.00	1,844,500	貸付有価証券 200株
		住石ホールディングス	49,500	116.00	5,742,000	貸付有価証券 21,000株(3,600株)
		日鉄鉱業	5,300	4,590.00	24,327,000	
		三井松島ホールディングス	9,600	1,311.00	12,585,600	貸付有価証券 1,400株
		国際石油開発帝石	922,300	1,062.00	979,482,600	
		石油資源開発	33,000	2,492.00	82,236,000	貸付有価証券 5,400株
		K&Oエナジーグループ	11,200	1,634.00	18,300,800	貸付有価証券 1,400株
		ヒノキヤグループ	4,800	2,141.00	10,276,800	貸付有価証券 200株
		ショーボンドホールディングス	16,400	7,610.00	124,804,000	貸付有価証券 8,600株
ミライト・ホールディングス	64,700	1,607.00	103,972,900	貸付有価証券 43,300株(21,600株)		

タマホーム	11,100	1,061.00	11,777,100	貸付有価証券 7,400株
サンヨーホームズ	3,300	777.00	2,564,100	貸付有価証券 1,900株
日本アクア	5,500	524.00	2,882,000	貸付有価証券 2,000株
ファーストコーポレーション	7,000	923.00	6,461,000	貸付有価証券 900株
ベステラ	4,400	1,339.00	5,891,600	貸付有価証券 2,100株
TATERU	28,000	273.00	7,644,000	貸付有価証券 18,700株（10,700株）
スペースバリューホールディングス	28,000	617.00	17,276,000	貸付有価証券 200株
ダイセキ環境ソリューション	4,400	613.00	2,697,200	貸付有価証券 500株
第一カッター興業	2,800	1,789.00	5,009,200	貸付有価証券 700株
安藤・間	147,100	727.00	106,941,700	貸付有価証券 34,000株
東急建設	67,300	797.00	53,638,100	貸付有価証券 600株
コムシスホールディングス	81,500	2,958.00	241,077,000	貸付有価証券 10,400株
ミサワホーム	18,100	745.00	13,484,500	貸付有価証券 2,300株
ピーアールホールディングス	18,800	323.00	6,072,400	
高松コンストラクショングループ	14,300	2,412.00	34,491,600	貸付有価証券 1,700株
東建コーポレーション	7,100	7,260.00	51,546,000	貸付有価証券 4,700株
ソネック	2,400	732.00	1,756,800	貸付有価証券 300株
ヤマウラ	8,900	895.00	7,965,500	貸付有価証券 1,700株
大成建設	188,800	4,830.00	911,904,000	貸付有価証券 24,200株
大林組	568,800	1,077.00	612,597,600	
清水建設	580,200	932.00	540,746,400	貸付有価証券 4,400株
飛島建設	16,200	1,391.00	22,534,200	

長谷工コーポレーション	237,100	1,340.00	317,714,000	貸付有価証券 2,800株
松井建設	20,900	714.00	14,922,600	貸付有価証券 2,600株
銭高組	2,300	5,330.00	12,259,000	貸付有価証券 200株
鹿島建設	444,600	1,591.00	707,358,600	
不動テトラ	13,000	1,504.00	19,552,000	
大末建設	6,700	906.00	6,070,200	貸付有価証券 800株
鉄建建設	11,500	2,908.00	33,442,000	
西松建設	40,900	2,346.00	95,951,400	貸付有価証券 5,200株
三井住友建設	136,800	732.00	100,137,600	貸付有価証券 17,500株
大豊建設	12,800	2,945.00	37,696,000	貸付有価証券 1,600株
前田建設工業	135,300	1,084.00	146,665,200	
佐田建設	12,200	402.00	4,904,400	貸付有価証券 1,500株
ナカノフドー建設	14,500	467.00	6,771,500	貸付有価証券 1,800株
奥村組	31,200	3,520.00	109,824,000	貸付有価証券 2,800株
東鉄工業	22,800	3,160.00	72,048,000	貸付有価証券 2,900株
イチケン	3,400	1,862.00	6,330,800	
富士ピー・エス	5,900	434.00	2,560,600	貸付有価証券 800株
浅沼組	6,700	2,382.00	15,959,400	貸付有価証券 800株
戸田建設	220,500	667.00	147,073,500	貸付有価証券 28,200株
熊谷組	27,100	3,060.00	82,926,000	
青木あすなろ建設	9,300	896.00	8,332,800	貸付有価証券 1,300株
北野建設	4,000	3,020.00	12,080,000	貸付有価証券 500株
植木組	2,300	2,336.00	5,372,800	貸付有価証券 200株
矢作建設工業	25,800	788.00	20,330,400	貸付有価証券

				3,300株
ピーエス三菱	20,000	636.00	12,720,000	
日本ハウスホールディングス	36,200	487.00	17,629,400	貸付有価証券 5,300株
大東建託	67,600	15,455.00	1,044,758,000	貸付有価証券 10,000株
新日本建設	22,600	944.00	21,334,400	貸付有価証券 2,800株
N I P P O	50,200	2,135.00	107,177,000	貸付有価証券 100株
東亜道路工業	3,600	2,865.00	10,314,000	貸付有価証券 400株
前田道路	59,400	2,124.00	126,165,600	貸付有価証券 27,500株
日本道路	5,100	6,250.00	31,875,000	貸付有価証券 600株
東亜建設工業	16,600	1,598.00	26,526,800	貸付有価証券 100株
若築建設	9,500	1,408.00	13,376,000	貸付有価証券 1,200株
東洋建設	69,400	406.00	28,176,400	
五洋建設	225,500	492.00	110,946,000	貸付有価証券 54,600株
世紀東急工業	27,600	569.00	15,704,400	貸付有価証券 300株
福田組	6,100	4,315.00	26,321,500	貸付有価証券 700株
住友林業	134,400	1,571.00	211,142,400	貸付有価証券 18,200株
日本基礎技術	19,500	374.00	7,293,000	貸付有価証券 200株
巴コーポレーション	23,600	361.00	8,519,600	貸付有価証券 3,000株
大和ハウス工業	525,200	3,038.00	1,595,557,600	貸付有価証券 20,000株
ライト工業	36,500	1,456.00	53,144,000	貸付有価証券 4,600株
積水ハウス	580,800	1,781.00	1,034,404,800	貸付有価証券 86,700株
日特建設	16,200	576.00	9,331,200	
北陸電気工事	9,200	851.00	7,829,200	貸付有価証券 1,100株

ユアテック	30,400	817.00	24,836,800	貸付有価証券 3,900株
四電工	2,900	2,642.00	7,661,800	貸付有価証券 300株
中電工	24,400	2,275.00	55,510,000	貸付有価証券 3,100株
関電工	86,300	921.00	79,482,300	
きんでん	126,100	1,795.00	226,349,500	貸付有価証券 6,300株
東京エネシス	19,600	955.00	18,718,000	貸付有価証券 2,500株
トーエネック	5,300	3,125.00	16,562,500	
住友電設	13,100	1,898.00	24,863,800	貸付有価証券 4,600株
日本電設工業	32,300	2,350.00	75,905,000	貸付有価証券 4,200株
協和エクシオ	74,300	3,070.00	228,101,000	
新日本空調	15,900	1,768.00	28,111,200	貸付有価証券 2,400株
九電工	37,400	3,170.00	118,558,000	
三機工業	42,800	1,230.00	52,644,000	貸付有価証券 5,700株
日揮	163,400	1,668.00	272,551,200	貸付有価証券 52,800株（1,600株）
中外炉工業	5,300	1,794.00	9,508,200	
ヤマト	17,000	524.00	8,908,000	貸付有価証券 2,100株
太平電業	12,800	2,401.00	30,732,800	貸付有価証券 2,100株
高砂熱学工業	46,100	1,794.00	82,703,400	
三晃金属工業	2,300	2,726.00	6,269,800	
朝日工業社	3,900	2,994.00	11,676,600	
明星工業	34,300	743.00	25,484,900	貸付有価証券 100株
大気社	25,800	3,475.00	89,655,000	貸付有価証券 3,100株
ダイダン	12,700	2,487.00	31,584,900	貸付有価証券 1,600株
日比谷総合設備	17,100	1,845.00	31,549,500	貸付有価証券 2,400株
東芝プラントシステム	41,100	1,931.00	79,364,100	貸付有価証券



				200株
OSJBホールディングス	83,700	262.00	21,929,400	貸付有価証券 10,700株
千代田化工建設	136,800	350.00	47,880,000	貸付有価証券 91,600株(29,700株)
新興プランテック	34,100	1,161.00	39,590,100	貸付有価証券 4,300株
日本製粉	53,900	1,869.00	100,739,100	貸付有価証券 31,500株(18,700株)
日清製粉グループ本社	192,000	2,541.00	487,872,000	貸付有価証券 24,600株
日東富士製粉	1,200	6,300.00	7,560,000	貸付有価証券 100株
昭和産業	15,600	3,030.00	47,268,000	貸付有価証券 2,000株
鳥越製粉	15,100	755.00	11,400,500	貸付有価証券 1,900株
中部飼料	20,800	1,205.00	25,064,000	貸付有価証券 2,600株
フィード・ワン	114,100	174.00	19,853,400	
東洋精糖	2,600	986.00	2,563,600	貸付有価証券 300株
日本甜菜製糖	9,700	1,836.00	17,809,200	貸付有価証券 1,200株
三井製糖	13,400	2,735.00	36,649,000	貸付有価証券 1,700株
塩水港精糖	18,400	230.00	4,232,000	貸付有価証券 3,800株
日新製糖	8,000	1,988.00	15,904,000	
森永製菓	42,700	4,525.00	193,217,500	
中村屋	4,400	4,270.00	18,788,000	貸付有価証券 500株
江崎グリコ	51,100	5,740.00	293,314,000	貸付有価証券 6,500株
名糖産業	8,200	1,437.00	11,783,400	貸付有価証券 1,000株
井村屋グループ	7,200	2,441.00	17,575,200	貸付有価証券 900株
不二家	9,500	2,135.00	20,282,500	貸付有価証券 1,200株
山崎製パン	138,900	1,700.00	236,130,000	貸付有価証券 30,900株

第一屋製パン	2,900	1,017.00	2,949,300	貸付有価証券 300株
モロゾフ	2,900	5,060.00	14,674,000	貸付有価証券 300株
亀田製菓	10,600	5,150.00	54,590,000	
寿スピリッツ	18,000	4,760.00	85,680,000	
カルビー	77,400	3,050.00	236,070,000	貸付有価証券 12,000株
森永乳業	34,000	3,370.00	114,580,000	貸付有価証券 5,800株
六甲バター	12,400	2,083.00	25,829,200	貸付有価証券 1,500株
ヤクルト本社	125,900	7,400.00	931,660,000	貸付有価証券 15,400株
明治ホールディングス	120,400	8,730.00	1,051,092,000	
雪印メグミルク	40,900	2,432.00	99,468,800	貸付有価証券 5,200株
プリマハム	23,900	2,052.00	49,042,800	
日本ハム	73,400	4,350.00	319,290,000	貸付有価証券 10,800株
林兼産業	5,600	590.00	3,304,000	貸付有価証券 700株
丸大食品	18,100	1,942.00	35,150,200	貸付有価証券 2,300株
S Foods	15,300	3,995.00	61,123,500	貸付有価証券 700株（700株）
伊藤ハム米久ホールディングス	109,400	693.00	75,814,200	貸付有価証券 14,000株
サッポロホールディングス	62,100	2,272.00	141,091,200	貸付有価証券 12,300株
アサヒグループホールディングス	355,800	4,821.00	1,715,311,800	貸付有価証券 92,000株
キリンホールディングス	768,600	2,498.50	1,920,347,100	貸付有価証券 228,700株
宝ホールディングス	127,200	1,278.00	162,561,600	貸付有価証券 16,300株
オエノンホールディングス	48,300	394.00	19,030,200	貸付有価証券 6,200株（100株）
養命酒製造	5,200	2,147.00	11,164,400	貸付有価証券 600株
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	130,100	2,678.00	348,407,800	貸付有価証券 34,400株（3,300株）

サントリー食品インター ナショナル	113,700	4,860.00	552,582,000	貸付有価証券 17,200株
ダイドーグループホール ディングス	9,600	5,000.00	48,000,000	貸付有価証券 4,000株
伊藤園	51,600	5,500.00	283,800,000	貸付有価証券 15,700株
キーコーヒー	16,700	2,084.00	34,802,800	貸付有価証券 2,200株
ユニカフェ	4,700	995.00	4,676,500	貸付有価証券 600株
ジャパンフーズ	2,400	1,175.00	2,820,000	貸付有価証券 1,300株
日清オイリオグループ	21,900	3,195.00	69,970,500	
不二製油グループ本社	41,400	3,485.00	144,279,000	貸付有価証券 5,700株
かどや製油	1,900	5,140.00	9,766,000	
J - オイルミルズ	8,800	4,040.00	35,552,000	貸付有価証券 1,300株
キッコーマン	112,100	5,480.00	614,308,000	貸付有価証券 16,700株
味の素	375,200	1,748.50	656,037,200	貸付有価証券 53,300株
キューピー	94,600	2,578.00	243,878,800	貸付有価証券 14,100株
ハウス食品グループ本社	64,800	4,375.00	283,500,000	貸付有価証券 8,700株
カゴメ	68,100	2,992.00	203,755,200	貸付有価証券 500株
焼津水産化学工業	8,200	1,121.00	9,192,200	貸付有価証券 1,000株
アリアケジャパン	15,500	6,590.00	102,145,000	貸付有価証券 3,000株
ピエトロ	2,200	1,622.00	3,568,400	貸付有価証券 200株
エバラ食品工業	4,100	2,187.00	8,966,700	貸付有価証券 500株
ニチレイ	88,200	2,519.00	222,175,800	
東洋水産	87,400	4,240.00	370,576,000	貸付有価証券 11,200株
イトアンド	5,900	1,607.00	9,481,300	貸付有価証券 1,600株
大冷	1,900	1,726.00	3,279,400	貸付有価証券

				200株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,600	828.00	3,808,800	貸付有価証券 3,000株(1,000株)
日清食品ホールディングス	72,200	7,660.00	553,052,000	貸付有価証券 9,200株
永谷園ホールディングス	9,100	2,270.00	20,657,000	貸付有価証券 1,100株
一正蒲鉾	6,600	1,145.00	7,557,000	貸付有価証券 800株
フジッコ	18,400	2,194.00	40,369,600	
ロック・フィールド	18,300	1,660.00	30,378,000	貸付有価証券 12,200株
日本たばこ産業	981,100	2,579.50	2,530,747,450	貸付有価証券 118,000株
ケンコーマヨネーズ	9,500	2,255.00	21,422,500	貸付有価証券 2,000株
わらべや日洋ホールディングス	11,100	1,820.00	20,202,000	貸付有価証券 1,400株
なとり	9,500	1,619.00	15,380,500	貸付有価証券 1,200株
イフジ産業	3,000	676.00	2,028,000	貸付有価証券 300株
ピクルスコーポレーション	4,000	2,098.00	8,392,000	貸付有価証券 200株
北の達人コーポレーション	66,700	525.00	35,017,500	貸付有価証券 33,400株(3,600株)
ユーグレナ	72,400	775.00	56,110,000	貸付有価証券 34,400株(5,000株)
ミヨシ油脂	6,500	1,144.00	7,436,000	貸付有価証券 800株
理研ビタミン	8,000	3,575.00	28,600,000	貸付有価証券 1,000株
片倉工業	20,400	1,278.00	26,071,200	貸付有価証券 11,100株(8,300株)
ゲンゼ	11,200	4,725.00	52,920,000	
東洋紡	70,200	1,495.00	104,949,000	貸付有価証券 9,000株
ユニチカ	48,600	455.00	22,113,000	貸付有価証券 7,000株
富士紡ホールディングス	8,600	2,803.00	24,105,800	貸付有価証券 1,100株
倉敷紡績	15,800	2,133.00	33,701,400	貸付有価証券

				2,000株
シキボウ	8,700	1,018.00	8,856,600	
日本毛織	54,500	917.00	49,976,500	貸付有価証券 7,700株
ダイトウボウ	26,800	81.00	2,170,800	貸付有価証券 1,400株(800株)
トーア紡コーポレーショ ン	7,000	453.00	3,171,000	貸付有価証券 800株
グライダーリミテッド	19,800	329.00	6,514,200	貸付有価証券 3,600株
帝国繊維	18,600	2,551.00	47,448,600	貸付有価証券 2,800株
帝人	135,300	1,927.00	260,723,100	貸付有価証券 18,000株
東レ	1,286,200	786.10	1,011,081,820	
サカイオーベックス	4,100	1,790.00	7,339,000	
住江織物	4,800	2,985.00	14,328,000	貸付有価証券 700株
日本フェルト	9,400	461.00	4,333,400	貸付有価証券 1,200株
イチカワ	2,300	1,361.00	3,130,300	貸付有価証券 200株
日東製網	1,900	1,692.00	3,214,800	貸付有価証券 200株
アツギ	13,700	925.00	12,672,500	貸付有価証券 1,700株
ダイニック	6,700	733.00	4,911,100	貸付有価証券 800株
セーレン	40,800	1,701.00	69,400,800	
ソトー	6,600	977.00	6,448,200	貸付有価証券 700株
東海染工	2,300	1,094.00	2,516,200	貸付有価証券 200株
小松マテーレ	27,200	861.00	23,419,200	貸付有価証券 3,400株
ワコールホールディング ス	48,300	2,762.00	133,404,600	
ホギメディカル	20,600	3,705.00	76,323,000	貸付有価証券 300株
レナウン	47,900	102.00	4,885,800	貸付有価証券 23,600株(11,000株)
クラウドシアホールディ	4,100	472.00	1,935,200	貸付有価証券

ングス				500株
T S Iホールディングス	61,200	718.00	43,941,600	貸付有価証券 1,400株
マツオカコーポレーショ ン	5,200	3,370.00	17,524,000	貸付有価証券 1,200株
ワールド	16,300	2,103.00	34,278,900	貸付有価証券 200株
三陽商会	10,000	1,858.00	18,580,000	貸付有価証券 100株
ナイガイ	6,000	525.00	3,150,000	貸付有価証券 700株
オンワードホールディン グス	99,600	636.00	63,345,600	貸付有価証券 13,500株
ルックホールディングス	6,000	1,557.00	9,342,000	
ゴールドウイン	15,000	17,350.00	260,250,000	貸付有価証券 8,200株(6,400株)
デザート	40,400	2,472.00	99,868,800	貸付有価証券 4,400株
キング	8,800	653.00	5,746,400	貸付有価証券 1,100株
ヤマトインターナシヨナ ル	10,900	418.00	4,556,200	
特種東海製紙	10,500	4,100.00	43,050,000	貸付有価証券 1,300株
王子ホールディングス	746,400	667.00	497,848,800	貸付有価証券 600株
日本製紙	79,400	2,213.00	175,712,200	貸付有価証券 9,200株(7,400株)
三菱製紙	27,000	581.00	15,687,000	貸付有価証券 1,300株
北越コーポレーション	110,000	622.00	68,420,000	貸付有価証券 600株
中越パルプ工業	7,000	1,394.00	9,758,000	貸付有価証券 800株
巴川製紙所	5,500	1,028.00	5,654,000	貸付有価証券 700株
大王製紙	80,800	1,298.00	104,878,400	貸付有価証券 31,300株(9,000株)
阿波製紙	4,300	495.00	2,128,500	貸付有価証券 500株
レンゴー	171,000	983.00	168,093,000	貸付有価証券 22,200株

トーマク	10,200	1,779.00	18,145,800	貸付有価証券 1,300株
ザ・パック	12,600	3,455.00	43,533,000	貸付有価証券 1,600株
クラレ	279,800	1,511.00	422,777,800	貸付有価証券 156,100株
旭化成	1,179,500	1,138.50	1,342,860,750	
共和レザー	10,300	787.00	8,106,100	貸付有価証券 200株
昭和電工	110,200	4,105.00	452,371,000	貸付有価証券 73,800株
住友化学	1,305,100	547.00	713,889,700	貸付有価証券 600株
住友精化	8,100	4,360.00	35,316,000	
日産化学	101,800	5,110.00	520,198,000	
ラサ工業	5,800	1,567.00	9,088,600	貸付有価証券 3,400株(2,200株)
クレハ	15,300	6,550.00	100,215,000	
多木化学	4,800	5,430.00	26,064,000	貸付有価証券 2,500株
テイカ	13,500	2,452.00	33,102,000	貸付有価証券 2,700株
石原産業	31,800	1,250.00	39,750,000	貸付有価証券 200株
片倉コープアグリ	4,800	1,148.00	5,510,400	貸付有価証券 600株
日東エフシー	10,400	873.00	9,079,200	
日本曹達	26,200	3,060.00	80,172,000	貸付有価証券 3,300株
東ソー	256,300	1,805.00	462,621,500	貸付有価証券 32,800株
トクヤマ	47,800	2,810.00	134,318,000	
セントラル硝子	36,100	2,653.00	95,773,300	貸付有価証券 4,600株
東亜合成	104,100	1,253.00	130,437,300	貸付有価証券 6,600株
大阪ソーダ	17,800	2,745.00	48,861,000	貸付有価証券 4,600株
関東電化工業	39,300	832.00	32,697,600	貸付有価証券 4,900株
デンカ	65,200	3,305.00	215,486,000	

信越化学工業	292,200	10,570.00	3,088,554,000	貸付有価証券 39,500株
日本カーバイド工業	5,600	1,508.00	8,444,800	
堺化学工業	11,000	2,701.00	29,711,000	貸付有価証券 1,400株
第一稀元素化学工業	13,500	892.00	12,042,000	
エア・ウォーター	135,800	1,727.00	234,526,600	貸付有価証券 17,400株
大陽日酸	136,600	1,848.00	252,436,800	貸付有価証券 60,600株
日本化学工業	5,600	2,165.00	12,124,000	貸付有価証券 700株
東邦アセチレン	2,500	1,421.00	3,552,500	
日本パーカライジング	90,600	1,446.00	131,007,600	貸付有価証券 11,600株
高压ガス工業	26,300	853.00	22,433,900	貸付有価証券 3,300株
チタン工業	2,100	2,360.00	4,956,000	貸付有価証券 1,300株（100株）
四国化成工業	27,900	1,157.00	32,280,300	貸付有価証券 2,700株
戸田工業	3,500	2,229.00	7,801,500	貸付有価証券 2,000株
ステラ ケミファ	9,700	3,060.00	29,682,000	貸付有価証券 1,600株
保土谷化学工業	5,700	3,115.00	17,755,500	貸付有価証券 100株
日本触媒	27,900	7,690.00	214,551,000	貸付有価証券 3,600株
大日精化工業	13,700	3,310.00	45,347,000	貸付有価証券 1,700株
カネカ	44,100	4,405.00	194,260,500	
三菱瓦斯化学	170,500	1,623.00	276,721,500	
三井化学	150,500	2,825.00	425,162,500	
J S R	166,400	1,839.00	306,009,600	貸付有価証券 22,600株
東京応化工業	28,400	3,670.00	104,228,000	貸付有価証券 2,500株
大阪有機化学工業	15,300	1,171.00	17,916,300	
三菱ケミカルホールディングス	1,108,300	795.80	881,985,140	



KHネオケム	25,200	3,215.00	81,018,000	貸付有価証券 6,700株
ダイセル	257,500	1,248.00	321,360,000	貸付有価証券 34,400株
住友ベークライト	28,700	4,380.00	125,706,000	貸付有価証券 700株
積水化学工業	362,400	1,775.00	643,260,000	貸付有価証券 46,500株
日本ゼオン	149,500	1,179.00	176,260,500	
アイカ工業	49,700	3,615.00	179,665,500	貸付有価証券 1,800株
宇部興産	83,700	2,433.00	203,642,100	
積水樹脂	27,400	2,061.00	56,471,400	貸付有価証券 3,500株
タキロンシーアイ	35,900	666.00	23,909,400	貸付有価証券 4,000株
旭有機材	11,400	1,816.00	20,702,400	貸付有価証券 1,400株
日立化成	76,700	2,636.00	202,181,200	貸付有価証券 45,500株
ニチバン	8,700	2,346.00	20,410,200	貸付有価証券 100株
リケンテクノス	45,200	526.00	23,775,200	貸付有価証券 5,800株
大倉工業	8,500	1,855.00	15,767,500	貸付有価証券 1,000株
積水化成品工業	24,700	917.00	22,649,900	貸付有価証券 3,100株
群栄化学工業	4,300	2,741.00	11,786,300	貸付有価証券 500株
タイガースポリマー	8,700	595.00	5,176,500	貸付有価証券 600株
ミライアル	4,800	1,249.00	5,995,200	貸付有価証券 700株
ダイキアクシス	5,900	848.00	5,003,200	
ダイキョーニシカワ	35,000	1,160.00	40,600,000	貸付有価証券 600株
竹本容器	5,900	1,424.00	8,401,600	
森六ホールディングス	8,900	2,623.00	23,344,700	貸付有価証券 1,100株
日本化薬	105,500	1,319.00	139,154,500	貸付有価証券 600株

カーリットホールディングス	17,700	852.00	15,080,400	貸付有価証券 100株
日本精化	13,300	1,252.00	16,651,600	貸付有価証券 1,700株
扶桑化学工業	16,800	2,006.00	33,700,800	貸付有価証券 2,100株
トリケミカル研究所	3,700	5,960.00	22,052,000	貸付有価証券 1,600株
A D E K A	81,700	1,673.00	136,684,100	
日油	63,900	3,960.00	253,044,000	貸付有価証券 700株
新日本理化	30,000	208.00	6,240,000	貸付有価証券 17,900株
ハリマ化成グループ	13,700	1,085.00	14,864,500	
花王	411,000	8,293.00	3,408,423,000	貸付有価証券 23,200株
第一工業製薬	6,200	3,660.00	22,692,000	貸付有価証券 600株
石原ケミカル	4,200	1,724.00	7,240,800	貸付有価証券 700株
日華化学	5,600	1,022.00	5,723,200	貸付有価証券 600株
ニイタカ	2,600	1,564.00	4,066,400	貸付有価証券 300株
三洋化成工業	11,100	5,640.00	62,604,000	貸付有価証券 1,400株
有機合成薬品工業	12,700	239.00	3,035,300	貸付有価証券 700株
大日本塗料	18,700	1,085.00	20,289,500	
日本ペイントホールディングス	136,800	4,275.00	584,820,000	貸付有価証券 91,600株
関西ペイント	186,300	2,160.00	402,408,000	貸付有価証券 81,400株
神東塗料	13,000	171.00	2,223,000	貸付有価証券 1,600株
中国塗料	54,500	1,049.00	57,170,500	貸付有価証券 7,300株
日本特殊塗料	12,400	1,194.00	14,805,600	貸付有価証券 1,500株
藤倉化成	22,400	621.00	13,910,400	貸付有価証券 2,800株
太陽ホールディングス	13,700	3,910.00	53,567,000	

D I C	75,000	3,330.00	249,750,000	貸付有価証券 9,600株
サカタインクス	36,200	1,012.00	36,634,400	貸付有価証券 10,000株（2,100株）
東洋インキ S C ホール ディングス	35,000	2,640.00	92,400,000	貸付有価証券 5,100株
T & K T O K A	12,800	997.00	12,761,600	
富士フィルムホールディ ングス	351,600	5,267.00	1,851,877,200	
資生堂	336,400	8,403.00	2,826,769,200	貸付有価証券 62,900株
ライオン	235,800	2,272.00	535,737,600	貸付有価証券 1,900株
高砂香料工業	11,700	3,435.00	40,189,500	貸付有価証券 1,500株
マンダム	38,100	2,855.00	108,775,500	
ミルボン	20,900	5,670.00	118,503,000	貸付有価証券 1,100株
ファンケル	75,400	3,105.00	234,117,000	貸付有価証券 5,300株
コーセー	28,700	21,610.00	620,207,000	貸付有価証券 5,000株
コタ	8,900	1,244.00	11,071,600	貸付有価証券 1,100株
シーボン	2,000	2,553.00	5,106,000	貸付有価証券 200株
ポーラ・オルビスホール ディングス	72,300	3,490.00	252,327,000	貸付有価証券 16,600株
ノエビアホールディング ス	10,800	6,030.00	65,124,000	貸付有価証券 500株
アジュバンコスメジャパ ン	3,800	916.00	3,480,800	貸付有価証券 1,500株
エステー	12,100	1,937.00	23,437,700	貸付有価証券 1,500株
アグロ カネショウ	6,900	2,223.00	15,338,700	貸付有価証券 800株
コニシ	30,000	1,716.00	51,480,000	貸付有価証券 2,800株
長谷川香料	20,200	1,819.00	36,743,800	貸付有価証券 300株
星光 P M C	11,300	778.00	8,791,400	貸付有価証券 1,100株（100株）

小林製薬	47,400	9,670.00	458,358,000	貸付有価証券 9,500株
荒川化学工業	15,200	1,544.00	23,468,800	貸付有価証券 1,900株
メック	11,600	1,155.00	13,398,000	貸付有価証券 600株
日本高純度化学	4,600	2,309.00	10,621,400	貸付有価証券 500株
タカラバイオ	44,300	2,367.00	104,858,100	貸付有価証券 200株
J C U	21,900	1,860.00	40,734,000	貸付有価証券 3,000株
新田ゼラチン	10,600	691.00	7,324,600	貸付有価証券 1,400株
O A T アグリオ	2,300	1,700.00	3,910,000	貸付有価証券 200株
デクセリアルズ	43,600	699.00	30,476,400	貸付有価証券 1,700株
アース製薬	12,800	5,020.00	64,256,000	貸付有価証券 1,700株
北興化学工業	17,300	530.00	9,169,000	
大成ラミック	5,600	2,797.00	15,663,200	貸付有価証券 700株
クミアイ化学工業	70,000	820.00	57,400,000	貸付有価証券 1,100株
日本農薬	40,500	448.00	18,144,000	貸付有価証券 1,400株
アキレス	12,300	1,927.00	23,702,100	貸付有価証券 1,500株
有沢製作所	26,600	894.00	23,780,400	
日東電工	127,900	6,022.00	770,213,800	
レック	18,100	1,489.00	26,950,900	貸付有価証券 2,400株
三光合成	14,500	342.00	4,959,000	貸付有価証券 1,800株
きもと	28,800	168.00	4,838,400	貸付有価証券 4,000株
藤森工業	15,200	3,245.00	49,324,000	
前澤化成工業	11,600	1,028.00	11,924,800	貸付有価証券 1,400株
未来工業	9,100	2,349.00	21,375,900	貸付有価証券 1,100株

ウェーブロックホールディングス	3,500	829.00	2,901,500	貸付有価証券 800株
J S P	9,900	2,444.00	24,195,600	貸付有価証券 2,700株
エフピコ	14,000	6,680.00	93,520,000	
天馬	11,700	2,097.00	24,534,900	貸付有価証券 1,500株
信越ポリマー	30,400	878.00	26,691,200	貸付有価証券 3,900株
東リ	42,100	261.00	10,988,100	貸付有価証券 5,500株
ニフコ	67,800	3,205.00	217,299,000	貸付有価証券 45,400株（500株）
バルカー	13,800	2,404.00	33,175,200	貸付有価証券 1,900株
ユニ・チャーム	358,900	3,650.00	1,309,985,000	貸付有価証券 97,300株（600株）
ショーエイコーポレーション	1,400	750.00	1,050,000	貸付有価証券 100株（100株）
協和発酵キリン	198,700	2,034.00	404,155,800	貸付有価証券 55,100株
武田薬品工業	1,477,900	4,118.00	6,085,992,200	貸付有価証券 189,600株
アステラス製薬	1,560,800	1,516.50	2,366,953,200	
大日本住友製薬	125,500	2,415.00	303,082,500	貸付有価証券 18,400株
塩野義製薬	216,400	6,299.00	1,363,103,600	貸付有価証券 27,700株
田辺三菱製薬	177,000	1,476.00	261,252,000	貸付有価証券 22,700株
わかもと製薬	20,100	279.00	5,607,900	貸付有価証券 2,500株
あすか製薬	20,900	1,134.00	23,700,600	
日本新薬	44,300	7,010.00	310,543,000	貸付有価証券 200株
バイオフェルミン製薬	2,900	2,320.00	6,728,000	貸付有価証券 300株
中外製薬	176,500	6,780.00	1,196,670,000	貸付有価証券 56,600株
科研製薬	30,600	4,735.00	144,891,000	
エーザイ	202,600	6,447.00	1,306,162,200	

ロート製薬	86,800	3,085.00	267,778,000	貸付有価証券 100株
小野薬品工業	399,800	2,029.00	811,194,200	貸付有価証券 54,400株
久光製薬	50,000	4,810.00	240,500,000	貸付有価証券 800株
持田製薬	25,600	5,250.00	134,400,000	
参天製薬	321,100	1,668.00	535,594,800	貸付有価証券 41,300株
扶桑薬品工業	6,000	2,482.00	14,892,000	貸付有価証券 700株
日本ケミファ	2,200	2,865.00	6,303,000	
ツムラ	52,400	3,350.00	175,540,000	貸付有価証券 7,700株
日医工	43,800	1,338.00	58,604,400	貸付有価証券 7,200株
キッセイ薬品工業	30,000	2,709.00	81,270,000	
生化学工業	32,800	1,161.00	38,080,800	
栄研化学	29,700	2,400.00	71,280,000	
日水製薬	7,100	1,141.00	8,101,100	
鳥居薬品	9,100	2,125.00	19,337,500	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
J C R ファーマ	11,900	6,090.00	72,471,000	貸付有価証券 100株
東和薬品	24,400	2,712.00	66,172,800	貸付有価証券 16,300株（100株）
富士製薬工業	11,500	1,709.00	19,653,500	貸付有価証券 1,400株
沢井製薬	34,700	5,870.00	203,689,000	貸付有価証券 4,400株
ゼリア新薬工業	33,500	1,939.00	64,956,500	貸付有価証券 300株
第一三共	484,400	4,996.00	2,420,062,400	貸付有価証券 55,900株
キョーリン製薬ホールディングス	37,400	2,040.00	76,296,000	
大幸薬品	7,500	1,824.00	13,680,000	
ダイト	9,900	3,520.00	34,848,000	
大塚ホールディングス	322,500	3,875.00	1,249,687,500	貸付有価証券 54,200株
大正製薬ホールディング	37,900	10,160.00	385,064,000	貸付有価証券

ス				4,800株
ペプチドリーム	84,800	5,970.00	506,256,000	貸付有価証券 51,200株
日本コークス工業	143,000	99.00	14,157,000	
ニチレキ	21,600	1,066.00	23,025,600	
ユシロ化学工業	8,800	1,332.00	11,721,600	貸付有価証券 1,100株
ピーピー・カストロール	6,000	1,439.00	8,634,000	貸付有価証券 1,400株
富士石油	41,100	273.00	11,220,300	貸付有価証券 5,200株
MORESCO	6,100	1,512.00	9,223,200	貸付有価証券 900株
出光興産	195,400	3,575.00	698,555,000	貸付有価証券 700株
JXTGホールディングス	2,847,300	550.20	1,566,584,460	貸付有価証券 73,900株
コスモエネルギーホールディングス	49,000	2,262.00	110,838,000	貸付有価証券 32,800株
横浜ゴム	98,000	2,186.00	214,228,000	貸付有価証券 28,700株
TOYO TIRE	86,900	1,343.00	116,706,700	貸付有価証券 5,600株
ブリヂストン	520,300	4,422.00	2,300,766,600	貸付有価証券 89,800株
住友ゴム工業	152,100	1,441.00	219,176,100	貸付有価証券 8,800株
藤倉コンポジット	14,800	446.00	6,600,800	貸付有価証券 300株
オカモト	11,800	5,740.00	67,732,000	貸付有価証券 900株
フコク	7,400	832.00	6,156,800	貸付有価証券 900株
ニッタ	19,100	3,760.00	71,816,000	貸付有価証券 2,400株
住友理工	32,800	1,050.00	34,440,000	貸付有価証券 4,200株
三ツ星ベルト	22,300	2,133.00	47,565,900	
バンドー化学	32,300	1,147.00	37,048,100	貸付有価証券 4,100株
日東紡績	25,200	2,330.00	58,716,000	貸付有価証券 3,200株

A G C	167,400	3,760.00	629,424,000	貸付有価証券 35,400株
日本板硝子	80,900	930.00	75,237,000	貸付有価証券 21,500株
石塚硝子	2,800	1,740.00	4,872,000	貸付有価証券 300株
日本山村硝子	7,000	1,445.00	10,115,000	
日本電気硝子	73,200	3,070.00	224,724,000	貸付有価証券 16,200株
オハラ	6,700	1,424.00	9,540,800	貸付有価証券 4,400株（1,500株）
住友大阪セメント	34,200	4,590.00	156,978,000	貸付有価証券 4,400株
太平洋セメント	106,900	3,675.00	392,857,500	
日本ヒューム	17,000	781.00	13,277,000	貸付有価証券 900株
日本コンクリート工業	36,400	282.00	10,264,800	貸付有価証券 200株（200株）
三谷セキサン	7,900	3,025.00	23,897,500	
アジアパイルホールディングス	24,000	579.00	13,896,000	
東海カーボン	153,700	1,456.00	223,787,200	貸付有価証券 83,200株（500株）
日本カーボン	8,100	5,290.00	42,849,000	貸付有価証券 5,400株
東洋炭素	9,900	2,209.00	21,869,100	貸付有価証券 100株
ノリタケカンパニーリミテド	10,100	5,350.00	54,035,000	
T O T O	130,200	4,755.00	619,101,000	貸付有価証券 20,100株
日本碍子	206,600	1,659.00	342,749,400	貸付有価証券 29,600株
日本特殊陶業	142,700	2,284.00	325,926,800	貸付有価証券 27,200株
ダントーホールディングス	14,200	108.00	1,533,600	貸付有価証券 2,000株
M A R U W A	5,900	6,670.00	39,353,000	
品川リフラクトリーズ	4,500	3,280.00	14,760,000	貸付有価証券 500株
黒崎播磨	3,400	5,890.00	20,026,000	貸付有価証券 200株



ヨータイ	14,800	546.00	8,080,800	貸付有価証券 1,800株
イソライト工業	8,700	521.00	4,532,700	貸付有価証券 4,000株(1,200株)
東京窯業	21,500	382.00	8,213,000	貸付有価証券 3,000株
ニッカトー	7,700	904.00	6,960,800	貸付有価証券 2,100株
フジインコーポレー テッド	15,100	2,519.00	38,036,900	貸付有価証券 2,700株
クニミネ工業	5,700	870.00	4,959,000	
エーアンドエーマテリア ル	3,300	1,025.00	3,382,500	貸付有価証券 500株
ニチアス	46,300	2,263.00	104,776,900	貸付有価証券 6,500株
ニチハ	23,500	3,120.00	73,320,000	貸付有価証券 100株
日本製鉄	777,900	2,039.50	1,586,527,050	貸付有価証券 2,200株
神戸製鋼所	306,400	881.00	269,938,400	
中山製鋼所	23,200	523.00	12,133,600	
合同製鐵	8,100	1,737.00	14,069,700	貸付有価証券 2,800株
ジェイ エフ イー ホールディングス	452,100	1,948.50	880,916,850	
東京製鐵	89,600	891.00	79,833,600	貸付有価証券 12,100株
共英製鋼	18,900	1,700.00	32,130,000	貸付有価証券 2,500株
大和工業	35,600	2,933.00	104,414,800	
東京鐵鋼	6,900	1,209.00	8,342,100	貸付有価証券 800株
大阪製鐵	11,100	1,887.00	20,945,700	貸付有価証券 1,400株
淀川製鋼所	22,600	2,115.00	47,799,000	
丸一鋼管	59,300	3,135.00	185,905,500	
モリ工業	5,000	2,664.00	13,320,000	貸付有価証券 600株
大同特殊鋼	27,400	4,760.00	130,424,000	貸付有価証券 3,600株
日本高周波鋼業	6,200	516.00	3,199,200	貸付有価証券

				700株
日本冶金工業	138,500	260.00	36,010,000	貸付有価証券 92,700株
山陽特殊製鋼	21,100	2,317.00	48,888,700	貸付有価証券 2,700株
愛知製鋼	9,400	3,520.00	33,088,000	
日立金属	180,300	1,322.00	238,356,600	貸付有価証券 89,400株
日本金属	3,900	1,228.00	4,789,200	貸付有価証券 200株
大平洋金属	11,300	2,554.00	28,860,200	貸付有価証券 4,200株
新日本電工	100,300	237.00	23,771,100	貸付有価証券 43,700株
栗本鐵工所	8,500	1,463.00	12,435,500	貸付有価証券 1,000株
虹技	2,500	1,394.00	3,485,000	貸付有価証券 300株
日本鑄鉄管	1,700	836.00	1,421,200	
三菱製鋼	12,400	1,588.00	19,691,200	貸付有価証券 1,500株
日亜鋼業	24,500	349.00	8,550,500	貸付有価証券 1,200株
日本精線	2,400	3,295.00	7,908,000	貸付有価証券 100株
エンピプロ・ホールディングス	4,700	625.00	2,937,500	貸付有価証券 2,800株(600株)
シンニッタン	26,000	381.00	9,906,000	貸付有価証券 3,300株
新家工業	3,800	1,600.00	6,080,000	貸付有価証券 400株
大紀アルミニウム工業所	27,500	673.00	18,507,500	貸付有価証券 9,300株
日本軽金属ホールディングス	456,100	250.00	114,025,000	
三井金属鉱業	45,200	3,130.00	141,476,000	貸付有価証券 100株
東邦亜鉛	9,300	3,155.00	29,341,500	貸付有価証券 500株
三菱マテリアル	110,600	3,055.00	337,883,000	貸付有価証券 14,400株
住友金属鉱山	229,300	3,623.00	830,753,900	貸付有価証券

				31,800株
DOWAホールディングス	39,100	3,750.00	146,625,000	貸付有価証券 10,000株
古河機械金属	27,600	1,408.00	38,860,800	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,300	1,612.00	31,111,600	貸付有価証券 9,800株
東邦チタニウム	30,000	946.00	28,380,000	貸付有価証券 4,500株
UACJ	25,400	2,258.00	57,353,200	貸付有価証券 12,700株
CKサンエツ	3,100	2,946.00	9,132,600	貸付有価証券 300株
古河電気工業	48,300	3,045.00	147,073,500	貸付有価証券 5,600株
住友電気工業	625,900	1,524.50	954,184,550	
フジクラ	202,100	478.00	96,603,800	貸付有価証券 9,300株
昭和電線ホールディングス	19,400	770.00	14,938,000	
東京特殊電線	2,100	1,903.00	3,996,300	貸付有価証券 200株
タツタ電線	33,200	483.00	16,035,600	
カナレ電気	2,800	1,947.00	5,451,600	貸付有価証券 300株
平河ヒューテック	6,900	1,414.00	9,756,600	貸付有価証券 800株
リョービ	20,600	2,656.00	54,713,600	貸付有価証券 1,400株
アールスティ	20,600	677.00	13,946,200	
アサヒホールディングス	31,400	2,080.00	65,312,000	
稲葉製作所	9,400	1,430.00	13,442,000	貸付有価証券 1,200株
宮地エンジニアリンググループ	5,100	1,882.00	9,598,200	貸付有価証券 600株
トーカロ	43,200	948.00	40,953,600	
アルファC o	5,900	1,312.00	7,740,800	貸付有価証券 800株
SUMCO	185,000	1,482.00	274,170,000	貸付有価証券 17,400株
川田テクノロジーズ	3,700	6,910.00	25,567,000	貸付有価証券 400株

RS Technologies	3,400	3,420.00	11,628,000	貸付有価証券 2,000株
東洋製罐グループホールディングス	106,600	2,212.00	235,799,200	貸付有価証券 2,200株
ホッカンホールディングス	8,500	1,789.00	15,206,500	貸付有価証券 1,000株
コロナ	9,300	1,064.00	9,895,200	貸付有価証券 1,100株
横河ブリッジホールディングス	31,100	1,795.00	55,824,500	
駒井ハルテック	3,100	1,803.00	5,589,300	
高田機工	1,500	2,524.00	3,786,000	貸付有価証券 100株
三和ホールディングス	172,900	1,314.00	227,190,600	
文化シャッター	49,300	814.00	40,130,200	貸付有価証券 7,700株
三協立山	23,200	1,236.00	28,675,200	貸付有価証券 2,900株
アルインコ	13,300	984.00	13,087,200	貸付有価証券 1,700株
東洋シャッター	4,000	706.00	2,824,000	貸付有価証券 100株
LIXILグループ	247,000	1,508.00	372,476,000	
日本フィルコン	12,800	522.00	6,681,600	貸付有価証券 1,600株
ノーリツ	37,400	1,709.00	63,916,600	貸付有価証券 5,600株
長府製作所	17,000	2,295.00	39,015,000	貸付有価証券 2,100株
リンナイ	29,800	7,640.00	227,672,000	貸付有価証券 1,700株
ダイニチ工業	9,000	675.00	6,075,000	貸付有価証券 1,100株
日東精工	23,100	650.00	15,015,000	
三洋工業	2,200	1,851.00	4,072,200	貸付有価証券 200株
岡部	33,900	1,007.00	34,137,300	
ジーテクト	18,500	1,707.00	31,579,500	
中国工業	2,500	533.00	1,332,500	貸付有価証券 300株
東プレ	31,200	2,170.00	67,704,000	貸付有価証券

				300株
高周波熱錬	32,200	957.00	30,815,400	貸付有価証券 4,000株
東京製鋼	10,300	1,107.00	11,402,100	
サンコール	9,400	605.00	5,687,000	貸付有価証券 1,000株
モリテック スチール	13,000	398.00	5,174,000	貸付有価証券 4,400株
パイオラックス	26,800	2,266.00	60,728,800	貸付有価証券 3,500株
エイチワン	16,400	968.00	15,875,200	貸付有価証券 2,400株
日本発條	166,800	1,075.00	179,310,000	貸付有価証券 21,400株
中央発條	2,000	2,953.00	5,906,000	貸付有価証券 200株
アドバネクス	2,200	1,771.00	3,896,200	貸付有価証券 1,100株
立川ブラインド工業	7,400	1,228.00	9,087,200	貸付有価証券 1,100株
三益半導体工業	14,900	1,715.00	25,553,500	貸付有価証券 300株(300株)
日本ドライケミカル	4,500	1,107.00	4,981,500	貸付有価証券 500株
日本製鋼所	50,800	2,141.00	108,762,800	
三浦工業	72,400	2,792.00	202,140,800	貸付有価証券 500株
タクマ	61,100	1,344.00	82,118,400	
ツガミ	37,600	1,066.00	40,081,600	貸付有価証券 25,100株
オークマ	21,300	6,590.00	140,367,000	貸付有価証券 3,000株
東芝機械	18,900	2,509.00	47,420,100	貸付有価証券 1,400株
アマダホールディングス	258,300	1,254.00	323,908,200	
アイダエンジニアリング	46,400	892.00	41,388,800	
滝澤鉄工所	5,200	1,543.00	8,023,600	貸付有価証券 600株
F U J I	50,100	1,692.00	84,769,200	貸付有価証券 1,100株
牧野フライス製作所	19,600	4,920.00	96,432,000	

オーエスジー	82,500	2,214.00	182,655,000	貸付有価証券 6,000株
ダイジェット工業	1,900	1,725.00	3,277,500	貸付有価証券 200株
旭ダイヤモンド工業	43,900	800.00	35,120,000	貸付有価証券 5,700株
D M G 森精機	105,900	1,667.00	176,535,300	貸付有価証券 57,400株（9,700株）
ソディック	36,500	995.00	36,317,500	貸付有価証券 11,500株（2,200株）
ディスコ	22,700	19,710.00	447,417,000	貸付有価証券 8,500株（2,400株）
日東工器	9,200	2,343.00	21,555,600	貸付有価証券 1,100株
日進工具	4,900	2,541.00	12,450,900	
パンチ工業	11,600	682.00	7,911,200	貸付有価証券 1,400株
富士ダイス	7,400	628.00	4,647,200	貸付有価証券 900株
豊和工業	9,200	957.00	8,804,400	貸付有価証券 1,200株
O K K	6,900	802.00	5,533,800	貸付有価証券 900株
東洋機械金属	12,000	589.00	7,068,000	貸付有価証券 100株
津田駒工業	3,600	1,928.00	6,940,800	貸付有価証券 400株
エンシュウ	4,300	1,192.00	5,125,600	貸付有価証券 2,200株
島精機製作所	23,100	3,730.00	86,163,000	貸付有価証券 15,400株
オプトラ	16,300	2,975.00	48,492,500	貸付有価証券 7,100株
N C ホールディングス	5,400	548.00	2,959,200	貸付有価証券 600株
フリー	13,400	1,014.00	13,587,600	貸付有価証券 100株
ヤマシンフィルタ	29,100	754.00	21,941,400	貸付有価証券 17,200株（5,200株）
日阪製作所	20,600	949.00	19,549,400	貸付有価証券 2,600株
やまびこ	32,500	1,083.00	35,197,500	

平田機工	7,900	7,600.00	60,040,000	貸付有価証券 3,300株
ペガサスミシン製造	15,700	640.00	10,048,000	貸付有価証券 2,000株
マルマエ	4,600	1,001.00	4,604,600	貸付有価証券 3,000株(2,100株)
タツモ	5,200	944.00	4,908,800	貸付有価証券 1,400株
ナプテスコ	92,100	3,460.00	318,666,000	貸付有価証券 10,900株
三井海洋開発	17,800	3,480.00	61,944,000	
レオン自動機	16,400	1,682.00	27,584,800	貸付有価証券 2,800株
S M C	49,600	45,530.00	2,258,288,000	貸付有価証券 5,400株
新川	12,600	513.00	6,463,800	貸付有価証券 6,800株(1,300株)
ホソカワミクロン	5,900	5,330.00	31,447,000	
ユニオンツール	7,300	3,075.00	22,447,500	
オイレス工業	23,400	1,884.00	44,085,600	貸付有価証券 3,000株
日精エー・エス・ビー機 械	4,800	4,140.00	19,872,000	貸付有価証券 3,100株
サトーホールディングス	20,200	2,726.00	55,065,200	
技研製作所	11,700	3,415.00	39,955,500	貸付有価証券 100株
日本エアテック	5,300	597.00	3,164,100	貸付有価証券 700株
カワタ	3,400	1,630.00	5,542,000	貸付有価証券 1,500株
日精樹脂工業	14,000	987.00	13,818,000	貸付有価証券 100株
オカダアイヨン	5,700	1,267.00	7,221,900	貸付有価証券 1,500株
ワイエイシイホールディ ングス	6,700	911.00	6,103,700	貸付有価証券 2,200株
小松製作所	766,500	2,840.50	2,177,243,250	貸付有価証券 217,300株
住友重機械工業	96,900	3,920.00	379,848,000	
日立建機	67,800	2,879.00	195,196,200	貸付有価証券 2,800株

日工	4,600	2,449.00	11,265,400	貸付有価証券 500株
巴工業	7,200	2,442.00	17,582,400	貸付有価証券 900株
井関農機	16,900	1,729.00	29,220,100	貸付有価証券 400株
TOWA	14,500	976.00	14,152,000	貸付有価証券 7,900株
丸山製作所	3,700	1,370.00	5,069,000	貸付有価証券 400株
北川鉄工所	7,600	2,334.00	17,738,400	
ローツェ	7,400	2,742.00	20,290,800	貸付有価証券 4,900株
タカキタ	5,900	582.00	3,433,800	貸付有価証券 700株
クボタ	906,900	1,656.50	1,502,279,850	貸付有価証券 171,300株
荏原実業	4,900	2,038.00	9,986,200	貸付有価証券 600株
三菱化工機	5,800	1,514.00	8,781,200	貸付有価証券 300株
月島機械	33,600	1,431.00	48,081,600	貸付有価証券 4,500株
帝国電機製作所	11,800	1,129.00	13,322,200	
東京機械製作所	6,600	428.00	2,824,800	貸付有価証券 2,500株
新東工業	40,200	1,059.00	42,571,800	貸付有価証券 4,900株
澁谷工業	14,800	3,430.00	50,764,000	
アイチ コーポレーシ ョン	29,200	725.00	21,170,000	貸付有価証券 3,700株
小森コーポレーション	45,800	1,340.00	61,372,000	
鶴見製作所	13,200	2,015.00	26,598,000	貸付有価証券 1,600株
住友精密工業	2,800	3,060.00	8,568,000	
酒井重工業	3,200	2,948.00	9,433,600	貸付有価証券 1,000株
荏原製作所	75,000	3,405.00	255,375,000	貸付有価証券 19,300株
石井鐵工所	2,600	1,915.00	4,979,000	
西島製作所	17,300	993.00	17,178,900	貸付有価証券



				2,200株
北越工業	17,400	1,186.00	20,636,400	
ダイキン工業	231,100	13,400.00	3,096,740,000	貸付有価証券 31,100株
オルガノ	6,100	3,160.00	19,276,000	貸付有価証券 700株
トーヨーカネツ	6,400	2,213.00	14,163,200	貸付有価証券 2,000株
栗田工業	91,600	2,909.00	266,464,400	貸付有価証券 11,700株
椿本チエイン	22,100	4,095.00	90,499,500	
大同工業	8,000	876.00	7,008,000	貸付有価証券 1,100株
木村化工機	14,100	362.00	5,104,200	貸付有価証券 1,800株
アネスト岩田	26,300	961.00	25,274,300	
ダイフク	93,200	6,700.00	624,440,000	貸付有価証券 20,500株
サムコ	4,600	909.00	4,181,400	貸付有価証券 500株
加藤製作所	8,600	2,759.00	23,727,400	貸付有価証券 200株
油研工業	2,800	1,730.00	4,844,000	貸付有価証券 300株
タダノ	81,700	1,173.00	95,834,100	貸付有価証券 11,800株
フジテック	61,500	1,366.00	84,009,000	貸付有価証券 7,800株
C K D	47,100	1,346.00	63,396,600	貸付有価証券 2,400株
キトー	12,800	1,787.00	22,873,600	
平和	47,200	2,216.00	104,595,200	貸付有価証券 6,000株
理想科学工業	14,900	1,808.00	26,939,200	
SANKYO	42,400	4,385.00	185,924,000	貸付有価証券 5,400株
日本金銭機械	18,700	1,232.00	23,038,400	貸付有価証券 6,200株(900株)
マースグループホールディングス	10,700	2,255.00	24,128,500	貸付有価証券 1,300株
福島工業	10,400	3,885.00	40,404,000	

オーイズミ	7,100	400.00	2,840,000	貸付有価証券 3,800株(3,800株)
ダイコク電機	7,800	1,496.00	11,668,800	貸付有価証券 1,000株
竹内製作所	28,300	2,119.00	59,967,700	貸付有価証券 8,300株
アマノ	48,300	2,581.00	124,662,300	貸付有価証券 3,200株
J U K I	23,600	1,275.00	30,090,000	
サンデンホールディングス	20,700	871.00	18,029,700	貸付有価証券 4,600株
蛇の目ミシン工業	15,400	468.00	7,207,200	
マックス	25,800	1,726.00	44,530,800	貸付有価証券 3,300株
グローリー	46,900	2,847.00	133,524,300	貸付有価証券 7,600株
新晃工業	15,700	1,623.00	25,481,100	貸付有価証券 5,800株
大和冷機工業	24,500	1,264.00	30,968,000	貸付有価証券 3,100株
セガサミーホールディングス	167,900	1,375.00	230,862,500	貸付有価証券 21,600株
日本ピストンリング	6,200	1,649.00	10,223,800	貸付有価証券 700株
リケン	7,800	5,280.00	41,184,000	貸付有価証券 1,000株
T P R	22,800	2,305.00	52,554,000	貸付有価証券 2,500株
ツバキ・ナカシマ	25,600	2,091.00	53,529,600	貸付有価証券 200株
ホシザキ	49,500	7,120.00	352,440,000	貸付有価証券 6,300株
大豊工業	13,800	1,001.00	13,813,800	貸付有価証券 1,700株
日本精工	347,700	1,188.00	413,067,600	貸付有価証券 50,500株
N T N	363,800	378.00	137,516,400	貸付有価証券 146,600株
ジェイテクト	162,400	1,502.00	243,924,800	貸付有価証券 22,000株
不二越	15,700	5,480.00	86,036,000	貸付有価証券 6,100株

日本トムソン	50,200	576.00	28,915,200	
THK	105,500	3,010.00	317,555,000	貸付有価証券 5,900株
コーシン精機	13,100	1,217.00	15,942,700	
前澤給装工業	6,600	1,920.00	12,672,000	貸付有価証券 900株
イーグル工業	20,900	1,301.00	27,190,900	
前澤工業	11,300	363.00	4,101,900	貸付有価証券 1,400株
日本ピラー工業	17,100	1,350.00	23,085,000	
キット	68,600	852.00	58,447,200	
マキタ	206,000	4,075.00	839,450,000	貸付有価証券 28,500株
日立造船	134,200	345.00	46,299,000	貸付有価証券 22,200株
三菱重工業	283,700	4,544.00	1,289,132,800	貸付有価証券 500株
IHI	130,100	2,639.00	343,333,900	
スター精密	28,900	1,864.00	53,869,600	貸付有価証券 200株
日清紡ホールディングス	94,000	1,031.00	96,914,000	貸付有価証券 32,700株
イビデン	103,600	1,817.00	188,241,200	貸付有価証券 15,700株
コニカミノルタ	369,900	1,107.00	409,479,300	貸付有価証券 52,000株
ブラザー工業	220,500	2,193.00	483,556,500	貸付有価証券 28,200株
ミネベアミツミ	314,200	1,969.00	618,659,800	貸付有価証券 43,300株
日立製作所	762,100	3,647.00	2,779,378,700	貸付有価証券 97,700株
三菱電機	1,692,800	1,521.50	2,575,595,200	貸付有価証券 217,100株
富士電機	109,900	3,450.00	379,155,000	
東洋電機製造	6,700	1,533.00	10,271,100	
安川電機	196,200	4,260.00	835,812,000	貸付有価証券 115,500株
シンフォニアテクノロジー	23,500	1,569.00	36,871,500	
明電舎	33,500	1,594.00	53,399,000	

オリジン	4,600	2,093.00	9,627,800	貸付有価証券 500株
山洋電気	8,200	4,855.00	39,811,000	貸付有価証券 2,000株
デンヨー	15,600	1,380.00	21,528,000	貸付有価証券 200株
東芝テック	21,200	3,140.00	66,568,000	
芝浦メカトロニクス	3,000	3,855.00	11,565,000	
マブチモーター	46,800	4,175.00	195,390,000	貸付有価証券 7,400株
日本電産	203,700	15,820.00	3,222,534,000	貸付有価証券 50,600株
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	9,100	1,490.00	13,559,000	貸付有価証券 4,100株
トレックス・セミコンダ クター	5,700	1,309.00	7,461,300	貸付有価証券 1,600株（200株）
東光高岳	8,600	1,361.00	11,704,600	貸付有価証券 100株
ダブル・スコープ	24,700	1,650.00	40,755,000	貸付有価証券 13,300株（100株）
ダイヘン	18,500	3,170.00	58,645,000	貸付有価証券 3,200株
ヤーマン	24,500	1,149.00	28,150,500	貸付有価証券 16,400株（300株）
JVCケンウッド	129,300	293.00	37,884,900	
ミマキエンジニアリング	15,200	621.00	9,439,200	貸付有価証券 300株
第一精工	7,000	1,190.00	8,330,000	貸付有価証券 1,900株
日新電機	39,700	1,078.00	42,796,600	貸付有価証券 7,600株
大崎電気工業	33,700	735.00	24,769,500	
オムロン	179,900	6,080.00	1,093,792,000	貸付有価証券 28,400株
日東工業	27,100	2,192.00	59,403,200	貸付有価証券 100株
I D E C	22,700	2,355.00	53,458,500	貸付有価証券 2,900株
正興電機製作所	3,000	807.00	2,421,000	貸付有価証券 600株
不二電機工業	1,800	1,293.00	2,327,400	貸付有価証券 300株

ジーエス・ユアサ コーポレーション	60,900	2,275.00	138,547,500	貸付有価証券 9,500株
サクサホールディングス	4,300	1,734.00	7,456,200	貸付有価証券 500株
メルコホールディングス	7,000	3,740.00	26,180,000	
テクノメディカ	3,800	2,086.00	7,926,800	貸付有価証券 400株
日本電気	219,000	3,745.00	820,155,000	
富士通	163,200	8,000.00	1,305,600,000	貸付有価証券 20,900株
沖電気工業	73,300	1,335.00	97,855,500	貸付有価証券 9,400株
岩崎通信機	7,900	784.00	6,193,600	貸付有価証券 1,100株
電気興業	8,900	3,280.00	29,192,000	貸付有価証券 1,900株
サンケン電気	19,800	2,470.00	48,906,000	貸付有価証券 2,700株
ナカヨ	3,300	1,394.00	4,600,200	貸付有価証券 400株
アイホン	9,600	1,777.00	17,059,200	貸付有価証券 1,000株
ルネサスエレクトロニクス	175,400	624.00	109,449,600	貸付有価証券 73,900株
セイコーエプソン	210,000	1,789.00	375,690,000	貸付有価証券 3,300株
ワコム	122,500	450.00	55,125,000	
アルバック	33,700	3,765.00	126,880,500	貸付有価証券 13,000株
アクセル	7,100	555.00	3,940,500	貸付有価証券 3,800株
E I Z O	15,500	4,325.00	67,037,500	
ジャパンディスプレイ	400,200	78.00	31,215,600	貸付有価証券 268,100株（13,600株）
日本信号	43,100	1,034.00	44,565,400	貸付有価証券 5,700株
京三製作所	36,300	432.00	15,681,600	貸付有価証券 4,600株
能美防災	22,400	1,916.00	42,918,400	
ホーチキ	10,700	1,235.00	13,214,500	貸付有価証券 1,300株

星和電機	6,800	509.00	3,461,200	貸付有価証券 1,400株
エレコム	15,900	3,655.00	58,114,500	貸付有価証券 2,000株
パナソニック	1,933,900	1,029.00	1,989,983,100	貸付有価証券 53,600株
シャープ	167,900	1,297.00	217,766,300	貸付有価証券 51,400株（9,000株）
アンリツ	108,900	2,231.00	242,955,900	貸付有価証券 59,000株
富士通ゼネラル	51,700	1,552.00	80,238,400	貸付有価証券 6,600株
ソニー	1,135,700	5,310.00	6,030,567,000	貸付有価証券 121,400株
T D K	88,500	9,720.00	860,220,000	貸付有価証券 14,000株
帝国通信工業	7,500	1,223.00	9,172,500	貸付有価証券 900株
タムラ製作所	65,300	706.00	46,101,800	貸付有価証券 14,600株
アルプスアルパイン	176,200	2,317.00	408,255,400	
池上通信機	5,400	1,138.00	6,145,200	貸付有価証券 1,900株
日本電波工業	15,300	507.00	7,757,100	貸付有価証券 5,600株（800株）
鈴木	9,100	687.00	6,251,700	貸付有価証券 1,100株
日本トリム	3,200	5,640.00	18,048,000	貸付有価証券 1,500株
ローランド ディー ジー	8,600	2,456.00	21,121,600	
フォスター電機	19,100	1,740.00	33,234,000	
S M K	4,700	2,836.00	13,329,200	貸付有価証券 2,100株
ヨコオ	12,100	1,783.00	21,574,300	貸付有価証券 2,400株
ティアック	12,200	196.00	2,391,200	貸付有価証券 6,800株（800株）
ホシデン	49,800	1,073.00	53,435,400	貸付有価証券 6,700株
ヒロセ電機	24,300	12,880.00	312,984,000	貸付有価証券 6,800株

日本航空電子工業	38,800	1,664.00	64,563,200	貸付有価証券 3,100株
TOA	18,200	1,197.00	21,785,400	
マクセルホールディングス	36,400	1,679.00	61,115,600	貸付有価証券 4,600株
古野電気	21,800	1,004.00	21,887,200	貸付有価証券 8,900株
ユニデンホールディングス	5,000	2,520.00	12,600,000	貸付有価証券 600株
スミダコーポレーション	14,400	1,714.00	24,681,600	貸付有価証券 500株（500株）
アイコム	9,400	2,077.00	19,523,800	貸付有価証券 1,200株
リオン	7,800	2,047.00	15,966,600	貸付有価証券 1,000株
本多通信工業	14,500	563.00	8,163,500	貸付有価証券 6,200株
船井電機	17,100	785.00	13,423,500	貸付有価証券 7,700株
横河電機	169,400	2,288.00	387,587,200	貸付有価証券 21,700株
新電元工業	6,000	4,695.00	28,170,000	
アズビル	109,300	2,682.00	293,142,600	貸付有価証券 15,300株
東亜ディーケーケー	8,400	832.00	6,988,800	貸付有価証券 1,000株
日本光電工業	74,600	3,070.00	229,022,000	
チノー	5,800	1,313.00	7,615,400	
共和電業	17,700	406.00	7,186,200	貸付有価証券 2,200株
日本電子材料	6,700	704.00	4,716,800	貸付有価証券 2,400株
堀場製作所	33,500	6,640.00	222,440,000	貸付有価証券 1,100株
アドバンテスト	115,400	3,295.00	380,243,000	貸付有価証券 5,900株
小野測器	7,900	623.00	4,921,700	貸付有価証券 1,000株
エスベック	15,000	2,195.00	32,925,000	
キーエンス	83,100	72,940.00	6,061,314,000	貸付有価証券 14,300株

日置電機	8,800	4,210.00	37,048,000	貸付有価証券 1,100株
シスメックス	131,900	6,098.00	804,326,200	貸付有価証券 22,600株
日本マイクロニクス	27,300	879.00	23,996,700	貸付有価証券 11,900株
メガチップス	13,300	1,472.00	19,577,600	貸付有価証券 8,500株
O B A R A G R O U P	9,900	4,305.00	42,619,500	
澤藤電機	2,000	1,648.00	3,296,000	貸付有価証券 200株
原田工業	5,100	836.00	4,263,600	貸付有価証券 2,900株
コーセル	21,500	1,245.00	26,767,500	貸付有価証券 14,400株(1,600株)
イリソ電子工業	15,500	5,840.00	90,520,000	貸付有価証券 5,600株
オブテックスグループ	29,700	1,969.00	58,479,300	貸付有価証券 14,000株(1,200株)
千代田インテグレ	7,100	2,072.00	14,711,200	貸付有価証券 900株
アイ・オー・データ機器	6,200	1,185.00	7,347,000	貸付有価証券 700株
レーザーテック	34,700	4,945.00	171,591,500	貸付有価証券 2,500株
スタンレー電気	119,700	3,415.00	408,775,500	
岩崎電気	6,600	1,378.00	9,094,800	貸付有価証券 800株
ウシオ電機	98,300	1,358.00	133,491,400	貸付有価証券 13,500株
岡谷電機産業	12,000	373.00	4,476,000	貸付有価証券 4,700株
ヘリオス テクノ ホールディング	15,600	668.00	10,420,800	貸付有価証券 10,400株
エノモト	3,500	906.00	3,171,000	貸付有価証券 500株
日本セラミック	17,200	3,115.00	53,578,000	貸付有価証券 3,900株
遠藤照明	8,500	766.00	6,511,000	
古河電池	12,100	709.00	8,578,900	貸付有価証券 5,600株
双信電機	8,200	537.00	4,403,400	貸付有価証券



				5,400株(2,300株)
山一電機	12,300	1,305.00	16,051,500	貸付有価証券 3,300株(100株)
図研	11,000	1,475.00	16,225,000	
日本電子	33,400	2,221.00	74,181,400	貸付有価証券 4,200株
カシオ計算機	149,700	1,405.00	210,328,500	貸付有価証券 22,000株
ファナック	160,900	21,645.00	3,482,680,500	貸付有価証券 21,900株
日本シイエムケイ	43,100	788.00	33,962,800	貸付有価証券 8,300株
エンプラス	7,700	3,040.00	23,408,000	貸付有価証券 200株
大真空	6,200	1,088.00	6,745,600	貸付有価証券 900株
ローム	81,800	8,410.00	687,938,000	貸付有価証券 2,800株
浜松ホトニクス	121,400	4,410.00	535,374,000	貸付有価証券 16,200株
三井ハイテック	18,700	1,333.00	24,927,100	貸付有価証券 7,000株
新光電気工業	56,800	942.00	53,505,600	貸付有価証券 7,200株
京セラ	258,000	6,839.00	1,764,462,000	
太陽誘電	75,300	2,665.00	200,674,500	貸付有価証券 50,400株
村田製作所	532,800	5,971.00	3,181,348,800	貸付有価証券 92,600株
ユーシン	26,600	983.00	26,147,800	貸付有価証券 4,500株
双葉電子工業	27,700	1,783.00	49,389,100	貸付有価証券 3,500株
北陸電気工業	6,300	1,080.00	6,804,000	貸付有価証券 700株
ニチコン	53,300	1,080.00	57,564,000	
日本ケミコン	12,000	2,390.00	28,680,000	
K O A	25,500	1,643.00	41,896,500	貸付有価証券 300株
市光工業	25,300	730.00	18,469,000	
小糸製作所	101,400	6,880.00	697,632,000	貸付有価証券

				10,200株
ミツバ	31,100	747.00	23,231,700	貸付有価証券 3,900株
S C R E E Nホールディングス	29,400	5,620.00	165,228,000	貸付有価証券 4,800株
キヤノン電子	15,500	1,838.00	28,489,000	
キヤノン	911,300	3,167.00	2,886,087,100	貸付有価証券 106,900株
リコー	509,000	1,114.00	567,026,000	貸付有価証券 79,600株
象印マホービン	31,500	1,131.00	35,626,500	貸付有価証券 17,100株(1,100株)
M U T O Hホールディングス	2,300	1,861.00	4,280,300	貸付有価証券 200株
東京エレクトロン	112,900	17,945.00	2,025,990,500	
トヨタ紡織	59,200	1,814.00	107,388,800	貸付有価証券 7,500株
芦森工業	3,500	1,615.00	5,652,500	貸付有価証券 1,200株
ユニプレス	32,800	1,903.00	62,418,400	
豊田自動織機	137,000	6,210.00	850,770,000	貸付有価証券 5,000株
モリタホールディングス	29,600	1,880.00	55,648,000	貸付有価証券 3,700株
三櫻工業	21,500	540.00	11,610,000	貸付有価証券 3,100株
デンソー	372,700	5,159.00	1,922,759,300	貸付有価証券 47,800株
東海理化電機製作所	44,600	2,088.00	93,124,800	貸付有価証券 100株
三井E & Sホールディングス	61,100	1,178.00	71,975,800	貸付有価証券 800株
川崎重工業	131,700	2,688.00	354,009,600	
名村造船所	50,800	374.00	18,999,200	貸付有価証券 16,600株
サノヤスホールディングス	22,300	246.00	5,485,800	貸付有価証券 5,100株
日本車輛製造	6,200	2,454.00	15,214,800	貸付有価証券 3,200株
三菱ロジスネクスト	20,100	1,245.00	25,024,500	貸付有価証券 2,600株
近畿車輛	2,500	2,057.00	5,142,500	貸付有価証券

				600株
日産自動車	1,996,500	944.50	1,885,694,250	貸付有価証券 281,300株
いすゞ自動車	535,100	1,580.00	845,458,000	
トヨタ自動車	1,886,400	6,963.00	13,135,003,200	貸付有価証券 242,000株
日野自動車	211,400	1,049.00	221,758,600	
三菱自動車工業	626,600	643.00	402,903,800	貸付有価証券 17,900株
エフテック	11,800	918.00	10,832,400	
レシップホールディングス	6,100	800.00	4,880,000	貸付有価証券 700株
G M B	3,300	900.00	2,970,000	貸付有価証券 400株
ファルテック	3,000	822.00	2,466,000	貸付有価証券 300株
武蔵精密工業	41,100	1,778.00	73,075,800	貸付有価証券 5,200株
日産車体	33,100	1,049.00	34,721,900	貸付有価証券 4,300株
新明和工業	70,900	1,367.00	96,920,300	貸付有価証券 10,400株
極東開発工業	33,700	1,564.00	52,706,800	貸付有価証券 4,300株
日信工業	31,000	1,532.00	47,492,000	
トピー工業	13,900	2,594.00	36,056,600	
ティラド	6,100	2,450.00	14,945,000	
タチエス	28,700	1,746.00	50,110,200	貸付有価証券 3,600株
N O K	91,000	1,845.00	167,895,000	貸付有価証券 16,200株
フタバ産業	47,100	725.00	34,147,500	貸付有価証券 2,300株
K Y B	17,600	3,020.00	53,152,000	貸付有価証券 700株
大同メタル工業	27,500	737.00	20,267,500	
プレス工業	83,900	603.00	50,591,700	
ミクニ	21,500	459.00	9,868,500	貸付有価証券 2,700株
太平洋工業	35,400	1,758.00	62,233,200	貸付有価証券 2,500株

ケーヒン	38,900	1,946.00	75,699,400	貸付有価証券 4,900株
河西工業	20,800	949.00	19,739,200	貸付有価証券 500株
アイシン精機	139,400	4,795.00	668,423,000	貸付有価証券 17,800株
マツダ	531,300	1,336.50	710,082,450	
今仙電機製作所	15,700	1,050.00	16,485,000	貸付有価証券 2,100株
本田技研工業	1,428,000	3,167.00	4,522,476,000	貸付有価証券 201,200株
スズキ	309,700	5,155.00	1,596,503,500	貸付有価証券 40,300株
S U B A R U	525,500	2,795.00	1,468,772,500	貸付有価証券 67,900株
安永	8,200	1,735.00	14,227,000	貸付有価証券 5,400株
ヤマハ発動機	239,100	2,423.00	579,339,300	貸付有価証券 101,500株
ショーワ	40,000	1,659.00	66,360,000	
T B K	20,100	422.00	8,482,200	貸付有価証券 1,000株
エクセディ	23,000	2,845.00	65,435,000	
豊田合成	54,700	2,521.00	137,898,700	貸付有価証券 7,000株
愛三工業	26,500	787.00	20,855,500	
盟和産業	2,600	1,073.00	2,789,800	貸付有価証券 300株
日本プラスト	13,300	788.00	10,480,400	貸付有価証券 1,700株
ヨロズ	15,800	1,702.00	26,891,600	
エフ・シー・シー	30,400	2,431.00	73,902,400	
シマノ	68,200	18,010.00	1,228,282,000	貸付有価証券 19,000株
テイ・エス テック	39,300	3,485.00	136,960,500	
ジャムコ	8,500	2,258.00	19,193,000	貸付有価証券 3,700株
テルモ	479,000	3,207.00	1,536,153,000	貸付有価証券 65,100株
クリエートメディック	5,600	951.00	5,325,600	
日機装	54,700	1,358.00	74,282,600	貸付有価証券

				5,700株(200株)
島津製作所	217,800	3,075.00	669,735,000	貸付有価証券 28,700株
JMS	15,600	646.00	10,077,600	貸付有価証券 1,200株
クボテック	3,600	427.00	1,537,200	貸付有価証券 2,400株
長野計器	13,300	814.00	10,826,200	貸付有価証券 1,700株
ブイ・テクノロジー	4,000	15,430.00	61,720,000	
東京計器	10,800	1,125.00	12,150,000	
愛知時計電機	2,200	4,075.00	8,965,000	貸付有価証券 200株
インターアクション	7,900	1,725.00	13,627,500	貸付有価証券 5,200株
オーバル	16,500	258.00	4,257,000	貸付有価証券 2,100株
東京精密	30,600	3,280.00	100,368,000	貸付有価証券 4,800株
マニー	20,600	6,400.00	131,840,000	貸付有価証券 13,800株
ニコン	295,000	1,569.00	462,855,000	貸付有価証券 40,500株
トプコン	90,900	1,352.00	122,896,800	
オリンパス	1,008,700	1,200.00	1,210,440,000	貸付有価証券 133,700株
理研計器	14,900	2,162.00	32,213,800	貸付有価証券 1,900株
タムロン	15,000	2,197.00	32,955,000	貸付有価証券 1,200株
HOYA	340,800	7,515.00	2,561,112,000	
シード	7,200	1,200.00	8,640,000	貸付有価証券 2,800株
ノーリツ鋼機	13,300	2,063.00	27,437,900	貸付有価証券 5,000株(100株)
エー・アンド・デイ	15,400	927.00	14,275,800	貸付有価証券 2,000株
朝日インテック	71,800	5,140.00	369,052,000	貸付有価証券 5,600株
シチズン時計	185,200	614.00	113,712,800	貸付有価証券 25,000株
リズム時計工業	5,700	1,288.00	7,341,600	貸付有価証券

				700株
大研医器	13,400	568.00	7,611,200	貸付有価証券 3,300株(2,800株)
メニコン	23,200	3,135.00	72,732,000	貸付有価証券 300株
シンシア	2,500	592.00	1,480,000	貸付有価証券 1,300株
松風	8,300	1,256.00	10,424,800	
セイコーホールディングス	26,100	2,535.00	66,163,500	
ニプロ	117,100	1,324.00	155,040,400	貸付有価証券 37,500株
中本パックス	4,700	1,556.00	7,313,200	貸付有価証券 2,200株
スノーピーク	6,500	1,568.00	10,192,000	貸付有価証券 2,000株(1,000株)
パラマウントベッドホールディングス	19,500	5,060.00	98,670,000	
トランザクション	9,200	815.00	7,498,000	貸付有価証券 500株(500株)
S H O - B I	4,900	347.00	1,700,300	貸付有価証券 1,900株
ニホンフラッシュ	7,200	2,320.00	16,704,000	貸付有価証券 1,500株
前田工織	18,600	2,270.00	42,222,000	貸付有価証券 7,900株(2,600株)
永大産業	22,100	430.00	9,503,000	貸付有価証券 2,800株
アートネイチャー	18,100	634.00	11,475,400	
バンダイナムコホールディングス	175,000	5,070.00	887,250,000	
アイフィスジャパン	3,800	584.00	2,219,200	
共立印刷	28,100	206.00	5,788,600	
S H O E I	8,100	4,900.00	39,690,000	
フランスベッドホールディングス	23,900	913.00	21,820,700	貸付有価証券 5,100株
パイロットコーポレーション	29,500	4,540.00	133,930,000	貸付有価証券 400株
萩原工業	9,400	1,478.00	13,893,200	貸付有価証券 6,200株
トッパン・フォームズ	36,300	979.00	35,537,700	

フジシールインターナショナル	37,900	3,845.00	145,725,500	貸付有価証券 100株
タカラトミー	70,900	1,158.00	82,102,200	貸付有価証券 9,000株
廣済堂	15,700	771.00	12,104,700	貸付有価証券 2,900株
エステールホールディングス	4,500	643.00	2,893,500	貸付有価証券 500株
アーク	64,600	104.00	6,718,400	貸付有価証券 10,600株
タカノ	6,600	833.00	5,497,800	貸付有価証券 800株
プロネクサス	14,500	1,380.00	20,010,000	貸付有価証券 1,800株
ホクシン	10,400	141.00	1,466,400	貸付有価証券 1,700株
ウッドワン	5,700	1,075.00	6,127,500	貸付有価証券 700株
大建工業	12,800	2,035.00	26,048,000	貸付有価証券 1,600株
凸版印刷	238,900	1,776.00	424,286,400	
大日本印刷	238,600	2,604.00	621,314,400	貸付有価証券 20,400株
図書印刷	15,900	959.00	15,248,100	貸付有価証券 2,200株
共同印刷	5,200	2,473.00	12,859,600	貸付有価証券 600株
N I S S H A	34,700	1,250.00	43,375,000	貸付有価証券 15,700株（400株）
光村印刷	1,500	2,330.00	3,495,000	貸付有価証券 100株
宝印刷	8,200	1,704.00	13,972,800	貸付有価証券 1,000株
アシックス	159,700	1,303.00	208,089,100	貸付有価証券 106,900株
ツツミ	5,300	1,805.00	9,566,500	貸付有価証券 500株
小松ウオール工業	5,200	1,868.00	9,713,600	貸付有価証券 600株
ヤマハ	100,700	5,650.00	568,955,000	貸付有価証券 13,100株
河合楽器製作所	5,200	2,926.00	15,215,200	貸付有価証券

				700株
クリナップ	15,700	625.00	9,812,500	貸付有価証券 2,200株（200株）
ビジョン	102,300	4,815.00	492,574,500	貸付有価証券 46,600株（2,700株）
兼松サステック	1,100	1,576.00	1,733,600	
キングジム	14,100	876.00	12,351,600	貸付有価証券 1,800株
リンテック	40,200	2,482.00	99,776,400	
イトーキ	31,200	570.00	17,784,000	貸付有価証券 4,000株
任天堂	104,200	38,560.00	4,017,952,000	貸付有価証券 4,400株
三菱鉛筆	27,900	2,209.00	61,631,100	貸付有価証券 5,600株
タカラスタンダード	35,000	1,666.00	58,310,000	貸付有価証券 4,400株
コクヨ	81,200	1,615.00	131,138,000	
ナカバヤシ	16,600	514.00	8,532,400	貸付有価証券 2,100株
グロープライド	8,200	3,035.00	24,887,000	貸付有価証券 1,000株
オカムラ	59,100	1,176.00	69,501,600	貸付有価証券 7,500株
美津濃	16,800	2,511.00	42,184,800	
東京電力ホールディングス	1,351,400	628.00	848,679,200	貸付有価証券 374,700株（43,500株）
中部電力	517,900	1,598.00	827,604,200	貸付有価証券 8,000株
関西電力	690,700	1,572.50	1,086,125,750	貸付有価証券 90,100株
中国電力	234,000	1,340.00	313,560,000	貸付有価証券 156,700株
北陸電力	165,800	813.00	134,795,400	貸付有価証券 5,100株
東北電力	396,500	1,333.00	528,534,500	貸付有価証券 50,800株
四国電力	152,400	1,238.00	188,671,200	貸付有価証券 21,300株
九州電力	348,900	1,143.00	398,792,700	貸付有価証券 44,700株



北海道電力	158,400	623.00	98,683,200	貸付有価証券 20,300株
沖縄電力	31,300	1,884.00	58,969,200	
電源開発	134,700	2,548.00	343,215,600	
エフオン	8,000	806.00	6,448,000	貸付有価証券 100株
イーレックス	29,400	1,016.00	29,870,400	貸付有価証券 9,500株
レノバ	20,800	924.00	19,219,200	貸付有価証券 4,000株
東京瓦斯	332,100	2,755.00	914,935,500	貸付有価証券 42,600株
大阪瓦斯	328,500	2,057.00	675,724,500	
東邦瓦斯	83,800	4,575.00	383,385,000	貸付有価証券 8,300株
北海道瓦斯	9,100	1,441.00	13,113,100	
広島ガス	34,800	353.00	12,284,400	
西部瓦斯	19,100	2,399.00	45,820,900	貸付有価証券 2,500株
静岡ガス	52,100	919.00	47,879,900	貸付有価証券 100株
メタウォーター	8,200	3,150.00	25,830,000	
S B Sホールディングス	16,700	1,877.00	31,345,900	貸付有価証券 2,800株
東武鉄道	178,500	3,065.00	547,102,500	貸付有価証券 22,900株
相鉄ホールディングス	58,000	3,205.00	185,890,000	貸付有価証券 7,400株
東京急行電鉄	459,800	1,774.00	815,685,200	貸付有価証券 60,000株
京浜急行電鉄	231,900	1,840.00	426,696,000	貸付有価証券 30,400株
小田急電鉄	271,100	2,531.00	686,154,100	貸付有価証券 9,100株
京王電鉄	94,600	6,480.00	613,008,000	貸付有価証券 1,100株
京成電鉄	126,900	3,925.00	498,082,500	貸付有価証券 18,000株
富士急行	23,100	4,185.00	96,673,500	貸付有価証券 8,000株
新京成電鉄	4,300	2,068.00	8,892,400	貸付有価証券

				500株
東日本旅客鉄道	301,000	10,135.00	3,050,635,000	貸付有価証券 39,000株
西日本旅客鉄道	151,700	8,117.00	1,231,348,900	貸付有価証券 23,600株
東海旅客鉄道	151,600	23,975.00	3,634,610,000	貸付有価証券 19,500株
西武ホールディングス	215,800	1,804.00	389,303,200	貸付有価証券 27,600株
鴻池運輸	26,900	1,781.00	47,908,900	貸付有価証券 3,400株
西日本鉄道	46,900	2,592.00	121,564,800	
ハマキョウレックス	13,000	4,165.00	54,145,000	
サカイ引越センター	8,900	6,550.00	58,295,000	貸付有価証券 700株
近鉄グループホールディングス	160,300	4,800.00	769,440,000	貸付有価証券 200株
阪急阪神ホールディングス	213,800	4,025.00	860,545,000	貸付有価証券 27,400株
南海電気鉄道	71,500	2,874.00	205,491,000	
京阪ホールディングス	71,400	4,520.00	322,728,000	貸付有価証券 9,100株
神戸電鉄	4,100	3,940.00	16,154,000	貸付有価証券 600株
名古屋鉄道	129,700	2,950.00	382,615,000	貸付有価証券 16,900株
山陽電気鉄道	12,300	2,154.00	26,494,200	貸付有価証券 1,500株
日本通運	62,900	6,110.00	384,319,000	
ヤマトホールディングス	281,000	2,399.50	674,259,500	貸付有価証券 6,100株
山九	44,600	5,290.00	235,934,000	
丸運	9,100	281.00	2,557,100	貸付有価証券 100株
丸全昭和運輸	13,000	2,947.00	38,311,000	貸付有価証券 1,600株
センコーグループホールディングス	88,400	890.00	78,676,000	
トナミホールディングス	3,800	5,880.00	22,344,000	
ニッコンホールディングス	61,000	2,631.00	160,491,000	

日本石油輸送	1,900	2,887.00	5,485,300	貸付有価証券 200株
福山通運	20,500	4,245.00	87,022,500	
セイノーホールディングス	120,100	1,511.00	181,471,100	
エスライン	4,800	1,043.00	5,006,400	貸付有価証券 600株
神奈川中央交通	4,000	3,800.00	15,200,000	貸付有価証券 500株
日立物流	35,200	3,140.00	110,528,000	貸付有価証券 300株
丸和運輸機関	8,400	3,810.00	32,004,000	貸付有価証券 1,200株
C & F ロジホールディングス	16,200	1,227.00	19,877,400	貸付有価証券 2,000株
九州旅客鉄道	134,500	3,590.00	482,855,000	
S Gホールディングス	151,500	2,980.00	451,470,000	貸付有価証券 21,800株
日本郵船	134,100	1,833.00	245,805,300	貸付有価証券 89,700株
商船三井	95,100	2,828.00	268,942,800	貸付有価証券 14,700株
川崎汽船	49,400	1,546.00	76,372,400	貸付有価証券 29,900株（400株）
N S ユナイテッド海運	8,800	2,471.00	21,744,800	貸付有価証券 2,400株
明治海運	17,000	355.00	6,035,000	貸付有価証券 2,100株
飯野海運	75,900	396.00	30,056,400	貸付有価証券 9,700株
共栄タンカー	1,400	1,454.00	2,035,600	貸付有価証券 100株
乾汽船	14,400	860.00	12,384,000	貸付有価証券 1,900株
日本航空	293,500	3,708.00	1,088,298,000	貸付有価証券 2,100株
A N Aホールディングス	293,100	3,908.00	1,145,434,800	貸付有価証券 600株
パスコ	3,100	977.00	3,028,700	
トランコム	4,500	6,300.00	28,350,000	
日新	13,900	1,953.00	27,146,700	貸付有価証券 1,700株

三菱倉庫	55,500	3,065.00	170,107,500	貸付有価証券 17,400株
三井倉庫ホールディングス	19,600	1,728.00	33,868,800	
住友倉庫	60,300	1,413.00	85,203,900	貸付有価証券 7,500株
澁澤倉庫	8,800	1,790.00	15,752,000	貸付有価証券 500株
東陽倉庫	28,900	319.00	9,219,100	貸付有価証券 3,700株
日本トランスシティ	35,300	444.00	15,673,200	貸付有価証券 4,500株
ケイヒン	3,100	1,345.00	4,169,500	貸付有価証券 300株
中央倉庫	9,800	1,068.00	10,466,400	貸付有価証券 1,200株
川西倉庫	3,300	1,301.00	4,293,300	
安田倉庫	13,200	863.00	11,391,600	貸付有価証券 1,600株
ファイズ	2,100	806.00	1,692,600	貸付有価証券 200株
東洋埠頭	4,900	1,479.00	7,247,100	貸付有価証券 100株
宇徳	13,700	545.00	7,466,500	貸付有価証券 1,700株
上組	98,900	2,646.00	261,689,400	貸付有価証券 12,600株
サンリツ	3,800	692.00	2,629,600	
キムラユニティー	4,300	1,120.00	4,816,000	
キューソー流通システム	4,000	2,009.00	8,036,000	貸付有価証券 500株
近鉄エクスプレス	30,300	1,686.00	51,085,800	
東海運	9,100	263.00	2,393,300	貸付有価証券 200株
エーアイティー	10,400	1,082.00	11,252,800	貸付有価証券 700株
内外トランスライン	5,100	1,309.00	6,675,900	貸付有価証券 600株
日本コンセプト	4,400	1,098.00	4,831,200	
NEC ネットエスアイ	18,300	2,680.00	49,044,000	貸付有価証券 2,300株

クロスキャット	3,300	1,021.00	3,369,300	貸付有価証券 1,400株
システナ	59,200	1,303.00	77,137,600	
デジタルアーツ	8,900	9,400.00	83,660,000	貸付有価証券 3,700株（2,600株）
日鉄ソリューションズ	24,900	2,834.00	70,566,600	貸付有価証券 900株
キューブシステム	8,800	807.00	7,101,600	貸付有価証券 500株
エイジア	3,200	1,213.00	3,881,600	貸付有価証券 400株
コア	7,000	1,243.00	8,701,000	貸付有価証券 600株
ソリトンシステムズ	9,300	1,004.00	9,337,200	貸付有価証券 4,900株（100株）
ソフトクリエイティブホールディングス	7,200	1,586.00	11,419,200	貸付有価証券 900株
T I S	55,400	4,770.00	264,258,000	
ネオス	6,100	894.00	5,453,400	貸付有価証券 3,300株（500株）
電算システム	6,300	3,140.00	19,782,000	貸付有価証券 2,500株（1,700株）
グリーン	114,600	440.00	50,424,000	貸付有価証券 26,300株（5,700株）
コーエーテクモホールディングス	34,000	2,067.00	70,278,000	貸付有価証券 4,300株
三菱総合研究所	6,500	3,140.00	20,410,000	貸付有価証券 100株
ボルテージ	3,000	533.00	1,599,000	貸付有価証券 900株
電算	1,800	1,915.00	3,447,000	貸付有価証券 1,000株
A G S	9,400	707.00	6,645,800	貸付有価証券 1,200株
ファインデックス	14,000	841.00	11,774,000	貸付有価証券 5,000株（2,900株）
ブレインパッド	3,200	5,870.00	18,784,000	貸付有価証券 2,100株
K L a b	29,800	843.00	25,121,400	貸付有価証券 13,500株（3,000株）
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	22,000	1,008.00	22,176,000	貸付有価証券 900株

イーブックイニシアティブジャパン	2,600	1,676.00	4,357,600	貸付有価証券 300株
ネクソン	423,600	1,568.00	664,204,800	貸付有価証券 122,100株
アイスタイル	42,500	750.00	31,875,000	貸付有価証券 28,400株（900株）
エムアップ	5,700	2,489.00	14,187,300	貸付有価証券 2,900株（1,800株）
エイチーム	10,400	1,693.00	17,607,200	貸付有価証券 6,600株（2,000株）
テクノスジャパン	13,900	686.00	9,535,400	貸付有価証券 2,700株
e n i s h	6,000	560.00	3,360,000	貸付有価証券 3,900株
コロブラ	47,600	678.00	32,272,800	貸付有価証券 3,200株
オルトプラス	10,200	283.00	2,886,600	貸付有価証券 5,700株（700株）
ブロードリーフ	82,300	565.00	46,499,500	
クロス・マーケティンググループ	4,600	387.00	1,780,200	貸付有価証券 2,300株
デジタルハーツホールディングス	7,500	1,247.00	9,352,500	貸付有価証券 500株
メディアドゥホールディングス	5,100	2,948.00	15,034,800	貸付有価証券 2,300株
じげん	17,600	539.00	9,486,400	貸付有価証券 11,700株
ブイキューブ	8,900	517.00	4,601,300	貸付有価証券 1,700株（200株）
サイバーリンクス	2,500	1,039.00	2,597,500	貸付有価証券 300株
ディー・エル・イー	11,800	140.00	1,652,000	貸付有価証券 7,200株（2,600株）
フィックスターズ	15,900	1,324.00	21,051,600	貸付有価証券 9,300株（1,300株）
CARTA HOLDINGS	8,800	1,170.00	10,296,000	貸付有価証券 1,100株
オブティム	7,200	2,102.00	15,134,400	貸付有価証券 4,300株（1,200株）
セレス	5,400	2,080.00	11,232,000	貸付有価証券 1,800株（300株）
ティーガイア	16,600	1,787.00	29,664,200	

セック	2,700	3,610.00	9,747,000	貸付有価証券 1,700株
日本アジアグループ	17,500	336.00	5,880,000	貸付有価証券 2,600株
豆蔵ホールディングス	11,300	1,073.00	12,124,900	貸付有価証券 1,600株
テクマトリックス	11,700	1,846.00	21,598,200	
プロシップ	4,800	1,203.00	5,774,400	貸付有価証券 600株
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	400,300	351.00	140,505,300	貸付有価証券 216,900株（3,600株）
GMOペイメントゲート ウェイ	27,300	8,640.00	235,872,000	貸付有価証券 18,200株
ザッパラス	8,600	421.00	3,620,600	
システムリサーチ	2,200	2,682.00	5,900,400	
インターネットイニシア ティブ	27,000	2,249.00	60,723,000	貸付有価証券 4,700株
さくらインターネット	19,800	529.00	10,474,200	貸付有価証券 10,800株
ヴィンクス	5,600	1,094.00	6,126,400	貸付有価証券 3,700株
GMOクラウド	3,700	4,310.00	15,947,000	貸付有価証券 400株
SRAホールディングス	8,800	2,387.00	21,005,600	
Minorityソリュー ションズ	3,200	1,611.00	5,155,200	貸付有価証券 400株
システムインテグレータ	4,700	704.00	3,308,800	貸付有価証券 3,100株
朝日ネット	13,500	580.00	7,830,000	貸付有価証券 1,700株
eBASE	9,900	1,107.00	10,959,300	貸付有価証券 1,200株
アバント	5,900	1,575.00	9,292,500	貸付有価証券 400株
アドソル日進	5,900	1,628.00	9,605,200	
フリービット	9,800	1,189.00	11,652,200	貸付有価証券 6,500株（4,300株）
コムチュア	9,300	3,660.00	34,038,000	貸付有価証券 1,400株
サイバーコム	3,000	2,137.00	6,411,000	貸付有価証券 2,000株（200株）

アステリア	8,300	828.00	6,872,400	貸付有価証券 4,000株
マークラインズ	5,700	1,529.00	8,715,300	貸付有価証券 1,500株
メディカル・データ・ビ ジョン	14,700	1,022.00	15,023,400	貸付有価証券 8,100株（3,600株）
g u m i	21,200	639.00	13,546,800	貸付有価証券 3,100株
ショーケース	3,600	696.00	2,505,600	貸付有価証券 2,000株（100株）
モバイルファクトリー	4,600	1,479.00	6,803,400	貸付有価証券 1,600株
テラスカイ	1,000	3,575.00	3,575,000	貸付有価証券 500株
デジタル・インフォメー ション・テクノロジ	7,300	1,510.00	11,023,000	貸付有価証券 2,900株（800株）
P C Iホールディングス	2,900	2,366.00	6,861,400	
パイプドHD	2,600	1,054.00	2,740,400	貸付有価証券 200株
アイビーシー	2,700	1,251.00	3,377,700	貸付有価証券 1,500株
ネオジャパン	3,100	906.00	2,808,600	貸付有価証券 1,600株
P R T I M E S	1,100	2,347.00	2,581,700	貸付有価証券 700株
ランドコンピュータ	1,900	1,124.00	2,135,600	貸付有価証券 200株
ダブルスタンダード	1,100	4,925.00	5,417,500	貸付有価証券 100株
オーブンドア	8,200	3,055.00	25,051,000	貸付有価証券 400株（400株）
マイネット	5,300	951.00	5,040,300	貸付有価証券 600株
アカツキ	5,800	5,470.00	31,726,000	貸付有価証券 2,600株
ベネフィットジャパン	900	877.00	789,300	貸付有価証券 100株
U b i c o mホールディ ングス	3,000	1,453.00	4,359,000	貸付有価証券 1,000株（300株）
L I N E	50,600	3,725.00	188,485,000	貸付有価証券 33,900株（10,800株）
カナミックネットワーク	2,500	1,873.00	4,682,500	貸付有価証券



				1,500株
ノムラシステムコーポレーション	1,400	744.00	1,041,600	貸付有価証券 200株
チェンジ	2,200	3,875.00	8,525,000	貸付有価証券 1,400株(1,200株)
シンクロ・フード	7,100	559.00	3,968,900	貸付有価証券 4,100株
オークネット	8,700	1,240.00	10,788,000	貸付有価証券 2,100株
AOI TYO Holdings	18,100	754.00	13,647,400	
マクロミル	29,400	1,302.00	38,278,800	貸付有価証券 800株
ピーグリー	3,100	928.00	2,876,800	貸付有価証券 1,100株
オロ	1,600	6,620.00	10,592,000	貸付有価証券 1,000株(100株)
ソルクシーズ	7,000	796.00	5,572,000	貸付有価証券 300株
フェイス	6,500	861.00	5,596,500	貸付有価証券 800株
ハイマックス	2,000	1,829.00	3,658,000	貸付有価証券 200株
野村総合研究所	105,600	5,270.00	556,512,000	
サイバネットシステム	13,600	543.00	7,384,800	
CEホールディングス	4,400	830.00	3,652,000	貸付有価証券 1,300株
日本システム技術	2,700	1,391.00	3,755,700	貸付有価証券 300株
インテージホールディングス	21,200	949.00	20,118,800	貸付有価証券 2,700株
東邦システムサイエンス	4,900	918.00	4,498,200	貸付有価証券 600株
ソースネクスト	64,400	486.00	31,298,400	貸付有価証券 43,100株(22,100株)
インフォコム	13,600	1,738.00	23,636,800	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
F I G	14,700	317.00	4,659,900	貸付有価証券 300株
アルテリア・ネットワークス	13,800	1,042.00	14,379,600	貸付有価証券 6,400株
ヒト・コミュニケーション	3,800	1,857.00	7,056,600	貸付有価証券

ンズ・ホールディング				2,500株
フォーカスシステムズ	11,100	961.00	10,667,100	貸付有価証券 900株
クレスコ	5,000	3,345.00	16,725,000	貸付有価証券 400株
フジ・メディア・ホールディングス	172,300	1,484.00	255,693,200	
オーピック	57,600	12,020.00	692,352,000	貸付有価証券 7,300株
ジャストシステム	23,600	2,997.00	70,729,200	
TDCソフト	14,500	852.00	12,354,000	
ヤフー	1,083,000	282.00	305,406,000	貸付有価証券 100,200株
トレンドマイクロ	88,500	5,450.00	482,325,000	貸付有価証券 16,600株
IDホールディングス	4,700	1,329.00	6,246,300	貸付有価証券 1,800株
日本オラクル	33,700	7,370.00	248,369,000	貸付有価証券 18,200株
アルファシステムズ	5,200	2,697.00	14,024,400	貸付有価証券 400株
フューチャー	22,500	1,834.00	41,265,000	貸付有価証券 2,800株
CAC Holdings	11,900	1,592.00	18,944,800	
ソフトバンク・テクノロジー	7,000	2,212.00	15,484,000	貸付有価証券 1,400株(300株)
トーセ	4,500	865.00	3,892,500	貸付有価証券 2,100株(1,600株)
オーピックビジネスコンサルティング	17,000	4,640.00	78,880,000	貸付有価証券 2,800株
伊藤忠テクノソリューションズ	75,700	2,518.00	190,612,600	貸付有価証券 9,700株
アイティフォー	20,100	869.00	17,466,900	貸付有価証券 1,400株
東計電算	2,500	3,085.00	7,712,500	貸付有価証券 300株
エクスネット	3,000	909.00	2,727,000	貸付有価証券 300株
大塚商会	89,900	4,435.00	398,706,500	
サイボウズ	19,400	1,015.00	19,691,000	貸付有価証券 100株

ソフトブレーン	13,000	490.00	6,370,000	貸付有価証券 6,100株(1,400株)
電通国際情報サービス	10,300	3,635.00	37,440,500	貸付有価証券 1,300株
デジタルガレージ	32,300	3,090.00	99,807,000	貸付有価証券 8,900株
E Mシステムズ	13,500	1,480.00	19,980,000	貸付有価証券 4,600株(2,500株)
ウェザーニューズ	5,600	3,280.00	18,368,000	貸付有価証券 1,600株
C I J	13,000	823.00	10,699,000	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,700	2,079.00	3,534,300	貸付有価証券 200株
日本エンタープライズ	17,100	172.00	2,941,200	貸付有価証券 9,300株
WOWOW	8,000	2,857.00	22,856,000	貸付有価証券 3,100株
スカラ	11,600	888.00	10,300,800	貸付有価証券 2,500株
I M A G I C A G R O U P	14,000	565.00	7,910,000	貸付有価証券 7,600株(2,000株)
ネットワンシステムズ	58,800	2,698.00	158,642,400	
システムソフト	39,300	101.00	3,969,300	貸付有価証券 5,500株
アルゴグラフィックス	14,100	2,262.00	31,894,200	貸付有価証券 1,800株
マーベラス	25,400	850.00	21,590,000	貸付有価証券 7,000株
エイベックス	28,500	1,349.00	38,446,500	貸付有価証券 1,700株
日本ユニシス	51,900	2,769.00	143,711,100	
兼松エレクトロニクス	9,000	3,185.00	28,665,000	貸付有価証券 1,100株
東京放送ホールディングス	110,200	2,100.00	231,420,000	貸付有価証券 14,100株
日本テレビホールディングス	152,500	1,644.00	250,710,000	貸付有価証券 1,800株
朝日放送グループホールディングス	16,500	770.00	12,705,000	
テレビ朝日ホールディングス	45,600	1,956.00	89,193,600	貸付有価証券 500株
スカパーJ S A Tホール	126,800	442.00	56,045,600	

ディングス				
テレビ東京ホールディングス	13,600	2,324.00	31,606,400	貸付有価証券 3,400株
日本BS放送	5,600	1,072.00	6,003,200	貸付有価証券 100株(100株)
ビジョン	5,100	5,020.00	25,602,000	
スマートバリュー	3,600	767.00	2,761,200	貸付有価証券 900株
USEN-NEXT HOLDINGS	6,300	806.00	5,077,800	貸付有価証券 3,700株
ワイヤレスゲート	7,300	413.00	3,014,900	貸付有価証券 4,300株(300株)
コネクシオ	11,800	1,396.00	16,472,800	貸付有価証券 1,500株
日本通信	143,300	114.00	16,336,200	貸付有価証券 96,000株(30,600株)
クロップス	3,000	636.00	1,908,000	貸付有価証券 900株
日本電信電話	1,136,100	4,575.00	5,197,657,500	
KDDI	1,463,800	2,479.00	3,628,760,200	貸付有価証券 7,100株
ソフトバンク	1,320,900	1,341.50	1,771,987,350	貸付有価証券 885,000株(21,800株)
光通信	19,600	19,820.00	388,472,000	貸付有価証券 400株
NTTドコモ	1,051,700	2,378.00	2,500,942,600	貸付有価証券 134,900株
エムティーアイ	19,200	630.00	12,096,000	
GMOインターネット	60,500	1,807.00	109,323,500	貸付有価証券 7,700株
アイドママーケティングコミュニケーション	3,600	466.00	1,677,600	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
カドカワ	48,400	1,382.00	66,888,800	貸付有価証券 500株
学研ホールディングス	5,600	5,220.00	29,232,000	
ゼンリン	33,100	2,435.00	80,598,500	貸付有価証券 12,100株
昭文社	7,600	405.00	3,078,000	貸付有価証券 900株
インプレスホールディングス	13,700	148.00	2,027,600	貸付有価証券 1,700株

アイネット	9,400	1,292.00	12,144,800	貸付有価証券 1,200株
松竹	11,000	13,070.00	143,770,000	貸付有価証券 5,100株
東宝	109,300	4,380.00	478,734,000	貸付有価証券 4,900株
東映	7,000	14,250.00	99,750,000	
エヌ・ティ・ティ・デー タ	442,300	1,283.00	567,470,900	貸付有価証券 56,700株
ピー・シー・エー	2,100	3,390.00	7,119,000	
ビジネスブレイン太田昭 和	2,800	1,902.00	5,325,600	貸付有価証券 300株
D T S	18,600	3,900.00	72,540,000	貸付有価証券 2,300株
スクウェア・エニック ス・ホールディングス	77,300	3,785.00	292,580,500	貸付有価証券 9,900株
シーイーシー	17,800	2,109.00	37,540,200	
カブコン	71,200	2,467.00	175,650,400	
アイ・エス・ピー	3,200	1,867.00	5,974,400	貸付有価証券 500株
ジャステック	9,600	978.00	9,388,800	貸付有価証券 1,200株
S C S K	43,800	5,120.00	224,256,000	
日本システムウエア	5,500	2,195.00	12,072,500	
アイネス	21,000	1,407.00	29,547,000	
T K C	14,000	4,195.00	58,730,000	貸付有価証券 1,700株
富士ソフト	24,800	4,370.00	108,376,000	貸付有価証券 100株
N S D	27,300	2,708.00	73,928,400	
コナミホールディングス	67,900	5,060.00	343,574,000	貸付有価証券 9,300株
福井コンピュータホール ディングス	5,400	2,080.00	11,232,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
J B C Cホールディング ス	13,100	1,434.00	18,785,400	貸付有価証券 1,600株
ミロク情報サービス	16,500	2,887.00	47,635,500	貸付有価証券 8,000株(3,100株)
ソフトバンクグループ	694,200	11,470.00	7,962,474,000	
ハウスイ	1,300	879.00	1,142,700	貸付有価証券 100株

高千穂交易	6,400	980.00	6,272,000	貸付有価証券 1,000株
伊藤忠食品	4,100	4,745.00	19,454,500	貸付有価証券 500株
エレマテック	7,800	1,851.00	14,437,800	貸付有価証券 200株
JALUX	4,700	2,503.00	11,764,100	
あらた	9,200	3,995.00	36,754,000	
トーメンデバイス	2,500	2,442.00	6,105,000	貸付有価証券 300株
東京エレクトロン デバ イス	6,000	1,840.00	11,040,000	
フィールズ	14,600	751.00	10,964,600	貸付有価証券 3,100株
双日	920,900	382.00	351,783,800	
アルフレッサ ホール ディングス	185,300	2,956.00	547,746,800	貸付有価証券 23,700株
横浜冷凍	43,600	887.00	38,673,200	貸付有価証券 300株
神栄	2,300	766.00	1,761,800	貸付有価証券 200株
ラサ商事	8,800	828.00	7,286,400	貸付有価証券 200株
ラクーンホールディング ス	7,900	711.00	5,616,900	貸付有価証券 500株
アルコニックス	17,700	1,396.00	24,709,200	貸付有価証券 1,200株（100株）
神戸物産	25,200	4,400.00	110,880,000	貸付有価証券 500株
あい ホールディングス	23,800	1,842.00	43,839,600	
ディーブイエックス	6,500	925.00	6,012,500	貸付有価証券 1,300株
ダイワボウホールディン グス	15,200	5,770.00	87,704,000	
マクニカ・富士エレホー ルディングス	46,200	1,626.00	75,121,200	貸付有価証券 16,000株
ラクト・ジャパン	3,600	8,410.00	30,276,000	貸付有価証券 2,400株
パイタルケーエスケー・ ホールディングス	31,400	1,045.00	32,813,000	貸付有価証券 15,700株
八洲電機	12,900	864.00	11,145,600	

メディアスホールディングス	9,400	714.00	6,711,600	貸付有価証券 1,200株
レスターホールディングス	18,300	1,882.00	34,440,600	貸付有価証券 1,000株
ジュテックホールディングス	3,800	991.00	3,765,800	
大光	5,300	685.00	3,630,500	貸付有価証券 2,900株
OCHIホールディングス	4,800	1,223.00	5,870,400	貸付有価証券 600株
TOKAIホールディングス	88,100	922.00	81,228,200	
黒谷	2,800	461.00	1,290,800	貸付有価証券 1,500株
Cominix	2,900	843.00	2,444,700	
三洋貿易	8,400	2,240.00	18,816,000	
ビューティガレージ	2,700	1,451.00	3,917,700	貸付有価証券 1,500株
ウイン・パートナーズ	10,800	1,238.00	13,370,400	貸付有価証券 1,300株
ミタチ産業	5,000	760.00	3,800,000	貸付有価証券 1,300株
シップヘルスケアホールディングス	34,700	4,375.00	151,812,500	貸付有価証券 4,400株
明治電機工業	5,200	1,800.00	9,360,000	貸付有価証券 600株
デリカフーズホールディングス	2,900	1,393.00	4,039,700	貸付有価証券 300株
スターティアホールディングス	3,200	635.00	2,032,000	
コメダホールディングス	38,600	2,038.00	78,666,800	貸付有価証券 5,900株
富士興産	6,400	697.00	4,460,800	貸付有価証券 800株
協栄産業	2,000	1,537.00	3,074,000	
小野建	14,900	1,575.00	23,467,500	貸付有価証券 1,900株
南陽	3,400	2,034.00	6,915,600	貸付有価証券 400株
佐鳥電機	12,300	1,004.00	12,349,200	貸付有価証券 1,500株
エコートレーディング	3,800	543.00	2,063,400	貸付有価証券

				1,200株
伯東	11,400	1,215.00	13,851,000	貸付有価証券 1,400株
コンドーテック	12,900	976.00	12,590,400	貸付有価証券 1,600株
中山福	9,600	536.00	5,145,600	貸付有価証券 1,200株
ナガイレーベン	24,100	2,491.00	60,033,100	貸付有価証券 3,000株
三菱食品	18,300	2,897.00	53,015,100	貸付有価証券 2,300株
松田産業	12,200	1,387.00	16,921,400	
第一興商	24,800	5,420.00	134,416,000	
メディカルホールディングス	179,900	2,455.00	441,654,500	
S P K	3,600	2,405.00	8,658,000	
萩原電気ホールディングス	6,200	3,040.00	18,848,000	
アズワン	12,000	8,810.00	105,720,000	貸付有価証券 1,500株
スズデン	5,800	1,522.00	8,827,600	貸付有価証券 3,400株(700株)
尾家産業	5,400	1,350.00	7,290,000	貸付有価証券 600株
シモジマ	10,200	1,170.00	11,934,000	貸付有価証券 1,300株
ドウシシャ	15,700	1,801.00	28,275,700	貸付有価証券 2,000株
小津産業	3,700	1,912.00	7,074,400	貸付有価証券 2,400株
高速	9,900	1,190.00	11,781,000	貸付有価証券 1,200株
たけびし	5,800	1,414.00	8,201,200	貸付有価証券 200株
リックス	3,700	1,485.00	5,494,500	貸付有価証券 400株
丸文	14,700	670.00	9,849,000	貸付有価証券 1,800株
ハビネット	13,900	1,346.00	18,709,400	貸付有価証券 200株
橋本総業ホールディングス	3,300	1,421.00	4,689,300	貸付有価証券 400株



日本ライフライン	52,300	1,720.00	89,956,000	貸付有価証券 25,200株
タカショー	8,100	455.00	3,685,500	貸付有価証券 1,600株
エクセル	6,200	2,046.00	12,685,200	貸付有価証券 900株
マルカ	5,400	2,122.00	11,458,800	
I D O M	56,200	266.00	14,949,200	貸付有価証券 14,100株
日本エム・ディ・エム	9,700	1,227.00	11,901,900	
進和	9,800	2,261.00	22,157,800	貸付有価証券 1,200株
エスケイジャパン	4,000	559.00	2,236,000	貸付有価証券 2,600株（1,200株）
ダイترون	7,600	1,730.00	13,148,000	貸付有価証券 900株
シークス	21,200	1,833.00	38,859,600	貸付有価証券 7,400株（3,500株）
田中商事	5,600	598.00	3,348,800	貸付有価証券 200株
オーハシテクニカ	9,400	1,457.00	13,695,800	貸付有価証券 1,200株
白銅	5,400	1,540.00	8,316,000	
伊藤忠商事	1,166,200	2,003.00	2,335,898,600	貸付有価証券 137,200株
丸紅	1,644,100	802.70	1,319,719,070	貸付有価証券 210,900株
高島	2,600	1,698.00	4,414,800	貸付有価証券 300株
長瀬産業	93,700	1,716.00	160,789,200	貸付有価証券 12,000株
蝶理	10,600	1,646.00	17,447,600	貸付有価証券 200株
豊田通商	186,100	3,680.00	684,848,000	貸付有価証券 23,800株
三共生興	28,400	496.00	14,086,400	貸付有価証券 3,800株
兼松	66,600	1,240.00	82,584,000	貸付有価証券 8,500株
ツカモトコーポレーショ ン	3,000	1,169.00	3,507,000	貸付有価証券 300株
三井物産	1,373,600	1,789.00	2,457,370,400	貸付有価証券

				176,200株
日本紙パルプ商事	9,500	4,160.00	39,520,000	貸付有価証券 1,200株
日立ハイテクノロジーズ	50,700	4,730.00	239,811,000	貸付有価証券 6,500株
カメイ	21,700	1,202.00	26,083,400	
東都水産	2,300	2,308.00	5,308,400	貸付有価証券 200株
OUGホールディングス	2,600	2,615.00	6,799,000	貸付有価証券 300株
スターゼン	6,100	4,010.00	24,461,000	貸付有価証券 100株
山善	65,100	1,186.00	77,208,600	貸付有価証券 8,300株
椿本興業	3,800	3,790.00	14,402,000	
住友商事	986,100	1,606.50	1,584,169,650	
内田洋行	7,700	3,490.00	26,873,000	貸付有価証券 900株
三菱商事	1,170,000	3,020.00	3,533,400,000	貸付有価証券 150,100株
第一実業	7,600	3,340.00	25,384,000	貸付有価証券 900株
キャノンマーケティング ジャパン	47,600	2,187.00	104,101,200	
西華産業	9,400	1,358.00	12,765,200	貸付有価証券 1,300株
佐藤商事	14,900	945.00	14,080,500	貸付有価証券 1,900株
菱洋エレクトロ	16,900	1,706.00	28,831,400	貸付有価証券 2,200株
東京産業	16,600	514.00	8,532,400	
ユアサ商事	17,000	3,300.00	56,100,000	貸付有価証券 2,100株
神鋼商事	3,700	2,718.00	10,056,600	貸付有価証券 200株
小林産業	9,900	350.00	3,465,000	貸付有価証券 2,100株
阪和興業	28,900	3,360.00	97,104,000	貸付有価証券 3,700株
正栄食品工業	8,800	3,455.00	30,404,000	貸付有価証券 5,800株
カナデン	15,900	1,257.00	19,986,300	貸付有価証券

				2,000株
菱電商事	13,200	1,512.00	19,958,400	貸付有価証券 1,600株
フルサト工業	9,200	1,596.00	14,683,200	貸付有価証券 300株
岩谷産業	37,000	3,505.00	129,685,000	貸付有価証券 24,700株(11,100株)
すてきナイスグループ	7,100	956.00	6,787,600	貸付有価証券 900株
昭光通商	5,900	637.00	3,758,300	貸付有価証券 100株
ニチモウ	2,600	1,719.00	4,469,400	
極東貿易	5,100	1,587.00	8,093,700	
イワキ	20,000	448.00	8,960,000	貸付有価証券 2,500株
三愛石油	44,800	937.00	41,977,600	貸付有価証券 5,700株
稲畑産業	40,000	1,561.00	62,440,000	貸付有価証券 5,100株
G S Iクレオス	4,400	1,163.00	5,117,200	貸付有価証券 100株
明和産業	15,400	460.00	7,084,000	貸付有価証券 400株
ワキタ	35,500	1,137.00	40,363,500	貸付有価証券 4,500株
東邦ホールディングス	49,400	2,576.00	127,254,400	貸付有価証券 33,000株(18,100株)
サンゲツ	49,500	2,082.00	103,059,000	
ミツウロコグループホールディングス	24,200	845.00	20,449,000	貸付有価証券 3,200株
シナネンホールディングス	6,900	2,080.00	14,352,000	貸付有価証券 800株
伊藤忠エネクス	36,900	890.00	32,841,000	貸付有価証券 4,100株
サンリオ	51,500	2,483.00	127,874,500	貸付有価証券 10,800株
サンワテクノス	10,100	923.00	9,322,300	
リョーサン	18,400	3,055.00	56,212,000	貸付有価証券 2,300株
新光商事	15,700	1,873.00	29,406,100	貸付有価証券 2,000株
トーヨー	7,500	2,139.00	16,042,500	貸付有価証券

				900株
三信電気	11,500	1,925.00	22,137,500	貸付有価証券 2,100株
東陽テクニカ	19,200	915.00	17,568,000	貸付有価証券 2,500株
モスフードサービス	21,900	2,618.00	57,334,200	貸付有価証券 2,800株
加賀電子	16,600	2,143.00	35,573,800	貸付有価証券 3,200株
ソーダニッカ	17,200	580.00	9,976,000	貸付有価証券 1,900株
立花エレテック	12,300	1,741.00	21,414,300	貸付有価証券 1,500株
フォーバル	7,300	958.00	6,993,400	貸付有価証券 900株
PALTAC	30,100	6,230.00	187,523,000	
三谷産業	19,500	296.00	5,772,000	貸付有価証券 5,900株
太平洋興発	6,500	762.00	4,953,000	貸付有価証券 800株
西本Wismettac ホールディングス	3,800	3,990.00	15,162,000	貸付有価証券 400株
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,300	1,219.00	1,584,700	貸付有価証券 100株
国際紙パルプ商事	29,200	297.00	8,672,400	貸付有価証券 10,900株
ヤマタネ	8,300	1,581.00	13,122,300	貸付有価証券 200株
丸紅建材リース	1,600	1,882.00	3,011,200	貸付有価証券 200株
日鉄物産	11,900	4,710.00	56,049,000	
泉州電業	5,500	2,654.00	14,597,000	
トラスコ中山	34,700	2,834.00	98,339,800	貸付有価証券 6,800株
オートバックスセブン	66,300	1,947.00	129,086,100	
モリト	12,100	840.00	10,164,000	貸付有価証券 1,500株
加藤産業	26,100	3,665.00	95,656,500	貸付有価証券 3,300株
北恵	3,200	900.00	2,880,000	貸付有価証券 400株
イノテック	9,900	1,002.00	9,919,800	貸付有価証券

				1,300株
イエローハット	31,500	1,416.00	44,604,000	
J Kホールディングス	15,100	584.00	8,818,400	貸付有価証券 100株
日伝	13,800	1,652.00	22,797,600	貸付有価証券 1,700株
北沢産業	12,500	280.00	3,500,000	貸付有価証券 7,300株
杉本商事	9,000	1,911.00	17,199,000	貸付有価証券 1,100株
因幡電機産業	23,700	4,535.00	107,479,500	
東テク	5,500	2,154.00	11,847,000	
ミスミグループ本社	208,800	2,898.00	605,102,400	貸付有価証券 89,000株
アルテック	12,200	226.00	2,757,200	貸付有価証券 1,800株
タキヒヨー	5,000	1,831.00	9,155,000	貸付有価証券 600株
蔵王産業	2,700	1,349.00	3,642,300	貸付有価証券 300株
スズケン	76,000	6,290.00	478,040,000	貸付有価証券 9,700株
ジェコス	11,500	1,017.00	11,695,500	貸付有価証券 1,100株
ルネサスイーストン	15,300	418.00	6,395,400	貸付有価証券 1,900株
ローソン	42,200	5,290.00	223,238,000	貸付有価証券 27,800株
サンエー	12,600	4,185.00	52,731,000	貸付有価証券 3,300株(400株)
カワチ薬品	12,900	1,784.00	23,013,600	貸付有価証券 1,600株
エービーシー・マート	26,000	6,880.00	178,880,000	貸付有価証券 3,700株
ハードオフコーポレーション	6,600	765.00	5,049,000	貸付有価証券 800株
アスクル	17,400	2,853.00	49,642,200	貸付有価証券 5,200株
ゲオホールディングス	25,400	1,495.00	37,973,000	貸付有価証券 6,300株(6,300株)
アダストリア	23,100	2,844.00	65,696,400	貸付有価証券 600株

ジーフット	10,100	648.00	6,544,800	貸付有価証券 1,400株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,100	667.00	1,400,700	
くらコーポレーション	9,800	5,060.00	49,588,000	貸付有価証券 6,500株（1,000株）
キャンドウ	7,900	1,698.00	13,414,200	貸付有価証券 5,200株
パルグループホールディ ングス	8,500	3,380.00	28,730,000	
エディオン	70,600	934.00	65,940,400	貸付有価証券 24,800株（700株）
サーラコーポレーション	33,800	605.00	20,449,000	貸付有価証券 4,300株
ワッツ	5,500	705.00	3,877,500	
ハローズ	6,300	2,214.00	13,948,200	貸付有価証券 2,900株
フジオフードシステム	7,000	2,835.00	19,845,000	貸付有価証券 800株
あみやき亭	3,600	3,520.00	12,672,000	
ひらまつ	33,200	339.00	11,254,800	貸付有価証券 11,800株
大黒天物産	4,000	3,805.00	15,220,000	貸付有価証券 2,400株
ハニーズホールディ ングス	14,700	1,014.00	14,905,800	貸付有価証券 8,000株
ファーマライズホール ディングス	3,900	540.00	2,106,000	貸付有価証券 500株
アルペン	12,800	1,748.00	22,374,400	貸付有価証券 1,600株
ハブ	5,300	1,175.00	6,227,500	貸付有価証券 600株
クオールホールディ ングス	24,500	1,674.00	41,013,000	
ジンズ	11,300	5,760.00	65,088,000	貸付有価証券 2,400株
ビックカメラ	89,000	1,186.00	105,554,000	
D C Mホールディ ングス	89,900	1,097.00	98,620,300	貸付有価証券 60,300株
ペッパーフードサー ビス	13,100	2,264.00	29,658,400	貸付有価証券 8,500株（2,700株）
MonotaRO	105,300	2,460.00	259,038,000	貸付有価証券

				56,400株
東京一番フーズ	4,200	609.00	2,557,800	貸付有価証券 1,000株(500株)
DDホールディングス	3,700	1,954.00	7,229,800	貸付有価証券 700株
きちりホールディングス	4,400	758.00	3,335,200	貸付有価証券 2,400株
アークランドサービス ホールディングス	12,200	1,952.00	23,814,400	貸付有価証券 200株
J.フロント リテイリ ング	213,300	1,347.00	287,315,100	貸付有価証券 18,600株
ドトール・日レスホール ディングス	29,300	2,131.00	62,438,300	貸付有価証券 15,900株
マツモトキヨシホール ディングス	68,900	3,605.00	248,384,500	
ブロンコピリー	8,700	2,302.00	20,027,400	貸付有価証券 5,300株(200株)
Z O Z O	180,200	2,050.00	369,410,000	貸付有価証券 120,700株(3,700株)
トレジャー・ファクト リー	4,900	727.00	3,562,300	貸付有価証券 600株
物語コーポレーション	4,100	8,920.00	36,572,000	貸付有価証券 900株
ココカラファイン	18,700	4,365.00	81,625,500	
三越伊勢丹ホールディ ングス	311,900	1,046.00	326,247,400	貸付有価証券 40,000株
H a m e e	5,100	826.00	4,212,600	貸付有価証券 3,400株
ウエルシアホールディ ングス	44,100	4,330.00	190,953,000	貸付有価証券 22,100株
クリエイトSDホール ディングス	24,600	2,550.00	62,730,000	貸付有価証券 16,400株
丸善CHIホールディ ングス	19,500	365.00	7,117,500	貸付有価証券 2,900株
ミサワ	3,000	402.00	1,206,000	貸付有価証券 1,600株(1,300株)
ティーライフ	2,200	880.00	1,936,000	貸付有価証券 1,100株
エー・ピーカンパニー	3,100	465.00	1,441,500	貸付有価証券 2,000株(600株)
チムニー	5,100	2,641.00	13,469,100	貸付有価証券 600株

シュッピン	11,300	767.00	8,667,100	貸付有価証券 3,800株(1,500株)
ネクステージ	25,800	1,202.00	31,011,600	貸付有価証券 15,700株
ジョイフル本田	48,800	1,287.00	62,805,600	貸付有価証券 3,400株
鳥貴族	5,500	1,918.00	10,549,000	貸付有価証券 3,600株(600株)
キリン堂ホールディングス	6,600	1,689.00	11,147,400	貸付有価証券 800株
ホットランド	8,700	1,525.00	13,267,500	貸付有価証券 2,600株
すかいらくホールディングス	155,400	1,844.00	286,557,600	貸付有価証券 85,900株(18,000株)
SFPホールディングス	7,100	1,765.00	12,531,500	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
綿半ホールディングス	6,200	2,254.00	13,974,800	貸付有価証券 1,700株
ヨシックス	2,700	2,869.00	7,746,300	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	48,400	1,000.00	48,400,000	貸付有価証券 6,200株
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	673.00	4,509,100	貸付有価証券 1,600株(1,600株)
B E E N O S	3,900	1,328.00	5,179,200	
あさひ	13,800	1,341.00	18,505,800	貸付有価証券 700株
日本調剤	5,900	3,955.00	23,334,500	貸付有価証券 1,500株
コスモス薬品	7,400	17,100.00	126,540,000	貸付有価証券 4,100株
トーエル	8,000	863.00	6,904,000	貸付有価証券 5,300株
オンリー	2,800	844.00	2,363,200	貸付有価証券 300株
セブン & アイ・ホールディングス	698,800	3,773.00	2,636,572,400	貸付有価証券 74,900株
薬王堂	7,300	2,618.00	19,111,400	貸付有価証券 2,000株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	44,800	1,297.00	58,105,600	貸付有価証券 25,500株
ツルハホールディングス	36,200	9,010.00	326,162,000	貸付有価証券 4,900株



サンマルクホールディングス	13,200	2,475.00	32,670,000	
フェリシモ	3,700	998.00	3,692,600	貸付有価証券 400株
トリドールホールディングス	20,600	2,450.00	50,470,000	貸付有価証券 11,700株
T O K Y O B A S E	14,900	1,059.00	15,779,100	貸付有価証券 5,700株
ウイルプラスホールディングス	1,900	872.00	1,656,800	
ジャパンミート	6,300	1,794.00	11,302,200	
サツドラホールディングス	2,500	1,995.00	4,987,500	貸付有価証券 1,300株
デファクトスタンダード	1,100	405.00	445,500	貸付有価証券 300株
アレンザホールディングス	9,000	857.00	7,713,000	貸付有価証券 1,100株
バロックジャパンリミテッド	13,500	928.00	12,528,000	貸付有価証券 5,900株（600株）
クスリのアオキホールディングス	16,600	7,710.00	127,986,000	貸付有価証券 11,100株
力の源ホールディングス	4,700	768.00	3,609,600	貸付有価証券 2,700株
スシローグローバルホールディングス	18,300	7,050.00	129,015,000	
L I X I L ビバ	14,100	1,345.00	18,964,500	
メディカルシステムネットワーク	17,700	525.00	9,292,500	貸付有価証券 7,500株
はるやまホールディングス	7,800	824.00	6,427,200	貸付有価証券 1,000株
ノジマ	29,700	1,875.00	55,687,500	
カップ・クリエイト	23,400	1,433.00	33,532,200	貸付有価証券 3,000株
ライトオン	14,000	749.00	10,486,000	貸付有価証券 4,100株
ジーンズメイト	5,100	384.00	1,958,400	貸付有価証券 2,800株（100株）
良品計画	23,600	21,180.00	499,848,000	貸付有価証券 3,000株
三城ホールディングス	20,600	392.00	8,075,200	貸付有価証券 2,600株
アドヴァン	25,500	1,037.00	26,443,500	貸付有価証券

				3,600株
アルピス	6,300	2,283.00	14,382,900	
コナカ	21,300	446.00	9,499,800	貸付有価証券 1,100株
ハウス オブ ローゼ	2,000	1,704.00	3,408,000	貸付有価証券 900株
G - 7ホールディングス	4,900	2,377.00	11,647,300	貸付有価証券 600株
イオン北海道	16,700	738.00	12,324,600	貸付有価証券 11,100株
コジマ	24,600	538.00	13,234,800	貸付有価証券 3,900株
ヒマラヤ	5,200	890.00	4,628,000	貸付有価証券 600株
コーナン商事	21,900	2,509.00	54,947,100	
エコス	6,100	1,512.00	9,223,200	貸付有価証券 800株
ワタミ	21,900	1,567.00	34,317,300	貸付有価証券 14,600株（1,500株）
マルシェ	4,400	774.00	3,405,600	貸付有価証券 2,500株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	99,800	7,230.00	721,554,000	貸付有価証券 2,300株
西松屋チェーン	36,600	881.00	32,244,600	貸付有価証券 4,600株
ゼンショーホールディン グス	78,600	2,448.00	192,412,800	貸付有価証券 15,500株
幸楽苑ホールディングス	10,600	3,240.00	34,344,000	貸付有価証券 2,100株
ハークスレイ	3,500	1,066.00	3,731,000	貸付有価証券 400株
サイゼリヤ	27,500	2,447.00	67,292,500	貸付有価証券 5,200株
V Tホールディングス	56,500	461.00	26,046,500	
魚力	4,600	1,455.00	6,693,000	貸付有価証券 500株
ポブラ	4,300	528.00	2,270,400	貸付有価証券 500株
フジ・コーポレーション	3,300	2,226.00	7,345,800	貸付有価証券 1,800株
ユナイテッドアローズ	19,100	3,540.00	67,614,000	貸付有価証券 2,400株

ハイデイ日高	24,100	2,028.00	48,874,800	貸付有価証券 3,000株
京都きもの友禅	10,600	395.00	4,187,000	貸付有価証券 6,200株
コロワイド	55,400	2,187.00	121,159,800	貸付有価証券 18,800株
ピーシーデポコーポレーション	22,100	415.00	9,171,500	貸付有価証券 3,000株（2,900株）
壱番屋	11,700	4,455.00	52,123,500	貸付有価証券 1,500株
トップカルチャー	6,000	323.00	1,938,000	貸付有価証券 4,000株（2,600株）
P L A N T	3,800	999.00	3,796,200	貸付有価証券 400株
スギホールディングス	36,600	5,510.00	201,666,000	貸付有価証券 16,700株
ヴィア・ホールディングス	20,400	649.00	13,239,600	貸付有価証券 8,800株（1,100株）
スクロール	25,600	371.00	9,497,600	貸付有価証券 3,200株
ヨンドシーホールディングス	18,500	2,498.00	46,213,000	貸付有価証券 200株
ユニー・ファミリーマートホールディングス	186,500	3,040.00	566,960,000	貸付有価証券 62,500株
木曽路	20,400	2,612.00	53,284,800	貸付有価証券 2,600株
S R Sホールディングス	19,600	1,007.00	19,737,200	貸付有価証券 2,000株
千趣会	30,200	234.00	7,066,800	貸付有価証券 16,400株
タカキュー	12,900	184.00	2,373,600	貸付有価証券 3,300株
ケーヨー	30,800	481.00	14,814,800	貸付有価証券 13,800株（1,400株）
上新電機	19,700	2,433.00	47,930,100	貸付有価証券 2,200株
日本瓦斯	27,100	3,000.00	81,300,000	貸付有価証券 500株
ロイヤルホールディングス	29,100	2,701.00	78,599,100	貸付有価証券 4,400株
東天紅	1,200	1,254.00	1,504,800	貸付有価証券 100株

いなげや	18,600	1,287.00	23,938,200	貸付有価証券 2,400株
島忠	37,800	2,627.00	99,300,600	貸付有価証券 17,700株
チヨダ	17,500	1,739.00	30,432,500	貸付有価証券 400株
ライフコーポレーション	12,600	2,181.00	27,480,600	
リンガーハット	20,600	2,293.00	47,235,800	貸付有価証券 2,600株
MrMaxHD	22,900	469.00	10,740,100	
テンアライド	15,400	412.00	6,344,800	貸付有価証券 2,000株
AOKIホールディングス	33,300	1,145.00	38,128,500	
オークワ	23,800	1,111.00	26,441,800	貸付有価証券 3,000株
コメリ	25,700	2,598.00	66,768,600	
青山商事	29,100	2,451.00	71,324,100	
しまむら	19,400	8,530.00	165,482,000	貸付有価証券 12,900株
はせがわ	8,800	406.00	3,572,800	貸付有価証券 1,400株（400株）
高島屋	130,800	1,256.00	164,284,800	貸付有価証券 9,100株（1,500株）
松屋	33,600	994.00	33,398,400	貸付有価証券 4,700株
エイチ・ツー・オー リテイリング	85,500	1,416.00	121,068,000	貸付有価証券 7,100株
近鉄百貨店	6,400	3,265.00	20,896,000	貸付有価証券 1,600株
パルコ	16,000	1,062.00	16,992,000	
丸井グループ	141,100	2,242.00	316,346,200	貸付有価証券 31,300株
アクシアル リテイリング	13,800	3,340.00	46,092,000	貸付有価証券 1,700株
井筒屋	8,400	256.00	2,150,400	貸付有価証券 1,000株
イオン	641,600	2,058.50	1,320,733,600	貸付有価証券 34,900株（20,800株）
イズミ	33,900	4,715.00	159,838,500	貸付有価証券 200株

平和堂	33,800	2,069.00	69,932,200	貸付有価証券 4,500株
フジ	20,100	1,877.00	37,727,700	
ヤオコー	18,900	5,220.00	98,658,000	貸付有価証券 2,400株
ゼビオホールディングス	20,100	1,182.00	23,758,200	
ケーズホールディングス	173,300	965.00	167,234,500	
Olympicグループ	9,800	771.00	7,555,800	貸付有価証券 5,300株（4,000株）
日産東京販売ホールディングス	24,500	294.00	7,203,000	貸付有価証券 3,100株
Genky Drug Stores	8,100	2,661.00	21,554,100	貸付有価証券 2,400株
総合メディカルホールディングス	14,500	1,789.00	25,940,500	
ブックオフグループホールディングス	8,600	840.00	7,224,000	貸付有価証券 1,100株
アインホールディングス	22,300	8,810.00	196,463,000	貸付有価証券 14,900株
元気寿司	4,700	4,400.00	20,680,000	
ヤマダ電機	508,000	520.00	264,160,000	貸付有価証券 340,300株（133,800株）
アークランドサカモト	28,300	1,455.00	41,176,500	貸付有価証券 100株
ニトリホールディングス	72,200	13,540.00	977,588,000	
グルメ杵屋	11,900	1,167.00	13,887,300	貸付有価証券 1,500株
愛眼	13,300	260.00	3,458,000	貸付有価証券 5,300株
ケーユーホールディングス	8,700	860.00	7,482,000	貸付有価証券 1,100株
吉野家ホールディングス	58,200	1,682.00	97,892,400	貸付有価証券 37,200株（12,500株）
松屋フーズホールディングス	8,000	3,635.00	29,080,000	貸付有価証券 1,200株
サガミホールディングス	22,300	1,318.00	29,391,400	貸付有価証券 2,800株
関西スーパーマーケット	12,600	1,069.00	13,469,400	貸付有価証券 1,600株
王将フードサービス	12,200	7,340.00	89,548,000	貸付有価証券 1,500株

プレナス	18,700	1,778.00	33,248,600	貸付有価証券 8,700株
ミニストップ	12,300	1,761.00	21,660,300	貸付有価証券 2,100株
アークス	31,300	2,304.00	72,115,200	貸付有価証券 19,900株
パローホールディングス	36,000	2,665.00	95,940,000	
藤久	1,300	815.00	1,059,500	貸付有価証券 100株
ベルク	8,200	4,960.00	40,672,000	貸付有価証券 1,000株
大庄	8,900	1,540.00	13,706,000	貸付有価証券 1,100株
ファーストリテイリング	22,300	64,530.00	1,439,019,000	貸付有価証券 2,900株
サンドラッグ	62,700	2,943.00	184,526,100	
サックスパーホールディングス	14,100	1,107.00	15,608,700	
ヤマザワ	3,500	1,602.00	5,607,000	貸付有価証券 400株
やまや	2,900	2,132.00	6,182,800	
ベルーナ	40,900	833.00	34,069,700	貸付有価証券 6,100株
島根銀行	3,500	799.00	2,796,500	貸付有価証券 800株
じもとホールディングス	112,800	102.00	11,505,600	貸付有価証券 14,400株
めぶきフィナンシャルグループ	867,500	282.00	244,635,000	貸付有価証券 129,500株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	22,600	1,661.00	37,538,600	貸付有価証券 3,000株
九州フィナンシャルグループ	274,000	451.00	123,574,000	貸付有価証券 43,400株
ゆうちょ銀行	473,000	1,218.00	576,114,000	貸付有価証券 65,500株
富山第一銀行	39,800	382.00	15,203,600	貸付有価証券 5,100株
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,063,400	438.00	465,769,200	貸付有価証券 23,000株
西日本フィナンシャルホールディングス	107,000	945.00	101,115,000	貸付有価証券 13,700株
関西みらいフィナンシャル	78,400	769.00	60,289,600	貸付有価証券

ルグループ				10,100株
三十三フィナンシャルグループ	14,400	1,511.00	21,758,400	貸付有価証券 1,800株
第四北越フィナンシャルグループ	29,000	3,315.00	96,135,000	貸付有価証券 3,700株
新生銀行	122,500	1,521.00	186,322,500	貸付有価証券 100株
あおぞら銀行	93,300	2,736.00	255,268,800	貸付有価証券 11,900株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,493,400	560.60	6,443,200,040	
りそなホールディングス	1,832,200	468.20	857,836,040	
三井住友トラスト・ホールディングス	328,200	3,969.00	1,302,625,800	
三井住友フィナンシャルグループ	1,176,800	4,061.00	4,778,984,800	
千葉銀行	591,400	584.00	345,377,600	貸付有価証券 95,600株
群馬銀行	334,000	450.00	150,300,000	
武蔵野銀行	24,900	2,189.00	54,506,100	貸付有価証券 3,300株
千葉興業銀行	45,800	296.00	13,556,800	貸付有価証券 5,900株
筑波銀行	69,400	200.00	13,880,000	貸付有価証券 8,900株
七十七銀行	52,400	1,569.00	82,215,600	
青森銀行	12,900	2,834.00	36,558,600	貸付有価証券 3,500株
秋田銀行	10,700	2,178.00	23,304,600	貸付有価証券 1,800株
山形銀行	18,800	1,812.00	34,065,600	貸付有価証券 2,400株
岩手銀行	11,700	3,175.00	37,147,500	貸付有価証券 1,600株
東邦銀行	149,300	289.00	43,147,700	貸付有価証券 19,200株
東北銀行	8,500	1,070.00	9,095,000	貸付有価証券 1,000株
みちのく銀行	10,700	1,616.00	17,291,200	貸付有価証券 1,300株
ふくおかフィナンシャルグループ	147,000	2,577.00	378,819,000	貸付有価証券 7,700株

静岡銀行	420,300	834.00	350,530,200	貸付有価証券 24,700株
十六銀行	22,400	2,303.00	51,587,200	
スルガ銀行	170,800	513.00	87,620,400	貸付有価証券 101,600株
八十二銀行	302,200	477.00	144,149,400	貸付有価証券 38,700株
山梨中央銀行	20,100	1,329.00	26,712,900	貸付有価証券 2,500株
大垣共立銀行	26,400	2,504.00	66,105,600	貸付有価証券 100株
福井銀行	14,300	1,634.00	23,366,200	貸付有価証券 1,800株
北國銀行	17,700	3,375.00	59,737,500	貸付有価証券 2,200株
清水銀行	6,900	1,807.00	12,468,300	貸付有価証券 900株
富山銀行	3,200	3,040.00	9,728,000	貸付有価証券 400株
滋賀銀行	33,500	2,665.00	89,277,500	貸付有価証券 8,800株
南都銀行	19,500	2,172.00	42,354,000	
百五銀行	150,300	363.00	54,558,900	貸付有価証券 19,200株
京都銀行	59,800	4,860.00	290,628,000	貸付有価証券 13,300株
紀陽銀行	59,100	1,542.00	91,132,200	貸付有価証券 7,500株
ほくほくフィナンシャル グループ	111,100	1,181.00	131,209,100	貸付有価証券 14,300株
広島銀行	246,500	572.00	140,998,000	貸付有価証券 32,500株
山陰合同銀行	99,000	734.00	72,666,000	貸付有価証券 12,700株
中国銀行	107,800	1,143.00	123,215,400	
鳥取銀行	5,700	1,402.00	7,991,400	貸付有価証券 700株
伊予銀行	221,200	602.00	133,162,400	貸付有価証券 28,400株
百十四銀行	17,700	2,314.00	40,957,800	貸付有価証券 2,200株
四国銀行	23,700	1,016.00	24,079,200	貸付有価証券



				3,000株
阿波銀行	26,700	2,764.00	73,798,800	貸付有価証券 3,800株
大分銀行	10,200	3,365.00	34,323,000	貸付有価証券 2,300株
宮崎銀行	11,100	2,693.00	29,892,300	貸付有価証券 1,400株
佐賀銀行	10,100	1,781.00	17,988,100	貸付有価証券 1,300株
沖縄銀行	15,300	3,455.00	52,861,500	貸付有価証券 1,900株
琉球銀行	38,500	1,193.00	45,930,500	
セブン銀行	564,100	297.00	167,537,700	貸付有価証券 90,600株
みずほフィナンシャルグループ	22,687,400	174.20	3,952,145,080	貸付有価証券 2,910,700株
高知銀行	6,100	819.00	4,995,900	貸付有価証券 800株
山口フィナンシャルグループ	208,400	834.00	173,805,600	貸付有価証券 30,100株
長野銀行	5,500	1,703.00	9,366,500	貸付有価証券 700株
名古屋銀行	13,500	3,555.00	47,992,500	貸付有価証券 4,100株(2,100株)
北洋銀行	251,700	274.00	68,965,800	貸付有価証券 32,400株
愛知銀行	6,000	3,645.00	21,870,000	貸付有価証券 700株
中京銀行	6,900	2,168.00	14,959,200	貸付有価証券 1,000株
大光銀行	5,700	1,656.00	9,439,200	貸付有価証券 700株
愛媛銀行	23,300	1,057.00	24,628,100	貸付有価証券 6,100株
トマト銀行	6,400	1,062.00	6,796,800	貸付有価証券 800株
京葉銀行	73,800	672.00	49,593,600	
栃木銀行	86,400	230.00	19,872,000	貸付有価証券 11,000株
北日本銀行	5,200	1,911.00	9,937,200	貸付有価証券 800株
東和銀行	29,300	698.00	20,451,400	貸付有価証券

				3,700株
福島銀行	14,500	339.00	4,915,500	貸付有価証券 1,800株
大東銀行	8,000	637.00	5,096,000	貸付有価証券 1,000株
トモニホールディングス	129,100	409.00	52,801,900	貸付有価証券 16,500株
フィデアホールディングス	162,100	134.00	21,721,400	貸付有価証券 20,700株
池田泉州ホールディングス	177,200	279.00	49,438,800	貸付有価証券 22,700株
F P G	52,400	955.00	50,042,000	貸付有価証券 22,600株
マーキュリアインベストメント	6,400	695.00	4,448,000	貸付有価証券 2,200株
S B Iホールディングス	198,900	2,414.00	480,144,600	貸付有価証券 18,700株（6,100株）
日本アジア投資	14,100	195.00	2,749,500	貸付有価証券 4,300株（800株）
ジャフコ	27,400	4,280.00	117,272,000	貸付有価証券 3,500株
大和証券グループ本社	1,339,700	530.70	710,978,790	貸付有価証券 30,500株
野村ホールディングス	2,937,800	432.20	1,269,717,160	貸付有価証券 723,200株
岡三証券グループ	142,300	412.00	58,627,600	貸付有価証券 21,000株
丸三証券	49,600	659.00	32,686,400	貸付有価証券 28,500株
東洋証券	59,700	132.00	7,880,400	貸付有価証券 7,600株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	199,100	394.00	78,445,400	貸付有価証券 25,500株
光世証券	4,000	701.00	2,804,000	貸付有価証券 2,000株
水戸証券	48,300	197.00	9,515,100	貸付有価証券 6,500株
いちよし証券	35,000	794.00	27,790,000	
松井証券	81,800	1,016.00	83,108,800	貸付有価証券 39,500株
だいこう証券ビジネス	6,700	447.00	2,994,900	貸付有価証券 300株

マネックスグループ	155,900	371.00	57,838,900	貸付有価証券 103,100株（41,700株）
カブドットコム証券	124,600	557.00	69,402,200	貸付有価証券 7,600株
極東証券	22,400	1,062.00	23,788,800	貸付有価証券 2,800株
岩井コスモホールディングス	17,100	1,212.00	20,725,200	
藍澤證券	30,000	671.00	20,130,000	貸付有価証券 3,800株
マネーパートナーズグループ	19,500	306.00	5,967,000	貸付有価証券 8,300株（100株）
小林洋行	4,800	259.00	1,243,200	貸付有価証券 600株
かんぼ生命保険	63,100	2,204.00	139,072,400	貸付有価証券 42,200株（300株）
S O M P Oホールディングス	294,300	4,229.00	1,244,594,700	貸付有価証券 37,700株
アニコムホールディングス	13,800	3,375.00	46,575,000	貸付有価証券 9,200株
M S & A Dインシュアランスグループホール	436,500	3,416.00	1,491,084,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	137,200	2,255.00	309,386,000	貸付有価証券 38,400株
第一生命ホールディングス	944,600	1,596.50	1,508,053,900	
東京海上ホールディングス	605,200	5,629.00	3,406,670,800	貸付有価証券 77,600株
T & Dホールディングス	516,400	1,212.00	625,876,800	貸付有価証券 700株
アドバンスクリエイト	3,900	1,838.00	7,168,200	貸付有価証券 300株
全国保証	47,100	3,765.00	177,331,500	貸付有価証券 15,900株（12,800株）
ジェイリース	3,500	324.00	1,134,000	貸付有価証券 400株
イントラスト	4,700	509.00	2,392,300	貸付有価証券 1,500株
日本モーゲージサービス	2,300	1,166.00	2,681,800	貸付有価証券 1,000株
C a s a	5,600	1,041.00	5,829,600	

アルヒ	15,200	1,988.00	30,217,600	貸付有価証券 6,700株（6,700株）
プレミアグループ	7,200	1,902.00	13,694,400	
クレディセゾン	117,000	1,444.00	168,948,000	貸付有価証券 17,200株
芙蓉総合リース	19,100	5,650.00	107,915,000	
興銀リース	31,400	2,605.00	81,797,000	貸付有価証券 4,000株
東京センチュリー	33,600	5,120.00	172,032,000	貸付有価証券 4,300株
日本証券金融	73,600	580.00	42,688,000	貸付有価証券 9,400株
アイフル	254,700	260.00	66,222,000	貸付有価証券 137,800株（800株）
リコーリース	13,100	3,290.00	43,099,000	貸付有価証券 1,600株
イオンフィナンシャル サービス	106,700	2,227.00	237,620,900	貸付有価証券 29,900株
アコム	335,600	367.00	123,165,200	貸付有価証券 43,000株
ジャックス	18,400	1,784.00	32,825,600	貸付有価証券 2,300株
オリエントコーポレー ション	451,600	114.00	51,482,400	貸付有価証券 158,000株
日立キャピタル	39,400	2,577.00	101,533,800	貸付有価証券 9,000株
アプラスフィナンシャル	80,100	86.00	6,888,600	貸付有価証券 29,400株
オリックス	1,113,900	1,564.50	1,742,696,550	
三菱UFJリース	376,700	560.00	210,952,000	貸付有価証券 48,500株
九州リースサービス	8,200	648.00	5,313,600	貸付有価証券 1,000株
日本取引所グループ	451,000	1,831.00	825,781,000	
イー・ギャランティ	15,600	1,181.00	18,423,600	貸付有価証券 300株
アサックス	6,900	517.00	3,567,300	貸付有価証券 800株
NECキャピタルソ リューション	6,800	1,707.00	11,607,600	貸付有価証券 800株
いちご	212,400	380.00	80,712,000	貸付有価証券 69,800株

日本駐車場開発	201,400	169.00	34,036,600	貸付有価証券 300株
ヒューリック	348,500	1,007.00	350,939,500	貸付有価証券 25,100株
三栄建築設計	6,700	1,607.00	10,766,900	貸付有価証券 1,800株（1,000株）
スター・マイカ	7,700	1,433.00	11,034,100	貸付有価証券 4,400株
野村不動産ホールディングス	111,200	2,093.00	232,741,600	
三重交通グループホールディングス	33,800	584.00	19,739,200	貸付有価証券 5,500株
サムティ	23,100	1,420.00	32,802,000	貸付有価証券 13,900株（4,100株）
ディア・ライフ	21,400	420.00	8,988,000	貸付有価証券 3,500株
コーセーアールイー	4,900	736.00	3,606,400	貸付有価証券 1,600株
エー・ディー・ワークス	257,300	34.00	8,748,200	貸付有価証券 35,000株
日本商業開発	10,400	1,477.00	15,360,800	
プレサンスコーポレーション	26,400	1,383.00	36,511,200	
ユニゾホールディングス	25,200	2,003.00	50,475,600	貸付有価証券 2,300株
THEグローバル社	8,500	542.00	4,607,000	貸付有価証券 4,900株
日本管理センター	11,000	930.00	10,230,000	
サンセイランディック	4,400	738.00	3,247,200	貸付有価証券 400株
エストラスト	2,300	735.00	1,690,500	貸付有価証券 300株
フージャースホールディングス	36,300	657.00	23,849,100	貸付有価証券 20,100株（12,800株）
オープンハウス	27,200	3,965.00	107,848,000	貸付有価証券 13,100株（1,100株）
東急不動産ホールディングス	449,100	618.00	277,543,800	貸付有価証券 67,700株
飯田グループホールディングス	139,300	1,907.00	265,645,100	貸付有価証券 23,400株
イーランド	2,300	667.00	1,534,100	貸付有価証券 400株

ムゲンエステート	11,500	579.00	6,658,500	貸付有価証券 6,300株
ビーロッド	2,600	1,751.00	4,552,600	貸付有価証券 1,200株(200株)
ファーストブラザーズ	4,600	1,129.00	5,193,400	貸付有価証券 2,600株
ハウズドゥ	9,200	1,406.00	12,935,200	貸付有価証券 6,100株(3,500株)
シーアールイー	5,500	917.00	5,043,500	貸付有価証券 700株(200株)
プロパティエージェント	1,700	1,067.00	1,813,900	貸付有価証券 800株(300株)
ケイアイスター不動産	4,500	1,606.00	7,227,000	貸付有価証券 2,000株(1,900株)
アグレ都市デザイン	2,000	496.00	992,000	貸付有価証券 400株
グッドコムアセット	2,900	1,586.00	4,599,400	貸付有価証券 1,900株(200株)
ジェイ・エス・ピー	600	3,605.00	2,163,000	貸付有価証券 300株
テンポイノベーション	1,400	1,483.00	2,076,200	貸付有価証券 100株
グローバル・リンク・マ ネジメント	1,200	678.00	813,600	貸付有価証券 500株
パーク24	97,600	2,368.00	231,116,800	貸付有価証券 13,400株
パラカ	4,300	1,950.00	8,385,000	貸付有価証券 700株
三井不動産	885,800	2,598.50	2,301,751,300	
三菱地所	1,169,700	1,841.50	2,154,002,550	貸付有価証券 150,000株
平和不動産	31,600	2,020.00	63,832,000	貸付有価証券 100株
東京建物	182,400	1,241.00	226,358,400	貸付有価証券 47,300株
ダイビル	49,100	993.00	48,756,300	
京阪神ビルディング	29,800	1,013.00	30,187,400	貸付有価証券 3,900株
住友不動産	375,300	4,097.00	1,537,604,100	貸付有価証券 3,700株
テーオーシー	38,200	707.00	27,007,400	貸付有価証券 4,900株

東京楽天地	2,400	5,040.00	12,096,000	貸付有価証券 300株
レオパレス21	205,900	205.00	42,209,500	貸付有価証券 111,800株(46,600 株)
スターツコーポレーショ ン	22,700	2,518.00	57,158,600	貸付有価証券 2,900株
フジ住宅	21,300	828.00	17,636,400	貸付有価証券 2,700株
空港施設	19,500	550.00	10,725,000	貸付有価証券 2,500株
明和地所	9,200	561.00	5,161,200	貸付有価証券 1,100株
ゴールドクレスト	13,200	1,454.00	19,192,800	貸付有価証券 1,600株
日本エスリード	6,500	1,569.00	10,198,500	貸付有価証券 800株
日神不動産	24,700	457.00	11,287,900	貸付有価証券 3,100株
日本エスコン	30,200	764.00	23,072,800	貸付有価証券 20,200株(13,800株)
タカラレーベン	78,200	343.00	26,822,600	貸付有価証券 44,300株(3,100株)
サンヨーハウジング名古 屋	9,400	955.00	8,977,000	貸付有価証券 600株
イオンモール	83,700	1,737.00	145,386,900	貸付有価証券 100株
毎日コムネット	3,500	776.00	2,716,000	貸付有価証券 400株
ファースト住建	6,200	1,255.00	7,781,000	貸付有価証券 4,100株
カチタス	18,600	3,460.00	64,356,000	貸付有価証券 12,400株(300株)
トーセイ	23,000	954.00	21,942,000	貸付有価証券 2,900株
穴吹興産	1,800	2,931.00	5,275,800	貸付有価証券 200株
サンフロンティア不動産	23,100	1,138.00	26,287,800	貸付有価証券 2,900株
エフ・ジェー・ネクスト	14,600	911.00	13,300,600	
インテリックス	4,700	718.00	3,374,600	貸付有価証券 600株

ランドビジネス	8,400	776.00	6,518,400	貸付有価証券 2,200株
グランディハウス	14,600	425.00	6,205,000	貸付有価証券 1,800株
日本空港ビルデング	53,300	4,585.00	244,380,500	貸付有価証券 35,700株
日本工営	10,900	2,512.00	27,380,800	貸付有価証券 1,600株
L I F U L L	62,700	588.00	36,867,600	貸付有価証券 18,800株（16,500株）
ジェイエシーリクルー トメント	13,000	2,636.00	34,268,000	貸付有価証券 4,400株
日本M&Aセンター	120,600	3,110.00	375,066,000	貸付有価証券 64,700株
メンバーズ	5,400	1,792.00	9,676,800	貸付有価証券 3,600株
中広	1,700	558.00	948,600	貸付有価証券 200株
タケエイ	16,800	791.00	13,288,800	貸付有価証券 400株
E・Jホールディングス	2,000	1,199.00	2,398,000	貸付有価証券 200株
トラスト・テック	8,900	3,650.00	32,485,000	貸付有価証券 1,100株
コシダカホールディング ス	43,300	1,586.00	68,673,800	貸付有価証券 13,100株
アルトナー	2,900	881.00	2,554,900	
パソナグループ	19,700	1,650.00	32,505,000	貸付有価証券 10,000株
C D S	4,000	1,256.00	5,024,000	貸付有価証券 200株
リンクアンドモチベー ション	29,700	861.00	25,571,700	貸付有価証券 16,000株
G C A	16,400	837.00	13,726,800	貸付有価証券 500株
エス・エム・エス	59,400	2,013.00	119,572,200	貸付有価証券 17,200株
サニーサイドアップ	1,800	2,062.00	3,711,600	貸付有価証券 200株
パーソルホールディング ス	161,700	2,030.00	328,251,000	貸付有価証券 23,200株
リニカル	9,100	1,284.00	11,684,400	貸付有価証券



				2,500株(100株)
クックパッド	50,800	276.00	14,020,800	貸付有価証券 33,600株(1,000株)
エスクリ	4,400	632.00	2,780,800	貸付有価証券 100株
アイ・ケイ・ケイ	7,900	775.00	6,122,500	貸付有価証券 5,200株(200株)
学情	6,500	1,215.00	7,897,500	貸付有価証券 2,700株(400株)
スタジオアリス	8,100	2,070.00	16,767,000	貸付有価証券 2,100株
シミックホールディングス	9,000	1,585.00	14,265,000	
N J S	3,600	1,500.00	5,400,000	貸付有価証券 400株
総合警備保障	64,400	4,825.00	310,730,000	
カカクコム	121,100	2,288.00	277,076,800	貸付有価証券 17,600株
セントケア・ホールディング	8,800	530.00	4,664,000	
サイネックス	2,700	669.00	1,806,300	貸付有価証券 400株
ルネサンス	9,000	2,046.00	18,414,000	貸付有価証券 1,100株
ディップ	26,100	1,670.00	43,587,000	貸付有価証券 10,700株(5,700株)
オプトホールディング	9,900	1,819.00	18,008,100	貸付有価証券 6,600株
新日本科学	21,900	767.00	16,797,300	貸付有価証券 10,000株
ツクイ	38,100	667.00	25,412,700	
キャリアデザインセンター	4,100	1,485.00	6,088,500	貸付有価証券 1,000株
ベネフィット・ワン	44,800	2,193.00	98,246,400	貸付有価証券 20,600株(14,900株)
エムスリー	340,500	1,841.00	626,860,500	貸付有価証券 91,200株(2,200株)
ツカダ・グローバルホールディング	10,300	609.00	6,272,700	貸付有価証券 5,500株
プラス	1,200	598.00	717,600	
アウトソーシング	85,300	1,443.00	123,087,900	貸付有価証券 14,700株

ウェルネット	15,300	1,068.00	16,340,400	貸付有価証券 3,900株(1,500株)
ワールドホールディングス	4,500	1,880.00	8,460,000	
ディー・エヌ・エー	87,200	1,695.00	147,804,000	貸付有価証券 200株
博報堂DYホールディングス	224,900	1,781.00	400,546,900	貸付有価証券 28,800株
ぐるなび	23,000	610.00	14,030,000	貸付有価証券 3,100株
タカミヤ	16,700	668.00	11,155,600	貸付有価証券 2,800株(500株)
ジャパンベストレスキューシステム	12,800	1,693.00	21,670,400	貸付有価証券 100株
ファンコミュニケーションズ	44,500	665.00	29,592,500	貸付有価証券 800株
ライク	6,300	1,118.00	7,043,400	貸付有価証券 3,300株
ビジネス・ブレークスルー	6,700	364.00	2,438,800	貸付有価証券 900株
WDBホールディングス	7,400	3,140.00	23,236,000	
ティア	8,200	663.00	5,436,600	貸付有価証券 800株
CDG	1,500	1,293.00	1,939,500	貸付有価証券 500株
バリューコマース	10,900	2,117.00	23,075,300	貸付有価証券 6,100株(4,300株)
インフォマート	88,600	1,509.00	133,697,400	貸付有価証券 59,300株(40,700株)
JPHホールディングス	46,200	283.00	13,074,600	貸付有価証券 200株
EPSホールディングス	24,300	1,949.00	47,360,700	
レグス	4,000	1,105.00	4,420,000	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
プレステージ・インターナショナル	30,200	1,544.00	46,628,800	貸付有価証券 3,900株
アミューズ	9,800	2,549.00	24,980,200	貸付有価証券 1,700株
ドリームインキュベータ	4,900	1,552.00	7,604,800	
クイック	10,000	1,677.00	16,770,000	貸付有価証券 200株(200株)
TAC	8,800	228.00	2,006,400	貸付有価証券

				1,400株
ケネディクス	142,000	541.00	76,822,000	貸付有価証券 30,100株
電通	197,100	4,525.00	891,877,500	貸付有価証券 50,800株
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,200	1,358.00	8,419,600	貸付有価証券 700株
ぴあ	4,600	4,535.00	20,861,000	貸付有価証券 2,000株
イオンファンタジー	5,200	2,753.00	14,315,600	貸付有価証券 100株
シーティーエス	18,200	625.00	11,375,000	貸付有価証券 7,400株
ネクシィーズグループ	4,700	2,400.00	11,280,000	
みらかホールディングス	45,200	2,815.00	127,238,000	貸付有価証券 6,000株
アルプス技研	14,200	1,896.00	26,923,200	
ダイオーズ	3,700	1,379.00	5,102,300	貸付有価証券 400株
日本空調サービス	18,300	686.00	12,553,800	貸付有価証券 200株
オリエンタルランド	191,100	12,570.00	2,402,127,000	貸付有価証券 26,400株
ダスキン	43,500	2,679.00	116,536,500	貸付有価証券 5,500株
明光ネットワークジャパン	20,500	1,076.00	22,058,000	貸付有価証券 2,700株
ファルコホールディングス	8,900	1,307.00	11,632,300	貸付有価証券 1,200株
秀英予備校	3,500	480.00	1,680,000	貸付有価証券 600株
田谷	2,900	623.00	1,806,700	貸付有価証券 300株
ラウンドワン	50,200	1,429.00	71,735,800	貸付有価証券 6,400株
リゾートトラスト	68,400	1,571.00	107,456,400	貸付有価証券 1,000株
ピー・エム・エル	20,800	3,125.00	65,000,000	
ワタベウェディング	2,600	633.00	1,645,800	貸付有価証券 300株
りらいあコミュニケーションズ	29,200	1,023.00	29,871,600	

リソー教育	82,100	415.00	34,071,500	貸付有価証券 26,300株（2,300株）
早稲田アカデミー	4,600	688.00	3,164,800	貸付有価証券 500株
ユー・エス・エス	197,600	2,091.00	413,181,600	貸付有価証券 100株
東京個別指導学院	5,700	1,036.00	5,905,200	貸付有価証券 2,700株
サイバーエージェント	99,700	4,200.00	418,740,000	貸付有価証券 66,700株
楽天	754,000	1,224.00	922,896,000	貸付有価証券 234,000株
クリーク・アンド・リ バー社	9,500	1,285.00	12,207,500	貸付有価証券 4,100株（1,500株）
テー・オー・ダブリュー	14,200	729.00	10,351,800	貸付有価証券 1,800株
山田コンサルティンググ ループ	7,800	2,342.00	18,267,600	貸付有価証券 5,100株（700株）
セントラルスポーツ	6,000	3,220.00	19,320,000	貸付有価証券 700株
フルキャストホールディ ングス	16,200	2,422.00	39,236,400	
エン・ジャパン	17,600	3,460.00	60,896,000	貸付有価証券 1,400株（800株）
リソルホールディングス	1,800	4,000.00	7,200,000	貸付有価証券 200株
テクノプロ・ホールディ ングス	32,400	6,580.00	213,192,000	貸付有価証券 100株
アトラ	3,200	373.00	1,193,600	貸付有価証券 1,900株
インターワークス	3,100	665.00	2,061,500	貸付有価証券 100株
アイ・アールジャパン ホールディングス	4,900	1,928.00	9,447,200	貸付有価証券 200株
K e e P e r 技研	5,900	1,352.00	7,976,800	貸付有価証券 800株
ファーストロジック	3,100	571.00	1,770,100	貸付有価証券 800株
三機サービス	3,400	1,279.00	4,348,600	貸付有価証券 1,800株
G u n o s y	11,300	1,705.00	19,266,500	貸付有価証券 7,500株（400株）

デザインワン・ジャパン	3,200	366.00	1,171,200	貸付有価証券 1,700株
イー・ガーディアン	7,700	2,108.00	16,231,600	貸付有価証券 4,300株
リブセンス	8,900	278.00	2,474,200	貸付有価証券 5,900株
ジャパンマテリアル	44,200	1,673.00	73,946,600	貸付有価証券 29,600株(15,500株)
ベクトル	19,700	1,266.00	24,940,200	貸付有価証券 1,100株
ウチヤマホールディングス	8,000	496.00	3,968,000	貸付有価証券 1,000株
チャーム・ケア・コーポレーション	3,900	1,596.00	6,224,400	
ライクキッズネクスト	3,900	841.00	3,279,900	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
キャリアリンク	5,900	442.00	2,607,800	貸付有価証券 700株
I B J	10,900	975.00	10,627,500	貸付有価証券 1,700株(100株)
アサンテ	6,500	2,087.00	13,565,500	
N・フィールド	10,400	749.00	7,789,600	貸付有価証券 4,200株(2,400株)
バリューHR	3,500	2,443.00	8,550,500	貸付有価証券 100株
M&Aキャピタルパートナーズ	4,100	4,550.00	18,655,000	貸付有価証券 700株(200株)
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,700	1,123.00	7,524,100	貸付有価証券 3,600株(1,800株)
E R Iホールディングス	4,500	937.00	4,216,500	貸付有価証券 400株
アビスト	2,500	3,205.00	8,012,500	
シグマクシス	7,700	1,053.00	8,108,100	貸付有価証券 5,100株(1,800株)
ウィルグループ	10,500	1,130.00	11,865,000	貸付有価証券 600株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	22,200	310.00	6,882,000	貸付有価証券 7,100株
日本ビューホテル	5,100	1,237.00	6,308,700	貸付有価証券 2,800株
リクルートホールディングス	1,158,800	3,167.00	3,669,919,600	貸付有価証券 161,600株

エラン	11,100	1,638.00	18,181,800	貸付有価証券 1,300株
土木管理総合試験所	7,000	452.00	3,164,000	貸付有価証券 800株
日本郵政	1,325,800	1,218.00	1,614,824,400	貸付有価証券 170,000株
ベルシステム24ホールディングス	27,100	1,603.00	43,441,300	貸付有価証券 7,300株
鎌倉新書	11,800	1,296.00	15,292,800	貸付有価証券 5,600株(100株)
一蔵	1,700	538.00	914,600	貸付有価証券 200株
LITALICO	3,700	1,783.00	6,597,100	貸付有価証券 1,100株
グローバルキッズCOMPANY	1,900	1,012.00	1,922,800	貸付有価証券 600株
エボラブルアジア	4,900	2,139.00	10,481,100	貸付有価証券 800株
アトラエ	3,100	3,225.00	9,997,500	貸付有価証券 1,000株
ストライク	4,100	2,193.00	8,991,300	貸付有価証券 2,100株(900株)
ソラスト	39,600	1,041.00	41,223,600	
セラク	3,600	630.00	2,268,000	貸付有価証券 2,000株
インソース	5,300	2,260.00	11,978,000	貸付有価証券 1,000株
ベイカレント・コンサルティング	8,600	3,845.00	33,067,000	
Orchestra Holdings	2,000	872.00	1,744,000	貸付有価証券 500株
アイモバイル	3,800	879.00	3,340,200	貸付有価証券 2,500株(1,600株)
キャリアインデックス	5,500	793.00	4,361,500	貸付有価証券 3,600株
MS - Japan	6,500	1,538.00	9,997,000	貸付有価証券 200株
船場	2,600	986.00	2,563,600	貸付有価証券 300株
グレイステクノロジー	4,400	1,858.00	8,175,200	貸付有価証券 2,900株
ジャパンエレベーター	9,500	2,033.00	19,313,500	貸付有価証券

サービスホールディング				5,100株(4,200株)
フルテック	1,700	1,069.00	1,817,300	貸付有価証券 900株
グリーンズ	4,600	1,500.00	6,900,000	
ツナググループ・ホールディングス	1,400	619.00	866,600	
MS&Consulting	2,600	1,013.00	2,633,800	
日総工産	4,000	2,450.00	9,800,000	貸付有価証券 1,200株
キュービーネットホールディングス	7,300	2,483.00	18,125,900	
スプリックス	4,500	2,490.00	11,205,000	貸付有価証券 3,000株
アドバンテッジリスクマネジメント	6,300	918.00	5,783,400	貸付有価証券 2,600株
リログループ	88,400	2,967.00	262,282,800	貸付有価証券 11,300株
東祥	10,100	2,992.00	30,219,200	貸付有価証券 1,000株
エイチ・アイ・エス	28,800	3,700.00	106,560,000	貸付有価証券 19,200株
ラックランド	3,200	2,131.00	6,819,200	貸付有価証券 1,500株
共立メンテナンス	24,700	5,540.00	136,838,000	貸付有価証券 8,900株
イチネンホールディングス	16,800	1,231.00	20,680,800	貸付有価証券 2,100株
建設技術研究所	11,200	1,513.00	16,945,600	
スペース	10,500	1,299.00	13,639,500	貸付有価証券 1,300株
長大	6,400	792.00	5,068,800	貸付有価証券 200株(200株)
燦ホールディングス	3,500	2,500.00	8,750,000	貸付有価証券 400株
スバル興業	1,100	5,940.00	6,534,000	貸付有価証券 100株
東京テアトル	6,300	1,302.00	8,202,600	貸付有価証券 800株
タナベ経営	3,100	1,205.00	3,735,500	貸付有価証券 300株
ナガワ	4,500	6,060.00	27,270,000	貸付有価証券

				1,600株
よみうりランド	3,500	4,180.00	14,630,000	貸付有価証券 400株
東京都競馬	10,600	3,205.00	33,973,000	
常磐興産	6,500	1,620.00	10,530,000	貸付有価証券 2,800株
カナモト	24,200	2,661.00	64,396,200	
東京ドーム	60,500	1,077.00	65,158,500	貸付有価証券 20,800株(19,100株)
西尾レントオール	16,400	3,065.00	50,266,000	
トランス・コスモス	18,000	2,327.00	41,886,000	貸付有価証券 2,300株
乃村工藝社	37,800	3,115.00	117,747,000	
藤田観光	6,400	2,763.00	17,683,200	貸付有価証券 1,600株
KNT-CTホールディングス	8,600	1,418.00	12,194,800	貸付有価証券 1,200株
日本管財	17,300	2,013.00	34,824,900	
トーカイ	15,600	2,556.00	39,873,600	
白洋舎	1,800	2,982.00	5,367,600	
セコム	171,700	9,173.00	1,575,004,100	
セントラル警備保障	7,800	5,470.00	42,666,000	貸付有価証券 1,000株
丹青社	30,500	1,190.00	36,295,000	貸付有価証券 3,900株
メイテック	20,500	5,040.00	103,320,000	
応用地質	17,400	1,138.00	19,801,200	貸付有価証券 1,800株
船井総研ホールディングス	33,400	2,825.00	94,355,000	貸付有価証券 14,100株
進学会ホールディングス	7,400	563.00	4,166,200	貸付有価証券 900株
オオバ	12,700	670.00	8,509,000	貸付有価証券 6,900株
いであ	3,300	1,035.00	3,415,500	貸付有価証券 400株
学究社	5,300	1,287.00	6,821,100	
ベネッセホールディングス	59,200	2,993.00	177,185,600	貸付有価証券 7,500株
イオンディライト	19,900	3,810.00	75,819,000	貸付有価証券



					9,700株
	ナック	10,200	986.00	10,057,200	貸付有価証券 500株(200株)
	ニチイ学館	23,000	1,303.00	29,969,000	貸付有価証券 3,700株
	ダイセキ	27,100	2,785.00	75,473,500	貸付有価証券 3,700株
	ステップ	5,900	1,450.00	8,555,000	貸付有価証券 700株
	小計 銘柄数: 2,110			392,661,834,200	
	組入時価比率: 97.4%			100.0%	
	合計			392,661,834,200	

(注1)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 4月22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	10,445,673,000	-	10,594,800,000	148,809,156
合計	10,445,673,000	-	10,594,800,000	148,809,156

(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)

(2019年 4月22日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	4,202,731,867
コール・ローン	464,510,569
株式	560,542,111,217
投資証券	14,789,967,461
派生商品評価勘定	191,405,418
未収入金	13,964,592
未収配当金	676,323,066
差入委託証拠金	2,056,036,190
流動資産合計	582,937,050,380
資産合計	582,937,050,380
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	273,350
未払解約金	948,027,049
未払利息	1,011
その他未払費用	3,491,900
流動負債合計	951,793,310
負債合計	951,793,310
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	206,020,646,067
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	375,964,611,003
元本等合計	581,985,257,070
純資産合計	581,985,257,070
負債純資産合計	582,937,050,380

## 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	受取配当金

4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 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> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>
------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 4月22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	2.8249円
(10,000口当たり純資産額)	(28,249円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2019年 4月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
投資証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 4月22日現在	
期首	2018年 4月24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	185,370,875,367円
同期中における追加設定元本額	42,638,979,760円
同期中における一部解約元本額	21,989,209,060円
期末元本額	206,020,646,067円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	47,601,115円
バランスセレクト50	149,386,633円
バランスセレクト70	157,103,701円
野村外国株式インデックスファンド	543,508,776円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,802,353,723円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	6,492,854,068円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,532,720,577円
野村資産設計ファンド2015	18,412,202円
野村資産設計ファンド2020	21,771,320円
野村資産設計ファンド2025	33,835,822円

野村資産設計ファンド2030	38,605,804円
野村資産設計ファンド2035	29,617,550円
野村資産設計ファンド2040	67,440,162円
野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	35,996,871,066円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	1,010,117,097円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	6,955,436,654円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	4,716,390,087円
野村資産設計ファンド2045	9,866,154円
野村インデックスファンド・外国株式	4,085,972,615円
マイ・ロード	1,346,480,819円
ネクストコア	16,152,133円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	107,847,679円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,133,867,553円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	676,723,480円
野村資産設計ファンド2050	16,170,087円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,996,599円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,006,515円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,421,956円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	890,531円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	177,644,999円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	291,715,763円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,311,355円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,900,538円
インデックス・ブレンド(タイプ)	11,435,188円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,372,467円
インデックス・ブレンド(タイプ)	17,846,344円
野村6資産均等バランス	271,376,774円
野村つみたて外国株投信	2,245,032,777円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	3,811,752,351円
世界6資産分散ファンド	74,981,994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	281,419,927円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	643,340,442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)	285,574,253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)	225,023,944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)	1,356,870,374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)	2,389,356,006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)	3,074,104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)	8,846,047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)	3,621,350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)	4,702,953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)	64,749,692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)	92,481,192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)	31,680,383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)	47,352,671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)	175,603,217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)	3,292,702,511円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	393,854,447円

野村MSCI - KOKUSA Iインデックスファンド(適格機関投資家専用)	37,048,631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)	796,780,233円
野村FOFs用・外国株式MSCI - KOKUSA Iインデックスファンド(適格機関投資家専用)	16,008,912,812円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,349,268円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	12,722,880円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	14,117,305円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSA I(確定拠出年金向け)	63,637,719,345円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,405,125,667円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,768,980,729円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,354,944,294円
マイバランスDC30	913,535,954円
マイバランスDC50	1,754,570,402円
マイバランスDC70	1,401,428,372円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSA I	18,994,663,104円
野村DC運用戦略ファンド	129,881,261円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	6,621,445円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	205,249,590円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	131,067,540円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	92,150,672円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	4,934,062円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,468,398円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	11,637,692円
野村資産設計ファンド(DC)2030	562,973円
野村資産設計ファンド(DC)2040	549,618円
野村資産設計ファンド(DC)2050	1,004,071円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	50,897,786円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	28,217,199円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	9,574,985円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	14,883,238円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES, A GE CO, LLC	68,100	25.60	1,743,360.00	
		HALLIBURTON CO	119,600	31.13	3,723,148.00	
		HELMERICH & PAYNE	14,600	62.52	912,792.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	50,600	26.97	1,364,682.00	

SCHLUMBERGER LTD	191,100	45.56	8,706,516.00
TECHNIPFMC PLC	61,000	24.45	1,491,450.00
ANADARKO PETE	67,800	64.18	4,351,404.00
APACHE CORPORATION	54,100	35.87	1,940,567.00
CABOT OIL & GAS CORP	58,500	26.13	1,528,605.00
CHENIERE ENERGY INC	28,600	65.00	1,859,000.00
CHEVRON CORP	261,900	119.86	31,391,334.00
CIMAREX ENERGY CO	13,800	69.30	956,340.00
CONCHO RESOURCES INC	27,600	116.96	3,228,096.00
CONOCOPHILLIPS	158,600	65.90	10,451,740.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	13,900	49.85	692,915.00
DEVON ENERGY CORP	62,400	33.55	2,093,520.00
DIAMONDBACK ENERGY INC	21,600	107.28	2,317,248.00
EOG RESOURCES INC	80,000	103.87	8,309,600.00
EXXON MOBIL CORP	578,400	81.13	46,925,592.00
HESS CORP	36,600	65.86	2,410,476.00
HOLLYFRONTIER CORP	23,600	47.34	1,117,224.00
KINDER MORGAN INC	273,000	19.39	5,293,470.00
MARATHON OIL CORP	111,000	17.62	1,955,820.00
MARATHON PETROLEUM CORP	94,600	59.81	5,658,026.00
NOBLE ENERGY INC	64,400	27.11	1,745,884.00
OCCIDENTAL PETE CORP	102,900	61.82	6,361,278.00
ONEOK INC	56,000	69.14	3,871,840.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	37,000	21.30	788,100.00
PHILLIPS 66	59,400	95.42	5,667,948.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	23,200	175.06	4,061,392.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	19,000	24.15	458,850.00
TARGA RESOURCES CORP	29,900	39.34	1,176,266.00
VALERO ENERGY CORP	58,000	88.04	5,106,320.00
WILLIAMS COS	168,100	28.32	4,760,592.00
AIR PRODUCTS	30,400	198.10	6,022,240.00
ALBEMARLE CORP	14,800	82.57	1,222,036.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	29,200	28.01	817,892.00
CELANESE CORP-SERIES A	18,000	105.19	1,893,420.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	31,400	45.14	1,417,396.00

CHEMOURS CO/THE	23,400	39.29	919,386.00
DOW INC	104,700	57.77	6,048,519.00
DOWDUPONT INC	314,100	39.00	12,249,900.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	18,600	84.03	1,562,958.00
ECOLAB INC	36,000	183.20	6,595,200.00
FMC CORP	18,000	79.95	1,439,100.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	11,500	136.00	1,564,000.00
LINDE PLC	75,100	180.40	13,548,040.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	45,500	91.79	4,176,445.00
MOSAIC CO/THE	48,800	27.07	1,321,016.00
PPG INDUSTRIES	32,600	119.86	3,907,436.00
SHERWIN-WILLIAMS	11,650	452.43	5,270,809.50
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5,000	75.21	376,050.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	8,900	211.57	1,882,973.00
VULCAN MATERIALS CO	18,600	122.80	2,284,080.00
AVERY DENNISON CORP	12,200	113.37	1,383,114.00
BALL CORP	45,400	58.51	2,656,354.00
CROWN HOLDINGS INC	19,100	56.43	1,077,813.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	52,300	44.43	2,323,689.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	13,200	96.41	1,272,612.00
SEALED AIR CORP	21,900	45.71	1,001,049.00
WESTROCK CO	34,200	35.49	1,213,758.00
FREEMONT-MCMORAN INC	187,000	14.00	2,618,000.00
NEWMONT GOLDCORP CORP	71,700	33.04	2,368,968.00
NUCOR CORP	42,700	57.50	2,455,250.00
STEEL DYNAMICS	33,400	33.96	1,134,264.00
ARCONIC INC	57,000	20.04	1,142,280.00
BOEING CO	73,950	380.07	28,106,176.50
GENERAL DYNAMICS	34,500	176.85	6,101,325.00
HARRIS CORP	16,000	165.65	2,650,400.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,660	220.90	1,250,294.00
L3 TECHNOLOGIES INC	10,900	214.67	2,339,903.00
LOCKHEED MARTIN	34,980	314.26	10,992,814.80
NORTHROP GRUMMAN CORP	22,370	281.16	6,289,549.20
RAYTHEON COMPANY	39,400	182.49	7,190,106.00



SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	14,600	85.55	1,249,030.00	
TEXTRON INC	33,500	55.15	1,847,525.00	
TRANSDIGM GROUP INC	6,350	469.28	2,979,928.00	
UNITED TECHNOLOGIES	112,800	137.00	15,453,600.00	
ALLEGION PLC	13,600	93.75	1,275,000.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	19,400	48.97	950,018.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	127,100	36.75	4,670,925.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,100	270.64	1,380,264.00	
MASCO CORP	42,800	40.04	1,713,712.00	
OWENS CORNING INC	14,200	54.28	770,776.00	
SMITH (A.O.) CORP	18,600	56.49	1,050,714.00	
FLUOR CORP	18,400	41.05	755,320.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	17,900	76.93	1,377,047.00	
ACUITY BRANDS INC	5,000	142.44	712,200.00	
AMETEK INC	31,800	86.49	2,750,382.00	
EATON CORP PLC	60,100	85.21	5,121,121.00	
EMERSON ELEC	86,100	72.51	6,243,111.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	16,800	189.92	3,190,656.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	21,400	51.25	1,096,750.00	
3M CORP	79,700	218.88	17,444,736.00	
GENERAL ELEC CO	1,198,000	9.35	11,201,300.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	100,900	169.06	17,058,154.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	30,700	63.60	1,952,520.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	30,000	36.98	1,109,400.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	14,350	349.72	5,018,482.00	
CATERPILLAR INC DEL	81,100	143.36	11,626,496.00	
CUMMINS INC	20,500	167.84	3,440,720.00	
DEERE & COMPANY	42,200	169.05	7,133,910.00	
DOVER CORP	19,700	97.78	1,926,266.00	
FLOWSERVE CORP	17,200	49.45	850,540.00	
FORTIVE CORP	40,600	88.50	3,593,100.00	
IDEX CORP	10,300	154.52	1,591,556.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	40,500	158.33	6,412,365.00	
INGERSOLL-RAND PLC	33,400	112.79	3,767,186.00	

MIDDLEBY CORP	7,500	135.04	1,012,800.00
PACCAR	47,800	71.44	3,414,832.00
PARKER HANNIFIN CORP	18,100	189.92	3,437,552.00
PENTAIR PLC	23,200	38.22	886,704.00
SNAP-ON INC	7,400	168.07	1,243,718.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	21,100	145.74	3,075,114.00
WABCO HOLDINGS INC	7,000	133.00	931,000.00
WABTEC CORP	17,934	77.93	1,397,596.62
XYLEM INC	23,900	82.93	1,982,027.00
AERCAP HOLDINGS NV	16,900	49.41	835,029.00
FASTENAL CO	38,700	71.08	2,750,796.00
GRAINGER(W.W.) INC	6,430	308.18	1,981,597.40
HD SUPPLY HOLDINGS INC	22,900	44.43	1,017,447.00
UNITED RENTALS INC	11,200	136.00	1,523,200.00
CINTAS CORP	12,700	213.68	2,713,736.00
COPART INC	27,900	65.06	1,815,174.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	30,800	79.04	2,434,432.00
ROLLINS INC	21,000	43.30	909,300.00
WASTE CONNECTIONS INC	36,800	88.55	3,258,640.00
WASTE MANAGEMENT INC	57,800	105.78	6,114,084.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	18,300	89.99	1,646,817.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	23,000	80.43	1,849,890.00
FEDEX CORPORATION	34,400	198.15	6,816,360.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	94,600	114.15	10,798,590.00
XPO LOGISTICS INC	18,000	66.03	1,188,540.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,600	34.37	501,802.00
DELTA AIR LINES INC	22,400	58.17	1,303,008.00
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	52.18	1,033,164.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	9,200	88.28	812,176.00
AMERCO	1,170	368.02	430,583.40
CSX CORP	109,000	78.97	8,607,730.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	11,800	97.21	1,147,078.00
KANSAS CITY SOUTHERN	14,200	125.03	1,775,426.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,700	34.72	579,824.00

NORFOLK SOUTHERN CORP	37,100	198.58	7,367,318.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,600	155.23	1,334,978.00
UNION PAC CORP	100,500	176.66	17,754,330.00
APTIV PLC	36,700	90.34	3,315,478.00
AUTOLIV INC	11,900	86.75	1,032,325.00
BORGWARNER INC	29,600	44.00	1,302,400.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	34,000	20.51	697,340.00
LEAR CORP	9,300	157.83	1,467,819.00
FORD MOTOR COMPANY	516,000	9.55	4,927,800.00
GENERAL MOTORS CO	175,700	40.30	7,080,710.00
HARLEY-DAVIDSON INC	22,400	40.89	915,936.00
TESLA INC	17,520	273.26	4,787,515.20
DR HORTON INC	48,000	46.42	2,228,160.00
GARMIN LTD	15,200	86.53	1,315,256.00
LEGGETT & PLATT INC	18,900	43.27	817,803.00
LENNAR CORP-A	40,700	52.91	2,153,437.00
MOHAWK INDUSTRIES	8,700	131.77	1,146,399.00
NEWELL BRANDS INC	67,000	15.15	1,015,050.00
NVR INC	480	3,084.12	1,480,377.60
PULTEGROUP INC	37,900	30.39	1,151,781.00
WHIRLPOOL CORP	9,300	139.06	1,293,258.00
HASBRO INC	15,800	88.78	1,402,724.00
MATTEL INC	48,000	12.49	599,520.00
POLARIS INDUSTRIES INC	8,300	98.79	819,957.00
CAPRI HOLDINGS LTD	19,900	49.22	979,478.00
HANESBRANDS INC	51,000	18.89	963,390.00
LULULEMON ATHLETICA INC	13,800	173.31	2,391,678.00
NIKE INC-B	174,200	89.20	15,538,640.00
PVH CORP	9,900	132.20	1,308,780.00
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	131.10	1,022,580.00
TAPESTRY INC	38,300	32.55	1,246,665.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	24,000	22.16	531,840.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	25,000	19.74	493,500.00
V F CORP	45,400	95.55	4,337,970.00
ARAMARK	35,400	31.65	1,120,410.00

CARNIVAL CORP	58,600	53.63	3,142,718.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,390	700.00	2,373,000.00
DARDEN RESTAURANTS INC	16,600	116.87	1,940,042.00
DOMINOS PIZZA INC	5,270	267.61	1,410,304.70
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	39,500	87.23	3,445,585.00
LAS VEGAS SANDS CORP	54,900	68.22	3,745,278.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	39,400	134.41	5,295,754.00
MCDONALD'S CORP	105,600	194.91	20,582,496.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	25.79	876,860.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	70,000	27.52	1,926,400.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	30,200	56.92	1,718,984.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	22,700	120.99	2,746,473.00
STARBUCKS CORP	169,600	76.06	12,899,776.00
VAIL RESORTS INC	5,410	209.47	1,133,232.70
WYNN RESORTS LTD	13,800	142.44	1,965,672.00
YUM BRANDS INC	42,200	103.32	4,360,104.00
GENUINE PARTS CO	19,600	105.45	2,066,820.00
LKQ CORP	45,000	30.78	1,385,100.00
AMAZON.COM INC	56,820	1,861.69	105,781,225.80
BOOKING HOLDINGS INC	6,330	1,844.31	11,674,482.30
EBAY INC	123,700	35.98	4,450,726.00
EXPEDIA GROUP INC	17,300	124.51	2,154,023.00
GRUBHUB INC	11,900	64.07	762,433.00
MERCADOLIBRE INC	5,710	492.00	2,809,320.00
QURATE RETAIL INC - A	58,000	16.78	973,240.00
WAYFAIR INC - CLASS A	7,500	145.21	1,089,075.00
DOLLAR GENERAL CORP	36,100	123.55	4,460,155.00
DOLLAR TREE INC	32,400	108.67	3,520,908.00
KOHL'S CORP	22,500	70.37	1,583,325.00
MACYS INC	43,700	25.08	1,095,996.00
NORDSTROM INC	15,000	43.86	657,900.00
TARGET CORP	68,600	83.26	5,711,636.00
ADVANCE AUTO PARTS	9,900	175.40	1,736,460.00
AUTOZONE	3,410	1,045.05	3,563,620.50
BEST BUY COMPANY INC	33,800	73.64	2,489,032.00

BURLINGTON STORES INC	8,900	163.99	1,459,511.00	
CARMAX INC	23,900	77.00	1,840,300.00	
GAP INC	31,500	25.97	818,055.00	
HOME DEPOT	154,800	205.66	31,836,168.00	
L BRANDS, INC	30,300	25.68	778,104.00	
LOWES COS INC	109,800	113.74	12,488,652.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,070	399.46	4,422,022.20	
ROSS STORES INC	50,500	100.00	5,050,000.00	
TIFFANY & CO	14,400	107.12	1,542,528.00	
TJX COS INC	169,600	55.12	9,348,352.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	16,300	103.09	1,680,367.00	
ULTA BEAUTY INC	7,890	350.88	2,768,443.20	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	59,700	245.81	14,674,857.00	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	7.81	351,450.00	
KROGER CO	107,600	25.78	2,773,928.00	
SYSCO CORP	67,800	70.99	4,813,122.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	110,100	54.63	6,014,763.00	
WALMART INC	198,900	103.18	20,522,502.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	35,600	52.85	1,881,460.00	
COCA COLA CO	552,000	47.48	26,208,960.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	29,200	52.04	1,519,568.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	22,800	198.80	4,532,640.00	
MOLSON COORS BREWING CO-B	25,600	61.40	1,571,840.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	55,900	55.20	3,085,680.00	
PEPSICO INC	192,600	127.09	24,477,534.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	75,500	42.76	3,228,380.00	
BUNGE LIMITED	19,100	51.13	976,583.00	
CAMPBELL SOUP CO	24,800	39.39	976,872.00	
CONAGRA BRANDS INC	66,700	30.52	2,035,684.00	
GENERAL MILLS	80,500	51.72	4,163,460.00	
HERSHEY CO/THE	19,000	116.96	2,222,240.00	
HORMEL FOODS CORP	39,100	40.39	1,579,249.00	
INGREDION INC	9,600	93.48	897,408.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,900	120.70	1,919,130.00	
KELLOGG CO	35,600	58.45	2,080,820.00	

KRAFT HEINZ CO/THE	84,700	32.96	2,791,712.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	19,300	67.62	1,305,066.00	
MCCORMICK & CO INC.	16,800	154.38	2,593,584.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	198,500	50.09	9,942,865.00	
TYSON FOODS INC-CL A	41,000	73.49	3,013,090.00	
ALTRIA GROUP INC	256,100	54.37	13,924,157.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	212,100	84.49	17,920,329.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	32,900	73.83	2,429,007.00	
CLOROX CO	17,700	153.48	2,716,596.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	112,700	69.35	7,815,745.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	46,900	123.55	5,794,495.00	
PROCTER & GAMBLE CO	340,300	106.05	36,088,815.00	
COTY INC-CL A	65,000	11.26	731,900.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	29,900	170.33	5,092,867.00	
ABBOTT LABORATORIES	239,600	73.92	17,711,232.00	
ABIOMED INC	5,870	256.56	1,506,007.20	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,200	281.49	2,871,198.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	69,600	74.33	5,173,368.00	
BECTON,DICKINSON	36,900	227.89	8,409,141.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	189,100	35.11	6,639,301.00	
DANAHER CORP	86,000	126.77	10,902,220.00	
DENTSPLY SIRONA INC	30,300	49.73	1,506,819.00	
DEXCOM INC	11,600	114.29	1,325,764.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	28,400	177.26	5,034,184.00	
HOLOGIC INC	40,800	43.40	1,770,720.00	
IDEXX LABORATORIES INC	12,100	218.49	2,643,729.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	15,540	528.06	8,206,052.40	
MEDTRONIC PLC	183,800	84.22	15,479,636.00	
RESMED INC	19,200	99.22	1,905,024.00	
STRYKER CORP	46,500	180.26	8,382,090.00	
TELEFLEX INC	6,320	277.05	1,750,956.00	
THE COOPER COMPANIES, INC.	6,580	281.22	1,850,427.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12,900	130.78	1,687,062.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	28,400	120.00	3,408,000.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	22,000	72.45	1,593,900.00	

ANTHEM INC	35,480	239.62	8,501,717.60
CARDINAL HEALTH INC	41,000	46.00	1,886,000.00
CENTENE CORP	55,800	48.20	2,689,560.00
CIGNA CORP	51,900	149.00	7,733,100.00
CVS HEALTH CORP	178,100	52.63	9,373,403.00
DAVITA INC	17,500	52.23	914,025.00
HCA HEALTHCARE INC	37,500	115.24	4,321,500.00
HENRY SCHEIN INC	20,500	61.50	1,260,750.00
HUMANA INC	18,590	240.69	4,474,427.10
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,200	145.22	2,062,124.00
MCKESSON CORP	27,000	114.10	3,080,700.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	19,100	85.75	1,637,825.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	131,380	221.75	29,133,515.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	11,800	124.51	1,469,218.00
WELLCARE HEALTH PLANS INC	7,050	252.29	1,778,644.50
ABBVIE INC	205,900	77.57	15,971,663.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	30,700	126.01	3,868,507.00
ALKERMES PLC	20,100	33.58	674,958.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,700	82.07	1,042,289.00
AMGEN INC	87,200	177.47	15,475,384.00
BEIGENE, LTD ADR	4,600	119.80	551,080.00
BIOGEN INC	27,510	226.39	6,227,988.90
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	24,100	83.16	2,004,156.00
CELGENE CORP	96,200	93.76	9,019,712.00
GILEAD SCIENCES INC	176,200	62.95	11,091,790.00
INCYTE CORP	24,900	73.96	1,841,604.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,040	333.34	3,680,073.60
SEATTLE GENETICS INC	15,400	69.18	1,065,372.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	6,300	100.34	632,142.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	35,000	168.16	5,885,600.00
ALLERGAN PLC	46,400	140.31	6,510,384.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	222,200	45.52	10,114,544.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,136	31.11	1,124,190.96
ELI LILLY & CO.	122,440	115.20	14,105,088.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,800	128.44	1,001,832.00

JOHNSON & JOHNSON	366,500	137.52	50,401,080.00
MERCK & CO INC	356,400	73.19	26,084,916.00
MYLAN NV	69,300	26.85	1,860,705.00
NEKTAR THERAPEUTICS	25,000	31.68	792,000.00
PERRIGO CO PLC	16,500	48.82	805,530.00
PFIZER INC	792,400	39.38	31,204,712.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	133,000	14.36	1,909,880.00
ZOETIS INC	66,000	99.03	6,535,980.00
BANK OF AMERICA CORP	1,273,500	30.03	38,243,205.00
BB&T CORPORATION	104,900	49.35	5,176,815.00
CIT GROUP INC	13,400	50.53	677,102.00
CITIGROUP	334,500	69.67	23,304,615.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	63,900	35.36	2,259,504.00
COMERICA INC	23,000	78.25	1,799,750.00
EAST WEST BANCORP INC	20,700	49.75	1,029,825.00
FIFTH THIRD BANCORP	106,300	27.50	2,923,250.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	22,600	103.62	2,341,812.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	141,000	13.61	1,919,010.00
JPMORGAN CHASE & CO	454,400	113.46	51,556,224.00
KEYCORP	146,000	16.79	2,451,340.00
M & T BANK CORP	17,900	166.34	2,977,486.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	50,000	17.13	856,500.00
PNC FINANCIAL	62,700	133.19	8,351,013.00
REGIONS FINANCIAL CORP	139,000	15.25	2,119,750.00
SIGNATURE BANK	7,600	126.38	960,488.00
SUNTRUST BKS INC.	60,700	63.49	3,853,843.00
SVB FINANCIAL GROUP	7,400	243.14	1,799,236.00
US BANCORP	211,200	51.21	10,815,552.00
WELLS FARGO CO	612,900	47.58	29,161,782.00
ZIONS BANCORP NA	27,500	47.30	1,300,750.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	31,000	22.60	700,600.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	176,800	209.99	37,126,232.00
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	42,000	20.16	846,720.00
VOYA FINANCIAL INC	21,700	54.66	1,186,122.00
AFLAC INC	105,300	48.92	5,151,276.00



ALLEGHANY CORP	2,100	646.92	1,358,532.00
ALLSTATE CORP	46,600	96.72	4,507,152.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	10,800	100.00	1,080,000.00
AMERICAN INTL GROUP	119,800	46.04	5,515,592.00
AON PLC	32,900	175.17	5,763,093.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,000	32.53	1,821,680.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,900	80.42	2,002,458.00
ASSURANT INC	7,600	93.23	708,548.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,400	43.78	936,892.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	13,900	41.19	572,541.00
CHUBB LTD	63,300	138.66	8,777,178.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	21,600	86.60	1,870,560.00
EVEREST RE GROUP LTD	5,600	229.04	1,282,624.00
FNF GROUP	37,200	38.92	1,447,824.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	48,200	50.94	2,455,308.00
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	66.19	1,979,081.00
LOEWS CORP	36,100	48.82	1,762,402.00
MARKEL CORP	1,860	1,014.82	1,887,565.20
MARSH & MCLENNAN COS	69,100	93.72	6,476,052.00
METLIFE INC	115,900	45.32	5,252,588.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	38,000	55.22	2,098,360.00
PROGRESSIVE CO	80,800	75.00	6,060,000.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	57,200	103.83	5,939,076.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	9,000	151.61	1,364,490.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,900	152.98	902,582.00
TORCHMARK CORP	14,000	88.74	1,242,360.00
TRAVELERS COS INC/THE	36,700	138.93	5,098,731.00
UNUM GROUP	31,200	36.58	1,141,296.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	17,800	177.37	3,157,186.00
WR BERKLEY CORP	19,500	58.35	1,137,825.00
ACCENTURE PLC-CL A	87,000	178.61	15,539,070.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	22,500	75.34	1,695,150.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,600	162.60	1,073,160.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	59,500	162.44	9,665,180.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	16,300	112.79	1,838,477.00

INC				
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	80,400	71.34	5,735,736.00	
DXC TECHNOLOGY CO	37,800	64.58	2,441,124.00	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	45,100	110.89	5,001,139.00	
FIRST DATA CORP- CLASS A	74,000	25.12	1,858,880.00	
FISERV INC	54,100	85.06	4,601,746.00	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	12,100	251.42	3,042,182.00	
GARTNER INC	12,700	157.20	1,996,440.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	21,200	139.67	2,961,004.00	
GODADDY INC - CLASS A	22,700	78.27	1,776,729.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	124,400	140.33	17,457,052.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	10,600	143.50	1,521,100.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	20,000	65.25	1,305,000.00	
MASTERCARD INC	125,900	240.89	30,328,051.00	
PAYCHEX INC	45,000	81.59	3,671,550.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	152,600	107.36	16,383,136.00	
SABRE CORP	36,000	21.93	789,480.00	
SQUARE INC - A	41,800	70.74	2,956,932.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	22,200	100.54	2,231,988.00	
VERISIGN INC	14,700	186.65	2,743,755.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	240,400	160.16	38,502,464.00	
WESTERN UNION CO	59,000	19.30	1,138,700.00	
WIX.COM LTD	5,700	122.75	699,675.00	
WORLDPAY INC - CL A	40,700	111.23	4,527,061.00	
ADOBE INC	66,570	270.57	18,011,844.90	
ANSYS INC	11,500	186.59	2,145,785.00	
AUTODESK INC.	30,000	169.20	5,076,000.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	37,800	63.37	2,395,386.00	
CDK GLOBAL INC	16,700	60.75	1,014,525.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	17,200	119.99	2,063,828.00	
CITRIX SYSTEMS INC	18,500	100.11	1,852,035.00	
FORTINET INC	19,900	91.08	1,812,492.00	
INTUIT INC	33,700	257.77	8,686,849.00	
MICROSOFT CORP	997,000	123.37	122,999,890.00	
ORACLE CORPORATION	363,100	54.52	19,796,212.00	

PALO ALTO NETWORKS INC	12,600	235.46	2,966,796.00
PTC INC	14,700	97.60	1,434,720.00
RED HAT INC	24,300	181.94	4,421,142.00
SALESFORCE.COM INC	104,300	155.99	16,269,757.00
SERVICENOW INC	24,800	237.40	5,887,520.00
SPLUNK INC	19,700	128.08	2,523,176.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	30,600	64.21	1,964,826.00
SYMANTEC CORP	83,000	24.40	2,025,200.00
SYNOPSYS INC	20,700	115.98	2,400,786.00
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	10,200	118.57	1,209,414.00
VMWARE INC - CLASS A	11,600	188.09	2,181,844.00
WORKDAY INC-CLASS A	20,700	187.83	3,888,081.00
ARISTA NETWORKS INC	7,400	323.38	2,393,012.00
CISCO SYSTEMS	616,300	56.40	34,759,320.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22,800	26.01	593,028.00
F5 NETWORKS INC	8,100	163.40	1,323,540.00
JUNIPER NETWORKS INC	46,700	28.01	1,308,067.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22,100	143.36	3,168,256.00
APPLE INC	648,800	203.86	132,264,368.00
DELL TECHNOLOGIES-C	20,790	62.85	1,306,651.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	200,000	16.66	3,332,000.00
HP INC	219,000	20.52	4,493,880.00
NETAPP INC	35,200	77.69	2,734,688.00
SEAGATE TECHNOLOGY	37,800	50.50	1,908,900.00
WESTERN DIGITAL CORP	38,300	55.39	2,121,437.00
XEROX CORP	28,900	34.56	998,784.00
AMPHENOL CORP-CL A	41,300	104.57	4,318,741.00
ARROW ELECTRS INC	12,100	84.96	1,028,016.00
CDW CORPORATION	21,100	105.39	2,223,729.00
COGNEX CORP	24,800	56.50	1,401,200.00
CORNING INC	108,000	34.85	3,763,800.00
FLEX LTD	76,000	11.21	851,960.00
FLIR SYSTEMS INC	17,800	49.98	889,644.00
IPG PHOTONICS CORP	4,730	175.48	830,020.40
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	25,200	89.84	2,263,968.00

TE CONNECTIVITY LTD	47,900	89.43	4,283,697.00	
TRIMBLE INC	34,900	41.14	1,435,786.00	
ADVANCED MICRO DEVICES	126,000	27.68	3,487,680.00	
ANALOG DEVICES INC	51,000	114.79	5,854,290.00	
APPLIED MATERIALS	136,300	43.95	5,990,385.00	
BROADCOM INC	56,580	318.62	18,027,519.60	
INTEL CORP	625,600	58.49	36,591,344.00	
KLA TENCOR CORP	21,900	124.20	2,719,980.00	
LAM RESEARCH	21,200	194.77	4,129,124.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	86,000	24.85	2,137,100.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	37,400	59.77	2,235,398.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	33,000	98.71	3,257,430.00	
MICRON TECHNOLOGY	154,500	43.40	6,705,300.00	
NVIDIA CORP	79,600	186.30	14,829,480.00	
NXP SEMICONDUCTORS NV	46,800	100.59	4,707,612.00	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	59,000	22.62	1,334,580.00	
QORVO INC	17,600	76.68	1,349,568.00	
QUALCOMM INC	165,500	79.89	13,221,795.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	23,800	90.00	2,142,000.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	131,400	115.51	15,178,014.00	
XILINX INC	34,900	134.95	4,709,755.00	
AT & T INC	993,800	32.03	31,831,414.00	
CENTURYLINK INC	136,000	12.14	1,651,040.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	564,300	58.04	32,751,972.00	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	26,400	31.71	837,144.00	
SPRINT CORP	109,000	5.77	628,930.00	
T-MOBILE US INC	47,200	73.75	3,481,000.00	
ALLIANT ENERGY CORP	31,000	45.98	1,425,380.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	68,300	83.01	5,669,583.00	
DUKE ENERGY CORP	97,300	89.14	8,673,322.00	
EDISON INTERNATIONAL	45,000	63.09	2,839,050.00	
ENERGY CORP	25,400	93.46	2,373,884.00	
EVERGY INC	37,200	56.57	2,104,404.00	
EVERSOURCE ENERGY	44,200	69.96	3,092,232.00	
EXELON CORPORATION	132,200	49.40	6,530,680.00	

FIRSTENERGY CORP	71,400	40.50	2,891,700.00	
NEXTERA ENERGY INC	65,100	189.36	12,327,336.00	
OGE ENERGY CORP	28,600	41.43	1,184,898.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	15,400	94.07	1,448,678.00	
PPL CORPORATION	97,600	30.97	3,022,672.00	
SOUTHERN CO.	140,200	51.96	7,284,792.00	
XCEL ENERGY INC	70,800	54.68	3,871,344.00	
ATMOS ENERGY CORP	15,600	99.18	1,547,208.00	
UGI CORP	22,700	52.51	1,191,977.00	
AMEREN CORPORATION	32,800	70.48	2,311,744.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	70,400	30.29	2,132,416.00	
CMS ENERGY CORP	37,800	53.81	2,034,018.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	42,300	83.61	3,536,703.00	
DOMINION ENERGY INC	102,439	74.92	7,674,729.88	
DTE ENERGY COMPANY	25,100	123.21	3,092,571.00	
NISOURCE INC	47,600	27.56	1,311,856.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	69,500	58.87	4,091,465.00	
SEMPRA ENERGY	37,100	127.41	4,726,911.00	
WEC ENERGY GROUP INC	43,500	76.29	3,318,615.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24,700	104.70	2,586,090.00	
ALLY FINANCIAL INC	57,400	29.73	1,706,502.00	
AMERICAN EXPRESS CO	99,900	113.67	11,355,633.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	65,600	88.11	5,780,016.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	46,300	77.15	3,572,045.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	87,200	33.34	2,907,248.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	7,500	113.64	852,300.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,200	143.27	2,750,784.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	136,800	48.41	6,622,488.00	
BLACKROCK INC	16,130	465.69	7,511,579.70	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,000	101.26	1,518,900.00	
CME GROUP INC	48,800	176.36	8,606,368.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	51.14	1,789,900.00	
EATON VANCE CORP	16,400	41.68	683,552.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	35.30	1,532,020.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	45,700	205.91	9,410,087.00	

INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	78,500	79.86	6,269,010.00
INVESCO LTD	58,000	21.53	1,248,740.00
KKR & CO INC-A	68,000	23.76	1,615,680.00
MOODYS CORP	23,500	189.06	4,442,910.00
MORGAN STANLEY	175,300	47.55	8,335,515.00
MSCI INC	12,000	221.35	2,656,200.00
NASDAQ INC	15,400	89.99	1,385,846.00
NORTHERN TRUST CORP	28,400	91.87	2,609,108.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,700	89.19	1,578,663.00
S&P GLOBAL INC	34,400	217.20	7,471,680.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	166,200	45.55	7,570,410.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	58.34	1,114,294.00
STATE STREET CORP	52,200	69.96	3,651,912.00
T ROWE PRICE GROUP INC	32,400	105.90	3,431,160.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	37,900	53.53	2,028,787.00
H & R BLOCK INC	27,900	27.00	753,300.00
AES CORP	91,000	17.72	1,612,520.00
NRG ENERGY INC	40,000	41.00	1,640,000.00
VISTRA ENERGY CORP	48,200	26.01	1,253,682.00
CERNER CORP	40,600	62.71	2,546,026.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	16,700	127.83	2,134,761.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,400	76.17	3,381,948.00
ILLUMINA INC	20,110	319.03	6,415,693.30
IQVIA HOLDINGS INC	22,400	133.01	2,979,424.00
METTLER-TOLEDO INTL	3,420	728.73	2,492,256.60
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	54,870	259.78	14,254,128.60
WATERS CORP	10,600	239.58	2,539,548.00
COSTAR GROUP INC	5,130	481.72	2,471,223.60
EQUIFAX INC	16,100	125.70	2,023,770.00
IHS MARKIT LTD	54,700	55.01	3,009,047.00
MANPOWERGROUP INC	8,000	97.04	776,320.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	47,200	26.23	1,238,056.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	68.15	1,165,365.00
TRUNSON	25,300	71.04	1,797,312.00
VERISK ANALYTICS INC	21,900	137.99	3,021,981.00

CBRE GROUP INC	45,500	50.73	2,308,215.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	161,000	7.10	1,143,100.00
JONES LANG LASALLE INC	6,300	156.30	984,690.00
ALTICE USA INC-A	47,000	23.16	1,088,520.00
CBS CORP-CL B	47,000	52.39	2,462,330.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	21,780	359.37	7,827,078.60
COMCAST CORP-CL A	622,000	42.43	26,391,460.00
DISCOVERY INC - A	19,300	30.13	581,509.00
DISCOVERY INC - C	39,800	28.03	1,115,594.00
DISH NETWORK CORP-A	31,900	34.89	1,112,991.00
FOX CORP-CLASS A	48,033	38.44	1,846,388.52
FOX CORP-CLASS B	19,800	37.92	750,816.00
INTERPUBRIC GROUP	50,000	22.65	1,132,500.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	13,900	95.92	1,333,288.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	69,500	26.66	1,852,870.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	27.58	661,920.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	22,400	39.93	894,432.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	39.95	515,355.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	12.52	688,600.00
OMNICOM GROUP	30,300	82.30	2,493,690.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	229,000	6.04	1,383,160.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	100,400	45.31	4,549,124.00
DISNEY (WALT) CO	245,928	132.45	32,573,163.60
ELECTRONIC ARTS	40,800	93.14	3,800,112.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	29,300	37.65	1,103,145.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	20,800	65.35	1,359,280.00
NETFLIX INC	59,500	360.35	21,440,825.00
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	15,700	90.74	1,424,618.00
VIACOM INC-CLASS B	50,200	30.18	1,515,036.00
ALPHABET INC-CL A	40,850	1,241.47	50,714,049.50
ALPHABET INC-CL C	42,990	1,236.37	53,151,546.30
FACEBOOK INC-A	328,300	178.28	58,529,324.00
IAC/INTERACTIVE CORP	10,400	220.02	2,288,208.00
TRIPADVISOR INC	14,600	51.72	755,112.00
TWITTER INC	94,200	34.40	3,240,480.00

	ZILLOW GROUP INC - C	16,000	36.28	580,480.00	
小計	銘柄数：597			3,397,767,475.28	
				(380,515,979,556)	
	組入時価比率：65.4%			67.8%	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	50,000	9.28	464,000.00	
	CAMECO CORP	56,000	15.78	883,680.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	163,100	41.94	6,840,414.00	
	CENOVUS ENERGY INC	140,000	13.50	1,890,000.00	
	ENBRIDGE INC	275,900	49.79	13,737,061.00	
	ENCANA CORP	206,000	9.70	1,998,200.00	
	HUSKY ENERGY INC	52,000	14.49	753,480.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	39.38	1,476,750.00	
	INTER PIPELINE LTD	52,000	22.34	1,161,680.00	
	KEYERA CORP	28,500	32.30	920,550.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	70,600	49.95	3,526,470.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	31,000	19.03	589,930.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	37,000	10.16	375,920.00	
	SUNCOR ENERGY INC	218,000	44.48	9,696,640.00	
	TOURMALINE OIL CORP	33,000	21.38	705,540.00	
	TRANSCANADA CORP	125,700	62.64	7,873,848.00	
	VERMILION ENERGY INC	18,500	35.33	653,605.00	
	METHANEX CORP	8,600	77.94	670,284.00	
	NUTRIEN LTD	83,100	72.36	6,013,116.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	21,200	56.12	1,189,744.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	33,100	54.06	1,789,386.00	
	BARRICK GOLD	236,600	17.70	4,187,820.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	99,000	15.93	1,577,070.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	25,400	95.21	2,418,334.00	
	GOLDCORP INC	121,000	14.43	1,746,030.00	
	KINROSS GOLD CORP	174,000	4.33	753,420.00	
	LUNDIN MINING CORP	95,000	7.70	731,500.00	
	TECK RESOURCES LTD-CLS B	68,000	33.24	2,260,320.00	
	TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	126,000	2.13	268,380.00	
	WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63,000	29.36	1,849,680.00	
	WEST FRASER TIMBER	8,400	66.99	562,716.00	



BOMBARDIER B SHEARS	262,000	2.74	717,880.00
CAE INC	36,000	30.74	1,106,640.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	25,200	34.27	863,604.00
WSP GLOBAL INC	13,200	73.09	964,788.00
FINNING INTERNATIONAL INC	24,000	24.27	582,480.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	100,100	125.40	12,552,540.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	19,800	289.99	5,741,802.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	44,500	75.91	3,377,995.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	27,800	49.79	1,384,162.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	32,000	90.84	2,906,880.00
STARS GROUP INC/THE	23,000	25.99	597,770.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	149.55	1,286,130.00
DOLLARAMA INC	41,800	40.16	1,678,688.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	59,600	79.09	4,713,764.00
EMPIRE CO LTD A	26,000	29.73	772,980.00
LOBLAW COMPANIES	26,100	66.36	1,731,996.00
METRO INC	33,400	49.25	1,644,950.00
WESTON(GEORGE)LTD	10,700	102.10	1,092,470.00
SAPUTO INC	32,100	45.75	1,468,575.00
AURORA CANNABIS INC	97,000	12.03	1,166,910.00
BAUSCH HEALTH COS INC	42,500	30.98	1,316,650.00
CANOPY GROWTH CORP	27,500	59.64	1,640,100.00
CRONOS GROUP INC	25,000	21.11	527,750.00
BANK OF MONTREAL	87,600	105.50	9,241,800.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	168,200	73.16	12,305,512.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	60,000	110.99	6,659,400.00
NATIONAL BANK OF CANADA	46,000	63.31	2,912,260.00
ROYAL BANK OF CANADA	196,200	107.06	21,005,172.00
TORONTO DOMINION BANK	249,500	75.75	18,899,625.00
ONEX CORPORATION	10,900	79.90	870,910.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,880	631.04	2,448,435.20
GREAT-WEST LIFE CO INC	42,000	34.38	1,443,960.00
IA FINANCIAL CORP INC	14,700	54.01	793,947.00
INTACT FINANCIAL CORP	18,900	111.07	2,099,223.00

	MANULIFE FINANCIAL CORP	275,000	24.64	6,776,000.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	46,000	32.60	1,499,600.00	
	POWER FINANCIAL CORP	32,500	33.20	1,079,000.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	83,800	54.89	4,599,782.00	
	CGI INC	33,800	95.01	3,211,338.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	12,200	295.45	3,604,490.00	
	BLACKBERRY LTD	71,000	12.34	876,140.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,720	1,181.49	3,213,652.80	
	OPEN TEXT CORP	35,400	51.00	1,805,400.00	
	BCE INC	19,800	60.81	1,204,038.00	
	TELUS CORP	29,300	49.93	1,462,949.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	50,200	68.90	3,458,780.00	
	EMERA INC	7,600	50.54	384,104.00	
	FORTIS INC	58,300	49.90	2,909,170.00	
	HYDRO ONE LTD	42,000	21.47	901,740.00	
	ALTAGAS LTD	33,800	17.91	605,358.00	
	ATCO LTD CL1	9,600	46.91	450,336.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	15,700	37.17	583,569.00	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	116,800	64.32	7,512,576.00	
	CI FINANCIAL CORP	33,600	18.90	635,040.00	
	IGM FINANCIAL INC	10,300	36.58	376,774.00	
	THOMSON REUTERS CORP	28,247	80.20	2,265,409.40	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	25,000	20.72	518,000.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	63,000	27.29	1,719,270.00	
小計	銘柄数：89			259,735,832.40	
				(21,742,486,530)	
	組入時価比率：3.7%			3.9%	
ユーロ	TENARIS SA	60,000	13.04	782,400.00	
	ENAGAS	30,400	24.95	758,480.00	
	ENI SPA	345,000	15.43	5,324,040.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	67,000	14.41	965,470.00	
	NESTE OYJ	52,800	32.21	1,700,688.00	
	OMV AG	21,000	49.47	1,038,870.00	
	REPSOL SA	188,228	15.06	2,835,654.82	
	SNAM SPA	298,000	4.44	1,325,504.00	

TOTAL SA	329,400	50.30	16,568,820.00
VOPAK	9,000	42.77	384,930.00
AIR LIQUIDE	59,200	118.30	7,003,360.00
AKZO NOBEL	31,022	80.25	2,489,515.50
ARKEMA	9,900	94.90	939,510.00
BASF SE	125,400	74.16	9,299,664.00
COVESTRO AG	27,000	53.04	1,432,080.00
EVONIK INDUSTRIES AG	22,700	27.22	617,894.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	39.16	411,180.00
KONINKLIJKE DSM NV	24,700	102.65	2,535,455.00
LANXESS	12,000	54.74	656,880.00
SOLVAY SA	10,300	110.25	1,135,575.00
SYMRISE AG	16,300	82.36	1,342,468.00
UMICORE	28,000	43.45	1,216,600.00
CRH PLC	113,600	30.53	3,468,208.00
HEIDELBERGCEMENT AG	20,300	72.90	1,479,870.00
IMERYS	3,800	48.82	185,516.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,000	27.45	878,400.00
ARCELORMITTAL	88,500	21.04	1,862,040.00
THYSSENKRUPP AG	62,000	13.62	844,440.00
VOESTALPINE AG	16,500	30.44	502,260.00
STORA ENSO OYJ-R	73,000	11.37	830,375.00
UPM-KYMMENE OYJ	73,300	25.42	1,863,286.00
AIRBUS SE	79,300	120.24	9,535,032.00
DASSAULT AVIATION SA	330	1,297.00	428,010.00
LEONARDO SPA	55,000	10.61	583,825.00
MTU AERO ENGINES AG	6,900	205.20	1,415,880.00
SAFRAN SA	45,700	123.75	5,655,375.00
THALES SA	14,100	107.75	1,519,275.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	66,900	36.87	2,466,603.00
KINGSPAN GROUP PLC	22,200	46.00	1,021,200.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	35,055	40.77	1,429,192.35
BOUYGUES	31,400	35.00	1,099,000.00
EIFFAGE SA	10,800	87.98	950,184.00
FERROVIAL SA	66,511	20.99	1,396,065.89
HOCHTIEF AG	2,600	132.20	343,720.00

VINCI	70,200	89.36	6,273,072.00
LEGRAND SA	37,000	64.46	2,385,020.00
OSRAM LICHT AG	14,300	31.10	444,730.00
PRYSMIAN SPA	30,900	16.33	504,597.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	75,400	77.00	5,805,800.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	30,000	15.46	463,950.00
SIEMENS AG	104,200	106.50	11,097,300.00
ALSTOM	20,500	40.64	833,120.00
ANDRITZ AG	9,200	43.74	402,408.00
CNH INDUSTRIAL NV	141,000	9.85	1,389,978.00
GEA GROUP AG	24,200	25.88	626,296.00
KION GROUP AG	9,900	60.80	601,920.00
KONE OYJ	45,600	48.07	2,191,992.00
METSO OYJ	16,200	33.82	547,884.00
WARTSILA OYJ	63,000	15.51	977,445.00
BRENNTAG AG	20,600	48.21	993,126.00
REXEL SA	45,000	11.36	511,200.00
EDENRED	32,800	42.18	1,383,504.00
SOCIETE BIC SA	3,800	81.65	310,270.00
BOLLORE	106,000	4.32	457,920.00
DEUTSCHE POST AG-REG	137,100	31.09	4,263,124.50
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	31,000	22.59	700,290.00
ADP	3,900	179.30	699,270.00
AENA SME SA	9,300	158.90	1,477,770.00
ATLANTIA SPA	70,000	22.91	1,603,700.00
FRAPORT AG	6,300	72.76	458,388.00
GETLINK	62,000	14.03	869,860.00
CONTINENTAL AG	15,400	155.60	2,396,240.00
FAURECIA	10,500	48.01	504,105.00
MICHELIN (CGDE)	23,800	117.45	2,795,310.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	15,800	31.34	495,172.00
PIRELLI & C. SPA	53,000	6.44	341,320.00
VALEO SA	33,100	32.42	1,073,102.00
BAYER MOTOREN WERK	44,900	77.75	3,490,975.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	7,800	67.85	529,230.00

DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	125,700	59.31	7,455,267.00	
FERRARI NV	17,100	123.10	2,105,010.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	150,000	14.65	2,198,400.00	
PEUGEOT CITROEN	82,000	24.83	2,036,060.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	20,300	64.54	1,310,162.00	
RENAULT SA	25,500	63.87	1,628,685.00	
VOLKSWAGEN AG	4,500	166.60	749,700.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	25,200	163.14	4,111,128.00	
SEB SA	3,000	162.50	487,500.00	
ADIDAS AG	24,600	232.15	5,710,890.00	
ESSILORLUXOTTICA	39,900	108.15	4,315,185.00	
HERMES INTERNATIONAL	4,430	610.00	2,702,300.00	
HUGO BOSS AG	9,300	62.50	581,250.00	
KERING SA	10,500	510.40	5,359,200.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	37,850	352.30	13,334,555.00	
MONCLER SPA	25,200	36.52	920,304.00	
PUMA SE	1,061	544.50	577,714.50	
ACCOR SA	26,200	37.73	988,526.00	
PADDY POWER PLC	11,900	76.60	911,540.00	
SODEXO	12,100	102.85	1,244,485.00	
DELIVERY HERO SE	11,900	35.50	422,450.00	
ZALANDO SE	17,100	41.64	712,044.00	
INDITEX SA	148,000	28.00	4,144,000.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	80,000	16.71	1,337,200.00	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	8,300	38.05	315,815.00	
COLRUYT SA	8,700	65.10	566,370.00	
JERONIMO MARTINS	31,000	14.03	434,930.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	160,600	22.03	3,538,821.00	
METRO AG	25,000	14.89	372,250.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	103,600	79.84	8,271,424.00	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	76,000	8.63	655,880.00	
HEINEKEN HOLDING NV	16,000	89.25	1,428,000.00	
HEINEKEN NV	35,700	94.18	3,362,226.00	
PERNOD RICARD SA	29,100	154.70	4,501,770.00	
REMY COINTREAU	3,000	117.60	352,800.00	

DANONE	84,400	70.40	5,941,760.00
KERRY GROUP PLC-A	22,100	96.95	2,142,595.00
HENKEL AG & CO KGAA	14,400	82.70	1,190,880.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,600	88.18	2,169,228.00
BEIERSDORF AG	13,700	93.12	1,275,744.00
LOREAL-ORD	34,430	243.20	8,373,376.00
UNILEVER NV-CVA	210,200	52.27	10,987,154.00
BIOMERIEUX	5,900	72.40	427,160.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	125,900	35.33	4,448,047.00
SARTORIUS AG-VORZUG	4,500	152.90	688,050.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,900	36.64	729,136.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	29,400	70.16	2,062,704.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	57,600	48.90	2,816,928.00
GRIFOLS SA	40,100	24.04	964,004.00
BAYER AG-REG	127,300	61.16	7,785,668.00
IPSEN	5,500	117.60	646,800.00
MERCK KGAA	17,300	93.78	1,622,394.00
ORION OYJ	13,000	30.86	401,180.00
RECORDATI SPA	14,100	35.48	500,268.00
SANOFI	153,600	72.87	11,192,832.00
UCB SA	16,500	70.30	1,159,950.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	58,100	21.88	1,271,228.00
AIB GROUP PLC	125,000	4.24	530,750.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	923,000	5.59	5,163,262.00
BANCO DE SABADELL SA	790,000	1.02	807,775.00
BANCO SANTANDER SA	2,211,000	4.60	10,190,499.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	133,000	5.95	791,350.00
BANKIA SA	151,000	2.41	364,212.00
BANKINTER S.A.	88,000	7.34	646,448.00
BNP PARIBAS	152,900	48.98	7,489,806.50
CAIXABANK	505,000	2.95	1,492,780.00
COMMERZBANK AG	135,000	8.12	1,097,145.00
CREDIT AGRICOLE SA	154,000	12.47	1,920,380.00
ERSTE GROUP BANK AG	40,000	37.05	1,482,000.00
ING GROEP NV	528,000	12.04	6,357,120.00

INTESA SANPAOLO	2,062,000	2.33	4,809,615.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	34,600	67.00	2,318,200.00
MEDIOBANCA S.P.A.	88,000	9.50	836,000.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	24.01	482,601.00
SOCIETE GENERALE	104,300	29.01	3,026,264.50
UNICREDIT SPA	271,000	12.76	3,457,960.00
EURAZEO SE	5,670	66.70	378,189.00
EXOR NV	15,100	60.30	910,530.00
GROUPE BRUXELLES LAM	11,000	89.20	981,200.00
WENDEL	3,400	120.20	408,680.00
AEGON NV	246,000	4.66	1,148,574.00
AGEAS	25,800	46.58	1,201,764.00
ALLIANZ SE-REG	58,000	214.85	12,461,300.00
ASSICURAZIONI GENERALI	162,000	17.04	2,761,290.00
AXA	265,000	23.73	6,289,775.00
CNP ASSURANCES	21,200	21.34	452,408.00
HANNOVER RUECK SE	7,900	133.60	1,055,440.00
MAPFRE SA	163,000	2.66	435,047.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	20,700	221.50	4,585,050.00
NN GROUP NV	42,900	38.30	1,643,070.00
POSTE ITALIANE SPA	77,000	9.52	733,040.00
SAMPO OYJ-A SHS	61,200	41.25	2,524,500.00
SCOR SE	23,200	39.15	908,280.00
ADYEN NV	1,480	670.00	991,600.00
AMADEUS IT GROUP SA	59,500	68.86	4,097,170.00
ATOS SE	13,600	94.42	1,284,112.00
CAPGEMINI SA	21,900	111.35	2,438,565.00
WIRECARD AG	15,900	120.10	1,909,590.00
DASSAULT SYSTEMES SA	17,800	135.45	2,411,010.00
SAP SE	134,000	100.48	13,464,320.00
NOKIA OYJ	781,000	5.13	4,011,997.00
INGENICO GROUP	8,100	67.60	547,560.00
ASML HOLDING NV	56,000	183.22	10,260,320.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	155,000	21.47	3,328,625.00

STMICROELECTRONICS NV	97,000	16.60	1,610,685.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	460,000	14.88	6,848,480.00
ELISA OYJ	19,500	37.62	733,590.00
ILIAD SA	3,900	97.20	379,080.00
KONINKLIJKE KPN NV	446,000	2.77	1,236,312.00
ORANGE SA	277,000	14.62	4,051,125.00
PROXIMUS	21,600	26.47	571,752.00
TELECOM ITALIA SPA	1,530,000	0.51	785,655.00
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.47	415,976.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	97,000	2.89	281,009.00
TELEFONICA SA	640,000	7.50	4,805,120.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	36.44	612,192.00
1&1 DRILLISCH AG	8,000	34.26	274,080.00
ELECTRICITE DE FRANCE	82,000	12.83	1,052,060.00
ENDESA S.A.	44,400	21.92	973,248.00
ENEL SPA	1,104,000	5.52	6,099,600.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	361,000	3.44	1,243,284.00
FORTUM OYJ	60,000	18.32	1,099,500.00
IBERDROLA SA	858,666	7.77	6,678,704.14
RED ELECTRICA CORPORACION SA	59,000	18.31	1,080,585.00
TERNA SPA	185,000	5.34	988,640.00
VERBUND AG	9,000	43.94	395,460.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	49,300	24.82	1,223,626.00
E.ON SE	307,000	9.83	3,017,810.00
ENGIE	251,000	13.33	3,347,085.00
INNOGY SE	19,500	41.37	806,715.00
RWE AG	72,000	22.90	1,648,800.00
SUEZ	52,000	12.28	638,820.00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	71,000	21.05	1,494,550.00
AMUNDI SA	8,200	62.70	514,140.00
DEUTSCHE BANK AG-REG	275,000	7.78	2,140,325.00
DEUTSCHE BOERSE AG	25,600	118.05	3,022,080.00
NATIXIS	128,000	5.24	671,744.00
UNIPER SE	26,200	27.20	712,640.00
EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,430	370.00	529,100.00



	QIAGEN NV	31,400	34.00	1,067,600.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,100	107.00	438,700.00	
	BUREAU VERITAS SA	34,200	22.01	752,742.00	
	RANDSTAD NV	17,400	49.21	856,254.00	
	TELEPERFORMANCE	7,700	167.60	1,290,520.00	
	WOLTERS KLUWER	39,000	62.50	2,437,500.00	
	AROWNTOWN SA	107,000	7.14	763,980.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	48,400	39.75	1,923,900.00	
	VONOVIA SE	66,400	44.23	2,936,872.00	
	AXEL SPRINGER SE	5,900	50.50	297,950.00	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	24,100	16.25	391,625.00	
	JC DECAUX SA	9,300	28.94	269,142.00	
	PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	34,000	14.73	500,820.00	
	PUBLICIS GROUPE	29,200	51.58	1,506,136.00	
	RTL GROUP	5,400	52.05	281,070.00	
	SES FDR	48,000	15.80	758,400.00	
	TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	47.48	318,116.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	11,100	80.20	890,220.00	
	VIVENDI SA	143,700	25.89	3,720,393.00	
小計	銘柄数：238			538,635,797.70	
				(67,803,474,214)	
	組入時価比率：11.7%			12.0%	
英ポンド	WOOD GROUP (JOHN) PLC	86,000	5.05	434,300.00	
	BP PLC	2,749,000	5.67	15,606,073.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	617,000	24.66	15,218,305.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	510,700	24.84	12,685,788.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	17,200	50.80	873,760.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	26,700	34.36	917,412.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	143,300	21.69	3,108,893.50	
	ANTOFAGASTA PLC	59,000	10.09	595,310.00	
	BHP GROUP PLC	289,000	18.69	5,402,566.00	
	FRESNILLO PLC	26,000	7.78	202,384.00	
	GLENCORE PLC	1,533,000	3.38	5,184,606.00	
	RIO TINTO PLC-REG	157,800	46.00	7,258,800.00	
	MONDI PLC	49,400	17.27	853,138.00	

BAE SYSTEMS PLC	441,000	4.91	2,169,279.00
MEGGITT PLC	111,000	5.18	575,868.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	237,000	9.07	2,151,486.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	680,000	1.96	1,336,880.00
DCC PLC	12,800	68.94	882,432.00
SMITHS GROUP PLC	54,000	15.45	834,300.00
WEIR GROUP PLC	37,000	17.75	656,750.00
ASHTED GROUP PLC	68,000	21.70	1,475,600.00
BUNZLE	44,400	23.52	1,044,288.00
FERGUSON PLC	32,500	54.00	1,755,000.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	39,000	5.20	202,956.00
G4S PLC	219,000	2.32	508,518.00
ROYAL MAIL PLC	136,000	2.59	352,240.00
EASYJET PLC	21,000	12.19	255,990.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	145,000	6.15	892,040.00
PERSIMMON PLC	42,600	23.44	998,544.00
TAYLOR WIMPEY PLC	450,000	1.90	855,225.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	17,100	38.50	658,350.00
BURBERRY GROUP PLC	55,000	20.14	1,107,700.00
CARNIVAL PLC	22,900	40.36	924,244.00
COMPASS GROUP PLC	215,000	17.19	3,695,850.00
GVC HOLDINGS PLC	71,000	6.48	460,506.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	23,750	49.33	1,171,587.50
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	89,000	3.60	320,400.00
TUI AG-DI	60,000	8.47	508,440.00
WHITBREAD PLC	24,500	48.42	1,186,290.00
MARKS & SPENCER PLC	208,000	2.82	587,184.00
NEXT PLC	19,800	57.74	1,143,252.00
KINGFISHER PLC	308,000	2.61	805,420.00
MORRISON SUPERMARKETS	315,000	2.21	697,410.00
SAINSBURY	255,000	2.27	580,635.00
TESCO PLC	1,362,000	2.50	3,406,362.00
COCA-COLA HBC AG-DI	29,000	27.05	784,450.00
DIAGEO PLC	331,900	31.26	10,375,194.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49,400	25.12	1,240,928.00

BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	312,500	30.57	9,553,125.00	
IMPERIAL BRANDS PLC	129,500	24.91	3,225,845.00	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	91,300	58.12	5,306,356.00	
UNILEVER PLC	150,900	45.03	6,795,781.50	
CONVATEC GROUP PLC-WI	210,000	1.32	278,985.00	
SMITH & NEPHEW PLC	123,000	14.44	1,776,735.00	
NMC HEALTH PLC	13,300	25.18	334,894.00	
ASTRAZENECA PLC	172,700	58.15	10,042,505.00	
GLAXOSMITHKLINE PLC	676,000	15.24	10,304,944.00	
BARCLAYS PLC	2,370,000	1.69	4,014,780.00	
HSBC HOLDINGS PLC	2,734,000	6.66	18,222,110.00	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,730,000	0.65	6,412,070.00	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	650,000	2.62	1,705,600.00	
STANDARD CHARTERED PLC	383,000	6.72	2,573,760.00	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	359,000	2.80	1,006,277.00	
ADMIRAL GROUP PLC	27,000	22.33	602,910.00	
AVIVA PLC	542,000	4.31	2,339,272.00	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	183,000	3.40	623,481.00	
LEGAL & GENERAL	808,000	2.91	2,352,896.00	
PRUDENTIAL PLC	355,000	17.80	6,319,000.00	
RSA INSURANCE GROUP PLC	140,000	5.45	763,560.00	
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	58,000	19.04	1,104,320.00	
SAGE GROUP PLC (THE)	143,000	7.09	1,013,870.00	
BT GROUP PLC	1,145,000	2.29	2,631,782.50	
VODAFONE GROUP PLC	3,650,000	1.42	5,203,440.00	
SSE PLC	137,000	11.24	1,539,880.00	
CENTRICA PLC	780,000	1.05	824,850.00	
NATIONAL GRID PLC	461,000	8.18	3,774,207.00	
SEVERN TRENT PLC	32,400	19.59	634,716.00	
UNITED UTILITIES GROUP PLC	96,000	8.20	787,584.00	
3I GROUP PLC	132,000	10.80	1,425,600.00	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	40,100	21.80	874,180.00	
INVESTEC PLC	92,000	5.14	473,064.00	
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	42,600	49.64	2,114,664.00	
SCHRODERS PLC	15,800	31.96	504,968.00	

	ST JAMES S PLACE PLC	70,000	11.13	779,450.00	
	EXPERIAN PLC	126,200	22.00	2,776,400.00	
	INTERTEK GROUP PLC	21,600	53.30	1,151,280.00	
	RELX PLC	271,000	17.01	4,609,710.00	
	INFORMA PLC	173,000	7.98	1,380,540.00	
	ITV PLC	500,000	1.40	701,500.00	
	PEARSON	109,000	8.43	919,306.00	
	WPP PLC	169,000	9.34	1,578,460.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	138,000	5.51	761,208.00	
小計	銘柄数：92			247,062,800.00	
				(35,922,931,120)	
	組入時価比率：6.2%			6.4%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	25,900	22.34	578,606.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	623.00	760,060.00	
	GIVAUDAN-REG	1,247	2,565.00	3,198,555.00	
	SIKA AG-REG	18,000	151.65	2,729,700.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	67,000	53.14	3,560,380.00	
	GEBERIT AG-REG	5,000	421.30	2,106,500.00	
	ABB LTD	250,000	21.16	5,290,000.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	216.40	649,200.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,500	220.20	1,211,100.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	7,300	145.35	1,061,055.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	71,600	76.04	5,444,464.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,120	318.80	1,313,456.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	62.35	461,390.00	
	DUFREY AG-REG	4,400	104.30	458,920.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	300	1,841.00	552,300.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	140	6,795.00	951,300.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	15	78,400.00	1,176,000.00	
	NESTLE SA-REG	418,400	95.85	40,103,640.00	
	ALCON INC	59,200	55.91	3,309,872.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	7,600	200.30	1,522,280.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,450	836.80	1,213,360.00	
	NOVARTIS AG-REG	296,000	77.03	22,800,880.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	95,900	263.40	25,260,060.00	
		5,700	132.30	754,110.00	

	VIFOR PHARMA AG				
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	5,800	81.70	473,860.00	
	BALOISE HOLDING AG	6,600	174.50	1,151,700.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,550	475.40	2,163,070.00	
	SWISS RE LTD	41,400	102.85	4,257,990.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	20,710	328.20	6,797,022.00	
	TEMENOS AG-REG	8,400	165.90	1,393,560.00	
	SWISSCOM AG-REG	3,510	471.20	1,653,912.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	347,000	13.68	4,746,960.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	31,000	48.02	1,488,620.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,430	762.00	1,851,660.00	
	UBS GROUP AG	533,000	13.44	7,163,520.00	
	LONZA AG-REG	10,390	297.40	3,089,986.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	21,500	60.06	1,291,290.00	
	SGS SA-REG	746	2,658.00	1,982,868.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	10,100	81.85	826,685.00	
小計	銘柄数：39			166,799,891.00	
				(18,409,703,969)	
	組入時価比率：3.2%			3.3%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	24,800	310.00	7,688,000.00	
	BOLIDEN AB	36,300	286.60	10,403,580.00	
	ASSA ABLOY AB-B	136,000	210.40	28,614,400.00	
	SKANSKA AB-B SHS	45,000	175.50	7,897,500.00	
	ALFA LAVAL AB	38,900	230.20	8,954,780.00	
	ATLAS COPCO AB-A	94,000	282.50	26,555,000.00	
	ATLAS COPCO AB-B	52,900	262.30	13,875,670.00	
	EPIROC AB - A	92,000	102.15	9,397,800.00	
	EPIROC AB - B	58,000	96.67	5,606,860.00	
	SANDVIK AB	151,000	175.75	26,538,250.00	
	SKF AB-B SHARES	55,000	177.70	9,773,500.00	
	VOLVO AB-B SHS	214,000	150.00	32,100,000.00	
	SECURITAS AB-B SHS	45,000	160.25	7,211,250.00	
	ELECTROLUX AB-B	34,000	239.80	8,153,200.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	55,000	84.54	4,649,700.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	118,000	167.16	19,724,880.00	

	ICA GRUPPEN AB	10,500	343.20	3,603,600.00	
	SWEDISH MATCH AB	23,400	453.20	10,604,880.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	81,700	264.80	21,634,160.00	
	NORDEA BANK ABP	413,000	77.88	32,164,440.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	221,000	91.26	20,168,460.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	212,000	104.10	22,069,200.00	
	SWEDBANK AB	126,000	154.85	19,511,100.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	208.90	5,222,500.00	
	INVESTOR AB-B SHS	61,700	438.70	27,067,790.00	
	KINNEVIK AB - B	33,700	257.50	8,677,750.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	9,200	308.00	2,833,600.00	
	ERICSSON LM-B	417,000	94.10	39,239,700.00	
	HEXAGON AB-B SHS	36,100	519.40	18,750,340.00	
	TELIA CO AB	396,000	41.05	16,255,800.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	9,700	565.50	5,485,350.00	
	TELE 2 AB-B SHS	69,000	124.15	8,566,350.00	
	小計銘柄数：32			488,999,390.00	
				(5,887,552,655)	
	組入時価比率：1.0%			1.1%	
ノルウェーク ローネ	AKER AB ASA	14,100	308.00	4,342,800.00	
	EQUINOR ASA	161,000	198.40	31,942,400.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	23,200	372.30	8,637,360.00	
	NORSK HYDRO	184,000	39.01	7,177,840.00	
	MOWI ASA	62,000	187.70	11,637,400.00	
	ORKLA ASA	115,000	66.36	7,631,400.00	
	DNB ASA	135,000	168.70	22,774,500.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,000	159.50	3,987,500.00	
	TELENOR ASA	102,000	169.35	17,273,700.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	222.20	2,866,380.00	
	小計銘柄数：10			118,271,280.00	
				(1,556,450,044)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	13,700	649.40	8,896,780.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	31,100	311.90	9,700,090.00	

	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	26,800	603.40	16,171,120.00	
	ISS A/S	21,800	210.10	4,580,180.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	520	8,440.00	4,388,800.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	880	8,994.00	7,914,720.00	
	DSV A/S	25,100	576.40	14,467,640.00	
	PANDORA A/S	16,200	289.70	4,693,140.00	
	CARLSBERG B	14,500	840.00	12,180,000.00	
	COLOPLAST-B	16,400	685.40	11,240,560.00	
	DEMANT A/S	13,000	194.15	2,523,950.00	
	GENMAB A/S	8,400	1,122.00	9,424,800.00	
	H LUNDBECK A/S	10,500	277.20	2,910,600.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	247,500	322.75	79,880,625.00	
	DANSKE BANK AS	97,000	128.90	12,503,300.00	
	TRYG A/S	16,000	200.80	3,212,800.00	
	ORSTED A/S	25,400	496.50	12,611,100.00	
	小計銘柄数：17			217,300,205.00	
				(3,663,681,456)	
	組入時価比率：0.6%			0.7%	
豪ドル	WORLEYPARSONS LTD	47,000	14.48	680,560.00	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	33,300	27.36	911,088.00	
	OIL SEARCH LTD	179,000	8.06	1,442,740.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	239,000	7.32	1,749,480.00	
	SANTOS LTD.	232,000	7.22	1,675,040.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	23.55	400,350.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	127,000	35.65	4,527,550.00	
	INCITEC PIVOT LTD	233,000	3.34	778,220.00	
	ORICA LTD	50,000	18.71	935,500.00	
	BORAL LTD	153,000	4.87	745,110.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	58,000	18.86	1,093,880.00	
	AMCOR	155,000	15.38	2,383,900.00	
	ALUMINA LTD	350,000	2.36	826,000.00	
	BHP GROUP LIMITED	401,000	38.23	15,330,230.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	68,000	13.94	947,920.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	223,000	7.48	1,668,040.00	
	NEWCREST MINING	103,000	25.24	2,599,720.00	

RIO TINTO LTD	51,200	97.74	5,004,288.00
SOUTH32 LTD	700,000	3.49	2,443,000.00
CIMIC GROUP LTD	11,700	48.97	572,949.00
BRAMBLES LTD	218,000	11.87	2,587,660.00
AURIZON HOLDINGS LTD	273,000	4.68	1,277,640.00
SYDNEY AIRPORT	144,000	7.45	1,072,800.00
TRANSURBAN GROUP	372,000	13.19	4,906,680.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	76,000	25.41	1,931,160.00
CROWN RESORTS LTD	55,000	13.19	725,450.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	8,500	43.14	366,690.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	7,300	43.61	318,353.00
TABCORP HOLDINGS	247,000	4.78	1,180,660.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	97,117	4.12	400,122.04
WESFARMERS LIMITED	154,000	34.99	5,388,460.00
COLES GROUP LTD	161,000	12.45	2,004,450.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	181,000	31.22	5,650,820.00
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	8.64	665,280.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	100,000	16.75	1,675,000.00
COCHLEAR LTD	8,100	175.75	1,423,575.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20,500	62.07	1,272,435.00
SONIC HEALTHCARE LTD	62,000	24.41	1,513,420.00
CSL LIMITED	61,800	190.51	11,773,518.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	393,000	26.78	10,524,540.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	56,000	9.13	511,280.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	67,000	10.02	671,340.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	242,400	73.41	17,794,584.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	371,000	25.27	9,375,170.00
WESTPAC BANKING CORP	469,000	26.83	12,583,270.00
AMP LIMITED	390,000	2.28	889,200.00
CHALLENGER LIMITED	80,000	7.79	623,200.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	308,000	7.74	2,383,920.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	350,000	2.74	959,000.00
QBE INSURANCE	179,000	12.75	2,282,250.00
SUNCORP GROUP LTD	181,000	13.54	2,450,740.00
COMPUTERSHARE LTD	63,000	17.80	1,121,400.00



	TELSTRA CORP LTD	590,000	3.41	2,011,900.00	
	TPG TELECOM LTD	52,000	6.91	359,320.00	
	AUSNET SERVICES	230,000	1.76	405,950.00	
	APA GROUP	159,000	9.51	1,512,090.00	
	AGL ENERGY LTD	93,000	21.79	2,026,470.00	
	ASX LTD	26,300	71.62	1,883,606.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	43,900	133.17	5,846,163.00	
	SEEK LTD	48,000	17.84	856,320.00	
	REA GROUP LTD	6,900	78.40	540,960.00	
小計	銘柄数：61			170,462,411.04	
				(13,645,516,003)	
	組入時価比率：2.3%			2.4%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	112,627	5.18	583,407.86	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,000	8.00	1,040,000.00	
	A2 MILK CO LTD	106,000	15.70	1,664,200.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	74,000	15.16	1,121,840.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	12.35	716,300.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	260,000	3.70	962,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	159,000	4.08	648,720.00	
小計	銘柄数：7			6,736,467.86	
				(504,426,713)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	371,040	82.80	30,722,112.00	
	NWS HOLDINGS LTD	220,500	16.78	3,699,990.00	
	MTR CORP	201,000	47.45	9,537,450.00	
	MINTH GROUP LTD	112,000	28.55	3,197,600.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	195,000	58.25	11,358,750.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	97,000	25.35	2,458,950.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	333,000	58.65	19,530,450.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	124,000	16.44	2,038,560.00	
	SANDS CHINA LTD	336,000	43.05	14,464,800.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	160,333	11.12	1,782,902.96	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	9.54	2,575,800.00	
	WYNN MACAU LTD	228,000	21.30	4,856,400.00	

	WH GROUP LIMITED	1,170,000	9.21	10,775,700.00	
	BANK OF EAST ASIA	167,060	25.55	4,268,383.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	495,000	35.35	17,498,250.00	
	HANG SENG BANK	105,800	204.60	21,646,680.00	
	AIA GROUP LTD	1,647,000	79.70	131,265,900.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	38,000	96.45	3,665,100.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	519,600	12.46	6,474,216.00	
	PCCW LTD	550,000	4.78	2,629,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	89,000	62.85	5,593,650.00	
	CLP HLDGS	227,000	88.70	20,134,900.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	191,000	54.50	10,409,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,240,317	18.46	22,896,251.82	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	162,400	277.20	45,017,280.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	361,040	66.05	23,846,692.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	103,000	23.30	2,399,900.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	251,000	18.56	4,658,560.00	
	HENDERSON LAND	185,858	49.85	9,265,021.30	
	HYSAN DEVELOPMENT	83,000	42.30	3,510,900.00	
	KERRY PROPERTIES	79,000	34.30	2,709,700.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	839,666	13.28	11,150,764.48	
	SINO LAND CO.LTD	480,000	14.06	6,748,800.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	217,000	133.50	28,969,500.00	
	SWIRE PACIFIC-A	64,000	98.70	6,316,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	31.75	5,492,750.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	164,000	58.30	9,561,200.00	
	WHARF(HOLDING)	174,000	22.35	3,888,900.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	117,000	55.45	6,487,650.00	
小計	銘柄数：39			533,505,713.56	
				(7,613,126,532)	
	組入時価比率：1.3%			1.4%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	198,000	3.87	766,260.00	
	KEPPEL CORP.	202,000	6.74	1,361,480.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	140,040	2.71	379,508.40	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	380,000	1.60	608,000.00	

	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,040	9.85	758,844.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	310,000	2.61	809,100.00	
	SATS LTD	77,000	5.24	403,480.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	870,000	0.96	835,200.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	36.20	506,800.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	940,020	0.29	277,305.90	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	247,000	3.64	899,080.00	
	DBS GROUP HLDGS	243,000	27.40	6,658,200.00	
	OCBC-ORD	433,000	11.77	5,096,410.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	185,000	26.80	4,958,000.00	
	VENTURE CORP LTD	35,000	19.24	673,400.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,110,000	3.15	3,496,500.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	111,000	7.33	813,630.00	
	CAPITALAND LIMITED	330,000	3.64	1,201,200.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	51,000	9.23	470,730.00	
	UOL GROUP LIMITED	65,000	7.67	498,550.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	240,000	2.47	592,800.00	
	小計 銘柄数：21			32,064,478.30	
				(2,651,091,065)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
新シケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	91,000	19.95	1,815,450.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	499.10	1,796,760.00	
	BANK HAPOALIM BM	141,000	25.78	3,634,980.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	214,000	24.49	5,240,860.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,000	78.00	1,326,000.00	
	NICE LTD	8,600	477.00	4,102,200.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	280,000	2.72	761,600.00	
	AZRIELI GROUP	6,500	216.70	1,408,550.00	
	小計 銘柄数：8			20,086,400.00	
				(625,691,360)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				560,542,111,217	
				(560,542,111,217)	

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

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2019年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	71,000	1,283,680.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	14,400	1,996,704.00	
		AMERICAN TOWER CORP	60,200	11,613,182.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	196,000	1,958,040.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,200	3,766,080.00	
		BOSTON PROPERTIES	20,700	2,752,893.00	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	15,000	313,050.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,100	1,292,053.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	56,800	6,964,816.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	27,800	3,348,510.00	
		DUKE REALTY CORP	47,800	1,440,214.00	
		EQUINIX INC	10,930	4,879,589.20	
		EQUITY RESIDENTIAL	51,300	3,851,091.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,030	2,512,958.70	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	17,900	1,802,530.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,800	1,295,560.00	
		HCP INC	66,100	1,971,763.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	100,000	1,890,000.00	
		INVITATION HOMES INC	45,000	1,097,550.00	
		IRON MOUNTAIN INC	38,300	1,376,502.00	
		KIMCO REALTY CORP	58,000	1,016,740.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	19,800	957,528.00	
		MACERICH CO /THE	14,200	588,732.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,000	1,598,400.00	
		NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,000	1,133,880.00	
		PROLOGIS INC	86,300	6,349,091.00	
PUBLIC STORAGE	21,500	4,675,175.00			
REALTY INCOME CORP	39,300	2,693,229.00			
REGENCY CENTERS CORP	21,000	1,393,980.00			

	SBA COMMUNICATIONS CORP	15,200	3,012,336.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	42,300	7,531,938.00	
	SL GREEN REALTY CORP	12,500	1,088,125.00	
	UDR INC	36,700	1,623,241.00	
	VENTAS INC	49,200	2,904,276.00	
	VEREIT INC	125,000	1,008,750.00	
	VORNADO REALTY TRUST	24,200	1,621,642.00	
	WELLTOWER INC	51,700	3,786,508.00	
	WEYERHAEUSER CO	100,500	2,649,180.00	
	WP CAREY INC	21,500	1,649,265.00	
小計	銘柄数：39	1,666,260	104,688,781.90	
			(11,724,096,684)	
	組入時価比率：2.0%		79.4%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	20,000	462,600.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	570,900.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	375,870.00	
小計	銘柄数：3	53,000	1,409,370.00	
			(117,978,362)	
	組入時価比率：0.0%		0.8%	
ユーロ	COVIVIO	6,600	625,020.00	
	GECINA SA	6,400	832,640.00	
	ICADE	5,100	384,285.00	
	KLEPIERRE	28,000	896,840.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	19,100	2,953,815.00	
小計	銘柄数：5	65,200	5,692,600.00	
			(716,584,488)	
	組入時価比率：0.1%		4.8%	
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	762,368.00	
	HAMMERSON PLC	108,000	356,832.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	99,000	901,890.00	
	SEGRO PLC	145,000	971,500.00	
小計	銘柄数：4	480,000	2,992,590.00	
			(435,122,586)	
	組入時価比率：0.1%		2.9%	
豪ドル	DEXUS	140,000	1,766,800.00	
	GOODMAN GROUP	227,000	2,885,170.00	

小計	GPT GROUP	256,000	1,500,160.00	
	LENDLEASE GROUP	77,000	985,600.00	
	MIRVAC GROUP	490,000	1,372,000.00	
	SCENTRE GROUP	723,000	2,805,240.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	348,000	1,353,720.00	
	VICINITY CENTRES	480,000	1,204,800.00	
	銘柄数：8 組入時価比率：0.2%	2,741,000	13,873,490.00 (1,110,572,874) 7.5%	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	370,000	2,856,400.00	
	LINK REIT	288,000	26,208,000.00	
小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.1%	658,000	29,064,400.00 (414,748,988) 2.8%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	380,000	1,117,200.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	369,972	714,045.96	
	CAPITALAND MALL TRUST	380,000	877,800.00	
	SUNTEC REIT	300,000	567,000.00	
	小計	銘柄数：4 組入時価比率：0.0%	1,429,972	3,276,045.96 (270,863,479) 1.8%
合計			14,789,967,461 (14,789,967,461)	

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

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

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 4月22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	6,269,963,237	-	6,461,094,929	191,131,692
市場取引以外の取引				

為替予約取引				
売建	549,815,376	-	549,815,000	376
米ドル	430,849,650	-	431,123,000	273,350
英ポンド	58,279,902	-	58,156,000	123,902
豪ドル	32,157,024	-	32,016,000	141,024
香港ドル	28,528,800	-	28,520,000	8,800
合計	-	-	-	191,132,068

## (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)

(2019年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	167,457,321
コール・ローン	224,020,292
株式	46,886,751,893
投資証券	1,232,339,756
派生商品評価勘定	43,875,283
未収入金	974,273
未収配当金	56,247,971
差入委託証拠金	316,617,789
流動資産合計	48,928,284,578
資産合計	48,928,284,578
負債の部	
流動負債	

(2019年 4月22日現在)

派生商品評価勘定	410,091,563
未払解約金	72,982,077
未払利息	487
その他未払費用	548,700
流動負債合計	483,622,827
負債合計	483,622,827
純資産の部	
元本等	
元本	25,069,680,630
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,374,981,121
元本等合計	48,444,661,751
純資産合計	48,444,661,751
負債純資産合計	48,928,284,578

## 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	<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>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>



4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>
------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 4月22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	1.9324円
(10,000口当たり純資産額)	(19,324円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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 style="padding-left: 20px;">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 style="padding-left: 20px;">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 style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 4月22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

## 2. 時価の算定方法

### 株式

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

### 投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

### 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (その他の注記)

### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 4月22日現在	
期首	2018年 4月24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	23,223,525,846円
同期中における追加設定元本額	9,814,259,804円
同期中における一部解約元本額	7,968,105,020円
期末元本額	25,069,680,630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	1,861,509,465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	786,500,726円
野村外国株インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	580,901,366円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,797,811円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,606,282円
インデックス・ブレンド(タイプ )	6,094,461円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,201,266円
インデックス・ブレンド(タイプ )	4,020,374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)	7,135,093,320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)	2,404,805,410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	104,009,518円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	112,581,575円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	9,362,992,675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)	1,705,787,999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)	907,974,004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)	89,207,380円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスオープン投信・為替ヘッジ型(適格機関投資家専用)	596,998円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2019年4月22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	5,200	25.60	133,120.00	
		HALLIBURTON CO	10,600	31.13	329,978.00	
		HELMERICH & PAYNE	1,000	62.52	62,520.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	4,200	26.97	113,274.00	
		SCHLUMBERGER LTD	16,200	45.56	738,072.00	
		TECHNIPFMC PLC	5,200	24.45	127,140.00	
		ANADARKO PETE	6,100	64.18	391,498.00	
		APACHE CORPORATION	4,400	35.87	157,828.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	4,600	26.13	120,198.00	
		CHENIERE ENERGY INC	2,500	65.00	162,500.00	
		CHEVRON CORP	21,690	119.86	2,599,763.40	
		CIMAREX ENERGY CO	960	69.30	66,528.00	
		CONCHO RESOURCES INC	2,340	116.96	273,686.40	
		CONOCOPHILLIPS	12,900	65.90	850,110.00	
		CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,180	49.85	58,823.00	
		DEVON ENERGY CORP	6,000	33.55	201,300.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	1,800	107.28	193,104.00	
		EOG RESOURCES INC	6,810	103.87	707,354.70	
		EXXON MOBIL CORP	48,200	81.13	3,910,466.00	
		HESS CORP	2,900	65.86	190,994.00	
		HOLLYFRONTIER CORP	1,600	47.34	75,744.00	
		KINDER MORGAN INC	21,700	19.39	420,763.00	
		MARATHON OIL CORP	10,800	17.62	190,296.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	7,600	59.81	454,556.00	
		NOBLE ENERGY INC	5,000	27.11	135,550.00	
OCCIDENTAL PETE CORP	8,300	61.82	513,106.00			
ONEOK INC	4,600	69.14	318,044.00			
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	3,500	21.30	74,550.00			
PHILLIPS 66	4,800	95.42	458,016.00			
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,190	175.06	383,381.40			

PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	2,000	24.15	48,300.00
TARGA RESOURCES CORP	2,800	39.34	110,152.00
VALERO ENERGY CORP	5,150	88.04	453,406.00
WILLIAMS COS	14,600	28.32	413,472.00
AIR PRODUCTS	2,400	198.10	475,440.00
ALBEMARLE CORP	1,080	82.57	89,175.60
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,900	28.01	81,229.00
CELANESE CORP-SERIES A	1,480	105.19	155,681.20
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,400	45.14	108,336.00
CHEMOURS CO/THE	1,700	39.29	66,793.00
DOW INC	8,933	57.77	516,059.41
DOWDUPONT INC	26,800	39.00	1,045,200.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	1,490	84.03	125,204.70
ECOLAB INC	2,970	183.20	544,104.00
FMC CORP	1,800	79.95	143,910.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	950	136.00	129,200.00
LINDE PLC	6,360	180.40	1,147,344.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	4,030	91.79	369,913.70
MOSAIC CO/THE	3,660	27.07	99,076.20
PPG INDUSTRIES	2,870	119.86	343,998.20
SHERWIN-WILLIAMS	960	452.43	434,332.80
WESTLAKE CHEMICAL CORP	280	75.21	21,058.80
MARTIN MARIETTA MATERIALS	620	211.57	131,173.40
VULCAN MATERIALS CO	1,520	122.80	186,656.00
AVERY DENNISON CORP	810	113.37	91,829.70
BALL CORP	4,200	58.51	245,742.00
CROWN HOLDINGS INC	1,800	56.43	101,574.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	4,400	44.43	195,492.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	1,050	96.41	101,230.50
SEALED AIR CORP	1,500	45.71	68,565.00
WESTROCK CO	2,900	35.49	102,921.00
FREEMONT-MCMORAN INC	14,500	14.00	203,000.00
NEWMONT GOLDCORP CORP	7,000	33.04	231,280.00
NUCOR CORP	3,300	57.50	189,750.00
STEEL DYNAMICS	2,100	33.96	71,316.00

ARCONIC INC	4,400	20.04	88,176.00
BOEING CO	6,130	380.07	2,329,829.10
GENERAL DYNAMICS	3,000	176.85	530,550.00
HARRIS CORP	1,300	165.65	215,345.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	540	220.90	119,286.00
L3 TECHNOLOGIES INC	860	214.67	184,616.20
LOCKHEED MARTIN	3,000	314.26	942,780.00
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,970	281.16	553,885.20
RAYTHEON COMPANY	3,390	182.49	618,641.10
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	1,120	85.55	95,816.00
TEXTRON INC	2,800	55.15	154,420.00
TRANSDIGM GROUP INC	490	469.28	229,947.20
UNITED TECHNOLOGIES	9,470	137.00	1,297,390.00
ALLEGION PLC	1,400	93.75	131,250.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	1,740	48.97	85,207.80
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	10,700	36.75	393,225.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	530	270.64	143,439.20
MASCO CORP	3,300	40.04	132,132.00
OWENS CORNING INC	1,050	54.28	56,994.00
SMITH (A.O.) CORP	1,400	56.49	79,086.00
FLUOR CORP	1,400	41.05	57,470.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,270	76.93	97,701.10
ACUITY BRANDS INC	440	142.44	62,673.60
AMETEK INC	2,630	86.49	227,468.70
EATON CORP PLC	5,300	85.21	451,613.00
EMERSON ELEC	6,900	72.51	500,319.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,270	189.92	241,198.40
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,600	51.25	82,000.00
3M CORP	6,800	218.88	1,488,384.00
GENERAL ELEC CO	100,100	9.35	935,935.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,600	169.06	1,453,916.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,500	63.60	159,000.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	3,100	36.98	114,638.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,200	349.72	419,664.00

CATERPILLAR INC DEL	7,000	143.36	1,003,520.00
CUMMINS INC	1,760	167.84	295,398.40
DEERE & COMPANY	3,370	169.05	569,698.50
DOVER CORP	1,700	97.78	166,226.00
FLOWSERVE CORP	1,480	49.45	73,186.00
FORTIVE CORP	3,470	88.50	307,095.00
IDEX CORP	950	154.52	146,794.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	3,270	158.33	517,739.10
INGERSOLL-RAND PLC	2,830	112.79	319,195.70
MIDDLEBY CORP	660	135.04	89,126.40
PACCAR	3,890	71.44	277,901.60
PARKER HANNIFIN CORP	1,400	189.92	265,888.00
PENTAIR PLC	2,100	38.22	80,262.00
SNAP-ON INC	550	168.07	92,438.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,580	145.74	230,269.20
WABCO HOLDINGS INC	620	133.00	82,460.00
WABTEC CORP	1,397	77.93	108,868.21
XYLEM INC	2,150	82.93	178,299.50
AERCAP HOLDINGS NV	1,400	49.41	69,174.00
FASTENAL CO	3,800	71.08	270,104.00
GRAINGER(W.W.) INC	570	308.18	175,662.60
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,700	44.43	75,531.00
UNITED RENTALS INC	800	136.00	108,800.00
CINTAS CORP	1,200	213.68	256,416.00
COPART INC	2,600	65.06	169,156.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	3,000	79.04	237,120.00
ROLLINS INC	1,500	43.30	64,950.00
WASTE CONNECTIONS INC	3,000	88.55	265,650.00
WASTE MANAGEMENT INC	4,670	105.78	493,992.60
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	1,580	89.99	142,184.20
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	2,300	80.43	184,989.00
FEDEX CORPORATION	2,990	198.15	592,468.50
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	7,770	114.15	886,945.50
XPO LOGISTICS INC	1,490	66.03	98,384.70
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	1,100	34.37	37,807.00

DELTA AIR LINES INC	1,700	58.17	98,889.00
SOUTHWEST AIRLINES	1,500	52.18	78,270.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	860	88.28	75,920.80
AMERCO	80	368.02	29,441.60
CSX CORP	8,900	78.97	702,833.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	880	97.21	85,544.80
KANSAS CITY SOUTHERN	1,260	125.03	157,537.80
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	1,300	34.72	45,136.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,000	198.58	595,740.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	580	155.23	90,033.40
UNION PAC CORP	8,580	176.66	1,515,742.80
APTIV PLC	2,950	90.34	266,503.00
AUTOLIV INC	980	86.75	85,015.00
BORGWARNER INC	2,600	44.00	114,400.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	2,800	20.51	57,428.00
LEAR CORP	810	157.83	127,842.30
FORD MOTOR COMPANY	40,100	9.55	382,955.00
GENERAL MOTORS CO	15,100	40.30	608,530.00
HARLEY-DAVIDSON INC	1,800	40.89	73,602.00
TESLA INC	1,520	273.26	415,355.20
DR HORTON INC	4,300	46.42	199,606.00
GARMIN LTD	1,700	86.53	147,101.00
LEGGETT & PLATT INC	1,400	43.27	60,578.00
LENNAR CORP-A	3,000	52.91	158,730.00
MOHAWK INDUSTRIES	660	131.77	86,968.20
NEWELL BRANDS INC	5,900	15.15	89,385.00
NVR INC	44	3,084.12	135,701.28
PULTEGROUP INC	2,800	30.39	85,092.00
WHIRLPOOL CORP	700	139.06	97,342.00
HASBRO INC	1,690	88.78	150,038.20
MATTEL INC	3,400	12.49	42,466.00
POLARIS INDUSTRIES INC	640	98.79	63,225.60
CAPRI HOLDINGS LTD	1,900	49.22	93,518.00
HANESBRANDS INC	3,400	18.89	64,226.00
	1,350	173.31	233,968.50

LULULEMON ATHLETICA INC			
NIKE INC-B	14,800	89.20	1,320,160.00
PVH CORP	930	132.20	122,946.00
RALPH LAUREN CORPORATION	640	131.10	83,904.00
TAPESTRY INC	3,300	32.55	107,415.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,100	22.16	46,536.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	2,114	19.74	41,730.36
V F CORP	3,720	95.55	355,446.00
ARAMARK	3,000	31.65	94,950.00
CARNIVAL CORP	4,800	53.63	257,424.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	270	700.00	189,000.00
DARDEN RESTAURANTS INC	1,390	116.87	162,449.30
DOMINOS PIZZA INC	470	267.61	125,776.70
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,400	87.23	296,582.00
LAS VEGAS SANDS CORP	4,330	68.22	295,392.60
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	3,150	134.41	423,391.50
MCDONALD'S CORP	8,710	194.91	1,697,666.10
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,000	25.79	77,370.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	6,500	27.52	178,880.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,600	56.92	147,992.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,940	120.99	234,720.60
STARBUCKS CORP	13,900	76.06	1,057,234.00
VAIL RESORTS INC	500	209.47	104,735.00
WYNN RESORTS LTD	1,360	142.44	193,718.40
YUM BRANDS INC	3,740	103.32	386,416.80
GENUINE PARTS CO	1,560	105.45	164,502.00
LKQ CORP	2,800	30.78	86,184.00
AMAZON.COM INC	4,743	1,861.69	8,829,995.67
BOOKING HOLDINGS INC	548	1,844.31	1,010,681.88
EBAY INC	9,900	35.98	356,202.00
EXPEDIA GROUP INC	1,510	124.51	188,010.10
GRUBHUB INC	800	64.07	51,256.00
MERCADOLIBRE INC	450	492.00	221,400.00
QURATE RETAIL INC - A	5,100	16.78	85,578.00
WAYFAIR INC - CLASS A	450	145.21	65,344.50
	3,060	123.55	378,063.00



DOLLAR GENERAL CORP			
DOLLAR TREE INC	3,080	108.67	334,703.60
KOHL'S CORP	2,100	70.37	147,777.00
MACYS INC	3,700	25.08	92,796.00
NORDSTROM INC	1,600	43.86	70,176.00
TARGET CORP	6,030	83.26	502,057.80
ADVANCE AUTO PARTS	760	175.40	133,304.00
AUTOZONE	320	1,045.05	334,416.00
BEST BUY COMPANY INC	2,700	73.64	198,828.00
BURLINGTON STORES INC	930	163.99	152,510.70
CARMAX INC	2,400	77.00	184,800.00
GAP INC	2,400	25.97	62,328.00
HOME DEPOT	12,810	205.66	2,634,504.60
L BRANDS, INC	2,600	25.68	66,768.00
LOWE'S COS INC	9,340	113.74	1,062,331.60
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	860	399.46	343,535.60
ROSS STORES INC	4,350	100.00	435,000.00
TIFFANY & CO	1,390	107.12	148,896.80
TJX COS INC	14,700	55.12	810,264.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,600	103.09	164,944.00
ULTA BEAUTY INC	620	350.88	217,545.60
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	5,070	245.81	1,246,256.70
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	2,500	7.81	19,525.00
KROGER CO	9,500	25.78	244,910.00
SYSCO CORP	5,300	70.99	376,247.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,900	54.63	486,207.00
WALMART INC	16,410	103.18	1,693,183.80
BROWN-FORMAN CORP-CL B	3,000	52.85	158,550.00
COCA COLA CO	45,800	47.48	2,174,584.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,100	52.04	109,284.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,910	198.80	379,708.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	1,960	61.40	120,344.00
MONSTER BEVERAGE CORP	4,800	55.20	264,960.00
PEPSICO INC	15,970	127.09	2,029,627.30
ARCHER DANIELS MIDLAND	6,300	42.76	269,388.00
	1,700	51.13	86,921.00

BUNGE LIMITED			
CAMPBELL SOUP CO	2,000	39.39	78,780.00
CONAGRA BRANDS INC	6,100	30.52	186,172.00
GENERAL MILLS	7,300	51.72	377,556.00
HERSHEY CO/THE	1,510	116.96	176,609.60
HORMEL FOODS CORP	3,600	40.39	145,404.00
INGREDION INC	690	93.48	64,501.20
JM SMUCKER CO/THE-NEW	1,230	120.70	148,461.00
KELLOGG CO	3,100	58.45	181,195.00
KRAFT HEINZ CO/THE	7,800	32.96	257,088.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,000	67.62	135,240.00
MCCORMICK & CO INC.	1,450	154.38	223,851.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	17,300	50.09	866,557.00
TYSON FOODS INC-CL A	3,900	73.49	286,611.00
ALTRIA GROUP INC	21,800	54.37	1,185,266.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	18,000	84.49	1,520,820.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,600	73.83	191,958.00
CLOROX CO	1,610	153.48	247,102.80
COLGATE PALMOLIVE CO.	9,800	69.35	679,630.00
KIMBERLY-CLARK CORP	3,780	123.55	467,019.00
PROCTER & GAMBLE CO	28,300	106.05	3,001,215.00
COTY INC-CL A	4,300	11.26	48,418.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,530	170.33	430,934.90
ABBOTT LABORATORIES	20,400	73.92	1,507,968.00
ABIOMED INC	500	256.56	128,280.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	810	281.49	228,006.90
BAXTER INTERNATIONAL INC.	6,100	74.33	453,413.00
BECTON,DICKINSON	2,990	227.89	681,391.10
BOSTON SCIENTIFIC CORP	15,300	35.11	537,183.00
DANAHER CORP	7,390	126.77	936,830.30
DENTSPLY SIRONA INC	2,420	49.73	120,346.60
DEXCOM INC	850	114.29	97,146.50
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,550	177.26	452,013.00
HOLOGIC INC	2,900	43.40	125,860.00
IDEXX LABORATORIES INC	1,150	218.49	251,263.50
	1,340	528.06	707,600.40

INTUITIVE SURGICAL INC			
MEDTRONIC PLC	15,670	84.22	1,319,727.40
RESMED INC	1,680	99.22	166,689.60
STRYKER CORP	3,970	180.26	715,632.20
TELEFLEX INC	510	277.05	141,295.50
THE COOPER COMPANIES, INC.	620	281.22	174,356.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,060	130.78	138,626.80
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,500	120.00	300,000.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,650	72.45	119,542.50
ANTHEM INC	2,990	239.62	716,463.80
CARDINAL HEALTH INC	3,500	46.00	161,000.00
CENTENE CORP	4,400	48.20	212,080.00
CIGNA CORP	4,380	149.00	652,620.00
CVS HEALTH CORP	14,900	52.63	784,187.00
DAVITA INC	1,400	52.23	73,122.00
HCA HEALTHCARE INC	3,210	115.24	369,920.40
HENRY SCHEIN INC	2,100	61.50	129,150.00
HUMANA INC	1,640	240.69	394,731.60
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,050	145.22	152,481.00
MCKESSON CORP	2,470	114.10	281,827.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,360	85.75	116,620.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	10,930	221.75	2,423,727.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	870	124.51	108,323.70
WELLCARE HEALTH PLANS INC	690	252.29	174,080.10
ABBVIE INC	17,600	77.57	1,365,232.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,510	126.01	316,285.10
ALKERMES PLC	1,640	33.58	55,071.20
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	840	82.07	68,938.80
AMGEN INC	7,180	177.47	1,274,234.60
BEIGENE, LTD ADR	370	119.80	44,326.00
BIOGEN INC	2,240	226.39	507,113.60
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,140	83.16	177,962.40
CELGENE CORP	7,770	93.76	728,515.20
GILEAD SCIENCES INC	15,000	62.95	944,250.00
INCYTE CORP	1,830	73.96	135,346.80

REGENERON PHARMACEUTICALS	860	333.34	286,672.40
SEATTLE GENETICS INC	1,100	69.18	76,098.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	490	100.34	49,166.60
VERTEX PHARMACEUTICALS	3,030	168.16	509,524.80
ALLERGAN PLC	4,000	140.31	561,240.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	18,800	45.52	855,776.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	2,500	31.11	77,775.00
ELI LILLY & CO.	10,070	115.20	1,160,064.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	550	128.44	70,642.00
JOHNSON & JOHNSON	30,540	137.52	4,199,860.80
MERCK & CO INC	29,500	73.19	2,159,105.00
MYLAN NV	6,100	26.85	163,785.00
NEKTAR THERAPEUTICS	2,200	31.68	69,696.00
PERRIGO CO PLC	1,700	48.82	82,994.00
PFIZER INC	65,700	39.38	2,587,266.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	11,700	14.36	168,012.00
ZOETIS INC	5,280	99.03	522,878.40
BANK OF AMERICA CORP	106,000	30.03	3,183,180.00
BB&T CORPORATION	9,300	49.35	458,955.00
CIT GROUP INC	1,000	50.53	50,530.00
CITIGROUP	27,600	69.67	1,922,892.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,300	35.36	187,408.00
COMERICA INC	1,800	78.25	140,850.00
EAST WEST BANCORP INC	1,900	49.75	94,525.00
FIFTH THIRD BANCORP	8,100	27.50	222,750.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,700	103.62	176,154.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	11,900	13.61	161,959.00
JPMORGAN CHASE & CO	37,850	113.46	4,294,461.00
KEYCORP	12,300	16.79	206,517.00
M & T BANK CORP	1,410	166.34	234,539.40
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	5,700	17.13	97,641.00
PNC FINANCIAL	5,520	133.19	735,208.80
REGIONS FINANCIAL CORP	12,300	15.25	187,575.00
SIGNATURE BANK	520	126.38	65,717.60
SUNTRUST BKS INC.	5,200	63.49	330,148.00
SVB FINANCIAL GROUP	630	243.14	153,178.20

US BANCORP	17,800	51.21	911,538.00
WELLS FARGO CO	50,800	47.58	2,417,064.00
ZIONS BANCORP NA	2,300	47.30	108,790.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	1,900	22.60	42,940.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	14,710	209.99	3,088,952.90
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	3,000	20.16	60,480.00
VOYA FINANCIAL INC	2,100	54.66	114,786.00
AFLAC INC	9,300	48.92	454,956.00
ALLEGHANY CORP	170	646.92	109,976.40
ALLSTATE CORP	4,240	96.72	410,092.80
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,130	100.00	113,000.00
AMERICAN INTL GROUP	10,100	46.04	465,004.00
AON PLC	2,630	175.17	460,697.10
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,990	32.53	129,794.70
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,400	80.42	193,008.00
ASSURANT INC	750	93.23	69,922.50
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,000	43.78	87,560.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	890	41.19	36,659.10
CHUBB LTD	5,480	138.66	759,856.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,550	86.60	134,230.00
EVEREST RE GROUP LTD	440	229.04	100,777.60
FNF GROUP	3,500	38.92	136,220.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	4,100	50.94	208,854.00
LINCOLN NATIONAL CORP	2,200	66.19	145,618.00
LOEWS CORP	2,800	48.82	136,696.00
MARKEL CORP	144	1,014.82	146,134.08
MARSH & MCLENNAN COS	5,790	93.72	542,638.80
METLIFE INC	10,000	45.32	453,200.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,080	55.22	170,077.60
PROGRESSIVE CO	6,400	75.00	480,000.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,510	103.83	468,273.30
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	750	151.61	113,707.50
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	490	152.98	74,960.20
TORCHMARK CORP	1,230	88.74	109,150.20
TRAVELERS COS INC/THE	3,250	138.93	451,522.50

UNUM GROUP	2,700	36.58	98,766.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,640	177.37	290,886.80
WR BERKLEY CORP	1,485	58.35	86,649.75
ACCENTURE PLC-CL A	7,410	178.61	1,323,500.10
AKAMAI TECHNOLOGIES	1,800	75.34	135,612.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	510	162.60	82,926.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	4,870	162.44	791,082.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	1,410	112.79	159,033.90
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	7,000	71.34	499,380.00
DXC TECHNOLOGY CO	3,310	64.58	213,759.80
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	3,810	110.89	422,490.90
FIRST DATA CORP- CLASS A	5,600	25.12	140,672.00
FISERV INC	4,600	85.06	391,276.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	950	251.42	238,849.00
GARTNER INC	920	157.20	144,624.00
GLOBAL PAYMENTS INC	1,880	139.67	262,579.60
GODADDY INC - CLASS A	1,800	78.27	140,886.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	10,600	140.33	1,487,498.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	970	143.50	139,195.00
LEIDOS HOLDINGS INC	1,800	65.25	117,450.00
MASTERCARD INC	10,420	240.89	2,510,073.80
PAYCHEX INC	3,400	81.59	277,406.00
PAYPAL HOLDINGS INC	13,020	107.36	1,397,827.20
SABRE CORP	3,700	21.93	81,141.00
SQUARE INC - A	3,300	70.74	233,442.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	2,220	100.54	223,198.80
VERISIGN INC	1,390	186.65	259,443.50
VISA INC-CLASS A SHARES	20,000	160.16	3,203,200.00
WESTERN UNION CO	5,500	19.30	106,150.00
WIX.COM LTD	410	122.75	50,327.50
WORLDPAY INC - CL A	3,240	111.23	360,385.20
ADOBE INC	5,680	270.57	1,536,837.60
ANSYS INC	950	186.59	177,260.50
AUTODESK INC.	2,480	169.20	419,616.00
CADENCE DESIGN SYS INC	2,900	63.37	183,773.00

CDK GLOBAL INC	1,430	60.75	86,872.50
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	1,430	119.99	171,585.70
CITRIX SYSTEMS INC	1,590	100.11	159,174.90
FORTINET INC	1,500	91.08	136,620.00
INTUIT INC	2,880	257.77	742,377.60
MICROSOFT CORP	83,260	123.37	10,271,786.20
ORACLE CORPORATION	30,000	54.52	1,635,600.00
PALO ALTO NETWORKS INC	1,000	235.46	235,460.00
PTC INC	1,590	97.60	155,184.00
RED HAT INC	1,910	181.94	347,505.40
SALESFORCE.COM INC	8,640	155.99	1,347,753.60
SERVICENOW INC	1,970	237.40	467,678.00
SPLUNK INC	1,750	128.08	224,140.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,200	64.21	141,262.00
SYMANTEC CORP	6,700	24.40	163,480.00
SYNOPSYS INC	1,780	115.98	206,444.40
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	680	118.57	80,627.60
VMWARE INC - CLASS A	900	188.09	169,281.00
WORKDAY INC-CLASS A	1,880	187.83	353,120.40
ARISTA NETWORKS INC	560	323.38	181,092.80
CISCO SYSTEMS	51,000	56.40	2,876,400.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	1,600	26.01	41,616.00
F5 NETWORKS INC	760	163.40	124,184.00
JUNIPER NETWORKS INC	4,100	28.01	114,841.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,940	143.36	278,118.40
APPLE INC	54,180	203.86	11,045,134.80
DELL TECHNOLOGIES-C	2,200	62.85	138,270.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	16,500	16.66	274,890.00
HP INC	18,400	20.52	377,568.00
NETAPP INC	2,900	77.69	225,301.00
SEAGATE TECHNOLOGY	3,200	50.50	161,600.00
WESTERN DIGITAL CORP	3,040	55.39	168,385.60
XEROX CORP	2,500	34.56	86,400.00
AMPHENOL CORP-CL A	3,670	104.57	383,771.90

ARROW ELECTRS INC	750	84.96	63,720.00
CDW CORPORATION	1,500	105.39	158,085.00
COGNEX CORP	1,640	56.50	92,660.00
CORNING INC	10,100	34.85	351,985.00
FLEX LTD	4,700	11.21	52,687.00
FLIR SYSTEMS INC	1,200	49.98	59,976.00
IPG PHOTONICS CORP	360	175.48	63,172.80
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	2,300	89.84	206,632.00
TE CONNECTIVITY LTD	3,700	89.43	330,891.00
TRIMBLE INC	2,500	41.14	102,850.00
ADVANCED MICRO DEVICES	10,900	27.68	301,712.00
ANALOG DEVICES INC	4,040	114.79	463,751.60
APPLIED MATERIALS	11,500	43.95	505,425.00
BROADCOM INC	4,650	318.62	1,481,583.00
INTEL CORP	51,800	58.49	3,029,782.00
KLA TENCOR CORP	1,610	124.20	199,962.00
LAM RESEARCH	1,660	194.77	323,318.20
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	7,400	24.85	183,890.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	3,700	59.77	221,149.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	2,660	98.71	262,568.60
MICRON TECHNOLOGY	13,800	43.40	598,920.00
NVIDIA CORP	6,500	186.30	1,210,950.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,800	100.59	382,242.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	6,300	22.62	142,506.00
QORVO INC	1,200	76.68	92,016.00
QUALCOMM INC	13,500	79.89	1,078,515.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,950	90.00	175,500.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	11,250	115.51	1,299,487.50
XILINX INC	2,730	134.95	368,413.50
AT & T INC	82,600	32.03	2,645,678.00
CENTURYLINK INC	11,200	12.14	135,968.00
VERIZON COMMUNICATIONS	46,900	58.04	2,722,076.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	1,800	31.71	57,078.00
SPRINT CORP	7,300	5.77	42,121.00
T-MOBILE US INC	3,900	73.75	287,625.00



ALLIANT ENERGY CORP	3,300	45.98	151,734.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,400	83.01	448,254.00
DUKE ENERGY CORP	7,920	89.14	705,988.80
EDISON INTERNATIONAL	3,700	63.09	233,433.00
ENTERGY CORP	2,410	93.46	225,238.60
EVERGY INC	3,300	56.57	186,681.00
EVERSOURCE ENERGY	4,100	69.96	286,836.00
EXELON CORPORATION	10,600	49.40	523,640.00
FIRSTENERGY CORP	5,700	40.50	230,850.00
NEXTERA ENERGY INC	5,440	189.36	1,030,118.40
OGE ENERGY CORP	2,700	41.43	111,861.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	1,150	94.07	108,180.50
PPL CORPORATION	9,100	30.97	281,827.00
SOUTHERN CO.	11,400	51.96	592,344.00
XCEL ENERGY INC	5,700	54.68	311,676.00
ATMOS ENERGY CORP	1,100	99.18	109,098.00
UGI CORP	2,500	52.51	131,275.00
AMEREN CORPORATION	3,000	70.48	211,440.00
CENTERPOINT ENERGY INC	6,100	30.29	184,769.00
CMS ENERGY CORP	3,800	53.81	204,478.00
CONSOLIDATED EDISON INC	3,800	83.61	317,718.00
DOMINION ENERGY INC	8,300	74.92	621,836.00
DTE ENERGY COMPANY	2,250	123.21	277,222.50
NISOURCE INC	4,700	27.56	129,532.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	5,700	58.87	335,559.00
SEMPRA ENERGY	2,960	127.41	377,133.60
WEC ENERGY GROUP INC	3,600	76.29	274,644.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,180	104.70	228,246.00
ALLY FINANCIAL INC	5,900	29.73	175,407.00
AMERICAN EXPRESS CO	8,120	113.67	923,000.40
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,200	88.11	458,172.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,600	77.15	277,740.00
SYNCHRONY FINANCIAL	6,800	33.34	226,712.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	600	113.64	68,184.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,680	143.27	240,693.60

BANK OF NEWYORK MELLON CORP	10,900	48.41	527,669.00
BLACKROCK INC	1,420	465.69	661,279.80
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,240	101.26	125,562.40
CME GROUP INC	3,980	176.36	701,912.80
E*TRADE FINANCIAL CORP	3,100	51.14	158,534.00
EATON VANCE CORP	1,600	41.68	66,688.00
FRANKLIN RESOURCES INC	3,400	35.30	120,020.00
GOLDMAN SACHS GROUP	3,730	205.91	768,044.30
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6,200	79.86	495,132.00
INVESCO LTD	4,400	21.53	94,732.00
KKR & CO INC-A	4,700	23.76	111,672.00
MOODYS CORP	2,110	189.06	398,916.60
MORGAN STANLEY	14,300	47.55	679,965.00
MSCI INC	1,070	221.35	236,844.50
NASDAQ INC	1,430	89.99	128,685.70
NORTHERN TRUST CORP	2,180	91.87	200,276.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,300	89.19	115,947.00
S&P GLOBAL INC	2,770	217.20	601,644.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	14,300	45.55	651,365.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,400	58.34	81,676.00
STATE STREET CORP	4,500	69.96	314,820.00
T ROWE PRICE GROUP INC	2,730	105.90	289,107.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	3,600	53.53	192,708.00
H & R BLOCK INC	1,800	27.00	48,600.00
AES CORP	9,300	17.72	164,796.00
NRG ENERGY INC	2,800	41.00	114,800.00
VISTRA ENERGY CORP	4,600	26.01	119,646.00
CERNER CORP	3,190	62.71	200,044.90
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,500	127.83	191,745.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,590	76.17	273,450.30
ILLUMINA INC	1,740	319.03	555,112.20
IQVIA HOLDINGS INC	1,910	133.01	254,049.10
METTLER-TOLEDO INTL	300	728.73	218,619.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,660	259.78	1,210,574.80
WATERS CORP	810	239.58	194,059.80
	370	481.72	178,236.40

COSTAR GROUP INC			
EQUIFAX INC	1,220	125.70	153,354.00
IHS MARKIT LTD	4,500	55.01	247,545.00
MANPOWERGROUP INC	590	97.04	57,253.60
NIELSEN HOLDINGS PLC	3,700	26.23	97,051.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	1,430	68.15	97,454.50
TRUNSONIC	2,300	71.04	163,392.00
VERISK ANALYTICS INC	1,720	137.99	237,342.80
CBRE GROUP INC	4,000	50.73	202,920.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	15,000	7.10	106,500.00
JONES LANG LASALLE INC	470	156.30	73,461.00
ALTICE USA INC-A	2,900	23.16	67,164.00
CBS CORP-CL B	3,700	52.39	193,843.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,770	359.37	636,084.90
COMCAST CORP-CL A	51,400	42.43	2,180,902.00
DISCOVERY INC - A	2,030	30.13	61,163.90
DISCOVERY INC - C	2,751	28.03	77,110.53
DISH NETWORK CORP-A	2,400	34.89	83,736.00
FOX CORP-CLASS A	3,900	38.44	149,916.00
FOX CORP-CLASS B	1,900	37.92	72,048.00
INTERPUBLIC GROUP	3,600	22.65	81,540.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	1,340	95.92	128,532.80
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	5,300	26.66	141,298.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,300	27.58	63,434.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	2,030	39.93	81,057.90
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	1,160	39.95	46,342.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	4,300	12.52	53,836.00
OMNICOM GROUP	2,620	82.30	215,626.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	17,000	6.04	102,680.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	8,600	45.31	389,666.00
DISNEY (WALT) CO	20,750	132.45	2,748,337.50
ELECTRONIC ARTS	3,730	93.14	347,412.20
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	1,900	37.65	71,535.00
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,400	65.35	91,490.00
NETFLIX INC	5,070	360.35	1,826,974.50
	1,380	90.74	125,221.20

	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC				
	VIACOM INC-CLASS B	3,600	30.18	108,648.00	
	ALPHABET INC-CL A	3,403	1,241.47	4,224,722.41	
	ALPHABET INC-CL C	3,582	1,236.37	4,428,677.34	
	FACEBOOK INC-A	27,360	178.28	4,877,740.80	
	IAC/INTERACTIVE CORP	950	220.02	209,019.00	
	TRIPADVISOR INC	1,300	51.72	67,236.00	
	TWITTER INC	8,300	34.40	285,520.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	1,120	36.28	40,633.60	
小計	銘柄数：597			284,175,337.92	
				(31,824,796,093)	
	組入時価比率：65.7%			67.8%	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	3,800	9.28	35,264.00	
	CAMECO CORP	5,000	15.78	78,900.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	13,100	41.94	549,414.00	
	CENOVUS ENERGY INC	14,000	13.50	189,000.00	
	ENBRIDGE INC	23,200	49.79	1,155,128.00	
	ENCANA CORP	14,000	9.70	135,800.00	
	HUSKY ENERGY INC	3,779	14.49	54,757.71	
	IMPERIAL OIL	2,900	39.38	114,202.00	
	INTER PIPELINE LTD	3,800	22.34	84,892.00	
	KEYERA CORP	2,020	32.30	65,246.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	5,200	49.95	259,740.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1,800	19.03	34,254.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	3,100	10.16	31,496.00	
	SUNCOR ENERGY INC	18,500	44.48	822,880.00	
	TOURMALINE OIL CORP	2,800	21.38	59,864.00	
	TRANSCANADA CORP	10,200	62.64	638,928.00	
	VERMILION ENERGY INC	1,410	35.33	49,815.30	
	METHANEX CORP	970	77.94	75,601.80	
	NUTRIEN LTD	6,700	72.36	484,812.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,450	56.12	81,374.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	3,200	54.06	172,992.00	
	BARRICK GOLD	18,400	17.70	325,680.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7,800	15.93	124,254.00	

FRANCO-NEVADA CORP	2,400	95.21	228,504.00
GOLDCORP INC	8,100	14.43	116,883.00
KINROSS GOLD CORP	10,000	4.33	43,300.00
LUNDIN MINING CORP	8,000	7.70	61,600.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	6,100	33.24	202,764.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	8,740	2.13	18,616.20
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,200	29.36	182,032.00
WEST FRASER TIMBER	780	66.99	52,252.20
BOMBARDIER B SHEARS	19,500	2.74	53,430.00
CAE INC	3,800	30.74	116,812.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	1,900	34.27	65,113.00
WSP GLOBAL INC	1,100	73.09	80,399.00
FINNING INTERNATIONAL INC	2,000	24.27	48,540.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	8,100	125.40	1,015,740.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,540	289.99	446,584.60
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,900	75.91	296,049.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,700	49.79	134,433.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	2,700	90.84	245,268.00
STARS GROUP INC/THE	1,400	25.99	36,386.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	660	149.55	98,703.00
DOLLARAMA INC	3,120	40.16	125,299.20
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	5,300	79.09	419,177.00
EMPIRE CO LTD A	1,300	29.73	38,649.00
LOBLAW COMPANIES	2,400	66.36	159,264.00
METRO INC	3,400	49.25	167,450.00
WESTON(GEORGE)LTD	714	102.10	72,899.40
SAPUTO INC	3,100	45.75	141,825.00
AURORA CANNABIS INC	9,000	12.03	108,270.00
BAUSCH HEALTH COS INC	3,900	30.98	120,822.00
CANOPY GROWTH CORP	2,800	59.64	166,992.00
CRONOS GROUP INC	1,600	21.11	33,776.00
BANK OF MONTREAL	7,600	105.50	801,800.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	14,100	73.16	1,031,556.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	5,290	110.99	587,137.10

NATIONAL BANK OF CANADA	3,400	63.31	215,254.00	
ROYAL BANK OF CANADA	16,700	107.06	1,787,902.00	
TORONTO DOMINION BANK	21,100	75.75	1,598,325.00	
ONEX CORPORATION	900	79.90	71,910.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	330	631.04	208,243.20	
GREAT-WEST LIFE CO INC	3,800	34.38	130,644.00	
IA FINANCIAL CORP INC	800	54.01	43,208.00	
INTACT FINANCIAL CORP	1,460	111.07	162,162.20	
MANULIFE FINANCIAL CORP	22,900	24.64	564,256.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	3,500	32.60	114,100.00	
POWER FINANCIAL CORP	3,300	33.20	109,560.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	6,800	54.89	373,252.00	
CGI INC	3,000	95.01	285,030.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	1,040	295.45	307,268.00	
BLACKBERRY LTD	4,500	12.34	55,530.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	236	1,181.49	278,831.64	
OPEN TEXT CORP	3,100	51.00	158,100.00	
BCE INC	2,200	60.81	133,782.00	
TELUS CORP	2,600	49.93	129,818.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	4,200	68.90	289,380.00	
EMERA INC	600	50.54	30,324.00	
FORTIS INC	5,000	49.90	249,500.00	
HYDRO ONE LTD	3,100	21.47	66,557.00	
ALTAGAS LTD	3,600	17.91	64,476.00	
ATCO LTD CL1	900	46.91	42,219.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	1,090	37.17	40,515.30	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	9,200	64.32	591,744.00	
CI FINANCIAL CORP	3,700	18.90	69,930.00	
IGM FINANCIAL INC	600	36.58	21,948.00	
THOMSON REUTERS CORP	2,451	80.20	196,570.20	
FIRST CAPITAL REALTY INC	1,100	20.72	22,792.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	6,100	27.29	166,469.00	
小計 銘柄数：89			21,722,221.05	
			(1,818,367,124)	
組入時価比率：3.8%				3.9%

ユーロ	TENARIS SA	5,400	13.04	70,416.00
	ENAGAS	2,900	24.95	72,355.00
	ENI SPA	28,900	15.43	445,984.80
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	5,800	14.41	83,578.00
	NESTE OYJ	4,500	32.21	144,945.00
	OMV AG	1,600	49.47	79,152.00
	REPSOL SA	15,100	15.06	227,481.50
	SNAM SPA	31,000	4.44	137,888.00
	TOTAL SA	27,800	50.30	1,398,340.00
	VOPAK	700	42.77	29,939.00
	AIR LIQUIDE	4,760	118.30	563,108.00
	AKZO NOBEL	2,737	80.25	219,644.25
	ARKEMA	850	94.90	80,665.00
	BASF SE	10,600	74.16	786,096.00
	COVESTRO AG	2,240	53.04	118,809.60
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,800	27.22	48,996.00
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	740	39.16	28,978.40
	KONINKLIJKE DSM NV	1,890	102.65	194,008.50
	LANXESS	970	54.74	53,097.80
	SOLVAY SA	920	110.25	101,430.00
	SYMRISE AG	1,530	82.36	126,010.80
	UMICORE	2,400	43.45	104,280.00
	CRH PLC	9,800	30.53	299,194.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	1,470	72.90	107,163.00
	IMERYS	450	48.82	21,969.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	3,200	27.45	87,840.00
	ARCELORMITTAL	8,000	21.04	168,320.00
	THYSSENKRUPP AG	4,800	13.62	65,376.00
	VOESTALPINE AG	1,400	30.44	42,616.00
	STORA ENSO OYJ-R	6,100	11.37	69,387.50
	UPM-KYMMENE OYJ	6,200	25.42	157,604.00
	AIRBUS SE	6,670	120.24	802,000.80
	DASSAULT AVIATION SA	26	1,297.00	33,722.00
	LEONARDO SPA	4,200	10.61	44,583.00
	MTU AERO ENGINES AG	520	205.20	106,704.00

SAFRAN SA	3,690	123.75	456,637.50
THALES SA	1,360	107.75	146,540.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	5,500	36.87	202,785.00
KINGSPAN GROUP PLC	1,700	46.00	78,200.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	3,166	40.77	129,077.82
BOUYGUES	2,130	35.00	74,550.00
EIFFAGE SA	930	87.98	81,821.40
FERROVIAL SA	4,896	20.99	102,767.04
HOCHTIEF AG	160	132.20	21,152.00
VINCI	6,000	89.36	536,160.00
LEGRAND SA	2,860	64.46	184,355.60
OSRAM LICHT AG	821	31.10	25,533.10
PRYSMIAN SPA	2,800	16.33	45,724.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,500	77.00	500,500.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	1,800	15.46	27,837.00
SIEMENS AG	8,830	106.50	940,395.00
ALSTOM	2,100	40.64	85,344.00
ANDRITZ AG	700	43.74	30,618.00
CNH INDUSTRIAL NV	13,400	9.85	132,097.20
GEA GROUP AG	1,700	25.88	43,996.00
KION GROUP AG	970	60.80	58,976.00
KONE OYJ	3,600	48.07	173,052.00
METSO OYJ	1,600	33.82	54,112.00
WARTSILA OYJ	4,800	15.51	74,472.00
BRENNTAG AG	1,900	48.21	91,599.00
REXEL SA	4,100	11.36	46,576.00
EDENRED	2,900	42.18	122,322.00
SOCIETE BIC SA	300	81.65	24,495.00
BOLLORE	7,500	4.32	32,400.00
DEUTSCHE POST AG-REG	10,700	31.09	332,716.50
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	3,000	22.59	67,770.00
ADP	290	179.30	51,997.00
AENA SME SA	690	158.90	109,641.00
ATLANTIA SPA	5,300	22.91	121,423.00
FRAPORT AG	380	72.76	27,648.80



GETLINK	6,300	14.03	88,389.00
CONTINENTAL AG	1,380	155.60	214,728.00
FAURECIA	750	48.01	36,007.50
MICHELIN (CGDE)	1,990	117.45	233,725.50
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,800	31.34	56,412.00
PIRELLI & C. SPA	3,500	6.44	22,540.00
VALEO SA	2,400	32.42	77,808.00
BAYER MOTOREN WERK	3,560	77.75	276,790.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	760	67.85	51,566.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	10,700	59.31	634,617.00
FERRARI NV	1,440	123.10	177,264.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	13,400	14.65	196,390.40
PEUGEOT CITROEN	6,900	24.83	171,327.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	1,600	64.54	103,264.00
RENAULT SA	2,020	63.87	129,017.40
VOLKSWAGEN AG	370	166.60	61,642.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,010	163.14	327,911.40
SEB SA	260	162.50	42,250.00
ADIDAS AG	1,990	232.15	461,978.50
ESSILORLUXOTTICA	3,334	108.15	360,572.10
HERMES INTERNATIONAL	330	610.00	201,300.00
HUGO BOSS AG	720	62.50	45,000.00
KERING SA	830	510.40	423,632.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	3,200	352.30	1,127,360.00
MONCLER SPA	1,700	36.52	62,084.00
PUMA SE	120	544.50	65,340.00
ACCOR SA	2,100	37.73	79,233.00
PADDY POWER PLC	890	76.60	68,174.00
SODEXO	1,110	102.85	114,163.50
DELIVERY HERO SE	800	35.50	28,400.00
ZALANDO SE	900	41.64	37,476.00
INDITEX SA	12,000	28.00	336,000.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	7,600	16.71	127,034.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	700	38.05	26,635.00
COLRUYT SA	900	65.10	58,590.00

JERONIMO MARTINS	2,500	14.03	35,075.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	12,700	22.03	279,844.50
METRO AG	1,700	14.89	25,313.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	8,900	79.84	710,576.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	5,500	8.63	47,465.00
HEINEKEN HOLDING NV	1,290	89.25	115,132.50
HEINEKEN NV	3,140	94.18	295,725.20
PERNOD RICARD SA	2,450	154.70	379,015.00
REMY COINTREAU	140	117.60	16,464.00
DANONE	7,300	70.40	513,920.00
KERRY GROUP PLC-A	1,820	96.95	176,449.00
HENKEL AG & CO KGAA	1,450	82.70	119,915.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,220	88.18	195,759.60
BEIERSDORF AG	1,280	93.12	119,193.60
LOREAL-ORD	2,880	243.20	700,416.00
UNILEVER NV-CVA	17,900	52.27	935,633.00
BIOMERIEUX	420	72.40	30,408.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	10,100	35.33	356,833.00
SARTORIUS AG-VORZUG	320	152.90	48,928.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,600	36.64	58,624.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	2,300	70.16	161,368.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,400	48.90	215,182.00
GRIFOLS SA	3,600	24.04	86,544.00
BAYER AG-REG	10,700	61.16	654,412.00
IPSEN	520	117.60	61,152.00
MERCK KGAA	1,670	93.78	156,612.60
ORION OYJ	1,000	30.86	30,860.00
RECORDATI SPA	1,100	35.48	39,028.00
SANOFI	13,020	72.87	948,767.40
UCB SA	1,210	70.30	85,063.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	4,400	21.88	96,272.00
AIB GROUP PLC	8,000	4.24	33,968.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	79,000	5.59	441,926.00
BANCO DE SABADELL SA	70,000	1.02	71,575.00
BANCO SANTANDER SA	188,000	4.60	866,492.00

BANK OF IRELAND GROUP PLC	11,500	5.95	68,425.00	
BANKIA SA	12,250	2.41	29,547.00	
BANKINTER S.A.	8,200	7.34	60,237.20	
BNP PARIBAS	12,800	48.98	627,008.00	
CAIXABANK	41,000	2.95	121,196.00	
COMMERZBANK AG	11,400	8.12	92,647.80	
CREDIT AGRICOLE SA	14,400	12.47	179,568.00	
ERSTE GROUP BANK AG	3,300	37.05	122,265.00	
ING GROEP NV	45,800	12.04	551,432.00	
INTESA SANPAOLO	168,000	2.33	391,860.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	13,429	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	2,750	67.00	184,250.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	5,600	9.50	53,200.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	1,500	24.01	36,015.00	
SOCIETE GENERALE	9,800	29.01	284,347.00	
UNICREDIT SPA	21,400	12.76	273,064.00	
EURAZEO SE	334	66.70	22,277.80	
EXOR NV	1,300	60.30	78,390.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	940	89.20	83,848.00	
WENDEL	260	120.20	31,252.00	
AEGON NV	18,000	4.66	84,042.00	
AGEAS	1,800	46.58	83,844.00	
ALLIANZ SE-REG	4,970	214.85	1,067,804.50	
ASSICURAZIONI GENERALI	12,300	17.04	209,653.50	
AXA	22,900	23.73	543,531.50	
CNP ASSURANCES	1,640	21.34	34,997.60	
HANNOVER RUECK SE	840	133.60	112,224.00	
MAPFRE SA	12,700	2.66	33,896.30	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,730	221.50	383,195.00	
NN GROUP NV	3,700	38.30	141,710.00	
POSTE ITALIANE SPA	7,300	9.52	69,496.00	
SAMPO OYJ-A SHS	4,600	41.25	189,750.00	
SCOR SE	2,200	39.15	86,130.00	
ADYEN NV	110	670.00	73,700.00	
AMADEUS IT GROUP SA	5,000	68.86	344,300.00	

ATOS SE	890	94.42	84,033.80
CAPGEMINI SA	1,980	111.35	220,473.00
WIRECARD AG	1,350	120.10	162,135.00
DASSAULT SYSTEMES SA	1,410	135.45	190,984.50
SAP SE	11,380	100.48	1,143,462.40
NOKIA OYJ	67,000	5.13	344,179.00
INGENICO GROUP	690	67.60	46,644.00
ASML HOLDING NV	4,730	183.22	866,630.60
INFINEON TECHNOLOGIES AG	12,100	21.47	259,847.50
STMICROELECTRONICS NV	8,000	16.60	132,840.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	39,300	14.88	585,098.40
ELISA OYJ	1,600	37.62	60,192.00
ILIAD SA	310	97.20	30,132.00
KONINKLIJKE KPN NV	39,000	2.77	108,108.00
ORANGE SA	21,700	14.62	317,362.50
PROXIMUS	1,550	26.47	41,028.50
TELECOM ITALIA SPA	112,000	0.51	57,512.00
TELECOM ITALIA-RNC	68,000	0.47	32,143.60
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	5,000	2.89	14,485.00
TELEFONICA SA	55,600	7.50	417,444.80
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,500	36.44	54,660.00
1&1 DRILLISCH AG	570	34.26	19,528.20
ELECTRICITE DE FRANCE	7,400	12.83	94,942.00
ENDESA S.A.	3,500	21.92	76,720.00
ENEL SPA	97,000	5.52	535,925.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	30,000	3.44	103,320.00
FORTUM OYJ	4,900	18.32	89,792.50
IBERDROLA SA	72,577	7.77	564,503.90
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,200	18.31	76,923.00
TERNA SPA	18,000	5.34	96,192.00
VERBUND AG	1,100	43.94	48,334.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,200	24.82	104,244.00
E.ON SE	24,800	9.83	243,784.00
ENGIE	19,800	13.33	264,033.00
INNOGY SE	1,600	41.37	66,192.00

	RWE AG	6,300	22.90	144,270.00	
	SUEZ	3,600	12.28	44,226.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,400	21.05	155,770.00	
	AMUNDI SA	600	62.70	37,620.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	20,400	7.78	158,773.20	
	DEUTSCHE BOERSE AG	2,370	118.05	279,778.50	
	NATIXIS	11,000	5.24	57,728.00	
	UNIPER SE	2,100	27.20	57,120.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	130	370.00	48,100.00	
	QIAGEN NV	2,176	34.00	73,984.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	220	107.00	23,540.00	
	BUREAU VERITAS SA	3,100	22.01	68,231.00	
	RANDSTAD NV	1,500	49.21	73,815.00	
	TELEPERFORMANCE	570	167.60	95,532.00	
	WOLTERS KLUWER	3,500	62.50	218,750.00	
	AROUNDTOWN SA	11,600	7.14	82,824.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	4,200	39.75	166,950.00	
	VONOVIA SE	5,700	44.23	252,111.00	
	AXEL SPRINGER SE	360	50.50	18,180.00	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,200	16.25	35,750.00	
	JC DECAUX SA	750	28.94	21,705.00	
	PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	2,700	14.73	39,771.00	
	PUBLICIS GROUPE	2,700	51.58	139,266.00	
	RTL GROUP	310	52.05	16,135.50	
	SES FDR	3,900	15.80	61,620.00	
	TELENET GROUP HOLDING NV	690	47.48	32,761.20	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	920	80.20	73,784.00	
	VIVENDI SA	11,300	25.89	292,557.00	
小計	銘柄数：238			45,065,093.41	
				(5,672,793,958)	
	組入時価比率：11.7%			12.0%	
英債券	WOOD GROUP (JOHN) PLC	6,500	5.05	32,825.00	
	BP PLC	233,000	5.67	1,322,741.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	50,900	24.66	1,255,448.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	43,500	24.84	1,080,540.00	

CRODA INTERNATIONAL PLC	1,500	50.80	76,200.00
JOHNSON MATTHEY PLC	2,600	34.36	89,336.00
ANGLO AMERICAN PLC	11,300	21.69	245,153.50
ANTOFAGASTA PLC	5,400	10.09	54,486.00
BHP GROUP PLC	25,100	18.69	469,219.40
FRESNILLO PLC	2,700	7.78	21,016.80
GLENCORE PLC	124,000	3.38	419,368.00
RIO TINTO PLC-REG	12,900	46.00	593,400.00
MONDI PLC	3,900	17.27	67,353.00
BAE SYSTEMS PLC	35,200	4.91	173,148.80
MEGGITT PLC	11,000	5.18	57,068.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	19,000	9.07	172,482.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	56,000	1.96	110,096.00
DCC PLC	1,360	68.94	93,758.40
SMITHS GROUP PLC	4,700	15.45	72,615.00
WEIR GROUP PLC	2,800	17.75	49,700.00
ASHTED GROUP PLC	5,900	21.70	128,030.00
BUNZLE	4,400	23.52	103,488.00
FERGUSON PLC	2,548	54.00	137,592.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	3,300	5.20	17,173.20
G4S PLC	16,100	2.32	37,384.20
ROYAL MAIL PLC	12,100	2.59	31,339.00
EASYJET PLC	1,900	12.19	23,161.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	10,500	6.15	64,596.00
PERSIMMON PLC	4,200	23.44	98,448.00
TAYLOR WIMPEY PLC	34,300	1.90	65,187.15
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	1,400	38.50	53,900.00
BURBERRY GROUP PLC	4,800	20.14	96,672.00
CARNIVAL PLC	1,700	40.36	68,612.00
COMPASS GROUP PLC	17,300	17.19	297,387.00
GVC HOLDINGS PLC	5,800	6.48	37,618.80
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,470	49.33	121,845.10
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	6,200	3.60	22,320.00
TUI AG-DI	5,400	8.47	45,759.60
WHITBREAD PLC	2,300	48.42	111,366.00

MARKS & SPENCER PLC	17,200	2.82	48,555.60
NEXT PLC	1,800	57.74	103,932.00
KINGFISHER PLC	25,000	2.61	65,375.00
MORRISON SUPERMARKETS	20,000	2.21	44,280.00
SAINSBURY	18,000	2.27	40,986.00
TESCO PLC	106,000	2.50	265,106.00
COCA-COLA HBC AG-DI	1,900	27.05	51,395.00
DIAGEO PLC	28,500	31.26	890,910.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,700	25.12	118,064.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	26,500	30.57	810,105.00
IMPERIAL BRANDS PLC	10,300	24.91	256,573.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	7,900	58.12	459,148.00
UNILEVER PLC	12,300	45.03	553,930.50
CONVATEC GROUP PLC-WI	9,000	1.32	11,956.50
SMITH & NEPHEW PLC	11,600	14.44	167,562.00
NMC HEALTH PLC	800	25.18	20,144.00
ASTRAZENECA PLC	14,700	58.15	854,805.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	57,500	15.24	876,530.00
BARCLAYS PLC	187,000	1.69	316,778.00
HSBC HOLDINGS PLC	232,400	6.66	1,548,946.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	820,000	0.65	540,380.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,000	2.62	149,568.00
STANDARD CHARTERED PLC	36,000	6.72	241,920.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	23,447	2.80	65,721.94
ADMIRAL GROUP PLC	1,500	22.33	33,495.00
AVIVA PLC	44,100	4.31	190,335.60
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	12,000	3.40	40,884.00
LEGAL & GENERAL	63,000	2.91	183,456.00
PRUDENTIAL PLC	28,700	17.80	510,860.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	12,100	5.45	65,993.40
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	3,900	19.04	74,256.00
SAGE GROUP PLC (THE)	13,500	7.09	95,715.00
BT GROUP PLC	99,000	2.29	227,551.50
VODAFONE GROUP PLC	315,000	1.42	449,064.00
SSE PLC	13,700	11.24	153,988.00

	CENTRICA PLC	55,000	1.05	58,162.50	
	NATIONAL GRID PLC	37,200	8.18	304,556.40	
	SEVERN TRENT PLC	2,700	19.59	52,893.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,300	8.20	59,889.20	
	3I GROUP PLC	12,400	10.80	133,920.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,600	21.80	78,480.00	
	INVESTEC PLC	6,200	5.14	31,880.40	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	3,600	49.64	178,704.00	
	SCHRODERS PLC	1,100	31.96	35,156.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	6,200	11.13	69,037.00	
	EXPERIAN PLC	10,400	22.00	228,800.00	
	INTERTEK GROUP PLC	2,200	53.30	117,260.00	
	RELX PLC	22,900	17.01	389,529.00	
	INFORMA PLC	13,000	7.98	103,740.00	
	ITV PLC	41,000	1.40	57,523.00	
	PEARSON	8,800	8.43	74,219.20	
	WPP PLC	13,200	9.34	123,288.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	13,000	5.51	71,708.00	
小計	銘柄数：92			20,714,850.19	
				(3,011,939,217)	
	組入時価比率：6.2%			6.4%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,200	22.34	49,148.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	70	623.00	43,610.00	
	GIVAUDAN-REG	114	2,565.00	292,410.00	
	SIKA AG-REG	1,530	151.65	232,024.50	
	LAFARGEHOLCIM LTD	5,700	53.14	302,898.00	
	GEBERIT AG-REG	380	421.30	160,094.00	
	ABB LTD	22,100	21.16	467,636.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	320	216.40	69,248.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	580	220.20	127,716.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	630	145.35	91,570.50	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	5,900	76.04	448,636.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	340	318.80	108,392.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	550	62.35	34,292.50	
	DUFREY AG-REG	280	104.30	29,204.00	
		22	1,841.00	40,502.00	



	BARRY CALLEBAUT AG			
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	14	6,795.00	95,130.00
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	78,400.00	78,400.00
	NESTLE SA-REG	34,840	95.85	3,339,414.00
	ALCON INC	4,922	55.91	275,189.02
	SONOVA HOLDING AG-REG	690	200.30	138,207.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	100	836.80	83,680.00
	NOVARTIS AG-REG	24,610	77.03	1,895,708.30
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	7,970	263.40	2,099,298.00
	VIFOR PHARMA AG	590	132.30	78,057.00
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	280	81.70	22,876.00
	BALOISE HOLDING AG	580	174.50	101,210.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	390	475.40	185,406.00
	SWISS RE LTD	3,470	102.85	356,889.50
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,800	328.20	590,760.00
	TEMENOS AG-REG	770	165.90	127,743.00
	SWISSCOM AG-REG	350	471.20	164,920.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	27,800	13.68	380,304.00
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,500	48.02	120,050.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	170	762.00	129,540.00
	UBS GROUP AG	45,500	13.44	611,520.00
	LONZA AG-REG	840	297.40	249,816.00
	ADECCO GROUP AG-REG	1,910	60.06	114,714.60
	SGS SA-REG	57	2,658.00	151,506.00
	SWISS PRIME SITE-REG	786	81.85	64,334.10
小計	銘柄数：39			13,952,054.02
				(1,539,888,202)
	組入時価比率：3.2%			3.3%
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	2,500	310.00	775,000.00
	BOLIDEN AB	2,600	286.60	745,160.00
	ASSA ABLOY AB-B	12,300	210.40	2,587,920.00
	SKANSKA AB-B SHS	5,300	175.50	930,150.00
	ALFA LAVAL AB	3,000	230.20	690,600.00
	ATLAS COPCO AB-A	8,400	282.50	2,373,000.00
	ATLAS COPCO AB-B	4,800	262.30	1,259,040.00

	EPIROC AB - A	6,900	102.15	704,835.00	
	EPIROC AB - B	3,500	96.67	338,345.00	
	SANDVIK AB	12,800	175.75	2,249,600.00	
	SKF AB-B SHARES	4,600	177.70	817,420.00	
	VOLVO AB-B SHS	16,400	150.00	2,460,000.00	
	SECURITAS AB-B SHS	4,300	160.25	689,075.00	
	ELECTROLUX AB-B	2,600	239.80	623,480.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	4,600	84.54	388,884.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	10,000	167.16	1,671,600.00	
	ICA GRUPPEN AB	900	343.20	308,880.00	
	SWEDISH MATCH AB	1,900	453.20	861,080.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	6,100	264.80	1,615,280.00	
	NORDEA BANK ABP	33,500	77.88	2,608,980.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	18,400	91.26	1,679,184.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	17,100	104.10	1,780,110.00	
	SWEDBANK AB	11,800	154.85	1,827,230.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,000	208.90	417,800.00	
	INVESTOR AB-B SHS	4,900	438.70	2,149,630.00	
	KINNEVIK AB - B	2,300	257.50	592,250.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	800	308.00	246,400.00	
	ERICSSON LM-B	37,000	94.10	3,481,700.00	
	HEXAGON AB-B SHS	3,000	519.40	1,558,200.00	
	TELIA CO AB	32,000	41.05	1,313,600.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	570	565.50	322,335.00	
	TELE 2 AB-B SHS	7,100	124.15	881,465.00	
小計	銘柄数：32			40,948,233.00	
				(493,016,725)	
	組入時価比率：1.0%				1.1%
ノルウェーク ローネ	AKER AB ASA	1,000	308.00	308,000.00	
	EQUINOR ASA	13,900	198.40	2,757,760.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,300	372.30	856,290.00	
	NORSK HYDRO	14,200	39.01	553,942.00	
	MOWI ASA	4,800	187.70	900,960.00	
	ORKLA ASA	10,200	66.36	676,872.00	

	DNB ASA	10,200	168.70	1,720,740.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,600	159.50	414,700.00	
	TELENOR ASA	8,700	169.35	1,473,345.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	900	222.20	199,980.00	
小計	銘柄数：10			9,862,589.00	
				(129,791,671)	
	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	649.40	649,400.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,500	311.90	779,750.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,300	603.40	1,387,820.00	
	ISS A/S	1,900	210.10	399,190.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	51	8,440.00	430,440.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	79	8,994.00	710,526.00	
	DSV A/S	2,280	576.40	1,314,192.00	
	PANDORA A/S	1,290	289.70	373,713.00	
	CARLSBERG B	1,050	840.00	882,000.00	
	COLOPLAST-B	1,290	685.40	884,166.00	
	DEMANT A/S	1,300	194.15	252,395.00	
	GENMAB A/S	780	1,122.00	875,160.00	
	H LUNDBECK A/S	700	277.20	194,040.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	20,900	322.75	6,745,475.00	
	DANSKE BANK AS	7,200	128.90	928,080.00	
	TRYG A/S	1,000	200.80	200,800.00	
	ORSTED A/S	2,300	496.50	1,141,950.00	
小計	銘柄数：17			18,149,097.00	
				(305,993,775)	
	組入時価比率：0.6%			0.7%	
豪ドル	WORLEYPARSONS LTD	2,600	14.48	37,648.00	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	3,200	27.36	87,552.00	
	OIL SEARCH LTD	14,000	8.06	112,840.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	17,000	7.32	124,440.00	
	SANTOS LTD.	23,000	7.22	166,060.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	900	23.55	21,195.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	11,500	35.65	409,975.00	
	INCITEC PIVOT LTD	17,000	3.34	56,780.00	

ORICA LTD	5,600	18.71	104,776.00
BORAL LTD	14,000	4.87	68,180.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	5,200	18.86	98,072.00
AMCOR	14,000	15.38	215,320.00
ALUMINA LTD	26,200	2.36	61,832.00
BHP GROUP LIMITED	33,800	38.23	1,292,174.00
BLUESCOPE STEEL LTD	7,300	13.94	101,762.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	15,000	7.48	112,200.00
NEWCREST MINING	7,800	25.24	196,872.00
RIO TINTO LTD	4,000	97.74	390,960.00
SOUTH32 LTD	61,000	3.49	212,890.00
CIMIC GROUP LTD	1,045	48.97	51,173.65
BRAMBLES LTD	16,000	11.87	189,920.00
AURIZON HOLDINGS LTD	19,000	4.68	88,920.00
SYDNEY AIRPORT	17,000	7.45	126,650.00
TRANSURBAN GROUP	30,561	13.19	403,099.59
ARISTOCRAT LEISURE LTD	5,700	25.41	144,837.00
CROWN RESORTS LTD	4,800	13.19	63,312.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	500	43.14	21,570.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	800	43.61	34,888.00
TABCORP HOLDINGS	18,320	4.78	87,569.60
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	5,865	4.12	24,163.80
WESFARMERS LIMITED	13,000	34.99	454,870.00
COLES GROUP LTD	13,000	12.45	161,850.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	15,900	31.22	496,398.00
COCA-COLA AMATIL LTD	4,300	8.64	37,152.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	9,100	16.75	152,425.00
COCHLEAR LTD	740	175.75	130,055.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,900	62.07	117,933.00
SONIC HEALTHCARE LTD	4,900	24.41	119,609.00
CSL LIMITED	5,310	190.51	1,011,608.10
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	32,700	26.78	875,706.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	4,126	9.13	37,670.38
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	3,700	10.02	37,074.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	20,300	73.41	1,490,223.00

	NATIONAL AUSTRALIA BANK	30,300	25.27	765,681.00	
	WESTPAC BANKING CORP	39,300	26.83	1,054,419.00	
	AMP LIMITED	31,000	2.28	70,680.00	
	CHALLENGER LIMITED	6,000	7.79	46,740.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	27,328	7.74	211,518.72	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	30,000	2.74	82,200.00	
	QBE INSURANCE	16,400	12.75	209,100.00	
	SUNCORP GROUP LTD	13,700	13.54	185,498.00	
	COMPUTERSHARE LTD	6,600	17.80	117,480.00	
	TELSTRA CORP LTD	42,000	3.41	143,220.00	
	TPG TELECOM LTD	4,359	6.91	30,120.69	
	AUSNET SERVICES	25,264	1.76	44,590.96	
	APA GROUP	12,700	9.51	120,777.00	
	AGL ENERGY LTD	6,300	21.79	137,277.00	
	ASX LTD	2,000	71.62	143,240.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	3,910	133.17	520,694.70	
	SEEK LTD	3,800	17.84	67,792.00	
	REA GROUP LTD	600	78.40	47,040.00	
小計	銘柄数：61			14,228,274.19	
				(1,138,973,348)	
	組入時価比率：2.4%			2.4%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	7,345	5.18	38,047.10	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	13,000	8.00	104,000.00	
	A2 MILK CO LTD	8,000	15.70	125,600.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	6,500	15.16	98,540.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,000	12.35	61,750.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	20,000	3.70	74,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	15,300	4.08	62,424.00	
小計	銘柄数：7			564,361.10	
				(42,259,359)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	28,916	82.80	2,394,244.80	
	NWS HOLDINGS LTD	19,000	16.78	318,820.00	
	MTR CORP	19,000	47.45	901,550.00	

MINTH GROUP LTD	10,000	28.55	285,500.00
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	18,000	58.25	1,048,500.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	5,500	25.35	139,425.00
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	30,000	58.65	1,759,500.00
MGM CHINA HOLDINGS LTD	13,600	16.44	223,584.00
SANDS CHINA LTD	27,200	43.05	1,170,960.00
SHANGRI-LA ASIA LTD	7,000	11.12	77,840.00
SJM HOLDINGS LIMITED	24,000	9.54	228,960.00
WYNN MACAU LTD	18,000	21.30	383,400.00
WH GROUP LIMITED	106,000	9.21	976,260.00
BANK OF EAST ASIA	11,540	25.55	294,847.00
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	37,000	35.35	1,307,950.00
HANG SENG BANK	8,800	204.60	1,800,480.00
AIA GROUP LTD	141,000	79.70	11,237,700.00
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	3,200	96.45	308,640.00
HKT TRUST AND HKT LTD	38,120	12.46	474,975.20
PCCW LTD	41,000	4.78	195,980.00
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	9,000	62.85	565,650.00
CLP HLDGS	20,500	88.70	1,818,350.00
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	14,500	54.50	790,250.00
HONG KONG & CHINA GAS	96,503	18.46	1,781,445.38
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	13,600	277.20	3,769,920.00
CK ASSET HOLDINGS LTD	29,416	66.05	1,942,926.80
HANG LUNG GROUP LTD	10,000	23.30	233,000.00
HANG LUNG PROPERTIES LTD	22,000	18.56	408,320.00
HENDERSON LAND	16,223	49.85	808,716.55
HYSAN DEVELOPMENT	7,000	42.30	296,100.00
KERRY PROPERTIES	6,500	34.30	222,950.00
NEW WORLD DEVELOPMENT	73,333	13.28	973,862.24
SINO LAND CO.LTD	31,000	14.06	435,860.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	18,000	133.50	2,403,000.00
SWIRE PACIFIC-A	5,000	98.70	493,500.00
SWIRE PROPERTIES LTD	10,800	31.75	342,900.00
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	16,200	58.30	944,460.00
WHARF(HOLDING)	10,200	22.35	227,970.00

	WHEELOCK & COMPANY LTD	8,000	55.45	443,600.00	
小計	銘柄数：39			44,431,896.97	
				(634,043,169)	
	組入時価比率：1.3%			1.4%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	18,000	3.87	69,660.00	
	KEPPEL CORP.	16,000	6.74	107,840.00	
	SEBACORP INDUSTRIES	12,000	2.71	32,520.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	27,000	1.60	43,200.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	8,000	9.85	78,800.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	32,000	2.61	83,520.00	
	SATS LTD	8,000	5.24	41,920.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	81,000	0.96	77,760.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	1,111	36.20	40,218.20	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	86,000	0.29	25,370.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	17,000	3.64	61,880.00	
	DBS GROUP HLDGS	20,500	27.40	561,700.00	
	OCBC-ORD	35,450	11.77	417,246.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	14,600	26.80	391,280.00	
	VENTURE CORP LTD	3,200	19.24	61,568.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	92,000	3.15	289,800.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	12,000	7.33	87,960.00	
	CAPITALAND LIMITED	32,000	3.64	116,480.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	4,000	9.23	36,920.00	
	UOL GROUP LIMITED	3,000	7.67	23,010.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	17,000	2.47	41,990.00	
小計	銘柄数：21			2,690,642.70	
				(222,462,338)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
新シェケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	6,000	19.95	119,700.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	270	499.10	134,757.00	
	BANK HAPOLIM BM	14,000	25.78	360,920.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	18,000	24.49	440,820.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,100	78.00	85,800.00	
	NICE LTD	810	477.00	386,370.00	

		BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	25,000	2.72	68,000.00	
		AZRIELI GROUP	400	216.70	86,680.00	
	小計	銘柄数：8			1,683,047.00	
					(52,426,914)	
		組入時価比率：0.1%			0.1%	
	合計				46,886,751,893	
					(46,886,751,893)	

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

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2019年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	6,100	110,288.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,450	201,057.00	
		AMERICAN TOWER CORP	5,180	999,273.80	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	16,800	167,832.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,560	305,994.00	
		BOSTON PROPERTIES	1,660	220,763.40	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	2,669	55,702.03	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	960	94,684.80	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,930	604,516.60	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,340	281,853.00	
		DUKE REALTY CORP	4,800	144,624.00	
		EQUINIX INC	870	388,402.80	
		EQUITY RESIDENTIAL	4,500	337,815.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	680	189,237.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	1,610	162,127.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	780	103,116.00	
		HCP INC	6,100	181,963.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	7,700	145,530.00	
		INVITATION HOMES INC	3,000	73,170.00	
		IRON MOUNTAIN INC	3,400	122,196.00	
KIMCO REALTY CORP	5,000	87,650.00			



	LIBERTY PROPERTY TRUST	1,400	67,704.00	
	MACERICH CO /THE	800	33,168.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,420	151,315.20	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,700	87,618.00	
	PROLOGIS INC	6,900	507,633.00	
	PUBLIC STORAGE	1,700	369,665.00	
	REALTY INCOME CORP	3,300	226,149.00	
	REGENCY CENTERS CORP	1,400	92,932.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,290	255,652.20	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	3,650	649,919.00	
	SL GREEN REALTY CORP	940	81,827.00	
	UDR INC	3,400	150,382.00	
	VENTAS INC	4,200	247,926.00	
	VEREIT INC	11,100	89,577.00	
	VORNADO REALTY TRUST	1,770	118,607.70	
	WELLTOWER INC	4,230	309,805.20	
	WEYERHAEUSER CO	8,300	218,788.00	
	WP CAREY INC	1,800	138,078.00	
小計	銘柄数：39	141,389	8,774,541.93	
			(982,660,950)	
	組入時価比率：2.0%		79.7%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	1,200	27,756.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,986	51,536.70	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	700	23,919.00	
小計	銘柄数：3	3,886	103,211.70	
			(8,639,851)	
	組入時価比率：0.0%		0.7%	
ユーロ	COVIVIO	560	53,032.00	
	GECINA SA	560	72,856.00	
	ICADE	230	17,330.50	
	KLEPIERRE	2,200	70,466.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,470	227,335.50	
小計	銘柄数：5	5,020	441,020.00	
			(55,515,597)	
	組入時価比率：0.1%		4.5%	
英ポンド	BRITISH LAND	9,100	54,199.60	

小計	HAMMERSON PLC	8,600	28,414.40	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	7,312	66,612.32	
	SEGRO PLC	9,360	62,712.00	
	銘柄数：4	34,372	211,938.32	(30,815,831)
	組入時価比率：0.1%			2.5%
豪ドル	DEXUS	13,200	166,584.00	
	GOODMAN GROUP	16,700	212,257.00	
	GPT GROUP	26,000	152,360.00	
	LENDLEASE GROUP	6,600	84,480.00	
	MIRVAC GROUP	36,000	100,800.00	
	SCENTRE GROUP	68,000	263,840.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	25,800	100,362.00	
	VICINITY CENTRES	44,000	110,440.00	
	小計	銘柄数：8	236,300	1,191,123.00
	組入時価比率：0.2%			7.7%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	30,000	231,600.00	
	LINK REIT	26,500	2,411,500.00	
小計	銘柄数：2	56,500	2,643,100.00	(37,717,037)
	組入時価比率：0.1%			3.1%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	34,000	99,960.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	22,154	42,757.22	
	CAPITALAND MALL TRUST	27,800	64,218.00	
	SUNTEC REIT	29,000	54,810.00	
	小計	銘柄数：4	112,954	261,745.22
	組入時価比率：0.0%			1.8%
合計			1,232,339,756	(1,232,339,756)

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

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

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 4月22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	912,809,734	-	938,740,739	25,931,005
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	46,633,005,115	-	47,025,152,400	392,147,285
米ドル	31,732,660,907	-	32,029,092,600	296,431,693
カナダドル	1,776,461,080	-	1,789,468,000	13,006,920
ユーロ	5,456,300,062	-	5,506,812,500	50,512,438
英ポンド	3,009,900,213	-	3,026,599,000	16,698,787
スイスフラン	1,546,212,615	-	1,528,763,000	17,449,615
スウェーデンクローナ	468,137,304	-	471,004,800	2,867,496
ノルウェークローネ	126,237,644	-	128,640,600	2,402,956
デンマーククローネ	310,007,229	-	312,753,000	2,745,771
豪ドル	1,234,493,910	-	1,251,374,000	16,880,090
ニュージーランドドル	43,113,563	-	42,618,900	494,663
香港ドル	648,513,641	-	654,217,500	5,703,859
シンガポールドル	231,754,077	-	233,673,100	1,919,023
新シェケル	49,212,870	-	50,135,400	922,530
合計	-	-	-	366,216,280

## (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)

(2019年 4月22日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	737,318,424
コール・ローン	47,444,584
株式	37,843,605,586
投資信託受益証券	327,046,636
投資証券	130,220,033
派生商品評価勘定	38,056,276
未収配当金	40,421,701
差入委託証拠金	320,406,500
流動資産合計	39,484,519,740
資産合計	39,484,519,740
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	12,600,991
未払解約金	37,175,208
未払利息	103
その他未払費用	1,505,400
流動負債合計	51,281,702
負債合計	51,281,702
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	29,933,997,721
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,499,240,317
元本等合計	39,433,238,038
純資産合計	39,433,238,038
負債純資産合計	39,484,519,740

### 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。 投資信託受益証券
-------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>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>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 4月22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	1.3173円
(10,000口当たり純資産額)	(13,173円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日
1. 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

## 2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

当ファンドは、信託財産に属する資産の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。

当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

## 3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

### 市場リスクの管理

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

### 信用リスクの管理

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

### 流動性リスクの管理

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

## (2) 金融商品の時価等に関する事項

2019年 4月22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

2019年 4月22日現在

期首	2018年 4月24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	25,194,047,349円
同期中における追加設定元本額	6,815,459,460円
同期中における一部解約元本額	2,075,509,088円

期末元本額		29,933,997,721円
期末元本額の内訳*		
野村資産設計ファンド2015		27,730,600円
野村資産設計ファンド2020		32,564,504円
野村資産設計ファンド2025		50,095,294円
野村資産設計ファンド2030		58,029,826円
野村資産設計ファンド2035		44,333,033円
野村資産設計ファンド2040		100,487,771円
野村資産設計ファンド2045		14,642,751円
野村インデックスファンド・新興国株式		3,591,006,677円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		233,724,030円
野村資産設計ファンド2050		24,248,668円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		7,404,762円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		3,006,341円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		2,136,336円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		1,331,407円
インデックス・ブレンド(タイプ)		3,098,997円
インデックス・ブレンド(タイプ)		2,410,845円
インデックス・ブレンド(タイプ)		8,158,782円
インデックス・ブレンド(タイプ)		2,752,865円
インデックス・ブレンド(タイプ)		12,556,656円
野村つみたて外国株投信		702,922,397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)		504,343,165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)		1,193,464,161円
世界6資産分散ファンド		162,509,574円
NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場投信		278,554,498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)		22,885,550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)		1,270,795,836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)		21,575,631,516円
野村資産設計ファンド(DC)2030		846,223円
野村資産設計ファンド(DC)2040		818,947円
野村資産設計ファンド(DC)2050		1,505,709円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年4月22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	19.90	290,540.00	
		INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	57,700	1.18	68,547.60	

LUKOIL PJSC-SPON ADR	30,750	87.50	2,690,625.00
NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	5,550	184.10	1,021,755.00
PJSC GAZPROM-ADR	331,700	5.00	1,659,826.80
ROSNEFT OJSC - GDR	72,800	6.81	495,913.60
SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	122,900	3.85	473,410.80
TATNEFT-SPONSORED ADR	16,280	70.00	1,139,600.00
TRANSNEFT PJSC	21	2,649.16	55,632.39
PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	7,010	12.79	89,657.90
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	7,400	38.08	281,792.00
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	11,100	15.95	177,045.00
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	10,700	8.88	95,016.00
NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	7,370	27.00	198,990.00
PJSC ALROSA	176,000	1.49	263,183.36
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	40,100	22.56	904,656.00
POLYUS PJSC-REG S-GDR	3,960	38.98	154,360.80
SEVERSTAL-GDR REG S	11,380	16.15	183,787.00
SOUTHERN COPPER CORP	4,792	41.03	196,615.76
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	21,600	19.60	423,360.00
LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR	20,300	10.88	220,864.00
DP WORLD PLC	11,000	17.21	189,310.00
HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	8,800	42.43	373,384.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	22,450	45.24	1,015,638.00
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	81,060	186.94	15,153,356.40
BAOZUN INC-SPN ADR	2,300	41.77	96,071.00
CTIP.COM INTERNATIONAL -ADR	25,880	44.43	1,149,848.40
JD.COM INC-ADR	46,600	30.01	1,398,466.00
PINDUODUO INC ADR	13,200	23.55	310,860.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	26,600	7.93	210,938.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	20,570	14.23	292,711.10
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	8,500	27.51	233,835.00
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	4,000	28.70	114,800.00
HUTCHISON CHINA MEDITECH - ADR	3,890	30.35	118,061.50
BANCO DE CHILE-ADR	8,370	30.04	251,434.80
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	9,596	29.46	282,698.16
BANCOLOMBIA S.A. -SPONS ADR	7,330	53.08	389,076.40



	CREDICORP LTD	4,310	231.34	997,075.40	
	ITAU CORPBANCA-ADR	5,466	13.45	73,517.70	
	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	673,400	3.63	2,445,169.27	
	STATE BANK OF INDIA-GDR	11,070	44.60	493,722.00	
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	1.16	102,391.85	
	GDS HOLDINGS LTD-ADR	3,200	39.10	125,120.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	28,650	8.09	231,778.50	
	ENEL AMERICAS S.A-ADR	37,300	8.92	332,716.00	
	ENEL CHILE SA-ADR	30,925	5.22	161,428.50	
	INTER RAO UES PJSC	1,669,000	0.05	99,272.12	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	85,170	1.42	121,788.84	
	NOAH HLDS LTD ADR	1,500	53.90	80,850.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	9,140	89.99	822,508.60	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	22,700	34.08	773,616.00	
	51JOB INC-ADR	1,300	92.92	120,796.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	73,040	1.54	112,481.60	
	IQIYI INC-ADR	9,100	23.19	211,074.50	
	NETEASE INC-ADR	4,970	266.01	1,322,069.70	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	7,400	18.22	134,828.00	
	58.COM INC-ADR	5,780	72.59	419,570.20	
	AUTOHOME INC-ADR	3,860	113.26	437,183.60	
	BAIDU INC - SPON ADR	17,440	171.02	2,982,588.80	
	MOMO INC-SPON ADR	8,800	35.67	313,896.00	
	SINA CORP	4,150	65.11	270,206.50	
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,400	71.50	243,100.00	
	YY INC-ADR	3,000	87.79	263,370.00	
小計	銘柄数：63			46,357,787.45	
				(5,191,608,616)	
	組入時価比率：13.2%			13.8%	
メキシコペソ	MEXICHEM SAB DE CV-*	60,458	45.79	2,768,371.82	
	CEMEX SAB - CPO	886,985	9.24	8,195,741.40	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	229,983	58.75	13,511,501.25	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	229.26	1,928,076.60	
	ALFA S.A.B. -A	172,100	20.37	3,505,677.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	73.03	2,548,747.00	

	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,300	308.37	4,409,691.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	21,400	194.98	4,172,572.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	12,900	190.89	2,462,481.00	
	ALSEA SAB DE CV	30,000	44.85	1,345,500.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,800	119.71	1,292,868.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	338,000	55.46	18,745,480.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	26,100	107.02	2,793,222.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	32,495	122.01	3,964,714.95	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	118,200	181.55	21,459,210.00	
	GRUMA S.A.B. -B	13,400	199.73	2,676,382.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	90,500	40.52	3,667,060.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	79,500	34.10	2,710,950.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO SA INSTITUCION	132,000	32.50	4,290,000.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	163,700	122.92	20,122,004.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	140,200	28.88	4,048,976.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,142,000	14.91	31,937,220.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	38,700	84.18	3,257,766.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	153,400	40.68	6,240,312.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	23,100	91.02	2,102,562.00	
小計	銘柄数：25			174,157,086.02	
				(1,039,717,803)	
	組入時価比率：2.6%			2.7%	
リアル	COSAN SA	9,100	46.40	422,240.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	185,700	30.76	5,712,132.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	244,000	27.60	6,734,400.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	22.63	1,086,240.00	
	BRASKEM SA-PREF A	12,100	48.32	584,672.00	
	KLABIN SA-UNIT	42,700	16.35	698,145.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	15.27	705,474.00	
	GERDAU SA PFD NPV	56,100	14.93	837,573.00	
	VALE SA	195,921	52.58	10,301,526.18	
	SUZANO SA	32,960	41.03	1,352,348.80	
	EMBRAER SA	41,000	19.32	792,120.00	
	WEG SA	51,924	18.63	967,344.12	
	LOCALIZA RENT A CAR	38,534	32.76	1,262,373.84	

RUMO SA	70,600	17.86	1,260,916.00
CCR SA	69,000	11.98	826,620.00
B2W CIA DIGITAL	13,500	37.90	511,650.00
LOJAS AMERICANAS S.A. (PREF)	50,492	15.19	766,973.48
LOJAS RENNER S.A.	46,450	43.02	1,998,279.00
MAGAZINE LUIZA SA	4,100	170.80	700,280.00
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	19,000	22.54	428,260.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,000	20.20	383,800.00
CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF	11,103	93.80	1,041,461.40
RAIA DROGASIL SA	13,500	65.08	878,580.00
AMBEV SA	301,056	17.08	5,142,036.48
BRF SA	32,700	27.61	902,847.00
JBS SA	65,700	18.24	1,198,368.00
M DIAS BRANCO SA	5,500	40.51	222,805.00
NATURA COSMETICOS SA	14,200	46.00	653,200.00
HYPERA SA	23,900	24.87	594,393.00
BANCO BRADESCO S.A.	74,131	30.45	2,257,288.95
BANCO BRADESCO SA - PREF	255,015	34.75	8,861,771.25
BANCO DO BRASIL SA	52,300	48.85	2,554,855.00
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	45.32	1,105,808.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	299,291	32.83	9,825,723.53
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	278,517	11.59	3,228,012.03
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	44,100	27.30	1,203,930.00
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	10,000	92.88	928,800.00
PORTO SEGURO SA	7,000	55.32	387,240.00
SUL AMERICA SA - UNITS	9,149	31.06	284,167.94
CIELO SA	73,763	8.25	608,544.75
TELEFONICA BRASIL-PREF	30,405	47.20	1,435,116.00
TIM PARTICIPACOES SA	46,552	12.11	563,744.72
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	11,800	34.47	406,746.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	11,100	32.35	359,085.00
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	60,029	14.09	845,808.61
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	10,000	79.90	799,000.00
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	19,000	41.34	785,460.00
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	132,033	31.95	4,218,454.35

	KROTON EDUCACIONAL SA	83,456	9.88	824,545.28	
	ENGIE BRASIL SA	12,000	42.37	508,440.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	46,700	12.23	571,141.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	17,600	23.10	406,560.00	
小計	銘柄数：52			91,937,300.71	
				(2,620,213,070)	
	組入時価比率：6.6%			6.9%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	8,660.00	224,294,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	2,265.00	162,969,015.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	51,000	4,972.80	253,612,800.00	
	CENCOSUD SA	80,738	1,385.90	111,894,794.20	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	28,800	2,473.70	71,242,560.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,960	45,590.00	134,946,400.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	8,972	7,041.00	63,171,852.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	208,000	387.90	80,683,200.00	
	COLBUN SA	471,000	153.00	72,063,000.00	
小計	銘柄数：9			1,174,877,621.20	
				(198,671,805)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
コロンビアペソ	CEMENTOS ARGOS SA	27,600	8,110.00	223,836,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	15,600	17,860.00	278,616,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	15,900	41,080.00	653,172,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PFD	205,700	1,310.00	269,467,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	35,320.00	459,160,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF	7,000	34,100.00	238,700,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,400	16,300.00	544,420,000.00	
小計	銘柄数：7			2,667,371,000.00	
				(94,691,670)	
	組入時価比率：0.2%			0.3%	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	3,800	21.80	82,840.00	
	TITAN CEMENT CO	2,570	19.00	48,830.00	
	FF GROUP	2,030	1.92	3,897.60	
	OPAP SA	13,190	9.36	123,458.40	
	JUMBO SA	6,732	16.06	108,115.92	
	ALPHA BANK A.E.	76,409	1.47	112,321.23	
	HELLENIC TELECOM	16,700	12.32	205,744.00	

小計	銘柄数：7			685,207.15 (86,253,876)	0.2%
	組入時価比率：0.2%				
英債券	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	10,000	8.16	81,640.00	
小計	銘柄数：1			81,640.00 (11,870,456)	0.0%
	組入時価比率：0.0%				
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,300	128.20	1,064,060.00	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	41,360	4.66	192,737.60	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	78,250	9.27	725,377.50	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	20,730	21.20	439,476.00	
	KOC HLDGS	53,000	16.90	895,700.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	42,345	5.96	252,376.20	
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,186	14.15	455,431.90	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,660	24.22	233,965.20	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	3,320	52.35	173,802.00	
	ARCELIK A.S	14,543	19.38	281,843.34	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	12,690	80.55	1,022,179.50	
	ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYI I	12,740	19.88	253,271.20	
	AKBANK T.A.S	198,000	6.24	1,235,520.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	142,160	8.45	1,201,252.00	
	TURKIYE HALK BANKASI	32,890	6.23	204,904.70	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	5.91	542,538.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	47,880	7.92	379,209.60	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	77,000	12.75	981,750.00	
小計	銘柄数：18			10,535,394.74 (203,017,056)	0.5%
	組入時価比率：0.5%				
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	905.50	4,572,775.00	
	MONETA MONEY BANK AS	27,300	80.35	2,193,555.00	
	CEZ AS	9,530	537.00	5,117,610.00	
小計	銘柄数：3			11,883,940.00 (58,231,306)	0.2%
	組入時価比率：0.1%				
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	25,000	3,310.00	82,750,000.00	

	RICHTER GEDEON NYRT	8,470	5,700.00	48,279,000.00	
	OTP BANK NYRT	13,690	13,000.00	177,970,000.00	
小計	銘柄数：3			308,999,000.00	
				(121,498,406)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
ズロチ	GRUPA LOTOS SA	6,800	83.92	570,656.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	18,800	101.15	1,901,620.00	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	97,770	6.05	591,997.35	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	2,570	58.75	150,987.50	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,700	107.20	1,039,840.00	
	CCC SA	1,520	233.00	354,160.00	
	LPP SA	94	8,545.00	803,230.00	
	DINO POLSKA SA	2,410	125.00	301,250.00	
	ALIOR BANK SA	4,843	60.00	290,580.00	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	65.10	130,851.00	
	BANK MILLENNIUM SA	35,830	9.55	342,176.50	
	BANK PEKAO SA	10,520	116.90	1,229,788.00	
	MBANK	900	442.00	397,800.00	
	PKO BANK POLSKI SA	56,400	39.23	2,212,572.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,030	398.20	808,346.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	37,500	42.55	1,595,625.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	4.94	193,401.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	9.59	496,090.70	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	26.16	494,424.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,080	202.00	824,160.00	
小計	銘柄数：20			14,729,555.05	
				(433,638,100)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	100,000	8.51	851,000.00	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	112,000	3.53	395,360.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,630,900	6.11	9,964,799.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	203,000	17.78	3,609,340.00	
	CNOOC LTD	1,109,000	14.74	16,346,660.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	186,000	8.41	1,564,260.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,284,000	5.04	6,471,360.00	
	YANZHOU COAL MINING-H	96,000	8.79	843,840.00	

SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	206,000	3.74	770,440.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	82,000	49.75	4,079,500.00	
BBMG CORPORATION - H	127,000	2.97	377,190.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	235,000	7.45	1,750,750.00	
CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	152,000	8.46	1,285,920.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	3.35	703,500.00	
ANGANG STEEL CO LTD-H	58,000	5.75	333,500.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	167,000	6.42	1,072,140.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	180,000	3.36	604,800.00	
CHINA ORIENTAL GROUP COMPANY LIMITED	86,000	4.98	428,280.00	
CHINA ZHONGWANG HOLDING LTD	88,800	4.46	396,048.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	11.20	1,097,600.00	
MAANSHAN IRON & STEEL CO LTD - H	134,000	4.11	550,740.00	
MMG LTD	132,000	3.87	510,840.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	57,000	7.22	411,540.00	
ZIJIN MINING GROUP CO-H	347,000	3.39	1,176,330.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	6.56	511,680.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	7.79	786,790.00	
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	112,000	4.67	523,040.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	299,000	8.05	2,406,950.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	230,000	6.40	1,472,000.00	
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	135,000	9.47	1,278,450.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	8.08	1,238,260.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	156,000	2.30	358,800.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	7.18	513,370.00	
FULLSHARE HOLDINGS LIMITED	390,000	0.93	362,700.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	126,000	3.15	396,900.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	33,600	9.08	305,088.00	
XINJIANG GOLDWIND SCIENCE-RT	6,384	0.87	5,554.08	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	36,300	41.50	1,506,450.00	
CITIC LTD	362,000	11.76	4,257,120.00	
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	165,940	12.84	2,130,669.60	
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	30,000	18.88	566,400.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	99,500	27.30	2,716,350.00	

CRRC CORP LTD-H	275,350	7.21	1,985,273.50
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	32,000	18.80	601,600.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	37,500	18.72	702,000.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	117,800	14.32	1,686,896.00
BOC AVIATION LTD	11,300	68.45	773,485.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	211,000	7.76	1,637,360.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	92,000	14.30	1,315,600.00
GREENTOWN SER	60,000	6.96	417,600.00
SINOTRANS LIMITED-H	111,000	3.36	372,960.00
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	10.04	1,024,080.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	76,000	5.98	454,480.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	7.41	785,460.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION-H	66,000	5.13	338,580.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	140,000	3.78	529,200.00
CAR INC	41,000	6.36	260,760.00
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	7.01	686,980.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	82,000	16.34	1,339,880.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	8.90	907,800.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.82	735,760.00
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	49,500	17.60	871,200.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	8.91	1,015,740.00
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	172,000	3.60	619,200.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	39,200	30.50	1,195,600.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	43,000	12.78	549,540.00
BAIC MOTOR CORPORATION LIMITED	96,000	6.27	601,920.00
BRIILLANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	9.59	2,090,620.00
BYD CO LTD-H	44,000	57.35	2,523,400.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	8.54	1,571,360.00
GEEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	301,000	18.12	5,454,120.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	166,500	6.97	1,160,505.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	199,890	10.02	2,002,897.80
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	87,000	23.15	2,014,050.00



ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	67,000	55.30	3,705,100.00
HENGTEEN NETWORKS GROUP LTD	1,216,000	0.23	285,760.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	48,400	104.50	5,057,800.00
CHINA TRAVEL INTL INV HK	118,000	1.81	213,580.00
MEITUAN DIANPING B	25,400	55.20	1,402,080.00
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	523,360	0.85	444,856.00
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	31,000	23.00	713,000.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	127,000	7.01	890,270.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	87,333	35.05	3,061,021.65
TSING TAO BREWERY CO-H	20,000	48.25	965,000.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	114,000	2.64	300,960.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.10	15,120.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	172,000	28.35	4,876,200.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	5.47	609,905.00
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	118,000	12.72	1,500,960.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	70,000	6.98	488,600.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	288,000	6.21	1,788,480.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	28,000	36.60	1,024,800.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	44,500	69.90	3,110,550.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	116,000	7.71	894,360.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	17.32	881,588.00
SINOPHARM GROUP CO-H	69,200	31.55	2,183,260.00
3SBIO, INC	77,000	15.52	1,195,040.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	81,000	7.14	578,340.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	11.42	1,062,060.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	124,000	4.74	587,760.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	292,000	15.34	4,479,280.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	62,500	7.17	448,125.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	28.75	991,875.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	155,000	1.91	296,050.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	433,000	7.80	3,377,400.00
SSY GROUP LTD	82,000	7.58	621,560.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	31,000	11.02	341,620.00

AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,848,000	3.66	6,763,680.00	
BANK OF CHINA LTD-H	4,923,000	3.81	18,756,630.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	581,790	6.72	3,909,628.80	
CHINA CITIC BANK-H	560,000	5.14	2,878,400.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,036,000	7.06	42,614,160.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	134,000	3.87	518,580.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	250,192	40.55	10,145,285.60	
CHINA MINSHENG BANKING-H	419,800	6.07	2,548,186.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	137,000	4.82	660,340.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,374,000	6.00	26,244,000.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	546,000	4.72	2,577,120.00	
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	8.46	1,302,840.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	467,000	21.90	10,227,300.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	172,000	33.85	5,822,200.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	308,000	1.64	505,120.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	25.90	2,679,924.80	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	47,400	46.20	2,189,880.00	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	3.37	1,978,190.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	434,420	9.36	4,066,171.20	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	325,500	94.50	30,759,750.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	8,900	28.65	254,985.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	19.76	1,304,160.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	142,000	9.82	1,394,440.00	
KINGSOFT CORP LTD	46,000	21.30	979,800.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	33,000	13.64	450,120.00	
ZTE CORP-H	58,052	26.75	1,552,891.00	
LEGEND HLDS CORP	18,100	21.50	389,150.00	
LENOVO GROUP LTD	426,000	7.30	3,109,800.00	
MEITU INC	106,000	3.35	355,100.00	
XIAOMI CORPORATION	236,000	11.70	2,761,200.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	45,000	54.10	2,434,500.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	80,000	6.35	508,000.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	43,000	27.80	1,195,400.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	58,500	8.85	517,725.00	

SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	43,800	99.55	4,360,290.00
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LTD	367,000	0.05	19,451.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	26,000	19.28	501,280.00
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	176,000	8.37	1,473,120.00
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	162,000	4.37	707,940.00
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	6.94	1,210,336.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	856,000	4.12	3,526,720.00
CHINA TOWER CORP LTD	2,540,000	2.20	5,588,000.00
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	378,000	9.69	3,662,820.00
CHINA MOBILE LTD	383,500	75.70	29,030,950.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	42.30	1,522,800.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	117,400	24.70	2,899,780.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	52,000	35.70	1,856,400.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	49,600	75.30	3,734,880.00
TOWNGAS CHINA COMPANY LTD	53,000	6.05	320,650.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	317,000	4.80	1,521,600.00
GUANGDONG INVESTMENT	184,000	14.50	2,668,000.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	2.19	1,357,800.00
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LT	56,000	23.10	1,293,600.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	48,000	14.94	717,120.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	5.57	1,481,620.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	592,000	1.69	1,000,480.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	56,400	17.62	993,768.00
CITIC SECURITIES CO LTD-H	149,000	18.00	2,682,000.00
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	11.30	933,380.00
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	32,600	16.44	535,944.00
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	217,200	10.40	2,258,880.00
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	92,200	15.58	1,436,476.00
CGN POWER CO LTD-H	627,000	2.18	1,366,860.00
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	218,000	5.37	1,170,660.00
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	240,000	2.06	494,400.00

CHINA RESOURCES POWER HOLDING	108,000	11.34	1,224,720.00
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN-H	166,000	2.17	360,220.00
HUADIAN POWER INTL CORP-H	88,000	3.57	314,160.00
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	4.76	1,132,880.00
HUANENG RENEWABLES CORP-H	380,000	2.21	839,800.00
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	212,000	9.65	2,045,800.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	72,000	20.60	1,483,200.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	29,000	80.25	2,327,250.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	12.48	1,173,120.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	158,000	25.40	4,013,200.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	300,000	5.41	1,623,000.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	234,000	28.75	6,727,500.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	170,444	33.80	5,761,007.20
CHINA VANKE CO LTD-H	81,300	32.30	2,625,990.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	196,000	5.62	1,101,520.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	487,380	12.94	6,306,697.20
FUTURE LAND DEVELOPMENT HLD LTD	96,000	9.58	919,680.00
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	47,000	7.63	358,610.00
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	50,400	16.54	833,616.00
JIAYUAN INTL GROUP LTD	54,000	3.75	202,500.00
KAISA GROUP HLDS LTD	115,000	3.38	388,700.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	68,500	9.38	642,530.00
LOGAN PROPERTY HLDS CO LTD	74,000	12.92	956,080.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	98,000	28.45	2,788,100.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	176,000	3.19	561,440.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	72,000	24.25	1,746,000.00
SHUI ON LAND LTD	197,000	1.94	382,180.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	146,000	3.72	543,120.00
SOHO CHINA LTD	106,000	3.02	320,120.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	148,000	41.75	6,179,000.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	370,000	1.90	703,000.00
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	91,000	4.42	402,220.00
CHINA LITERATURE LTD	20,800	37.15	772,720.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	1.65	1,435,500.00
TENCENT HOLDINGS LTD	356,500	391.60	139,605,400.00

小計	銘柄数：207			639,033,819.43	
				(9,119,012,603)	
	組入時価比率：23.1%			24.2%	
リンギ	DIALOG GROUP BHD	219,344	3.17	695,320.48	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	14,500	24.72	358,440.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	163,000	8.95	1,458,850.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	81,100	4.50	364,950.00	
	GAMUDA BERHAD	100,200	3.08	308,616.00	
	IJM CORP	152,600	2.20	335,720.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	9.80	331,240.00	
	SIME DARBY BERHAD	122,800	2.25	276,300.00	
	AIRASIA GROUP BHD	86,600	2.50	216,500.00	
	MISC BHD	69,060	6.64	458,558.40	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	56,460	6.77	382,234.20	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	3.87	198,918.00	
	GENTING BHD	124,000	6.78	840,720.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	163,200	3.24	528,768.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	34.42	265,034.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,600	10.48	153,008.00	
	IOI CORP	116,700	4.47	521,649.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG	26,400	24.80	654,720.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	3,600	146.60	527,760.00	
	PPB GROUP BERHAD	35,040	18.78	658,051.20	
	QL RESOURCES BHD	40,000	6.89	275,600.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	5.10	735,930.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	7,800	36.30	283,140.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	74,400	4.72	351,168.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	84,200	4.53	381,426.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	164,000	5.56	911,840.00	
ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	54,800	4.00	219,200.00		
AMMB HOLDING	125,000	4.47	558,750.00		
CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	289,000	5.07	1,465,230.00		
HONG LEONG BANK	37,460	20.08	752,196.80		
HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	19.06	255,823.32		
MALAYAN BANKING	246,000	9.09	2,236,140.00		

	PUBLIC BANK BHD	182,760	22.52	4,115,755.20	
	RHB BANK BHD	80,023	5.80	464,133.40	
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	2.98	184,760.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	4.04	787,800.00	
	DIGI.COM BERHAD	220,000	4.65	1,023,000.00	
	MAXIS BHD	146,200	5.35	782,170.00	
	TENAGA NASIONAL	192,300	12.14	2,334,522.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	46,800	17.64	825,552.00	
	YTL CORPORATION	210,847	1.15	242,474.05	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	70,540	1.29	90,996.60	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	250,000	1.09	272,500.00	
	SP SETIA BHD	87,500	2.23	195,125.00	
小計	銘柄数：44			29,280,589.65	
				(793,503,979)	
	組入時価比率：2.0%			2.1%	
パーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	122,000	16.40	2,000,800.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	95,000	53.25	5,058,750.00	
	IRPC PCL - NVDR	527,900	5.70	3,009,030.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	86,400	131.50	11,361,600.00	
	PTT PCL-NVDR	665,000	48.50	32,252,500.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	73.00	6,059,000.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	48.25	5,354,157.75	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	70.75	10,753,575.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	22,800	460.00	10,488,000.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	311,600	11.50	3,583,400.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	275,000	69.00	18,975,000.00	
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	10.30	4,605,130.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	163,000	37.75	6,153,250.00	
	ROBINSON PCL -NVDR	26,100	58.50	1,526,850.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	242,597	15.30	3,711,734.10	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	51.25	3,777,125.00	
	CP ALL PCL-NVDR	311,000	77.25	24,024,750.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	213,200	25.75	5,489,900.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	112,800	18.80	2,120,640.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	280,000	25.75	7,210,000.00	

	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	20,800	178.00	3,702,400.00	
	BANGKOK BANK(F)	13,500	220.00	2,970,000.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	37,000	190.00	7,030,000.00	
	KASIKORNBANK PCL(F)	72,000	190.50	13,716,000.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	19.20	5,127,360.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	109,800	129.00	14,164,200.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	649,400	2.06	1,337,764.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	30,700	75.50	2,317,850.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	597,200	5.20	3,105,440.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	64,600	190.00	12,274,000.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	51.00	2,499,000.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	6,700	299.00	2,003,300.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	26,100	91.25	2,381,625.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	33,000	101.00	3,333,000.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	75,900	76.25	5,787,375.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	162,300	11.00	1,785,300.00	
小計	銘柄数：36			251,049,806.35	
				(881,184,820)	
	組入時価比率：2.2%			2.3%	
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	55.00	8,030,000.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	218,900	14.98	3,279,122.00	
	DMCI HOLDINGS INC	178,000	12.00	2,136,000.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	173,700	61.35	10,656,495.00	
	SM INVESTMENTS CORP	16,305	930.00	15,163,650.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	69,000	129.00	8,901,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	24,400	304.00	7,417,600.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	50,800	152.00	7,721,600.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	53,599	83.00	4,448,717.00	
	BDO UNIBANK INC	124,998	132.00	16,499,736.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	113,005	78.00	8,814,390.00	
	SECURITY BANK CORP	12,000	180.00	2,160,000.00	
	AYALA CORPORATION	17,002	900.00	15,301,800.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,061	862.00	4,362,582.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	4.48	3,350,144.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	1,865.00	3,860,550.00	

	PLDT INC	4,970	1,224.00	6,083,280.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	379.00	6,405,100.00	
	ABOITIZ POWER CORP	76,700	35.95	2,757,365.00	
	AYALA LAND LTD	441,300	47.00	20,741,100.00	
	MEGAWORLD CORP	558,000	5.69	3,175,020.00	
	ROBINSONS LAND CO	92,868	24.30	2,256,692.40	
	SM PRIME HLDGS	669,975	39.60	26,531,010.00	
小計	銘柄数：23			190,052,953.40	
				(412,414,908)	
	組入時価比率：1.0%			1.1%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	1,295.00	1,086,764,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	220,000	3,950.00	869,000,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	99,150	26,075.00	2,585,336,250.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	101,200	21,850.00	2,211,220,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	13,725.00	2,415,600,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	148,600	7,500.00	1,114,500,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA	100,000	10,075.00	1,007,500,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	113,559	6,050.00	687,031,950.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,286,000	7,850.00	10,095,100,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	104,000	9,100.00	946,400,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	266,200	6,275.00	1,670,405,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	499,000	6,025.00	3,006,475,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	79,100.00	2,309,720,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	640,000	3,630.00	2,323,200,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	89,100	49,400.00	4,401,540,000.00	
	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,495.00	2,302,300,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	631,000	28,125.00	17,746,875,000.00	
	BANK DANAMON PT	165,196	8,600.00	1,420,685,600.00	
	BANK MANDIRI	1,142,000	7,800.00	8,907,600,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	9,850.00	4,915,150,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,570,000	4,460.00	15,922,200,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	208,000	2,620.00	544,960,000.00	
	TELEKOMUNIKASI	3,080,000	3,860.00	11,888,800,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	88,700	3,770.00	334,399,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	593,500	2,360.00	1,400,660,000.00	



	BUMI SERPONG DAMAI PT	428,300	1,445.00	618,893,500.00
	PAKUWON JATI TBK PT	920,000	740.00	680,800,000.00
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	345,500	1,735.00	599,442,500.00
小計	銘柄数：28			104,012,557,800.00 (832,100,462)
	組入時価比率：2.1%			2.2%
ウォン	GS HOLDINGS CORP	3,600	53,000.00	190,800,000.00
	S-OIL CORPORATION	2,690	93,900.00	252,591,000.00
	SK INNOVATION CO LTD	3,980	191,000.00	760,180,000.00
	HANWHA CHEMICAL CORP	6,330	21,800.00	137,994,000.00
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	998	93,600.00	93,412,800.00
	LG CHEM LTD - PREFERRED	384	208,000.00	79,872,000.00
	LG CHEMICALS LTD	2,892	366,500.00	1,059,918,000.00
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,050	282,000.00	296,100,000.00
	OCI COMPANY LTD	860	94,900.00	81,614,000.00
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,810	58,300.00	105,523,000.00
	HYUNDAI STEEL CO	4,779	48,250.00	230,586,750.00
	KOREA ZINC CO LTD	592	457,500.00	270,840,000.00
	POSCO	4,920	263,500.00	1,296,420,000.00
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	4,520	36,100.00	163,172,000.00
	KCC CORP	309	349,500.00	107,995,500.00
	DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	1,600	93,500.00	149,600,000.00
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	9,690	5,180.00	50,194,200.00
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	39,100.00	165,002,000.00
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	1,566	44,950.00	70,391,700.00
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	4,650	51,700.00	240,405,000.00
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,520	16,050.00	136,746,000.00
	CJ CORP	1,100	123,000.00	135,300,000.00
	CJ CORP-CONVERT PEF	165	83,354.00	13,753,533.62
	HANWHA CORPORATION	2,470	31,150.00	76,940,500.00
LG CORP	6,050	73,700.00	445,885,000.00	
LOTTE CORP	1,620	51,000.00	82,620,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	4,770	111,500.00	531,855,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	1,892	266,500.00	504,218,000.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,900	28,900.00	83,810,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	31,000.00	103,850,000.00	

HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	2,377	121,000.00	287,617,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	597	343,000.00	204,771,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	30,700	8,420.00	258,494,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,900	18,000.00	70,200,000.00	
S-1 CORPORATION	820	98,600.00	80,852,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,140	145,500.00	165,870,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,576	35,200.00	90,675,200.00	
PAN OCEAN CO LTD	14,890	4,685.00	69,759,650.00	
CJ LOGISTICS	390	160,500.00	62,595,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD/NEW	5,320	40,150.00	213,598,000.00	
HANON SYSTEMS	11,650	12,500.00	145,625,000.00	
HYUNDAI MOBIS	4,410	229,000.00	1,009,890,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	8,740	134,000.00	1,171,160,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	84,500.00	223,080,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	76,000.00	111,720,000.00	
KIA MOTORS CORP	15,770	42,500.00	670,225,000.00	
LG ELECTRONICS INC	6,980	73,900.00	515,822,000.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	3,340	91,300.00	304,942,000.00	
HLB INC	2,500	82,700.00	206,750,000.00	
FILA KOREA LTD	3,430	76,300.00	261,709,000.00	
KANGWON LAND INC	7,900	33,100.00	261,490,000.00	
CJ ENM CO LTD	657	217,900.00	143,160,300.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,140	97,900.00	111,606,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	800	180,500.00	144,400,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	427	315,500.00	134,718,500.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,672	104,000.00	173,888,000.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	230,500.00	111,792,500.00	
E-MART CO	1,181	174,000.00	205,494,000.00	
GS RETAIL CO LTD	1,140	40,950.00	46,683,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	510	315,500.00	160,905,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,131	95,000.00	107,445,000.00	
OTTOGI CORPORATION	70	727,000.00	50,890,000.00	
KT & G CORP	7,450	101,500.00	756,175,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	2,180	233,000.00	507,940,000.00	

AMOREPACIFIC CORP-PREF	410	131,000.00	53,710,000.00
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	81,400.00	123,728,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	570	1,411,000.00	804,270,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	830,000.00	86,320,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,335	76,300.00	254,460,500.00
CELLTRION INC	5,059	218,000.00	1,102,862,000.00
MEDY-TOX INC	226	626,400.00	141,566,400.00
SILLAJEN INC	3,750	63,100.00	236,625,000.00
VIROMED CO LTD	960	261,500.00	251,040,000.00
CELLTRION PHARM INC	830	59,100.00	49,053,000.00
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	472	430,000.00	202,960,000.00
HANMI SCIENCE CO LTD	750	74,300.00	55,725,000.00
YUHAN CORPORATION	690	247,500.00	170,775,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	12,887	7,090.00	91,368,830.00
DGB FINANCIAL GROUP INC	8,359	8,480.00	70,884,320.00
HANA FINANCIAL HOLDINGS	18,090	37,850.00	684,706,500.00
INDUSTRIAL BK OF KOREA	15,040	14,450.00	217,328,000.00
KB FINANCIAL GROUP INC	24,980	45,350.00	1,132,843,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP	26,890	44,650.00	1,200,638,500.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	29,900	13,950.00	417,105,000.00
DB INSURANCE CO LTD	2,850	67,100.00	191,235,000.00
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	13,280	3,965.00	52,655,200.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,400	37,950.00	129,030,000.00
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	1,610	35,150.00	56,591,500.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	1,890	298,500.00	564,165,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,640	84,400.00	391,616,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	2,320	224,000.00	519,680,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS	298,820	45,300.00	13,536,546,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	52,280	36,650.00	1,916,062,000.00
LG INNOTEK CO LTD	860	124,500.00	107,070,000.00
LG.DISPLAY CO LTD	16,200	21,500.00	348,300,000.00
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	3,320	115,000.00	381,800,000.00
SAMSUNG SDI CO,LTD	3,500	229,500.00	803,250,000.00
SK HYNIX INC	36,810	81,800.00	3,011,058,000.00
KT CORP	880	27,600.00	24,288,000.00

	LG UPLUS CORP	6,440	14,400.00	92,736,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	1,270	243,500.00	309,245,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	15,370	28,850.00	443,424,500.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,599	47,200.00	75,472,800.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,360	34,750.00	47,260,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	2,250	70,800.00	159,300,000.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	24,737	7,870.00	194,680,190.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	14,150.00	109,379,500.00	
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	36,600.00	130,479,000.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,024	370,500.00	379,392,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	3,320	24,750.00	82,170,000.00	
	NCSOFT CORPORATION	1,137	491,000.00	558,267,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	133,000.00	195,510,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	310	180,100.00	55,831,000.00	
	KAKAO CORP	3,070	117,000.00	359,190,000.00	
	NAVER CORP	8,810	118,000.00	1,039,580,000.00	
	小計銘柄数：115			50,572,764,873.62	
				(4,981,417,340)	
	組入時価比率：12.6%			13.2%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	72,360	113.50	8,212,860.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	214,998	108.50	23,327,283.00	
	FORMOSA PLASTIC	278,424	108.50	30,209,004.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	333,726	77.50	25,863,765.00	
	ASIA CEMENT	126,980	41.40	5,256,972.00	
	TAIWAN CEMENT	276,955	41.70	11,549,023.50	
	CHINA STEEL	762,544	25.20	19,216,108.80	
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	226,454	31.95	7,235,205.30	
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	6,000	406.00	2,436,000.00	
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	12,858	287.00	3,690,246.00	
	CHINA AIRLINES	133,561	9.73	1,299,548.53	
	EVA AIRWAYS CORP	175,677	15.40	2,705,425.80	
	EVERGREEN MARINE	91,157	12.95	1,180,483.15	
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	148,000	37.00	5,476,000.00	
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	107,036	41.20	4,409,883.20	

NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	241.00	2,410,000.00
TATUNG CO LTD	130,000	24.90	3,237,000.00
GIANT MANUFACTURING	18,752	220.00	4,125,440.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,443	430.50	4,926,211.50
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	20,315	235.00	4,774,025.00
FORMOSA TAFFETA CO.	65,000	35.85	2,330,250.00
POU CHEN CORP	135,468	37.35	5,059,729.80
RUENTEX INDUSTRIES LTD	20,271	76.60	1,552,758.60
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	16,000	412.00	6,592,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	34,816	282.00	9,818,112.00
STANDARD FOODS CORP	27,079	51.20	1,386,444.80
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	296,836	71.60	21,253,457.60
TAI MED BIOLOGICS INC	11,000	163.50	1,798,500.00
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	378,185	18.20	6,882,967.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	838,789	10.00	8,387,890.00
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,139,212	20.40	23,239,924.80
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	614,718	24.10	14,814,703.80
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	611,671	21.55	13,181,510.05
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	464,017	19.30	8,955,528.10
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	661,380	28.15	18,617,847.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	748,549	11.60	8,683,168.40
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	644,233	14.25	9,180,320.25
TAIWAN BUSINESS BANK	305,349	11.90	3,633,653.10
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	554,672	19.95	11,065,706.40
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	211,000	48.60	10,254,600.00
CHAILEASE HOLDING CO LTD	70,924	132.00	9,361,968.00
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	518,510	44.35	22,995,918.50
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	162,205	25.40	4,120,007.00
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	434,541	45.20	19,641,253.20
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	676,891	8.73	5,909,258.43
ACER INC	160,767	21.70	3,488,643.90
ADVANTECH CO.,LTD.	21,594	242.50	5,236,545.00
ASUSTEK COMPUTER INC	41,805	238.00	9,949,590.00
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	40,840	253.00	10,332,520.00

CHICONY ELECTRONICS CO LTD	29,645	76.10	2,255,984.50
COMPAL ELECTRONICS	244,590	19.60	4,793,964.00
INVENTEC CO.,LTD	136,911	24.65	3,374,856.15
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,897	44.40	6,477,826.80
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	87.20	4,534,400.00
PEGATRON CORP	121,692	60.10	7,313,689.20
QUANTA COMPUTER INC	175,684	60.30	10,593,745.20
WISTRON CORP	156,457	25.35	3,966,184.95
AU OPTRONICS CORP	489,008	11.25	5,501,340.00
DELTA ELECTRONICS INC	129,681	159.00	20,619,279.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	70.00	3,838,380.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	817,649	88.90	72,688,996.10
INNOLUX CORP	505,322	10.05	5,078,486.10
LARGAN PRECISION CO LTD	6,040	4,585.00	27,693,400.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	77,566	38.45	2,982,412.70
WALSIN TECHNOLOGY CORP	18,000	224.00	4,032,000.00
WPG HOLDINGS CO LTD	115,387	40.40	4,661,634.80
YAGEO CORPORATION	14,377	333.50	4,794,729.50
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	36,410	110.00	4,005,100.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	217,658	75.50	16,433,179.00
GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	360.00	4,680,000.00
MEDIATEK INC	94,538	290.00	27,416,020.00
NANYA TECHNOLOGY CO	59,000	63.70	3,758,300.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	34,058	199.50	6,794,571.00
PHISON ELECTRONICS CORP	9,306	307.00	2,856,942.00
POWERTECH TECHNOLOGY INC	46,147	74.80	3,451,795.60
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	28,417	200.50	5,697,608.50
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,537,000	264.50	406,536,500.00
UNITED MICROELECTRONICS CORP	704,500	12.10	8,524,450.00
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	69.20	4,774,800.00
WIN SEMICONDUCTORS CORP	21,000	220.00	4,620,000.00
WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	16.75	4,053,500.00
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	233,065	109.50	25,520,617.50
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	105,000	74.20	7,791,000.00
TAIWAN MOBILE CO LTD	95,200	111.50	10,614,800.00

	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	672,377	17.75	11,934,691.75	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	39,110	48.90	1,912,479.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	31,006	42.75	1,325,506.50	
小計	銘柄数：87			1,207,168,430.36	
				(4,382,021,402)	
	組入時価比率：11.1%			11.6%	
インドルビー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	44,705	362.90	16,223,444.50	
	COAL INDIA LTD	76,900	251.45	19,336,505.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	266.60	9,165,708.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	130,000	156.10	20,293,000.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	96,000	160.60	15,417,600.00	
	PETRONET LNG LTD	34,980	239.90	8,391,702.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	179,500	1,385.95	248,778,025.00	
	ASIAN PAINTS LTD	17,000	1,469.60	24,983,200.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	6,620	1,255.50	8,311,410.00	
	UPL LTD	24,400	934.05	22,790,820.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	29,920	233.40	6,983,328.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	21,600	867.25	18,732,600.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	470	19,693.85	9,256,109.50	
	ULTRATECH CEMENT LTD	6,180	4,259.95	26,326,491.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	71,770	207.20	14,870,744.00	
	JSW STEEL LTD	46,500	299.15	13,910,475.00	
	TATA STEEL LIMITED	18,606	543.10	10,104,918.60	
	VEDANTA LTD	80,514	178.60	14,379,800.40	
	LARSEN&TOUBRO LIMITED	31,200	1,360.70	42,453,840.00	
	HAVELLS INDIA LTD	17,700	757.70	13,411,290.00	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	60,650	95.75	5,807,237.50	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	5,010	1,554.40	7,787,544.00	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	521.05	6,450,599.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	32,039	390.55	12,512,831.45	
	BHARAT FORGE LIMITED	12,700	500.55	6,356,985.00	
	BOSCH LTD	390	18,173.50	7,087,665.00	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	57,438	157.15	9,026,381.70	
	BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	3,069.50	17,158,505.00	
	EICHER MOTORS LTD	820	21,023.90	17,239,598.00	

HERO MOTOCORP LTD	3,590	2,741.55	9,842,164.50
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	43,990	684.65	30,117,753.50
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	6,400	7,447.45	47,663,680.00
TATA MOTORS LTD	104,000	236.25	24,570,000.00
PAGE INDUSTRIES LTD	340	23,585.90	8,019,206.00
TITAN CO LTD	17,890	1,125.40	20,133,406.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	6,780	1,358.50	9,210,630.00
UNITED SPIRITS LTD	15,615	552.75	8,631,191.25
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,000	2,997.75	11,991,000.00
NESTLE INDIA LIMITED	1,550	10,954.45	16,979,397.50
ITC LTD	216,400	304.40	65,872,160.00
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	41,700	1,739.90	72,553,830.00
DABUR INDIA LTD	37,800	404.95	15,307,110.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	20,175	667.65	13,469,838.75
MARICO LIMITED	26,340	366.10	9,643,074.00
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	789.55	14,764,585.00
CADILA HEALTHCARE LTD	8,880	336.50	2,988,120.00
CIPLA LIMITED	20,980	561.55	11,781,319.00
DR.REDDYS LABORATORIES	6,590	2,799.10	18,446,069.00
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	6,830	639.15	4,365,394.50
LUPIN LTD	14,900	835.80	12,453,420.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	4,720	2,649.85	12,507,292.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	49,282	463.20	22,827,422.40
AXIS BANK LIMITED	121,400	771.20	93,623,680.00
ICICI BANK LTD	151,000	404.40	61,064,400.00
YES BANK LTD	114,800	255.80	29,365,840.00
REC LTD	39,810	153.20	6,098,892.00
BAJAJ FINSERV LTD	2,320	7,571.15	17,565,068.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	34,800	1,102.65	38,372,220.00
INFOSYS LTD	216,500	717.05	155,241,325.00
TATA CONSULTANCY SVS LTD	57,200	2,150.05	122,982,860.00
TECH MAHINDRA LTD	32,000	800.35	25,611,200.00
WIPRO LTD	100,133	284.80	28,517,878.40
BHARTI INFRATEL LTD	16,510	307.20	5,071,872.00
BHARTI AIRTEL LIMITED	92,000	346.95	31,919,400.00



	VODAFONE IDEA LTD	114,350	17.25	1,972,537.50	
	VODAFONE IDEA LTD-RIGHTS	261,801	4.75	1,243,554.75	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	106,000	194.30	20,595,800.00	
	TATA POWER COMPANY LIMITED	63,864	70.55	4,505,605.20	
	GAIL INDIA LTD	54,900	351.95	19,322,055.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	103,000	2,003.75	206,386,250.00	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	17,020	800.55	13,625,361.00	
	LIC HOUSING FINANCE	18,050	517.45	9,339,972.50	
	BAJAJ FINANCE LTD	10,330	3,014.45	31,139,268.50	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	15,160	417.90	6,335,364.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	8,940	1,215.65	10,867,911.00	
	NTPC LIMITED	142,008	135.35	19,220,782.80	
	DIVIS LABORATORIES LTD	5,900	1,724.35	10,173,665.00	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	27,550	402.30	11,083,365.00	
小計	銘柄数：78			2,098,932,548.70	
				(3,421,260,054)	
	組入時価比率：8.7%			9.0%	
パキスタンルビー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	51,000	144.59	7,374,090.00	
	HABIB BANK LTD	35,600	127.10	4,524,760.00	
	MCB BANK LIMITED	21,900	192.27	4,210,713.00	
小計	銘柄数：3			16,109,563.00	
				(12,726,554)	
	組入時価比率：0.0%			0.0%	
カタールリヤル	INDUSTRIES QATAR	11,170	125.00	1,396,250.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	11,790	47.63	561,557.70	
	MASRAF AL RAYAN	21,160	36.35	769,166.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	6,580	169.08	1,112,546.40	
	QATAR NATIONAL BANK	28,320	183.00	5,182,560.00	
	QATAR INSURANCE CO	10,001	39.00	390,039.00	
	OOREDOO QSC	4,310	64.75	279,072.50	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	3,440	169.00	581,360.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	11,300	35.11	396,743.00	
	EZDAN HOLDING GROUP	44,190	10.80	477,252.00	
小計	銘柄数：10			11,146,546.60	
				(341,976,049)	

	組入時価比率：0.9%			0.9%
エジプトbond	ELSWEDY ELECTRIC CO	41,500	15.54	644,910.00
	EASTERN TOBACCO	51,525	18.53	954,758.25
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	78,000	73.19	5,708,820.00
	小計 銘柄数：3			7,308,488.25 (47,578,258)
	組入時価比率：0.1%			0.1%
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	18,300	167.85	3,071,655.00
	SASOL LTD	35,200	467.81	16,466,912.00
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,960	750.00	2,220,000.00
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	26,400	183.85	4,853,640.00
	GOLD FIELDS LTD	58,700	54.90	3,222,630.00
	KUMBA IRON ORE LTD	5,100	455.96	2,325,396.00
	MONDI LTD	7,270	316.39	2,300,155.30
	SAPPI LIMITED	32,090	65.50	2,101,895.00
	BIDVEST GROUP LTD	21,900	219.47	4,806,393.00
	NASPERS LTD-N SHS	27,510	3,620.35	99,595,828.50
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	61,610	47.63	2,934,484.30
	MR PRICE GROUP LTD	16,700	215.96	3,606,532.00
	THE FOSCHINI GROUP LTD	13,920	186.66	2,598,307.20
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	22,670	74.98	1,699,796.60
	BID CORP LTD	21,900	304.17	6,661,323.00
	CLICKS GROUP LTD	15,190	195.46	2,969,037.40
	PICKN PAY STORES LTD	26,700	72.54	1,936,818.00
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	29,200	178.20	5,203,440.00
	SPAR GROUP LIMITED/THE	10,860	202.66	2,200,887.60
	TIGER BRANDS LTD	8,700	269.00	2,340,300.00
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	69,273	27.65	1,915,398.45
	NETCARE LTD	72,810	23.89	1,739,430.90
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	21,630	107.87	2,333,228.10
	ABSA GROUP LTD	44,300	164.29	7,278,047.00
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,500	1,421.41	3,553,525.00
NEDBANK GROUP LTD	24,800	274.02	6,795,696.00	
STANDARD BANK GROUP LTD	81,500	202.34	16,490,710.00	
FIRSTRAND LTD	211,600	68.26	14,443,816.00	
	8,660	272.90	2,363,314.00	

	PSG GROUP LTD				
	REMGRO LTD	33,200	196.95	6,538,740.00	
	RMB HOLDINGS LTD	43,680	82.94	3,622,819.20	
	DISCOVERY LTD	25,800	147.87	3,815,046.00	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,360	105.00	667,800.00	
	MMI HOLDINGS LTD	56,462	17.55	990,908.10	
	OLD MUTUAL LTD	292,340	23.50	6,869,990.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	36.03	1,453,810.50	
	SANLAM LIMITED	108,700	79.92	8,687,304.00	
	TELKOM SA SOC LTD	15,970	85.09	1,358,887.30	
	MTN GROUP LTD	108,300	105.30	11,403,990.00	
	VODACOM GROUP	39,800	120.71	4,804,258.00	
	INVESTEC LTD	15,640	94.03	1,470,629.20	
	REINET INVESTMENTS SCA	8,790	228.48	2,008,339.20	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	25,200	118.92	2,996,784.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	126.89	3,382,887.40	
	小計 銘柄数：44			290,100,789.25	
				(2,309,202,282)	
	組入時価比率：5.9%			6.1%	
UAEデイルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	119,870	9.79	1,173,527.30	
	DUBAI ISLAMIC BANK	102,029	5.13	523,408.77	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	161,800	16.38	2,650,284.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	112,500	16.66	1,874,250.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	1.91	529,070.00	
	DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	100,980	1.31	132,283.80	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	43,470	3.84	166,924.80	
	EMAAR MALLS PJSC	89,700	1.72	154,284.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	201,630	4.97	1,002,101.10	
	小計 銘柄数：9			8,206,133.77	
				(249,794,711)	
	組入時価比率：0.6%			0.7%	
合計				37,843,605,586	
				(37,843,605,586)	

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

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2019年4月22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	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	96,000	2,920,320.00	
	小計	銘柄数：1	96,000	2,920,320.00	
		組入時価比率：0.8%		(327,046,636)	71.5%
	合計			327,046,636	(327,046,636)
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	208,100	5,712,345.00	
		小計	銘柄数：1	208,100	5,712,345.00
		組入時価比率：0.1%		(34,102,699)	7.5%
	ランド	FORTRESS REIT LTD-A	59,650	1,150,648.50	
		FORTRESS REIT LTD-B	43,946	474,616.80	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	191,000	4,734,890.00	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS	13,650	1,005,868.50	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	387,000	3,866,130.00	
		RESILIENT REIT LTD	15,092	842,888.20	
	小計	銘柄数：6	710,338	12,075,042.00	
	組入時価比率：0.2%		(96,117,334)	21.0%	
合計			130,220,033	(130,220,033)	
合計			457,266,669	(457,266,669)	

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

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

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 4月22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	1,067,395,728	-	1,105,374,897	37,979,169
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	4,813,323	-	4,890,000	76,677
インドルピー	4,813,323	-	4,890,000	76,677
売建	4,813,323	-	4,812,893	430
米ドル	4,813,323	-	4,812,893	430
合計	-	-	-	38,056,276

## (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)

(2019年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	6,143,125
コール・ローン	42,491,094

(2019年 4月22日現在)

株式	12,814,320,868
投資信託受益証券	96,087,420
投資証券	217,190,494
派生商品評価勘定	541,752
未収入金	54,051,324
未収配当金	18,346,252
差入委託証拠金	20,083,773
流動資産合計	13,269,256,102
資産合計	13,269,256,102
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	21,620
未払金	1,474,203
未払解約金	39,926,913
未払利息	92
その他未払費用	335,400
流動負債合計	41,758,228
負債合計	41,758,228
純資産の部	
元本等	
元本	10,378,025,751
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,849,472,123
元本等合計	13,227,497,874
純資産合計	13,227,497,874
負債純資産合計	13,269,256,102

## 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

4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 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> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>
------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 4月22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	1.2746円
(10,000口当たり純資産額)	(12,746円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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>

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 4月22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

2019年 4月22日現在	
期首	2018年 4月24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	3,322,959,456円
同期中における追加設定元本額	8,811,421,418円
同期中における一部解約元本額	1,756,355,123円
期末元本額	10,378,025,751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	5,516,088,449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	2,288,135,333円
インデックス・ブレンド(タイプ )	4,475,829円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,899,585円
インデックス・ブレンド(タイプ )	9,309,462円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,626,422円
インデックス・ブレンド(タイプ )	12,166,141円
米国株式配当貴族・為替ヘッジあり型(投資一任サービス向け)	325,061,649円



米国株式配当貴族・為替ヘッジなし型(投資一任サービス向け)	52,777,293円
米国株式配当貴族(年4回決算型)	2,164,485,588円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年4月22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	16,380	119.86	1,963,306.80	
		EXXON MOBIL CORP	26,030	81.13	2,111,813.90	
		AIR PRODUCTS	11,880	198.10	2,353,428.00	
		ECOLAB INC	12,240	183.20	2,242,368.00	
		LINDE PLC	11,810	180.40	2,130,524.00	
		PPG INDUSTRIES	18,180	119.86	2,179,054.80	
		SHERWIN-WILLIAMS	4,763	452.43	2,154,924.09	
		NUCOR CORP	32,680	57.50	1,879,100.00	
		GENERAL DYNAMICS	10,880	176.85	1,924,128.00	
		UNITED TECHNOLOGIES	16,080	137.00	2,202,960.00	
		SMITH (A.O.) CORP	40,060	56.49	2,262,989.40	
		EMERSON ELEC	29,490	72.51	2,138,319.90	
		3M CORP	9,650	218.88	2,112,192.00	
		ROPER TECHNOLOGIES INC	6,670	349.72	2,332,632.40	
		CATERPILLAR INC DEL	14,000	143.36	2,007,040.00	
		DOVER CORP	23,480	97.78	2,295,874.40	
		ILLINOIS TOOL WORKS INC	14,200	158.33	2,248,286.00	
		PENTAIR PLC	45,940	38.22	1,755,826.80	
		STANLEY BLACK & DECKER INC	15,720	145.74	2,291,032.80	
		GRAINGER(W.W.) INC	6,490	308.18	2,000,088.20	
		CINTAS CORP	10,180	213.68	2,175,262.40	
		LEGGETT & PLATT INC	46,930	43.27	2,030,661.10	
		V F CORP	22,300	95.55	2,130,765.00	
MCDONALD'S CORP	9,920	194.91	1,933,507.20			
GENUINE PARTS CO	19,460	105.45	2,052,057.00			

TARGET CORP	26,320	83.26	2,191,403.20	
LOWES COS INC	20,250	113.74	2,303,235.00	
SYSCO CORP	29,730	70.99	2,110,532.70	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	26,060	54.63	1,423,657.80	
WALMART INC	18,900	103.18	1,950,102.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	40,750	52.85	2,153,637.50	
COCA COLA CO	38,980	47.48	1,850,770.40	
PEPSICO INC	16,980	127.09	2,157,988.20	
ARCHER DANIELS MIDLAND	42,560	42.76	1,819,865.60	
HORMEL FOODS CORP	44,700	40.39	1,805,433.00	
MCCORMICK & CO INC.	14,950	154.38	2,307,981.00	
CLOROX CO	12,460	153.48	1,912,360.80	
COLGATE PALMOLIVE CO.	29,880	69.35	2,072,178.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	16,680	123.55	2,060,814.00	
PROCTER & GAMBLE CO	19,710	106.05	2,090,245.50	
ABBOTT LABORATORIES	26,230	73.92	1,938,921.60	
BECTON,DICKINSON	7,720	227.89	1,759,310.80	
MEDTRONIC PLC	21,310	84.22	1,794,728.20	
CARDINAL HEALTH INC	38,310	46.00	1,762,260.00	
ABBVIE INC	21,640	77.57	1,678,614.80	
JOHNSON & JOHNSON	14,630	137.52	2,011,917.60	
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	113,300	17.13	1,940,829.00	
AFLAC INC	39,270	48.92	1,921,088.40	
CHUBB LTD	14,040	138.66	1,946,786.40	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	23,490	86.60	2,034,234.00	
AUTOMATIC DATA PROCESS	13,790	162.44	2,240,047.60	
AT & T INC	60,700	32.03	1,944,221.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	23,930	83.61	2,000,787.30	
FRANKLIN RESOURCES INC	59,300	35.30	2,093,290.00	
S&P GLOBAL INC	9,860	217.20	2,141,592.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	19,800	105.90	2,096,820.00	
小計	銘柄数：56		114,423,795.59	
			(12,814,320,868)	
	組入時価比率：96.9%		100.0%	
合計			12,814,320,868	

(12,814,320,868)

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

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2019年4月22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	12,500	858,000.00	
		小計	12,500	858,000.00 (96,087,420)	30.7%
	組入時価比率: 0.7%				
合計				96,087,420 (96,087,420)	
投資証券	米ドル	FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,670	1,939,374.00	
		小計	14,670	1,939,374.00 (217,190,494)	69.3%
	組入時価比率: 1.6%				
合計				217,190,494 (217,190,494)	
合計				313,277,914 (313,277,914)	

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

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

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 4月22日現在			評価損益(円)
	契約額等(円)		時価(円)	
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	80,946,372	-	81,472,725	526,353
市場取引以外の取引				

為替予約取引				
売建	10,878,235	-	10,884,456	6,221
米ドル	10,878,235	-	10,884,456	6,221
合計	-	-	-	520,132

## (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)

(2019年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,819,950,385
国債証券	528,217,928,260
地方債証券	43,930,497,231
特殊債証券	57,259,874,456
社債証券	27,660,415,430
未収利息	1,150,674,367
前払費用	12,453,739
流動資産合計	663,051,793,868
資産合計	663,051,793,868
負債の部	
流動負債	
未払金	606,394,000
未払解約金	997,140,464
未払利息	10,492
流動負債合計	1,603,544,956
負債合計	1,603,544,956
純資産の部	

(2019年 4月22日現在)

元本等	
元本	497,317,256,859
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	164,130,992,053
元本等合計	661,448,248,912
純資産合計	661,448,248,912
負債純資産合計	663,051,793,868

## 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)

2019年 4月22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	1.3300円
(10,000口当たり純資産額)	(13,300円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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。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>

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 4月22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

2019年 4月22日現在	
期首	2018年 4月24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	510,311,647,515円
同期中における追加設定元本額	63,028,619,370円
同期中における一部解約元本額	76,023,010,026円
期末元本額	497,317,256,859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	463,258,488円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	30,792,680,026円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	17,530,058,803円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	2,621,955,231円
野村資産設計ファンド2015	379,087,911円
野村資産設計ファンド2020	335,238,988円
野村資産設計ファンド2025	278,130,205円
野村資産設計ファンド2030	195,401,189円
野村資産設計ファンド2035	99,219,455円
野村資産設計ファンド2040	153,605,106円
野村日本債券インデックスファンド	995,016,173円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	203,582,505,910円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	12,377,673,421円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	8,037,668,635円

のむらップ・ファンド(積極型)	989,493,998円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	10,930,488,992円
野村資産設計ファンド2045	15,198,201円
野村円債投資インデックスファンド	1,309,973,675円
野村インデックスファンド・国内債券	2,972,963,198円
マイ・ロード	36,466,610,523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	733,321,326円
野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)	25,288,419円
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	10,232,840,649円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	2,042,087,145円
野村資産設計ファンド2050	19,014,553円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	14,581,448円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	3,787,159円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	2,473,065円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,529,346円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	697,023,157円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	141,266,987円
インデックス・ブレンド(タイプ)	63,994,344円
インデックス・ブレンド(タイプ)	27,389,911円
インデックス・ブレンド(タイプ)	47,355,859円
インデックス・ブレンド(タイプ)	8,125,369円
インデックス・ブレンド(タイプ)	13,836,377円
野村6資産均等バランス	549,423,363円
世界6資産分散ファンド	151,806,841円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信	629,146,744円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	7,935,522,271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)	693,800,495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)	182,252,742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)	2,292,338,216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)	1,453,193,836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)	22,824,481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)	13,025,762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)	1,333,155円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,365,803,233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)	19,047,894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)	131,105,780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)	171,067,620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)	383,599,004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)	355,626,245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)	833,532,912円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,594,565,706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)	656,246,814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)	596,088,048円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	15,981,964,948円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	23,643,130,911円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	10,469,666,892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)	46,428,338,456円

マイバランスDC30	10,466,141,004円
マイバランスDC50	7,233,473,785円
マイバランスDC70	2,341,873,525円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	11,482,724,946円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	386,592,175円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	646,150,732円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	264,024,625円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	39,957,651円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	9,362,905円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	6,731,830円
野村資産設計ファンド(DC)2030	2,849,482円
野村資産設計ファンド(DC)2040	1,251,842円
野村資産設計ファンド(DC)2050	1,180,683円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	174,326,759円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	66,405,305円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	15,508,256円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	24,105,743円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

###### (1) 株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

###### (2) 株式以外の有価証券(2019年4月22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390回	500,000,000	501,575,000	
		国庫債券 利付(2年)第391回	3,000,000,000	3,010,140,000	
		国庫債券 利付(2年)第392回	1,500,000,000	1,505,400,000	
		国庫債券 利付(2年)第394回	3,000,000,000	3,011,910,000	
		国庫債券 利付(5年)第124回	5,100,000,000	5,115,657,000	
		国庫債券 利付(5年)第125回	7,200,000,000	7,226,928,000	
		国庫債券 利付(5年)第126回	7,500,000,000	7,532,400,000	
		国庫債券 利付(5年)第127回	6,000,000,000	6,029,820,000	
		国庫債券 利付(5年)第128回	5,200,000,000	5,228,704,000	
		国庫債券 利付(5年)第129回	4,000,000,000	4,024,680,000	
		国庫債券 利付(5年)第130回	5,000,000,000	5,034,050,000	
		国庫債券 利付(5年)第131回	4,000,000,000	4,029,760,000	
		国庫債券 利付(5年)第132回	5,000,000,000	5,040,450,000	
		国庫債券 利付(5年)第133回	4,000,000,000	4,035,640,000	



国庫債券 利付(5年)第134回	3,000,000,000	3,028,710,000	
国庫債券 利付(5年)第135回	3,000,000,000	3,030,660,000	
国庫債券 利付(5年)第136回	4,300,000,000	4,346,784,000	
国庫債券 利付(5年)第137回	3,000,000,000	3,033,960,000	
国庫債券 利付(5年)第138回	2,700,000,000	2,732,319,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	2,360,000,000	3,519,161,200	
国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,301,436,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,311,327,000	
国庫債券 利付(40年)第4回	1,300,000,000	1,908,114,000	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,200,000,000	1,703,820,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,817,101,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,879,738,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,879,485,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	2,200,000,000	2,042,348,000	
国庫債券 利付(40年)第10回	2,100,000,000	2,294,544,000	
国庫債券 利付(40年)第11回	1,400,000,000	1,481,312,000	
国庫債券 利付(10年)第308回	1,700,000,000	1,728,917,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	3,000,000,000	3,044,040,000	
国庫債券 利付(10年)第310回	3,700,000,000	3,760,939,000	
国庫債券 利付(10年)第311回	1,800,000,000	1,824,552,000	
国庫債券 利付(10年)第312回	4,950,000,000	5,062,018,500	
国庫債券 利付(10年)第313回	3,200,000,000	3,289,024,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	2,200,000,000	2,252,800,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	3,600,000,000	3,705,660,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	1,400,000,000	1,438,052,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,854,666,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,289,440,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,912,012,000	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,607,975,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,307,904,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,473,920,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	1,700,000,000	1,756,933,000	
	3,200,000,000	3,296,992,000	

国庫債券 利付(10年)第324回			
国庫債券 利付(10年)第325回	4,400,000,000	4,544,056,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,166,087,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,208,965,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,000,000,000	5,148,350,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,511,841,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	3,961,158,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,963,707,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	5,400,000,000	5,591,376,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	4,200,000,000	4,356,786,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	5,600,000,000	5,818,344,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	3,700,000,000	3,831,165,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	1,700,000,000	1,763,070,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	1,700,000,000	1,743,656,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	3,700,000,000	3,821,249,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	3,000,000,000	3,101,580,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	4,200,000,000	4,348,092,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	3,700,000,000	3,810,704,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	4,650,000,000	4,729,468,500	
国庫債券 利付(10年)第343回	5,400,000,000	5,493,690,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	5,300,000,000	5,393,227,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	6,300,000,000	6,412,077,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	5,400,000,000	5,494,824,000	
国庫債券 利付(10年)第347回	4,300,000,000	4,376,110,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	4,500,000,000	4,578,255,000	
国庫債券 利付(10年)第349回	5,000,000,000	5,085,100,000	
	6,850,000,000	6,963,710,000	

国庫債券 利付(10年)第350回			
国庫債券 利付(10年)第351回	5,600,000,000	5,687,752,000	
国庫債券 利付(10年)第352回	4,300,000,000	4,363,038,000	
国庫債券 利付(10年)第353回	4,200,000,000	4,259,052,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	128,949,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	251,848,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	200,419,200	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,197,333,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	188,590,500	
国庫債券 利付(30年)第6回	700,000,000	902,790,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	770,844,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	122,536,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	265,000,000	310,587,950	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	283,125,000	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	194,652,800	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	280,711,200	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	366,696,300	
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	1,060,904,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,209,888,000	
国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,233,310,200	
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,603,308,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	1,500,000,000	1,985,610,000	
国庫債券 利付(30年)第19回	1,600,000,000	2,122,608,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	1,400,000,000	1,905,582,000	
国庫債券 利付(30年)第21回	1,400,000,000	1,864,996,000	
国庫債券 利付(30年)第22回	600,000,000	820,980,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	840,000,000	1,151,908,800	
国庫債券 利付(30年)第24回	700,000,000	961,975,000	
国庫債券 利付(30年)第25回	500,000,000	671,655,000	
国庫債券 利付(30年)第26回	850,000,000	1,158,261,000	
国庫債券 利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,148,687,500	
国庫債券 利付(30年)第28回	1,200,000,000	1,670,844,000	
国庫債券 利付(30年)第29回	1,500,000,000	2,068,305,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	1,700,000,000	2,321,248,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	1,600,000,000	2,161,808,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	1,900,000,000	2,614,134,000	
国庫債券 利付(30年)第33回	2,100,000,000	2,773,575,000	
国庫債券 利付(30年)第34回	2,100,000,000	2,870,028,000	
国庫債券 利付(30年)第35回	2,300,000,000	3,060,012,000	
国庫債券 利付(30年)第36回	2,300,000,000	3,072,202,000	

国庫債券	利付(30年)第37回	2,300,000,000	3,032,021,000
国庫債券	利付(30年)第38回	1,800,000,000	2,339,658,000
国庫債券	利付(30年)第39回	1,600,000,000	2,119,376,000
国庫債券	利付(30年)第40回	1,100,000,000	1,434,510,000
国庫債券	利付(30年)第41回	1,500,000,000	1,924,725,000
国庫債券	利付(30年)第42回	1,200,000,000	1,541,124,000
国庫債券	利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,671,020,000
国庫債券	利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,801,100,000
国庫債券	利付(30年)第45回	1,700,000,000	2,108,187,000
国庫債券	利付(30年)第46回	1,800,000,000	2,233,332,000
国庫債券	利付(30年)第47回	1,700,000,000	2,152,506,000
国庫債券	利付(30年)第48回	1,900,000,000	2,315,131,000
国庫債券	利付(30年)第49回	1,900,000,000	2,315,872,000
国庫債券	利付(30年)第50回	1,600,000,000	1,711,792,000
国庫債券	利付(30年)第51回	1,600,000,000	1,509,040,000
国庫債券	利付(30年)第52回	1,900,000,000	1,886,339,000
国庫債券	利付(30年)第53回	1,700,000,000	1,728,696,000
国庫債券	利付(30年)第54回	1,700,000,000	1,815,991,000
国庫債券	利付(30年)第55回	1,500,000,000	1,601,190,000
国庫債券	利付(30年)第56回	1,900,000,000	2,026,673,000
国庫債券	利付(30年)第57回	1,400,000,000	1,492,190,000
国庫債券	利付(30年)第58回	1,800,000,000	1,917,000,000
国庫債券	利付(30年)第59回	1,600,000,000	1,660,304,000
国庫債券	利付(30年)第60回	600,000,000	653,988,000
国庫債券	利付(30年)第61回	1,200,000,000	1,242,720,000
国庫債券	利付(20年)第46回	90,000,000	92,488,500
国庫債券	利付(20年)第47回	1,230,000,000	1,271,118,900
国庫債券	利付(20年)第48回	200,000,000	208,870,000
国庫債券	利付(20年)第49回	200,000,000	208,650,000
国庫債券	利付(20年)第50回	183,000,000	190,212,030
国庫債券	利付(20年)第51回	310,000,000	324,489,400
国庫債券	利付(20年)第52回	100,000,000	105,463,000
国庫債券	利付(20年)第53回	250,000,000	265,092,500
国庫債券	利付(20年)第54回	100,000,000	106,305,000
国庫債券	利付(20年)第55回	231,000,000	245,548,380
国庫債券	利付(20年)第56回	120,000,000	128,228,400
国庫債券	利付(20年)第57回	210,000,000	223,734,000
国庫債券	利付(20年)第58回	180,000,000	192,717,000
国庫債券	利付(20年)第59回	230,000,000	245,750,400
国庫債券	利付(20年)第60回	780,000,000	824,795,400
国庫債券	利付(20年)第61回	300,000,000	313,680,000
国庫債券	利付(20年)第62回	440,000,000	457,586,800
国庫債券	利付(20年)第63回	300,000,000	324,549,000

国庫債券	利付（20年）第64回	400,000,000	436,408,000	
国庫債券	利付（20年）第65回	455,000,000	498,889,300	
国庫債券	利付（20年）第66回	300,000,000	327,531,000	
国庫債券	利付（20年）第67回	310,000,000	341,412,300	
国庫債券	利付（20年）第68回	290,000,000	323,686,400	
国庫債券	利付（20年）第69回	560,000,000	622,283,200	
国庫債券	利付（20年）第70回	540,000,000	611,431,200	
国庫債券	利付（20年）第71回	200,000,000	224,376,000	
国庫債券	利付（20年）第72回	670,000,000	752,028,100	
国庫債券	利付（20年）第73回	1,600,000,000	1,795,856,000	
国庫債券	利付（20年）第74回	900,000,000	1,015,308,000	
国庫債券	利付（20年）第75回	600,000,000	680,250,000	
国庫債券	利付（20年）第76回	910,000,000	1,020,865,300	
国庫債券	利付（20年）第77回	700,000,000	789,453,000	
国庫債券	利付（20年）第78回	800,000,000	901,384,000	
国庫債券	利付（20年）第79回	860,000,000	974,328,400	
国庫債券	利付（20年）第80回	900,000,000	1,025,235,000	
国庫債券	利付（20年）第81回	360,000,000	409,834,800	
国庫債券	利付（20年）第82回	820,000,000	938,818,000	
国庫債券	利付（20年）第83回	1,370,000,000	1,576,308,300	
国庫債券	利付（20年）第84回	1,200,000,000	1,372,644,000	
国庫債券	利付（20年）第85回	400,000,000	462,328,000	
国庫債券	利付（20年）第86回	1,400,000,000	1,637,664,000	
国庫債券	利付（20年）第87回	500,000,000	581,395,000	
国庫債券	利付（20年）第88回	1,100,000,000	1,293,149,000	
国庫債券	利付（20年）第89回	470,000,000	549,129,200	
国庫債券	利付（20年）第90回	1,500,000,000	1,760,865,000	
国庫債券	利付（20年）第91回	250,000,000	295,347,500	
国庫債券	利付（20年）第92回	1,550,000,000	1,816,026,500	
国庫債券	利付（20年）第93回	300,000,000	350,628,000	
国庫債券	利付（20年）第94回	200,000,000	235,348,000	
国庫債券	利付（20年）第95回	700,000,000	838,887,000	
国庫債券	利付（20年）第96回	400,000,000	472,776,000	
国庫債券	利付（20年）第97回	1,300,000,000	1,553,617,000	
国庫債券	利付（20年）第98回	300,000,000	355,983,000	
国庫債券	利付（20年）第99回	2,100,000,000	2,501,394,000	
国庫債券	利付（20年）第100回	1,520,000,000	1,830,885,600	
国庫債券	利付（20年）第101回	250,000,000	305,617,500	
国庫債券	利付（20年）第102回	500,000,000	613,555,000	
国庫債券	利付（20年）第103回	600,000,000	730,740,000	

国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	479,788,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,286,251,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	485,096,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	362,433,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,901,936,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,072,593,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,332,804,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	980,784,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,188,440,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,439,800,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	1,700,000,000	2,080,562,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	1,000,000,000	1,234,520,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,362,449,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,400,000,000	1,718,780,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	610,225,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	958,544,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	940,728,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	1,700,000,000	2,061,505,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,321,408,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	1,500,000,000	1,858,620,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,227,480,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,129,032,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,230,800,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	1,200,000,000	1,462,764,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,800,000,000	2,199,780,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	800,000,000	968,024,000	
	1,400,000,000	1,698,004,000	

国庫債券 利付(20年)第130回			
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	960,440,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,563,952,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,701,798,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,705,438,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	843,787,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	834,855,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,207,800,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	945,464,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	700,000,000	836,367,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,783,299,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	2,600,000,000	3,152,110,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	950,000,000	1,164,500,500	
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,561,040,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,300,000,000	1,543,282,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,300,000,000	2,798,134,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	2,924,736,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	2,200,000,000	2,653,772,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	1,400,000,000	1,670,704,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	2,350,000,000	2,807,733,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	3,230,000,000	3,815,146,800	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,700,000,000	3,107,619,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	1,700,000,000	1,957,550,000	
国庫債券 利付(20年)第153回	2,450,000,000	2,860,644,500	
国庫債券 利付(20年)第154回	3,000,000,000	3,457,440,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	2,800,000,000	3,135,860,000	
	2,600,000,000	2,654,626,000	

	国庫債券 利付(20年)第156回			
	国庫債券 利付(20年)第157回	2,650,000,000	2,613,138,500	
	国庫債券 利付(20年)第158回	2,800,000,000	2,897,440,000	
	国庫債券 利付(20年)第159回	2,700,000,000	2,838,213,000	
	国庫債券 利付(20年)第160回	2,300,000,000	2,454,238,000	
	国庫債券 利付(20年)第161回	2,100,000,000	2,202,795,000	
	国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,781,209,000	
	国庫債券 利付(20年)第163回	1,900,000,000	1,988,426,000	
	国庫債券 利付(20年)第164回	2,600,000,000	2,669,160,000	
	国庫債券 利付(20年)第165回	2,200,000,000	2,255,198,000	
	国庫債券 利付(20年)第166回	2,300,000,000	2,439,656,000	
	国庫債券 利付(20年)第167回	3,000,000,000	3,065,850,000	
	メキシコ合衆国 第22回円貨社債(2016)	300,000,000	302,025,000	
	メキシコ合衆国 第25回円貨社債(2018)	100,000,000	100,070,000	
	ポーランド共和国 第15回円貨債券(2013)	100,000,000	100,653,000	
小計	銘柄数: 262	479,079,000,000	528,217,928,260	
	組入時価比率: 79.9%		80.4%	
合計			528,217,928,260	
地方債証券	日本円			
	東京都 公募第685回	100,000,000	101,297,000	
	東京都 公募第690回	200,000,000	204,244,000	
	東京都 公募第703回	100,000,000	102,609,000	
	東京都 公募第707回	100,000,000	102,496,000	
	東京都 公募第708回	100,000,000	102,783,000	
	東京都 公募第710回	100,000,000	102,530,000	
	東京都 公募第712回	100,000,000	102,590,000	
	東京都 公募第715回	100,000,000	102,746,000	
	東京都 公募第716回	200,000,000	205,566,000	
	東京都 公募第731回	100,000,000	103,065,000	
	東京都 公募第745回	300,000,000	309,471,000	
	東京都 公募第760回	100,000,000	100,192,000	
	東京都 公募第761回	100,000,000	100,414,000	
	東京都 公募第769回	500,000,000	507,115,000	
	東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	136,036,000	



東京都	公募第10回	200,000,000	266,560,000
東京都	公募第1回	300,000,000	319,095,000
東京都	公募(20年)第3回	200,000,000	222,070,000
東京都	公募第7回	100,000,000	113,702,000
東京都	公募(20年)第16回	200,000,000	236,558,000
東京都	公募(20年)第17回	200,000,000	238,090,000
東京都	公募第23回	100,000,000	122,162,000
東京都	公募(20年)第26回	100,000,000	119,130,000
北海道	公募平成24年度第6回	100,000,000	102,715,000
北海道	公募平成24年度第9回	100,000,000	102,674,000
北海道	公募平成25年度第1回	300,000,000	306,609,000
北海道	公募平成26年度第13回	100,000,000	102,414,000
北海道	公募平成27年度第7回	100,000,000	103,130,000
北海道	公募平成28年度第13回	200,000,000	199,944,000
北海道	公募平成29年度第5回	200,000,000	201,872,000
北海道	公募平成29年度第6回	700,000,000	699,538,000
北海道	公募平成29年度第7回	100,000,000	101,121,000
北海道	公募平成29年度第9回	100,000,000	101,057,000
宮城県	公募第32回2号	100,000,000	100,599,000
神奈川県	公募第184回	100,000,000	102,178,000
神奈川県	公募第188回	200,000,000	206,040,000
神奈川県	公募第196回	100,000,000	102,611,000
神奈川県	公募第200回	100,000,000	103,595,000
神奈川県	公募第205回	100,000,000	103,207,000
神奈川県	公募第206回	100,000,000	103,269,000
神奈川県	公募第210回	200,000,000	204,874,000
神奈川県	公募第231回	200,000,000	202,670,000
神奈川県	公募(30年)第3回	100,000,000	136,981,000
神奈川県	公募第7回	300,000,000	351,684,000
大阪府	公募第346回	100,000,000	102,158,000
大阪府	公募第356回	100,000,000	102,760,000
大阪府	公募第378回	104,000,000	107,202,160
大阪府	公募第381回	100,000,000	103,163,000
大阪府	公募第382回	100,000,000	103,171,000
大阪府	公募第383回	100,000,000	103,327,000
大阪府	公募第384回	100,000,000	103,259,000
大阪府	公募第387回	300,000,000	307,785,000
大阪府	公募第389回	100,000,000	102,728,000
大阪府	公募第417回	102,000,000	103,536,120
大阪府	公募第423回	100,000,000	100,913,000
大阪府	公募第429回	179,000,000	180,600,260
大阪府	公募第5回	100,000,000	121,348,000

大阪府	公募第8回	100,000,000	119,250,000
大阪府	公募(5年)第130回	600,000,000	599,634,000
大阪府	公募(5年)第137回	1,024,000,000	1,023,109,120
大阪府	公募(5年)第141回	230,000,000	229,770,000
京都府	公募平成24年度第2回	100,000,000	102,846,000
京都府	公募平成24年度第6回	100,000,000	102,760,000
京都府	公募平成26年度第5回	100,000,000	116,382,000
京都府	公募平成26年度第7回	200,000,000	205,880,000
兵庫県	公募平成26年度第17回	100,000,000	102,480,000
兵庫県	公募(30年)第2回	100,000,000	134,190,000
兵庫県	公募(15年)第1回	300,000,000	335,232,000
兵庫県	公募(15年)第3回	200,000,000	221,044,000
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	309,402,000
兵庫県	公募第2回	100,000,000	119,219,000
兵庫県	公募第9回	100,000,000	121,545,000
兵庫県	公募(20年)第11回	200,000,000	236,182,000
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	118,253,000
静岡県	公募平成24年度第5回	100,060,000	102,782,632
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	102,614,000
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	104,936,980
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	170,534,100
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	102,949,000
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	205,874,000
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	116,115,480
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	301,239,000
静岡県	公募平成29年度第3回	100,000,000	101,064,000
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	118,638,000
静岡県	公募(20年)第14回	100,000,000	118,927,000
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	118,283,000
愛知県	公募平成22年度第3回	100,000,000	101,487,000
愛知県	公募平成22年度第9回	100,000,000	101,646,000
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	102,843,000
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	102,929,000
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	118,277,000
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	442,940,000
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	120,663,000
愛知県	公募(30年)平成25年度第8回	120,000,000	156,873,600
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	126,533,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	115,069,000
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	102,972,000
愛知県	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,794,000

広島県	公募平成22年度第6回	300,000,000	306,606,000
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	102,880,000
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	206,992,000
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	111,607,252
広島県	公募平成29年度第4回	111,300,000	112,773,612
埼玉県	公募平成22年度第2回	200,000,000	202,974,000
埼玉県	公募平成24年度第4回	300,000,000	308,109,000
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	103,874,000
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	153,219,960
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	103,199,000
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	103,175,000
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	103,296,000
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	205,792,000
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	410,340,000
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	102,388,000
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	101,469,000
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,090,000
福岡県	公募平成22年度第5回	100,000,000	101,411,000
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	102,534,000
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	103,279,000
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	310,329,000
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	101,261,000
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	111,074,000
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	137,592,000
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	126,817,000
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	118,379,000
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	117,696,000
千葉県	公募平成24年度第1回	100,000,000	103,128,000
千葉県	公募平成24年度第2回	100,000,000	102,782,000
千葉県	公募平成24年度第7回	100,000,000	102,677,000
千葉県	公募平成24年度第8回	100,000,000	103,121,000
千葉県	公募平成25年度第3回	100,000,000	103,668,000
千葉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	103,873,000
千葉県	公募平成26年度第3回	200,000,000	206,208,000
千葉県	公募平成28年度第4回	200,000,000	200,902,000
千葉県	公募(20年)第8回	100,000,000	121,817,000
千葉県	公募(20年)第17回	100,000,000	115,690,000
群馬県	公募第8回	100,000,000	102,646,000
群馬県	公募第12回	100,000,000	103,147,000
群馬県	公募(20年)第3回	100,000,000	118,329,000

岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	192,087,163
大分県 公募平成23年度第1回	902,000,000	924,495,880
共同発行市場地方債 公募第88回	100,000,000	101,456,000
共同発行市場地方債 公募第89回	100,000,000	101,383,000
共同発行市場地方債 公募第92回	110,000,000	111,788,600
共同発行市場地方債 公募第93回	300,000,000	306,237,000
共同発行市場地方債 公募第94回	300,000,000	306,501,000
共同発行市場地方債 公募第96回	100,000,000	102,461,000
共同発行市場地方債 公募第101回	300,000,000	307,305,000
共同発行市場地方債 公募第102回	150,000,000	153,709,500
共同発行市場地方債 公募第103回	100,000,000	102,484,000
共同発行市場地方債 公募第104回	200,000,000	205,292,000
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	205,846,000
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	205,438,000
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	205,586,000
共同発行市場地方債 公募第112回	100,000,000	102,703,000
共同発行市場地方債 公募第113回	800,000,000	820,304,000
共同発行市場地方債 公募第114回	243,700,000	250,438,305
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	102,769,000
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	205,676,000
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	103,121,000
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	206,070,000
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	307,875,000
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	102,243,000
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	409,976,000
共同発行市場地方債 公募第124回	100,000,000	103,830,000
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	103,540,000
共同発行市場地方債 公募第128回	300,000,000	308,949,000
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	103,272,000
	100,000,000	103,569,000

共同発行市場地方債 公募第130回			
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	103,198,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	206,098,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	205,712,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	159,381,850	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	553,170,600	
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,022,540,000	
共同発行市場地方債 公募第156回	100,000,000	100,483,000	
共同発行市場地方債 公募第157回	300,000,000	301,047,000	
共同発行市場地方債 公募第161回	300,000,000	300,564,000	
共同発行市場地方債 公募第172回	200,000,000	202,708,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	120,237,000	
堺市 公募平成22年度第2回	100,000,000	102,082,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	122,916,000	
島根県 公募平成22年度第1回	100,000,000	101,709,000	
島根県 公募平成28年度第3回	100,000,000	99,976,000	
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	100,375,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	205,316,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,946,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	145,774,360	
栃木県 公募平成24年度第1回	100,000,000	102,813,000	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,946,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	240,944,572	
新潟市 公募平成29年度第1回	100,000,000	101,250,000	
奈良県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,976,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,811,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	103,135,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	103,109,000	
大阪市 公募（5年）平成28年度第5回	100,000,000	99,976,000	
大阪市 公募（15年）第1回	100,000,000	112,523,000	
大阪市 公募（20年）第1回	300,000,000	357,276,000	
大阪市 公募（20年）第5回	100,000,000	122,108,000	
大阪市 公募（20年）第6回	100,000,000	120,021,000	
大阪市 公募（20年）第17回	100,000,000	119,125,000	
名古屋市 公募第478回	100,000,000	103,057,000	

名古屋市 公募第481回	100,000,000	102,687,000
名古屋市 公募第488回	300,000,000	309,375,000
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	212,468,000
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	107,798,000
京都市 公募平成23年度第4回	100,000,000	102,820,000
京都市 公募平成29年度第4回	101,280,000	102,737,419
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	113,446,000
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	115,026,000
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	304,491,000
神戸市 公募平成28年度第1回	200,000,000	200,836,000
横浜市 公募平成22年度第5回	100,000,000	102,056,000
横浜市 公募公債平成24年度2回	200,000,000	205,608,000
横浜市 公募公債平成25年度1回	200,000,000	205,326,000
横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	205,896,000
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	205,084,000
横浜市 公募平成28年度第5回	300,000,000	304,560,000
横浜市 公募平成29年度第3回	100,000,000	101,406,000
横浜市 公募(30年)第2回	200,000,000	265,100,000
横浜市 公募(20年)第26回	100,000,000	119,916,000
横浜市 公募(20年)第30回	100,000,000	115,220,000
札幌市 公募平成22年度第4回	100,000,000	101,204,000
札幌市 公募(15年)平成23年度第9回	100,000,000	111,354,000
札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	120,275,000
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	102,681,000
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	204,638,000
川崎市 公募第85回	100,000,000	102,600,000
川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	116,694,000
北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	119,200,000
福岡市 公募(20年)平成23年度第4回	100,000,000	120,110,000
福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	116,829,000
福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,860,000
福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	164,211,200
広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	102,472,000
広島市 公募平成27年度第2回	500,000,000	514,800,000
千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	103,128,000
三重県 公募平成24年度第1回	140,660,000	144,560,501
三重県 公募平成28年度第1回	155,000,000	156,590,300
鹿児島県 公募(5年)平成28年度第1回	100,000,000	99,977,000
福井県 公募平成22年度第2回	100,000,000	102,783,000
福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	101,804,000

		福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	200,910,000
		徳島県 公募平成22年度第1回	400,000,000	406,688,000
		山梨県 公募平成24年度第1回	200,000,000	205,552,000
		岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	171,171,705
		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	120,401,000
		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	364,554,000
		福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	119,415,000
		福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	105,908,000
	小計	銘柄数：250 組入時価比率：6.6%	41,697,820,000	43,930,497,231 6.7%
	合計			43,930,497,231
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	103,738,000
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	155,286,890
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	198,414,620
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	109,065,000
		新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	200,000,000
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	109,353,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	307,671,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	108,656,000
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	302,892,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第9回	141,000,000	143,058,600
		日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	105,009,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000	163,423,380
		日本政策投資銀行社債 政府保証第38回	1,500,000,000	1,502,640,000
		日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	303,891,000
		道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	316,341,000
		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	204,048,000
		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	134,632,000
		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	233,038,000

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	116,768,000	
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	237,544,000	
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	312,620,000	
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	120,775,000	
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	122,133,000	
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	102,793,000	
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	411,372,000	
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	205,246,000	
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	118,083,000	
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	102,483,000	
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	415,222,500	
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	120,811,000	
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	205,198,000	
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	204,878,000	
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	205,698,000	
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	357,990,000	
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	121,281,000	
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	92,102,000	
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	103,599,000	
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	103,749,000	
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	241,654,000	
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	242,148,000	
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	244,382,000	
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	242,940,000	
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	239,078,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	131,339,000	
	440,000,000	451,998,800	



日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	140,000,000	143,819,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	100,000,000	102,628,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	140,000,000	143,781,400	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第163回	1,000,000,000	1,029,440,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	100,000,000	127,037,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	100,000,000	102,893,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	100,000,000	118,231,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	224,197,740	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	100,000,000	117,310,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	300,000,000	387,450,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	200,000,000	205,948,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	200,000,000	205,900,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	200,000,000	205,750,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	900,000,000	929,934,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	100,000,000	119,821,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	196,000,000	200,619,720	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	400,000,000	410,696,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	1,000,000,000	1,038,900,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	272,000,000	282,452,960	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	300,000,000	310,392,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	137,000,000	141,699,100	
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	149,947,400	
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	117,162,000	
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	125,671,000	
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	117,444,000	
	100,000,000	103,579,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回			
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	125,892,000	
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	196,129,400	
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	102,910,000	
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	566,365,000	
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	151,682,520	
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	506,900,000	
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	104,853,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	400,000,000	541,336,000	
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	137,341,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	137,539,000	
公営企業債券 政府保証15年第1回	300,000,000	305,760,000	
地方公営企業等金融機構債券(20年) 第1回	100,000,000	118,344,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	120,333,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	114,988,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	366,108,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	106,433,000	
地方公共団体金融機構債券 第13回	200,000,000	202,926,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保証第16回	100,000,000	101,460,000	
地方公共団体金融機構債券 第16回	100,000,000	101,620,000	
地方公共団体金融機構債券 第27回	300,000,000	307,065,000	
地方公共団体金融機構債券 第28回	500,000,000	512,385,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	107,434,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	106,021,000	
地方公共団体金融機構債券 F122回	100,000,000	110,703,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第37回	604,000,000	621,932,760	
	400,000,000	410,460,000	

地方公共団体金融機構債券 第37回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回	194,000,000	199,546,460	
地方公共団体金融機構債券 F132回	500,000,000	532,840,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	102,807,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	103,970,410	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	104,977,380	
地方公共団体金融機構債券 第41回	600,000,000	616,242,000	
地方公共団体金融機構債券 F142回	100,000,000	105,426,000	
地方公共団体金融機構債券 F144回	200,000,000	201,614,000	
地方公共団体金融機構債券 F145回	200,000,000	211,946,000	
地方公共団体金融機構債券 F147回	100,000,000	109,514,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第42回	108,000,000	111,274,560	
地方公共団体金融機構債券 第42回	100,000,000	102,773,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第43回	202,000,000	207,754,980	
政保 地方公共団体金融機構債券 第44回	145,000,000	149,783,550	
地方公共団体金融機構債券 第44回	100,000,000	102,863,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第45回	223,000,000	230,345,620	
地方公共団体金融機構債券 F160回	100,000,000	108,383,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第49回	13,000,000	13,501,020	
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回	100,000,000	104,048,000	
地方公共団体金融機構債券 第51回	600,000,000	621,138,000	
地方公共団体金融機構債券 第52回	300,000,000	311,187,000	
地方公共団体金融機構債券（15年）第2回	200,000,000	219,302,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第56回	591,000,000	613,257,060	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	120,127,280	
政保 地方公共団体金融機構債券（6年）第14回	300,000,000	300,843,000	
	100,000,000	116,473,000	

地方公共団体金融機構債券(20年)第38回			
地方公共団体金融機構債券 F240回	300,000,000	327,864,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第64回	100,000,000	103,185,000	
地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	102,839,000	
地方公共団体金融機構債券(20年)第39回	100,000,000	115,732,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第65回	400,000,000	412,844,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第69回	320,000,000	328,576,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第72回	189,000,000	195,388,200	
地方公共団体金融機構債券 第74回	300,000,000	308,883,000	
地方公共団体金融機構債券 第77回	100,000,000	102,865,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第78回	509,000,000	523,297,810	
地方公共団体金融機構債券 第79回	400,000,000	411,692,000	
政保 地方公共団体金融機構債券(8年)第5回	500,000,000	505,210,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第83回	116,000,000	116,527,800	
地方公共団体金融機構債券 第101回	400,000,000	404,560,000	
地方公共団体金融機構債券 第113回	110,000,000	111,860,100	
公営企業債券(20年)第2回財投機関債	100,000,000	105,196,000	
公営企業債券(20年)第5回財投機関債	200,000,000	218,336,000	
公営企業債券(20年)第25回財投機関債	100,000,000	121,622,000	
首都高速道路 第17回	200,000,000	199,870,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	102,509,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	205,872,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	108,554,000	
都市再生債券 財投機関債第109回	100,000,000	107,727,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	113,401,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	360,000,000	372,063,600	
東京交通債券 第342回	200,000,000	215,056,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	172,065,720	
関西国際空港社債 財投機関債第26回	300,000,000	304,668,000	

関西国際空港社債 財投機関債第3 2回	100,000,000	102,676,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機 関債	100,000,000	102,844,000	
中部国際空港債券 政府保証第18 回	368,000,000	378,289,280	
預金保険機構債券 政府保証第20 9回	2,000,000,000	2,004,740,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第3回	200,000,000	234,072,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第18回	100,000,000	109,344,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	110,967,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	119,479,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第73回	100,000,000	102,642,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	121,546,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	335,562,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	121,485,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第79回	100,000,000	102,497,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第86回	200,000,000	204,884,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	223,130,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第120回	100,000,000	120,325,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	134,496,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第132回	200,000,000	217,120,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	250,000,000	256,605,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	200,000,000	201,126,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	101,282,000	
成田国際空港 第10回	100,000,000	102,508,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	205,704,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	204,808,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第17回	100,000,000	102,538,000	
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	299,901,000	
商工債券 利付第811回い号	300,000,000	300,660,000	
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	100,239,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,084,000	

商工債券 利付第 8 1 9 回い号	300,000,000	300,387,000
農林債券 利付第 7 8 1 回い号	100,000,000	100,287,000
しんきん中金債券 利付第 3 0 8 回	100,000,000	100,271,000
しんきん中金債券 利付第 3 1 6 回	100,000,000	100,067,000
しんきん中金債券 利付第 3 1 7 回	800,000,000	800,400,000
しんきん中金債券 利付第 3 3 5 回	200,000,000	200,346,000
商工債券 利付(10年)第 1 5 回	200,000,000	203,608,000
国際協力機構債券 第 6 回財投機関債	100,000,000	121,322,000
東日本高速道路 第 3 4 回	100,000,000	100,314,000
東日本高速道路 第 3 6 回	200,000,000	200,000,000
中日本高速道路社債 第 6 1 回	100,000,000	100,224,000
中日本高速道路 第 6 2 回	200,000,000	200,464,000
中日本高速道路 第 6 3 回	100,000,000	103,237,000
中日本高速道路 第 6 6 回	1,200,000,000	1,199,124,000
西日本高速道路 第 2 0 回	200,000,000	206,154,000
西日本高速道路 第 2 3 回	100,000,000	102,656,000
西日本高速道路 第 3 0 回	300,000,000	301,794,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 3 5 回	200,000,000	203,194,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 2 回	100,000,000	103,185,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 8 回	200,000,000	205,598,000
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 9 回	100,000,000	115,741,000
貸付債権担保第 6 回住宅金融公庫債券	10,354,000	10,426,063
貸付債権担保第 1 2 回住宅金融公庫債券	35,220,000	35,894,110
貸付債権担保第 1 9 回住宅金融公庫債券	65,240,000	67,294,407
貸付債権担保第 1 0 回住宅金融公庫債券	65,742,000	66,350,113
貸付債権担保第 5 回 S 種住宅金融公庫債券	40,698,000	41,947,428
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融公庫債券	44,652,000	47,038,649
貸付債権担保第 7 回 S 種住宅金融公庫債券	13,966,000	14,592,095
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融公庫債券	30,114,000	31,350,781
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融公庫債券	34,400,000	36,329,840
貸付債権担保第 1 5 回住宅金融公庫債券	38,565,000	39,602,012
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融公庫債券	65,084,000	67,761,555
	66,330,000	68,840,590

貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券			
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	59,388,000	62,657,903	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	99,906,000	104,865,333	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	16,535,000	17,381,922	
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	25,432,000	27,594,228	
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	86,652,000	93,138,768	
貸付債権担保5種第16回住宅金融支援機構債券	18,776,000	19,303,981	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	90,990,000	96,503,084	
貸付債権担保5種第17回住宅金融支援機構債券	37,900,000	39,032,831	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	110,259,000	117,993,668	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	80,580,000	85,487,322	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	46,362,000	50,057,051	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	102,777,000	110,101,916	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	114,321,000	120,348,003	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	152,034,000	160,041,630	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	147,867,000	156,493,560	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	95,438,000	100,619,329	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	37,197,000	39,622,244	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	88,346,000	94,299,636	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	50,022,000	52,247,478	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	105,762,000	110,547,730	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	48,291,000	50,426,910	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	27,372,000	28,316,334	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	144,729,000	152,236,093	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	31,943,000	34,302,309	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	33,395,000	35,885,265	
	33,407,000	35,753,841	

貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	36,553,000	39,195,416	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	96,952,000	102,847,651	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	138,702,000	147,097,632	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	46,190,000	49,021,908	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	92,980,000	97,693,156	
貸付債権担保5種第3回住宅金融公庫債券	13,029,000	13,422,475	
貸付債権担保5種第14回住宅金融支援機構債券	81,300,000	83,143,884	
貸付債権担保5種第15回住宅金融支援機構債券	33,212,000	33,955,284	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	90,404,000	97,256,623	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	90,900,000	97,228,458	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	180,205,000	190,577,599	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	97,606,000	103,517,995	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	159,306,000	167,245,811	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	139,899,000	145,960,823	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	108,254,000	114,558,712	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	92,520,000	97,447,615	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	223,580,000	233,473,415	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	395,017,000	411,745,969	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	58,859,000	61,145,672	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	61,256,000	63,717,878	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	62,561,000	64,800,058	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	129,592,000	133,361,831	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	135,852,000	138,755,157	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	72,906,000	75,290,026	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	76,739,000	79,019,683	
	227,679,000	235,697,854	



		貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援機構債券	232,158,000	241,342,170	
		貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援機構債券	155,892,000	161,895,400	
		貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支援機構債券	76,682,000	79,475,525	
		貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支援機構債券	77,030,000	80,062,671	
		貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支援機構債券	270,159,000	272,741,720	
		貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支援機構債券	181,116,000	183,691,469	
		貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券	182,242,000	184,611,146	
		貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支援機構債券	91,369,000	92,627,151	
		貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支援機構債券	182,852,000	185,296,731	
		貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支援機構債券	92,136,000	92,963,381	
		貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支援機構債券	92,619,000	93,599,835	
		貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支援機構債券	93,353,000	94,557,253	
		貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券	375,028,000	379,022,048	
		貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券	282,813,000	286,093,630	
		貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券	189,476,000	191,533,709	
		貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券	190,832,000	193,494,106	
		貸付債権担保第 1 3 4 回住宅金融支援機構債券	194,738,000	196,342,641	
		貸付債権担保第 1 3 5 回住宅金融支援機構債券	97,559,000	98,355,081	
		貸付債権担保第 1 3 6 回住宅金融支援機構債券	97,921,000	99,090,176	
		貸付債権担保第 1 4 0 回住宅金融支援機構債券	99,139,000	99,834,955	
		貸付債権担保第 1 4 2 回住宅金融支援機構債券	299,619,000	300,215,241	
		貸付債権担保第 1 4 4 回住宅金融支援機構債券	300,000,000	300,369,000	
	小計	銘柄数：287	54,293,832,000	57,259,874,456	
		組入時価比率：8.7%		8.7%	
	合計			57,259,874,456	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（BFCM）第14回円貸社債	200,000,000	201,688,000	

ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第11回円貨社債	100,000,000	100,391,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第14回円貨社債	100,000,000	99,492,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第1回非上位円貨社債	200,000,000	200,574,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第6回円貨社債(2014)	100,000,000	102,608,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第15回円貨社債(2018)	100,000,000	99,350,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第16回円貨社債(2018)	100,000,000	99,593,000	
マラヤン・バンキング・ベルハッ ド 第2回円貨社債(2015)	200,000,000	200,324,000	
スタンダード・チャータード 第2 回円貨社債(2015)	100,000,000	100,173,000	
スタンダード・チャータード 第3 回円貨社債(2015)	100,000,000	100,632,000	
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	101,700,000	
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	103,675,000	
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	99,911,000	
ロイズ・バンキング・グループ・ ピーエルシー 第6回円貨社債	100,000,000	99,106,000	
ロイズ・バンキング・グループ・ ピーエルシー 第7回円貨社債	100,000,000	96,491,000	
サントナデル銀行 第1回円貨社 債	100,000,000	99,878,000	
フランス電力 第4回円貨社債(2 017)	100,000,000	102,529,000	
ルノー 第19回円貨社債(201 7)	100,000,000	99,588,000	
現代キャピタル・サービス・イン ク 第15回円貨社債	200,000,000	200,980,000	
ビー・エヌ・ビー・パリバ 第1回 円貨社債(2017)	100,000,000	101,747,000	
ウエストパック・バンキング・コー ポレーション 第12回円貨社	200,000,000	200,242,000	
オーストラリア・ニュージーランド 銀行 第10回円貨社債	200,000,000	199,930,000	
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上 位円貨社債(2017)	100,000,000	99,792,000	
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	100,697,000	
大和ハウス工業 第9回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,401,000	
森永乳業 第13回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	103,256,000	
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	100,011,000	
	100,000,000	100,205,000	

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			
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	100,619,000	
麒麟ホールディングス 第10回 社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,658,000	
味の素 第24回特定社債間限定同 順位特約付	200,000,000	200,434,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	100,547,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,759,000	
野村不動産ホールディングス 第5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,151,000	
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	199,006,000	
森ビル 第13回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,360,000	
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	102,746,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,866,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	201,600,000	
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	100,768,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,832,000	
住友化学 第56回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,329,000	
エア・ウォーター 第2回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,185,000	
三井化学 第47回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	99,938,000	
三井化学 第48回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,313,000	
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	201,732,000	
電通 第1回社債間限定同順位特約 付	100,000,000	99,971,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約 付	100,000,000	101,102,000	
花王 第4回特定社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,653,000	
武田薬品工業 第15回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,745,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	100,072,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	103,058,000	
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	102,928,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,570,000	

住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,918,000
日本特殊陶業 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,766,000
新日鐵住金 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,765,000
新日鐵住金 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,242,000
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,536,000
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,242,000
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,945,000
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	102,442,000
DOWAホールディングス 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,884,000
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,930,000
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	219,458,000
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,674,000
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,957,000
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,177,000
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,776,000
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,365,000
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,174,000
ソニー 第32回	200,000,000	200,786,000
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	100,799,000
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,865,000
J A 三井リース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,044,000
J A 三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,997,000
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	100,115,000
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	103,320,000
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,267,000
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	100,237,000
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,395,000

大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,040,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	205,276,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,622,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,873,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	209,538,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,690,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,891,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,692,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,368,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,330,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,873,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,857,000	
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	102,475,000	
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	99,958,000	
りそなホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,400,000	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	200,000,000	204,864,000	
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	118,875,000	
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	107,498,000	
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	101,466,000	
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	201,330,000	
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	306,210,000	
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	102,545,000	
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	106,802,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	100,000,000	103,119,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	300,000,000	311,595,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,749,000	
	100,000,000	102,107,000	

セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付			
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	204,478,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	103,084,000	
トヨタファイナンス 第81回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,875,000	
リコーリース 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,404,000	
アコム 第76回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,676,000	
アコム 第77回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,432,000	
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,851,000	
ジャックス 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,849,000	
日立キャピタル 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,880,000	
日立キャピタル 第57回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,870,000	
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	100,194,000	
三菱UFJリース 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,483,000	
三菱UFJリース 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,966,000	
三菱UFJリース 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,743,000	
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	100,276,000	
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	103,161,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	107,322,000	
三菱地所 第98回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,279,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	102,817,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	100,002,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,002,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,391,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,056,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,666,000	
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	101,365,000	
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	103,960,000	

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	102,225,000	
東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	214,410,000	
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	203,402,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,726,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,935,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	216,508,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,554,000	
東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	103,537,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	213,314,000	
東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,873,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	240,594,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	117,879,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,988,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,255,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	200,000,000	235,484,000	
西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,556,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	241,498,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,021,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	122,108,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	100,241,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	102,000,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	106,386,000	
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	203,428,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,201,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,788,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,626,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,957,000	
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	102,870,000	

三菱倉庫 第14回	100,000,000	100,589,000
澁澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,890,000
日本電信電話 第60回	100,000,000	102,061,000
KDDI 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,065,000
東京電力 第547回	100,000,000	102,129,000
東京電力 第548回	100,000,000	112,833,000
東京電力 第560回	100,000,000	111,189,000
東京電力 第565回	300,000,000	303,795,000
中部電力 第500回	200,000,000	206,124,000
中部電力 第524回	100,000,000	100,354,000
関西電力 第482回	100,000,000	101,389,000
関西電力 第484回	100,000,000	101,300,000
関西電力 第496回	100,000,000	103,315,000
関西電力 第497回	200,000,000	207,926,000
関西電力 第498回	200,000,000	200,930,000
関西電力 第511回	100,000,000	99,918,000
関西電力 第514回	200,000,000	200,186,000
中国電力 第330回	100,000,000	103,819,000
中国電力 第377回	400,000,000	415,320,000
中国電力 第378回	100,000,000	103,339,000
中国電力 第400回	100,000,000	99,592,000
北陸電力 第301回	100,000,000	103,666,000
北陸電力 第304回	100,000,000	103,226,000
北陸電力 第307回	100,000,000	104,971,000
北陸電力 第308回	100,000,000	102,449,000
東北電力 第473回	100,000,000	100,993,000
東北電力 第475回	100,000,000	102,663,000
東北電力 第481回	200,000,000	205,798,000
四国電力 第281回	200,000,000	207,768,000
九州電力 第424回	300,000,000	313,101,000
九州電力 第428回	105,000,000	108,371,550
九州電力 第449回	200,000,000	200,620,000
九州電力 第451回	100,000,000	100,431,000
北海道電力 第316回	207,000,000	209,657,880
北海道電力 第323回	100,000,000	108,053,000
北海道電力 第338回	100,000,000	100,461,000
電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,541,000
電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,119,000
電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,064,000
	100,000,000	103,042,000



	電源開発 第 4 0 回社債間限定同順位特約付			
	電源開発 第 4 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,497,000	
	電源開発 第 5 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,543,000	
	東京電力パワーグリッド 第 2 回	100,000,000	100,348,000	
	東京電力パワーグリッド 第 6 回	100,000,000	99,769,000	
	東京電力パワーグリッド 第 1 1 回	300,000,000	297,330,000	
	東京電力パワーグリッド 第 1 4 回	100,000,000	99,556,000	
	東京瓦斯 第 3 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,524,000	
	東京瓦斯 第 3 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	128,229,000	
	東邦瓦斯 第 3 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,844,000	
	北海道瓦斯 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,505,000	
	広島ガス 第 1 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,412,000	
	東京都競馬 第 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,972,000	
	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	101,139,000	
	ファーストリテイリング 第 4 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,964,000	
	ソフトバンクグループ 第 5 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,254,000	
小計	銘柄数：217 組入時価比率：4.2%	26,912,000,000	27,660,415,430 4.2%	
合計			27,660,415,430	
合計			657,068,715,377	

(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)

(2019年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	54,638,138
コール・ローン	769,895,087
国債証券	608,979,286,006
派生商品評価勘定	2,815,183
未収入金	1,952,100,386
未収利息	6,538,775,051

(2019年 4月22日現在)

前払費用	337,022,547
流動資産合計	618,634,532,398
資産合計	618,634,532,398
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	657,576
未払金	13,602,845
未払解約金	2,271,229,593
未払利息	1,676
その他未払費用	5,016,000
流動負債合計	2,290,507,690
負債合計	2,290,507,690
純資産の部	
元本等	
元本	268,533,625,797
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	347,810,398,911
元本等合計	616,344,024,708
純資産合計	616,344,024,708
負債純資産合計	618,634,532,398

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 4月22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	2.2952円
(10,000口当たり純資産額)	(22,952円)

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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

2019年 4月22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>国債証券</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

2019年 4月22日現在	
期首	2018年 4月24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	275,873,817,039円

同期中における追加設定元本額	32,419,663,609円
同期中における一部解約元本額	39,759,854,851円
期末元本額	268,533,625,797円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	87,807,626円
バランスセレクト50	90,754,291円
バランスセレクト70	76,677,973円
野村外国債券インデックスファンド	287,578,101円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,997,281,701円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	25,592,616,069円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,531,288,796円
野村資産設計ファンド2015	29,888,577円
野村資産設計ファンド2020	35,169,355円
野村資産設計ファンド2025	47,933,714円
野村資産設計ファンド2030	44,543,314円
野村資産設計ファンド2035	30,484,982円
野村資産設計ファンド2040	60,304,569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)	139,654,301,767円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	5,764,856,679円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	10,584,371,030円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	2,163,609,278円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	852,820,372円
野村資産設計ファンド2045	7,164,315円
野村インデックスファンド・外国債券	808,974,989円
マイ・ロード	8,855,504,592円
ネクストコア	372,941,064円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	127,529,617円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	4,365,768,916円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,618,894,804円
野村資産設計ファンド2050	8,980,437円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,256,796円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,772,201円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,392,619円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,073,045円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	463,560,578円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	245,420,237円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,165,886円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,758,716円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,581,669円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,343,626円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,477,220円
野村6資産均等バランス	320,877,220円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	8,763,934,325円
世界6資産分散ファンド	88,659,074円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	450,742,787円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	805,810,477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)	9,043,577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)	1,620,788,983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)	425,757,994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)	1,874,297,430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)	1,414,504,072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)	3,636,085円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	11,414,668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)	778,795円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,249,172,310円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	25,026,446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)	114,853,208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)	37,462,008円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	196,024,528円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	207,693,021円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	1,947,206,668円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	930,865,355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)	1,350,953,934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)	930,311,499円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	4,162,713円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,753,625円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	6,727,318円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	559,977,576円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,544,617,301円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	3,453,455,835円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	3,063,160,343円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	14,452,497,108円
マイバランスDC30	1,661,654,228円
マイバランスDC50	1,048,310,340円
マイバランスDC70	678,242,627円
野村DC外国債券インデックスファンド	4,842,258,199円
野村DC運用戦略ファンド	2,967,063,671円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	311,793,581円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	98,467,732円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	97,187,658円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	47,183,318円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	3,889,374円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	13,670,397円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	3,931,560円
野村資産設計ファンド(DC)2030	649,559円
野村資産設計ファンド(DC)2040	491,466円
野村資産設計ファンド(DC)2050	557,633円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	26,717,813円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	13,973,030円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	4,528,605円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	7,039,202円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2019年4月22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	25,500,000.00	27,575,860.65	
		US TREASURY BOND	25,300,000.00	28,819,270.48	
		US TREASURY BOND	13,800,000.00	15,984,281.94	
		US TREASURY BOND	47,100,000.00	47,061,363.87	
		US TREASURY BOND	55,700,000.00	67,967,056.08	
		US TREASURY BOND	20,100,000.00	25,625,930.19	
		US TREASURY BOND	23,000,000.00	29,332,187.50	
		US TREASURY BOND	28,300,000.00	35,187,071.02	
		US TREASURY BOND	40,400,000.00	49,584,689.52	
		US TREASURY BOND	35,600,000.00	43,849,189.28	
		US TREASURY BOND	100,000.00	123,976.56	
		US TREASURY BOND	27,500,000.00	27,263,673.25	
		US TREASURY BOND	16,000,000.00	18,320,000.00	
		US TREASURY N/B	300,000.00	296,355.48	
		US TREASURY N/B	100,000.00	98,996.09	
		US TREASURY N/B	600,000.00	598,828.14	
		US TREASURY N/B	300,000.00	297,257.82	
		US TREASURY N/B	7,800,000.00	7,695,796.68	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,967,539.10	
		US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,598,171.94	
		US TREASURY N/B	56,400,000.00	57,016,875.00	
		US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,848,672.20	
		US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,225,288.88	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,001,250.00	
		US TREASURY N/B	500,000.00	494,726.55	
		US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,445,547.30	
		US TREASURY N/B	10,400,000.00	10,301,687.76	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,201,031.28	
		US TREASURY N/B	20,800,000.00	20,568,437.76	
		US TREASURY N/B	13,400,000.00	13,329,859.04	
		US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,622,398.63	
		US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,037,500.00	
US TREASURY N/B	32,180,000.00	32,260,450.00			

US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,086,894.49
US TREASURY N/B	36,200,000.00	36,057,180.14
US TREASURY N/B	37,700,000.00	37,177,206.56
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,964,843.60
US TREASURY N/B	700,000.00	689,746.12
US TREASURY N/B	300,000.00	296,601.57
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,960,781.20
US TREASURY N/B	700,000.00	689,171.91
US TREASURY N/B	52,600,000.00	52,766,431.66
US TREASURY N/B	13,700,000.00	13,611,163.72
US TREASURY N/B	1,000,000.00	987,695.30
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,796,015.88
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,384,796.84
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,314,265.16
US TREASURY N/B	35,300,000.00	35,130,394.09
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,125,023.28
US TREASURY N/B	47,200,000.00	48,221,436.32
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,382,843.84
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,810,878.76
US TREASURY N/B	11,800,000.00	11,770,961.38
US TREASURY N/B	600,000.00	587,250.00
US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,298,792.84
US TREASURY N/B	10,800,000.00	10,773,843.48
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,117,312.50
US TREASURY N/B	42,600,000.00	43,234,007.28
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,004,882.80
US TREASURY N/B	22,500,000.00	22,328,613.00
US TREASURY N/B	300,000.00	293,871.09
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,005,507.80
US TREASURY N/B	34,000,000.00	33,824,689.20
US TREASURY N/B	800,000.00	779,250.00
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,111,730.39
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,572,672.14
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,696,242.14
US TREASURY N/B	24,600,000.00	24,467,391.24
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,743,687.84
US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,912,500.80
US TREASURY N/B	16,800,000.00	16,653,656.88
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,848,714.82
US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,211,886.59
US TREASURY N/B	1,000,000.00	988,046.90
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,643,922.06

US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,328,796.72
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,641,113.03
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,818,750.40
US TREASURY N/B	14,000,000.00	13,822,265.80
US TREASURY N/B	33,700,000.00	33,394,593.75
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,179,663.88
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,453,925.65
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,733,710.69
US TREASURY N/B	500,000.00	493,476.55
US TREASURY N/B	70,300,000.00	69,067,001.27
US TREASURY N/B	21,300,000.00	21,004,628.64
US TREASURY N/B	11,100,000.00	10,903,582.17
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,675,894.51
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,848,003.87
US TREASURY N/B	27,100,000.00	26,914,747.11
US TREASURY N/B	100,000.00	98,199.22
US TREASURY N/B	100,000.00	98,898.44
US TREASURY N/B	1,000,000.00	985,078.10
US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,062,616.93
US TREASURY N/B	20,000,000.00	19,693,750.00
US TREASURY N/B	900,000.00	882,070.29
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,481,953.20
US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,115,890.34
US TREASURY N/B	28,200,000.00	27,969,772.38
US TREASURY N/B	47,900,000.00	46,852,187.50
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,778,867.40
US TREASURY N/B	24,200,000.00	23,435,241.28
US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,438,531.25
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,645,078.40
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,859,179.50
US TREASURY N/B	49,300,000.00	48,131,052.63
US TREASURY N/B	24,000,000.00	23,307,187.20
US TREASURY N/B	13,700,000.00	13,082,430.03
US TREASURY N/B	18,000,000.00	18,101,953.80
US TREASURY N/B	13,900,000.00	13,332,054.34
US TREASURY N/B	5,200,000.00	4,983,062.76
US TREASURY N/B	14,600,000.00	14,135,765.26
US TREASURY N/B	15,600,000.00	15,853,500.00
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,101,531.48
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,983,593.90
US TREASURY N/B	27,500,000.00	27,969,433.25
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,680,542.99
US TREASURY N/B	23,800,000.00	23,934,805.58



US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,868,359.00	
US TREASURY N/B	46,000,000.00	45,354,923.60	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,555,812.64	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	33,916,782.96	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,448,047.05	
US TREASURY N/B	46,900,000.00	45,824,597.07	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,460,562.50	
US TREASURY N/B	35,000,000.00	35,377,345.50	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	30,742,968.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,385,742.35	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,088,281.50	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	26,300,743.20	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	19,827,000.96	
US TREASURY N/B	70,300,000.00	69,421,250.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,895,000.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	756,125.04	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,869,062.60	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,561,250.00	
US TREASURY N/B	21,600,000.00	21,215,250.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	495,156.25	
US TREASURY N/B	500,000.00	508,359.40	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	5,672,953.02	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	22,416,406.25	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,863,632.85	
US TREASURY N/B	200,000.00	265,093.76	
US TREASURY N/B	100,000.00	125,984.38	
US TREASURY N/B	300,000.00	332,789.07	
US TREASURY N/B	100,000.00	122,468.75	
US TREASURY N/B	100,000.00	126,460.94	
US TREASURY N/B	100,000.00	124,484.38	
US TREASURY N/B	100,000.00	128,562.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	124,554.69	
US TREASURY N/B	200,000.00	233,109.38	
US TREASURY N/B	800,000.00	981,000.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	261,828.12	
US TREASURY N/B	5,700,000.00	7,112,531.25	
US TREASURY N/B	700,000.00	800,570.33	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,509,101.43	
US TREASURY N/B	500,000.00	519,023.45	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,048,984.30	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,084,171.98	
US TREASURY N/B	17,600,000.00	17,096,750.88	

	US TREASURY N/B	24,200,000.00	25,052,672.48
	US TREASURY N/B	14,000,000.00	15,713,906.60
	US TREASURY N/B	12,700,000.00	14,257,735.01
	US TREASURY N/B	18,900,000.00	20,380,992.66
	US TREASURY N/B	24,000,000.00	24,804,374.40
	US TREASURY N/B	36,900,000.00	37,315,125.00
	US TREASURY N/B	45,600,000.00	41,930,627.28
	US TREASURY N/B	21,700,000.00	21,945,819.77
	US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,797,500.80
	US TREASURY N/B	14,400,000.00	14,560,875.36
	US TREASURY N/B	30,500,000.00	27,936,093.75
	US TREASURY N/B	21,600,000.00	19,765,686.96
	US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,214,390.66
	US TREASURY N/B	14,200,000.00	13,996,984.02
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,715,007.77
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,261,078.04
	US TREASURY N/B	100,000.00	95,867.19
	US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,056,875.20
	US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,707,695.15
	US TREASURY N/B	12,500,000.00	12,588,867.50
小計	銘柄数：180	2,483,180,000.00	2,535,119,662.02 (283,908,050,949)
	組入時価比率：46.1%		46.6%
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,686,945.00
	CANADIAN GOVERNMENT	16,400,000.00	16,716,684.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,500,720.00
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,456,040.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,206,108.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,920,710.00
	CANADIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	7,282,192.00
	CANADIAN GOVERNMENT	10,050,000.00	10,387,881.00
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	294,003.00
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,518,698.00
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,563,521.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,607,952.00
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,578,012.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,117,864.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,647,408.00
	CANADIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	8,236,698.00
	CANADIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,583,654.00
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,973,180.00
	CANADIAN GOVERNMENT	4,750,000.00	6,988,912.50
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	188,928.00

	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	102,118.00
	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	13,758,998.40
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	6,205,752.00
	CANADIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	4,941,696.00
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	11,025,802.00
	CANADIAN GOVERNMENT	9,900,000.00	12,809,016.00
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	346,482.00
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	593,370.00
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	244,092.00
小計	銘柄数 : 29	123,180,000.00	139,483,436.90 (11,676,158,502)
	組入時価比率 : 1.9%		1.9%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	52,600,000.00	52,674,166.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	103,000,000.00	100,211,790.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	57,100,000.00	56,211,843.76
	MEX BONOS DESARR FIX RT	108,100,000.00	103,952,203.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,000,000.00	11,045,210.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	43,815,600.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	47,700,000.00	42,128,640.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	86,300,000.00	83,599,673.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	49,600,000.00	51,039,888.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,500,000.00	44,955,270.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	9,519,300.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	64,689,263.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,300,000.00	40,568,398.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	59,609,700.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	14,231,343.00
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	83,390,100.00
小計	銘柄数 : 16	870,700,000.00	861,642,387.76 (5,144,005,054)
	組入時価比率 : 0.8%		0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,800,000.00	1,910,786.40
	BELGIUM KINGDOM	5,700,000.00	6,363,204.12
	BELGIUM KINGDOM	6,300,000.00	7,128,267.30
	BELGIUM KINGDOM	4,800,000.00	5,576,817.12
	BELGIUM KINGDOM	7,900,000.00	8,764,631.30
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,963,124.30
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,580,380.00
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,035,272.90
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,051,999.00
	BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	10,997,620.20
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,064,998.00
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,092,783.40

BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,041,400.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,043,731.60	
BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,559,359.50	
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,929,958.60	
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	529,191.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,054,834.30	
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	563,503.00	
BELGIUM KINGDOM	5,400,000.00	8,499,810.60	
BELGIUM KINGDOM	5,500,000.00	8,375,889.50	
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	2,789,364.60	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,037,547.70	
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,376,592.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,107,895.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,772,267.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	17,594,830.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,050,000.00	18,855,369.34	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,400,000.00	3,464,933.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,900,000.00	11,764,359.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,600,000.00	3,622,284.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,400,000.00	21,673,476.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,900,000.00	6,039,893.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,021,797.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,550,000.00	17,005,648.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,350,000.00	5,446,086.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	5,408,416.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,500,000.00	16,294,049.10	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,338,207.99	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	17,854,150.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	9,215,204.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	511,461.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	967,009.59	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,600,000.00	19,695,564.72	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,538,864.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,567,540.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	30,809,296.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,260,285.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,089,218.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,199,825.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	12,840,045.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,157,940.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,400,000.00	7,083,219.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,400,000.00	3,666,219.60	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,400,000.00	12,592,287.96
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,100,000.00	13,040,813.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,624,400.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,312,615.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,500,000.00	4,375,724.50
BUNDES OBLIGATION	100,000.00	100,563.30
BUNDES OBLIGATION	1,000,000.00	1,012,450.10
BUNDES OBLIGATION	1,600,000.00	1,618,929.92
BUNDES OBLIGATION	3,300,000.00	3,355,271.04
BUNDES OBLIGATION	1,900,000.00	1,935,633.93
BUNDES OBLIGATION	1,000,000.00	1,020,157.00
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	104,302.34
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	103,894.50
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	12,800,000.00	13,491,025.92
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	4,800,000.00	5,206,848.00
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	6,400,000.00	6,831,923.20
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	14,300,000.00	15,304,446.30
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	6,984,783.00
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,348,205.00
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	3,233,205.00
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	11,000,000.00	11,901,395.00
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	5,600,000.00	6,205,617.60
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	13,900,000.00	18,311,331.80
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,881,084.00
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,646,982.00
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	10,300,000.00	11,071,552.40
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,835,759.24
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,864,918.70
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	8,800,000.00	9,267,460.40
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,016,867.00
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	723,978.08
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000.00	30,092,048.10
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,053,461.20
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	9,027,246.00
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	3,200,000.00	3,366,469.76
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	6,300,000.00	9,114,184.80
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	10,855,611.00
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	8,659,118.80
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	7,800,000.00	13,004,429.88
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	5,506,102.80
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	10,724,674.44
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	13,398,815.52
BUNDES REPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000.00	6,205,528.29

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,525,250.96
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	10,553,241.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,600,000.00	6,451,075.68
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	100,000.00	100,655.04
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,017,379.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,805,108.40
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000,000.00	9,456,597.90
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,000,000.00	3,997,212.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,010,902.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,600,000.00	12,305,451.68
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	99,120.22
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,200,000.00	12,984,307.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	99,818.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,551,120.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,400,000.00	15,743,836.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	414,840.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	544,876.31
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	103,427.96
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	18,706,623.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	301,974.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	404,074.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	397,490.40
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000.00	8,459,420.26
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,134,351.10
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,400,000.00	34,894,640.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	98,789.61
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,235,439.15
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	569,194.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	24,834,161.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	18,030,736.74
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,010,368.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	880,932.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,623,460.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	19,719,672.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	5,178,895.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,935,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,008,782.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	13,305,626.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,100,000.00	23,168,136.78
BUONI POLIENNALI DEL TES	21,500,000.00	28,485,199.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	8,770,431.70
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,700,000.00	24,525,712.00

BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	24,387,670.68
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	443,811.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	14,389,070.38
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,500,000.00	4,287,618.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,100,000.00	15,048,163.79
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,680,384.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	482,531.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,990,672.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,300,000.00	16,536,739.87
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,800,000.00	18,037,677.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	5,204,918.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	2,817,250.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,111,281.20
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	1,863,884.00
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	103,841.20
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,012,736.30
FINNISH GOVERNMENT	2,300,000.00	2,483,829.80
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,520,421.00
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,425,542.40
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,290,201.60
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	405,540.00
FINNISH GOVERNMENT	2,900,000.00	3,229,215.54
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,534,048.80
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	106,342.50
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,073,208.00
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,070,970.42
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	826,076.00
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,607,581.50
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,383,665.00
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,005,781.80
FRANCE (GOVT OF)	6,700,000.00	6,764,833.89
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,086,567.20
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	404,738.08
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	3,041,365.50
FRANCE (GOVT OF)	5,970,000.00	6,485,791.88
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	101,153.84
FRANCE (GOVT OF)	10,500,000.00	11,838,933.75
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,416,109.10
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,864,655.82
FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	2,676,310.00
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,083,988.00
FRANCE (GOVT OF)	12,000,000.00	14,659,957.20
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,066,466.60

FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	105,308.72
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	112,691.50
FRANCE (GOVT OF)	6,100,000.00	7,029,322.80
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	800,000.00	832,429.36
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,900,000.00	9,308,625.70
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,100,000.00	1,113,755.28
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	12,816,452.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,270,864.80
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	10,490,964.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,900,000.00	2,939,308.34
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,248,394.88
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	9,778,356.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,300,000.00	35,389,755.95
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,326,265.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	27,649,710.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,421,818.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	42,620,464.70
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	8,794,080.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,858,821.90
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	14,999,690.70
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,100,000.00	36,843,749.80
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,300,000.00	11,669,415.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,600,000.00	5,541,199.20
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000.00	29,246,000.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	21,200,000.00	30,600,885.60
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,200,000.00	8,840,327.60
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,200,000.00	5,585,337.60
IRISH GOVERNMENT	680,000.00	713,493.40
IRISH GOVERNMENT	500,000.00	541,095.75
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,204,042.48
IRISH GOVERNMENT	6,000,000.00	6,281,154.00
IRISH TSY 0.8% 2022	3,400,000.00	3,518,789.20
IRISH TSY 1.3% 2033	1,400,000.00	1,471,926.40
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,142,022.60
IRISH TSY 1.7% 2037	1,300,000.00	1,416,112.10
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,879,289.46
IRISH TSY 2.4% 2030	4,600,000.00	5,474,846.40
IRISH TSY 2% 2045	2,800,000.00	3,189,331.60
IRISH TSY 2022	2,000,000.00	2,024,410.20
IRISH TSY 3.4% 2024	5,200,000.00	6,111,907.88
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	210,064.50
NETHERLANDS GOVERNMENT	850,000.00	923,283.94



	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	304,307.10
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	544,936.20
	NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	695,740.56
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,400,000.00	5,722,519.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,528,296.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	101,564.60
	NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,136,456.50
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,542,955.80
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,178,832.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,246,916.40
	NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	10,806,774.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,060,291.90
	NETHERLANDS GOVERNMENT	3,000,000.00	3,017,706.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,600,000.00	5,906,486.02
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	6,368,893.60
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,900,000.00	8,146,221.58
	NETHERLANDS GOVERNMENT	4,500,000.00	6,808,005.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,026,187.68
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,800,000.00	1,898,076.60
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,100,000.00	1,206,810.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,370,392.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,600,000.00	1,622,990.40
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,200,000.00	4,778,718.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	4,056,990.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,550,000.00	1,696,374.25
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	5,295,312.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,412,288.80
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,238,980.80
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,108,650.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,455,799.20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,245,038.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,500,000.00	5,473,223.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,700,000.00	8,419,281.90
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,500,000.00	1,642,368.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	1,750,717.00
	REPUBLIC OF IRELAND	6,750,000.00	7,874,450.77
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,512,608.00
	SPANISH GOVERNMENT	13,900,000.00	21,337,834.40
	SPANISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,384,851.30
小計	銘柄数：263	1,510,230,000.00	1,869,284,828.57 (235,305,574,220)
	組入時価比率：38.2%		38.6%
英ポンド	UK TREASURY	490,000.00	497,541.49

	UK TREASURY	1,850,000.00	1,925,498.31
	UK TREASURY	5,800,000.00	5,873,701.76
	UK TREASURY	440,000.00	507,506.69
	UK TREASURY	670,000.00	717,345.61
	UK TREASURY	5,850,000.00	6,389,506.30
	UK TREASURY	2,400,000.00	2,378,059.20
	UK TREASURY	7,900,000.00	8,149,703.20
	UK TREASURY	21,900,000.00	21,804,450.30
	UK TREASURY	3,800,000.00	4,027,875.36
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,205,362.56
	UK TREASURY	9,350,000.00	10,255,641.00
	UK TREASURY	11,850,000.00	14,599,200.00
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,278,350.40
	UK TREASURY	700,000.00	724,061.24
	UK TREASURY	9,630,000.00	12,141,985.50
	UK TREASURY	200,000.00	207,715.20
	UK TREASURY	6,900,000.00	9,934,355.04
	UK TREASURY	5,700,000.00	7,818,017.40
	UK TREASURY	5,250,000.00	7,035,086.10
	UK TREASURY	6,600,000.00	9,301,908.00
	UK TREASURY	2,900,000.00	4,050,847.60
	UK TREASURY	200,000.00	203,376.00
	UK TREASURY	3,800,000.00	5,799,940.00
	UK TREASURY	4,900,000.00	7,104,314.00
	UK TREASURY	3,500,000.00	5,140,310.00
	UK TREASURY	5,900,000.00	9,130,169.76
	UK TREASURY	24,000,000.00	32,880,384.00
	UK TREASURY	6,700,000.00	10,427,411.00
	UK TREASURY	2,800,000.00	2,669,240.00
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,617,405.50
	UK TREASURY	8,750,000.00	13,442,164.75
	UK TREASURY	3,000,000.00	3,107,229.60
	UK TREASURY	200,000.00	259,048.00
	UK TREASURY	2,950,000.00	4,863,075.00
	UK TSY 3 1/4% 2044	22,900,000.00	29,960,894.40
	UNITED KINGDOM(GOVERNMEN	6,800,000.00	11,705,887.20
小計	銘柄数：37	214,330,000.00	276,134,567.47
			(40,149,966,110)
	組入時価比率：6.5%		6.6%
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,700,000.00	1,850,756.00
	SWEDISH GOVERNMENT	48,150,000.00	53,926,940.70
	SWEDISH GOVERNMENT	29,900,000.00	32,251,966.89
	SWEDISH GOVERNMENT	34,350,000.00	39,620,104.09

小計	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,778,598.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	15,300,000.00	15,963,617.61	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,000,000.00	10,345,950.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,500,000.00	15,509,533.20	
	銘柄数：8 組入時価比率：0.4%	161,900,000.00	182,247,466.89 (2,194,259,501) 0.4%	
小計	NORWEGIAN GOVERNMENT	20,600,000.00	21,607,323.52	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	13,578,901.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	48,030,760.26	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,748,786.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,667,538.04	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,647,088.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,365,254.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	7,463,964.75	
	銘柄数：8 組入時価比率：0.3%	112,500,000.00	117,109,615.97 (1,541,162,546) 0.3%	
小計	KINGDOM OF DENMARK	2,700,000.00	2,738,718.00	
	KINGDOM OF DENMARK	34,100,000.00	37,268,404.91	
	KINGDOM OF DENMARK	16,070,000.00	17,495,312.58	
	KINGDOM OF DENMARK	36,600,000.00	41,474,534.40	
	KINGDOM OF DENMARK	12,200,000.00	12,800,947.60	
	KINGDOM OF DENMARK	42,000,000.00	75,448,716.00	
銘柄数：6 組入時価比率：0.5%	143,670,000.00	187,226,633.49 (3,156,641,040) 0.5%		
小計	POLAND GOVERNMENT BOND	22,200,000.00	23,434,320.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,800,000.00	3,810,716.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	14,869,575.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	11,273,620.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	37,300,000.00	40,344,799.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	22,900,000.00	23,984,315.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,500,000.00	11,435,715.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,164,569.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	3,677,514.36	
銘柄数：9 組入時価比率：0.6%	127,100,000.00	134,995,143.36 (3,974,257,020) 0.7%		
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,450,000.00	7,662,410.67	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,200,000.00	5,217,149.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,100,000.00	12,048,195.30	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,169,233.01	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,940,374.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,053,572.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,354,968.64	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	6,400,000.00	6,763,708.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,200,000.00	14,395,298.28	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	14,866,153.52	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,700,000.00	14,219,055.63	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,417,035.84	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,800,000.00	18,285,448.72	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,247,335.79	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	11,286,672.23	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,503,758.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	525,273.85	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,300,000.00	9,412,860.90	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,929,664.26	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	6,074,618.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,596,278.04	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,572,181.05	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,900,000.00	4,236,630.84	
小計	銘柄数：23	146,030,000.00	161,777,877.83	
			(12,950,319,120)	
	組入時価比率：2.1%		2.1%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,444,844.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,780,000.00	2,801,779.91	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	984,860.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,800,000.00	1,791,622.26	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,454,329.66	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	297,850.17	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,094,502.70	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	700,939.89	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	1,997,805.35	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,122,543.62	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	702,452.59	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,292,631.72	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	318,899.19	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,552,881.92	
	SINGAPORE GOVERNMENT	850,000.00	957,860.75	
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	785,884.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,107,989.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	826,228.00	
小計	銘柄数：18	29,130,000.00	30,235,905.73	
			(2,499,904,685)	

	組入時価比率：0.4%		0.4%
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,111,850.96
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	405,479.04
	MALAYSIA GOVERNMENT	600,000.00	623,982.42
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	417,621.52
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	5,302,954.75
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,414,276.64
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	601,975.02
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,086,409.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,300,000.00	9,418,807.50
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	500,999.10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,568,932.06
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	502,229.40
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,384,761.30
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,506,048.35
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,205,093.88
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,911,775.28
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	601,084.44
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	9,020,538.56
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,361,334.86
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,739,378.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,757,354.76
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,945,916.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,866,632.66
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,424,569.16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,049,879.75
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	762,495.12
MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	889,884.45	
MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	10,104,372.63	
小計	銘柄数：28	107,600,000.00	108,486,637.41 (2,939,987,873)
	組入時価比率：0.5%		0.5%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,900,000.00	5,891,386.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	57,700,000.00	57,893,295.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	59,300,000.00	65,775,560.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	34,000,000.00	31,661,034.60
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	25,440,354.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	53,900,000.00	50,038,377.62
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,800,000.00	6,469,384.68
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,100,000.00	28,098,750.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00	29,216,131.20
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000.00	11,177,550.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,600,000.00	22,028,940.00

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	77,500,000.00	71,099,507.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	43,200,000.00	39,807,642.24	
	小計	銘柄数：13	480,800,000.00	444,597,912.84	
		組入時価比率：0.6%		(3,538,999,386)	0.6%
合計				608,979,286,006	(608,979,286,006)

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

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 4月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
	うち1年超			
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	1,911,851,607	-	1,909,694,000	2,157,607
米ドル	1,287,049,424	-	1,287,707,000	657,576
カナダドル	25,144,296	-	25,110,000	34,296
ユーロ	442,658,230	-	440,545,000	2,113,230
英ポンド	116,790,832	-	116,312,000	478,832
豪ドル	40,208,825	-	40,020,000	188,825
合計	1,911,851,607	-	1,909,694,000	2,157,607

(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)

(2019年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	63,837,852
コール・ローン	324,574,301

(2019年 4月22日現在)

国債証券	57,288,642,053
派生商品評価勘定	2,393,345
未収入金	594,992,137
未収利息	424,285,759
前払費用	53,385,360
差入委託証拠金	293,370
流動資産合計	58,752,404,177
資産合計	58,752,404,177
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	721,138,826
未払金	9,022,121
未払解約金	704,811,279
未払利息	706
その他未払費用	625,900
流動負債合計	1,435,598,832
負債合計	1,435,598,832
純資産の部	
元本等	
元本	50,165,158,553
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,151,646,792
元本等合計	57,316,805,345
純資産合計	57,316,805,345
負債純資産合計	58,752,404,177

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3.費用・収益の計上基準	<p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 4月22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	1,1426円
(10,000口当たり純資産額)	(11,426円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 4月22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</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>国債証券</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</p> <p>ます。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳



2019年 4月22日現在	
期首	2018年 4月24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	30,636,789,232円
同期中における追加設定元本額	36,554,516,891円
同期中における一部解約元本額	17,026,147,570円
期末元本額	50,165,158,553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	851,090,565円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	744,832,308円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	16,922,302円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	4,395,134円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,870,081円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,774,860円
野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	2,565,188,619円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	17,748,122円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,853,301円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	13,082,918円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,255,278円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,395,731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）	31,937,821,825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）	9,684,534,245円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	2,129,622,915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）	2,181,770,349円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2019年4月22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	1,100,000.00	1,189,546.93	
		US TREASURY BOND	70,000.00	81,079.69	
		US TREASURY BOND	1,000,000.00	999,179.70	
		US TREASURY BOND	610,000.00	744,342.98	
		US TREASURY BOND	2,680,000.00	3,416,790.69	
		US TREASURY BOND	1,800,000.00	2,295,562.50	
		US TREASURY BOND	2,280,000.00	2,834,859.43	
		US TREASURY BOND	20,000.00	24,546.87	

US TREASURY BOND	80,000.00	98,537.50	
US TREASURY BOND	510,000.00	505,617.21	
US TREASURY BOND	3,450,000.00	3,950,250.00	
US TREASURY N/B	1,430,000.00	1,410,896.05	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,561,046.92	
US TREASURY N/B	1,380,000.00	1,395,093.75	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	990,078.10	
US TREASURY N/B	1,150,000.00	1,138,230.44	
US TREASURY N/B	1,050,000.00	1,040,074.24	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,483,300.80	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,557,109.24	
US TREASURY N/B	2,800,000.00	2,788,953.16	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,943,593.60	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,378,343.82	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,682,800.76	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	993,515.60	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,145,445.26	
US TREASURY N/B	3,580,000.00	3,554,408.72	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,999,531.20	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,627,156.25	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,977,148.40	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,011,015.60	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,481,953.30	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,011,171.80	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,820,816.37	
US TREASURY N/B	6,150,000.00	6,116,847.81	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,512,949.20	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,887,031.20	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,491,796.95	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,457,109.45	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,315,996.11	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,685,191.47	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,459,511.70	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,482,070.35	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	984,843.80	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	991,210.90	
US TREASURY N/B	600,000.00	594,562.50	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,475,273.40	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,146,249.92	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,947,382.70	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,356,968.72	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,681,543.07	

US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,178,390.64
US TREASURY N/B	300,000.00	293,085.93
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,052,531.25
US TREASURY N/B	700,000.00	689,089.87
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,475,566.35
US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,096,417.91
US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,241,549.13
US TREASURY N/B	110,000.00	108,569.14
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,009,687.50
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,064,507.84
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,464,433.65
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,826,796.80
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,401,953.25
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,342,226.65
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,223,789.22
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,877,421.80
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,539,550.75
US TREASURY N/B	700,000.00	677,742.17
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,016,250.00
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,967,890.70
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,044,687.60
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,989,062.60
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,983,125.00
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,458,039.02
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,977,109.40
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,437,246.05
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,508,496.15
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,971,953.20
US TREASURY N/B	400,000.00	396,687.52
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,954,140.60
US TREASURY N/B	800,000.00	785,937.52
US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,708,002.44
US TREASURY N/B	600,000.00	610,593.78
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,619,500.00
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,895,000.00
US TREASURY N/B	4,200,000.00	3,969,656.46
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,551,218.94
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,898,750.00
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,651,906.25
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,782,562.50
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,722,812.50
US TREASURY N/B	600,000.00	586,968.78
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,253,500.16

	US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,950,765.72	
	US TREASURY N/B	500,000.00	675,351.55	
	US TREASURY N/B	340,000.00	450,659.39	
	US TREASURY N/B	2,360,000.00	2,973,231.36	
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,816,781.25	
	US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,764,093.75	
	US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,727,379.74	
	US TREASURY N/B	300,000.00	392,742.18	
	US TREASURY N/B	300,000.00	310,570.32	
	US TREASURY N/B	400,000.00	449,062.52	
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,655,156.34	
	US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,568,773.37	
	US TREASURY N/B	2,760,000.00	2,725,068.88	
	US TREASURY N/B	3,020,000.00	3,053,739.13	
	US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,401,384.37	
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,111,265.54	
	US TREASURY N/B	2,730,000.00	2,368,061.78	
	US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,365,687.44	
	US TREASURY N/B	2,620,000.00	2,512,948.37	
	US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,215,640.68	
小計	銘柄数：113	233,970,000.00	235,511,306.83 (26,374,911,251)	
	組入時価比率：46.0%		46.0%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	2,570,000.00	2,529,085.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,937,460.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,004,970.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	796,176.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,105,177.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	986,590.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	485,545.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	408,472.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	620,000.00	846,287.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	295,512.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	581,376.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	680,000.00	914,334.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,040,000.00	1,201,137.60	
小計	銘柄数：13	12,100,000.00	13,092,124.30 (1,095,941,725)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,000,000.00	3,004,230.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,200,000.00	8,950,956.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	14,424,450.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,000,000.00	12,364,800.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,100,000.00	9,783,971.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,100,000.00	2,950,983.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	6,894,060.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	5,033,300.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	4,079,651.66
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,300,000.00	9,343,710.00
	銘柄数 : 10	79,000,000.00	76,830,111.66 (458,675,766)
組入時価比率 : 0.8%		0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,300,000.00	1,380,012.40
	BELGIUM KINGDOM	340,000.00	379,559.54
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	565,735.50
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	813,285.83
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	221,889.40
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	408,706.80
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	263,371.85
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	724,691.03
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	851,998.40
	BELGIUM KINGDOM	950,000.00	994,072.11
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,247,487.60
	BELGIUM KINGDOM	550,000.00	774,707.78
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	210,966.86
	BELGIUM KINGDOM	420,000.00	473,342.52
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	472,211.70
	BELGIUM KINGDOM	550,000.00	837,588.95
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	206,619.60
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	207,509.54
	BELGIUM KINGDOM	170,000.00	188,342.15
	BELGIUM KINGDOM GOVT	370,000.00	591,826.10
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,426,737.20
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	420,000.00	453,305.58
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	1,509,285.30
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	730,000.00	747,308.88
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	503,632.90
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,490,000.00	1,741,471.91
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	816,364.80
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	482,786.64
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000.00	1,115,178.90
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,440,000.00	1,722,079.15
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,120,000.00	1,323,208.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	454,632.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	631,268.10	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,120,000.00	1,225,940.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,047,600.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,374,113.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000.00	1,156,875.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	940,148.19
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000.00	1,143,961.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	455,614.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,078,970.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	996,077.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	1,199,265.52
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	1,287,981.60
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,150,000.00	1,329,515.00
BUNDESobligation	1,700,000.00	1,720,113.04
BUNDESobligation	1,700,000.00	1,724,376.64
BUNDESobligation	1,000,000.00	1,020,157.00
BUNDESobligation	600,000.00	612,334.08
BUNDESobligation	1,000,000.00	1,019,979.10
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	312,907.02
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	779,208.75
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	909,704.85
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,396,956.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,310,000.00	1,417,347.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	775,702.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	526,944.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	674,977.20
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	472,959.52
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	947,808.45
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,118,553.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,770,000.00	1,830,630.28
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	775,568.25
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	895,442.02
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,052,021.80
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,797,175.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	666,893.84
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	485,832.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	882,190.96
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	60,000.00	111,656.78
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,150,000.00	1,829,835.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	720,907.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,110,000.00	1,626,958.08
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	230,395.56
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,504,257.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	483,337.22

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,809,811.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	180,338.51
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	745,001.25
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,500,000.00	2,495,470.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	710,000.00	776,258.62
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,450,000.00	1,436,492.09
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	704,606.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,030,000.00	1,040,492.61
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	496,863.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	909,972.90
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,400,000.00	2,370,950.64
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	168,468.97
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,041,127.30
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	1,935,640.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	239,045.40
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,927,814.62
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	688,600.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	410,826.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	330,966.10
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	535,234.70
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	2,931,895.06
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,100,319.30
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	783,792.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,040,000.00	2,450,915.16
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	932,861.72
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	88,762.32
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	1,019,500.28
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,110,000.00	1,380,451.38
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	451,485.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,080,000.00	1,209,876.48
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	386,025.20
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	187,325.10
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	373,009.17
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,880,000.00	2,291,272.56
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,460,000.00	1,433,807.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	8,472.20
FINNISH GOVERNMENT	50,000.00	51,920.60
FINNISH GOVERNMENT	190,000.00	192,419.89
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	304,084.20
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	321,144.60
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	161,275.20
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	222,704.52

FINNISH GOVERNMENT	310,000.00	321,347.24
FINNISH GOVERNMENT	440,000.00	542,796.05
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	214,344.20
FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	221,386.40
FRANCE (GOVT OF)	900,000.00	905,203.62
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	3,032,462.70
FRANCE (GOVT OF)	3,500,000.00	3,802,390.55
FRANCE (GOVT OF)	1,710,000.00	1,928,054.92
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	415,131.24
FRANCE (GOVT OF)	1,300,000.00	1,346,695.87
FRANCE (GOVT OF)	1,250,000.00	1,268,236.25
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	642,314.40
FRANCE (GOVT OF)	2,300,000.00	2,404,025.32
FRANCE (GOVT OF)	1,700,000.00	1,771,389.80
FRANCE (GOVT OF)	1,020,000.00	1,246,096.36
FRANCE (GOVT OF)	1,850,000.00	1,948,211.32
FRANCE (GOVT OF)	600,000.00	676,149.00
FRANCE (GOVT OF)	1,510,000.00	1,740,045.48
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	200,000.00	208,107.34
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	941,321.70
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,600,000.00	1,620,007.68
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,140,000.00	1,238,199.60
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,094,935.50
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,320,000.00	1,457,691.84
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	100,000.00	101,355.46
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	610,000.00	667,131.86
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	800,000.00	966,273.20
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,600,000.00	1,774,008.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	837,870.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	910,000.00	1,137,378.97
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,900,000.00	2,320,660.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	605,315.88
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,640,000.00	1,822,184.64
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,190,000.00	1,902,274.50
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,020,000.00	1,704,624.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,443,438.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	1,047,250.80
IRISH GOVERNMENT	300,000.00	314,776.50
IRISH GOVERNMENT	800,000.00	837,487.20
IRISH TSY 0.8% 2022	1,300,000.00	1,345,419.40
IRISH TSY 1.7% 2037	550,000.00	599,124.35
IRISH TSY 1% 2026	650,000.00	689,464.81
IRISH TSY 2% 2045	50,000.00	56,952.35



	IRISH TSY 3.4% 2024	500,000.00	587,683.45
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	525,161.25
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	543,108.20
	NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	266,700.54
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	390,171.75
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,300,000.00	1,419,132.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	672,731.40
	NETHERLANDS GOVERNMENT	800,000.00	835,766.40
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,061,729.10
	NETHERLANDS GOVERNMENT	850,000.00	1,091,415.89
	NETHERLANDS GOVERNMENT	610,000.00	1,014,121.46
	NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	680,800.50
	REPUBLIC OF AUSTRIA	10,000.00	10,240.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	738,140.90
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	898,771.20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	710,058.30
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,120,000.00	1,225,767.20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	316,297.50
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	413,088.80
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	734,023.50
	REPUBLIC OF AUSTRIA	530,000.00	659,870.14
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	359,668.94
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	590,826.80
	REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	109,491.20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	423,857.80
	REPUBLIC OF IRELAND	80,000.00	93,326.82
	SPANISH GOVERNMENT	90,000.00	132,258.42
	SPANISH GOVERNMENT	500,000.00	767,548.00
	SPANISH GOVERNMENT	410,000.00	567,789.03
小計	銘柄数：190	158,330,000.00	177,826,766.20 (22,384,833,329)
	組入時価比率：39.1%		39.1%
英債券	UK TREASURY	1,480,000.00	1,502,778.38
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,620,331.52
	UK TREASURY	920,000.00	1,004,845.43
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,031,608.00
	UK TREASURY	900,000.00	896,073.30
	UK TREASURY	550,000.00	582,981.96
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,316,232.00
	UK TREASURY	1,670,000.00	1,727,403.24
	UK TREASURY	300,000.00	378,255.00
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,038,576.00

	UK TREASURY	90,000.00	129,578.54
	UK TREASURY	600,000.00	822,949.20
	UK TREASURY	200,000.00	281,876.00
	UK TREASURY	1,160,000.00	1,620,339.04
	UK TREASURY	470,000.00	477,933.60
	UK TREASURY	1,450,000.00	2,243,855.28
	UK TREASURY	700,000.00	959,011.20
	UK TREASURY	1,880,000.00	2,925,900.40
	UK TREASURY	1,700,000.00	1,620,610.00
	UK TREASURY	600,000.00	605,934.00
	UK TREASURY	840,000.00	1,353,013.20
	UK TREASURY	860,000.00	1,321,172.76
	UK TREASURY	280,000.00	461,580.00
	UK TSY 3 1/4% 2044	100,000.00	130,833.60
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	480,000.00	826,297.92
小計	銘柄数：25	22,030,000.00	26,879,969.57 (3,908,347,575)
	組入時価比率：6.8%		6.8%
スウェーデンクローネ	SWEDISH GOVERNMENT	600,000.00	653,208.00
	SWEDISH GOVERNMENT	3,500,000.00	3,919,923.00
	SWEDISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,235,983.30
	SWEDISH GOVERNMENT	250,000.00	288,355.92
	SWEDISH GOVERNMENT	2,700,000.00	2,875,184.64
	SWEDISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,173,494.80
	SWEDISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,624,808.24
小計	銘柄数：7	15,150,000.00	16,770,957.90 (201,922,333)
	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	1,101,344.16
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,939,843.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	750,000.00	802,295.55
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,688,258.44
	NORWEGIAN GOVERNMENT	750,000.00	753,678.75
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,534,428.00
小計	銘柄数：6	7,650,000.00	7,819,847.90 (102,909,198)
	組入時価比率：0.2%		0.2%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,550,000.00	1,572,227.00
	KINGDOM OF DENMARK	1,500,000.00	1,639,372.65
	KINGDOM OF DENMARK	1,650,000.00	1,796,345.10
	KINGDOM OF DENMARK	3,400,000.00	3,852,825.60
	KINGDOM OF DENMARK	2,300,000.00	2,413,293.40
	KINGDOM OF DENMARK	3,900,000.00	7,005,952.20

小計	銘柄数：6 組入時価比率：0.5%	14,300,000.00	18,280,015.95 (308,201,068) 0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,650,000.00	1,654,653.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,150,000.00	4,571,017.50
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,800,000.00	3,028,564.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	994,410.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,850,000.00	2,804,100.75
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.7%	12,450,000.00	13,052,745.25 (384,272,820) 0.7%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	70,000.00	71,995.80
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,420,000.00	1,424,683.16
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,114,932.61
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	136,120.70
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,129,464.71
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	923,947.52
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,056,829.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	370,787.98
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	604,882.61
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	996,549.19
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	961,041.33
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,820,000.00	2,896,908.16
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,070,159.90
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	322,234.05
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	670,000.00	863,920.11
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	182,238.54
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	478,883.41
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	314,436.21
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	293,305.21
小計	銘柄数：19 組入時価比率：2.1%	14,120,000.00	15,213,320.60 (1,217,826,314) 2.1%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	407,474.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,030,000.00	1,014,406.31
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,444,101.26
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	408,197.68
	SINGAPORE GOVERNMENT	730,000.00	803,492.60
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	311,883.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	610,000.00	648,857.48
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	687,648.50
	SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	206,557.00
小計	銘柄数：9	5,770,000.00	5,932,617.83

				(490,508,842)	
		組入時価比率：0.9%		0.9%	
ランド		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	798,832.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,500,000.00	4,515,075.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,900,000.00	7,653,480.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,650,000.00	6,192,525.88	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,800,000.00	2,374,433.04	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,500,000.00	3,329,830.35	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,800,000.00	8,034,436.08	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000.00	5,683,500.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,250,000.00	6,680,680.70	
小計		銘柄数：9	47,200,000.00	45,262,793.05	
				(360,291,832)	
		組入時価比率：0.6%		0.6%	
合計				57,288,642,053	
				(57,288,642,053)	

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

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 4月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	57,942,554,862	-	58,661,300,343	718,745,481
米ドル	26,756,233,747	-	27,086,190,880	329,957,133
カナダドル	1,082,216,344	-	1,099,853,860	17,637,516
メキシコペソ	431,721,494	-	452,259,720	20,538,226
ユーロ	22,666,858,446	-	22,934,017,480	267,159,034
英ポンド	4,050,752,266	-	4,071,004,340	20,252,074
スウェーデンクローナ	198,806,848	-	200,899,440	2,092,592
ノルウェークローネ	101,275,931	-	103,924,260	2,648,329
デンマーククローネ	293,811,302	-	297,329,472	3,518,170
ズロチ	372,213,796	-	378,859,620	6,645,824
豪ドル	1,178,607,328	-	1,202,918,240	24,310,912
シンガポールドル	478,341,395	-	484,710,671	6,369,276
ランド	331,715,965	-	349,332,360	17,616,395
合計	57,942,554,862	-	58,661,300,343	718,745,481

(注)時価の算定方法

### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 新興国債券マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2019年 4月22日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	792,887,618
コール・ローン	36,688,752
国債証券	19,634,093,559
派生商品評価勘定	12,418
未収利息	227,105,998
前払費用	15,772,554
流動資産合計	20,706,560,899
資産合計	20,706,560,899
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払金	578,073,902
未払解約金	12,123,978
未払利息	79
その他未払費用	273,800
流動負債合計	590,471,759
負債合計	590,471,759
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	10,636,188,015
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,479,901,125
元本等合計	20,116,089,140
純資産合計	20,116,089,140
負債純資産合計	20,706,560,899

### 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 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

4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>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。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>
------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 4月22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	1.8913円
(10,000口当たり純資産額)	(18,913円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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

2019年 4月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ

ん。

## 2. 時価の算定方法

### 国債証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

### 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (その他の注記)

### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 4月22日現在	
期首	2018年 4月24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	8,034,951,314円
同期中における追加設定元本額	4,914,714,318円
同期中における一部解約元本額	2,313,477,617円
期末元本額	10,636,188,015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	1,278,718,032円
ネクストコア	102,285,060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	516,061,939円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,566,456円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,896,067円
インデックス・ブレンド(タイプ )	4,522,029円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,224,782円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,561,661円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	1,219,840,093円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	2,214,550,373円
NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(為替ヘッジなし)連動型上場投信	147,172,116円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	225,117,113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)	15,190,092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)	3,475,238円
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	241,132,485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)	3,804,526,141円
野村DC運用戦略ファンド	813,843,436円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	41,504,902円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1)株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年4月22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	704,760.70	
		ARGENT-GLOBAL	420,000.00	451,210.87	
		ARGENT-GLOBAL	2,300,000.00	1,262,493.00	
		BRAZIL GLOBAL	650,000.00	814,976.50	
		BRAZIL GLOBAL	1,070,000.00	1,358,001.20	
		BRAZIL GLOBAL	900,000.00	1,051,569.00	
		COLOMBIA GLOBAL	250,000.00	301,682.50	
		COLOMBIA GLOBAL	1,220,000.00	1,583,572.20	
		CROATIA	1,000,000.00	1,041,740.00	
		CROATIA	500,000.00	529,114.50	
		CROATIA	800,000.00	863,687.20	
		CROATIA	1,000,000.00	1,116,529.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,930,000.00	1,987,687.70	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,400,000.00	1,353,324.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,000,000.00	2,017,720.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	900,000.00	989,262.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	1,898,651.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,489,050.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,600,000.00	1,448,128.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	1,854,324.00	
		HUNGARY	1,100,000.00	1,184,997.00	
		HUNGARY	950,000.00	1,048,505.50	
		HUNGARY	1,100,000.00	1,204,533.00	
		INDONESIA GLOBAL	1,200,000.00	1,328,108.40	
		MEXICO GLOBAL	880,000.00	1,072,156.80	
		PANAMA GLOBAL	300,000.00	364,194.00	
		PANAMA GLOBAL	250,000.00	362,027.50	
		PANAMA GLOBAL	950,000.00	1,230,117.00	
		PERU GLOBAL	900,000.00	1,122,192.00	
		PERU GLOBAL	670,000.00	897,545.40	
		PHILIPPINES GLOBAL	1,600,000.00	1,569,939.20	
		PHILIPPINES GLOBAL	750,000.00	1,150,594.50	
		PHILIPPINES GLOBAL	800,000.00	1,118,861.60	
		PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	641,521.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	900,000.00	639,562.50			
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,400,000.00	2,136,000.00			
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,250,000.00	1,865,250.00			



REPUBLIC OF ARGENTINA	600,000.00	468,000.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	4,100,000.00	3,245,703.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,900,000.00	1,443,306.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000.00	1,667,845.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,500,000.00	1,116,240.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,100,000.00	1,532,212.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,850,000.00	1,382,412.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,300,000.00	921,076.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	1,131,416.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000.00	586,992.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,900,000.00	1,952,421.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	1,048,780.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000.00	1,310,231.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,220,000.00	1,426,997.40	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	1,227,622.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000.00	2,593,675.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	1,500,000.00	1,596,795.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	600,000.00	893,250.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,035,181.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,524,856.50	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,304,680.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,234,419.60	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,400,000.00	1,487,775.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	726,540.50	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	401,954.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	195,223.60	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,323,037.30	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,382,500.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,304,445.60	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	812,404.80	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	1,032,073.60	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	855,877.60	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	950,015.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,400,000.00	1,527,457.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	691,562.20	
REPUBLIC OF PANAMA	1,100,000.00	1,127,918.00	
REPUBLIC OF PANAMA	1,500,000.00	1,544,925.00	
REPUBLIC OF PANAMA	500,000.00	524,125.00	
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	827,224.00	
REPUBLIC OF PERU	600,000.00	647,478.00	
REPUBLIC OF PERU	1,400,000.00	1,796,802.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,200,000.00	1,222,740.96	

REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	844,224.00
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	917,157.60
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,057,197.60
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	938,714.40
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,500,000.00	1,562,770.50
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,800,000.00	1,799,913.60
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	750,000.00	791,680.50
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	709,646.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,350,000.00	1,431,000.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	498,917.50
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,692,000.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	200,000.00	206,000.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	373,080.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	445,549.50
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	665,980.00
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	507,850.00
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	1,087,683.30
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	575,704.80
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,672,701.40
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	352,720.00
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	334,094.40
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,113,528.00
REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000.00	1,903,572.30
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	934,615.00
REPUBLIC OF TURKEY	1,500,000.00	1,351,200.00
REPUBLIC OF TURKEY	750,000.00	650,708.25
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	968,428.80
REPUBLIC OF TURKEY	2,200,000.00	1,607,540.00
REPUBLIC OF TURKEY	1,400,000.00	1,195,838.00
REPUBLIC OF TURKEY	1,900,000.00	1,476,927.00
ROMANIA	900,000.00	983,277.00
ROMANIA	500,000.00	518,150.00
ROMANIA	500,000.00	531,228.40
ROMANIA	600,000.00	684,000.00
ROMANIA	600,000.00	592,500.00
RUSSIA	1,312,500.00	1,465,340.62
RUSSIAN FEDERATION	1,200,000.00	1,238,604.48
RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,105,250.00
RUSSIAN FEDERATION	1,600,000.00	1,653,376.00
RUSSIAN FEDERATION	1,600,000.00	1,601,601.60
RUSSIAN FEDERATION	800,000.00	799,752.00
RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,534,750.00
RUSSIAN FEDERATION	800,000.00	902,472.00

	RUSSIAN FEDERATION	3,800,000.00	3,880,761.40	
	TURKEY GLOBAL	850,000.00	857,973.00	
	TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,411,219.50	
	TURKEY GLOBAL	2,100,000.00	2,095,023.00	
	TURKEY GLOBAL	650,000.00	822,042.00	
	UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	570,076.20	
	UKRAINE GOVERNMENT	1,600,000.00	1,457,696.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	965,000.00	972,179.60	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	409,000.00	410,108.39	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	709,000.00	705,913.01	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	688,616.18	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,173,895.20	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,147,776.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,320,930.00	
	UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	404,420.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,118,271.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,650,000.00	1,698,163.50	
	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,195,620.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,000,000.00	1,015,660.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,300,000.00	2,326,335.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,500,000.00	1,471,920.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,110,000.00	2,402,319.40	
	UNITED MEXICAN STATES	1,800,000.00	1,756,890.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,415,466.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,500,000.00	1,433,190.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,400,000.00	1,293,768.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000.00	1,916,800.00	
小計	銘柄数：149	175,655,500.00	175,320,060.36	
			(19,634,093,559)	
	組入時価比率：97.6%		100.0%	
合計			19,634,093,559	
			(19,634,093,559)	

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

(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 4月22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	15,664,782	-	15,677,200	12,418

米ドル	15,664,782	-	15,677,200	12,418
合計	15,664,782	-	15,677,200	12,418

## (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。

## 米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2019年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	28,839,525
コール・ローン	6,422,699
社債券	2,131,274,630
未収利息	25,566,123
前払費用	4,562,784
流動資産合計	2,196,665,761
資産合計	2,196,665,761
負債の部	
流動負債	
未払解約金	4,696,718
未払利息	13
流動負債合計	4,696,731
負債合計	4,696,731
純資産の部	
元本等	
元本	1,749,800,205
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	442,168,825
元本等合計	2,191,969,030
純資産合計	2,191,969,030
負債純資産合計	2,196,665,761

## 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。
--------------------	-----------------------------------------------------------------

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。

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 4月22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	1.2527円
(10,000口当たり純資産額)	(12,527円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22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、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>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 4月22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ぬ。</p>

## 2. 時価の算定方法

## 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

2019年 4月22日現在	
期首	2018年 4月24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	1,731,304,452円
同期中における追加設定元本額	1,906,470,672円
同期中における一部解約元本額	1,887,974,919円
期末元本額	1,749,800,205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	688,697,000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	218,438,032円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,945,861円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,092,684円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,428,526円
インデックス・ブレンド(タイプ )	820,537円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,867,392円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	458,555,193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)	372,954,980円

\* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2019年4月22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	119,412.00	
		ABC SUPPLY CO INC	30,000.00	31,087.50	
		ACADIA HEALTHCARE CO INC	20,000.00	20,175.00	
		ACRISURE LLC / FIN INC	50,000.00	51,569.75	
		ADT CORP	100,000.00	105,625.00	
		AECOM	50,000.00	52,937.50	
		AES CORP/VA	70,000.00	74,375.00	

AHERN RENTALS INC	30,000.00	27,000.00	
ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	50,000.00	49,000.00	
ALLISON TRANSMISSION INC	30,000.00	30,375.00	
ALLY FINANCIAL INC	100,000.00	100,570.00	
ALTICE FINANCING SA	200,000.00	204,000.00	
ALTICE FRANCE SA	200,000.00	205,940.00	
ALTICE SA	200,000.00	202,000.00	
AMC ENTERTAINMENT INC	50,000.00	46,380.00	
AMC NETWORKS INC	50,000.00	50,750.00	
AMERICAN AXLE & MFG INC	50,000.00	50,437.50	
AMERICAN EQUITY INVESTME	30,000.00	30,201.49	
AMERIGAS PART/FIN CORP	50,000.00	51,250.00	
AMERIGAS PART/FIN CORP	20,000.00	20,700.00	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	20,000.00	20,400.00	
ANTERO RESOURCES CORP	80,000.00	81,300.00	
ARAMARK SERVICES INC	40,000.00	41,392.40	
ARAMARK SERVICES INC	50,000.00	51,547.00	
ARAMARK SERVICES INC	30,000.00	30,600.00	
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000.00	201,500.00	
ARGOS MERGER SUB INC	50,000.00	41,625.00	
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	50,000.00	52,062.50	
ASCENT RESOURCES/ARU FIN	50,000.00	48,883.50	
AVANTOR INC	60,000.00	65,025.00	
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	70,000.00	73,556.00	
AVOLON HOLDINGS FNDG LTD	30,000.00	31,338.00	
AVON INTERNATIONAL OPERA	30,000.00	31,161.00	
B&G FOODS INC	50,000.00	48,937.50	
BAFFINLAND IRON CORP/LP	20,000.00	20,290.91	
BALL CORP	50,000.00	52,125.00	
BANFF MERGER SUB INC	50,000.00	50,000.00	
BARCLAYS PLC	200,000.00	201,011.18	
BAUSCH HEALTH AMERICAS	50,000.00	53,760.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	100,000.00	99,750.00	
BEACON ESCROW CORP	50,000.00	47,976.00	
BERRY PLASTICS CORP	50,000.00	51,062.50	
BIG RIVER STEEL/BRS FIN	20,000.00	21,000.00	
BLUE CUBE SPINCO INC	50,000.00	56,230.50	
BOMBARDIER INC	30,000.00	31,350.00	
BOMBARDIER INC	100,000.00	103,250.00	
BOYD GAMING CORP	50,000.00	51,937.50	
BOYD GAMING CORP	50,000.00	51,937.50	
BRAND ENERGY & INFRASTRU	30,000.00	28,275.00	

BRINK'S CO/THE	20,000.00	19,250.00
BRUIN E&P PARTNERS LLC	20,000.00	19,300.00
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	50,000.00	50,422.50
BWAY HOLDING CO	50,000.00	49,750.00
BWAY HOLDING CO	40,000.00	38,550.00
CALFRAC HOLDINGS LP	20,000.00	16,750.00
CALIFORNIA RESOURCES CRP	50,000.00	41,136.00
CALLON PETROLEUM CO	20,000.00	20,575.00
CALPINE CORP	100,000.00	99,625.00
CALPINE CORP	50,000.00	49,718.75
CARRIZO OIL & GAS INC	20,000.00	19,800.00
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	100,000.00	100,625.00
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	70,000.00	72,450.00
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	160,000.00	159,400.00
CDK GLOBAL INC	50,000.00	50,375.00
CDW LLC/CDW FINANCE	50,000.00	51,126.00
CEDAR FAIR/CAN/MAGNUM/MI	30,000.00	30,675.00
CENGAGE LEARNING INC	30,000.00	25,725.00
CENTENE CORP	50,000.00	52,297.50
CENTENE ESCROW I CORP	80,000.00	83,600.00
CENTURYLINK INC	70,000.00	75,492.20
CHANGE HEALTH / FIN INC	50,000.00	49,125.00
CHARLES RIVER LABORATORI	20,000.00	20,950.00
CHEMOURS CO	70,000.00	74,375.00
CHENIERE CORP CHRISTI HD	100,000.00	108,375.00
CHENIERE CORP CHRISTI HD	50,000.00	52,312.50
CHENIERE ENERGY PARTNERS	50,000.00	51,625.00
CHESAPEAKE ENERGY CORP	30,000.00	29,962.50
CHESAPEAKE ENERGY CORP	40,000.00	39,150.00
CHOBANI LLC/FINANCE CORP	12,000.00	10,800.00
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	90,000.00	91,575.00
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	80,000.00	59,600.00
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	50,000.00	49,000.00
CHURCHILL DOWNS INC	30,000.00	29,550.00
CINCINNATI BELL INC	20,000.00	18,750.00
CIT GROUP INC	50,000.00	50,875.00
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	50,000.00	54,125.00
CLEARWAY ENERGY OP LLC	50,000.00	50,875.00
CLIFFS NATURAL RESOURCES	50,000.00	49,250.00
COMMSCOPE FINANCE LLC	70,000.00	73,062.50
COMMSCOPE TECH FINANCE L	50,000.00	50,376.50
COMMSCOPE TECH LLC	50,000.00	46,250.00
COMSTOCK ESCROW CORP	20,000.00	18,600.00



CONSOL ENERGY INC	27,000.00	27,236.25	
CORTES NP ACQUISITION	50,000.00	49,062.50	
COTT HOLDINGS INC	50,000.00	50,937.50	
COTY INC	30,000.00	29,737.50	
COVEY PARK ENERGY LLC/FI	20,000.00	18,700.00	
CRC ESCROW ISSUER LLC	50,000.00	49,215.00	
CRESTWOOD MIDSTREAM PART	50,000.00	51,750.00	
CROWN AMER/CAP CORP VI	50,000.00	50,875.00	
CROWNROCK LP/CROWNROCK F	40,000.00	39,600.00	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	204,726.00	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	205,938.00	
CSVC ACQUISITION CORP	20,000.00	14,700.00	
CURO GROUP HOLDINGS CORP	50,000.00	43,500.00	
DAKOTA MERGER SUB INC	20,000.00	18,800.00	
DAVITA HEALTHCARE PARTNE	50,000.00	48,297.50	
DCP MIDSTREAM OPERATING	30,000.00	31,462.50	
DEAN FOODS CO	20,000.00	11,600.00	
DELPHI JERSEY HOLDINGS	30,000.00	28,200.00	
DENBURY RESOURCES INC	50,000.00	50,755.50	
DIAMOND OFFSHORE DRILL	20,000.00	19,725.00	
DIAMONDBACK ENERGY INC	40,000.00	41,000.00	
DIAMONDBACK ENERGY INC	20,000.00	20,952.00	
DISH DBS CORP	50,000.00	43,937.50	
DISH DBS CORP	50,000.00	45,562.50	
ECLIPSE RESOURCES CORP	30,000.00	28,725.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	30,000.00	31,782.21	
ELDORADA RESORTS INC	20,000.00	20,696.00	
ENDEAVOR ENERGY RESOURCE	30,000.00	32,181.00	
ENERGIZER GAMMA ACQ INC	30,000.00	31,106.25	
ENLINK MIDSTREAM PARTNER	20,000.00	19,950.00	
ENSCO PLC	30,000.00	26,250.00	
ENTEGRIS INC	30,000.00	30,112.50	
ENTERPRISE MERGER SUB IN	30,000.00	27,375.00	
EP ENER/EVEREST ACQ FIN	16,000.00	10,160.00	
EP ENER/EVEREST ACQ FIN	30,000.00	26,212.50	
EQUINIX INC	50,000.00	52,672.50	
EQUINIX INC	50,000.00	52,750.00	
ESH HOSPITALITY INC	50,000.00	50,235.00	
EXELA INTERMED/EXELA FIN	20,000.00	20,455.00	
EXTRACTION OIL & GAS INC	20,000.00	16,900.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE	200,000.00	202,500.00	
FIDELITY & GUARANTY LIFE	30,000.00	30,375.00	

FINANCIAL & RISK US HOLD	50,000.00	51,630.00
FINANCIAL & RISK US HOLD	50,000.00	51,250.00
FIRST DATA CORPORATION	40,000.00	41,019.00
FIVE POINT OP CO LP/FIVE	20,000.00	19,300.00
FLEX ACQUISITION CO INC	20,000.00	19,150.00
FMG RESOURCES AUG 2006	30,000.00	30,562.50
FORTRESS TRANS & INFRAST	30,000.00	30,825.00
FREEDOM MORTGAGE CORP	20,000.00	17,900.00
FREEPORT MCMORAN	70,000.00	74,200.00
FREEPORT-MCMORAN INC	30,000.00	30,412.50
FRESH MARKET INC	20,000.00	15,350.00
FRONTIER COMMUNICATIONS	100,000.00	75,500.00
FRONTIER COMMUNICATIONS	50,000.00	32,800.00
FRONTIER COMMUNICATIONS	70,000.00	65,975.00
FS ENERGY & POWER FUND	20,000.00	20,700.00
GARTNER INC	50,000.00	51,000.00
GENESIS ENERGY LP/GENESI	50,000.00	51,127.50
GOGO INTERMEDIATE/FINANC	30,000.00	32,449.50
GOLDEN NUGGET INC	50,000.00	51,312.50
GOODYEAR TIRE & RUBBER	50,000.00	47,375.00
GRAY TELEVISION INC	100,000.00	103,750.00
GREYSTAR REAL ESTATE PAR	20,000.00	20,150.00
GRINDING MED/MC GRINDING	50,000.00	48,968.75
GTT COMMUNICATIONS INC	20,000.00	18,600.00
GULFPORT ENERGY CORP	50,000.00	45,125.00
GW HONOS SECURITY CORP	20,000.00	18,950.00
HALCON RESOURCES CORP	20,000.00	13,500.00
HANESBRANDS INC	50,000.00	50,625.00
HARLAND CLARKE HOLDINGS	30,000.00	26,775.00
HCA INC	70,000.00	75,162.50
HCA INC	50,000.00	52,250.00
HCA INC	70,000.00	74,025.00
HERTZ CORP	50,000.00	51,837.50
HESS INF PART / FIN CORP	20,000.00	20,500.00
HILCORP ENERGY I/HILCORP	30,000.00	30,300.00
HILTON DOMESTIC OPERATIN	70,000.00	71,662.50
HILTON WORLDWIDE FIN LLC	50,000.00	50,890.00
HOLLY ENERGY PARTNERS LP	30,000.00	31,200.00
HOLOGIC INC	30,000.00	29,812.50
HUB INTERNATIONAL LTD	30,000.00	30,075.00
HUDBAY MINERALS INC	20,000.00	21,075.00
HUGHES SATELLITE SYSTEMS	50,000.00	50,500.00
HUNT COS INC	20,000.00	18,900.00

ICAHN ENTERPRISES/FIN	30,000.00	31,275.00	
INCEPTION MRGR/RACKSPACE	50,000.00	46,875.00	
INDIGO NATURAL RES LLC	20,000.00	18,475.00	
INFOR SOFTWARE PARENT	50,000.00	50,297.50	
INMARSAT FINANCE PLC	100,000.00	101,250.00	
INTELSAT CONNECT FINANCE	20,000.00	18,719.00	
INTELSAT JACKSON HLDG	40,000.00	41,838.00	
INTELSAT JACKSON HLDG	50,000.00	49,687.50	
INTELSAT JACKSON HLDG	50,000.00	51,751.00	
INTERNATIONAL GAME TECH	200,000.00	209,688.00	
INTESA SANPAOLO SPA	200,000.00	196,890.06	
IRON MOUNTAIN INC	80,000.00	78,600.00	
ITALICS MERGER SUB	16,000.00	16,320.00	
J2 CLOUD LLC/GLOBAL INC	20,000.00	21,000.00	
JAGUAR HL / PPD I	30,000.00	30,525.00	
JBS USA LUX/JBS USA FIN	40,000.00	42,412.40	
JONAH NRG LLC/FINANCE	30,000.00	17,625.00	
KAR AUCTION SERVICES INC	30,000.00	30,300.00	
KFC HLD/PIZZA HUT/TACO	50,000.00	51,750.00	
KINETICS CONCEPT/KCI USA	18,000.00	18,337.50	
KOPPERS INC	20,000.00	19,450.00	
KRONOS ACQUISITION HOLDI	30,000.00	27,187.50	
L BRANDS INC	30,000.00	26,665.80	
LAMB WESTON HLD	50,000.00	51,187.50	
LAUREATE EDUCATION INC	30,000.00	32,700.00	
LENNAR CORP	70,000.00	71,225.00	
LENNAR CORP	50,000.00	51,250.00	
LEVEL 3 COMMUNICATIONS	20,000.00	20,270.35	
LEVEL 3 FINANCING INC	70,000.00	71,312.50	
LEVEL 3 FINANCING INC	50,000.00	51,125.00	
LIONS GATE CAPITAL HOLD	30,000.00	30,750.00	
MALLINCKRODT FIN/SB	100,000.00	94,750.00	
MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	50,000.00	52,750.00	
MATADOR RESOURCES CO	30,000.00	30,225.00	
MATTAMY GROUP CORP	30,000.00	30,487.50	
MATTEL INC	50,000.00	49,676.00	
MCDERMOTT ESCROW 1/ESC 2	30,000.00	27,375.00	
MDC PARTNERS INC	50,000.00	42,750.00	
MEDNAX INC	50,000.00	50,750.00	
MEG ENERGY CORP	30,000.00	30,375.00	
MEREDITH CORP	50,000.00	52,385.50	
MGM GROWTH/MGM FINANCE	50,000.00	52,750.00	

MGM RESORTS INTL	90,000.00	95,400.90
MIDCONTINENT COMM & FIN	20,000.00	20,982.00
MOLINA HEALTHCARE INC	30,000.00	31,200.00
MOSS CREEK RESOURCES HLD	20,000.00	18,475.00
MPH ACQUISITION HOLDINGS	40,000.00	40,000.00
MPT OPER PARTNERSP/FINL	50,000.00	51,312.50
MSCI INC	100,000.00	105,250.00
MULTI-COLOR CORP	30,000.00	31,312.50
MURPHY OIL CORP	30,000.00	30,888.19
NABORS INDUSTRIES INC	30,000.00	28,950.00
NATIONSTAR MTG	50,000.00	50,875.00
NAVIENT CORP	50,000.00	52,812.50
NAVIENT CORP	50,000.00	49,875.00
NAVISTAR INTL CORP	26,000.00	26,650.00
NETFLIX INC	150,000.00	147,750.00
NETFLIX INC	50,000.00	54,312.50
NEXSTAR ESCROW CORP	70,000.00	71,137.50
NEXTERA ENERGY OPERATING	50,000.00	49,812.50
NFP CORP	20,000.00	19,525.00
NGPL PIPECO LLC	50,000.00	51,327.50
NIELSEN FINANCE LLC/CO	100,000.00	100,250.00
NOBLE HOLDING INTL LTD	50,000.00	47,937.50
NOKIA OYJ	50,000.00	50,141.00
NORTHWEST ACQ/DOMINION	30,000.00	25,950.00
NOVELIS CORP	150,000.00	156,187.50
NRG ENERGY INC	30,000.00	31,912.50
NUSTAR LOGISTICS LP	20,000.00	20,125.00
NVA HOLDINGS	30,000.00	30,187.50
OLIN CORP	20,000.00	19,838.20
ORTHO-CLINICAL DIAGNOSTI	50,000.00	47,375.00
PANTHER BF AGGREGATOR 2	50,000.00	50,875.00
PAR PHARMACEUTICAL INC	50,000.00	51,687.50
PARK AEROSPACE HOLDINGS	40,000.00	42,337.60
PARKLAND FUEL CORP	30,000.00	30,975.00
PARSLEY ENERGY LLC/FINAN	50,000.00	51,312.50
PARTY CITY HOLDINGS INC	30,000.00	30,225.00
PBF HOLDING CO LLC	30,000.00	30,900.60
PBF LOGISTICS LP/FINANCE	20,000.00	20,450.00
PDC ENERGY INC	20,000.00	20,075.80
PEABODY SEC FIN CORP	20,000.00	20,425.00
PEABODY SEC FIN CORP	20,000.00	19,800.00
PETSMART INC	20,000.00	16,600.00
PILGRIM'S PRIDE CORP	50,000.00	51,375.00

PISCES MIDCO INC	20,000.00	18,675.00	
PITNEY BOWES INC	30,000.00	29,700.00	
PLASTIPAK HOLDINGS INC	30,000.00	28,200.00	
POLARIS INTERMEDIATE	40,000.00	39,650.00	
POST HOLDINGS INC	50,000.00	51,610.50	
POST HOLDINGS INC	50,000.00	50,812.50	
PQ CORP	30,000.00	31,050.00	
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	37,000.00	39,046.49	
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	50,000.00	50,375.00	
PULTE GROUP INC	50,000.00	50,841.50	
QEP RESOURCES INC	20,000.00	18,900.00	
QORVO INC	30,000.00	31,416.00	
QUICKEN LOANS INC	40,000.00	40,700.00	
QUICKEN LOANS INC	30,000.00	28,950.00	
QUINTILES TRANSNATIONAL	50,000.00	50,812.50	
RAIN CII CARBON LLC/CII	30,000.00	28,425.00	
RANGE RESOURCES CORP	40,000.00	39,500.00	
RAYONIER AM PROD INC	20,000.00	18,950.00	
RBS GLOBAL & REXNORD COR	30,000.00	29,850.00	
REALOGY GROUP/CO-ISSUER	50,000.00	50,593.75	
REGIONALCARE HOSPITAL PR	50,000.00	53,156.25	
REGIONALCARE/LIFEPOINT	50,000.00	51,625.00	
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	50,000.00	50,656.50	
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	30,000.00	31,087.50	
RITE AID CORP	70,000.00	57,925.00	
ROWAN COMPANIES INC	20,000.00	17,850.00	
SABRE GLBL INC	30,000.00	30,675.00	
SALLY HOLDINGS/SALLY CAP	20,000.00	20,100.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	50,000.00	50,500.00	
SCIENTIFIC GAMES CORP	50,000.00	49,750.00	
SERVICE CORP INTL	30,000.00	30,262.50	
SERVICEMASTER COMPANY LL	30,000.00	30,354.60	
SESI LLC	20,000.00	15,800.00	
SEVEN GENERATIONS ENERGY	20,000.00	19,675.00	
SIMMONS FOODS INC	20,000.00	17,900.00	
SIRIUS XM RADIO INC	30,000.00	30,271.87	
SIRIUS XM RADIO INC	100,000.00	104,045.00	
SIRIUS XM RADIO INC	50,000.00	51,750.00	
SIRIUS XM RADIO INC	50,000.00	50,922.50	
SIX FLAGS ENTERTAINMENT	50,000.00	50,812.50	
SM ENERGY CO	50,000.00	47,250.00	
SOLERA LLC / SOLERA FINA	50,000.00	54,500.00	

SOUTHWESTERN ENERGY CO	80,000.00	81,800.00
SPRINGLEAF FINANCE CORP	50,000.00	53,000.00
SPRINGLEAF FINANCE CORP	60,000.00	63,787.50
SPRINT CORP	50,000.00	50,562.50
SPRINT CORP	80,000.00	80,520.00
SRC ENERGY INC	20,000.00	18,900.00
SS&C TECHNOLOGIES INC	50,000.00	51,593.75
STANDARD INDUSTRIES INC	50,000.00	50,937.50
STANDARD INDUSTRIES INC	50,000.00	48,000.00
STAR MERGER SUB INC	30,000.00	31,336.50
STARS GRP HLDS/STARS GRP	20,000.00	20,969.40
STATION CASINOS LLC	50,000.00	49,625.00
STEEL DYNAMICS INC	50,000.00	51,775.00
SUBURBAN PROPANE PARTNRS	20,000.00	19,821.60
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	30,000.00	30,816.00
SUMMIT MID HLDS LLC / FI	20,000.00	18,800.00
SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	50,000.00	50,437.50
SUNOCO LP/FINANCE CORP	30,000.00	30,675.00
SUNOCO LP/FINANCE CORP	50,000.00	52,250.00
T-MOBILE USA INC	150,000.00	156,750.00
T-MOBILE USA INC	50,000.00	50,500.00
T-MOBILE USA INC	30,000.00	30,103.20
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	20,000.00	20,950.00
TALLGRASS NRG PRTRN/FIN	40,000.00	40,450.00
TARGA RESOURCES PARTNERS	50,000.00	52,750.00
TARGA RESOURCES PARTNERS	50,000.00	49,250.00
TEEKAY OFFSHORE PARTNERS	30,000.00	29,550.00
TELEFLEX INC	30,000.00	29,728.50
TELESAT CANADA/TELESAT L	30,000.00	32,662.50
TEMPO ACQUISITION LLC/FI	30,000.00	30,825.00
TENET HEALTHCARE CORP	120,000.00	122,100.00
TENET HEALTHCARE CORP	50,000.00	51,437.50
TENN MERGER SUB INC	20,000.00	16,550.00
TENNECO INC	50,000.00	43,437.50
TEREX CORP	30,000.00	30,412.50
TERRAFORM POWER OPERATIN	50,000.00	49,500.00
TERVITA ESCROW CORP	30,000.00	30,225.00
TESLA INC	50,000.00	42,906.25
TITAN ACQ/CO-BORROWER	20,000.00	17,984.00
TRANSDIGM INC	100,000.00	104,250.00
TRANSDIGM INC	70,000.00	70,612.50
TRANSOCEAN INC	30,000.00	29,812.50
TRANSOCEAN PONTUS LTD	28,350.00	29,094.18

TRAVELPORT CORP FIN	30,000.00	32,512.50	
TREEHOUSE FOODS INC	50,000.00	52,125.00	
TRINSEO OP / TRINSEO FIN	30,000.00	28,912.50	
TRONOX INC	20,000.00	20,125.00	
UNDER ARMOUR INC	20,000.00	18,392.41	
UNITED RENTALS NORTH AM	100,000.00	101,859.00	
UNITED RENTALS NORTH AM	70,000.00	69,606.60	
UNITED RENTALS NORTH AM	50,000.00	53,625.00	
UNITED STATES STEEL CORP	30,000.00	28,546.50	
UNIVISION COMMUNICATIONS	50,000.00	47,250.00	
US CONCRETE INC	30,000.00	30,825.00	
US FOODS INC	20,000.00	20,575.00	
USA COM PART/USA COM FIN	20,000.00	20,825.00	
USA COM PART/USA COM FIN	50,000.00	52,125.00	
USG CORP	50,000.00	50,625.00	
USI INC	30,000.00	30,003.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS	40,000.00	41,050.00	
VALEANT PHARMACEUTICALS	30,000.00	32,793.75	
VALEANT PHARMACEUTICALS	30,000.00	33,178.20	
VECTOR GROUP LTD	50,000.00	44,750.00	
VERISIGN INC	50,000.00	50,812.50	
VERSCEND HOLDING CORP	30,000.00	30,562.50	
VIACOM INC	40,000.00	40,400.00	
VIASAT INC	30,000.00	29,625.00	
VIDEOTRON LTD / LTEE	100,000.00	102,030.00	
VIKING CRUISES LTD	20,000.00	19,825.00	
VINE OIL & GAS LP / FIN	20,000.00	15,550.00	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	40,000.00	41,300.00	
VIZIENT INC	20,000.00	21,621.00	
VOC ESCROW LTD	20,000.00	19,875.00	
WASHINGTON PG LP	50,000.00	46,785.62	
WASTE PRO USA INC	30,000.00	29,475.00	
WAYNE MERGER SUB LLC	16,000.00	16,540.00	
WEATHERFORD INTL LLC	30,000.00	20,850.00	
WEATHERFORD INTL LTD	30,000.00	21,000.00	
WELLCARE HEALTH PLANS	50,000.00	51,572.50	
WEST CORP	50,000.00	44,125.00	
WEST STREET MERGER SUB	20,000.00	19,225.00	
WESTERN DIGITAL CORP	60,000.00	58,950.00	
WEWORK COS INC	20,000.00	19,000.00	
WHITING PETROLEUM CORP	30,000.00	29,775.00	
WILDHORSE RESOURCE DEVEL	30,000.00	30,712.50	

	WIND TRE SPA	200,000.00	184,700.00
	WPX ENERGY INC	50,000.00	52,312.50
	WR GRACE & CO-CONN	30,000.00	31,050.00
	WYNDHAM HOTELS & RESORTS	30,000.00	30,675.00
	WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	40,000.00	38,910.00
	XEROX CORPORATION	50,000.00	49,875.00
	XPO LOGISTICS INC	82,000.00	84,050.00
	ZAYO GROUP LLC/ZAYO CAP	50,000.00	51,234.50
	ZAYO GROUP LLC/ZAYO CAP	50,000.00	51,175.50
小計	銘柄数：398	19,028,350.00	19,030,936.96
			(2,131,274,630)
	組入時価比率：97.2%		100.0%
合計			2,131,274,630
			(2,131,274,630)

(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

該当事項はありません。

## J-REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2019年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	708,608,804
投資証券	38,720,334,680
派生商品評価勘定	19,640,214
未収配当金	291,978,914
差入委託証拠金	2,011,770
流動資産合計	39,742,574,382
資産合計	39,742,574,382
負債の部	
流動負債	
未払金	109,914,340
未払解約金	12,933,384
未払利息	1,542
流動負債合計	122,849,266
負債合計	122,849,266
純資産の部	
元本等	
元本	17,394,247,204
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	22,225,477,912
元本等合計	39,619,725,116
純資産合計	39,619,725,116



(2019年 4月22日現在)

負債純資産合計

39,742,574,382

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。</p>
2. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 4月22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	2,277円
(10,000口当たり純資産額)	(22,777円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、REITの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 4月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、	附属明細表に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 4月22日現在	
期首	2018年 4月24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	16,013,377,983円
同期中における追加設定元本額	6,316,678,730円
同期中における一部解約元本額	4,935,809,509円
期末元本額	17,394,247,204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)	1,493,743,072円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,550,837,551円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	763,142,430円
野村資産設計ファンド2015	18,389,446円
野村資産設計ファンド2020	18,069,294円
野村資産設計ファンド2025	19,742,102円

野村資産設計ファンド2030	22,015,414円
野村資産設計ファンド2035	18,833,900円
野村資産設計ファンド2040	32,289,154円
野村資産設計ファンド2045	3,159,691円
野村インデックスファンド・J-REIT ネクストコア	2,594,181,852円 144,579,061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	640,318,164円
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	2,020,179,827円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	878,202,963円
野村資産設計ファンド2050	4,812,396円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,794,361円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,190,657円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,825,462円
インデックス・ブレンド(タイプ )	910,959円
インデックス・ブレンド(タイプ )	4,303,010円
野村6資産均等バランス	319,828,650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)	87,417,788円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	60,203,457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)	1,022,273,970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)	1,743,557,862円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,720,630,857円
野村DC運用戦略ファンド	1,146,222,774円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	54,447,811円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	1,938,331円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,362,570円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	1,959,356円
野村資産設計ファンド(DC)2030	321,042円
野村資産設計ファンド(DC)2040	263,147円
野村資産設計ファンド(DC)2050	298,823円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2019年4月22日現在)

(単位:円)

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

投資証券	日本円	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	424	43,629,600	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	125	13,287,500	
		日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,371	775,986,000	
		MCUBS MidCity投資法人 投資証券	4,650	469,650,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,732	705,541,200	
		産業ファンド投資法人 投資証券	4,807	609,527,600	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	4,021	1,264,604,500	
		ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	2,551	456,118,800	
		アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,168	1,010,288,000	
		GLP投資法人 投資証券	10,224	1,224,835,200	
		コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,711	503,205,100	
		日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,534	1,327,053,200	
		星野リゾート・リート投資法人 投資証券	628	346,656,000	
		Oneリート投資法人 投資証券	601	164,073,000	
		イオンリート投資法人 投資証券	4,235	568,337,000	
		ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,335	601,300,500	
		日本リート投資法人 投資証券	1,332	554,778,000	
		インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	24,458	418,476,380	
		日本ヘルスケア投資法人 投資証券	189	33,944,400	
		積水ハウス・リート投資法人 投資証券	10,646	887,876,400	
		トーセイ・リート投資法人 投資証券	794	94,406,600	
		ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,512	406,274,400	
		ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	864	99,273,600	
		サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	826	82,682,600	
野村不動産マスターファンド投資法	12,838	2,043,809,600			

人 投資証券			
いちごホテルリート投資法人 投資証券	721	93,802,100	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,113	362,353,200	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	1,281	138,476,100	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	355	40,257,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,001	351,351,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	666	57,475,800	
さくら総合リート投資法人 投資証券	893	77,691,000	
投資法人みらい 投資証券	1,111	220,977,900	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	968	128,550,400	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	437	110,211,400	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	413	46,834,200	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	380	45,828,000	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	617	57,689,500	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	638	64,119,000	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,996	2,881,116,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,126	2,574,624,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,798	1,700,743,800	
オリックス不動産投資法人 投資証券	8,221	1,592,407,700	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,612	1,158,422,000	
プレミア投資法人 投資証券	3,923	559,027,500	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,766	486,816,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	2,854	361,031,000	

	投資証券			
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,100	1,623,440,000	
	森トラスト総合リート投資法人 投 資証券	2,949	500,150,400	
	インヴィンシブル投資法人 投資証 券	14,234	785,716,800	
	フロンティア不動産投資法人 投資 証券	1,404	653,562,000	
	平和不動産リート投資法人 投資証 券	2,569	317,014,600	
	日本ロジスティクスファンド投資法 人 投資証券	2,696	632,481,600	
	福岡リート投資法人 投資証券	2,134	365,981,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,276	971,036,000	
	いちごオフィスリート投資法人 投 資証券	3,423	356,334,300	
	大和証券オフィス投資法人 投資証 券	952	733,040,000	
	阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,856	271,718,400	
	スタートアップリート投資法人 投資 証券	650	117,130,000	
	大和ハウスリート投資法人 投資証 券	5,536	1,392,857,600	
	ジャパン・ホテル・リート投資法 人 投資証券	13,281	1,196,618,100	
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	4,641	399,590,100	
	ジャパンエクセレント投資法人 投 資証券	3,695	588,244,000	
	小計	223,862	38,720,334,680	
	銘柄数：63			
	組入時価比率：97.7%		100.0%	
	合計		38,720,334,680	

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 4月22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				
REIT指数先物取引				
買建	878,499,270	-	898,191,000	19,640,214
合計	878,499,270	-	898,191,000	19,640,214

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 海外REITインデックス マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2019年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	381,890,533
コール・ローン	107,853,760
投資証券	25,828,247,713
派生商品評価勘定	870,390
未収入金	89,294
未収配当金	22,592,832
前払金	1,200,586
差入委託証拠金	42,997,341
流動資産合計	26,385,742,449
資産合計	
26,385,742,449	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,795,301
未払金	264,477,674
未払解約金	5,184,306
未払利息	234
その他未払費用	196,700
流動負債合計	272,654,215
負債合計	
272,654,215	
純資産の部	
元本等	
元本	10,747,737,614
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	15,365,350,620
元本等合計	26,113,088,234
純資産合計	
26,113,088,234	
負債純資産合計	
26,385,742,449	

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

## (貸借対照表に関する注記)

2019年 4月22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	2.4296円
(10,000口当たり純資産額)	(24,296円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	
1.金融商品に対する取組方針	
<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>	



## 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。

当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。

当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

## 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

## 市場リスクの管理

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

## 信用リスクの管理

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

## 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 4月22日現在

## 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ

ん。

## 2.時価の算定方法

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

## (その他の注記)

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 4月22日現在

期首	2018年 4月24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	9,801,038,849円
同期中における追加設定元本額	3,820,121,331円
同期中における一部解約元本額	2,873,422,566円
期末元本額	10,747,737,614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)	1,399,933,407円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,390,671,334円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	715,215,625円

野村資産設計ファンド2015	17,234,555円
野村資産設計ファンド2020	16,934,507円
野村資産設計ファンド2025	18,502,521円
野村資産設計ファンド2030	20,632,805円
野村資産設計ファンド2035	17,651,098円
野村資産設計ファンド2040	30,261,335円
野村資産設計ファンド2045	2,961,256円
野村インデックスファンド・外国REIT ネクストコア	1,342,997,176円 56,202,690円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	238,257,314円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	841,373,970円
野村資産設計ファンド2050	4,510,178円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,637,043円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,648,167円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,771,088円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,571,658円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,228,674円
野村6資産均等バランス	299,742,803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	568,833,318円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	447,994,640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)	343,028,810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)	1,483,526,594円
野村DC運用戦略ファンド	446,821,056円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	22,836,531円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	1,816,600円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,276,999円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	1,836,305円
野村資産設計ファンド(DC)2030	300,880円
野村資産設計ファンド(DC)2040	246,621円
野村資産設計ファンド(DC)2050	280,056円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年4月22日現在)

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

投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	15,300	429,165.00
		AGREE REALTY CORP	7,400	483,294.00
		ALEXANDERS INC	750	280,822.50
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	21,930	3,040,813.80
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,000	313,320.00
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	26,500	1,254,245.00
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	10,000	96,600.00
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	49,500	1,153,845.00
		AMERICOLD REALTY TRUST	28,600	884,598.00
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	30,200	1,467,418.00
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	42,400	690,696.00
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,600	80,496.00
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	26,900	5,276,435.00
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	46,074.00
		BOSTON PROPERTIES	30,030	3,993,689.70
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,000	80,460.00
		BRANDYWINE REALTY TRUST	35,000	533,750.00
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	58,500	1,037,205.00
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	20,000	417,400.00
		BRT APARTMENTS CORP	1,600	22,208.00
		CAMDEN PROPERTY TRUST	18,650	1,839,449.50
		CARETRUST REIT INC ACQUIRES	17,600	411,664.00
		CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	31,000	36,890.00
		CEDAR REALTY TRUST INC	16,000	49,920.00
		CHATHAM LODGING TRUST	9,500	186,580.00
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	11,600	328,512.00
		CITY OFFICE REIT INC	8,000	87,680.00
		CLIPPER REALTY INC	2,400	31,656.00
		COLONY CAPITAL INC	96,000	504,960.00
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	22,200	494,838.00
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,500	125,230.00
		CORECIVIC INC	22,300	460,718.00
		CORESITE REALTY CORP	7,220	789,001.60
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	21,500	586,735.00		
COUSINS PROPERTIES INC	82,700	774,072.00		

CUBESMART	35,800	1,116,244.00	
CYRUSONE INC	21,200	1,206,280.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	39,000	420,420.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	40,370	4,862,566.50	
DOUGLAS EMMETT INC	31,600	1,287,700.00	
DUKE REALTY CORP	69,200	2,084,996.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	12,200	214,720.00	
EASTGROUP PROPERTIES	7,060	781,471.40	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	26,300	399,760.00	
EPR PROPERTIES	14,470	1,114,190.00	
EQUITY COMMONWEALTH	23,200	731,960.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,350	1,983,625.50	
EQUITY RESIDENTIAL	71,840	5,393,028.80	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	9,100	173,537.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,770	3,553,763.30	
EXTRA SPACE STORAGE INC	24,780	2,495,346.00	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	36,190.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,500	1,916,900.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	24,200	844,822.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,700	386,066.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	20,100	154,971.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,000	97,500.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	38,800	1,545,792.00	
GEO GROUP INC/THE	23,700	459,543.00	
GETTY REALTY CORP	6,400	203,456.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,400	110,916.00	
GLADSTONE LAND CORP	2,500	31,350.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,000	50,450.00	
GLOBAL NET LEASE INC	16,600	304,776.00	
HCP INC	93,000	2,774,190.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	24,700	754,091.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	40,200	1,105,500.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6,600	118,074.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	19,800	890,802.00	

HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	32,300	851,105.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	144,100	2,723,490.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	30,200	1,037,672.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	16,100	165,830.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	12,500	250,250.00	
INFREAREIT INC	8,000	168,480.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,000	161,480.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,200	130,482.00	
INVITATION HOMES INC	66,100	1,612,179.00	
IRON MOUNTAIN INC	55,800	2,005,452.00	
JBG SMITH PROPERTIES	21,300	891,192.00	
KILROY REALTY CORP	19,520	1,470,636.80	
KIMCO REALTY CORP	81,200	1,423,436.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	15,400	240,856.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	41,300	372,526.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	28,500	1,378,260.00	
LIFE STORAGE INC	9,160	863,055.20	
LTC PROPERTIES INC	7,600	334,400.00	
MACERICH CO /THE	20,800	862,368.00	
MACK-CALI REALTY CORP	16,900	383,292.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	225,007	195,756.09	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	5,600	59,360.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	73,500	1,267,140.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,190	2,364,566.40	
MONMOUTH REIT-CLASS A	18,000	240,480.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	31,100	1,602,894.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,800	304,344.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,430	632,418.60	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	15,000	78,900.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	4,100	146,985.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	9,700	169,362.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	9,250	253,172.50	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	39,400	1,407,762.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,800	75,124.00	

PARAMOUNT GROUP INC	38,500	541,695.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	39,000	1,212,900.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	25,000	776,000.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	11,500	65,205.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	36,000	643,320.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	24,900	510,699.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	8,000	121,440.00	
PROLOGIS INC	122,310	8,998,346.70	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,880	569,778.00	
PUBLIC STORAGE	29,130	6,334,318.50	
QTS REALTY TRUST INC CL A	10,400	476,840.00	
REALTY INCOME CORP	59,000	4,043,270.00	
REGENCY CENTERS CORP	32,300	2,144,074.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,400	385,952.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	42,000	511,560.00	
RETAIL VALUE INC	2,751	90,755.49	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	19,100	693,330.00	
RLJ LODGING TRUST	34,600	633,180.00	
RPT REALTY	15,700	187,301.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	9,830	799,375.60	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	34,100	652,674.00	
SAFEHOLD INC	1,500	34,755.00	
SAUL CENTERS INC	2,400	126,864.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	46,200	376,530.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	5,300	234,472.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	59,930	10,671,135.80	
SITE CENTERS CORP	26,900	360,460.00	
SL GREEN REALTY CORP	16,190	1,409,339.50	
SPIRIT MTA REIT	7,210	48,883.80	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	16,900	670,592.00	
STAG INDUSTRIAL INC	24,200	697,928.00	
STORE CAPITAL CORP	38,100	1,224,534.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	20,300	237,510.00	
SUN COMMUNITIES INC	16,650	1,985,346.00	

	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	43,500	637,710.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	18,400	349,784.00	
	TAUBMAN CENTERS INC	11,900	604,520.00	
	TERRENO REALTY CORP	11,600	500,888.00	
	TIER REIT INC	10,300	285,825.00	
	UDR INC	53,100	2,348,613.00	
	UMH PROPERTIES INC	7,200	99,504.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,280	177,543.60	
	URBAN EDGE PROPERTIES	23,900	447,408.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	6,000	124,440.00	
	VENTAS INC	69,200	4,084,876.00	
	VEREIT INC	186,500	1,505,055.00	
	VICI PROPERTIES INC	69,400	1,519,860.00	
	VORNADO REALTY TRUST	33,800	2,264,938.00	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	37,000	178,710.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	15,400	428,120.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	23,200	676,280.00	
	WELLTOWER INC	75,020	5,494,464.80	
	WHITESTONE REIT	7,400	90,650.00	
	WP CAREY INC	31,380	2,407,159.80	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	22,000	466,840.00	
小計	銘柄数：158	4,401,038	167,183,698.78	
			(18,722,902,426)	
	組入時価比率：71.7%		72.4%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,200	488,376.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	14,700	156,408.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,200	165,942.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,300	694,694.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	26,200	361,822.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16,500	190,245.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	8,200	117,342.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,500	133,760.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	17,300	239,605.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	9,000	103,590.00	

	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,200	146,072.00
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,400	275,880.00
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	27,800	643,014.00
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,000	149,820.00
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,200	156,210.00
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	1,500	28,905.00
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	58,476.00
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	5,800	163,038.00
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12,000	137,160.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	28,600	742,170.00
	SLATE OFFICE REIT	5,900	35,046.00
	SLATE RETAIL REIT	4,300	54,180.00
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	13,700	468,129.00
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	8,000	92,160.00
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,000	33,400.00
小計	銘柄数 : 25	275,800	5,835,444.00
			(488,485,017)
	組入時価比率 : 1.9%		1.9%
ユ-口	AEDIFICA	3,630	296,208.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	30,800	437,668.00
	ALTAREA	680	129,200.00
	BEFIMMO S.C.A.	4,300	223,170.00
	COFINIMMO	4,030	465,868.00
	COVIVIO	12,020	1,138,294.00
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	7,600	192,736.00
	GECINA SA	10,550	1,372,555.00
	GREEN REIT PLC	126,000	216,972.00
	HAMBORNER REIT AG	15,400	144,452.00
	HIBERNIA REIT PLC	140,000	196,280.00
	ICADE	8,870	668,354.50
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,000	67,100.00
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	54,300	510,148.50
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	4,114	102,644.30
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	70,000	111,160.00



	KLEPIERRE	40,500	1,297,215.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,000	103,180.00	
	MERCIALYS	10,400	131,248.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	70,300	846,412.00	
	MONTEA	2,120	157,940.00	
	NSI NV	3,800	140,410.00	
	RETAIL ESTATES	1,500	126,600.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26,740	4,135,341.00	
	VASTNED RETAIL NV	3,100	106,950.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,420	478,800.00	
	WERELDHAVE NV	7,700	191,730.00	
小計	銘柄数 : 27	685,874	13,988,636.30	
			(1,760,889,537)	
	組入時価比率 : 6.7%		6.8%	
英債券	ASSURA PLC	444,000	253,968.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	29,500	301,785.00	
	BRITISH LAND	186,600	1,111,389.60	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	93,000	22,413.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	122,000	106,018.00	
	DERWENT LONDON PLC	21,800	678,416.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	108,000	101,196.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	54,300	397,258.80	
	HAMMERSON PLC	147,000	485,688.00	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	82,000	74,866.00	
	INTU PROPERTIES PLC	162,000	164,754.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	144,900	1,320,039.00	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	140,000	278,320.00	
	LXI REIT PLC	64,000	82,432.00	
	NEWRIVER REIT PLC	63,000	143,640.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	104,000	95,680.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	151,000	197,508.00	
	RDI REIT PLC	56,000	88,480.00	
	REGIONAL REIT LTD	56,000	59,024.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	41,900	265,017.50	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	110,000	63,580.00	

小計	SEGR0 PLC	209,100	1,400,970.00
	SHAFTESBURY PLC	45,400	386,808.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	63,000	59,094.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	335,000	501,830.00
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	125,000	109,375.00
	UNITE GROUP PLC	51,600	476,784.00
	WORKSPACE GROUP PLC	24,900	241,405.50
	銘柄数：28	3,235,000	9,467,739.40 (1,376,609,308)
	組入時価比率：5.3%		5.3%
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	60,000	217,800.00
	APN INDUSTRIA REIT	20,000	56,800.00
	ARENA REIT	52,000	146,640.00
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	9,800	0.00
	BWP TRUST	89,000	323,960.00
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	42,000	153,720.00
	CHARTER HALL GROUP	90,000	877,500.00
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	40,444	184,020.20
	CHARTER HALL RETAIL REIT	66,000	302,940.00
	CROMWELL PROPERTY GROUP	304,000	338,960.00
	DEXUS	196,900	2,484,878.00
	GDI PROPERTY GROUP	90,000	125,550.00
	GOODMAN GROUP	311,800	3,962,978.00
	GPT GROUP	347,000	2,033,420.00
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	56,000	228,480.00
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	27,000	90,720.00
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,000	119,730.00
	MIRVAC GROUP	713,000	1,996,400.00
	NATIONAL STORAGE REIT	130,000	224,250.00
	RURAL FUNDS GROUP	60,000	135,600.00
	SCENTRE GROUP	1,036,000	4,019,680.00
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	176,000	450,560.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	476,000	1,851,640.00
	VICINITY CENTRES	629,000	1,578,790.00
VIVA ENERGY REIT	92,000	224,480.00	

小計	銘柄数 : 25  組入時価比率 : 6.8%	5,152,944	22,129,496.20  (1,771,466,170)  6.9%
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	160,000	208,000.00
	GOODMAN PROPERTY TRUST	210,000	364,350.00
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	271,000	406,500.00
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	201,000	317,580.00
	STRIDE STAPLED GROUP	69,000	139,380.00
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	64,000	135,360.00
小計	銘柄数 : 6  組入時価比率 : 0.5%	975,000	1,571,170.00  (117,649,209)  0.5%
香港ドル	CHAMPION REIT	386,000	2,516,720.00
	FORTUNE REIT	263,000	2,619,480.00
	LINK REIT	409,600	37,273,600.00
	PROSPERITY REIT	220,000	739,200.00
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	195,000	1,111,500.00
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	268,000	1,404,320.00
小計	銘柄数 : 6  組入時価比率 : 2.5%	1,741,600	45,664,820.00  (651,636,981)  2.5%
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	112,000	155,680.00
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	150,000	136,500.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	491,000	1,443,540.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	227,000	272,400.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	209,860	150,049.90
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	538,964	1,040,200.52
	CAPITALAND MALL TRUST	538,000	1,242,780.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	128,000	194,560.00
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	145,000	233,450.00
	ESR REIT	390,000	200,850.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	162,000	108,540.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	120,000	117,600.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	116,000	270,280.00
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	139,000	205,720.00

	FRASERS HOSPITALITY TRUST	140,000	104,300.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	299,000	346,840.00	
	KEPPEL DC REIT	190,956	284,524.44	
	KEPPEL REIT	340,000	418,200.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	340,000	68,000.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	369,025	682,696.25	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	264,000	541,200.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	444,000	639,360.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	424,000	563,920.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	220,043	158,430.96	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	72,000	208,800.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	133,764	56,849.70	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	136,700	86,121.00	
	SPH REIT	124,000	130,200.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	260,000	196,300.00	
	SUNTEC REIT	445,000	841,050.00	
小計	銘柄数：30	7,669,312	11,098,942.77	
			(917,660,588)	
	組入時価比率：3.5%		3.6%	
ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	36,660,000.00	
小計	銘柄数：1	6,000	36,660,000.00	
			(3,611,010)	
	組入時価比率：0.0%		0.0%	
新シェケル	REIT 1 LTD	34,000	556,580.00	
小計	銘柄数：1	34,000	556,580.00	
			(17,337,467)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
合計			25,828,247,713	
			(25,828,247,713)	

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

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

(注3)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 4月22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	243,605,127	-	241,970,073	1,635,054
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	95,079,657	-	94,789,800	289,857
米ドル	34,682,835	-	34,713,300	30,465
ユーロ	18,986,920	-	18,880,500	106,420
英ポンド	14,617,900	-	14,539,000	78,900
豪ドル	20,940,400	-	20,810,400	130,000
香港ドル	5,851,602	-	5,846,600	5,002
合計	-	-	-	1,924,911

## (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 ）

2019年5月31日現在

資産総額	168,474,510円
負債総額	4,560,558円
純資産総額（ - ）	163,913,952円
発行済口数	157,777,411口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0389円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019年5月31日現在

資産総額	87,301,291円
負債総額	3,077,024円
純資産総額（ - ）	84,224,267円
発行済口数	80,235,062口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0497円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019年5月31日現在

資産総額	225,322,088円
負債総額	8,813,769円
純資産総額（ - ）	216,508,319円
発行済口数	204,182,769口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0604円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019年5月31日現在

資産総額	56,680,959円
負債総額	2,242,056円
純資産総額（ - ）	54,438,903円
発行済口数	51,001,928口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0674円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019年5月31日現在

資産総額	199,030,793円
負債総額	4,544,601円
純資産総額（ - ）	194,486,192円
発行済口数	180,458,364口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0777円

## （参考）国内株式マザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	477,302,477,608円
負債総額	90,495,840,742円
純資産総額（ - ）	386,806,636,866円
発行済口数	256,590,058,166口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5075円

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	550,145,607,802円
負債総額	3,072,653,446円
純資産総額（ - ）	547,072,954,356円
発行済口数	206,477,883,771口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6495円

## （参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	93,295,345,095円
負債総額	47,302,789,506円
純資産総額（ - ）	45,992,555,589円
発行済口数	24,707,284,644口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8615円

## （参考）新興国株式マザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	36,028,392,053円
負債総額	134,976,942円
純資産総額（ - ）	35,893,415,111円
発行済口数	30,556,038,875口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1747円

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	13,725,340,256円
負債総額	178,111,493円
純資産総額（ - ）	13,547,228,763円
発行済口数	11,330,073,930口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1957円

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	674,611,632,912円
負債総額	11,967,771,740円
純資産総額（ - ）	662,643,861,172円
発行済口数	494,379,285,548口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3404円

（参考）外国債券マザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	606,343,713,388円
負債総額	855,591,390円
純資産総額（ - ）	605,488,121,998円
発行済口数	267,529,920,113口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2633円

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	116,198,512,418円
------	------------------



負債総額	58,037,719,955円
純資産総額（ - ）	58,160,792,463円
発行済口数	50,132,545,377口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1601円

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	9,009,573,690円
負債総額	23,163,281円
純資産総額（ - ）	8,986,410,409円
発行済口数	6,957,907,341口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2915円

## （参考）新興国債券マザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	20,410,372,877円
負債総額	99,263,115円
純資産総額（ - ）	20,311,109,762円
発行済口数	10,881,226,488口
1口当たり純資産額（ / ）	1.8666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

2019年5月31日現在

資産総額	2,058,950,338円
負債総額	17,037,237円
純資産総額（ - ）	2,041,913,101円
発行済口数	1,680,594,369口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2150円

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	41,816,986,151円
負債総額	1,102,557,422円
純資産総額（ - ）	40,714,428,729円
発行済口数	17,558,945,142口

1口当たり純資産額（ / ）	2.3187円
----------------	---------

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2019年5月31日現在

資産総額	25,244,454,133円
負債総額	66,601,913円
純資産総額（ - ）	25,177,852,220円
発行済口数	10,604,820,741口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3742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

2019年5月31日現在

資産総額	12,117,877,525円
負債総額	5,996,285,805円
純資産総額（ - ）	6,121,591,720円
発行済口数	4,111,334,693口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4890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

2019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

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

###### 株主総会

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

###### 取締役会

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

###### 代表取締役・業務執行取締役

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

###### 監査等委員会

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

## (b)投資信託の運用体制



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2019年4月26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	1,029	28,641,641
単位型株式投資信託	165	968,337
追加型公社債投資信託	14	5,233,433
単位型公社債投資信託	418	1,723,323
合計	1,626	36,566,733

### 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(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。  
なお、従来、当社が監査証明を受けている新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日に名称を変更し、EY新日本有限責任監査法人となりました。

#### (1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(2018年3月31日)	(2019年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
<b>(資産の部)</b>			
<b>流動資産</b>			
現金・預金		919	1,562
金銭の信託		47,936	45,493
有価証券		22,600	19,900
前払金		0	-
前払費用		26	27
未収入金		464	500
未収委託者報酬		24,059	25,246
未収運用受託報酬		6,764	5,933
その他		181	269
貸倒引当金		15	15
流動資産計		102,937	98,917
<b>固定資産</b>			
<b>有形固定資産</b>			
建物	2	348	320
器具備品	2	525	393
無形固定資産		7,157	6,438

ソフトウェア		7,156		6,437	
その他		0		0	
投資その他の資産			13,825		18,608
投資有価証券		1,184		1,562	
関係会社株式		9,033		12,631	
従業員長期貸付金		36		-	
長期差入保証金		54		235	
長期前払費用		36		22	
前払年金費用		2,350		2,001	
繰延税金資産		3,074		2,694	
その他		168		168	
貸倒引当金		0		-	
投資損失引当金		-		707	
固定資産計			23,969		25,761
資産合計			126,906		124,679

区分	注記 番号	前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
<b>(負債の部)</b>					
<b>流動負債</b>					
預り金			133		145
未払金	1		17,853		16,709
未払収益分配金		1		0	
未払償還金		31		25	
未払手数料		7,884		7,724	
関係会社未払金		7,930		7,422	
その他未払金		2,005		1,535	
未払費用	1		12,441		11,704
未払法人税等			2,241		1,560
前受収益			33		29
賞与引当金			4,626		3,792
流動負債計			37,329		33,942
<b>固定負債</b>					
退職給付引当金			2,938		3,219
時効後支払損引当金			548		558
固定負債計			3,486		3,777
負債合計			40,816		37,720
<b>(純資産の部)</b>					
<b>株主資本</b>					
資本金			86,078		86,924
資本剰余金			17,180		17,180
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			55,168		56,014
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		54,483		55,329	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		29,876		30,723	
評価・換算差額等			11		33

その他有価証券評価差額金		11	33
純資産合計		86,090	86,958
負債・純資産合計		126,906	124,679

## (2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		115,907	119,196
運用受託報酬		26,200	21,440
その他営業収益		338	355
営業収益計		142,447	140,992
営業費用			
支払手数料		45,252	42,675
広告宣伝費		1,079	1,210
公告費		0	0
調査費		30,516	30,082
調査費		5,830	5,998
委託調査費		24,685	24,083
委託計算費		1,376	1,311
営業雑経費		5,464	5,435
通信費		125	92
印刷費		966	970
協会費		79	86
諸経費		4,293	4,286
営業費用計		83,689	80,715
一般管理費			
給料		11,716	11,113
役員報酬		425	379
給料・手当		6,856	7,067
賞与		4,433	3,666
交際費		132	107
旅費交通費		482	514
租税公課		1,107	1,048
不動産賃借料		1,221	1,223
退職給付費用		1,110	1,474
固定資産減価償却費		2,706	2,835
諸経費		9,131	10,115
一般管理費計		27,609	28,433
営業利益		31,148	31,843

	前事業年度	当事業年度
	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)



区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,031		6,538	
受取利息		4		0	
その他		362		424	
営業外収益計			4,398		6,964
営業外費用					
支払利息		2		1	
金銭の信託運用損		312		489	
時効後支払損引当金繰入額		13		43	
為替差損		46		34	
その他		31		17	
営業外費用計			405		585
経常利益			35,141		38,222
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		20	
関係会社清算益	3	-		29	
株式報酬受入益		75		85	
特別利益計			95		135
特別損失					
投資有価証券等評価損		2		938	
関係会社株式評価損		-		161	
固定資産除却損	2	58		310	
投資損失引当金繰入額		-		707	
特別損失計			60		2,118
税引前当期純利益			35,176		36,239
法人税、住民税及び事業税			10,775		10,196
法人税等調整額			439		370
当期純利益			24,840		25,672

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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		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		その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剰余金の配当							24,826	24,826	24,826
当期純利益							25,672	25,672	25,672
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(単位：百万円)

	評価・換算差額等
--	----------

	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	純資産合計
当期首残高	11	11	86,090
当期変動額			
剰余金の配当			24,826
当期純利益			25,672
株主資本以外の項目 の当期変動額（純 額）	21	21	21
当期変動額合計	21	21	868
当期末残高	33	33	86,958

## [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: 20px;"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(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>(5) 投資損失引当金  子会社等に対する投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要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】

- ・「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】

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期

首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」2,111百万円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」3,074百万円に含めて表示しております。

#### [注記事項]

##### 貸借対照表関係

前事業年度末 (2018年3月31日)	当事業年度末 (2019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 1,781百万円	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 1,434百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 708百万円 器具備品 3,491 合計 4,200	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 736百万円 器具備品 3,106 合計 3,842

##### 損益計算書関係

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019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 4,026百万円 支払利息 2	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 6,531百万円 支払利息 1
2. 固定資産除却損 建物 4百万円 器具備品 0 ソ フ ト ウ エ 53 ア 合計 58	2. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 3 ソ フ ト ウ エ 307 ア 合計 310
	3. 関係会社清算益 関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう清算配当です。

##### 株主資本等変動計算書関係

前事業年度(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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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

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

## (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

2019年5月15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	25,650百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,980円
基準日	2019年3月31日
効力発生日	2019年6月28日

## 金融商品関係

前事業年度(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				
其他有価証券	22,600	-	-	-
合計	102,279	-	-	-

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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

2019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	1,562	1,562	-
(2)金銭の信託	45,493	45,493	-
(3)未収委託者報酬	25,246	25,246	-
(4)未収運用受託報酬	5,933	5,933	-
(5)有価証券及び投資有価証券	19,900	19,900	-
その他有価証券	19,900	19,900	-
資産計	98,136	98,136	-
(6)未払金	16,709	16,709	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	7,724	7,724	-
関係会社未払金	7,422	7,422	-
その他未払金	1,535	1,535	-
(7)未払費用	11,704	11,704	-
(8)未払法人税等	1,560	1,560	-
負債計	29,974	29,974	-

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1,562百万円、関係会社株式12,631百万円）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。なお、当事業年度において、非上場株式について1,100百万円（投資有価証券938百万円、関係会社株式161百万円）減損処理を行っております。

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	1,562	-	-	-
金銭の信託	45,493	-	-	-
未収委託者報酬	25,246	-	-	-
未収運用受託報酬	5,933	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	19,900	-	-	-
合計	98,136	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（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。

## 当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

## 1．売買目的有価証券(2019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(2019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(2019年3月31日)

該当事項はありません。

## 4．その他有価証券(2019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	19,900	19,900	-
小計	19,900	19,900	-
合計	19,900	19,900	-

5. 事業年度中に売却したその他有価証券（自 2018年4月1日 至 2019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 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。	

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	21,398 百万円
勤務費用	951
利息費用	179
数理計算上の差異の発生額	1,672
退職給付の支払額	737
過去勤務費用の発生額	71
その他	15
退職給付債務の期末残高	23,551

(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	17,373 百万円
期待運用収益	434
数理計算上の差異の発生額	241
事業主からの拠出額	483
退職給付の支払額	579
年金資産の期末残高	17,469

## (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	20,181 百万円
年金資産	17,469
	2,712
非積立型制度の退職給付債務	3,369
未積立退職給付債務	6,082
未認識数理計算上の差異	5,084
未認識過去勤務費用	220
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218
退職給付引当金	3,219
前払年金費用	2,001
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	951 百万円
利息費用	179
期待運用収益	434
数理計算上の差異の費用処理額	598
過去勤務費用の費用処理額	38
確定給付制度に係る退職給付費用	1,255

## (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

確定給付型企业年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.4%
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、197百万円でした。

## 税効果会計関係

前事業年度末 (2018年3月31日)	当事業年度末 (2019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	1,434	賞与引当金	1,175
退職給付引当金	910	退職給付引当金	998
投資有価証券評価減	417	投資有価証券評価減	708
未払事業税	409	未払事業税	288
投資損失引当金	-	投資損失引当金	219
ゴルフ会員権評価減	207	ゴルフ会員権評価減	192
時効後支払損引当金	169	時効後支払損引当金	172
減価償却超過額	171	減価償却超過額	171
子会社株式売却損	148	子会社株式売却損	148
未払社会保険料	107	未払社会保険料	82
その他	566	その他	466
繰延税金資産小計	4,543	繰延税金資産小計	4,625
評価性引当額	735	評価性引当額	1,295
繰延税金資産合計	3,808	繰延税金資産合計	3,329
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	5	その他有価証券評価差額金	15
前払年金費用	728	前払年金費用	620
繰延税金負債合計	733	繰延税金負債合計	635
繰延税金資産の純額	3,074	繰延税金資産の純額	2,694
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	0.2%	交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	3.4%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%
タックスヘイブン税制	1.8%	タックスヘイブン税制	2.6%
外国税額控除	0.2%	外国税額控除	0.6%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%	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	0.4%	その他	1.3%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.3%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%

## セグメント情報等

前事業年度(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。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借 及び購入等  役員の兼任	資金の借入(*1)	3,000	短期借入金	-
							資金の返済	3,000		
							借入金利息の支払	2	未払費用	-

(イ) 子会社等  
該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等

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

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019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	1	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)	34,646	未払手数料	6,410

## (エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

(\*2) 投資信託に係る事務代行手数料については、商品性等を勘案し総合的に決定しております。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

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

## (2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

## 1株当たり情報

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,714円33銭	1株当たり純資産額	16,882円89銭
1株当たり当期純利益	4,822円68銭	1株当たり当期純利益	4,984円30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いません。		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いません。	
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	24,840百万円	損益計算書上の当期純利益	25,672百万円
普通株式に係る当期純利益	24,840百万円	普通株式に係る当期純利益	25,672百万円
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

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

\* 2019年4月末現在

###### (2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 <sup>*</sup>	(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	
松井証券株式会社	11,945百万円	
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	

\* 2019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力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

2019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

### EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の財務諸表、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2019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。

#### 利害関係

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

以 上

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



## 独立監査人の監査報告書

2019年6月14日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2018年4月24日から2019年4月22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2019年4月22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

2019年6月14日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2018年4月24日から2019年4月22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2019年4月22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

2019年6月14日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2018年4月24日から2019年4月22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2019年4月22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

2019年6月14日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2018年4月24日から2019年4月22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2019年4月22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

2019年6月14日

野村アセットマネジメント株式会社  
取締役会 御中

## EY新日本有限責任監査法人

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているインデックス・ブレンド（タイプ ）の2018年4月24日から2019年4月22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2019年4月22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。