

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年7月15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】	東京都江東区豊洲二丁目2番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-6387-5000
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ） インデックス・ブレンド（タイプ ）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。 インデックス・ブレンド（タイプ ） 1兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【証券情報】

## (1)【ファンドの名称】

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

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

ファンドの名称については、正式名称ではなく略称で記載する場合があります。

正式名称	略称
インデックス・ブレンド(タイプ )	タイプ
インデックス・ブレンド(タイプ )	タイプ
インデックス・ブレンド(タイプ )	タイプ
インデックス・ブレンド(タイプ )	タイプ
インデックス・ブレンド(タイプ )	タイプ

## (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

## 信用格付

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

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

## (3)【発行（売出）価額の総額】

各ファンドにつき1兆円を上限とします。

## (4)【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

#### (5) 【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2% (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。

#### (6) 【申込単位】

1万口以上1口単位(当初元本1口=1円)または1万円以上1円単位

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

#### (7) 【申込期間】

2020年7月16日から2021年7月15日まで

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

#### (8) 【申込取扱場所】

ファンドの申込取扱場所(以下「販売会社」といいます。)については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

#### (9) 【払込期日】

販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

各取得申込日の発行価額の総額は、各販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、「委託者」(または「委託会社」といいます。)の指定する口座を経由して、「受託者」(または「受託会社」といいます。)の指定するファンド口座に払い込まれます。

**（ 1 0 ） 【 払込取扱場所 】**

申込代金は申込みの販売会社にお支払いください。払込取扱場所についてご不明の場合は、下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

**（ 1 1 ） 【 振替機関に関する事項 】**

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**（ 1 2 ） 【 その他 】**

該当事項はありません。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### （1）【ファンドの目的及び基本的性格】

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

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

##### 信託金の限度額

信託金限度額は、各ファンドにつき5,000億円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

##### <商品分類>

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

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

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

##### 《商品分類表》

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

## 《属性区分表》

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

## &lt; 商品分類表定義 &gt;

## [ 単位型投信・追加型投信の区分 ]

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

## [ 投資対象地域による区分 ]

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

## [ 投資対象資産による区分 ]

- (1) 株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載

があるものをいう。

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

#### [ 独立した区分 ]

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

#### [ 補足分類 ]

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

#### < 属性区分表定義 >

##### [ 投資対象資産による属性区分 ]

###### 株式

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

###### 債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

##### [ 決算頻度による属性区分 ]

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

##### [ 投資対象地域による属性区分(重複使用可能) ]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載が

あるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。

- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (4)欧州...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (5)アジア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (6)オセアニア...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (7)中南米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (8)アフリカ...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (9)中近東(中東)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (10)エマージング...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。

#### [ 投資形態による属性区分 ]

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

#### [ 為替ヘッジによる属性区分 ]

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

#### [ インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分 ]

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

#### [ 特殊型 ]

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

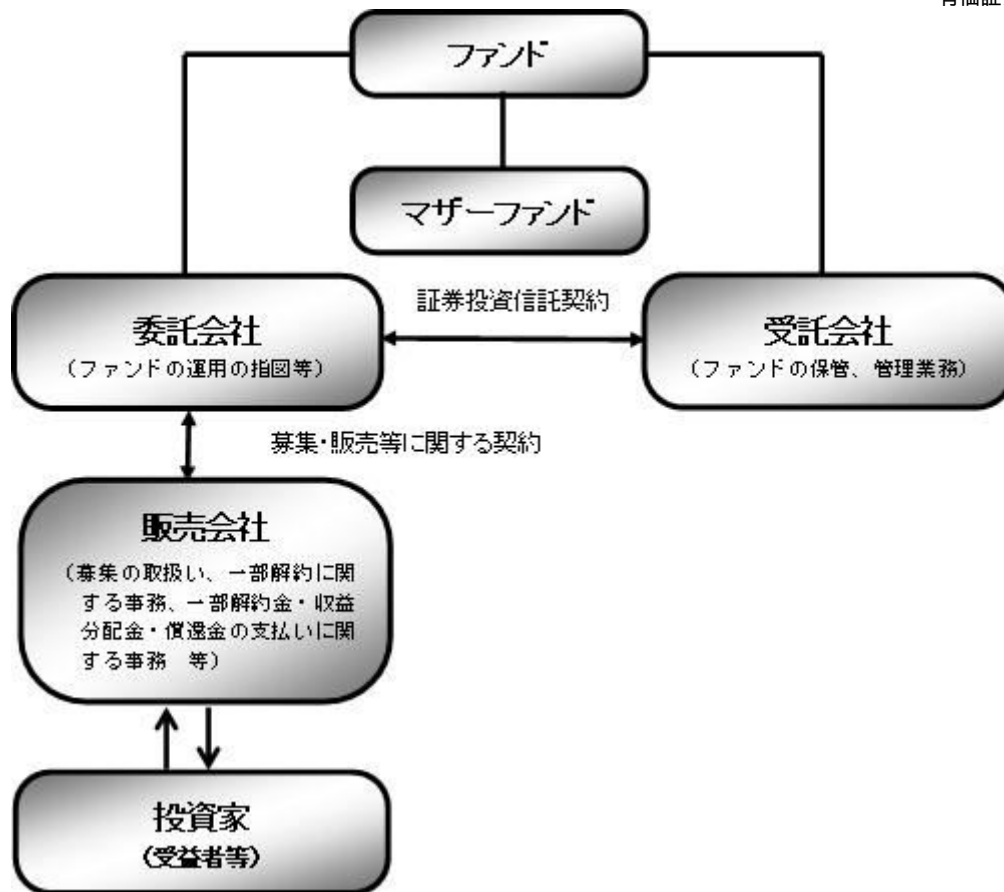
## ( 2 ) 【ファンドの沿革】

2017年1月10日

信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

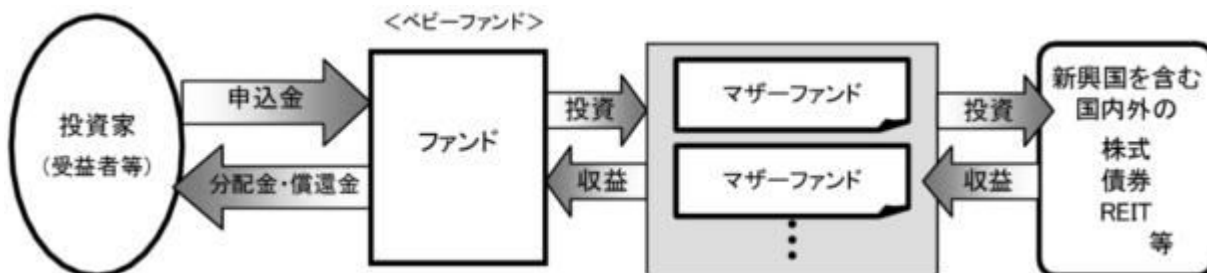
## ( 3 ) 【ファンドの仕組み】





#### 《ファミリーファンド方式について》

ファンドはファミリーファンド方式で運用します。ファミリーファンド方式とは、投資家の皆様が投資した資金をまとめてベビーファンドとし、その資金をマザーファンドに投資して、実質的な運用を行なうしくみをいいます。



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

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

上記マザーファンドは2020年7月15日現在のものであり、変更する場合があります。

#### 委託会社の概況(2020年5月末現在)

##### ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

##### ・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】

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

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

投資対象とする各マザーファンドは、各々以下の指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数	リスク性資産
国内株式マザーファンド	わが国の株式	東証株価指数（TOPIX）	
外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSA I 指数（円ベース・為替ヘッジなし） ・MSCI-KOKUSA I 指数をもとに、委託会社が円換算したものです。	
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSA I 指数（円ベース・為替ヘッジあり）	

新興国株式マザーファンド	新興国の株式(DR (預託証券) <sup>*1</sup> を 含みます。)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース) ・MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配 当込み・ドルベース)をもとに、委託会社が円換算 したものです。	
米国株式配当貴族インデックス マザーファンド	米国の株式	S&P 500配当貴族指数(配当込み・円換算ベー (注1) ス) ・S&P 500配当貴族指数(配当込み・米ドル建て)をも とに、委託会社が円換算したものです。	
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI総合	
外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジな し・円ベース)	
外国債券為替ヘッジ型 マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッ ジ・円ベース)	
新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	現地通貨建ての新興 国の公社債	JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデック ス・エマージング・マーケット・グローバル・ ディバーシファイド(円換算ベース) ・JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベー 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) (注1) ・JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース)をもとに、委託会社が円換算 したものです。	(注2)
米国ハイ・イールド債券イン デックスマザーファンド	米ドル建てのハイ・ イールド社債	ブルームバーグ・パークレイズ米国ハイイールド 社債高流動性インデックス(ヘッジなし・円換算 ベース) (注1) ・ブルームバーグ・パークレイズ米国ハイイールド社 債高流動性インデックス(USドルベース)をもとに、 委託会社が円換算したものです。	
J-REITインデックス マザーファンド	J-REIT <sup>*2</sup>	東証REIT指数(配当込み)	
海外REITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国 のREIT <sup>*3</sup>	S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換 算ベース) ・S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルベー 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7月15日現在のものであり、変更する場合があります。

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

\*2 わが国の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。)とします。

\*3 世界の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。)とします。なお、国によっては、「不動産投資信託証券」について、「REIT」という表記を用いていない場合もありますが、ファンドにおいては、こうした場合も含め、全て「REIT」といいます。

(注1) マザーファンドでは原則として為替ヘッジを行ないませんが、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。

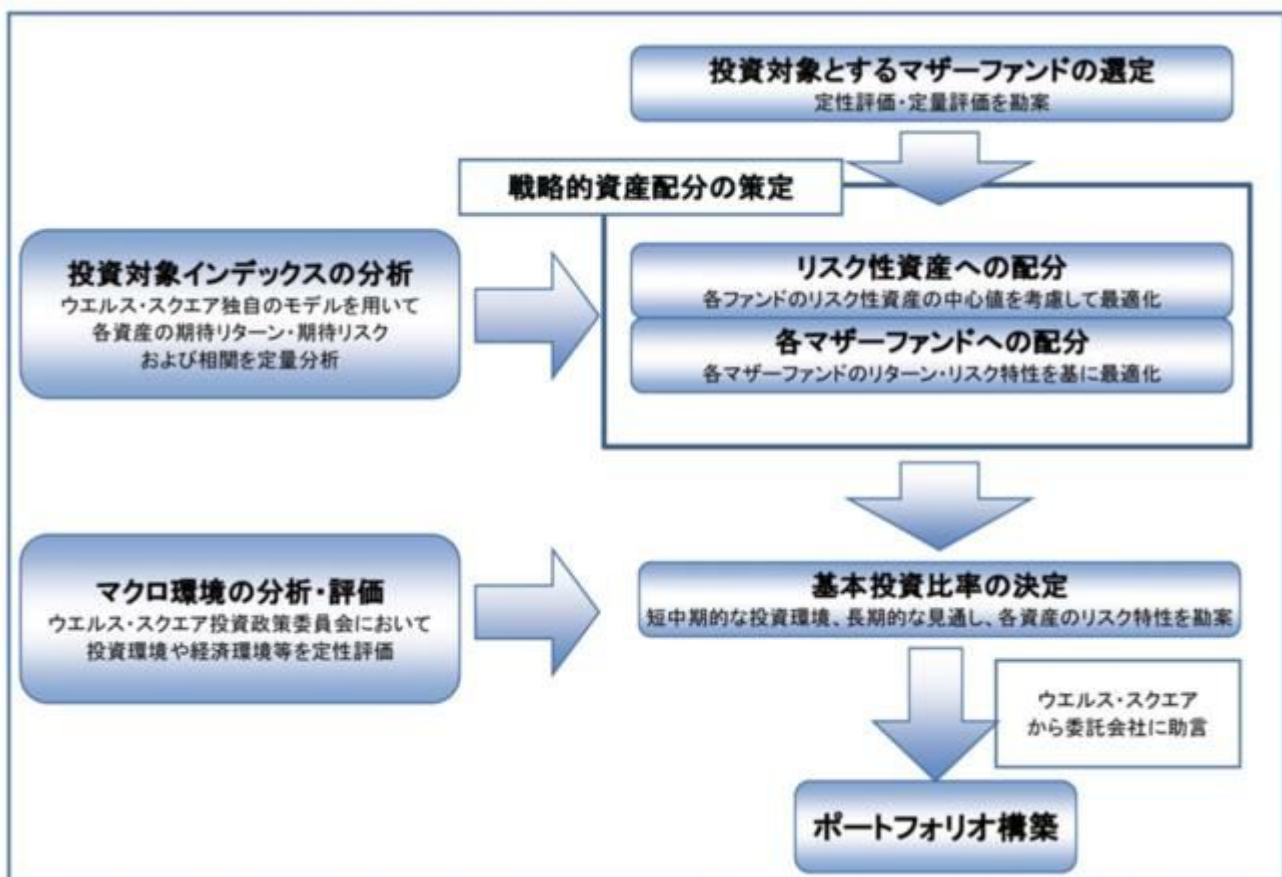
株式会社ウエルス・スクエア(ウエルス・スクエア) による以下のプロセスに従った助言に基づいて投資対象とするマザーファンドおよび各マザーファンドへの投資比率を決定します。

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、適宜見直しを行ないます。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) ウェルス・スクエアについて

ウェルス・スクエアの概要

株式会社ウェルス・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、参加もしておりません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

ていたとしても、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

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

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7月15日現在の組入マザーファンドであり、変更する場合があります。

### 投資の対象とする資産の種類（信託約款）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

- 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ロ．次に掲げるものをすべてみたす資産

- ・リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティー・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するもの
- ・流動性に考慮し、時価の取得が可能なもの
- ・前号または本号イに掲げるものに該当しないもの

### 有価証券の指図範囲等（信託約款）

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された別に定める親投資信託証券（以下「各マザーファンド」といいます。）のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。

- 株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

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

6．特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

す。）

7. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
9. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
10. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券および新株予約権証券
13. 外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
14. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の性質を有するもの
15. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
16. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。）
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

#### 金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記 に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形

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

#### その他の投資対象

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

「金利先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日（以下「決済日」という。）における決済日から一定の期間を経過した日（以下「満期日」という。）までの期間に係る国内又は海外において代表的利率として公表される預金契約又は金銭の貸借契約に基づく債権の利率（以下「指標利率」という。）の数値を取り決め、その取決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額及び当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### 5. 為替先渡取引

「為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引（同一の相手方との間で直物外国為替取引及び当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいう。）のスワップ幅（当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいう。）を取り決め、その取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭又はその取決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

#### 6. 直物為替先渡取引

「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

## （国内株式マザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1．基本方針

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

## 2．運用方法

## (1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

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

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

## (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

## （外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1．基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

（外国株式為替ヘッジ型マザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

この投資信託は、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

## 2. 運用方法

### (1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指します。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。

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ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

## (3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の上場投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

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

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

（国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

主としてわが国の公社債に投資することにより、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指します。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

## （外国債券マザーファンド）

### 運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1．基本方針

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

#### 2．運用方法

##### (1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

##### (3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそ

それぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

## （外国債券為替ヘッジ型マザーファンド）

### 運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1．基本方針

この投資信託は、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

#### 2．運用方法

##### (1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

##### (2) 投資態度

主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

##### (3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

## （新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド）

### 運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1．基本方針

この投資信託は、JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

## 2．運用方法

### (1) 投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

### (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

（新興国債券マザーファンド）

## 運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

## 1．基本方針

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

## 2．運用方法

### (1) 投資対象

新興国の公社債を主要投資対象とします。

## (2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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

## (3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

（米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

この投資信託は、ブルームバーグ・バークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

米ドル建てのハイ・イールド社債を主要投資対象とします。

#### (2) 投資態度

米ドル建てのハイ・イールド社債を主要投資対象とし、ブルームバーグ・バークレイズ米国ハイイールド社債高流動性インデックス（ヘッジなし・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、米国国債に投資する場合があります。

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

（ETF）を活用する場合があります。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

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

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

## （J-REITインデックス マザーファンド）

### 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

#### 1. 基本方針

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

#### 2. 運用方法

##### (1) 投資対象

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

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

##### (2) 投資態度

J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は行ないません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が30%を超えるJ-REITがある場合には、当該J-REITへ東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

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

（海外REITインデックス マザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

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

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

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

#### (2) 投資態度

REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

株式への直接投資は行ないません。



不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

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

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

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

（海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド）

## 運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

### 1. 基本方針

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

### 2. 運用方法

#### (1) 投資対象

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

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

#### (2) 投資態度

日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円ヘッジ）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

#### (3) 投資制限

投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

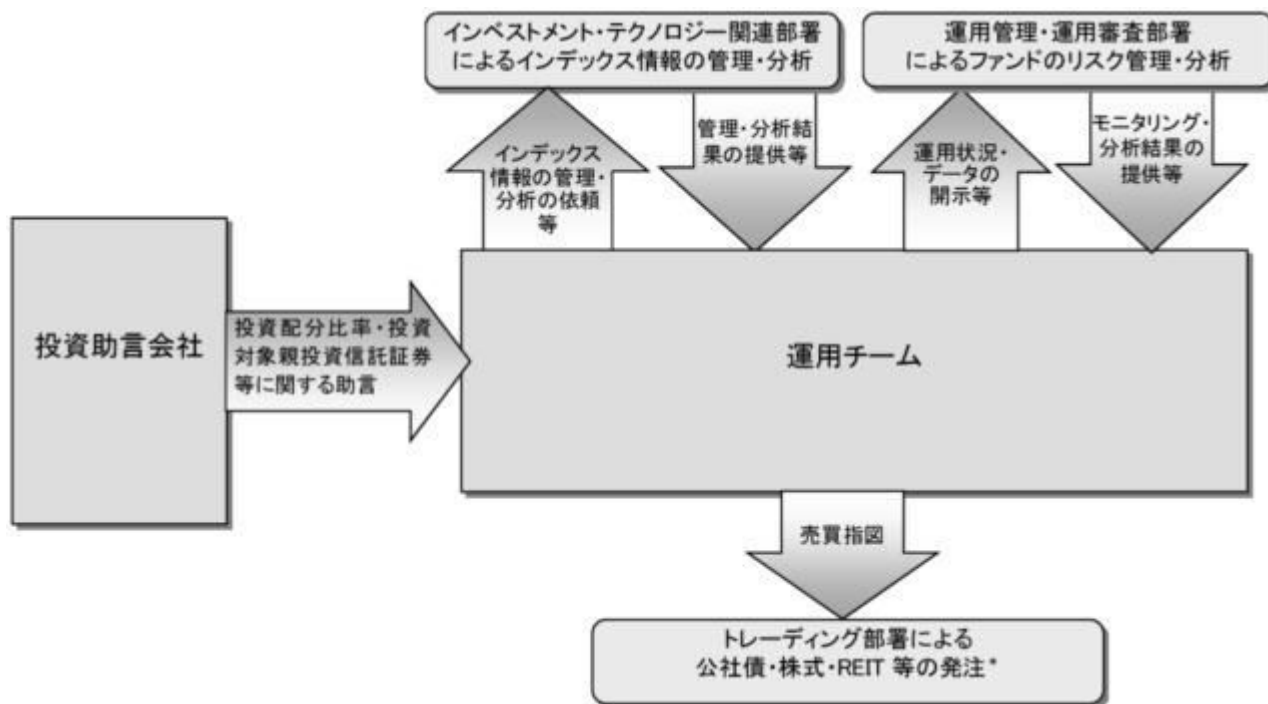
外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

### （3）【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。



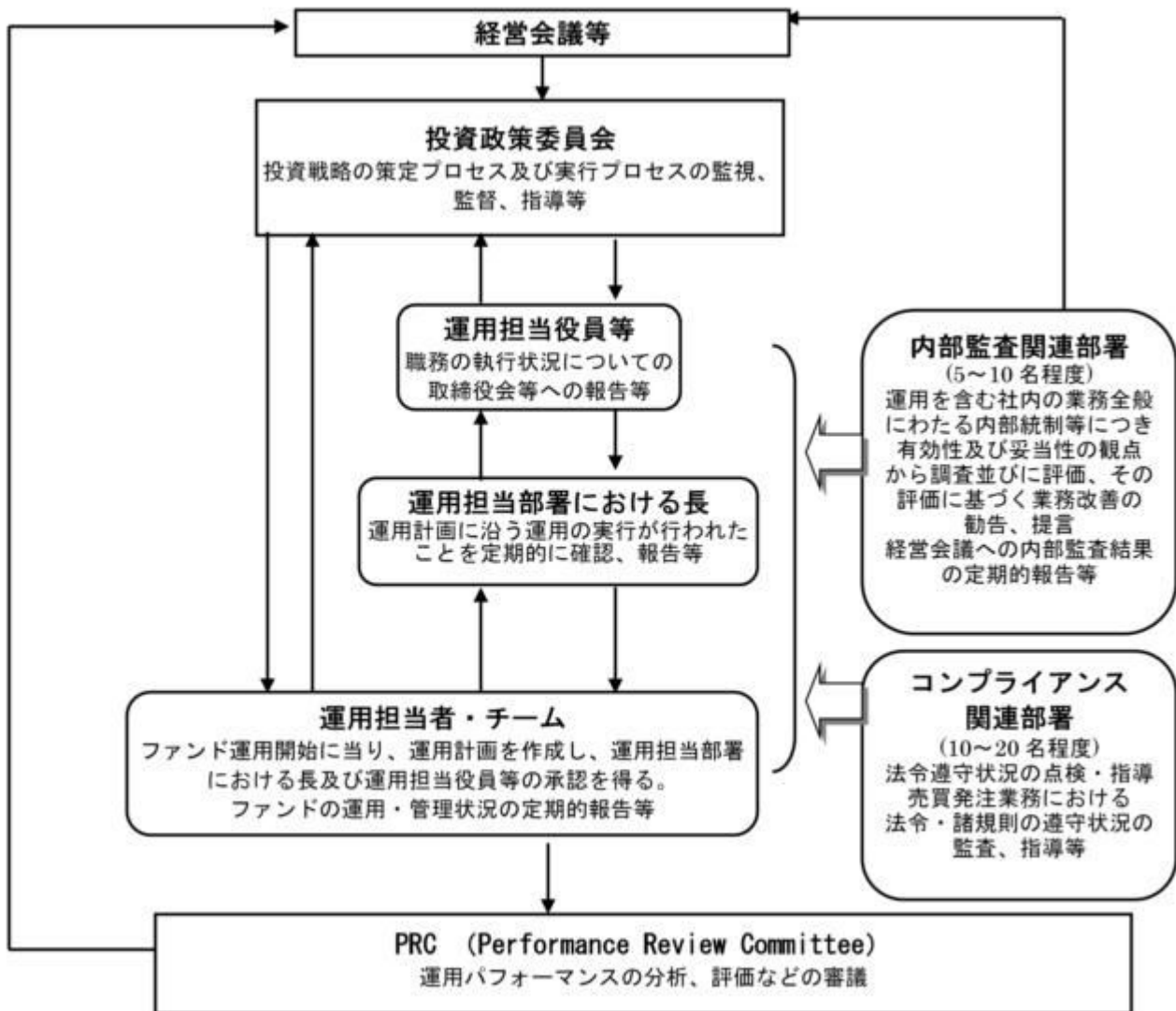
\*一部のマザーファンドにおける公社債等の発注業務（発注に伴う裁量権は付与しないものとします。）の一部をノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッドに代行させます。

運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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

す。



#### 委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

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

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

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

ファンドの決算日

原則として**毎年4月22日**(休業日の場合は翌営業日)を決算日とします。

## (5) 【投資制限】

運用の基本方針 2. 運用方法 (3) 投資制限 (信託約款)

- ・ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。
- ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

投資する株式等の範囲(信託約款)

- ( ) 委託者が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- ( ) 上記( )の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託者が投資することを指図することができるものとします。

信用取引の指図範囲(信託約款)

- ( ) 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。
- ( ) 上記( )の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  2. 株式分割により取得する株券

3. 有償増資により取得する株券
4. 売り出しにより取得する株券
5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使により取得可能な株券  
転換社債型新株予約権付社債とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）をいいます。
6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前号のものを除きます。）の行使により取得可能な株券

#### 先物取引等の運用指図(信託約款)

- ( )委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引ならびに有価証券店頭デリバティブ取引（金融商品取引法第28条第8項第4号イからニに掲げるものをいいます。以下同じ。）を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- ( )委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- ( )委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。
- ( )上記( )の店頭デリバティブ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ( )委託者は、上記( )の店頭デリバティブ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

#### スワップ取引の運用指図(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取り金利または異なった受取り金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引および有価証券店頭指数等スワップ取引（金融商品取引法第28条第8項第4号ホに掲げるものをいいます。以下同じ。）（これらを総称して以下「スワップ取引」といいます。）を行なうことの指図をすることができます。
- ( )スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ( )スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ( )委託者は、スワップ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## クレジットデリバティブ取引の運用指図(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、クレジットデリバティブ取引(金融商品取引法第2条第21項第5号イ、同条第22項第6号イに掲げるものおよび外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引をいいます。以下同じ。)を行なうことの指図をすることができます。
- ( )クレジットデリバティブ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ( )クレジットデリバティブ取引(金融商品取引法第2条第22項第6号イに掲げるものに限りです。)の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ( )委託者は、クレジットデリバティブ取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

## 有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - 1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。
  - 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
- ( )上記( )に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- ( )委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

## 公社債の借入れ(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行なうものとします。
- ( )上記( )の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- ( )信託財産の一部解約等の事由により、上記( )の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- ( )上記( )の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

## 金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ( )金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ( )金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

す。

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券（外国通貨表示の有価証券をいいます。以下同じ。）への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、直物為替先渡取引を行なうことの指図をすることができます。
- ( )直物為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- ( )直物為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が提示する価額、価格情報会社が提供する価額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。
- ( )委託者は、直物為替先渡取引を行なうにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行なうものとします。

資金の借入れ(信託約款)

- ( )委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。
- ( )一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- ( )収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- ( )借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

- ( )委託者が運用の指図を行なうすべてのファンドで保有する当該株式に係る議決権の総数
- ( )当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数

### 3【投資リスク】

#### 基準価額の変動要因

ファンドの基準価額は、投資を行なっている有価証券等の値動きによる影響を受けますが、これらの運用

による損益はすべて投資者の皆様へ帰属します。

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

#### [株価変動リスク]

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

#### [REITの価格変動リスク]

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

#### [債券価格変動リスク]

債券（公社債等）は、市場金利や信用度の変動により価格が変動します。ファンドは実質的に債券に投資を行ないますので、これらの影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の債券価格の変動は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。また、ファンドが実質的に投資を行なうハイ・イールド社債等の格付けの低い債券については、格付けの高い債券に比べ、価格が大きく変動する可能性や組入債券の元利金の支払遅延および支払不履行などが生じるリスクが高いと想定されます。

#### [為替変動リスク]

ファンドは、基本投資比率の決定において為替ヘッジを行なうこととした実質組入外貨建資産については、マザーファンドもしくはファンドにおいて為替ヘッジを行ない為替変動リスクの低減を図りますが、その他の実質組入外貨建資産については、為替変動の影響を受けます。なお、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図る場合においても、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

#### その他の留意点

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

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

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

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

投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。また、投資対象に含まれる一部のマザーファンドにおいてはベビーファンドの換金等に伴ない、マザーファンドの換金を行なう場合には、原則として当該マザーファンドの信託財産に信託財産留保額を繰り入れます。

ファンドが実質的な投資対象とするREITの中には、流動性の低いものもあり、こうしたREITへの投資は、



流動性の高い株式等に比べて制約を受けることが想定されます。

REITに関する法律（税制度、会計制度等）、不動産を取り巻く規制が変更となった場合、REITの価格や配当に影響が及ぶことが想定されます。

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

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

金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、投資信託約款の規定に従い、委託会社の判断でファンドの購入（スイッチングによる購入を含みます。）・換金の各受付けを中止すること、およびすでに受付けた購入（スイッチングによる購入を含みます。）・換金の各受付けを取り消す場合があります。

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

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

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

## 委託会社におけるリスクマネジメント体制

### リスク管理関連の委員会

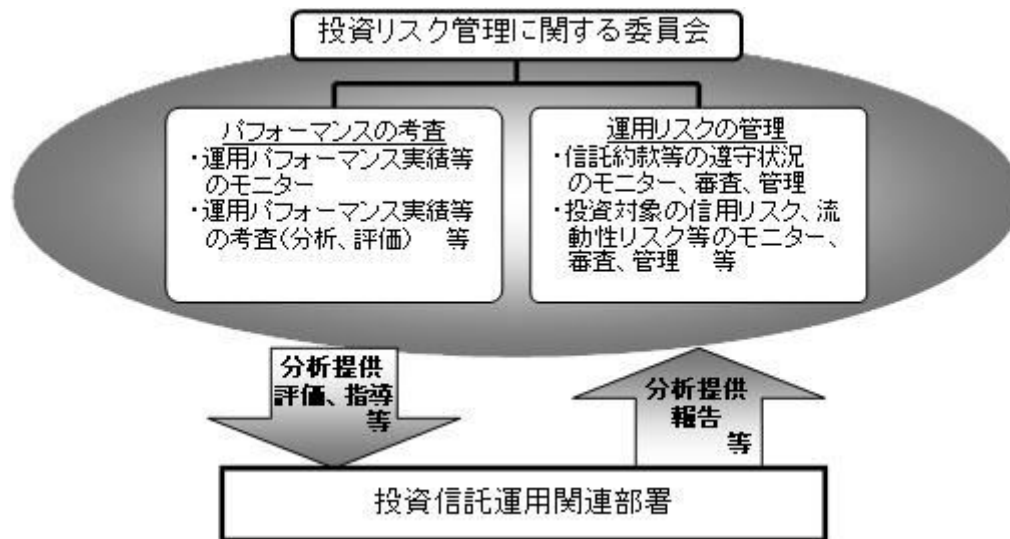
#### パフォーマンスの考査

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

#### 運用リスクの管理

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

## リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

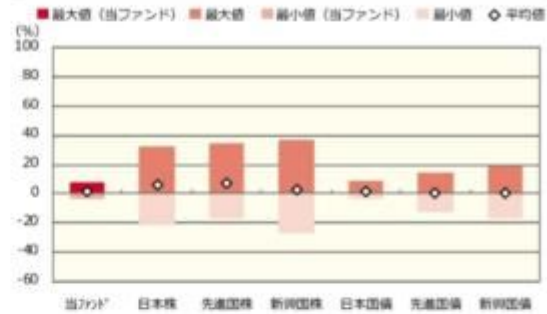
## ■ リスクの定量的比較 (2015年6月末～2020年5月末：月次)

### ■ タイプⅠ

#### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



#### ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	7.5	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値 (%)	△ 3.6	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	1.9	5.5	7.1	3.1	1.9	0.9	0.3

- \* 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2020年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

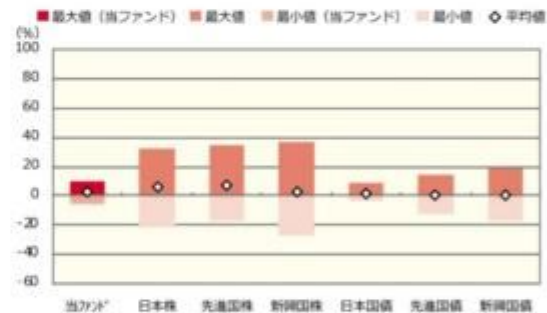
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2015年6月から2020年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2020年5月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

### ■ タイプⅡ

#### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



#### ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	10.4	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値 (%)	△ 5.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.3	5.5	7.1	3.1	1.9	0.9	0.3

- \* 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2020年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2015年6月から2020年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2020年5月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

### タイプⅢ

#### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2015年6月 2016年5月 2017年5月 2018年5月 2019年5月 2020年5月

- \* 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2020年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

#### 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 (%)	13.2	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値 (%)	△ 6.9	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.6	5.5	7.1	3.1	1.9	0.9	0.3

- \* 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。
- \* 2015年6月から2020年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2020年5月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

### タイプⅣ

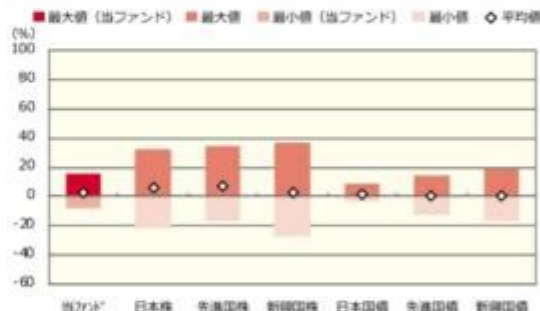
#### ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2015年6月 2016年5月 2017年5月 2018年5月 2019年5月 2020年5月

- \* 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2020年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

#### 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 (%)	15.4	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値 (%)	△ 8.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	2.7	5.5	7.1	3.1	1.9	0.9	0.3

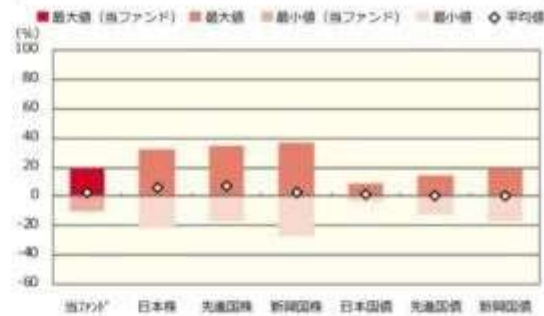
- \* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- \* 2015年6月から2020年5月の5年間（当ファンドは2018年1月から2020年5月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- \* 決算日に対応した数値とは異なります。
- \* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## タイプV

## ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



## ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	18.6	32.2	34.1	37.2	9.3	14.0	19.3
最小値 (%)	△10.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値 (%)	3.1	5.5	7.1	3.1	1.9	0.9	0.3

- 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2020年5月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 2015年6月から2020年5月の5年間(当ファンドは2018年1月から2020年5月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

## &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・ディバーシファイド(円ベース)

## ■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

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

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

## 4【手数料等及び税金】

## (1)【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（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。

## （２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

## （３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に下記の信託報酬率を乗じて得た額とします。ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

信託報酬率の配分については次の通り(税抜)とします。

ファンド	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】

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】

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。

分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本と同額の場合または受益者の個別元本を上回っている場合には分配金の全額が普通分配金となります。





分配金落ち後の基準価額が受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、分配金発生時にその個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者の個別元本となります。



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(2020年5月末現在)が変更になる場合があります。

## 5【運用状況】

以下は2020年5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	141,604,611	99.25
現金・預金・その他資産(負債控除後)		1,063,447	0.74
合計(純資産総額)		142,668,058	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	92,069,327	99.70
現金・預金・その他資産(負債控除後)		274,142	0.29
合計(純資産総額)		92,343,469	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	317,852,419	99.75
現金・預金・その他資産(負債控除後)		789,125	0.24
合計(純資産総額)		318,641,544	100.00

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	85,073,051	99.72
現金・預金・その他資産（負債控除後）		237,267	0.27
合計（純資産総額）		85,310,318	100.00

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	232,285,741	99.36
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,489,827	0.63
合計（純資産総額）		233,775,568	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	430,915,748,340	96.79
現金・預金・その他資産（負債控除後）		14,291,057,516	3.20
合計（純資産総額）		445,206,805,856	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	9,166,920,000	2.05

## （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	440,325,041,616	67.71
	カナダ	21,378,558,059	3.28
	ドイツ	19,017,143,441	2.92
	イタリア	4,492,565,516	0.69
	フランス	22,415,115,925	3.44
	オランダ	8,762,863,754	1.34
	スペイン	5,375,708,375	0.82

	ベルギー	1,848,797,590	0.28
	オーストリア	391,894,337	0.06
	ルクセンブルグ	253,648,022	0.03
	フィンランド	2,284,735,539	0.35
	アイルランド	1,267,552,969	0.19
	ポルトガル	384,277,522	0.05
	イギリス	31,502,083,896	4.84
	スイス	22,187,846,399	3.41
	スウェーデン	6,199,613,347	0.95
	ノルウェー	1,219,560,959	0.18
	デンマーク	4,925,769,721	0.75
	オーストラリア	13,179,862,135	2.02
	ニュージーランド	668,099,632	0.10
	香港	6,344,408,796	0.97
	シンガポール	2,150,387,348	0.33
	イスラエル	694,993,315	0.10
	小計	617,270,528,213	94.92
投資証券	アメリカ	13,868,099,077	2.13
	カナダ	131,492,485	0.02
	フランス	391,646,605	0.06
	イギリス	353,590,835	0.05
	オーストラリア	989,710,120	0.15
	香港	310,959,852	0.04
	シンガポール	302,519,208	0.04
	小計	16,348,018,182	2.51
現金・預金・その他資産（負債控除後）		16,681,551,366	2.56
合計（純資産総額）		650,300,097,761	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	12,103,350,987	1.86
	買建	カナダ	574,777,680	0.08
	買建	ドイツ	1,786,497,298	0.27
	買建	イギリス	849,612,715	0.13
	買建	スイス	587,273,235	0.09
	買建	オーストラリア	376,043,040	0.05

（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	32,221,619,048	68.41
	カナダ	1,567,378,952	3.32
	ドイツ	1,394,325,112	2.96
	イタリア	328,884,311	0.69
	フランス	1,642,175,861	3.48
	オランダ	642,968,116	1.36
	スペイン	393,638,672	0.83
	ベルギー	135,716,978	0.28
	オーストリア	27,009,512	0.05
	ルクセンブルグ	16,454,712	0.03
	フィンランド	167,509,348	0.35
	アイルランド	93,800,126	0.19
	ポルトガル	27,731,796	0.05
	イギリス	2,305,759,045	4.89
	スイス	1,624,473,028	3.44
	スウェーデン	454,446,321	0.96
	ノルウェー	88,762,889	0.18
	デンマーク	359,743,182	0.76
	オーストラリア	966,672,461	2.05
	ニュージーランド	48,246,622	0.10
香港	463,881,071	0.98	
シンガポール	155,271,700	0.32	
イスラエル	50,724,351	0.10	
小計		45,177,193,214	95.91
投資証券	アメリカ	1,014,200,002	2.15
	カナダ	7,050,894	0.01
	フランス	26,817,413	0.05
	イギリス	27,135,029	0.05
	オーストラリア	68,438,634	0.14
	香港	23,750,988	0.05
	シンガポール	24,873,648	0.05
小計		1,192,266,608	2.53
現金・預金・その他資産（負債控除後）		730,034,213	1.54
合計（純資産総額）		47,099,494,035	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	767,688,929	1.62
	買建	カナダ	43,108,326	0.09

買建	ドイツ	114,188,484	0.24
買建	イギリス	57,740,669	0.12
買建	スイス	33,241,881	0.07
買建	オーストラリア	20,891,280	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	5,973,143,388	15.55
	メキシコ	677,706,179	1.76
	ブラジル	1,893,538,990	4.93
	チリ	95,029,524	0.24
	コロンビア	36,849,039	0.09
	ギリシャ	59,267,711	0.15
	イギリス	32,771,355	0.08
	トルコ	164,841,051	0.42
	チェコ	46,113,826	0.12
	ハンガリー	93,137,402	0.24
	ポーランド	280,165,022	0.72
	香港	8,681,234,937	22.61
	マレーシア	676,196,718	1.76
	タイ	866,164,749	2.25
	フィリピン	294,964,218	0.76
	インドネシア	547,852,199	1.42
	韓国	4,297,396,410	11.19
	台湾	4,507,738,590	11.74
	インド	2,916,658,138	7.59
	パキスタン	9,452,591	0.02
	カタール	333,428,416	0.86
	エジプト	45,200,990	0.11
	南アフリカ	1,403,676,690	3.65
アラブ首長国連邦	182,326,916	0.47	
サウジアラビア	942,544,480	2.45	
	小計	35,057,399,529	91.31
投資信託受益証券	アメリカ	1,472,492,055	3.83
投資証券	メキシコ	17,555,565	0.04
	南アフリカ	14,836,421	0.03
	小計	32,391,986	0.08
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,831,497,719	4.77
合計（純資産総額）		38,393,781,289	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	1,553,536,971	4.04
	買建	シンガポール	234,111,627	0.60

（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	26,720,726,093	94.01
投資信託受益証券	アメリカ	190,463,587	0.67
投資証券	アメリカ	1,277,709,676	4.49
現金・預金・その他資産（負債控除後）		232,012,655	0.81
合計（純資産総額）		28,420,912,011	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	212,339,491	0.74

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	538,323,846,350	79.31
地方債証券	日本	47,228,863,656	6.95
特殊債券	日本	61,012,659,104	8.98
社債券	日本	28,638,058,250	4.21
現金・預金・その他資産（負債控除後）		3,523,331,221	0.51
合計（純資産総額）		678,726,758,581	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	264,880,890,824	45.73
	カナダ	11,206,491,695	1.93
	メキシコ	4,597,711,147	0.79
	ドイツ	35,618,459,163	6.15
	イタリア	56,990,348,202	9.84

	フランス	55,450,184,953	9.57
	オランダ	8,812,663,559	1.52
	スペイン	39,636,264,620	6.84
	ベルギー	13,481,985,240	2.32
	オーストリア	7,613,072,868	1.31
	フィンランド	2,534,600,313	0.43
	アイルランド	6,113,054,307	1.05
	イギリス	38,054,528,303	6.57
	スウェーデン	1,653,392,469	0.28
	ノルウェー	1,445,785,064	0.24
	デンマーク	2,913,122,680	0.50
	ポーランド	3,503,786,134	0.60
	オーストラリア	11,831,694,052	2.04
	シンガポール	2,615,847,750	0.45
	マレーシア	2,826,587,436	0.48
	イスラエル	2,229,484,797	0.38
	小計	574,009,955,576	99.11
現金・預金・その他資産（負債控除後）		5,151,106,838	0.88
合計（純資産総額）		579,161,062,414	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	31,189,708,961	46.29
	カナダ	1,241,184,790	1.84
	メキシコ	527,339,407	0.78
	ドイツ	4,670,507,518	6.93
	イタリア	6,249,567,079	9.27
	フランス	6,621,115,174	9.82
	オランダ	1,354,229,294	2.01
	スペイン	4,098,670,075	6.08
	ベルギー	1,782,698,108	2.64
	オーストリア	908,701,306	1.34
	フィンランド	354,369,801	0.52
	アイルランド	672,938,336	0.99
	イギリス	4,537,281,587	6.73
	スウェーデン	191,023,115	0.28
	ノルウェー	126,338,188	0.18
	デンマーク	294,171,207	0.43
	ポーランド	373,102,142	0.55
	オーストラリア	1,321,805,751	1.96

	シンガポール	653,533,437	0.97
	イスラエル	224,287,006	0.33
	小計	67,392,572,282	100.03
現金・預金・その他資産（負債控除後）		26,701,959	0.03
合計（純資産総額）		67,365,870,323	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	670,021,911	9.58
	ブラジル	659,419,640	9.43
	チリ	184,896,724	2.64
	コロンビア	400,713,017	5.73
	ペルー	259,848,038	3.71
	ウルグアイ	8,932,426	0.12
	ドミニカ共和国	12,455,899	0.17
	トルコ	208,532,623	2.98
	チェコ	309,813,895	4.43
	ハンガリー	244,122,385	3.49
	ポーランド	603,614,827	8.63
	ロシア	598,222,176	8.55
	ルーマニア	196,670,879	2.81
	マレーシア	448,351,923	6.41
	タイ	632,199,708	9.04
	フィリピン	21,292,008	0.30
	インドネシア	662,945,283	9.48
	南アフリカ	512,559,612	7.33
中国	119,116,350	1.70	
	小計	6,753,729,324	96.63
現金・預金・その他資産（負債控除後）		235,037,470	3.36
合計（純資産総額）		6,988,766,794	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	21,260,271,228	96.36
現金・預金・その他資産（負債控除後）		801,883,800	3.63
合計（純資産総額）		22,062,155,028	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	3,521,525,680	96.16
現金・預金・その他資産（負債控除後）		140,593,504	3.83
合計（純資産総額）		3,662,119,184	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	34,914,176,650	94.98
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,843,429,275	5.01
合計（純資産総額）		36,757,605,925	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	1,246,833,000	3.39

（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	19,454,675,620	74.93
	カナダ	474,068,252	1.82
	ドイツ	73,373,358	0.28
	イタリア	3,871,725	0.01
	フランス	594,095,948	2.28
	オランダ	47,141,409	0.18
	スペイン	139,233,426	0.53
	ベルギー	313,132,967	1.20
	アイルランド	35,356,831	0.13
	イギリス	1,361,962,463	5.24
	オーストラリア	1,668,524,459	6.42
	ニュージーランド	112,217,867	0.43
	香港	464,826,697	1.79
	シンガポール	1,017,716,934	3.91
	韓国	3,987,620	0.01

	イスラエル	18,561,904	0.07
	小計	25,782,747,480	99.30
現金・預金・その他資産（負債控除後）		180,787,855	0.69
合計（純資産総額）		25,963,535,335	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	164,897,250	0.63

## （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	4,636,211,499	73.47
	カナダ	112,649,717	1.78
	ドイツ	17,501,984	0.27
	イタリア	851,779	0.01
	フランス	141,395,635	2.24
	オランダ	11,192,859	0.17
	スペイン	33,206,892	0.52
	ベルギー	74,972,322	1.18
	アイルランド	8,510,647	0.13
	イギリス	324,557,256	5.14
	オーストラリア	397,468,454	6.29
	ニュージーランド	26,801,532	0.42
	香港	110,346,113	1.74
	シンガポール	241,430,141	3.82
	イスラエル	4,640,476	0.07
	小計	6,141,737,306	97.33
現金・預金・その他資産（負債控除後）		168,110,835	2.66
合計（純資産総額）		6,309,848,141	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	217,664,371	3.44

## （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	57,766,641	1.3355	77,152,373	1.3328	76,991,379	53.96
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	12,198,715	1.2377	15,099,483	1.2401	15,127,626	10.60
3	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	5,154,286	1.7838	9,194,216	1.9488	10,044,672	7.04
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	2,863,716	2.4903	7,131,512	2.7600	7,903,856	5.54
5	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	4,908,830	1.4408	7,072,643	1.5997	7,852,655	5.50
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	2,923,546	1.8260	5,338,497	1.9307	5,644,490	3.95
7	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	2,073,890	2.3761	4,927,944	2.4005	4,978,372	3.48
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	2,461,446	1.1087	2,729,058	1.2207	3,004,687	2.10
9	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデッ クスマザーファンド	2,412,205	1.1447	2,761,345	1.1977	2,889,097	2.02
10	日本	親投資信託 受益証券	J - R E I Tインデックス マ ザーファンド	1,345,251	1.9208	2,583,959	2.1396	2,878,299	2.01
11	日本	親投資信託 受益証券	海外R E I Tインデックス マ ザーファンド	1,442,890	1.8368	2,650,301	1.9941	2,877,266	2.01
12	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,284,998	1.0428	1,339,996	1.0990	1,412,212	0.98

## 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	99.25
合 計	99.25

## 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	28,714,597	1.3358	38,359,083	1.3328	38,270,814	41.44
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	3,530,752	2.4862	8,778,156	2.7600	9,744,875	10.55
3	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	4,041,975	1.7776	7,185,015	1.9488	7,877,000	8.53
4	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	4,899,539	1.4400	7,055,337	1.5997	7,837,792	8.48
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	6,062,628	1.2378	7,504,888	1.2401	7,518,264	8.14
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	2,831,879	1.8337	5,192,818	1.9307	5,467,508	5.92

7	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックス マザーファンド	1,630,646	1.8368	2,995,171	1.9941	3,251,671	3.52
8	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,339,322	2.3761	3,182,371	2.4005	3,215,042	3.48
9	日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	1,303,252	1.9198	2,501,984	2.1396	2,788,437	3.01
10	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックス マザーファンド	1,979,403	1.1082	2,193,714	1.2207	2,416,257	2.61
11	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデ ックスマザーファンド	1,550,999	1.1448	1,775,619	1.1977	1,857,631	2.01
12	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,659,724	1.0425	1,730,263	1.0990	1,824,036	1.97

## 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	99.70
合 計	99.70

## 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	71,947,667	1.3357	96,105,743	1.3328	95,891,850	30.09
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	22,591,850	2.4870	56,187,582	2.7600	62,353,506	19.56
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	19,860,923	1.4407	28,613,632	1.5997	31,771,518	9.97
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	13,108,097	1.7807	23,342,022	1.9488	25,545,059	8.01
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	9,758,034	1.8350	17,906,458	1.9307	18,839,836	5.91
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザー ファンド	14,539,485	1.2378	17,998,235	1.2401	18,030,415	5.65
7	日本	親投資信託 受益証券	海外REITインデックス マザーファンド	6,421,009	1.8378	11,800,531	1.9941	12,804,134	4.01
8	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	5,274,713	2.3762	12,534,247	2.4005	12,661,948	3.97
9	日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックス マザーファンド	5,238,656	1.9203	10,059,869	2.1396	11,208,628	3.51
10	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックス マザーファンド	8,069,339	1.1087	8,946,853	1.2207	9,850,242	3.09
11	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデ ックスマザーファンド	7,905,828	1.1445	9,048,453	1.1977	9,468,810	2.97
12	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	8,577,319	1.0437	8,952,887	1.0990	9,426,473	2.95

## 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	99.75
合 計	99.75

## 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	8,364,123	2.4953	20,871,618	2.7600	23,084,979	27.06
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	13,179,128	1.3357	17,604,435	1.3328	17,565,141	20.58
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	6,107,084	1.4413	8,802,141	1.5997	9,769,502	11.45
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	3,285,890	1.7856	5,867,456	1.9488	6,403,542	7.50
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	2,826,745	1.8335	5,182,858	1.9307	5,457,596	6.39
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	2,146,342	1.8382	3,945,406	1.9941	4,280,020	5.01
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	2,909,151	1.2378	3,601,181	1.2401	3,607,638	4.22
8	日本	親投資信託 受益証券	J-REITインデックスマ ザーファンド	1,600,715	1.9204	3,074,014	2.1396	3,424,889	4.01
9	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,410,169	2.3759	3,350,483	2.4005	3,385,110	3.96
10	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,675,437	1.0442	2,793,824	1.0990	2,940,305	3.44
11	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマ ザーファンド	2,153,176	1.1089	2,387,754	1.2207	2,628,381	3.08
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	2,108,999	1.1445	2,413,890	1.1977	2,525,948	2.96

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.72
合計	99.72

## 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	30,897,905	2.4921	77,003,420	2.7600	85,278,217	36.47
2	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	21,767,760	1.4405	31,356,459	1.5997	34,821,885	14.89
3	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA-BPI総 合マザーファンド	13,790,291	1.3357	18,420,622	1.3328	18,379,699	7.86
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	8,978,481	1.7900	16,071,747	1.9488	17,497,263	7.48
5	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	7,037,230	1.8376	12,931,614	1.9941	14,032,940	6.00
6	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	5,468,764	1.9206	10,503,387	2.1396	11,700,967	5.00
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	5,941,383	1.8414	10,940,607	1.9307	11,471,028	4.90

8	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	9,400,567	1.0446	9,820,174	1.0990	10,331,223	4.41
9	日本	親投資信託 受益証券	米国株式配当貴族インデックスマ ザーファンド	7,756,010	1.1081	8,594,997	1.2207	9,467,761	4.04
10	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	3,372,002	2.3768	8,014,768	2.4005	8,094,490	3.46
11	日本	親投資信託 受益証券	米国ハイ・イールド債券インデッ クスマザーファンド	6,647,188	1.1446	7,608,552	1.1977	7,961,337	3.40
12	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	2,619,895	1.2377	3,242,872	1.2401	3,248,931	1.38

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.36
合計	99.36

## (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	2,189,200	6,658.34	14,576,437,928	6,755.00	14,788,046,000	3.32
2	日本	株式	ソニー	電気機器	1,229,100	7,058.82	8,675,995,662	6,874.00	8,448,833,400	1.89
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	177,800	39,995.14	7,111,135,892	44,350.00	7,885,430,000	1.77
4	日本	株式	ソフトバンクグル ープ	情報・通 信業	1,527,600	4,685.14	7,157,019,864	4,832.00	7,381,363,200	1.65
5	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,632,400	3,764.43	6,145,055,532	4,191.00	6,841,388,400	1.53
6	日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	2,573,600	2,419.54	6,226,928,144	2,444.00	6,289,878,400	1.41
7	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	13,237,600	423.83	5,610,492,008	444.20	5,880,141,920	1.32
8	日本	株式	第一三共	医薬品	561,500	7,636.76	4,288,040,740	10,085.00	5,662,727,500	1.27
9	日本	株式	任天堂	その他製 品	120,300	43,640.19	5,249,914,857	43,540.00	5,237,862,000	1.17
10	日本	株式	リクルートホール ディングス	サービ ス業	1,343,200	3,312.63	4,449,524,616	3,710.00	4,983,272,000	1.11
11	日本	株式	KDDI	情報・通 信業	1,434,800	3,157.99	4,531,084,052	3,136.00	4,499,532,800	1.01
12	日本	株式	本田技研工業	輸送用機 器	1,544,800	2,614.31	4,038,586,088	2,784.00	4,300,723,200	0.96
13	日本	株式	三井住友フィナン シャルグループ	銀行業	1,338,400	2,816.41	3,769,483,144	3,119.00	4,174,469,600	0.93
14	日本	株式	信越化学工業	化学	330,000	12,120.74	3,999,844,200	12,620.00	4,164,600,000	0.93
15	日本	株式	NTTドコモ	情報・通 信業	1,376,700	3,079.00	4,238,859,300	2,951.50	4,063,330,050	0.91
16	日本	株式	花王	化学	469,800	8,450.38	3,969,988,524	8,647.00	4,062,360,600	0.91
17	日本	株式	ダイキン工業	機械	250,000	14,052.25	3,513,062,500	15,850.00	3,962,500,000	0.89
18	日本	株式	HOYA	精密機器	391,800	9,732.39	3,813,150,402	10,110.00	3,961,098,000	0.88
19	日本	株式	ファナック	電気機器	186,400	17,838.08	3,325,018,112	19,215.00	3,581,676,000	0.80
20	日本	株式	みずほフィナンシ ャルグループ	銀行業	26,295,400	123.31	3,242,485,774	134.50	3,536,731,300	0.79
21	日本	株式	村田製作所	電気機器	576,300	6,051.15	3,487,277,745	6,015.00	3,466,444,500	0.77
22	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,356,000	2,417.12	3,277,614,720	2,515.00	3,410,340,000	0.76

23	日本	株式	S M C	機械	61,600	51,120.00	3,148,992,000	54,370.00	3,349,192,000	0.75
24	日本	株式	日立製作所	電気機器	942,800	3,268.36	3,081,409,808	3,455.00	3,257,374,000	0.73
25	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,701,200	1,805.07	3,070,785,084	1,914.50	3,256,947,400	0.73
26	日本	株式	中外製薬	医薬品	204,600	12,727.23	2,603,991,258	15,890.00	3,251,094,000	0.73
27	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	684,200	4,507.22	3,083,839,924	4,668.00	3,193,845,600	0.71
28	日本	株式	日本電産	電気機器	472,200	6,242.75	2,947,826,550	6,622.00	3,126,908,400	0.70
29	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,351,600	2,235.10	3,020,961,160	2,310.00	3,122,196,000	0.70
30	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	199,400	14,281.70	2,847,770,980	15,615.00	3,113,631,000	0.69

## 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	0.21
		建設業	2.52
		食料品	3.85
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.04
		医薬品	6.91
		石油・石炭製品	0.43
		ゴム製品	0.62
		ガラス・土石製品	0.76
		鉄鋼	0.55
		非鉄金属	0.67
		金属製品	0.52
		機械	4.94
		電気機器	14.05
		輸送用機器	7.05
		精密機器	2.53
		その他製品	2.30
		電気・ガス業	1.54
		陸運業	4.19
		海運業	0.13
		空運業	0.35
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	9.23
		卸売業	4.49
小売業	4.77		
銀行業	4.92		
証券、商品先物取引業	0.74		
保険業	1.99		
その他金融業	1.10		

		不動産業	2.04
		サービス業	5.20
合 計			96.79

## (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	703,700	27,426.60	19,300,099,686	34,221.42	24,081,615,013	3.70
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,147,800	17,239.20	19,787,164,779	19,505.94	22,388,920,228	3.44
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	66,740	211,496.45	14,115,273,460	258,190.28	17,231,619,487	2.64
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	380,900	17,853.20	6,800,286,127	24,243.71	9,234,430,586	1.42
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	48,940	123,421.85	6,040,265,764	152,340.97	7,455,567,409	1.14
6	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	47,420	123,362.71	5,849,860,049	152,503.34	7,231,708,724	1.11
7	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	416,600	14,317.61	5,964,720,284	15,803.68	6,583,814,796	1.01
8	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	271,000	17,804.81	4,825,105,516	20,888.77	5,660,858,784	0.87
9	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	471,000	11,133.04	5,243,662,594	11,468.71	5,401,765,613	0.83
10	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	496,300	10,048.67	4,987,159,140	10,737.94	5,329,242,501	0.81
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	394,600	12,369.17	4,880,876,810	12,479.93	4,924,581,088	0.75
12	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	149,890	27,036.26	4,052,466,196	32,685.89	4,899,288,667	0.75
13	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術 サービス	142,000	27,234.12	3,867,245,480	32,506.31	4,615,897,298	0.70
14	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・ 半導体製 造装置	688,200	5,968.99	4,107,859,124	6,634.60	4,565,932,408	0.70
15	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売 り	172,500	21,085.55	3,637,258,704	26,359.90	4,547,083,475	0.69
16	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	111,150	34,449.64	3,829,077,842	38,056.20	4,229,946,630	0.65
17	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	207,900	19,699.49	4,095,525,219	19,903.80	4,138,000,644	0.63
18	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	654,200	5,890.49	3,853,560,783	5,991.57	3,919,686,141	0.60



19	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	1,155,400	3,249.55	3,754,537,696	3,339.88	3,858,899,432	0.59
20	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,351,000	2,368.88	3,200,364,851	2,673.19	3,611,487,526	0.55
21	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	875,200	3,515.15	3,076,464,269	4,105.49	3,593,129,574	0.55
22	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	285,000	10,734.71	3,059,395,172	12,554.12	3,577,926,338	0.55
23	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	402,700	8,277.65	3,333,413,440	8,499.17	3,422,616,242	0.52
24	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	91,920	28,578.24	2,626,912,565	36,504.28	3,355,473,822	0.51
25	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	670,800	4,335.60	2,908,326,920	4,902.83	3,288,818,599	0.50
26	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	643,600	4,839.92	3,114,975,923	5,063.58	3,258,925,044	0.50
27	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	669,000	4,034.52	2,699,097,627	4,843.15	3,240,068,153	0.49
28	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品	339,700	8,682.94	2,949,597,164	9,298.53	3,158,713,223	0.48
29	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	220,500	13,499.31	2,976,599,222	14,225.14	3,136,644,186	0.48
30	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア	76,530	34,251.53	2,621,269,660	40,843.11	3,125,723,966	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	3.91
		メディア	1.14
		娯楽	1.43
		不動産管理・開発	0.43
		エネルギー設備・サービス	0.15
		石油・ガス・消耗燃料	3.46
		化学	2.15
		建設資材	0.24
		容器・包装	0.27
		金属・鉱業	1.35
		紙製品・林産品	0.08
		航空宇宙・防衛	1.62
		建設関連製品	0.46
		建設・土木	0.28
		電気設備	0.71
		コングロマリット	1.12
		機械	1.55
		商社・流通業	0.28
		商業サービス・用品	0.44
		航空貨物・物流サービス	0.49
旅客航空輸送業	0.05		
海運業	0.04		
陸運・鉄道	1.03		
運送インフラ	0.17		
自動車部品	0.23		

自動車	0.82
家庭用耐久財	0.33
レジャー用品	0.03
繊維・アパレル・贅沢品	1.39
ホテル・レストラン・レジャー	1.50
販売	0.05
インターネット販売・通信販売	3.31
複合小売り	0.50
専門小売り	1.77
食品・生活必需品小売り	1.53
飲料	1.83
食品	1.99
タバコ	0.80
家庭用品	1.43
パーソナル用品	0.68
ヘルスケア機器・用品	3.03
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.14
バイオテクノロジー	2.16
医薬品	5.80
銀行	5.61
各種金融サービス	0.87
保険	3.10
情報技術サービス	4.66
ソフトウェア	6.58
通信機器	0.77
コンピュータ・周辺機器	3.91
電子装置・機器・部品	0.52
半導体・半導体製造装置	3.61
各種電気通信サービス	1.87
無線通信サービス	0.29
電力	2.10
ガス	0.17
総合公益事業	1.05
水道	0.12
消費者金融	0.35
資本市場	2.96
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06
ヘルスケア・テクノロジー	0.12
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.94
専門サービス	0.79
投資証券	2.51
合計	97.43

## （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	51,570	33,348.27	1,719,770,743	34,221.42	1,764,798,758	3.74
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	84,140	19,858.64	1,670,906,003	19,505.94	1,641,229,960	3.48
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	4,888	255,879.46	1,250,738,816	258,190.28	1,262,034,103	2.67
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	28,000	22,833.99	639,351,874	24,243.71	678,823,986	1.44
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3,599	149,291.42	537,299,843	152,340.97	548,275,176	1.16
6	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	3,488	148,858.08	519,216,984	152,503.34	531,931,675	1.12
7	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	30,600	15,989.71	489,285,156	15,803.68	483,592,733	1.02
8	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	19,960	19,902.72	397,258,445	20,888.77	416,940,005	0.88
9	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	34,670	11,709.60	405,971,832	11,468.71	397,620,411	0.84
10	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	36,430	9,968.03	363,135,369	10,737.94	391,183,365	0.83
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	29,050	12,468.10	362,198,407	12,479.93	362,542,019	0.76
12	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	30,861.11	341,015,266	32,685.89	361,179,130	0.76
13	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	10,470	30,370.77	317,981,995	32,506.31	340,341,160	0.72
14	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	50,700	6,416.31	325,307,176	6,634.60	336,374,271	0.71
15	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	12,650	25,208.25	318,884,462	26,359.90	333,452,788	0.70
16	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	8,180	38,056.20	311,299,716	38,056.20	311,299,716	0.66
17	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	15,330	19,014.52	291,492,743	19,903.80	305,125,300	0.64
18	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	48,200	6,129.21	295,427,922	5,991.57	288,793,751	0.61
19	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	85,200	3,203.31	272,922,753	3,339.88	284,557,929	0.60
20	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	99,800	2,534.48	252,941,314	2,673.19	266,784,941	0.56
21	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	64,600	4,002.26	258,546,423	4,105.49	265,215,003	0.56
22	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	21,060	11,737.97	247,201,749	12,554.12	264,389,925	0.56
23	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	29,720	8,215.29	244,158,478	8,499.17	252,595,368	0.53
24	アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	6,800	33,603.12	228,501,250	36,504.28	248,229,134	0.52
25	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	49,600	4,622.71	229,286,649	4,902.83	243,180,385	0.51
26	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	47,500	4,958.20	235,514,895	5,063.58	240,520,416	0.51

27	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	49,500	4,965.73	245,803,902	4,843.15	239,735,984	0.50
28	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品	25,110	9,221.58	231,554,095	9,298.53	233,486,279	0.49
29	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	16,290	14,433.75	235,125,819	14,225.14	231,727,591	0.49
30	アメリカ	株式	ADOBE INC	ソフトウェア	5,660	39,518.35	223,673,863	40,843.11	231,172,059	0.49

## 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	3.97
		メディア	1.15
		娯楽	1.43
		不動産管理・開発	0.41
		エネルギー設備・サービス	0.15
		石油・ガス・消耗燃料	3.51
		化学	2.18
		建設資材	0.24
		容器・包装	0.26
		金属・鉱業	1.34
		紙製品・林産品	0.08
		航空宇宙・防衛	1.65
		建設関連製品	0.44
		建設・土木	0.29
		電気設備	0.70
		コングロマリット	1.16
		機械	1.56
		商社・流通業	0.27
		商業サービス・用品	0.44
		航空貨物・物流サービス	0.48
		旅客航空輸送業	0.06
		海運業	0.04
		陸運・鉄道	1.04
		運送インフラ	0.17
		自動車部品	0.24
		自動車	0.84
		家庭用耐久財	0.34
		レジャー用品	0.04
		繊維・アパレル・贅沢品	1.41
		ホテル・レストラン・レジャー	1.54
販売	0.06		
インターネット販売・通信販売	3.32		
複合小売り	0.51		
専門小売り	1.79		

	食品・生活必需品小売り	1.54
	飲料	1.84
	食品	2.00
	タバコ	0.82
	家庭用品	1.45
	パーソナル用品	0.70
	ヘルスケア機器・用品	3.05
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.16
	バイオテクノロジー	2.20
	医薬品	5.91
	銀行	5.69
	各種金融サービス	0.88
	保険	3.12
	情報技術サービス	4.74
	ソフトウェア	6.62
	通信機器	0.78
	コンピュータ・周辺機器	3.97
	電子装置・機器・部品	0.50
	半導体・半導体製造装置	3.66
	各種電気通信サービス	1.89
	無線通信サービス	0.29
	電力	2.11
	ガス	0.17
	総合公益事業	1.06
	水道	0.11
	消費者金融	0.35
	資本市場	2.99
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.07
	ヘルスケア・テクノロジー	0.12
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.93
	専門サービス	0.79
投資証券		2.53
合 計		98.45

## (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	121,040	21,675.63	2,623,618,946	21,451.15	2,596,448,370	6.76
2	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	369,300	5,802.09	2,142,714,939	5,661.73	2,090,878,366	5.44
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	1,587,000	1,064.94	1,690,063,906	1,052.52	1,670,349,240	4.35
4	アメリカ	投資信託受益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF		512,300	3,010.83	1,542,453,331	2,874.27	1,472,492,055	3.83
5	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	306,940	4,239.50	1,301,273,173	4,379.75	1,344,323,534	3.50
6	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,196,000	85.43	529,381,284	85.71	531,100,054	1.38
7	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インターネット販売・通信販売	28,650	18,361.72	526,063,507	17,987.63	515,345,634	1.34
8	香港	株式	MEITUAN DIANPING B	インターネット販売・通信販売	229,100	1,792.52	410,667,368	1,900.19	435,333,529	1.13
9	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	384,000	1,088.46	417,969,434	1,061.05	407,445,120	1.06
10	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	186,800	2,212.01	413,204,134	2,105.31	393,273,309	1.02
11	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信サービス	399,000	819.59	327,019,776	750.36	299,396,433	0.77
12	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,915,000	70.87	277,478,365	69.76	273,134,281	0.71
13	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インターネット販売・通信販売	48,030	5,030.25	241,603,071	5,486.18	263,501,254	0.68
14	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	35,180	7,384.15	259,774,527	7,290.91	256,494,214	0.66
15	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	108,100	2,413.18	260,865,302	2,321.89	250,996,417	0.65

16	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	238,321	974.26	232,187,756	995.28	237,198,103	0.61
17	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガス・消耗燃料	27,100	7,069.02	191,570,501	8,226.04	222,925,819	0.58
18	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	375,800	541.42	203,466,799	593.13	222,900,313	0.58
19	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	821,649	272.90	224,229,326	269.57	221,495,208	0.57
20	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	218,600	964.10	210,753,571	1,011.58	221,131,825	0.57
21	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	673,300	287.07	193,289,763	313.91	211,356,446	0.55
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	17,890	10,728.26	191,928,716	11,432.58	204,529,028	0.53
23	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	5,097,000	40.36	205,723,584	39.52	201,481,861	0.52
24	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	53,020	3,617.82	191,816,859	3,780.15	200,423,553	0.52
25	アメリカ	株式	NETEASE INC-ADR	娯楽	4,700	38,684.71	181,818,155	39,382.86	185,099,454	0.48
26	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術サービス	59,100	2,707.56	160,016,914	2,866.14	169,389,406	0.44
27	韓国	株式	NAVER CORP	インタラクティブ・メディアおよびサービス	7,780	18,596.60	144,681,548	20,899.45	162,597,721	0.42
28	台湾	株式	MEDIATEK INC	半導体・半導体製造装置	97,538	1,472.70	143,644,782	1,646.79	160,625,578	0.41
29	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信サービス	2,171,000	73.08	158,665,364	72.98	158,455,211	0.41
30	インド	株式	HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	家庭用品	53,600	2,987.91	160,152,164	2,874.22	154,058,648	0.40

## 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	7.00
		メディア	0.24
		娯楽	1.02

不動産管理・開発	2.20
エネルギー設備・サービス	0.07
石油・ガス・消耗燃料	5.94
化学	2.11
建設資材	0.98
容器・包装	0.04
金属・鉱業	3.14
紙製品・林産品	0.16
航空宇宙・防衛	0.07
建設関連製品	0.03
建設・土木	0.46
電気設備	0.19
コングロマリット	1.11
機械	0.52
商社・流通業	0.03
商業サービス・用品	0.24
航空貨物・物流サービス	0.25
旅客航空輸送業	0.11
海運業	0.09
陸運・鉄道	0.25
運送インフラ	0.73
自動車部品	0.36
自動車	1.38
家庭用耐久財	0.26
レジャー用品	0.09
繊維・アパレル・贅沢品	0.77
ホテル・レストラン・レジャー	0.62
インターネット販売・通信販売	10.66
複合小売り	0.49
専門小売り	0.45
食品・生活必需品小売り	1.52
飲料	0.84
食品	1.75
タバコ	0.35
家庭用品	0.52
パーソナル用品	0.64



	ヘルスケア機器・用品	0.24
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.52
	バイオテクノロジー	0.48
	医薬品	1.15
	銀行	12.55
	各種金融サービス	0.56
	保険	3.18
	情報技術サービス	1.49
	ソフトウェア	0.21
	通信機器	0.13
	コンピュータ・周辺機器	5.16
	電子装置・機器・部品	2.01
	半導体・半導体製造装置	6.26
	各種電気通信サービス	1.35
	無線通信サービス	2.57
	電力	0.85
	ガス	0.61
	総合公益事業	0.05
	水道	0.22
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.67
	消費者金融	0.13
	資本市場	0.94
	各種消費者サービス	0.75
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.47
	ヘルスケア・テクノロジー	0.22
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.51
	専門サービス	0.03
	その他の業種	0.00
投資信託受益証券		3.83
投資証券		0.08
合 計		95.22

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	LOWES COS INC	専門小売 り	37,870	10,055.28	380,793,752	13,776.74	521,725,280	1.83
2	アメリカ	株式	PENTAIR PLC	機械	117,400	3,253.58	381,970,633	4,228.07	496,376,545	1.74
3	アメリカ	株式	CINTAS CORP	商業サー ビス・用 品	18,020	20,956.51	377,636,417	27,067.45	487,755,478	1.71
4	アメリカ	株式	ALBEMARLE CORP	化学	59,240	6,266.53	371,229,540	8,164.75	483,679,962	1.70
5	アメリカ	株式	CARRIER GLOBAL CORP	建設関連 製品	228,590	1,862.61	425,775,094	2,107.58	481,773,541	1.69
6	アメリカ	株式	AMCOR PLC	容器・包 装	437,700	892.19	390,514,443	1,075.30	470,658,810	1.65
7	アメリカ	株式	T ROWE PRICE GROUP INC	資本市場	36,240	10,744.31	389,373,974	12,974.56	470,198,410	1.65
8	アメリカ	株式	ROPER TECHNOLOGIES INC	コングロ マリット	11,440	33,609.66	384,494,548	41,047.42	469,582,564	1.65
9	アメリカ	株式	ECOLAB INC	化学	20,530	18,417.38	378,108,868	22,732.91	466,706,792	1.64
10	アメリカ	株式	GRAINGER(W.W.) INC	商社・流 通業	13,900	29,112.88	404,669,058	33,249.35	462,165,983	1.62
11	アメリカ	株式	STANLEY BLACK & DECKER INC	機械	33,950	11,547.01	392,021,218	13,601.46	461,769,896	1.62
12	アメリカ	株式	FRANKLIN RESOURCES INC	資本市場	226,600	1,785.37	404,566,431	2,033.39	460,766,695	1.62
13	アメリカ	株式	ROSS STORES INC	専門小売 り	43,490	8,999.00	391,366,776	10,566.97	459,557,660	1.61
14	アメリカ	株式	CHUBB LTD	保険	34,530	11,992.21	414,091,269	13,302.53	459,336,579	1.61
15	アメリカ	株式	SHERWIN-WILLIAMS	化学	7,210	52,439.82	378,091,136	63,443.77	457,429,620	1.60
16	アメリカ	株式	SMITH (A.O.) CORP	建設関連 製品	90,700	4,180.90	379,208,524	5,009.82	454,390,919	1.59
17	アメリカ	株式	GENUINE PARTS CO	販売	49,160	7,696.82	378,376,043	9,065.85	445,677,397	1.56
18	アメリカ	株式	EMERSON ELEC	電気設備	67,900	5,556.39	377,279,148	6,562.55	445,597,546	1.56
19	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST		51,200	8,003.00	409,753,721	8,649.71	442,865,316	1.55
20	アメリカ	株式	TARGET CORP	複合小売 り	34,600	11,537.50	399,197,544	12,734.77	440,623,315	1.55
21	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	資本市場	12,850	28,897.31	371,330,456	34,280.56	440,505,247	1.54
22	アメリカ	株式	AIR PRODUCTS	化学	17,010	22,406.75	381,138,902	25,880.32	440,224,250	1.54
23	アメリカ	株式	GENERAL DYNAMICS	航空宇宙 ・防衛	27,540	14,160.31	389,975,095	15,967.12	439,734,752	1.54
24	アメリカ	株式	MCCORMICK & CO INC.	食品	23,700	16,331.54	387,057,547	18,550.00	439,635,007	1.54
25	アメリカ	株式	PPG INDUSTRIES	化学	39,700	9,505.85	377,382,497	11,036.87	438,164,104	1.54
26	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP		72,860	5,465.87	398,243,443	5,989.42	436,389,214	1.53
27	アメリカ	株式	NUCOR CORP	金属・鋳 業	95,300	3,915.18	373,117,207	4,575.40	436,035,763	1.53
28	アメリカ	株式	SYSCO CORP	食品・生 活必需品 小売り	72,200	5,458.90	394,132,829	6,016.30	434,377,113	1.52
29	アメリカ	株式	ILLINOIS TOOL WORKS INC	機械	23,170	16,366.07	379,202,007	18,593.01	430,800,095	1.51
30	アメリカ	株式	LEGGETT & PLATT INC	家庭用耐 久財	124,600	3,139.87	391,227,873	3,456.01	430,619,369	1.51

## 種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	石油・ガス・消耗燃料	2.83

	化学	9.54
	容器・包装	1.65
	金属・鉱業	1.53
	航空宇宙・防衛	2.99
	建設関連製品	3.29
	電気設備	1.56
	コングロマリット	3.12
	機械	9.29
	商社・流通業	1.62
	商業サービス・用品	1.71
	航空貨物・物流サービス	1.46
	家庭用耐久財	1.51
	繊維・アパレル・贅沢品	1.47
	ホテル・レストラン・レジャー	1.40
	販売	1.56
	複合小売り	1.55
	専門小売り	3.45
	食品・生活必需品小売り	4.14
	飲料	4.28
	食品	4.40
	家庭用品	5.52
	ヘルスケア機器・用品	3.96
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.49
	バイオテクノロジー	1.49
	医薬品	1.28
	銀行	1.41
	保険	4.08
	情報技術サービス	1.44
	各種電気通信サービス	1.43
	ガス	1.36
	総合公益事業	1.21
	資本市場	4.82
投資信託受益証券		0.67
投資証券		4.49
合 計		99.18

(参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	7,500,000,000	100.40	7,530,375,000	100.40	7,530,300,000	0.1	2021/12/20	1.10

2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	7,200,000,000	100.34	7,224,910,000	100.33	7,224,408,000	0.1	2021/9/20	1.06
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	6,600,000,000	103.07	6,802,950,000	103.03	6,800,376,000	0.6	2024/6/20	1.00
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 3回	6,200,000,000	100.62	6,238,440,000	100.61	6,237,944,000	0.1	2022/9/20	0.91
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	5,900,000,000	101.40	5,983,005,000	101.37	5,980,948,000	0.1	2026/6/20	0.88
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	5,850,000,000	101.64	5,946,349,500	101.53	5,939,622,000	0.1	2028/3/20	0.87
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	5,800,000,000	101.50	5,887,058,000	101.42	5,882,882,000	0.1	2026/9/20	0.86
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 51回	5,600,000,000	101.57	5,688,088,000	101.49	5,683,944,000	0.1	2028/6/20	0.83
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,400,000,000	102.69	5,545,260,000	102.69	5,545,638,000	0.6	2023/12/20	0.81
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	103.00	5,459,318,000	102.96	5,456,880,000	0.8	2023/6/20	0.80
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	5,300,000,000	102.47	5,430,910,000	102.40	5,427,465,000	0.3	2025/12/20	0.79
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	5,300,000,000	101.49	5,379,353,000	101.46	5,377,486,000	0.1	2028/9/20	0.79
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	5,200,000,000	102.83	5,347,316,000	102.79	5,345,236,000	0.5	2024/9/20	0.78
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	5,300,000,000	100.47	5,325,014,000	100.46	5,324,857,000	0.1	2022/3/20	0.78
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 53回	5,100,000,000	101.40	5,171,502,000	101.37	5,170,125,000	0.1	2028/12/20	0.76
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 55回	5,100,000,000	101.15	5,158,905,000	101.22	5,162,475,000	0.1	2029/6/20	0.76
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,000,000,000	102.20	5,110,200,000	102.15	5,107,550,000	0.6	2023/3/20	0.75
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	5,000,000,000	101.59	5,079,650,000	101.45	5,072,650,000	0.1	2026/12/20	0.74
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 47回	4,200,000,000	118.53	4,978,554,000	119.10	5,002,284,000	1.6	2033/12/20	0.73
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	4,900,000,000	101.68	4,982,712,000	101.47	4,972,177,000	0.1	2027/3/20	0.73
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 8回	4,900,000,000	100.82	4,940,180,000	100.91	4,944,639,000	0.1	2023/12/20	0.72
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	4,600,000,000	101.81	4,683,352,000	101.50	4,669,368,000	0.1	2027/9/20	0.68
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 49回	3,850,000,000	117.73	4,532,961,000	118.09	4,546,503,500	1.5	2034/6/20	0.66
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,400,000,000	102.34	4,503,092,000	102.23	4,498,164,000	0.8	2022/9/20	0.66

25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 56回	4,400,000,000	100.99	4,443,736,000	101.11	4,449,192,000	0.1	2029/9/20	0.65
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 9回	4,400,000,000	100.87	4,438,544,000	100.95	4,442,020,000	0.1	2024/3/20	0.65
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 54回	4,350,000,000	101.25	4,404,766,500	101.28	4,405,723,500	0.1	2029/3/20	0.64
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	4,200,000,000	102.86	4,320,498,000	102.86	4,320,372,000	0.6	2024/3/20	0.63
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	4,200,000,000	102.92	4,322,640,000	102.83	4,318,860,000	0.4	2025/9/20	0.63
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	4,200,000,000	102.62	4,310,168,000	102.58	4,308,528,000	0.4	2025/3/20	0.63

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.31
地方債証券	6.95
特殊債券	8.98
社債券	4.21
合計	99.48

## (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	14,188.91	10,244,399,513	14,146.91	10,214,073,081	6	2026/2/15	1.76
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,000,000	11,174.29	8,939,438,591	11,157.49	8,925,997,341	2.5	2022/1/15	1.54
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	49,300,000	14,913.90	7,352,555,996	14,885.34	7,338,474,341	5.25	2028/11/15	1.26
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	46,200,000	15,022.27	6,940,291,739	14,992.87	6,926,707,552	5.5	2028/8/15	1.19
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,500,000	13,355.14	6,877,897,641	13,171.58	6,783,365,819	2.5	2046/2/15	1.17
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	50,500,000	12,031.17	6,075,741,627	11,990.85	6,055,381,359	8	2021/11/15	1.04
7	スペイン	国債証券	SPANISH GOVERNMENT	31,400,000	18,575.94	5,832,845,442	19,010.76	5,969,380,336	5.75	2032/7/30	1.03
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,300,000	11,832.50	5,951,747,561	11,815.69	5,943,296,375	2.25	2025/11/15	1.02
9	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	28,400,000	21,106.43	5,994,226,433	20,896.00	5,934,465,448	3.25	2044/1/22	1.02
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,700,000	16,013.56	5,876,979,706	15,962.32	5,858,172,976	5.375	2031/2/15	1.01
11	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,700,000	19,228.05	5,710,733,380	19,285.24	5,727,716,553	3.25	2045/5/25	0.98
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	11,205.80	5,367,578,824	11,194.04	5,361,945,518	1.75	2023/1/31	0.92

13	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	11,699.76	5,276,595,026	11,685.48	5,270,154,268	2.375	2024/8/15	0.90
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	14,417.42	5,320,028,070	14,253.60	5,259,580,149	3	2044/11/15	0.90
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	39,400,000	13,283.31	5,233,626,233	13,114.45	5,167,096,768	2.5	2045/2/15	0.89
16	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	14,657.15	4,998,091,407	14,638.09	4,991,591,674	3.5	2026/4/25	0.86
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,869.99	4,993,558,788	12,830.51	4,978,239,019	6.25	2023/8/15	0.85
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,695.56	4,982,311,593	11,680.44	4,975,870,103	2.75	2023/11/15	0.85
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,000,000	11,531.75	4,958,653,195	11,517.47	4,952,512,339	2.25	2023/12/31	0.85
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	11,608.19	4,956,700,971	11,592.23	4,949,885,302	2.125	2024/9/30	0.85
21	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	17,934.04	4,842,192,051	17,923.17	4,839,258,594	5.5	2029/4/25	0.83
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,100,000	11,624.16	4,777,530,067	11,608.19	4,770,969,786	2.75	2023/7/31	0.82
23	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000	15,480.94	4,520,435,502	15,914.57	4,647,056,396	5.25	2029/11/1	0.80
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	38,000,000	12,127.36	4,608,399,768	12,108.88	4,601,376,511	2.375	2027/5/15	0.79
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,500,000	12,784.05	4,410,498,111	12,610.41	4,350,592,115	2.25	2046/8/15	0.75
26	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	31,100,000	13,298.48	4,135,827,871	13,368.76	4,157,687,035	5.5	2022/11/1	0.71
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	27,500,000	15,024.79	4,131,819,174	14,988.67	4,121,885,176	5.25	2029/2/15	0.71
28	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000	20,224.96	4,065,217,400	20,230.26	4,066,282,958	5.75	2032/10/25	0.70
29	イギリス	国債証券	UK TREASURY	18,440,000	22,193.60	4,092,501,007	21,949.61	4,047,509,670	3.5	2045/1/22	0.69
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,200,000	11,687.16	3,997,011,071	11,669.52	3,990,977,354	2.25	2024/11/15	0.68

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.11
合計	99.11

## (参考) 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,150,000	10,865.99	668,258,408	11,005.44	676,834,732	2.125	2021/8/15	1.00
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	3,450,000	14,356.93	495,314,245	15,850.59	546,845,495	3.75	2043/11/15	0.81
3	イギリス	国債証券	UK TREASURY	2,180,000	22,950.21	500,314,665	24,977.92	544,518,854	4.25	2046/12/7	0.80
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,500,000	11,505.71	517,756,950	11,923.22	536,545,285	2.625	2025/3/31	0.79
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	11,779.57	494,742,147	12,516.32	525,685,573	2.75	2028/2/15	0.78

6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,581.38	463,255,262	12,073.60	482,944,113	2.875	2025/4/30	0.71
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	10,833.64	455,013,195	11,488.06	482,498,837	1.625	2026/5/15	0.71
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	12,413.24	422,050,210	13,898.25	472,540,585	2.75	2047/11/15	0.70
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,178.07	447,123,160	11,669.52	466,780,977	2.25	2024/11/15	0.69
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,110,000	11,211.95	460,811,497	11,272.16	463,286,094	2	2023/2/15	0.68
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,025.18	441,007,413	11,500.66	460,026,760	2	2024/6/30	0.68
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,001.24	440,049,724	11,473.78	458,951,460	1.625	2026/2/15	0.68
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	11,758.57	399,791,491	13,194.26	448,605,061	2.5	2046/5/15	0.66
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,928.15	437,126,252	11,194.04	447,761,630	1.75	2023/1/31	0.66
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,530,000	11,555.22	407,899,329	12,610.41	445,147,540	2.25	2046/8/15	0.66
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,866.83	434,673,223	11,102.47	444,098,900	1.625	2022/8/31	0.65
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,660.59	426,423,635	10,879.85	435,194,040	1.125	2021/8/31	0.64
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	10,747.11	408,390,529	11,420.86	433,992,730	1.5	2026/8/15	0.64
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,020,000	12,872.51	388,749,992	14,331.73	432,818,331	3	2045/11/15	0.64
20	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,480,000	18,524.64	459,411,264	17,290.52	428,805,099	4.75	2044/9/1	0.63
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	12,214.77	415,302,418	12,559.16	427,011,693	2.625	2029/2/15	0.63
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	11,834.80	366,878,913	12,703.66	393,813,487	2.875	2028/8/15	0.58
23	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000	13,257.97	410,997,309	12,702.83	393,787,789	2.2	2027/6/1	0.58
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,820,000	12,232.10	344,945,302	13,878.93	391,385,838	2.75	2047/8/15	0.58
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	12,140.13	364,204,110	12,969.12	389,073,767	3.125	2028/11/15	0.57
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	10,665.63	373,297,116	11,099.95	388,498,320	1.25	2023/7/31	0.57
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,760,000	12,572.60	347,003,999	14,015.86	386,837,831	2.875	2045/8/15	0.57
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	11,333.49	362,671,782	12,050.92	385,629,454	2.25	2027/8/15	0.57
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	10,853.80	379,883,328	10,978.98	384,264,326	2.125	2021/6/30	0.57
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,300,000	14,989.51	344,758,803	16,512.57	379,789,239	4.25	2039/5/15	0.56

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	100.03
合計	100.03

## (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	5,910,000,000	3.70	218,708,238	3.62	214,246,191	9.85	2027/6/28	3.06
2	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000	2,255.84	137,611,895	2,334.35	142,395,814	10	2023/1/1	2.03
3	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5,200,000	2,684.22	139,579,783	2,723.25	141,609,069	1.75	2021/7/25	2.02

4	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	25,200,000	427.00	107,605,424	443.74	111,823,319	0.45	2023/10/25	1.60
5	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	23,600,000	428.49	101,123,904	451.31	106,509,588	1	2026/6/26	1.52
6	中国	国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	6,500,000	1,608.94	104,581,500	1,592.32	103,501,125	3.48	2027/6/29	1.48
7	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000	2,740.40	95,914,157	2,930.84	102,579,614	2.5	2026/7/25	1.46
8	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,300,000	2,906.28	95,907,240	3,028.50	99,940,797	2.75	2029/10/25	1.43
9	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	411,000	2,345.04	96,382,643	2,389.68	98,215,850	10	2025/1/1	1.40
10	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	5,700,000	1,683.47	95,957,956	1,703.69	97,110,565		2023/7/1	1.38
11	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	5,100,000	1,824.53	93,051,250	1,859.17	94,817,992		2022/1/1	1.35
12	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,900,000	1,762.70	86,372,413	1,812.04	88,790,034		2022/7/1	1.27
13	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,900,000	2,890.28	83,818,357	3,002.55	87,074,071	4	2023/10/25	1.24
14	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,000,000	2,824.82	84,744,792	2,870.34	86,110,299	2.25	2024/10/25	1.23
15	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	49,000,000	168.87	82,747,280	174.09	85,308,647	7.75	2026/9/16	1.22
16	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	47,700,000	169.51	80,860,974	175.26	83,601,099	7.95	2026/10/7	1.19
17	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,000,000	345.50	79,466,683	347.02	79,815,044	1.875	2022/6/17	1.14
18	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,300,000	693.91	78,412,480	704.17	79,571,634	10.5	2026/12/21	1.13
19	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000	2,419.56	77,432,093	2,410.22	77,127,093	10	2027/1/1	1.10
20	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,500,000	544.29	73,480,038	560.74	75,700,963	8.5	2029/5/31	1.08
21	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,850,000	507.80	70,331,088	527.39	73,043,598	7.5	2027/6/3	1.04
22	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	13,500,000	507.81	68,554,728	526.26	71,046,142	8	2023/12/7	1.01
23	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,900,000	515.45	71,648,351	505.02	70,198,503	8.75	2048/2/28	1.00
24	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,000,000	580.61	69,673,756	579.16	69,500,116	8	2030/1/31	0.99
25	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	2,620.17	68,124,573	2,635.69	68,528,111	4.181	2024/7/15	0.98



26	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	8,800,000,000	0.76	67,421,770	0.77	68,262,040	8.125	2024/5/15	0.97
27	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,160,000,000	2.99	64,688,165	2.98	64,553,018	7.75	2021/4/14	0.92
28	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,700,000	361.94	64,064,080	362.15	64,100,897	2.125	2026/12/17	0.91
29	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000	2,771.19	60,966,391	2,831.21	62,286,745	2.5	2023/1/25	0.89
30	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,300,000	162.75	60,706,958	166.11	61,959,373	7.4	2024/7/17	0.88

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	96.63
合計	96.63

## (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	4,600,000	13,350.08	614,104,045	14,515.47	667,711,835	5.25	2047/6/23	3.02
2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	3,000,000	10,363.95	310,918,694	11,036.38	331,091,537	7.625	2029/4/26	1.50
3	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,700,000	11,269.25	304,269,791	12,250.83	330,772,656	5	2045/6/15	1.49
4	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,600,000	10,750.10	279,502,729	11,121.77	289,166,128	5.625	2047/2/21	1.31
5	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,110,000	12,268.09	258,856,862	13,040.53	275,155,383	6.05	2040/1/11	1.24
6	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	2,000,000	12,658.32	253,166,481	13,478.88	269,577,710	5.1	2035/3/28	1.22
7	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	2,400,000	10,774.72	258,593,306	11,177.41	268,257,844	7.375	2025/2/5	1.21
8	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000	11,324.52	260,464,005	11,452.64	263,410,811	4.25	2025/1/7	1.19
9	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,300,000	10,295.99	236,807,943	11,234.68	258,397,655	4.6	2048/2/10	1.17
10	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,500,000	16,327.71	244,915,705	16,901.51	253,522,675	5.625	2050/11/18	1.14
11	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	2,000,000	12,435.25	248,705,061	12,381.65	247,633,052	3.7	2042/2/2	1.12
12	アメリカ	国債証券	UKRAINE GOVERNMENT	2,100,000	11,105.16	233,208,376	11,589.85	243,386,897	9.75	2028/11/1	1.10
13	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000	9,709.04	223,308,035	10,252.83	235,815,204	6	2027/3/25	1.06
14	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000	13,850.67	221,610,727	14,729.45	235,671,350	5.625	2042/4/4	1.06
15	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,900,000	12,097.01	229,843,331	12,309.88	233,887,752	3.75	2029/1/14	1.06

16	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000	11,228.28	224,565,651	11,676.41	233,528,277	4.5	2029/4/22	1.05
17	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,800,000	11,960.66	215,291,920	12,448.96	224,081,337	4.375	2029/3/21	1.01
18	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,950,000	11,233.65	219,056,352	11,366.94	221,655,379	4	2023/10/2	1.00
19	アメリカ	国債証券	HUNGARY	1,800,000	12,016.75	216,301,626	12,084.86	217,527,598	5.375	2024/3/25	0.98
20	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	11,165.37	212,142,174	11,367.91	215,990,296	4.625	2028/1/13	0.97
21	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,900,000	11,094.94	210,803,963	11,329.73	215,265,006	4	2024/2/26	0.97
22	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	11,632.16	197,746,810	12,642.83	214,928,276	5.55	2045/1/21	0.97
23	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,800,000	11,747.80	211,460,455	11,914.20	214,455,703	4.875	2023/9/16	0.97
24	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000	12,601.65	214,228,147	12,578.51	213,834,778	3.95	2040/1/20	0.96
25	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,700,000	11,930.45	202,817,710	12,473.04	212,041,794	4.75	2029/2/11	0.96
26	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	10,813.75	205,461,337	11,119.30	211,266,719	4.5	2029/5/30	0.95
27	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000	11,734.31	199,483,419	11,988.03	203,796,609	3.875	2028/3/17	0.92
28	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000	11,396.13	193,734,328	11,598.77	197,179,213	3.75	2025/3/16	0.89
29	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,500,000	12,070.24	181,053,638	13,111.07	196,666,187	5.625	2044/2/26	0.89
30	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000	8,796.17	184,719,765	9,330.91	195,949,230	6.625	2045/2/17	0.88

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	96.36
合計	96.36

## (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	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	400,000	9,637.34	38,549,396	10,282.55	41,130,224	4.063	2024/11/1	1.12
2	アメリカ	社債券	CCO HLDGS LLC/CAP CORP	340,000	11,013.95	37,447,431	11,302.10	38,427,147	4.75	2030/3/1	1.04
3	アメリカ	社債券	CENTENE ESCROW I CORP	280,000	11,202.47	31,366,932	11,414.63	31,960,970	5.375	2026/6/1	0.87
4	アメリカ	社債券	TRANSDIGM INC	280,000	10,754.79	30,113,433	11,100.75	31,082,106	6.25	2026/3/15	0.84
5	アメリカ	社債券	UNITED RENTALS NORTH AM	270,000	10,999.67	29,699,119	11,238.87	30,344,961	5.25	2030/1/15	0.82
6	アメリカ	社債券	OCCIDENTAL PETROLEUM COR	300,000	8,746.84	26,240,546	9,935.44	29,806,348	2.7	2022/8/15	0.81
7	アメリカ	社債券	OCCIDENTAL PETROLEUM COR	340,000	7,019.55	23,866,499	8,548.63	29,065,359	2.9	2024/8/15	0.79
8	アメリカ	社債券	T-MOBILE USA INC	250,000	11,020.21	27,550,530	11,057.36	27,643,409	4.5	2026/2/1	0.75
9	アメリカ	社債券	CONSTELLUM NV	250,000	10,574.60	26,436,519	10,920.90	27,302,270	6.625	2025/3/1	0.74

10	アメリカ	社債券	ALTICE FRANCE SA	200,000	11,598.72	23,197,447	11,906.90	23,813,809	8.125	2027/2/1	0.65
11	アメリカ	社債券	JBS INVESTMENTS II GMBH	200,000	11,107.41	22,214,838	11,516.73	23,033,464	7	2026/1/15	0.62
12	アメリカ	社債券	ALTICE FRANCE SA	200,000	11,158.92	22,317,851	11,444.57	22,889,158	7.375	2026/5/1	0.62
13	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	11,492.80	22,985,613	11,415.00	22,830,017	5.75	2030/1/15	0.62
14	アメリカ	社債券	VIRGIN MEDIA SECURED FIN	200,000	11,257.85	22,515,707	11,346.40	22,692,809	5.5	2029/5/15	0.61
15	アメリカ	社債券	CSC HOLDINGS LLC	200,000	11,111.42	22,222,849	11,289.52	22,579,042	5.5	2026/5/15	0.61
16	アメリカ	社債券	IQVIA INC	200,000	11,150.51	22,301,023	11,268.12	22,536,245	5	2027/5/15	0.61
17	アメリカ	社債券	EG GLOBAL FINANCE PLC	200,000	10,228.84	20,457,690	11,211.13	22,422,263	8.5	2025/10/30	0.61
18	アメリカ	社債券	VEON HOLDINGS BV	200,000	10,857.84	21,715,684	11,208.87	22,417,747	4	2025/4/9	0.61
19	アメリカ	社債券	ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000	10,998.16	21,996,336	11,115.91	22,231,827	6	2025/2/15	0.60
20	アメリカ	社債券	TARGA RESOURCES PARTNERS	200,000	9,791.91	19,583,837	11,060.42	22,120,857	5.875	2026/4/15	0.60
21	アメリカ	社債券	INTESA SANPAOLO SPA	200,000	10,848.38	21,696,779	11,037.17	22,074,343	5.71	2026/1/15	0.60
22	アメリカ	社債券	ALTICE FINANCING SA	200,000	10,588.47	21,176,958	10,879.61	21,759,233	5	2028/1/15	0.59
23	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000	9,919.64	19,839,285	10,736.33	21,472,666	5.584	2024/3/18	0.58
24	アメリカ	社債券	MELCO RESORTS FINANCE	200,000	10,500.07	21,000,146	10,721.03	21,442,073	5.625	2027/7/17	0.58
25	アメリカ	社債券	CHENIERE ENERGY PARTNERS	200,000	9,898.67	19,797,348	10,654.23	21,308,467	4.5	2029/10/1	0.58
26	アメリカ	社債券	ALCOA NEDERLAND HOLDING	200,000	10,490.08	20,980,179	10,620.57	21,241,154	6.125	2028/5/15	0.58
27	アメリカ	社債券	WYNN MACAU LTD	200,000	10,080.93	20,161,875	10,598.42	21,196,851	5.125	2029/12/15	0.57
28	アメリカ	社債券	CONNECT FINCO SARM/CONNE	200,000	9,959.96	19,919,932	10,496.70	20,993,404	6.75	2026/10/1	0.57
29	アメリカ	社債券	CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	190,000	10,618.26	20,174,703	10,843.48	20,602,624	8.625	2024/1/15	0.56
30	アメリカ	社債券	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000	9,855.66	19,711,324	10,228.79	20,457,582	3.087	2023/1/9	0.55

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
社債券	96.16
合計	96.16

## (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	3,846	748,956	2,880,485,468	676,000	2,599,896,000	7.07
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	3,971	659,317	2,618,147,807	588,000	2,334,948,000	6.35

3	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,976	245,844	1,469,165,775	304,000	1,816,704,000	4.94
4	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資 法人 投資証券	12,821	164,537	2,109,533,748	132,500	1,698,782,500	4.62
5	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資 証券	5,666	261,418	1,481,199,204	266,400	1,509,422,400	4.10
6	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	9,892	120,569	1,192,675,571	143,700	1,421,480,400	3.86
7	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法 人 投資証券	3,767	317,603	1,196,412,685	335,500	1,263,828,500	3.43
8	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資 証券	7,913	193,871	1,534,101,302	155,800	1,232,845,400	3.35
9	日本	投資証券	日本リートファンド投資法人 投資証券	7,506	207,695	1,558,963,699	142,200	1,067,353,200	2.90
10	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法 人 投資証券	8,917	171,396	1,528,341,431	114,200	1,018,321,400	2.77
11	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,115	135,327	692,201,032	176,700	903,820,500	2.45
12	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	1,320	595,169	785,623,647	653,000	861,960,000	2.34
13	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	2,610	453,710	1,184,184,274	329,000	858,690,000	2.33
14	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投 資証券	11,612	77,765	903,016,005	67,100	779,165,200	2.11
15	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	2,595	247,904	643,312,670	286,500	743,467,500	2.02
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	1,229	732,697	900,485,633	598,000	734,942,000	1.99
17	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	1,990	459,888	915,177,637	366,500	729,335,000	1.98
18	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資 証券	4,569	151,776	693,468,884	145,500	664,789,500	1.80
19	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投 資証券	3,692	132,597	489,550,893	160,700	593,304,400	1.61
20	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資 証券	917	744,568	682,768,892	629,000	576,793,000	1.56
21	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法 人 投資証券	12,794	80,102	1,024,829,082	44,850	573,810,900	1.56
22	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	1,729	304,294	526,125,882	326,000	563,654,000	1.53
23	日本	投資証券	三井不動産ロジスティクスパーク 投資法人 投資証券	1,130	392,236	443,227,278	469,000	529,970,000	1.44
24	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投 資証券	1,411	444,793	627,603,134	350,000	493,850,000	1.34
25	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,674	157,378	578,210,188	133,300	489,744,200	1.33
26	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,286	132,413	567,522,118	114,000	488,604,000	1.32
27	日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,290	410,441	529,469,689	378,500	488,265,000	1.32
28	日本	投資証券	大和証券リビング投資法人 投資 証券	4,862	86,386	420,009,169	98,900	480,851,800	1.30
29	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資 証券	17,420	55,554	967,759,738	27,280	475,217,600	1.29
30	日本	投資証券	ケネディクス・レジデンシャル・ ネクスト投資法人 投資証券	2,591	182,421	472,654,883	181,300	469,748,300	1.27

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	94.98
合計	94.98

## (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	167,830	8,486.70	1,424,323,191	10,005.66	1,679,251,009	6.46
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	20,050	62,642.99	1,255,992,146	74,555.92	1,494,846,306	5.75
3	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	59,800	13,217.80	790,424,542	15,704.75	939,144,439	3.61
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	34,190	25,128.61	859,147,269	21,633.96	739,665,116	2.84
5	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	31,800	21,233.72	675,232,318	17,100.49	543,795,770	2.09
6	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	79,500	8,073.32	641,829,579	6,545.35	520,355,412	2.00
7	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	92,400	8,146.33	752,721,613	5,520.59	510,102,534	1.96
8	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	78,100	7,277.87	568,402,019	5,989.42	467,773,780	1.80
9	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	27,930	16,037.92	447,939,382	16,682.20	465,933,963	1.79
10	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	69,900	15,009.11	1,049,136,875	6,424.91	449,101,733	1.72
11	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,950	30,397.10	454,436,694	26,759.91	400,060,741	1.54
12	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	363,100	998.04	362,388,412	1,099.50	399,229,721	1.53
13	香港	投資証券	LINK REIT	477,900	1,240.81	592,984,858	790.59	377,822,961	1.45
14	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	121,800	2,843.31	346,315,266	2,817.28	343,145,435	1.32
15	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	84,500	6,184.53	522,593,404	3,952.80	334,011,837	1.28
16	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	25,810	12,509.24	322,863,543	12,651.97	326,547,599	1.25
17	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	20,970	14,125.58	296,213,478	14,896.13	312,371,865	1.20
18	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	83,200	3,424.00	284,877,020	3,745.26	311,606,456	1.20
19	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	112,200	3,260.25	365,800,338	2,751.69	308,739,921	1.18
20	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	32,550	13,575.28	441,875,589	9,436.83	307,168,908	1.18
21	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	29,320	11,430.09	335,130,268	10,454.06	306,513,233	1.18
22	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	248,700	981.56	244,116,020	1,123.85	279,502,589	1.07
23	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	41,200	6,611.80	272,406,363	6,720.62	276,889,750	1.06
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	66,500	4,746.33	315,631,599	4,134.52	274,946,145	1.05
25	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	39,000	8,567.44	334,130,293	6,696.96	261,181,768	1.00
26	アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	117,400	1,972.75	231,601,961	1,951.66	229,125,999	0.88
27	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	22,130	10,905.91	241,348,004	9,951.90	220,235,580	0.84
28	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	105,300	2,277.15	239,784,157	2,083.93	219,437,976	0.84
29	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	163,900	1,782.48	292,149,241	1,293.58	212,018,729	0.81
30	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,217,000	242.19	294,754,307	169.81	206,662,421	0.79

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.30
合計	99.30

## (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	39,940	9,001.33	359,513,372	10,005.66	399,626,320	6.33
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	4,771	62,769.56	299,473,582	74,555.92	355,706,321	5.63
3	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	14,220	14,013.30	199,269,262	15,704.75	223,321,637	3.53
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	8,120	26,042.69	211,466,649	21,633.96	175,667,761	2.78
5	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	7,550	22,086.66	166,754,298	17,100.49	129,108,744	2.04
6	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	18,870	8,805.63	166,162,270	6,545.35	123,510,775	1.95
7	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	21,930	8,948.64	196,243,820	5,520.59	121,066,543	1.91
8	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	18,520	7,670.11	142,050,528	5,989.42	110,924,077	1.75
9	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	6,630	16,357.46	108,449,984	16,682.20	110,603,014	1.75
10	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	16,580	14,501.49	240,434,800	6,424.91	106,525,132	1.68
11	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,570	33,078.37	118,089,811	26,759.91	95,532,899	1.51
12	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	86,500	986.05	85,293,931	1,099.50	95,107,053	1.50
13	香港	投資証券	LINK REIT	113,200	1,168.96	132,326,680	790.59	89,494,788	1.41
14	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	29,100	3,001.16	87,333,823	2,817.28	81,983,023	1.29
15	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	20,130	7,020.63	141,325,356	3,952.80	79,569,920	1.26
16	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	6,160	13,591.79	83,725,439	12,651.97	77,936,196	1.23
17	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	5,000	15,723.03	78,615,183	14,896.13	74,480,654	1.18
18	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	19,850	3,597.95	71,419,383	3,745.26	74,343,608	1.17
19	アメリカ	投資証券	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	26,700	3,624.83	96,783,129	2,751.69	73,470,195	1.16
20	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	7,760	13,508.99	104,829,793	9,436.83	73,229,823	1.16
21	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,990	12,417.56	86,798,776	10,454.06	73,073,926	1.15
22	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	59,100	1,056.26	62,425,208	1,123.85	66,419,795	1.05
23	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	9,830	7,160.42	70,386,955	6,720.62	66,063,744	1.04
24	アメリカ	投資証券	JDR INC	15,820	5,005.52	79,187,350	4,134.52	65,408,241	1.03
25	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	9,300	9,107.79	84,702,456	6,696.96	62,281,806	0.98
26	アメリカ	投資証券	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	27,900	2,071.02	57,781,676	1,951.66	54,451,579	0.86
27	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	5,220	11,410.00	59,560,244	9,951.90	51,948,926	0.82
28	アメリカ	投資証券	VICI PROPERTIES INC	24,900	2,365.66	58,904,934	2,083.93	51,889,892	0.82
29	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	38,700	1,700.04	65,791,908	1,293.58	50,061,774	0.79
30	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	286,000	256.86	73,461,960	169.81	48,566,518	0.76

## 種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.33
合計	97.33

## 【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・ブレード（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレード（タイプ ）

該当事項はありません。

インデックス・ブレード（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(2020年06月限)	買建	588	日本円	8,733,772,870	9,166,920,000	2.05

（参考）外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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



種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2020 年06月限)	買建	741	米ドル	107,629,175	11,573,365,196	112,557,900	12,103,350,987	1.86
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2020年06 月限)	買建	40	カナダド ル	7,160,940	558,624,932	7,368,000	574,777,680	0.08
	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(2020年06月 限)	買建	485	ユーロ	14,030,130	1,671,409,386	14,996,200	1,786,497,298	0.27
	オース トラリア	シドニー先 物取引所 ア	SP1200株価指数先 物(2020年06月限)	買建	36	豪ドル	4,918,900	350,963,517	5,270,400	376,043,040	0.05
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指数先 物(2020年06月限)	買建	103	英ポンド	6,130,330	812,452,637	6,410,720	849,612,715	0.13
	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 (2020年06月限)	買建	53	スイスフ ラン	5,130,210	572,121,020	5,266,080	587,273,235	0.09

## (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(2020 年06月限)	買建	47	米ドル	6,850,612.5	736,646,367	7,139,300	767,688,929	1.62
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2020年06 月限)	買建	3	カナダド ル	534,660	41,708,827	552,600	43,108,326	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(2020年06月 限)	買建	31	ユーロ	891,680	106,225,838	958,520	114,188,484	0.24
	オース トラリア	シドニー先 物取引所 ア	SP1200株価指数先 物(2020年06月限)	買建	2	豪ドル	270,825	19,323,365	292,800	20,891,280	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(2020年06月限)	買建	7	英ポンド	414,915	54,988,686	435,680	57,740,669	0.12
	スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取引 所	SMI株価指数先物 (2020年06月限)	買建	3	スイスフ ラン	288,690	32,194,709	298,080	33,241,881	0.07

## (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(2020年06月限)	買建	315	米ドル	14,387,825	1,547,122,827	14,447,475	1,553,536,971	4.04
	シンガポール	シンガポール取引所	SGX FTSE China A50 指数先物(2020年06月限)	買建	165	米ドル	2,149,505	231,136,272	2,177,175	234,111,627	0.60

(参考) 米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額(円)	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴマーカンタイル取引所	E-mini S&P500株価指数先物(2020年06月限)	買建	13	米ドル	1,922,687.5	206,746,588	1,974,700	212,339,491	0.74

(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(2020年06月限)	買建	733	日本円	1,191,109,830	1,246,833,000	3.39

#### (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(2020年06月限)	買建	50	米ドル	1,435,970	154,409,864	1,533,500	164,897,250	0.63

#### (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(2020年06月限)	買建	66	米ドル	1,955,880	210,315,783	2,024,220	217,664,371	3.44

### (3) 【運用実績】

#### 【純資産の推移】

#### インデックス・ブレンド(タイプ)

2020年5月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2017年 4月24日)	1	1	1.0002	1.0002
第2計算期間	(2018年 4月23日)	67	67	1.0242	1.0242
第3計算期間	(2019年 4月22日)	163	163	1.0487	1.0487

第4計算期間	(2020年 4月22日)	138	138	1.0282	1.0282
	2019年 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	
	12月末日	122		1.0811	
	2020年 1月末日	141		1.0855	
	2月末日	141		1.0690	
	3月末日	137		1.0227	
	4月末日	138		1.0436	
	5月末日	142		1.0559	

### インデックス・ブレンド(タイプ )

2020年5月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額(百万円)		1口当たり純資産額(円)	
		(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第1計算期間	(2017年 4月24日)	1	1	0.9998	0.9998
第2計算期間	(2018年 4月23日)	78	78	1.0402	1.0402
第3計算期間	(2019年 4月22日)	90	90	1.0690	1.0690
第4計算期間	(2020年 4月22日)	87	87	1.0281	1.0281
	2019年 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	
	12月末日	73		1.1126	
	2020年 1月末日	86		1.1163	
	2月末日	86		1.0860	
	3月末日	86		1.0196	
	4月末日	89		1.0513	
	5月末日	92		1.0709	

### インデックス・ブレンド(タイプ )

2020年5月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間	(2017年 4月24日)	2	2	0.9986	0.9986
第2計算期間	(2018年 4月23日)	182	182	1.0534	1.0534
第3計算期間	(2019年 4月22日)	215	215	1.0904	1.0904
第4計算期間	(2020年 4月22日)	291	291	1.0231	1.0231
	2019年 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	
	12月末日	278		1.1434	
	2020年 1月末日	283		1.1443	
	2月末日	304		1.1016	
	3月末日	285		1.0117	
	4月末日	303		1.0533	
	5月末日	318		1.0798	

### インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年5月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間	(2017年 4月24日)	3	3	0.9989	0.9989
第2計算期間	(2018年 4月23日)	31	31	1.0646	1.0646
第3計算期間	(2019年 4月22日)	51	51	1.1052	1.1052
第4計算期間	(2020年 4月22日)	76	76	1.0179	1.0179
	2019年 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	
	12月末日	66		1.1667	
	2020年 1月末日	68		1.1659	
	2月末日	77		1.1130	
	3月末日	72		1.0045	
	4月末日	79		1.0539	

5月末日	85		1.0848	
------	----	--	--------	--

### インデックス・ブレード（タイプ ）

2020年5月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間	(2017年 4月24日)	2	2	0.9965	0.9965
第2計算期間	(2018年 4月23日)	114	114	1.0820	1.0820
第3計算期間	(2019年 4月22日)	194	194	1.1290	1.1290
第4計算期間	(2020年 4月22日)	210	210	1.0107	1.0107
	2019年 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	
	12月末日	231		1.2017	
	2020年 1月末日	240		1.1976	
	2月末日	228		1.1257	
	3月末日	205		0.9944	
	4月末日	221		1.0556	
	5月末日	233		1.0958	

### 【分配の推移】

### インデックス・ブレード（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
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	0.0000円

### インデックス・ブレード（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
第4計算期間	2019年 4月23日～2020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
第4計算期間	2019年 4月23日～2020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
第4計算期間	2019年 4月23日～2020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
第4計算期間	2019年 4月23日～2020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計算期間	2019年 4月23日～2020年 4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計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	3.8%

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

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.1%
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計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	6.2%

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

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	0.1%
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	6.6%
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	3.8%
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	7.9%

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	0.4%
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計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	10.5%



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

#### (4)【設定及び解約の実績】

##### インデックス・ブレンド(タイプ )

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	1,871,229	22,136	1,849,093
第2計算期間	2017年 4月25日～2018年 4月23日	84,588,270	20,341,137	66,096,226
第3計算期間	2018年 4月24日～2019年 4月22日	139,749,676	50,154,666	155,691,236
第4計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	68,957,367	89,937,465	134,711,138

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・ブレンド(タイプ )

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	1,140,737		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計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	40,391,880	40,547,332	84,812,456

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・ブレンド(タイプ )

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	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計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	148,863,569	61,665,955	284,581,574

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・ブレンド(タイプ )

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2017年 1月10日～2017年 4月24日	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計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	42,459,087	14,139,356	75,155,964

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計算期間	2019年 4月23日～2020年 4月22日	84,060,552	47,829,633	208,589,259

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

### 参考情報



## 運用実績（2020年5月29日現在）

### ■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）

#### ■ タイプⅠ



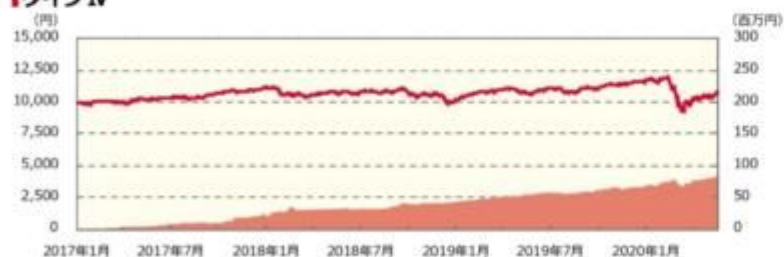
#### ■ タイプⅡ



#### ■ タイプⅢ



#### ■ タイプⅣ



#### ■ タイプⅤ



### ■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

#### ■ タイプⅠ

2020年4月	0 円
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

2020年4月	0 円
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

2020年4月	0 円
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

2020年4月	0 円
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

2020年4月	0 円
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	5.5	8.5	10.0	11.5	14.9
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	5.5	10.6	19.6	27.1	36.5
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	7.0	8.5	8.0	7.5	7.5
新興国株式マザーファンド	1.0	2.0	3.0	3.4	4.4
米国株式配当資産インデックスマザーファンド	2.1	2.6	3.1	3.1	4.0
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	54.0	41.4	30.1	20.6	7.9
外国債券マザーファンド	3.5	3.5	4.0	4.0	3.5
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	10.6	8.1	5.7	4.2	1.4
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	—	—	—	—	—
新興国債券マザーファンド	4.0	5.9	5.9	6.4	4.9
米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	2.0	2.0	3.0	3.0	3.4
J-REITインデックスマザーファンド	2.0	3.0	3.5	4.0	5.0
海外REITインデックスマザーファンド	2.0	3.5	4.0	5.0	6.0
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	—	—	—	—	—

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.2	0.3	0.3	0.4	0.5
2	ソニー	電気機器	0.1	0.2	0.2	0.2	0.3
3	キーエンス	電気機器	0.1	0.2	0.2	0.2	0.3
4	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
5	武田薬品工業	医薬品	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.2	0.4	0.7	1.0	1.3
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.2	0.4	0.7	0.9	1.3
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.1	0.3	0.5	0.7	1.0
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.1	0.3	0.4	0.5
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.1	0.2	0.3	0.4

・「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.3	0.3	0.3	0.3	0.3
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.2	0.3	0.3	0.3	0.3
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.2	0.2	0.2	0.2	0.2
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	ALPHABET INC-CL C	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

・「新興国株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	0.1	0.1	0.2	0.2	0.3
2	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
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.0	0.1	0.1	0.1	0.2
4	XTRADERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	—	0.0	0.1	0.1	0.1	0.2
5	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.0	0.1	0.1	0.1	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	LOWES COS INC	専門小売り	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1
2	PENTAIR PLC	機械	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1
3	CINTAS CORP	商業サービス・用品	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1
4	ALBEMARLE CORP	化学	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1
5	CARRIER GLOBAL CORP	建設関連製品	0.0	0.0	0.1	0.1	0.1

## ・「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（5年）第130回	国債証券	0.6	0.5	0.3	0.2	0.1
2	国庫債券 利付（5年）第129回	国債証券	0.6	0.4	0.3	0.2	0.1
3	国庫債券 利付（10年）第334回	国債証券	0.5	0.4	0.3	0.2	0.1
4	国庫債券 利付（5年）第133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343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 BOND	国債証券	0.0	0.0	0.1	0.0	0.0
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0

## ・「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」を通じた投資銘柄

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	0.1	0.1	0.1	0.0	0.0
2	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	0.0
3	UK TREASURY	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	0.0
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	0.0
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.0	0.0	0.0

## ・「新興国債券マザーファンド」を通じた投資銘柄

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	0.2	0.2	0.2	0.1
2	REPUBLIC OF TURKEY	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
3	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
4	FED REPUBLIC OF BRAZIL	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.1
5	UNITED MEXICAN STATES	国債証券	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1

## ・「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	FORD MOTOR CREDIT CO LLC	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	CENTENE ESCROW I CORP	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
4	TRANSDIGM INC	社債券	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0
5	UNITED RENTALS NORTH AM	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

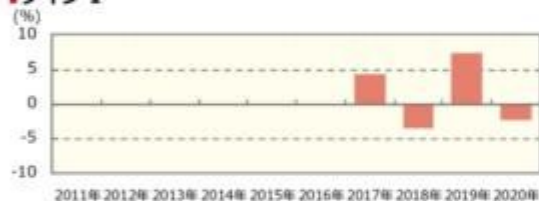
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)				
			タイプⅠ	タイプⅡ	タイプⅢ	タイプⅣ	タイプⅤ
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.3	0.4
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.2	0.2	0.3	0.3
3	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
4	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.2	0.2	0.2
5	大和ハウスリート投資法人 投資証券	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2

## ・「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	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.2	0.2
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.1	0.1	0.1	0.1	0.2
5	AVALONBAY COMMUNITIES INC	投資証券	0.0	0.1	0.1	0.1	0.1

## ■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)

## ■ タイプⅠ



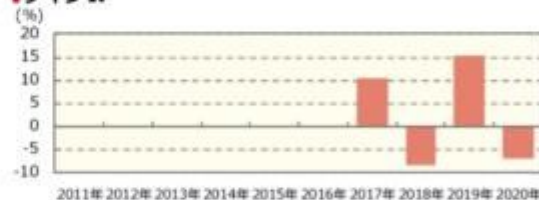
## ■ タイプⅡ



## ■ タイプⅢ



## ■ タイプⅣ



## ■ タイプⅤ



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2017年は設定日（2017年1月10日）から年末までの収益率。
- ・2020年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。●グラフの縦軸の目盛りはファンドごとに異なる場合があります。

## 第2【管理及び運営】

## 1【申込（販売）手続等】

- ・ 申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
- ・ 取得申込みの受付については、午後3時まで取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。
- ・ 販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則として取得およびスイッチングの申込みができません。

申込日当日あるいは申込日の翌営業日が以下のいずれかの休業日と同日の場合

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

申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

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

#### 積立方式

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

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

- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。  
詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

スイッチングの方法等は、購入、換金の場合と同様です。

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

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

スイッチングとは、「インデックス・ブレンド」を構成するいずれかのファンドをご換金した場合の手取金をもって、そのご換金のお申込み日の午後3時まで、「インデックス・ブレンド」を構成する他のファンドの取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものをいいます。

- ・ 金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項

第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、受益権の取得申込の受付け（スイッチングの申込みを含みます。）を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付け（スイッチングの申込みを含みます。）を取り消す場合があります。

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

## 2【換金（解約）手続等】

- ・受益者は、委託者に1口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。
  - ・受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
  - ・一部解約の実行の請求の受付けについては、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付けにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。
- ただし、販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として受益権の一部解約の実行の請求ができません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）
- ・換金価額は、換金申込日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差し引いた価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。
  - ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して7営業日目から販売会社において支払います。
  - ・金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消す場合があります。
- また、一部解約の実行の請求の受付けが中止された場合には、受益者は当該受付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして信託約款の規定に準じて計算された価額とします。



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

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### <基準価額の計算方法>

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

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

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

#### (2)【保管】

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

#### (3)【信託期間】

無期限とします(2017年1月10日設定)。

#### （４）【計算期間】

原則として、毎年4月23日から翌年4月22日までとします。

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

#### （５）【その他】

##### （a）ファンドの繰上償還条項

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

##### （b）信託期間の終了

（ ）委託者は、上記「（a）ファンドの繰上償還条項」に従い信託期間を終了させるには、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。

（ ）上記（ ）の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

（ ）上記（ ）の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。

（ ）上記（ ）から（ ）までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記（ ）から（ ）までに規定するこの信託契約の解約の手続を行なうことが困難な場合には適用しません。

（ ）委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

（ ）委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「（d）信託約款の変更等」の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

##### （c）運用報告書

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

## (d) 信託約款の変更等

- ( ) 委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- ( ) 委託者は、上記( )の事項（上記( )の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- ( ) 上記( )の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ( ) 上記( )の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ( ) 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ( ) 上記( )から( )までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ( ) 上記( )から( )の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

## (e) 公告

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

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

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

## (f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

## (g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

この信託は、受益者が一部解約の実行の請求を行なったときは、委託者が信託契約の一部の解約をす

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

収益分配金は、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としてします。）に、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取りください。

累積投資契約を結んでいる場合には、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

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

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

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

等」をご参照下さい。

### 第3【ファンドの経理状況】

インデックス・ブレイド（タイプ ）

インデックス・ブレイド（タイプ ）

インデックス・ブレイド（タイプ ）

インデックス・ブレイド（タイプ ）

インデックス・ブレイド（タイプ ）

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2019年4月23日から2020年4月22日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【インデックス・ブレンド（タイプ ）】

## （ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 (2019年 4月22日現在)	第4期 (2020年 4月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,493,713	1,237,677
親投資信託受益証券	162,279,984	135,975,996
派生商品評価勘定	-	53,605
未収入金	-	1,635,411
流動資産合計	163,773,697	138,902,689
資産合計	163,773,697	138,902,689
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	42,843	6,907
未払解約金	100,643	5,389
未払受託者報酬	22,317	23,881
未払委託者報酬	334,648	358,098
未払利息	3	1
その他未払費用	2,167	2,328
流動負債合計	502,621	396,604
負債合計	502,621	396,604
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	155,691,236	134,711,138
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,579,840	3,794,947
（分配準備積立金）	3,780,655	3,734,872
元本等合計	163,271,076	138,506,085
純資産合計	163,271,076	138,506,085
負債純資産合計	163,773,697	138,902,689

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自 2018年 4月24日	至 2019年 4月22日	自 2019年 4月23日	至 2020年 4月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		5,171,849		1,841,988
為替差損益		160,983		76,846
営業収益合計		5,010,866		1,765,142
営業費用				
支払利息		1,015		769
受託者報酬		33,686		50,483
委託者報酬		505,109		757,108
その他費用		14,047		15,730
営業費用合計		553,857		824,090
営業利益又は営業損失（ ）		4,457,009		2,589,232
経常利益又は経常損失（ ）		4,457,009		2,589,232
当期純利益又は当期純損失（ ）		4,457,009		2,589,232
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		544,071		1,300,590
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		3,202,067		4,655,681
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		3,202,067		4,655,681
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,135,256		4,550,752
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,135,256		4,550,752
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		7,579,840		3,794,947



## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年 4月23日から2020年 4月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年 4月22日現在	第4期 2020年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 155,691,236口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 134,711,138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. 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 1.0282円 (10,000口当たり純資産額) (10,282円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日																																										
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																										
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,661,159円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>1,800,724円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,799,185円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>318,772円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>7,579,840円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>155,691,236口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,661,159円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,800,724円	収益調整金額	C	3,799,185円	分配準備積立金額	D	318,772円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,579,840円	当ファンドの期末残存口数	F	155,691,236口	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,656,888円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,084,246円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,077,984円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>6,819,118円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>134,711,138口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,656,888円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	3,084,246円	分配準備積立金額	D	2,077,984円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,819,118円	当ファンドの期末残存口数	F	134,711,138口
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	1,661,159円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,800,724円																																									
収益調整金額	C	3,799,185円																																									
分配準備積立金額	D	318,772円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,579,840円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	155,691,236口																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	1,656,888円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																									
収益調整金額	C	3,084,246円																																									
分配準備積立金額	D	2,077,984円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	6,819,118円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	134,711,138口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	486円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	506円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年 4月22日現在	第4期 2020年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載して おります。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般 の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4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 68,957,367円
期中一部解約元本額 50,154,666円	期中一部解約元本額 89,937,465円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	4,597,685	3,236,655

合計	4,597,685	3,236,655
----	-----------	-----------

## 3 デリバティブ取引関係

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第3期(2019年 4月22日現在)				第4期(2020年 4月22日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	4,330,645	-	4,373,488	42,843	3,880,544	-	3,833,846	46,698
米ドル	4,330,645	-	4,373,488	42,843	3,880,544	-	3,833,846	46,698
合計	4,330,645	-	4,373,488	42,843	3,880,544	-	3,833,846	46,698

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	5,208,869	7,498,166	

親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,977,525	4,699,390	
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,672,139	6,632,248	
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	56,713,725	75,763,865	
	J-REITインデックスマザーファンド	1,742,337	3,334,833	
	海外REITインデックスマザーファンド	1,777,969	3,272,529	
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	3,970,463	6,983,647	
	新興国株式マザーファンド	1,937,236	2,018,987	
	新興国債券マザーファンド	2,243,215	4,059,546	
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	12,676,485	15,692,220	
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	2,373,107	2,716,495	
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	2,982,013	3,304,070	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：98.2%	96,275,083	135,975,996
合計			135,975,996	

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

## 【インデックス・ブレード（タイプ ）】

## （ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 (2019年 4月22日現在)	第4期 (2020年 4月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	847,909	682,542
親投資信託受益証券	90,293,286	86,061,201
派生商品評価勘定	-	45,975
未収入金	-	628,754
流動資産合計	91,141,195	87,418,472
資産合計	91,141,195	87,418,472
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	43,396	11,647
未払解約金	77,840	-
未払受託者報酬	11,532	12,877
未払委託者報酬	176,806	197,438
未払利息	1	-
その他未払費用	1,094	1,223
流動負債合計	310,669	223,185
負債合計	310,669	223,185
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	84,967,908	84,812,456
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,862,618	2,382,831
（分配準備積立金）	2,065,074	2,318,866
元本等合計	90,830,526	87,195,287
純資産合計	90,830,526	87,195,287
負債純資産合計	91,141,195	87,418,472

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	2018年 4月24日	自	2019年 4月23日
	至	2019年 4月22日	至	2020年 4月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,902,955		3,657,085
為替差損益		211,769		50,575
営業収益合計		2,691,186		3,606,510
営業費用				
支払利息		761		436
受託者報酬		22,229		25,574
委託者報酬		340,903		391,999
その他費用		12,908		13,232
営業費用合計		376,801		431,241
営業利益又は営業損失（ ）		2,314,385		4,037,751
経常利益又は経常損失（ ）		2,314,385		4,037,751
当期純利益又は当期純損失（ ）		2,314,385		4,037,751
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		184,147		253,465
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		2,932,806		3,620,263
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,932,806		3,620,263
剰余金減少額又は欠損金増加額		2,248,984		2,808,834
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		2,248,984		2,808,834
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		5,862,618		2,382,831

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年 4月23日から2020年 4月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年 4月22日現在	第4期 2020年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 84,967,908口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 84,812,456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. 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 1.0281円 (10,000口当たり純資産額) (10,281円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日																																										
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																										
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,206,857円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>660,635円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,797,544円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>197,582円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>5,862,618円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>84,967,908口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,206,857円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	660,635円	収益調整金額	C	3,797,544円	分配準備積立金額	D	197,582円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,862,618円	当ファンドの期末残存口数	F	84,967,908口	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,124,808円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,910,574円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,194,058円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>4,229,440円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>84,812,456口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,124,808円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	1,910,574円	分配準備積立金額	D	1,194,058円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,229,440円	当ファンドの期末残存口数	F	84,812,456口
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	1,206,857円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	660,635円																																									
収益調整金額	C	3,797,544円																																									
分配準備積立金額	D	197,582円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	5,862,618円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	84,967,908口																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	1,124,808円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																									
収益調整金額	C	1,910,574円																																									
分配準備積立金額	D	1,194,058円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,229,440円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	84,812,456口																																									



10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	689円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	498円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年 4月22日現在	第4期 2020年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4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 40,391,880円
期中一部解約元本額 55,040,537円	期中一部解約元本額 40,547,332円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,594,285	3,873,696

合計	2,594,285	3,873,696
----	-----------	-----------

## 3 デリバティブ取引関係

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第3期(2019年 4月22日現在)				第4期(2020年 4月22日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	3,195,499	-	3,238,895	43,396	3,262,168	-	3,227,840	34,328
米ドル	3,195,499	-	3,238,895	43,396	3,262,168	-	3,227,840	34,328
合計	3,195,499	-	3,238,895	43,396	3,262,168	-	3,227,840	34,328

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	5,092,626	7,330,835	

親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,253,357	2,978,477	
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	3,386,639	8,405,637	
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	28,161,672	37,621,177	
	J-REITインデックスマザーファンド	1,325,015	2,536,078	
	海外REITインデックスマザーファンド	2,027,525	3,731,862	
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	3,351,055	5,894,170	
	新興国株式マザーファンド	2,049,697	2,136,194	
	新興国債券マザーファンド	1,892,320	3,424,531	
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	6,276,336	7,769,476	
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1,503,118	1,720,619	
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	2,267,279	2,512,145	
小計	銘柄数：12 組入時価比率：98.7%	58,586,639	86,061,201	100.0%
合計			86,061,201	

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

## 【インデックス・ブレード（タイプ ）】

## （ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 (2019年 4月22日現在)	第4期 (2020年 4月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	1,887,886	3,072,927
親投資信託受益証券	213,934,228	285,250,126
派生商品評価勘定	-	138,649
未収入金	-	3,514,462
流動資産合計	215,822,114	291,976,164
資産合計	215,822,114	291,976,164
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	78,979	6,971
未払解約金	2,548	33,364
未払受託者報酬	30,221	46,057
未払委託者報酬	473,413	721,555
未払利息	4	3
その他未払費用	2,959	4,544
流動負債合計	588,124	812,494
負債合計	588,124	812,494
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	197,383,960	284,581,574
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	17,850,030	6,582,096
（分配準備積立金）	5,817,435	8,650,179
元本等合計	215,233,990	291,163,670
純資産合計	215,233,990	291,163,670
負債純資産合計	215,822,114	291,976,164

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	2018年 4月24日	自	2019年 4月23日
	至	2019年 4月22日	至	2020年 4月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		7,875,953		19,596,102
為替差損益		460,674		138,681
営業収益合計		7,415,279		19,457,421
営業費用				
支払利息		1,591		1,196
受託者報酬		59,808		83,662
委託者報酬		936,873		1,310,622
その他費用		16,665		19,045
営業費用合計		1,014,937		1,414,525
営業利益又は営業損失（ ）		6,400,342		20,871,946
経常利益又は経常損失（ ）		6,400,342		20,871,946
当期純利益又は当期純損失（ ）		6,400,342		20,871,946
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		95,806		459,958
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		5,910,806		15,748,492
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		5,910,806		15,748,492
剰余金減少額又は欠損金増加額		3,597,988		5,684,522
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		3,597,988		5,684,522
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		17,850,030		6,582,096

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年 4月23日から2020年 4月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年 4月22日現在	第4期 2020年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 197,383,960口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 284,581,574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. 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 1.0231円 (10,000口当たり純資産額) (10,231円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日																																										
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																										
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>3,597,172円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>1,200,269円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>12,032,595円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,019,994円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>17,850,030円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>197,383,960口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	3,597,172円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,200,269円	収益調整金額	C	12,032,595円	分配準備積立金額	D	1,019,994円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,850,030円	当ファンドの期末残存口数	F	197,383,960口	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>4,135,938円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>7,587,061円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>4,514,241円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>16,237,240円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>284,581,574口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	4,135,938円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	7,587,061円	分配準備積立金額	D	4,514,241円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	16,237,240円	当ファンドの期末残存口数	F	284,581,574口
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	3,597,172円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,200,269円																																									
収益調整金額	C	12,032,595円																																									
分配準備積立金額	D	1,019,994円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	17,850,030円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	197,383,960口																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	4,135,938円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																									
収益調整金額	C	7,587,061円																																									
分配準備積立金額	D	4,514,241円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	16,237,240円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	284,581,574口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	904円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	570円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項



第3期 2019年 4月22日現在	第4期 2020年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
期首元本額 172,950,641円	期首元本額 197,383,960円
期中追加設定元本額 90,227,074円	期中追加設定元本額 148,863,569円
期中一部解約元本額 65,793,755円	期中一部解約元本額 61,665,955円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	7,151,169	18,735,519

合計	7,151,169	18,735,519
----	-----------	------------

## 3 デリバティブ取引関係

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第3期(2019年 4月22日現在)				第4期(2020年 4月22日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
	うち1年超				うち1年超			
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	7,617,651	-	7,696,630	78,979	10,665,233	-	10,533,555	131,678
米ドル	7,617,651	-	7,696,630	78,979	10,665,233	-	10,533,555	131,678
合計	7,617,651	-	7,696,630	78,979	10,665,233	-	10,533,555	131,678

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	19,976,752	28,756,534	

親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	4,789,805	11,382,492	
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	21,550,389	53,488,065	
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	68,764,571	91,862,590	
	J-REITインデックスマザーファンド	5,176,783	9,908,362	
	海外REITインデックスマザーファンド	7,561,781	13,918,214	
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	9,907,583	17,426,447	
	新興国株式マザーファンド	9,602,093	10,007,301	
	新興国債券マザーファンド	6,278,135	11,361,540	
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	15,085,428	18,674,251	
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	7,554,803	8,647,982	
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	8,859,520	9,816,348	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：98.0%	185,107,643	285,250,126
合計			285,250,126	

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

## 【インデックス・ブレンド（タイプ ）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 (2019年 4月22日現在)	第4期 (2020年 4月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	456,065	775,996
親投資信託受益証券	51,446,390	74,610,988
派生商品評価勘定	-	32,035
未収入金	-	1,278,113
流動資産合計	51,902,455	76,697,132
資産合計	51,902,455	76,697,132
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	16,892	4,045
未払解約金	99	2
未払受託者報酬	7,231	11,389
未払委託者報酬	115,552	182,212
その他未払費用	660	1,067
流動負債合計	140,434	198,715
負債合計	140,434	198,715
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	46,836,233	75,155,964
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	4,925,788	1,342,453
（分配準備積立金）	1,370,908	2,199,635
元本等合計	51,762,021	76,498,417
純資産合計	51,762,021	76,498,417
負債純資産合計	51,902,455	76,697,132

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自	2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	自	2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,075,619		6,284,402
為替差損益		88,147		40,228
営業収益合計		1,987,472		6,244,174
営業費用				
支払利息		119		197
受託者報酬		12,685		20,649
委託者報酬		202,730		330,396
その他費用		11,918		12,742
営業費用合計		227,452		363,984
営業利益又は営業損失（ ）		1,760,020		6,608,158
経常利益又は経常損失（ ）		1,760,020		6,608,158
当期純利益又は当期純損失（ ）		1,760,020		6,608,158
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		29,859		416,791
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		1,439,590		4,920,627
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,439,590		4,920,627
剰余金減少額又は欠損金増加額		133,661		1,479,013
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		133,661		1,479,013
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		4,925,788		1,342,453

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年 4月23日から2020年 4月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年 4月22日現在	第4期 2020年 4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 46,836,233口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 75,155,964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. 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 1.0179円 (10,000口当たり純資産額) (10,179円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日																																										
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																										
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>842,121円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>266,095円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,554,880円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>262,692円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>4,925,788円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>46,836,233口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	842,121円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	266,095円	収益調整金額	C	3,554,880円	分配準備積立金額	D	262,692円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,925,788円	当ファンドの期末残存口数	F	46,836,233口	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>1,129,307円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,052,680円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,070,328円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>4,252,315円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>75,155,964口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,129,307円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	2,052,680円	分配準備積立金額	D	1,070,328円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,252,315円	当ファンドの期末残存口数	F	75,155,964口
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	842,121円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	266,095円																																									
収益調整金額	C	3,554,880円																																									
分配準備積立金額	D	262,692円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,925,788円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	46,836,233口																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	1,129,307円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																									
収益調整金額	C	2,052,680円																																									
分配準備積立金額	D	1,070,328円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,252,315円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	75,155,964口																																									

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

## 2. その他費用

その他費用のうち10,800円は、L E I 取得費用であります。

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	565円
10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

## 2. その他費用

その他費用のうち10,800円は、L E I 取得費用であります。

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年 4月22日現在	第4期 2020年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載して おります。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時 価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としてお ります。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般 の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4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 42,459,087円
期中一部解約元本額 2,057,321円	期中一部解約元本額 14,139,356円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,087,372	6,040,249



合計	2,087,372	6,040,249
----	-----------	-----------

## 3 デリバティブ取引関係

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第3期(2019年 4月22日現在)				第4期(2020年 4月22日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
	うち1年超				うち1年超			
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	2,064,475	-	2,081,367	16,892	3,184,224	-	3,156,234	27,990
米ドル	2,064,475	-	2,081,367	16,892	3,184,224	-	3,156,234	27,990
合計	2,064,475	-	2,081,367	16,892	3,184,224	-	3,156,234	27,990

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	6,045,731	8,702,829	

親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	1,287,499	3,059,612	
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	7,469,382	18,539,006	
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	12,629,210	16,871,361	
	J-REITインデックスマザーファンド	1,561,905	2,989,486	
	海外REITインデックスマザーファンド	2,794,638	5,143,810	
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	2,170,366	3,817,456	
	新興国株式マザーファンド	3,256,459	3,393,881	
	新興国債券マザーファンド	1,893,464	3,426,601	
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	3,084,225	3,817,962	
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	1,970,914	2,256,105	
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	2,340,144	2,592,879	
小計	銘柄数：12 組入時価比率：97.5%	46,503,937	74,610,988	100.0%
合計			74,610,988	

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

## 【インデックス・ブレード（タイプ ）】

## （ 1 ）【貸借対照表】

（単位：円）

	第3期 (2019年 4月22日現在)	第4期 (2020年 4月22日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	17,122,558	2,289,015
親投資信託受益証券	193,451,179	205,244,735
派生商品評価勘定	-	40,891
未収入金	-	3,894,912
流動資産合計	210,573,737	211,469,553
資産合計	210,573,737	211,469,553
<b>負債の部</b>		
流動負債		
派生商品評価勘定	20,191	4,540
未払解約金	15,407,795	-
未払受託者報酬	31,399	37,222
未払委託者報酬	512,830	607,926
未払利息	37	2
その他未払費用	3,083	3,662
流動負債合計	15,975,335	653,352
負債合計	15,975,335	653,352
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	172,358,340	208,589,259
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,240,062	2,226,942
（分配準備積立金）	7,030,269	9,711,879
元本等合計	194,598,402	210,816,201
純資産合計	194,598,402	210,816,201
負債純資産合計	210,573,737	211,469,553

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第3期		第4期	
	自 2018年 4月24日	至 2019年 4月22日	自 2019年 4月23日	至 2020年 4月22日
営業収益				
有価証券売買等損益		10,000,889		23,176,444
為替差損益		217,735		95,895
営業収益合計		9,783,154		23,080,549
営業費用				
支払利息		1,459		930
受託者報酬		60,471		71,062
委託者報酬		987,659		1,160,609
その他費用		16,735		17,791
営業費用合計		1,066,324		1,250,392
営業利益又は営業損失（ ）		8,716,830		24,330,941
経常利益又は経常損失（ ）		8,716,830		24,330,941
当期純利益又は当期純損失（ ）		8,716,830		24,330,941
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（ ）		769,962		626,646
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		9,958,634		10,995,342
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		9,958,634		10,995,342
剰余金減少額又は欠損金増加額		4,338,131		6,050,875
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		4,338,131		6,050,875
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		22,240,062		2,226,942

## (3)【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1.運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年4月23日から2020年4月22日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

第3期 2019年4月22日現在	第4期 2020年4月22日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 172,358,340口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 208,589,259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. 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 1.0107円 (10,000口当たり純資産額) (10,107円)

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日																																										
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																										
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>4,158,390円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>2,243,692円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>15,209,793円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>628,187円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>22,240,062円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>172,358,340口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	4,158,390円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,243,692円	収益調整金額	C	15,209,793円	分配準備積立金額	D	628,187円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	22,240,062円	当ファンドの期末残存口数	F	172,358,340口	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>4,177,574円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>6,040,198円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>5,534,305円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>15,752,077円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>208,589,259口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	4,177,574円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	6,040,198円	分配準備積立金額	D	5,534,305円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,752,077円	当ファンドの期末残存口数	F	208,589,259口
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	4,158,390円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	2,243,692円																																									
収益調整金額	C	15,209,793円																																									
分配準備積立金額	D	628,187円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	22,240,062円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	172,358,340口																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	4,177,574円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																									
収益調整金額	C	6,040,198円																																									
分配準備積立金額	D	5,534,305円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	15,752,077円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	208,589,259口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,290円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	755円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

第3期 2019年 4月22日現在	第4期 2020年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2. 時価の算定方法 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4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 84,060,552円
期中一部解約元本額 53,143,123円	期中一部解約元本額 47,829,633円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2018年 4月24日 至 2019年 4月22日	第4期 自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	9,089,918	22,314,977

合計	9,089,918	22,314,977
----	-----------	------------

## 3 デリバティブ取引関係

## デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第3期(2019年 4月22日現在)				第4期(2020年 4月22日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	4,362,608	-	4,382,799	20,191	5,793,946	-	5,757,595	36,351
米ドル	4,362,608	-	4,382,799	20,191	5,793,946	-	5,757,595	36,351
合計	4,362,608	-	4,382,799	20,191	5,793,946	-	5,757,595	36,351

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	21,718,259	31,263,433	



親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	3,071,055	7,298,055	
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	28,611,732	71,014,318	
	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	15,118,912	20,197,354	
	J-REITインデックスマザーファンド	6,501,486	12,443,844	
	海外REITインデックスマザーファンド	7,674,444	14,125,581	
	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	5,467,478	9,616,747	
	新興国株式マザーファンド	11,048,326	11,514,565	
	新興国債券マザーファンド	3,408,280	6,167,964	
	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	3,296,589	4,080,847	
	米国ハイ・イールド債券インデックスマザーファンド	6,334,461	7,251,057	
	米国株式配当貴族インデックスマザーファンド	9,269,829	10,270,970	
小計	銘柄数：12 組入時価比率：97.4%	121,520,851	205,244,735	100.0%
合計			205,244,735	

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

### （参考）

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

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

## 国内株式マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	22,263,391,933
株式	390,882,128,580

(2020年 4月22日現在)

派生商品評価勘定	25,428,197
未収入金	579,946,462
未収配当金	5,017,827,780
未収利息	1,574,851
その他未収収益	68,595,031
差入委託証拠金	601,604,428
流動資産合計	419,440,497,262
資産合計	419,440,497,262
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	221,232,825
未払解約金	830,337,834
未払利息	26,258
有価証券貸借取引受入金	17,397,816,944
流動負債合計	18,449,413,861
負債合計	18,449,413,861
純資産の部	
元本等	
元本	278,557,544,313
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	122,433,539,088
元本等合計	400,991,083,401
純資産合計	400,991,083,401
負債純資産合計	419,440,497,262

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

## （貸借対照表に関する注記）

2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.4395円
(10,000口当たり純資産額)	(14,395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	
	16,241,441,780円

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日	
1.金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	
当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。	
当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。	
これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	
当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。	
3.金融商品に係るリスク管理体制	
委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。	
市場リスクの管理	
市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。	
信用リスクの管理	
信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。	
流動性リスクの管理	
流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	

## 株式、新株予約権証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4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	75,604,058,658円
同期中における一部解約元本額	47,118,579,531円
期末元本額	278,557,544,313円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	178,625,645円
バランスセレクト50	402,085,927円
バランスセレクト70	495,000,716円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,885,677,974円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,813,770,474円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	7,868,901,058円
野村資産設計ファンド2015	51,971,322円
野村資産設計ファンド2020	58,492,538円
野村資産設計ファンド2025	95,479,125円
野村資産設計ファンド2030	116,655,093円
野村資産設計ファンド2035	89,511,116円
野村資産設計ファンド2040	186,220,376円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	92,864,014,804円
のむらップ・ファンド（保守型）	3,116,173,449円
のむらップ・ファンド（普通型）	9,189,478,315円
のむらップ・ファンド（積極型）	2,387,690,895円
野村資産設計ファンド2045	27,603,787円
野村インデックスファンド・TOPIX	2,021,799,740円
マイ・ロード	4,122,090,807円
ネクストコア	14,802,055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	1,458,156,630円
野村TOPIXインデックス（野村SMA・EW向け）	3,529,540,592円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,030,413,166円
野村資産設計ファンド2050	45,417,194円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	15,612,880円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	7,076,679円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	5,570,475円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	3,454,206円
のむらップ・ファンド（やや保守型）	324,325,653円

のむラップ・ファンド(やや積極型)	321,482,971円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,208,869円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,092,626円
インデックス・ブレンド(タイプ)	19,976,752円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,045,731円
インデックス・ブレンド(タイプ)	21,718,259円
野村6資産均等バランス	1,189,949,530円
世界6資産分散ファンド	121,876,700円
野村資産設計ファンド2060	15,495,197円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	523,012,371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)	469,678,290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)	332,134,118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)	703,756,395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)	776,532,521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)	4,920,890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)	9,889,902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)	579,947円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,212,440,889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)	15,451,654円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	131,950,420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)	101,306,695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)	34,839,277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)	117,147,104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)	283,267,600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)	4,639,818,845円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	83,060,027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)	222,221,243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)	3,134,064,046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)	231,250,800円
野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	848,059,661円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	287,611円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,162,546円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	29,432,462円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	37,712,450円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	135,068,579円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	10,714,368,328円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	26,471,100,666円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	28,007,941,085円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	31,940,932,955円
マイバランスDC30	3,709,300,643円
マイバランスDC50	5,485,559,524円
マイバランスDC70	4,898,054,553円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,024,535,552円
野村DC運用戦略ファンド	219,548,236円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	17,483,123円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	901,479,930円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	703,900,875円

マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	529,603,149円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	6,996,035円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,668,044円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	42,369,271円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	9,075,152円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	6,992,151円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	6,751,696円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	266,709,465円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	196,100,000円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	89,884,771円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	104,856,959円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	2,826,481円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	9,400	2,538.00	23,857,200	
		日本水産	268,500	458.00	122,973,000	貸付有価証券 1,500株
		マルハニチロ	38,800	2,231.00	86,562,800	
		カネコ種苗	8,100	1,472.00	11,923,200	
		サカタのタネ	32,000	3,510.00	112,320,000	貸付有価証券 1,400株(400株)
		ホクト	20,500	1,937.00	39,708,500	貸付有価証券 700株
		ホクリヨウ	4,200	603.00	2,532,600	
		住石ホールディングス	54,200	111.00	6,016,200	
		日鉄鉱業	6,200	4,140.00	25,668,000	
		三井松島ホールディングス	10,400	822.00	8,548,800	
		国際石油開発帝石	1,077,100	614.30	661,662,530	貸付有価証券 353,700株
		石油資源開発	35,100	1,723.00	60,477,300	
		K&Oエナジーグループ	13,000	1,509.00	19,617,000	貸付有価証券 4,000株

ヒノキヤグループ	6,700	1,360.00	9,112,000	
ショーボンドホールディングス	41,800	4,245.00	177,441,000	貸付有価証券 15,500株（1,700株）
ミライト・ホールディングス	79,800	1,330.00	106,134,000	
タマホーム	14,500	1,142.00	16,559,000	貸付有価証券 3,400株
サンヨーホームズ	2,300	573.00	1,317,900	
日本アクア	10,700	580.00	6,206,000	貸付有価証券 2,300株（100株）
ファーストコーポレーション	8,200	428.00	3,509,600	貸付有価証券 3,900株
ベストセラ	4,600	956.00	4,397,600	貸付有価証券 2,100株（1,200株）
T A T E R U	55,300	110.00	6,083,000	貸付有価証券 25,900株（24,700株）
キャンディル	2,400	423.00	1,015,200	貸付有価証券 400株
スペースバリューホールディングス	32,700	307.00	10,038,900	貸付有価証券 600株
ダイセキ環境ソリューション	5,200	910.00	4,732,000	
第一カッター興業	3,300	1,557.00	5,138,100	
明豊ファシリティワークス	6,500	478.00	3,107,000	
安藤・間	159,900	643.00	102,815,700	
東急建設	78,600	521.00	40,950,600	貸付有価証券 100株
コムシスホールディングス	95,200	2,837.00	270,082,400	貸付有価証券 1,200株
ピーアールホールディングス	29,200	477.00	13,928,400	貸付有価証券 400株
高松コンストラクショングループ	16,700	2,148.00	35,871,600	
東建コーポレーション	8,300	7,900.00	65,570,000	貸付有価証券 1,800株
ソネック	2,800	676.00	1,892,800	
ヤマウラ	11,700	709.00	8,295,300	
大成建設	206,700	3,145.00	650,071,500	
大林組	620,000	894.00	554,280,000	貸付有価証券 400株

清水建設	629,200	798.00	502,101,600	貸付有価証券 13,100株
飛島建設	17,800	998.00	17,764,400	
長谷工コーポレーション	240,000	1,123.00	269,520,000	貸付有価証券 1,600株
松井建設	24,400	613.00	14,957,200	
銭高組	2,700	3,470.00	9,369,000	
鹿島建設	486,700	1,042.00	507,141,400	貸付有価証券 5,600株
不動テトラ	16,200	1,232.00	19,958,400	貸付有価証券 100株
大末建設	7,200	704.00	5,068,800	
鉄建建設	13,500	2,094.00	28,269,000	
西松建設	47,800	1,924.00	91,967,200	貸付有価証券 1,300株
三井住友建設	149,800	403.00	60,369,400	
大豊建設	13,900	2,169.00	30,149,100	
前田建設工業	155,300	776.00	120,512,800	
佐田建設	13,300	344.00	4,575,200	
ナカノフドー建設	16,900	323.00	5,458,700	
奥村組	33,600	2,139.00	71,870,400	
東鉄工業	26,600	2,698.00	71,766,800	
イチケン	4,500	1,157.00	5,206,500	
富士ピー・エス	9,100	507.00	4,613,700	
浅沼組	6,900	3,285.00	22,666,500	
戸田建設	257,500	618.00	159,135,000	貸付有価証券 2,900株
熊谷組	28,700	2,182.00	62,623,400	
北野建設	3,800	2,445.00	9,291,000	
植木組	2,700	2,377.00	6,417,900	
矢作建設工業	27,400	763.00	20,906,200	
ピーエス三菱	20,400	510.00	10,404,000	貸付有価証券 1,200株
日本ハウスホールディングス	42,300	278.00	11,759,400	貸付有価証券 600株
大東建託	74,300	10,450.00	776,435,000	貸付有価証券 700株
新日本建設	26,400	735.00	19,404,000	
N I P P O	51,300	2,321.00	119,067,300	貸付有価証券



				300株
東亜道路工業	3,800	2,725.00	10,355,000	
前田道路	54,700	1,946.00	106,446,200	貸付有価証券 1,100株
日本道路	6,000	6,120.00	36,720,000	貸付有価証券 900株
東亜建設工業	19,300	1,290.00	24,897,000	貸付有価証券 2,900株(1,000株)
日本国土開発	45,200	510.00	23,052,000	貸付有価証券 300株
若築建設	11,100	1,134.00	12,587,400	
東洋建設	69,500	416.00	28,912,000	貸付有価証券 500株
五洋建設	245,800	523.00	128,553,400	貸付有価証券 3,900株
世紀東急工業	29,800	757.00	22,558,600	
福田組	7,200	4,075.00	29,340,000	
住友林業	157,000	1,220.00	191,540,000	貸付有価証券 4,500株
日本基礎技術	20,800	399.00	8,299,200	
巴コーポレーション	27,500	327.00	8,992,500	
大和ハウス工業	613,400	2,641.00	1,619,989,400	貸付有価証券 1,700株
ライト工業	35,500	1,237.00	43,913,500	貸付有価証券 3,400株
積水ハウス	678,300	1,765.00	1,197,199,500	貸付有価証券 58,900株
日特建設	16,200	696.00	11,275,200	
北陸電気工事	10,700	903.00	9,662,100	
ユアテック	35,500	612.00	21,726,000	貸付有価証券 500株
日本リーテック	13,000	1,908.00	24,804,000	貸付有価証券 6,100株
四電工	3,400	2,268.00	7,711,200	
中電工	25,000	2,108.00	52,700,000	貸付有価証券 100株
関電工	88,200	829.00	73,117,800	
きんでん	147,300	1,637.00	241,130,100	
東京エネシス	20,600	684.00	14,090,400	
トーエネック	6,200	3,205.00	19,871,000	

住友電設	17,500	2,101.00	36,767,500	
日本電設工業	34,000	2,182.00	74,188,000	
協和エクシオ	94,000	2,562.00	240,828,000	
新日本空調	16,400	2,007.00	32,914,800	貸付有価証券 900株
九電工	43,500	2,640.00	114,840,000	
三機工業	44,700	1,186.00	53,014,200	
日揮ホールディングス	190,900	882.00	168,373,800	貸付有価証券 400株
中外炉工業	6,700	1,461.00	9,788,700	
ヤマト	19,800	640.00	12,672,000	貸付有価証券 500株
太平電業	15,000	2,127.00	31,905,000	
高砂熱学工業	53,900	1,627.00	87,695,300	
三晃金属工業	2,700	1,998.00	5,394,600	
朝日工業社	4,200	2,954.00	12,406,800	
明星工業	40,100	680.00	27,268,000	貸付有価証券 600株
大気社	30,100	2,923.00	87,982,300	
ダイダン	14,800	2,635.00	38,998,000	
日比谷総合設備	20,000	1,778.00	35,560,000	
フィル・カンパニー	2,700	2,388.00	6,447,600	貸付有価証券 900株
OSJBホールディングス	97,800	225.00	22,005,000	貸付有価証券 2,700株
レイズネクスト	33,200	1,179.00	39,142,800	貸付有価証券 600株
日本製粉	58,100	1,685.00	97,898,500	貸付有価証券 100株
日清製粉グループ本社	224,200	1,649.00	369,705,800	貸付有価証券 100株
日東富士製粉	1,400	5,700.00	7,980,000	
昭和産業	18,200	3,270.00	59,514,000	貸付有価証券 1,100株
鳥越製粉	17,600	887.00	15,611,200	
中部飼料	24,200	1,565.00	37,873,000	
フィード・ワン	133,300	154.00	20,528,200	
東洋精糖	3,300	1,192.00	3,933,600	
日本甜菜製糖	10,300	1,604.00	16,521,200	

三井製糖	17,400	2,159.00	37,566,600	
塩水港精糖	21,500	195.00	4,192,500	貸付有価証券 9,500株
日新製糖	9,400	1,879.00	17,662,600	
森永製菓	46,600	4,680.00	218,088,000	
中村屋	5,100	3,825.00	19,507,500	
江崎グリコ	58,800	4,840.00	284,592,000	貸付有価証券 4,100株（4,100株）
名糖産業	9,500	1,291.00	12,264,500	
井村屋グループ	8,400	1,922.00	16,144,800	
不二家	11,100	2,078.00	23,065,800	
山崎製パン	148,700	2,338.00	347,660,600	貸付有価証券 19,000株
第一屋製パン	3,400	897.00	3,049,800	
モロゾフ	3,400	5,160.00	17,544,000	
亀田製菓	11,300	5,090.00	57,517,000	
寿スピリッツ	19,100	4,575.00	87,382,500	貸付有価証券 600株
カルビー	90,400	3,270.00	295,608,000	
森永乳業	36,700	4,260.00	156,342,000	
六甲バター	13,200	1,431.00	18,889,200	貸付有価証券 100株
ヤクルト本社	136,500	6,970.00	951,405,000	
明治ホールディングス	131,200	7,600.00	997,120,000	
雪印メグミルク	47,800	2,498.00	119,404,400	
プリマハム	31,000	2,377.00	73,687,000	
日本ハム	75,800	3,405.00	258,099,000	
林兼産業	6,600	539.00	3,557,400	
丸大食品	21,200	1,899.00	40,258,800	
S Foods	15,800	2,230.00	35,234,000	
柿安本店	6,900	2,154.00	14,862,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	127,800	620.00	79,236,000	貸付有価証券 20,400株
サッポロホールディングス	67,700	1,934.00	130,931,800	貸付有価証券 500株
アサヒグループホールディングス	415,600	3,502.00	1,455,431,200	貸付有価証券 50,500株（25,300株）
キリンホールディングス	841,500	2,036.00	1,713,294,000	貸付有価証券 177,300株（51,500

				株)
宝ホールディングス	147,100	755.00	111,060,500	
オエノンホールディングス	52,300	396.00	20,710,800	
養命酒製造	6,100	1,898.00	11,577,800	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	139,300	1,942.00	270,520,600	貸付有価証券 41,800株
サントリー食品インターナショナル	132,800	4,100.00	544,480,000	貸付有価証券 2,900株
ダイドグループホールディングス	10,200	4,020.00	41,004,000	貸付有価証券 4,300株
伊藤園	60,200	6,300.00	379,260,000	貸付有価証券 16,600株(13,300株)
キーコーヒー	19,500	2,236.00	43,602,000	
ユニカフェ	5,100	885.00	4,513,500	
ジャパンフーズ	2,800	1,109.00	3,105,200	
日清オイリオグループ	25,500	3,580.00	91,290,000	
不二製油グループ本社	48,400	2,648.00	128,163,200	貸付有価証券 7,500株
かどや製油	2,200	3,575.00	7,865,000	
J-オイルミルズ	10,300	4,015.00	41,354,500	
キッコーマン	142,800	4,630.00	661,164,000	貸付有価証券 7,800株
味の素	438,200	1,928.00	844,849,600	貸付有価証券 300株
キューピー	110,500	2,138.00	236,249,000	貸付有価証券 5,200株
ハウス食品グループ本社	74,200	3,395.00	251,909,000	貸付有価証券 200株
カゴメ	75,300	2,699.00	203,234,700	貸付有価証券 3,400株
焼津水産化学工業	9,600	887.00	8,515,200	
アリアケジャパン	18,100	6,520.00	118,012,000	
ピエトロ	2,600	1,588.00	4,128,800	
エバラ食品工業	4,800	2,197.00	10,545,600	
やまみ	1,300	1,835.00	2,385,500	
ニチレイ	94,500	2,807.00	265,261,500	貸付有価証券 200株
東洋水産	102,100	5,540.00	565,634,000	
イトアンド	6,900	1,679.00	11,585,100	貸付有価証券

				3,200株
大冷	2,600	1,847.00	4,802,200	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,900	869.00	9,472,100	貸付有価証券 2,000株（100株）
日清食品ホールディングス	84,300	9,070.00	764,601,000	
永谷園ホールディングス	9,700	2,187.00	21,213,900	
一正蒲鉾	7,700	950.00	7,315,000	貸付有価証券 3,500株
フジッコ	21,500	1,990.00	42,785,000	
ロック・フィールド	21,400	1,331.00	28,483,400	貸付有価証券 10,000株
日本たばこ産業	1,145,800	1,956.50	2,241,757,700	貸付有価証券 157,300株（10,800株）
ケンコーマヨネーズ	11,100	1,940.00	21,534,000	貸付有価証券 900株
わらべや日洋ホールディングス	13,000	1,528.00	19,864,000	貸付有価証券 200株
なとり	11,100	1,689.00	18,747,900	貸付有価証券 4,900株
イフジ産業	3,500	760.00	2,660,000	
ピックルスコーポレーション	4,300	2,301.00	9,894,300	
北の達人コーポレーション	69,300	472.00	32,709,600	貸付有価証券 32,500株（8,700株）
ユーグレナ	84,600	617.00	52,198,200	貸付有価証券 19,900株（600株）
ミヨシ油脂	7,600	1,031.00	7,835,600	
理研ビタミン	18,700	2,005.00	37,493,500	
片倉工業	28,100	1,009.00	28,352,900	貸付有価証券 100株
ゲンゼ	14,200	3,630.00	51,546,000	
東洋紡	76,500	1,180.00	90,270,000	貸付有価証券 400株
ユニチカ	56,700	292.00	16,556,400	貸付有価証券 26,600株（8,600株）
富士紡ホールディングス	9,400	2,558.00	24,045,200	
倉敷紡績	19,200	2,543.00	48,825,600	貸付有価証券 900株
シキボウ	10,100	1,081.00	10,918,100	貸付有価証券

				2,300株
日本毛織	63,700	908.00	57,839,600	
ダイトウボウ	31,300	127.00	3,975,100	貸付有価証券 14,700株(13,700株)
トーア紡コーポレーション	7,700	463.00	3,565,100	
ダイドーリミテッド	25,500	191.00	4,870,500	貸付有価証券 11,700株
帝国繊維	21,700	2,074.00	45,005,800	貸付有価証券 200株
帝人	158,000	1,692.00	267,336,000	貸付有価証券 1,900株
東レ	1,402,000	452.20	633,984,400	貸付有価証券 11,000株
サカイオーベックス	5,100	1,997.00	10,184,700	
住江織物	4,200	1,685.00	7,077,000	貸付有価証券 100株(100株)
日本フェルト	11,000	422.00	4,642,000	貸付有価証券 4,800株
イチカワ	2,700	1,264.00	3,412,800	
日東製網	2,200	1,700.00	3,740,000	
アツギ	15,900	613.00	9,746,700	
ダイニック	7,300	705.00	5,146,500	
セーレン	47,600	1,235.00	58,786,000	
ソトー	7,700	898.00	6,914,600	
東海染工	2,700	1,120.00	3,024,000	
小松マテーレ	31,800	713.00	22,673,400	貸付有価証券 200株
ワコールホールディングス	50,500	2,154.00	108,777,000	
ホギメディカル	22,100	3,465.00	76,576,500	
レナウン	49,700	74.00	3,677,800	貸付有価証券 2,000株
クラウドシアホールディングス	4,800	367.00	1,761,600	
T S Iホールディングス	64,900	370.00	24,013,000	貸付有価証券 400株
マツオカコーポレーション	5,500	1,837.00	10,103,500	貸付有価証券 200株
ワールド	27,400	1,210.00	33,154,000	貸付有価証券 1,000株

三陽商会	10,100	838.00	8,463,800	貸付有価証券 600株(400株)
ナイガイ	7,100	417.00	2,960,700	
オンワードホールディングス	116,300	353.00	41,053,900	貸付有価証券 54,600株
ルックホールディングス	6,600	735.00	4,851,000	
ゴールドウイン	35,100	5,470.00	191,997,000	
デサント	37,800	1,306.00	49,366,800	貸付有価証券 1,200株
キング	9,100	466.00	4,240,600	
ヤマトインターナショナル	11,800	337.00	3,976,600	
特種東海製紙	12,300	4,005.00	49,261,500	
王子ホールディングス	809,400	541.00	437,885,400	貸付有価証券 4,600株
日本製紙	85,600	1,498.00	128,228,800	貸付有価証券 2,000株
三菱製紙	22,000	326.00	7,172,000	
北越コーポレーション	128,400	392.00	50,332,800	貸付有価証券 5,700株(5,700株)
中越パルプ工業	8,200	1,338.00	10,971,600	
巴川製紙所	5,700	819.00	4,668,300	
大王製紙	84,900	1,468.00	124,633,200	貸付有価証券 39,900株(21,800株)
阿波製紙	5,000	537.00	2,685,000	貸付有価証券 400株
レンゴー	183,000	795.00	145,485,000	貸付有価証券 1,100株
トーモク	11,900	1,483.00	17,647,700	
ザ・パック	14,700	3,260.00	47,922,000	
クラレ	305,000	1,025.00	312,625,000	貸付有価証券 7,600株
旭化成	1,283,400	691.70	887,727,780	
共和レザー	10,500	618.00	6,489,000	
昭和電工	137,800	2,240.00	308,672,000	貸付有価証券 53,300株(22,700株)
住友化学	1,422,600	300.00	426,780,000	貸付有価証券 36,000株
住友精化	8,600	2,912.00	25,043,200	
日産化学	107,500	3,715.00	399,362,500	貸付有価証券

				100株
ラサ工業	6,800	1,197.00	8,139,600	
クレハ	16,600	4,015.00	66,649,000	
多木化学	5,700	4,805.00	27,388,500	
テイカ	14,200	1,468.00	20,845,600	
石原産業	34,700	543.00	18,842,100	
片倉コープアグリ	5,000	1,158.00	5,790,000	
日本曹達	28,700	2,684.00	77,030,800	
東ソー	299,300	1,267.00	379,213,100	
トクヤマ	55,800	2,112.00	117,849,600	貸付有価証券 100株
セントラル硝子	39,600	1,768.00	70,012,800	
東亜合成	121,500	958.00	116,397,000	貸付有価証券 32,000株
大阪ソーダ	19,700	2,400.00	47,280,000	
関東電化工業	45,900	832.00	38,188,800	貸付有価証券 400株
デンカ	70,700	2,488.00	175,901,600	貸付有価証券 7,000株（900株）
信越化学工業	332,500	11,305.00	3,758,912,500	貸付有価証券 300株
日本カーバイド工業	6,600	952.00	6,283,200	
堺化学工業	12,500	1,655.00	20,687,500	
第一稀元素化学工業	21,000	698.00	14,658,000	貸付有価証券 100株
エア・ウォーター	180,100	1,490.00	268,349,000	
大陽日酸	186,100	1,574.00	292,921,400	
日本化学工業	6,000	2,073.00	12,438,000	
東邦アセチレン	2,900	1,179.00	3,419,100	
日本パーカライジング	97,700	1,104.00	107,860,800	
高压ガス工業	30,700	682.00	20,937,400	
チタン工業	2,400	1,597.00	3,832,800	貸付有価証券 700株
四国化成工業	29,900	1,021.00	30,527,900	
戸田工業	4,500	1,219.00	5,485,500	貸付有価証券 1,300株
ステラ ケミファ	10,500	2,252.00	23,646,000	
保土谷化学工業	7,200	3,190.00	22,968,000	
日本触媒	30,100	4,920.00	148,092,000	貸付有価証券



				5,600株(1,300株)
大日精化工業	17,100	2,157.00	36,884,700	
カネカ	50,100	2,708.00	135,670,800	貸付有価証券 400株
三菱瓦斯化学	180,100	1,228.00	221,162,800	
三井化学	175,800	1,904.00	334,723,200	
J S R	180,400	1,887.00	340,414,800	
東京応化工業	33,200	4,330.00	143,756,000	貸付有価証券 700株
大阪有機化学工業	17,900	1,563.00	27,977,700	貸付有価証券 100株
三菱ケミカルホールディングス	1,294,400	593.20	767,838,080	貸付有価証券 26,800株
K H ネオケム	34,100	1,595.00	54,389,500	貸付有価証券 15,400株
ダイセル	264,900	801.00	212,184,900	貸付有価証券 16,000株
住友ベークライト	30,400	2,403.00	73,051,200	
積水化学工業	416,400	1,302.00	542,152,800	貸付有価証券 4,000株
日本ゼオン	174,600	806.00	140,727,600	
アイカ工業	58,100	3,005.00	174,590,500	
宇部興産	97,800	1,693.00	165,575,400	貸付有価証券 1,100株
積水樹脂	34,900	1,951.00	68,089,900	
タキロンシーアイ	41,900	567.00	23,757,300	
旭有機材	10,900	1,215.00	13,243,500	
日立化成	89,500	4,605.00	412,147,500	貸付有価証券 7,900株
ニチバン	10,200	1,403.00	14,310,600	貸付有価証券 100株
リケンテクノス	48,700	419.00	20,405,300	
大倉工業	9,100	1,464.00	13,322,400	貸付有価証券 4,200株
積水化成成品工業	26,000	560.00	14,560,000	
群栄化学工業	4,400	2,488.00	10,947,200	
タイガースポリマー	10,200	466.00	4,753,200	
ミライアル	6,800	1,035.00	7,038,000	
ダイキアクシス	6,900	795.00	5,485,500	
ダイキョーニシカワ	40,800	492.00	20,073,600	

竹本容器	6,900	682.00	4,705,800	貸付有価証券 900株(200株)
森六ホールディングス	10,400	1,344.00	13,977,600	
日本化薬	119,900	955.00	114,504,500	貸付有価証券 900株
カーリットホールディングス	20,700	485.00	10,039,500	貸付有価証券 9,200株
日本精化	15,600	1,544.00	24,086,400	
扶桑化学工業	19,600	3,105.00	60,858,000	貸付有価証券 4,500株
トリケミカル研究所	4,300	9,560.00	41,108,000	貸付有価証券 200株(100株)
A D E K A	89,100	1,275.00	113,602,500	
日油	72,900	3,605.00	262,804,500	
新日本理化	32,000	165.00	5,280,000	貸付有価証券 200株
ハリマ化成グループ	16,000	915.00	14,640,000	貸付有価証券 100株
花王	473,400	8,844.00	4,186,749,600	貸付有価証券 27,600株
第一工業製薬	7,200	4,305.00	30,996,000	
石原ケミカル	5,300	1,818.00	9,635,400	貸付有価証券 100株(100株)
日華化学	6,500	823.00	5,349,500	
ニイタカ	3,000	2,485.00	7,455,000	貸付有価証券 1,400株
三洋化成工業	11,600	4,005.00	46,458,000	
有機合成薬品工業	14,800	285.00	4,218,000	貸付有価証券 3,600株
大日本塗料	21,900	824.00	18,045,600	貸付有価証券 9,900株
日本ペイントホールディングス	159,800	6,150.00	982,770,000	貸付有価証券 19,200株(3,600株)
関西ペイント	217,500	2,019.00	439,132,500	
神東塗料	15,200	159.00	2,416,800	貸付有価証券 100株(100株)
中国塗料	55,100	806.00	44,410,600	
日本特殊塗料	14,500	796.00	11,542,000	
藤倉化成	26,100	454.00	11,849,400	
太陽ホールディングス	14,200	4,000.00	56,800,000	

D I C	81,800	2,337.00	191,166,600	
サカタインクス	42,300	845.00	35,743,500	
東洋インキ S C ホールディングス	40,900	1,989.00	81,350,100	
T & K T O K A	15,000	720.00	10,800,000	
富士フイルムホールディングス	379,100	5,099.00	1,933,030,900	貸付有価証券 3,600株
資生堂	392,800	6,574.00	2,582,267,200	貸付有価証券 40,600株
ライオン	257,000	2,416.00	620,912,000	貸付有価証券 100株
高砂香料工業	12,400	1,945.00	24,118,000	
マンダム	44,400	2,074.00	92,085,600	
ミルボン	26,400	5,040.00	133,056,000	貸付有価証券 12,100株
ファンケル	80,000	2,559.00	204,720,000	貸付有価証券 37,600株
コーセー	37,200	13,970.00	519,684,000	貸付有価証券 9,700株
コタ	11,400	1,208.00	13,771,200	
シーボン	2,600	2,082.00	5,413,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	84,400	2,084.00	175,889,600	貸付有価証券 16,600株（16,600株）
ノエビアホールディングス	18,900	5,120.00	96,768,000	
アジュバンコスメジャパン	4,400	925.00	4,070,000	貸付有価証券 100株（100株）
エステー	12,700	1,479.00	18,783,300	
アグロ カネショウ	6,200	1,618.00	10,031,600	貸付有価証券 100株
コニシ	32,500	1,386.00	45,045,000	
長谷川香料	26,200	2,191.00	57,404,200	
星光 P M C	11,300	613.00	6,926,900	
小林製薬	55,400	11,040.00	611,616,000	貸付有価証券 6,800株（3,000株）
荒川化学工業	17,700	1,188.00	21,027,600	
メック	13,600	1,541.00	20,957,600	貸付有価証券 2,000株
日本高純度化学	5,400	2,428.00	13,111,200	
タカラバイオ	51,700	2,450.00	126,665,000	貸付有価証券

				700株(700株)
J C U	23,900	2,300.00	54,970,000	
新田ゼラチン	12,400	672.00	8,332,800	
O A T アグリオ	3,400	1,122.00	3,814,800	
デクセリアルズ	51,000	661.00	33,711,000	
アース製薬	14,900	6,150.00	91,635,000	貸付有価証券 1,300株
北興化学工業	20,200	558.00	11,271,600	
大成ラミック	6,500	2,574.00	16,731,000	
クミアイ化学工業	81,800	839.00	68,630,200	貸付有価証券 2,600株
日本農薬	35,200	408.00	14,361,600	
アキレス	13,600	1,528.00	20,780,800	貸付有価証券 300株
有沢製作所	31,300	768.00	24,038,400	貸付有価証券 800株
日東電工	136,400	4,860.00	662,904,000	貸付有価証券 100株
レック	21,100	1,164.00	24,560,400	貸付有価証券 1,100株
三光合成	22,600	255.00	5,763,000	
きもと	33,600	133.00	4,468,800	
藤森工業	17,700	2,947.00	52,161,900	
前澤化成工業	12,600	1,002.00	12,625,200	
未来工業	10,600	1,919.00	20,341,400	
ウェーブロックホール ディングス	6,800	788.00	5,358,400	貸付有価証券 1,200株
J S P	11,600	1,308.00	15,172,800	貸付有価証券 5,100株
エフピコ	21,700	8,150.00	176,855,000	
天馬	13,200	1,440.00	19,008,000	
信越ポリマー	35,500	792.00	28,116,000	
東リ	49,200	252.00	12,398,400	
ニフコ	72,600	1,840.00	133,584,000	貸付有価証券 300株
バルカー	16,100	1,762.00	28,368,200	
ユニ・チャーム	381,100	4,031.00	1,536,214,100	貸付有価証券 164,500株
ショーエイコーポレー	2,200	671.00	1,476,200	

シオン				
協和キリン	198,900	2,418.00	480,940,200	貸付有価証券 22,500株
武田薬品工業	1,644,900	3,674.00	6,043,362,600	貸付有価証券 3,000株
アステラス製薬	1,714,200	1,756.00	3,010,135,200	貸付有価証券 300株
大日本住友製薬	146,500	1,391.00	203,781,500	貸付有価証券 1,500株
塩野義製薬	252,800	5,529.00	1,397,731,200	貸付有価証券 200株
わかもと製薬	23,500	228.00	5,358,000	
あすか製薬	22,500	1,097.00	24,682,500	
日本新薬	51,700	7,810.00	403,777,000	貸付有価証券 3,100株
ピオフェルミン製薬	3,400	2,255.00	7,667,000	
中外製薬	206,100	13,280.00	2,737,008,000	貸付有価証券 14,700株（4,100株）
科研製薬	33,800	5,830.00	197,054,000	
エーザイ	236,600	7,767.00	1,837,672,200	貸付有価証券 1,500株
ロート製薬	101,500	3,210.00	325,815,000	
小野薬品工業	454,000	2,575.00	1,169,050,000	貸付有価証券 1,700株
久光製薬	52,300	4,935.00	258,100,500	
持田製薬	27,400	4,005.00	109,737,000	
参天製薬	368,300	1,922.00	707,872,600	
扶桑薬品工業	7,000	2,210.00	15,470,000	
日本ケミファ	2,600	2,300.00	5,980,000	
ツムラ	61,300	2,897.00	177,586,100	貸付有価証券 400株
日医工	56,000	1,344.00	75,264,000	貸付有価証券 26,000株（26,000株）
キッセイ薬品工業	35,000	2,533.00	88,655,000	
生化学工業	38,400	1,070.00	41,088,000	
栄研化学	34,700	1,976.00	68,567,200	貸付有価証券 1,400株
日水製薬	8,300	1,245.00	10,333,500	
鳥居薬品	12,400	2,961.00	36,716,400	貸付有価証券 100株

J C R ファーマ	13,900	10,460.00	145,394,000	
東和薬品	25,300	2,128.00	53,838,400	貸付有価証券 500株
富士製薬工業	13,400	1,147.00	15,369,800	
沢井製薬	40,600	5,740.00	233,044,000	
ゼリア新薬工業	35,900	2,077.00	74,564,300	
第一三共	565,800	7,511.00	4,249,723,800	
キョーリン製薬ホールディングス	43,600	2,291.00	99,887,600	貸付有価証券 1,600株
大幸薬品	24,100	1,872.00	45,115,200	貸付有価証券 8,500株（4,500株）
ダイト	11,800	3,480.00	41,064,000	
大塚ホールディングス	376,700	4,258.00	1,603,988,600	貸付有価証券 20,900株
大正製薬ホールディングス	41,800	6,600.00	275,880,000	
ペプチドリーム	100,500	3,875.00	389,437,500	貸付有価証券 7,300株
日本コークス工業	167,000	58.00	9,686,000	貸付有価証券 200株
ニチレキ	23,300	1,337.00	31,152,100	
ユシロ化学工業	11,100	1,084.00	12,032,400	
ビーピー・カストロール	7,100	1,072.00	7,611,200	
富士石油	52,800	175.00	9,240,000	
MORESCO	7,100	840.00	5,964,000	
出光興産	222,400	2,255.00	501,512,000	貸付有価証券 7,600株
J X T Gホールディングス	2,974,200	361.30	1,074,578,460	貸付有価証券 2,600株
コスモエネルギーホールディングス	57,200	1,422.00	81,338,400	
横浜ゴム	114,500	1,274.00	145,873,000	貸付有価証券 600株
TOYO TIRE	113,500	1,109.00	125,871,500	貸付有価証券 14,400株
ブリヂストン	569,500	3,190.00	1,816,705,000	貸付有価証券 148,700株（28,700株）
住友ゴム工業	177,600	964.00	171,206,400	貸付有価証券 9,600株
藤倉コンポジット	17,300	342.00	5,916,600	貸付有価証券

				100株(100株)
オカモト	12,000	4,325.00	51,900,000	
フコク	8,600	561.00	4,824,600	貸付有価証券 1,300株
ニッタ	22,300	1,857.00	41,411,100	
住友理工	38,300	525.00	20,107,500	
三ツ星ベルト	26,000	1,406.00	36,556,000	
バンドー化学	34,800	588.00	20,462,400	
日東紡績	29,400	5,060.00	148,764,000	貸付有価証券 1,700株
A G C	195,500	2,411.00	471,350,500	貸付有価証券 44,200株
日本板硝子	94,600	297.00	28,096,200	貸付有価証券 13,600株
石塚硝子	3,600	2,094.00	7,538,400	
日本山村硝子	8,200	808.00	6,625,600	
日本電気硝子	79,400	1,341.00	106,475,400	
オハラ	7,800	860.00	6,708,000	貸付有価証券 3,600株(2,000株)
住友大阪セメント	37,400	3,385.00	126,599,000	
太平洋セメント	124,900	1,992.00	248,800,800	
日本ヒューム	19,800	566.00	11,206,800	貸付有価証券 200株
日本コンクリート工業	42,600	234.00	9,968,400	貸付有価証券 600株
三谷セキサン	9,200	4,405.00	40,526,000	
アジアパイルホールディングス	28,100	397.00	11,155,700	
東海カーボン	207,100	867.00	179,555,700	貸付有価証券 82,300株(6,000株)
日本カーボン	10,200	3,235.00	32,997,000	貸付有価証券 4,200株
東洋炭素	11,600	1,352.00	15,683,200	
ノリタケカンパニーリミテド	10,900	3,295.00	35,915,500	
T O T O	141,200	3,455.00	487,846,000	貸付有価証券 1,000株
日本碍子	241,300	1,257.00	303,314,100	貸付有価証券 100株
日本特殊陶業	153,900	1,474.00	226,848,600	貸付有価証券

				8,400株
ダントーホールディングス	14,700	76.00	1,117,200	貸付有価証券 1,100株(300株)
MARUWA	7,600	6,420.00	48,792,000	
品川リフラクトリーズ	5,200	2,073.00	10,779,600	
黒崎播磨	3,900	3,705.00	14,449,500	
ヨータイ	15,700	604.00	9,482,800	
イソライト工業	10,100	391.00	3,949,100	
東京窯業	25,100	271.00	6,802,100	
ニッカトー	8,900	517.00	4,601,300	貸付有価証券 2,100株
フジミインコーポレーテッド	17,600	2,864.00	50,406,400	貸付有価証券 300株
クニミネ工業	8,000	954.00	7,632,000	
エーアンドエーマテリアル	3,300	1,024.00	3,379,200	
ニチアス	54,100	1,931.00	104,467,100	貸付有価証券 300株
ニチハ	27,500	1,897.00	52,167,500	貸付有価証券 200株
日本製鉄	875,000	807.00	706,125,000	貸付有価証券 12,700株
神戸製鋼所	357,800	326.00	116,642,800	貸付有価証券 80,000株
中山製鋼所	27,100	363.00	9,837,300	
合同製鐵	10,500	1,854.00	19,467,000	貸付有価証券 400株
ジェイ エフ イー ホールディングス	528,000	654.00	345,312,000	貸付有価証券 241,000株(165,800 株)
東京製鐵	95,200	672.00	63,974,400	
共英製鋼	22,000	1,326.00	29,172,000	貸付有価証券 9,800株
大和工業	41,500	2,009.00	83,373,500	
東京鐵鋼	8,000	1,021.00	8,168,000	貸付有価証券 3,600株
大阪製鐵	10,400	1,081.00	11,242,400	
淀川製鋼所	26,400	1,616.00	42,662,400	
丸一鋼管	63,500	2,466.00	156,591,000	
モリ工業	5,900	2,157.00	12,726,300	



大同特殊鋼	32,000	3,195.00	102,240,000	貸付有価証券 800株
日本高周波鋼業	7,200	352.00	2,534,400	
日本冶金工業	16,200	1,517.00	24,575,400	貸付有価証券 2,600株
山陽特殊製鋼	13,400	827.00	11,081,800	貸付有価証券 1,600株
愛知製鋼	11,000	2,584.00	28,424,000	
日立金属	210,600	1,017.00	214,180,200	
日本金属	4,500	580.00	2,610,000	
大太平洋金属	13,200	1,670.00	22,044,000	貸付有価証券 100株（100株）
新日本電工	126,000	141.00	17,766,000	貸付有価証券 32,900株
栗本鐵工所	9,600	1,654.00	15,878,400	貸付有価証券 200株
虹技	2,900	982.00	2,847,800	
日本鑄鉄管	2,000	1,295.00	2,590,000	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
三菱製鋼	14,500	764.00	11,078,000	
日亜鋼業	28,600	249.00	7,121,400	貸付有価証券 100株
日本精線	3,200	2,828.00	9,049,600	
エンビプロ・ホールディングス	8,300	515.00	4,274,500	貸付有価証券 200株
シンニッタン	30,400	235.00	7,144,000	
新家工業	4,500	992.00	4,464,000	
大紀アルミニウム工業所	32,100	534.00	17,141,400	
日本軽金属ホールディングス	494,700	161.00	79,646,700	貸付有価証券 13,300株
三井金属鉱業	52,800	1,830.00	96,624,000	貸付有価証券 400株
東邦亜鉛	10,000	1,187.00	11,870,000	貸付有価証券 100株
三菱マテリアル	129,100	2,031.00	262,202,100	貸付有価証券 2,400株
住友金属鉱山	249,900	2,372.50	592,887,750	貸付有価証券 400株
DOWAホールディングス	49,500	2,758.00	136,521,000	貸付有価証券 200株
古河機械金属	34,800	1,033.00	35,948,400	

大阪チタニウムテクノロ ジーズ	20,300	862.00	17,498,600	貸付有価証券 5,400株（2,400株）
東邦チタニウム	35,000	574.00	20,090,000	
U A C J	29,700	1,571.00	46,658,700	
C Kサンエツ	4,100	2,756.00	11,299,600	
古河電気工業	60,700	1,853.00	112,477,100	貸付有価証券 1,300株
住友電気工業	731,000	1,032.50	754,757,500	貸付有価証券 20,200株
フジクラ	236,100	264.00	62,330,400	貸付有価証券 4,000株
昭和電線ホールディング ス	22,700	967.00	21,950,900	
東京特殊電線	2,900	2,263.00	6,562,700	
タツタ電線	38,800	487.00	18,895,600	
カナレ電気	3,200	1,585.00	5,072,000	
平河ヒューテック	7,300	955.00	6,971,500	貸付有価証券 400株
リヨービ	24,000	1,162.00	27,888,000	
アーレスティ	25,600	337.00	8,627,200	
アサヒホールディングス	34,200	2,266.00	77,497,200	
稲葉製作所	11,000	1,239.00	13,629,000	貸付有価証券 200株
宮地エンジニアリンググ ループ	5,900	1,466.00	8,649,400	貸付有価証券 400株
トーカロ	54,300	1,004.00	54,517,200	
アルファC o	6,900	924.00	6,375,600	貸付有価証券 100株
S U M C O	234,000	1,446.00	338,364,000	貸付有価証券 91,000株（91,000株）
川田テクノロジーズ	4,000	4,990.00	19,960,000	
R S Technolo gies	5,500	2,555.00	14,052,500	貸付有価証券 500株
信和	8,400	679.00	5,703,600	
東洋製罐グループホール ディングス	124,500	991.00	123,379,500	貸付有価証券 1,000株
ホッカンホールディング ス	10,700	1,477.00	15,803,900	
コロナ	10,800	885.00	9,558,000	
横河ブリッジホールディ	36,400	1,824.00	66,393,600	

ングス				
駒井ハルテック	3,700	1,445.00	5,346,500	
高田機工	1,800	2,122.00	3,819,600	
三和ホールディングス	184,300	747.00	137,672,100	
文化シャッター	57,600	750.00	43,200,000	
三協立山	25,200	793.00	19,983,600	
アルインコ	14,200	945.00	13,419,000	貸付有価証券 100株
東洋シャッター	4,700	677.00	3,181,900	
L I X I Lグループ	288,500	1,158.00	334,083,000	貸付有価証券 2,000株
日本ファイルコン	15,000	505.00	7,575,000	
ノーリツ	40,500	1,071.00	43,375,500	貸付有価証券 19,000株
長府製作所	19,900	2,111.00	42,008,900	
リンナイ	38,000	8,030.00	305,140,000	
ダイニチ工業	10,500	613.00	6,436,500	
日東精工	27,000	452.00	12,204,000	貸付有価証券 12,600株
三洋工業	2,600	1,718.00	4,466,800	
岡部	39,600	714.00	28,274,400	
ジーテクト	24,300	1,014.00	24,640,200	
東プレ	36,500	1,150.00	41,975,000	
高周波熱錬	37,600	583.00	21,920,800	貸付有価証券 16,700株
東京製綱	14,000	523.00	7,322,000	
サンコール	11,000	387.00	4,257,000	
モリテック スチール	15,200	273.00	4,149,600	
パイオラックス	28,900	1,530.00	44,217,000	
エイチワン	19,200	464.00	8,908,800	
日本発條	209,700	669.00	140,289,300	
中央発條	2,400	2,628.00	6,307,200	
アドバネクス	2,800	1,323.00	3,704,400	
立川ブラインド工業	8,600	1,029.00	8,849,400	貸付有価証券 3,900株
三益半導体工業	15,300	2,041.00	31,227,300	貸付有価証券 100株
日本ドライケミカル	4,800	1,329.00	6,379,200	

日本製鋼所	59,300	1,198.00	71,041,400	貸付有価証券 600株
三浦工業	84,600	4,235.00	358,281,000	貸付有価証券 100株
タクマ	66,200	1,215.00	80,433,000	
ツガミ	40,500	842.00	34,101,000	貸付有価証券 600株
オークマ	22,800	3,350.00	76,380,000	
芝浦機械	22,100	2,002.00	44,244,200	貸付有価証券 1,100株
アマダ	248,600	868.00	215,784,800	
アイダエンジニアリング	51,200	710.00	36,352,000	
滝澤鉄工所	6,100	1,032.00	6,295,200	
F U J I	84,100	1,640.00	137,924,000	貸付有価証券 4,400株（4,400株）
牧野フライス製作所	22,900	2,719.00	62,265,100	
オーエスジー	90,400	1,209.00	109,293,600	貸付有価証券 800株
ダイジェット工業	2,200	1,236.00	2,719,200	
旭ダイヤモンド工業	51,300	457.00	23,444,100	
D M G 森精機	123,700	908.00	112,319,600	貸付有価証券 58,100株（500株）
ソディック	45,900	679.00	31,166,100	貸付有価証券 1,400株
ディスコ	26,500	24,650.00	653,225,000	
日東工器	10,700	1,774.00	18,981,800	
日進工具	5,800	2,638.00	15,300,400	貸付有価証券 500株
パンチ工業	17,700	315.00	5,575,500	
富士ダイス	8,600	574.00	4,936,400	
豊和工業	10,800	654.00	7,063,200	貸付有価証券 300株
O K K	8,000	438.00	3,504,000	
東洋機械金属	14,000	417.00	5,838,000	
津田駒工業	3,800	795.00	3,021,000	貸付有価証券 200株
エンシュウ	4,700	903.00	4,244,100	貸付有価証券 200株
島精機製作所	30,800	1,473.00	45,368,400	
オプトラン	21,800	2,851.00	62,151,800	貸付有価証券

				100株
NCホールディングス	5,900	500.00	2,950,000	
イワキポンプ	9,300	898.00	8,351,400	
フリー	19,100	814.00	15,547,400	貸付有価証券 100株
ヤマシンフィルタ	42,500	825.00	35,062,500	貸付有価証券 12,100株(7,500株)
日阪製作所	24,100	708.00	17,062,800	
やまびこ	37,900	770.00	29,183,000	貸付有価証券 200株
平田機工	9,200	4,645.00	42,734,000	
ペガサスマシン製造	19,800	297.00	5,880,600	貸付有価証券 300株(100株)
マルマエ	8,000	861.00	6,888,000	貸付有価証券 2,600株(2,100株)
タツモ	9,100	1,090.00	9,919,000	貸付有価証券 2,600株(2,600株)
ナブテスコ	115,200	2,734.00	314,956,800	貸付有価証券 7,600株
三井海洋開発	20,800	1,315.00	27,352,000	
レオン自動機	19,200	1,166.00	22,387,200	貸付有価証券 1,500株(100株)
S M C	62,000	48,400.00	3,000,800,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディング	17,000	748.00	12,716,000	貸付有価証券 6,900株
ホソカワミクロン	6,900	4,885.00	33,706,500	貸付有価証券 200株
ユニオンツール	7,300	2,650.00	19,345,000	
オイレス工業	25,300	1,339.00	33,876,700	貸付有価証券 11,300株
日精エー・エス・ビー機械	6,600	2,815.00	18,579,000	貸付有価証券 100株
サトーホールディングス	27,900	2,012.00	56,134,800	
技研製作所	17,200	3,935.00	67,682,000	
日本エアテック	6,200	1,268.00	7,861,600	貸付有価証券 2,900株(2,100株)
カワタ	5,800	637.00	3,694,600	
日精樹脂工業	16,400	971.00	15,924,400	
オカダアイヨン	6,200	789.00	4,891,800	貸付有価証券 500株

ワイエイシイホールディングス	8,400	387.00	3,250,800	貸付有価証券 2,200株
小松製作所	895,500	1,883.50	1,686,674,250	貸付有価証券 3,200株
住友重機械工業	113,200	2,055.00	232,626,000	貸付有価証券 500株
日立建機	79,200	2,417.00	191,426,400	貸付有価証券 1,300株
日工	27,000	556.00	15,012,000	
巴工業	8,400	1,950.00	16,380,000	
井関農機	19,800	1,139.00	22,552,200	貸付有価証券 9,200株
TOWA	20,000	845.00	16,900,000	
丸山製作所	4,300	1,085.00	4,665,500	
北川鉄工所	8,900	1,504.00	13,385,600	
ローツェ	8,700	4,430.00	38,541,000	貸付有価証券 1,900株(1,900株)
タカキタ	6,900	516.00	3,560,400	
クボタ	1,048,900	1,238.00	1,298,538,200	貸付有価証券 179,200株(50,900株)
荏原実業	4,900	2,114.00	10,358,600	
三菱化工機	6,800	1,613.00	10,968,400	貸付有価証券 100株
月島機械	36,400	1,170.00	42,588,000	
帝国電機製作所	16,300	1,239.00	20,195,700	
東京機械製作所	8,000	234.00	1,872,000	
新東工業	46,900	699.00	32,783,100	
澁谷工業	17,300	2,547.00	44,063,100	貸付有価証券 8,100株
アイチ コーポレーション	34,100	653.00	22,267,300	
小森コーポレーション	50,100	714.00	35,771,400	
鶴見製作所	15,400	1,858.00	28,613,200	
住友精密工業	2,900	2,088.00	6,055,200	
日本ギア工業	5,900	232.00	1,368,800	
酒井重工業	3,700	2,041.00	7,551,700	
荏原製作所	81,800	2,150.00	175,870,000	貸付有価証券 1,400株
石井鐵工所	2,600	2,381.00	6,190,600	

西島製作所	19,900	746.00	14,845,400	
北越工業	20,400	976.00	19,910,400	貸付有価証券 100株
ダイキン工業	251,900	13,270.00	3,342,713,000	貸付有価証券 3,000株
オルガノ	7,100	5,310.00	37,701,000	
トーヨーカネツ	8,600	1,960.00	16,856,000	
栗田工業	107,000	2,711.00	290,077,000	貸付有価証券 300株
椿本チエイン	28,200	2,320.00	65,424,000	
大同工業	9,400	580.00	5,452,000	
木村化工機	16,400	417.00	6,838,800	貸付有価証券 800株
アネスト岩田	30,700	863.00	26,494,100	
ダイフク	101,000	7,130.00	720,130,000	貸付有価証券 8,700株（3,700株）
サムコ	5,400	1,695.00	9,153,000	貸付有価証券 2,400株（1,100株）
加藤製作所	10,800	1,182.00	12,765,600	貸付有価証券 100株
油研工業	3,300	1,268.00	4,184,400	
タダノ	95,400	758.00	72,313,200	貸付有価証券 40,900株（2,200株）
フジテック	71,900	1,479.00	106,340,100	貸付有価証券 15,300株（15,300株）
C K D	55,000	1,706.00	93,830,000	
キトー	14,900	961.00	14,318,900	
平和	55,100	1,755.00	96,700,500	貸付有価証券 25,000株
理想科学工業	17,500	1,404.00	24,570,000	
SANKYO	44,000	2,940.00	129,360,000	貸付有価証券 700株
日本金銭機械	21,800	516.00	11,248,800	貸付有価証券 900株（900株）
マースグループホールディングス	12,600	1,654.00	20,840,400	
フクシマガリレイ	12,200	3,270.00	39,894,000	
オーイズミ	8,300	339.00	2,813,700	
ダイコク電機	9,100	1,110.00	10,101,000	
竹内製作所	33,100	1,437.00	47,564,700	貸付有価証券

				1,200株
アマノ	51,800	2,382.00	123,387,600	貸付有価証券 200株
J U K I	27,500	543.00	14,932,500	
サンデンホールディング ス	25,800	305.00	7,869,000	貸付有価証券 5,700株(1,500株)
蛇の目マシン工業	18,000	398.00	7,164,000	貸付有価証券 300株
マックス	30,200	1,493.00	45,088,600	
グローリー	50,800	2,273.00	115,468,400	
新晃工業	18,400	1,380.00	25,392,000	貸付有価証券 500株
大和冷機工業	28,600	885.00	25,311,000	貸付有価証券 13,400株
セガサミーホールディン グス	196,100	1,275.00	250,027,500	
日本ピストンリング	7,200	1,141.00	8,215,200	
リケン	9,200	2,753.00	25,327,600	
T P R	26,600	1,172.00	31,175,200	
ツバキ・ナカシマ	40,300	635.00	25,590,500	貸付有価証券 18,900株
ホシザキ	57,800	7,880.00	455,464,000	貸付有価証券 8,600株
大豊工業	16,100	511.00	8,227,100	
日本精工	372,200	653.00	243,046,600	貸付有価証券 1,300株
N T N	457,600	175.00	80,080,000	貸付有価証券 19,800株
ジェイテクト	189,600	704.00	133,478,400	貸付有価証券 1,100株
不二越	18,400	2,696.00	49,606,400	
日本トムソン	58,700	346.00	20,310,200	
T H K	115,000	2,351.00	270,365,000	貸付有価証券 47,000株
ユーシン精機	15,300	624.00	9,547,200	
前澤給装工業	7,200	1,960.00	14,112,000	
イーグル工業	24,400	621.00	15,152,400	
前澤工業	13,200	316.00	4,171,200	
日本ピラー工業	20,000	1,236.00	24,720,000	
キッツ	80,100	633.00	50,703,300	貸付有価証券



				100株
マキタ	257,800	3,220.00	830,116,000	貸付有価証券 2,100株
日立造船	156,700	330.00	51,711,000	
三菱重工業	331,300	2,571.00	851,772,300	
I H I	142,400	1,194.00	170,025,600	貸付有価証券 800株
スター精密	30,400	1,036.00	31,494,400	貸付有価証券 9,000株(5,700株)
日清紡ホールディングス	131,800	651.00	85,801,800	貸付有価証券 1,600株
イビデン	121,000	2,336.00	282,656,000	貸付有価証券 2,900株
コニカミノルタ	432,000	378.00	163,296,000	貸付有価証券 7,400株
ブラザー工業	241,400	1,683.00	406,276,200	貸付有価証券 1,000株
ミネベアミツミ	367,000	1,565.00	574,355,000	貸付有価証券 100株
日立製作所	950,000	2,890.00	2,745,500,000	
三菱電機	1,977,000	1,260.00	2,491,020,000	貸付有価証券 30,200株
富士電機	119,100	2,378.00	283,219,800	
東洋電機製造	7,200	1,198.00	8,625,600	
安川電機	212,800	3,170.00	674,576,000	貸付有価証券 97,000株(24,900株)
シンフォニアテクノロジー	25,600	868.00	22,220,800	
明電舎	36,300	1,533.00	55,647,900	
オリジン	5,300	1,389.00	7,361,700	
山洋電気	9,600	4,325.00	41,520,000	
デンヨー	16,800	1,869.00	31,399,200	
東芝テック	24,800	3,460.00	85,808,000	
芝浦メカトロニクス	3,500	2,470.00	8,645,000	
マブチモーター	54,700	3,135.00	171,484,500	貸付有価証券 600株
日本電産	475,800	5,335.00	2,538,393,000	貸付有価証券 100株
ユー・エム・シー・エレ クトロニクス	11,800	211.00	2,489,800	

トレックス・セミコンダクター	11,300	997.00	11,266,100	
東光高岳	11,000	869.00	9,559,000	
ダブル・スコープ	31,300	304.00	9,515,200	貸付有価証券 9,100株(100株)
ダイヘン	21,600	2,824.00	60,998,400	
ヤーマン	32,200	695.00	22,379,000	貸付有価証券 15,100株(500株)
JVCケンウッド	161,100	170.00	27,387,000	
ミマキエンジニアリング	17,700	380.00	6,726,000	
第一精工	8,000	2,044.00	16,352,000	貸付有価証券 3,700株
日新電機	46,300	935.00	43,290,500	
大崎電気工業	39,300	461.00	18,117,300	貸付有価証券 400株
オムロン	177,200	5,720.00	1,013,584,000	
日東工業	29,000	1,722.00	49,938,000	
I D E C	28,600	1,415.00	40,469,000	
正興電機製作所	4,600	932.00	4,287,200	
不二電機工業	2,500	1,223.00	3,057,500	
ジーエス・ユアサコーポレーション	66,000	1,338.00	88,308,000	貸付有価証券 500株
サクサホールディングス	4,600	1,645.00	7,567,000	
メルコホールディングス	6,800	2,581.00	17,550,800	
テクノメディカ	4,400	1,811.00	7,968,400	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	3,200	474.00	1,516,800	貸付有価証券 200株
日本電気	239,800	4,010.00	961,598,000	
富士通	190,600	10,380.00	1,978,428,000	貸付有価証券 800株
沖電気工業	80,300	934.00	75,000,200	貸付有価証券 11,900株
岩崎通信機	8,700	818.00	7,116,600	
電気興業	9,500	2,335.00	22,182,500	
サンケン電気	21,600	2,024.00	43,718,400	
ナカヨ	3,800	1,356.00	5,152,800	
アイホン	11,200	1,540.00	17,248,000	
ルネサスエレクトロニクス	945,200	450.00	425,340,000	貸付有価証券 37,800株

セイコーエプソン	245,300	1,006.00	246,771,800	貸付有価証券 1,400株
ワコム	132,900	348.00	46,249,200	貸付有価証券 100株
アルバック	36,400	2,757.00	100,354,800	貸付有価証券 1,800株
アクセル	8,200	688.00	5,641,600	
E I Z O	15,300	3,120.00	47,736,000	
日本信号	50,300	965.00	48,539,500	
京三製作所	46,300	450.00	20,835,000	貸付有価証券 20,000株
能美防災	26,100	1,964.00	51,260,400	
ホーチキ	14,300	1,288.00	18,418,400	
星和電機	9,800	599.00	5,870,200	貸付有価証券 200株
エレコム	21,900	4,380.00	95,922,000	
パナソニック	2,258,800	739.50	1,670,382,600	貸付有価証券 200株
シャープ	228,800	1,109.00	253,739,200	貸付有価証券 93,100株（5,700株）
アンリツ	127,300	2,112.00	268,857,600	貸付有価証券 60,700株（2,300株）
富士通ゼネラル	53,700	1,637.00	87,906,900	貸付有価証券 9,400株
ソニー	1,250,900	6,743.00	8,434,818,700	貸付有価証券 200株
T D K	95,500	8,340.00	796,470,000	貸付有価証券 500株
帝国通信工業	8,700	1,135.00	9,874,500	
タムラ製作所	66,000	382.00	25,212,000	
アルプスアルパイン	175,000	945.00	165,375,000	貸付有価証券 1,800株
池上通信機	6,300	767.00	4,832,100	
日本電波工業	17,800	393.00	6,995,400	貸付有価証券 300株
鈴木	9,700	691.00	6,702,700	
日本トリム	2,700	2,771.00	7,481,700	貸付有価証券 300株
ローランド ディー . ジー .	10,900	1,232.00	13,428,800	
フォスター電機	20,700	1,083.00	22,418,100	

S M K	5,100	2,328.00	11,872,800	
ヨコオ	12,800	2,291.00	29,324,800	
ティアック	14,200	144.00	2,044,800	貸付有価証券 100株
ホシデン	54,000	865.00	46,710,000	
ヒロセ電機	30,600	10,670.00	326,502,000	
日本航空電子工業	45,300	1,270.00	57,531,000	
T O A	21,200	675.00	14,310,000	
マクセルホールディング ス	42,600	950.00	40,470,000	貸付有価証券 700株
古野電気	25,500	787.00	20,068,500	
ユニデンホールディング ス	5,400	1,695.00	9,153,000	貸付有価証券 500株
スミダコーポレーション	15,200	658.00	10,001,600	
アイコム	10,900	2,569.00	28,002,100	
リオン	8,300	2,240.00	18,592,000	貸付有価証券 200株
本多通信工業	16,900	380.00	6,422,000	
船井電機	20,000	415.00	8,300,000	貸付有価証券 5,100株
横河電機	181,400	1,267.00	229,833,800	
新電元工業	7,000	2,432.00	17,024,000	
アズビル	124,800	2,761.00	344,572,800	
東亜ディーケーケー	9,800	844.00	8,271,200	
日本光電工業	81,700	3,945.00	322,306,500	
チノー	6,800	1,239.00	8,425,200	貸付有価証券 2,100株
共和電業	20,700	368.00	7,617,600	
日本電子材料	7,800	891.00	6,949,800	貸付有価証券 1,600株
堀場製作所	39,200	5,140.00	201,488,000	
アドバンテスト	147,000	5,100.00	749,700,000	貸付有価証券 1,000株
小野測器	8,200	495.00	4,059,000	
エスベック	17,500	1,613.00	28,227,500	
キーエンス	179,100	37,280.00	6,676,848,000	貸付有価証券 17,600株
日置電機	10,300	2,946.00	30,343,800	貸付有価証券 4,800株

シスメックス	141,300	7,259.00	1,025,696,700	貸付有価証券 800株
日本マイクロニクス	34,400	793.00	27,279,200	貸付有価証券 200株
メガチップス	18,400	1,528.00	28,115,200	貸付有価証券 4,400株
O B A R A G R O U P	10,200	2,643.00	26,958,600	貸付有価証券 4,600株（2,800株）
澤藤電機	2,400	1,849.00	4,437,600	
原田工業	9,300	785.00	7,300,500	貸付有価証券 500株
コーセル	26,300	908.00	23,880,400	貸付有価証券 1,400株
イリソ電子工業	16,600	2,707.00	44,936,200	
オブテックスグループ	32,400	1,068.00	34,603,200	貸付有価証券 200株
千代田インテグレ	9,100	1,697.00	15,442,700	
アイ・オー・データ機器	6,400	930.00	5,952,000	
レーザーテック	86,800	6,130.00	532,084,000	貸付有価証券 1,600株
スタンレー電気	139,000	2,338.00	324,982,000	
岩崎電気	7,700	1,246.00	9,594,200	
ウシオ電機	109,100	1,088.00	118,700,800	
岡谷電機産業	15,500	323.00	5,006,500	
ヘリオス テクノ ホールディング	18,200	306.00	5,569,200	貸付有価証券 1,500株
エノモト	5,900	915.00	5,398,500	
日本セラミック	20,100	1,827.00	36,722,700	貸付有価証券 9,400株
遠藤照明	10,000	553.00	5,530,000	
古河電池	14,100	535.00	7,543,500	貸付有価証券 4,000株
双信電機	9,600	306.00	2,937,600	
山一電機	14,300	1,348.00	19,276,400	
図研	12,900	2,233.00	28,805,700	
日本電子	39,000	2,902.00	113,178,000	
カシオ計算機	174,900	1,650.00	288,585,000	貸付有価証券 8,300株
ファナック	187,900	14,565.00	2,736,763,500	
日本シイエムケイ	46,400	386.00	17,910,400	貸付有価証券

				800株（700株）
エンプラス	10,100	2,170.00	21,917,000	
大真空	7,200	1,705.00	12,276,000	貸付有価証券 2,700株（100株）
ローム	87,800	6,330.00	555,774,000	
浜松ホトニクス	141,800	4,675.00	662,915,000	
三井ハイテック	21,800	1,115.00	24,307,000	貸付有価証券 4,700株
新光電気工業	66,400	1,249.00	82,933,600	貸付有価証券 19,800株
京セラ	278,100	5,719.00	1,590,453,900	貸付有価証券 1,200株
太陽誘電	87,900	2,780.00	244,362,000	貸付有価証券 9,400株
村田製作所	580,800	5,610.00	3,258,288,000	
双葉電子工業	31,300	964.00	30,173,200	
北陸電気工業	7,900	922.00	7,283,800	
ニチコン	67,000	638.00	42,746,000	貸付有価証券 2,400株
日本ケミコン	15,000	1,036.00	15,540,000	
K O A	29,800	836.00	24,912,800	
市光工業	29,600	418.00	12,372,800	貸付有価証券 13,800株
小糸製作所	118,400	3,660.00	433,344,000	貸付有価証券 300株
ミツバ	36,400	404.00	14,705,600	貸付有価証券 100株
S C R E E Nホールディングス	34,300	4,590.00	157,437,000	貸付有価証券 5,200株
キヤノン電子	20,700	1,552.00	32,126,400	
キヤノン	1,064,300	2,145.00	2,282,923,500	貸付有価証券 108,700株（60,400株）
リコー	503,000	681.00	342,543,000	貸付有価証券 9,100株
象印マホービン	57,900	1,520.00	88,008,000	貸付有価証券 5,700株（900株）
M U T O Hホールディングス	2,500	1,307.00	3,267,500	
東京エレクトロン	125,400	22,155.00	2,778,237,000	貸付有価証券 500株

トヨタ紡織	57,600	1,228.00	70,732,800	
芦森工業	4,100	804.00	3,296,400	
ユニプレス	38,300	892.00	34,163,600	
豊田自動織機	160,000	5,120.00	819,200,000	
モリタホールディングス	34,600	1,578.00	54,598,800	
三櫻工業	25,100	660.00	16,566,000	
デンソー	435,300	3,630.00	1,580,139,000	貸付有価証券 200株
東海理化電機製作所	52,100	1,257.00	65,489,700	貸付有価証券 100株
三井E & Sホールディングス	71,400	518.00	36,985,200	貸付有価証券 700株
川崎重工業	153,800	1,430.00	219,934,000	貸付有価証券 5,500株
名村造船所	63,600	170.00	10,812,000	貸付有価証券 5,900株
サノヤスホールディングス	24,000	140.00	3,360,000	貸付有価証券 2,300株
日本車輛製造	7,200	2,606.00	18,763,200	貸付有価証券 400株
三菱ロジスネクスト	26,200	883.00	23,134,600	
近畿車輛	3,000	1,084.00	3,252,000	
日産自動車	2,331,700	337.40	786,715,580	貸付有価証券 327,500株
いすゞ自動車	572,900	710.60	407,102,740	
トヨタ自動車	2,206,000	6,500.00	14,339,000,000	貸付有価証券 12,100株
日野自動車	246,900	553.00	136,535,700	貸付有価証券 2,000株
三菱自動車工業	731,800	277.00	202,708,600	貸付有価証券 110,800株
エフテック	13,800	403.00	5,561,400	貸付有価証券 2,600株
レシップホールディングス	7,700	405.00	3,118,500	貸付有価証券 100株
GMB	3,500	612.00	2,142,000	
ファルテック	3,500	589.00	2,061,500	貸付有価証券 100株
武蔵精密工業	44,000	792.00	34,848,000	貸付有価証券 100株
日産車体	38,600	788.00	30,416,800	

新明和工業	53,300	1,076.00	57,350,800	貸付有価証券 500株
極東開発工業	36,700	1,205.00	44,223,500	
日信工業	40,200	2,197.00	88,319,400	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
トピー工業	16,300	1,158.00	18,875,400	
ティラド	7,200	1,194.00	8,596,800	
タチエス	32,400	941.00	30,488,400	貸付有価証券 14,400株
N O K	106,300	1,059.00	112,571,700	
フタバ産業	55,000	470.00	25,850,000	
K Y B	22,100	1,960.00	43,316,000	
大同メタル工業	37,900	510.00	19,329,000	
プレス工業	98,000	234.00	22,932,000	
ミクニ	25,100	229.00	5,747,900	
太平洋工業	41,400	797.00	32,995,800	
ケーヒン	45,400	2,537.00	115,179,800	
河西工業	26,700	475.00	12,682,500	貸付有価証券 5,400株
アイシン精機	162,800	2,742.00	446,397,600	
マツダ	581,700	529.00	307,719,300	貸付有価証券 60,900株(24,900株)
今仙電機製作所	18,300	695.00	12,718,500	
本田技研工業	1,556,600	2,343.00	3,647,113,800	貸付有価証券 34,300株
スズキ	391,900	2,998.00	1,174,916,200	
S U B A R U	613,800	1,968.50	1,208,265,300	貸付有価証券 300株
安永	9,500	942.00	8,949,000	貸付有価証券 2,000株(500株)
ヤマハ発動機	257,800	1,208.00	311,422,400	貸付有価証券 30,300株
ショーワ	46,700	2,243.00	104,748,100	
T B K	23,500	450.00	10,575,000	
エクセディ	26,800	1,538.00	41,218,400	貸付有価証券 400株
豊田合成	63,800	1,775.00	113,245,000	
愛三工業	30,900	542.00	16,747,800	
盟和産業	3,000	925.00	2,775,000	



日本プラスト	15,500	408.00	6,324,000	
ヨロズ	18,500	1,030.00	19,055,000	
エフ・シー・シー	32,300	1,415.00	45,704,500	
シマノ	74,000	15,550.00	1,150,700,000	貸付有価証券 3,400株(3,400株)
テイ・エス テック	45,900	2,719.00	124,802,100	貸付有価証券 400株
ジャムコ	9,900	590.00	5,841,000	貸付有価証券 2,700株(100株)
テルモ	559,400	3,540.00	1,980,276,000	貸付有価証券 500株
クリエートメディック	6,500	1,017.00	6,610,500	
日機装	59,300	786.00	46,609,800	貸付有価証券 27,700株
日本エム・ディ・エム	11,400	1,508.00	17,191,200	
島津製作所	236,300	2,783.00	657,622,900	貸付有価証券 7,600株
JMS	16,700	815.00	13,610,500	
クボテック	5,100	320.00	1,632,000	貸付有価証券 2,300株
長野計器	14,300	739.00	10,567,700	
ブイ・テクノロジー	9,300	3,290.00	30,597,000	貸付有価証券 2,900株(100株)
東京計器	12,600	697.00	8,782,200	
愛知時計電機	2,600	4,465.00	11,609,000	
インターアクション	10,600	2,158.00	22,874,800	貸付有価証券 600株
オーバル	17,700	207.00	3,663,900	貸付有価証券 100株
東京精密	35,800	3,185.00	114,023,000	
マニー	78,700	2,326.00	183,056,200	貸付有価証券 15,900株(1,700株)
ニコン	319,900	940.00	300,706,000	貸付有価証券 1,500株
トプコン	99,600	788.00	78,484,800	貸付有価証券 1,300株
オリンパス	1,093,900	1,564.00	1,710,859,600	貸付有価証券 2,200株
理研計器	17,400	1,978.00	34,417,200	
タムロン	15,900	1,697.00	26,982,300	貸付有価証券

				100株
HOYA	394,800	9,716.00	3,835,876,800	
シード	8,400	772.00	6,484,800	貸付有価証券 700株
ノーリツ鋼機	13,300	1,089.00	14,483,700	
エー・アンド・デイ	18,000	683.00	12,294,000	
朝日インテック	167,900	2,784.00	467,433,600	貸付有価証券 2,000株
シチズン時計	231,500	343.00	79,404,500	貸付有価証券 7,000株
リズム時計工業	6,200	584.00	3,620,800	
大研医器	13,700	648.00	8,877,600	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
メニコン	28,000	4,930.00	138,040,000	貸付有価証券 500株
シンシア	2,100	349.00	732,900	
松風	8,900	1,526.00	13,581,400	
セイコーホールディングス	28,000	1,610.00	45,080,000	貸付有価証券 300株(200株)
ニプロ	136,800	1,159.00	158,551,200	
中本パックス	5,000	1,419.00	7,095,000	
スノーピーク	10,300	725.00	7,467,500	貸付有価証券 600株
パラマウントベッドホールディングス	20,800	4,280.00	89,024,000	
トランザクション	12,600	917.00	11,554,200	
粧美堂	5,800	343.00	1,989,400	
ニホンフラッシュ	18,500	1,163.00	21,515,500	貸付有価証券 4,400株
前田工織	21,800	1,937.00	42,226,600	貸付有価証券 4,100株(3,200株)
永大産業	25,800	266.00	6,862,800	貸付有価証券 100株(100株)
アートネイチャー	21,100	661.00	13,947,100	
バンダイナムコホールディングス	204,400	5,351.00	1,093,744,400	貸付有価証券 1,700株
アイフィスジャパン	5,000	652.00	3,260,000	貸付有価証券 500株(500株)
共立印刷	33,000	145.00	4,785,000	
SHOEI	19,000	2,027.00	38,513,000	貸付有価証券

				1,600株(700株)
フランスベッドホールディングス	28,000	838.00	23,464,000	貸付有価証券 11,900株
パイロットコーポレーション	32,300	3,520.00	113,696,000	貸付有価証券 8,500株
萩原工業	11,000	1,237.00	13,607,000	
トッパン・フォームズ	42,400	930.00	39,432,000	
フジシールインターナショナル	44,300	1,788.00	79,208,400	
タカラトミー	88,700	790.00	70,073,000	貸付有価証券 700株
廣済堂	13,800	764.00	10,543,200	貸付有価証券 3,000株
エステールホールディングス	5,300	550.00	2,915,000	
アーク	75,500	88.00	6,644,000	貸付有価証券 500株
タカノ	7,700	701.00	5,397,700	
プロネクサス	17,000	993.00	16,881,000	
ホクシン	12,200	109.00	1,329,800	
ウッドワン	6,600	1,022.00	6,745,200	
大建工業	13,300	1,563.00	20,787,900	
凸版印刷	279,100	1,514.00	422,557,400	貸付有価証券 300株
大日本印刷	258,700	2,153.00	556,981,100	貸付有価証券 800株
共同印刷	6,100	2,669.00	16,280,900	
N I S S H A	40,600	665.00	26,999,000	貸付有価証券 800株
光村印刷	1,700	1,507.00	2,561,900	
TAKARA & COMPANY	9,500	1,757.00	16,691,500	貸付有価証券 3,000株
アシックス	163,200	918.00	149,817,600	貸付有価証券 70,700株
ツツミ	6,200	1,551.00	9,616,200	
小松ウオール工業	6,000	1,746.00	10,476,000	貸付有価証券 100株
ヤマハ	117,600	3,960.00	465,696,000	貸付有価証券 2,800株(200株)
河合楽器製作所	6,100	2,416.00	14,737,600	

クリナップ	18,400	511.00	9,402,400	
ピジョン	119,500	4,050.00	483,975,000	貸付有価証券 3,800株
オリバー	4,200	2,668.00	11,205,600	貸付有価証券 1,800株
兼松サステック	1,300	1,440.00	1,872,000	
キングジム	16,400	848.00	13,907,200	貸付有価証券 7,600株
リンテック	47,000	2,269.00	106,643,000	
イトーキ	42,000	282.00	11,844,000	貸付有価証券 500株
任天堂	121,200	46,980.00	5,693,976,000	貸付有価証券 900株
三菱鉛筆	32,600	1,281.00	41,760,600	貸付有価証券 15,200株
タカラスタンド	40,800	1,537.00	62,709,600	
コクヨ	94,800	1,331.00	126,178,800	貸付有価証券 500株
ナカバヤシ	19,400	517.00	10,029,800	
グロープライド	8,800	1,638.00	14,414,400	貸付有価証券 100株
オカムラ	69,000	774.00	53,406,000	
美津濃	17,900	1,711.00	30,626,900	貸付有価証券 200株
東京電力ホールディングス	1,578,300	363.00	572,922,900	貸付有価証券 688,000株
中部電力	604,900	1,544.00	933,965,600	
関西電力	749,100	1,138.00	852,475,800	
中国電力	285,200	1,500.00	427,800,000	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
北陸電力	180,700	713.00	128,839,100	貸付有価証券 1,200株
東北電力	493,900	1,046.00	516,619,400	
四国電力	178,000	804.00	143,112,000	貸付有価証券 200株
九州電力	407,500	866.00	352,895,000	
北海道電力	185,000	402.00	74,370,000	
沖縄電力	36,600	1,921.00	70,308,600	
電源開発	157,300	2,116.00	332,846,800	
エフオン	10,600	441.00	4,674,600	

イーレックス	28,200	1,375.00	38,775,000	
レノバ	33,000	1,003.00	33,099,000	貸付有価証券 2,500株
東京瓦斯	380,200	2,645.50	1,005,819,100	
大阪瓦斯	383,600	2,137.00	819,753,200	貸付有価証券 500株
東邦瓦斯	97,200	5,850.00	568,620,000	貸付有価証券 300株
北海道瓦斯	10,600	1,543.00	16,355,800	貸付有価証券 100株
広島ガス	40,700	358.00	14,570,600	
西部瓦斯	22,300	2,740.00	61,102,000	
静岡ガス	56,100	1,020.00	57,222,000	
メタウォーター	9,500	4,095.00	38,902,500	
SBSホールディングス	17,100	1,788.00	30,574,800	
東武鉄道	208,500	3,670.00	765,195,000	
相鉄ホールディングス	63,300	2,794.00	176,860,200	
東急	498,600	1,632.00	813,715,200	
京浜急行電鉄	253,900	1,818.00	461,590,200	貸付有価証券 10,300株
小田急電鉄	294,000	2,420.00	711,480,000	貸付有価証券 2,800株
京王電鉄	102,600	6,290.00	645,354,000	貸付有価証券 4,300株
京成電鉄	137,600	3,110.00	427,936,000	貸付有価証券 300株
富士急行	27,000	2,847.00	76,869,000	貸付有価証券 9,800株
新京成電鉄	5,100	2,042.00	10,414,200	
東日本旅客鉄道	348,000	8,158.00	2,838,984,000	貸付有価証券 5,700株
西日本旅客鉄道	176,200	6,751.00	1,189,526,200	貸付有価証券 300株
東海旅客鉄道	164,400	17,115.00	2,813,706,000	貸付有価証券 1,600株
西武ホールディングス	265,300	1,232.00	326,849,600	
鴻池運輸	31,500	1,148.00	36,162,000	
西日本鉄道	54,800	2,554.00	139,959,200	貸付有価証券 1,800株
ハマキョウレックス	15,200	2,815.00	42,788,000	

サカイ引越センター	10,400	5,440.00	56,576,000	
近鉄グループホールディングス	187,300	5,220.00	977,706,000	貸付有価証券 3,700株
阪急阪神ホールディングス	249,700	3,700.00	923,890,000	
南海電気鉄道	88,800	2,319.00	205,927,200	貸付有価証券 200株
京阪ホールディングス	83,400	4,920.00	410,328,000	貸付有価証券 100株
神戸電鉄	4,500	3,670.00	16,515,000	貸付有価証券 100株
名古屋鉄道	153,900	3,125.00	480,937,500	貸付有価証券 2,500株
山陽電気鉄道	13,400	1,991.00	26,679,400	貸付有価証券 5,300株
日本通運	66,200	5,060.00	334,972,000	貸付有価証券 1,100株
ヤマトホールディングス	328,200	1,894.00	621,610,800	貸付有価証券 1,100株
山九	52,000	3,800.00	197,600,000	
丸運	10,700	220.00	2,354,000	貸付有価証券 100株
丸全昭和運輸	15,200	2,248.00	34,169,600	
センコーグループホールディングス	103,200	851.00	87,823,200	貸付有価証券 900株
トナミホールディングス	4,500	4,795.00	21,577,500	
ニッコンホールディングス	67,000	2,019.00	135,273,000	
日本石油輸送	2,000	2,762.00	5,524,000	
福山通運	24,000	3,650.00	87,600,000	貸付有価証券 300株
セイノーホールディングス	140,200	1,205.00	168,941,000	
エスライン	5,600	875.00	4,900,000	
神奈川中央交通	4,600	3,985.00	18,331,000	
日立物流	34,300	2,436.00	83,554,800	
丸和運輸機関	19,700	3,190.00	62,843,000	貸付有価証券 1,600株
C & F ロジホールディングス	18,900	1,228.00	23,209,200	
九州旅客鉄道	164,100	3,015.00	494,761,500	

S Gホールディングス	196,500	2,974.00	584,391,000	貸付有価証券 1,300株
日本郵船	156,600	1,308.00	204,832,800	貸付有価証券 800株
商船三井	118,500	1,713.00	202,990,500	貸付有価証券 100株
川崎汽船	57,700	921.00	53,141,700	貸付有価証券 26,300株（5,300株）
N S ユナイテッド海運	10,300	1,335.00	13,750,500	貸付有価証券 100株
明治海運	19,900	431.00	8,576,900	
飯野海運	88,600	328.00	29,060,800	
共栄タンカー	3,300	1,065.00	3,514,500	
乾汽船	10,800	1,174.00	12,679,200	貸付有価証券 2,000株
日本航空	337,100	1,826.00	615,544,600	貸付有価証券 4,400株
A N Aホールディングス	342,300	2,354.50	805,945,350	貸付有価証券 45,800株（17,500株）
パスコ	3,600	1,361.00	4,899,600	
トランコム	5,200	7,010.00	36,452,000	
日新	16,200	1,710.00	27,702,000	貸付有価証券 100株
三菱倉庫	59,400	2,194.00	130,323,600	貸付有価証券 5,900株（5,400株）
三井倉庫ホールディングス	21,400	1,398.00	29,917,200	
住友倉庫	68,900	1,192.00	82,128,800	
澁澤倉庫	10,300	2,154.00	22,186,200	
東陽倉庫	33,800	317.00	10,714,600	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	41,200	464.00	19,116,800	貸付有価証券 100株
ケイヒン	3,600	1,127.00	4,057,200	
中央倉庫	11,400	1,024.00	11,673,600	
川西倉庫	3,400	965.00	3,281,000	
安田倉庫	15,400	849.00	13,074,600	
ファイズホールディングス	4,000	1,205.00	4,820,000	貸付有価証券 1,900株（700株）
東洋埠頭	5,700	1,218.00	6,942,600	

宇徳	16,000	442.00	7,072,000	
上組	104,500	1,841.00	192,384,500	
サンリツ	4,400	543.00	2,389,200	
キムラユニティー	5,000	963.00	4,815,000	
キューソー流通システム	4,700	1,593.00	7,487,100	
近鉄エクスプレス	39,800	1,446.00	57,550,800	
東海運	10,700	270.00	2,889,000	貸付有価証券 100株
エーアイティー	13,200	706.00	9,319,200	
内外トランスライン	6,600	1,126.00	7,431,600	
日本コンセプト	6,000	1,414.00	8,484,000	
NEC ネットスアイ	18,300	4,625.00	84,637,500	
クロスキャット	5,100	943.00	4,809,300	
システナ	69,200	1,418.00	98,125,600	
デジタルアーツ	9,500	5,860.00	55,670,000	貸付有価証券 300株
日鉄ソリューションズ	29,100	2,718.00	79,093,800	
キューブシステム	10,300	627.00	6,458,100	
エイジア	3,500	1,207.00	4,224,500	
コア	8,200	1,196.00	9,807,200	
ラクーンホールディングス	8,600	615.00	5,289,000	貸付有価証券 1,600株
ソリトンシステムズ	8,500	1,301.00	11,058,500	貸付有価証券 1,000株
ソフトクリエイトホールディングス	8,500	1,694.00	14,399,000	
T I S	194,000	1,932.00	374,808,000	貸付有価証券 1,200株
ネオス	7,800	679.00	5,296,200	貸付有価証券 2,500株
電算システム	7,400	2,322.00	17,182,800	
グリー	119,000	403.00	47,957,000	貸付有価証券 16,500株
コーエーテクモホールディングス	39,700	2,913.00	115,646,100	
三菱総合研究所	8,300	3,325.00	27,597,500	
ボルテージ	4,500	349.00	1,570,500	貸付有価証券 2,100株（2,000株）
電算	2,100	1,938.00	4,069,800	



A G S	11,000	742.00	8,162,000	
ファインデックス	16,300	779.00	12,697,700	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
ブレインパッド	4,900	5,050.00	24,745,000	貸付有価証券 2,300株
K L a b	37,500	677.00	25,387,500	貸付有価証券 17,300株（2,400株）
ポールトゥウィン・ピット クルーホールディ	23,400	807.00	18,883,800	
イーブクイニシアティ ブジャパン	2,800	1,550.00	4,340,000	
ネクソン	540,900	1,819.00	983,897,100	貸付有価証券 41,800株
アイスタイル	54,300	226.00	12,271,800	貸付有価証券 21,800株（900株）
エムアップホールディン グス	5,600	2,448.00	13,708,800	貸付有価証券 1,900株（1,600株）
エイチーム	13,300	666.00	8,857,800	貸付有価証券 100株
エニグモ	13,700	908.00	12,439,600	貸付有価証券 6,300株（5,800株）
テクノスジャパン	15,000	361.00	5,415,000	
e n i s h	8,700	364.00	3,166,800	貸付有価証券 3,100株（800株）
コロプラ	63,600	825.00	52,470,000	貸付有価証券 1,600株（1,600株）
オルトプラス	14,400	416.00	5,990,400	貸付有価証券 5,600株（100株）
ブロードリーフ	96,100	483.00	46,416,300	貸付有価証券 45,600株
クロス・マーケティング グループ	8,600	256.00	2,201,600	貸付有価証券 400株
デジタルハーツホール ディングス	10,300	761.00	7,838,300	
システム情報	9,800	774.00	7,585,200	
メディアドゥホールディ ングス	6,100	3,805.00	23,210,500	貸付有価証券 2,800株
じげん	48,000	285.00	13,680,000	貸付有価証券 600株
ブイキューブ	11,900	1,299.00	15,458,100	貸付有価証券 5,500株（1,700株）
エンカレッジ・テクノロ	3,200	686.00	2,195,200	

ジ				
サイバーリンクス	3,000	1,211.00	3,633,000	
ディー・エル・イー	15,600	111.00	1,731,600	貸付有価証券 6,300株(3,200株)
フィックスターズ	20,600	1,022.00	21,053,200	貸付有価証券 2,300株
CARTA HOLDINGS	9,400	786.00	7,388,400	
オブティム	10,100	2,378.00	24,017,800	貸付有価証券 4,600株(1,200株)
セレス	6,300	717.00	4,517,100	貸付有価証券 800株
SHIFT	5,100	9,260.00	47,226,000	貸付有価証券 1,100株(200株)
ティーガイア	17,200	2,063.00	35,483,600	
セック	2,800	2,870.00	8,036,000	
日本アジアグループ	20,500	219.00	4,489,500	貸付有価証券 400株
豆蔵ホールディングス	2,400	1,880.00	4,512,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
テクマトリックス	13,700	2,588.00	35,455,600	
プロシップ	5,600	1,092.00	6,115,200	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	46,800	1,582.00	74,037,600	貸付有価証券 200株
GMOペイメントゲートウェイ	31,900	9,500.00	303,050,000	貸付有価証券 11,600株(3,800株)
ザッパラス	8,400	330.00	2,772,000	
システムリサーチ	5,100	1,458.00	7,435,800	
インターネットイニシアティブ	28,700	3,770.00	108,199,000	
さくらインターネット	20,800	617.00	12,833,600	貸付有価証券 2,800株
ヴィンクス	5,400	841.00	4,541,400	貸付有価証券 200株(100株)
GMOクラウド	3,600	2,610.00	9,396,000	貸付有価証券 100株
SRAホールディングス	10,300	2,103.00	21,660,900	
システムインテグレータ	6,100	673.00	4,105,300	
朝日ネット	13,700	863.00	11,823,100	
eBASE	23,200	996.00	23,107,200	貸付有価証券 500株

アバント	13,800	878.00	12,116,400	貸付有価証券 3,500株
アドソル日進	6,800	2,319.00	15,769,200	
フリービット	10,100	712.00	7,191,200	貸付有価証券 4,700株（3,600株）
コムチュア	21,800	2,229.00	48,592,200	
サイバーコム	3,400	1,666.00	5,664,400	貸付有価証券 1,500株
アステリア	11,800	492.00	5,805,600	貸付有価証券 2,200株（2,200株）
アイル	6,900	1,514.00	10,446,600	貸付有価証券 3,200株（2,200株）
マークラインズ	9,700	1,735.00	16,829,500	
メディカル・データ・ビ ジョン	14,700	718.00	10,554,600	貸付有価証券 4,900株（1,200株）
g u m i	24,800	677.00	16,789,600	
ショーケース	4,600	449.00	2,065,400	
モバイルファクトリー	4,300	964.00	4,145,200	貸付有価証券 1,300株（200株）
テラスカイ	7,000	2,343.00	16,401,000	貸付有価証券 3,200株（300株）
デジタル・インフォメー ション・テクノロジ	7,600	1,252.00	9,515,200	貸付有価証券 300株
P C Iホールディングス	7,800	810.00	6,318,000	
パイブドHD	2,500	1,132.00	2,830,000	貸付有価証券 1,200株（700株）
アイピーシー	3,500	865.00	3,027,500	
ネオジャパン	3,600	1,206.00	4,341,600	貸付有価証券 700株（700株）
P R T I M E S	1,700	1,943.00	3,303,100	貸付有価証券 700株（700株）
ランドコンピュータ	2,900	995.00	2,885,500	
ダブルスタンダード	2,500	3,855.00	9,637,500	貸付有価証券 1,100株
オープンドア	9,600	816.00	7,833,600	貸付有価証券 2,000株（100株）
マイネット	6,200	691.00	4,284,200	貸付有価証券 100株
アカツキ	6,900	3,700.00	25,530,000	貸付有価証券 1,400株
ベネフィットジャパン	1,400	1,227.00	1,717,800	

Ubicomホールディングス	4,300	1,213.00	5,215,900	貸付有価証券 1,800株（1,300株）
LINE	44,400	5,250.00	233,100,000	貸付有価証券 7,700株（7,500株）
カナミックネットワーク	11,800	682.00	8,047,600	貸付有価証券 200株
ノムラシステムコーポレーション	4,200	324.00	1,360,800	
チェンジ	3,900	3,605.00	14,059,500	貸付有価証券 100株
シンクロ・フード	8,300	224.00	1,859,200	貸付有価証券 2,000株（1,900株）
オークネット	11,900	1,033.00	12,292,700	貸付有価証券 100株
セグエグループ	3,200	873.00	2,793,600	貸付有価証券 1,500株（700株）
エイトレッド	2,400	1,408.00	3,379,200	貸付有価証券 200株（200株）
AOI TYO Holdings	19,600	416.00	8,153,600	貸付有価証券 9,100株
マクロミル	39,600	617.00	24,433,200	貸付有価証券 300株
ピーグリー	3,800	1,274.00	4,841,200	
オロ	5,100	2,853.00	14,550,300	貸付有価証券 200株（200株）
ユーザーローカル	1,400	2,773.00	3,882,200	
テモナ	2,600	674.00	1,752,400	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
ニーズウェル	2,300	596.00	1,370,800	
サインポスト	3,000	1,137.00	3,411,000	貸付有価証券 1,400株（800株）
ソルクシーズ	8,200	560.00	4,592,000	
フェイス	6,800	588.00	3,998,400	
プロトコーポレーション	17,400	840.00	14,616,000	
ハイマックス	2,300	1,873.00	4,307,900	貸付有価証券 1,000株
野村総合研究所	275,000	2,565.00	705,375,000	
サイバネットシステム	13,800	593.00	8,183,400	貸付有価証券 500株
CEホールディングス	11,100	440.00	4,884,000	
日本システム技術	3,100	1,121.00	3,475,100	

インテージホールディングス	24,200	742.00	17,956,400	
東邦システムサイエンス	5,100	914.00	4,661,400	
ソースネクスト	92,000	306.00	28,152,000	貸付有価証券 43,200株（17,000株）
インフォコム	21,200	2,879.00	61,034,800	
HEROZ	2,100	3,465.00	7,276,500	貸付有価証券 900株
ラクスル	10,300	2,350.00	24,205,000	貸付有価証券 2,700株
F I G	21,000	229.00	4,809,000	貸付有価証券 1,100株
システムサポート	1,600	2,395.00	3,832,000	
イーソル	6,900	1,107.00	7,638,300	貸付有価証券 3,200株（200株）
アルテリア・ネットワークス	21,500	2,172.00	46,698,000	
東海ソフト	1,300	1,132.00	1,471,600	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,400	846.00	3,722,400	
フォーカスシステムズ	12,000	708.00	8,496,000	
クレスコ	11,800	1,282.00	15,127,600	
フジ・メディア・ホールディングス	186,900	1,019.00	190,451,100	
オービック	67,200	15,210.00	1,022,112,000	
ジャストシステム	31,500	6,300.00	198,450,000	
TDCソフト	17,000	802.00	13,634,000	
Zホールディングス	2,664,100	382.00	1,017,686,200	
トレンドマイクロ	86,300	4,940.00	426,322,000	貸付有価証券 15,300株（3,100株）
IDホールディングス	7,400	1,361.00	10,071,400	
日本オラクル	39,300	10,570.00	415,401,000	
アルファシステムズ	6,000	2,881.00	17,286,000	貸付有価証券 200株
フューチャー	23,400	1,524.00	35,661,600	貸付有価証券 100株
C A C H o l d i n g s	12,600	1,019.00	12,839,400	貸付有価証券 100株
S B テクノロジー	7,000	2,531.00	17,717,000	貸付有価証券 1,400株

トーセ	5,200	758.00	3,941,600	
オービックビジネスコンサルティング	19,800	4,480.00	88,704,000	貸付有価証券 8,800株（100株）
伊藤忠テクノソリューションズ	88,400	3,215.00	284,206,000	
アイティフォー	23,500	609.00	14,311,500	
東計電算	2,900	4,060.00	11,774,000	
エクスネット	3,000	893.00	2,679,000	
大塚商会	105,000	4,845.00	508,725,000	貸付有価証券 6,200株（2,200株）
サイボウズ	22,700	2,134.00	48,441,800	貸付有価証券 100株
ソフトブレーン	11,400	424.00	4,833,600	貸付有価証券 2,000株
電通国際情報サービス	12,000	4,175.00	50,100,000	
A C C E S S	18,100	905.00	16,380,500	貸付有価証券 2,900株（2,800株）
デジタルガレージ	34,900	3,555.00	124,069,500	貸付有価証券 200株
E Mシステムズ	27,200	819.00	22,276,800	
ウェザーニューズ	6,500	3,380.00	21,970,000	
C I J	13,200	756.00	9,979,200	
ビジネスエンジニアリング	2,200	2,210.00	4,862,000	
日本エンタープライズ	19,700	228.00	4,491,600	貸付有価証券 2,700株
WOWOW	9,300	2,396.00	22,282,800	
スカラ	12,900	477.00	6,153,300	
インテリジェント ウェイブ	8,500	557.00	4,734,500	
I M A G I C A G R O U P	16,500	328.00	5,412,000	貸付有価証券 600株
ネットワンシステムズ	73,900	2,697.00	199,308,300	貸付有価証券 800株
システムソフト	45,900	70.00	3,213,000	貸付有価証券 200株
アルゴグラフィックス	16,500	3,350.00	55,275,000	
マーベラス	29,600	518.00	15,332,800	
エイベックス	33,300	767.00	25,541,100	
日本ユニシス	60,600	2,895.00	175,437,000	

兼松エレクトロニクス	10,500	3,385.00	35,542,500	
東京放送ホールディングス	118,000	1,562.00	184,316,000	貸付有価証券 16,200株（2,700株）
日本テレビホールディングス	161,900	1,162.00	188,127,800	
朝日放送グループホールディングス	19,300	681.00	13,143,300	
テレビ朝日ホールディングス	53,300	1,512.00	80,589,600	貸付有価証券 23,600株
スカパーJ S A Tホールディングス	127,600	380.00	48,488,000	貸付有価証券 200株
テレビ東京ホールディングス	15,900	2,255.00	35,854,500	貸付有価証券 300株
日本BS放送	6,600	992.00	6,547,200	
ビジョン	18,100	698.00	12,633,800	貸付有価証券 3,000株
スマートパリュー	5,000	842.00	4,210,000	貸付有価証券 700株
USEN-NEXT HOLDINGS	7,400	1,190.00	8,806,000	貸付有価証券 2,900株（1,600株）
ワイヤレスゲート	9,200	449.00	4,130,800	貸付有価証券 3,700株（800株）
コネクシオ	11,000	1,365.00	15,015,000	
日本通信	151,200	158.00	23,889,600	貸付有価証券 34,900株（31,700株）
クロップス	3,500	503.00	1,760,500	
日本電信電話	2,593,300	2,574.50	6,676,450,850	貸付有価証券 78,900株
KDDI	1,445,800	3,173.00	4,587,523,400	貸付有価証券 4,100株
ソフトバンク	1,763,100	1,398.00	2,464,813,800	貸付有価証券 56,300株（1,400株）
光通信	20,000	20,110.00	402,200,000	
NTTドコモ	1,433,100	3,276.00	4,694,835,600	貸付有価証券 16,800株
エムティーアイ	18,800	550.00	10,340,000	
GMOインターネット	76,500	2,237.00	171,130,500	貸付有価証券 100株
ファイバーゲート	4,600	1,183.00	5,441,800	貸付有価証券 1,200株（800株）
アйдママーケティング	5,800	432.00	2,505,600	

コミュニケーション				
KADOKAWA	52,200	1,482.00	77,360,400	貸付有価証券 500株
学研ホールディングス	26,000	1,747.00	45,422,000	貸付有価証券 1,200株
ゼンリン	38,700	1,019.00	39,435,300	貸付有価証券 1,700株
昭文社ホールディングス	8,900	378.00	3,364,200	貸付有価証券 200株
インプレスホールディングス	16,100	140.00	2,254,000	貸付有価証券 200株
アイネット	10,000	1,437.00	14,370,000	貸付有価証券 100株
松竹	12,800	11,500.00	147,200,000	貸付有価証券 5,500株(400株)
東宝	114,500	3,490.00	399,605,000	貸付有価証券 33,400株
東映	7,300	13,440.00	98,112,000	貸付有価証券 2,300株
エヌ・ティ・ティ・データ	516,500	1,014.00	523,731,000	貸付有価証券 6,200株
ピー・シー・エー	2,500	3,185.00	7,962,500	貸付有価証券 1,100株(700株)
ビジネスブレイン太田昭和	3,300	2,709.00	8,939,700	
D T S	43,300	1,908.00	82,616,400	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	82,700	4,425.00	365,947,500	貸付有価証券 300株
シーイーシー	20,800	1,433.00	29,806,400	
カプコン	91,500	3,405.00	311,557,500	
アイ・エス・ビー	3,800	1,550.00	5,890,000	
ジャステック	12,300	1,089.00	13,394,700	
S C S K	44,800	5,030.00	225,344,000	
日本システムウエア	6,400	1,868.00	11,955,200	
アイネス	19,100	1,313.00	25,078,300	
T K C	16,400	4,880.00	80,032,000	
富士ソフト	24,800	3,665.00	90,892,000	貸付有価証券 11,600株(900株)
N S D	62,400	1,493.00	93,163,200	貸付有価証券 16,000株
コナミホールディングス	70,500	3,165.00	223,132,500	貸付有価証券



				1,200株
福井コンピュータホールディングス	7,600	2,587.00	19,661,200	
J B C Cホールディングス	13,100	1,796.00	23,527,600	
ミロク情報サービス	17,100	2,583.00	44,169,300	貸付有価証券 800株
ソフトバンクグループ	1,539,300	4,377.00	6,737,516,100	貸付有価証券 3,100株
ハウスイ	1,500	797.00	1,195,500	
高千穂交易	7,500	891.00	6,682,500	
カワニシホールディングス	2,300	1,132.00	2,603,600	貸付有価証券 1,000株
伊藤忠食品	4,800	4,335.00	20,808,000	
エレマテック	18,200	789.00	14,359,800	
J A L U X	5,500	1,511.00	8,310,500	貸付有価証券 2,400株
あらた	15,500	4,295.00	66,572,500	貸付有価証券 1,000株
トーメンデバイス	2,900	3,370.00	9,773,000	
東京エレクトロン デバイス	7,100	2,239.00	15,896,900	
フィールズ	14,900	299.00	4,455,100	貸付有価証券 2,100株
双日	1,075,500	240.00	258,120,000	
アルフレッサ ホールディングス	216,400	2,122.00	459,200,800	
横浜冷凍	54,600	873.00	47,665,800	
神栄	2,700	572.00	1,544,400	
ラサ商事	10,300	827.00	8,518,100	
アルコニックス	20,700	1,054.00	21,817,800	
神戸物産	67,200	5,580.00	374,976,000	貸付有価証券 22,300株
ハイパー	2,800	556.00	1,556,800	
あい ホールディングス	27,800	1,300.00	36,140,000	貸付有価証券 1,700株
ディービーエックス	6,900	816.00	5,630,400	貸付有価証券 2,100株
ダイワボウホールディングス	16,600	6,300.00	104,580,000	
マクニカ・富士エレホー	46,400	1,353.00	62,779,200	

ルディングス				貸付有価証券 20,600株
ラクト・ジャパン	7,300	3,290.00	24,017,000	貸付有価証券 900株
バイタルケーエスケー・ ホールディングス	36,600	1,094.00	40,040,400	貸付有価証券 17,200株
八洲電機	15,000	802.00	12,030,000	
メディアスホールディン グス	11,000	888.00	9,768,000	
レスターホールディン グス	20,300	1,614.00	32,764,200	
ジューテックホールディ ングス	4,400	980.00	4,312,000	
大光	8,300	641.00	5,320,300	
OCHIホールディン グス	5,600	1,313.00	7,352,800	
TOKAIホールディン グス	102,900	949.00	97,652,100	貸付有価証券 1,500株
黒谷	4,400	392.00	1,724,800	
Cominix	3,400	701.00	2,383,400	
三洋貿易	19,600	809.00	15,856,400	
ビューティガレージ	3,100	1,453.00	4,504,300	
ウイン・パートナーズ	14,000	892.00	12,488,000	貸付有価証券 6,300株
ミタチ産業	5,800	550.00	3,190,000	
シップヘルスケアホール ディングス	31,200	4,760.00	148,512,000	
明治電機工業	6,100	1,220.00	7,442,000	
デリカフーズホールディ ングス	6,800	621.00	4,222,800	
スターティアホールディ ングス	4,400	514.00	2,261,600	貸付有価証券 1,500株
コメダホールディングス	42,400	1,570.00	66,568,000	
ピーバンドットコム	1,500	823.00	1,234,500	
アセンテック	1,600	3,265.00	5,224,000	貸付有価証券 600株
富士興産	5,900	395.00	2,330,500	
協栄産業	2,200	1,010.00	2,222,000	
小野建	17,400	1,104.00	19,209,600	貸付有価証券 1,200株(1,200株)
南陽	4,300	1,245.00	5,353,500	

佐島電機	13,200	833.00	10,995,600	
エコートレーディング	4,400	522.00	2,296,800	貸付有価証券 700株
伯東	11,900	910.00	10,829,000	
コンドーテック	15,100	892.00	13,469,200	
中山福	11,200	424.00	4,748,800	
ナガイレーベン	28,200	2,646.00	74,617,200	貸付有価証券 100株
三菱食品	21,400	2,705.00	57,887,000	
松田産業	14,200	1,279.00	18,161,800	
第一興商	29,000	2,878.00	83,462,000	貸付有価証券 400株
メディパルホールディングス	210,100	2,022.00	424,822,200	貸付有価証券 1,100株
S P K	8,300	1,234.00	10,242,200	
萩原電気ホールディングス	7,200	1,967.00	14,162,400	
アズワン	12,700	9,300.00	118,110,000	
スズデン	6,700	1,070.00	7,169,000	
尾家産業	5,700	1,455.00	8,293,500	
シモジマ	11,900	1,250.00	14,875,000	
ドウシシャ	18,400	1,287.00	23,680,800	
小津産業	4,300	1,805.00	7,761,500	貸付有価証券 2,000株
高速	11,600	1,349.00	15,648,400	
たけびし	6,800	1,224.00	8,323,200	
リックス	4,400	1,438.00	6,327,200	
丸文	17,200	484.00	8,324,800	
ハピネット	16,200	1,042.00	16,880,400	貸付有価証券 1,100株
橋本総業ホールディングス	3,900	1,689.00	6,587,100	
日本ライフライン	57,700	1,184.00	68,316,800	貸付有価証券 600株
タカショー	9,500	465.00	4,417,500	
マルカ	6,900	1,618.00	11,164,200	
I D O M	52,500	395.00	20,737,500	貸付有価証券 3,500株（3,500株）
進和	11,500	1,755.00	20,182,500	

エスケイジャパン	4,200	251.00	1,054,200	
ダイトロン	8,200	1,373.00	11,258,600	
シークス	24,700	771.00	19,043,700	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
田中商事	6,000	673.00	4,038,000	
オーハシテクニカ	11,000	1,386.00	15,246,000	
白銅	7,000	1,208.00	8,456,000	
伊藤忠商事	1,362,000	2,082.00	2,835,684,000	貸付有価証券 2,500株
丸紅	2,026,900	470.50	953,656,450	貸付有価証券 61,300株
高島	3,100	1,480.00	4,588,000	
長瀬産業	109,500	1,229.00	134,575,500	
蝶理	12,400	1,531.00	18,984,400	
豊田通商	217,300	2,265.00	492,184,500	
三共生興	29,500	443.00	13,068,500	
兼松	72,600	1,030.00	74,778,000	貸付有価証券 600株
ツカモトコーポレーシ ョン	3,500	1,093.00	3,825,500	
三井物産	1,711,500	1,415.50	2,422,628,250	貸付有価証券 15,000株
日本紙パルプ商事	11,100	3,500.00	38,850,000	
カメイ	25,400	976.00	24,790,400	
東都水産	2,500	2,651.00	6,627,500	
OUGホールディングス	3,100	2,610.00	8,091,000	
スターゼン	7,200	4,160.00	29,952,000	貸付有価証券 100株
山善	76,100	872.00	66,359,200	
椿本興業	3,600	3,100.00	11,160,000	
住友商事	1,228,600	1,151.00	1,414,118,600	貸付有価証券 200株
内田洋行	8,300	4,255.00	35,316,500	
三菱商事	1,366,400	2,127.50	2,907,016,000	貸付有価証券 8,900株
第一実業	9,500	3,425.00	32,537,500	
キャノンマーケティング ジャパン	55,600	2,020.00	112,312,000	貸付有価証券 13,800株
西華産業	11,000	1,070.00	11,770,000	

佐藤商事	16,100	756.00	12,171,600	
菱洋エレクトロ	19,700	2,457.00	48,402,900	貸付有価証券 3,000株
東京産業	17,600	490.00	8,624,000	
ユアサ商事	18,500	2,862.00	52,947,000	貸付有価証券 100株
神鋼商事	4,900	1,632.00	7,996,800	
トルク	11,600	307.00	3,561,200	
阪和興業	36,400	1,567.00	57,038,800	貸付有価証券 700株
正栄食品工業	12,600	3,800.00	47,880,000	貸付有価証券 5,900株
カナデン	15,800	1,216.00	19,212,800	貸付有価証券 7,300株
菱電商事	14,000	1,266.00	17,724,000	
フルサト工業	10,700	1,318.00	14,102,600	
岩谷産業	43,200	3,695.00	159,624,000	貸付有価証券 16,000株（3,800株）
ナイス	8,300	760.00	6,308,000	
昭光通商	6,200	537.00	3,329,400	
ニチモウ	3,000	1,612.00	4,836,000	
極東貿易	5,600	1,180.00	6,608,000	
イワキ	25,500	417.00	10,633,500	
三愛石油	47,900	1,002.00	47,995,800	貸付有価証券 100株
稲畑産業	42,900	1,150.00	49,335,000	貸付有価証券 2,900株
G S Iクレオス	4,800	969.00	4,651,200	
明和産業	18,000	463.00	8,334,000	貸付有価証券 6,500株（4,100株）
クワザワ	6,900	466.00	3,215,400	
ヤマエ久野	7,200	1,318.00	9,489,600	
ワキタ	41,500	960.00	39,840,000	貸付有価証券 18,900株
東邦ホールディングス	62,500	2,207.00	137,937,500	貸付有価証券 200株
サンゲツ	53,100	1,574.00	83,579,400	
ミツウロコグループホー ルディングス	28,700	1,057.00	30,335,900	貸付有価証券 200株
シナネンホールディング	8,000	2,762.00	22,096,000	

ス				
伊藤忠エネクス	43,000	787.00	33,841,000	
サンリオ	54,700	1,501.00	82,104,700	貸付有価証券 23,900株（400株）
サンワテクノス	13,800	792.00	10,929,600	
リョーサン	21,500	2,308.00	49,622,000	
新光商事	30,500	853.00	26,016,500	
トーヨー	8,800	1,672.00	14,713,600	貸付有価証券 3,800株
三信電気	10,400	1,387.00	14,424,800	
東陽テクニカ	22,400	970.00	21,728,000	貸付有価証券 400株
モスフードサービス	25,500	2,717.00	69,283,500	貸付有価証券 11,300株（100株）
加賀電子	19,400	1,773.00	34,396,200	
ソーダニッカ	20,100	582.00	11,698,200	
立花エレテック	14,400	1,484.00	21,369,600	貸付有価証券 100株
フォーバル	8,500	1,043.00	8,865,500	
PALTA C	31,200	5,660.00	176,592,000	
三谷産業	25,600	314.00	8,038,400	
太平洋興発	7,600	580.00	4,408,000	
西本Wismettac ホールディングス	3,500	1,730.00	6,055,000	
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,700	1,845.00	3,136,500	貸付有価証券 700株
国際紙パルプ商事	46,100	301.00	13,876,100	貸付有価証券 100株
ヤマタネ	9,700	1,135.00	11,009,500	
丸紅建材リース	1,900	1,358.00	2,580,200	
日鉄物産	13,900	3,225.00	44,827,500	貸付有価証券 200株
泉州電業	6,000	2,397.00	14,382,000	
トラスコ中山	40,500	2,239.00	90,679,500	貸付有価証券 18,400株
オートバックスセブン	72,200	1,250.00	90,250,000	
モリト	14,200	655.00	9,301,000	
加藤産業	30,400	3,510.00	106,704,000	
北恵	3,700	870.00	3,219,000	

イノテック	11,600	821.00	9,523,600	
イエローハット	36,800	1,420.00	52,256,000	
J Kホールディングス	17,600	739.00	13,006,400	貸付有価証券 7,900株
日伝	17,600	1,986.00	34,953,600	
北沢産業	14,600	265.00	3,869,000	貸付有価証券 100株
杉本商事	10,500	1,666.00	17,493,000	
因幡電機産業	55,400	2,150.00	119,110,000	
東テク	6,400	1,734.00	11,097,600	
ミスミグループ本社	244,100	2,467.00	602,194,700	貸付有価証券 200株
アルテック	15,400	189.00	2,910,600	
タキヒヨー	5,900	1,618.00	9,546,200	貸付有価証券 100株
蔵王産業	3,800	1,333.00	5,065,400	
スズケン	82,500	3,930.00	324,225,000	貸付有価証券 1,000株
ジェコス	13,400	825.00	11,055,000	
グローセル	19,500	386.00	7,527,000	貸付有価証券 9,000株
ローソン	49,300	5,760.00	283,968,000	貸付有価証券 11,200株（3,200株）
サンエー	16,200	4,555.00	73,791,000	貸付有価証券 2,300株
カワチ薬品	15,100	2,536.00	38,293,600	貸付有価証券 2,000株
エービーシー・マート	30,400	5,210.00	158,384,000	貸付有価証券 1,000株
ハードオフコーポレーション	7,700	627.00	4,827,900	
アスクル	20,400	3,440.00	70,176,000	
ゲオホールディングス	35,100	1,350.00	47,385,000	貸付有価証券 1,100株
アダストリア	27,000	1,320.00	35,640,000	貸付有価証券 8,500株
ジーフット	11,800	420.00	4,956,000	貸付有価証券 1,600株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,800	399.00	1,117,200	
くら寿司	10,200	4,160.00	42,432,000	貸付有価証券

				4,700株
キャンドゥ	9,300	1,850.00	17,205,000	貸付有価証券 4,300株（200株）
パルグループホールディングス	19,900	1,234.00	24,556,600	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
エディオン	89,400	903.00	80,728,200	貸付有価証券 42,000株
サーラコーポレーション	39,500	554.00	21,883,000	
ワッツ	8,600	584.00	5,022,400	
ハローズ	7,300	3,020.00	22,046,000	貸付有価証券 600株
フジオフードシステム	16,400	1,219.00	19,991,600	貸付有価証券 200株
あみやき亭	4,200	2,707.00	11,369,400	貸付有価証券 100株
ひらまつ	35,800	136.00	4,868,800	
大黒天物産	4,700	4,085.00	19,199,500	貸付有価証券 2,200株
ハニーズホールディングス	17,100	1,040.00	17,784,000	貸付有価証券 2,800株（1,300株）
ファーマライズホールディングス	4,700	633.00	2,975,100	
アルペン	14,900	1,575.00	23,467,500	貸付有価証券 6,900株
ハブ	5,500	524.00	2,882,000	貸付有価証券 2,300株
クオールホールディングス	28,700	1,134.00	32,545,800	
ジズホールディングス	10,300	5,420.00	55,826,000	貸付有価証券 600株
ビックカメラ	115,500	894.00	103,257,000	貸付有価証券 16,000株（15,600株）
DCMホールディングス	107,900	1,039.00	112,108,100	貸付有価証券 41,700株（13,000株）
MonotaRO	138,500	3,170.00	439,045,000	貸付有価証券 46,600株（16,800株）
東京一番フーズ	4,900	407.00	1,994,300	貸付有価証券 1,400株
DDホールディングス	7,700	689.00	5,305,300	貸付有価証券 1,700株
きちりホールディングス	5,200	537.00	2,792,400	貸付有価証券 1,300株（1,300株）



アークランドサービス ホールディングス	14,200	1,575.00	22,365,000	貸付有価証券 6,600株
J.フロント リテイリ ング	232,500	782.00	181,815,000	貸付有価証券 107,800株(90,100 株)
ドトール・日レスホール ディングス	31,100	1,622.00	50,444,200	貸付有価証券 100株(100株)
マツモトキヨシホール ディングス	80,500	3,715.00	299,057,500	貸付有価証券 4,100株
ブロンコビリー	10,200	1,992.00	20,318,400	貸付有価証券 4,700株
Z O Z O	133,900	1,648.00	220,667,200	貸付有価証券 1,600株
トレジャー・ファクト リー	5,700	662.00	3,773,400	
物語コーポレーション	5,200	5,840.00	30,368,000	貸付有価証券 2,200株
ココカラファイン	20,300	5,060.00	102,718,000	
三越伊勢丹ホールディ ングス	340,300	622.00	211,666,600	貸付有価証券 12,200株
H a m e e	6,900	1,322.00	9,121,800	貸付有価証券 100株
ウエルシアホールディ ングス	57,900	8,760.00	507,204,000	貸付有価証券 5,800株
クリエイトSDホール ディングス	32,800	3,145.00	103,156,000	貸付有価証券 15,400株
丸善CHIホールディ ングス	22,700	375.00	8,512,500	
ミサワ	3,900	435.00	1,696,500	貸付有価証券 200株
ティーライフ	2,600	869.00	2,259,400	
エー・ピーカンパニー	3,600	364.00	1,310,400	
チムニー	5,900	1,491.00	8,796,900	貸付有価証券 2,600株
シュッピン	13,200	655.00	8,646,000	貸付有価証券 1,900株
ネクステージ	27,800	605.00	16,819,000	貸付有価証券 13,000株
ジョイフル本田	57,000	1,275.00	72,675,000	
鳥貴族	6,400	1,420.00	9,088,000	貸付有価証券 2,700株
キリン堂ホールディ ング	7,700	2,056.00	15,831,200	貸付有価証券

ス				200株
ホットランド	13,000	1,002.00	13,026,000	貸付有価証券 1,900株
すかいらーくホールディングス	218,200	1,540.00	336,028,000	貸付有価証券 102,500株
SFPホールディングス	8,300	1,291.00	10,715,300	貸付有価証券 300株
綿半ホールディングス	7,300	1,565.00	11,424,500	
ヨシックス	3,200	1,713.00	5,481,600	貸付有価証券 1,400株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	56,600	1,070.00	60,562,000	貸付有価証券 25,800株
ゴルフダイジェスト・オンライン	9,000	455.00	4,095,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
B E E N O S	7,300	822.00	6,000,600	貸付有価証券 2,400株(1,400株)
あさひ	14,500	1,259.00	18,255,500	貸付有価証券 300株(300株)
日本調剤	11,800	1,695.00	20,001,000	
コスモス薬品	8,600	29,800.00	256,280,000	貸付有価証券 3,800株
トーエル	9,400	757.00	7,115,800	貸付有価証券 4,300株
オンリー	3,300	544.00	1,795,200	貸付有価証券 100株(100株)
セブン & アイ・ホールディングス	761,800	3,494.00	2,661,729,200	貸付有価証券 195,800株(47,300株)
クリエイト・レストランツ・ホールディング	104,700	506.00	52,978,200	貸付有価証券 18,600株(6,800株)
ツルハホールディングス	42,300	15,060.00	637,038,000	貸付有価証券 5,700株(4,500株)
サンマルクホールディングス	15,400	1,715.00	26,411,000	
フェリシモ	4,300	955.00	4,106,500	
トリドールホールディングス	48,100	1,172.00	56,373,200	貸付有価証券 19,000株
T O K Y O B A S E	17,500	245.00	4,287,500	
ウイルプラスホールディングス	2,400	496.00	1,190,400	
J Mホールディングス	9,800	2,442.00	23,931,600	
サツドラホールディング	2,900	2,048.00	5,939,200	貸付有価証券

ス				1,300株
アレンザホールディングス	9,700	773.00	7,498,100	貸付有価証券 100株
串カツ田中ホールディングス	3,000	1,189.00	3,567,000	貸付有価証券 1,400株
パロックジャパンリミテッド	13,500	527.00	7,114,500	貸付有価証券 1,700株(1,300株)
クスリのアオキホールディングス	17,400	9,030.00	157,122,000	貸付有価証券 1,000株
力の源ホールディングス	8,800	533.00	4,690,400	貸付有価証券 4,100株(2,500株)
スシローグローバルホールディングス	85,500	1,645.00	140,647,500	
LIXILピバ	19,200	1,789.00	34,348,800	
メディカルシステムネットワーク	18,800	460.00	8,648,000	貸付有価証券 7,300株
はるやまホールディングス	9,100	698.00	6,351,800	貸付有価証券 4,200株
ノジマ	34,600	1,766.00	61,103,600	
カップ・クリエイト	27,300	1,314.00	35,872,200	貸付有価証券 12,300株(200株)
ライトオン	14,600	466.00	6,803,600	
ジーンズメイト	5,900	200.00	1,180,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
良品計画	258,500	1,142.00	295,207,000	貸付有価証券 10,800株
三城ホールディングス	20,600	252.00	5,191,200	貸付有価証券 500株
アドヴァン	29,700	1,054.00	31,303,800	
アルピス	7,400	2,114.00	15,643,600	
コナカ	22,900	315.00	7,213,500	
ハウスオブローゼ	2,400	1,491.00	3,578,400	貸付有価証券 200株(200株)
G-7ホールディングス	11,500	2,418.00	27,807,000	
イオン北海道	25,700	733.00	18,838,100	
コジマ	33,500	380.00	12,730,000	
ヒマラヤ	6,800	682.00	4,637,600	
コーナン商事	27,700	2,405.00	66,618,500	貸付有価証券 7,100株
エコス	7,200	1,907.00	13,730,400	

ワタミ	23,000	974.00	22,402,000	貸付有価証券 7,700株(600株)
マルシェ	5,100	533.00	2,718,300	貸付有価証券 1,200株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	428,000	2,099.00	898,372,000	貸付有価証券 22,400株
西松屋チェーン	42,700	837.00	35,739,900	貸付有価証券 18,800株
ゼンショーホールディン グス	93,300	2,038.00	190,145,400	貸付有価証券 1,300株
幸楽苑ホールディングス	12,400	1,407.00	17,446,800	貸付有価証券 5,800株
ハークスレイ	4,100	982.00	4,026,200	貸付有価証券 100株
サイゼリヤ	32,100	1,998.00	64,135,800	貸付有価証券 300株
V Tホールディングス	80,600	288.00	23,212,800	貸付有価証券 800株
魚力	5,400	1,451.00	7,835,400	
ポブラ	5,100	457.00	2,330,700	貸付有価証券 2,200株
フジ・コーポレーション	5,100	1,629.00	8,307,900	貸付有価証券 400株
ユナイテッドアローズ	20,400	1,567.00	31,966,800	貸付有価証券 2,500株
ハイデイ日高	28,100	1,560.00	43,836,000	貸付有価証券 11,700株
京都きもの友禅	12,400	248.00	3,075,200	
コロワイド	64,700	1,450.00	93,815,000	貸付有価証券 29,800株(1,000株)
ピーシーデポコーポレー ション	25,800	516.00	13,312,800	貸付有価証券 3,400株(500株)
壱番屋	13,700	4,115.00	56,375,500	貸付有価証券 100株
トップカルチャー	7,000	305.00	2,135,000	貸付有価証券 2,200株(2,200株)
P L A N T	5,000	483.00	2,415,000	
スギホールディングス	38,900	6,590.00	256,351,000	貸付有価証券 300株
薬王堂ホールディングス	8,500	2,723.00	23,145,500	
ヴィア・ホールディング ス	23,800	398.00	9,472,400	貸付有価証券 1,700株

スクロール	29,900	285.00	8,521,500	貸付有価証券 400株
ヨンドシーホールディングス	19,800	1,719.00	34,036,200	貸付有価証券 9,000株
ファミリーマート	155,600	1,718.00	267,320,800	貸付有価証券 25,500株(2,500株)
木曽路	25,500	2,370.00	60,435,000	貸付有価証券 11,600株
S R Sホールディングス	22,900	831.00	19,029,900	貸付有価証券 10,500株
千趣会	35,100	358.00	12,565,800	貸付有価証券 16,400株
タカキュー	15,000	125.00	1,875,000	貸付有価証券 600株(300株)
ケーヨー	40,000	508.00	20,320,000	貸付有価証券 800株
上新電機	22,900	1,904.00	43,601,600	
日本瓦斯	30,800	3,680.00	113,344,000	
ロイヤルホールディングス	34,000	1,697.00	57,698,000	貸付有価証券 15,900株(300株)
東天紅	1,400	827.00	1,157,800	
いなげや	24,100	1,579.00	38,053,900	
島忠	36,600	2,687.00	98,344,200	貸付有価証券 10,400株(7,900株)
チヨダ	20,400	960.00	19,584,000	
ライフコーポレーション	14,800	3,545.00	52,466,000	貸付有価証券 6,900株
リンガーハット	24,000	2,049.00	49,176,000	貸付有価証券 1,000株
M r M a x H D	26,700	429.00	11,454,300	貸付有価証券 100株
テンアライド	17,900	340.00	6,086,000	貸付有価証券 7,900株
A O K Iホールディングス	38,900	625.00	24,312,500	貸付有価証券 2,100株(1,200株)
オークワ	30,500	1,496.00	45,628,000	貸付有価証券 7,200株
コメリ	30,100	1,984.00	59,718,400	
青山商事	40,200	813.00	32,682,600	貸付有価証券 600株(600株)
しまむら	22,700	6,690.00	151,863,000	貸付有価証券

				700株(500株)
はせがわ	10,300	405.00	4,171,500	
高島屋	141,800	893.00	126,627,400	貸付有価証券 37,900株(26,600株)
松屋	39,300	592.00	23,265,600	貸付有価証券 18,400株
エイチ・ツー・オー リテイリング	92,200	775.00	71,455,000	
近鉄百貨店	7,400	2,395.00	17,723,000	貸付有価証券 3,400株
丸井グループ	178,500	1,583.00	282,565,500	貸付有価証券 1,000株
アクシアル リテイリング	16,200	3,925.00	63,585,000	
井筒屋	10,600	159.00	1,685,400	貸付有価証券 200株
イオン	749,300	2,151.50	1,612,118,950	貸付有価証券 4,000株
イズミ	39,600	2,908.00	115,156,800	
平和堂	39,500	1,789.00	70,665,500	貸付有価証券 17,800株
フジ	23,500	1,569.00	36,871,500	貸付有価証券 10,900株
ヤオコー	22,100	6,750.00	149,175,000	貸付有価証券 2,800株
ゼビオホールディングス	23,500	872.00	20,492,000	
ケーズホールディングス	187,900	1,168.00	219,467,200	貸付有価証券 1,000株
O l y m p i cグループ	10,000	616.00	6,160,000	
日産東京販売ホールディ ングス	28,600	199.00	5,691,400	貸付有価証券 12,700株
シルバーライフ	2,000	2,006.00	4,012,000	貸付有価証券 900株(900株)
一家ダイニングプロジェ クト	2,000	510.00	1,020,000	
Genky D r u g S t o r e s	8,600	2,314.00	19,900,400	貸付有価証券 700株
ナルミヤ・インターナ ショナル	3,300	529.00	1,745,700	
ブックオフグループホー ルディングス	11,400	768.00	8,755,200	貸付有価証券 5,300株(400株)
アインホールディングス	23,900	6,180.00	147,702,000	貸付有価証券

				2,800株(300株)
元気寿司	4,900	2,232.00	10,936,800	貸付有価証券 2,500株
ヤマダ電機	593,200	500.00	296,600,000	貸付有価証券 52,400株
アークランドサカモト	30,500	950.00	28,975,000	貸付有価証券 200株
ニトリホールディングス	84,300	16,205.00	1,366,081,500	貸付有価証券 1,900株
グルメ杵屋	13,900	870.00	12,093,000	貸付有価証券 6,300株
愛眼	15,500	206.00	3,193,000	貸付有価証券 800株
ケーユーホールディングス	10,200	763.00	7,782,600	
吉野家ホールディングス	64,000	2,230.00	142,720,000	貸付有価証券 10,800株(9,000株)
松屋フーズホールディングス	9,400	3,820.00	35,908,000	貸付有価証券 4,100株
サガミホールディングス	26,000	1,227.00	31,902,000	貸付有価証券 11,600株
関西スーパーマーケット	16,200	1,072.00	17,366,400	
王将フードサービス	14,300	5,630.00	80,509,000	
プレナス	21,800	1,841.00	40,133,800	貸付有価証券 9,200株
ミニストップ	14,400	1,432.00	20,620,800	
アークス	39,800	2,080.00	82,784,000	貸付有価証券 18,700株
バローホールディングス	43,100	1,994.00	85,941,400	
藤久	1,500	739.00	1,108,500	貸付有価証券 600株
ベルク	9,600	6,210.00	59,616,000	貸付有価証券 4,500株
大庄	10,400	1,118.00	11,627,200	貸付有価証券 4,800株
ファーストリテイリング	26,000	48,300.00	1,255,800,000	貸付有価証券 4,500株(1,000株)
サンドラッグ	73,200	3,665.00	268,278,000	
サクスパーホールディングス	16,500	543.00	8,959,500	
ヤマザワ	4,500	1,693.00	7,618,500	

やまや	4,000	2,102.00	8,408,000	
ベルーナ	41,800	459.00	19,186,200	貸付有価証券 400株
島根銀行	3,900	404.00	1,575,600	
じもとホールディングス	131,800	91.00	11,993,800	
めぶきフィナンシャルグループ	1,013,200	219.00	221,890,800	貸付有価証券 163,700株
東京きらぼしフィナンシャルグループ	26,300	1,084.00	28,509,200	
九州フィナンシャルグループ	320,000	433.00	138,560,000	貸付有価証券 1,600株
ゆうちょ銀行	552,400	993.00	548,533,200	貸付有価証券 259,600株（2,700株）
富山第一銀行	46,500	264.00	12,276,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,146,900	305.00	349,804,500	貸付有価証券 1,500株
西日本フィナンシャルホールディングス	132,900	588.00	78,145,200	
関西みらいフィナンシャルグループ	114,400	312.00	35,692,800	貸付有価証券 3,400株
三十三フィナンシャルグループ	18,100	1,445.00	26,154,500	
第四北越フィナンシャルグループ	33,800	2,135.00	72,163,000	貸付有価証券 1,000株
新生銀行	143,100	1,300.00	186,030,000	貸付有価証券 4,600株
あおぞら銀行	116,200	1,866.00	216,829,200	貸付有価証券 10,700株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	13,339,000	409.90	5,467,656,100	貸付有価証券 23,400株
りそなホールディングス	2,139,900	312.80	669,360,720	貸付有価証券 5,700株
三井住友トラスト・ホールディングス	368,600	3,043.00	1,121,649,800	
三井住友フィナンシャルグループ	1,348,600	2,648.50	3,571,767,100	
千葉銀行	650,800	481.00	313,034,800	貸付有価証券 8,100株
群馬銀行	383,200	339.00	129,904,800	貸付有価証券 6,200株
武蔵野銀行	29,100	1,252.00	36,433,200	
千葉興業銀行	53,500	234.00	12,519,000	貸付有価証券



				3,600株
筑波銀行	81,100	158.00	12,813,800	
七十七銀行	65,900	1,356.00	89,360,400	貸付有価証券 100株
青森銀行	15,100	2,051.00	30,970,100	貸付有価証券 700株
秋田銀行	12,500	1,309.00	16,362,500	貸付有価証券 600株
山形銀行	21,900	1,278.00	27,988,200	貸付有価証券 400株
岩手銀行	12,800	2,474.00	31,667,200	
東邦銀行	174,400	243.00	42,379,200	
東北銀行	9,300	829.00	7,709,700	
みちのく銀行	12,500	1,050.00	13,125,000	
ふくおかフィナンシャル グループ	164,300	1,347.00	221,312,100	
静岡銀行	482,900	619.00	298,915,100	貸付有価証券 300株
十六銀行	24,400	1,844.00	44,993,600	
スルガ銀行	199,500	352.00	70,224,000	貸付有価証券 30,200株
八十二銀行	470,600	369.00	173,651,400	貸付有価証券 200株
山梨中央銀行	22,600	732.00	16,543,200	
大垣共立銀行	38,500	2,124.00	81,774,000	貸付有価証券 100株
福井銀行	16,700	1,469.00	24,532,300	
北國銀行	20,100	3,410.00	68,541,000	貸付有価証券 400株
清水銀行	8,000	1,646.00	13,168,000	
富山銀行	3,800	1,977.00	7,512,600	
滋賀銀行	39,100	2,556.00	99,939,600	貸付有価証券 7,200株(6,300株)
南都銀行	32,400	2,225.00	72,090,000	
百五銀行	175,500	306.00	53,703,000	
京都銀行	69,800	3,575.00	249,535,000	
紀陽銀行	69,000	1,568.00	108,192,000	
ほくほくフィナンシャル グループ	129,800	841.00	109,161,800	
広島銀行	287,800	431.00	124,041,800	貸付有価証券

				200株
山陰合同銀行	115,600	553.00	63,926,800	
中国銀行	167,800	980.00	164,444,000	
鳥取銀行	6,600	1,102.00	7,273,200	
伊予銀行	278,200	601.00	167,198,200	貸付有価証券 5,300株
百十四銀行	20,700	1,916.00	39,661,200	貸付有価証券 200株
四国銀行	29,600	811.00	24,005,600	貸付有価証券 13,100株
阿波銀行	31,800	2,429.00	77,242,200	貸付有価証券 1,500株
大分銀行	11,200	1,936.00	21,683,200	
宮崎銀行	13,000	2,228.00	28,964,000	
佐賀銀行	11,800	1,000.00	11,800,000	貸付有価証券 500株
沖縄銀行	17,900	3,105.00	55,579,500	
琉球銀行	45,000	958.00	43,110,000	
セブン銀行	651,400	294.00	191,511,600	貸付有価証券 20,400株
みずほフィナンシャルグループ	26,496,800	119.60	3,169,017,280	
高知銀行	7,100	706.00	5,012,600	
山口フィナンシャルグループ	243,400	552.00	134,356,800	
長野銀行	6,400	1,014.00	6,489,600	
名古屋銀行	15,800	2,106.00	33,274,800	
北洋銀行	293,900	186.00	54,665,400	
愛知銀行	7,100	2,957.00	20,994,700	
中京銀行	8,000	1,941.00	15,528,000	
大光銀行	6,700	1,388.00	9,299,600	
愛媛銀行	27,200	1,100.00	29,920,000	
トマト銀行	7,500	995.00	7,462,500	
京葉銀行	83,100	504.00	41,882,400	
栃木銀行	94,200	149.00	14,035,800	
北日本銀行	6,100	1,824.00	11,126,400	
東和銀行	34,200	615.00	21,033,000	
福島銀行	18,400	152.00	2,796,800	貸付有価証券 4,600株（800株）

大東銀行	10,100	534.00	5,393,400	
トモニホールディングス	150,700	379.00	57,115,300	貸付有価証券 2,400株
フィデアホールディングス	189,300	96.00	18,172,800	
池田泉州ホールディングス	224,200	160.00	35,872,000	貸付有価証券 200株
F P G	60,100	492.00	29,569,200	貸付有価証券 25,900株
マーキュリアインベストメント	8,600	562.00	4,833,200	
S B I ホールディングス	217,800	1,714.00	373,309,200	貸付有価証券 10,300株
日本アジア投資	16,500	195.00	3,217,500	貸付有価証券 5,000株
ジャフコ	30,000	3,005.00	90,150,000	貸付有価証券 100株
大和証券グループ本社	1,564,700	419.00	655,609,300	
野村ホールディングス	3,431,100	428.90	1,471,598,790	
岡三証券グループ	166,100	317.00	52,653,700	貸付有価証券 1,000株
丸三証券	57,900	417.00	24,144,300	貸付有価証券 17,600株
東洋証券	69,700	121.00	8,433,700	貸付有価証券 400株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	223,900	224.00	50,153,600	
光世証券	4,700	516.00	2,425,200	貸付有価証券 800株
水戸証券	56,400	189.00	10,659,600	
いちよし証券	36,500	412.00	15,038,000	
松井証券	111,400	786.00	87,560,400	貸付有価証券 8,300株（2,100株）
だいこう証券ビジネス	9,400	489.00	4,596,600	貸付有価証券 200株
マネックスグループ	147,100	193.00	28,390,300	貸付有価証券 60,300株（37,600株）
極東証券	26,200	503.00	13,178,600	
岩井コスモホールディングス	18,400	906.00	16,670,400	
藍澤証券	35,000	720.00	25,200,000	

マネーパートナーズグループ	20,700	192.00	3,974,400	貸付有価証券 4,200株
スパークス・グループ	67,500	172.00	11,610,000	
小林洋行	5,600	225.00	1,260,000	貸付有価証券 1,900株
かんぼ生命保険	69,100	1,282.00	88,586,200	貸付有価証券 22,700株（2,600株）
S O M P Oホールディングス	366,700	3,255.00	1,193,608,500	貸付有価証券 100株
アニコム ホールディングス	16,100	4,090.00	65,849,000	貸付有価証券 600株
M S & A Dインシュアランスグループホール	509,800	2,991.50	1,525,066,700	
ソニーフィナンシャルホールディングス	160,200	1,841.00	294,928,200	貸付有価証券 800株
第一生命ホールディングス	1,103,400	1,224.50	1,351,113,300	
東京海上ホールディングス	697,300	4,840.00	3,374,932,000	貸付有価証券 3,700株
T & Dホールディングス	582,800	824.00	480,227,200	
アドバンスクリエイト	4,600	1,773.00	8,155,800	貸付有価証券 600株
全国保証	55,000	2,765.00	152,075,000	貸付有価証券 7,500株
ジェイリース	5,400	209.00	1,128,600	貸付有価証券 200株
イントラスト	6,800	614.00	4,175,200	
日本モーゲージサービス	3,900	1,520.00	5,928,000	
C a s a	6,800	1,055.00	7,174,000	
アルヒ	31,000	1,203.00	37,293,000	貸付有価証券 9,600株（5,800株）
プレミアグループ	10,600	1,455.00	15,423,000	
クレディセゾン	136,600	1,083.00	147,937,800	貸付有価証券 8,500株
芙蓉総合リース	20,500	5,160.00	105,780,000	
みずほリース	30,100	1,981.00	59,628,100	
東京センチュリー	39,300	3,355.00	131,851,500	
日本証券金融	85,900	488.00	41,919,200	貸付有価証券 300株
アイフル	297,500	214.00	63,665,000	貸付有価証券 7,600株

リコーリース	15,300	2,744.00	41,983,200	
イオンフィナンシャルサービス	119,300	967.00	115,363,100	貸付有価証券 700株
アコム	391,900	440.00	172,436,000	貸付有価証券 900株
ジャックス	21,500	1,542.00	33,153,000	貸付有価証券 600株
オリエントコーポレーション	527,400	114.00	60,123,600	貸付有価証券 400株
日立キャピタル	46,000	1,915.00	88,090,000	
アプラスフィナンシャル	93,600	58.00	5,428,800	貸付有価証券 9,100株(3,400株)
オリックス	1,219,600	1,188.00	1,448,884,800	
三菱UFJリース	494,900	493.00	243,985,700	
九州リースサービス	9,600	422.00	4,051,200	
日本取引所グループ	559,700	2,145.00	1,200,556,500	貸付有価証券 5,000株
イー・ギャランティ	20,900	1,937.00	40,483,300	貸付有価証券 500株
アサックス	10,100	613.00	6,191,300	貸付有価証券 4,000株
NECキャピタルソリューション	7,900	1,808.00	14,283,200	
いちご	248,200	235.00	58,327,000	貸付有価証券 13,800株
日本駐車場開発	213,900	128.00	27,379,200	貸付有価証券 8,600株
スター・マイカ・ホールディングス	10,100	1,318.00	13,311,800	貸付有価証券 1,900株
ADワークスグループ	35,700	154.00	5,497,800	貸付有価証券 400株
ヒューリック	416,400	983.00	409,321,200	貸付有価証券 32,900株(12,300株)
三栄建築設計	7,800	1,219.00	9,508,200	
野村不動産ホールディングス	118,300	1,628.00	192,592,400	貸付有価証券 1,600株
三重交通グループホールディングス	39,500	451.00	17,814,500	貸付有価証券 18,100株
サムティ	27,600	1,321.00	36,459,600	貸付有価証券 1,600株
ディア・ライフ	25,000	394.00	9,850,000	貸付有価証券

				100株
コーセーアールイー	5,700	421.00	2,399,700	貸付有価証券 700株
日本商業開発	12,300	1,303.00	16,026,900	貸付有価証券 5,400株
プレサンスコーポレーション	32,000	1,021.00	32,672,000	貸付有価証券 5,100株（400株）
ユニゾホールディングス	29,400	5,980.00	175,812,000	貸付有価証券 5,200株
THEグローバル社	9,200	307.00	2,824,400	貸付有価証券 3,200株（1,900株）
ハウスコム	2,500	1,353.00	3,382,500	
日本管理センター	12,800	1,006.00	12,876,800	
サンセイランディック	5,700	663.00	3,779,100	
エストラスト	2,600	565.00	1,469,000	
フージャースホールディングス	38,900	600.00	23,340,000	貸付有価証券 4,500株（4,500株）
オープンハウス	56,600	2,155.00	121,973,000	貸付有価証券 100株
東急不動産ホールディングス	530,200	486.00	257,677,200	貸付有価証券 1,900株
飯田グループホールディングス	162,700	1,360.00	221,272,000	
イーグランド	3,100	604.00	1,872,400	
ムゲンエステート	13,500	439.00	5,926,500	貸付有価証券 6,300株
ビーロット	9,100	586.00	5,332,600	
ファーストブラザーズ	4,400	596.00	2,622,400	
ハウズドゥ	9,600	703.00	6,748,800	貸付有価証券 4,400株
シーアールイー	4,800	1,140.00	5,472,000	
プロパティエージェント	3,100	816.00	2,529,600	
ケイアイスター不動産	6,100	1,031.00	6,289,100	
アグレ都市デザイン	3,100	405.00	1,255,500	貸付有価証券 200株
グッドコムアセット	4,500	1,439.00	6,475,500	貸付有価証券 1,700株
ジェイ・エス・ビー	2,100	4,360.00	9,156,000	
テンポイノベーション	4,400	656.00	2,886,400	貸付有価証券 2,000株（200株）

グローバル・リンク・マネジメント	3,300	518.00	1,709,400	
パーク24	104,700	1,435.00	150,244,500	貸付有価証券 2,000株
パラカ	5,000	1,530.00	7,650,000	
三井不動産	961,700	1,813.00	1,743,562,100	貸付有価証券 2,400株
三菱地所	1,366,300	1,701.50	2,324,759,450	貸付有価証券 5,900株
平和不動産	35,800	2,666.00	95,442,800	貸付有価証券 900株
東京建物	205,400	1,075.00	220,805,000	貸付有価証券 18,300株
ダイビル	50,200	829.00	41,615,800	貸付有価証券 100株
京阪神ビルディング	31,600	1,359.00	42,944,400	
住友不動産	438,300	2,704.50	1,185,382,350	貸付有価証券 4,600株
テーオーシー	38,300	615.00	23,554,500	
東京楽天地	3,200	4,030.00	12,896,000	
レオパレス21	255,500	225.00	57,487,500	貸付有価証券 113,400株(46,600株)
スターツコーポレーション	26,500	2,005.00	53,132,500	
フジ住宅	22,600	460.00	10,396,000	貸付有価証券 100株(100株)
空港施設	19,500	402.00	7,839,000	
明和地所	10,700	409.00	4,376,300	
ゴールドクレスト	15,400	1,583.00	24,378,200	貸付有価証券 4,100株
エスリード	7,600	1,254.00	9,530,400	
日神グループホールディングス	28,800	375.00	10,800,000	
日本エスコン	35,300	596.00	21,038,800	貸付有価証券 8,200株(8,200株)
タカラレーベン	89,100	338.00	30,115,800	
A V A N T I A	11,000	625.00	6,875,000	
イオンモール	97,800	1,232.00	120,489,600	
毎日コムネット	5,000	748.00	3,740,000	
ファースト住建	8,300	997.00	8,275,100	貸付有価証券

				700株
カチタス	48,300	1,655.00	79,936,500	貸付有価証券 22,400株
トーセイ	26,900	985.00	26,496,500	貸付有価証券 12,600株
穴吹興産	4,200	1,427.00	5,993,400	
サンフロンティア不動産	26,900	776.00	20,874,400	
エフ・ジェー・ネクスト	17,000	786.00	13,362,000	貸付有価証券 5,900株
インテリックス	5,500	494.00	2,717,000	貸付有価証券 1,300株(1,300株)
ランドビジネス	8,200	278.00	2,279,600	
日本社宅サービス	4,500	994.00	4,473,000	
グランディハウス	15,100	311.00	4,696,100	
日本空港ビルデング	62,200	3,950.00	245,690,000	貸付有価証券 6,000株
日本工営	12,700	2,780.00	35,306,000	貸付有価証券 100株
L I F U L L	65,900	308.00	20,297,200	
ジェイエシーリクルートメント	12,700	1,032.00	13,106,400	貸付有価証券 2,400株(2,100株)
日本M&Aセンター	142,700	3,420.00	488,034,000	貸付有価証券 4,000株
メンバーズ	5,600	1,435.00	8,036,000	貸付有価証券 200株
中広	1,900	469.00	891,100	
UTグループ	22,300	1,230.00	27,429,000	貸付有価証券 10,400株(4,900株)
アイティメディア	5,700	912.00	5,198,400	貸付有価証券 2,000株(1,100株)
タケエイ	18,100	705.00	12,760,500	
E・Jホールディングス	3,300	1,299.00	4,286,700	
ビーネックスグループ	23,600	550.00	12,980,000	貸付有価証券 300株
コシダカホールディングス	45,500	399.00	18,154,500	貸付有価証券 21,300株
アルトナー	4,600	563.00	2,589,800	
パソナグループ	20,500	1,000.00	20,500,000	貸付有価証券 3,100株
C D S	4,700	1,182.00	5,555,400	



リンクアンドモチベーション	41,600	309.00	12,854,400	貸付有価証券 19,300株(5,300株)
G C A	22,800	599.00	13,657,200	
エス・エム・エス	58,800	2,175.00	127,890,000	貸付有価証券 100株
サニーサイドアップグループ	4,900	578.00	2,832,200	
パーソルホールディングス	188,900	1,000.00	188,900,000	
リニカル	9,100	857.00	7,798,700	貸付有価証券 2,500株
クックパッド	65,900	305.00	20,099,500	貸付有価証券 500株
エスクリ	5,900	338.00	1,994,200	貸付有価証券 2,300株
アイ・ケイ・ケイ	9,200	611.00	5,621,200	貸付有価証券 4,300株
学情	6,700	1,065.00	7,135,500	貸付有価証券 2,200株
スタジオアリス	9,500	1,368.00	12,996,000	
シミックホールディングス	10,500	1,415.00	14,857,500	
エプロ	3,000	852.00	2,556,000	
N J S	4,200	1,443.00	6,060,600	
総合警備保障	75,200	5,460.00	410,592,000	
カカクコム	139,600	2,226.00	310,749,600	貸付有価証券 13,500株
セントケア・ホールディング	12,200	393.00	4,794,600	貸付有価証券 6,600株
サイネックス	3,200	599.00	1,916,800	
ルネサンス	10,500	907.00	9,523,500	貸付有価証券 3,800株
ディップ	26,600	1,803.00	47,959,800	貸付有価証券 1,500株
オプトホールディング	10,200	1,451.00	14,800,200	貸付有価証券 900株
新日本科学	20,400	636.00	12,974,400	貸付有価証券 2,300株
ツクイ	44,500	390.00	17,355,000	貸付有価証券 100株
キャリアデザインセン	4,800	805.00	3,864,000	

ター				
ベネフィット・ワン	51,600	1,870.00	96,492,000	貸付有価証券 4,600株（1,300株）
エムスリー	416,600	3,930.00	1,637,238,000	貸付有価証券 500株
ツカダ・グローバルホールディング	12,000	326.00	3,912,000	貸付有価証券 5,500株
プラス	2,100	387.00	812,700	
アウトソーシング	108,100	422.00	45,618,200	貸付有価証券 800株
ウェルネット	19,100	470.00	8,977,000	
ワールドホールディングス	6,200	1,211.00	7,508,200	貸付有価証券 200株
ディー・エヌ・エー	92,600	1,291.00	119,546,600	貸付有価証券 1,100株
博報堂D Yホールディングス	262,800	1,045.00	274,626,000	貸付有価証券 200株
ぐるなび	32,900	517.00	17,009,300	貸付有価証券 100株
タカミヤ	20,000	396.00	7,920,000	
ジャパンベストレスキューシステム	12,800	679.00	8,691,200	貸付有価証券 6,100株
ファンコミュニケーションズ	51,900	420.00	21,798,000	貸付有価証券 2,300株
ライク	6,200	1,394.00	8,642,800	貸付有価証券 2,900株（200株）
ビジネス・ブレークスルー	7,900	379.00	2,994,100	貸付有価証券 100株
エスプール	36,400	714.00	25,989,600	貸付有価証券 400株
WDBホールディングス	8,600	2,308.00	19,848,800	貸付有価証券 700株
手間いらず	1,200	4,150.00	4,980,000	貸付有価証券 500株
ティア	11,000	488.00	5,368,000	
CDG	2,000	1,368.00	2,736,000	
バリューコマース	10,600	1,871.00	19,832,600	貸付有価証券 400株（100株）
インフォマート	207,000	723.00	149,661,000	貸付有価証券 37,000株（4,500株）
J Pホールディングス	59,300	261.00	15,477,300	

E P S ホールディングス	28,400	1,142.00	32,432,800	
レグス	4,700	866.00	4,070,200	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
プレステージ・インター ナショナル	70,700	839.00	59,317,300	貸付有価証券 1,400株
アミューズ	10,300	2,137.00	22,011,100	貸付有価証券 100株
ドリームインキュベータ	5,700	1,094.00	6,235,800	貸付有価証券 600株(600株)
クイック	11,700	945.00	11,056,500	
T A C	11,400	161.00	1,835,400	貸付有価証券 800株
ケネディクス	176,000	436.00	76,736,000	貸付有価証券 82,600株
電通グループ	194,700	1,924.00	374,602,800	貸付有価証券 21,800株
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	7,200	534.00	3,844,800	
ぴあ	5,400	2,574.00	13,899,600	貸付有価証券 2,500株(1,400株)
イオンファンタジー	7,300	1,421.00	10,373,300	貸付有価証券 3,000株(2,000株)
シーティーエス	21,300	505.00	10,756,500	貸付有価証券 200株
ネクシィーズグループ	6,600	919.00	6,065,400	貸付有価証券 3,000株(1,900株)
みらかホールディングス	52,800	2,322.00	122,601,600	貸付有価証券 1,300株
アルプス技研	16,700	1,498.00	25,016,600	
ダイオーズ	3,700	1,004.00	3,714,800	貸付有価証券 2,100株
日本空調サービス	19,800	695.00	13,761,000	
オリエンタルランド	200,900	14,165.00	2,845,748,500	貸付有価証券 2,600株
ダスキン	48,500	2,744.00	133,084,000	
明光ネットワークジャ パン	22,200	738.00	16,383,600	
ファルコホールディング ス	10,400	1,610.00	16,744,000	貸付有価証券 200株
秀英予備校	4,100	374.00	1,533,400	貸付有価証券 100株

田谷	3,400	552.00	1,876,800	
ラウンドワン	52,700	761.00	40,104,700	貸付有価証券 24,700株（8,800株）
リゾートトラスト	86,600	1,012.00	87,639,200	貸付有価証券 14,200株
ビー・エム・エル	24,300	2,713.00	65,925,900	
ワタベウェディング	3,000	351.00	1,053,000	
りらいあコミュニケーションズ	34,100	1,071.00	36,521,100	
リソー教育	86,300	253.00	21,833,900	貸付有価証券 500株
早稲田アカデミー	6,100	1,043.00	6,362,300	
ユー・エス・エス	211,500	1,672.00	353,628,000	
東京個別指導学院	6,700	500.00	3,350,000	貸付有価証券 3,100株（3,100株）
サイバーエージェント	108,600	4,115.00	446,889,000	貸付有価証券 44,200株（700株）
楽天	880,600	896.00	789,017,600	貸付有価証券 112,900株
クリーク・アンド・リ バー社	9,700	854.00	8,283,800	貸付有価証券 300株
テー・オー・ダブリュー	30,100	253.00	7,615,300	
山田コンサルティンググ ループ	9,200	1,056.00	9,715,200	
セントラルスポーツ	7,000	2,015.00	14,105,000	貸付有価証券 3,100株
フルキャストホールディ ングス	18,900	1,191.00	22,509,900	
エン・ジャパン	33,600	2,099.00	70,526,400	貸付有価証券 1,800株
リソルホールディングス	2,000	3,045.00	6,090,000	
テクノプロ・ホールディ ングス	37,700	4,850.00	182,845,000	貸付有価証券 5,000株（5,000株）
アトラ	4,300	245.00	1,053,500	
インターワークス	3,600	338.00	1,216,800	
アイ・アールジャパン ホールディングス	7,700	6,830.00	52,591,000	貸付有価証券 300株
K e e P e r 技研	6,900	1,410.00	9,729,000	
ファーストロジック	4,400	577.00	2,538,800	貸付有価証券 500株（300株）
三機サービス	3,600	1,092.00	3,931,200	

Gunosy	11,700	752.00	8,798,400	
デザインワン・ジャパン	3,700	187.00	691,900	貸付有価証券 100株
イー・ガーディアン	9,600	1,718.00	16,492,800	貸付有価証券 1,200株
リブセンス	12,100	254.00	3,073,400	貸付有価証券 100株
ジャパンマテリアル	58,100	1,532.00	89,009,200	
ベクトル	23,500	733.00	17,225,500	貸付有価証券 11,000株（3,100株）
ウチヤマホールディングス	9,300	312.00	2,901,600	貸付有価証券 4,200株
チャーム・ケア・コーポレーション	16,100	800.00	12,880,000	貸付有価証券 6,300株
ライクキッズ	3,200	553.00	1,769,600	
キャリアリンク	6,200	454.00	2,814,800	
I B J	12,900	596.00	7,688,400	貸付有価証券 6,000株（2,000株）
アサンテ	7,600	1,465.00	11,134,000	
N・フィールド	13,000	399.00	5,187,000	
バリューHR	7,500	1,380.00	10,350,000	貸付有価証券 200株
M&Aキャピタルパートナーズ	13,400	2,740.00	36,716,000	貸付有価証券 1,600株
ライドオンエクスプレス ホールディングス	7,200	1,535.00	11,052,000	貸付有価証券 3,300株
E R Iホールディングス	5,300	631.00	3,344,300	
アピスト	2,900	1,813.00	5,257,700	
シグマクシス	12,900	1,482.00	19,117,800	貸付有価証券 100株
ウィルグループ	12,300	576.00	7,084,800	貸付有価証券 5,300株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	26,100	179.00	4,671,900	
リクルートホールディング ス	1,353,300	2,788.50	3,773,677,050	貸付有価証券 600株
エラン	11,200	1,665.00	18,648,000	貸付有価証券 200株
土木管理総合試験所	8,200	303.00	2,484,600	貸付有価証券 100株
ネットマーケティング	5,400	582.00	3,142,800	

日本郵政	1,548,400	823.30	1,274,797,720	貸付有価証券 1,700株
ベルシステム24ホールディングス	31,600	1,114.00	35,202,400	貸付有価証券 7,000株（5,800株）
鎌倉新書	14,200	1,016.00	14,427,200	貸付有価証券 6,300株（100株）
S M N	3,000	732.00	2,196,000	
一蔵	2,000	332.00	664,000	
L I T A L I C O	6,500	2,170.00	14,105,000	貸付有価証券 2,800株
グローバルキッズCOMPANY	2,800	506.00	1,416,800	
エアトリ	8,400	802.00	6,736,800	貸付有価証券 3,900株
アトラエ	4,900	2,598.00	12,730,200	貸付有価証券 1,800株
ストライク	7,100	4,190.00	29,749,000	貸付有価証券 1,300株
ソラスト	52,000	1,083.00	56,316,000	貸付有価証券 100株
セラク	5,900	741.00	4,371,900	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
インソース	9,200	2,058.00	18,933,600	貸付有価証券 3,400株（1,100株）
ベイカレント・コンサルティング	11,400	6,360.00	72,504,000	貸付有価証券 800株（300株）
Orchestra Holdings	3,900	787.00	3,069,300	
アイモバイル	5,300	569.00	3,015,700	貸付有価証券 2,400株
キャリアインデックス	7,700	257.00	1,978,900	貸付有価証券 3,600株（100株）
MS - Japan	6,100	675.00	4,117,500	貸付有価証券 400株（400株）
船場	3,100	848.00	2,628,800	
グレイステクノロジー	8,600	2,852.00	24,527,200	貸付有価証券 900株
ジャパンエレベーターサービスホールディング	19,900	2,693.00	53,590,700	貸付有価証券 7,800株（300株）
フルテック	2,600	1,200.00	3,120,000	
グリーンズ	4,700	386.00	1,814,200	

ツナググループ・ホールディングス	2,300	386.00	887,800	貸付有価証券 1,000株
GameWith	4,200	546.00	2,293,200	貸付有価証券 1,600株
ソウルドアウト	2,900	1,968.00	5,707,200	貸付有価証券 100株
MS&Consulting	2,600	426.00	1,107,600	
ミダック	1,800	991.00	1,783,800	貸付有価証券 500株
日総工産	12,500	412.00	5,150,000	貸付有価証券 700株
キュービーネットホールディングス	7,800	1,600.00	12,480,000	
RPAホールディングス	10,700	617.00	6,601,900	貸付有価証券 4,500株
スプリックス	6,400	817.00	5,228,800	貸付有価証券 2,400株（2,200株）
マネジメントソリューションズ	6,100	1,055.00	6,435,500	貸付有価証券 1,200株（300株）
and factory	1,800	949.00	1,708,200	貸付有価証券 700株（700株）
カーブスホールディングス	46,800	450.00	21,060,000	貸付有価証券 300株
フォーラムエンジニアリング	12,800	749.00	9,587,200	貸付有価証券 6,000株
アドバンテッジリスクマネジメント	9,500	725.00	6,887,500	貸付有価証券 1,300株
リログループ	103,300	2,183.00	225,503,900	
東祥	11,800	851.00	10,041,800	貸付有価証券 5,100株
エイチ・アイ・エス	29,400	1,230.00	36,162,000	貸付有価証券 13,100株（900株）
ラックランド	4,400	1,705.00	7,502,000	
共立メンテナンス	31,300	2,197.00	68,766,100	貸付有価証券 100株
イチネンホールディングス	21,200	1,056.00	22,387,200	
建設技術研究所	13,000	1,617.00	21,021,000	
スペース	12,200	999.00	12,187,800	
長大	6,900	767.00	5,292,300	

燦ホールディングス	8,200	1,207.00	9,897,400	
スバル興業	1,100	7,690.00	8,459,000	
東京テアトル	7,400	1,143.00	8,458,200	
タナベ経営	3,600	1,226.00	4,413,600	
ナガワ	6,000	6,740.00	40,440,000	貸付有価証券 300株
よみうりランド	4,100	3,330.00	13,653,000	貸付有価証券 300株
東京都競馬	12,400	3,265.00	40,486,000	
常磐興産	7,600	1,290.00	9,804,000	貸付有価証券 200株
カナモト	30,900	2,015.00	62,263,500	貸付有価証券 2,700株
東京ドーム	76,500	731.00	55,921,500	貸付有価証券 33,300株
西尾レントオール	19,200	2,058.00	39,513,600	
トランス・コスモス	18,000	1,972.00	35,496,000	貸付有価証券 900株
乃村工藝社	81,000	729.00	59,049,000	貸付有価証券 38,000株
藤田観光	8,200	1,615.00	13,243,000	貸付有価証券 3,800株
KNT-CTホールディングス	11,700	791.00	9,254,700	貸付有価証券 5,000株（100株）
日本管財	20,200	1,800.00	36,360,000	
トーカイ	18,300	2,784.00	50,947,200	
白洋舎	2,200	2,480.00	5,456,000	
セコム	200,500	8,951.00	1,794,675,500	貸付有価証券 900株
セントラル警備保障	9,100	4,030.00	36,673,000	貸付有価証券 100株
丹青社	35,700	627.00	22,383,900	貸付有価証券 200株
メイテック	23,400	4,215.00	98,631,000	貸付有価証券 100株
応用地質	20,300	1,172.00	23,791,600	貸付有価証券 100株
船井総研ホールディングス	39,000	2,154.00	84,006,000	貸付有価証券 200株
進学会ホールディングス	7,400	536.00	3,966,400	貸付有価証券 100株



	オオバ	13,600	516.00	7,017,600	貸付有価証券 100株（100株）
	いであ	3,500	1,443.00	5,050,500	
	学究社	5,500	1,090.00	5,995,000	
	ベネッセホールディングス	62,900	3,100.00	194,990,000	貸付有価証券 300株
	イオンディライト	23,300	3,075.00	71,647,500	
	ナック	10,400	817.00	8,496,800	貸付有価証券 2,700株
	ニチイ学館	26,900	1,070.00	28,783,000	
	ダイセキ	31,700	2,232.00	70,754,400	貸付有価証券 14,800株
	ステップ	6,900	1,351.00	9,321,900	
小計	銘柄数：2,151 組入時価比率：97.5%			390,882,128,580 100.0%	
合計				390,882,128,580	

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

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

(2)株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	個数	評価額	備考
新株予約権証券	日本円	千葉興業銀行	52,900		0
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	52,900		0 0.0%
合計					0

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 4月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引 株価指数先物取引 買建	9,792,315,553	-	9,596,850,000	195,804,628

合計	9,792,315,553	-	9,596,850,000	195,804,628
----	---------------	---	---------------	-------------

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(2020年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	3,120,461,821
コール・ローン	748,083,121
株式	558,859,166,806
投資証券	15,299,078,156
派生商品評価勘定	516,941,499
未収入金	1,535,576
未収配当金	611,836,576
差入委託証拠金	2,945,136,440
流動資産合計	582,102,239,995
資産合計	582,102,239,995
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	31,123,329
未払解約金	766,624,133
未払利息	882
その他未払費用	3,468,900
流動負債合計	801,217,244
負債合計	801,217,244
純資産の部	
元本等	
元本	234,207,680,093
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	347,093,342,658
元本等合計	581,301,022,751
純資産合計	581,301,022,751
負債純資産合計	582,102,239,995

## 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。
-------------------	---

	<p>投資証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引 計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.4820円
(10,000口当たり純資産額)	(24,820円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日	
<p>1. 金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p>	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在

### 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

### 2.時価の算定方法

#### 株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

#### 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

#### コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### （その他の注記）

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4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	60,761,820,656円
同期中における一部解約元本額	32,574,786,630円
期末元本額	234,207,680,093円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	48,039,541円
バランスセレクト50	147,740,559円
バランスセレクト70	158,105,510円

野村外国株式インデックスファンド	522,689,497円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	5,158,384,467円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	6,816,409,083円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,688,767,373円
野村資産設計ファンド2015	17,960,689円
野村資産設計ファンド2020	20,278,338円
野村資産設計ファンド2025	33,068,615円
野村資産設計ファンド2030	40,348,933円
野村資産設計ファンド2035	31,073,915円
野村資産設計ファンド2040	64,442,100円
野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	36,281,405,301円
のむらップ・ファンド(保守型)	1,208,331,157円
のむらップ・ファンド(普通型)	8,716,217,122円
のむらップ・ファンド(積極型)	5,836,000,561円
野村資産設計ファンド2045	9,545,218円
野村インデックスファンド・外国株式	5,239,573,761円
マイ・ロード	1,497,755,894円
ネクストコア	11,707,262円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	130,796,832円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,589,854,403円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	607,510,683円
野村資産設計ファンド2050	15,747,156円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,410,981円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,450,053円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,927,334円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,195,125円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	219,247,303円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	460,067,754円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,672,139円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,386,639円
インデックス・ブレンド(タイプ)	21,550,389円
インデックス・ブレンド(タイプ)	7,469,382円
インデックス・ブレンド(タイプ)	28,611,732円
野村6資産均等バランス	709,044,041円
野村つみたて外国株投信	4,526,019,751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)	3,650,425,740円
世界6資産分散ファンド	72,615,879円
野村資産設計ファンド2060	5,355,129円
野村スリーゼロ先進国株式投信	3,199,060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	503,832,879円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	1,306,209,579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)	279,862,721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)	197,800,176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)	1,270,762,969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)	2,336,956,144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)	2,932,981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)	7,204,525円

ワールド・インデックス・ファンドV A積極型(適格機関投資家専用)	759,839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)	3,683,070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)	52,413,376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)	15,941,557円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	15,561,018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)	46,527,651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)	168,759,299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)	3,159,639,377円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	50,404,871円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	30,716,895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)	1,077,431,370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)	16,291,958,010円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	171,376円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	1,982,969円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	11,427,119円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	12,371,453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)	67,969,191,892円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	3,022,019,775円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	10,230,673,704円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,964,128,693円
マイバランスDC30	1,082,968,421円
マイバランスDC50	2,053,945,666円
マイバランスDC70	1,586,750,810円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	22,598,650,040円
野村DC運用戦略ファンド	173,609,662円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	13,140,801円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	307,309,268円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	258,828,369円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	196,787,818円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	12,505,984円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	6,556,922円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	25,246,188円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	3,139,004円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,419,687円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	2,340,664円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	104,631,636円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	69,677,152円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	29,754,886円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	34,711,155円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	978,271円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	101,000	12.75	1,287,750.00	
		HALLIBURTON CO	147,000	7.46	1,096,620.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	58,000	11.48	665,840.00	
		SCHLUMBERGER LTD	224,000	14.69	3,290,560.00	
		TECHNIPFMC PLC	61,000	7.53	459,330.00	
		APACHE CORPORATION	54,100	8.57	463,637.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	64,000	21.03	1,345,920.00	
		CHENIERE ENERGY INC	36,400	41.30	1,503,320.00	
		CHEVRON CORP	301,500	81.64	24,614,460.00	
		CONCHO RESOURCES INC	31,000	49.61	1,537,910.00	
		CONOCOPHILLIPS	176,300	33.19	5,851,397.00	
		CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	13,900	11.02	153,178.00	
		DEVON ENERGY CORP	62,400	9.05	564,720.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	23,100	31.40	725,340.00	
		EOG RESOURCES INC	93,900	40.50	3,802,950.00	
		EXXON MOBIL CORP	674,500	40.96	27,627,520.00	
		HESS CORP	43,200	36.37	1,571,184.00	
		HOLLYFRONTIER CORP	23,600	26.58	627,288.00	
		KINDER MORGAN INC	326,000	14.46	4,713,960.00	
		MARATHON OIL CORP	123,000	4.24	521,520.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	105,000	23.72	2,490,600.00	
		NOBLE ENERGY INC	71,000	6.72	477,475.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	142,000	12.34	1,752,280.00	
		ONEOK INC	67,000	26.93	1,804,310.00	
		PHILLIPS 66	70,300	56.80	3,993,040.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	26,100	73.47	1,917,567.00	
		TARGA RESOURCES CORP	34,800	7.84	272,832.00	
		VALERO ENERGY CORP	65,900	49.45	3,258,755.00	
WILLIAMS COS	191,000	18.02	3,441,820.00			
AIR PRODUCTS	35,300	207.39	7,320,867.00			

ALBEMARLE CORP	16,700	57.86	966,262.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	36,000	17.05	613,800.00
CELANESE CORP-SERIES A	19,600	73.46	1,439,816.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	35,300	26.86	948,158.00
CORTEVA INC	120,000	24.27	2,912,400.00
DOW INC	119,600	30.88	3,693,248.00
DUPONT DE NEMOURS INC	119,400	39.07	4,664,958.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	20,800	52.72	1,096,576.00
ECOLAB INC	41,300	170.16	7,027,608.00
FMC CORP	21,100	83.59	1,763,749.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	16,600	122.17	2,028,022.00
LINDE PLC	85,100	178.88	15,222,688.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	42,100	46.63	1,963,123.00
MOSAIC CO/THE	56,000	10.89	609,840.00
PPG INDUSTRIES	36,800	88.01	3,238,768.00
RPM INTERNATIONAL INC	21,100	62.82	1,325,502.00
SHERWIN-WILLIAMS	13,220	484.90	6,410,378.00
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5,000	38.03	190,150.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	9,700	179.25	1,738,725.00
VULCAN MATERIALS CO	20,800	106.00	2,204,800.00
AMCOR PLC	250,000	8.26	2,065,000.00
AVERY DENNISON CORP	13,400	103.26	1,383,684.00
BALL CORP	49,800	65.54	3,263,892.00
CROWN HOLDINGS INC	21,200	59.48	1,260,976.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	59,800	30.12	1,801,176.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	14,500	85.68	1,242,360.00
SEALED AIR CORP	26,500	28.18	746,770.00
WESTROCK CO	38,700	29.07	1,125,009.00
FREEMONT-MCMORAN INC	225,000	7.41	1,667,250.00
NEWMONT CORP	130,500	59.27	7,734,735.00
NUCOR CORP	46,700	36.05	1,683,535.00
STEEL DYNAMICS	33,400	22.22	742,148.00
BOEING CO	84,700	136.33	11,547,151.00
GENERAL DYNAMICS	39,200	131.69	5,162,248.00
HEICO CORP	6,300	75.69	476,847.00



HEICO CORP-CLASS A	12,400	67.10	832,040.00	
HOWMET AEROSPACE INC	57,000	10.59	603,630.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	6,500	184.45	1,198,925.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	35,200	187.78	6,609,856.00	
LOCKHEED MARTIN	40,230	373.44	15,023,491.20	
NORTHROP GRUMMAN CORP	25,630	333.68	8,552,218.40	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	241,600	62.65	15,136,240.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	14,600	19.37	282,802.00	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,770	304.80	1,758,696.00	
TEXTRON INC	37,900	26.15	991,085.00	
TRANSDIGM GROUP INC	7,660	307.75	2,357,365.00	
ALLEGION PLC	14,800	90.76	1,343,248.00	
CARRIER GLOBAL CORP	130,000	14.69	1,909,700.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	21,600	42.25	912,600.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	124,600	27.59	3,437,714.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,700	172.95	985,815.00	
MASCO CORP	46,300	38.46	1,780,698.00	
OWENS CORNING INC	16,800	37.23	625,464.00	
SMITH (A.O.) CORP	21,800	38.72	844,096.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	37,600	80.50	3,026,800.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	21,600	78.21	1,689,336.00	
ACUITY BRANDS INC	6,200	82.09	508,958.00	
AMETEK INC	35,500	73.91	2,623,805.00	
EATON CORP PLC	66,500	76.91	5,114,515.00	
EMERSON ELEC	97,300	50.77	4,939,921.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	18,700	164.46	3,075,402.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	24,500	31.68	776,160.00	
3M CORP	91,200	141.63	12,916,656.00	
GENERAL ELEC CO	1,385,000	6.48	8,974,800.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	113,200	132.00	14,942,400.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	35,400	50.40	1,784,160.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	33,300	23.26	774,558.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	16,410	310.58	5,096,617.80	
CATERPILLAR INC DEL	88,400	109.85	9,710,740.00	

CUMMINS INC	23,500	142.38	3,345,930.00
DEERE & COMPANY	47,100	134.06	6,314,226.00
DOVER CORP	22,900	84.51	1,935,279.00
FLOWSERVE CORP	20,600	23.93	492,958.00
FORTIVE CORP	47,600	55.84	2,657,984.00
IDEX CORP	12,300	148.63	1,828,149.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	51,100	151.77	7,755,447.00
INGERSOLL-RAND INC	58,000	26.38	1,530,040.00
MIDDLEBY CORP	8,700	49.27	428,649.00
OTIS WORLDWIDE CORP	65,000	45.90	2,983,500.00
PACCAR	55,900	65.72	3,674,027.50
PARKER HANNIFIN CORP	20,100	130.42	2,621,442.00
PENTAIR PLC	23,200	29.25	678,600.00
SNAP-ON INC	8,400	110.54	928,536.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	23,900	106.34	2,541,526.00
WABCO HOLDINGS INC	8,100	134.73	1,091,313.00
WABTEC CORP	28,800	50.06	1,441,728.00
XYLEM INC	27,800	68.08	1,892,624.00
AERCAP HOLDINGS NV	21,000	22.60	474,600.00
FASTENAL CO	92,100	34.14	3,144,294.00
GRAINGER(W.W.) INC	7,480	270.09	2,020,273.20
HD SUPPLY HOLDINGS INC	26,800	27.08	725,744.00
UNITED RENTALS INC	12,500	97.67	1,220,875.00
CINTAS CORP	14,200	190.50	2,705,100.00
COPART INC	33,700	66.14	2,229,086.50
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	35,900	76.57	2,748,863.00
ROLLINS INC	23,900	37.06	885,734.00
WASTE CONNECTIONS INC	42,300	84.02	3,554,046.00
WASTE MANAGEMENT INC	66,800	96.73	6,461,564.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	22,100	70.96	1,568,216.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	27,300	69.67	1,901,991.00
FEDEX CORPORATION	39,100	120.48	4,710,768.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	111,200	100.62	11,188,944.00
XPO LOGISTICS INC	14,300	57.90	827,970.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,600	11.00	160,600.00

DELTA AIR LINES INC	25,200	23.10	582,120.00	
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	30.11	596,178.00	
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	9,200	27.88	256,496.00	
AMERCO	1,170	259.17	303,228.90	
CSX CORP	118,400	59.48	7,042,432.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	13,200	99.88	1,318,416.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	16,000	131.01	2,096,160.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,800	35.19	731,952.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	41,500	150.00	6,225,000.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	15,300	124.17	1,899,801.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	65,500	27.19	1,780,945.00	
UNION PAC CORP	110,000	144.41	15,885,100.00	
APTIV PLC	41,500	58.35	2,421,525.00	
AUTOLIV INC	11,900	54.46	648,074.00	
BORGWARNER INC	35,000	25.51	892,850.00	
LEAR CORP	8,400	83.37	700,308.00	
FORD MOTOR COMPANY	607,000	4.77	2,895,390.00	
GENERAL MOTORS CO	205,000	21.24	4,354,200.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	22,400	17.74	397,376.00	
TESLA INC	21,580	686.72	14,819,417.60	
DR HORTON INC	53,800	38.02	2,045,476.00	
GARMIN LTD	20,500	78.04	1,599,820.00	
LEGGETT & PLATT INC	18,900	26.99	510,111.00	
LENNAR CORP-A	43,000	40.15	1,726,450.00	
MOHAWK INDUSTRIES	10,200	73.05	745,110.00	
NEWELL BRANDS INC	66,000	12.52	826,320.00	
NVR INC	559	2,805.44	1,568,240.96	
PULTEGROUP INC	43,000	24.18	1,039,740.00	
WHIRLPOOL CORP	9,400	98.18	922,892.00	
HASBRO INC	21,400	72.34	1,548,076.00	
POLARIS INC	8,300	59.12	490,696.00	
CAPRI HOLDINGS LTD	19,900	11.48	228,452.00	
HANESBRANDS INC	51,000	8.68	442,680.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	17,900	206.72	3,700,288.00	
	198,900	85.20	16,946,280.00	

NIKE INC-B			
PVH CORP	11,600	39.33	456,228.00
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	68.32	532,896.00
TAPESTRY INC	45,000	13.75	618,750.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	24,000	9.54	228,960.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	25,000	8.52	213,000.00
V F CORP	55,000	53.34	2,933,700.00
ARAMARK	41,000	20.43	837,630.00
CARNIVAL CORP	79,000	11.84	935,360.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	4,120	786.69	3,241,162.80
DARDEN RESTAURANTS INC	19,800	63.32	1,253,736.00
DOMINOS PIZZA INC	6,280	365.22	2,293,581.60
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	43,400	71.35	3,096,590.00
LAS VEGAS SANDS CORP	53,800	40.69	2,189,122.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	44,900	79.90	3,587,510.00
MCDONALD'S CORP	120,100	177.58	21,327,358.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	14.02	476,680.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	79,000	13.19	1,042,010.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	33,000	11.00	363,000.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26,600	34.43	915,838.00
STARBUCKS CORP	187,200	72.72	13,613,184.00
VAIL RESORTS INC	6,000	150.59	903,540.00
WYNN RESORTS LTD	15,500	70.40	1,091,200.00
YUM BRANDS INC	48,800	81.20	3,962,560.00
GENUINE PARTS CO	23,200	71.04	1,648,128.00
LKQ CORP	51,000	19.93	1,016,430.00
AMAZON.COM INC	67,070	2,328.12	156,147,008.40
BOOKING HOLDINGS INC	6,650	1,342.22	8,925,763.00
EBAY INC	124,500	37.61	4,682,445.00
EXPEDIA GROUP INC	22,900	57.25	1,311,025.00
GRUBHUB INC	14,500	40.93	593,485.00
MERCADOLIBRE INC	7,170	573.38	4,111,134.60
WAYFAIR INC - CLASS A	10,600	95.84	1,015,904.00
DOLLAR GENERAL CORP	40,900	178.74	7,310,466.00
DOLLAR TREE INC	37,600	77.74	2,923,024.00
	25,300	16.48	416,944.00

KOHL'S CORP				
NORDSTROM INC	15,000	16.68	250,200.00	
TARGET CORP	80,500	106.90	8,605,450.00	
ADVANCE AUTO PARTS	10,900	113.51	1,237,259.00	
AUTOZONE	3,820	978.85	3,739,207.00	
BEST BUY COMPANY INC	38,600	67.80	2,617,080.00	
BURLINGTON STORES INC	10,500	172.59	1,812,195.00	
CARMAX INC	26,100	63.58	1,659,438.00	
GAP INC	31,500	7.56	238,140.00	
HOME DEPOT	173,800	200.61	34,866,018.00	
LOWES COS INC	122,800	92.62	11,373,736.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,970	358.30	4,288,851.00	
ROSS STORES INC	57,700	82.70	4,771,790.00	
TIFFANY & CO	16,900	129.32	2,185,508.00	
TJX COS INC	193,500	46.05	8,910,675.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	19,300	93.13	1,797,409.00	
ULTA BEAUTY INC	9,200	201.57	1,854,444.00	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	70,460	301.33	21,231,711.80	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	4.62	207,900.00	
KROGER CO	126,900	32.17	4,082,373.00	
SYSCO CORP	75,800	49.10	3,721,780.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	120,900	42.55	5,144,295.00	
WALMART INC	226,700	129.21	29,291,907.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	50,000	60.29	3,014,500.00	
COCA COLA CO	648,700	45.38	29,438,006.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	35,100	38.82	1,362,582.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	26,800	153.02	4,100,936.00	
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	31,400	42.10	1,321,940.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	63,800	59.04	3,766,752.00	
PEPSICO INC	222,300	130.94	29,107,962.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	88,400	35.00	3,094,000.00	
BUNGE LIMITED	22,000	36.13	794,860.00	
CAMPBELL SOUP CO	27,400	50.44	1,382,056.00	
CONAGRA BRANDS INC	76,900	33.83	2,601,527.00	
GENERAL MILLS	97,100	59.78	5,804,638.00	
	23,500	141.62	3,328,070.00	

HERSHEY CO/THE				
HORMEL FOODS CORP	45,600	48.93	2,231,208.00	
INGREDION INC	11,200	77.44	867,328.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	18,600	117.36	2,182,896.00	
KELLOGG CO	40,000	65.52	2,620,800.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	108,800	28.47	3,097,536.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	23,900	55.71	1,331,469.00	
MCCORMICK & CO INC.	19,900	151.18	3,008,482.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	228,300	51.08	11,661,564.00	
TYSON FOODS INC-CL A	46,900	61.91	2,903,579.00	
ALTRIA GROUP INC	298,500	37.76	11,271,360.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	248,300	72.28	17,947,124.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	39,500	70.55	2,786,725.00	
CLOROX CO	20,100	190.77	3,834,477.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	129,300	70.61	9,129,873.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	54,500	139.47	7,601,115.00	
PROCTER & GAMBLE CO	397,200	119.68	47,536,896.00	
COTY INC-CL A	49,000	5.67	277,830.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	35,400	161.11	5,703,294.00	
ABBOTT LABORATORIES	281,900	94.05	26,512,695.00	
ABIOMED INC	7,200	164.50	1,184,400.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,800	187.26	2,209,668.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	77,200	90.10	6,955,720.00	
BECTON,DICKINSON	42,900	256.50	11,003,850.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	223,300	35.05	7,826,665.00	
DANAHER CORP	99,200	153.75	15,252,000.00	
DENTSPLY SIRONA INC	35,200	39.66	1,396,032.00	
DEXCOM INC	14,480	308.39	4,465,487.20	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	33,200	216.02	7,171,864.00	
HOLOGIC INC	43,300	42.35	1,833,755.00	
IDEXX LABORATORIES INC	13,600	259.23	3,525,528.00	
INSULET CORP	9,800	197.51	1,935,598.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	18,490	496.63	9,182,688.70	
MEDTRONIC PLC	213,800	97.61	20,869,018.00	
RESMED INC	22,500	157.35	3,540,375.00	
	13,800	147.78	2,039,364.00	

STERIS PLC			
STRYKER CORP	53,900	178.91	9,643,249.00
TELEFLEX INC	7,530	328.35	2,472,475.50
THE COOPER COMPANIES, INC.	8,070	288.53	2,328,437.10
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	14,200	104.10	1,478,220.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	11,800	165.20	1,949,360.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	33,200	112.14	3,723,048.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	23,900	85.57	2,045,123.00
ANTHEM INC	40,300	249.37	10,049,611.00
CARDINAL HEALTH INC	47,200	48.27	2,278,344.00
CENTENE CORP	92,100	66.24	6,100,704.00
CIGNA CORP	59,200	177.91	10,532,272.00
CVS HEALTH CORP	206,200	60.25	12,423,550.00
DAVITA INC	14,800	72.53	1,073,444.00
HCA HEALTHCARE INC	43,700	105.47	4,609,039.00
HENRY SCHEIN INC	23,100	52.03	1,201,893.00
HUMANA INC	21,070	358.86	7,561,180.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	15,800	148.18	2,341,244.00
MCKESSON CORP	25,600	132.44	3,390,464.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	22,000	94.46	2,078,120.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	150,920	274.19	41,380,754.80
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	13,200	97.78	1,290,696.00
ABBVIE INC	235,900	80.36	18,956,924.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	35,800	103.39	3,701,362.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	17,500	137.85	2,412,375.00
AMGEN INC	94,800	230.75	21,875,100.00
BEIGENE, LTD ADR	6,300	158.53	998,739.00
BIOGEN INC	28,870	329.01	9,498,518.70
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	28,000	90.72	2,540,160.00
EXACT SCIENCES CORP	22,600	76.51	1,729,126.00
GILEAD SCIENCES INC	200,400	78.53	15,737,412.00
INCYTE CORP	28,500	99.46	2,834,610.00
IONIS PHARMACEUTICALS INC	21,400	53.38	1,142,332.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	14,200	97.00	1,377,400.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	12,750	544.46	6,941,865.00

SAREPTA THERAPEUTICS INC	12,300	113.40	1,394,820.00
SEATTLE GENETICS INC	18,700	137.37	2,568,819.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	41,100	262.80	10,801,080.00
ALLERGAN PLC	52,100	184.04	9,588,484.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	373,900	60.59	22,654,601.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	60,000	23.88	1,432,800.00
ELI LILLY & CO.	137,800	152.67	21,037,926.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	9,000	103.25	929,250.00
JOHNSON & JOHNSON	419,100	149.68	62,730,888.00
MERCK & CO INC	405,700	78.56	31,871,792.00
MYLAN NV	86,000	15.13	1,301,180.00
PERRIGO CO PLC	19,600	49.69	973,924.00
PFIZER INC	882,000	35.62	31,416,840.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	179,000	9.76	1,747,040.00
ZOETIS INC	75,600	124.70	9,427,320.00
BANK OF AMERICA CORP	1,362,000	21.64	29,473,680.00
CITIGROUP	345,800	41.57	14,374,906.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	70,000	19.29	1,350,300.00
COMERICA INC	23,000	29.43	676,890.00
EAST WEST BANCORP INC	20,700	27.36	566,352.00
FIFTH THIRD BANCORP	112,000	16.26	1,821,120.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	27,100	97.73	2,648,483.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	169,000	7.80	1,318,200.00
JPMORGAN CHASE & CO	499,600	89.05	44,489,380.00
KEYCORP	158,000	10.32	1,630,560.00
M & T BANK CORP	20,000	104.63	2,092,600.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	71,000	10.98	779,580.00
PNC FINANCIAL	70,300	99.00	6,959,700.00
REGIONS FINANCIAL CORP	150,000	8.88	1,332,000.00
SIGNATURE BANK	8,900	87.68	780,352.00
SVB FINANCIAL GROUP	8,100	165.49	1,340,469.00
TRUIST FINANCIAL CORP	213,300	34.03	7,258,599.00
US BANCORP	235,700	32.73	7,714,461.00
WELLS FARGO CO	641,100	26.84	17,207,124.00
ZIONS BANCORP NA	27,500	28.65	787,875.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	209,400	183.48	38,420,712.00



EQUITABLE HOLDINGS INC	62,000	14.63	907,060.00	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	43,000	12.11	520,730.00	
VOYA FINANCIAL INC	21,700	41.13	892,521.00	
AFLAC INC	118,300	34.59	4,091,997.00	
ALLEGHANY CORP	2,300	532.90	1,225,670.00	
ALLSTATE CORP	52,100	100.09	5,214,689.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	12,500	62.80	785,000.00	
AMERICAN INTL GROUP	137,800	22.25	3,066,050.00	
AON PLC	36,900	178.18	6,574,842.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	63,900	25.29	1,616,031.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	29,700	77.54	2,302,938.00	
ASSURANT INC	9,000	101.15	910,350.00	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,200	22.25	471,700.00	
BROWN & BROWN INC	38,800	35.50	1,377,400.00	
CHUBB LTD	72,600	112.39	8,159,514.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	24,600	80.17	1,972,182.00	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,700	177.41	656,417.00	
EVEREST RE GROUP LTD	6,200	179.60	1,113,520.00	
FNF GROUP	45,400	24.86	1,128,644.00	
GLOBE LIFE INC	15,700	73.51	1,154,107.00	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	58,300	36.76	2,143,108.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	27.13	811,187.00	
LOEWS CORP	43,300	33.71	1,459,643.00	
MARKEL CORP	2,130	889.44	1,894,507.20	
MARSH & MCLENNAN COS	80,900	92.70	7,499,430.00	
METLIFE INC	125,000	31.46	3,932,500.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	44,400	28.43	1,262,292.00	
PROGRESSIVE CO	93,700	81.25	7,613,125.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	63,000	51.79	3,262,770.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	10,500	96.24	1,010,520.00	
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,700	148.34	993,878.00	
TRAVELERS COS INC/THE	40,800	101.78	4,152,624.00	
UNUM GROUP	31,200	14.39	448,968.00	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	20,200	182.50	3,686,500.00	
WR BERKLEY CORP	24,100	53.35	1,285,735.00	

ACCENTURE PLC-CL A	101,400	166.24	16,856,736.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	25,800	103.36	2,666,688.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,600	35.97	237,402.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	69,200	133.61	9,245,812.00
BLACK KNIGHT INC	24,200	65.98	1,596,716.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	22,600	73.49	1,660,874.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	17,900	107.36	1,921,744.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	86,600	50.99	4,415,734.00
DXC TECHNOLOGY CO	37,800	14.41	544,698.00
EPAM SYSTEMS INC	8,400	193.98	1,629,432.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	97,400	117.47	11,441,578.00
FISERV INC	92,500	91.76	8,487,800.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	13,800	204.30	2,819,340.00
GARTNER INC	14,100	101.58	1,432,278.00
GLOBAL PAYMENTS INC	47,300	141.29	6,683,017.00
GODADDY INC - CLASS A	26,900	64.41	1,732,629.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	140,300	116.76	16,381,428.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	12,500	156.38	1,954,750.00
LEIDOS HOLDINGS INC	21,500	94.56	2,033,040.00
MASTERCARD INC	143,000	245.35	35,085,050.00
MONGODB INC	7,400	152.24	1,126,576.00
OKTA INC	16,500	148.41	2,448,765.00
PAYCHEX INC	50,500	64.02	3,233,010.00
PAYPAL HOLDINGS INC	178,000	107.54	19,142,120.00
SABRE CORP	42,000	5.57	233,940.00
SQUARE INC - A	55,700	57.40	3,197,180.00
TWILIO INC - A	18,600	105.00	1,953,000.00
VERISIGN INC	17,000	206.75	3,514,750.00
VISA INC-CLASS A SHARES	272,800	160.53	43,792,584.00
WESTERN UNION CO	66,000	18.69	1,233,540.00
WIX.COM LTD	7,700	126.43	973,511.00
ADOBE INC	77,180	328.99	25,391,448.20
ANSYS INC	13,400	253.28	3,393,952.00
AUTODESK INC.	35,000	170.02	5,950,700.00
CADENCE DESIGN SYS INC	44,600	74.59	3,326,714.00

CDK GLOBAL INC	20,000	34.05	681,000.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	18,900	101.79	1,923,831.00
CITRIX SYSTEMS INC	20,900	146.64	3,064,776.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5,500	91.29	502,095.00
DOCUSIGN INC	16,600	99.33	1,648,878.00
DROPBOX INC-CLASS A	39,000	19.66	766,740.00
FORTINET INC	22,800	101.18	2,306,904.00
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	13,600	85.26	1,159,536.00
INTUIT INC	41,300	249.15	10,289,895.00
MICROSOFT CORP	1,153,300	167.82	193,546,806.00
NORTONLIFELOCK INC	98,000	19.38	1,899,240.00
ORACLE CORPORATION	366,600	51.31	18,810,246.00
PALO ALTO NETWORKS INC	15,200	186.51	2,834,952.00
PAYCOM SOFTWARE INC	8,100	208.20	1,686,420.00
PTC INC	17,000	62.97	1,070,490.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	11,900	234.58	2,791,502.00
SALESFORCE.COM INC	132,900	150.56	20,009,424.00
SERVICENOW INC	30,190	288.77	8,717,966.30
SPLUNK INC	24,800	127.18	3,154,064.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	36,700	50.08	1,837,936.00
SYNOPSYS INC	23,900	144.84	3,461,676.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	6,100	312.90	1,908,690.00
VMWARE INC - CLASS A	13,000	124.97	1,624,610.00
WORKDAY INC-CLASS A	26,500	140.15	3,713,975.00
ARISTA NETWORKS INC	8,700	200.05	1,740,435.00
CISCO SYSTEMS	676,200	40.55	27,419,910.00
F5 NETWORKS INC	9,300	119.84	1,114,512.00
JUNIPER NETWORKS INC	53,000	22.61	1,198,330.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	26,800	144.68	3,877,424.00
APPLE INC	707,100	268.37	189,764,427.00
DELL TECHNOLOGIES-C	26,600	37.40	994,840.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	202,000	9.05	1,828,100.00
HP INC	232,000	14.42	3,345,440.00
NETAPP INC	35,200	38.94	1,370,688.00

SEAGATE TECHNOLOGY	37,300	49.74	1,855,302.00
WESTERN DIGITAL CORP	47,600	37.83	1,800,708.00
XEROX HOLDINGS CORP	28,900	16.77	484,653.00
AMPHENOL CORP-CL A	46,400	76.92	3,569,088.00
ARROW ELECTRS INC	12,100	50.87	615,527.00
CDW CORPORATION	22,400	98.84	2,214,128.00
COGNEX CORP	27,800	46.93	1,304,654.00
CORNING INC	119,000	19.44	2,313,360.00
FLEX LTD	76,000	7.49	569,240.00
FLIR SYSTEMS INC	20,700	40.65	841,455.00
IPG PHOTONICS CORP	5,900	111.65	658,735.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	30,400	91.60	2,784,640.00
TE CONNECTIVITY LTD	52,400	64.55	3,382,420.00
TRIMBLE INC	38,800	31.68	1,229,184.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	8,400	192.85	1,619,940.00
ADVANCED MICRO DEVICES	169,300	52.92	8,959,356.00
ANALOG DEVICES INC	58,100	96.47	5,604,907.00
APPLIED MATERIALS	146,900	48.33	7,099,677.00
BROADCOM INC	63,300	247.65	15,676,245.00
INTEL CORP	693,000	56.36	39,057,480.00
KLA CORP	25,300	148.59	3,759,327.00
LAM RESEARCH	23,100	243.63	5,627,853.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	99,000	25.28	2,502,720.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	42,400	50.35	2,134,840.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	37,300	74.85	2,791,905.00
MICRON TECHNOLOGY	177,300	41.41	7,341,993.00
NVIDIA CORP	92,690	269.51	24,980,881.90
NXP SEMICONDUCTORS NV	44,700	81.06	3,623,382.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	69,000	12.83	885,270.00
QORVO INC	19,100	81.18	1,550,538.00
QUALCOMM INC	181,000	71.84	13,003,040.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	27,200	88.10	2,396,320.00
TERADYNE INC	27,400	60.93	1,669,482.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	148,100	106.84	15,823,004.00
XILINX INC	39,900	86.32	3,444,168.00

AT & T INC	1,164,000	29.87	34,768,680.00
CENTURYLINK INC	161,000	9.71	1,563,310.00
VERIZON COMMUNICATIONS	658,900	56.82	37,438,698.00
T-MOBILE US INC	67,830	87.22	5,916,132.60
ALLIANT ENERGY CORP	37,600	49.70	1,868,720.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	79,200	82.47	6,531,624.00
DUKE ENERGY CORP	116,300	85.44	9,936,672.00
EDISON INTERNATIONAL	58,000	58.19	3,375,020.00
ENTERGY CORP	31,300	94.66	2,962,858.00
EVERGY INC	35,900	58.24	2,090,816.00
EVERSOURCE ENERGY	52,100	87.20	4,543,120.00
EXELON CORPORATION	154,800	35.68	5,523,264.00
FIRSTENERGY CORP	86,600	43.20	3,741,120.00
NEXTERA ENERGY INC	78,000	235.42	18,362,760.00
NRG ENERGY INC	40,500	30.31	1,227,555.00
OGE ENERGY CORP	32,500	29.46	957,450.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	17,000	75.61	1,285,370.00
PPL CORPORATION	114,800	24.57	2,820,636.00
SOUTHERN CO.	167,800	55.50	9,312,900.00
XCEL ENERGY INC	83,600	63.41	5,301,076.00
ATMOS ENERGY CORP	18,400	100.79	1,854,536.00
UGI CORP	30,900	27.30	843,570.00
AMEREN CORPORATION	39,100	74.02	2,894,182.00
CENTERPOINT ENERGY INC	75,400	15.51	1,169,454.00
CMS ENERGY CORP	45,600	58.41	2,663,496.00
CONSOLIDATED EDISON INC	52,500	83.49	4,383,225.00
DOMINION ENERGY INC	130,600	76.61	10,005,266.00
DTE ENERGY COMPANY	30,500	99.14	3,023,770.00
NISOURCE INC	58,200	25.38	1,477,116.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	81,000	50.01	4,050,810.00
SEMPRA ENERGY	44,900	119.27	5,355,223.00
WEC ENERGY GROUP INC	49,800	95.14	4,737,972.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	28,300	125.43	3,549,669.00
ESSENTIAL UTILITIES INC	34,900	41.29	1,441,021.00
ALLY FINANCIAL INC	57,400	14.18	813,932.00

AMERICAN EXPRESS CO	110,400	81.52	8,999,808.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	75,100	51.16	3,842,116.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	49,600	34.30	1,701,280.00
SYNCHRONY FINANCIAL	94,000	15.17	1,425,980.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	20,300	103.45	2,100,035.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	132,500	35.21	4,665,325.00
BLACKROCK INC	18,540	474.37	8,794,819.80
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	104,000	45.50	4,732,000.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	17,900	100.39	1,796,981.00
CME GROUP INC	57,300	178.02	10,200,546.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	37.64	1,317,400.00
EATON VANCE CORP	16,400	32.56	533,984.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,920	266.54	1,577,916.80
FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	15.98	693,532.00
GOLDMAN SACHS GROUP	51,000	173.81	8,864,310.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	89,200	87.53	7,807,676.00
INVESCO LTD	58,000	8.93	517,940.00
KKR & CO INC-A	78,400	21.84	1,712,256.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	6,160	410.49	2,528,618.40
MOODYS CORP	26,800	228.26	6,117,368.00
MORGAN STANLEY	194,500	36.95	7,186,775.00
MSCI INC	13,650	311.32	4,249,518.00
NASDAQ INC	18,400	105.27	1,936,968.00
NORTHERN TRUST CORP	32,100	74.43	2,389,203.00
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	19,600	61.28	1,201,088.00
S&P GLOBAL INC	39,080	267.23	10,443,348.40
SCHWAB(CHARLES)CORP	183,700	35.94	6,602,178.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	48.13	919,283.00
STATE STREET CORP	58,400	55.99	3,269,816.00
T ROWE PRICE GROUP INC	36,600	98.85	3,617,910.00
TD AMERITRADE HOLDING CORP	41,200	37.49	1,544,588.00
AES CORP	101,000	12.46	1,258,460.00
VISTRA ENERGY CORP	59,000	17.02	1,004,180.00
CERNER CORP	49,900	68.59	3,422,641.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	20,700	176.24	3,648,168.00
	49,000	73.75	3,613,750.00

AGILENT TECHNOLOGIES INC			
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,640	417.71	1,520,464.40
ILLUMINA INC	23,390	310.40	7,260,256.00
IQVIA HOLDINGS INC	26,500	122.00	3,233,000.00
METTLER-TOLEDO INTL	3,880	683.43	2,651,708.40
PERKINELMER INC	17,400	82.64	1,437,936.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	63,960	319.62	20,442,895.20
WATERS CORP	10,300	185.39	1,909,517.00
COSTAR GROUP INC	5,810	562.99	3,270,971.90
EQUIFAX INC	19,500	130.04	2,535,780.00
IHS MARKIT LTD	61,400	62.57	3,841,798.00
MANPOWERGROUP INC	9,600	66.65	639,840.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	54,000	11.94	644,760.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	41.30	706,230.00
TRUNION	29,000	70.26	2,037,540.00
VERISK ANALYTICS INC	25,100	145.21	3,644,771.00
CBRE GROUP INC	51,400	39.97	2,054,458.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	184,000	4.07	748,880.00
JONES LANG LASALLE INC	7,600	98.98	752,248.00
ALTICE USA INC-A	20,000	24.89	497,800.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	24,030	490.78	11,793,443.40
COMCAST CORP-CL A	723,700	35.71	25,843,327.00
DISCOVERY INC - A	24,500	20.78	509,110.00
DISCOVERY INC - C	57,000	19.00	1,083,285.00
DISH NETWORK CORP-A	43,000	21.57	927,510.00
FOX CORP-CLASS A	58,000	25.54	1,481,320.00
FOX CORP-CLASS B	25,400	25.05	636,270.00
INTERPUBRIC GROUP	58,000	14.03	813,740.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	16,700	122.57	2,046,919.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	64,000	16.81	1,075,840.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	17.62	422,880.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	26,700	29.48	787,116.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	29.08	375,132.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	8.43	463,925.00
OMNICOM GROUP	34,500	51.34	1,771,230.00
	255,000	5.00	1,275,000.00

	SIRIUS XM HOLDINGS INC				
	VIACOMCBS INC-CLASS B	88,000	15.15	1,333,200.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	123,100	65.72	8,090,132.00	
	DISNEY (WALT) CO	287,300	100.54	28,885,142.00	
	ELECTRONIC ARTS	46,100	113.27	5,221,747.00	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	34,000	25.60	870,400.00	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	23,000	36.47	838,810.00	
	NETFLIX INC	69,850	433.83	30,303,025.50	
	ROKU INC	14,200	123.56	1,754,552.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	18,100	125.73	2,275,713.00	
	ALPHABET INC-CL A	47,710	1,212.16	57,832,153.60	
	ALPHABET INC-CL C	49,230	1,216.34	59,880,418.20	
	FACEBOOK INC-A	383,200	170.80	65,450,560.00	
	IAC/INTERACTIVE CORP	12,600	214.68	2,704,968.00	
	MATCH GROUP INC	8,400	76.90	645,960.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	46,000	16.87	776,020.00	
	SNAP INC-A	117,000	12.44	1,455,480.00	
	TRIPADVISOR INC	14,600	17.36	253,456.00	
	TWITTER INC	114,700	25.75	2,953,525.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	20,200	36.20	731,240.00	
	小計銘柄数：608			3,693,830,175.66	
				(398,416,522,746)	
	組入時価比率：68.5%			71.4%	
カナダドル	CAMECO CORP	69,000	13.36	921,840.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	187,000	17.60	3,291,200.00	
	CENOVUS ENERGY INC	156,000	3.73	581,880.00	
	ENBRIDGE INC	321,300	39.90	12,819,870.00	
	HUSKY ENERGY INC	52,000	3.67	190,840.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	17.34	650,250.00	
	INTER PIPELINE LTD	60,000	10.20	612,000.00	
	KEYERA CORP	34,000	16.67	566,780.00	
	OVINTIV INC	41,000	5.50	225,500.00	
	PARKLAND FUEL CORP	21,700	26.70	579,390.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	88,000	26.59	2,339,920.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	31,000	8.41	260,710.00	



SUNCOR ENERGY INC	244,000	20.64	5,036,160.00
TC ENERGY CORP	149,800	62.80	9,407,440.00
METHANEX CORP	8,600	17.92	154,112.00
NUTRIEN LTD	90,000	47.59	4,283,100.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	24,700	41.23	1,018,381.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	37,700	76.46	2,882,542.00
BARRICK GOLD	283,000	35.16	9,950,280.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	119,000	7.14	849,660.00
FRANCO-NEVADA CORP	30,400	177.95	5,409,680.00
KINROSS GOLD CORP	198,000	8.81	1,744,380.00
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	44,100	51.95	2,290,995.00
LUNDIN MINING CORP	95,000	6.02	571,900.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	82,000	10.03	822,460.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	71,600	49.63	3,553,508.00
WEST FRASER TIMBER	8,400	28.23	237,132.00
BOMBARDIER B SHEARS	280,000	0.41	114,800.00
CAE INC	41,000	20.81	853,210.00
WSP GLOBAL INC	17,700	87.87	1,555,299.00
AIR CANADA	20,400	17.75	362,100.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	114,500	107.70	12,331,650.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	21,900	305.50	6,690,450.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	45,100	49.05	2,212,155.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31,800	21.07	670,026.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	46,000	60.19	2,768,740.00
STARS GROUP INC/THE	38,000	34.85	1,324,300.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	92.07	791,802.00
DOLLARAMA INC	46,600	42.79	1,994,014.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	139,000	39.32	5,465,480.00
EMPIRE CO LTD A	26,000	32.32	840,320.00
LOBLAW COMPANIES	28,500	72.89	2,077,365.00
METRO INC	39,600	59.44	2,353,824.00
WESTON(GEORGE)LTD	12,300	102.72	1,263,456.00
SAPUTO INC	41,000	35.19	1,442,790.00
AURORA CANNABIS INC	200,000	1.02	204,000.00
BAUSCH HEALTH COS INC	51,000	23.00	1,173,000.00

CANOPY GROWTH CORP	33,000	21.27	701,910.00	
CRONOS GROUP INC	25,000	8.44	211,000.00	
BANK OF MONTREAL	102,000	66.43	6,775,860.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	193,700	52.46	10,161,502.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	71,800	77.80	5,586,040.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	52,300	51.44	2,690,312.00	
ROYAL BANK OF CANADA	227,300	83.73	19,031,829.00	
TORONTO DOMINION BANK	287,200	54.49	15,649,528.00	
ONEX CORPORATION	13,200	60.50	798,600.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	4,140	393.10	1,627,434.00	
GREAT-WEST LIFE CO INC	42,000	20.93	879,060.00	
IA FINANCIAL CORP INC	18,300	41.70	763,110.00	
INTACT FINANCIAL CORP	22,700	130.17	2,954,859.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	312,000	16.27	5,076,240.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	86,950	20.14	1,751,173.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	92,300	42.98	3,967,054.00	
CGI INC	38,400	81.84	3,142,656.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	16,600	831.03	13,795,098.00	
BLACKBERRY LTD	71,000	5.55	394,050.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	3,200	1,324.71	4,239,072.00	
OPEN TEXT CORP	41,700	51.39	2,142,963.00	
BCE INC	25,600	56.69	1,451,264.00	
TELUS CORP	58,600	21.81	1,278,066.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	58,100	57.44	3,337,264.00	
EMERA INC	37,900	53.14	2,014,006.00	
FORTIS INC	71,200	52.76	3,756,512.00	
HYDRO ONE LTD	55,000	25.35	1,394,250.00	
ALTAGAS LTD	42,000	14.03	589,260.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	85,000	19.20	1,632,000.00	
ATCO LTD CL1	13,000	37.36	485,680.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	20,300	33.64	682,892.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	214,000	45.12	9,655,680.00	
CI FINANCIAL CORP	33,600	13.88	466,368.00	
IGM FINANCIAL INC	15,000	25.84	387,600.00	
	31,700	98.20	3,112,940.00	

	THOMSON REUTERS CORP				
	QUEBECOR INC-CL B	27,000	29.75	803,250.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	77,000	22.43	1,727,110.00	
小計	銘柄数：84			252,854,183.00	
				(19,204,275,198)	
	組入時価比率：3.3%			3.4%	
ユ-口	TENARIS SA	71,000	5.47	388,938.00	
	ENI SPA	403,000	7.96	3,207,880.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	81,000	9.06	734,184.00	
	NESTE OYJ	66,800	27.19	1,816,292.00	
	OMV AG	25,200	25.20	635,040.00	
	REPSOL SA	220,484	7.27	1,604,682.55	
	TOTAL SA	380,300	29.70	11,294,910.00	
	VOPAK	11,400	51.72	589,608.00	
	AIR LIQUIDE SA	75,100	115.75	8,692,825.00	
	AKZO NOBEL	32,400	62.16	2,013,984.00	
	ARKEMA	11,700	73.16	855,972.00	
	BASF SE	147,200	43.00	6,329,600.00	
	COVESTRO AG	26,900	29.32	788,708.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	33,000	21.50	709,500.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	36.08	378,840.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	28,500	111.75	3,184,875.00	
	LANXESS	12,000	40.82	489,840.00	
	SOLVAY SA	11,400	67.14	765,396.00	
	SYMRISE AG	21,000	94.64	1,987,440.00	
	UMICORE	31,000	36.35	1,126,850.00	
	CRH PLC	125,300	24.37	3,053,561.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	22,600	38.46	869,196.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	35,300	25.10	886,030.00	
	ARCELORMITTAL	99,000	8.32	824,175.00	
	THYSSENKRUPP AG	62,000	5.44	337,280.00	
	VOESTALPINE AG	20,000	18.46	369,300.00	
	STORA ENSO OYJ-R	97,000	10.05	975,335.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	83,200	23.64	1,966,848.00	
	AIRBUS SE	91,800	51.96	4,769,928.00	
	DASSAULT AVIATION SA	330	780.50	257,565.00	

LEONARDO SPA	64,000	6.20	396,800.00
MTU AERO ENGINES AG	8,400	110.15	925,260.00
SAFRAN SA	52,200	73.92	3,858,624.00
THALES SA	16,300	71.22	1,160,886.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	79,000	23.68	1,870,720.00
KINGSPAN GROUP PLC	24,500	42.90	1,051,050.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	40,394	20.00	807,880.00
BOUYGUES	34,800	25.15	875,220.00
EIFFAGE SA	12,100	70.10	848,210.00
FERROVIAL SA	77,000	22.71	1,748,670.00
HOCHTIEF AG	3,800	65.35	248,330.00
VINCI	82,500	70.00	5,775,000.00
LEGRAND SA	42,900	55.98	2,401,542.00
PRYSMIAN SPA	37,000	15.15	560,735.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	88,600	81.26	7,199,636.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	38,000	13.62	517,560.00
SIEMENS AG	122,300	77.54	9,483,142.00
ALSTOM	30,300	39.70	1,202,910.00
ANDRITZ AG	11,700	30.30	354,510.00
CNH INDUSTRIAL NV	154,000	5.62	866,712.00
GEA GROUP AG	24,200	20.23	489,566.00
KION GROUP AG	9,900	43.45	430,155.00
KNORR-BREMSE AG	7,100	80.90	574,390.00
KONE OYJ	54,000	52.02	2,809,080.00
METSO OYJ	16,200	22.11	358,182.00
WARTSILA OYJ	63,000	6.35	400,428.00
BRENNTAG AG	23,800	38.28	911,064.00
DEUTSCHE POST AG-REG	158,100	25.80	4,078,980.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	42,000	7.99	335,580.00
ADP	4,700	86.35	405,845.00
AENA SME SA	10,700	112.10	1,199,470.00
ATLANTIA SPA	79,000	12.86	1,016,335.00
FRAPORT AG	6,300	38.04	239,652.00
GETLINK	72,000	10.76	774,720.00
CONTINENTAL AG	17,500	68.18	1,193,150.00

FAURECIA	10,500	30.61	321,405.00	
MICHELIN (CGDE)	26,700	84.66	2,260,422.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	21,000	18.26	383,460.00	
PIRELLI & C. SPA	53,000	3.32	176,384.00	
VALEO SA	37,300	15.11	563,603.00	
BAYER MOTOREN WERK	52,100	48.56	2,529,976.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	10,200	40.76	415,752.00	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	145,300	27.43	3,985,579.00	
FERRARI NV	18,900	142.60	2,695,140.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	170,000	7.09	1,206,660.00	
PEUGEOT CITROEN	97,000	11.69	1,134,415.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	25,400	40.95	1,040,130.00	
RENAULT SA	28,100	16.33	458,929.20	
VOLKSWAGEN AG	5,100	128.40	654,840.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	29,900	116.50	3,483,350.00	
SEB SA	3,800	114.00	433,200.00	
ADIDAS AG	28,700	211.20	6,061,440.00	
ESSILORLUXOTTICA	45,300	105.85	4,795,005.00	
HERMES INTERNATIONAL	5,010	669.20	3,352,692.00	
KERING SA	12,060	489.00	5,897,340.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	44,370	350.00	15,529,500.00	
MONCLER SPA	28,100	34.00	955,400.00	
PUMA SE	12,600	54.20	682,920.00	
ACCOR SA	26,200	25.63	671,506.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,202	100.85	1,331,421.70	
SODEXO	13,200	66.60	879,120.00	
DELIVERY HERO SE	17,900	67.96	1,216,484.00	
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	18,900	88.90	1,680,210.00	
PROSUS NV	76,800	64.88	4,982,784.00	
ZALANDO SE	21,500	42.00	903,000.00	
INDITEX SA	174,000	24.35	4,236,900.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	95,000	13.62	1,293,900.00	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	8,300	35.55	295,065.00	
COLRUYT SA	8,700	55.76	485,112.00	
JERONIMO MARTINS	38,000	15.63	594,130.00	

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	176,000	22.60	3,977,600.00
METRO AG	25,000	7.54	188,550.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	120,100	38.26	4,595,626.50
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	91,000	6.67	607,516.00
HEINEKEN HOLDING NV	19,000	69.95	1,329,050.00
HEINEKEN NV	41,900	77.36	3,241,384.00
PERNOD RICARD SA	33,500	138.20	4,629,700.00
REMY COINTREAU	4,000	101.70	406,800.00
DANONE	99,000	62.84	6,221,160.00
KERRY GROUP PLC-A	25,500	104.60	2,667,300.00
HENKEL AG & CO KGAA	16,300	67.95	1,107,585.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	29,000	76.26	2,211,540.00
BEIERSDORF AG	16,000	95.88	1,534,080.00
LOREAL-ORD	39,840	245.80	9,792,672.00
UNILEVER NV	232,700	46.13	10,734,451.00
BIOMERIEUX	6,900	113.40	782,460.00
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	6,000	91.50	549,000.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	142,600	38.43	5,480,118.00
SARTORIUS AG-VORZUG	5,800	257.40	1,492,920.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	23,900	37.78	903,061.50
FRESENIUS MEDICAL CARE	33,300	66.48	2,213,784.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	67,300	36.42	2,451,066.00
GALAPAGOS NV	7,000	192.00	1,344,000.00
GRIFOLS SA	46,800	33.09	1,548,612.00
BAYER AG-REG	157,200	58.04	9,123,888.00
IPSEN	5,500	58.35	320,925.00
MERCK KGAA	21,100	100.80	2,126,880.00
ORION OYJ	16,500	42.92	708,180.00
RECORDATI SPA	16,800	38.16	641,088.00
SANOFI	180,000	88.09	15,856,200.00
UCB SA	20,700	84.00	1,738,800.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	70,000	6.43	450,100.00
AIB GROUP PLC	125,000	0.90	113,125.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	1,056,000	2.47	2,617,824.00
BANCO DE SABADELL SA	801,933	0.36	291,582.83

BANCO SANTANDER SA	2,670,000	1.87	4,993,968.00	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	133,000	1.33	176,890.00	
BANKIA SA	151,000	0.89	135,024.20	
BANKINTER S.A.	121,000	3.27	396,154.00	
BNP PARIBAS	179,200	24.67	4,420,864.00	
CAIXABANK	590,000	1.55	914,500.00	
COMMERZBANK AG	158,000	3.03	479,214.00	
CREDIT AGRICOLE SA	184,000	6.25	1,151,104.00	
ERSTE GROUP BANK AG	48,000	15.92	764,400.00	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	102,000	8.16	832,524.00	
ING GROEP NV	617,000	4.52	2,793,159.00	
INTESA SANPAOLO	2,400,000	1.32	3,168,000.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	40,600	42.37	1,720,222.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	107,000	4.88	522,695.00	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	14.30	287,430.00	
SOCIETE GENERALE	127,000	13.16	1,671,320.00	
UNICREDIT SPA	327,000	6.59	2,154,930.00	
EURAZEO SE	5,953	40.22	239,429.66	
EXOR NV	17,200	47.42	815,624.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	12,400	67.58	837,992.00	
WENDEL	4,300	75.45	324,435.00	
AEGON NV	293,000	2.11	620,867.00	
AGEAS	28,900	30.63	885,207.00	
ALLIANZ SE-REG	66,200	161.30	10,678,060.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	175,000	12.16	2,128,875.00	
AXA	308,000	14.68	4,522,056.00	
CNP ASSURANCES	28,000	8.00	224,140.00	
HANNOVER RUECK SE	9,600	133.70	1,283,520.00	
MAPFRE SA	163,000	1.62	264,223.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	22,800	197.85	4,510,980.00	
NN GROUP NV	47,000	23.17	1,088,990.00	
POSTE ITALIANE SPA	88,000	7.45	655,600.00	
SAMPO OYJ-A SHS	71,800	25.07	1,800,026.00	
SCOR SE	23,200	21.98	509,936.00	

ADYEN NV	1,650	865.00	1,427,250.00
AMADEUS IT GROUP SA	69,100	43.41	2,999,631.00
ATOS SE	15,300	63.16	966,348.00
CAPGEMINI SA	25,900	78.92	2,044,028.00
EDENRED	38,200	34.52	1,318,664.00
WIRECARD AG	19,000	122.50	2,327,500.00
WORLDLINE SA	19,800	57.88	1,146,024.00
DASSAULT SYSTEMES SA	20,900	131.60	2,750,440.00
SAP SE	156,800	106.28	16,664,704.00
NOKIA OYJ	914,000	3.09	2,827,916.00
INGENICO GROUP	9,500	106.15	1,008,425.00
ASML HOLDING NV	67,910	258.60	17,561,526.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	199,000	15.17	3,018,830.00
STMICROELECTRONICS NV	110,000	19.70	2,167,000.00
CELLNEX TELECOM SA	40,900	48.49	1,983,241.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	530,000	12.21	6,471,300.00
ELISA OYJ	22,100	52.30	1,155,830.00
ILIAD SA	2,400	139.60	335,040.00
KONINKLIJKE KPN NV	560,000	1.98	1,111,600.00
ORANGE SA	322,000	11.01	3,545,220.00
PROXIMUS	26,000	21.07	547,820.00
TELECOM ITALIA SPA	1,550,000	0.33	522,195.00
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.34	299,200.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	150,000	2.43	364,500.00
TELEFONICA SA	732,000	3.91	2,866,512.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	29.90	502,320.00
ELECTRICITE DE FRANCE	94,000	6.70	630,364.00
ENDESA S.A.	50,000	19.24	962,000.00
ENEL SPA	1,291,000	6.00	7,752,455.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	417,000	3.70	1,542,900.00
FORTUM OYJ	72,000	14.83	1,067,760.00
IBERDROLA SA	977,000	8.74	8,542,888.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	70,000	15.19	1,063,300.00
TERNA SPA	222,000	5.28	1,173,936.00
VERBUND AG	11,000	37.00	407,000.00



ENAGAS SA	39,000	20.09	783,510.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	49,000	14.97	733,775.00	
SNAM SPA	320,000	3.76	1,203,520.00	
E.ON SE	355,000	8.33	2,958,570.00	
ENGIE	290,000	9.22	2,673,800.00	
RWE AG	93,100	23.54	2,191,574.00	
SUEZ	52,000	9.26	481,936.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	87,000	17.56	1,528,155.00	
AMUNDI SA	10,000	53.50	535,000.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	314,000	5.55	1,744,898.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	30,400	133.15	4,047,760.00	
NATIXIS	158,000	1.90	300,200.00	
UNIPER SE	31,100	23.12	719,032.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,950	464.00	904,800.00	
QIAGEN NV	35,400	37.90	1,341,660.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,600	203.60	936,560.00	
BUREAU VERITAS SA	47,000	18.49	869,030.00	
RANDSTAD NV	18,400	33.87	623,208.00	
TELEPERFORMANCE	9,600	189.55	1,819,680.00	
WOLTERS KLUWER	43,800	66.66	2,919,708.00	
AROUNDTOWN SA	185,000	4.72	874,680.00	
DEUTSCHE WOHNEN SE	56,200	35.11	1,973,182.00	
VONOVIA SE	82,400	44.45	3,662,680.00	
ALTICE EUROPE N.V.	99,000	3.30	326,898.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	24,100	9.90	238,590.00	
JC DECAUX SA	15,000	16.73	250,950.00	
PUBLICIS GROUPE	36,300	24.43	886,809.00	
SES FDR	56,000	5.56	311,584.00	
TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	34.60	231,820.00	
BOLLORE	138,000	2.35	324,300.00	
UBISOFT ENTERTAINMENT	14,400	66.62	959,328.00	
VIVENDI SA	130,000	20.45	2,658,500.00	
小計 銘柄数：237			501,924,103.14	
			(58,770,293,236)	
組入時価比率：10.1%				10.5%

英ポンド	BP PLC	3,213,000	2.93	9,418,909.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	663,000	13.10	8,685,300.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	597,000	12.88	7,689,360.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	21,500	46.35	996,525.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	30,200	18.91	571,082.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	167,000	13.29	2,219,764.00	
	ANTOFAGASTA PLC	59,000	7.30	431,172.00	
	BHP GROUP PLC	337,000	12.26	4,131,620.00	
	EVRAZ PLC	76,000	2.33	177,688.00	
	GLENCORE PLC	1,700,000	1.33	2,270,860.00	
	RIO TINTO PLC-REG	178,900	36.33	6,500,331.50	
	MONDI PLC	75,000	13.10	982,875.00	
	BAE SYSTEMS PLC	502,000	5.34	2,683,692.00	
	MEGGITT PLC	111,000	2.44	271,617.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	277,000	3.07	851,498.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	730,000	0.86	634,808.00	
	DCC PLC	16,000	53.88	862,080.00	
	SMITHS GROUP PLC	61,000	11.42	696,620.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	11,600	88.16	1,022,656.00	
	WEIR GROUP PLC	38,000	7.85	298,300.00	
	ASHTREAD GROUP PLC	74,000	16.75	1,239,870.00	
	BUNZLE	56,000	16.15	904,400.00	
	FERGUSON PLC	36,600	50.52	1,849,032.00	
	G4S PLC	219,000	0.90	197,143.80	
	RENTOKIL INTIAL PLC	285,000	4.45	1,270,530.00	
	EASYJET PLC	21,000	6.09	128,016.00	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	159,000	4.52	719,316.00	
	PERSIMMON PLC	48,000	19.33	927,840.00	
	TAYLOR WIMPEY PLC	500,000	1.28	642,000.00	
	THE BERKELEY GRP HOLDINGS	19,500	39.29	766,155.00	
	BURBERRY GROUP PLC	66,000	13.89	916,740.00	
	CARNIVAL PLC	22,900	8.50	194,650.00	
COMPASS GROUP PLC	251,000	12.64	3,173,895.00		
GVC HOLDINGS PLC	87,000	7.00	609,000.00		
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP	28,500	34.27	976,695.00		

PLC			
TUI AG-DI	70,000	3.21	225,330.00
WHITBREAD PLC	21,100	26.88	567,168.00
OCADO GROUP PLC	72,000	16.00	1,152,360.00
MARKS & SPENCER PLC	310,000	0.91	282,224.00
NEXT PLC	22,100	45.62	1,008,202.00
JD SPORTS FASHION PLC	76,000	4.80	365,180.00
KINGFISHER PLC	308,000	1.37	423,038.00
MORRISON SUPERMARKETS	370,000	1.86	690,975.00
SAINSBURY	299,000	2.01	602,485.00
TESCO PLC	1,577,000	2.33	3,682,295.00
COCA-COLA HBC AG-DI	34,000	18.63	633,590.00
DIAGEO PLC	372,100	25.80	9,602,040.50
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	54,100	18.65	1,009,235.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	363,700	28.71	10,441,827.00
IMPERIAL BRANDS PLC	149,000	15.30	2,280,445.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	112,700	63.96	7,208,292.00
UNILEVER PLC	177,500	42.00	7,455,000.00
SMITH & NEPHEW PLC	137,000	15.23	2,087,195.00
NMC HEALTH PLC	13,300	2.34	31,201.80
ASTRAZENECA PLC	209,300	81.50	17,057,950.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	796,000	16.50	13,138,776.00
BARCLAYS PLC	2,740,000	0.86	2,370,374.00
HSBC HOLDINGS PLC	3,242,000	3.99	12,945,306.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	11,050,000	0.29	3,228,810.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	770,000	1.02	791,560.00
STANDARD CHARTERED PLC	438,000	3.81	1,670,970.00
M&G PLC	440,000	1.28	564,740.00
ADMIRAL GROUP PLC	30,800	22.53	693,924.00
AVIVA PLC	604,000	2.36	1,428,460.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	219,000	2.61	572,247.00
LEGAL & GENERAL	940,000	1.93	1,814,200.00
PRUDENTIAL PLC	410,000	9.79	4,015,540.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	162,000	3.46	560,520.00
AVEVA GROUP PLC	11,200	33.23	372,176.00
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	48,116	3.77	181,445.43

	SAGE GROUP PLC (THE)	175,000	6.26	1,096,900.00	
	HALMA PLC	59,000	21.13	1,246,670.00	
	BT GROUP PLC	1,370,000	1.15	1,588,515.00	
	VODAFONE GROUP PLC	4,300,000	1.05	4,551,980.00	
	SSE PLC	165,000	12.00	1,980,825.00	
	CENTRICA PLC	920,000	0.31	288,512.00	
	NATIONAL GRID PLC	559,000	8.95	5,005,286.00	
	SEVERN TRENT PLC	37,000	23.13	855,810.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	106,000	8.84	937,040.00	
	3I GROUP PLC	155,000	7.16	1,109,800.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	52,000	14.75	767,000.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	50,700	73.50	3,726,450.00	
	SCHRODERS PLC	19,700	25.26	497,622.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	81,000	7.59	615,114.00	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	366,000	2.03	745,176.00	
	EXPERIAN PLC	145,200	22.97	3,335,244.00	
	INTERTEK GROUP PLC	25,600	48.99	1,254,144.00	
	RELX PLC	308,000	18.00	5,544,000.00	
	INFORMA PLC	207,000	4.26	882,441.00	
	ITV PLC	640,000	0.67	432,512.00	
	PEARSON	126,000	4.62	583,002.00	
	WPP PLC	200,000	5.27	1,055,600.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	165,000	4.45	735,570.00	
小計	銘柄数：93			215,902,336.03	
				(28,609,218,547)	
	組入時価比率：4.9%			5.1%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	32,000	17.76	568,480.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	630.50	769,210.00	
	GIVAUDAN-REG	1,458	3,282.00	4,785,156.00	
	SIKA AG-REG	19,900	164.60	3,275,540.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	77,400	35.89	2,777,886.00	
	GEBERIT AG-REG	5,960	397.40	2,368,504.00	
	ABB LTD	294,000	16.51	4,853,940.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	210.40	631,200.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,700	221.70	1,485,390.00	

	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,400	137.90	1,158,360.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	84,000	53.40	4,485,600.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,700	188.40	885,480.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	36.68	271,432.00	
	DUFREY AG-REG	6,500	27.86	181,090.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	460	1,900.00	874,000.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	177	7,775.00	1,376,175.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	17	82,500.00	1,402,500.00	
	NESTLE SA-REG	474,000	104.70	49,627,800.00	
	ALCON INC	65,900	49.75	3,278,525.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	8,800	174.90	1,539,120.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,600	755.80	1,209,280.00	
	NOVARTIS AG-REG	342,400	85.82	29,384,768.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	111,940	335.70	37,578,258.00	
	VIFOR PHARMA AG	7,600	141.70	1,076,920.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	5,800	64.00	371,200.00	
	BALOISE HOLDING AG	7,400	136.90	1,013,060.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	5,190	323.20	1,677,408.00	
	SWISS RE LTD	46,200	70.36	3,250,632.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	23,970	295.00	7,071,150.00	
	TEMENOS AG-REG	10,400	120.05	1,248,520.00	
	SWISSCOM AG-REG	4,030	511.20	2,060,136.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	413,000	7.63	3,152,016.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	35,800	34.03	1,218,274.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,990	722.60	2,160,574.00	
	UBS GROUP AG	615,000	8.99	5,531,310.00	
	LONZA AG-REG	11,880	418.00	4,965,840.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	24,900	41.33	1,029,117.00	
	SGS SA-REG	980	2,235.00	2,190,300.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	11,400	90.80	1,035,120.00	
小計	銘柄数：39			193,819,271.00	
				(21,552,702,935)	
	組入時価比率：3.7%			3.9%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	28,800	199.45	5,744,160.00	
	BOLIDEN AB	44,000	193.60	8,518,400.00	

	ASSA ABLOY AB-B	159,000	189.70	30,162,300.00	
	SKANSKA AB-B SHS	51,000	166.05	8,468,550.00	
	ALFA LAVAL AB	51,000	164.95	8,412,450.00	
	ATLAS COPCO AB-A	107,600	335.90	36,142,840.00	
	ATLAS COPCO AB-B	62,700	299.50	18,778,650.00	
	EPIROC AB - A	103,000	95.40	9,826,200.00	
	EPIROC AB - B	58,000	93.50	5,423,000.00	
	SANDVIK AB	178,000	137.75	24,519,500.00	
	SKF AB-B SHARES	58,000	136.00	7,888,000.00	
	VOLVO AB-B SHS	234,000	120.70	28,243,800.00	
	SECURITAS AB-B SHS	55,000	107.95	5,937,250.00	
	ELECTROLUX AB-B	34,000	127.15	4,323,100.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	76,000	57.70	4,385,200.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	127,000	129.90	16,497,300.00	
	ICA GRUPPEN AB	13,800	450.50	6,216,900.00	
	SWEDISH MATCH AB	27,900	610.40	17,030,160.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	97,400	310.80	30,271,920.00	
	NORDEA BANK ABP	515,000	53.07	27,331,050.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	267,000	64.42	17,200,140.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	243,000	77.84	18,915,120.00	
	SWEDBANK AB	148,000	103.68	15,344,640.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	189.90	4,747,500.00	
	INVESTOR AB-B SHS	71,500	478.20	34,191,300.00	
	KINNEVIK AB - B	39,000	186.80	7,285,200.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	12,600	392.40	4,944,240.00	
	ERICSSON LM-B	492,000	81.34	40,019,280.00	
	HEXAGON AB-B SHS	42,300	436.50	18,463,950.00	
	TELIA CO AB	430,000	34.27	14,736,100.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	15,800	263.00	4,155,400.00	
	TELE 2 AB-B SHS	78,000	124.60	9,718,800.00	
小計	銘柄数：32			493,842,400.00	
				(5,279,175,256)	
	組入時価比率：0.9%			0.9%	
ノルウェーク ローネ	AKER AB ASA	18,000	138.60	2,494,800.00	

	EQUINOR ASA	158,000	128.70	20,334,600.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	29,600	351.80	10,413,280.00	
	NORSK HYDRO	218,000	21.50	4,687,000.00	
	MOWI ASA	69,000	171.05	11,802,450.00	
	ORKLA ASA	115,000	96.18	11,060,700.00	
	DNB ASA	156,000	107.00	16,692,000.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	178.60	5,536,600.00	
	TELENOR ASA	116,000	151.15	17,533,400.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	196.20	2,530,980.00	
小計	銘柄数：10			103,085,810.00	
				(1,046,320,971)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	16,700	596.60	9,963,220.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	33,700	321.80	10,844,660.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	29,800	569.20	16,962,160.00	
	ISS A/S	21,800	94.08	2,050,944.00	
	DSV PANALPINA A S	34,000	653.00	22,202,000.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	640	5,950.00	3,808,000.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	1,040	6,294.00	6,545,760.00	
	PANDORA A/S	16,000	228.60	3,657,600.00	
	CARLSBERG B	17,300	812.20	14,051,060.00	
	COLOPLAST-B	19,300	1,064.00	20,535,200.00	
	DEMANT A/S	16,000	169.00	2,704,000.00	
	GENMAB A/S	10,600	1,585.00	16,801,000.00	
	H LUNDBECK A/S	10,500	227.00	2,383,500.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	282,400	441.65	124,721,960.00	
	DANSKE BANK AS	97,000	70.36	6,824,920.00	
	TRYG A/S	19,900	186.00	3,701,400.00	
	ORSTED A/S	30,000	690.40	20,712,000.00	
小計	銘柄数：17			288,469,384.00	
				(4,528,969,328)	
	組入時価比率：0.8%			0.8%	
豪ドル	WORLEY LTD	47,000	6.82	320,540.00	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	40,000	21.98	879,200.00	
	OIL SEARCH LTD	324,500	2.50	811,250.00	

OIL SEARCH LTD RTS	25,500	0.40	10,200.00	
ORIGIN ENERGY LTD	265,000	4.76	1,261,400.00	
SANTOS LTD.	301,000	4.01	1,207,010.00	
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	17.68	300,560.00	
WOODSIDE PETROLEUM	152,000	19.89	3,023,280.00	
INCITEC PIVOT LTD	233,000	2.11	491,630.00	
ORICA LTD	59,000	16.35	964,650.00	
BORAL LTD	200,000	2.57	514,000.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	67,000	17.91	1,199,970.00	
ALUMINA LTD	350,000	1.45	507,500.00	
BHP GROUP LIMITED	468,000	30.05	14,063,400.00	
BLUESCOPE STEEL LTD	88,000	9.55	840,400.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	219,000	11.10	2,430,900.00	
NEWCREST MINING	125,000	27.66	3,457,500.00	
RIO TINTO LTD	59,600	87.06	5,188,776.00	
SOUTH32 LTD	780,000	1.87	1,458,600.00	
CIMIC GROUP LTD	18,000	21.80	392,400.00	
BRAMBLES LTD	251,000	10.60	2,660,600.00	
QANTAS AIRWAYS LIMITED	108,000	3.59	387,720.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	4.47	1,363,350.00	
SYDNEY AIRPORT	168,000	5.76	967,680.00	
TRANSURBAN GROUP	434,000	12.46	5,407,640.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	88,000	22.37	1,968,560.00	
CROWN RESORTS LTD	55,000	8.01	440,550.00	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	24,805	9.79	242,840.95	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD RTS	4,195	2.59	10,865.05	
TABCORP HOLDINGS	340,000	2.90	986,000.00	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	97,117	2.63	255,417.71	
WESFARMERS LIMITED	181,000	36.37	6,582,970.00	
COLES GROUP LTD	213,000	16.00	3,408,000.00	
WOOLWORTHS GROUP LTD	201,000	36.01	7,238,010.00	
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	8.30	639,100.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	111,000	10.00	1,110,000.00	
COCHLEAR LTD	10,300	181.18	1,866,154.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	25,000	64.29	1,607,250.00	



	SONIC HEALTHCARE LTD	69,000	25.59	1,765,710.00	
	CSL LIMITED	72,500	306.69	22,235,025.00	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	453,000	15.80	7,157,400.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	92,000	5.65	519,800.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	280,800	58.63	16,463,304.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	456,000	15.64	7,131,840.00	
	WESTPAC BANKING CORP	563,000	15.17	8,540,710.00	
	AMP LIMITED	530,000	1.36	720,800.00	
	CHALLENGER LIMITED	80,000	4.41	352,800.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	361,000	5.95	2,147,950.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	450,000	2.56	1,152,000.00	
	QBE INSURANCE	241,000	8.06	1,942,460.00	
	SUNCORP GROUP LTD	210,000	9.01	1,892,100.00	
	COMPUTERSHARE LTD	76,000	10.97	833,720.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,000	13.78	289,380.00	
	TELSTRA CORP LTD	650,000	3.04	1,976,000.00	
	TPG TELECOM LTD	52,000	7.47	388,440.00	
	AUSNET SERVICES	330,000	1.79	592,350.00	
	APA GROUP	180,000	10.84	1,951,200.00	
	AGL ENERGY LTD	105,000	17.00	1,785,000.00	
	ASX LTD	30,700	81.50	2,502,050.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	53,000	98.40	5,215,200.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	19,200	46.32	889,344.00	
	SEEK LTD	48,000	16.16	775,680.00	
	REA GROUP LTD	8,800	80.67	709,896.00	
小計	銘柄数：63			166,396,032.71	
				(11,281,651,017)	
	組入時価比率：1.9%			2.0%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	150,000	3.79	568,500.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	152,000	5.99	911,240.00	
	A2 MILK CO LTD	117,000	19.45	2,275,650.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	95,000	28.55	2,712,250.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	12.40	719,200.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	307,000	4.28	1,313,960.00	

	MERCURY NZ LTD	100,000	4.48	448,000.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	201,000	4.45	894,450.00	
小計	銘柄数：8			9,843,250.00	
				(632,330,380)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	425,040	55.60	23,632,224.00	
	NWS HOLDINGS LTD	220,500	7.70	1,697,850.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	212,000	55.00	11,660,000.00	
	MTR CORP	243,000	41.65	10,120,950.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	97,000	12.48	1,210,560.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	335,000	47.90	16,046,500.00	
	SANDS CHINA LTD	384,000	30.10	11,558,400.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	7.66	2,068,200.00	
	WYNN MACAU LTD	228,000	13.24	3,018,720.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	216,000	21.25	4,590,000.00	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	130,000	27.30	3,549,000.00	
	WH GROUP LIMITED	1,580,000	7.54	11,913,200.00	
	BANK OF EAST ASIA	220,060	16.36	3,600,181.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	606,000	23.55	14,271,300.00	
	HANG SENG BANK	119,000	134.00	15,946,000.00	
	AIA GROUP LTD	1,929,000	70.15	135,319,350.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	48,000	78.80	3,782,400.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	599,600	11.84	7,099,264.00	
	PCCW LTD	750,000	4.63	3,472,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	107,000	45.80	4,900,600.00	
	CLP HLDGS	265,000	81.20	21,518,000.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	225,000	50.50	11,362,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,640,348	13.76	22,571,188.48	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	192,300	242.40	46,613,520.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	409,040	46.85	19,163,524.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	16.42	5,090,200.00	
	HENDERSON LAND	229,443	31.30	7,181,565.90	
	KERRY PROPERTIES	114,000	21.15	2,411,100.00	

	NEW WORLD DEVELOPMENT	939,666	8.80	8,269,060.80	
	SINO LAND CO.LTD	480,000	10.26	4,924,800.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	256,000	103.80	26,572,800.00	
	SWIRE PACIFIC-A	75,000	49.85	3,738,750.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	21.10	3,650,300.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	183,000	30.55	5,590,650.00	
	WHEELLOCK & COMPANY LTD	134,000	53.60	7,182,400.00	
小計	銘柄数：35			485,297,558.78	
				(6,755,342,018)	
	組入時価比率：1.2%			1.2%	
シンガポール	SINGAPORE TECH ENGINEERING	249,000	3.33	829,170.00	
ドル	KEPPEL CORP.	232,000	5.67	1,315,440.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	140,040	1.52	212,860.80	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	440,000	1.02	448,800.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,040	6.01	463,010.40	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	310,000	1.50	465,000.00	
	SATS LTD	115,000	3.06	351,900.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	1,060,000	0.73	773,800.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	20.33	284,620.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	289,000	3.37	973,930.00	
	DBS GROUP HLDGS	284,000	18.84	5,350,560.00	
	OCBC-ORD	524,000	8.70	4,558,800.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	200,000	19.60	3,920,000.00	
	VENTURE CORP LTD	45,000	15.53	698,850.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,290,000	2.75	3,547,500.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	129,000	10.06	1,297,740.00	
	CAPITALAND LIMITED	430,000	2.87	1,234,100.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	7.54	527,800.00	
	UOL GROUP LIMITED	85,000	6.78	576,300.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	240,000	1.43	343,200.00	
小計	銘柄数：20			28,173,381.20	
				(2,123,427,741)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	
新シケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	125,000	11.65	1,456,250.00	

	ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	442.50	1,593,000.00	
	BANK HAPOLIM BM	183,000	20.69	3,786,270.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	238,000	18.80	4,474,400.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	172,000	10.41	1,790,520.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	23,000	66.52	1,529,960.00	
	NICE LTD	10,100	584.60	5,904,460.00	
	AZRIELI GROUP	6,500	186.50	1,212,250.00	
	小計 銘柄数：8			21,747,110.00	
				(658,937,433)	
				0.1%	
	組入時価比率：0.1%				
	合計			558,859,166,806	
				(558,859,166,806)	

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	80,000	988,400.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,900	2,638,460.00	
		AMERICAN TOWER CORP	70,200	16,988,400.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	237,000	1,455,180.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	21,900	3,465,675.00	
		BOSTON PROPERTIES	24,700	2,184,221.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	16,000	1,309,600.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	66,000	10,538,220.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	41,900	6,062,930.00	
		DUKE REALTY CORP	56,600	1,889,874.00	
		EQUINIX INC	13,540	9,101,588.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	26,500	1,562,705.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	59,900	3,822,219.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,700	2,555,053.00	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	20,700	1,838,574.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,100	781,551.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	81,000	1,983,690.00			

	HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	1,151,040.00	
	INVITATION HOMES INC	85,000	1,798,600.00	
	IRON MOUNTAIN INC	43,100	1,064,570.00	
	KIMCO REALTY CORP	65,000	539,500.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	83,000	1,284,010.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	17,600	1,892,704.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	27,900	821,097.00	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	36,500	1,049,740.00	
	PROLOGIS INC	117,000	10,413,000.00	
	PUBLIC STORAGE	25,300	4,829,770.00	
	REALTY INCOME CORP	52,400	2,612,140.00	
	REGENCY CENTERS CORP	26,200	932,458.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	17,770	5,224,913.10	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	47,900	2,565,524.00	
	SL GREEN REALTY CORP	12,500	560,750.00	
	SUN COMMUNITIES INC	14,300	1,680,250.00	
	UDR INC	46,300	1,647,354.00	
	VENTAS INC	61,100	1,706,523.00	
	VEREIT INC	160,000	788,800.00	
	VICI PROPERTIES INC	76,000	1,166,600.00	
	VORNADO REALTY TRUST	27,000	973,890.00	
	WELLTOWER INC	63,100	2,759,363.00	
	WEYERHAEUSER CO	115,000	2,157,400.00	
	WP CAREY INC	27,400	1,611,394.00	
小計	銘柄数：41	2,212,010	120,397,730.10 (12,986,099,168)	
	組入時価比率：2.2%		84.8%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,900	669,457.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	218,560.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	20,000	181,000.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	338,580.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	227,260.00	
小計	銘柄数：5	83,900	1,634,857.00 (124,167,389)	
	組入時価比率：0.0%		0.8%	

ユーロ	COVIVIO	8,500	499,375.00	
	GECINA SA	7,100	809,400.00	
	ICADE	5,200	374,140.00	
	KLEPIERRE	32,300	521,645.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	21,400	1,111,944.00	
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.1%	74,500	3,316,504.00 (388,329,453) 2.5%	
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	499,840.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	111,000	694,638.00	
	SEGRO PLC	176,000	1,416,800.00	
小計	銘柄数：3 組入時価比率：0.1%	415,000	2,611,278.00 (346,020,447) 2.3%	
豪ドル	DEXUS	171,000	1,508,220.00	
	GOODMAN GROUP	268,000	3,382,160.00	
	GPT GROUP	330,000	1,234,200.00	
	LENDLEASE GROUP	88,000	950,400.00	
	MIRVAC GROUP	660,000	1,412,400.00	
	SCENTRE GROUP	870,000	1,827,000.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	410,000	1,156,200.00	
	VICINITY CENTRES	470,000	627,450.00	
小計	銘柄数：8 組入時価比率：0.1%	3,267,000	12,098,030.00 (820,246,434) 5.4%	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	470,000	3,661,300.00	
	LINK REIT	330,000	22,192,500.00	
小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.1%	800,000	25,853,800.00 (359,884,896) 2.4%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	440,800	1,225,424.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	439,972	659,958.00	
	CAPITALAND MALL TRUST	390,000	686,400.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	370,000	666,000.00	
	SUNTEC REIT	300,000	402,000.00	
小計	銘柄数：5	1,940,772	3,639,782.00	

			(274,330,369)	
		組入時価比率：0.0%	1.8%	
合計			15,299,078,156	(15,299,078,156)

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

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 4月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	6,344,983,396	-	6,831,179,216	486,195,820
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	75,730,850	-	76,108,500	377,650
ユーロ	75,730,850	-	76,108,500	377,650
合計	-	-	-	485,818,170

### (注) 時価の算定方法

#### 1 先物取引

##### 外国先物取引について

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

#### 2 為替予約取引

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

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

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

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

- ・計算日に当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

### 貸借対照表

（単位：円）

(2020年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	98,480,049
コール・ローン	1,918,070,460
株式	40,731,684,952
投資証券	1,115,778,247
派生商品評価勘定	298,806,171
未収配当金	44,909,399
差入委託証拠金	507,556,786
流動資産合計	44,715,286,064
資産合計	
44,715,286,064	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	70,008,828
未払解約金	79,844,302
未払利息	2,262
その他未払費用	747,800
流動負債合計	150,603,192
負債合計	
150,603,192	
純資産の部	
元本等	
元本	25,336,454,968
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	19,228,227,904
元本等合計	44,564,682,872
純資産合計	
44,564,682,872	
負債純資産合計	
44,715,286,064	

### 注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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



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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.7589円
(10,000口当たり純資産額)	(17,589円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4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	8,748,156,592円
同期中における一部解約元本額	8,481,382,254円
期末元本額	25,336,454,968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	2,023,444,676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	1,237,518,086円
野村外国株インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	684,532,215円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,970,463円
インデックス・ブレンド(タイプ )	3,351,055円
インデックス・ブレンド(タイプ )	9,907,583円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,170,366円
インデックス・ブレンド(タイプ )	5,467,478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)	7,828,802,200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)	2,460,480,477円

NEXT FUNDS 外国株式・MSCI - KOKUSAI 指数(為替ヘッジあり)連動型上場投信	321,009,622円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	295,043,798円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	8,179,049,825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)	1,573,496,251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)	476,873,000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)	49,224,943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)	595,375円
野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	181,517,555円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	6,500	12.75	82,875.00	
		HALLIBURTON CO	10,600	7.46	79,076.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	4,200	11.48	48,216.00	
		SCHLUMBERGER LTD	16,200	14.69	237,978.00	
		TECHNIPFMC PLC	5,200	7.53	39,156.00	
		APACHE CORPORATION	4,400	8.57	37,708.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	4,600	21.03	96,738.00	
		CHENIERE ENERGY INC	2,500	41.30	103,250.00	
		CHEVRON CORP	22,100	81.64	1,804,244.00	
		CONCHO RESOURCES INC	2,340	49.61	116,087.40	
		CONOCOPHILLIPS	12,300	33.19	408,237.00	
		CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,180	11.02	13,003.60	
		DEVON ENERGY CORP	3,700	9.05	33,485.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	1,800	31.40	56,520.00	
		EOG RESOURCES INC	6,810	40.50	275,805.00	
		EXXON MOBIL CORP	49,500	40.96	2,027,520.00	
		HESS CORP	2,900	36.37	105,473.00	
		HOLLYFRONTIER CORP	1,600	26.58	42,528.00	
KINDER MORGAN INC	25,200	14.46	364,392.00			

MARATHON OIL CORP	10,800	4.24	45,792.00
MARATHON PETROLEUM CORP	7,600	23.72	180,272.00
NOBLE ENERGY INC	5,000	6.72	33,625.00
OCCIDENTAL PETE CORP	10,089	12.34	124,498.26
ONEOK INC	4,600	26.93	123,878.00
PHILLIPS 66	4,960	56.80	281,728.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,760	73.47	129,307.20
TARGA RESOURCES CORP	2,800	7.84	21,952.00
VALERO ENERGY CORP	4,530	49.45	224,008.50
WILLIAMS COS	14,600	18.02	263,092.00
AIR PRODUCTS	2,630	207.39	545,435.70
ALBEMARLE CORP	1,080	57.86	62,488.80
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,900	17.05	49,445.00
CELANESE CORP-SERIES A	1,480	73.46	108,720.80
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,400	26.86	64,464.00
CORTEVA INC	8,266	24.27	200,615.82
DOW INC	8,933	30.88	275,851.04
DUPONT DE NEMOURS INC	9,200	39.07	359,444.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	1,490	52.72	78,552.80
ECOLAB INC	2,930	170.16	498,568.80
FMC CORP	1,680	83.59	140,431.20
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	1,320	122.17	161,264.40
LINDE PLC	6,320	178.88	1,130,521.60
LYONDELLBASELL INDU-CL A	2,900	46.63	135,227.00
MOSAIC CO/THE	3,660	10.89	39,857.40
PPG INDUSTRIES	2,870	88.01	252,588.70
RPM INTERNATIONAL INC	1,200	62.82	75,384.00
SHERWIN-WILLIAMS	960	484.90	465,504.00
WESTLAKE CHEMICAL CORP	280	38.03	10,648.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	630	179.25	112,927.50
VULCAN MATERIALS CO	1,520	106.00	161,120.00
AMCOR PLC	19,400	8.26	160,244.00
AVERY DENNISON CORP	810	103.26	83,640.60
BALL CORP	3,300	65.54	216,282.00
CROWN HOLDINGS INC	1,800	59.48	107,064.00

IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	4,400	30.12	132,528.00	
PACKAGING CORP OP AMERICA	1,050	85.68	89,964.00	
SEALED AIR CORP	1,500	28.18	42,270.00	
WESTROCK CO	2,900	29.07	84,303.00	
FREEMONT-MCMORAN INC	14,500	7.41	107,445.00	
NEWMONT CORP	9,656	59.27	572,311.12	
NUCOR CORP	3,300	36.05	118,965.00	
STEEL DYNAMICS	2,100	22.22	46,662.00	
BOEING CO	6,300	136.33	858,879.00	
GENERAL DYNAMICS	2,640	131.69	347,661.60	
HEICO CORP	340	75.69	25,734.60	
HEICO CORP-CLASS A	1,090	67.10	73,139.00	
HOWMET AEROSPACE INC	4,400	10.59	46,596.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	540	184.45	99,603.00	
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,650	187.78	497,617.00	
LOCKHEED MARTIN	2,990	373.44	1,116,585.60	
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,900	333.68	633,992.00	
RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	17,458	62.65	1,093,743.70	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	1,120	19.37	21,694.40	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	360	304.80	109,728.00	
TEXTRON INC	2,800	26.15	73,220.00	
TRANSDIGM GROUP INC	610	307.75	187,727.50	
ALLEGION PLC	890	90.76	80,776.40	
CARRIER GLOBAL CORP	9,660	14.69	141,905.40	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	1,740	42.25	73,515.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	9,300	27.59	256,587.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	300	172.95	51,885.00	
MASCO CORP	3,300	38.46	126,918.00	
OWENS CORNING INC	1,050	37.23	39,091.50	
SMITH (A.O.) CORP	1,400	38.72	54,208.00	
TRANE TECHNOLOGIES PLC	2,830	80.50	227,815.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,300	78.21	101,673.00	
ACUITY BRANDS INC	440	82.09	36,119.60	
AMETEK INC	2,630	73.91	194,383.30	

EATON CORP PLC	4,540	76.91	349,171.40
EMERSON ELEC	6,900	50.77	350,313.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,270	164.46	208,864.20
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,600	31.68	50,688.00
3M CORP	6,780	141.63	960,251.40
GENERAL ELEC CO	103,000	6.48	667,440.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,400	132.00	1,108,800.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,500	50.40	126,000.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,600	23.26	60,476.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,200	310.58	372,696.00
CATERPILLAR INC DEL	6,540	109.85	718,419.00
CUMMINS INC	1,760	142.38	250,588.80
DEERE & COMPANY	3,400	134.06	455,804.00
DOVER CORP	1,700	84.51	143,667.00
FLOWSERVE CORP	1,480	23.93	35,416.40
FORTIVE CORP	3,470	55.84	193,764.80
IDEX CORP	950	148.63	141,198.50
ILLINOIS TOOL WORKS INC	3,830	151.77	581,279.10
INGERSOLL-RAND INC	3,497	26.38	92,250.86
MIDDLEBY CORP	660	49.27	32,518.20
OTIS WORLDWIDE CORP	4,830	45.90	221,697.00
PACCAR	3,890	65.72	255,670.25
PARKER HANNIFIN CORP	1,400	130.42	182,588.00
PENTAIR PLC	2,100	29.25	61,425.00
SNAP-ON INC	550	110.54	60,797.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,620	106.34	172,270.80
WABCO HOLDINGS INC	620	134.73	83,532.60
WABTEC CORP	2,200	50.06	110,132.00
XYLEM INC	2,150	68.08	146,372.00
AERCAP HOLDINGS NV	1,400	22.60	31,640.00
FASTENAL CO	6,000	34.14	204,840.00
GRAINGER(W.W.) INC	570	270.09	153,951.30
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,700	27.08	46,036.00
UNITED RENTALS INC	800	97.67	78,136.00
CINTAS CORP	960	190.50	182,880.00

COPART INC	2,600	66.14	171,977.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	2,880	76.57	220,521.60
ROLLINS INC	1,500	37.06	55,590.00
WASTE CONNECTIONS INC	3,000	84.02	252,060.00
WASTE MANAGEMENT INC	4,610	96.73	445,925.30
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	1,580	70.96	112,116.80
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	2,300	69.67	160,241.00
FEDEX CORPORATION	2,640	120.48	318,067.20
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	8,280	100.62	833,133.60
XPO LOGISTICS INC	800	57.90	46,320.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	1,100	11.00	12,100.00
DELTA AIR LINES INC	1,700	23.10	39,270.00
SOUTHWEST AIRLINES	1,500	30.11	45,165.00
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	860	27.88	23,976.80
AMERCO	80	259.17	20,733.60
CSX CORP	8,800	59.48	523,424.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	880	99.88	87,894.40
KANSAS CITY SOUTHERN	1,260	131.01	165,072.60
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	1,300	35.19	45,747.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,000	150.00	450,000.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	930	124.17	115,478.10
UBER TECHNOLOGIES INC	5,700	27.19	154,983.00
UNION PAC CORP	8,160	144.41	1,178,385.60
APTIV PLC	2,950	58.35	172,132.50
AUTOLIV INC	980	54.46	53,370.80
BORGWARNER INC	2,600	25.51	66,326.00
LEAR CORP	810	83.37	67,529.70
FORD MOTOR COMPANY	49,000	4.77	233,730.00
GENERAL MOTORS CO	15,100	21.24	320,724.00
HARLEY-DAVIDSON INC	1,800	17.74	31,932.00
TESLA INC	1,570	686.72	1,078,150.40
DR HORTON INC	4,300	38.02	163,486.00
GARMIN LTD	1,700	78.04	132,668.00
LEGGETT & PLATT INC	1,400	26.99	37,786.00

LENNAR CORP-A	3,000	40.15	120,450.00
MOHAWK INDUSTRIES	660	73.05	48,213.00
NEWELL BRANDS INC	5,900	12.52	73,868.00
NVR INC	44	2,805.44	123,439.36
PULTEGROUP INC	2,800	24.18	67,704.00
WHIRLPOOL CORP	700	98.18	68,726.00
HASBRO INC	1,640	72.34	118,637.60
POLARIS INC	640	59.12	37,836.80
CAPRI HOLDINGS LTD	1,900	11.48	21,812.00
HANESBRANDS INC	3,400	8.68	29,512.00
LULULEMON ATHLETICA INC	1,170	206.72	241,862.40
NIKE INC-B	14,550	85.20	1,239,660.00
PVH CORP	930	39.33	36,576.90
RALPH LAUREN CORPORATION	640	68.32	43,724.80
TAPESTRY INC	3,300	13.75	45,375.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,100	9.54	20,034.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	2,114	8.52	18,011.28
V F CORP	3,720	53.34	198,424.80
ARAMARK	3,000	20.43	61,290.00
CARNIVAL CORP	4,800	11.84	56,832.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	270	786.69	212,406.30
DARDEN RESTAURANTS INC	1,390	63.32	88,014.80
DOMINOS PIZZA INC	470	365.22	171,653.40
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,900	71.35	206,915.00
LAS VEGAS SANDS CORP	4,330	40.69	176,187.70
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	3,140	79.90	250,886.00
MCDONALD'S CORP	8,740	177.58	1,552,049.20
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,000	14.02	42,060.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	6,500	13.19	85,735.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,600	11.00	28,600.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,940	34.43	66,794.20
STARBUCKS CORP	13,700	72.72	996,264.00
VAIL RESORTS INC	500	150.59	75,295.00
WYNN RESORTS LTD	960	70.40	67,584.00
YUM BRANDS INC	3,810	81.20	309,372.00



GENUINE PARTS CO	1,560	71.04	110,822.40
LKQ CORP	4,300	19.93	85,699.00
AMAZON.COM INC	4,888	2,328.12	11,379,850.56
BOOKING HOLDINGS INC	477	1,342.22	640,238.94
EBAY INC	8,200	37.61	308,402.00
EXPEDIA GROUP INC	1,510	57.25	86,447.50
GRUBHUB INC	800	40.93	32,744.00
MERCADOLIBRE INC	560	573.38	321,092.80
WAYFAIR INC - CLASS A	840	95.84	80,505.60
DOLLAR GENERAL CORP	3,060	178.74	546,944.40
DOLLAR TREE INC	2,600	77.74	202,124.00
KOHL'S CORP	2,100	16.48	34,608.00
NORDSTROM INC	1,600	16.68	26,688.00
TARGET CORP	5,990	106.90	640,331.00
ADVANCE AUTO PARTS	760	113.51	86,267.60
AUTOZONE	264	978.85	258,416.40
BEST BUY COMPANY INC	2,700	67.80	183,060.00
BURLINGTON STORES INC	670	172.59	115,635.30
CARMAX INC	1,700	63.58	108,086.00
GAP INC	2,400	7.56	18,144.00
HOME DEPOT	12,650	200.61	2,537,716.50
LOWE'S COS INC	8,910	92.62	825,244.20
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	860	358.30	308,138.00
ROSS STORES INC	4,350	82.70	359,745.00
TIFFANY & CO	1,390	129.32	179,754.80
TJX COS INC	14,100	46.05	649,305.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,600	93.13	149,008.00
ULTA BEAUTY INC	620	201.57	124,973.40
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	5,180	301.33	1,560,889.40
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	4,500	4.62	20,790.00
KROGER CO	9,500	32.17	305,615.00
SYSCO CORP	5,500	49.10	270,050.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,900	42.55	378,695.00
WALMART INC	16,620	129.21	2,147,470.20
BROWN-FORMAN CORP-CL B	3,800	60.29	229,102.00

COCA COLA CO	47,500	45.38	2,155,550.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,300	38.82	89,286.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,910	153.02	292,268.20
MOLSON COORS BEVERAGE CO-B	1,960	42.10	82,516.00
MONSTER BEVERAGE CORP	4,800	59.04	283,392.00
PEPSICO INC	16,290	130.94	2,133,012.60
ARCHER DANIELS MIDLAND	6,300	35.00	220,500.00
BUNGE LIMITED	1,700	36.13	61,421.00
CAMPBELL SOUP CO	2,000	50.44	100,880.00
CONAGRA BRANDS INC	6,100	33.83	206,363.00
GENERAL MILLS	6,500	59.78	388,570.00
HERSHEY CO/THE	1,890	141.62	267,661.80
HORMEL FOODS CORP	3,600	48.93	176,148.00
INGREDION INC	690	77.44	53,433.60
JM SMUCKER CO/THE-NEW	1,230	117.36	144,352.80
KELLOGG CO	3,100	65.52	203,112.00
KRAFT HEINZ CO/THE	7,800	28.47	222,066.00
LAMB WESTON HOLDINGS INC	1,400	55.71	77,994.00
MCCORMICK & CO INC.	1,450	151.18	219,211.00
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	17,000	51.08	868,360.00
TYSON FOODS INC-CL A	3,100	61.91	191,921.00
ALTRIA GROUP INC	21,400	37.76	808,064.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	18,300	72.28	1,322,724.00
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,560	70.55	180,608.00
CLOROX CO	1,340	190.77	255,631.80
COLGATE PALMOLIVE CO.	9,700	70.61	684,917.00
KIMBERLY-CLARK CORP	4,090	139.47	570,432.30
PROCTER & GAMBLE CO	29,050	119.68	3,476,704.00
COTY INC-CL A	4,300	5.67	24,381.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,530	161.11	407,608.30
ABBOTT LABORATORIES	20,700	94.05	1,946,835.00
ABIOMED INC	500	164.50	82,250.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	810	187.26	151,680.60
BAXTER INTERNATIONAL INC.	5,270	90.10	474,827.00
BECTON, DICKINSON	3,200	256.50	820,800.00

BOSTON SCIENTIFIC CORP	16,600	35.05	581,830.00
DANAHER CORP	7,370	153.75	1,133,137.50
DENTSPLY SIRONA INC	2,420	39.66	95,977.20
DEXCOM INC	1,160	308.39	357,732.40
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,260	216.02	488,205.20
HOLOGIC INC	2,900	42.35	122,815.00
IDEXX LABORATORIES INC	910	259.23	235,899.30
INSULET CORP	580	197.51	114,555.80
INTUITIVE SURGICAL INC	1,340	496.63	665,484.20
MEDTRONIC PLC	15,710	97.61	1,533,453.10
RESMED INC	1,680	157.35	264,348.00
STERIS PLC	1,140	147.78	168,469.20
STRYKER CORP	4,000	178.91	715,640.00
TELEFLEX INC	510	328.35	167,458.50
THE COOPER COMPANIES, INC.	620	288.53	178,888.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,060	104.10	110,346.00
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	700	165.20	115,640.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,500	112.14	280,350.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,650	85.57	141,190.50
ANTHEM INC	2,970	249.37	740,628.90
CARDINAL HEALTH INC	3,500	48.27	168,945.00
CENTENE CORP	6,300	66.24	417,312.00
CIGNA CORP	4,330	177.91	770,350.30
CVS HEALTH CORP	14,900	60.25	897,725.00
DAVITA INC	1,400	72.53	101,542.00
HCA HEALTHCARE INC	3,210	105.47	338,558.70
HENRY SCHEIN INC	2,100	52.03	109,263.00
HUMANA INC	1,480	358.86	531,112.80
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,050	148.18	155,589.00
MCKESSON CORP	2,020	132.44	267,528.80
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,360	94.46	128,465.60
UNITEDHEALTH GROUP INC	11,050	274.19	3,029,799.50
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	870	97.78	85,068.60
ABBVIE INC	17,350	80.36	1,394,246.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,510	103.39	259,508.90

ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,090	137.85	150,256.50
AMGEN INC	6,960	230.75	1,606,020.00
BEIGENE, LTD ADR	480	158.53	76,094.40
BIOGEN INC	2,050	329.01	674,470.50
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,140	90.72	194,140.80
EXACT SCIENCES CORP	1,690	76.51	129,301.90
GILEAD SCIENCES INC	14,770	78.53	1,159,888.10
INCYTE CORP	1,800	99.46	179,028.00
IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,200	53.38	64,056.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	820	97.00	79,540.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	880	544.46	479,124.80
SAREPTA THERAPEUTICS INC	1,100	113.40	124,740.00
SEATTLE GENETICS INC	1,620	137.37	222,539.40
VERTEX PHARMACEUTICALS	3,050	262.80	801,540.00
ALLERGAN PLC	3,890	184.04	715,915.60
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	27,500	60.59	1,666,225.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	5,000	23.88	119,400.00
ELI LILLY & CO.	10,130	152.67	1,546,547.10
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	550	103.25	56,787.50
JOHNSON & JOHNSON	30,600	149.68	4,580,208.00
MERCK & CO INC	29,720	78.56	2,334,803.20
MYLAN NV	6,100	15.13	92,293.00
PERRIGO CO PLC	1,700	49.69	84,473.00
PFIZER INC	64,600	35.62	2,301,052.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	11,800	9.76	115,168.00
ZOETIS INC	5,650	124.70	704,555.00
BANK OF AMERICA CORP	99,800	21.64	2,159,672.00
CITIGROUP	25,700	41.57	1,068,349.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,300	19.29	102,237.00
COMERICA INC	1,800	29.43	52,974.00
EAST WEST BANCORP INC	1,900	27.36	51,984.00
FIFTH THIRD BANCORP	7,800	16.26	126,828.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,700	97.73	166,141.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	11,900	7.80	92,820.00
JPMORGAN CHASE & CO	36,430	89.05	3,244,091.50

KEYCORP	12,300	10.32	126,936.00
M & T BANK CORP	1,410	104.63	147,528.30
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	5,700	10.98	62,586.00
PNC FINANCIAL	4,970	99.00	492,030.00
REGIONS FINANCIAL CORP	12,300	8.88	109,224.00
SIGNATURE BANK	520	87.68	45,593.60
SVB FINANCIAL GROUP	630	165.49	104,258.70
TRUIST FINANCIAL CORP	16,000	34.03	544,480.00
US BANCORP	17,600	32.73	576,048.00
WELLS FARGO CO	47,100	26.84	1,264,164.00
ZIONS BANCORP NA	2,300	28.65	65,895.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	15,330	183.48	2,812,748.40
EQUITABLE HOLDINGS INC	4,100	14.63	59,983.00
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	3,000	12.11	36,330.00
VOYA FINANCIAL INC	2,100	41.13	86,373.00
AFLAC INC	8,000	34.59	276,720.00
ALLEGHANY CORP	170	532.90	90,593.00
ALLSTATE CORP	3,730	100.09	373,335.70
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,130	62.80	70,964.00
AMERICAN INTL GROUP	10,100	22.25	224,725.00
AON PLC	2,800	178.18	498,904.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	4,100	25.29	103,689.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,400	77.54	186,096.00
ASSURANT INC	750	101.15	75,862.50
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,000	22.25	44,500.00
BROWN & BROWN INC	2,200	35.50	78,100.00
CHUBB LTD	5,390	112.39	605,782.10
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,520	80.17	121,858.40
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	200	177.41	35,482.00
EVEREST RE GROUP LTD	440	179.60	79,024.00
FNF GROUP	3,500	24.86	87,010.00
GLOBE LIFE INC	1,230	73.51	90,417.30
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	4,100	36.76	150,716.00
LINCOLN NATIONAL CORP	2,200	27.13	59,686.00
LOEWS CORP	2,800	33.71	94,388.00

MARKEL CORP	144	889.44	128,079.36
MARSH & MCLENNAN COS	5,780	92.70	535,806.00
METLIFE INC	9,000	31.46	283,140.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,080	28.43	87,564.40
PROGRESSIVE CO	6,980	81.25	567,125.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,430	51.79	229,429.70
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	750	96.24	72,180.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	490	148.34	72,686.60
TRAVELERS COS INC/THE	2,800	101.78	284,984.00
UNUM GROUP	2,700	14.39	38,853.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,360	182.50	248,200.00
WR BERKLEY CORP	1,485	53.35	79,224.75
ACCENTURE PLC-CL A	7,450	166.24	1,238,488.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	1,800	103.36	186,048.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	510	35.97	18,344.70
AUTOMATIC DATA PROCESS	5,130	133.61	685,419.30
BLACK KNIGHT INC	1,400	65.98	92,372.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	1,300	73.49	95,537.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	1,410	107.36	151,377.60
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	6,000	50.99	305,940.00
DXC TECHNOLOGY CO	3,310	14.41	47,697.10
EPAM SYSTEMS INC	530	193.98	102,809.40
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	7,250	117.47	851,657.50
FISERV INC	6,860	91.76	629,473.60
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	950	204.30	194,085.00
GARTNER INC	920	101.58	93,453.60
GLOBAL PAYMENTS INC	3,590	141.29	507,231.10
GODADDY INC - CLASS A	1,800	64.41	115,938.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	10,400	116.76	1,214,304.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	970	156.38	151,688.60
LEIDOS HOLDINGS INC	1,800	94.56	170,208.00
MASTERCARD INC	10,470	245.35	2,568,814.50
MONGODB INC	640	152.24	97,433.60
OKTA INC	1,420	148.41	210,742.20
PAYCHEX INC	3,400	64.02	217,668.00

PAYPAL HOLDINGS INC	13,090	107.54	1,407,698.60
SABRE CORP	3,700	5.57	20,609.00
SQUARE INC - A	4,100	57.40	235,340.00
TWILIO INC - A	1,460	105.00	153,300.00
VERISIGN INC	1,100	206.75	227,425.00
VISA INC-CLASS A SHARES	19,960	160.53	3,204,178.80
WESTERN UNION CO	5,500	18.69	102,795.00
WIX.COM LTD	530	126.43	67,007.90
ADOBE INC	5,660	328.99	1,862,083.40
ANSYS INC	950	253.28	240,616.00
AUTODESK INC.	2,480	170.02	421,649.60
CADENCE DESIGN SYS INC	2,900	74.59	216,311.00
CDK GLOBAL INC	1,430	34.05	48,691.50
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	1,430	101.79	145,559.70
CITRIX SYSTEMS INC	1,590	146.64	233,157.60
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	510	91.29	46,557.90
DOCUSIGN INC	900	99.33	89,397.00
DROPBOX INC-CLASS A	1,500	19.66	29,490.00
FORTINET INC	1,500	101.18	151,770.00
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	770	85.26	65,650.20
INTUIT INC	3,080	249.15	767,382.00
MICROSOFT CORP	84,140	167.82	14,120,374.80
NORTONLIFELOCK INC	6,700	19.38	129,846.00
ORACLE CORPORATION	26,900	51.31	1,380,239.00
PALO ALTO NETWORKS INC	1,010	186.51	188,375.10
PAYCOM SOFTWARE INC	490	208.20	102,018.00
PTC INC	1,590	62.97	100,122.30
RINGCENTRAL INC-CLASS A	980	234.58	229,888.40
SALESFORCE.COM INC	9,760	150.56	1,469,465.60
SERVICENOW INC	2,180	288.77	629,518.60
SPLUNK INC	1,750	127.18	222,565.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,200	50.08	110,176.00
SYNOPSYS INC	1,780	144.84	257,815.20
TYLER TECHNOLOGIES INC	370	312.90	115,773.00

VMWARE INC - CLASS A	900	124.97	112,473.00
WORKDAY INC-CLASS A	1,860	140.15	260,679.00
ARISTA NETWORKS INC	560	200.05	112,028.00
CISCO SYSTEMS	49,600	40.55	2,011,280.00
F5 NETWORKS INC	760	119.84	91,078.40
JUNIPER NETWORKS INC	4,100	22.61	92,701.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,940	144.68	280,679.20
APPLE INC	51,570	268.37	13,839,840.90
DELL TECHNOLOGIES-C	2,200	37.40	82,280.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	16,500	9.05	149,325.00
HP INC	18,500	14.42	266,770.00
NETAPP INC	2,900	38.94	112,926.00
SEAGATE TECHNOLOGY	3,200	49.74	159,168.00
WESTERN DIGITAL CORP	3,040	37.83	115,003.20
XEROX HOLDINGS CORP	2,500	16.77	41,925.00
AMPHENOL CORP-CL A	3,740	76.92	287,680.80
ARROW ELECTRS INC	750	50.87	38,152.50
CDW CORPORATION	1,500	98.84	148,267.50
COGNEX CORP	1,640	46.93	76,965.20
CORNING INC	8,300	19.44	161,352.00
FLEX LTD	4,700	7.49	35,203.00
FLIR SYSTEMS INC	1,200	40.65	48,780.00
IPG PHOTONICS CORP	360	111.65	40,194.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	2,300	91.60	210,680.00
TE CONNECTIVITY LTD	3,720	64.55	240,126.00
TRIMBLE INC	2,500	31.68	79,200.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	530	192.85	102,210.50
ADVANCED MICRO DEVICES	12,600	52.92	666,792.00
ANALOG DEVICES INC	4,140	96.47	399,385.80
APPLIED MATERIALS	11,000	48.33	531,630.00
BROADCOM INC	4,660	247.65	1,154,049.00
INTEL CORP	50,700	56.36	2,857,452.00
KLA CORP	1,760	148.59	261,518.40
LAM RESEARCH	1,660	243.63	404,425.80
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	7,400	25.28	187,072.00



MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,800	50.35	140,980.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	2,660	74.85	199,101.00
MICRON TECHNOLOGY	12,500	41.41	517,625.00
NVIDIA CORP	6,800	269.51	1,832,668.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,420	81.06	277,225.20
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	3,900	12.83	50,037.00
QORVO INC	1,200	81.18	97,416.00
QUALCOMM INC	13,500	71.84	969,840.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,950	88.10	171,795.00
TERADYNE INC	1,600	60.93	97,488.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	10,990	106.84	1,174,171.60
XILINX INC	2,680	86.32	231,337.60
AT & T INC	85,200	29.87	2,544,924.00
CENTURYLINK INC	11,200	9.71	108,752.00
VERIZON COMMUNICATIONS	48,200	56.82	2,738,724.00
T-MOBILE US INC	4,648	87.22	405,398.56
ALLIANT ENERGY CORP	2,400	49.70	119,280.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,370	82.47	442,863.90
DUKE ENERGY CORP	8,680	85.44	741,619.20
EDISON INTERNATIONAL	3,900	58.19	226,941.00
ENTERGY CORP	2,420	94.66	229,077.20
EVERGY INC	2,500	58.24	145,600.00
EVERSOURCE ENERGY	3,470	87.20	302,584.00
EXELON CORPORATION	11,500	35.68	410,320.00
FIRSTENERGY CORP	5,800	43.20	250,560.00
NEXTERA ENERGY INC	5,730	235.42	1,348,956.60
NRG ENERGY INC	2,800	30.31	84,868.00
OGE ENERGY CORP	2,700	29.46	79,542.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	1,150	75.61	86,951.50
PPL CORPORATION	9,200	24.57	226,044.00
SOUTHERN CO.	12,400	55.50	688,200.00
XCEL ENERGY INC	5,700	63.41	361,437.00
ATMOS ENERGY CORP	1,170	100.79	117,924.30
UGI CORP	2,500	27.30	68,250.00
AMEREN CORPORATION	3,000	74.02	222,060.00

CENTERPOINT ENERGY INC	6,100	15.51	94,611.00
CMS ENERGY CORP	3,000	58.41	175,230.00
CONSOLIDATED EDISON INC	3,800	83.49	317,262.00
DOMINION ENERGY INC	9,500	76.61	727,795.00
DTE ENERGY COMPANY	2,250	99.14	223,065.00
NISOURCE INC	4,700	25.38	119,286.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	5,700	50.01	285,057.00
SEMPRA ENERGY	3,400	119.27	405,518.00
WEC ENERGY GROUP INC	3,600	95.14	342,504.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,180	125.43	273,437.40
ESSENTIAL UTILITIES INC	2,000	41.29	82,580.00
ALLY FINANCIAL INC	4,000	14.18	56,720.00
AMERICAN EXPRESS CO	8,150	81.52	664,388.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,270	51.16	269,613.20
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,600	34.30	123,480.00
SYNCHRONY FINANCIAL	6,800	15.17	103,156.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,530	103.45	158,278.50
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	9,700	35.21	341,537.00
BLACKROCK INC	1,360	474.37	645,143.20
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	7,300	45.50	332,150.00
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,240	100.39	124,483.60
CME GROUP INC	4,160	178.02	740,563.20
E*TRADE FINANCIAL CORP	3,100	37.64	116,684.00
EATON VANCE CORP	1,600	32.56	52,096.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	360	266.54	95,954.40
FRANKLIN RESOURCES INC	3,400	15.98	54,332.00
GOLDMAN SACHS GROUP	3,790	173.81	658,739.90
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6,640	87.53	581,199.20
INVESCO LTD	4,400	8.93	39,292.00
KKR & CO INC-A	4,800	21.84	104,832.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	500	410.49	205,245.00
MOODYS CORP	1,830	228.26	417,715.80
MORGAN STANLEY	14,300	36.95	528,385.00
MSCI INC	1,070	311.32	333,112.40
NASDAQ INC	1,430	105.27	150,536.10

NORTHERN TRUST CORP	2,180	74.43	162,257.40
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,300	61.28	79,664.00
S&P GLOBAL INC	2,800	267.23	748,244.00
SCHWAB(CHARLES)CORP	13,100	35.94	470,814.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,400	48.13	67,382.00
STATE STREET CORP	4,500	55.99	251,955.00
T ROWE PRICE GROUP INC	2,730	98.85	269,860.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	3,600	37.49	134,964.00
AES CORP	7,900	12.46	98,434.00
VISTRA ENERGY CORP	4,600	17.02	78,292.00
CERNER CORP	3,300	68.59	226,347.00
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,500	176.24	264,360.00
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,590	73.75	264,762.50
BIO-RAD LABORATORIES-A	200	417.71	83,542.00
ILLUMINA INC	1,740	310.40	540,096.00
IQVIA HOLDINGS INC	1,910	122.00	233,020.00
METTLER-TOLEDO INTL	300	683.43	205,029.00
PERKINELMER INC	1,010	82.64	83,466.40
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,700	319.62	1,502,214.00
WATERS CORP	810	185.39	150,165.90
COSTAR GROUP INC	390	562.99	219,566.10
EQUIFAX INC	1,580	130.04	205,463.20
IHS MARKIT LTD	4,500	62.57	281,565.00
MANPOWERGROUP INC	590	66.65	39,323.50
NIelsen HOLDINGS PLC	3,700	11.94	44,178.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	1,430	41.30	59,059.00
TRUNION	2,300	70.26	161,598.00
VERISK ANALYTICS INC	1,720	145.21	249,761.20
CBRE GROUP INC	4,000	39.97	159,880.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	13,000	4.07	52,910.00
JONES LANG LASALLE INC	470	98.98	46,520.60
ALTICE USA INC-A	1,200	24.89	29,868.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,780	490.78	873,588.40
COMCAST CORP-CL A	53,100	35.71	1,896,201.00
DISCOVERY INC - A	2,030	20.78	42,183.40
DISCOVERY INC - C	5,000	19.00	95,025.00

	DISH NETWORK CORP-A	2,400	21.57	51,768.00	
	FOX CORP-CLASS A	3,900	25.54	99,606.00	
	FOX CORP-CLASS B	1,900	25.05	47,595.00	
	INTERPUBRIC GROUP	3,600	14.03	50,508.00	
	LIBERTY BROADBAND CORP-C	1,340	122.57	164,243.80	
	LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	5,300	16.81	89,093.00	
	LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,300	17.62	40,526.00	
	LIBERTY SIRIUS GROUP-C	2,030	29.48	59,844.40	
	LIBERTY SIRIUSXM GROUP	1,160	29.08	33,732.80	
	NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	4,300	8.43	36,270.50	
	OMNICOM GROUP	2,620	51.34	134,510.80	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	17,000	5.00	85,000.00	
	VIACOMCBS INC-CLASS B	5,846	15.15	88,566.90	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	8,400	65.72	552,048.00	
	DISNEY (WALT) CO	21,060	100.54	2,117,372.40	
	ELECTRONIC ARTS	3,150	113.27	356,800.50	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	1,900	25.60	48,640.00	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,400	36.47	51,058.00	
	NETFLIX INC	5,120	433.83	2,221,209.60	
	ROKU INC	1,110	123.56	137,151.60	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	1,380	125.73	173,507.40	
	ALPHABET INC-CL A	3,488	1,212.16	4,228,014.08	
	ALPHABET INC-CL C	3,599	1,216.34	4,377,607.66	
	FACEBOOK INC-A	28,000	170.80	4,782,400.00	
	IAC/INTERACTIVE CORP	950	214.68	203,946.00	
	MATCH GROUP INC	400	76.90	30,760.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	4,500	16.87	75,915.00	
	SNAP INC-A	9,500	12.44	118,180.00	
	TRIPADVISOR INC	1,300	17.36	22,568.00	
	TWITTER INC	8,300	25.75	213,725.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	1,120	36.20	40,544.00	
小計	銘柄数：608			269,206,788.40	
				(29,036,644,196)	
	組入時価比率：65.2%			71.4%	
カナダドル	CAMECO CORP	5,000	13.36	66,800.00	

CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	14,700	17.60	258,720.00
CENOVUS ENERGY INC	14,000	3.73	52,220.00
ENBRIDGE INC	24,000	39.90	957,600.00
HUSKY ENERGY INC	3,779	3.67	13,868.93
IMPERIAL OIL	2,900	17.34	50,286.00
INTER PIPELINE LTD	3,800	10.20	38,760.00
KEYERA CORP	2,020	16.67	33,673.40
OVINTIV INC	2,800	5.50	15,400.00
PARKLAND FUEL CORP	1,200	26.70	32,040.00
PEMBINA PIPELINE CORP	6,500	26.59	172,835.00
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1,800	8.41	15,138.00
SUNCOR ENERGY INC	18,800	20.64	388,032.00
TC ENERGY CORP	11,200	62.80	703,360.00
METHANEX CORP	970	17.92	17,382.40
NUTRIEN LTD	6,700	47.59	318,853.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,450	41.23	59,783.50
AGNICO EAGLE MINES LTD	2,400	76.46	183,504.00
BARRICK GOLD	21,400	35.16	752,424.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7,800	7.14	55,692.00
FRANCO-NEVADA CORP	1,960	177.95	348,782.00
KINROSS GOLD CORP	10,000	8.81	88,100.00
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	2,800	51.95	145,460.00
LUNDIN MINING CORP	8,000	6.02	48,160.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	6,100	10.03	61,183.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	4,500	49.63	223,335.00
WEST FRASER TIMBER	780	28.23	22,019.40
BOMBARDIER B SHEARS	19,500	0.41	7,995.00
CAE INC	2,300	20.81	47,863.00
WSP GLOBAL INC	1,100	87.87	96,657.00
AIR CANADA	2,000	17.75	35,500.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	8,490	107.70	914,373.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,630	305.50	497,965.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,000	49.05	147,150.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,700	21.07	56,889.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL	3,700	60.19	222,703.00

INC			
STARS GROUP INC/THE	3,500	34.85	121,975.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	660	92.07	60,766.20
DOLLARAMA INC	3,120	42.79	133,504.80
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	9,100	39.32	357,812.00
EMPIRE CO LTD A	1,300	32.32	42,016.00
LOBLAW COMPANIES	2,400	72.89	174,936.00
METRO INC	3,400	59.44	202,096.00
WESTON(GEORGE)LTD	714	102.72	73,342.08
SAPUTO INC	3,100	35.19	109,089.00
AURORA CANNABIS INC	9,000	1.02	9,180.00
BAUSCH HEALTH COS INC	3,900	23.00	89,700.00
CANOPY GROWTH CORP	2,800	21.27	59,556.00
CRONOS GROUP INC	1,600	8.44	13,504.00
BANK OF MONTREAL	7,200	66.43	478,296.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	14,000	52.46	734,440.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	4,700	77.80	365,660.00
NATIONAL BANK OF CANADA	3,500	51.44	180,040.00
ROYAL BANK OF CANADA	16,900	83.73	1,415,037.00
TORONTO DOMINION BANK	21,400	54.49	1,166,086.00
ONEX CORPORATION	900	60.50	54,450.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	330	393.10	129,723.00
GREAT-WEST LIFECO INC	3,800	20.93	79,534.00
IA FINANCIAL CORP INC	800	41.70	33,360.00
INTACT FINANCIAL CORP	1,460	130.17	190,048.20
MANULIFE FINANCIAL CORP	22,900	16.27	372,583.00
POWER CORPORATION OF CANADA	6,965	20.14	140,275.10
SUN LIFE FINANCIAL INC	6,800	42.98	292,264.00
CGI INC	3,000	81.84	245,520.00
SHOPIFY INC - CLASS A	1,240	831.03	1,030,477.20
BLACKBERRY LTD	4,500	5.55	24,975.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	236	1,324.71	312,631.56
OPEN TEXT CORP	3,100	51.39	159,309.00
BCE INC	2,200	56.69	124,718.00
TELUS CORP	5,200	21.81	113,412.00

	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	4,200	57.44	241,248.00	
	EMERA INC	3,300	53.14	175,362.00	
	FORTIS INC	5,000	52.76	263,800.00	
	HYDRO ONE LTD	3,100	25.35	78,585.00	
	ALTAGAS LTD	3,600	14.03	50,508.00	
	ALGONQUIN POWER & UTILITIES	7,300	19.20	140,160.00	
	ATCO LTD CL1	900	37.36	33,624.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	1,090	33.64	36,667.60	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	15,300	45.12	690,336.00	
	CI FINANCIAL CORP	3,700	13.88	51,356.00	
	IGM FINANCIAL INC	600	25.84	15,504.00	
	THOMSON REUTERS CORP	2,451	98.20	240,688.20	
	QUEBECOR INC-CL B	1,400	29.75	41,650.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	6,100	22.43	136,823.00	
小計	銘柄数：84			18,437,134.57	
				(1,400,300,370)	
	組入時価比率：3.1%			3.4%	
ユ-口	TENARIS SA	5,400	5.47	29,581.20	
	ENI SPA	28,700	7.96	228,452.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	5,800	9.06	52,571.20	
	NESTE OYJ	4,600	27.19	125,074.00	
	OMV AG	1,600	25.20	40,320.00	
	REPSOL SA	16,690	7.27	121,469.82	
	TOTAL SA	28,200	29.70	837,540.00	
	VOPAK	700	51.72	36,204.00	
	AIR LIQUIDE SA	5,610	115.75	649,357.50	
	AKZO NOBEL	2,600	62.16	161,616.00	
	ARKEMA	850	73.16	62,186.00	
	BASF SE	10,500	43.00	451,500.00	
	COVESTRO AG	2,240	29.32	65,676.80	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,800	21.50	38,700.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	740	36.08	26,699.20	
	KONINKLIJKE DSM NV	2,200	111.75	245,850.00	
	LANXESS	970	40.82	39,595.40	
	SOLVAY SA	920	67.14	61,768.80	
	SYMRISE AG	1,530	94.64	144,799.20	

UMICORE	2,400	36.35	87,240.00
CRH PLC	9,700	24.37	236,389.00
HEIDELBERGCEMENT AG	1,470	38.46	56,536.20
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,500	25.10	62,750.00
ARCELORMITTAL	8,000	8.32	66,600.00
THYSSENKRUPP AG	4,800	5.44	26,112.00
VOESTALPINE AG	1,400	18.46	25,851.00
STORA ENSO OYJ-R	6,100	10.05	61,335.50
UPM-KYMMENE OYJ	6,200	23.64	146,568.00
AIRBUS SE	7,030	51.96	365,278.80
DASSAULT AVIATION SA	26	780.50	20,293.00
LEONARDO SPA	4,200	6.20	26,040.00
MTU AERO ENGINES AG	550	110.15	60,582.50
SAFRAN SA	3,720	73.92	274,982.40
THALES SA	1,360	71.22	96,859.20
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	5,500	23.68	130,240.00
KINGSPAN GROUP PLC	1,700	42.90	72,930.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	3,341	20.00	66,820.00
BOUYGUES	2,130	25.15	53,569.50
EIFFAGE SA	930	70.10	65,193.00
FERROVIAL SA	5,600	22.71	127,176.00
HOCHTIEF AG	160	65.35	10,456.00
VINCI	6,150	70.00	430,500.00
LEGRAND SA	2,900	55.98	162,342.00
PRYSMIAN SPA	2,800	15.15	42,434.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,590	81.26	535,503.40
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	1,800	13.62	24,516.00
SIEMENS AG	9,060	77.54	702,512.40
ALSTOM	2,100	39.70	83,370.00
ANDRITZ AG	700	30.30	21,210.00
CNH INDUSTRIAL NV	13,600	5.62	76,540.80
GEA GROUP AG	1,700	20.23	34,391.00
KION GROUP AG	970	43.45	42,146.50
KNORR-BREMSE AG	490	80.90	39,641.00
KONE OYJ	4,100	52.02	213,282.00



METSO OYJ	1,200	22.11	26,532.00
WARTSILA OYJ	4,800	6.35	30,508.80
BRENNTAG AG	1,900	38.28	72,732.00
DEUTSCHE POST AG-REG	10,500	25.80	270,900.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	3,000	7.99	23,970.00
ADP	290	86.35	25,041.50
AENA SME SA	870	112.10	97,527.00
ATLANTIA SPA	5,300	12.86	68,184.50
FRAPORT AG	380	38.04	14,455.20
GETLINK	6,300	10.76	67,788.00
CONTINENTAL AG	1,380	68.18	94,088.40
FAURECIA	750	30.61	22,957.50
MICHELIN (CGDE)	1,990	84.66	168,473.40
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,800	18.26	32,868.00
PIRELLI & C. SPA	3,500	3.32	11,648.00
VALEO SA	2,400	15.11	36,264.00
BAYER MOTOREN WERK	3,600	48.56	174,816.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	760	40.76	30,977.60
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	10,700	27.43	293,501.00
FERRARI NV	1,440	142.60	205,344.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	13,400	7.09	95,113.20
PEUGEOT CITROEN	6,900	11.69	80,695.50
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	1,600	40.95	65,520.00
RENAULT SA	2,020	16.33	32,990.64
VOLKSWAGEN AG	370	128.40	47,508.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,320	116.50	270,280.00
SEB SA	260	114.00	29,640.00
ADIDAS AG	2,110	211.20	445,632.00
ESSILORLUXOTTICA	3,334	105.85	352,903.90
HERMES INTERNATIONAL	400	669.20	267,680.00
KERING SA	880	489.00	430,320.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	3,220	350.00	1,127,000.00
MONCLER SPA	1,700	34.00	57,800.00
PUMA SE	1,200	54.20	65,040.00
ACCOR SA	2,100	25.63	53,823.00

FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	904	100.85	91,168.40
SODEXO	1,110	66.60	73,926.00
DELIVERY HERO SE	1,000	67.96	67,960.00
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	1,300	88.90	115,570.00
PROSUS NV	5,700	64.88	369,816.00
ZALANDO SE	1,800	42.00	75,600.00
INDITEX SA	12,300	24.35	299,505.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	7,600	13.62	103,512.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	700	35.55	24,885.00
COLRUYT SA	400	55.76	22,304.00
JERONIMO MARTINS	2,800	15.63	43,778.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	13,100	22.60	296,060.00
METRO AG	1,700	7.54	12,821.40
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	9,000	38.26	344,385.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	5,500	6.67	36,718.00
HEINEKEN HOLDING NV	1,290	69.95	90,235.50
HEINEKEN NV	2,840	77.36	219,702.40
PERNOD RICARD SA	2,450	138.20	338,590.00
REMY COINTREAU	140	101.70	14,238.00
DANONE	7,300	62.84	458,732.00
KERRY GROUP PLC-A	1,820	104.60	190,372.00
HENKEL AG & CO KGAA	1,450	67.95	98,527.50
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,220	76.26	169,297.20
BEIERSDORF AG	1,280	95.88	122,726.40
LOREAL-ORD	2,940	245.80	722,652.00
UNILEVER NV	17,300	46.13	798,049.00
BIOMERIEUX	420	113.40	47,628.00
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	390	91.50	35,685.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	10,100	38.43	388,143.00
SARTORIUS AG-VORZUG	320	257.40	82,368.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,600	37.78	60,456.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	2,300	66.48	152,904.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,200	36.42	189,384.00
GALAPAGOS NV	640	192.00	122,880.00
GRIFOLS SA	3,600	33.09	119,124.00

BAYER AG-REG	11,600	58.04	673,264.00
IPSEN	520	58.35	30,342.00
MERCK KGAA	1,700	100.80	171,360.00
ORION OYJ	1,000	42.92	42,920.00
RECORDATI SPA	1,100	38.16	41,976.00
SANOFI	13,200	88.09	1,162,788.00
UCB SA	1,400	84.00	117,600.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	4,400	6.43	28,292.00
AIB GROUP PLC	8,000	0.90	7,240.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	82,000	2.47	203,278.00
BANCO DE SABADELL SA	71,057	0.36	25,836.32
BANCO SANTANDER SA	199,000	1.87	372,209.60
BANK OF IRELAND GROUP PLC	11,500	1.33	15,295.00
BANKIA SA	12,250	0.89	10,953.95
BANKINTER S.A.	8,200	3.27	26,846.80
BNP PARIBAS	12,800	24.67	315,776.00
CAIXABANK	41,000	1.55	63,550.00
COMMERZBANK AG	11,400	3.03	34,576.20
CREDIT AGRICOLE SA	14,400	6.25	90,086.40
ERSTE GROUP BANK AG	3,300	15.92	52,552.50
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	5,600	8.16	45,707.20
ING GROEP NV	48,200	4.52	218,201.40
INTESA SANPAOLO	176,000	1.32	232,320.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	13,429	0.00	0.00
KBC GROEP NV	2,750	42.37	116,517.50
MEDIOBANCA S.P.A.	8,600	4.88	42,011.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	1,500	14.30	21,450.00
SOCIETE GENERALE	9,700	13.16	127,652.00
UNICREDIT SPA	24,000	6.59	158,160.00
EURAZEO SE	350	40.22	14,077.00
EXOR NV	1,300	47.42	61,646.00
GROUPE BRUXELLES LAM	940	67.58	63,525.20
WENDEL	260	75.45	19,617.00
AEGON NV	18,000	2.11	38,142.00
AGEAS	1,800	30.63	55,134.00

ALLIANZ SE-REG	4,930	161.30	795,209.00
ASSICURAZIONI GENERALI	12,300	12.16	149,629.50
AXA	22,800	14.68	334,749.60
CNP ASSURANCES	1,640	8.00	13,128.20
HANNOVER RUECK SE	610	133.70	81,557.00
MAPFRE SA	12,700	1.62	20,586.70
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,740	197.85	344,259.00
NN GROUP NV	3,700	23.17	85,729.00
POSTE ITALIANE SPA	7,600	7.45	56,620.00
SAMPO OYJ-A SHS	5,600	25.07	140,392.00
SCOR SE	2,200	21.98	48,356.00
ADYEN NV	110	865.00	95,150.00
AMADEUS IT GROUP SA	5,000	43.41	217,050.00
ATOS SE	890	63.16	56,212.40
CAPGEMINI SA	1,980	78.92	156,261.60
EDENRED	2,900	34.52	100,108.00
WIRECARD AG	1,350	122.50	165,375.00
WORLDLINE SA	1,200	57.88	69,456.00
DASSAULT SYSTEMES SA	1,410	131.60	185,556.00
SAP SE	11,530	106.28	1,225,408.40
NOKIA OYJ	67,000	3.09	207,298.00
INGENICO GROUP	690	106.15	73,243.50
ASML HOLDING NV	4,990	258.60	1,290,414.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	15,800	15.17	239,686.00
STMICROELECTRONICS NV	8,000	19.70	157,600.00
CELLNEX TELECOM SA	2,600	48.49	126,074.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	39,500	12.21	482,295.00
ELISA OYJ	1,600	52.30	83,680.00
ILIAD SA	310	139.60	43,276.00
KONINKLIJKE KPN NV	39,000	1.98	77,415.00
ORANGE SA	20,900	11.01	230,109.00
PROXIMUS	1,550	21.07	32,658.50
TELECOM ITALIA SPA	112,000	0.33	37,732.80
TELECOM ITALIA-RNC	68,000	0.34	23,120.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	5,000	2.43	12,150.00

TELEFONICA SA	53,000	3.91	207,548.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,500	29.90	44,850.00
ELECTRICITE DE FRANCE	7,400	6.70	49,624.40
ENDESA S.A.	3,500	19.24	67,340.00
ENEL SPA	95,000	6.00	570,475.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	30,000	3.70	111,000.00
FORTUM OYJ	4,900	14.83	72,667.00
IBERDROLA SA	73,000	8.74	638,312.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,200	15.19	63,798.00
TERNA SPA	18,000	5.28	95,184.00
VERBUND AG	900	37.00	33,300.00
ENAGAS SA	2,900	20.09	58,261.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	3,300	14.97	49,417.50
SNAM SPA	23,000	3.76	86,503.00
E.ON SE	24,800	8.33	206,683.20
ENGIE	22,600	9.22	208,372.00
RWE AG	6,300	23.54	148,302.00
SUEZ	3,600	9.26	33,364.80
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,000	17.56	122,955.00
AMUNDI SA	600	53.50	32,100.00
DEUTSCHE BANK AG-REG	22,300	5.55	123,921.10
DEUTSCHE BOERSE AG	2,310	133.15	307,576.50
NATIXIS	11,000	1.90	20,900.00
UNIPER SE	2,100	23.12	48,552.00
EUROFINS SCIENTIFIC SE	130	464.00	60,320.00
QIAGEN NV	2,176	37.90	82,470.40
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	220	203.60	44,792.00
BUREAU VERITAS SA	3,100	18.49	57,319.00
RANDSTAD NV	1,500	33.87	50,805.00
TELEPERFORMANCE	590	189.55	111,834.50
WOLTERS KLUWER	3,000	66.66	199,980.00
AROUNDTOWN SA	11,600	4.72	54,844.80
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,200	35.11	147,462.00
VONOVIA SE	5,700	44.45	253,365.00
ALTICE EUROPE N.V.	5,000	3.30	16,510.00

	EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,200	9.90	21,780.00	
	JC DECAUX SA	750	16.73	12,547.50	
	PUBLICIS GROUPE	2,700	24.43	65,961.00	
	SES FDR	3,900	5.56	21,699.60	
	TELENET GROUP HOLDING NV	690	34.60	23,874.00	
	BOLLORE	7,500	2.35	17,625.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	920	66.62	61,290.40	
	VIVENDI SA	9,200	20.45	188,140.00	
小計	銘柄数：237			36,609,453.23	
				(4,286,600,878)	
	組入時価比率：9.6%			10.5%	
英ボンド	BP PLC	237,000	2.93	694,765.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	48,400	13.10	634,040.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	43,800	12.88	564,144.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,464	46.35	67,856.40	
	JOHNSON MATTHEY PLC	2,600	18.91	49,166.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	11,000	13.29	146,212.00	
	ANTOFAGASTA PLC	5,400	7.30	39,463.20	
	BHP GROUP PLC	25,500	12.26	312,630.00	
	EVRAZ PLC	4,000	2.33	9,352.00	
	GLENCORE PLC	122,000	1.33	162,967.60	
	RIO TINTO PLC-REG	12,900	36.33	468,721.50	
	MONDI PLC	5,400	13.10	70,767.00	
	BAE SYSTEMS PLC	40,000	5.34	213,840.00	
	MEGGITT PLC	11,000	2.44	26,917.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	19,000	3.07	58,406.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	56,000	0.86	48,697.60	
	DCC PLC	1,360	53.88	73,276.80	
	SMITHS GROUP PLC	4,700	11.42	53,674.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	720	88.16	63,475.20	
	WEIR GROUP PLC	2,800	7.85	21,980.00	
	ASHTED GROUP PLC	5,900	16.75	98,854.50	
	BUNZLE	4,400	16.15	71,060.00	
	FERGUSON PLC	2,548	50.52	128,724.96	
	G4S PLC	16,100	0.90	14,493.22	
		18,000	4.45	80,244.00	

RENTOKIL INTIAL PLC			
EASYJET PLC	1,900	6.09	11,582.40
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	10,500	4.52	47,502.00
PERSIMMON PLC	4,200	19.33	81,186.00
TAYLOR WIMPEY PLC	34,300	1.28	44,041.20
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	1,400	39.29	55,006.00
BURBERRY GROUP PLC	4,800	13.89	66,672.00
CARNIVAL PLC	1,700	8.50	14,450.00
COMPASS GROUP PLC	19,600	12.64	247,842.00
GVC HOLDINGS PLC	5,800	7.00	40,600.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,300	34.27	78,821.00
TUI AG-DI	5,400	3.21	17,382.60
WHITBREAD PLC	1,600	26.88	43,008.00
OCADO GROUP PLC	4,300	16.00	68,821.50
MARKS & SPENCER PLC	20,640	0.91	18,790.65
NEXT PLC	1,800	45.62	82,116.00
JD SPORTS FASHION PLC	3,600	4.80	17,298.00
KINGFISHER PLC	25,000	1.37	34,337.50
MORRISON SUPERMARKETS	20,000	1.86	37,350.00
SAINSBURY	18,000	2.01	36,270.00
TESCO PLC	104,000	2.33	242,840.00
COCA-COLA HBC AG-DI	1,900	18.63	35,406.50
DIAGEO PLC	27,400	25.80	707,057.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,700	18.65	87,678.50
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	26,900	28.71	772,299.00
IMPERIAL BRANDS PLC	12,100	15.30	185,190.50
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,310	63.96	531,507.60
UNILEVER PLC	13,000	42.00	546,000.00
SMITH & NEPHEW PLC	11,200	15.23	170,632.00
NMC HEALTH PLC	800	2.34	1,876.80
ASTRAZENECA PLC	15,260	81.50	1,243,690.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	58,100	16.50	958,998.60
BARCLAYS PLC	214,000	0.86	185,131.40
HSBC HOLDINGS PLC	236,000	3.99	942,348.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	820,000	0.29	239,604.00

ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,000	1.02	58,596.00
STANDARD CHARTERED PLC	30,000	3.81	114,450.00
M&G PLC	31,200	1.28	40,045.20
ADMIRAL GROUP PLC	2,900	22.53	65,337.00
AVIVA PLC	44,100	2.36	104,296.50
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	12,000	2.61	31,356.00
LEGAL & GENERAL	62,000	1.93	119,660.00
PRUDENTIAL PLC	30,700	9.79	300,675.80
RSA INSURANCE GROUP PLC	12,100	3.46	41,866.00
AVEVA GROUP PLC	500	33.23	16,615.00
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	3,235	3.77	12,199.18
SAGE GROUP PLC (THE)	13,500	6.26	84,618.00
HALMA PLC	3,800	21.13	80,294.00
BT GROUP PLC	99,000	1.15	114,790.50
VODAFONE GROUP PLC	315,000	1.05	333,459.00
SSE PLC	10,800	12.00	129,654.00
CENTRICA PLC	55,000	0.31	17,248.00
NATIONAL GRID PLC	41,600	8.95	372,486.40
SEVERN TRENT PLC	2,700	23.13	62,451.00
UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,300	8.84	64,532.00
3I GROUP PLC	12,400	7.16	88,784.00
HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,600	14.75	53,100.00
LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	3,600	73.50	264,600.00
SCHRODERS PLC	1,100	25.26	27,786.00
ST JAMES S PLACE PLC	6,200	7.59	47,082.80
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	23,447	2.03	47,738.09
EXPERIAN PLC	10,400	22.97	238,888.00
INTERTEK GROUP PLC	1,500	48.99	73,485.00
RELX PLC	23,200	18.00	417,600.00
INFORMA PLC	12,700	4.26	54,140.10
ITV PLC	41,000	0.67	27,707.80
PEARSON	8,800	4.62	40,717.60
WPP PLC	13,100	5.27	69,141.80
AUTO TRADER GROUP PLC	13,000	4.45	57,954.00
小計銘柄数：93			15,740,420.00



				(2,085,763,054)	
	組入時価比率：4.7%			5.1%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,200	17.76	39,083.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	70	630.50	44,135.00	
	GIVAUDAN-REG	99	3,282.00	324,918.00	
	SIKA AG-REG	1,530	164.60	251,838.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	5,700	35.89	204,573.00	
	GEBERIT AG-REG	380	397.40	151,012.00	
	ABB LTD	22,200	16.51	366,522.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	320	210.40	67,328.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	370	221.70	82,029.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	630	137.90	86,877.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	5,600	53.40	299,040.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	340	188.40	64,056.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	550	36.68	20,174.00	
	DUFREY AG-REG	280	27.86	7,800.80	
	BARRY CALLEBAUT AG	39	1,900.00	74,100.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	14	7,775.00	108,850.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	82,500.00	82,500.00	
	NESTLE SA-REG	34,670	104.70	3,629,949.00	
	ALCON INC	4,922	49.75	244,869.50	
	SONOVA HOLDING AG-REG	690	174.90	120,681.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	100	755.80	75,580.00	
	NOVARTIS AG-REG	25,110	85.82	2,154,940.20	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	8,180	335.70	2,746,026.00	
	VIFOR PHARMA AG	590	141.70	83,603.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	280	64.00	17,920.00	
	BALOISE HOLDING AG	580	136.90	79,402.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	390	323.20	126,048.00	
	SWISS RE LTD	3,470	70.36	244,149.20	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,780	295.00	525,100.00	
	TEMENOS AG-REG	770	120.05	92,438.50	
SWISSCOM AG-REG	340	511.20	173,808.00		
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	28,900	7.63	220,564.80		
JULIUS BAER GROUP LTD	2,500	34.03	85,075.00		

	PARTNERS GROUP HOLDING AG	240	722.60	173,424.00	
	UBS GROUP AG	45,500	8.99	409,227.00	
	LONZA AG-REG	840	418.00	351,120.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,910	41.33	78,940.30	
	SGS SA-REG	67	2,235.00	149,745.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	786	90.80	71,368.80	
小計	銘柄数：39			14,128,815.10	
				(1,571,124,239)	
	組入時価比率：3.5%			3.9%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN ENERGY AB	2,500	199.45	498,625.00	
	BOLIDEN AB	2,600	193.60	503,360.00	
	ASSA ABLOY AB-B	10,600	189.70	2,010,820.00	
	SKANSKA AB-B SHS	4,700	166.05	780,435.00	
	ALFA LAVAL AB	3,000	164.95	494,850.00	
	ATLAS COPCO AB-A	7,500	335.90	2,519,250.00	
	ATLAS COPCO AB-B	4,800	299.50	1,437,600.00	
	EPIROC AB - A	6,900	95.40	658,260.00	
	EPIROC AB - B	3,500	93.50	327,250.00	
	SANDVIK AB	12,800	137.75	1,763,200.00	
	SKF AB-B SHARES	4,600	136.00	625,600.00	
	VOLVO AB-B SHS	16,500	120.70	1,991,550.00	
	SECURITAS AB-B SHS	4,300	107.95	464,185.00	
	ELECTROLUX AB-B	2,600	127.15	330,590.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	4,600	57.70	265,420.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	10,500	129.90	1,363,950.00	
	ICA GRUPPEN AB	900	450.50	405,450.00	
	SWEDISH MATCH AB	1,900	610.40	1,159,760.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	7,400	310.80	2,299,920.00	
	NORDEA BANK ABP	40,000	53.07	2,122,800.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	18,400	64.42	1,185,328.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	17,100	77.84	1,331,064.00	
	SWEDBANK AB	9,600	103.68	995,328.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,000	189.90	379,800.00	
	INVESTOR AB-B SHS	5,500	478.20	2,630,100.00	
	KINNEVIK AB - B	3,400	186.80	635,120.00	

	LUNDBERGS AB-B SHS	800	392.40	313,920.00	
	ERICSSON LM-B	37,000	81.34	3,009,580.00	
	HEXAGON AB-B SHS	3,000	436.50	1,309,500.00	
	TELIA CO AB	32,000	34.27	1,096,640.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	970	263.00	255,110.00	
	TELE 2 AB-B SHS	6,900	124.60	859,740.00	
小計	銘柄数：32			36,024,105.00	
				(385,097,682)	
	組入時価比率：0.9%			0.9%	
ノルウェーク ローネ	AKER AB ASA	1,000	138.60	138,600.00	
	EQUINOR ASA	11,500	128.70	1,480,050.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,300	351.80	809,140.00	
	NORSK HYDRO	14,200	21.50	305,300.00	
	MOWI ASA	5,000	171.05	855,250.00	
	ORKLA ASA	8,200	96.18	788,676.00	
	DNB ASA	11,700	107.00	1,251,900.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,600	178.60	464,360.00	
	TELENOR ASA	8,200	151.15	1,239,430.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	900	196.20	176,580.00	
小計	銘柄数：10			7,509,286.00	
				(76,219,252)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,200	596.60	715,920.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,500	321.80	804,500.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	1,980	569.20	1,127,016.00	
	ISS A/S	1,900	94.08	178,752.00	
	DSV PANALPINA A S	2,350	653.00	1,534,550.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	51	5,950.00	303,450.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	79	6,294.00	497,226.00	
	PANDORA A/S	1,290	228.60	294,894.00	
	CARLSBERG B	1,270	812.20	1,031,494.00	
	COLOPLAST-B	1,290	1,064.00	1,372,560.00	
	DEMANT A/S	1,300	169.00	219,700.00	
	GENMAB A/S	780	1,585.00	1,236,300.00	

	H LUNDBECK A/S	700	227.00	158,900.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	20,800	441.65	9,186,320.00	
	DANSKE BANK AS	7,200	70.36	506,592.00	
	TRYG A/S	1,000	186.00	186,000.00	
	ORSTED A/S	2,340	690.40	1,615,536.00	
小計	銘柄数：17			20,969,710.00	
				(329,224,447)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
豪ドル	WORLEY LTD	2,600	6.82	17,732.00	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	3,200	21.98	70,336.00	
	OIL SEARCH LTD	14,000	2.50	35,000.00	
	OIL SEARCH LTD RTS	1,750	0.40	700.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	17,000	4.76	80,920.00	
	SANTOS LTD.	23,000	4.01	92,230.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	900	17.68	15,912.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	12,200	19.89	242,658.00	
	INCITEC PIVOT LTD	17,000	2.11	35,870.00	
	ORICA LTD	5,600	16.35	91,560.00	
	BORAL LTD	14,000	2.57	35,980.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	5,200	17.91	93,132.00	
	ALUMINA LTD	26,200	1.45	37,990.00	
	BHP GROUP LIMITED	34,900	30.05	1,048,745.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	7,300	9.55	69,715.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	15,000	11.10	166,500.00	
	NEWCREST MINING	10,100	27.66	279,366.00	
	RIO TINTO LTD	4,000	87.06	348,240.00	
	SOUTH32 LTD	61,000	1.87	114,070.00	
	CIMIC GROUP LTD	1,045	21.80	22,781.00	
	BRAMBLES LTD	21,000	10.60	222,600.00	
	QANTAS AIRWAYS LIMITED	10,000	3.59	35,900.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	19,000	4.47	84,930.00	
	SYDNEY AIRPORT	16,000	5.76	92,160.00	
	TRANSURBAN GROUP	30,561	12.46	380,790.06	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	7,700	22.37	172,249.00	
	CROWN RESORTS LTD	4,800	8.01	38,448.00	

FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	800	9.79	7,832.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD RTS	459	2.59	1,188.81
TABCORP HOLDINGS	18,320	2.90	53,128.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	5,865	2.63	15,424.95
WESFARMERS LIMITED	13,000	36.37	472,810.00
COLES GROUP LTD	16,000	16.00	256,000.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	14,900	36.01	536,549.00
COCA-COLA AMATIL LTD	4,300	8.30	35,690.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	9,100	10.00	91,000.00
COCHLEAR LTD	740	181.18	134,073.20
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,900	64.29	122,151.00
SONIC HEALTHCARE LTD	4,900	25.59	125,391.00
CSL LIMITED	5,310	306.69	1,628,523.90
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	32,100	15.80	507,180.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	3,700	5.65	20,905.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	20,900	58.63	1,225,367.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	34,100	15.64	533,324.00
WESTPAC BANKING CORP	42,200	15.17	640,174.00
AMP LIMITED	31,000	1.36	42,160.00
CHALLENGER LIMITED	6,000	4.41	26,460.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	27,328	5.95	162,601.60
MEDIBANK PRIVATE LTD	30,000	2.56	76,800.00
QBE INSURANCE	16,400	8.06	132,184.00
SUNCORP GROUP LTD	13,302	9.01	119,851.02
COMPUTERSHARE LTD	6,600	10.97	72,402.00
WISETECH GLOBAL LTD	2,200	13.78	30,316.00
TELSTRA CORP LTD	42,000	3.04	127,680.00
TPG TELECOM LTD	4,359	7.47	32,561.73
AUSNET SERVICES	25,264	1.79	45,348.88
APA GROUP	12,700	10.84	137,668.00
AGL ENERGY LTD	6,300	17.00	107,100.00
ASX LTD	2,000	81.50	163,000.00
MACQUARIE GROUP LIMITED	3,500	98.40	344,400.00
MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,900	46.32	88,008.00
SEEK LTD	3,800	16.16	61,408.00

	REA GROUP LTD	600	80.67	48,402.00	
小計	銘柄数：63			12,151,577.15	
				(823,876,930)	
	組入時価比率：1.8%			2.0%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	12,000	3.79	45,480.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	12,000	5.99	71,940.00	
	A2 MILK CO LTD	8,000	19.45	155,600.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	6,500	28.55	185,575.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,000	12.40	62,000.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	20,000	4.28	85,600.00	
	MERCURY NZ LTD	8,000	4.48	35,840.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	15,300	4.45	68,085.00	
小計	銘柄数：8			710,120.00	
				(45,618,108)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	33,916	55.60	1,885,729.60	
	NWS HOLDINGS LTD	19,000	7.70	146,300.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	18,000	55.00	990,000.00	
	MTR CORP	19,000	41.65	791,350.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	5,500	12.48	68,640.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	24,000	47.90	1,149,600.00	
	SANDS CHINA LTD	27,200	30.10	818,720.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	24,000	7.66	183,840.00	
	WYNN MACAU LTD	18,000	13.24	238,320.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	13,000	21.25	276,250.00	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	8,000	27.30	218,400.00	
	WH GROUP LIMITED	106,000	7.54	799,240.00	
	BANK OF EAST ASIA	11,540	16.36	188,794.40	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	38,000	23.55	894,900.00	
	HANG SENG BANK	8,800	134.00	1,179,200.00	
	AIA GROUP LTD	142,000	70.15	9,961,300.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	3,200	78.80	252,160.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	38,120	11.84	451,340.80	

	PCCW LTD	41,000	4.63	189,830.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	9,000	45.80	412,200.00	
	CLP HLDGS	20,500	81.20	1,664,600.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	15,000	50.50	757,500.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	106,153	13.76	1,460,665.28	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	14,400	242.40	3,490,560.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	29,416	46.85	1,378,139.60	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	22,000	16.42	361,240.00	
	HENDERSON LAND	17,845	31.30	558,548.50	
	KERRY PROPERTIES	6,500	21.15	137,475.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	73,333	8.80	645,330.40	
	SINO LAND CO.LTD	31,000	10.26	318,060.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	19,000	103.80	1,972,200.00	
	SWIRE PACIFIC-A	5,000	49.85	249,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	10,800	21.10	227,880.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	16,200	30.55	494,910.00	
	WHEELOK & COMPANY LTD	8,000	53.60	428,800.00	
小計	銘柄数：35			35,241,273.58	
				(490,558,528)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	18,000	3.33	59,940.00	
	KEPPEL CORP.	16,000	5.67	90,720.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	12,000	1.52	18,240.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	27,000	1.02	27,540.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	8,000	6.01	48,080.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	21,000	1.50	31,500.00	
	SATS LTD	8,000	3.06	24,480.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	81,000	0.73	59,130.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	1,111	20.33	22,586.63	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	18,000	3.37	60,660.00	
	DBS GROUP HLDGS	21,100	18.84	397,524.00	
	OCBC-ORD	38,950	8.70	338,865.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	14,600	19.60	286,160.00	
	VENTURE CORP LTD	3,200	15.53	49,696.00	

	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	92,000	2.75	253,000.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	9,000	10.06	90,540.00	
	CAPITALAND LIMITED	32,000	2.87	91,840.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	4,000	7.54	30,160.00	
	UOL GROUP LIMITED	3,000	6.78	20,340.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	17,000	1.43	24,310.00	
	小計 銘柄数：20			2,025,311.63	
				(152,647,737)	
	組入時価比率：0.3%			0.4%	
新シェケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	6,000	11.65	69,900.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	270	442.50	119,475.00	
	BANK HAPOALIM BM	14,000	20.69	289,660.00	
	BANK LEUMI LE- ISRAEL	18,000	18.80	338,400.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	14,000	10.41	145,740.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,100	66.52	73,172.00	
	NICE LTD	810	584.60	473,526.00	
	AZRIELI GROUP	400	186.50	74,600.00	
	小計 銘柄数：8			1,584,473.00	
				(48,009,531)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				40,731,684,952	
				(40,731,684,952)	

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	6,100	75,365.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,450	213,730.00	
		AMERICAN TOWER CORP	5,200	1,258,400.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	16,800	103,152.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,560	246,870.00	
		BOSTON PROPERTIES	1,660	146,793.80	



CAMDEN PROPERTY TRUST	960	78,576.00	
CROWN CASTLE INTL CORP	4,920	785,576.40	
DIGITAL REALTY TRUST INC	3,040	439,888.00	
DUKE REALTY CORP	4,800	160,272.00	
EQUINIX INC	980	658,756.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,600	94,352.00	
EQUITY RESIDENTIAL	4,500	287,145.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	690	164,765.10	
EXTRA SPACE STORAGE INC	1,610	143,000.20	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	780	54,919.80	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6,100	149,389.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	7,700	81,312.00	
INVITATION HOMES INC	5,400	114,264.00	
IRON MOUNTAIN INC	3,400	83,980.00	
KIMCO REALTY CORP	5,000	41,500.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	4,800	74,256.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,420	152,706.80	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,700	50,031.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	2,000	57,520.00	
PROLOGIS INC	8,700	774,300.00	
PUBLIC STORAGE	1,900	362,710.00	
REALTY INCOME CORP	4,100	204,385.00	
REGENCY CENTERS CORP	2,300	81,857.00	
SBA COMMUNICATIONS CORP	1,290	379,298.70	
SIMON PROPERTY GROUP INC	3,650	195,494.00	
SL GREEN REALTY CORP	940	42,168.40	
SUN COMMUNITIES INC	1,210	142,175.00	
UDR INC	3,400	120,972.00	
VENTAS INC	4,200	117,306.00	
VEREIT INC	11,100	54,723.00	
VICI PROPERTIES INC	4,400	67,540.00	
VORNADO REALTY TRUST	1,770	63,843.90	
WELLTOWER INC	5,100	223,023.00	
WEYERHAEUSER CO	8,300	155,708.00	
WP CAREY INC	1,800	105,858.00	

小計	銘柄数：41 組入時価比率：2.1%	158,330	8,807,882.60 (950,018,217) 85.1%
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	400	17,972.00
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	1,100	15,026.00
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	1,200	10,860.00
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,986	30,564.54
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	700	14,462.00
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.0%	5,386	88,884.54 (6,750,780) 0.6%
ユーロ	COVIVIO	560	32,900.00
	GECINA SA	560	63,840.00
	ICADE	230	16,548.50
	KLEPIERRE	2,200	35,530.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,490	77,420.40
小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.1%	5,040	226,238.90 (26,490,312) 2.4%
英ポンド	BRITISH LAND	9,100	35,535.50
	LAND SECURITIES GROUP PLC	7,312	45,758.49
	SEGRO PLC	14,700	118,335.00
小計	銘柄数：3 組入時価比率：0.1%	31,112	199,628.99 (26,452,837) 2.4%
豪ドル	DEXUS	13,200	116,424.00
	GOODMAN GROUP	17,600	222,112.00
	GPT GROUP	26,000	97,240.00
	LENDLEASE GROUP	6,600	71,280.00
	MIRVAC GROUP	36,000	77,040.00
	SCENTRE GROUP	52,000	109,200.00
	STOCKLAND TRUST GROUP	25,800	72,756.00
	VICINITY CENTRES	44,000	58,740.00
小計	銘柄数：8	221,200	824,792.00 (55,920,897)

		組入時価比率：0.1%		5.0%
香港ドル		HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	30,000	233,700.00
		LINK REIT	26,000	1,748,500.00
小計		銘柄数：2	56,000	1,982,200.00
				(27,592,224)
		組入時価比率：0.1%		2.5%
シンガポールドル		ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	40,040	111,311.20
		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	37,954	56,931.00
		CAPITALAND MALL TRUST	27,800	48,928.00
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	24,000	43,200.00
		SUNTEC REIT	29,000	38,860.00
小計		銘柄数：5	158,794	299,230.20
				(22,552,980)
		組入時価比率：0.1%		2.0%
合計				1,115,778,247
				(1,115,778,247)

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

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 4月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	2,480,129,197	-	2,674,133,771	194,004,574
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	40,853,338,569	-	40,818,545,800	34,792,769
米ドル	29,046,802,900	-	29,089,836,000	43,033,100
カナダドル	1,361,079,795	-	1,353,831,900	7,247,895
ユーロ	4,394,567,400	-	4,333,500,900	61,066,500
英ポンド	2,148,091,290	-	2,133,930,600	14,160,690
スイスフラン	1,523,325,936	-	1,512,592,000	10,733,936

スウェーデンクローナ	380,345,184	-	374,577,600	5,767,584
ノルウェークローネ	75,324,654	-	73,993,500	1,331,154
デンマーククローネ	307,822,230	-	304,266,000	3,556,230
豪ドル	872,638,375	-	898,085,000	25,446,625
ニュージーランドドル	42,820,169	-	43,020,700	200,531
香港ドル	483,182,024	-	484,276,000	1,093,976
シンガポールドル	169,333,472	-	168,761,600	571,872
新シケル	48,005,140	-	47,874,000	131,140
合計	-	-	-	228,797,343

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 外国先物取引について

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

## 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 新興国株式マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	892,890,529
コール・ローン	110,839,447
株式	32,541,422,108
投資信託受益証券	1,463,749,400
投資証券	42,062,918
派生商品評価勘定	103,374,912
未収入金	1,209,425
未収配当金	46,506,303
差入委託証拠金	482,833,292

(2020年 4月22日現在)

流動資産合計	35,684,888,334
資産合計	35,684,888,334
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,483,705
未払解約金	122,214,950
未払利息	130
その他未払費用	1,145,100
流動負債合計	125,843,885
負債合計	125,843,885
純資産の部	
元本等	
元本	34,118,060,612
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,440,983,837
元本等合計	35,559,044,449
純資産合計	35,559,044,449
負債純資産合計	35,684,888,334

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</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>

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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0422円
(10,000口当たり純資産額)	(10,422円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

## 株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4月22日現在

	2019年 4月23日
期首	
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	29,933,997,721円
同期中における追加設定元本額	7,596,249,962円
同期中における一部解約元本額	3,412,187,071円
期末元本額	34,118,060,612円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	31,426,462円
野村資産設計ファンド2020	35,198,145円
野村資産設計ファンド2025	57,533,040円
野村資産設計ファンド2030	70,463,436円
野村資産設計ファンド2035	53,791,859円
野村資産設計ファンド2040	112,387,111円
野村資産設計ファンド2045	16,672,635円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,599,387,136円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	315,868,866円
野村資産設計ファンド2050	27,345,108円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	9,405,835円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	4,269,369円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	3,363,693円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	2,085,798円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,937,236円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,049,697円
インデックス・ブレンド(タイプ)	9,602,093円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,256,459円
インデックス・ブレンド(タイプ)	11,048,326円
野村つみたて外国株投信	1,592,389,931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)	587,348,134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)	1,284,662,108円
世界6資産分散ファンド	175,536,778円
野村資産設計ファンド2060	9,364,867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	507,250,737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)	12,528,976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)	1,772,293,747円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	103,469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)	23,794,023,917円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	5,478,400円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	4,218,125円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	4,064,342円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	1,704,777円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	18,300	9.00	164,700.00	
		INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	57,700	0.64	37,101.10	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	27,100	58.34	1,581,014.00	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	5,790	123.80	716,802.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	342,800	4.69	1,610,817.20	
		ROSNEFT OJSC - GDR	72,800	3.91	285,303.20	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	103,700	4.30	445,910.00	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	16,260	37.12	603,571.20	
		TRANSNEFT PJSC	21	1,805.14	37,908.00	
		YPF S.A. -SPONSORED ADR	10,600	3.45	36,570.00	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	7,010	11.48	80,474.80	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	7,400	20.84	154,216.00	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	17,000	7.10	120,700.00	
		MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	10,700	6.51	69,657.00	
		NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	7,370	16.07	118,435.90	



PJSC ALROSA	176,000	0.78	137,383.84
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	39,500	24.99	987,105.00
POLYUS PJSC-REG S-GDR	3,330	76.70	255,411.00
SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	11.17	176,486.00
SOUTHERN COPPER CORP	6,300	29.02	182,826.00
BEST INC - ADR	8,600	5.39	46,354.00
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	20,900	27.90	583,110.00
LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR	15,100	3.32	50,132.00
DP WORLD PLC	11,000	15.50	170,500.00
NIO INC ADR	40,900	3.02	123,518.00
HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	8,800	29.61	260,568.00
LUCKIN COFFEE INC - ADR	5,200	4.39	22,828.00
YUM CHINA HOLDINGS INC	23,160	44.44	1,029,230.40
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	111,700	207.34	23,159,878.00
BAOZUN INC-SPN ADR	2,300	29.10	66,930.00
JD.COM INC-ADR	48,030	43.24	2,076,817.20
PINDUODUO INC ADR	13,000	50.94	662,220.00
TRIP.COM GROUP LTD-ADR	29,400	23.25	683,550.00
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	26,600	17.38	462,308.00
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	19,700	8.71	171,685.50
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	8,500	27.72	235,620.00
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	4,000	13.78	55,120.00
ZAI LAB LTD - ADR	2,320	62.40	144,768.00
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD - ADR	3,890	19.48	75,777.20
BANCO DE CHILE-ADR	14,300	15.80	225,940.00
BANCO MACRO SA-ADR	3,800	15.59	59,242.00
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	12,400	14.33	177,692.00
BANCOLOMBIA S.A. -SPONS ADR	7,330	24.85	182,150.50
CREDICORP LTD	4,350	138.21	601,213.50
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	7,430	6.85	50,895.50
ITAU CORPBANCA-ADR	5,466	3.99	21,809.34
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	673,300	2.40	1,622,134.55
STATE BANK OF INDIA-GDR	11,070	23.90	264,573.00
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	0.86	75,805.12
GDS HOLDINGS LTD-ADR	4,340	58.16	252,414.40

	GLOBALANT SA	2,520	97.24	245,044.80	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	5,300	7.55	40,015.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	28,650	7.78	222,897.00	
	ENEL AMERICAS S.A-ADR	48,400	7.72	373,648.00	
	ENEL CHILE SA-ADR	42,900	3.66	157,014.00	
	INTER RAO UES PJSC	2,280,000	0.06	143,412.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	85,170	1.43	122,421.65	
	NOAH HLDS LTD ADR	1,500	23.29	34,935.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	9,400	113.13	1,063,422.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	24,640	50.96	1,255,654.40	
	51JOB INC-ADR	1,300	66.72	86,736.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.79	69,417.21	
	HUYA INC-ADR	2,700	15.17	40,959.00	
	IQIYI INC-ADR	9,100	18.57	168,987.00	
	NETEASE INC-ADR	4,540	344.40	1,563,576.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	7,400	10.96	81,104.00	
	58.COM INC-ADR	5,780	52.05	300,849.00	
	AUTOHOME INC-ADR	3,860	76.15	293,939.00	
	BAIDU INC - SPON ADR	17,890	101.41	1,814,224.90	
	JOYY INC	4,250	59.73	253,852.50	
	MOMO INC-SPON ADR	8,800	22.78	200,464.00	
	SINA CORP	4,150	33.06	137,199.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,400	35.46	120,564.00	
小計	銘柄数：73			50,207,511.91	
				(5,415,382,234)	
	組入時価比率：15.2%			16.7%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	60,458	26.21	1,584,604.18	
	CEMEX SAB - CPO	861,985	4.68	4,034,089.80	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	229,983	44.79	10,300,938.57	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	174.96	1,471,413.60	
	ALFA S.A.B. -A	172,100	9.54	1,641,834.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	48.53	1,693,697.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,300	231.32	3,307,876.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	21,400	133.76	2,862,464.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	12,900	154.75	1,996,275.00	

	ALSEA SAB DE CV	30,000	16.19	485,700.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,800	65.67	709,236.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	341,000	55.89	19,058,490.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	26,100	94.56	2,468,016.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	32,495	97.65	3,173,136.75	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	118,700	136.18	16,164,566.00	
	GRUMA S.A.B.-B	13,400	204.21	2,736,414.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	101,000	32.38	3,270,380.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	95,000	33.72	3,203,400.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	167,300	59.55	9,962,715.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	140,200	15.49	2,171,698.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,171,000	13.12	28,483,520.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	38,700	66.49	2,573,163.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	153,400	25.46	3,905,564.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	23,100	61.01	1,409,331.00	
小計	銘柄数：24			128,668,521.90	
				(568,714,866)	
	組入時価比率：1.6%			1.7%	
リアル	COSAN SA	9,100	56.49	514,059.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	233,300	16.55	3,861,115.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	279,000	15.95	4,450,050.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	14.20	681,600.00	
	BRASKEM SA-PREF A	12,100	20.89	252,769.00	
	KLABIN SA-UNIT	42,700	15.95	681,065.00	
	CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	7.32	338,184.00	
	GERDAU SA PFD NPV	74,500	11.85	882,825.00	
	VALE SA	202,221	42.46	8,586,303.66	
	SUZANO SA	32,960	34.92	1,150,963.20	
	EMBRAER SA	41,000	9.20	377,200.00	
	WEG SA	51,924	39.10	2,030,228.40	
	LOCALIZA RENT A CAR	37,760	34.00	1,283,840.00	
	RUMO SA	70,600	20.04	1,414,824.00	
	CCR SA	75,600	13.14	993,384.00	
	B2W CIA DIGITAL	13,500	64.66	872,910.00	
	LOJAS AMERICANAS SA-PREF	50,492	23.01	1,161,820.92	

LOJAS RENNER S.A.	49,595	39.00	1,934,205.00
MAGAZINE LUIZA SA	46,000	48.48	2,230,080.00
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	43,600	18.67	814,012.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	29,600	20.09	594,664.00
CIA BRASILEIRA DE DISTRIBUICIAO	11,103	65.00	721,695.00
RAIA DROGASIL SA	15,700	108.45	1,702,665.00
AMBEV SA	308,956	11.61	3,586,979.16
BRF SA	39,700	18.92	751,124.00
JBS SA	74,600	21.35	1,592,710.00
NATURA &CO HOLDING SA	40,900	33.46	1,368,514.00
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	13,900	54.07	751,573.00
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	30,300	57.54	1,743,462.00
HYPERA SA	23,900	31.37	749,743.00
BANCO BRADESCO S.A.	93,754	18.42	1,726,948.68
BANCO BRADESCO SA - PREF	287,336	19.70	5,660,519.20
BANCO DO BRASIL SA	53,600	28.99	1,553,864.00
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	25.95	633,180.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	312,191	22.64	7,068,004.24
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	284,017	8.97	2,547,632.49
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	44,100	26.25	1,157,625.00
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	44,700	11.93	533,271.00
PORTO SEGURO SA	7,000	47.03	329,210.00
SUL AMERICA SA - UNITS	18,149	45.80	831,224.20
CIELO SA	73,763	4.40	324,557.20
TELEFONICA BRASIL-PREF	26,805	48.40	1,297,362.00
TIM PARTICIPACOES SA	46,552	12.82	596,796.64
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	29.21	525,780.00
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	16,500	25.70	424,050.00
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	60,029	10.06	603,891.74
ENERGISA SA-UNITS	10,200	44.69	455,838.00
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	50,000	19.29	964,500.00
CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	21,300	41.51	884,163.00
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	136,133	40.59	5,525,638.47
BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	16,100	39.50	635,950.00

	COGNA EDUCACAO	103,956	5.09	529,136.04	
	ENGIE BRASIL SA	12,000	40.63	487,560.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	46,700	10.15	474,005.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	17,600	21.60	380,160.00	
小計	銘柄数：55			84,225,434.24	
				(1,708,091,806)	
	組入時価比率：4.8%			5.2%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	4,852.00	125,666,800.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	1,569.00	112,891,119.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	2,065.00	103,663,000.00	
	CENCOSUD SA	80,738	925.00	74,682,650.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	28,800	1,775.00	51,120,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,085	26,935.00	83,094,475.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	8,972	4,051.00	36,345,572.00	
	AGUAS ANDINAS SA-A	216,000	251.10	54,237,600.00	
	COLBUN SA	471,000	115.00	54,165,000.00	
小計	銘柄数：9			695,866,216.00	
				(87,400,796)	
	組入時価比率：0.2%			0.3%	
コロンビアペソ	GRUPO ARGOS SA	15,600	10,500.00	163,800,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	15,900	24,800.00	394,320,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PFD	205,700	914.00	188,009,800.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	21,600.00	280,800,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	17,500.00	591,500,000.00	
小計	銘柄数：5			1,618,429,800.00	
				(43,050,232)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	3,800	13.14	49,932.00	
	TITANCEMENT INTERNATIONAL	2,570	11.00	28,270.00	
	FF GROUP	2,030	0.96	1,948.80	
	OPAP SA	13,190	7.19	94,902.05	
	JUMBO SA	6,732	13.00	87,516.00	
	ALPHA BANK A.E.	114,000	0.60	68,400.00	
	EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS	162,000	0.33	53,460.00	
NATIONAL BANK OF GREECE	33,000	1.06	34,980.00		

	HELLENIC TELECOM	16,700	11.50	192,050.00	
小計	銘柄数：9			611,458.85	
				(71,595,716)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
英bond	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	15,000	15.28	229,275.00	
小計	銘柄数：1			229,275.00	
				(30,381,230)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,300	84.35	700,105.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	111,000	8.19	909,090.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	20,730	26.96	558,880.80	
	KOC HLDGS	53,000	14.68	778,040.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,186	10.43	335,699.98	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,660	19.15	184,989.00	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	3,320	59.35	197,042.00	
	ARCELIK A.S	14,543	15.31	222,653.33	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	30,000	55.50	1,665,000.00	
	ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYII	12,740	18.29	233,014.60	
	AKBANK T.A.S	205,000	5.67	1,162,350.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	142,160	8.18	1,162,868.80	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	4.85	445,230.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	75,000	7.57	567,750.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	77,000	13.17	1,014,090.00	
小計	銘柄数：15			10,136,803.51	
				(156,714,982)	
	組入時価比率：0.4%			0.5%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	506.00	2,555,300.00	
	MONETA MONEY BANK AS	42,000	49.90	2,095,800.00	
	CEZ AS	11,700	456.50	5,341,050.00	
小計	銘柄数：3			9,992,150.00	
				(42,466,637)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
フォロント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	25,000	1,903.00	47,575,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	10,300	6,330.00	65,199,000.00	
	OTP BANK NYRT	14,400	8,010.00	115,344,000.00	

小計	銘柄数：3			228,118,000.00	
				(75,438,622)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
ズロチ	GRUPA LOTOS SA	6,800	61.74	419,832.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	18,800	59.00	1,109,200.00	
	POLSKIE GORNICtwo NAFTOWE I	97,770	3.60	352,558.62	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,900	69.76	690,624.00	
	CCC SA	1,520	42.50	64,600.00	
	LPP SA	94	5,545.00	521,230.00	
	AMREST HOLDINGS SE	4,800	25.00	120,000.00	
	DINO POLSKA SA	3,840	175.90	675,456.00	
	BANK MILLENNIUM SA	35,830	2.84	101,900.52	
	BANK PEKAO SA	10,520	52.50	552,300.00	
	MBANK	900	208.00	187,200.00	
	PKO BANK POLSKI SA	56,200	21.07	1,184,134.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,890	152.00	439,280.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	37,500	29.92	1,122,000.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	6.89	269,743.50	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	4.10	212,093.00	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	24.38	460,782.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,080	336.00	1,370,880.00	
小計	銘柄数：18			9,853,813.64	
				(254,326,930)	
	組入時価比率：0.7%			0.8%	
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.05	19,451.00	
	LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	100,000	5.83	583,000.00	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	112,000	2.12	237,440.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,692,900	3.79	6,416,091.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	231,000	13.84	3,197,040.00	
	CNOOC LTD	1,171,000	8.27	9,684,170.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION-H	66,000	4.89	322,740.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,400,000	2.71	3,794,000.00	
	YANZHOU COAL MINING-H	96,000	5.90	566,400.00	

SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	206,000	2.13	438,780.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	77,000	58.85	4,531,450.00	
BBMG CORPORATION - H	127,000	1.97	250,190.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	235,000	9.19	2,159,650.00	
CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	152,000	9.85	1,497,200.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	1.50	315,000.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	104,000	3.44	357,760.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	180,000	2.25	405,000.00	
CHINA ZHONGWANG HOLDING LTD	88,800	1.71	151,848.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	7.39	724,220.00	
MAANSHAN IRON & STEEL CO LTD - H	134,000	2.27	304,180.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	57,000	8.73	497,610.00	
ZIJIN MINING GROUP CO-H	347,000	3.34	1,158,980.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	4.90	382,200.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	7.56	763,560.00	
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	2.91	587,820.00	
CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	48,000	10.30	494,400.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	299,000	5.07	1,515,930.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	5.63	981,872.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	230,000	4.48	1,030,400.00	
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	135,000	8.78	1,185,300.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	6.03	924,097.50	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	156,000	1.34	209,040.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	3.44	245,960.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	126,000	2.37	298,620.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	39,984	7.42	296,681.28	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	36,300	23.95	869,385.00	
CITIC LTD	362,000	7.50	2,715,000.00	
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	165,940	9.52	1,579,748.80	
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	30,000	12.42	372,600.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	99,500	35.95	3,577,025.00	
CRRC CORP LTD-H	275,350	4.00	1,101,400.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	32,000	13.94	446,080.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	37,500	15.50	581,250.00	



WEICHAI POWER CO LTD-H	117,800	14.28	1,682,184.00
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	61,000	6.26	381,860.00
BOC AVIATION LTD	11,300	51.25	579,125.00
A-LIVING SERVICES CO LTD	33,000	38.00	1,254,000.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	281,000	4.31	1,211,110.00
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	72,000	33.70	2,426,400.00
GREENTOWN SER	60,000	9.25	555,000.00
SINOTRANS LIMITED-H	111,000	1.78	197,580.00
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	5.21	531,420.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	76,000	2.94	223,440.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	3.47	367,820.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	140,000	2.09	292,600.00
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	5.05	494,900.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	82,000	8.98	736,360.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	3.78	385,560.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	8.39	570,520.00
SHENZHEN EXPRESSWAY-H	32,000	7.95	254,400.00
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	79,000	14.16	1,118,640.00
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	5.09	580,260.00
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	39,200	16.30	638,960.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	43,000	4.47	192,210.00
BAIC MOTOR CORPORATION LIMITED	96,000	3.08	295,680.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	6.75	1,471,500.00
BYD CO LTD-H	44,000	41.75	1,837,000.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	4.90	901,600.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	342,000	11.26	3,850,920.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	238,000	4.92	1,170,960.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	199,890	6.49	1,297,286.10
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	87,000	20.85	1,813,950.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	70,000	62.55	4,378,500.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	204,000	1.92	391,680.00
LI NING CO LTD	136,000	23.70	3,223,200.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	50,100	88.20	4,418,820.00

HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD.	24,000	32.45	778,800.00	
MEITUAN DIANPING B	64,700	98.55	6,376,185.00	
GOME RETAIL HODINGS LTD	523,360	0.86	450,089.60	
TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLD	77,000	9.31	716,870.00	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	31,000	29.85	925,350.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	149,000	12.18	1,814,820.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	93,333	35.10	3,275,988.30	
TSING TAO BREWERY CO-H	24,000	42.10	1,010,400.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.00	0.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	180,000	26.95	4,851,000.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	4.66	519,590.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	118,000	12.94	1,526,920.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	70,000	7.51	525,700.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	364,000	5.36	1,951,040.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	28,000	59.25	1,659,000.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	44,500	65.25	2,903,625.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	116,000	11.74	1,361,840.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	13.98	711,582.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	87,200	19.60	1,709,120.00	
3SBIO, INC	77,000	8.50	654,500.00	
INNOVENT BIOLOGICS INC	58,500	34.95	2,044,575.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	81,000	9.38	759,780.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	4.76	442,680.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	124,000	3.39	420,360.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	306,000	15.82	4,840,920.00	
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	30,000	28.45	853,500.00	
LUYE PHARMA GROUP LTD	62,500	3.96	247,500.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	28.15	971,175.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	458,000	10.94	5,010,520.00	
SSY GROUP LTD	82,000	5.78	473,960.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,887,000	3.06	5,774,220.00	
BANK OF CHINA LTD-H	5,097,000	2.94	14,985,180.00	

BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	597,790	4.69	2,803,635.10	
CHINA CITIC BANK-H	560,000	3.61	2,021,600.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,208,000	6.00	37,248,000.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	3.01	773,570.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	253,192	34.65	8,773,102.80	
CHINA MINSHENG BANKING-H	480,800	5.55	2,668,440.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	137,000	3.11	426,070.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,158,000	5.05	20,997,900.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	540,000	4.61	2,489,400.00	
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	6.01	925,540.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	492,000	15.70	7,724,400.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	172,200	23.95	4,124,190.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	308,000	0.89	274,120.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	12.40	1,283,052.80	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	59,100	24.45	1,444,995.00	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	2.49	1,461,630.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	434,420	7.31	3,175,610.20	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	358,500	77.75	27,873,375.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	25,000	24.40	610,000.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	14.08	929,280.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	142,000	11.94	1,695,480.00	
KINGSOFT CORP LTD	46,000	27.05	1,244,300.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	33,000	16.74	552,420.00	
ZTE CORP-H	47,252	23.30	1,100,971.60	
LEGEND HLDS CORP	18,100	9.14	165,434.00	
LENOVO GROUP LTD	498,000	4.43	2,206,140.00	
XIAOMI CORPORATION	651,000	10.04	6,536,040.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	45,000	37.15	1,671,750.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	80,000	3.66	292,800.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	43,000	18.72	804,960.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	58,500	7.11	415,935.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	47,700	107.90	5,146,830.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	26,000	15.06	391,560.00	

SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	189,000	14.82	2,800,980.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	262,000	4.72	1,236,640.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	866,000	2.55	2,208,300.00	
CHINA TOWER CORP LTD	2,790,000	1.71	4,770,900.00	
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	378,000	4.88	1,844,640.00	
CHINA MOBILE LTD	394,500	59.85	23,610,825.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	26.00	936,000.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	117,400	23.25	2,729,550.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	56,000	41.40	2,318,400.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	49,600	77.15	3,826,640.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	186,000	4.41	820,260.00	
TOWNGAS CHINA COMPANY LTD	53,000	3.41	180,730.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	247,000	2.97	733,590.00	
GUANGDONG INVESTMENT	184,000	15.72	2,892,480.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.43	886,600.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	48,000	11.78	565,440.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	3.76	1,000,160.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	592,000	0.86	509,120.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	92,400	11.08	1,023,792.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	123,000	14.26	1,753,980.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	8.12	670,712.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	62,000	10.72	664,640.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	173,600	6.90	1,197,840.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	102,000	12.60	1,285,200.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	19,000	13.10	248,900.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS	25,000	10.32	258,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	627,000	1.91	1,197,570.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	218,000	3.69	804,420.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	240,000	1.51	362,400.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	8.95	1,342,500.00	
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN-H	166,000	1.06	175,960.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	88,000	2.33	205,040.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	2.65	630,700.00	

ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	232,000	17.08	3,962,560.00
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	23,200	107.00	2,482,400.00
GENSCRIPT BIOTECH CORP	56,000	12.68	710,080.00
WUXI APPTEC CO LTD	9,560	109.40	1,045,864.00
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	48,500	118.50	5,747,250.00
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	8.15	766,100.00
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD	98,000	8.80	862,400.00
CHINA EVERGRANDE GROUP	126,000	12.84	1,617,840.00
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	330,000	5.25	1,732,500.00
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	244,000	25.75	6,283,000.00
CHINA RESOURCES LAND LTD	200,444	31.00	6,213,764.00
CHINA VANKE CO LTD-H	99,300	24.60	2,442,780.00
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	196,000	5.59	1,095,640.00
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	494,380	9.47	4,681,778.60
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	80,000	9.61	768,800.00
KAISA GROUP HLDS LTD	115,000	2.94	338,100.00
KWG GROUP HOLDINGS LTD	68,500	11.04	756,240.00
LOGAN PROPERTY HLDS CO LTD	74,000	12.08	893,920.00
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	116,500	37.95	4,421,175.00
SEAZEN GROUP LTD	168,000	6.76	1,135,680.00
SHENZHEN INVESTMENT LTD	176,000	2.37	417,120.00
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	72,000	29.80	2,145,600.00
SHUI ON LAND LTD	197,000	1.30	256,100.00
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	146,000	1.96	286,160.00
SOHO CHINA LTD	106,000	3.50	371,000.00
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	154,000	32.85	5,058,900.00
WHARF(HOLDING)	84,000	13.94	1,170,960.00
YUEXIU PROPERTY CO LTD	370,000	1.43	529,100.00
YUZHOU PROPERTIES CO LTD	91,000	3.16	287,560.00
ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	67,000	4.81	322,270.00
CHINA LITERATURE LTD	20,800	29.85	620,880.00
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	0.94	817,800.00
TENCENT HOLDINGS LTD	367,900	400.60	147,380,740.00
小計銘柄数：208			591,610,306.68

				(8,235,215,468)	
	組入時価比率：23.2%			25.4%	
リンギ	DIALOG GROUP BHD	219,344	3.20	701,900.80	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	14,500	20.20	292,900.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	144,000	5.30	763,200.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	81,100	3.77	305,747.00	
	GAMUDA BERHAD	100,200	3.14	314,628.00	
	IJM CORP	152,600	1.69	257,894.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	7.31	247,078.00	
	SIME DARBY BERHAD	220,000	1.83	402,600.00	
	AIRASIA GROUP BHD	86,600	0.83	71,878.00	
	MISC BHD	99,960	7.96	795,681.60	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	56,460	5.29	298,673.40	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	3.85	197,890.00	
	GENTING BHD	112,000	3.98	445,760.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	229,000	2.26	517,540.00	
	CARLSBERG BREWERY MALAYSIA BERHAD	9,500	28.30	268,850.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	31.60	243,320.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,600	9.40	137,240.00	
	IOI CORP	116,700	3.86	450,462.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG	26,400	20.40	538,560.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	4,400	139.00	611,600.00	
	PPB GROUP BERHAD	35,040	16.50	578,160.00	
	QL RESOURCES BHD	40,000	8.07	322,800.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	4.77	688,311.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	121,000	7.25	877,250.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	84,200	6.50	547,300.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	156,000	5.13	800,280.00	
	AMMB HOLDING	125,000	3.01	376,250.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	280,000	3.61	1,010,800.00	
	HONG LEONG BANK	37,460	13.48	504,960.80	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	13.56	182,002.32	
	MALAYAN BANKING	246,000	7.56	1,859,760.00	
	PUBLIC BANK BHD	203,960	15.74	3,210,330.40	
	RHB BANK BHD	125,023	4.69	586,357.87	

	TELEKOM MALAYSIA	62,000	4.00	248,000.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	3.75	731,250.00	
	DIGI.COM BERHAD	186,000	4.52	840,720.00	
	MAXIS BHD	146,200	5.39	788,018.00	
	TENAGA NASIONAL	209,000	12.50	2,612,500.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	43,700	15.34	670,358.00	
	YTL CORPORATION	210,847	0.74	157,081.01	
小計	銘柄数：40			25,455,892.20	
				(624,433,035)	
	組入時価比率：1.8%			1.9%	
パーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	263,000	5.55	1,459,650.00	
	IRPC PCL - NVDR	900,000	2.52	2,268,000.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	86,400	76.25	6,588,000.00	
	PTT PCL-NVDR	759,000	34.00	25,806,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	39.25	3,257,750.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	27.00	2,996,109.00	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	36.00	5,471,784.00	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	50,600	319.00	16,141,400.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	10.80	5,140,800.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	257,000	60.50	15,548,500.00	
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	9.05	4,046,255.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	163,000	20.80	3,390,400.00	
	CENTRAL RETAIL CORP PCL-NVDR	148,025	35.50	5,254,887.50	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	354,597	13.40	4,751,599.80	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	42.25	3,113,825.00	
	CP ALL PCL-NVDR	375,000	65.50	24,562,500.00	
	OSOTSPA PCL-NVDR	33,000	40.00	1,320,000.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	27.00	7,533,000.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	12.60	2,517,480.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	651,000	21.00	13,671,000.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	119.00	3,831,800.00	
	BANGKOK BANK(F)	28,600	112.50	3,217,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	37,300	97.00	3,618,100.00	
	KASIKORNBANK PCL(F)	72,000	97.25	7,002,000.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	10.90	2,910,845.00	

	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	50,800	69.75	3,543,300.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,098,957	0.92	1,011,040.44	
	TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	3.24	2,980,800.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	74,200	195.50	14,506,100.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	140,000	50.00	7,000,000.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	43,000	41.50	1,784,500.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	45.25	2,217,250.00	
	SRISAWAD CORP PCL-NVDR	32,000	53.50	1,712,000.00	
	B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	43.75	1,487,500.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	252.00	4,359,600.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	95,000	37.00	3,515,000.00	
	GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	33,000	66.00	2,178,000.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	165,000	36.50	6,022,500.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	43,000	60.50	2,601,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	133,900	48.25	6,460,675.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	7.35	4,557,000.00	
小計	銘柄数：41			241,355,950.74	
				(801,301,756)	
	組入時価比率：2.3%			2.5%	
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	43.90	6,409,400.00	
	AYALA CORPORATION	20,702	575.00	11,903,650.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	475.00	2,595,875.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	173,700	50.00	8,685,000.00	
	SM INVESTMENTS CORP	16,800	839.00	14,095,200.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	69,000	77.00	5,313,000.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	24,400	136.10	3,320,840.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	119.40	7,999,800.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	53,599	60.00	3,215,940.00	
	BDO UNIBANK INC	124,998	100.60	12,574,798.80	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	38.95	4,973,720.25	
	SECURITY BANK CORP	12,000	104.00	1,248,000.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	2.67	1,996,626.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	2,106.00	4,359,420.00	
	PLDT INC	4,970	1,130.00	5,616,100.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	257.60	4,353,440.00	



	ABOITIZ POWER CORP	76,700	26.00	1,994,200.00	
	AYALA LAND LTD	499,000	30.95	15,444,050.00	
	MEGAWORLD CORP	910,000	2.78	2,529,800.00	
	ROBINSONS LAND CO	132,000	15.78	2,082,960.00	
	SM PRIME HLDGS	652,975	30.00	19,589,250.00	
小計	銘柄数：21			140,301,070.05	
				(297,438,268)	
	組入時価比率：0.8%			0.9%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	930.00	780,456,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	220,000	1,825.00	401,500,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	99,150	16,400.00	1,626,060,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	1,660,000	1,015.00	1,684,900,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	136,000	10,700.00	1,455,200,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	5,900.00	1,038,400,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	148,600	4,990.00	741,514,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA	100,000	4,900.00	490,000,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	113,559	2,640.00	299,795,760.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,335,000	3,640.00	4,859,400,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	300,000	1,280.00	384,000,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	9,975.00	1,775,550,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	266,200	6,275.00	1,670,405,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	499,000	3,940.00	1,966,060,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	43,200.00	1,261,440,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	640,000	1,570.00	1,004,800,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	523,500	6,925.00	3,625,237,500.00	
	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,210.00	1,863,400,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	638,000	25,800.00	16,460,400,000.00	
	BANK MANDIRI	1,107,000	4,350.00	4,815,450,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	4,030.00	2,010,970,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,536,000	2,720.00	9,617,920,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	208,000	880.00	183,040,000.00	
	TELEKOMUNIKASI	3,320,000	3,070.00	10,192,400,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	160,000	2,300.00	368,000,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	593,500	765.00	454,027,500.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	428,300	695.00	297,668,500.00	

	PAKUWON JATI TBK PT	920,000	378.00	347,760,000.00	
小計	銘柄数：28			71,675,754,260.00	
				(501,730,279)	
	組入時価比率：1.4%			1.5%	
ウォン	GS HOLDINGS CORP	3,600	37,850.00	136,260,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,690	68,300.00	183,727,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,580	98,500.00	352,630,000.00	
	HANWHA SOLUTIONS CORP	6,330	14,400.00	91,152,000.00	
	KCC CORP	260	139,500.00	36,270,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	998	65,800.00	65,668,400.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	384	166,000.00	63,744,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	2,970	354,000.00	1,051,380,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,050	203,500.00	213,675,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,580	39,150.00	61,857,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,810	51,600.00	93,396,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	4,779	19,400.00	92,712,600.00	
	KOREA ZINC CO LTD	592	396,000.00	234,432,000.00	
	POSCO	5,040	171,000.00	861,840,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	4,520	24,900.00	112,548,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	1,600	81,400.00	130,240,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	9,690	3,310.00	32,073,900.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	24,200.00	102,124,000.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2,349	18,750.00	44,043,750.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	4,650	34,500.00	160,425,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,520	11,000.00	93,720,000.00	
	CJ CORP	1,100	70,700.00	77,770,000.00	
	HANWHA CORPORATION	2,470	17,900.00	44,213,000.00	
	LG CORP	6,050	62,300.00	376,915,000.00	
	LOTTE CORP	1,620	26,600.00	43,092,000.00	
	SAMSUNG C&T CORP	5,700	93,900.00	535,230,000.00	
	SK HOLDINGS CO LTD	2,340	183,000.00	428,220,000.00	
	DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,900	16,500.00	47,850,000.00	
	DOOSAN BOBCAT INC	3,350	24,450.00	81,907,500.00	
	HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	597	224,500.00	134,026,500.00	
	KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE	2,377	77,000.00	183,029,000.00	

ENGINEERIN			
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	30,700	4,160.00	127,712,000.00
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,900	12,950.00	50,505,000.00
S-1 CORPORATION	1,450	83,300.00	120,785,000.00
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,140	100,500.00	114,570,000.00
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,576	19,150.00	49,330,400.00
PAN OCEAN CO LTD	14,890	3,270.00	48,690,300.00
CJ LOGISTICS	780	142,500.00	111,150,000.00
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	21,300.00	113,316,000.00
HANON SYSTEMS	11,650	9,180.00	106,947,000.00
HYUNDAI MOBIS	4,480	176,500.00	790,720,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD	9,980	93,500.00	933,130,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	59,700.00	157,608,000.00
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	57,400.00	84,378,000.00
KIA MOTORS CORP	16,400	28,850.00	473,140,000.00
COWAY CO LTD	3,340	59,500.00	198,730,000.00
LG ELECTRONICS INC	6,150	52,600.00	323,490,000.00
HLB INC	1,830	98,500.00	180,255,000.00
HLB INC RTS	182	19,800.00	3,603,600.00
FILA HOLDINGS CORP	2,930	33,750.00	98,887,500.00
KANGWON LAND INC	7,900	24,650.00	194,735,000.00
CJ ENM CO LTD	657	107,900.00	70,890,300.00
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,140	66,300.00	75,582,000.00
LOTTE SHOPPING CO	800	86,700.00	69,360,000.00
SHINSEGAE CO LTD	427	259,500.00	110,806,500.00
HOTEL SHILLA CO LTD	1,960	77,900.00	152,684,000.00
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	143,000.00	69,355,000.00
E-MART CO	1,181	110,500.00	130,500,500.00
GS RETAIL CO LTD	1,140	31,200.00	35,568,000.00
CJ CHEILJEDANG CORP	510	233,500.00	119,085,000.00
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,800	112,500.00	202,500,000.00
OTTOGI CORPORATION	70	526,000.00	36,820,000.00
KT & G CORP	7,280	78,000.00	567,840,000.00
AMOREPACIFIC CORP	1,930	172,000.00	331,960,000.00
AMOREPACIFIC CORP-PREF	410	64,100.00	26,281,000.00
	1,520	58,700.00	89,224,000.00

AMOREPACIFIC GROUP			
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	584	1,299,000.00	758,616,000.00
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	699,000.00	72,696,000.00
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,501	81,100.00	283,931,100.00
CELLTRION INC	6,090	212,000.00	1,291,080,000.00
HELIXMITH CO LTD	1,200	87,300.00	104,760,000.00
MEDY-TOX INC	232	128,700.00	29,858,400.00
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	481	258,500.00	124,338,500.00
YUHAN CORPORATION	3,620	46,500.00	168,330,000.00
BNK FINANCIAL GROUP INC	22,800	4,695.00	107,046,000.00
HANA FINANCIAL HOLDINGS	20,100	23,750.00	477,375,000.00
INDUSTRIAL BK OF KOREA	15,040	7,480.00	112,499,200.00
KB FINANCIAL GROUP INC	25,550	31,700.00	809,935,000.00
SHINHAN FINANCIAL GROUP	28,600	27,700.00	792,220,000.00
WOORI FINANCIAL GROUP INC	38,800	7,940.00	308,072,000.00
DB INSURANCE CO LTD	2,850	39,850.00	113,572,500.00
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	13,280	1,745.00	23,173,600.00
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,400	24,400.00	82,960,000.00
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	1,890	186,500.00	352,485,000.00
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,640	47,550.00	220,632,000.00
SAMSUNG SDS CO LTD	2,460	165,500.00	407,130,000.00
KMW CO.LTD.	1,140	63,600.00	72,504,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS	307,300	49,250.00	15,134,525,000.00
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	52,490	42,650.00	2,238,698,500.00
LG INNOTEK CO LTD	860	128,000.00	110,080,000.00
LG.DISPLAY CO LTD	16,200	11,100.00	179,820,000.00
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	3,490	110,000.00	383,900,000.00
SAMSUNG SDI CO,LTD	3,430	283,000.00	970,690,000.00
SK HYNIX INC	34,950	81,300.00	2,841,435,000.00
LG UPLUS CORP	13,300	12,350.00	164,255,000.00
SK TELECOM CO LTD	1,270	209,500.00	266,065,000.00
KOREA ELECTRIC POWER	14,800	21,500.00	318,200,000.00
KOREA GAS CORPORATION	1,599	26,700.00	42,693,300.00
SAMSUNG CARD CO	1,360	28,050.00	38,148,000.00
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	47,450.00	148,993,000.00

	MERITZ SECURITIES	24,500	2,950.00	72,275,000.00
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	24,737	5,230.00	129,374,510.00
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	8,720.00	67,405,600.00
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	27,850.00	99,285,250.00
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,024	579,000.00	592,896,000.00
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	16,650.00	98,235,000.00
	NCSOFT CORPORATION	1,083	642,000.00	695,286,000.00
	NETMARBLE CORP	1,470	92,500.00	135,975,000.00
	PEARL ABYSS CORP	310	196,700.00	60,977,000.00
	KAKAO CORP	3,530	175,500.00	619,515,000.00
	NAVER CORP	9,190	178,500.00	1,640,415,000.00
小計	銘柄数：111			46,298,667,210.00
				(4,046,503,514)
	組入時価比率：11.4%			12.4%
新台湾ドル	SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS RTS	17,219	0.28	4,821.32
	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	88,360	79.50	7,024,620.00
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	218,998	68.90	15,088,962.20
	FORMOSA PLASTIC	297,424	80.10	23,823,662.40
	NAN YA PLASTICS CORP	340,726	57.20	19,489,527.20
	ASIA CEMENT	126,980	42.25	5,364,905.00
	TAIWAN CEMENT	329,371	41.80	13,767,707.80
	CHINA STEEL	754,544	19.10	14,411,790.40
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	229,454	23.95	5,495,423.30
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	8,000	493.50	3,948,000.00
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	13,243	240.00	3,178,320.00
	CHINA AIRLINES	133,561	7.00	934,927.00
	EVA AIRWAYS CORP	180,918	10.00	1,809,180.00
	EVERGREEN MARINE	202,375	9.88	1,999,465.00
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	31.50	4,504,500.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	153,036	31.80	4,866,544.80
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	208.50	2,085,000.00
	TATUNG CO LTD	130,000	21.95	2,853,500.00
	GIANT MANUFACTURING	18,752	143.50	2,690,912.00
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,443	278.00	3,181,154.00

FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	22,346	149.00	3,329,554.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	65,000	31.20	2,028,000.00	
POU CHEN CORP	135,468	27.30	3,698,276.40	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	20,271	65.90	1,335,858.90	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	18,000	490.50	8,829,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	37,816	284.00	10,739,744.00	
STANDARD FOODS CORP	27,079	66.40	1,798,045.60	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	300,836	66.00	19,855,176.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	341,788	19.20	6,562,329.60	
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,236,212	18.70	23,117,164.40	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	658,425	25.60	16,855,680.00	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	617,787	20.10	12,417,518.70	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	489,305	18.05	8,831,955.25	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	711,380	28.35	20,167,623.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	741,549	11.40	8,453,658.60	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	664,776	11.75	7,811,118.00	
TAIWAN BUSINESS BANK	320,616	10.10	3,238,221.60	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	571,312	19.20	10,969,190.40	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	220,574	40.95	9,032,505.30	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	73,051	96.50	7,049,421.50	
YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	619,377	16.10	9,971,969.70	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	497,035	37.00	18,390,295.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	838,789	8.36	7,012,276.04	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	176,754	19.20	3,393,676.80	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	425,541	39.00	16,596,099.00	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	691,009	8.08	5,583,352.72	
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	32,000	184.00	5,888,000.00	
ACER INC	160,767	15.20	2,443,658.40	
ADVANTECH CO.,LTD.	21,594	265.00	5,722,410.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	45,805	193.50	8,863,267.50	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	40,840	215.50	8,801,020.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	48,645	81.90	3,984,025.50	
COMPAL ELECTRONICS	244,590	18.45	4,512,685.50	
INVENTEC CO.,LTD	136,911	23.40	3,203,717.40	

LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,897	43.00	6,273,571.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	90.30	4,695,600.00	
PEGATRON CORP	121,692	63.20	7,690,934.40	
QUANTA COMPUTER INC	175,684	62.20	10,927,544.80	
WISTRON CORP	216,457	25.30	5,476,362.10	
WIWYNN CORP	5,000	651.00	3,255,000.00	
AU OPTRONICS CORP	489,008	7.07	3,457,286.56	
DELTA ELECTRONICS INC	123,681	128.50	15,893,008.50	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	52.40	2,873,301.60	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	800,649	73.50	58,847,701.50	
INNOLUX CORP	505,322	6.00	3,031,932.00	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,040	3,700.00	22,348,000.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	77,566	37.80	2,931,994.80	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	18,000	192.00	3,456,000.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	37.15	4,472,377.05	
YAGEO CORPORATION	14,377	326.00	4,686,902.00	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	36,410	100.00	3,641,000.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	217,658	63.10	13,734,219.80	
GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	370.00	4,810,000.00	
MEDIATEK INC	94,538	353.50	33,419,183.00	
NANYA TECHNOLOGY CO	63,000	58.00	3,654,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	34,058	179.00	6,096,382.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	9,306	267.50	2,489,355.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	46,147	97.50	4,499,332.50	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	28,417	233.50	6,635,369.50	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,581,000	295.00	466,395,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	704,500	14.80	10,426,600.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	66.50	4,588,500.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	21,000	265.50	5,575,500.00	
WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	12.80	3,097,600.00	
CHUNGHWA TELECOM CO LTD	242,065	108.50	26,264,052.50	
FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	105,000	64.80	6,804,000.00	
TAIWAN MOBILE CO LTD	102,200	106.00	10,833,200.00	
HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	39,110	40.40	1,580,044.00	
RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	31,006	41.20	1,277,447.20	

小計	銘柄数：89			1,203,147,719.04	
				(4,307,268,834)	
	組入時価比率：12.1%			13.3%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	44,705	355.25	15,881,451.25	
	COAL INDIA LTD	76,900	139.00	10,689,100.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	215.85	7,420,923.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	113,000	83.00	9,379,000.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	157,000	69.35	10,887,950.00	
	PETRONET LNG LTD	34,980	215.20	7,527,696.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	182,300	1,237.35	225,568,905.00	
	ASIAN PAINTS LTD	19,300	1,726.00	33,311,800.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	19,000	525.15	9,977,850.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	6,620	1,475.70	9,769,134.00	
	UPL LTD	32,100	345.95	11,104,995.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	29,920	167.55	5,013,096.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,700	509.55	9,019,035.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	470	18,828.45	8,849,371.50	
	ULTRATECH CEMENT LTD	6,180	3,403.25	21,032,085.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	71,770	107.10	7,686,567.00	
	JSW STEEL LTD	53,000	159.60	8,458,800.00	
	TATA STEEL LIMITED	18,606	265.95	4,948,265.70	
	VEDANTA LTD	126,000	78.45	9,884,700.00	
	LARSEN&TOUBRO LIMITED	31,100	870.35	27,067,885.00	
	HAVELLS INDIA LTD	17,700	503.80	8,917,260.00	
	SIEMENS LIMITED	3,100	1,159.20	3,593,520.00	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	60,650	44.10	2,674,665.00	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	5,010	1,010.65	5,063,356.50	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	365.75	4,527,985.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	265.20	11,297,520.00	
	BHARAT FORGE LIMITED	12,700	259.30	3,293,110.00	
	BOSCH LTD	390	10,006.85	3,902,671.50	
	MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	57,438	71.95	4,132,664.10	
	BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	2,323.25	12,986,967.50	
EICHER MOTORS LTD	820	13,495.00	11,065,900.00		
HERO MOTOCORP LTD	6,210	1,827.55	11,349,085.50		



MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	50,800	332.05	16,868,140.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	7,060	5,001.10	35,307,766.00
TATA MOTORS LTD	104,000	74.65	7,763,600.00
PAGE INDUSTRIES LTD	340	17,584.10	5,978,594.00
TITAN CO LTD	21,000	936.70	19,670,700.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	7,800	2,238.20	17,457,960.00
UNITED SPIRITS LTD	22,600	523.80	11,837,880.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,530	2,863.25	12,970,522.50
NESTLE INDIA LIMITED	1,550	17,015.35	26,373,792.50
ITC LTD	221,100	179.60	39,709,560.00
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	53,600	2,317.40	124,212,640.00
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	2,900	1,403.80	4,071,020.00
DABUR INDIA LTD	37,800	498.20	18,831,960.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,200	529.80	14,410,560.00
MARICO LIMITED	26,340	296.05	7,797,957.00
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	644.40	12,050,280.00
CIPLA LIMITED	20,980	592.10	12,422,258.00
DR.REDDYS LABORATORIES	7,130	4,016.40	28,636,932.00
LUPIN LTD	14,900	812.50	12,106,250.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,927	829.70	6,577,031.90
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	60,100	473.15	28,436,315.00
AXIS BANK LIMITED	140,400	420.65	59,059,260.00
BANDHAN BANK LTD	28,900	195.35	5,645,615.00
ICICI BANK LTD	314,500	331.85	104,366,825.00
REC LTD	39,810	91.45	3,640,624.50
BAJAJ FINSERV LTD	2,320	4,595.05	10,660,516.00
HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	32,000	496.35	15,883,200.00
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	10,200	1,159.20	11,823,840.00
ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	17,100	370.40	6,333,840.00
SBI LIFE INSURANCE CO LTD	19,600	671.30	13,157,480.00
HCL TECHNOLOGIES LTD	69,600	455.70	31,716,720.00
INFOSYS LTD	218,600	633.20	138,417,520.00
TATA CONSULTANCY SVS LTD	59,100	1,737.65	102,695,115.00
TECH MAHINDRA LTD	28,300	512.95	14,516,485.00

	WIPRO LTD	80,400	178.05	14,315,220.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	16,510	163.05	2,691,955.50	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	154,200	500.50	77,177,100.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	127,000	162.65	20,656,550.00	
	TATA POWER COMPANY LIMITED	63,864	32.45	2,072,386.80	
	GAIL INDIA LTD	94,600	82.50	7,804,500.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	105,000	1,669.70	175,318,500.00	
	LIC HOUSING FINANCE	18,050	262.30	4,734,515.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	11,130	2,099.75	23,370,217.50	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	15,160	151.55	2,297,498.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	5,200	588.60	3,060,720.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,990	2,626.40	5,226,536.00	
	NTPC LIMITED	142,008	97.30	13,817,378.40	
	DIVIS LABORATORIES LTD	5,900	2,406.60	14,198,940.00	
	DLF LIMITED	26,000	132.65	3,448,900.00	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	70,000	129.25	9,047,500.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	2,980	2,387.15	7,113,707.00	
小計	銘柄数：83			1,904,044,198.15	
				(2,684,702,319)	
	組入時価比率：7.5%			8.3%	
パキスタンルピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	51,000	89.35	4,556,850.00	
	HABIB BANK LTD	35,600	104.61	3,724,116.00	
	MCB BANK LIMITED	34,000	156.97	5,336,980.00	
小計	銘柄数：3			13,617,946.00	
				(9,124,023)	
	組入時価比率：0.0%			0.0%	
カタールリヤル	QATAR FUEL CO	34,700	16.70	579,490.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	1.70	518,500.00	
	INDUSTRIES QATAR	111,700	6.50	726,050.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	117,900	3.92	462,285.90	
	MASRAF AL RAYAN	211,600	3.72	787,152.00	
	QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	8.05	378,632.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	80,400	14.61	1,174,644.00	
	QATAR NATIONAL BANK	289,200	16.56	4,789,152.00	
	QATAR INSURANCE CO	100,010	2.03	203,020.30	

	OOREDOO QSC	43,100	5.88	253,686.60	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	14.51	499,144.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	113,000	2.60	293,800.00	
小計	銘柄数：12			10,665,556.80	
				(314,953,892)	
	組入時価比率：0.9%			1.0%	
エジプト債券	ELSWEDY ELECTRIC CO	41,500	8.94	371,010.00	
	EASTERN TOBACCO	51,525	12.27	632,211.75	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	91,300	59.47	5,429,611.00	
小計	銘柄数：3			6,432,832.75	
				(44,064,904)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	15,000	105.51	1,582,650.00	
	SASOL LTD	36,200	55.02	1,991,724.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,980	825.00	2,458,500.00	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	26,400	424.20	11,198,880.00	
	GOLD FIELDS LTD	51,700	122.39	6,327,563.00	
	IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	45,800	97.38	4,460,004.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,900	316.83	1,235,637.00	
	NORTHAM PLATINUM LTD	17,900	83.25	1,490,175.00	
	SIBANYE STILLWATER LTD	161,000	29.50	4,749,500.00	
	BIDVEST GROUP LTD	17,200	140.85	2,422,620.00	
	NASPERS LTD-N SHS	28,740	2,791.28	80,221,387.20	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	61,610	27.99	1,724,463.90	
	MR PRICE GROUP LTD	16,700	125.63	2,098,021.00	
	PEPKOR HOLDINGS LTD	38,000	10.80	410,400.00	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	13,920	73.29	1,020,196.80	
	BID CORP LTD	22,800	222.46	5,072,088.00	
	CLICKS GROUP LTD	18,300	265.00	4,849,500.00	
	PICKN PAY STORES LTD	26,700	57.18	1,526,706.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	29,200	109.29	3,191,268.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	180.02	2,754,306.00	
	TIGER BRANDS LTD	12,800	177.42	2,270,976.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	102,000	17.10	1,744,200.00	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	21,630	108.73	2,351,829.90	
	ABSA GROUP LTD	42,300	80.13	3,389,499.00	

	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,130	900.00	2,817,000.00	
	NEDBANK GROUP LTD	21,300	90.30	1,923,390.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	88,100	96.69	8,518,389.00	
	FIRSTRAND LTD	216,300	36.80	7,959,840.00	
	PSG GROUP LTD	8,660	139.86	1,211,187.60	
	REMGRO LTD	33,200	125.22	4,157,304.00	
	RMB HOLDINGS LTD	54,800	48.96	2,683,008.00	
	DISCOVERY LTD	25,800	82.19	2,120,502.00	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,360	64.04	407,294.40	
	MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS	56,462	16.18	913,555.16	
	OLD MUTUAL LTD	294,000	12.04	3,539,760.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	23.84	961,944.00	
	SANLAM LIMITED	119,300	53.82	6,420,726.00	
	TELKOM SA SOC LTD	15,970	18.66	298,000.20	
	MTN GROUP LTD	109,700	44.76	4,910,172.00	
	VODACOM GROUP	39,800	119.29	4,747,742.00	
	INVESTEC LTD	15,640	36.32	568,044.80	
	REINET INVESTMENTS SCA	8,790	272.03	2,391,143.70	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	25,200	87.17	2,196,684.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	88.55	2,360,743.00	
	小計 銘柄数：44			211,648,524.66	
				(1,200,047,134)	
	組入時価比率：3.4%			3.7%	
UAE	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	173,870	4.15	721,560.50	
ディール	DUBAI ISLAMIC BANK	102,029	3.29	335,675.41	
ム	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	173,200	10.50	1,818,600.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	112,500	14.32	1,611,000.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	1.44	398,880.00	
	EMAAR MALLS PJSC	211,000	1.08	227,880.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	262,000	2.36	618,320.00	
	小計 銘柄数：7			5,731,915.91	
				(168,575,646)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
サウジアラビア	RABIGH REFINING AND PETROCHE	9,600	13.06	125,376.00	

## リアル

SAUDI ARABIAN OIL CO	74,800	29.40	2,199,120.00
ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,020	42.95	387,409.00
NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	10,000	9.16	91,600.00
SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	29,300	13.14	385,002.00
SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	11,900	62.60	744,940.00
SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	45,800	70.80	3,242,640.00
SAUDI IND INVESTMENT GROUP	18,700	16.42	307,054.00
SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	47,000	7.54	354,380.00
YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	14,300	41.60	594,880.00
SAUDI CEMENT	6,400	49.70	318,080.00
SAUDI ARABIAN MINING CO	28,200	33.30	939,060.00
SAUDI AIRLINES CATERING CO	1,200	70.70	84,840.00
JARIR MARKETING CO	3,730	137.80	513,994.00
ALMARAI CO	18,000	47.60	856,800.00
SAVOLA	16,600	40.75	676,450.00
AL RAJHI BANK	80,600	51.90	4,183,140.00
ALINMA BANK	61,066	14.30	873,243.80
ARAB NATIONAL BANK	32,800	17.74	581,872.00
BANK AL - JAZIRA	34,100	10.86	370,326.00
BANK ALBILAD	23,300	20.02	466,466.00
BANQUE SAUDI FRANSI	37,400	27.10	1,013,540.00
NATIONAL COMMERCIAL BANK	72,700	34.80	2,529,960.00
RIYAD BANK	80,300	15.00	1,204,500.00
SAMBA FINANCIAL GROUP	65,800	20.02	1,317,316.00
SAUDI BRITISH BANK	41,600	20.30	844,480.00
BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	101.00	80,800.00
CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,700	68.00	183,600.00
SAUDI TELECOM CO	26,400	89.50	2,362,800.00
ETIHAD ETISALAT CO	23,900	24.76	591,764.00
SAUDI ELECTRICITY CO	58,200	15.84	921,888.00
DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	23,000	7.94	182,620.00
EMAAR ECONOMIC CITY	12,000	6.75	81,000.00
小計銘柄数：33			29,610,940.80
			(852,498,985)

	組入時価比率：2.4%		2.6%
合計			32,541,422,108 (32,541,422,108)

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	512,300	13,570,827.00	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：4.1%	512,300	13,570,827.00 (1,463,749,400) 97.2%	
	合計			1,463,749,400 (1,463,749,400)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	208,100	3,781,177.00	
		小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.0%	208,100	3,781,177.00 (16,712,802) 1.1%
	ランド	FORTRESS REIT LTD-A	100,000	1,061,000.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	191,000	2,612,880.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	328,000	797,040.00	
	小計	銘柄数：3 組入時価比率：0.1%	619,000	4,470,920.00 (25,350,116) 1.7%	
	合計			42,062,918 (42,062,918)	
合計				1,505,812,318 (1,505,812,318)	

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

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 4月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	1,391,541,767	-	1,492,516,794	100,975,027
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	23,643,180	-	23,727,000	83,820
米ドル	23,643,180	-	23,727,000	83,820
合計	-	-	-	100,891,207

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 外国先物取引について

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

## 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	24,718,181
コール・ローン	70,178,156
株式	23,464,018,661
投資信託受益証券	172,983,710

(2020年 4月22日現在)

投資証券	932,267,103
未収配当金	40,580,869
差入委託証拠金	79,186,113
流動資産合計	24,783,932,793
資産合計	24,783,932,793
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	3,569,110
未払解約金	74,195,826
未払利息	82
その他未払費用	480,400
流動負債合計	78,245,418
負債合計	78,245,418
純資産の部	
元本等	
元本	22,298,536,380
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,407,150,995
元本等合計	24,705,687,375
純資産合計	24,705,687,375
負債純資産合計	24,783,932,793

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>市場価格のない有価証券については基準価額で評価しております。</p> <p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</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>



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

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1080円
(10,000口当たり純資産額)	(11,080円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>    市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>    信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>    流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
投資信託受益証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、	附属明細表に記載しております。
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4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	14,558,114,507円
同期中における一部解約元本額	2,637,603,878円
期末元本額	22,298,536,380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	6,938,547,268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	2,835,683,239円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,982,013円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,267,279円
インデックス・ブレンド(タイプ )	8,859,520円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,340,144円
インデックス・ブレンド(タイプ )	9,269,829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)	531,716,438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)	76,507,446円
米国株式配当貴族(年4回決算型)	11,890,363,204円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1)株式(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	CHEVRON CORP	39,420	81.64	3,218,248.80	
		EXXON MOBIL CORP	66,500	40.96	2,723,840.00	
		AIR PRODUCTS	18,070	207.39	3,747,537.30	
		ALBEMARLE CORP	54,310	57.86	3,142,376.60	
		ECOLAB INC	22,260	170.16	3,787,761.60	
		LINDE PLC	20,990	178.88	3,754,691.20	
		PPG INDUSTRIES	35,040	88.01	3,083,870.40	
		SHERWIN-WILLIAMS	7,410	484.90	3,593,109.00	
		AMCOR PLC	420,300	8.26	3,471,678.00	
		NUCOR CORP	87,600	36.05	3,157,980.00	
		GENERAL DYNAMICS	23,820	131.69	3,136,855.80	
		RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP	28,780	62.65	1,803,067.00	
		CARRIER GLOBAL CORP	28,780	14.69	422,778.20	
		SMITH (A.O.) CORP	97,000	38.72	3,755,840.00	
		EMERSON ELEC	57,500	50.77	2,919,275.00	
		3M CORP	24,750	141.63	3,505,342.50	
		ROPER TECHNOLOGIES INC	11,700	310.58	3,633,786.00	
		CATERPILLAR INC DEL	31,400	109.85	3,449,290.00	
		DOVER CORP	37,640	84.51	3,180,956.40	
		ILLINOIS TOOL WORKS INC	25,010	151.77	3,795,767.70	
		OTIS WORLDWIDE CORP	14,390	45.90	660,501.00	
		PENTAIR PLC	95,400	29.25	2,790,450.00	
		STANLEY BLACK & DECKER INC	26,480	106.34	2,815,883.20	
		GRAINGER(W.W.) INC	13,400	270.09	3,619,206.00	
		CINTAS CORP	15,550	190.50	2,962,275.00	
		EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	59,300	69.67	4,131,431.00	
		LEGGETT & PLATT INC	86,600	26.99	2,337,334.00	
		V F CORP	52,150	53.34	2,781,681.00	
MCDONALD'S CORP	20,870	177.58	3,706,094.60			
GENUINE PARTS CO	44,950	71.04	3,193,248.00			
TARGET CORP	38,560	106.90	4,122,064.00			

LOWES COS INC	36,670	92.62	3,396,375.40	
ROSS STORES INC	38,080	82.70	3,149,216.00	
SYSCO CORP	53,400	49.10	2,621,940.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	84,700	42.55	3,603,985.00	
WALMART INC	38,550	129.21	4,981,045.50	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	61,400	60.29	3,701,806.00	
COCA COLA CO	76,400	45.38	3,467,032.00	
PEPSICO INC	30,850	130.94	4,039,499.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	99,500	35.00	3,482,500.00	
HORMEL FOODS CORP	93,300	48.93	4,565,169.00	
MCCORMICK & CO INC.	25,530	151.18	3,859,625.40	
CLOROX CO	27,850	190.77	5,312,944.50	
COLGATE PALMOLIVE CO.	62,710	70.61	4,427,953.10	
KIMBERLY-CLARK CORP	30,740	139.47	4,287,307.80	
PROCTER & GAMBLE CO	35,230	119.68	4,216,326.40	
ABBOTT LABORATORIES	48,770	94.05	4,586,818.50	
BECTON,DICKINSON	15,840	256.50	4,062,960.00	
MEDTRONIC PLC	36,970	97.61	3,608,641.70	
CARDINAL HEALTH INC	81,900	48.27	3,953,313.00	
ABBVIE INC	52,770	80.36	4,240,597.20	
JOHNSON & JOHNSON	29,720	149.68	4,448,489.60	
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	278,100	10.98	3,053,538.00	
AFLAC INC	84,100	34.59	2,909,019.00	
CHUBB LTD	29,000	112.39	3,259,310.00	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	41,580	80.17	3,333,468.60	
AUTOMATIC DATA PROCESS	24,880	133.61	3,324,216.80	
AT & T INC	114,500	29.87	3,420,115.00	
ATMOS ENERGY CORP	37,560	100.79	3,785,672.40	
CONSOLIDATED EDISON INC	47,100	83.49	3,932,379.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	174,500	15.98	2,788,510.00	
S&P GLOBAL INC	14,950	267.23	3,995,088.50	
T ROWE PRICE GROUP INC	33,610	98.85	3,322,348.50	
小計銘柄数：63			217,541,430.20	
			(23,464,018,661)	
組入時価比率：95.0%			100.0%	

合計			23,464,018,661	
			(23,464,018,661)	

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

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

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

(2)株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資信託受益証券	米ドル	PROSHARES S&P 500 DIV ARISTO CRATS ETF	26,500	1,603,780.00	
		小計	26,500	1,603,780.00 (172,983,710)	15.7%
	合計			172,983,710 (172,983,710)	
	合計			172,983,710 (172,983,710)	
投資証券	米ドル	ESSEX PROPERTY TRUST INC	14,250	3,402,757.50	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	33,960	2,391,123.60	
		REALTY INCOME CORP	57,160	2,849,426.00	
		小計	105,370	8,643,307.10 (932,267,103)	84.3%
	合計			932,267,103 (932,267,103)	
合計			1,105,250,813 (1,105,250,813)		

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

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 4月22日現在		
	契約額等(円)	時価(円)	評価損益(円)
市場取引			

株価指数先物取引				
買建	121,272,391	-	117,869,408	3,402,983
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	23,731,202	-	23,727,000	4,202
米ドル	23,731,202	-	23,727,000	4,202
売建	40,928,925	-	41,090,850	161,925
米ドル	40,928,925	-	41,090,850	161,925
合計	-	-	-	3,569,110

## (注) 時価の算定方法

## 1 先物取引

## 外国先物取引について

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

## 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	7,971,859,961
国債証券	529,839,141,520
地方債証券	48,011,483,689
特殊債証券	61,794,118,957
社債証券	29,398,261,700
未収入金	746,000
未収利息	1,130,419,699
前払費用	7,006,726
流動資産合計	678,153,038,252

(2020年 4月22日現在)

資産合計	678,153,038,252
負債の部	
流動負債	
未払金	1,832,788,000
未払解約金	477,331,164
未払利息	9,402
流動負債合計	2,310,128,566
負債合計	2,310,128,566
純資産の部	
元本等	
元本	505,925,402,477
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	169,917,507,209
元本等合計	675,842,909,686
純資産合計	675,842,909,686
負債純資産合計	678,153,038,252

## 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)

2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.3359円
(10,000口当たり純資産額)	(13,359円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日	
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

### 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在

### 1.貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

### 2.時価の算定方法

国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

### （その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4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	103,482,768,064円
同期中における一部解約元本額	94,874,622,446円
期末元本額	505,925,402,477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	479,600,191円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	37,259,808,538円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	16,414,584,123円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,419,120,067円
野村資産設計ファンド2015	335,526,017円
野村資産設計ファンド2020	326,132,472円
野村資産設計ファンド2025	276,101,195円
野村資産設計ファンド2030	202,058,019円
野村資産設計ファンド2035	100,499,833円
野村資産設計ファンド2040	146,426,369円



野村日本債券インデックスファンド	910,772,331円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	159,021,919,150円
のむらップ・ファンド(保守型)	12,233,658,521円
のむらップ・ファンド(普通型)	7,951,473,685円
のむらップ・ファンド(積極型)	991,001,871円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	10,836,701,980円
野村資産設計ファンド2045	14,120,452円
野村円債投資インデックスファンド	1,049,072,220円
野村インデックスファンド・国内債券	3,178,142,672円
マイ・ロード	33,461,732,085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	1,045,980,388円
野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)	22,192,188円
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	14,875,933,130円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	2,345,607,364円
野村資産設計ファンド2050	17,775,668円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	17,607,349円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	4,597,491円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	2,760,078円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,583,779円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	694,881,243円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	188,483,091円
インデックス・ブレンド(タイプ)	56,713,725円
インデックス・ブレンド(タイプ)	28,161,672円
インデックス・ブレンド(タイプ)	68,764,571円
インデックス・ブレンド(タイプ)	12,629,210円
インデックス・ブレンド(タイプ)	15,118,912円
野村6資産均等バランス	1,280,381,163円
世界6資産分散ファンド	131,126,104円
野村資産設計ファンド2060	4,763,643円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信	1,113,339,384円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	16,045,743,780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)	606,447,815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)	142,875,759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)	1,893,103,802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)	1,253,323,769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)	19,422,589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)	9,463,005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)	249,481円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,456,593,308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)	13,302,842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)	94,632,819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)	74,950,657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)	336,138,577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)	304,800,042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)	713,205,778円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	181,980,444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)	315,226,493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)	1,737,763,474円

野村F O F s用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格 機関投資家専用)	1,237,837円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	32,232,423,551円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	38,349,343,915円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	12,877,431,645円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合(確定拠出年金向 け)	48,907,501,557円
マイバランスDC30	11,194,157,534円
マイバランスDC50	7,687,310,099円
マイバランスDC70	2,348,853,374円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	12,546,595,306円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	541,176,751円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,261,388,790円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	521,829,778円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	90,332,427円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	15,787,374円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	13,025,435円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	15,718,964円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	5,497,948円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	2,641,753円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	330,649,524円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	152,423,726円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	42,984,732円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	50,145,145円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	868,934円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付(2年)第402回	1,400,000,000	1,404,326,000	
		国庫債券 利付(2年)第403回	1,500,000,000	1,504,875,000	
		国庫債券 利付(2年)第406回	4,000,000,000	4,015,880,000	
		国庫債券 利付(5年)第129回	7,000,000,000	7,024,710,000	
		国庫債券 利付(5年)第130回	7,500,000,000	7,531,200,000	
		国庫債券 利付(5年)第131回	4,800,000,000	4,823,376,000	
		国庫債券 利付(5年)第132回	3,000,000,000	3,016,230,000	

国庫債券 利付(5年)第133回	6,200,000,000	6,238,998,000	
国庫債券 利付(5年)第134回	3,000,000,000	3,020,820,000	
国庫債券 利付(5年)第135回	3,500,000,000	3,526,565,000	
国庫債券 利付(5年)第136回	3,300,000,000	3,327,225,000	
国庫債券 利付(5年)第137回	4,000,000,000	4,034,960,000	
国庫債券 利付(5年)第138回	5,900,000,000	5,953,159,000	
国庫債券 利付(5年)第139回	4,400,000,000	4,441,448,000	
国庫債券 利付(5年)第140回	3,400,000,000	3,432,674,000	
国庫債券 利付(5年)第141回	4,000,000,000	4,040,800,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	2,360,000,000	3,585,430,000	
国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,331,829,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,345,302,000	
国庫債券 利付(40年)第4回	1,130,000,000	1,705,893,200	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,200,000,000	1,758,192,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,880,710,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,955,072,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,965,465,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	2,350,000,000	2,317,241,000	
国庫債券 利付(40年)第10回	2,100,000,000	2,425,962,000	
国庫債券 利付(40年)第11回	1,900,000,000	2,136,094,000	
国庫債券 利付(40年)第12回	1,600,000,000	1,629,184,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,831,806,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,252,032,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,888,646,500	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,567,270,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,270,368,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,448,168,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	1,700,000,000	1,738,658,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,265,824,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,400,000,000	4,501,684,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,147,670,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,178,647,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,000,000,000	5,109,450,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,459,795,000	
	3,800,000,000	3,924,412,000	

国庫債券 利付(10年)第330回			
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,949,172,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	5,400,000,000	5,548,014,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	4,200,000,000	4,322,052,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	6,600,000,000	6,801,432,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	5,200,000,000	5,345,288,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	1,700,000,000	1,750,201,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	3,700,000,000	3,774,592,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	4,200,000,000	4,309,914,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	4,000,000,000	4,111,160,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	4,200,000,000	4,322,472,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	6,000,000,000	6,148,860,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	2,750,000,000	2,788,472,500	
国庫債券 利付(10年)第343回	5,400,000,000	5,478,786,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,888,102,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	5,000,000,000	5,078,950,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	4,900,000,000	4,978,498,000	
国庫債券 利付(10年)第347回	3,400,000,000	3,456,508,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	4,600,000,000	4,677,418,000	
国庫債券 利付(10年)第349回	4,000,000,000	4,066,440,000	
国庫債券 利付(10年)第350回	5,850,000,000	5,945,589,000	
国庫債券 利付(10年)第351回	5,600,000,000	5,689,768,000	
国庫債券 利付(10年)第352回	5,300,000,000	5,380,772,000	
国庫債券 利付(10年)第353回	5,100,000,000	5,173,287,000	
国庫債券 利付(10年)第354回	4,350,000,000	4,408,377,000	
国庫債券 利付(10年)第355回	5,100,000,000	5,163,240,000	
	4,400,000,000	4,451,876,000	

国庫債券 利付（10年）第356回			
国庫債券 利付（10年）第357回	1,400,000,000	1,415,568,000	
国庫債券 利付（30年）第1回	500,000,000	632,645,000	
国庫債券 利付（30年）第2回	200,000,000	247,426,000	
国庫債券 利付（30年）第3回	160,000,000	197,072,000	
国庫債券 利付（30年）第4回	900,000,000	1,173,600,000	
国庫債券 利付（30年）第5回	150,000,000	185,619,000	
国庫債券 利付（30年）第6回	700,000,000	887,824,000	
国庫債券 利付（30年）第7回	600,000,000	758,832,000	
国庫債券 利付（30年）第8回	100,000,000	120,975,000	
国庫債券 利付（30年）第9回	265,000,000	307,490,100	
国庫債券 利付（30年）第10回	250,000,000	280,960,000	
国庫債券 利付（30年）第11回	160,000,000	192,499,200	
国庫債券 利付（30年）第12回	220,000,000	276,942,600	
国庫債券 利付（30年）第13回	290,000,000	362,056,300	
国庫債券 利付（30年）第14回	800,000,000	1,045,208,000	
国庫債券 利付（30年）第15回	900,000,000	1,191,573,000	
国庫債券 利付（30年）第16回	915,000,000	1,215,742,200	
国庫債券 利付（30年）第17回	1,200,000,000	1,581,636,000	
国庫債券 利付（30年）第18回	1,500,000,000	1,960,215,000	
国庫債券 利付（30年）第19回	1,600,000,000	2,097,424,000	
国庫債券 利付（30年）第20回	1,400,000,000	1,882,790,000	
国庫債券 利付（30年）第21回	1,400,000,000	1,845,018,000	
国庫債券 利付（30年）第22回	600,000,000	811,494,000	
国庫債券 利付（30年）第23回	840,000,000	1,138,846,800	
国庫債券 利付（30年）第24回	700,000,000	952,035,000	
国庫債券 利付（30年）第25回	500,000,000	665,535,000	
国庫債券 利付（30年）第26回	850,000,000	1,148,299,000	
国庫債券 利付（30年）第27回	1,550,000,000	2,131,870,000	
国庫債券 利付（30年）第28回	1,200,000,000	1,659,912,000	
国庫債券 利付（30年）第29回	1,500,000,000	2,060,370,000	
国庫債券 利付（30年）第30回	1,700,000,000	2,320,772,000	
国庫債券 利付（30年）第31回	1,600,000,000	2,167,552,000	
国庫債券 利付（30年）第32回	1,900,000,000	2,626,161,000	
国庫債券 利付（30年）第33回	2,400,000,000	3,196,992,000	
国庫債券 利付（30年）第34回	2,100,000,000	2,896,341,000	
国庫債券 利付（30年）第35回	2,300,000,000	3,092,856,000	
国庫債券 利付（30年）第36回	2,300,000,000	3,106,909,000	
国庫債券 利付（30年）第37回	2,300,000,000	3,069,534,000	
国庫債券 利付（30年）第38回	1,600,000,000	2,107,632,000	
国庫債券 利付（30年）第39回	1,600,000,000	2,147,376,000	

国庫債券	利付(30年)第40回	1,100,000,000	1,454,563,000
国庫債券	利付(30年)第41回	1,500,000,000	1,953,135,000
国庫債券	利付(30年)第42回	1,600,000,000	2,085,712,000
国庫債券	利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,698,489,000
国庫債券	利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,831,228,000
国庫債券	利付(30年)第45回	1,700,000,000	2,146,233,000
国庫債券	利付(30年)第46回	1,800,000,000	2,274,228,000
国庫債券	利付(30年)第47回	1,700,000,000	2,191,351,000
国庫債券	利付(30年)第48回	1,900,000,000	2,360,028,000
国庫債券	利付(30年)第49回	1,900,000,000	2,361,377,000
国庫債券	利付(30年)第50回	1,600,000,000	1,754,352,000
国庫債券	利付(30年)第51回	2,900,000,000	2,817,959,000
国庫債券	利付(30年)第52回	1,900,000,000	1,938,437,000
国庫債券	利付(30年)第53回	1,700,000,000	1,777,622,000
国庫債券	利付(30年)第54回	1,700,000,000	1,862,911,000
国庫債券	利付(30年)第55回	1,500,000,000	1,644,960,000
国庫債券	利付(30年)第56回	1,900,000,000	2,082,590,000
国庫債券	利付(30年)第57回	1,600,000,000	1,755,008,000
国庫債券	利付(30年)第58回	2,100,000,000	2,305,086,000
国庫債券	利付(30年)第59回	1,600,000,000	1,714,960,000
国庫債券	利付(30年)第60回	1,050,000,000	1,180,914,000
国庫債券	利付(30年)第61回	1,000,000,000	1,071,620,000
国庫債券	利付(30年)第62回	1,300,000,000	1,323,387,000
国庫債券	利付(30年)第63回	1,400,000,000	1,387,316,000
国庫債券	利付(30年)第64回	1,500,000,000	1,484,370,000
国庫債券	利付(30年)第65回	1,200,000,000	1,188,960,000
国庫債券	利付(20年)第51回	310,000,000	317,790,300
国庫債券	利付(20年)第52回	100,000,000	103,194,000
国庫債券	利付(20年)第53回	250,000,000	259,360,000
国庫債券	利付(20年)第54回	100,000,000	103,911,000
国庫債券	利付(20年)第55回	231,000,000	240,510,270
国庫債券	利付(20年)第56回	120,000,000	125,587,200
国庫債券	利付(20年)第57回	210,000,000	219,324,000
国庫債券	利付(20年)第58回	180,000,000	188,928,000
国庫債券	利付(20年)第59回	230,000,000	241,364,300
国庫債券	利付(20年)第60回	780,000,000	812,284,200
国庫債券	利付(20年)第61回	300,000,000	310,071,000
国庫債券	利付(20年)第62回	440,000,000	453,336,400
国庫債券	利付(20年)第63回	300,000,000	318,618,000
国庫債券	利付(20年)第64回	400,000,000	428,112,000
国庫債券	利付(20年)第65回	455,000,000	489,147,750
国庫債券	利付(20年)第66回	300,000,000	321,411,000
国庫債券	利付(20年)第67回	310,000,000	334,775,200

国庫債券 利付(20年)第68回	290,000,000	316,593,000	
国庫債券 利付(20年)第69回	560,000,000	609,156,800	
国庫債券 利付(20年)第70回	540,000,000	597,002,400	
国庫債券 利付(20年)第71回	200,000,000	219,438,000	
国庫債券 利付(20年)第72回	670,000,000	736,115,600	
国庫債券 利付(20年)第73回	1,600,000,000	1,759,376,000	
国庫債券 利付(20年)第74回	900,000,000	993,861,000	
国庫債券 利付(20年)第75回	600,000,000	665,910,000	
国庫債券 利付(20年)第76回	910,000,000	1,000,972,700	
国庫債券 利付(20年)第77回	700,000,000	773,437,000	
国庫債券 利付(20年)第78回	800,000,000	884,344,000	
国庫債券 利付(20年)第79回	860,000,000	955,133,200	
国庫債券 利付(20年)第80回	900,000,000	1,004,238,000	
国庫債券 利付(20年)第81回	360,000,000	401,781,600	
国庫債券 利付(20年)第82回	820,000,000	919,638,200	
国庫債券 利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,544,195,500	
国庫債券 利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,345,740,000	
国庫債券 利付(20年)第85回	400,000,000	453,096,000	
国庫債券 利付(20年)第86回	1,400,000,000	1,602,496,000	
国庫債券 利付(20年)第87回	500,000,000	569,345,000	
国庫債券 利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,265,946,000	
国庫債券 利付(20年)第89回	470,000,000	537,990,200	
国庫債券 利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,725,945,000	
国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	289,272,500	
国庫債券 利付(20年)第92回	1,550,000,000	1,782,221,000	
国庫債券 利付(20年)第93回	300,000,000	344,412,000	
国庫債券 利付(20年)第94回	200,000,000	231,002,000	
国庫債券 利付(20年)第95回	700,000,000	822,619,000	
国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	464,288,000	
国庫債券 利付(20年)第97回	600,000,000	704,082,000	
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	349,797,000	
国庫債券 利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,458,533,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,798,616,000	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	299,810,000	
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	602,325,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	717,864,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	472,000,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,249,771,000	
	400,000,000	477,024,000	

国庫債券 利付（20年）第106回			
国庫債券 利付（20年）第107回	300,000,000	356,409,000	
国庫債券 利付（20年）第108回	1,600,000,000	1,872,992,000	
国庫債券 利付（20年）第109回	900,000,000	1,056,537,000	
国庫債券 利付（20年）第110回	1,100,000,000	1,311,002,000	
国庫債券 利付（20年）第111回	800,000,000	964,280,000	
国庫債券 利付（20年）第112回	1,800,000,000	2,153,106,000	
国庫債券 利付（20年）第113回	2,000,000,000	2,400,900,000	
国庫債券 利付（20年）第114回	1,700,000,000	2,047,837,000	
国庫債券 利付（20年）第115回	1,000,000,000	1,214,280,000	
国庫債券 利付（20年）第116回	1,100,000,000	1,341,065,000	
国庫債券 利付（20年）第117回	1,400,000,000	1,692,936,000	
国庫債券 利付（20年）第118回	500,000,000	601,280,000	
国庫債券 利付（20年）第119回	800,000,000	945,800,000	
国庫債券 利付（20年）第120回	800,000,000	929,560,000	
国庫債券 利付（20年）第121回	1,700,000,000	2,033,098,000	
国庫債券 利付（20年）第122回	1,100,000,000	1,304,094,000	
国庫債券 利付（20年）第123回	1,500,000,000	1,830,915,000	
国庫債券 利付（20年）第124回	1,000,000,000	1,209,980,000	
国庫債券 利付（20年）第125回	900,000,000	1,111,707,000	
国庫債券 利付（20年）第126回	1,000,000,000	1,213,500,000	
国庫債券 利付（20年）第127回	1,200,000,000	1,443,156,000	
国庫債券 利付（20年）第128回	1,800,000,000	2,169,522,000	
国庫債券 利付（20年）第129回	800,000,000	955,352,000	
国庫債券 利付（20年）第130回	1,400,000,000	1,676,080,000	
国庫債券 利付（20年）第131回	800,000,000	948,688,000	
	1,300,000,000	1,545,076,000	



国庫債券 利付(20年)第132回			
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,680,112,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,684,004,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	833,749,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	825,489,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,193,630,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	935,664,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	1,000,000,000	1,181,610,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,751,122,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	2,600,000,000	3,116,178,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	950,000,000	1,150,459,500	
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,544,530,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,300,000,000	1,528,007,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,300,000,000	2,767,176,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	2,892,840,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	4,200,000,000	5,015,178,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,100,000,000	2,482,809,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	2,350,000,000	2,782,118,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	3,330,000,000	3,903,392,700	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,500,000,000	2,862,175,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	1,700,000,000	1,947,486,000	
国庫債券 利付(20年)第153回	2,450,000,000	2,846,508,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	2,900,000,000	3,328,562,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	2,600,000,000	2,907,008,000	
国庫債券 利付(20年)第156回	2,350,000,000	2,407,598,500	
国庫債券 利付(20年)第157回	2,490,000,000	2,470,652,700	
	2,100,000,000	2,181,039,000	

		国庫債券 利付(20年)第158回			
		国庫債券 利付(20年)第159回	2,000,000,000	2,108,580,000	
		国庫債券 利付(20年)第160回	2,300,000,000	2,461,897,000	
		国庫債券 利付(20年)第161回	2,100,000,000	2,211,825,000	
		国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,790,304,000	
		国庫債券 利付(20年)第163回	2,900,000,000	3,053,584,000	
		国庫債券 利付(20年)第164回	2,600,000,000	2,690,636,000	
		国庫債券 利付(20年)第165回	2,200,000,000	2,275,768,000	
		国庫債券 利付(20年)第166回	2,300,000,000	2,460,494,000	
		国庫債券 利付(20年)第167回	2,600,000,000	2,687,126,000	
		国庫債券 利付(20年)第168回	3,300,000,000	3,353,031,000	
		国庫債券 利付(20年)第169回	2,530,000,000	2,523,118,400	
		国庫債券 利付(20年)第170回	2,000,000,000	1,994,500,000	
		国庫債券 利付(20年)第171回	1,300,000,000	1,296,386,000	
		メキシコ合衆国 第22回円貨社債(2016)	300,000,000	299,313,000	
		メキシコ合衆国 第25回円貨社債(2018)	100,000,000	97,528,000	
	小計	銘柄数: 257 組入時価比率: 78.4%	481,126,000,000	529,839,141,520 79.2%	
	合計			529,839,141,520	
地方債証券	日本円	東京都 公募第703回	100,000,000	101,613,000	
		東京都 公募第707回	100,000,000	101,618,000	
		東京都 公募第708回	100,000,000	101,890,000	
		東京都 公募第710回	100,000,000	101,718,000	
		東京都 公募第712回	100,000,000	101,821,000	
		東京都 公募第715回	100,000,000	101,984,000	
		東京都 公募第716回	200,000,000	204,022,000	
		東京都 公募第731回	100,000,000	102,440,000	
		東京都 公募第736回	100,000,000	102,183,000	
		東京都 公募第745回	300,000,000	307,533,000	
		東京都 公募第760回	100,000,000	99,936,000	
		東京都 公募第761回	100,000,000	100,127,000	
		東京都 公募第769回	500,000,000	504,795,000	
		東京都 公募第778回	100,000,000	100,667,000	

東京都	公募（30年）第7回	100,000,000	137,051,000
東京都	公募第10回	200,000,000	271,314,000
東京都	公募第1回	300,000,000	314,454,000
東京都	公募（20年）第3回	200,000,000	217,568,000
東京都	公募第7回	100,000,000	111,409,000
東京都	公募（20年）第13回	100,000,000	115,755,000
東京都	公募（20年）第16回	200,000,000	232,584,000
東京都	公募（20年）第17回	200,000,000	233,956,000
東京都	公募第23回	100,000,000	120,297,000
東京都	公募（20年）第26回	100,000,000	117,788,000
北海道	公募平成24年度第6回	100,000,000	101,897,000
北海道	公募平成24年度第9回	100,000,000	101,905,000
北海道	公募平成25年度第1回	300,000,000	304,920,000
北海道	公募平成26年度第13回	100,000,000	102,015,000
北海道	公募平成27年度第7回	100,000,000	102,472,000
北海道	公募平成28年度第13回	200,000,000	199,930,000
北海道	公募平成29年度第5回	200,000,000	201,214,000
北海道	公募平成29年度第6回	700,000,000	699,601,000
北海道	公募平成29年度第7回	100,000,000	100,840,000
北海道	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,805,000
宮城県	公募第32回2号	100,000,000	100,320,000
神奈川県	公募第184回	100,000,000	101,155,000
神奈川県	公募第188回	200,000,000	203,922,000
神奈川県	公募第196回	100,000,000	101,931,000
神奈川県	公募第200回	100,000,000	102,780,000
神奈川県	公募第205回	100,000,000	102,553,000
神奈川県	公募第206回	100,000,000	102,678,000
神奈川県	公募第210回	200,000,000	204,114,000
神奈川県	公募第231回	200,000,000	202,132,000
神奈川県	公募（30年）第3回	100,000,000	136,402,000
神奈川県	公募第7回	300,000,000	344,544,000
神奈川県	公募（20年）第14回	100,000,000	118,225,000
神奈川県	公募（20年）第17回	200,000,000	238,958,000
神奈川県	公募（20年）第26回	100,000,000	115,930,000
大阪府	公募第356回	100,000,000	101,732,000
大阪府	公募第378回	104,000,000	106,544,880
大阪府	公募第381回	100,000,000	102,551,000
大阪府	公募第382回	100,000,000	102,568,000
大阪府	公募第383回	100,000,000	102,704,000
大阪府	公募第384回	100,000,000	102,662,000
大阪府	公募第387回	300,000,000	306,531,000
大阪府	公募第389回	100,000,000	102,305,000

大阪府	公募第417回	102,000,000	103,245,420
大阪府	公募第423回	100,000,000	100,731,000
大阪府	公募第429回	179,000,000	180,491,070
大阪府	公募第452回	100,000,000	99,150,000
大阪府	公募第5回	100,000,000	119,940,000
大阪府	公募第8回	100,000,000	118,255,000
大阪府	公募(5年)第130回	600,000,000	599,796,000
大阪府	公募(5年)第137回	1,024,000,000	1,023,447,040
大阪府	公募(5年)第141回	230,000,000	229,868,900
京都府	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,934,000
京都府	公募平成24年度第6回	100,000,000	101,961,000
京都府	公募平成26年度第5回	100,000,000	115,692,000
京都府	公募平成26年度第7回	200,000,000	204,882,000
京都府	公募(15年)平成27年度第8回	100,000,000	106,133,000
京都府	公募(20年)平成28年度第5回	100,000,000	99,226,000
京都府	公募平成29年度第4回	100,000,000	100,819,000
兵庫県	公募平成26年度第17回	100,000,000	102,131,000
兵庫県	公募平成29年度第22回	100,000,000	100,769,000
兵庫県	公募(30年)第2回	200,000,000	274,382,000
兵庫県	公募(15年)第1回	300,000,000	329,853,000
兵庫県	公募(15年)第3回	200,000,000	218,172,000
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	308,082,000
兵庫県	公募第2回	100,000,000	116,802,000
兵庫県	公募第9回	100,000,000	120,035,000
兵庫県	公募(20年)第11回	200,000,000	233,862,000
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	117,387,000
兵庫県	公募(20年)第22回	100,000,000	115,015,000
静岡県	公募平成24年度第5回	100,060,000	101,931,122
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	101,934,000
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	104,000,710
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	169,517,700
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	102,451,000
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	204,900,000
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	115,840,828
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	300,618,000
静岡県	公募平成29年度第3回	100,000,000	100,756,000
静岡県	公募(31年)第1回	174,000,000	173,770,320
静岡県	公募(15年)第5回	200,000,000	216,598,000
静岡県	公募(15年)第9回	100,000,000	105,721,000
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	117,179,000
静岡県	公募(20年)第14回	200,000,000	235,482,000

静岡県	公募(20年)第18回	100,000,000	115,931,000
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	116,549,000
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	101,829,000
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	101,941,000
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	117,136,000
愛知県	公募平成24年度第8回	150,000,000	152,892,000
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	437,488,000
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	119,405,000
愛知県	公募(30年)平成25年度第8回	120,000,000	160,128,000
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	129,440,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	114,602,000
愛知県	公募(15年)平成27年度第2回	100,000,000	105,741,000
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	102,378,000
愛知県	公募平成29年度第8回	100,000,000	100,914,000
愛知県	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,552,000
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	102,069,000
広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	205,412,000
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	111,322,162
広島県	公募平成29年度第4回	211,300,000	213,554,571
埼玉県	公募平成24年度第4回	300,000,000	305,583,000
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	102,953,000
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	152,041,880
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	102,539,000
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	102,530,000
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	102,689,000
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	204,816,000
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	408,716,000
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	102,029,000
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	101,107,000
埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	99,969,000
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	201,540,000
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,070,000
埼玉県	公募(15年)第3回	100,000,000	102,145,000
埼玉県	公募(20年)第6回	100,000,000	117,916,000
埼玉県	公募(20年)第16回	100,000,000	112,846,000
埼玉県	公募(20年)第20回	100,000,000	103,872,000
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	101,509,000
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	102,689,000
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	308,256,000
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	100,891,000

福岡県 公募平成23年度第1回	100,000,000	109,436,000
福岡県 公募(15年)令和元年度第1回	100,000,000	99,027,000
福岡県 公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	137,288,000
福岡県 公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	129,722,000
福岡県 公募(30年・定時償還)平成29年度第2回	100,000,000	110,606,000
福岡県 公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	116,635,000
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	116,624,000
千葉県 公募平成24年度第1回	100,000,000	102,072,000
千葉県 公募平成24年度第2回	100,000,000	101,867,000
千葉県 公募平成24年度第7回	100,000,000	101,935,000
千葉県 公募平成24年度第8回	100,000,000	102,279,000
千葉県 公募平成25年度第3回	100,000,000	102,772,000
千葉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	102,952,000
千葉県 公募平成26年度第3回	200,000,000	205,114,000
千葉県 公募平成28年度第4回	200,000,000	200,384,000
千葉県 公募平成29年度第4回	100,000,000	100,552,000
千葉県 公募平成29年度第8回	100,000,000	100,944,000
千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	120,178,000
千葉県 公募(20年)第16回	200,000,000	233,864,000
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	115,071,000
群馬県 公募第8回	100,000,000	101,610,000
群馬県 公募第12回	100,000,000	102,511,000
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	117,120,000
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	191,176,213
大分県 公募平成23年度第1回	902,000,000	915,430,780
共同発行市場地方債 公募第101回	300,000,000	304,146,000
共同発行市場地方債 公募第102回	150,000,000	152,157,000
共同発行市場地方債 公募第103回	100,000,000	101,479,000
共同発行市場地方債 公募第104回	200,000,000	203,220,000
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	203,808,000
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	203,650,000
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	203,800,000
共同発行市場地方債 公募第112回	100,000,000	101,861,000
共同発行市場地方債 公募第113回	800,000,000	814,136,000

共同発行市場地方債 公募第114回	243,700,000	248,442,402
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	101,969,000
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	204,072,000
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	102,279,000
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	204,466,000
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	305,832,000
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	101,670,000
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	407,476,000
共同発行市場地方債 公募第124回	300,000,000	308,757,000
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	102,740,000
共同発行市場地方債 公募第128回	700,000,000	716,331,000
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	102,572,000
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	102,819,000
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	102,548,000
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	205,114,000
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	204,818,000
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	158,730,850
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	551,453,400
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,017,870,000
共同発行市場地方債 公募第156回	200,000,000	200,648,000
共同発行市場地方債 公募第157回	300,000,000	300,447,000
共同発行市場地方債 公募第161回	300,000,000	300,093,000
共同発行市場地方債 公募第172回	600,000,000	606,486,000
共同発行市場地方債 公募第184回	100,000,000	100,532,000
共同発行市場地方債 公募第190回	610,000,000	612,647,400
共同発行市場地方債 公募第191回	100,000,000	100,263,000
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	118,437,000

堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	126,735,000	
島根県 公募平成28年度第3回	100,000,000	99,970,000	
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	100,164,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	204,464,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,306,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	145,169,440	
栃木県 公募平成24年度第1回	100,000,000	102,021,000	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,306,000	
熊本市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,840,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	239,286,520	
新潟市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,991,000	
奈良県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,970,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,546,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	102,451,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,582,000	
大阪市 公募(5年)平成28年度第5回	100,000,000	99,970,000	
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	110,544,000	
大阪市 公募(20年)第1回	300,000,000	350,106,000	
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	119,666,000	
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	118,007,000	
大阪市 公募(20年)第17回	100,000,000	117,917,000	
名古屋市 公募第478回	100,000,000	101,986,000	
名古屋市 公募第481回	100,000,000	101,941,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	307,779,000	
名古屋市 公募第503回	100,000,000	100,983,000	
名古屋市 公募第504回	200,000,000	201,536,000	
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	210,170,000	
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	107,318,000	
京都市 公募平成23年度第4回	100,000,000	101,747,000	
京都市 公募平成29年度第1回	100,000,000	100,985,000	
京都市 公募平成29年度第4回	101,280,000	102,492,321	
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	111,193,000	
京都市 公募(20年)第6回	100,000,000	116,961,000	
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	114,573,000	
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	303,861,000	
神戸市 公募平成28年度第1回	200,000,000	200,418,000	
横浜市 公募公債平成24年度2回	200,000,000	203,978,000	
横浜市 公募公債平成25年度1回	200,000,000	203,988,000	
横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	204,604,000	
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	204,282,000	
横浜市 公募平成28年度第5回	300,000,000	303,501,000	
横浜市 公募平成29年度第3回	100,000,000	101,053,000	



	横浜市 公募(30年)第2回	200,000,000	262,078,000	
	横浜市 公募(20年)第18回	100,000,000	118,779,000	
	横浜市 公募(20年)第26回	100,000,000	118,697,000	
	横浜市 公募(20年)第30回	100,000,000	114,716,000	
	札幌市 公募(15年)平成23年度第9回	100,000,000	109,728,000	
	札幌市 公募(20年)平成24年度第1回	100,000,000	118,222,000	
	札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	119,067,000	
	札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	102,204,000	
	札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	203,918,000	
	川崎市 公募第85回	100,000,000	101,877,000	
	川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	115,855,000	
	川崎市 公募(20年)第19回	100,000,000	114,523,000	
	北九州市 公募(20年)第3回	200,000,000	232,892,000	
	北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	117,761,000	
	福岡市 公募(20年)平成23年度第4回	100,000,000	118,654,000	
	福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	116,106,000	
	福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,388,000	
	福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	163,582,400	
	広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	102,086,000	
	広島市 公募平成27年度第2回	500,000,000	511,855,000	
	広島市 公募(10年)平成30年度第6回	241,000,000	241,759,150	
	千葉市 公募平成24年度第1回	100,000,000	102,072,000	
	三重県 公募平成24年度第1回	140,660,000	143,433,815	
	三重県 公募平成28年度第1回	155,000,000	156,129,950	
	鹿児島県 公募(5年)平成28年度第1回	100,000,000	99,971,000	
	福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	101,340,000	
	福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	200,358,000	
	山梨県 公募平成24年度第1回	200,000,000	203,952,000	
	岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	170,597,445	
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	100,000,000	117,759,000	
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	300,000,000	357,408,000	
	福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	117,031,000	
	福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	105,267,000	
小計	銘柄数：273 組入時価比率：7.1%	45,662,820,000	48,011,483,689 7.2%	
合計			48,011,483,689	

特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	100,000,000	101,369,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	153,881,080	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	196,420,580	
		新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000	117,934,830	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	108,054,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	200,218,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	106,981,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	305,619,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	108,284,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	303,087,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回	100,000,000	100,692,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	104,040,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000	162,125,940	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第38回	1,500,000,000	1,500,495,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	302,865,000	
		道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	312,270,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第4回	100,000,000	133,724,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第8回	200,000,000	228,184,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第17回	100,000,000	114,535,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回	300,000,000	349,491,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第33回	200,000,000	320,424,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第39回	200,000,000	237,652,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回	100,000,000	120,201,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第80回	100,000,000	101,788,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第84回	400,000,000	407,660,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	203,540,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第89回	100,000,000	117,585,000			

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第100回	200,000,000	204,152,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第102回	100,000,000	101,925,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第103回	350,000,000	412,499,500
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回	100,000,000	119,963,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第107回	100,000,000	102,923,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第116回	400,000,000	409,788,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第122回	100,000,000	102,729,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第123回	100,000,000	102,675,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第130回	200,000,000	204,488,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第134回	200,000,000	204,230,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第136回	200,000,000	204,962,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第145回	300,000,000	366,645,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第149回	100,000,000	124,190,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第157回	100,000,000	107,138,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第164回	100,000,000	111,784,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第173回	100,000,000	98,925,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第188回	100,000,000	103,575,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	238,490,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	200,000,000	239,010,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	200,000,000	241,316,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	200,000,000	240,192,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	236,844,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	132,883,000
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回	840,000,000	852,381,600
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	140,000,000	142,342,200
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	100,000,000	101,673,000
	140,000,000	142,443,000

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第163回	1,000,000,000	1,019,160,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	100,000,000	128,936,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	100,000,000	101,925,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	100,000,000	117,457,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	222,170,340	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	100,000,000	116,616,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	300,000,000	393,201,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	200,000,000	204,046,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	200,000,000	204,046,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	200,000,000	203,998,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	900,000,000	921,114,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	100,000,000	118,974,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	196,000,000	199,259,480	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	400,000,000	407,644,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回	1,000,000,000	1,028,460,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	272,000,000	279,754,720	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	300,000,000	307,827,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	137,000,000	140,564,740	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	145,000,000	148,765,650	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回	100,000,000	116,713,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	100,000,000	128,042,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回	100,000,000	116,670,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	100,000,000	102,757,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	100,000,000	128,181,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	190,000,000	194,725,300	
	630,000,000	645,800,400	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第229回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	100,000,000	102,254,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第239回	500,000,000	562,410,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第261回	401,000,000	409,437,040	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回	151,000,000	151,134,390	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第297回	100,000,000	100,397,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第306回	403,000,000	406,224,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第315回	100,000,000	100,753,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第321回	600,000,000	605,724,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第324回	100,000,000	100,478,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第335回	100,000,000	108,659,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第339回	500,000,000	506,460,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第342回	131,000,000	132,192,100	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第351回	100,000,000	100,856,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第354回	200,000,000	201,482,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第357回	100,000,000	101,407,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回	130,000,000	137,137,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	400,000,000	533,808,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回	100,000,000	135,435,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	135,571,000	
地方公営企業等金融機構債券(20年) 第1回	100,000,000	116,706,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	118,899,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	113,045,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	361,131,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	104,866,000	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第10回	300,000,000	348,801,000	
	300,000,000	304,119,000	

地方公共団体金融機構債券 第27回			
地方公共団体金融機構債券 第28回	500,000,000	507,490,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	106,298,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	104,898,000	
地方公共団体金融機構債券 F122回	100,000,000	109,353,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第37回	604,000,000	615,759,880	
地方公共団体金融機構債券 第37回	400,000,000	407,400,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回	194,000,000	197,670,480	
地方公共団体金融機構債券 F132回	500,000,000	527,460,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	101,877,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	103,010,910	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	104,034,900	
地方公共団体金融機構債券 第41回	600,000,000	612,024,000	
地方公共団体金融機構債券 F142回	100,000,000	104,580,000	
地方公共団体金融機構債券 F145回	200,000,000	210,182,000	
地方公共団体金融機構債券 F147回	100,000,000	108,165,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第42回	108,000,000	110,257,200	
地方公共団体金融機構債券 第42回	100,000,000	102,073,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第43回	202,000,000	205,987,480	
政保 地方公共団体金融機構債券 第44回	145,000,000	148,364,000	
地方公共団体金融機構債券 第44回	100,000,000	102,177,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第45回	223,000,000	228,200,360	
地方公共団体金融機構債券 F160回	100,000,000	107,551,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第48回	500,000,000	509,430,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第49回	13,000,000	13,365,300	
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回	100,000,000	102,976,000	
	600,000,000	616,776,000	

地方公共団体金融機構債券 第51回			
地方公共団体金融機構債券 第52回	300,000,000	308,319,000	
地方公共団体金融機構債券（15年）第2回	200,000,000	217,882,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第56回	591,000,000	607,867,140	
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回	116,000,000	119,151,720	
地方公共団体金融機構債券（20年）第38回	100,000,000	116,093,000	
地方公共団体金融機構債券 F240回	300,000,000	326,883,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	102,457,000	
地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	102,453,000	
地方公共団体金融機構債券（20年）第39回	100,000,000	115,333,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回	400,000,000	409,940,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	320,000,000	326,627,200	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	193,823,280	
地方公共団体金融機構債券 第74回	300,000,000	307,464,000	
地方公共団体金融機構債券 第77回	100,000,000	102,397,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	519,663,550	
地方公共団体金融機構債券 第79回	400,000,000	409,708,000	
政保 地方公共団体金融機構債券（8年）第5回	500,000,000	503,545,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	116,000,000	116,103,240	
地方公共団体金融機構債券 第95回	200,000,000	201,422,000	
地方公共団体金融機構債券 第101回	400,000,000	404,116,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第108回	157,000,000	158,325,080	
政保 地方公共団体金融機構債券 第110回	100,000,000	100,738,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第113回	110,000,000	111,663,200	
公営企業債券（20年）第2回財投機関債	100,000,000	103,848,000	
公営企業債券（20年）第5回財投機関債	200,000,000	214,368,000	
	100,000,000	115,153,000	

公営企業債券(20年) 第19回 財投機関債			
公営企業債券(20年) 第20回 財投機関債	100,000,000	114,809,000	
公営企業債券(20年) 第24回 財投機関債	100,000,000	117,293,000	
公営企業債券(20年) 第25回 財投機関債	100,000,000	119,319,000	
首都高速道路 第17回	200,000,000	200,056,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	101,473,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	205,104,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	108,191,000	
都市再生債券 財投機関債第101回	100,000,000	107,458,000	
都市再生債券 財投機関債第109回	100,000,000	107,749,000	
都市再生債券 財投機関債第113回	300,000,000	321,084,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	111,400,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	360,000,000	368,985,600	
東京交通債券 第342回	200,000,000	209,684,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	168,266,320	
関西国際空港社債 財投機関債第32回	100,000,000	101,621,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	100,000,000	102,000,000	
中部国際空港債券 政府保証第18回	368,000,000	375,282,720	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	200,000,000	229,694,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	100,000,000	107,320,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	100,000,000	109,408,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回	100,000,000	119,725,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	118,567,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回	100,000,000	101,448,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	120,536,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	300,000,000	330,903,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	100,000,000	120,499,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回	100,000,000	101,481,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	202,910,000	



住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	219,978,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第120回	100,000,000	119,384,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第123回	100,000,000	118,876,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	137,555,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第132回	200,000,000	215,374,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第137回	100,000,000	109,700,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第143回	100,000,000	109,009,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	250,000,000	256,047,500
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	300,000,000	301,389,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	101,708,000
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	131,757,600
成田国際空港 第10回	100,000,000	101,516,000
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	204,408,000
成田国際空港 第17回	200,000,000	204,528,000
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第17回	100,000,000	101,379,000
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	300,033,000
商工債券 利付第811回い号	300,000,000	300,606,000
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	100,136,000
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,152,000
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	300,585,000
しんきん中金債券 利付第327回	200,000,000	199,908,000
しんきん中金債券 利付第335回	200,000,000	200,050,000
商工債券 利付(3年)第223回	500,000,000	500,130,000
商工債券 利付(3年)第231回	200,000,000	199,928,000
商工債券 利付(3年)第236回	500,000,000	499,090,000
商工債券 利付(10年)第15回	200,000,000	202,726,000
国際協力機構債券 第6回財投機関 債	200,000,000	240,554,000
東日本高速道路 第36回	200,000,000	200,092,000
東日本高速道路 第61回	200,000,000	198,952,000
中日本高速道路 第63回	100,000,000	102,659,000
中日本高速道路 第66回	1,200,000,000	1,200,420,000
西日本高速道路 第20回	200,000,000	205,040,000
西日本高速道路 第22回	400,000,000	411,300,000
西日本高速道路 第23回	100,000,000	102,376,000
西日本高速道路 第30回	300,000,000	301,179,000

鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第6 2回	100,000,000	102,596,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第6 8回	200,000,000	204,848,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第6 9回	100,000,000	115,406,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第7 1回	500,000,000	511,605,000	
貸付債権担保第1 2回住宅金融公庫債券	31,530,000	31,788,546	
貸付債権担保第1 9回住宅金融公庫債券	58,300,000	59,478,826	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	35,865,000	36,551,456	
貸付債権担保第4 2回住宅金融公庫債券	39,546,000	41,359,975	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	12,441,000	12,831,274	
貸付債権担保第3 9回住宅金融公庫債券	26,864,000	27,811,493	
貸付債権担保第4 0回住宅金融公庫債券	30,710,000	32,180,701	
貸付債権担保第1 5回住宅金融公庫債券	34,701,000	35,399,184	
貸付債権担保第3 2回住宅金融公庫債券	56,564,000	58,354,250	
貸付債権担保第2 0回住宅金融公庫債券	59,245,000	60,683,468	
貸付債権担保第4 4回住宅金融公庫債券	52,940,000	55,174,068	
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	88,836,000	92,491,601	
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	14,799,000	15,471,170	
貸付債権担保第2 5回住宅金融支援機構債券	23,276,000	25,196,968	
貸付債権担保第2 8回住宅金融支援機構債券	75,276,000	80,694,366	
貸付債権担保S種第1 6回住宅金融支援機構債券	14,923,000	15,219,669	
貸付債権担保第4 2回住宅金融支援機構債券	80,126,000	84,634,690	
貸付債権担保S種第1 7回住宅金融支援機構債券	30,020,000	30,630,907	
貸付債権担保第4 5回住宅金融支援機構債券	95,751,000	101,986,305	
貸付債権担保第5 2回住宅金融支援機構債券	71,814,000	75,944,741	
貸付債権担保第2 4回住宅金融支援機構債券	41,342,000	44,413,710	
貸付債権担保第4 8回住宅金融支援機構債券	90,474,000	96,340,334	
	100,467,000	105,314,532	

貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	137,070,000	143,970,103	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	133,104,000	140,489,940	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	85,718,000	90,151,334	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	33,271,000	35,267,592	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	77,882,000	82,763,643	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	44,399,000	46,336,572	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	95,612,000	99,896,373	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	43,261,000	45,157,994	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	24,732,000	25,445,023	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	130,086,000	136,764,615	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	28,215,000	30,252,405	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	30,261,000	32,496,077	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	29,419,000	31,351,239	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	32,082,000	34,203,903	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	87,166,000	92,243,419	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	123,987,000	131,167,087	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	41,540,000	43,990,444	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	83,994,000	88,099,626	
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	11,463,000	11,678,848	
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	61,950,000	62,725,614	
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	25,454,000	25,768,611	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	80,472,000	86,228,162	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	81,105,000	86,621,762	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	161,655,000	170,251,812	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	88,216,000	93,366,932	
	144,120,000	151,155,938	

貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	126,312,000	131,748,468	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	97,776,000	103,279,811	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	83,574,000	87,878,061	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	203,108,000	212,010,223	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	349,755,000	364,570,621	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	52,925,000	54,974,256	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	55,397,000	57,611,772	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	56,786,000	58,822,345	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	117,734,000	121,174,187	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	124,042,000	126,723,788	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	66,494,000	68,665,694	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	70,328,000	72,410,412	
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	209,040,000	216,287,416	
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	215,274,000	223,635,242	
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	143,706,000	149,138,086	
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	70,658,000	73,203,807	
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	70,748,000	73,499,389	
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	255,783,000	258,553,129	
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	171,762,000	174,458,663	
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	172,538,000	174,991,490	
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	86,521,000	87,813,623	
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	173,100,000	175,570,137	
貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券	87,524,000	88,437,750	
貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券	87,773,000	88,859,629	
貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	89,087,000	90,363,616	
	357,268,000	361,383,727	

		貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	269,475,000	272,757,205	
		貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	180,182,000	182,245,083	
		貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券	181,956,000	184,527,038	
		貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券	185,982,000	187,627,940	
		貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	93,131,000	93,949,621	
		貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	93,625,000	94,786,886	
		貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	94,603,000	95,345,633	
		貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	287,511,000	288,439,660	
		貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	288,891,000	289,988,785	
		貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	491,405,000	488,255,093	
		貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	198,366,000	198,986,885	
		貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	199,836,000	199,915,934	
	小計	銘柄数：312 組入時価比率：9.1%	58,801,020,000	61,794,118,957 9.2%	
	合計			61,794,118,957	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行(BFCM)第14回円貨社債	200,000,000	199,782,000	
		フランス相互信用連合銀行(BFCM)第29回円貨社債	200,000,000	196,348,000	
		フランス相互信用連合銀行(BFCM)第31回円貨社債	100,000,000	95,719,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第14回円貨社債	100,000,000	99,303,000	
		ピー・ピー・シー・イー・エス・エー第1回非上位円貨社債	200,000,000	199,852,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第6回円貨社債(2014)	100,000,000	101,889,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第15回円貨社債(2018)	100,000,000	99,674,000	
		クレディ・アグリコル・エス・エー第16回円貨社債(2018)	100,000,000	99,567,000	
		スタンダード・チャータード第3回円貨社債(2015)	100,000,000	100,931,000	
		エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー第2回円	100,000,000	99,398,000	
		エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー第3回円	100,000,000	98,577,000	

ロイズ・バンキング・グループ・ ピーエルシー 第1回円貨社債	100,000,000	99,386,000	
ロイズ・バンキング・グループ・ ピーエルシー 第6回円貨社債	100,000,000	98,071,000	
ロイズ・バンキング・グループ・ ピーエルシー 第7回円貨社債	100,000,000	93,987,000	
サンタンデール銀行 第1回円貨社 債	100,000,000	97,934,000	
フランス電力 第4回円貨社債(2 017)	100,000,000	102,834,000	
現代キャピタル・サービス・イン ク 第15回円貨社債	200,000,000	196,264,000	
ピー・エヌ・ピー・パリバ 第1回 円貨社債(2017)	100,000,000	100,320,000	
ウエストバック・バンキング・コー ポレーション 第12回円貨社	200,000,000	199,106,000	
オーストラリア・ニュージーランド 銀行 第10回円貨社債	200,000,000	200,292,000	
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上 位円貨社債(2017)	100,000,000	99,522,000	
大和ハウス工業 第5回特定社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,286,000	
大和ハウス工業 第9回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	98,678,000	
森永乳業 第13回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,313,000	
明治ホールディングス 第8回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	99,658,000	
アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,263,000	
麒麟ホールディングス 第10回 社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,624,000	
味の素 第24回特定社債間限定同 順位特約付	200,000,000	199,386,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	99,637,000	
三越伊勢丹ホールディングス 第6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,406,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,684,000	
野村不動産ホールディングス 第5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,683,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回 特定投資法人債間限定同順位特	200,000,000	197,128,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,358,000	
東急不動産ホールディングス 第2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,894,000	
東レ 第30回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,651,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	99,328,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	201,768,000	

王子ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,254,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,357,000	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,771,000	
三井化学 第47回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,531,000	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,604,000	
三菱ケミカルホールディングス 第14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,684,000	
三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,182,000	
電通 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,507,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,118,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,636,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,985,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,548,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,844,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,194,000	
JXホールディングス 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,012,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,221,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,571,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,793,000	
日本特殊陶業 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,586,000	
新日鐵住金 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,397,000	
新日鐵住金 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,104,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	300,000,000	296,592,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,769,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回(JFEス保証)	100,000,000	101,207,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位	100,000,000	98,464,000	
DOWAホールディングス 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,539,000	
	200,000,000	199,154,000	

住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付			
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	216,038,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,271,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,790,000	
日本電産 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,206,000	
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,893,000	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,011,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,382,000	
ソニー 第32回	200,000,000	200,034,000	
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,671,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,955,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,149,000	
J A 三井リース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,594,000	
J A 三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,059,000	
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第2回社債間限定	100,000,000	99,862,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	102,224,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,309,000	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,430,000	
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,037,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,714,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,458,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,182,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,971,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	205,598,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,928,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,615,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,341,000	



住友商事 第53回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,794,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,358,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,760,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,706,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,647,000	
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,935,000	
イオン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,858,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	100,000,000	100,486,000	
りそなホールディングス 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,830,000	
りそなホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,755,000	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	200,000,000	200,368,000	
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,240,000	
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,278,000	
三菱東京UFJ銀行 第159回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,676,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	300,000,000	299,490,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	99,983,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	100,000,000	103,235,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	300,000,000	307,272,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,999,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,511,000	
みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	200,000,000	200,494,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	101,426,000	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	100,000,000	113,047,000	
NTTファイナンス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,585,000	
トヨタファイナンス 第77回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,432,000	
トヨタファイナンス 第81回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,296,000	
リコーリース 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,248,000	
	100,000,000	99,623,000	

アコム 第76回特定社債間限定同順位特約付			
アコム 第77回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,035,000	
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,356,000	
ジャックス 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,525,000	
日立キャピタル 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,338,000	
日立キャピタル 第57回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,764,000	
日立キャピタル 第61回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,689,000	
日立キャピタル 第80回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,195,000	
三井住友ファイナンス&リース 第27回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,650,000	
三菱UFJリース 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,321,000	
三菱UFJリース 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,098,000	
三菱UFJリース 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,224,000	
大和証券グループ本社 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,446,000	
三井不動産 第71回社債間限定同順位特約付	200,000,000	196,924,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	104,673,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,641,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	98,665,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,180,000	
ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,956,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,535,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,462,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,962,000	
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	102,724,000	
野村不動産オフィスファンド投資法人 第7回特定投資法人債間限	100,000,000	116,892,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	101,910,000	
東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	210,262,000	
	200,000,000	201,652,000	

相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付			
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,576,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,023,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	212,940,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,403,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	208,140,000	
東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,335,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	234,750,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,598,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,015,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	116,988,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,259,000	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,924,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	344,793,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	235,914,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,723,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	122,715,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	99,685,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	101,678,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	108,795,000	
西武ホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,752,000	
西日本鉄道 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,232,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,960,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,846,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,767,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,914,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,078,000	
九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,667,000	

A N Aホールディングス 第32回 社債間限定同順位特約付	100,000,000	91,327,000	
澁澤倉庫 第8回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	99,371,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	101,763,000	
K D D I 第25回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	99,509,000	
東京電力 第548回	100,000,000	109,459,000	
東京電力 第560回	100,000,000	107,804,000	
中部電力 第500回	200,000,000	205,138,000	
中部電力 第524回	100,000,000	100,303,000	
中部電力 第530回	200,000,000	197,782,000	
関西電力 第496回	100,000,000	102,561,000	
関西電力 第497回	200,000,000	206,192,000	
関西電力 第509回	100,000,000	99,890,000	
関西電力 第511回	100,000,000	99,290,000	
関西電力 第514回	200,000,000	199,838,000	
関西電力 第527回	200,000,000	199,722,000	
中国電力 第377回	400,000,000	412,140,000	
中国電力 第378回	100,000,000	102,640,000	
中国電力 第400回	100,000,000	99,748,000	
中国電力 第402回	300,000,000	299,601,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	102,754,000	
北陸電力 第304回	100,000,000	102,606,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	104,291,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	102,115,000	
北陸電力 第326回	100,000,000	100,727,000	
東北電力 第475回	100,000,000	102,246,000	
東北電力 第481回	200,000,000	204,834,000	
東北電力 第484回	100,000,000	101,583,000	
東北電力 第491回	100,000,000	100,276,000	
四国電力 第281回	200,000,000	205,990,000	
九州電力 第424回	300,000,000	310,329,000	
九州電力 第428回	105,000,000	107,828,700	
九州電力 第449回	200,000,000	200,300,000	
九州電力 第451回	100,000,000	100,302,000	
九州電力 第476回	100,000,000	99,568,000	
北海道電力 第321回	100,000,000	102,397,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	107,644,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	101,500,000	
電源開発 第37回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	101,061,000	
電源開発 第39回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	102,303,000	

	電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,338,000	
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,953,000	
	電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,739,000	
	電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,428,000	
	東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	100,434,000	
	東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	99,335,000	
	東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	295,872,000	
	東京電力パワーグリッド 第14回	100,000,000	99,736,000	
	東京電力パワーグリッド 第28回	100,000,000	99,726,000	
	東京瓦斯 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,308,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	128,703,000	
	東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	94,957,000	
	大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,610,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,568,000	
	北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,864,000	
	北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	97,688,000	
	広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,839,000	
	東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,548,000	
	ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,623,000	
	ファーストリテイリング 第4回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,120,000	
	ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,605,000	
	ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付	100,000,000	89,807,000	
小計	銘柄数：233 組入時価比率：4.3%	28,905,000,000	29,398,261,700	4.4%
合計			29,398,261,700	
合計			669,043,005,866	

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

## 外国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,058,458,065
コール・ローン	958,309,027
国債証券	565,348,088,403
未収利息	5,535,545,997
前払費用	237,329,273
その他未収収益	7,296,339
流動資産合計	573,145,027,104
資産合計	573,145,027,104
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,314,278
未払金	876,525,826
未払解約金	417,640,972
未払利息	1,130
その他未払費用	5,573,174
流動負債合計	1,301,055,380
負債合計	1,301,055,380
純資産の部	
元本等	
元本	240,634,818,748
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	331,209,152,976
元本等合計	571,843,971,724
純資産合計	571,843,971,724
負債純資産合計	573,145,027,104

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>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。</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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
-----------------------	---

## (貸借対照表に関する注記)

2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.3764円
(10,000口当たり純資産額)	(23,764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	
	162,121,580,686円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	
3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価	
貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。	
有価証券	170,764,088,825円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日	
1.金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	
当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。	
当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。	
これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	
当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。	
3.金融商品に係るリスク管理体制	
委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。	
市場リスクの管理	
市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。	
信用リスクの管理	
信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。	
流動性リスクの管理	
流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

## 国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## （その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4月22日現在

	2019年 4月23日
期首	
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	268,533,625,797円
同期中における追加設定元本額	32,274,454,461円
同期中における一部解約元本額	60,173,261,510円
期末元本額	240,634,818,748円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	83,668,529円
バランスセレクト50	84,805,100円
バランスセレクト70	66,572,285円
野村外国債券インデックスファンド	304,241,811円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,438,577,764円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	22,722,903,572円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,339,513,490円
野村資産設計ファンド2015	25,377,639円
野村資産設計ファンド2020	28,513,552円
野村資産設計ファンド2025	43,375,982円
野村資産設計ファンド2030	41,363,044円
野村資産設計ファンド2035	28,288,988円
野村資産設計ファンド2040	52,061,407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）	106,014,098,993円
のむラップ・ファンド（保守型）	5,541,258,343円
のむラップ・ファンド（普通型）	11,004,213,105円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,206,127,584円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	754,071,768円
野村資産設計ファンド2045	6,362,907円
野村インデックスファンド・外国債券	817,941,356円
マイ・ロード	8,585,753,734円
ネクストコア	199,230,377円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	130,783,769円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	6,200,363,500円



野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,189,269,436円
野村資産設計ファンド2050	8,040,315円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	5,411,535円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,941,148円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,391,471円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	976,000円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	462,464,896円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	316,671,672円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,977,525円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,253,357円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,789,805円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,287,499円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,071,055円
野村6資産均等バランス	708,973,350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)	7,561,539,567円
世界6資産分散ファンド	72,619,505円
野村資産設計ファンド2060	2,162,942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	2,419,486,947円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	1,602,137,819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)	9,139,734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)	1,343,205,984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)	316,172,825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)	1,467,543,949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)	1,156,645,374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)	2,931,353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)	7,855,096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)	138,024円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,189,951,642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)	16,570,875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)	78,624,869円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	15,533,574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)	162,863,510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)	168,776,654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)	1,579,660,584円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	100,626,201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)	696,044,146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)	1,990,193,633円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	514,081円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,547,242円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	5,768,496円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	5,054,539円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	573,247,168円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,967,147,782円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,541,836,559円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	3,871,221,089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)	16,044,413,752円

マイバランスDC30	1,719,492,101円
マイバランスDC50	1,104,260,061円
マイバランスDC70	667,440,808円
野村DC外国債券インデックスファンド	5,957,330,892円
野村DC運用戦略ファンド	2,944,954,434円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	301,710,390円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	125,704,816円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	182,408,857円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	85,088,954円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	8,336,492円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	21,854,137円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	7,212,488円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	3,217,820円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	1,954,787円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,194,614円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	46,882,115円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	29,435,380円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	11,900,768円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	13,883,036円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	392,620円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	30,700,000.00	34,449,955.88	
		US TREASURY BOND	38,800,000.00	46,532,715.84	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	49,092,053.56	
		US TREASURY BOND	72,200,000.00	95,518,340.14	
		US TREASURY BOND	19,000,000.00	26,487,187.50	
		US TREASURY BOND	10,800,000.00	15,352,875.00	
		US TREASURY BOND	46,200,000.00	65,012,062.50	
		US TREASURY BOND	49,300,000.00	68,908,300.99	

US TREASURY BOND	27,500,000.00	38,701,951.75	
US TREASURY BOND	100,000.00	158,398.43	
US TREASURY BOND	24,500,000.00	33,253,007.20	
US TREASURY BOND	7,000,000.00	10,827,577.60	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,723,625.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	816,562.48	
US TREASURY N/B	400,000.00	404,312.48	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,916,354.62	
US TREASURY N/B	800,000.00	817,468.72	
US TREASURY N/B	4,600,000.00	4,659,296.76	
US TREASURY N/B	45,400,000.00	46,848,895.60	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,026,562.50	
US TREASURY N/B	6,300,000.00	6,430,183.20	
US TREASURY N/B	15,900,000.00	16,116,139.83	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,286,405.60	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,210,393.85	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,799,530.40	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,618,437.44	
US TREASURY N/B	40,300,000.00	41,008,397.43	
US TREASURY N/B	23,500,000.00	24,214,179.10	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,701,921.02	
US TREASURY N/B	24,300,000.00	24,596,156.25	
US TREASURY N/B	26,100,000.00	26,769,830.40	
US TREASURY N/B	12,200,000.00	12,500,710.48	
US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,409,031.25	
US TREASURY N/B	9,650,000.00	9,783,441.16	
US TREASURY N/B	30,400,000.00	31,226,500.00	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,930,429.64	
US TREASURY N/B	7,500,000.00	7,714,746.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,026,718.70	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,792,210.66	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,803,968.44	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,902,569.81	
US TREASURY N/B	80,000,000.00	83,159,368.00	
US TREASURY N/B	6,400,000.00	6,544,000.00	

US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,413,436.80	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,347,706.83	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,857,029.20	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,993,375.00	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,607,734.20	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	4,016,085.84	
US TREASURY N/B	500,000.00	516,054.65	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,352,050.70	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,819,873.36	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	26,147,944.68	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	9,078,780.48	
US TREASURY N/B	200,000.00	206,968.74	
US TREASURY N/B	900,000.00	928,898.37	
US TREASURY N/B	17,600,000.00	18,343,874.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	103,390.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	104,070.31	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,037,812.50	
US TREASURY N/B	900,000.00	929,917.89	
US TREASURY N/B	19,100,000.00	19,846,093.75	
US TREASURY N/B	900,000.00	933,820.29	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,566,445.20	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	7,872,234.28	
US TREASURY N/B	10,200,000.00	10,715,577.36	
US TREASURY N/B	47,900,000.00	49,917,035.47	
US TREASURY N/B	400,000.00	419,718.72	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,714,062.00	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	15,267,483.66	
US TREASURY N/B	400,000.00	414,781.24	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	15,629,296.50	
US TREASURY N/B	34,800,000.00	36,382,310.76	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,591,000.00	
US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,954,500.00	
US TREASURY N/B	41,100,000.00	44,423,317.23	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,979,882.65	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,304,491.37	

US TREASURY N/B	35,200,000.00	36,525,498.24	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	12,358,655.66	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	46,330,827.06	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,806,625.00	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,789,061.00	
US TREASURY N/B	43,000,000.00	46,090,625.00	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,407,453.06	
US TREASURY N/B	800,000.00	874,374.96	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,821,390.54	
US TREASURY N/B	20,100,000.00	21,877,593.75	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	18,941,764.74	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,094,202.84	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	46,095,982.24	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,911,906.16	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	37,176,467.04	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,489,390.51	
US TREASURY N/B	16,900,000.00	18,236,156.25	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,794,187.50	
US TREASURY N/B	32,700,000.00	36,345,536.61	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	33,757,029.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	7,073,827.80	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,603,210.63	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	29,295,000.00	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	21,901,499.52	
US TREASURY N/B	70,300,000.00	77,445,334.18	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,140,000.00	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	9,603,109.16	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,929,375.00	
US TREASURY N/B	21,100,000.00	22,499,522.91	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	12,701,250.00	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	6,020,874.72	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	14,301,015.30	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,285,154.00	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,656,000.00	
US TREASURY N/B	38,000,000.00	43,073,592.80	

US TREASURY N/B	8,400,000.00	9,471,000.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	586,171.85	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,137,218.66	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,460,718.72	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,177,187.40	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	6,077,296.68	
US TREASURY N/B	41,700,000.00	62,725,919.79	
US TREASURY N/B	7,200,000.00	11,217,936.96	
US TREASURY N/B	200,000.00	333,656.24	
US TREASURY N/B	100,000.00	160,882.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	145,070.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	158,117.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	163,023.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	161,007.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	165,898.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	161,671.87	
US TREASURY N/B	200,000.00	305,671.86	
US TREASURY N/B	100,000.00	160,164.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	170,187.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	163,648.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	151,812.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	419,414.04	
US TREASURY N/B	100,000.00	140,132.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	137,640.62	
US TREASURY N/B	200,000.00	265,218.74	
US TREASURY N/B	8,800,000.00	11,679,937.28	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	3,657,265.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	151,718.75	
US TREASURY N/B	7,400,000.00	11,285,000.00	
US TREASURY N/B	15,200,000.00	22,410,500.00	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	32,749,842.60	
US TREASURY N/B	36,900,000.00	51,622,520.67	
US TREASURY N/B	49,400,000.00	63,857,216.28	
US TREASURY N/B	21,900,000.00	30,787,464.57	
US TREASURY N/B	17,500,000.00	24,259,375.00	

	US TREASURY N/B	5,200,000.00	7,343,375.00	
	US TREASURY N/B	51,500,000.00	67,014,375.00	
	US TREASURY N/B	28,200,000.00	36,756,937.50	
	US TREASURY N/B	28,500,000.00	35,551,521.30	
	US TREASURY N/B	14,200,000.00	19,832,296.52	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,431,929.56	
	US TREASURY N/B	11,400,000.00	15,639,375.00	
	US TREASURY N/B	9,300,000.00	12,780,233.91	
	US TREASURY N/B	9,500,000.00	13,654,023.20	
	US TREASURY N/B	6,100,000.00	8,973,195.16	
	US TREASURY N/B	10,500,000.00	15,162,656.25	
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	4,935,578.04	
	US TREASURY N/B	100,000.00	142,359.37	
	US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,537,968.60	
	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,302,812.50	
小計	銘柄数：163	2,318,850,000.00	2,681,779,467.92 (289,256,733,409)	
	組入時価比率：50.6%		51.1%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,783,855.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	12,400,000.00	12,450,220.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	13,050,000.00	13,481,433.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	12,200,000.00	12,388,124.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,006,160.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	301,137.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,808,473.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	312,273.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,621,184.40	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,160,335.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	536,005.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	7,389,696.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,700,000.00	4,047,171.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	319,629.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,250,000.00	11,083,510.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	207,650.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	112,086.00	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	14,789,376.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	6,798,876.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	6,157,444.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,100,000.00	10,872,585.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,950,000.00	14,948,979.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,776,996.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	724,314.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	152,745.00	
	銘柄数：25	112,990,000.00	138,230,256.90	(10,498,588,011)
組入時価比率：1.8%			1.9%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	95,300,000.00	96,469,092.75	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	58,700,000.00	60,412,713.38	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	44,400,000.00	45,446,601.24	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	300,000.00	310,670.46	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	57,658,037.19	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	46,432,596.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	51,300,000.00	49,891,060.89	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	112,300,000.00	117,471,145.48	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	45,300,000.00	49,806,403.23	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,500,000.00	71,270,770.20	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,248,300.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	68,746,584.43	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	11,800,000.00	12,451,950.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	66,500,000.00	64,959,527.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	33,000,000.00	32,809,098.30	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	87,100,000.00	94,183,555.57	
	銘柄数：16	834,100,000.00	878,568,106.62	(3,883,271,031)
組入時価比率：0.7%			0.7%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	746,956.00	
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	869,248.80	
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	668,220.00	
	BELGIUM KINGDOM	9,700,000.00	10,509,668.70	
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,954,230.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,480,000.00	



BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,033,263.30	
BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,153,447.90	
BELGIUM KINGDOM	6,000,000.00	7,654,060.80	
BELGIUM KINGDOM	3,300,000.00	3,522,612.72	
BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,119,030.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,063,117.20	
BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,234,792.00	
BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,629,708.00	
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,047,000.00	
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	112,240.00	
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	577,150.50	
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	123,408.84	
BELGIUM KINGDOM	3,400,000.00	5,806,384.00	
BELGIUM KINGDOM	4,400,000.00	7,512,076.00	
BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,304,984.40	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,242,138.00	
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,729,856.40	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,464,362.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,526,167.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	18,336,615.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,400,000.00	20,484,906.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,100,000.00	5,147,562.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,700,000.00	10,702,782.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,550,000.00	16,034,347.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,350,000.00	4,377,753.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,018,600.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	17,234,083.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,202,651.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,049,350.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	17,001,174.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	7,840,125.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	495,585.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	944,280.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	18,299,961.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,420,675.50	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	4,304,764.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	29,534,769.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,261,355.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,086,916.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,241,500.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	12,612,660.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,181,880.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,400,000.00	7,296,640.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	2,394,331.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,700,000.00	13,712,087.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,100,000.00	15,563,908.36	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,200,000.00	4,026,466.24	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,800,000.00	7,097,799.30	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,700,000.00	2,492,560.40	
BUNDES Obligation	700,000.00	703,885.00	
BUNDES Obligation	100,000.00	100,972.00	
BUNDES Obligation	700,000.00	709,156.00	
BUNDES Obligation	750,000.00	762,892.50	
BUNDES Obligation	1,000,000.00	1,020,720.00	
BUNDES Obligation	2,000,000.00	2,061,380.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	350,000.00	366,380.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	415,956.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000.00	4,216,680.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	736,876.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	390,000.00	414,371.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,200,000.00	9,826,520.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,580,000.00	2,813,567.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,900,000.00	17,498,432.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,861,177.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	872,088.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000.00	8,695,593.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,855,331.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,921,457.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	6,195,734.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,041,040.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	742,588.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	21,500,000.00	32,700,425.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,082,410.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	12,192,252.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,521,128.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,529,885.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,500,000.00	15,861,960.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	10,250,150.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,600,000.00	13,270,341.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	5,897,432.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,500,000.00	8,481,730.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,400,000.00	10,978,518.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,900,000.00	3,389,945.99	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	12,123,511.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	8,811,036.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,400,000.00	14,407,952.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	153,981.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	99,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,200,000.00	12,570,148.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	5,079,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,280,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,500,000.00	17,330,775.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,900,000.00	6,007,439.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,050,000.00	1,038,607.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,600,000.00	2,641,054.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,900,000.00	20,237,931.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,200,000.00	6,198,636.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	400,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	396,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,200,000.00	9,014,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,111,627.17	
BUONI POLIENNALI DEL TES	31,100,000.00	34,287,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,900,000.00	1,836,065.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	98,970.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,201,744.50	

BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	553,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	23,545,170.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,700,000.00	16,366,980.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	303,510.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,331,860.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,657,230.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,034,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	19,340,062.56	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	795,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,959,863.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	7,253,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,033,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	13,197,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,031,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	24,009,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,500,000.00	22,960,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,988,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,200,000.00	24,232,320.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,000,000.00	21,712,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	470,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	14,877,410.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,412,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,400,000.00	20,029,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,122,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	836,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	536,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	6,755,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	213,820.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	15,707,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,800,000.00	19,543,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000.00	3,743,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,209,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	8,468,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	904,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,610,733.00	

FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	623,577.00	
FINNISH GOVERNMENT	500,000.00	505,092.50	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,080.80	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,817.80	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	405,934.80	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	767,060.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,416,480.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	106,356.80	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,088,430.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,075,873.56	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,518,198.80	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	863,422.40	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	227,250.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	608,123.20	
FINNISH GOVERNMENT	1,300,000.00	1,661,285.60	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	803,592.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,000,000.00	6,047,007.60	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,631,460.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,676,438.15	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	101,380.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,600,000.00	10,629,916.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,823,832.00	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,434,844.30	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,876,500.00	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,632,101.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,700,000.00	1,831,161.80	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,128,028.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,600,000.00	1,704,224.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,500,000.00	11,811,148.60	
FRANCE (GOVT OF)	10,500,000.00	11,841,513.60	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	113,610.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	122,739.94	
FRANCE (GOVT OF)	10,600,000.00	14,048,331.58	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	496,136.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,900,000.00	1,979,876.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,100,000.00	4,331,551.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,500,000.00	9,091,413.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,100,000.00	5,149,709.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	18,802,326.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,900,000.00	13,842,764.56	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	31,434,750.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,286,379.10	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	26,622,466.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,405,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	41,678,725.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	5,460,750.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,363,515.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	15,518,965.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	33,887,333.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,300,000.00	16,959,238.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	487,228.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,100,000.00	14,425,079.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,200,000.00	35,510,387.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,500,000.00	12,902,175.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,700,000.00	9,785,247.25	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,078,072.25	
IRISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,243,308.80	
IRISH TSY 0.8% 2022	1,200,000.00	1,226,636.64	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	648,082.68	
IRISH TSY 1.3% 2033	2,400,000.00	2,663,318.40	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,218,548.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	1,500,000.00	1,749,702.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	700,000.00	822,723.30	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,871,110.20	
IRISH TSY 2.4% 2030	3,700,000.00	4,480,653.75	
IRISH TSY 2% 2045	3,100,000.00	4,002,589.80	
IRISH TSY 2022	4,800,000.00	4,835,049.60	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,100,000.00	6,948,205.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	50,000.00	52,375.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,514,118.00	

NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	106,420.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	223,783.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	244,400.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	429,964.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	102,025.15	
NETHERLANDS GOVERNMENT	10,000,000.00	11,080,760.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,558,125.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,234,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,702,917.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	10,636,100.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,086,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,400,000.00	3,558,644.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,500,000.00	7,388,150.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,700,000.00	6,234,352.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	550,310.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,400,000.00	4,362,204.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,500,000.00	9,450,397.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,495,264.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	739,601.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	3,464,640.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	101,300.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	220,080.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	900,000.00	911,475.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	150,000.00	161,379.75	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,317,745.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	762,930.14	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,405,387.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,034,040.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,122,892.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,107,894.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,600,000.00	2,721,940.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	6,300,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	663,078.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,200,000.00	5,343,903.36	
REPUBLIC OF AUSTRIA	7,100,000.00	9,123,500.00	

小計	REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	1,008,903.15	
	REPUBLIC OF IRELAND	4,450,000.00	4,987,186.20	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	22,864,480.00	
	SPANISH GOVERNMENT	16,400,000.00	25,141,200.00	
	SPANISH GOVERNMENT	500,000.00	714,226.50	
	銘柄数：256	1,350,320,000.00	1,702,322,606.77	(199,324,954,026)
	組入時価比率：34.9%			35.3%
英ボンド	UK TREASURY	40,000.00	43,554.40	
	UK TREASURY	470,000.00	493,645.70	
	UK TREASURY	2,350,000.00	2,523,641.50	
	UK TREASURY	300,000.00	303,003.00	
	UK TREASURY	1,300,000.00	1,351,857.00	
	UK TREASURY	14,000,000.00	14,300,860.00	
	UK TREASURY	4,800,000.00	5,150,880.00	
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,656,736.00	
	UK TREASURY	7,450,000.00	8,307,718.50	
	UK TREASURY	9,950,000.00	12,287,752.50	
	UK TREASURY	200,000.00	204,752.00	
	UK TREASURY	200,000.00	220,710.00	
	UK TREASURY	160,000.00	173,705.60	
	UK TREASURY	400,000.00	431,792.00	
	UK TREASURY	9,630,000.00	12,601,625.40	
	UK TREASURY	200,000.00	224,776.00	
	UK TREASURY	6,900,000.00	10,337,028.00	
	UK TREASURY	6,000,000.00	8,796,600.00	
	UK TREASURY	5,550,000.00	8,066,925.00	
	UK TREASURY	13,400,000.00	20,874,520.00	
	UK TREASURY	2,600,000.00	4,070,040.00	
	UK TREASURY	100,000.00	173,860.00	
	UK TREASURY	600,000.00	1,001,220.00	
	UK TREASURY	500,000.00	851,550.00	
	UK TREASURY	400,000.00	447,720.00	
	UK TREASURY	1,200,000.00	2,178,240.00	
UK TREASURY	18,440,000.00	30,433,376.00		



	UK TREASURY	6,700,000.00	12,604,040.00	
	UK TREASURY	9,100,000.00	11,068,330.00	
	UK TREASURY	12,100,000.00	15,634,410.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	10,583,905.00	
	UK TREASURY	6,750,000.00	13,063,275.00	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,335,000.00	
	UK TREASURY	2,100,000.00	2,985,150.00	
	UK TREASURY	100,000.00	182,440.00	
	UK TREASURY	650,000.00	1,504,880.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	26,900,000.00	42,233,000.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,800,000.00	15,021,880.00	
小計	銘柄数：38	186,290,000.00	273,724,398.60	
			(36,271,220,058)	
	組入時価比率：6.3%		6.4%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	36,050,000.00	38,980,865.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	3,100,000.00	3,301,546.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	32,250,000.00	36,737,587.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,905,280.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	17,992,464.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	14,300,000.00	15,398,383.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,500,000.00	16,633,619.10	
小計	銘柄数：7	125,000,000.00	141,949,745.10	
			(1,517,442,775)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ノルウェークロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	23,600,000.00	24,469,164.40	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	13,933,080.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	38,900,000.00	42,751,100.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,985,760.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,957,795.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,310,400.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,922,880.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	8,180,250.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,850,336.00	
小計	銘柄数：9	112,200,000.00	120,360,765.40	
			(1,221,661,768)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	

デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	14,400,000.00	15,197,987.52	
	KINGDOM OF DENMARK	400,000.00	408,120.00	
	KINGDOM OF DENMARK	18,570,000.00	19,921,896.00	
	KINGDOM OF DENMARK	32,000,000.00	35,849,600.00	
	KINGDOM OF DENMARK	15,700,000.00	16,734,630.00	
	KINGDOM OF DENMARK	10,400,000.00	11,100,960.00	
	KINGDOM OF DENMARK	38,100,000.00	71,484,744.00	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.5%	129,570,000.00	170,697,937.52 (2,679,957,619) 0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	46,300,000.00	47,017,061.99	
	POLAND GOVERNMENT BOND	28,500,000.00	31,870,412.85	
	POLAND GOVERNMENT BOND	25,000,000.00	27,100,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,173,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	16,911,019.50	
	小計	銘柄数：5 組入時価比率：0.6%	116,800,000.00	125,071,694.34 (3,228,100,430) 0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,034,308.42	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	7,721,488.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	40,000.00	44,858.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	80,000.00	84,092.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	6,243,267.78	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,887,240.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	15,200,000.00	17,316,183.52	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	15,583,638.06	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	15,524,076.15	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,688,060.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,800,000.00	19,946,680.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,444,951.25	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	12,250,882.87	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,256,650.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,316,576.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,700,000.00	10,963,132.95	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,180,682.18	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,000,000.00	5,428,974.40	

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	904,470.00		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,565,246.41		
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,300,000.00	6,796,190.00		
	銘柄数：21	127,300,000.00	151,181,649.25 (10,250,115,819)		
	組入時価比率：1.8%		1.8%		
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	480,000.00	489,792.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	708,197.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,356,810.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,547,600.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	310,020.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,600,000.00	3,848,400.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	736,750.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,093,724.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,190,860.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	756,000.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,582,500.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	566,250.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	349,068.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,815,200.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,514,922.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	2,373,000.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,050,000.00	2,566,600.00		
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,281,000.00		
	小計	銘柄数：18	27,630,000.00	31,086,693.00 (2,343,004,051)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,129,096.98		
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	423,945.80		
	MALAYSIA GOVERNMENT	2,600,000.00	2,993,825.38		
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	471,926.76		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	408,523.04		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	6,342,954.64		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	509,691.00		
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,699,015.46		

	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	515,929.90
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,880,596.05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,628,108.05
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,289,055.34
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,164,030.62
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	639,587.10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,430,344.32
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,889,093.44
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,305,377.10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,328,757.86
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	3,157,610.85
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	301,889.33
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,431,564.79
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,854,506.36
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	439,205.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	849,113.92
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	1,003,197.42
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,357,858.28
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	11,565,770.75
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,274,696.17
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	363,782.76
小計	銘柄数：29	94,780,000.00	102,649,055.07
			(2,517,981,320)
	組入時価比率：0.4%		0.4%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	35,600,000.00	37,180,373.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	62,300,000.00	67,141,619.58
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,200,000.00	32,807,569.58
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	23,130,000.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	68,900,000.00	57,278,657.67
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,800,000.00	5,667,411.72
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	27,100,000.00	17,294,095.35
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00	25,228,800.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000.00	9,617,626.58
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	2,477,881.20
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	132,500,000.00	103,787,594.50
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	43,200,000.00	33,742,530.72

小計	銘柄数：12 組入時価比率：0.4%	492,400,000.00	415,354,159.90 (2,355,058,086) 0.4%
合計			565,348,088,403 (565,348,088,403)

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

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

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

(3)貸付有価証券の明細(2020年 4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	24,000,000	
		US TREASURY N/B	1,700,000	
		US TREASURY N/B	39,000,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY N/B	30,000,000	
		US TREASURY N/B	8,000,000	
		US TREASURY N/B	10,227,000	
		US TREASURY N/B	6,400,000	
		US TREASURY N/B	7,480,000	
		US TREASURY N/B	5,000,000	
		US TREASURY N/B	8,925,000	
		US TREASURY N/B	31,000,000	
		US TREASURY N/B	10,000,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY BOND	23,000,000	
		US TREASURY BOND	41,000,000	
		US TREASURY N/B	35,000,000	
		US TREASURY BOND	36,000,000	
		US TREASURY BOND	50,000,000	
		US TREASURY BOND	9,403,000	
		US TREASURY BOND	32,000,000	
		US TREASURY BOND	13,800,000	
		US TREASURY BOND	25,000,000	
		US TREASURY N/B	3,590,000	
		US TREASURY N/B	29,000,000	
		US TREASURY N/B	9,265,000	
		US TREASURY N/B	13,500,000	
		US TREASURY N/B	340,000	
		US TREASURY N/B	1,700,000	
		US TREASURY N/B	1,530,000	
		US TREASURY N/B	6,460,000	
		US TREASURY N/B	12,500,000	
		US TREASURY N/B	17,000,000	
US TREASURY N/B	17,000,000			
US TREASURY N/B	2,820,000			

US TREASURY N/B	10,030,000	
US TREASURY N/B	29,000,000	
US TREASURY N/B	17,000,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	40,000,000	
US TREASURY N/B	1,181,000	
US TREASURY N/B	765,000	
US TREASURY N/B	16,000,000	
US TREASURY N/B	5,000,000	
US TREASURY N/B	425,000	
US TREASURY N/B	20,600,000	
US TREASURY N/B	2,000,000	
US TREASURY N/B	85,000	
US TREASURY N/B	5,215,000	
US TREASURY N/B	21,000,000	
US TREASURY N/B	20,000,000	
US TREASURY N/B	36,000,000	
US TREASURY N/B	8,670,000	
US TREASURY N/B	11,050,000	
US TREASURY N/B	7,140,000	
US TREASURY N/B	6,826,000	
US TREASURY N/B	50,000,000	
US TREASURY N/B	9,755,000	
US TREASURY N/B	1,000,000	
US TREASURY N/B	35,000,000	
US TREASURY N/B	3,035,000	
US TREASURY BOND	38,000,000	
US TREASURY BOND	335,000	
US TREASURY N/B	30,000,000	
US TREASURY N/B	4,925,000	
US TREASURY N/B	41,000,000	
US TREASURY N/B	27,000,000	
US TREASURY N/B	1,105,000	
US TREASURY N/B	12,000,000	
US TREASURY N/B	155,000	
US TREASURY N/B	26,000,000	
US TREASURY N/B	36,000,000	
US TREASURY N/B	210,000	
US TREASURY N/B	34,000,000	
US TREASURY N/B	1,530,000	
US TREASURY N/B	25,000,000	
US TREASURY N/B	38,000,000	
US TREASURY N/B	1,020,000	
ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,600,000
	FRANCE (GOVT OF)	900,000
	FRANCE (GOVT OF)	2,000,000
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,700,000

		BELGIUM KINGDOM	1,000,000	
		REPUBLIC OF AUSTRIA	5,100,000	
	豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,000,000	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,000,000	
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,100,000	

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 4月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	255,839,278	-	254,525,000	1,314,278
米ドル	161,787,390	-	161,775,000	12,390
英ポンド	94,051,888	-	92,750,000	1,301,888
合計	255,839,278	-	254,525,000	1,314,278

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

## 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	137,097,751
コール・ローン	302,427,838
国債証券	66,137,538,069
派生商品評価勘定	738,284,757

(2020年 4月22日現在)

未収入金	8,519,880
未収利息	469,053,790
前払費用	40,683,655
差入委託証拠金	3,725,287
流動資産合計	67,837,331,027
資産合計	67,837,331,027
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	19,803,171
未払解約金	17,588,571
未払利息	356
その他未払費用	611,800
流動負債合計	38,003,898
負債合計	38,003,898
純資産の部	
元本等	
元本	54,769,039,580
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	13,030,287,549
元本等合計	67,799,327,129
純資産合計	67,799,327,129
負債純資産合計	67,837,331,027

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)



2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1,2379円
(10,000口当たり純資産額)	(12,379円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>国債証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており ます。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4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	18,246,958,725円
同期中における一部解約元本額	13,643,077,698円
期末元本額	54,769,039,580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	1,125,633,824円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	798,371,661円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	18,949,154円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	4,947,856円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,970,419円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,704,474円
野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	5,983,170,452円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	12,676,485円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	6,276,336円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	15,085,428円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,084,225円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,296,589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）	28,948,243,444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）	8,088,857,461円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	3,540,741,054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）	35,551,865円
野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）	131,720,238円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信（適格機関投資家専用）	6,047,758,615円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	70,000.00	83,950.77	
		US TREASURY BOND	500,000.00	544,257.80	
		US TREASURY BOND	610,000.00	807,010.90	
		US TREASURY BOND	2,680,000.00	3,736,087.50	
		US TREASURY BOND	1,800,000.00	2,558,812.50	
		US TREASURY BOND	2,280,000.00	3,208,387.50	
		US TREASURY BOND	20,000.00	27,954.68	

US TREASURY BOND	80,000.00	112,587.49	
US TREASURY BOND	510,000.00	692,205.45	
US TREASURY BOND	3,450,000.00	5,336,448.96	
US TREASURY N/B	580,000.00	589,447.62	
US TREASURY N/B	300,000.00	306,691.38	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,721,914.02	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,061,992.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,013,593.70	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,056,953.00	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,582,304.60	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,060,781.20	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,026,484.30	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,935,343.75	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,530,527.25	
US TREASURY N/B	6,150,000.00	6,307,833.60	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,550,449.20	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,050,937.20	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,542,656.25	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,520,742.15	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,184,081.90	
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,670,687.50	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,524,023.40	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,028,632.80	
US TREASURY N/B	800,000.00	833,281.20	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,540,078.05	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,024,921.80	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,090,702.90	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,039,492.10	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,020,742.10	
US TREASURY N/B	600,000.00	619,335.90	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,542,656.25	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,441,671.84	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,093,281.10	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,509,171.62	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,814,117.12	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,240,687.44	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,122,109.30	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,037,812.50	
US TREASURY N/B	700,000.00	723,269.47	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,221,093.75	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,131,874.80	
US TREASURY N/B	700,000.00	728,656.25	

US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,561,992.15
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,044,296.80
US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,227,013.64
US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,374,235.76
US TREASURY N/B	700,000.00	723,925.72
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,168,437.20
US TREASURY N/B	4,110,000.00	4,312,609.84
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,067,656.20
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,140,648.41
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,568,203.05
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,085,000.00
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,588,281.25
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,612,656.25
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,288,593.72
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,111,327.90
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,707,617.00
US TREASURY N/B	700,000.00	733,140.59
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,087,578.10
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,197,812.50
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,185,937.40
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,143,750.00
US TREASURY N/B	500,000.00	536,992.15
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,716,093.58
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,142,812.40
US TREASURY N/B	500,000.00	533,867.15
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,155,312.40
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,632,656.25
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,280,624.80
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,119,531.20
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,232,265.40
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,135,625.00
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,159,062.40
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,173,281.20
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,348,124.80
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,247,031.10
US TREASURY N/B	800,000.00	871,500.00
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,132,031.20
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,158,125.00
US TREASURY N/B	4,500,000.00	5,001,679.35
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,500,937.20
US TREASURY N/B	800,000.00	870,624.96
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,254,062.40
US TREASURY N/B	2,780,000.00	3,016,300.00

US TREASURY N/B	600,000.00	675,468.72
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,806,690.58
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,280,000.00
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,501,875.00
US TREASURY N/B	3,800,000.00	4,052,046.78
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,860,203.06
US TREASURY N/B	700,000.00	784,000.00
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,040,328.08
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,608,000.00
US TREASURY N/B	600,000.00	678,421.86
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,923,843.54
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,968,359.25
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,693,601.33
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,869,062.40
US TREASURY N/B	3,400,000.00	4,011,203.04
US TREASURY N/B	500,000.00	581,054.65
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,196,093.60
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,632,890.55
US TREASURY N/B	500,000.00	779,140.60
US TREASURY N/B	340,000.00	567,215.60
US TREASURY N/B	1,760,000.00	2,831,537.45
US TREASURY N/B	400,000.00	580,281.24
US TREASURY N/B	2,300,000.00	3,636,695.14
US TREASURY N/B	2,150,000.00	3,566,816.24
US TREASURY N/B	2,340,000.00	3,576,360.76
US TREASURY N/B	300,000.00	510,562.50
US TREASURY N/B	500,000.00	699,023.40
US TREASURY N/B	500,000.00	663,632.80
US TREASURY N/B	800,000.00	1,125,312.48
US TREASURY N/B	700,000.00	1,067,500.00
US TREASURY N/B	1,800,000.00	2,326,781.16
US TREASURY N/B	2,540,000.00	3,570,783.56
US TREASURY N/B	2,760,000.00	3,826,050.00
US TREASURY N/B	3,020,000.00	4,264,806.25
US TREASURY N/B	4,030,000.00	5,244,037.50
US TREASURY N/B	3,400,000.00	4,431,687.50
US TREASURY N/B	2,730,000.00	3,405,461.51
US TREASURY N/B	2,400,000.00	3,351,937.44
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,430,546.80
US TREASURY N/B	2,820,000.00	3,868,687.50
US TREASURY N/B	3,400,000.00	4,672,343.58
US TREASURY N/B	2,100,000.00	3,018,257.76

小計	US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,471,015.60
	US TREASURY N/B	400,000.00	577,625.00
	銘柄数：136	271,760,000.00	310,525,231.09 (33,493,251,425)
	組入時価比率：49.4%		50.6%
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	2,570,000.00	2,580,408.50
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,007,580.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,040,910.00
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	828,912.00
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	643,206.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,151,923.20
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,041,170.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,065,430.00
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	504,490.80
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	448,344.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,496,544.00
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	971,268.00
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	648,152.00
	CANADIAN GOVERNMENT	780,000.00	1,194,453.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,040,000.00	1,421,596.80
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	241,438.00
	小計	銘柄数：16	14,800,000.00
	組入時価比率：1.9%		2.0%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,200,000.00	9,312,861.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,800,000.00	2,881,696.72
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	15,353,581.50
	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,000,000.00	13,615,494.20
	MEX BONOS DESARR FIX RT	20,100,000.00	21,025,556.76
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,404,492.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,100,000.00	3,176,973.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	7,326,456.60
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,000,000.00	7,386,750.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	4,275,124.93
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,300,000.00	10,056,338.31
	小計	銘柄数：11	100,800,000.00
	組入時価比率：0.7%		0.7%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	340,000.00	362,807.20
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	543,280.50
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	779,590.00
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,300,165.20
	BELGIUM KINGDOM	600,000.00	611,220.00

BELGIUM KINGDOM	230,000.00	257,600.00
BELGIUM KINGDOM	300,000.00	309,978.99
BELGIUM KINGDOM	100,000.00	106,745.84
BELGIUM KINGDOM	950,000.00	1,006,539.25
BELGIUM KINGDOM	300,000.00	318,935.16
BELGIUM KINGDOM	800,000.00	862,611.20
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,303,766.40
BELGIUM KINGDOM	550,000.00	793,100.00
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	230,860.20
BELGIUM KINGDOM	420,000.00	518,317.12
BELGIUM KINGDOM	300,000.00	512,328.00
BELGIUM KINGDOM	750,000.00	1,280,467.50
BELGIUM KINGDOM	400,000.00	484,998.80
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	248,427.60
BELGIUM KINGDOM	170,000.00	248,941.54
BELGIUM KINGDOM GOVT	370,000.00	616,777.05
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	730,000.00	736,807.98
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	500,130.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,490,000.00	1,642,005.33
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	301,914.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	402,480.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,027,197.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	300,189.36
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,940,000.00	2,214,290.39
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,920,000.00	2,181,600.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,541,821.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	974,150.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	839,360.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	605,959.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	720,000.00	774,857.52
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,037,129.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,048,900.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	315,615.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,800,000.00	1,878,224.76
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,600,000.00	1,677,280.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	447,546.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	762,769.76
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,090,940.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,026,090.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,576,102.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,539,287.64
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,150,000.00	1,447,011.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	244,751.70

BUNDESobligation	1,700,000.00	1,716,524.00	
BUNDESobligation	1,100,000.00	1,126,697.00	
BUNDESobligation	1,000,000.00	1,027,050.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	889,295.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,370,421.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,310,000.00	1,399,211.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	763,371.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	503,552.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	667,834.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	763,077.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	472,353.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,057,530.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,180,540.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	961,407.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	312,312.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	270,000.00	286,426.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,977,235.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	920,048.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,086,520.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	419,288.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,572,225.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,818,575.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,200,000.00	2,095,317.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	693,815.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	961,262.79	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	60,000.00	121,983.54	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	1,338,136.57	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	2,158,981.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	1,033,602.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	600,000.00	831,228.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	174,511.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	721,238.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	710,000.00	745,748.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,018,210.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,750,000.00	1,731,012.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,015,790.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	699,846.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,030,000.00	1,032,266.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	495,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	903,375.63	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	220,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	1,932,700.00	



BUONI POLIENNALI DEL TES	2,400,000.00	2,375,280.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	163,874.25
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,549,485.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	226,638.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,449,480.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,637,550.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	693,630.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,034,900.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	938,300.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	402,917.97
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	497,350.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	789,296.80
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	333,729.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	543,125.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,059,080.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,151,770.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	524,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	800,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,040,000.00	2,457,996.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	535,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,262,100.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	445,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	949,900.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	470,500.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	1,079,523.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,110,000.00	1,443,666.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	489,800.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,580,000.00	1,888,100.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	429,040.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	202,665.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	402,750.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,480,000.00	3,274,840.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,160,000.00	1,240,736.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	291,000.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	362,940.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	9,474.90
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	303,055.50
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	315,242.40
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	158,726.70
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	219,160.00
FINNISH GOVERNMENT	310,000.00	323,706.65
FINNISH GOVERNMENT	740,000.00	913,983.76
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	227,250.00

FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	243,249.28
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	255,582.40
FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	2,519,586.50
FRANCE (GOVT OF)	2,800,000.00	2,989,826.00
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	811,040.00
FRANCE (GOVT OF)	2,010,000.00	2,225,638.83
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,026,480.00
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	415,812.52
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	729,750.00
FRANCE (GOVT OF)	250,000.00	256,242.50
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	861,723.20
FRANCE (GOVT OF)	2,300,000.00	2,447,232.43
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,065,140.00
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,043,304.00
FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	2,484,225.00
FRANCE (GOVT OF)	1,020,000.00	1,268,144.37
FRANCE (GOVT OF)	1,850,000.00	2,101,785.00
FRANCE (GOVT OF)	960,000.00	1,178,303.42
FRANCE (GOVT OF)	2,110,000.00	2,796,413.17
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	601,738.20
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	496,136.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	140,000.00	145,885.60
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,056,476.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,320,000.00	1,411,842.96
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	908,772.30
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	610,000.00	651,671.54
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,800,000.00	2,095,650.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	657,275.82
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,100,000.00	1,479,025.90
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,067,500.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	910,000.00	1,112,247.50
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,900,000.00	2,305,650.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,793,934.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	640,000.00	735,713.92
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	505,781.10
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,490,000.00	2,453,326.72
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	649,638.40
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	720,000.00	1,282,229.28
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,919,480.40
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	1,249,180.50
IRISH GOVERNMENT	800,000.00	848,661.76
IRISH TSY 0.8% 2022	1,300,000.00	1,328,856.36

	IRISH TSY 1.5% 2050	100,000.00	116,646.80
	IRISH TSY 1.7% 2037	550,000.00	646,425.45
	IRISH TSY 1% 2026	650,000.00	688,309.05
	IRISH TSY 2% 2045	250,000.00	322,789.50
	IRISH TSY 2022	1,000,000.00	1,007,302.00
	IRISH TSY 3.4% 2024	500,000.00	569,525.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	523,750.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	504,706.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,230,000.00	1,376,267.91
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	366,600.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	322,473.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,108,076.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	423,400.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,081,167.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	874,200.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	1,150,000.00	1,544,795.00
	NETHERLANDS GOVERNMENT	610,000.00	1,108,726.85
	NETHERLANDS GOVERNMENT	650,000.00	1,116,865.10
	REPUBLIC OF AUSTRIA	10,000.00	14,088.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	866,160.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	709,100.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	120,000.00	129,103.80
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	318,433.80
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	417,940.40
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	745,450.30
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	699,448.40
	REPUBLIC OF AUSTRIA	530,000.00	695,625.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	381,269.85
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	667,987.92
	REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	642,500.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	739,862.31
	REPUBLIC OF IRELAND	80,000.00	89,657.28
	SPANISH GOVERNMENT	90,000.00	128,612.70
	SPANISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,686,300.00
	SPANISH GOVERNMENT	410,000.00	585,665.73
小計	銘柄数：210	172,520,000.00	200,611,980.58 (23,489,656,806)
	組入時価比率：34.6%		35.5%
英ポンド	UK TREASURY	320,000.00	343,644.80
	UK TREASURY	200,000.00	202,002.00
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,559,835.00
	UK TREASURY	900,000.00	919,341.00
	UK TREASURY	550,000.00	590,205.00

	UK TREASURY	500,000.00	517,730.00
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,338,156.00
	UK TREASURY	900,000.00	921,384.00
	UK TREASURY	1,370,000.00	1,487,354.20
	UK TREASURY	300,000.00	392,574.00
	UK TREASURY	900,000.00	1,011,492.00
	UK TREASURY	90,000.00	134,830.80
	UK TREASURY	800,000.00	847,768.00
	UK TREASURY	600,000.00	879,660.00
	UK TREASURY	600,000.00	872,100.00
	UK TREASURY	200,000.00	311,560.00
	UK TREASURY	1,160,000.00	1,815,864.00
	UK TREASURY	370,000.00	440,522.00
	UK TREASURY	1,050,000.00	1,905,960.00
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,650,400.00
	UK TREASURY	2,180,000.00	4,101,016.00
	UK TREASURY	1,700,000.00	2,067,710.00
	UK TREASURY	1,350,000.00	1,744,335.00
	UK TREASURY	1,140,000.00	2,255,262.00
	UK TREASURY	860,000.00	1,664,358.00
	UK TREASURY	380,000.00	879,776.00
	UK TSY 3 1/4% 2044	100,000.00	157,000.00
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	780,000.00	1,723,098.00
小計	銘柄数 : 28	23,000,000.00	32,734,937.80 (4,337,706,607)
	組入時価比率 : 6.4%		6.6%
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	3,500,000.00	3,784,550.00
	SWEDISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,195,045.00
	SWEDISH GOVERNMENT	250,000.00	284,787.50
	SWEDISH GOVERNMENT	2,700,000.00	2,903,688.00
	SWEDISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,283,920.00
	SWEDISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,534,646.72
小計	銘柄数 : 6	15,050,000.00	16,986,637.22 (181,587,151)
	組入時価比率 : 0.3%		0.3%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,050,000.00	1,088,670.45
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,990,440.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,750,000.00	3,022,250.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,793,245.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,750,000.00	1,879,500.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,650,600.00
小計	銘柄数 : 6	10,650,000.00	11,424,705.45

			(115,960,760)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,500,000.00	1,583,123.70	
	KINGDOM OF DENMARK	1,650,000.00	1,770,120.00	
	KINGDOM OF DENMARK	3,400,000.00	3,809,020.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,300,000.00	2,451,570.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,400,000.00	1,494,360.00	
	KINGDOM OF DENMARK	3,900,000.00	7,317,336.00	
小計	銘柄数：6	14,150,000.00	18,425,529.70	(289,280,816)
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,600,000.00	1,592,642.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,700,000.00	4,772,790.31	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,130,717.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,800,000.00	3,131,128.28	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,254,802.60	
小計	銘柄数：5	13,100,000.00	13,882,080.59	(358,296,500)
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,235,438.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	134,574.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,261,380.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	924,928.56	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,095,450.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,340,000.00	1,526,558.28	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	634,076.04	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	1,052,044.83	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	1,037,266.92	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,820,000.00	3,160,092.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,164,262.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	944,400.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	926,630.64	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,170,000.00	1,665,826.69	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	363,447.03	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	203,586.54	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	542,682.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	361,210.71	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	346,221.00	
	小計	銘柄数：19	15,930,000.00	18,580,075.90
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,030,000.00	1,042,061.30	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,496,600.00	

		SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	433,040.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	756,000.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	730,000.00	857,750.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	339,750.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	465,424.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	610,000.00	715,530.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	791,000.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	200,000.00	233,636.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	640,500.00	
	小計	銘柄数：11	6,970,000.00	7,771,291.30 (585,722,225)	
		組入時価比率：0.9%		0.9%	
	ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	818,498.64	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,500,000.00	4,699,766.25	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,900,000.00	7,436,230.74	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,650,000.00	5,711,265.38	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,800,000.00	2,158,800.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,000,000.00	4,167,214.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,800,000.00	6,937,920.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000.00	4,890,318.60	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,100,000.00	1,644,935.46	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,250,000.00	5,662,808.97	
	小計	銘柄数：10	50,800,000.00	44,127,758.54 (250,204,390)	
		組入時価比率：0.4%		0.4%	
	合計			66,137,538,069 (66,137,538,069)	

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 4月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	67,111,637,616	-	66,393,156,030	718,481,586
米ドル	33,501,349,352	-	33,343,119,360	158,229,992
カナダドル	1,301,831,306	-	1,294,834,290	6,997,016
メキシコペソ	475,915,500	-	463,927,200	11,988,300
ユーロ	24,516,038,788	-	24,027,336,360	488,702,428
英ポンド	4,253,288,507	-	4,217,234,988	36,053,519
スウェーデンクローナ	179,815,010	-	178,373,340	1,441,670

ノルウェークローネ	122,301,619	-	120,876,350	1,425,269
デンマーククローネ	313,890,270	-	308,272,640	5,617,630
ズロチ	354,334,328	-	347,700,780	6,633,548
豪ドル	1,243,840,573	-	1,263,012,520	19,171,947
シンガポールドル	572,412,898	-	566,579,402	5,833,496
ランド	276,619,465	-	261,888,800	14,730,665
合計	67,111,637,616	-	66,393,156,030	718,481,586

## (注) 時価の算定方法

## 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 新興国債券マザーファンド

## 貸借対照表

(単位:円)

(2020年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	234,842,286
コール・ローン	77,375,803
国債証券	20,164,119,894
未収利息	260,527,208
前払費用	26,392,192
流動資産合計	20,763,257,383
資産合計	20,763,257,383
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	38,272
未払金	101,233,082
未払解約金	22,014,446
未払利息	91
その他未払費用	245,800
流動負債合計	123,531,691
負債合計	123,531,691
純資産の部	
元本等	
元本	11,405,171,087
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金( )	9,234,554,605
元本等合計	20,639,725,692
純資産合計	20,639,725,692
負債純資産合計	20,763,257,383

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.8097円
(10,000口当たり純資産額)	(18,097円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>



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

#### 市場リスクの管理

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

#### 信用リスクの管理

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

#### 流動性リスクの管理

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

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

### (その他の注記)

#### 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4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	4,429,730,096円
同期中における一部解約元本額	3,660,747,024円
期末元本額	11,405,171,087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	1,209,432,519円
ネクストコア	21,737,982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	781,395,009円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,243,215円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,892,320円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,278,135円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,893,464円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,408,280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)	1,085,502,516円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	1,954,490,518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	233,745,493円

ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	491,480,741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)	6,933,504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)	3,450,145円
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	607,093,239円
オールウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(適格機関投資家専用)	322,400,782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)	4,321,245,382円
野村DC運用戦略ファンド	316,775,926円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	33,771,917円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	ARGENT-GLOBAL	640,000.00	338,431.29	
		ARGENT-GLOBAL	420,000.00	219,668.27	
		ARGENT-GLOBAL	2,300,000.00	779,251.50	
		BRAZIL GLOBAL	650,000.00	798,694.00	
		BRAZIL GLOBAL	670,000.00	840,019.20	
		BRAZIL GLOBAL	900,000.00	1,040,634.00	
		COLOMBIA GLOBAL	250,000.00	288,752.50	
		COLOMBIA GLOBAL	1,220,000.00	1,506,700.00	
		CROATIA	1,100,000.00	1,187,626.00	
		CROATIA	1,200,000.00	1,340,100.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,300,000.00	1,311,050.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000.00	2,377,625.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	900,000.00	1,003,500.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	1,966,975.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	1,900,000.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,500,000.00	1,515,000.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,600,000.00	1,500,000.00	

FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	1,923,750.00	
HUNGARY	1,100,000.00	1,193,148.00	
HUNGARY	1,050,000.00	1,171,651.95	
HUNGARY	1,800,000.00	2,008,243.80	
INDONESIA GLOBAL	1,400,000.00	1,539,497.68	
MEXICO GLOBAL	1,080,000.00	1,321,380.00	
PANAMA GLOBAL	500,000.00	591,771.25	
PANAMA GLOBAL	250,000.00	345,575.62	
PANAMA GLOBAL	1,150,000.00	1,465,174.75	
PERU GLOBAL	900,000.00	1,126,129.50	
PERU GLOBAL	670,000.00	949,936.05	
PHILIPPINES GLOBAL	1,400,000.00	1,487,978.10	
PHILIPPINES GLOBAL	1,050,000.00	1,666,989.03	
PHILIPPINES GLOBAL	800,000.00	1,170,356.24	
PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	676,525.10	
REPUBLIC OF ARGENTINA	900,000.00	258,750.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,400,000.00	766,800.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,650,000.00	826,800.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	600,000.00	190,506.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	4,100,000.00	1,256,691.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000.00	678,523.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000.00	684,273.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,500,000.00	437,250.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,100,000.00	612,171.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,150,000.00	637,496.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,300,000.00	378,638.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	300,000.00	304,203.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000.00	587,256.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,900,000.00	1,921,983.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	1,028,135.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,600,000.00	1,560,000.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,400,000.00	1,423,800.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,320,000.00	1,477,093.20	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,500,000.00	1,608,750.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,700,000.00	2,727,000.00	

REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	1,036,570.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	600,000.00	977,868.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	204,108.78	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	811,960.32	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,361,327.24	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,407,437.46	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	741,349.56	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	411,487.72	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	804,607.92	
REPUBLIC OF INDONESIA	300,000.00	313,930.26	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,700,000.00	1,860,214.97	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	399,712.48	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,150,000.00	1,602,101.68	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,361,164.92	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	843,091.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,333,789.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	890,503.28	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,227,307.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,400,000.00	1,577,351.72	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,549,839.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	467,814.76	
REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000.00	1,774,383.50	
REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000.00	1,782,892.00	
REPUBLIC OF PANAMA	400,000.00	392,800.00	
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	858,252.00	
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	861,008.00	
REPUBLIC OF PERU	900,000.00	1,003,322.25	
REPUBLIC OF PERU	500,000.00	511,250.00	
REPUBLIC OF PERU	1,400,000.00	2,030,000.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	500,000.00	539,543.30	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	938,157.36	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,900,000.00	2,142,423.28	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,138,877.92	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,016,058.08	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000.00	1,986,568.66	

REPUBLIC OF PHILIPPINES	2,000,000.00	2,315,664.80	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	950,000.00	978,030.70	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	692,162.10	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,350,000.00	1,345,275.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	748,504.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,800,000.00	1,532,136.60	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	300,000.00	276,126.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	312,186.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	381,015.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	556,500.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	413,856.50	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	581,250.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,663,939.60	
REPUBLIC OF TURKEY	700,000.00	630,981.40	
REPUBLIC OF TURKEY	900,000.00	889,333.20	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	569,469.00	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	332,262.40	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,095,250.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,300,000.00	2,035,891.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,900,000.00	1,581,126.80	
REPUBLIC OF TURKEY	900,000.00	786,180.60	
REPUBLIC OF TURKEY	3,000,000.00	2,848,815.00	
REPUBLIC OF TURKEY	950,000.00	802,959.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	945,600.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,400,000.00	1,730,692.80	
REPUBLIC OF TURKEY	1,900,000.00	1,575,778.30	
REPUBLIC OF TURKEY	1,900,000.00	1,437,777.50	
ROMANIA	600,000.00	638,760.00	
ROMANIA	800,000.00	834,096.00	
ROMANIA	400,000.00	425,640.00	
ROMANIA	800,000.00	966,000.00	
ROMANIA	600,000.00	655,320.00	
RUSSIA	1,032,500.00	1,167,293.49	
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,049,800.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,800,000.00	1,958,202.00	

RUSSIAN FEDERATION	1,800,000.00	1,971,849.60	
RUSSIAN FEDERATION	1,600,000.00	1,712,214.40	
RUSSIAN FEDERATION	2,600,000.00	2,834,520.00	
RUSSIAN FEDERATION	2,000,000.00	2,308,600.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,600,000.00	1,960,000.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,264,900.00	
RUSSIAN FEDERATION	4,400,000.00	5,292,355.20	
TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,403,262.00	
TURKEY GLOBAL	2,400,000.00	2,367,660.00	
TURKEY GLOBAL	850,000.00	1,045,457.50	
UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	546,273.60	
UKRAINE GOVERNMENT	2,100,000.00	2,037,054.60	
UKRAINE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,072,929.60	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	609,000.00	594,002.15	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	709,000.00	680,852.70	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	665,026.60	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,132,050.00	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,102,320.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,259,388.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,107,700.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,950,000.00	1,976,958.75	
UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,203,204.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,316,263.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,600,800.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,163,700.00	
UNITED MEXICAN STATES	2,800,000.00	2,815,400.00	
UNITED MEXICAN STATES	2,110,000.00	2,309,162.90	
UNITED MEXICAN STATES	1,500,000.00	1,404,750.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,791,817.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,570,800.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,400,000.00	1,259,832.00	
UNITED MEXICAN STATES	2,300,000.00	2,145,923.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,198,925.00	
小計	銘柄数：155	196,580,500.00	186,947,152.74 (20,164,119,894)

	組入時価比率：97.7%		100.0%
合計		20,164,119,894	(20,164,119,894)

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 4月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	56,085,172	-	56,082,000	3,172
米ドル	56,085,172	-	56,082,000	3,172
売建	10,749,900	-	10,785,000	35,100
米ドル	10,749,900	-	10,785,000	35,100
合計	-	-	-	38,272

### (注) 時価の算定方法

#### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 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)

(2020年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	178,653,251
コール・ローン	31,278,325
社債券	3,117,239,582
派生商品評価勘定	73,500
未収利息	42,881,699
前払費用	7,675,053
流動資産合計	3,377,801,410
資産合計	3,377,801,410
負債の部	
流動負債	
未払金	32,565,415
未払解約金	200,000
未払利息	36
流動負債合計	32,765,451
負債合計	32,765,451
純資産の部	
元本等	
元本	2,922,210,035
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	422,825,924
元本等合計	3,345,035,959
純資産合計	3,345,035,959
負債純資産合計	3,377,801,410

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)



2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.1447円
(10,000口当たり純資産額)	(11,447円)

## (金融商品に関する注記)

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>社債券</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており</p> <p>ます。</p>

## (その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4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	2,277,417,540円
同期中における一部解約元本額	1,105,007,710円
期末元本額	2,922,210,035円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・米国ハイ・イールド債券	557,380,045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	252,451,864円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,373,107円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,503,118円
インデックス・ブレンド(タイプ )	7,554,803円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,970,914円
インデックス・ブレンド(タイプ )	6,334,461円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	1,083,614,647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)	1,009,027,076円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

#### 附属明細表

##### 第1 有価証券明細表

##### (1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

##### (2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
社債券	米ドル	1011778 BC / NEW RED FIN	120,000.00	120,600.60	
		1011778 BC / NEW RED FIN	100,000.00	98,624.50	
		1011778 BC / NEW RED FIN	100,000.00	95,126.00	
		ABC SUPPLY CO INC	30,000.00	30,841.50	
		ABC SUPPLY CO INC	50,000.00	48,277.50	
		ACRISURE LLC / FIN INC	50,000.00	51,911.25	
		ACRISURE LLC / FIN INC	40,000.00	36,698.80	
		AES CORP/THE	100,000.00	100,480.00	
		AES CORP/VA	70,000.00	73,188.50	
		AG ISSUER LLC	80,000.00	69,200.00	
		AHERN RENTALS INC	30,000.00	16,387.35	
		ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	50,000.00	51,373.50	
		ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	50,000.00	51,312.25	
		ALBERTSONS COS LLC/SAFEW	100,000.00	108,828.20	
		ALBERTSONS COS/SAFEWAY	90,000.00	90,850.50	

ALCOA NEDERLAND HOLDING	200,000.00	195,110.00	
ALLIANT HOLD/CO-ISSUER	40,000.00	40,822.00	
ALLIED UNIVERSAL HOLDCO	70,000.00	72,931.04	
ALLISON TRANSMISSION INC	80,000.00	78,053.60	
ALLY FINANCIAL INC	80,000.00	81,424.80	
ALTICE FRANCE SA	200,000.00	207,550.00	
AMC ENTERTAINMENT INC	50,000.00	15,598.37	
AMC NETWORKS INC	50,000.00	48,500.00	
AMERICAN AIRLINES GROUP	50,000.00	27,312.50	
AMERICAN AXLE & MFG INC	50,000.00	39,750.00	
AMERIGAS PART/FIN CORP	100,000.00	101,997.00	
AMERIGAS PART/FIN CORP	20,000.00	20,589.35	
AMKOR TECHNOLOGY INC	50,000.00	51,902.50	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	20,000.00	13,144.00	
ANTERO MIDSTREAM PART/FI	50,000.00	34,092.25	
ARAMARK SERVICES INC	130,000.00	120,522.67	
ARCHROCK PARTNERS LP/FIN	50,000.00	40,833.37	
ARDAGH PKG FIN/HLDGS USA	200,000.00	204,560.00	
ASCENT RESOURCES/ARU FIN	50,000.00	19,927.12	
ASSUREDPARTNERS INC	30,000.00	28,125.90	
AVANTOR INC	60,000.00	64,124.70	
B&G FOODS INC	50,000.00	51,062.75	
B&G FOODS INC	60,000.00	61,125.00	
BAFFINLAND IRON CORP/LP	20,000.00	17,939.00	
BALL CORP	50,000.00	54,277.50	
BANFF MERGER SUB INC	50,000.00	45,878.75	
BAUSCH HEALTH AMERICAS	50,000.00	53,902.50	
BAUSCH HEALTH COS INC	50,000.00	52,777.50	
BAUSCH HEALTH COS INC	50,000.00	53,902.50	
BAUSCH HEALTH COS INC	60,000.00	58,482.00	
BBA US HOLDINGS INC	50,000.00	45,277.50	
BEACON ESCROW CORP	50,000.00	45,172.75	
BERRY GLOBAL ESCROW CORP	50,000.00	51,906.10	
BERRY GLOBAL ESCROW CORP	50,000.00	51,753.75	
BIG RIVER STEEL/BRS FIN	20,000.00	19,085.80	
BLUE CUBE SPINCO INC	50,000.00	52,313.00	
BOMBARDIER INC	100,000.00	84,675.00	
BOMBARDIER INC	30,000.00	21,037.65	
BOMBARDIER INC	100,000.00	67,242.50	
BOYD GAMING CORP	50,000.00	46,072.87	
BOYD GAMING CORP	70,000.00	61,288.50	
BRAND ENERGY & INFRASTRU	30,000.00	23,915.10	

BRINK'S CO/THE	20,000.00	19,489.35
BROOKFIELD PPTY REIT INC	50,000.00	40,281.10
BRUIN E&P PARTNERS LLC	20,000.00	500.00
BWAY HOLDING CO	50,000.00	45,795.00
BWAY HOLDING CO	90,000.00	73,771.20
CALIFORNIA RESOURCES CRP	50,000.00	1,625.00
CALLON PETROLEUM CO	20,000.00	3,250.00
CALPINE CORP	50,000.00	51,199.87
CALPINE CORP	90,000.00	88,987.50
CALUMET SPECIALTY PROD	50,000.00	37,738.50
CAMELOT FINANCE SA	50,000.00	50,494.60
CARGO AIRCRAFT MANAGEMEN	60,000.00	57,600.00
CATALENT PHARMA SOLUTION	50,000.00	51,027.50
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	160,000.00	166,088.00
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	150,000.00	159,082.50
CCO HLDGS LLC/CAP CORP	140,000.00	144,291.00
CD&R WATERWORKS MERGER	30,000.00	30,074.10
CDK GLOBAL INC	50,000.00	51,151.62
CDK GLOBAL INC	50,000.00	52,937.50
CEDAR FAIR LP	50,000.00	43,637.50
CEDAR FAIR/CAN/MAGNUM/MI	30,000.00	27,134.02
GENGAGE LEARNING INC	30,000.00	19,678.35
GENTENE CORP	100,000.00	101,502.00
GENTENE CORP	110,000.00	114,812.50
GENTENE CORP	110,000.00	111,864.50
GENTENE ESCROW I CORP	280,000.00	291,704.00
GENTENNIAL RESOURCE PROD	50,000.00	13,848.37
CENTURYLINK INC	70,000.00	76,912.15
CENTURYLINK INC	120,000.00	117,252.00
CHANGE HEALTH / FIN INC	50,000.00	49,633.50
CHARLES RIVER LABORATORI	20,000.00	21,039.35
CHEMOURS CO	70,000.00	63,437.85
CHENIERE ENERGY PARTNERS	200,000.00	184,110.00
CHESAPEAKE ENERGY CORP	113,000.00	7,910.00
CHOBANI LLC/FINANCE CORP	12,000.00	12,029.64
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	190,000.00	187,619.30
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	80,000.00	60,597.60
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	100,000.00	98,437.80
CHS/COMMUNITY HEALTH SYS	150,000.00	146,625.00
CHURCHILL DOWNS INC	30,000.00	28,933.50
CINCINNATI BELL INC	20,000.00	20,149.40
CIT GROUP INC	50,000.00	50,215.50
CIT GROUP INC	50,000.00	49,937.50

CLEAN HARBORS INC	50,000.00	51,277.50	
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	74,000.00	61,281.62	
CLEAR CHANNEL WORLDWIDE	50,000.00	48,241.00	
CLEARWAY ENERGY OP LLC	60,000.00	60,075.00	
CLEVELAND-CLIFFS INC	50,000.00	31,834.50	
CNX RESOURCES CORP	50,000.00	39,621.25	
COLFAX CORP	50,000.00	51,442.75	
COMMSCOPE FINANCE LLC	120,000.00	121,665.00	
COMMSCOPE FINANCE LLC	50,000.00	48,905.00	
COMMSCOPE TECH FINANCE L	50,000.00	44,283.00	
COMMSCOPE TECH LLC	50,000.00	44,128.75	
COMSTOCK ESCROW CORP	20,000.00	16,754.95	
CONNECT FINCO SARL/CONNE	200,000.00	185,250.00	
COTT HOLDINGS INC	50,000.00	51,187.75	
COTY INC	30,000.00	26,777.25	
COVEY PARK ENERGY LLC/FI	20,000.00	16,100.00	
CRC ESCROW ISSUER LLC	50,000.00	41,750.00	
CRESTWOOD MID PARTNER LP	50,000.00	34,881.31	
CRESTWOOD MIDSTREAM PART	50,000.00	32,812.75	
CROWN AMER/CAP CORP VI	50,000.00	51,322.87	
CROWNROCK LP/CROWNROCK F	40,000.00	31,087.20	
CSC HOLDINGS LLC	200,000.00	206,666.50	
CSC HOLDINGS LLC	400,000.00	427,540.00	
CSVC ACQUISITION CORP	20,000.00	6,974.90	
CUMULUS MEDIA NEW HLDGS	60,000.00	50,737.32	
CURO GROUP HOLDINGS CORP	50,000.00	38,876.50	
DAKOTA MERGER SUB INC	20,000.00	12,774.90	
DCP MIDSTREAM OPERATING	80,000.00	64,997.60	
DELPHI JERSEY HOLDINGS	30,000.00	26,081.40	
DENBURY RESOURCES INC	50,000.00	6,662.50	
DIAMOND OFFSHORE DRILL	20,000.00	2,750.00	
DIAMOND SPORTS GR/DIAMON	100,000.00	78,187.20	
DIAMOND SPORTS GR/DIAMON	100,000.00	59,835.00	
DISH DBS CORP	100,000.00	96,776.00	
ECLIPSE RESOURCES CORP	30,000.00	22,875.90	
EG GLOBAL FINANCE PLC	200,000.00	190,251.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	30,000.00	33,460.22	
ELDORADA RESORTS INC	20,000.00	19,825.10	
ENCOMPASS HEALTH CORP	50,000.00	51,402.50	
ENDEAVOR ENERGY RESOURCE	30,000.00	25,671.00	
ENERGIZER GAMMA ACQ INC	30,000.00	30,958.50	
ENLINK MIDSTREAM LLC	30,000.00	18,209.02	

ENLINK MIDSTREAM PARTNER	70,000.00	41,737.85
ENSIGN DRILLING INC	50,000.00	15,873.50
ENTEGRIS INC	30,000.00	30,991.50
ENVIVA PARTNERS LP/FIN C	60,000.00	63,600.00
EQT CORP	150,000.00	139,125.00
ESH HOSPITALITY INC	50,000.00	47,812.75
ESH HOSPITALITY INC	50,000.00	44,597.50
EXELA INTERMED/EXELA FIN	20,000.00	4,600.00
EXTRACTION OIL & GAS INC	20,000.00	3,370.85
FIDELITY & GUARANTY LIFE	30,000.00	31,350.90
FINANCIAL & RISK US HOLD	50,000.00	53,496.50
FIVE POINT OP CO LP/FIVE	60,000.00	56,551.80
FLEX ACQUISITION CO INC	30,000.00	29,475.90
FLEX ACQUISITION CO INC	20,000.00	18,939.35
FMG RESOURCES AUG 2006	50,000.00	50,263.50
FMG RESOURCES AUG 2006	30,000.00	30,412.65
FMG RESOURCES AUG 2006	50,000.00	48,972.50
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	183,310.00
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	184,500.00
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	200,000.00	180,375.00
FORTRESS TRANS & INFRAST	30,000.00	27,088.20
FREEDOM MORTGAGE CORP	20,000.00	16,493.40
FREEPORT-MCMORAN INC	100,000.00	96,555.00
FRESH MARKET INC	20,000.00	11,000.00
FS ENERGY & POWER FUND	20,000.00	14,125.10
GARTNER INC	50,000.00	51,312.75
GATES GLOBAL LLC	30,000.00	26,700.15
GENESIS ENERGY LP/FIN	50,000.00	41,873.50
GFL ENVIRONMENTAL INC	60,000.00	63,300.00
GO DADDY OPCO/FINCO	50,000.00	51,402.50
GOGO INTERMEDIATE/FINANC	30,000.00	24,975.15
GOLDEN NUGGET INC	50,000.00	41,248.50
GOLDEN NUGGET INC	100,000.00	59,747.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER	50,000.00	43,777.50
GRAY TELEVISION INC	100,000.00	99,695.00
GREIF INC	50,000.00	49,722.50
GREYSTAR REAL ESTATE PAR	20,000.00	18,849.40
GRINDING MED/MC GRINDING	50,000.00	49,366.00
GRUBHUB HOLDINGS INC	70,000.00	66,002.30
GTT COMMUNICATIONS INC	20,000.00	11,700.00
GULFPORT ENERGY CORP	50,000.00	21,125.00
GW B-CR SECURITY CORP	30,000.00	30,279.00
H&E EQUIPMENT SERVICES	50,000.00	48,052.25

HANESBRANDS INC	50,000.00	50,687.75	
HARLAND CLARKE HOLDINGS	30,000.00	19,228.08	
HARSCO CORP	50,000.00	48,488.75	
HCA INC	70,000.00	77,388.50	
HCA INC	90,000.00	97,881.75	
HCA INC	70,000.00	77,913.50	
HCA INC	100,000.00	115,125.00	
HD SUPPLY INC	50,000.00	53,223.37	
HERC HOLDINGS INC	50,000.00	47,371.25	
HERTZ CORP	50,000.00	18,062.75	
HERTZ CORP	50,000.00	17,281.25	
HESS MIDSTREAM PARTNERS	60,000.00	51,675.00	
HILCORP ENERGY I/HILCORP	50,000.00	27,427.12	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	70,000.00	69,547.97	
HILTON DOMESTIC OPERATIN	40,000.00	38,946.70	
HILTON WORLDWIDE FIN LLC	50,000.00	48,572.75	
HILTON WORLDWIDE FIN LLC	40,000.00	39,222.00	
HJ HEINZ CO	200,000.00	208,764.30	
HOLOGIC INC	30,000.00	30,554.25	
HOWARD HUGHES CORP	50,000.00	48,998.50	
HUB INTERNATIONAL LTD	60,000.00	60,361.50	
HUDBAY MINERALS INC	20,000.00	19,100.10	
HUGHES SATELLITE SYSTEMS	50,000.00	52,927.12	
HUNT COS INC	70,000.00	57,087.27	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	30,000.00	29,803.65	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	100,000.00	99,062.20	
ICAHN ENTERPRISES/FIN	80,000.00	77,600.00	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	50,000.00	47,641.10	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	50,000.00	43,012.50	
IHEARTCOMMUNICATIONS INC	40,000.00	35,222.00	
INCEPTION MRGR/RACKSPACE	50,000.00	47,610.00	
INDIGO NATURAL RES LLC	20,000.00	17,751.50	
INTELSAT JACKSON HLDG	40,000.00	40,850.20	
INTESA SANPAOLO SPA	200,000.00	201,774.20	
IQVIA INC	200,000.00	207,393.50	
IRON MOUNTAIN INC	80,000.00	81,244.00	
IRON MOUNTAIN INC	50,000.00	49,973.87	
ISTAR INC	50,000.00	40,812.75	
J2 CLOUD LLC/GLOBAL INC	20,000.00	20,525.10	
JAGGED PEAK ENERGY LLC	100,000.00	85,211.75	
JAGUAR HL / PPD I	30,000.00	30,449.40	
JBS INVESTMENTS II GMBH	200,000.00	206,592.00	

JBS USA/FOOD/FINANCE	50,000.00	54,535.00
JBS USA/FOOD/FINANCE	70,000.00	72,284.10
JONAH NRG LLC/FINANCE	30,000.00	1,350.00
KAR AUCTION SERVICES INC	30,000.00	27,098.25
KFC HLD/PIZZA HUT/TACO	100,000.00	104,227.50
KOPPERS INC	20,000.00	16,580.40
KRAFT HEINZ FOODS CO	100,000.00	103,293.82
KRONOS ACQUISITION HOLDI	30,000.00	25,733.85
L BRANDS INC	30,000.00	21,682.50
LABL ESCROW ISSUER LLC	50,000.00	49,581.10
LADDER CAP FIN LLLP/CORP	50,000.00	42,248.95
LAMB WESTON HLD	90,000.00	92,088.00
LAUREATE EDUCATION INC	70,000.00	73,504.90
LENNAR CORP	150,000.00	151,506.00
LENNAR CORP	50,000.00	50,437.75
LEVEL 3 FINANCING INC	50,000.00	52,027.50
LEVEL 3 FINANCING INC	50,000.00	50,137.50
LIONS GATE CAPITAL HOLD	30,000.00	27,840.45
LIVE NATION ENTERTAINMEN	50,000.00	43,472.50
MARRIOTT OWNERSHIP RESOR	50,000.00	47,531.10
MASONITE INTERNATIONAL C	50,000.00	49,277.50
MATADOR RESOURCES CO	30,000.00	13,502.25
MATTAMY GROUP CORP	100,000.00	94,819.00
MATTEL INC	50,000.00	51,172.75
MATTEL INC	100,000.00	101,700.00
MDC PARTNERS INC	50,000.00	36,485.00
MEDNAX INC	50,000.00	44,389.75
MEG ENERGY CORP	70,000.00	45,325.00
MELCO RESORTS FINANCE	200,000.00	195,295.70
MEREDITH CORP	50,000.00	42,859.87
MGM GROWTH/MGM FINANCE	50,000.00	51,372.75
MGM GROWTH/MGM FINANCE	50,000.00	51,312.50
MGM RESORTS INTL	60,000.00	59,131.20
MGM RESORTS INTL	33,000.00	31,430.02
MICHAELS STORES INC	50,000.00	36,722.50
MINERAL RESOURCES LTD	50,000.00	51,151.62
MOHEGAN TRIBAL GAMING AU	30,000.00	16,762.35
MOLINA HEALTHCARE INC	30,000.00	31,060.20
MOOG INC	80,000.00	76,400.00
MOSS CREEK RESOURCES HLD	20,000.00	5,870.85
MOSS CREEK RESOURCES HLD	50,000.00	15,822.87
MPH ACQUISITION HOLDINGS	40,000.00	36,501.20
MPT OPER PARTNERSP/FINL	50,000.00	51,596.87



MPT OPER PARTNERSP/FINL	100,000.00	103,507.50
MSCI INC	50,000.00	52,848.37
MSCI INC	50,000.00	51,902.50
MURPHY OIL CORP	30,000.00	19,987.65
MURPHY OIL CORP	80,000.00	53,850.40
MURPHY OIL USA INC	40,000.00	41,310.00
NABORS INDUSTRIES INC	50,000.00	11,187.25
NATIONSTAR MTG	50,000.00	48,250.00
NATIONSTAR MTG HLD INC	60,000.00	54,037.50
NAVIENT CORP	150,000.00	150,375.00
NAVIENT CORP	50,000.00	48,237.50
NAVISTAR INTL CORP	26,000.00	21,872.63
NCR CORP	50,000.00	50,277.50
NETFLIX INC	150,000.00	157,552.50
NETFLIX INC	100,000.00	111,675.00
NETFLIX INC	50,000.00	57,478.50
NETFLIX INC	130,000.00	136,350.50
NEWELL BRANDS INC	160,000.00	162,908.01
NEWMARK GROUP INC	50,000.00	47,901.66
NEXSTAR ESCROW CORP	70,000.00	68,687.85
NEXSTAR ESCROW INC	90,000.00	86,224.50
NEXTERA ENERGY OPERATING	50,000.00	50,687.75
NEXTERA ENERGY OPERATING	50,000.00	50,062.75
NEXTERA ENERGY OPERATING	50,000.00	49,031.10
NFP CORP	20,000.00	19,149.40
NGL ENRGY PART LP/FIN CO	100,000.00	52,747.00
NIELSEN CO LUX SARL/THE	40,000.00	39,598.80
NOBLE HOLDING INTL LTD	50,000.00	12,927.12
NOKIA OYJ	50,000.00	50,623.95
NORTHWEST ACQ/DOMINION	30,000.00	13,585.20
NOVELIS CORP	50,000.00	50,348.37
NOVELIS CORP	100,000.00	91,349.50
NRG ENERGY INC	30,000.00	31,966.50
NRG ENERGY INC	50,000.00	52,847.50
NUSTAR LOGISTICS LP	50,000.00	41,907.10
NUSTAR LOGISTICS LP	20,000.00	16,655.00
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	200,000.00	154,500.00
OCCIDENTAL PETROLEUM COR	340,000.00	221,952.00
OLIN CORP	50,000.00	47,222.50
OLIN CORP	20,000.00	18,633.80
OPEN TEXT CORP	50,000.00	52,012.50
OUTFRONT MEDIA CAP LLC/C	50,000.00	45,152.50

PACIFIC DRILLING ESC ISS	30,000.00	8,924.10
PANTHER BF AGGREGATOR 2	50,000.00	50,536.10
PANTHER BF AGGREGATOR 2	50,000.00	44,027.50
PAR PHARMACEUTICAL INC	150,000.00	152,216.25
PARKLAND FUEL CORP	30,000.00	28,666.50
PARSLEY ENERGY LLC/FINAN	50,000.00	41,347.50
PARTY CITY HOLDINGS INC	20,000.00	2,200.00
PBF HOLDING CO LLC	30,000.00	23,092.71
PBF HOLDING CO LLC	70,000.00	49,875.00
PBF LOGISTICS LP/FINANCE	20,000.00	14,493.40
PDC ENERGY INC	20,000.00	15,201.50
PEABODY SEC FIN CORP	20,000.00	11,950.00
PERFORMANCE FOOD GROUP I	100,000.00	95,320.00
PETSMART INC	50,000.00	50,180.00
PETSMART INC	20,000.00	19,350.00
PILGRIM'S PRIDE CORP	50,000.00	51,527.50
PISCES MIDCO INC	20,000.00	17,648.50
PLASTIPAK HOLDINGS INC	30,000.00	27,825.00
PLATFORM SPECIALTY PROD	50,000.00	50,272.00
POLARIS INTERMEDIATE	40,000.00	33,700.78
POST HOLDINGS INC	100,000.00	101,845.00
POST HOLDINGS INC	50,000.00	52,583.37
POST HOLDINGS INC	50,000.00	52,277.50
POST HOLDINGS INC	50,000.00	52,277.50
PQ CORP	30,000.00	30,449.97
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	120,000.00	123,674.64
PRIME SECSRVC BRW/FINANC	50,000.00	46,625.50
PRIME SECURITY ONE MS IN	50,000.00	44,878.75
PTC INC	80,000.00	81,800.00
PULTE GROUP INC	50,000.00	52,348.37
PUMA INTERNATIONAL FINAN	200,000.00	116,746.00
QEP RESOURCES INC	20,000.00	6,551.50
QORVO INC	80,000.00	83,250.24
QUICKEN LOANS INC	80,000.00	79,442.60
RAIN CII CARBON LLC/CII	30,000.00	26,624.10
RANGE RESOURCES CORP	40,000.00	31,800.00
RANGE RESOURCES CORP	50,000.00	38,775.00
RBS GLOBAL & REXNORD COR	30,000.00	30,299.10
REALOGY GROUP/CO-ISSUER	50,000.00	38,621.25
REGIONALCARE/LIFEPOINT	50,000.00	52,128.75
REYNOLDS GRP ISS/REYNOLD	50,000.00	50,327.75
RITCHIE BROS AUCTIONEERS	30,000.00	30,637.35
RYMAN HOSPITALITY PROP	50,000.00	45,527.50

SABRE GLBL INC	30,000.00	27,985.50	
SALLY HOLDINGS/SALLY CAP	20,000.00	16,625.10	
SBA COMMUNICATIONS CORP	50,000.00	50,483.95	
SCIENTIFIC GAMES CORP	50,000.00	44,360.00	
SCIENTIFIC GAMES INTERNA	70,000.00	52,543.54	
SCIENTIFIC GAMES INTERNA	50,000.00	35,527.50	
SCRIPPS ESCROW INC	50,000.00	45,027.50	
SELECT MEDICAL CORP	50,000.00	48,775.25	
SENIOR HOUSING PROPRTIE	50,000.00	40,447.51	
SERVICE CORP INTL	30,000.00	30,209.02	
SERVICE CORP INTL	50,000.00	51,879.00	
SERVICEMASTER COMPANY LL	30,000.00	30,562.65	
SESI LLC	20,000.00	4,174.90	
SEVEN GENERATIONS ENERGY	20,000.00	16,549.40	
SIMMONS FOODS INC	60,000.00	56,475.30	
SIRIUS XM RADIO INC	30,000.00	30,065.37	
SIRIUS XM RADIO INC	50,000.00	51,878.75	
SIRIUS XM RADIO INC	50,000.00	51,285.00	
SIRIUS XM RADIO INC	100,000.00	105,243.00	
SIX FLAGS ENTERTAINMENT	50,000.00	42,617.50	
SM ENERGY CO	50,000.00	13,437.25	
SOLERA LLC / SOLERA FINA	100,000.00	98,313.50	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	50,000.00	48,875.00	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	50,000.00	48,376.50	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	50,000.00	49,503.50	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	60,000.00	57,337.50	
SPRINGLEAF FINANCE CORP	50,000.00	43,777.50	
SPRINT CORP	150,000.00	178,957.50	
SS&C TECHNOLOGIES INC	100,000.00	104,792.50	
SSL ROBOTICS LLC	60,000.00	64,471.20	
STANDARD INDUSTRIES INC	50,000.00	50,348.37	
STAPLES INC	130,000.00	96,293.86	
STAPLES INC	50,000.00	27,097.50	
STAR MERGER SUB INC	50,000.00	53,031.25	
STAR MERGER SUB INC	30,000.00	32,416.50	
STARFRUIT FINCO/STAR US	150,000.00	139,136.25	
STARS GRP HLDS/STARS GRP	20,000.00	21,121.00	
STATION CASINOS LLC	50,000.00	43,375.00	
STERICYCLE INC	50,000.00	50,870.00	
SUMMIT MATERIALS LLC/FIN	30,000.00	30,103.50	
SUMMIT MID HLDS LLC / FI	20,000.00	3,774.90	
SUNCOKE ENRGY PART LP/FI	50,000.00	39,998.50	

SUNOCO LP/FINANCE CORP	30,000.00	29,587.35
SUNOCO LP/FINANCE CORP	50,000.00	47,973.37
SYMANTEC CORP	50,000.00	50,561.47
T-MOBILE USA INC	50,000.00	51,152.50
T-MOBILE USA INC	80,000.00	84,044.00
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	70,000.00	60,561.72
TALEN ENERGY SUPPLY LLC	50,000.00	50,227.50
TALLGRASS NRG PRTRN/FIN	40,000.00	28,298.80
TALLGRASS NRG PRTRN/FIN	50,000.00	32,348.37
TARGA RESOURCES PARTNERS	200,000.00	182,124.40
TARGA RESOURCES PARTNERS	50,000.00	42,598.37
TARGA RESOURCES PARTNERS	70,000.00	59,799.60
TAYLOR MORRISON COMM/MON	50,000.00	45,723.37
TEEKAY OFFSHORE PARTNERS	30,000.00	27,037.65
TEGNA INC	50,000.00	45,875.00
TELEFLEX INC	30,000.00	31,333.50
TEMPO ACQUISITION LLC/FI	30,000.00	29,390.10
TENET HEALTHCARE CORP	120,000.00	121,649.40
TENET HEALTHCARE CORP	100,000.00	100,595.00
TENET HEALTHCARE CORP	50,000.00	50,450.00
TENET HEALTHCARE CORP	150,000.00	151,312.50
TENN MERGER SUB INC	20,000.00	10,974.90
TENNECO INC	50,000.00	27,128.75
TEREX CORP	30,000.00	28,987.50
TERRIER MEDIA BUYER INC	90,000.00	74,644.20
TERVITA ESCROW CORP	30,000.00	21,352.50
TESLA INC	100,000.00	94,887.00
TITAN ACQ/CO-BORROWER	40,000.00	37,133.30
TPC GROUP INC	50,000.00	39,812.75
TRANSDIGM INC	100,000.00	98,417.80
TRANSDIGM INC	150,000.00	141,082.50
TRANSDIGM INC	40,000.00	35,222.00
TRANSOCEAN INC	80,000.00	30,000.00
TRANSOCEAN INC	30,000.00	10,950.00
TRANSOCEAN PONTUS LTD	25,050.00	20,415.75
TREEHOUSE FOODS INC	50,000.00	51,062.75
TRINSEO OP / TRINSEO FIN	30,000.00	26,025.00
TRONOX INC	20,000.00	18,511.90
TWITTER INC	80,000.00	78,841.60
UBER TECHNOLOGIES INC	50,000.00	48,878.50
UBER TECHNOLOGIES INC	50,000.00	48,833.37
UBER TECHNOLOGIES INC	50,000.00	48,863.75
UNDER ARMOUR INC	20,000.00	18,314.08

UNITED RENTALS NORTH AM	70,000.00	68,594.05	
UNITED RENTALS NORTH AM	270,000.00	276,193.80	
UNITED STATES STEEL CORP	30,000.00	20,231.55	
UNITED STATES STEEL CORP	50,000.00	31,680.00	
US CONCRETE INC	30,000.00	28,387.65	
US FOODS INC	20,000.00	19,421.26	
USA COM PART/USA COM FIN	20,000.00	17,485.56	
USA COM PART/USA COM FIN	50,000.00	43,402.50	
USI INC	30,000.00	29,924.10	
VALEANT PHARMACEUTICALS	130,000.00	141,012.30	
VALEANT PHARMACEUTICALS	130,000.00	142,772.50	
VECTOR GROUP LTD	50,000.00	49,373.50	
VEON HOLDINGS BV	200,000.00	201,950.00	
VERISIGN INC	50,000.00	52,902.50	
VERSCEND HOLDING CORP	60,000.00	62,854.50	
VIASAT INC	30,000.00	28,603.65	
VICI PROPERTIES / NOTE	90,000.00	87,356.25	
VICI PROPERTIES / NOTE	100,000.00	94,610.00	
VIKING CRUISES LTD	20,000.00	13,261.00	
VINE OIL & GAS LP / FIN	20,000.00	7,100.00	
VIRGIN MEDIA SECURED FIN	200,000.00	209,390.00	
VISTAJET MALTA/XO MGMT	50,000.00	40,687.75	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	40,000.00	41,278.70	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	50,000.00	51,902.50	
VISTRA OPERATIONS CO LLC	50,000.00	50,972.50	
VOC ESCROW LTD	20,000.00	14,939.00	
VODAFONE GROUP PLC	70,000.00	78,605.04	
W & T OFFSHORE INC	50,000.00	14,373.50	
WASHINGTON PG LP	50,000.00	27,906.75	
WASTE PRO USA INC	30,000.00	29,933.02	
WEATHERFORD INTERNATIONA	50,000.00	34,625.00	
WEST CORP	50,000.00	36,344.00	
WEST STREET MERGER SUB	20,000.00	18,449.40	
WESTERN DIGITAL CORP	110,000.00	110,687.50	
WESTERN MIDSTREAM OPERAT	100,000.00	79,000.00	
WEWORK COS INC	60,000.00	25,048.20	
WOLVERINE ESCROW LLC	100,000.00	73,550.50	
WPX ENERGY INC	50,000.00	39,348.37	
WPX ENERGY INC	60,000.00	44,175.00	
WYNDHAM HOTELS & RESORTS	30,000.00	27,959.02	
WYNN LAS VEGAS LLC/CORP	90,000.00	81,562.50	
WYNN MACAU LTD	200,000.00	187,500.00	

	WYNN RESORTS FINANCE LLC	50,000.00	47,031.25
	XEROX CORPORATION	50,000.00	50,624.50
	XPO LOGISTICS INC	82,000.00	81,972.12
	XPO LOGISTICS INC	50,000.00	51,812.75
	YUM! BRANDS INC	50,000.00	51,090.00
	ZAYO GROUP LLC/ZAYO CAP	100,000.00	94,854.25
	ZIGGO SECURED FINANCE BV	150,000.00	154,222.50
小計	銘柄数：489	31,545,050.00	28,900,793.46
	組入時価比率：93.2%		(3,117,239,582)
			100.0%
合計			3,117,239,582
			(3,117,239,582)

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 4月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	22,575,000	-	22,648,500	73,500
米ドル	22,575,000	-	22,648,500	73,500
合計	22,575,000	-	22,648,500	73,500

(注)時価の算定方法

### 1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## J - R E I T インデックス マザーファンド

### 貸借対照表

(単位:円)

(2020年 4月22日現在)

資産の部
流動資産

(2020年 4月22日現在)

コール・ローン	748,299,251
投資証券	33,329,260,300
派生商品評価勘定	62,802,600
未収入金	466,988,793
未収配当金	311,816,656
差入委託証拠金	226,767,700
流動資産合計	35,145,935,300
資産合計	35,145,935,300
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	139,019,430
未払金	33,517,730
未払解約金	27,333,131
未払利息	882
流動負債合計	199,871,173
負債合計	199,871,173
純資産の部	
元本等	
元本	18,258,534,194
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	16,687,529,933
元本等合計	34,946,064,127
純資産合計	34,946,064,127
負債純資産合計	35,145,935,300

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

## （貸借対照表に関する注記）

2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.9140円
(10,000口当たり純資産額)	(19,140円)

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、REITの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>    市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>    信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>    流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p>    投資証券</p> <p>        （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>    派生商品評価勘定</p> <p>        デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>    コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>        これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>



（その他の注記）

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4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	8,612,461,538円
同期中における一部解約元本額	7,748,174,548円
期末元本額	18,258,534,194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）	2,076,314,614円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,743,700,997円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	808,837,082円
野村資産設計ファンド2015	18,659,130円
野村資産設計ファンド2020	19,130,354円
野村資産設計ファンド2025	21,468,587円
野村資産設計ファンド2030	22,518,958円
野村資産設計ファンド2035	21,001,723円
野村資産設計ファンド2040	36,073,736円
野村資産設計ファンド2045	3,255,991円
野村インデックスファンド・J-REIT	3,232,238,778円
ネクストコア	11,571,705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	1,049,173,812円
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	2,807,870,961円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	691,665,163円
野村資産設計ファンド2050	4,952,009円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,742,337円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,325,015円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,176,783円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,561,905円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	6,501,486円
野村6資産均等バランス	856,193,758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）	97,747,476円
野村資産設計ファンド2060	1,592,726円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	101,514,856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）	53,433,803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）	355,177,002円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,707,871,869円
野村国内外マルチアセット（6資産）オープン投信（適格機関投資家専用）	1,302,526,863円
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス（2%コース向け）（適格機関投資家専用）	51,733円
野村DC運用戦略ファンド	169,627,424円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	11,894,466円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	5,033,789円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	2,639,299円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	4,355,050円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030	1,751,881円

野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	1,354,492円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	736,053円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	290,528円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	513	45,759,600	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	611	53,034,800	
		S O S i L A 物流リート投資法人 投資証券	939	111,834,900	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,401	879,828,000	
		M C U B S M i d C i t y 投資法 人 投資証券	5,408	378,019,200	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,850	645,535,000	
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,429	788,833,700	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,998	1,241,379,000	
		ケネディクス・レジデンシャル・ネ クスト投資法人 投資証券	2,750	454,575,000	
		アクティブ・プロパティーズ投資 法人 投資証券	2,112	644,160,000	
		G L P 投資法人 投資証券	10,499	1,316,574,600	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	1,835	578,025,000	
日本プロロジスリート投資法人 投 資証券	6,343	1,774,137,100			

星野リゾート・リート投資法人 投資証券	641	228,196,000	
Oneリート投資法人 投資証券	657	146,905,200	
イオンリート投資法人 投資証券	4,549	473,096,000	
ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,585	415,143,000	
日本リート投資法人 投資証券	1,369	397,694,500	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	27,080	362,601,200	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	12,325	817,147,500	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	917	87,573,500	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,628	259,177,600	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	899	99,429,400	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	844	73,259,200	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	13,608	1,714,608,000	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	698	39,437,000	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,919	595,688,000	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	1,399	110,241,200	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	415	36,354,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,200	532,800,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	716	39,022,000	
さくら総合リート投資法人 投資証券	912	62,928,000	
投資法人みらい 投資証券	4,794	185,048,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	989	78,328,800	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	830	294,650,000	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	793	107,451,500	

ザイマックス・リート投資法人 投資証券	612	55,630,800	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,196	94,005,600	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	877	101,907,400	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,082	2,575,742,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,215	2,444,700,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,967	897,084,200	
オリックス不動産投資法人 投資証券	8,399	1,075,072,000	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,770	832,385,000	
プレミア投資法人 投資証券	3,807	411,156,000	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,826	377,836,200	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,927	252,892,800	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,464	1,008,862,400	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	3,013	358,547,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	18,490	507,180,700	
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,497	447,752,700	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,625	235,725,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,754	663,714,000	
福岡リート投資法人 投資証券	2,180	222,142,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,304	708,072,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,264	214,118,400	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	973	560,448,000	
阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,904	213,438,400	
スタートアップリート投資法人 投資	656	123,065,600	

		証券			
		大和ハウスリート投資法人 投資証券	6,014	1,508,311,200	
		ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,579	480,696,600	
		大和証券リビング投資法人 投資証券	5,160	447,372,000	
		ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,899	442,926,400	
	小計	銘柄数：63 組入時価比率：95.4%	247,909	33,329,260,300	100.0%
	合計			33,329,260,300	

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 4月22日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	1,191,029,200	-	1,114,893,000	76,216,830
合計	1,191,029,200	-	1,114,893,000	76,216,830

(注) 時価の算定方法

### 1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 海外REITインデックス マザーファンド

### 貸借対照表

(単位：円)

(2020年 4月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	153,003,797
コール・ローン	88,317,381
投資証券	24,149,775,424

(2020年 4月22日現在)

派生商品評価勘定	11,252,680
未収入金	375,137
未収配当金	19,664,129
差入委託証拠金	63,756,816
流動資産合計	24,486,145,364
資産合計	24,486,145,364
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	9,950
未払金	48,361,878
未払解約金	16,497,376
未払利息	104
その他未払費用	688,000
流動負債合計	65,557,308
負債合計	65,557,308
純資産の部	
元本等	
元本	13,267,520,967
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	11,153,067,089
元本等合計	24,420,588,056
純資産合計	24,420,588,056
負債純資産合計	24,486,145,364

## 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>投資証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>先物取引</p> <p>計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。</p> <p>為替予約取引</p> <p>計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<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>配当株式</p> <p>配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

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

## （貸借対照表に関する注記）

2020年 4月22日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.8406円
(10,000口当たり純資産額)	(18,406円)

## （金融商品に関する注記）

## (1)金融商品の状況に関する事項

自 2019年 4月23日 至 2020年 4月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>    市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>    信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>    流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

## (2)金融商品の時価等に関する事項

2020年 4月22日現在
---------------

## 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

## 2. 時価の算定方法

## 投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

## 派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

## コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

## (その他の注記)

## 元本の移動及び期末元本額の内訳

2020年 4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	6,529,816,326円
同期中における一部解約元本額	4,010,032,973円
期末元本額	13,267,520,967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)	2,243,683,380円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,964,823,309円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	874,036,886円
野村資産設計ファンド2015	20,206,115円
野村資産設計ファンド2020	20,672,428円
野村資産設計ファンド2025	23,199,155円
野村資産設計ファンド2030	24,334,158円
野村資産設計ファンド2035	22,694,729円
野村資産設計ファンド2040	38,981,588円
野村資産設計ファンド2045	3,518,470円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,488,415,612円
ネクストコア	6,070,736円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	341,347,180円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	774,669,108円
野村資産設計ファンド2050	5,352,473円
インデックス・ブレンド(タイプ )	1,777,969円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,027,525円
インデックス・ブレンド(タイプ )	7,561,781円
インデックス・ブレンド(タイプ )	2,794,638円
インデックス・ブレンド(タイプ )	7,674,444円
野村6資産均等バランス	925,214,241円
野村資産設計ファンド2060	1,721,128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	1,619,234,742円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	1,236,645,185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)	442,733,479円



ノムラ F O F s 用インデックスファンド・外国 R E I T ( 適格機関投資家専用)	54,451,473円
野村 F O F s 用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	55,907円
野村 D C 運用戦略ファンド	89,341,854円
野村 D C 運用戦略ファンド(マイルド)	6,817,394円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	5,439,585円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	2,851,990円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	4,706,163円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	1,893,114円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	1,463,692円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	795,385円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	313,951円

\*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

## 附属明細表

### 第1 有価証券明細表

#### (1) 株式(2020年4月22日現在)

該当事項はありません。

#### (2) 株式以外の有価証券(2020年4月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	20,300	218,631.00	
		AGREE REALTY CORP	11,200	702,576.00	
		ALEXANDERS INC	500	139,500.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	28,310	4,172,894.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	11,200	285,152.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	31,700	960,510.00	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	25,000	160,000.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	59,100	1,302,564.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	44,500	1,461,380.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	34,600	1,236,950.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	48,900	395,112.00	
		ARA US HOSPITALITY TRUST	107,000	43,870.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,600	9,857.64	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	32,230	5,100,397.50	

BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	23,562.00	
BOSTON PROPERTIES	33,220	2,937,644.60	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,000	14,940.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	40,700	381,766.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	68,100	604,047.00	
BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	12,500	105,125.00	
BRT APARTMENTS CORP	2,400	20,928.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	22,270	1,822,799.50	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	22,100	343,655.00	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	40,000	8,308.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	16,000	11,419.20	
CHATHAM LODGING TRUST	10,800	72,144.00	
CITY OFFICE REIT INC	12,600	106,596.00	
CLIPPER REALTY INC	2,400	11,568.00	
COLONY CAPITAL INC	112,000	215,040.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	26,600	318,136.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	4,800	162,672.00	
CORECIVIC INC	27,600	306,360.00	
COREPOINT LODGING INC	8,900	27,857.00	
CORESITE REALTY CORP	8,630	1,000,475.90	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	25,600	652,288.00	
COUSINS PROPERTIES INC	33,600	950,880.00	
CUBESMART	45,000	1,137,600.00	
CYRUSONE INC	26,100	1,780,020.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	47,000	221,840.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	60,620	8,771,714.00	
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	53,000	133,825.00	
DOUGLAS EMMETT INC	37,600	1,082,128.00	
DUKE REALTY CORP	85,000	2,838,150.00	
EAGLE HOSPITALITY TRUST	100,000	6,800.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	17,100	458,622.00	
EASTGROUP PROPERTIES	8,820	905,814.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	34,600	271,956.00	
EPR PROPERTIES	18,100	422,635.00	

EQUINIX INC	19,690	13,235,618.00	
EQUITY COMMONWEALTH	28,200	930,882.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	42,100	2,482,637.00	
EQUITY RESIDENTIAL	80,600	5,143,086.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	20,600	208,884.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	15,260	3,643,935.40	
EXTRA SPACE STORAGE INC	29,940	2,659,270.80	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	32,945.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	16,300	1,147,683.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	29,100	971,940.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	16,000	314,400.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	25,000	125,500.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	11,300	132,662.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	47,400	1,176,468.00	
GEO GROUP INC/THE	27,600	330,372.00	
GETTY REALTY CORP	7,900	186,282.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	8,300	114,291.00	
GLADSTONE LAND CORP	4,200	52,920.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	9,200	96,968.00	
GLOBAL NET LEASE INC	20,800	260,624.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	30,900	888,993.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	48,200	1,129,808.00	
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	114,400	2,801,656.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,800	37,050.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	23,800	850,374.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	164,900	1,741,344.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	35,800	791,538.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	20,500	186,755.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	15,200	255,056.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	3,950	281,635.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,700	155,817.00	
INVITATION HOMES INC	124,400	2,632,304.00	
IRON MOUNTAIN INC	66,100	1,632,670.00	
JBG SMITH PROPERTIES	27,300	852,852.00	

KILROY REALTY CORP	22,600	1,368,656.00	
KIMCO REALTY CORP	97,500	809,250.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	19,000	142,310.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	56,600	563,736.00	
LIFE STORAGE INC	10,680	947,636.40	
LTC PROPERTIES INC	9,200	302,312.00	
MACERICH CO /THE	26,000	156,520.00	
MACK-CALI REALTY CORP	20,900	303,468.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	343,515	237,025.35	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	118,900	1,839,383.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	26,360	2,834,754.40	
MONMOUTH REIT-CLASS A	22,500	274,050.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	39,800	1,171,314.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	13,400	370,242.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	10,200	509,184.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	18,000	47,700.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	5,400	150,714.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	11,200	277,088.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	50,600	1,455,256.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	3,400	49,674.00	
PARAMOUNT GROUP INC	45,600	381,216.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	55,500	414,585.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	29,700	316,602.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	11,500	9,993.50	
PHYSICIANS REALTY TRUST	45,000	675,900.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	28,800	458,784.00	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	3,400	38,046.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	10,600	68,794.00	
PRIME US REIT	90,000	61,650.00	
PROLOGIS INC	170,480	15,172,720.00	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,570	567,228.40	
PUBLIC STORAGE	34,660	6,616,594.00	
QTS REALTY TRUST INC CL A	13,400	802,794.00	
REALTY INCOME CORP	79,100	3,943,135.00	

REGENCY CENTERS CORP	38,800	1,380,892.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	27,400	210,158.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	50,000	216,000.00	
RETAIL VALUE INC	3,221	32,564.31	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	25,400	1,001,268.00	
RLJ LODGING TRUST	38,900	304,976.00	
RPT REALTY	19,000	99,180.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	12,600	352,800.00	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	48,100	580,326.50	
SAFEHOLD INC	3,100	157,852.00	
SAUL CENTERS INC	2,700	78,381.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	7,000	63,560.00	
SERVICE PROPERTIES TRUST	37,000	211,640.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	70,800	3,792,048.00	
SITE CENTERS CORP	34,000	165,920.00	
SL GREEN REALTY CORP	18,800	843,368.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	22,800	591,888.00	
STAG INDUSTRIAL INC	34,400	850,024.00	
STORE CAPITAL CORP	49,400	776,074.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	24,000	110,640.00	
SUN COMMUNITIES INC	21,430	2,518,025.00	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	51,900	414,681.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	22,000	116,820.00	
TAUBMAN CENTERS INC	14,000	585,480.00	
TERRENO REALTY CORP	15,500	813,595.00	
UDR INC	67,800	2,412,324.00	
UMH PROPERTIES INC	8,400	93,996.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,940	285,944.40	
URBAN EDGE PROPERTIES	27,100	227,369.00	
URSTADT BIDDLE-CL A	6,900	81,144.00	
VENTAS INC	86,200	2,407,566.00	
VEREIT INC	244,000	1,202,920.00	
VICI PROPERTIES INC	106,100	1,628,635.00	
VORNADO REALTY TRUST	36,700	1,323,769.00	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	42,000	29,400.00	

	WASHINGTON REAL ESTATE INV	18,600	396,180.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	27,400	384,422.00	
	WELLTOWER INC	93,700	4,097,501.00	
	WHITESTONE REIT	8,300	45,650.00	
	WP CAREY INC	39,800	2,340,638.00	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	26,300	224,865.00	
小計	銘柄数：157	5,777,596	168,592,728.80 (18,184,411,728)	
	組入時価比率：74.5%		75.3%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	13,800	585,672.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	16,000	134,400.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,600	139,720.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	18,700	840,191.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	36,000	453,960.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	21,000	171,990.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	10,900	138,539.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	12,500	157,625.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	15,700	149,464.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,800	143,276.00	
	FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT	24,900	340,134.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	6,300	385,560.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	30,400	275,120.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	13,700	186,320.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	11,600	184,440.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	4,000	77,000.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	4,600	61,870.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	7,200	246,168.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	18,200	165,438.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	35,400	544,806.00	
	SLATE OFFICE REIT	5,900	22,597.00	
	SLATE RETAIL REIT	4,300	37,496.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	16,800	347,088.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	17,000	156,060.00	

小計	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	10,000	53,700.00
	銘柄数：25	367,300	5,998,634.00 (455,596,252)
	組入時価比率：1.9%		1.9%
ユーロ	AEDIFICA	5,760	520,704.00
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	37,000	498,020.00
	ALTAREA	840	91,560.00
	BEFIMMO S.C.A.	5,200	198,900.00
	COFINIMMO	5,690	688,490.00
	COVIVIO	10,100	593,375.00
	EUROCOMMERCIAL PROPRTI-CVA	8,800	79,816.00
	GECINA SA	12,620	1,438,680.00
	HAMBORNER REIT AG	16,000	124,192.00
	HIBERNIA REIT PLC	156,000	162,864.00
	ICADE	6,590	474,150.50
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,000	35,350.00
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	55,800	424,638.00
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	5,300	113,950.00
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	100,000	117,600.00
	KLEPIERRE	47,900	773,585.00
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,000	52,640.00
	MERCIALYS	5,200	40,586.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	84,900	612,129.00
	MONTEA	2,610	206,451.00
	NSI NV	3,700	133,570.00
	RETAIL ESTATES	2,300	111,550.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	31,900	1,657,524.00
	VASTNED RETAIL NV	4,800	70,752.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	29,400	680,757.00
	WERELDHAVE NV	10,000	68,900.00
小計	銘柄数：26	672,410	9,970,733.50 (1,167,473,185)
	組入時価比率：4.8%		4.8%
英ポンド	AEW UK REIT PLC	32,000	19,520.00
	ASSURA PLC	542,000	414,088.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	36,200	365,620.00

	BRITISH LAND	219,000	855,195.00
	CAPITAL & COUNTIES PROPERTIES PLC	200,000	321,600.00
	CAPITAL & REGIONAL PLC	9,300	9,486.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	146,000	141,620.00
	DERWENT LONDON PLC	24,500	760,480.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	146,000	94,170.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	58,900	387,562.00
	HAMMERSON PLC	181,000	114,681.60
	INTU PROPERTIES PLC	184,000	10,764.00
	LAND SECURITIES GROUP PLC	172,100	1,077,001.80
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	191,000	339,980.00
	LXI REIT PLC	123,000	123,738.00
	NEWRIVER REIT PLC	63,000	36,729.00
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	131,000	87,770.00
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	285,000	436,620.00
	RDI REIT PLC	56,000	32,144.00
	REGIONAL REIT LTD	100,000	73,700.00
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	47,700	319,590.00
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	110,000	43,725.00
	SEGRO PLC	253,600	2,041,480.00
	SHAFTESBURY PLC	50,400	302,652.00
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	80,000	73,600.00
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	386,000	430,776.00
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	198,000	121,968.00
	UNITE GROUP PLC	84,800	653,808.00
	WORKSPACE GROUP PLC	30,000	219,600.00
小計	銘柄数：29	4,140,500	9,909,668.40 (1,313,130,159)
	組入時価比率：5.4%		5.4%
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	86,000	210,700.00
	APN INDUSTRIA REIT	30,000	61,500.00
	ARENA REIT	63,000	137,970.00
	BWP TRUST	111,000	368,520.00
	CENTURIA OFFICE REIT	78,000	141,180.00
	CHARTER HALL GROUP	108,000	757,080.00



	CHARTER HALL LONG WALE REIT	96,000	420,480.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	84,000	262,080.00	
	CHARTER HALL SOCIAL INFRASTRUCTURE REIT	54,000	120,960.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	430,000	331,100.00	
	DEXUS	252,000	2,222,640.00	
	GDI PROPERTY GROUP	130,000	134,550.00	
	GOODMAN GROUP	370,300	4,673,186.00	
	GPT GROUP	442,000	1,653,080.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	68,000	202,640.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	27,000	56,430.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	59,000	204,140.00	
	MIRVAC GROUP	905,000	1,936,700.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	185,000	289,525.00	
	RURAL FUNDS GROUP	80,000	154,000.00	
	SCENTRE GROUP	1,234,000	2,591,400.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	234,000	503,100.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	562,000	1,584,840.00	
	VICINITY CENTRES	746,000	995,910.00	
	VIVA ENERGY REIT	161,000	378,350.00	
小計	銘柄数：25	6,595,300	20,392,061.00	
			(1,382,581,735)	
	組入時価比率：5.7%		5.7%	
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	180,000	186,300.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	264,000	613,800.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	360,000	349,200.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	250,000	395,000.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	80,000	202,000.00	
小計	銘柄数：5	1,134,000	1,746,300.00	
			(112,182,312)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
香港ドル	CHAMPION REIT	460,000	2,111,400.00	
	FORTUNE REIT	330,000	2,326,500.00	
	LINK REIT	484,100	32,555,725.00	
	PROSPERITY REIT	260,000	624,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	240,000	924,000.00	

小計	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	340,000	1,275,000.00
	銘柄数：6	2,114,100	39,816,625.00 (554,247,420)
	組入時価比率：2.3%		2.3%
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	91,000	104,650.00
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	694,760	1,931,432.80
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	429,956	365,462.60
	CACHE LOGISTICS TRUST	209,860	105,979.30
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	666,964	1,000,446.00
	CAPITALAND MALL TRUST	657,000	1,156,320.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	181,136	228,231.36
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	200,000	184,000.00
	ESR REIT	509,760	178,416.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	200,000	95,000.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	120,000	93,000.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	169,596	357,847.56
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	162,000	210,600.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	140,000	68,600.00
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	370,000	357,050.00
	KEPPEL DC REIT	281,211	686,154.84
	KEPPEL REIT	443,000	443,000.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	350,000	50,400.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	502,716	904,888.80
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	343,000	830,060.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	695,000	1,160,650.00
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	490,000	441,000.00
	QUE COMMERCIAL REAL ESTATE I	610,216	234,933.16
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	91,000	303,030.00
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	149,764	45,678.02
	SASSEUR REAL ESTATE INVESTME	103,000	70,040.00
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	161,306	61,296.28
SPH REIT	210,000	164,850.00	
STARHILL GLOBAL REIT	330,000	153,450.00	
SUNTEC REIT	541,000	724,940.00	

小計	銘柄数：30 組入時価比率：3.9%	10,103,245	12,711,406.72 (958,058,724) 4.0%
ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	39,120,000.00
	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD RTS	546	114,660.00
小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.0%	6,546	39,234,660.00 (3,429,109) 0.0%
新シェケル	REIT 1 LTD	40,000	616,000.00
小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.1%	40,000	616,000.00 (18,664,800) 0.1%
合計			24,149,775,424 (24,149,775,424)

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

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

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

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

## 第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2020年 4月22日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	177,801,816	-	188,849,916	11,048,100
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	60,355,370	-	60,550,000	194,630
米ドル	56,955,920	-	57,160,500	204,580
豪ドル	3,399,450	-	3,389,500	9,950
合計	-	-	-	11,242,730

(注)時価の算定方法

### 1 先物取引

外国先物取引について

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

## 2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

## 2【ファンドの現況】

## 【純資産額計算書】

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年5月29日現在

資産総額	147,999,102円
負債総額	5,331,044円
純資産総額（ - ）	142,668,058円
発行済口数	135,119,030口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0559円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年5月29日現在

資産総額	97,470,470円
負債総額	5,127,001円
純資産総額（ - ）	92,343,469円
発行済口数	86,229,868口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0709円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年5月29日現在

資産総額	336,271,676円
負債総額	17,630,132円
純資産総額（ - ）	318,641,544円
発行済口数	295,095,930口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0798円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年5月29日現在

資産総額	90,417,337円
負債総額	5,107,019円
純資産総額（ - ）	85,310,318円
発行済口数	78,638,298口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0848円

## インデックス・ブレンド（タイプ ）

2020年5月29日現在

資産総額	244,538,986円
負債総額	10,763,418円
純資産総額（ - ）	233,775,568円
発行済口数	213,334,672口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0958円

## （参考）国内株式マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	496,510,396,979円
負債総額	51,303,591,123円
純資産総額（ - ）	445,206,805,856円
発行済口数	278,299,200,612口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5997円

## （参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	653,655,170,388円
負債総額	3,355,072,627円
純資産総額（ - ）	650,300,097,761円
発行済口数	235,619,534,120口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7600円

## （参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	92,799,405,191円
負債総額	45,699,911,156円
純資産総額（ - ）	47,099,494,035円
発行済口数	24,168,937,143口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9488円

## （参考）新興国株式マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	38,840,554,370円
負債総額	446,773,081円
純資産総額（ - ）	38,393,781,289円
発行済口数	34,936,154,332口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0990円

（参考）米国株式配当貴族インデックスマザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	28,480,898,889円
負債総額	59,986,878円
純資産総額（ - ）	28,420,912,011円
発行済口数	23,282,834,545口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2207円

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	687,009,471,188円
負債総額	8,282,712,607円
純資産総額（ - ）	678,726,758,581円
発行済口数	509,256,870,430口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3328円

（参考）外国債券マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	579,817,691,368円
負債総額	656,628,954円
純資産総額（ - ）	579,161,062,414円
発行済口数	241,271,659,005口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4005円

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	136,767,786,290円
------	------------------

負債総額	69,401,915,967円
純資産総額（ - ）	67,365,870,323円
発行済口数	54,321,254,783口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2401円

## （参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	7,114,585,928円
負債総額	125,819,134円
純資産総額（ - ）	6,988,766,794円
発行済口数	5,373,894,304口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3005円

## （参考）新興国債券マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	22,262,299,642円
負債総額	200,144,614円
純資産総額（ - ）	22,062,155,028円
発行済口数	11,426,914,644口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9307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

2020年5月29日現在

資産総額	3,750,535,643円
負債総額	88,416,459円
純資産総額（ - ）	3,662,119,184円
発行済口数	3,057,607,208口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1977円

## （参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	38,723,036,122円
負債総額	1,965,430,197円
純資産総額（ - ）	36,757,605,925円
発行済口数	17,180,009,490口



1口当たり純資産額（ / ）	2.1396円
----------------	---------

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2020年5月29日現在

資産総額	26,301,181,151円
負債総額	337,645,816円
純資産総額（ - ）	25,963,535,335円
発行済口数	13,020,418,851口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9941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

2020年5月29日現在

資産総額	13,248,774,385円
負債総額	6,938,926,244円
純資産総額（ - ）	6,309,848,141円
発行済口数	5,019,418,263口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2571円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

す。

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

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

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

(5) 受益権の再分割

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

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取扱い

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

### 第三部【委託会社等の情報】

#### 第1【委託会社等の概況】

##### 1【委託会社等の概況】

###### (1)資本金の額

2020年5月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

###### (2)会社の機構

###### (a)会社の意思決定機構

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

###### 株主総会

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

###### 取締役会

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

###### 代表取締役・業務執行取締役

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

###### 監査等委員会

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

## (b)投資信託の運用体制



## 2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2020年4月30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	1,014	27,839,261
単位型株式投資信託	178	815,084
追加型公社債投資信託	14	5,415,240
単位型公社債投資信託	459	1,603,257
合計	1,665	35,672,842

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2019年4月1日から2020年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

#### (1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(2019年3月31日)	(2020年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
<b>(資産の部)</b>			
<b>流動資産</b>			
現金・預金		1,562	2,626
金銭の信託		45,493	41,524
有価証券		19,900	24,399
前払費用		27	106
未収入金		500	522
未収委託者報酬		25,246	23,936
未収運用受託報酬		5,933	4,336
その他		269	71
貸倒引当金		15	14
流動資産計		98,917	97,509
<b>固定資産</b>			
<b>有形固定資産</b>			
建物	2	320	295
器具備品	2	393	349
<b>無形固定資産</b>			
ソフトウェア		6,437	5,893
その他		0	0

投資その他の資産		18,608		16,486
投資有価証券		1,562	1,437	
関係会社株式		12,631	10,171	
従業員長期貸付金		-	16	
長期差入保証金		235	329	
長期前払費用		22	19	
前払年金費用		2,001	1,545	
繰延税金資産		2,694	2,738	
その他		168	229	
貸倒引当金		-	0	
投資損失引当金		707	-	
固定資産計		25,761		23,026
資産合計		124,679		120,536

区分	注記 番号	前事業年度 (2019年3月31日)		当事業年度 (2020年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
<b>(負債の部)</b>					
流動負債					
預り金			145		157
未払金			16,709		15,279
未払収益分配金		0		0	
未払償還金		25		3	
未払手数料		7,724		6,948	
関係会社未払金		7,422		7,262	
その他未払金		1,535		1,063	
未払費用	1		11,704		10,290
未払法人税等			1,560		1,564
前受収益			29		26
賞与引当金			3,792		3,985
その他			-		67
流動負債計			33,942		31,371
固定負債					
退職給付引当金			3,219		3,311
時効後支払損引当金			558		572
固定負債計			3,777		3,883
負債合計			37,720		35,254
<b>(純資産の部)</b>					
株主資本					
資本金			86,924		85,270
資本剰余金			17,180		17,180
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			56,014		54,360
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,329		53,675	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,723		29,069	
評価・換算差額等			33		10
その他有価証券評価差額金			33		10

純資産合計		86,958	85,281
負債・純資産合計		124,679	120,536

## (2) 【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		119,196	115,736
運用受託報酬		21,440	17,170
その他営業収益		355	340
営業収益計		140,992	133,247
営業費用			
支払手数料		42,675	39,435
広告宣伝費		1,210	1,006
公告費		0	-
調査費		30,082	26,833
調査費		5,998	5,696
委託調査費		24,083	21,136
委託計算費		1,311	1,342
営業雑経費		5,435	5,823
通信費		92	75
印刷費		970	958
協会費		86	92
諸経費		4,286	4,696
営業費用計		80,715	74,440
一般管理費			
給料		11,113	11,418
役員報酬		379	109
給料・手当		7,067	7,173
賞与		3,666	4,134
交際費		107	86
旅費交通費		514	391
租税公課		1,048	1,029
不動産賃借料		1,223	1,227
退職給付費用		1,474	1,486
固定資産減価償却費		2,835	2,348
諸経費		10,115	10,067
一般管理費計		28,433	28,055
営業利益		31,843	30,751

	前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
--	--	--

区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	6,538		4,936	
受取利息		0		0	
その他		424		309	
営業外収益計			6,964		5,246
営業外費用					
支払利息	1	1		-	
金銭の信託運用損		489		230	
投資事業組合等評価損		-		146	
時効後支払損引当金繰入額		43		18	
為替差損		34		23	
その他		17		23	
営業外費用計			585		443
經常利益			38,222		35,555
特別利益					
投資有価証券等売却益		20		21	
関係会社清算益	3	29		-	
株式報酬受入益		85		59	
特別利益計			135		81
特別損失					
投資有価証券等評価損		938		119	
関係会社株式評価損		161		1,591	
固定資産除却損	2	310		67	
投資損失引当金繰入額		707		-	
特別損失計			2,118		1,778
税引前当期純利益			36,239		33,858
法人税、住民税及び事業税			10,196		9,896
法人税等調整額			370		34
当期純利益			25,672		23,996

## (3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剰余金の配当							24,826	24,826	24,826



当期純利益							25,672	25,672	25,672
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924
当期変動額									
剰余金の配当							25,650	25,650	25,650
当期純利益							23,996	23,996	23,996
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純 額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	1,653	1,653	1,653
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,069	54,360	85,270

(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
当期変動額			
剰余金の配当			25,650
当期純利益			23,996
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	23	23	23
当期変動額合計	23	23	1,676
当期末残高	10	10	85,281

## [重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>								
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table style="margin-left: 40px;"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>								

<p>5 . 消費税等の会計処理方法</p> <p>6 . 連結納税制度の適用</p>	<p>(3) 退職給付引当金  従業員からの退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。  退職給付見込額の期間帰属方法  退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。  数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法  確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。  退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金  時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理してまいります。</p> <p>連結納税制度を適用しております。  なお、当社は、「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号）において創設されたグループ通算制度への移行及びグループ通算制度への移行にあわせて単体納税制度の見直しが行われた項目については、「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」（実務対応報告第39号 2020年3月31日）第3項の取扱いにより、「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 2018年2月16日）第44項の定めを適用せず、繰延税金資産及び繰延税金負債の額について、改正前の税法の規定に基づいております。</p>
---	---

#### [ 未適用の会計基準等 ]

- ・ 「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31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 2020年3月31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せん。

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。

- ・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日）
- ・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 2019年7月4日）
- ・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 2019年7月4日）
- ・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 2020年3月31日）

## (1) 概要

国際的な会計基準の定めとの比較可能性を向上させるため、「時価の算定に関する会計基準」及び「時価の算定に関する会計基準の適用指針（以下「時価算定会計基準等」という。）が開発され、時価の算定方法に関するガイダンス等が定められました。時価算定会計基準等は次の項目の時価に適用されます。

- ・「金融商品に関する会計基準」における金融商品

また「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」が改訂され、金融商品の時価のレベルごとの内訳等の注記事項が定められました。

## (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。

- ・「会計方針の開示、会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 2020年3月31日）

## (1) 概要

関連する会計基準等の定めが明らかでない場合に、採用した会計処理の原則及び手続きの概要を示すことを目的とするものです。

## (2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

- ・「会計上の見積りの開示に関する会計基準（企業会計基準第31号 2020年3月31日）」

## (1) 概要

当年度の財務諸表に計上した金額が会計上の見積りによるもののうち、翌年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクがある項目における会計上の見積りの内容について、財務諸表利用者の理解に資する情報を開示することを目的とするものです。

## (2) 適用予定日

2021年3月期の年度末より適用予定であります。

## [注記事項]

## 貸借対照表関係

前事業年度末 (2019年3月31日)	当事業年度末 (2020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 1,434百万円	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 1,296百万円

2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額		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	建物	761百万円
器具備品	3,106	器具備品	2,347
合計	3,842	合計	3,109

## 損益計算書関係

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020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 6,531百万円 支払利息 1	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 4,931百万円
2. 固定資産除却損 器具備品 3百万円 ソフトウェア 307 合計 310	2. 固定資産除却損 器具備品 7百万円 ソフトウェア 59 合計 67
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 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

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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

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

##### (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

2020年5月19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	23,950百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,650円
基準日	2020年3月31日
効力発生日	2020年6月30日

#### 金融商品関係

前事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

#### 1. 金融商品の状況に関する事項

##### (1) 金融商品に対する取組方針

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

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

##### (2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒

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

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

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

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

## (1) 現金・預金

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

## (2) 金銭の信託

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

## (3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

## (5) 有価証券及び投資有価証券

## その他有価証券

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

## (6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,562百万円、関係会社株式12,631百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について1,100百万円（投資有価証券938百万円、関係会社株式161百万円）減損処理を行っております。

## 注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	1,562	-	-	-
金銭の信託	45,493	-	-	-
未収委託者報酬	25,246	-	-	-
未収運用受託報酬	5,933	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	19,900	-	-	-
合計	98,136	-	-	-



当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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

2020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	2,626	2,626	-
(2)金銭の信託	41,524	41,524	-
(3)未収委託者報酬	23,936	23,936	-
(4)未収運用受託報酬	4,336	4,336	-
(5)有価証券及び投資有価証券	24,399	24,399	-
その他有価証券	24,399	24,399	-
資産計	96,823	96,823	-
(6)未払金	15,279	15,279	-
未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	3	3	-
未払手数料	6,948	6,948	-
関係会社未払金	7,262	7,262	-
その他未払金	1,063	1,063	-
(7)未払費用	10,290	10,290	-
(8)未払法人税等	1,564	1,564	-
負債計	27,134	27,134	-

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

譲渡性預金及びコマーシャル・ペーパー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1,437百万円、関係会社株式10,171百万円）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。当事業年度において、非上場株式について2,416百万円（投資有価証券117百万円、関係会社株式2,298百万円）減損処理を行っております。なお、関係会社株式に係る評価損は、過年度に計上しておりました関係会社株式に対する投資損失引当金の戻入益707百万円と相殺し、関係会社株式評価損1,591百万円を特別損失に計上しております。

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	2,626	-	-	-
金銭の信託	41,524	-	-	-
未収委託者報酬	23,936	-	-	-
未収運用受託報酬	4,336	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	24,399	-	-	-
合計	96,823	-	-	-

#### 有価証券関係

前事業年度（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。

当事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

1．売買目的有価証券(2020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(2020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(2020年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2020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	4,400	4,400	-
コマーシャル・ペーパー	19,999	19,999	-
小計	24,399	24,399	-
合計	24,399	24,399	-

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2019年4月1日 至 2020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 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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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	23,551 百万円
勤務費用	1,034
利息費用	154
数理計算上の差異の発生額	138
退職給付の支払額	858
その他	17
退職給付債務の期末残高	23,761

## (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	17,469 百万円
期待運用収益	436
数理計算上の差異の発生額	393
事業主からの拠出額	566
退職給付の支払額	666
年金資産の期末残高	17,413

## (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	20,462 百万円
年金資産	17,413
	3,048
非積立型制度の退職給付債務	3,299
未積立退職給付債務	6,347
未認識数理計算上の差異	4,764
未認識過去勤務費用	185
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766
退職給付引当金	3,311
前払年金費用	1,545
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,766

## (4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	1,034 百万円
利息費用	154
期待運用収益	436
数理計算上の差異の費用処理額	572
過去勤務費用の費用処理額	35
確定給付制度に係る退職給付費用	1,289

(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	57%
株式	24%
生保一般勘定	12%
生保特別勘定	7%
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	0.6%
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、202百万円でした。	

## 税効果会計関係

前事業年度末 (2019年3月31日)		当事業年度末 (2020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	1,175	賞与引当金	1,235
退職給付引当金	998	退職給付引当金	1,026
関係会社株式評価減	51	関係会社株式評価減	762
投資有価証券評価減	708	投資有価証券評価減	462
未払事業税	288	未払事業税	285
時効後支払損引当金	172	時効後支払損引当金	177
減価償却超過額	171	減価償却超過額	171
ゴルフ会員権評価減	192	ゴルフ会員権評価減	167
関係会社株式売却損	148	関係会社株式売却損	148
未払社会保険料	82	未払社会保険料	97
その他	633	その他	219
繰延税金資産小計	4,625	繰延税金資産小計	4,754
評価性引当額	1,295	評価性引当額	1,532
繰延税金資産合計	3,329	繰延税金資産合計	3,222
繰延税金負債		繰延税金負債	
その他有価証券評価差額金	15	その他有価証券評価差額金	4
前払年金費用	620	前払年金費用	478
繰延税金負債合計	635	繰延税金負債合計	483
繰延税金資産の純額	2,694	繰延税金資産の純額	2,738

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 (調整)	法定実効税率 (調整)
31.0%	31.0%
交際費等永久に損金に算入されない項目	交際費等永久に損金に算入されない項目
0.1%	0.0%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	受取配当金等永久に益金に算入されない項目
5.6%	4.4%
タックスヘイブン税制	タックスヘイブン税制
2.6%	2.6%
外国税額控除	外国税額控除
0.6%	0.7%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税
0.3%	0.2%
その他	その他
1.3%	0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率	税効果会計適用後の法人税等の負担率
29.1%	29.1%

## セグメント情報等

前事業年度(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。

当事業年度(自 2019年4月1日 至 2020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 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

## 1. 関連当事者との取引

## (ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等  
該当はありません。

## (ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との 関係	取引の内容	取引 金額 (百万円)	科目	期末 残高 (百万円)
親会社の 子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託 の募集の取扱 及び売上の取扱 ならびに投資 信託に係る 事務代行の委 託等 役員の兼任	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払(*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㈱（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 2019年4月1日 至 2020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

該当はありません。

## (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(*1)	31,378	未払手数料	5,536
							コマーシャル・ペーパーの購入(*2)	20,000	有価証券	19,999
							有価証券受取利息	0	その他営業外収益	0

## (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) 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) コマーシャル・ペーパーの購入については、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. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

## (1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、

ニューヨーク証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

前事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)		当事業年度 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,882円89銭	1株当たり純資産額	16,557円31銭
1株当たり当期純利益	4,984円30銭	1株当たり当期純利益	4,658円88銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	25,672百万円	損益計算書上の当期純利益	23,996百万円
普通株式に係る当期純利益	25,672百万円	普通株式に係る当期純利益	23,996百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。		普通株主に帰属しない金額の主要な内訳 該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

## 5【その他】

### (1) 定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託者

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

\* 2020年4月末現在

#### (2) 販売会社

(a) 名称	(b) 資本金の額 <sup>*</sup>	(c) 事業の内容
株式会社 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	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社京葉銀行	49,759百万円	
株式会社百五銀行	20,000百万円	
株式会社北越銀行	24,538百万円	

\* 2020年4月末現在

## 2【関係業務の概要】

### (1) 受託者

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

## (2) 販売会社

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

## 3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

### (1) 受託者

該当事項はありません。

### (2) 販売会社

該当事項はありません。

## 第3【その他】

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

## 独立監査人の監査報告書

2020年6月10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 東京事務所

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

#### 監査意見

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。

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2020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、全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。

#### 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

#### 財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成すること

が適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

#### 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

## 利害関係

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

以 上

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



## 独立監査人の監査報告書

2020年6月12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

東京事務所

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

## 監査意見

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2020年4月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。  
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

2020年6月12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

東京事務所

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

## 監査意見

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2020年4月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。  
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

2020年6月12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

東京事務所

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

## 監査意見

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2020年4月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。  
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

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

## 独立監査人の監査報告書

2020年6月12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

東京事務所

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

## 監査意見

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2020年4月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。  
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



## 独立監査人の監査報告書

2020年6月12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

東京事務所

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

## 監査意見

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2020年4月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、インデックス・ブレンド（タイプ ）の2020年4月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、野村アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。  
監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 利害関係

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

以 上

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