

## 【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年1月20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。

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日、半期報告書を提出いたしましたので、2019年7月17日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

原届出書の下記の記載事項につきましては内容を更新・訂正いたします。

第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況

なお、原届出書の「第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況」において「1財務諸表」につきましては「中間財務諸表」が追加され、「2ファンドの現況」につきましては内容を更新・訂正いたします。

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

## 第一部【証券情報】

## (5) 申込手数料

## &lt;訂正前&gt;

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

\*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。

## &lt;訂正後&gt;

取得申込日の翌営業日の基準価額に、 $2.2\%$ （税抜2.0%）以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

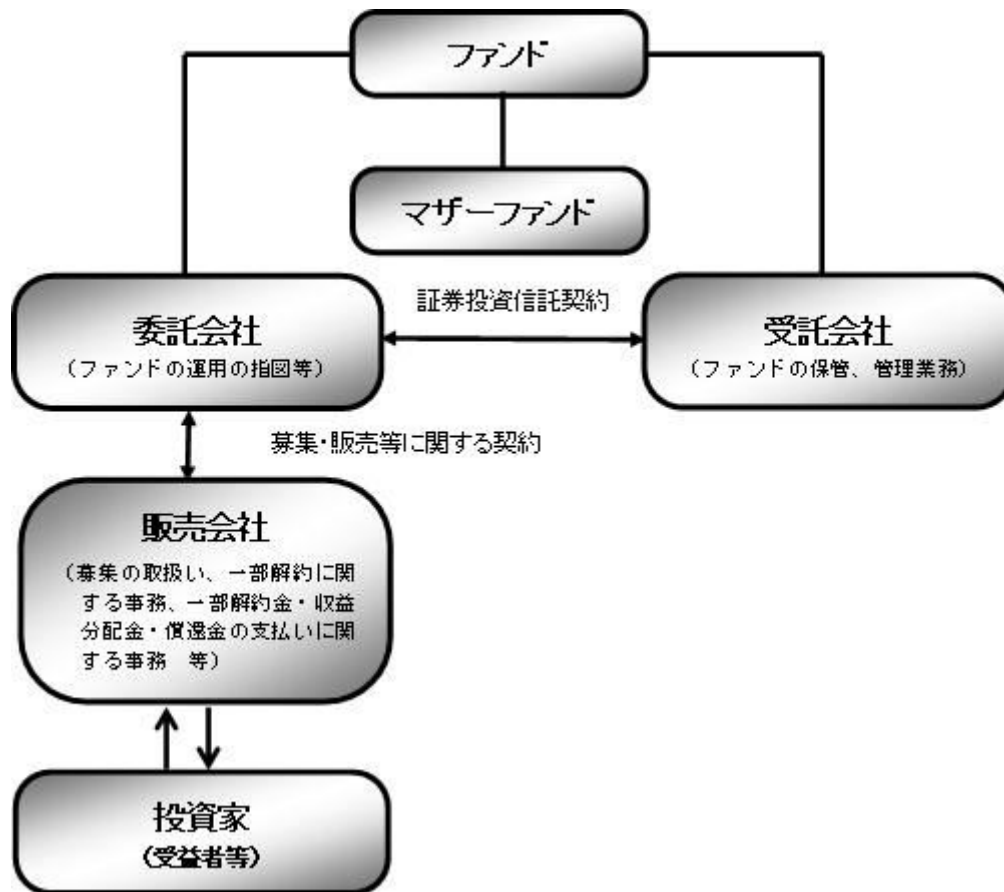
## 第二部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1 ファンドの性格

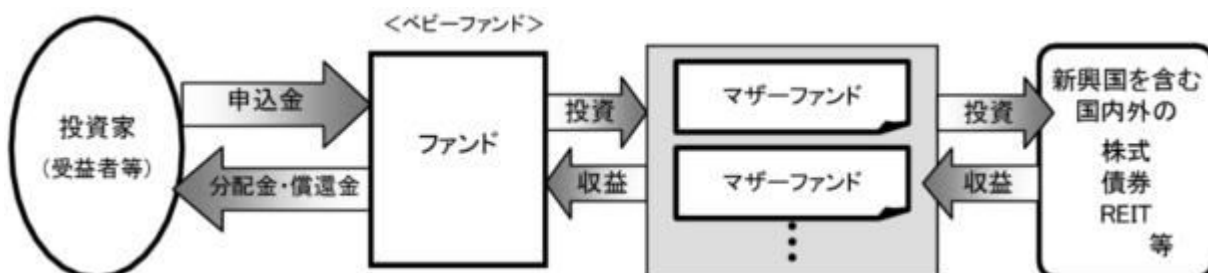
## (3) ファンドの仕組み

&lt;更新後&gt;



## 《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2020年1月20日現在のものであり、変更する場合があります。

#### < 更新後 >

委託会社の概況(2019年12月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

## 2 投資方針

## （１）投資方針

## &lt; 更新後 &gt;

「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（預託証書） <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・円換算ベース） <sup>（注1）</sup> ・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ドルベース)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） <sup>（注1）</sup> ・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・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） <sup>(注1)</sup> ・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(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、ドルベース）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2020年1月20日現在のものであり、変更する場合があります。

- \*1 Depository Receipt（預託証券）の略で、ある国の株式発行会社の株式を海外で流通させるために、その会社の株式を銀行などに預託し、その代替として海外で発行される証券をいいます。DRは、株式と同様に金融商品取引所などで取引されます。
- \*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。

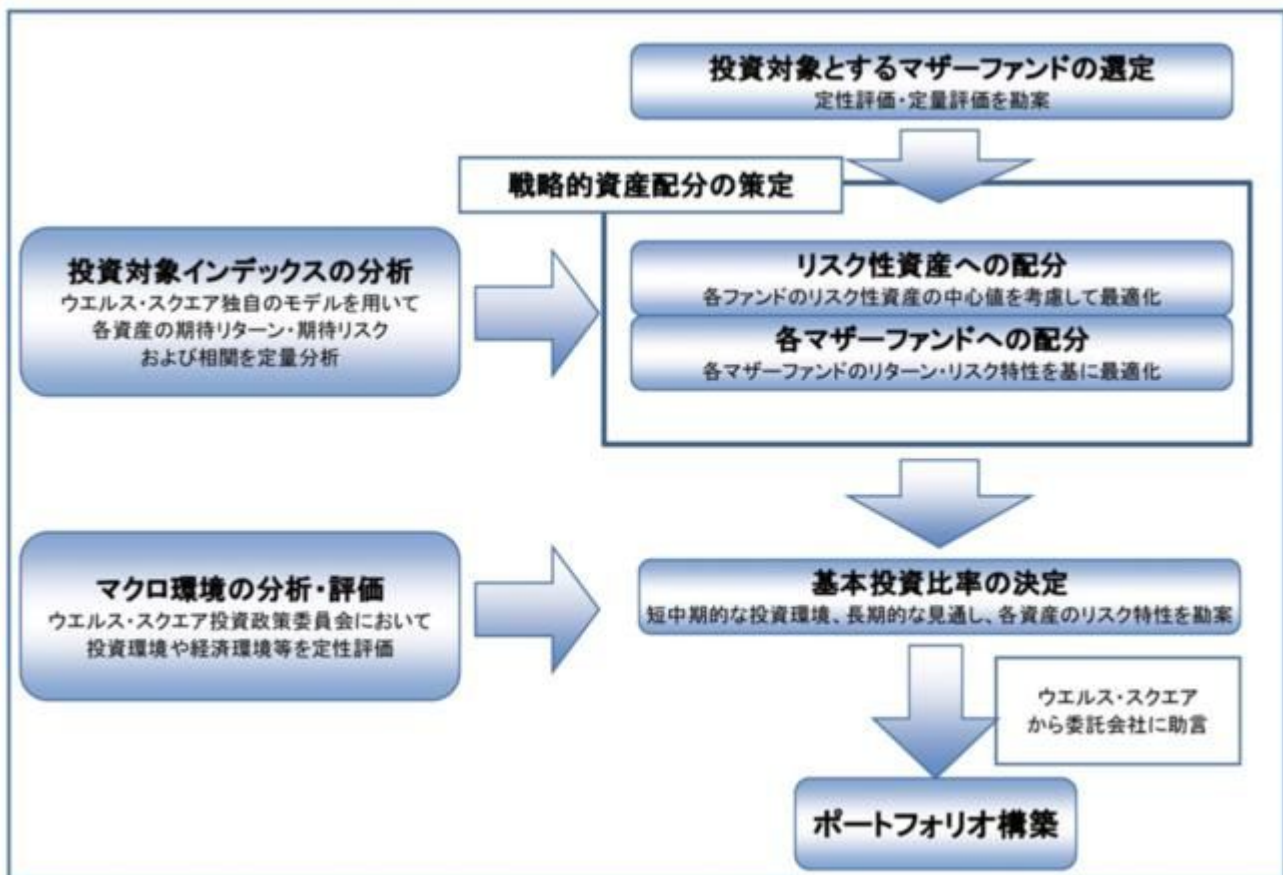
株式会社ウエルス・スクエア(ウエルス・スクエア) による以下のプロセスに従った助言に基づいて投資対象とするマザーファンドおよび各マザーファンドへの投資比率を決定します。

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。

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

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

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

本ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

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

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

### S&P先進国REIT指数

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (2) 投資対象

### <更新後>

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2020年1月20日現在の組入マザーファンドであり、変更する場合があります。

## 投資の対象とする資産の種類（信託約款）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

- 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、下記「（5）投資制限、及び」に定めるものに限ります。）に係る権利

ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

- 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ロ．次に掲げるものをすべてみだす資産

・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。

1．株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含

みます。）

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。）
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。



## (参考)各マザーファンドの概要

## （国内株式マザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1．基本方針

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

## 2．運用方法

## (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

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

非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

## （外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1．基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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ないます。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

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いません。

## 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 投資リスク

< 更新後 >

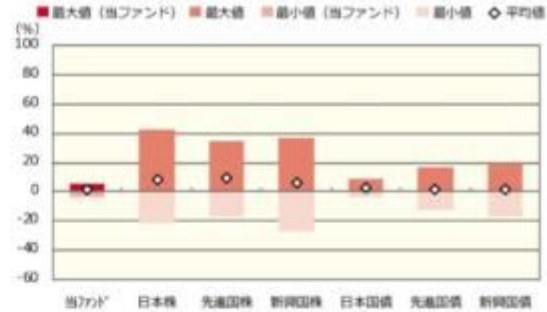
## ■ リスクの定量的比較 (2014年12月末～2019年11月末：月次)

### ■ 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 (%)	5.9	41.9	34.1	37.2	9.3	16.4	19.3
最小値 (%)	△ 3.6	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	1.7	8.1	9.0	5.5	2.1	1.8	1.0

- \* 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11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。

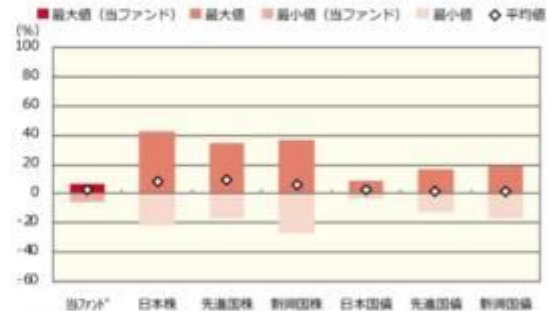
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2014年12月から2019年11月の5年間（当ファンドは2018年1月から2019年11月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

### ■ 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	16.4	19.3
最小値 (%)	△ 5.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.1	8.1	9.0	5.5	2.1	1.8	1.0

- \* 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11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12月から2019年11月の5年間（当ファンドは2018年1月から2019年11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12月 2015年11月 2016年11月 2017年11月 2018年11月 2019年11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	16.4	19.3
最小値 (%)	△ 6.9	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.5	8.1	9.0	5.5	2.1	1.8	1.0

- \* 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11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12月から2019年11月の5年間（当ファンドは2018年1月から2019年11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12月 2015年11月 2016年11月 2017年11月 2018年11月 2019年11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	16.4	19.3
最小値 (%)	△ 8.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.6	8.1	9.0	5.5	2.1	1.8	1.0

- \* 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11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。

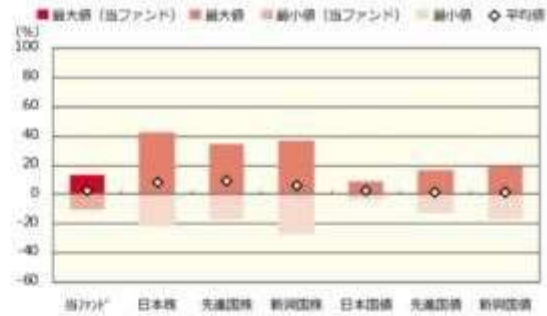
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2014年12月から2019年11月の5年間（当ファンドは2018年1月から2019年11月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 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	16.4	19.3
最小値 (%)	△ 9.9	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	3.1	8.1	9.0	5.5	2.1	1.8	1.0

- \* 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、設定日の値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11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12月から2019年11月の5年間で当ファンドは2018年1月から2019年11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。

## &lt;代表的な資産クラスの指数&gt;

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

## ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)・・・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
  - MSCI-KOKUSAI 指数 (配当込み、円ベース)、MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI 指数 (配当込み、円ベース)、MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的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プライアンス、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、JP Morgan 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）についての援助、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。JP Morgan 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



## &lt;更新後&gt;

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）（税抜2.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

## (3) 信託報酬等

## &lt;更新後&gt;

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	タイプ	タイプ	タイプ	タイプ	タイプ
信託報酬率	年0.528% (税抜年 0.48%)	年0.539% (税抜年 0.49%)	年0.55% (税抜年 0.50%)	年0.561% (税抜年 0.51%)	年0.572% (税抜年 0.52%)
委託会社	年0.25%	年0.26%	年0.27%	年0.28%	年0.29%
販売会社	年0.20%	年0.20%	年0.20%	年0.20%	年0.20%
受託会社	年0.03%	年0.03%	年0.03%	年0.03%	年0.03%

## 支払先の役務の内容

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

## (4) その他の手数料等

## &lt;更新後&gt;

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。また、ファンドが投資するマザーファンドに関する有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が、ファンドから実質的に支払われます。

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

<更新後>

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

<収益分配金に対する課税>

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

なお、配当控除は適用されません。

<換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税>

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

損益通算について

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

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 <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。

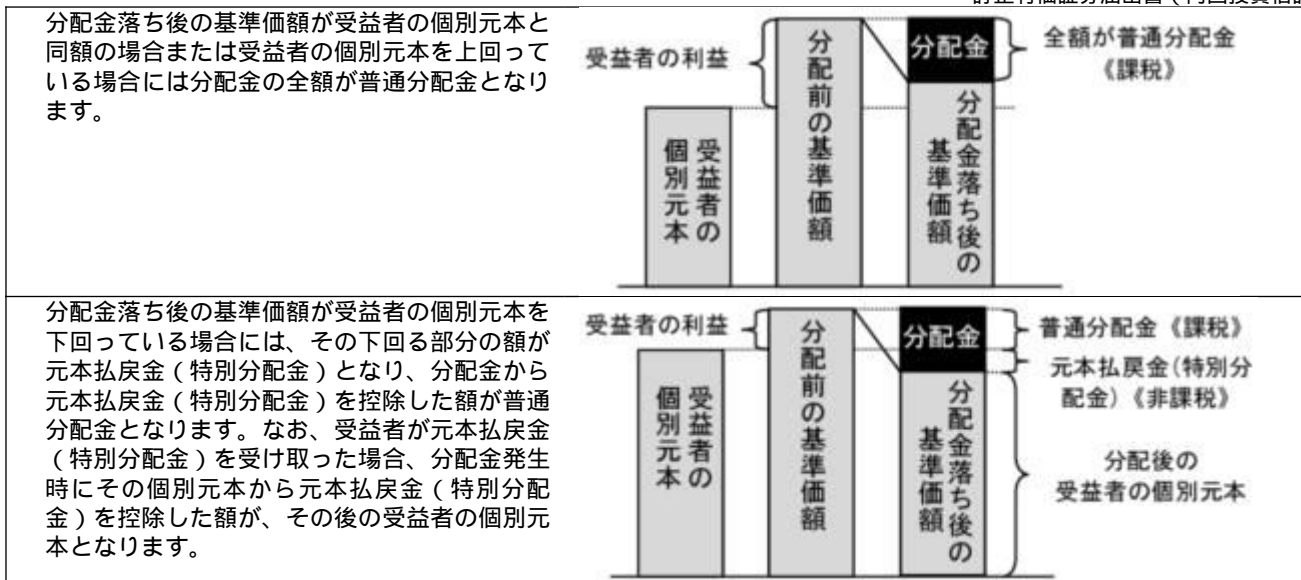
#### 個別元本について

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。

- \* 外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- \* 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11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11月29日現在の運用状況であります。

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

### (1) 投資状況

#### 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	175,104,490	99.41
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,028,391	0.58
合計(純資産総額)		176,132,881	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	68,698,447	99.42
現金・預金・その他資産(負債控除後)		399,976	0.57
合計(純資産総額)		69,098,423	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	266,923,431	99.41
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,559,545	0.58
合計（純資産総額）		268,482,976	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	63,356,486	99.43
現金・預金・その他資産（負債控除後）		360,859	0.56
合計（純資産総額）		63,717,345	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	224,327,244	99.41
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,316,767	0.58
合計（純資産総額）		225,644,011	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	444,925,164,610	97.93
現金・預金・その他資産（負債控除後）		9,401,259,631	2.06
合計（純資産総額）		454,326,424,241	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	9,384,410,000	2.06

## （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	433,672,404,072	66.11

	カナダ	23,731,290,596	3.61
	ドイツ	20,314,607,319	3.09
	イタリア	5,485,664,182	0.83
	フランス	25,639,535,987	3.90
	オランダ	8,521,810,587	1.29
	スペイン	6,542,593,802	0.99
	ベルギー	2,295,320,551	0.34
	オーストリア	532,772,408	0.08
	ルクセンブルグ	226,827,379	0.03
	フィンランド	2,159,797,227	0.32
	アイルランド	1,357,603,667	0.20
	ポルトガル	364,486,892	0.05
	イギリス	37,496,794,238	5.71
	スイス	21,537,520,385	3.28
	スウェーデン	6,153,633,454	0.93
	ノルウェー	1,423,809,060	0.21
	デンマーク	4,246,224,583	0.64
	オーストラリア	14,924,398,628	2.27
	ニュージーランド	623,281,574	0.09
	香港	7,133,197,525	1.08
	シンガポール	2,646,814,426	0.40
	イスラエル	803,822,985	0.12
	小計	627,834,211,527	95.71
投資証券	アメリカ	14,721,921,601	2.24
	カナダ	166,911,367	0.02
	フランス	710,423,425	0.10
	イギリス	445,108,919	0.06
	オーストラリア	1,249,488,092	0.19
	香港	396,169,200	0.06
	シンガポール	344,296,516	0.05
	小計	18,034,319,120	2.74
現金・預金・その他資産（負債控除後）		10,085,391,483	1.53
合計（純資産総額）		655,953,922,130	100.00

## その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	7,031,430,695	1.07
	買建	カナダ	371,196,496	0.05
	買建	ドイツ	1,164,537,630	0.17
	買建	イギリス	597,845,496	0.09
	買建	スイス	334,738,969	0.05

買建	オーストラリア	254,745,040	0.03
----	---------	-------------	------

## (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	34,489,024,072	66.34
	カナダ	1,889,341,822	3.63
	ドイツ	1,614,256,744	3.10
	イタリア	435,906,466	0.83
	フランス	2,041,591,873	3.92
	オランダ	677,784,695	1.30
	スペイン	520,473,075	1.00
	ベルギー	181,769,986	0.34
	オーストリア	42,304,538	0.08
	ルクセンブルグ	18,565,361	0.03
	フィンランド	171,807,383	0.33
	アイルランド	108,182,314	0.20
	ポルトガル	29,645,725	0.05
	イギリス	2,979,858,188	5.73
	スイス	1,712,000,360	3.29
	スウェーデン	489,806,382	0.94
	ノルウェー	114,164,930	0.21
	デンマーク	337,784,295	0.64
	オーストラリア	1,178,212,378	2.26
	ニュージーランド	48,715,714	0.09
	香港	566,690,622	1.09
シンガポール	208,376,930	0.40	
イスラエル	61,769,736	0.11	
小計		49,918,033,589	96.02
投資証券	アメリカ	1,154,162,361	2.22
	カナダ	10,281,566	0.01
	フランス	54,008,040	0.10
	イギリス	36,039,041	0.06
	オーストラリア	107,986,096	0.20
	香港	32,734,800	0.06
	シンガポール	29,932,772	0.05
小計		1,425,144,676	2.74
現金・預金・その他資産(負債控除後)		642,413,593	1.23
合計(純資産総額)		51,985,591,858	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	881,088,367	1.69
	買建	カナダ	50,617,704	0.09
	買建	ドイツ	142,778,560	0.27
	買建	イギリス	73,419,622	0.14
	買建	スイス	46,170,892	0.08
	買建	オーストラリア	25,474,504	0.04

## （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	5,864,575,905	14.12
	メキシコ	904,517,967	2.17
	ブラジル	2,864,987,249	6.90
	チリ	113,927,425	0.27
	コロンビア	71,144,346	0.17
	ギリシャ	123,637,241	0.29
	イギリス	18,213,102	0.04
	トルコ	204,290,312	0.49
	チェコ	57,988,244	0.13
	ハンガリー	118,073,383	0.28
	ポーランド	368,434,685	0.88
	香港	8,406,543,599	20.25
	マレーシア	747,303,103	1.80
	タイ	1,099,988,696	2.65
	フィリピン	403,884,044	0.97
	インドネシア	768,499,854	1.85
	韓国	4,712,139,601	11.35
	台湾	4,731,576,470	11.39
	インド	3,642,770,939	8.77
	パキスタン	11,445,611	0.02
	カタール	376,199,035	0.90
	エジプト	57,477,446	0.13
	南アフリカ	1,774,768,069	4.27
アラブ首長国連邦	243,722,019	0.58	
サウジアラビア	982,461,966	2.36	
小計		38,668,570,311	93.15
投資信託受益証券	アメリカ	1,618,317,662	3.89
投資証券	メキシコ	34,840,060	0.08
	南アフリカ	67,008,792	0.16
	小計	101,848,852	0.24
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,119,188,761	2.69



合計(純資産総額)	41,507,925,586	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	1,069,472,677	2.57

## (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	19,245,130,830	97.33
投資信託受益証券	アメリカ	115,782,460	0.58
投資証券	アメリカ	313,324,070	1.58
現金・預金・その他資産(負債控除後)		98,441,445	0.49
合計(純資産総額)		19,772,678,805	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	86,381,211	0.43

## (参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	563,674,654,800	79.88
地方債証券	日本	47,083,823,121	6.67
特殊債証券	日本	59,894,388,951	8.48
社債券	日本	28,355,292,200	4.01
現金・預金・その他資産(負債控除後)		6,633,303,871	0.94
合計(純資産総額)		705,641,462,943	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	297,002,417,583	48.31
	カナダ	11,436,526,362	1.86
	メキシコ	5,075,854,168	0.82
	ドイツ	32,472,565,708	5.28

	イタリア	54,860,608,643	8.92
	フランス	60,189,781,471	9.79
	オランダ	9,450,630,978	1.53
	スペイン	38,646,526,133	6.28
	ベルギー	14,201,575,773	2.31
	オーストリア	7,600,837,638	1.23
	フィンランド	3,057,324,270	0.49
	アイルランド	5,662,593,919	0.92
	イギリス	38,735,917,965	6.30
	スウェーデン	2,089,512,001	0.33
	ノルウェー	1,409,197,605	0.22
	デンマーク	3,223,976,878	0.52
	ポーランド	3,473,469,627	0.56
	オーストラリア	12,278,197,446	1.99
	シンガポール	2,516,848,703	0.40
	マレーシア	2,781,903,097	0.45
	南アフリカ	3,424,504,126	0.55
	小計	609,590,770,094	99.16
現金・預金・その他資産（負債控除後）		5,139,125,828	0.83
合計（純資産総額）		614,729,895,922	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	28,504,271,003	46.98
	カナダ	1,159,666,992	1.91
	メキシコ	512,942,251	0.84
	ドイツ	3,431,721,680	5.65
	イタリア	5,619,104,252	9.26
	フランス	5,830,359,853	9.60
	オランダ	1,067,868,425	1.76
	スペイン	3,727,174,725	6.14
	ベルギー	1,340,728,262	2.20
	オーストリア	865,966,748	1.42
	フィンランド	329,689,973	0.54
	アイルランド	671,963,053	1.10
	イギリス	4,022,083,279	6.62
	スウェーデン	194,078,069	0.31
	ノルウェー	132,493,224	0.21
	デンマーク	304,788,862	0.50
	ポーランド	377,372,548	0.62
	オーストラリア	1,254,451,760	2.06

	シンガポール	482,488,877	0.79
	南アフリカ	340,404,604	0.56
	小計	60,169,618,440	99.17
現金・預金・その他資産（負債控除後）		500,381,627	0.82
合計（純資産総額）		60,670,000,067	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	メキシコ	743,661,881	9.57
	ブラジル	737,315,653	9.48
	チリ	205,645,338	2.64
	コロンビア	471,657,857	6.07
	ペルー	286,149,549	3.68
	ウルグアイ	9,895,680	0.12
	ドミニカ共和国	16,905,607	0.21
	トルコ	308,759,903	3.97
	チェコ	297,697,935	3.83
	ハンガリー	319,300,716	4.10
	ポーランド	665,172,537	8.56
	ロシア	650,898,309	8.37
	ルーマニア	209,639,609	2.69
	マレーシア	472,874,518	6.08
	タイ	721,504,457	9.28
	フィリピン	21,841,704	0.28
	インドネシア	785,234,401	10.10
南アフリカ	666,212,742	8.57	
	小計	7,590,368,396	97.69
現金・預金・その他資産（負債控除後）		179,119,137	2.30
合計（純資産総額）		7,769,487,533	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	21,521,740,083	98.24
現金・預金・その他資産（負債控除後）		383,968,600	1.75
合計（純資産総額）		21,905,708,683	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	3,510,862,566	97.70
現金・預金・その他資産（負債控除後）		82,376,218	2.29
合計（純資産総額）		3,593,238,784	100.00

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	43,984,920,050	97.64
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,060,490,811	2.35
合計（純資産総額）		45,045,410,861	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	1,058,701,500	2.35

（参考）海外R E I Tインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	22,758,462,551	73.67
	カナダ	597,033,971	1.93
	ドイツ	81,241,411	0.26
	イタリア	7,693,642	0.02
	フランス	1,075,876,485	3.48
	オランダ	77,786,700	0.25
	スペイン	200,805,745	0.65
	ベルギー	314,403,212	1.01
	アイルランド	40,108,234	0.12
	イギリス	1,631,893,514	5.28
	オーストラリア	2,010,458,457	6.50
	ニュージーランド	129,344,494	0.41
	香港	610,707,440	1.97
	シンガポール	1,125,793,203	3.64
	韓国	4,552,590	0.01
イスラエル	25,174,800	0.08	

	小計	30,691,336,449	99.35
現金・預金・その他資産(負債控除後)		198,172,167	0.64
合計(純資産総額)		30,889,508,616	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	169,105,860	0.54

## (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	4,964,920,438	73.59
	カナダ	130,000,130	1.92
	ドイツ	17,922,882	0.26
	イタリア	1,692,601	0.02
	フランス	234,302,209	3.47
	オランダ	17,760,736	0.26
	スペイン	43,673,116	0.64
	ベルギー	68,509,229	1.01
	アイルランド	9,103,098	0.13
	イギリス	355,928,272	5.27
	オーストラリア	438,810,027	6.50
	ニュージーランド	28,627,359	0.42
	香港	133,422,100	1.97
	シンガポール	245,883,396	3.64
	イスラエル	5,244,750	0.07
	小計	6,695,800,343	99.25
現金・預金・その他資産(負債控除後)		50,155,530	0.74
合計(純資産総額)		6,745,955,873	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	132,868,890	1.96

## (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	65,655,119	1.3340	87,587,281	1.3438	88,227,348	50.09
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	21,202,433	1.1759	24,933,096	1.1953	25,343,268	14.38
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	6,091,609	1.6047	9,775,505	1.7143	10,442,845	5.92
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	4,235,676	1.9333	8,189,194	2.0751	8,789,451	4.99
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	3,733,684	2.3003	8,588,795	2.3510	8,777,891	4.98
6	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	2,367,114	2.8024	6,633,601	2.9826	7,060,154	4.00
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	4,498,617	1.2688	5,708,254	1.3766	6,192,796	3.51
8	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックス マ ザーファンド	2,057,078	2.4267	4,991,917	2.6010	5,350,459	3.03
9	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	2,251,776	1.8968	4,271,179	1.9498	4,390,512	2.49
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	1,600,019	2.3200	3,712,078	2.7333	4,373,331	2.48
11	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,781,042	1.2831	3,568,625	1.2640	3,515,237	1.99
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	2,083,950	1.2471	2,599,090	1.2674	2,641,198	1.49

## 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	99.41
合 計	99.41

## 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	19,849,864	1.3339	26,478,017	1.3438	26,674,247	38.60
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	6,583,038	1.1753	7,737,207	1.1953	7,868,705	11.38
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	2,087,265	2.8043	5,853,482	2.9826	6,225,476	9.00
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	3,580,523	1.6075	5,755,856	1.7143	6,138,090	8.88
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	2,322,078	1.9360	4,495,715	2.0751	4,818,544	6.97
6	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックス マ ザーファンド	1,343,317	2.4325	3,267,631	2.6010	3,493,967	5.05
7	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,462,381	2.3012	3,365,271	2.3510	3,438,057	4.97
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	2,013,865	1.2728	2,563,300	1.3766	2,772,286	4.01

9	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	1,234,987	1.8954	2,340,823	1.9498	2,407,977	3.48
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	772,332	2.3304	1,799,847	2.7333	2,111,015	3.05
11	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,357,330	1.2819	1,739,984	1.2640	1,715,665	2.48
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	816,174	1.2489	1,019,322	1.2674	1,034,418	1.49

## 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	99.42
合 計	99.42

## 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	56,232,279	1.3351	75,078,423	1.3438	75,564,936	28.14
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	14,024,602	2.8028	39,309,104	2.9826	41,829,777	15.58
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	16,228,902	1.6044	26,037,651	1.7143	27,821,206	10.36
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	18,864,087	1.1738	22,143,682	1.1953	22,548,243	8.39
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	8,377,598	1.9410	16,261,105	2.0751	17,384,353	6.47
6	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックスマ ザーファンド	6,241,531	2.4312	15,174,747	2.6010	16,234,222	6.04
7	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	6,801,551	2.2979	15,629,957	2.3510	15,990,446	5.95
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	10,784,226	1.2715	13,713,165	1.3766	14,845,565	5.52
9	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	8,451,251	1.2776	10,798,095	1.2640	10,682,381	3.97
10	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	4,791,503	1.8972	9,090,499	1.9498	9,342,472	3.47
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	3,414,871	2.3377	7,983,042	2.7333	9,333,866	3.47
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	4,218,056	1.2469	5,259,841	1.2674	5,345,964	1.99

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.41
合 計	99.41

## インデックス・ブレンド(タイプ)

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	4,377,706	2.7764	12,154,611	2.9826	13,056,945	20.49
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA-BPI総 合マザーファンド	9,610,115	1.3351	12,831,395	1.3438	12,914,072	20.26
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	4,397,091	1.5990	7,030,949	1.7143	7,537,933	11.83
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	1,973,925	2.4284	4,793,658	2.6010	5,134,178	8.05
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	3,013,458	1.2633	3,806,902	1.3766	4,148,326	6.51
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,615,845	2.2961	3,710,203	2.3510	3,798,851	5.96
7	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	3,163,970	1.1755	3,719,379	1.1953	3,781,893	5.93
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	1,680,520	1.9281	3,240,296	2.0751	3,487,247	5.47
9	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,258,409	1.2816	2,894,484	1.2640	2,854,628	4.48
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	1,036,497	2.3494	2,435,154	2.7333	2,833,057	4.44
11	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	1,302,279	1.8923	2,464,303	1.9498	2,539,183	3.98
12	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデ ックスマザーファンド	1,002,188	1.2470	1,249,790	1.2674	1,270,173	1.99

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.43
合計	99.43

## インデックス・ブレンド(タイプ)

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	21,933,990	2.7910	61,217,767	2.9826	65,420,318	28.99
2	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	20,065,744	1.6001	32,108,029	1.7143	34,398,704	15.24
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	14,904,858	1.3360	19,914,215	1.3438	20,029,148	8.87
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	7,427,697	2.4283	18,037,138	2.6010	19,319,439	8.56
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	13,935,269	1.2650	17,628,116	1.3766	19,183,291	8.50
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	6,185,092	2.2973	14,209,279	2.3510	14,541,151	6.44
7	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	4,890,976	2.3608	11,546,639	2.7333	13,368,504	5.92
8	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	9,750,508	1.2848	12,528,018	1.2640	12,324,642	5.46
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	4,862,555	1.9376	9,421,786	2.0751	10,090,287	4.47
10	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデ ックスマザーファンド	4,427,303	1.2474	5,522,896	1.2674	5,611,163	2.48



11	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファン ド	4,656,425	1.1752	5,472,646	1.1953	5,565,824	2.46
12	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	2,294,991	1.8991	4,358,505	1.9498	4,474,773	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	99.41
合計	99.41

## (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	2,067,400	6,602.49	13,650,005,265	7,638.00	15,790,801,200	3.47
2	日本	株式	ソニー	電気機器	1,172,600	5,479.76	6,425,573,080	6,904.00	8,095,630,400	1.78
3	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	12,596,300	525.49	6,619,301,341	578.10	7,281,921,030	1.60
4	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,543,600	4,233.63	6,535,046,428	4,455.00	6,876,738,000	1.51
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,216,800	4,783.75	5,820,879,156	5,527.00	6,725,253,600	1.48
6	日本	株式	キーエンス	電気機器	168,100	33,286.26	5,595,421,600	37,440.00	6,293,664,000	1.38
7	日本	株式	ソフトバンクグル ープ	情報・通信業	1,444,500	5,344.93	7,720,762,748	4,253.00	6,143,458,500	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	1,265,500	3,862.87	4,888,462,320	3,989.00	5,048,079,500	1.11
9	日本	株式	リクルートホール ディングス	サービス業	1,269,900	3,291.56	4,179,959,346	3,962.00	5,031,343,800	1.10
10	日本	株式	任天堂	その他製品	113,800	37,386.99	4,254,640,291	42,350.00	4,819,430,000	1.06
11	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,460,700	2,827.92	4,130,744,000	3,067.00	4,479,966,900	0.98
12	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,356,700	2,585.58	3,507,859,252	3,139.00	4,258,681,300	0.93
13	日本	株式	みずほフィナンシャル グループ	銀行業	24,864,500	166.85	4,148,675,740	169.20	4,207,073,400	0.92
14	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,344,800	2,515.04	3,382,236,239	3,003.00	4,038,434,400	0.88
15	日本	株式	東京海上ホールディ ングス	保険業	654,300	5,490.44	3,592,399,620	5,952.00	3,894,393,600	0.85
16	日本	株式	日立製作所	電気機器	891,500	3,754.29	3,346,951,360	4,300.00	3,833,450,000	0.84
17	日本	株式	花王	化学	444,200	8,393.31	3,728,312,280	8,612.00	3,825,450,400	0.84
18	日本	株式	HOYA	精密機器	373,500	7,833.59	2,925,847,187	9,990.00	3,731,265,000	0.82
19	日本	株式	ダイキン工業	機械	236,400	13,656.07	3,228,295,808	15,745.00	3,722,118,000	0.81
20	日本	株式	ファナック	電気機器	176,300	19,240.10	3,392,031,302	20,905.00	3,685,551,500	0.81
21	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,282,200	2,830.10	3,628,761,528	2,866.00	3,674,785,200	0.80
22	日本	株式	信越化学工業	化学	312,000	9,658.00	3,013,296,000	11,710.00	3,653,520,000	0.80
23	日本	株式	第一三共	医薬品	530,900	5,649.34	2,999,239,002	6,862.00	3,643,035,800	0.80
24	日本	株式	日本電産	電気機器	223,300	14,851.75	3,316,396,781	16,190.00	3,615,227,000	0.79
25	日本	株式	村田製作所	電気機器	545,000	5,029.39	2,741,019,449	6,344.00	3,457,480,000	0.76
26	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	154,300	22,145.06	3,416,983,458	22,095.00	3,409,258,500	0.75
27	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	326,500	9,943.97	3,246,708,988	10,070.00	3,287,855,000	0.72

28	日本	株式	三井物産	卸売業	1,606,100	1,679.85	2,698,014,116	1,939.50	3,115,030,950	0.68
29	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,278,100	1,980.57	2,531,367,542	2,388.00	3,052,102,800	0.67
30	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,632,000	1,459.02	2,381,129,584	1,867.50	3,047,760,000	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	0.09
		鉱業	0.27
		建設業	2.71
		食料品	3.82
		繊維製品	0.57
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.99
		医薬品	5.89
		石油・石炭製品	0.49
		ゴム製品	0.74
		ガラス・土石製品	0.83
		鉄鋼	0.75
		非鉄金属	0.74
		金属製品	0.57
		機械	5.00
		電気機器	13.91
		輸送用機器	7.66
		精密機器	2.29
		その他製品	2.28
		電気・ガス業	1.51
		陸運業	4.46
		海運業	0.16
		空運業	0.50
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	8.37
		卸売業	4.85
		小売業	4.57
		銀行業	5.73
		証券、商品先物取引業	0.81
		保険業	2.24
その他金融業	1.14		
不動産業	2.36		
サービス業	5.02		
合計		97.93	

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	665,900	20,984.02	13,973,263,446	29,344.55	19,540,536,111	2.97
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,068,800	13,105.56	14,007,230,223	16,688.17	17,836,325,929	2.71
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	61,970	195,099.03	12,090,287,097	199,235.95	12,346,652,169	1.88
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	354,300	18,432.37	6,530,590,250	22,131.12	7,841,055,816	1.19
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	470,800	11,211.27	5,278,268,176	14,468.49	6,811,766,787	1.03
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	46,030	128,758.19	5,926,739,891	143,851.18	6,621,470,018	1.00
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	44,150	129,130.70	5,701,120,529	143,756.96	6,346,869,908	0.96
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	388,600	15,213.50	5,911,966,722	15,091.89	5,864,708,454	0.89
9	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	254,200	17,284.18	4,393,639,979	20,199.57	5,134,732,524	0.78
10	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	438,100	10,523.79	4,610,475,027	11,439.62	5,011,699,274	0.76
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	368,400	11,555.29	4,256,970,015	13,340.02	4,914,465,431	0.74
12	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,301,600	3,032.62	3,947,259,233	3,661.49	4,765,802,152	0.72
13	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	623,700	8,737.41	5,449,522,617	7,526.77	4,694,447,696	0.71
14	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	194,100	22,071.70	4,284,118,094	24,157.98	4,689,063,918	0.71
15	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気 通信サー ビス	1,075,700	3,480.72	3,744,211,795	4,126.02	4,438,370,041	0.67
16	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	265,200	12,417.53	3,293,129,062	16,596.14	4,401,298,662	0.67
17	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	139,500	26,948.47	3,759,312,011	30,750.20	4,289,653,625	0.65
18	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術 サービス	132,900	26,128.96	3,472,539,369	31,958.65	4,247,304,851	0.64
19	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・ 半導体製 造装置	652,000	5,837.35	3,805,956,633	6,410.35	4,179,551,851	0.63
20	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	609,500	6,467.32	3,941,835,685	6,584.55	4,013,286,882	0.61
21	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売 り	161,200	21,262.30	3,427,484,243	24,431.88	3,938,419,056	0.60
22	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	615,900	5,293.93	3,260,537,153	5,953.49	3,666,754,737	0.55
23	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	376,700	9,115.39	3,433,768,167	9,598.55	3,615,774,388	0.55
24	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	279,300	13,437.53	3,753,103,247	12,935.74	3,612,954,752	0.55

25	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	597,100	5,198.62	3,104,097,196	5,910.76	3,529,315,990	0.53
26	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	103,510	30,112.64	3,116,959,780	33,891.11	3,508,069,831	0.53
27	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	813,700	4,593.85	3,738,016,396	4,232.30	3,443,824,788	0.52
28	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	667,200	4,418.55	2,948,059,762	4,866.65	3,247,032,349	0.49
29	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品	316,400	9,272.34	2,933,770,654	10,127.85	3,204,452,120	0.48
30	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	78,740	41,574.73	3,273,594,492	40,318.07	3,174,645,619	0.48

## 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	3.36
		メディア	1.24
		娯楽	1.35
		不動産管理・開発	0.49
		エネルギー設備・サービス	0.26
		石油・ガス・消耗燃料	4.85
		化学	2.22
		建設資材	0.29
		容器・包装	0.29
		金属・鉱業	1.32
		紙製品・林産品	0.09
		航空宇宙・防衛	2.35
		建設関連製品	0.40
		建設・土木	0.32
		電気設備	0.74
		コングロマリット	1.31
		機械	1.62
		商社・流通業	0.28
		商業サービス・用品	0.45
		航空貨物・物流サービス	0.54
		旅客航空輸送業	0.11
		海運業	0.05
		陸運・鉄道	0.99
		運送インフラ	0.20
		自動車部品	0.28
		自動車	0.80
		家庭用耐久財	0.40
		レジャー用品	0.04
		繊維・アパレル・贅沢品	1.46
		ホテル・レストラン・レジャー	1.75
販売	0.06		
インターネット販売・通信販売	2.40		
複合小売り	0.51		

専門小売り	1.68
食品・生活必需品小売り	1.51
飲料	1.95
食品	1.92
タバコ	0.84
家庭用品	1.34
パーソナル用品	0.69
ヘルスケア機器・用品	2.82
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.02
バイオテクノロジー	1.84
医薬品	5.41
銀行	7.64
各種金融サービス	0.98
保険	3.78
情報技術サービス	4.17
ソフトウェア	5.44
通信機器	0.73
コンピュータ・周辺機器	3.24
電子装置・機器・部品	0.54
半導体・半導体製造装置	3.21
各種電気通信サービス	2.07
無線通信サービス	0.27
電力	1.99
ガス	0.19
総合公益事業	1.06
水道	0.11
消費者金融	0.47
資本市場	2.92
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	0.78
専門サービス	0.75
投資証券	2.74
合計	98.46

## (参考) 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コンピ ュー タ・周 辺機 器	52,860	22,096.06	1,167,997,774	29,344.55	1,551,152,934	2.98
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウ ェア	84,830	13,845.09	1,174,479,596	16,688.17	1,415,658,242	2.72

3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	4,922	206,620.17	1,016,984,489	199,235.95	980,639,373	1.88
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	28,300	20,565.30	581,998,126	22,131.12	626,310,696	1.20
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	37,280	12,349.60	460,393,207	14,468.49	539,385,441	1.03
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3,694	127,613.28	471,403,459	143,851.18	531,386,275	1.02
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3,530	128,154.25	452,384,510	143,756.96	507,462,079	0.97
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	30,750	15,102.84	464,412,514	15,091.88	464,075,617	0.89
9	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	20,100	17,684.07	355,450,000	20,199.57	406,011,502	0.78
10	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	34,660	10,731.09	371,939,621	11,439.62	396,497,368	0.76
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	29,610	11,582.25	342,950,477	13,340.02	394,998,158	0.75
12	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	102,900	3,247.35	334,153,179	3,661.49	376,767,856	0.72
13	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	50,000	8,336.60	416,830,137	7,526.77	376,338,600	0.72
14	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	15,350	22,826.28	350,383,516	24,157.98	370,824,993	0.71
15	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	86,200	3,393.52	292,521,664	4,126.02	355,663,752	0.68
16	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	21,280	14,651.64	311,786,927	16,596.14	353,166,046	0.67
17	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	11,050	26,005.16	287,357,035	30,750.20	339,789,767	0.65
18	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	10,500	27,193.88	285,535,820	31,958.65	335,565,846	0.64
19	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	51,500	5,144.93	264,964,286	6,410.35	330,133,313	0.63
20	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	48,900	6,208.67	303,604,142	6,584.55	321,984,788	0.61
21	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	13,000	21,568.44	280,389,756	24,431.88	317,614,440	0.61
22	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	49,700	5,108.78	253,906,505	5,953.49	295,888,473	0.56
23	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	30,500	8,653.03	263,917,657	9,598.55	292,755,824	0.56
24	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	22,530	13,238.16	298,255,812	12,935.74	291,442,429	0.56
25	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	48,000	5,269.13	252,918,461	5,910.76	283,716,576	0.54
26	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	8,280	28,727.73	237,865,664	33,891.12	280,618,474	0.53
27	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	64,600	4,419.65	285,509,416	4,232.30	273,406,761	0.52
28	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	52,700	4,705.60	247,985,225	4,866.65	256,472,729	0.49
29	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品	25,300	9,023.05	228,283,176	10,127.85	256,234,635	0.49
30	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	6,220	38,779.85	241,210,715	40,318.08	250,778,458	0.48

## 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	3.38

メディア	1.22
娯楽	1.38
不動産管理・開発	0.46
エネルギー設備・サービス	0.26
石油・ガス・消耗燃料	4.88
化学	2.22
建設資材	0.29
容器・包装	0.28
金属・鉱業	1.30
紙製品・林産品	0.09
航空宇宙・防衛	2.38
建設関連製品	0.39
建設・土木	0.32
電気設備	0.73
コングロマリット	1.32
機械	1.61
商社・流通業	0.27
商業サービス・用品	0.47
航空貨物・物流サービス	0.54
旅客航空輸送業	0.11
海運業	0.05
陸運・鉄道	0.97
運送インフラ	0.20
自動車部品	0.29
自動車	0.80
家庭用耐久財	0.41
レジャー用品	0.04
繊維・アパレル・贅沢品	1.47
ホテル・レストラン・レジャー	1.78
販売	0.07
インターネット販売・通信販売	2.42
複合小売り	0.51
専門小売り	1.68
食品・生活必需品小売り	1.52
飲料	1.94
食品	1.94
タバコ	0.84
家庭用品	1.38
パーソナル用品	0.69
ヘルスケア機器・用品	2.84
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.99
バイオテクノロジー	1.84
医薬品	5.46

	銀行	7.68
	各種金融サービス	0.97
	保険	3.79
	情報技術サービス	4.21
	ソフトウェア	5.41
	通信機器	0.73
	コンピュータ・周辺機器	3.26
	電子装置・機器・部品	0.49
	半導体・半導体製造装置	3.21
	各種電気通信サービス	2.09
	無線通信サービス	0.27
	電力	2.02
	ガス	0.18
	総合公益事業	1.05
	水道	0.10
	消費者金融	0.46
	資本市場	2.96
	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	0.77
	専門サービス	0.77
投資証券		2.74
合 計		98.76

## (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	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネット販 売・通信販 売	106,190	19,547.63	2,075,762,943	22,001.83	2,336,375,305	5.62
2	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	1,548,000	917.60	1,420,450,992	1,111.10	1,719,990,540	4.14
3	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	360,400	5,220.46	1,881,453,784	4,732.00	1,705,412,800	4.10
4	アメリカ	投資信託受 益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF		525,100	2,980.16	1,564,883,198	3,081.92	1,618,317,662	3.89



5	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピューター・周辺機器	299,470	3,968.75	1,188,524,527	4,776.02	1,430,277,704	3.44
6	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,004,000	89.74	538,798,960	89.60	537,958,400	1.29
7	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	351,000	1,218.14	427,567,140	1,264.90	443,979,900	1.06
8	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	177,700	1,939.09	344,576,470	2,433.66	432,461,737	1.04
9	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インターネット販売・通信販売	27,350	18,485.09	505,567,403	15,733.99	430,324,651	1.03
10	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	102,000	2,982.81	304,246,681	3,557.01	362,815,530	0.87
11	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信サービス	386,000	1,014.72	391,681,920	844.20	325,861,200	0.78
12	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,046,000	76.86	310,975,560	80.36	325,136,560	0.78
13	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	330,500	560.94	185,393,050	865.52	286,055,682	0.68
14	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	686,300	388.27	266,475,895	401.91	275,836,030	0.66
15	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	300,691	849.68	255,491,129	899.60	270,501,624	0.65
16	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	33,870	7,019.83	237,761,747	7,708.68	261,092,992	0.62
17	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	196,421	1,263.33	248,146,506	1,309.61	257,236,870	0.61
18	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガス・消耗燃料	24,370	8,821.77	214,986,564	10,452.02	254,715,825	0.61
19	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	772,649	299.72	231,585,389	322.38	249,088,130	0.60
20	インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	295,600	682.55	201,764,172	799.49	236,329,540	0.56
21	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	210,800	1,110.26	234,043,440	1,080.84	227,842,969	0.54
22	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	17,100	16,973.03	290,238,902	13,093.51	223,899,117	0.53

23	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,912,000	48.58	238,624,960	44.94	220,745,280	0.53
24	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PEF	銀行	249,215	911.56	227,174,426	863.46	215,187,184	0.51
25	ブラジル	株式	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	石油・ガス・消耗燃料	259,300	696.80	180,680,240	767.78	199,085,354	0.47
26	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	50,820	3,237.27	164,518,224	3,882.26	197,296,961	0.47
27	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガス・消耗燃料	1,101,000	185.22	203,927,220	164.36	180,960,360	0.43
28	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	55,500	3,339.19	185,325,455	3,199.11	177,551,104	0.42
29	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信サービス	2,074,000	76.20	158,053,733	84.63	175,537,553	0.42
30	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インターネット販売・通信販売	47,700	3,023.95	144,242,679	3,631.91	173,242,298	0.41

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	5.53
		メディア	0.30
		娯楽	0.71
		不動産管理・開発	2.46
		エネルギー設備・サービス	0.08
		石油・ガス・消耗燃料	6.94
		化学	2.28
		建設資材	1.06
		容器・包装	0.04
		金属・鉱業	3.15
		紙製品・林産品	0.19
		航空宇宙・防衛	0.12
		建設関連製品	0.02
		建設・土木	0.58
		電気設備	0.20
コングロマリット	1.27		

機械	0.52
商社・流通業	0.04
商業サービス・用品	0.18
航空貨物・物流サービス	0.16
旅客航空輸送業	0.21
海運業	0.08
陸運・鉄道	0.32
運送インフラ	0.89
自動車部品	0.44
自動車	1.69
家庭用耐久財	0.29
レジャー用品	0.08
繊維・アパレル・贅沢品	0.85
ホテル・レストラン・レジャー	0.68
インターネット販売・通信販売	7.87
複合小売り	0.58
専門小売り	0.51
食品・生活必需品小売り	1.56
飲料	1.00
食品	1.79
タバコ	0.44
家庭用品	0.46
パーソナル用品	0.63
ヘルスケア機器・用品	0.10
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.51
バイオテクノロジー	0.32
医薬品	1.12
銀行	15.68
各種金融サービス	0.68
保険	3.79
情報技術サービス	1.48
ソフトウェア	0.13
通信機器	0.11
コンピュータ・周辺機器	4.86
電子装置・機器・部品	1.94
半導体・半導体製造装置	5.87

	各種電気通信サービス	1.40
	無線通信サービス	2.59
	電力	1.05
	ガス	0.60
	総合公益事業	0.05
	水道	0.23
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.90
	消費者金融	0.30
	資本市場	1.29
	各種消費者サービス	0.66
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.55
	ヘルスケア・テクノロジー	0.09
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.31
	専門サービス	0.02
	その他の業種	0.00
投資信託受益証券		3.89
投資証券		0.24
合 計		97.30

## (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	LEGGETT & PLATT INC	家庭用耐久財	68,100	4,619.03	314,556,401	5,765.04	392,599,714	1.98
2	アメリカ	株式	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	39,240	8,232.27	323,034,352	9,677.43	379,742,542	1.92
3	アメリカ	株式	TARGET CORP	複合小売り	27,340	9,533.71	260,651,643	13,793.60	377,117,133	1.90
4	アメリカ	株式	AIR PRODUCTS	化学	14,250	22,446.31	319,860,003	25,860.54	368,512,729	1.86
5	アメリカ	株式	CARDINAL HEALTH INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	60,650	5,092.96	308,888,556	6,049.90	366,926,629	1.85
6	アメリカ	株式	WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	食品・生活必需品小売り	55,350	5,924.49	327,920,563	6,585.65	364,515,816	1.84
7	アメリカ	株式	HORMEL FOODS CORP	食品	73,700	4,446.80	327,729,895	4,917.05	362,386,791	1.83
8	アメリカ	株式	ILLINOIS TOOL WORKS INC	機械	18,820	17,190.99	323,534,602	19,185.05	361,062,671	1.82
9	アメリカ	株式	ROPER TECHNOLOGIES INC	コングロマリット	9,070	38,331.88	347,670,166	39,748.36	360,517,698	1.82

10	アメリカ	株式	T ROWE PRICE GROUP INC	資本市場	26,590	11,748.19	312,384,408	13,553.66	360,392,022	1.82
11	アメリカ	株式	CATERPILLAR INC DEL	機械	22,520	15,106.85	340,206,271	15,961.79	359,459,655	1.81
12	アメリカ	株式	DOVER CORP	機械	29,230	10,689.15	312,444,074	12,281.67	358,993,390	1.81
13	アメリカ	株式	STANLEY BLACK & DECKER INC	機械	20,580	15,872.30	326,651,978	17,398.12	358,053,474	1.81
14	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	23,640	14,855.27	351,178,793	15,091.89	356,772,280	1.80
15	アメリカ	株式	NUCOR CORP	金属・鉱業	57,180	6,089.98	348,225,241	6,179.18	353,325,741	1.78
16	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	資本市場	12,130	24,595.82	298,347,339	29,088.17	352,839,623	1.78
17	アメリカ	株式	LOWES COS INC	専門小売り	27,180	12,097.30	328,804,712	12,978.47	352,755,021	1.78
18	アメリカ	株式	MEDTRONIC PLC	ヘルスケア機器・用品	28,620	9,838.46	281,576,815	12,322.21	352,661,742	1.78
19	アメリカ	株式	LINDE PLC	化学	15,620	20,238.08	316,118,924	22,569.35	352,533,403	1.78
20	アメリカ	株式	EMERSON ELEC	電気設備	43,130	7,626.64	328,937,181	8,155.64	351,753,029	1.77
21	アメリカ	株式	PENTAIR PLC	機械	72,400	4,164.51	301,510,873	4,857.89	351,711,265	1.77
22	アメリカ	株式	BECTON, DICKINSON	ヘルスケア機器・用品	12,260	25,798.32	316,287,416	28,529.42	349,770,738	1.76
23	アメリカ	株式	MCCORMICK & CO INC.	食品	18,840	17,081.67	321,818,717	18,562.75	349,722,225	1.76
24	アメリカ	株式	ARCHER DANIELS MIDLAND	食品	74,300	4,593.34	341,285,645	4,704.50	349,544,826	1.76
25	アメリカ	株式	AUTOMATIC DATA PROCESS	情報技術サービス	18,540	17,876.93	331,438,316	18,787.34	348,317,447	1.76
26	アメリカ	株式	3M CORP	コングロマリット	18,620	21,228.98	395,283,638	18,692.03	348,045,628	1.76
27	アメリカ	株式	BROWN-FORMAN CORP-CL B	飲料	46,090	5,957.18	274,566,497	7,528.96	347,009,914	1.75
28	アメリカ	株式	ABBOTT LABORATORIES	ヘルスケア機器・用品	37,040	8,449.86	312,983,032	9,358.61	346,643,107	1.75
29	アメリカ	株式	PPG INDUSTRIES	化学	24,390	12,988.68	316,794,132	14,154.05	345,217,436	1.74
30	アメリカ	株式	GENERAL DYNAMICS	航空宇宙・防衛	17,250	19,454.55	335,591,155	19,978.26	344,625,089	1.74

## 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	3.33
		化学	8.72
		金属・鉱業	1.78
		航空宇宙・防衛	3.47
		建設関連製品	1.59
		電気設備	1.77
		コングロマリット	3.58
		機械	9.04
		商社・流通業	1.69
		商業サービス・用品	1.59
		家庭用耐久財	1.98
		繊維・アパレル・贅沢品	1.63
		ホテル・レストラン・レジャー	1.67
販売	1.68		

	複合小売り	1.90
	専門小売り	1.78
	食品・生活必需品小売り	5.22
	飲料	5.05
	食品	5.36
	家庭用品	6.61
	ヘルスケア機器・用品	5.30
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.85
	バイオテクノロジー	1.92
	医薬品	1.80
	銀行	1.63
	保険	4.97
	情報技術サービス	1.76
	各種電気通信サービス	1.70
	総合公益事業	1.53
	資本市場	5.26
投資信託受益証券		0.58
投資証券		1.58
合計		99.50

## (参考) 国内債券NOMURA - B P I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 34回	7,600,000,000	104.14	7,914,972,000	103.60	7,873,600,000	0.6	2024/6/20	1.11
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	7,500,000,000	100.83	7,562,325,000	100.58	7,543,950,000	0.1	2021/12/20	1.06
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	7,000,000,000	100.75	7,052,810,000	100.51	7,035,980,000	0.1	2021/9/20	0.99
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 51回	6,600,000,000	102.65	6,774,950,000	102.20	6,745,728,000	0.1	2028/6/20	0.95
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	6,450,000,000	102.10	6,585,450,000	102.27	6,596,479,500	0.1	2028/3/20	0.93
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	6,400,000,000	102.36	6,551,204,000	101.99	6,527,360,000	0.1	2026/6/20	0.92
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 3回	6,200,000,000	101.25	6,277,820,000	100.90	6,255,862,000	0.1	2022/9/20	0.88
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 53回	6,100,000,000	102.88	6,275,960,000	102.10	6,228,466,000	0.1	2028/12/20	0.88
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	6,000,000,000	103.74	6,224,664,000	103.06	6,183,660,000	0.3	2025/12/20	0.87
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 7回	6,000,000,000	101.58	6,095,130,000	101.11	6,066,600,000	0.1	2023/9/20	0.85

11	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	100.35	6,021,000,000	0.1	2021/3/20	0.85
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 8回	5,900,000,000	101.43	5,984,760,000	101.18	5,969,797,000	0.1	2023/12/20	0.84
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	5,500,000,000	102.50	5,637,920,000	102.29	5,626,280,000	0.1	2027/9/20	0.79
14	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	103.22	5,574,042,000	0.6	2023/12/20	0.78
15	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	102.22	5,519,934,000	0.1	2027/3/20	0.78
16	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	103.55	5,488,362,000	0.8	2023/6/20	0.77
17	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	102.03	5,407,696,000	0.1	2026/9/20	0.76
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	5,200,000,000	103.95	5,405,912,000	103.34	5,373,784,000	0.5	2024/9/20	0.76
19	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	100.43	5,222,568,000	0.1	2021/6/20	0.74
20	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	102.63	5,131,850,000	0.6	2023/3/20	0.72
21	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	102.28	5,114,300,000	0.1	2027/12/20	0.72
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	5,000,000,000	102.27	5,113,500,000	102.14	5,107,250,000	0.1	2026/12/20	0.72
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 47回	4,200,000,000	122.12	5,129,262,000	121.37	5,097,540,000	1.6	2033/12/20	0.72
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	4,900,000,000	102.62	5,028,636,000	102.25	5,010,691,000	0.1	2027/6/20	0.71
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	4,800,000,000	101.99	4,895,793,000	102.13	4,902,624,000	0.1	2028/9/20	0.69
26	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	100.66	4,832,064,000	0.1	2022/3/20	0.68
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 50回	3,830,000,000	120.08	4,599,276,000	119.13	4,562,793,900	1.4	2034/9/20	0.64
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 5回	4,500,000,000	101.19	4,553,920,000	101.01	4,545,540,000	0.1	2023/3/20	0.64
29	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	102.78	4,522,584,000	0.8	2022/9/20	0.64
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 9回	4,400,000,000	102.04	4,489,936,000	101.25	4,455,264,000	0.1	2024/3/20	0.63

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.88
地方債証券	6.67
特殊債券	8.48

社債券	4.01
合計	99.05

## (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 BOND	72,200,000	13,522.53	9,763,269,142	13,736.08	9,917,453,370	6	2026/2/15	1.61
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,000,000	11,121.15	8,896,925,766	11,151.58	8,921,265,704	2.5	2022/1/15	1.45
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,900.36	7,662,955,358	11,301.79	7,945,164,521	2.25	2025/11/15	1.29
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	69,200,000	10,806.99	7,478,442,893	10,990.23	7,605,244,350	1.75	2022/4/30	1.23
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	49,300,000	13,689.64	6,748,995,678	14,124.68	6,963,467,818	5.25	2028/11/15	1.13
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	43,300,000	13,966.67	6,047,568,141	14,265.91	6,177,139,284	5.5	2028/8/15	1.00
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,800,000	11,209.62	5,470,296,304	11,208.50	5,469,748,896	3.625	2021/2/15	0.88
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,400,000	10,241.79	4,752,192,265	11,605.65	5,385,024,772	2.5	2045/2/15	0.87
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	10,766.83	5,157,314,918	11,000.50	5,269,243,691	1.75	2023/1/31	0.85
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,900,000	10,781.38	5,056,471,324	11,142.59	5,225,877,019	2	2025/2/15	0.85
11	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,065.30	5,137,270,267	15,067.11	5,137,887,085	3.5	2026/4/25	0.83
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	11,006.39	4,963,885,318	11,316.77	5,103,866,785	2.375	2024/8/15	0.83
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,400,000	11,143.61	5,059,200,734	11,182.39	5,076,807,729	3.125	2021/5/15	0.82
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	35,600,000	13,605.98	4,843,729,770	14,209.41	5,058,552,866	5.25	2029/2/15	0.82
15	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	18,251.29	4,927,850,055	18,495.30	4,993,731,194	5.5	2029/4/25	0.81
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,730.35	4,939,378,967	12,772.72	4,955,818,156	6.25	2023/8/15	0.80
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,800,000	11,027.93	4,940,512,883	11,054.00	4,952,194,109	2.625	2020/11/15	0.80
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	34,100,000	14,056.20	4,793,165,932	14,404.57	4,911,959,023	6.5	2026/11/15	0.79
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	32,700,000	14,566.31	4,763,184,544	14,942.95	4,886,347,077	5.375	2031/2/15	0.79
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,374.14	4,845,387,413	11,423.34	4,866,343,872	2.75	2023/11/15	0.79
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	10,866.16	4,639,850,661	11,197.80	4,781,461,542	2.125	2024/9/30	0.77
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,100,000	11,335.62	4,658,942,239	11,391.24	4,681,801,543	2.75	2023/7/31	0.76
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	11,245.30	4,149,518,035	12,665.30	4,673,498,251	3	2044/11/15	0.76
24	イギリス	国債証券	UK TREASURY	21,340,000	19,596.48	4,181,889,472	21,183.55	4,520,569,997	3.5	2045/1/22	0.73
25	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	21,700,000	18,719.68	4,062,172,698	20,197.64	4,382,889,073	3.25	2044/1/22	0.71



26	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	30,400,000	13,773.78	4,187,232,100	13,917.29	4,230,856,738	5.5	2022/11/1	0.68
27	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000	20,145.76	4,049,298,845	20,871.36	4,195,144,865	5.75	2032/10/25	0.68
28	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,700,000	17,604.22	3,644,073,636	19,610.32	4,059,336,588	3.25	2045/5/25	0.66
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	27,900,000	14,193.76	3,960,060,486	14,544.94	4,058,039,840	6.125	2027/11/15	0.66
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,000,000	11,146.87	3,901,405,634	11,492.24	4,022,285,647	2.625	2025/3/31	0.65

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	99.16
合計	99.16

## (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	11,071.12	680,874,093	11,038.59	678,873,800	2.125	2021/8/15	1.11
2	イギリス	国債証券	UK TREASURY	2,180,000	24,494.89	533,988,602	24,088.93	525,138,783	4.25	2046/12/7	0.86
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	4,500,000	11,416.96	513,763,635	11,316.77	509,255,001	2.375	2024/8/15	0.83
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	12,001.95	504,082,113	11,804.23	495,777,842	2.75	2028/2/15	0.81
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	3,450,000	14,627.97	504,665,011	14,176.03	489,073,291	3.75	2043/11/15	0.80
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,370.22	494,808,893	12,194.54	487,781,673	3.125	2028/11/15	0.80
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	11,038.17	463,603,140	10,903.35	457,941,108	1.625	2026/5/15	0.75
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,389.10	455,564,153	11,269.27	450,770,947	2.25	2024/11/15	0.74
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,233.32	449,332,950	11,128.47	445,138,862	2	2024/6/30	0.73
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,080.53	443,221,518	11,057.00	442,280,047	2.375	2021/4/15	0.72
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,861.84	434,473,853	10,851.57	434,063,047	1.125	2021/8/31	0.71
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	10,950.00	416,100,311	10,808.77	410,733,593	1.5	2026/8/15	0.67
13	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,010,000	13,772.90	414,564,575	13,561.86	408,212,134	2.25	2024/5/25	0.67
14	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000	13,420.46	416,034,294	13,103.30	406,202,591	2.2	2027/6/1	0.66
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,700,000	10,906.35	403,535,137	10,908.06	403,598,497	1.375	2021/4/30	0.66
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	11,980.55	407,338,935	11,622.77	395,174,370	2.5	2046/5/15	0.65
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,580,000	11,007.35	394,063,354	10,996.65	393,680,307	2	2021/2/28	0.64
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	11,224.76	392,866,734	11,124.19	389,346,725	2	2024/4/30	0.64
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	11,566.28	393,253,628	11,449.44	389,281,245	2.75	2024/2/15	0.64
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,180,000	18,721.59	408,130,826	17,788.23	387,783,434	4.75	2044/9/1	0.63
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	11,058.71	387,054,937	11,032.60	386,141,229	2.125	2021/6/30	0.63
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	2,680,000	14,685.74	393,578,010	14,404.57	386,042,526	6.5	2026/11/15	0.63

23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,020,000	13,115.52	396,088,990	12,725.22	384,301,736	3	2045/11/15	0.63
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	10,866.98	380,344,388	10,810.91	378,382,146	1.25	2023/7/31	0.62
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	11,030.46	375,035,835	10,991.52	373,711,732	1.75	2022/5/31	0.61
26	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,800,000	13,211.84	369,931,532	13,047.05	365,317,517	1.75	2023/5/25	0.60
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	11,547.45	369,518,463	11,371.12	363,876,141	2.25	2027/8/15	0.59
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	13,201.98	369,655,440	12,812.52	358,750,789	3	2048/2/15	0.59
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	11,027.89	352,892,760	10,989.38	351,660,219	1.75	2022/3/31	0.57
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,760,000	12,809.96	353,554,897	12,426.50	342,971,431	2.875	2045/8/15	0.56

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.17
合計	99.17

## (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	9,140,000,000	3.86	352,866,882	3.90	356,563,116	9.85	2027/6/28	4.58
2	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	6,800,000	2,802.60	190,577,453	2,809.22	191,027,450	1.75	2021/7/25	2.45
3	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000	2,808.26	171,319,441	2,985.85	182,137,112	10	2023/1/1	2.34
4	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5,600,000	2,848.40	159,510,730	2,886.93	161,668,218	2.5	2024/4/25	2.08
5	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5,250,000	2,838.90	149,042,544	2,978.78	156,386,202	2.75	2028/4/25	2.01
6	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	59,000,000	168.10	99,179,914	185.37	109,373,840	7.75	2026/9/16	1.40
7	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,300,000	828.30	110,164,247	822.09	109,338,134	10.5	2026/12/21	1.40
8	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	376,000	2,762.12	103,857,066	2,843.56	106,918,010	10	2021/1/1	1.37
9	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000	2,887.92	101,077,381	2,901.90	101,566,846	2.5	2026/7/25	1.30
10	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000	2,880.88	92,189,468	3,146.46	100,687,034	10	2027/1/1	1.29
11	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	20,900,000	448.21	93,676,141	460.28	96,199,103	1	2026/6/26	1.23
12	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	311,000	2,902.76	90,279,459	3,075.71	95,654,817	10	2025/1/1	1.23
13	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	20,200,000	421.96	85,235,960	449.58	90,815,160	0.95	2030/5/15	1.16
14	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3,300,000	2,620.17	86,465,830	2,713.52	89,546,311	3.899	2027/11/16	1.15
15	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000	385.08	83,563,263	390.20	84,674,488	3.625	2023/6/16	1.08
16	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,000,000	361.27	83,093,330	367.03	84,417,239	1.875	2022/6/17	1.08
17	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	13,500,000	557.81	75,305,528	582.93	78,696,598	8	2023/12/7	1.01
18	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	17,200,000	446.95	76,876,730	456.49	78,516,562	0.45	2023/10/25	1.01
19	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,230,000,000	0.79	73,392,124	0.83	77,108,454	8.375	2024/3/15	0.99

20	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	44,000,000	160.51	70,627,788	173.77	76,462,650	6.5	2024/2/28	0.98
21	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000	2,630.36	73,650,247	2,655.33	74,349,469	3.62	2021/11/30	0.95
22	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	18,500,000	383.70	70,984,948	399.36	73,882,697	2.875	2028/12/17	0.95
23	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	8,680,000,000	0.79	69,258,646	0.84	73,106,779	8.375	2034/3/15	0.94
24	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,500,000	2,033.57	71,174,960	2,062.27	72,179,633		2023/7/1	0.92
25	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,150,000,000	0.73	66,934,518	0.78	71,690,451	7	2027/5/15	0.92
26	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	2,677.09	69,604,583	2,732.29	71,039,710	4.181	2024/7/15	0.91
27	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,500,000	162.46	60,925,162	188.90	70,838,887	7.7	2033/3/23	0.91
28	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	35,000,000	174.01	60,904,557	200.30	70,105,597	8.5	2031/9/17	0.90
29	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,160,000,000	3.25	70,369,853	3.23	69,820,855	7.75	2021/4/14	0.89
30	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	39,000,000	169.51	66,109,249	175.07	68,279,889	7	2021/12/15	0.87

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	97.69
合計	97.69

## (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	4,200,000	11,325.21	475,659,122	13,457.91	565,232,311	5.25	2047/6/23	2.58
2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000	11,355.89	283,897,350	12,577.92	314,448,156	5	2045/6/15	1.43
3	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,110,000	12,517.22	264,113,552	14,128.41	298,109,648	6.05	2040/1/11	1.36
4	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	2,400,000	10,729.32	257,503,688	11,827.54	283,861,195	7.375	2025/2/5	1.29
5	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,200,000	12,719.61	279,831,578	12,901.27	283,827,954	5.1	2035/3/28	1.29
6	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,300,000	11,097.22	255,236,125	11,690.70	268,886,315	4.15	2027/3/28	1.22
7	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000	11,141.63	256,257,553	11,595.83	266,704,099	4.25	2025/1/7	1.21
8	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000	9,820.13	225,863,100	10,940.58	251,633,453	6	2027/3/25	1.14
9	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	2,200,000	11,028.66	242,630,590	11,426.71	251,387,699	3	2028/2/1	1.14
10	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000	11,548.44	242,517,415	11,903.60	249,975,734	7.625	2029/4/26	1.14
11	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,000,000	11,250.71	225,014,328	12,116.02	242,320,426	5.625	2041/1/7	1.10
12	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000	10,524.60	210,492,150	11,814.07	236,281,478	4.6	2048/2/10	1.07

13	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	10,836.85	205,900,216	12,125.22	230,379,262	5.625	2047/2/21	1.05
14	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	12,176.22	206,995,871	13,346.16	226,884,736	5.55	2045/1/21	1.03
15	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,950,000	11,306.61	220,478,954	11,605.90	226,315,243	4	2023/10/2	1.03
16	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,400,000	14,009.98	196,139,790	16,019.75	224,276,551	5.625	2050/11/18	1.02
17	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000	12,176.02	194,816,349	13,881.25	222,100,032	5.625	2042/4/4	1.01
18	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	11,041.01	209,779,353	11,688.62	222,083,927	4.625	2028/1/13	1.01
19	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,800,000	11,337.15	204,068,866	12,164.99	218,969,903	4.75	2026/5/27	0.99
20	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,900,000	11,243.59	213,628,305	11,506.10	218,615,914	4	2024/2/26	0.99
21	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,800,000	11,537.76	207,679,745	12,026.29	216,473,250	4.875	2023/9/16	0.98
22	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000	11,660.00	198,220,115	12,612.80	214,417,605	3.95	2040/1/20	0.97
23	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000	11,269.98	191,589,720	12,421.33	211,162,628	3.7	2042/2/2	0.96
24	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,400,000	7,842.48	188,219,522	8,664.00	207,936,115	4.875	2043/4/16	0.94
25	アメリカ	国債証券	HUNGARY	1,650,000	12,216.84	201,577,949	12,361.87	203,970,920	5.75	2023/11/22	0.93
26	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000	11,407.53	193,928,048	11,964.71	203,400,222	3.875	2028/3/17	0.92
27	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	10,482.48	178,202,188	11,721.93	199,272,877	4.6	2046/1/23	0.90
28	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	4,100,000	8,470.35	347,284,658	4,824.44	197,802,336	7.5	2026/4/22	0.90
29	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000	11,312.07	192,305,190	11,628.69	197,687,873	3.75	2025/3/16	0.90
30	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000	10,521.72	178,869,343	11,417.39	194,095,630	6.25	2022/9/26	0.88

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.24
合計	98.24

## (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	CHENIERE ENERGY PARTNERS	250,000	11,541.97	28,854,927	11,556.96	28,892,409	5.625	2026/10/1	0.80
2	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	250,000	11,106.57	27,766,449	11,193.36	27,983,405	4	2023/3/1	0.77
3	アメリカ	社債券	ALTICE LUXEMBOURG SA	200,000	11,198.12	22,396,255	12,421.63	24,843,278	10.5	2027/5/15	0.69
4	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	12,256.80	24,513,612	12,410.92	24,821,859	7.5	2028/4/1	0.69
5	アメリカ	社債券	ALTICE FRANCE SA	200,000	11,281.39	22,562,787	12,161.43	24,322,868	8.125	2027/2/1	0.67

6	アメリカ	社債券	JBS INVESTMENTS II GMBH	200,000	11,913.55	23,827,109	11,929.98	23,859,977	7	2026/1/15	0.66
7	アメリカ	社債券	FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE	200,000	11,720.94	23,441,896	11,804.48	23,608,975	5.25	2023/4/15	0.65
8	アメリカ	社債券	C&W SENIOR FINANCING DAC	200,000	11,883.97	23,767,946	11,795.20	23,590,404	7.5	2026/10/15	0.65
9	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	11,611.49	23,222,995	11,753.02	23,506,043	5.5	2027/4/15	0.65
10	アメリカ	社債券	ALTICE FRANCE SA	200,000	11,726.20	23,452,414	11,736.88	23,473,778	7.375	2026/5/1	0.65
11	アメリカ	社債券	INTESA SANPAOLO SPA	200,000	10,785.63	21,571,275	11,704.76	23,409,534	5.71	2026/1/15	0.65
12	アメリカ	社債券	BARCLAYS PLC	200,000	11,011.39	22,022,785	11,692.78	23,385,567	4.836	2028/5/9	0.65
13	アメリカ	社債券	ALTICE FINANCING SA	200,000	11,707.58	23,415,163	11,680.90	23,361,807	7.5	2026/5/15	0.65
14	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	11,605.69	23,211,381	11,605.22	23,210,450	5.5	2026/5/15	0.64
15	アメリカ	社債券	INTERNATIONAL GAME TECH	200,000	11,486.70	22,973,417	11,602.86	23,205,728	6.25	2022/2/15	0.64
16	アメリカ	社債券	ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000	11,501.60	23,003,217	11,567.23	23,134,470	6	2025/2/15	0.64
17	アメリカ	社債券	TARGA RESOURCES PARTNERS	200,000	11,623.19	23,246,386	11,553.89	23,107,793	5.875	2026/4/15	0.64
18	アメリカ	社債券	QUINTILES IMS INC	200,000	11,591.55	23,183,115	11,551.65	23,103,301	5	2026/10/15	0.64
19	アメリカ	社債券	VIRGIN MEDIA SECURED FIN	200,000	11,397.52	22,795,053	11,548.47	23,096,946	5.5	2026/8/15	0.64
20	アメリカ	社債券	MGM CHINA HOLDINGS LTD	200,000	11,312.07	22,624,140	11,494.43	22,988,865	5.375	2024/5/15	0.63
21	アメリカ	社債券	EG GLOBAL FINANCE PLC	200,000	11,537.98	23,075,965	11,476.41	22,952,820	8.5	2025/10/30	0.63
22	アメリカ	社債券	MELCO RESORTS FINANCE	200,000	11,416.15	22,832,304	11,367.06	22,734,123	5.625	2027/7/17	0.63
23	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	11,214.89	22,429,781	11,291.41	22,582,836	5.375	2023/7/15	0.62
24	アメリカ	社債券	CONNECT FINCO SARL/CONN	200,000	11,328.50	22,657,008	11,274.27	22,548,544	6.75	2026/10/1	0.62
25	アメリカ	社債券	ALTICE FINANCING SA	200,000	11,175.12	22,350,240	11,234.44	22,468,893	6.625	2023/2/15	0.62
26	アメリカ	社債券	ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000	11,038.17	22,076,340	11,118.28	22,236,561	4.25	2022/9/15	0.61
27	アメリカ	社債券	WYNN MACAU LTD	200,000	10,747.83	21,495,672	11,115.79	22,231,587	4.875	2024/10/1	0.61
28	アメリカ	社債券	CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	190,000	11,303.24	21,476,171	11,316.61	21,501,572	8.625	2024/1/15	0.59
29	アメリカ	社債券	ALGECO SCOTSMAN GLOB FIN	200,000	11,008.58	22,017,177	10,714.03	21,428,073	8	2023/2/15	0.59
30	アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC	170,000	11,398.26	19,377,056	11,531.71	19,603,907	6.375	2026/6/15	0.54

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
社債券	97.70
合計	97.70

(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	3,771	754,008	2,843,367,912	822,000	3,099,762,000	6.88
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,894	659,997	2,570,030,987	745,000	2,901,030,000	6.44
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	12,143	168,771	2,049,391,449	199,800	2,426,171,400	5.38
4	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	7,758	200,000	1,551,603,415	240,700	1,867,350,600	4.14
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,743	179,607	1,570,304,279	213,000	1,862,259,000	4.13
6	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,359	219,386	1,614,466,844	249,300	1,834,598,700	4.07
7	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,594	235,598	1,317,938,720	293,700	1,642,957,800	3.64
8	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,249	259,767	1,363,517,445	299,400	1,571,550,600	3.48
9	日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	9,698	119,297	1,156,944,402	145,600	1,412,028,800	3.13
10	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,693	319,653	1,180,480,587	353,500	1,305,475,500	2.89
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	2,465	473,415	1,166,968,567	498,500	1,228,802,500	2.72
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	12,543	87,600	1,098,778,361	89,700	1,125,107,100	2.49
13	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,080	60,223	1,028,616,035	65,100	1,111,908,000	2.46
14	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,951	475,157	927,031,880	565,000	1,102,315,000	2.44
15	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,385	79,062	900,124,740	96,800	1,102,068,000	2.44
16	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,205	757,133	912,345,762	829,000	998,945,000	2.21
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	1,294	594,078	768,737,250	688,000	890,272,000	1.97
18	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	4,791	131,564	630,324,691	171,200	820,219,200	1.82
19	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,480	153,102	685,897,734	177,400	794,752,000	1.76
20	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	899	766,280	688,885,933	822,000	738,978,000	1.64
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	2,544	248,602	632,444,741	280,200	712,828,800	1.58
22	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,311	185,217	613,255,570	202,000	668,822,000	1.48
23	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,383	467,590	646,677,248	476,000	658,308,000	1.46
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	3,487	161,546	563,312,084	185,000	645,095,000	1.43
25	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,202	136,880	575,173,860	152,400	640,384,800	1.42
26	日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,265	423,614	535,871,865	484,500	612,892,500	1.36
27	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,620	129,692	469,487,529	167,200	605,264,000	1.34
28	日本	投資証券	M C U B S M i d C i t y 投資法人 投資証券	4,995	106,448	531,708,070	118,300	590,908,500	1.31
29	日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	3,517	137,615	483,992,585	163,400	574,677,800	1.27
30	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	1,621	302,269	489,979,346	350,000	567,350,000	1.25

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
----	----------

投資証券	97.64
合計	97.64

## (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	PROLOGIS INC	131,210	8,636.29	1,133,168,624	10,123.34	1,328,283,966	4.30
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	17,640	62,133.51	1,096,035,228	61,922.21	1,092,307,897	3.53
3	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	64,050	17,782.49	1,138,968,834	16,567.66	1,061,158,828	3.43
4	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	84,110	9,186.02	772,636,304	9,402.43	790,839,161	2.56
5	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	31,250	26,937.05	841,783,060	23,239.86	726,245,850	2.35
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	29,060	22,945.84	666,806,307	23,617.84	686,334,698	2.22
7	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	72,380	8,612.38	623,364,069	9,381.62	679,041,858	2.19
8	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	43,380	12,808.35	555,626,473	13,278.67	576,028,791	1.86
9	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	66,300	7,978.11	528,949,325	8,511.71	564,326,797	1.82
10	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	77,600	7,192.20	558,115,074	6,432.26	499,143,966	1.61
11	香港	投資証券	LINK REIT	437,100	1,349.04	589,665,384	1,134.00	495,671,400	1.60
12	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	28,670	16,306.47	467,506,779	17,093.63	490,074,444	1.58
13	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,690	32,749.13	448,335,647	34,287.89	469,401,318	1.51
14	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	29,950	14,846.14	444,641,952	15,229.93	456,136,571	1.47
15	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	23,640	16,500.18	390,064,386	17,782.68	420,382,640	1.36
16	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	101,400	3,512.49	356,166,851	3,845.55	389,939,378	1.26
17	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	334,200	1,061.21	354,658,778	1,092.82	365,221,647	1.18
18	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	23,780	12,961.99	308,236,192	15,021.77	357,217,729	1.15
19	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	18,910	14,425.14	272,779,530	18,109.17	342,444,450	1.10
20	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	98,700	2,980.03	294,129,158	3,325.14	328,191,910	1.06
21	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	35,230	9,361.90	329,819,807	9,273.15	326,693,370	1.05
22	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,102,000	285.43	314,553,778	291.37	321,089,960	1.03
23	アメリカ	投資証券	UDR INC	60,400	5,077.01	306,651,428	5,262.16	317,834,875	1.02
24	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	26,510	12,096.51	320,678,735	11,636.36	308,480,105	0.99
25	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	37,900	6,796.25	257,577,953	8,086.62	306,483,034	0.99
26	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	150,400	1,990.70	299,402,062	1,944.69	292,481,376	0.94
27	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	74,500	3,466.47	258,252,641	3,865.27	287,963,122	0.93
28	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	224,200	1,019.85	228,651,379	1,263.43	283,261,320	0.91
29	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	95,900	2,432.96	233,321,691	2,726.94	261,514,352	0.84
30	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	20,190	11,660.07	235,416,846	12,294.82	248,232,480	0.80

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
投資証券	99.35
合計	99.35

## (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	PROLOGIS INC	28,550	9,275.34	264,811,231	10,123.34	289,021,471	4.28
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	3,836	62,179.68	238,521,262	61,922.21	237,533,622	3.52
3	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	13,930	16,448.24	229,124,022	16,567.66	230,787,548	3.42
4	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	18,320	9,973.24	182,709,881	9,402.43	172,252,686	2.55
5	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	6,790	28,211.70	191,557,443	23,239.86	157,798,698	2.33
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,310	23,531.29	148,482,482	23,617.84	149,028,628	2.20
7	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	15,750	9,421.06	148,381,764	9,381.62	147,760,559	2.19
8	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,410	13,888.92	130,694,749	13,278.67	124,952,304	1.85
9	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	14,380	8,233.43	118,396,781	8,511.71	122,398,482	1.81
10	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	16,830	8,167.69	137,462,358	6,432.26	108,255,064	1.60
11	香港	投資証券	LINK REIT	95,000	1,249.64	118,715,800	1,134.00	107,730,000	1.59
12	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,220	14,497.32	90,173,391	17,093.63	106,322,394	1.57
13	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	2,968	35,578.51	105,597,031	34,287.89	101,766,480	1.50
14	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	6,490	14,213.21	92,243,790	15,229.93	98,842,282	1.46
15	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,120	16,687.08	85,437,868	17,782.68	91,047,340	1.34
16	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	22,170	3,874.04	85,887,503	3,845.55	85,255,977	1.26
17	オースト ラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	72,300	1,037.96	75,044,508	1,092.82	79,011,146	1.17
18	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,140	14,070.79	72,323,865	15,021.77	77,211,906	1.14
19	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	4,090	16,256.51	66,489,137	18,109.17	74,066,515	1.09
20	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	21,600	3,148.75	68,013,095	3,325.14	71,823,154	1.06
21	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	7,700	9,877.92	76,060,058	9,273.15	71,403,320	1.05
22	オースト ラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	240,000	293.59	70,462,656	291.37	69,928,848	1.03
23	アメリカ	投資証券	UDR INC	13,210	5,300.51	70,019,774	5,262.16	69,513,223	1.03
24	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	5,790	13,265.52	76,807,388	11,636.36	67,374,568	0.99
25	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	8,210	7,395.30	60,715,413	8,086.62	66,391,180	0.98
26	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	32,900	1,830.74	60,231,596	1,944.69	63,980,301	0.94
27	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	16,300	3,660.39	59,664,514	3,865.27	63,004,012	0.93
28	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	48,800	1,111.79	54,255,693	1,263.43	61,655,452	0.91
29	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	20,800	2,438.80	50,727,157	2,726.94	56,720,527	0.84
30	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	7,550	7,302.17	55,131,413	7,129.06	53,824,472	0.79

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.25
合計	99.25

## 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 - REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外REIT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12月限)	買建	553	日本円	9,403,873,735	9,384,410,000	2.06

（参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴマーカンタイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2019年12月限)	買建	407	米ドル	62,868,125	6,887,831,774	64,178,812.5	7,031,430,695	1.07
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2019年12月限)	買建	22	カナダドル	4,415,340	364,044,783	4,502,080	371,196,496	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12月限)	買建	261	ユーロ	9,587,940	1,156,209,685	9,657,000	1,164,537,630	0.17
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2019年12月限)	買建	20	豪ドル	3,371,925	249,994,521	3,436,000	254,745,040	0.03
	イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2019年12月限)	買建	57	英ポンド	4,173,400	590,327,430	4,226,550	597,845,496	0.09
	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12月限)	買建	29	スイスフラン	2,989,190	327,854,359	3,051,960	334,738,969	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12月限)	買建	51	米ドル	7,847,762.5	859,800,859	8,042,062.5	881,088,367	1.69
	カナダ	モントリオール取引所	S&P TSX60株価指数先物(2019年12月限)	買建	3	カナダドル	599,940	49,465,053	613,920	50,617,704	0.09
	ドイツ	ユーレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2019年12月限)	買建	32	ユーロ	1,178,750	142,145,463	1,184,000	142,778,560	0.27
	オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2019年12月限)	買建	2	豪ドル	332,475	24,649,697	343,600	25,474,504	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12月限)	買建	7	英ポンド	514,310	72,749,150	519,050	73,419,622	0.14
	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12月限)	買建	4	スイスフラン	412,480	45,240,806	420,960	46,170,892	0.08

## (参考) 新興国株式マザーファンド

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
----	------	-----	----	-----------	----	----	------	-------------	-----	------------	-----------------

株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	E-mini MSCIエマージングマーケット株価指数先物(2019年12月限)	買建	185	米ドル	9,795,805	1,073,228,395	9,761,525	1,069,472,677	2.57
----------	------	----------------	---	----	-----	-----	-----------	---------------	-----------	---------------	------

## (参考) 米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額(円)	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴマーカントイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2019年12月限)	買建	5	米ドル	779,262.5	85,375,999	788,437.5	86,381,211	0.43

## (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12月限)	買建	477	日本円	1,016,777,016	1,058,701,500	2.35

### (参考) 海外REIT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12月限)	買建	42	米ドル	1,537,180	168,413,447	1,543,500	169,105,860	0.54

### (参考) 海外REIT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12月限)	買建	33	米ドル	1,216,490	133,278,654	1,212,750	132,868,890	1.96

## (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11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	
6月末日	158		1.0538	
7月末日	157		1.0616	
8月末日	159		1.0631	
9月末日	163		1.0676	
10月末日	171		1.0740	
11月末日	176		1.0775	

## インデックス・ブレード(タイプ )

2019年11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	
6月末日	83		1.0682	
7月末日	77		1.0793	
8月末日	74		1.0732	
9月末日	64		1.0852	
10月末日	69		1.0986	
11月末日	69		1.1063	

## インデックス・ブレード(タイプ )

2019年11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	
	6月末日	224		1.0824	
	7月末日	238		1.0966	
	8月末日	235		1.0821	
	9月末日	235		1.1009	
	10月末日	245		1.1210	
	11月末日	268		1.1327	

### インデックス・ブレード（タイプ ）

2019年11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	
	6月末日	57		1.0918	
	7月末日	57		1.1083	
	8月末日	57		1.0877	
	9月末日	58		1.1123	
	10月末日	63		1.1383	
	11月末日	63		1.1530	

### インデックス・ブレード（タイプ ）

2019年11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	
	6月末日	199		1.1059	
	7月末日	225		1.1263	
	8月末日	211		1.0961	
	9月末日	222		1.1297	
	10月末日	228		1.1642	
	11月末日	225		1.1843	

## 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%
第4期（中間期）	2019年 4月23日～2019年10月22日	1.9%

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%
第4期（中間期）	2019年 4月23日～2019年10月22日	2.0%

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

## インデックス・ブレード（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.1%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	5.5%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	3.5%
第4期（中間期）	2019年 4月23日～2019年10月22日	1.8%

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・ブレード（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.1%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	6.6%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	3.8%
第4期（中間期）	2019年 4月23日～2019年10月22日	1.8%

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・ブレード（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.4%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	8.6%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	4.3%
第4期（中間期）	2019年 4月23日～2019年10月22日	1.6%

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

## （４）設定及び解約の実績

## インデックス・ブレード（タイプ ）

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

第4期(中間期)	2019年 4月23日～2019年10月22日	28,771,037	21,994,946	162,467,327
----------	-------------------------	------------	------------	-------------

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
第4期(中間期)	2019年 4月23日～2019年10月22日	9,600,269	32,116,556	62,451,621

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
第4期(中間期)	2019年 4月23日～2019年10月22日	53,860,774	31,831,085	219,413,649

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
第4期(中間期)	2019年 4月23日～2019年10月22日	13,410,044	4,366,785	55,879,492

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
第4期(中間期)	2019年 4月23日～2019年10月22日	48,236,609	24,103,949	196,491,000

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

&lt; 更新後 &gt;



## 運用実績 (2019年11月29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	5.9	8.9	10.4	11.8	15.2
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	4.0	9.0	15.6	20.5	29.0
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	5.0	7.0	6.5	5.5	4.5
新興国株式マザーファンド	2.0	2.5	4.0	4.5	5.5
米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	3.5	4.0	5.5	6.5	8.5
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	50.1	38.6	28.1	20.3	8.9
外国債券マザーファンド	5.0	5.0	6.0	6.0	6.4
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	14.4	11.4	8.4	5.9	2.5
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	2.5	3.5	3.5	4.0	2.0
米国/ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1.5	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	3.1	3.5	4.4	5.9
海外REITインデックスマザーファンド	3.0	5.1	6.0	8.1	8.6
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」を通じた投資銘柄

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	ソニー	電気機器	0.1	0.2	0.2	0.2	0.3
3	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	0.2
4	武田薬品工業	医薬品	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
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」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.1	0.3	0.5	0.6	0.9
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.1	0.2	0.4	0.6	0.8
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	0.5
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	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.0	0.1	0.2	0.2	0.3

・「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.1	0.2	0.2	0.2	0.1
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.1	0.2	0.2	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	0.1
5	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.1	0.1	0.1	0.1	0.0

・「新興国株式マザーファンド」を通じた投資銘柄

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	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	0.1	0.1	0.2	0.3	0.3
2	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
3	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	0.2
4	XTRACKERS HARVEST CSI000 CHINA A-SHS ETF	—	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
5	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2

## ・「米国株式配当貴族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	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	LEGETT & PLATT INC	家庭用耐久財	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2
2	ABBVIE INC	バイオテクノロジー	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2
3	TARGET CORP	複合小売り	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2
4	AIR PRODUCTS	化学	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2
5	CARDINAL HEALTH INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2

## ・「国内債券NOMURA-BPI総合 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	国庫債券 利付（10年）第334回	国債証券	0.6	0.4	0.3	0.2	0.1
2	国庫債券 利付（5年）第130回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1
3	国庫債券 利付（5年）第129回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1
4	国庫債券 利付（10年）第351回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1
5	国庫債券 利付（10年）第350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	US TREASURY BOND	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 N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.1	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	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1	0.0
2	UK TREASURY	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.0
3	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.0	0.0
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.0	0.0
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.0	0.0

## ・「新興国債券マザーファンド」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	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
2	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.1	0.0
3	UNITED MEXICAN STATES	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.1	0.0
4	TURKEY GLOBAL	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.1	0.0
5	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.0	0.0	0.0	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	CHENIERE ENERGY PARTNERS	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
2	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
3	ALTICE LUXEMBOURG 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	ALTICE FRANCE SA	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

## ・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

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	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	0.4
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	オリックス不動産投資法人 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	PROLOGIS INC	投資証券	0.1	0.2	0.3	0.3	0.4
2	EQUINIX INC	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.3	0.3
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.3	0.3
4	WELLTOWER INC	投資証券	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
5	PUBLIC STORAGE	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)当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)(以下「中間財務諸表等規則」という。)ならびに同規則第38条の3および第57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、中間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4期中間計算期間(2019年4月23日から2019年10月22日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

## 中間財務諸表

インデックス・ブレード（タイプ ）

## (1) 中間貸借対照表

	(単位：円)	
	第3期 (2019年 4月22日現在)	第4期中間計算期間末 (2019年10月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,493,713	1,574,646
親投資信託受益証券	162,279,984	172,595,893
未収入金	-	21,000
流動資産合計	163,773,697	174,191,539
資産合計	163,773,697	174,191,539
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	42,843	46,399
未払金	-	927
未払解約金	100,643	83,397
未払受託者報酬	22,317	26,289
未払委託者報酬	334,648	394,314
未払利息	3	1
その他未払費用	2,167	2,571
流動負債合計	502,621	553,898
負債合計	502,621	553,898
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	155,691,236	162,467,327
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	7,579,840	11,170,314
(分配準備積立金)	3,780,655	3,299,854
元本等合計	163,271,076	173,637,641
純資産合計	163,271,076	173,637,641
負債純資産合計	163,773,697	174,191,539

## (2) 中間損益及び剰余金計算書



	第3期中間計算期間 自 2018年 4月24日 至 2018年10月23日	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	471,560	3,399,909
為替差損益	119,028	104,000
営業収益合計	590,588	3,503,909
<b>営業費用</b>		
支払利息	283	482
受託者報酬	11,436	26,289
委託者報酬	171,458	394,314
その他費用	1,086	2,571
営業費用合計	184,263	423,656
営業利益又は営業損失( )	774,851	3,080,253
経常利益又は経常損失( )	774,851	3,080,253
中間純利益又は中間純損失( )	774,851	3,080,253
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	77,073	111,997
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,600,091	7,579,840
剰余金増加額又は欠損金減少額	763,523	1,668,902
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	763,523	1,668,902
剰余金減少額又は欠損金増加額	457,332	1,046,684
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	457,332	1,046,684
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,054,358	11,170,314

## (3) 中間注記表

## (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	当ファンドの中間計算期間は、2019年 4月23日から2019年10月22日までとなっております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年 4月22日現在	第4期中間計算期間末 2019年10月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 155,691,236口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 162,467,327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 1.0487円 (10,000口当たり純資産額) (10,487円)	2. 中間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 1.0688円 (10,000口当たり純資産額) (10,688円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年 4月22日現在	第4期中間計算期間末 2019年10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。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間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 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。 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 2 デリバティブ取引関係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。	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。 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 2 デリバティブ取引関係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）

1 元本の移動

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日
期首元本額 66,096,226円	期首元本額 155,691,236円
期中追加設定元本額 139,749,676円	期中追加設定元本額 28,771,037円
期中一部解約元本額 50,154,666円	期中一部解約元本額 21,994,946円

2 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3期(2019年 4月22日現在)				第4期中間計算期間末(2019年10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	4,330,645	-	4,373,488	42,843	3,898,462	-	3,944,861	46,399
米ドル	4,330,645	-	4,373,488	42,843	3,898,462	-	3,944,861	46,399
合計	4,330,645	-	4,373,488	42,843	3,898,462	-	3,944,861	46,399

## (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。

## インデックス・ブレード(タイプ)

## (1) 中間貸借対照表

(単位:円)

	第3期 (2019年 4月22日現在)	第4期中間計算期間末 (2019年10月22日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	847,909	683,834
親投資信託受益証券	90,293,286	67,691,039
未収入金	-	12,000
流動資産合計	91,141,195	68,386,873
<b>資産合計</b>	91,141,195	68,386,873
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	43,396	37,761
未払解約金	77,840	43,821
未払受託者報酬	11,532	12,574
未払委託者報酬	176,806	192,679
未払利息	1	-
その他未払費用	1,094	1,197

	第3期 (2019年 4月22日現在)	第4期中間計算期間末 (2019年10月22日現在)
流動負債合計	310,669	288,032
負債合計	310,669	288,032
純資産の部		
元本等		
元本	84,967,908	62,451,621
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	5,862,618	5,647,220
(分配準備積立金)	2,065,074	1,344,660
元本等合計	90,830,526	68,098,841
純資産合計	90,830,526	68,098,841
負債純資産合計	91,141,195	68,386,873

## (2) 中間損益及び剰余金計算書

(単位:円)

	第3期中間計算期間 自 2018年 4月24日 至 2018年10月23日	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	162,995	1,670,753
為替差損益	172,798	70,427
営業収益合計	335,793	1,741,180
営業費用		
支払利息	519	318
受託者報酬	10,752	12,574
委託者報酬	164,939	192,679
その他費用	1,019	1,197
営業費用合計	177,229	206,768
営業利益又は営業損失( )	513,022	1,534,412
経常利益又は経常損失( )	513,022	1,534,412
中間純利益又は中間純損失( )	513,022	1,534,412
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	206,958	301,278
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,048,558	5,862,618
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,353,566	740,582
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,353,566	740,582
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,783,550	2,189,114
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,783,550	2,189,114
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,898,594	5,647,220

## (3) 中間注記表

(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	当ファンドの中間計算期間は、2019年 4月23日から2019年10月22日までとなっております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年 4月22日現在	第4期中間計算期間末 2019年10月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 84,967,908口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 62,451,621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 1.0690円 (10,000口当たり純資産額) (10,690円)	2. 中間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)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年 4月22日現在	第4期中間計算期間末 2019年10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 2 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. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間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 2 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>

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日		第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日	
期首元本額	75,846,336円	期首元本額	84,967,908円
期中追加設定元本額	64,162,109円	期中追加設定元本額	9,600,269円
期中一部解約元本額	55,040,537円	期中一部解約元本額	32,116,556円

## 2 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3期(2019年 4月22日現在)				第4期中間計算期間末(2019年10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	3,195,499	-	3,238,895	43,396	2,121,608	-	2,159,369	37,761
米ドル	3,195,499	-	3,238,895	43,396	2,121,608	-	2,159,369	37,761
合計	3,195,499	-	3,238,895	43,396	2,121,608	-	2,159,369	37,761

#### (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。

## インデックス・ブレード(タイプ )

### (1) 中間貸借対照表

	第3期 (2019年 4月22日現在)	第4期中間計算期間末 (2019年10月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,887,886	5,434,746
親投資信託受益証券	213,934,228	242,145,901
未収入金	-	47,000
流動資産合計	215,822,114	247,627,647
資産合計	215,822,114	247,627,647
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	78,979	112,432
未払金	-	14,552
未払解約金	2,548	3,271,055
未払受託者報酬	30,221	37,166
未払委託者報酬	473,413	582,185
未払利息	4	4
その他未払費用	2,959	3,658
流動負債合計	588,124	4,021,052
負債合計	588,124	4,021,052
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	197,383,960	219,413,649
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	17,850,030	24,192,946
（分配準備積立金）	5,817,435	5,059,081
元本等合計	215,233,990	243,606,595
純資産合計	215,233,990	243,606,595
負債純資産合計	215,822,114	247,627,647

## ( 2 ) 中間損益及び剰余金計算書

(単位：円)

	第3期中間計算期間 自 2018年 4月24日 至 2018年10月23日	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	396,756	5,010,673
為替差損益	395,133	163,885
営業収益合計	791,889	5,174,558
<b>営業費用</b>		
支払利息	818	663
受託者報酬	29,748	37,166
委託者報酬	465,978	582,185
その他費用	2,922	3,658
営業費用合計	499,466	623,672
営業利益又は営業損失（ ）	1,291,355	4,550,886
経常利益又は経常損失（ ）	1,291,355	4,550,886
中間純利益又は中間純損失（ ）	1,291,355	4,550,886
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（ ）	339,047	103,201
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	9,232,676	17,850,030
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,497,545	4,712,438
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,497,545	4,712,438
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,024,829	2,817,207
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,024,829	2,817,207
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	8,074,990	24,192,946

## (3) 中間注記表

## (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	当ファンドの中間計算期間は、2019年4月23日から2019年10月22日までとなっております。

## (中間貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年4月22日現在	第4期中間計算期間末 2019年10月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 197,383,960口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 219,413,649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 1.0904円 (10,000口当たり純資産額) (10,904円)	2. 中間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 1.1103円 (10,000口当たり純資産額) (11,103円)

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

該当事項はありません。

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年4月22日現在	第4期中間計算期間末 2019年10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	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間貸借対照表計上額と時価との差額はありませ



<p>2. 時価の算定方法</p> <p>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2 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>2. 時価の算定方法</p> <p>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2 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>
--	---

## (その他の注記)

## 1 元本の移動

	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日
期首元本額	172,950,641円	197,383,960円
期中追加設定元本額	90,227,074円	53,860,774円
期中一部解約元本額	65,793,755円	31,831,085円

## 2 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3期(2019年 4月22日現在)				第4期中間計算期間末(2019年10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	7,617,651	-	7,696,630	78,979	7,669,892	-	7,782,324	112,432
米ドル	7,617,651	-	7,696,630	78,979	7,669,892	-	7,782,324	112,432
合計	7,617,651	-	7,696,630	78,979	7,669,892	-	7,782,324	112,432

## (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。

## インデックス・ブレード(タイプ)

### (1) 中間貸借対照表

	第3期 (2019年 4月22日現在)	第4期中間計算期間末 (2019年10月22日現在)
(単位:円)		
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	456,065	565,110
親投資信託受益証券	51,446,390	62,512,827
流動資産合計	51,902,455	63,077,937
資産合計	51,902,455	63,077,937
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,892	24,189
未払金	-	7,863
未払解約金	99	-
未払受託者報酬	7,231	9,147
未払委託者報酬	115,552	146,370
その他未払費用	660	864
流動負債合計	140,434	188,433
負債合計	140,434	188,433
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	46,836,233	55,879,492
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	4,925,788	7,010,012
(分配準備積立金)	1,370,908	1,264,421
元本等合計	51,762,021	62,889,504
純資産合計	51,762,021	62,889,504
負債純資産合計	51,902,455	63,077,937

### (2) 中間損益及び剰余金計算書

	第3期中間計算期間 自 2018年 4月24日 至 2018年10月23日	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日
(単位:円)		
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	304,598	1,383,437
為替差損益	68,382	42,852
営業収益合計	372,980	1,426,289
<b>営業費用</b>		
支払利息	59	107
受託者報酬	5,489	9,147
委託者報酬	87,744	146,370
その他費用	461	864
営業費用合計	93,753	156,488
営業利益又は営業損失( )	466,733	1,269,801

	第3期中間計算期間 自 2018年 4月24日 至 2018年10月23日	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日
経常利益又は経常損失( )	466,733	1,269,801
中間純利益又は中間純損失( )	466,733	1,269,801
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	27,238	11,314
期首剰余金又は期首欠損金( )	1,889,698	4,925,788
剰余金増加額又は欠損金減少額	867,130	1,245,826
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	867,130	1,245,826
剰余金減少額又は欠損金増加額	103,875	442,717
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	103,875	442,717
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	2,158,982	7,010,012

## ( 3 ) 中間注記表

( 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	当ファンドの中間計算期間は、2019年 4月23日から2019年10月22日までとなっております。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

第3期 2019年 4月22日現在	第4期中間計算期間末 2019年10月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 46,836,233口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 55,879,492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 1.1052円 (10,000口当たり純資産額) (11,052円)	2. 中間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 1.1254円 (10,000口当たり純資産額) (11,254円)

( 中間損益及び剰余金計算書に関する注記 )

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年 4月22日現在	第4期中間計算期間末 2019年10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 2 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. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間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 2 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>

（その他の注記）

1 元本の移動

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日		第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日	
期首元本額	29,266,529円	期首元本額	46,836,233円
期中追加設定元本額	19,627,025円	期中追加設定元本額	13,410,044円
期中一部解約元本額	2,057,321円	期中一部解約元本額	4,366,785円

2 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3期(2019年 4月22日現在)				第4期中間計算期間末(2019年10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	2,064,475	-	2,081,367	16,892	2,212,263	-	2,236,452	24,189
米ドル	2,064,475	-	2,081,367	16,892	2,212,263	-	2,236,452	24,189

合計	2,064,475	-	2,081,367	16,892	2,212,263	-	2,236,452	24,189
----	-----------	---	-----------	--------	-----------	---	-----------	--------

## (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。

## インデックス・ブレード(タイプ)

## (1) 中間貸借対照表

(単位:円)

	第3期 (2019年 4月22日現在)	第4期中間計算期間末 (2019年10月22日現在)
<b>資産の部</b>		
<b>流動資産</b>		
コール・ローン	17,122,558	2,987,852
親投資信託受益証券	193,451,179	224,137,234
未収入金	-	2,134,000
流動資産合計	210,573,737	229,259,086
<b>資産合計</b>	210,573,737	229,259,086
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
派生商品評価勘定	20,191	28,736
未払金	-	15,796
未払解約金	15,407,795	3,147,463
未払受託者報酬	31,399	33,433
未払委託者報酬	512,830	546,043
未払利息	37	2
その他未払費用	3,083	3,289
流動負債合計	15,975,335	3,774,762
<b>負債合計</b>	15,975,335	3,774,762
<b>純資産の部</b>		
<b>元本等</b>		
元本	172,358,340	196,491,000
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	22,240,062	28,993,324
(分配準備積立金)	7,030,269	6,220,552
元本等合計	194,598,402	225,484,324
<b>純資産合計</b>	194,598,402	225,484,324
<b>負債純資産合計</b>	210,573,737	229,259,086

## ( 2 ) 中間損益及び剰余金計算書

( 単位 : 円 )

	第3期中間計算期間 自 2018年 4月24日 至 2018年10月23日	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	324,375	4,522,055
為替差損益	177,336	111,259
営業収益合計	501,711	4,633,314
<b>営業費用</b>		
支払利息	656	542
受託者報酬	29,247	33,433
委託者報酬	477,678	546,043
その他費用	2,869	3,289
営業費用合計	510,450	583,307
営業利益又は営業損失 ( )	1,012,161	4,050,007
経常利益又は経常損失 ( )	1,012,161	4,050,007
中間純利益又は中間純損失 ( )	1,012,161	4,050,007
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額 ( )	235,708	188,222
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	8,672,691	22,240,062
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,284,707	5,521,556
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,284,707	5,521,556
剰余金減少額又は欠損金増加額	830,394	3,006,523
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	830,394	3,006,523
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金 ( )	13,879,135	28,993,324

## ( 3 ) 中間注記表

( 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	当ファンドの中間計算期間は、2019年 4月23日から2019年10月22日までとなっております。

( 中間貸借対照表に関する注記 )

第3期 2019年 4月22日現在	第4期中間計算期間末 2019年10月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 172,358,340口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 196,491,000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 1.1290円 (10,000口当たり純資産額) (11,290円)	2. 中間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 1.1476円 (10,000口当たり純資産額) (11,476円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年 4月22日現在	第4期中間計算期間末 2019年10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。	1. 中間貸借対照表計上額、時価及び差額 中間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、中間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 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。 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 2 デリバティブ取引関係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。	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。 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 2 デリバティブ取引関係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）

1 元本の移動

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期中間計算期間 自 2019年 4月23日 至 2019年10月22日
期首元本額 105,819,700円	期首元本額 172,358,340円
期中追加設定元本額 119,681,763円	期中追加設定元本額 48,236,609円
期中一部解約元本額 53,143,123円	期中一部解約元本額 24,103,949円

2 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3期(2019年 4月22日現在)				第4期中間計算期間末(2019年10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	4,362,608	-	4,382,799	20,191	4,038,978	-	4,067,714	28,736
米ドル	4,362,608	-	4,382,799	20,191	4,038,978	-	4,067,714	28,736
合計	4,362,608	-	4,382,799	20,191	4,038,978	-	4,067,714	28,736

(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。

(参考)

「インデックス・ブレンド(タイプ )」、「インデックス・ブレンド(タイプ )」、「インデックス・ブレンド(タイプ )」、「インデックス・ブレンド(タイプ )」、「インデックス・ブレンド(タイプ )」は「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSA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10月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	22,715,385,590
株式	442,591,971,440
派生商品評価勘定	107,530,950
未収入金	4,445,456
未収配当金	4,005,168,291
未収利息	1,735,744
その他未収収益	44,781,993
差入委託証拠金	144,353,500
流動資産合計	469,615,372,964
資産合計	469,615,372,964
負債の部	
流動負債	
未払解約金	1,137,279,486
未払利息	18,141
有価証券貸借取引受入金	18,949,569,962
流動負債合計	20,086,867,589
負債合計	20,086,867,589
純資産の部	
元本等	
元本	273,668,905,126
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	175,859,600,249
元本等合計	449,528,505,375
純資産合計	449,528,505,375
負債純資産合計	469,615,372,964

## 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る場合、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10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	1.6426円
(10,000口当たり純資産額)	(16,426円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	
	18,090,909,700円

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年10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。	
派生商品評価勘定	
先物取引	
(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10月22日現在	
期首	2019年 4月23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	250,072,065,186円
同期中における追加設定元本額	42,415,795,023円
同期中における一部解約元本額	18,818,955,083円
期末元本額	273,668,905,126円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	173,821,102円
バランスセレクト50	386,228,791円
バランスセレクト70	491,324,383円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,614,375,863円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	3,686,208,028円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	7,950,321,529円
野村資産設計ファンド2015	51,454,313円
野村資産設計ファンド2020	57,910,217円
野村資産設計ファンド2025	92,047,329円
野村資産設計ファンド2030	108,872,013円

野村資産設計ファンド2035	84,618,143円
野村資産設計ファンド2040	187,075,598円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)	96,649,588,672円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	2,822,278,503円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	8,176,852,027円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	2,133,009,063円
野村資産設計ファンド2045	28,455,184円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,894,013,733円
マイ・ロード	3,797,242,104円
ネクストコア	80,874,458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	1,165,426,585円
野村日本株インデックス(野村SMA・EW向け)	1,984,950,249円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	983,607,187円
野村資産設計ファンド2050	48,426,895円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	14,826,858円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	6,296,743円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	4,721,755円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	3,012,679円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	316,132,062円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	270,563,069円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,399,987円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,772,877円
インデックス・ブレンド(タイプ)	15,549,754円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,571,957円
インデックス・ブレンド(タイプ)	21,241,796円
野村6資産均等バランス	801,284,962円
世界6資産分散ファンド	148,064,531円
野村資産設計ファンド2060	1,413,654円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	461,462,148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)	463,074,582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)	348,329,474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)	713,639,588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)	794,214,566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)	4,517,801円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	10,473,272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)	2,507,417円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,455,590,413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)	17,118,875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)	143,763,994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)	105,080,781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)	39,396,313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)	106,623,157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)	279,153,276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)	4,760,043,385円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	628,336,660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)	515,064,532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)	2,824,379,963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)	587,316,187円

バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,669,442円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	33,646,701円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	44,911,892円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	121,913,304円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	10,032,533,698円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	24,783,563,509円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	26,880,080,741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)	32,161,810,262円
マイバランスDC30	3,440,560,038円
マイバランスDC50	4,924,829,083円
マイバランスDC70	4,577,058,862円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,074,553,497円
野村DC運用戦略ファンド	950,185,511円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	60,852,907円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	737,408,772円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	476,535,040円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	374,141,064円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	4,602,492円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	2,655,405円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	31,651,539円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	4,694,638円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	3,609,446円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	4,933,708円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	181,953,737円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	122,526,339円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	48,406,463円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	54,459,148円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	236,851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

## 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

(2019年10月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	4,633,111,774
コール・ローン	767,226,270
株式	595,929,826,050
投資証券	17,636,347,601
派生商品評価勘定	41,797,128
未収入金	7,787,308
未収配当金	524,098,195
差入委託証拠金	2,393,445,355
流動資産合計	621,933,639,681
資産合計	621,933,639,681
負債の部	
流動負債	

(2019年10月22日現在)

派生商品評価勘定	32,182,401
未払解約金	1,540,460,718
未払利息	612
その他未払費用	3,108,100
流動負債合計	1,575,751,831
負債合計	1,575,751,831
純資産の部	
元本等	
元本	220,682,732,158
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	399,675,155,692
元本等合計	620,357,887,850
純資産合計	620,357,887,850
負債純資産合計	621,933,639,681

## 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>

## （貸借対照表に関する注記）

2019年10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	2,811円
(10,000口当たり純資産額)	(28,111円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年10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	
先物取引	
（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	
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。	
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10月22日現在	
期首	2019年 4月23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	206,020,646,067円
同期中における追加設定元本額	27,793,064,197円
同期中における一部解約元本額	13,130,978,106円
期末元本額	220,682,732,158円

期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	49,687,334円
バランスセレクト50	150,348,405円
バランスセレクト70	158,765,569円
野村外国株式インデックスファンド	532,894,447円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	4,541,670,014円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	6,403,797,495円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	4,603,850,226円
野村資産設計ファンド2015	17,280,948円
野村資産設計ファンド2020	19,510,138円
野村資産設計ファンド2025	30,982,014円
野村資産設計ファンド2030	36,595,018円
野村資産設計ファンド2035	28,546,856円
野村資産設計ファンド2040	62,915,439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）	34,265,943,940円
のむらップ・ファンド（保守型）	1,034,898,819円
のむらップ・ファンド（普通型）	7,705,416,864円
のむらップ・ファンド（積極型）	5,038,631,322円
野村資産設計ファンド2045	9,562,497円
野村インデックスファンド・外国株式	4,381,204,289円
マイ・ロード	1,363,195,763円
ネクストコア	24,470,319円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	117,502,787円
野村外国株インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	1,225,328,524円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,001,204,020円
野村資産設計ファンド2050	16,315,875円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	4,979,036円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	2,120,257円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,591,016円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,012,979円
のむらップ・ファンド（やや保守型）	207,785,868円
のむらップ・ファンド（やや積極型）	344,822,615円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,520,518円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,243,329円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	13,482,069円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,653,403円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	23,126,753円
野村6資産均等バランス	464,005,902円
野村つみたて外国株投信	3,292,987,249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）	3,704,620,240円
世界6資産分散ファンド	85,740,800円
野村資産設計ファンド2060	474,796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	569,648,559円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	805,868,865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）	268,155,948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）	201,704,912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）	1,237,704,151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)	2,295,749,568円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,616,659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)	7,411,937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)	3,194,874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)	3,965,260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)	55,499,077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)	15,420,712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)	17,109,388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)	41,149,881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)	161,612,304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)	3,150,207,200円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	364,776,829円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	73,727,387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)	702,458,243円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	16,904,154,372円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,177,598円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	12,732,332円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	14,107,364円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	65,744,775,697円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,907,599,627円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	9,577,531,736円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,658,375,615円
マイバランスDC30	993,509,406円
マイバランスDC50	1,892,178,733円
マイバランスDC70	1,478,869,730円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	20,519,286,957円
野村DC運用戦略ファンド	276,524,397円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	16,296,885円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	244,297,935円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	170,289,210円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	135,106,068円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	7,995,595円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	4,613,053円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	18,328,685円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	1,578,091円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	1,213,894円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,662,254円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	69,370,923円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	42,315,975円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	15,572,823円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	17,520,029円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	79,668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



## 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10月22日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	86,437,952
コール・ローン	822,306,836
株式	47,140,169,722
投資証券	1,408,916,882
派生商品評価勘定	4,737,493
未収入金	585,166
未収配当金	41,485,623
差入委託証拠金	396,911,518
流動資産合計	49,901,551,192
資産合計	
49,901,551,192	
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	577,296,859
未払解約金	204,664,750
未払利息	656
その他未払費用	397,900
流動負債合計	782,360,165
負債合計	
782,360,165	
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	24,917,092,822
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	24,202,098,205
元本等合計	49,119,191,027
純資産合計	49,119,191,027
負債純資産合計	49,901,551,192

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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10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	1.9713円
(10,000口当たり純資産額)	(19,713円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年10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

## 先物取引

（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

## 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。

## 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10月22日現在	
期首	2019年 4月23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	25,069,680,630円
同期中における追加設定元本額	2,619,480,271円
同期中における一部解約元本額	2,772,068,079円
期末元本額	24,917,092,822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	1,934,238,238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	949,841,827円
野村外国株インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	580,517,764円
インデックス・ブレンド(タイプ )	4,435,853円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,441,350円
インデックス・ブレンド(タイプ )	8,014,475円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,743,228円
インデックス・ブレンド(タイプ )	5,155,746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)	7,020,216,231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)	2,322,148,045円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSA I指数(為替ヘッジあり)連動型上場投信	599,659,199円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	221,060,552円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	8,449,253,009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)	1,569,374,557円
ノムラ外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA(適格機関投資家専用)	1,141,965,041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)	106,431,666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)	596,041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

## 新興国株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

(2019年10月22日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	648,430,686
コール・ローン	79,294,657
株式	37,892,894,385
投資信託受益証券	994,918,956
投資証券	102,020,299
派生商品評価勘定	11,375,066
未収入金	955,888
未収配当金	51,651,603
差入委託証拠金	305,625,420
流動資産合計	40,087,166,960
<b>資産合計</b>	<b>40,087,166,960</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	367,279
未払解約金	22,293,762
未払利息	63
その他未払費用	1,598,700
流動負債合計	24,259,804
<b>負債合計</b>	<b>24,259,804</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	32,844,878,277
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	7,218,028,879
元本等合計	40,062,907,156
純資産合計	40,062,907,156
<b>負債純資産合計</b>	<b>40,087,166,960</b>

### 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>

## （貸借対照表に関する注記）

2019年10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	1,2198円
(10,000口当たり純資産額)	(12,198円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年10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

## 先物取引

（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

## 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。

## 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10月22日現在		
期首		2019年 4月23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		29,933,997,721円
同期中における追加設定元本額		3,881,201,875円
同期中における一部解約元本額		970,321,319円
期末元本額		32,844,878,277円
期末元本額の内訳*		
野村資産設計ファンド2015		29,269,258円
野村資産設計ファンド2020		32,799,046円
野村資産設計ファンド2025		52,215,345円
野村資産設計ファンド2030		61,861,712円
野村資産設計ファンド2035		47,835,202円
野村資産設計ファンド2040		106,244,787円
野村資産設計ファンド2045		16,177,409円
野村インデックスファンド・新興国株式		3,879,831,474円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		274,883,750円
野村資産設計ファンド2050		27,434,012円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		8,437,814円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		3,569,994円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		2,674,481円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		1,711,478円

インデックス・ブレンド(タイプ )	2,192,580円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,149,058円
インデックス・ブレンド(タイプ )	6,024,888円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,828,253円
インデックス・ブレンド(タイプ )	8,319,703円
野村つみたて外国株投信	1,094,775,356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)	529,474,364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)	1,231,628,825円
世界6資産分散ファンド	200,580,287円
野村資産設計ファンド2060	804,322円
NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIE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	337,151,843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)	13,339,368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)	1,611,892,623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)	23,253,123,714円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	2,667,989円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,049,892円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	2,794,963円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	134,487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

## 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10月22日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	244,090,726
コール・ローン	73,075,220
株式	17,759,591,616
投資信託受益証券	120,839,190
投資証券	329,712,018
派生商品評価勘定	670,112
未収配当金	24,282,449
差入委託証拠金	30,488,752
流動資産合計	18,582,750,083
資産合計	18,582,750,083
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	4,070
未払金	212,554,367
未払解約金	58,814,362
未払利息	58
その他未払費用	236,400
流動負債合計	271,609,257
負債合計	271,609,257
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	14,021,815,711
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	4,289,325,115

(2019年10月22日現在)

元本等合計	18,311,140,826
純資産合計	18,311,140,826
負債純資産合計	18,582,750,083

## 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 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>投資信託受益証券 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。 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 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>
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3.費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 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>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	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10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	1.3059円



(10,000口当たり純資産額)

(13,059円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年10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	
先物取引	(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10月22日現在	
期首	2019年 4月23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	10,378,025,751円
同期中における追加設定元本額	4,798,867,464円
同期中における一部解約元本額	1,155,077,504円
期末元本額	14,021,815,711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	6,172,030,087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	2,565,679,032円
インデックス・ブレンド(タイプ )	4,804,426円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,158,306円
インデックス・ブレンド(タイプ )	10,373,830円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,188,758円
インデックス・ブレンド(タイプ )	14,787,554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)	391,144,174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)	53,029,891円
米国株式配当貴族(年4回決算型)	4,804,619,653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

## 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10月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,514,017,378
国債証券	561,054,726,900
地方債証券	46,558,609,366
特殊債券	60,149,703,246
社債券	27,068,133,250
未収入金	824,440,000
未収利息	1,127,319,153
前払費用	35,217,847
流動資産合計	703,332,167,140
資産合計	
703,332,167,140	
負債の部	
流動負債	
未払金	500,000,000
未払解約金	668,422,381
未払利息	5,202
流動負債合計	1,168,427,583
負債合計	
1,168,427,583	
純資産の部	
元本等	
元本	521,707,282,213
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	180,456,457,344
元本等合計	702,163,739,557
純資産合計	
702,163,739,557	
負債純資産合計	
703,332,167,140	

## 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10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

2019年10月22日現在	
1口当たり純資産額	1.3459円
(10,000口当たり純資産額)	(13,459円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年10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10月22日現在	
期首	2019年 4月23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	497,317,256,859円
同期中における追加設定元本額	66,892,072,372円
同期中における一部解約元本額	42,502,047,018円
期末元本額	521,707,282,213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	491,825,803円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	37,113,095,794円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	17,441,400,707円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	2,686,940,736円
野村資産設計ファンド2015	365,189,526円
野村資産設計ファンド2020	354,962,505円
野村資産設計ファンド2025	292,618,267円
野村資産設計ファンド2030	207,343,213円
野村資産設計ファンド2035	104,446,071円
野村資産設計ファンド2040	161,710,723円
野村日本債券インデックスファンド	979,456,868円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	176,536,565,853円
のむラップ・ファンド(保守型)	12,369,528,281円
のむラップ・ファンド(普通型)	8,452,889,982円
のむラップ・ファンド(積極型)	1,010,154,710円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	10,680,288,540円

2019年10月22日現在

野村資産設計ファンド2045	16,001,870円
野村円債投資インデックスファンド	1,181,498,101円
野村インデックスファンド・国内債券	3,331,124,640円
マイ・ロード	35,315,757,320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	919,043,257円
野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)	23,283,319円
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	12,641,204,252円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	991,457,469円
野村資産設計ファンド2050	20,830,270円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	16,497,348円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	4,275,889円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	2,627,229円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,647,713円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	783,044,257円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	152,074,383円
インデックス・ブレンド(タイプ)	62,485,018円
インデックス・ブレンド(タイプ)	18,810,384円
インデックス・ブレンド(タイプ)	49,846,414円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,174,061円
インデックス・ブレンド(タイプ)	13,900,767円
野村6資産均等バランス	947,829,493円
世界6資産分散ファンド	175,142,939円
野村資産設計ファンド2060	477,767円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信	845,753,401円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	10,788,877,255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)	657,315,077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)	164,826,716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)	2,110,379,410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)	1,409,193,788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)	19,580,318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)	11,001,094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)	1,185,504円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,087,591,147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)	16,199,650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)	113,389,909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)	93,203,318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)	335,915,469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)	330,101,140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)	804,429,339円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,489,516,206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)	836,660,217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)	1,794,926,074円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	32,802,736,844円

2019年10月22日現在	
マイバランス50（確定拠出年金向け）	39,381,801,806円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	14,204,776,174円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA - B P I 総合（確定拠出年金向け）	48,129,915,733円
マイバランスDC30	10,879,042,211円
マイバランスDC50	7,581,880,623円
マイバランスDC70	2,389,315,580円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - B P I 総合	12,161,006,089円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	486,655,431円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	938,773,954円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	405,270,402円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	65,330,475円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	12,564,051円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	10,697,156円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	8,939,305円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040	3,120,055円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050	2,122,181円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	247,982,715円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	104,695,522円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	25,448,542円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	28,630,545円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2060	80,048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

## 外国債券マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

(2019年10月22日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	63,506,588
コール・ローン	323,651,321
国債証券	618,355,538,473
派生商品評価勘定	653,064
未収入金	343,804,554
未収利息	6,154,590,069
前払費用	269,210,417
その他未収収益	1,952
流動資産合計	625,510,956,438
資産合計	625,510,956,438
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,534,500
未払金	98,528,783
未払解約金	494,706,691
未払利息	258
その他未払費用	3,721,088

(2019年10月22日現在)

流動負債合計	598,491,320
負債合計	598,491,320
純資産の部	
元本等	
元本	266,139,901,453
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	358,772,563,665
元本等合計	624,912,465,118
純資産合計	624,912,465,118
負債純資産合計	625,510,956,438

## 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>

(貸借対照表に関する注記)

2019年10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	2,3481円
(10,000口当たり純資産額)	(23,481円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2019年10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

## 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。

## 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10月22日現在	
期首	2019年 4月23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	268,533,625,797円
同期中における追加設定元本額	18,522,777,638円
同期中における一部解約元本額	20,916,501,982円
期末元本額	266,139,901,453円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	87,964,834円
バランスセレクト50	89,276,007円
バランスセレクト70	75,558,283円
野村外国債券インデックスファンド	298,986,660円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	3,595,755,916円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	25,365,290,862円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	1,563,063,533円
野村資産設計ファンド2015	29,022,486円
野村資産設計ファンド2020	32,591,509円
野村資産設計ファンド2025	48,290,646円
野村資産設計ファンド2030	44,577,020円
野村資産設計ファンド2035	30,874,125円
野村資産設計ファンド2040	60,403,708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)	125,825,430,495円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	5,770,188,543円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	11,276,158,580円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	2,228,588,115円
野村外国債券インデックス(野村SMA向け)	923,950,372円
野村資産設計ファンド2045	7,575,363円
野村インデックスファンド・外国債券	842,972,254円

マイ・ロード	8,771,512,683円
ネクストコア	199,753,170円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	139,627,715円
野村外国債券インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	4,794,633,106円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,995,613,341円
野村資産設計ファンド2050	9,895,975円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,683,619円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,957,818円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,437,757円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,114,552円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	521,732,657円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	271,179,351円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,663,844円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,440,100円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,205,012円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,570,570円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,149,663円
野村6資産均等バランス	551,375,479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)	8,547,203,093円
世界6資産分散ファンド	101,885,180円
野村資産設計ファンド2060	227,775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	1,731,422,031円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	1,347,726,450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)	9,022,802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)	1,529,509,501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)	383,213,169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)	1,718,727,411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)	1,365,278,598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)	3,108,773円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	9,608,513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)	690,142円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,961,595,375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)	21,203,495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)	98,945,621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)	20,324,230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)	171,144,669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)	192,111,651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)	1,871,653,298円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	866,792,066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)	1,520,938,717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)	2,177,087,793円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,764,203円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,336,388円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	6,763,415円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	566,727,065円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,220,125,298円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,741,296,465円



マイバランス70(確定拠出年金向け)	4,150,745,373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)	15,342,195,909円
マイバランスDC30	1,717,388,945円
マイバランスDC50	1,086,344,028円
マイバランスDC70	683,233,204円
野村DC外国債券インデックスファンド	5,422,318,145円
野村DC運用戦略ファンド	2,377,463,986円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	244,034,530円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	118,758,080円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	142,622,533円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	69,425,133円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	6,334,073円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	18,272,164円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	6,222,813円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	1,922,508円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	1,165,432円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,008,197円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	36,939,325円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	21,240,565円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	7,402,033円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	8,327,569円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	37,998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

## 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10月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	91,214,327
コール・ローン	197,487,015
国債証券	60,241,878,503
派生商品評価勘定	390,388
未収入金	565,440
未収利息	425,053,265
前払費用	43,587,526
差入委託証拠金	283,322
流動資産合計	61,000,459,786
資産合計	61,000,459,786
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,115,400,477
未払金	1,960,200
未払解約金	15,958,489
未払利息	157
その他未払費用	489,000
流動負債合計	1,133,808,323
負債合計	1,133,808,323

(2019年10月22日現在)

純資産の部	
元本等	
元本	49,893,645,198
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,973,006,265
元本等合計	59,866,651,463
純資産合計	59,866,651,463
負債純資産合計	61,000,459,786

## 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>

(貸借対照表に関する注記)

2019年10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	1.1999円
(10,000口当たり純資産額)	(11,999円)

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

2019年10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

## 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。

## 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10月22日現在	
期首	2019年 4月23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	50,165,158,553円
同期中における追加設定元本額	5,555,869,213円
同期中における一部解約元本額	5,827,382,568円
期末元本額	49,893,645,198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	1,027,036,862円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	755,207,068円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	18,435,913円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	4,778,332円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,935,943円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,841,327円
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	3,570,123,680円
インデックス・ブレンド(タイプ )	22,714,926円
インデックス・ブレンド(タイプ )	6,870,116円
インデックス・ブレンド(タイプ )	17,758,190円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,287,310円
インデックス・ブレンド(タイプ )	5,452,765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)	31,098,260,791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)	9,197,475,315円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	3,941,064,666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)	220,401,994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

## 新興国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)	
(2019年10月22日現在)	
<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	42,252,321
コール・ローン	83,421,802
国債証券	21,000,399,720
派生商品評価勘定	5,458
未収利息	255,667,616
前払費用	17,558,904
流動資産合計	21,399,305,821
資産合計	21,399,305,821
<b>負債の部</b>	
流動負債	
派生商品評価勘定	120,257
未払解約金	26,305,632
未払利息	66
その他未払費用	195,100
流動負債合計	26,621,055
負債合計	26,621,055
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	11,100,462,793
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,272,221,973
元本等合計	21,372,684,766
純資産合計	21,372,684,766
負債純資産合計	21,399,305,821

## 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>

## （貸借対照表に関する注記）

2019年10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	1.9254円
(10,000口当たり純資産額)	(19,254円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年10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	
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。	
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10月22日現在	
期首	2019年 4月23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	10,636,188,015円
同期中における追加設定元本額	1,756,231,722円
同期中における一部解約元本額	1,291,956,944円
期末元本額	11,100,462,793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	1,297,230,582円
ネクストコア	81,137,620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	647,989,524円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,233,466円

インデックス・ブレード(タイプ )	1,228,631円
インデックス・ブレード(タイプ )	4,412,701円
インデックス・ブレード(タイプ )	1,276,501円
インデックス・ブレード(タイプ )	2,306,998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)	1,121,812,894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)	2,017,325,192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	121,402,073円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	252,863,421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)	8,275,361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)	3,462,639円
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	316,991,837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)	4,196,339,643円
野村DC運用戦略ファンド	944,637,063円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	79,536,647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

## 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10月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	114,744,631
コール・ローン	3,240,841
社債券	3,196,171,907
未収利息	34,337,096
前払費用	8,670,697
流動資産合計	3,357,165,172
資産合計	
3,357,165,172	
負債の部	
流動負債	
未払金	67,799,118
未払解約金	1,423,676
未払利息	2
流動負債合計	69,222,796
負債合計	
69,222,796	
純資産の部	
元本等	
元本	2,629,523,801
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	658,418,575
元本等合計	3,287,942,376
純資産合計	
3,287,942,376	
負債純資産合計	
3,357,165,172	

### 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10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	1,2504円
(10,000口当たり純資産額)	(12,504円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年10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	
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10月22日現在	
期首	2019年 4月23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	1,749,800,205円
同期中における追加設定元本額	1,240,695,071円
同期中における一部解約元本額	360,971,475円
期末元本額	2,629,523,801円

2019年10月22日現在

2019年10月22日現在	
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	529,803,002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	218,443,198円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,085,819円
インデックス・ブレンド(タイプ )	819,415円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,924,512円
インデックス・ブレンド(タイプ )	993,208円
インデックス・ブレンド(タイプ )	4,488,090円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	970,992,747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)	897,973,810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

## 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10月22日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	843,561,116
投資証券	47,658,249,900
派生商品評価勘定	54,087,984
未収配当金	313,894,847
流動資産合計	48,869,793,847
資産合計	48,869,793,847
<b>負債の部</b>	
流動負債	
前受金	26,950,500
未払金	100,501,091
未払解約金	11,856,055
未払利息	673
流動負債合計	139,308,319
負債合計	139,308,319
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	17,628,390,099
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	31,102,095,429
元本等合計	48,730,485,528
純資産合計	48,730,485,528
負債純資産合計	48,869,793,847

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法 | 投資証券



2.費用・収益の計上基準	<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 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> <p>受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。</p>
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2019年10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	2.7643円
(10,000口当たり純資産額)	(27,643円)

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年10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	
先物取引	
(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10月22日現在	
---------------	--

期首	2019年 4月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	17,394,247,204円
同期中における追加設定元本額	2,468,770,853円
同期中における一部解約元本額	2,234,627,958円
期末元本額	17,628,390,099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)	1,568,227,482円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,211,068,025円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	681,253,887円
野村資産設計ファンド2015	15,432,254円
野村資産設計ファンド2020	15,789,548円
野村資産設計ファンド2025	17,253,778円
野村資産設計ファンド2030	17,521,378円
野村資産設計ファンド2035	16,551,384円
野村資産設計ファンド2040	30,210,936円
野村資産設計ファンド2045	2,798,040円
野村インデックスファンド・J-REIT	3,073,002,029円
ネクストコア	107,274,635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	699,047,232円
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	1,992,509,648円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	809,542,630円
野村資産設計ファンド2050	4,401,141円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,544,267円
インデックス・ブレンド(タイプ )	727,889円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,050,005円
インデックス・ブレンド(タイプ )	992,557円
インデックス・ブレンド(タイプ )	4,840,248円
野村6資産均等バランス	480,626,572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)	82,754,595円
野村資産設計ファンド2060	121,134円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	98,436,913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)	426,273,247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)	2,150,196,609円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,719,271,052円
野村DC運用戦略ファンド	1,312,067,023円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	76,731,254円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	2,760,675円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,592,777円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	2,712,184円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	755,498円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	582,891円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	448,386円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	20,296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

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10月22日現在)

<b>資産の部</b>	
流動資産	
預金	75,007,346
コール・ローン	47,964,942
投資証券	30,643,038,690
派生商品評価勘定	3,887,340
未収入金	328,547
未収配当金	27,791,441
差入委託証拠金	50,523,341
流動資産合計	30,848,541,647
<b>資産合計</b>	<b>30,848,541,647</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払解約金	45,453,198
未払利息	38
その他未払費用	503,200
流動負債合計	45,956,436
<b>負債合計</b>	<b>45,956,436</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	11,913,312,989
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	18,889,272,222
元本等合計	30,802,585,211
<b>純資産合計</b>	<b>30,802,585,211</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>30,848,541,647</b>

## 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 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。 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。 有価証券売買等損益 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	派生商品取引等損益 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。 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10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	2.5856円
(10,000口当たり純資産額)	(25,856円)

## （金融商品に関する注記）

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年10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	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	先物取引 （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	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。
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10月22日現在	
期首	2019年 4月23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	10,747,737,614円
同期中における追加設定元本額	2,244,518,385円
同期中における一部解約元本額	1,078,943,010円
期末元本額	11,913,312,989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)	1,659,827,047円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,340,417,061円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	721,107,591円
野村資産設計ファンド2015	16,333,920円
野村資産設計ファンド2020	16,712,106円
野村資産設計ファンド2025	18,263,072円
野村資産設計ファンド2030	18,543,708円
野村資産設計ファンド2035	17,518,445円
野村資産設計ファンド2040	31,978,290円
野村資産設計ファンド2045	2,961,726円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,401,633,454円
ネクストコア	42,970,854円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	257,664,796円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	883,555,059円
野村資産設計ファンド2050	4,658,607円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,386,412円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,473,761円
インデックス・ブレンド(タイプ )	6,655,429円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,192,122円
インデックス・ブレンド(タイプ )	8,309,619円
野村6資産均等バランス	508,745,304円
野村資産設計ファンド2060	128,220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	733,217,549円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	746,690,917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)	397,825,221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)	1,537,343,725円
野村DC運用戦略ファンド	496,456,181円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	28,351,033円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	2,922,177円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,685,948円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	2,870,848円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	799,696円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	616,991円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	474,617円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	21,483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

## 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11月29日現在

資産総額	185,463,747円
負債総額	9,330,866円
純資産総額（ - ）	176,132,881円
発行済口数	163,461,827口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0775円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019年11月29日現在

資産総額	71,316,225円
負債総額	2,217,802円
純資産総額（ - ）	69,098,423円
発行済口数	62,461,417口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1063円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019年11月29日現在

資産総額	276,963,375円
負債総額	8,480,399円
純資産総額（ - ）	268,482,976円
発行済口数	237,032,840口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1327円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019年11月29日現在

資産総額	66,058,103円
負債総額	2,340,758円
純資産総額（ - ）	63,717,345円
発行済口数	55,264,343口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1530円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2019年11月29日現在

資産総額	238,129,614円
負債総額	12,485,603円
純資産総額（ - ）	225,644,011円
発行済口数	190,522,001口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1843円

## （参考）国内株式マザーファンド

2019年11月29日現在

資産総額	491,582,557,255円
負債総額	37,256,133,014円
純資産総額（ - ）	454,326,424,241円
発行済口数	265,025,868,352口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7143円

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2019年11月29日現在

資産総額	657,829,235,850円
負債総額	1,875,313,720円
純資産総額（ - ）	655,953,922,130円
発行済口数	219,927,530,692口
1口当たり純資産額（ / ）	2.9826円

## （参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

2019年11月29日現在

資産総額	101,517,670,783円
負債総額	49,532,078,925円
純資産総額（ - ）	51,985,591,858円
発行済口数	25,051,488,621口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0751円

## （参考）新興国株式マザーファンド

2019年11月29日現在

資産総額	41,761,347,829円
負債総額	253,422,243円
純資産総額（ - ）	41,507,925,586円
発行済口数	32,838,133,115口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2640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11月29日現在

資産総額	20,014,506,041円
負債総額	241,827,236円
純資産総額（ - ）	19,772,678,805円
発行済口数	14,363,148,250口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3766円

## （参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

2019年11月29日現在

資産総額	726,118,042,511円
負債総額	20,476,579,568円
純資産総額（ - ）	705,641,462,943円
発行済口数	525,124,627,560口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3438円

## （参考）外国債券マザーファンド

2019年11月29日現在

資産総額	617,129,487,334円
負債総額	2,399,591,412円
純資産総額（ - ）	614,729,895,922円
発行済口数	261,470,690,788口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3510円

## （参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2019年11月29日現在

資産総額	121,977,870,352円
負債総額	61,307,870,285円
純資産総額（ - ）	60,670,000,067円



発行済口数	50,755,124,283口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1953円

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2019年11月29日現在

資産総額	7,781,108,937円
負債総額	11,621,404円
純資産総額（ - ）	7,769,487,533円
発行済口数	5,643,527,260口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3767円

## （参考）新興国債券マザーファンド

2019年11月29日現在

資産総額	21,978,730,104円
負債総額	73,021,421円
純資産総額（ - ）	21,905,708,683円
発行済口数	11,234,760,155口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9498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11月29日現在

資産総額	3,593,255,131円
負債総額	16,347円
純資産総額（ - ）	3,593,238,784円
発行済口数	2,835,100,097口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2674円

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2019年11月29日現在

資産総額	47,093,845,869円
負債総額	2,048,435,008円
純資産総額（ - ）	45,045,410,861円
発行済口数	16,480,067,108口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7333円

## （参考）海外REITインデックス マザーファンド

2019年11月29日現在

資産総額	30,961,764,944円
負債総額	72,256,328円
純資産総額（ - ）	30,889,508,616円
発行済口数	11,876,021,088口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6010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11月29日現在

資産総額	13,837,088,151円
負債総額	7,091,132,278円
純資産総額（ - ）	6,745,955,873円
発行済口数	4,185,233,904口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6118円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 委託会社等の概況

< 更新後 >

##### (1) 資本金の額

2019年12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

## &lt;更新後&gt;

「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11月29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	1,005	29,948,655
単位型株式投資信託	178	917,000
追加型公社債投資信託	14	5,576,745
単位型公社債投資信託	441	1,722,742
合計	1,638	38,165,142

### 3 委託会社等の経理状況

#### < 更新後 >

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

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

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

3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表ならびに中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の中間財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査及び中間監査を受けております。

#### (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)
(資産の部)			
流動資産			
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
固定資産					
有形固定資産			874		714
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)	
(負債の部)					
流動負債					
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
固定負債					
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
(純資産の部)					
株主資本			86,078		86,924
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729

資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			55,168		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 (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)	
		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

区分	注記 番号	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)	
		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			
	資本剰余金		利益剰余金	
				その他利益剰余金



	資本金	資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	別途積立金	繰越利益剰余金	利益剰余金合計	株主資本合計
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	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			
		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	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		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	11	11	86,090
当期変動額			
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	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法  (2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3. 固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 38～50年 附属設備 8～15年 構築物 20年 器具備品 4～15年  (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

4．引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、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>
5．消費税等の会計処理方法	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理してあります。
6．連結納税制度の適用	連結納税制度を適用しております。

## 【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 ソフトウェア 53 合計 58	2. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 3 ソフトウェア 307 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。

す。

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

（単位：百万円）

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

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

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業年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	19,546 百万円
勤務費用	929
利息費用	167
数理計算上の差異の発生額	1,415
退職給付の支払額	660
その他	0
退職給付債務の期末残高	21,398
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	16,572 百万円
期待運用収益	414
数理計算上の差異の発生額	395
事業主からの拠出額	510
退職給付の支払額	518
年金資産の期末残高	17,373

## (3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金

## 及び前払年金費用の調整表

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

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	929百万円
利息費用	167
期待運用収益	414
数理計算上の差異の費用処理額	244
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	887

## (5) 年金資産に関する事項

## 年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	47%
株式	41%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%

## 長期期待運用収益率の設定方法

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

## (6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	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	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

確定給付型企業年金制度の割引率	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)
							資金の借入 (*1)	3,000		

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	資金の返済	3,000	短期借入金	-
						役員の兼任	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おりません。	潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
1株当たり当期純利益の算定上の基礎	1株当たり当期純利益の算定上の基礎
損益計算書上の当期純利益 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

## 中間財務諸表

## 中間貸借対照表

		2019年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(資産の部)		
流動資産		
現金・預金		2,212
金銭の信託		42,268
有価証券		5,800
未収委託者報酬		25,161
未収運用受託報酬		4,788
その他		957
貸倒引当金		15
流動資産計		81,173
固定資産		
有形固定資産	1	679
無形固定資産		5,940
ソフトウェア		5,939
その他		0
投資その他の資産		17,485
投資有価証券		1,362
関係会社株式		12,869
前払年金費用		1,736
繰延税金資産		2,096
その他		420
投資損失引当金		999
固定資産計		24,105
資産合計		105,278

		2019年9月30日現在
区分	注記番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
未払金		11,888
未払収益分配金		0
未払償還金		25
未払手数料		7,472
関係会社未払金		3,649
その他未払金	2	739
未払費用		9,291
未払法人税等		1,661
賞与引当金		2,294
その他		181

流動負債計		25,317
固定負債		
退職給付引当金		3,267
時効後支払損引当金		565
固定負債計		3,832
負債合計		29,150
(純資産の部)		
株主資本		76,122
資本金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		45,212
利益準備金		685
その他利益剰余金		44,527
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		19,920
評価・換算差額等		6
その他有価証券評価差額金		6
純資産合計		76,128
負債・純資産合計		105,278

## 中間損益計算書

		自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日
区分	注記 番号	金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		58,947
運用受託報酬		8,401
その他営業収益		158
営業収益計		67,507
営業費用		
支払手数料		20,298
調査費		13,552
その他営業費用		3,856
営業費用計		37,706
一般管理費	1	14,394
営業利益		15,406
営業外収益	2	5,561
営業外費用	3	27
経常利益		20,940
特別利益	4	44
特別損失	5	410
税引前中間純利益		20,574

法人税、住民税及び事業税		5,116
法人税等調整額		610
中間純利益		14,847

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当中間期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
中間純利益							14,847	14,847	14,847
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計	-	-	-	-	-	-	10,802	10,802	10,802
当中間期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	19,920	45,212	76,122

(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	33	33	86,958
当中間期変動額			
剰余金の配当			25,650
中間純利益			14,847
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	27	27	27
当中間期変動額合計	27	27	10,830
当中間期末残高	6	6	76,128

[重要な会計方針]

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

## [注記事項]

## 中間貸借対照表関係

2019年9月30日現在

1 有形固定資産の減価償却累計額	3,881百万円
2 消費税等の取扱い	
仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。	

## 中間損益計算書関係

		自 2019年4月 1日	至 2019年9月30日
1 減価償却実施額			
有形固定資産	38百万円		
無形固定資産	1,145百万円		
2 営業外収益のうち主要なもの			
受取配当金	4,936百万円		
金銭信託運用益	433百万円		
3 営業外費用のうち主要なもの			
時効後支払損引当金繰入	10百万円		
為替差損	6百万円		
4 特別利益の内訳			
投資有価証券等売却益	1百万円		
株式報酬受入益	43百万円		
5 特別損失の内訳			
投資有価証券等評価損	119百万円		
投資損失引当金繰入額	291百万円		

## 中間株主資本等変動計算書関係

					自 2019年4月 1日	至 2019年9月30日
1 発行済株式に関する事項						
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少	当中間会計期間末	
	普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株	
2 配当に関する事項						
	配当金支払額					
	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					
	(1) 配当金の総額			25,650百万円		
	(2) 1株当たり配当額			4,980円		
	(3) 基準日			2019年3月31日		
	(4) 効力発生日			2019年6月28日		

## 金融商品関係

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

## 金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	2,212	2,212	-
(2)金銭の信託	42,268	42,268	-
(3)未収委託者報酬	25,161	25,161	-
(4)未収運用受託報酬	4,788	4,788	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
其他有価証券	5,800	5,800	-
資産計	80,231	80,231	-
(6)未払金	11,888	11,888	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	7,472	7,472	-
関係会社未払金	3,649	3,649	-
其他未払金	739	739	-
(7)未払費用	9,291	9,291	-
(8)未払法人税等	1,661	1,661	-
負債計	22,841	22,841	-

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

    其他有価証券

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

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等



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

注2：非上場株式等(中間貸借対照表計上額：投資有価証券1,362百万円、関係会社株式12,869百万円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

#### 有価証券関係

当中間会計期間末(2019年9月30日)

##### 1. 満期保有目的の債券(2019年9月30日)

該当事項はありません。

##### 2. 子会社株式及び関連会社株式(2019年9月30日)

該当事項はありません。

##### 3. その他有価証券(2019年9月30日)

区分	中間貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
中間貸借対照表計上額 が取得原価を超えない もの			
譲渡性預金	5,800	5,800	-
小計	5,800	5,800	-
合計	5,800	5,800	-

#### セグメント情報等

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

##### 1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

##### 2. 関連情報

###### (1) 製品・サービスごとの情報

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

###### (2) 地域ごとの情報

###### 売上高

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

## 有形固定資産

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

## (3) 主要な顧客ごとの情報

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

## 1 株当たり情報

		自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日
1 株当たり純資産額		14,780円24銭
1 株当たり中間純利益		2,882円67銭
(注) 1. 潜在株式調整後 1 株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。		
2. 1 株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。		
	中間純利益	14,847百万円
	普通株主に帰属しない金額	-
	普通株式に係る中間純利益	14,847百万円
	期中平均株式数	5,150千株

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1 名称、資本金の額及び事業の内容

< 更新後 >

## (1) 受託者

(a) 名称	(b) 資本金の額 <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11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 S B I 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。
a u カブコム証券株式会社	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	
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	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社北越銀行	24,538百万円	

\* 2019年11月末現在

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年12月6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2019年4月23日から2019年10月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2019年10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中間計算期間（2019年4月23日から2019年10月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年12月6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2019年4月23日から2019年10月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2019年10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中間計算期間（2019年4月23日から2019年10月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年12月6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2019年4月23日から2019年10月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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



## 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2019年10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中間計算期間（2019年4月23日から2019年10月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年12月6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2019年4月23日から2019年10月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2019年10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中間計算期間（2019年4月23日から2019年10月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年12月6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2019年4月23日から2019年10月22日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2019年10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中間計算期間（2019年4月23日から2019年10月22日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 利害関係

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

[次へ](#)

## 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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28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2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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



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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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

以 上

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