

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2018年9月13日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼執行役社長 渡邊 国夫
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	野村資産設計ファンド（DC）2040
【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】	4兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

野村資産設計ファンド（DC）2040

（以下「ファンド」といいます。なお、ファンドの愛称を「未来時計DC2040」とします。）

（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】

4兆円を上限とします。

（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】

ありません。

(6) 【申込単位】

1円以上1円単位(当初元本1口=1円)

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

(7) 【申込期間】

2018年9月14日から2019年9月18日まで

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

(8) 【申込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時~午後5時

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

(9) 【払込期日】

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

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

各取得申込日の発行価額の総額は、各販売会社によって、追加信託が行なわれる日に、「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。

(10) 【払込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時~午後5時

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

(11) 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(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】

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

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

国内および外国（新興国を含む）の各債券、国内および外国（新興国を含む）の各株式、国内および外国の各不動産投資信託証券（REIT）を投資対象とする別に定める親投資信託証券（マザーファンド）を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目的に運用を行なうことを基本とします。

投資対象とする別に定める親投資信託証券とは「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」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」とします。

信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、2兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

<商品分類>

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

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

(野村資産設計ファンド(DC)2040)

《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)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ()	
		資産複合	

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を含む)			
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年2回 年4回 年6回 (隔月) 年12回 (毎月)	日本 北米 欧州 アジア オセアニア	ファミリーファンド	あり ()	日経225 T O P I X
不動産投信	日々 その他 ()	中南米 アフリカ 中近東 (中東) エマージング	ファンド・オブ・ ファンズ	なし	その他 (合成指数)
その他資産 (投資信託証券 (資産複合 (株式、債券、 不動産投信) 資産配分変更型))					
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

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

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

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

があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

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

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

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

[投資形態による属性区分]

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

[為替ヘッジによる属性区分]

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

[インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分]

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

[特殊型]

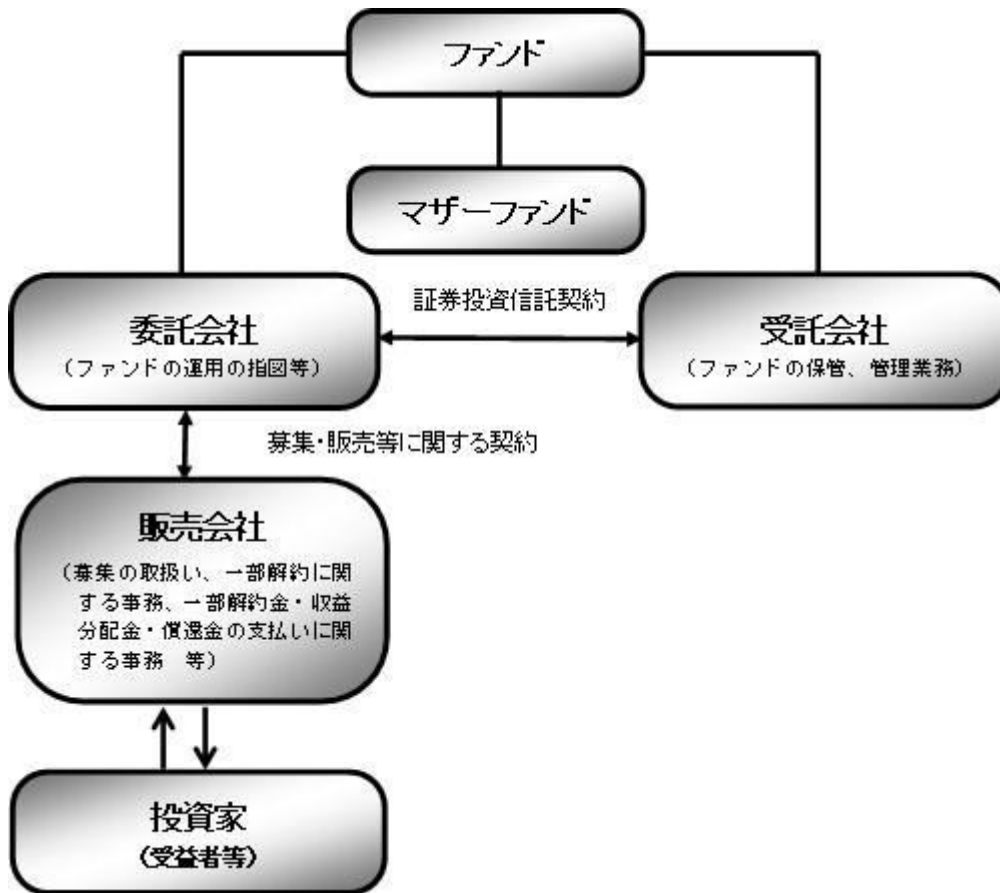
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定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

(2) 【ファンドの沿革】

2017年8月31日

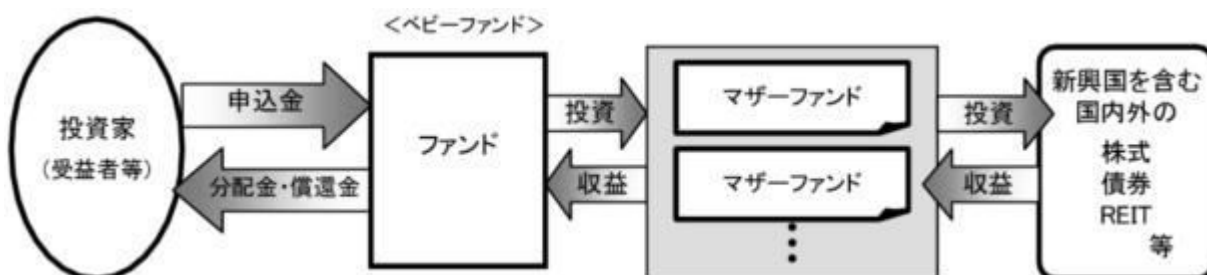
信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(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	野村資産設計ファンド (DC) 2040
マザーファンド (親投資信託)	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
	新興国債券 (現地通貨建て) マザーファンド
	国内株式マザーファンド
	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド
	新興国株式マザーファンド
	J-REITインデックス マザーファンド
	海外REITインデックス マザーファンド
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

委託会社の概況(2018年7月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

2003年6月27日

委員会等設置会社へ移行

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

2040年6月の決算日の翌日(第24計算期間開始日)をターゲットイヤー(安定運用開始時期)とし、ターゲットイヤーに近づくにしたがって、リスクを徐々に減らすことを基本とします。

投資を行なうマザーファンドは、原則として、金融指標の動きに連動する投資成果を目指すものとします。

一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。また、基本投資割合の変更に際し、新たにマザーファンドを投資対象に追加する場合があります。

当初設定時に投資するマザーファンドは、以下の通りです。各マザーファンドは、各々以下の対象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
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)

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。
国内株式マザーファンド	わが国の株式	東証株価指数（TOPIX）
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） ・ MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が円換算したものです。
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証券） ^{*1} を含みます。）	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース） ・ MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。
J-REITインデックスマザーファンド	J-REIT ^{*2}	東証REIT指数（配当込み）
海外REITインデックスマザーファンド	日本を除く世界各国のREIT ^{*3}	S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース） ・ S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

*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。

ファンドは、投資対象とする各マザーファンドが連動を目指す対象指数の月次リターンに、各マザーファンドへの基本投資割合を掛け合わせた合成指数をベンチマークとします。

当初設定以降、定期的に各マザーファンドへの基本投資割合を変更し、安定運用開始時期に近づくとしたがつて、株式への実質投資割合を徐々に減らし債券への実質投資割合を徐々に増やすことで、リスクを徐々に減らすことを基本とします。

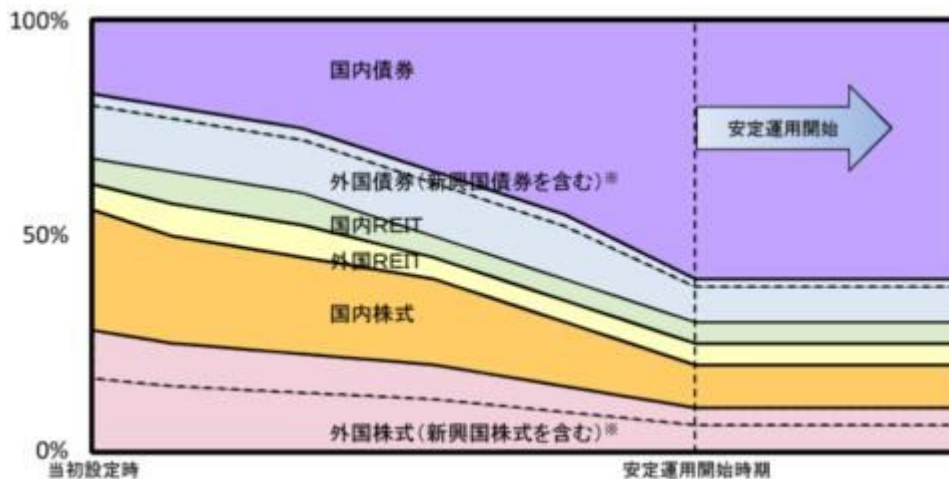
定期的な基本投資割合の変更は、家計や市場の構造変化等を考慮し、原則年1回行なうことを基本とします。

当初設定時および安定運用開始時期以降のマザーファンドを通じた各資産への基本投資割合はそれぞれ以下を基本とします。

基本投資割合

		当初設定時	安定運用 開始時期以降	2018年9月 現在
国内債券	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	17.0%	60%	18.0%
外国債券	外国債券マザーファンド	12.3%	10%	12.1%
	新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	2.7%		2.9%
国内株式	国内株式マザーファンド	28.0%	10%	27.0%
外国株式	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	16.8%	10%	16.0%
	新興国株式マザーファンド	11.2%		11.0%
国内REIT	J-REITインデックス マザーファンド	6.0%	5%	6.5%
外国REIT	海外REITインデックス マザーファンド	6.0%	5%	6.5%

基本投資割合のイメージ図



新興国債券、新興国株式の割合は、各々外国債券、外国株式内に点線で示しています。

*上記の図表は現時点で決定している基本投資割合をもとにしたイメージ図です。

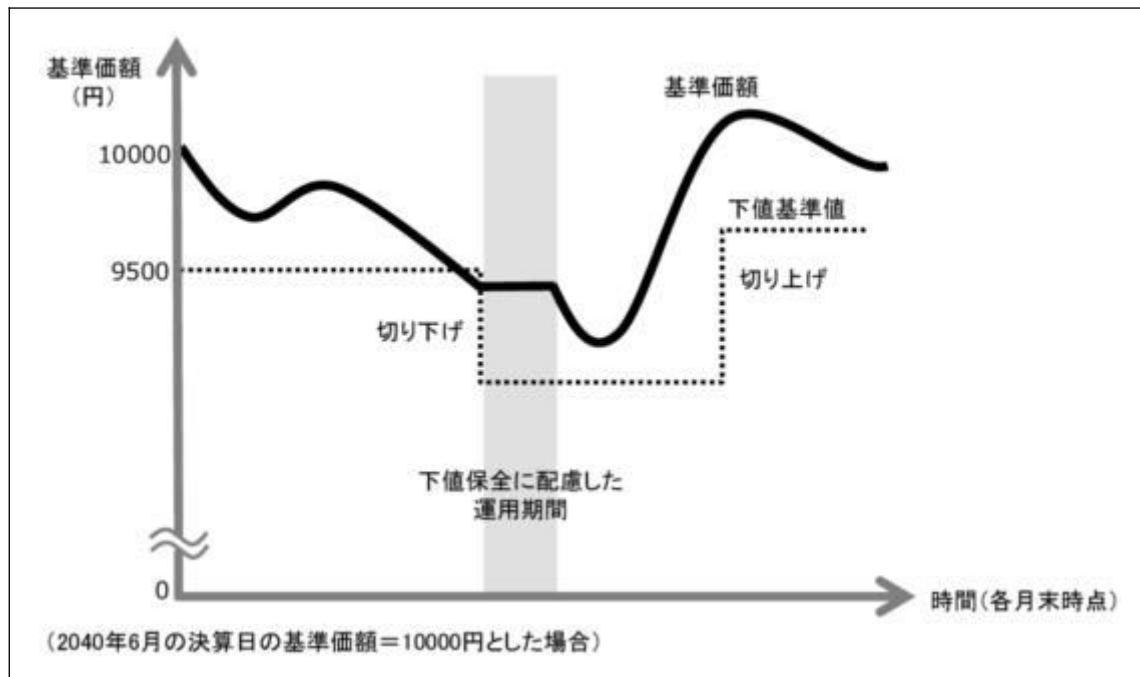
安定運用開始時期以降は、各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投資する各資産への実質的なエクスポージャーを引き下げ、短期有価証券等へ投資する運用（「下値保全に配慮した運用」といいます。）を行ないます。

各資産への実質的なエクスポージャーをゼロに近づけることを基本とします。

下値保全に配慮した運用を行なうにあたっては、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等の売建てを行なう場合があります。

- ・委託会社の定める下値基準値は、当初、2040年6月の決算日の基準価額の95%程度とします。毎月末の基準価額を勘案して下値基準値を見直すことを基本とし、原則として、月末の基準価額が下値基準値を下回った場合には切り下げを行ない、月末の基準価額が直近の下値基準値改定時（一度も改定されていない場合は2040年6月の決算日）の基準価額を一定水準上回った場合には切り上げを行ないます。
- ・下値保全に配慮した運用に切り替えた場合の、下値保全に配慮した運用を行なう一定期間は、3ヵ月程度を基本とします。なお、当該期間は、市況動向等により見直される場合があります。
- ・下値保全に配慮した運用期間終了後は、安定運用期における基本投資割合となるよう、各資産への実質的なエクスポージャーを引き上げます。

基準価額と下値保全に配慮した運用（イメージ図）



実質組入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。ただし、2040年6月の決算日の翌日以降、下値保全に配慮した運用を行なう場合においては為替ヘッジを行なう場合があります。

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

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、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」

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

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

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド（英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員）及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

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

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

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問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIとその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、本ファンドまたは本ファンドの発行会社あるいは所有者に関わらず、MSCIにより決定、作成、及び計算されています。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、本ファンドの発行者または所有者の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、本ファンドを現金に償還する方程式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

本証券の購入者、販売者、または所有者あるいはいかなる個人・法人は、MSCIの許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCIに問い合わせることなく、本証券を保証、推奨、売買、又は宣伝するためにいかなるMSCIのトレードネーム、トレードマーク、又はサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCIの書面による許諾を得ることなくMSCIとの関係を一切主張することはできません。

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R

E I T 指数（配当込み）に関するすべての権利及び東証 R E I T 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 R E I T 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 R E I T 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 R E I T 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 R E I T 指数（配当込み）の商標の使用もしくは東証 R E I T 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 R E I T 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 R E I T 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 R E I T 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 R E I T 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 R E I T 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、参加もしておりません。

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

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

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

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

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

別に定めるマザーファンドを主要投資対象とし、実質的に国内および外国（新興国を含む）の各債券、国内および外国（新興国を含む）の各株式、国内および外国の各不動産投資信託証券（REIT）に投資を行ない

ます。なお、短期有価証券等に直接投資する場合があります。また、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等を取引対象とします。

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
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
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
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。）
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

投資の対象とする資産の種類（信託約款）

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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

イ．有価証券

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

ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

- 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ロ．次に掲げるものをすべてみだす資産

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

有価証券の指図範囲等（信託約款）

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

- 株券または新株引受権証券

- 国債証券

- 地方債証券

- 特別の法律により法人の発行する債券

- 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。）

- 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。）

- 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. 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。

4. 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。

5. 直物為替先渡取引

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

(参考)各マザーファンドの概要

(国内債券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-債券・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。

（国内株式マザーファンド）

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

（外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド）

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

（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。

（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。

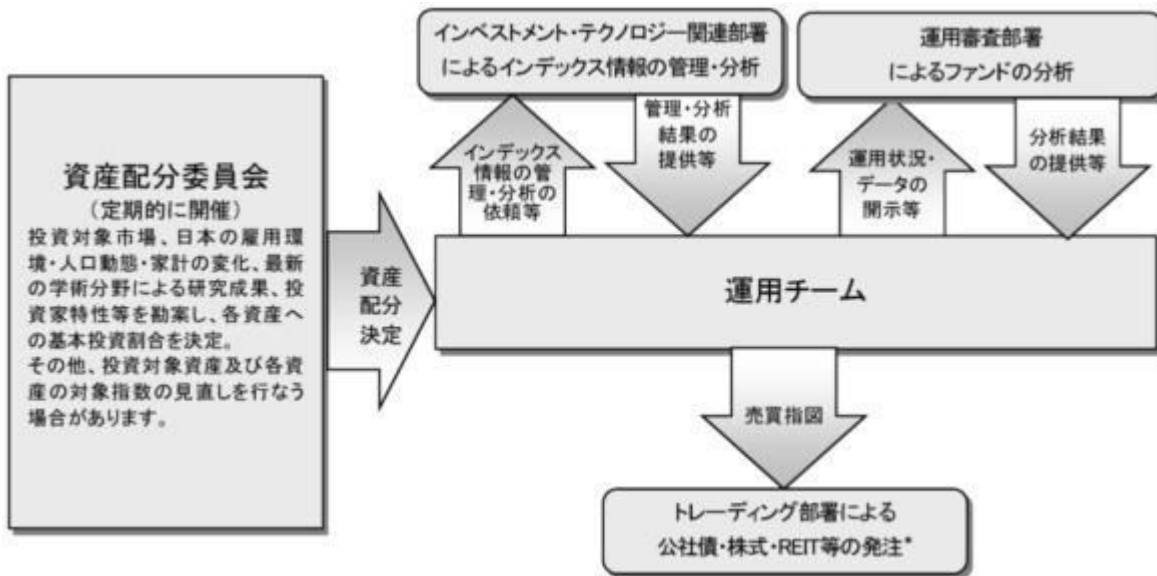
同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、当該REITをS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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。

(3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。



*新興国債券（現地通貨建て）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、）の一部をノムラ・アセット・マネジメントU.K.リミテッドに代行させます。

運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

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

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

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

ファンドの決算日

原則として**毎年6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、)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。

有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- ()委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。

1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。

()上記()に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。

()委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

公社債の借入れ(信託約款)

()委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行なうにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行なうものとします。

()上記()の指図は、当該借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。

()信託財産の一部解約等の事由により、上記()の借入れにかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

()上記()の借入れにかかる品貸料は信託財産中から支弁します。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

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

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

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

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

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

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

資金の借入れ(信託約款)

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

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

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

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

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

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

[REITの価格変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

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

[為替変動リスク]

ファンドは、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジを行ないませんので、為替変動の影

響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されます。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

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

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

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

ファンドの基準価額とファンドのベンチマークである合成指数は、費用等の要因により、完全に一致するものではありません。また、ファンドの投資成果が合成指数に連動または上回ることを保証するものではありません。なお、下値保全に配慮した運用期間中は、ファンドの基準価額は合成指数に連動しません。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。

安定運用開始時期以降の運用においては、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、下値保全に配慮した運用への切り替えを行なうことで、基準価額の大幅な下落を回避することを目指しますが、必ずしもある一定水準の基準価額が保全されることを示唆するものではありません。

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

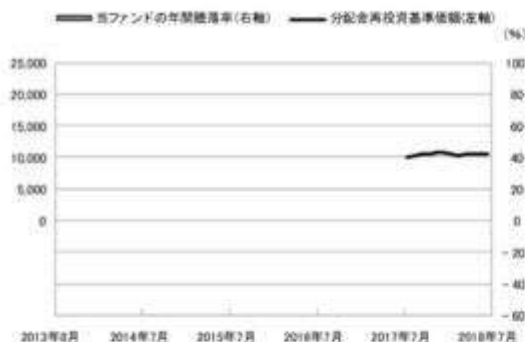


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

リスクの定量的比較

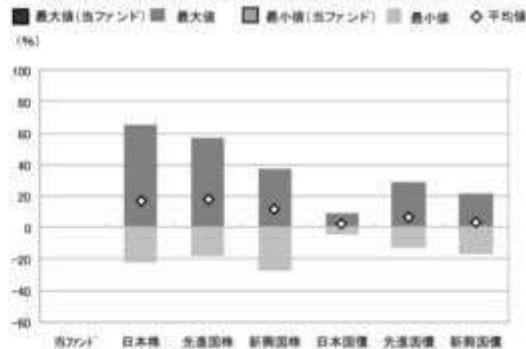
(2013年8月末～2018年7月末:月次)

〈ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移〉



- * 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、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

〈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(%)	—	65.0	57.1	37.2	9.3	29.1
最小値(%)	—	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3
平均値(%)	—	17.3	17.5	11.4	2.2	6.2

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2013年8月から2018年7月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの騰落率につきましては、運用期間が1年未満であるため掲載しておりません。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

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

＜代表的な資産クラスの指数＞

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

■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■

- 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)・・・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)は、株式会社東京証券取引所(株東京証券取引所)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、株東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、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なく、株東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSAI指数(配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド(円ベース)」(ここでは「指数」と呼びます)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IRMーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価値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は法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、JPMC)がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMC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、またはマーケティング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JP Morgan Securities LLC(ここでは「JPMSLLC」と呼びます)は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての奨励、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JP MorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPMS, JP Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

申込手数料はありません。

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に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。

計算期間	信託報酬率	< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
1期～23期 (設定日～ 2040年決算日)	年0.4536% (税抜年0.42%)	年0.19%	年0.19%	年0.04%
24期以降 (2040年決算日翌日以降)	年0.4104% (税抜年0.38%)	年0.17%	年0.17%	年0.04%

支払先の役務の内容

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

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

なお、上記以外の受益者(法人)の場合の課税の取扱いは以下の通りです。

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

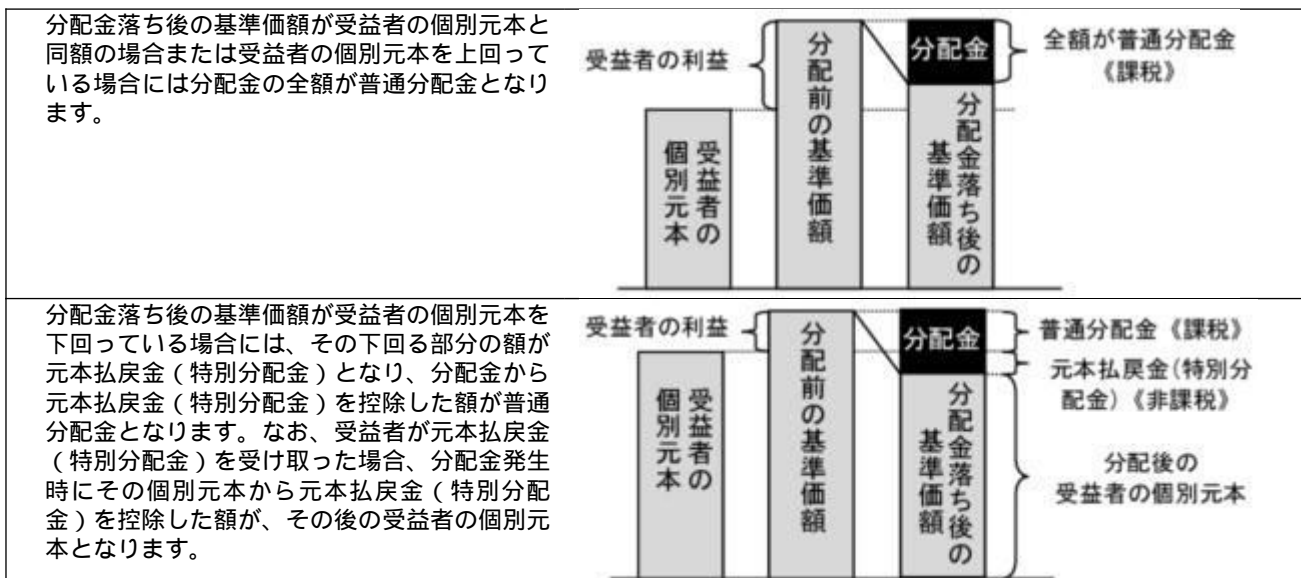
換金(解約)時および償還時の課税について

換金(解約)時および償還時の個別元本超過額が課税対象となります。

詳しくは販売会社にお問い合わせください。

分配金の課税について

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



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

* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(2018年7月末現在)が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2018年7月31日現在の運用状況であります。

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

(1)【投資状況】

野村資産設計ファンド(DC)2040

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	4,031,366	99.89
現金・預金・その他資産(負債控除後)		4,039	0.10
合計(純資産総額)		4,035,405	100.00

(参考)国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	530,545,588,270	80.22
地方債証券	日本	43,851,861,971	6.63
特殊債券	日本	55,719,356,636	8.42
社債券	日本	28,741,826,930	4.34
現金・預金・その他資産(負債控除後)		2,491,637,385	0.37
合計(純資産総額)		661,350,271,192	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	268,009,462,418	43.42
	カナダ	12,539,074,569	2.03
	メキシコ	5,248,824,301	0.85
	ドイツ	39,756,363,562	6.44
	イタリア	57,525,594,005	9.32
	フランス	60,639,697,553	9.82
	オランダ	12,788,708,528	2.07
	スペイン	42,849,116,312	6.94
	ベルギー	14,971,873,132	2.42
	オーストリア	8,865,779,249	1.43
	フィンランド	3,141,590,459	0.50
	アイルランド	6,905,747,953	1.11
	イギリス	42,597,502,437	6.90
	スイス	822,205,536	0.13

	スウェーデン	2,390,441,341	0.38
	ノルウェー	1,382,090,482	0.22
	デンマーク	3,738,265,464	0.60
	ポーランド	3,995,229,922	0.64
	オーストラリア	13,079,944,270	2.11
	シンガポール	2,404,291,064	0.38
	マレーシア	3,011,526,031	0.48
	南アフリカ	3,761,272,139	0.60
	小計	610,424,600,727	98.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,746,193,849	1.09
合計（純資産総額）		617,170,794,576	100.00

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アルゼンチン	69,636,173	0.88
	メキシコ	795,365,129	10.13
	ブラジル	797,550,614	10.16
	チリ	201,873,562	2.57
	コロンビア	632,412,032	8.05
	ペルー	223,592,515	2.84
	ウルグアイ	12,694,110	0.16
	トルコ	369,181,142	4.70
	チェコ	353,189,108	4.49
	ハンガリー	355,138,829	4.52
	ポーランド	689,209,389	8.78
	ロシア	584,314,371	7.44
	ルーマニア	195,758,672	2.49
	マレーシア	420,805,513	5.36
	タイ	603,061,965	7.68
	フィリピン	20,806,577	0.26
	インドネシア	689,457,788	8.78
	南アフリカ	653,209,596	8.32
	小計	7,667,257,085	97.67
現金・預金・その他資産（負債控除後）		182,313,240	2.32
合計（純資産総額）		7,849,570,325	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	382,833,796,660	98.89

現金・預金・その他資産（負債控除後）		4,270,140,191	1.10
合計（純資産総額）		387,103,936,851	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	4,247,640,000	1.09

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	328,243,624,185	63.76
	カナダ	18,975,553,691	3.68
	ドイツ	19,130,821,216	3.71
	イタリア	4,736,366,356	0.92
	フランス	20,801,912,989	4.04
	オランダ	6,814,457,226	1.32
	スペイン	6,094,645,298	1.18
	ベルギー	2,138,211,625	0.41
	オーストリア	482,635,768	0.09
	ルクセンブルグ	119,477,781	0.02
	フィンランド	2,036,117,115	0.39
	アイルランド	1,072,382,192	0.20
	ポルトガル	336,379,415	0.06
	イギリス	34,353,319,257	6.67
	スイス	16,032,146,263	3.11
	スウェーデン	5,236,387,070	1.01
	ノルウェー	1,431,586,406	0.27
	デンマーク	3,416,136,561	0.66
	オーストラリア	12,637,095,592	2.45
	ニュージーランド	408,345,569	0.07
香港	6,194,373,728	1.20	
シンガポール	2,272,772,454	0.44	
イスラエル	553,259,808	0.10	
小計		493,518,007,565	95.87
投資証券	アメリカ	9,282,655,023	1.80
	カナダ	76,619,357	0.01
	フランス	725,696,729	0.14
	イギリス	411,165,298	0.07
	オーストラリア	974,318,391	0.18

	香港	332,301,312	0.06
	シンガポール	206,182,123	0.04
	小計	12,008,938,233	2.33
現金・預金・その他資産（負債控除後）		9,223,476,702	1.79
合計（純資産総額）		514,750,422,500	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	5,492,482,000	1.06
	買建	カナダ	314,454,447	0.06
	買建	ドイツ	1,048,924,890	0.20
	買建	イギリス	567,889,411	0.11
	買建	スイス	256,911,129	0.04
	買建	オーストラリア	243,123,739	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	4,313,360,716	12.61
	メキシコ	1,019,859,946	2.98
	ブラジル	2,173,088,592	6.35
	チリ	191,402,903	0.55
	コロンビア	88,136,962	0.25
	ギリシャ	100,790,896	0.29
	トルコ	225,684,857	0.66
	チェコ	61,559,109	0.18
	ハンガリー	89,523,021	0.26
	ポーランド	407,277,510	1.19
	香港	7,648,165,056	22.37
	マレーシア	797,583,285	2.33
	タイ	749,616,921	2.19
	フィリピン	335,251,723	0.98
	インドネシア	656,356,733	1.92
	韓国	4,693,161,057	13.72
	台湾	3,947,225,368	11.54
	インド	2,958,754,109	8.65
	パキスタン	23,122,286	0.06
	カタール	282,951,913	0.82
エジプト	38,970,877	0.11	

	南アフリカ	2,149,783,320	6.28
	アラブ首長国連邦	191,550,631	0.56
	小計	33,143,177,791	96.96
投資信託受益証券	アメリカ	115,938,844	0.33
投資証券	メキシコ	33,867,921	0.09
	トルコ	4,182,115	0.01
	南アフリカ	93,882,454	0.27
	小計	131,932,490	0.38
現金・預金・その他資産（負債控除後）		791,091,201	2.31
合計（純資産総額）		34,182,140,326	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	763,005,026	2.23

（参考）J-REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	33,588,203,550	97.82
現金・預金・その他資産（負債控除後）		747,231,563	2.17
合計（純資産総額）		34,335,435,113	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	745,392,000	2.17

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	15,694,754,326	70.74
	カナダ	403,164,885	1.81
	ドイツ	59,635,401	0.26

	イタリア	25,265,837	0.11
	フランス	1,114,576,245	5.02
	オランダ	96,382,204	0.43
	スペイン	229,408,874	1.03
	ベルギー	178,197,669	0.80
	アイルランド	58,218,515	0.26
	シンガポール	6,392,556	0.02
	イギリス	1,249,054,812	5.62
	オーストラリア	1,506,317,914	6.78
	ニュージーランド	97,024,084	0.43
	香港	516,686,417	2.32
	シンガポール	738,868,606	3.33
	イスラエル	11,996,936	0.05
	小計	21,985,945,281	99.09
現金・預金・その他資産（負債控除後）		200,250,952	0.90
合計（純資産総額）		22,186,196,233	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	126,364,901	0.56
	買建	フランス	17,524,958	0.07

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

野村資産設計ファンド（DC）2040

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	国内株式マザーファンド	634,016	1.6982	1,076,690	1.7090	1,083,533	26.85
2	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	542,735	1.3138	713,097	1.3115	711,796	17.63
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA I マザーファンド	242,243	2.6411	639,795	2.7204	658,997	16.33

4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	215,688	2.2157	477,901	2.2391	482,947	11.96
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	355,210	1.2594	447,359	1.2899	458,185	11.35
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	125,246	2.0471	256,402	2.0671	258,896	6.41
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	114,603	2.2264	255,153	2.2560	258,544	6.40
8	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド	90,227	1.2721	114,780	1.3130	118,468	2.93

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	99.89
合計	99.89

(参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 2回	9,800,000,000	100.39	9,838,612,000	100.31	9,830,576,000	0.1	2019/12/20	1.48
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 3回	7,300,000,000	100.44	7,332,193,000	100.35	7,326,207,000	0.1	2020/3/20	1.10
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 5回	7,200,000,000	100.54	7,239,096,000	100.47	7,233,912,000	0.1	2020/9/20	1.09
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	6,800,000,000	100.91	6,862,220,000	100.88	6,859,840,000	0.1	2026/12/20	1.03
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	6,800,000,000	100.78	6,853,108,000	100.79	6,854,264,000	0.1	2027/6/20	1.03
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	6,200,000,000	100.70	6,243,958,000	100.62	6,238,564,000	0.1	2021/6/20	0.94
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 2回	6,000,000,000	100.90	6,054,000,000	100.79	6,047,940,000	0.1	2022/6/20	0.91
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	6,000,000,000	100.65	6,039,180,000	100.58	6,034,860,000	0.1	2021/3/20	0.91
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	6,000,000,000	100.64	6,038,500,000	100.57	6,034,500,000	0.1	2028/3/20	0.91
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	5,900,000,000	101.02	5,960,652,000	100.94	5,955,873,000	0.1	2026/6/20	0.90
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	5,800,000,000	100.97	5,856,492,000	100.93	5,854,288,000	0.1	2026/9/20	0.88
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	5,800,000,000	100.85	5,849,300,000	100.81	5,847,502,000	0.1	2027/3/20	0.88
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,400,000,000	103.96	5,613,894,000	103.65	5,597,100,000	0.6	2023/12/20	0.84

14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	5,500,000,000	100.75	5,541,525,000	100.72	5,540,095,000	0.1	2027/9/20	0.83
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	104.71	5,549,842,000	104.36	5,531,398,000	0.8	2023/6/20	0.83
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	5,500,000,000	100.59	5,532,890,000	100.52	5,528,930,000	0.1	2020/12/20	0.83
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 0回	5,500,000,000	100.48	5,526,565,000	100.37	5,520,350,000	0.2	2019/9/20	0.83
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	5,300,000,000	101.07	5,356,710,000	100.99	5,352,682,000	0.1	2026/3/20	0.80
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,000,000,000	103.51	5,175,700,000	103.23	5,161,700,000	0.6	2023/3/20	0.78
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 4回	5,100,000,000	100.49	5,125,398,000	100.41	5,121,165,000	0.1	2020/6/20	0.77
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 12回	4,950,000,000	103.59	5,127,754,500	103.15	5,106,321,000	1.2	2020/12/20	0.77
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 3回	5,000,000,000	100.96	5,048,200,000	100.85	5,042,550,000	0.1	2022/9/20	0.76
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	5,000,000,000	100.80	5,040,050,000	100.71	5,035,650,000	0.1	2021/12/20	0.76
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	4,700,000,000	102.63	4,823,610,000	102.48	4,816,560,000	0.3	2025/12/20	0.72
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	4,500,000,000	103.33	4,649,940,000	103.18	4,643,370,000	0.4	2025/9/20	0.70
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,400,000,000	104.10	4,580,576,000	103.73	4,564,472,000	0.8	2022/9/20	0.69
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 33回	4,200,000,000	104.10	4,372,284,000	103.78	4,359,096,000	0.6	2024/3/20	0.65
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 05回	4,100,000,000	102.45	4,200,614,000	101.97	4,180,811,000	1.3	2019/12/20	0.63
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	4,000,000,000	100.87	4,035,000,000	100.76	4,030,600,000	0.1	2022/3/20	0.60
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	4,000,000,000	100.76	4,030,400,000	100.67	4,027,040,000	0.1	2021/9/20	0.60

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	80.22
地方債証券	6.63
特殊債券	8.42
社債券	4.34
合計	99.62

(参考) 外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,701.62	7,523,243,665	10,685.57	7,511,962,381	1.75	2022/4/30	1.21
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,800,000	11,314.78	5,861,056,474	11,270.55	5,838,144,907	3.625	2020/2/15	0.94
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	52,600,000	11,101.00	5,839,126,000	11,077.58	5,826,808,948	2.625	2020/11/15	0.94
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,800,000	11,252.33	5,716,187,558	11,220.24	5,699,886,010	3.375	2019/11/15	0.92
5	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000	16,072.34	5,319,944,871	16,142.50	5,343,168,559	3.5	2026/4/25	0.86
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	50,300,000	10,562.42	5,312,900,889	10,598.85	5,331,223,022	2.25	2025/11/15	0.86
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	39,200,000	13,440.01	5,268,485,924	13,405.32	5,254,887,199	6	2026/2/15	0.85
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	49,600,000	10,536.40	5,226,059,261	10,560.69	5,238,103,846	1.75	2023/5/15	0.84
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,200,000	11,306.54	5,223,622,254	11,264.47	5,204,189,241	3.5	2020/5/15	0.84
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,800,000	11,386.33	5,214,939,192	11,339.49	5,193,489,724	3.625	2021/2/15	0.84
11	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,500,000	19,375.42	5,134,486,362	19,396.22	5,139,999,162	5.5	2029/4/25	0.83
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	47,100,000	10,754.52	5,065,382,071	10,774.90	5,074,981,727	2.375	2024/8/15	0.82
13	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000	15,930.06	4,986,111,175	15,907.32	4,978,994,259	4.25	2023/10/25	0.80
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,241.11	4,788,716,207	11,209.84	4,775,392,209	3.125	2021/5/15	0.77
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,700,000	10,457.48	4,674,497,293	10,489.57	4,688,840,875	2	2025/2/15	0.75
16	スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	29,050,000	14,083.69	4,091,314,818	13,984.26	4,062,428,099	4	2020/4/30	0.65
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	10,812.19	3,989,701,695	10,897.19	4,021,063,959	3	2044/11/15	0.65
18	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000	14,048.94	4,102,290,804	13,704.23	4,001,637,151	4.25	2020/3/1	0.64
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,200,000	10,982.18	3,975,550,527	10,975.24	3,973,038,926	2.125	2020/8/31	0.64
20	イギリス	国債証券	UK TREASURY	20,100,000	19,432.13	3,905,858,572	19,690.00	3,957,690,703	3.5	2045/1/22	0.64
21	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000	20,061.06	3,891,846,042	20,134.99	3,906,188,495	6.5	2027/7/4	0.63
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,000,000	10,874.20	3,805,973,465	10,898.92	3,814,624,197	2.625	2025/3/31	0.61
23	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	20,300,000	18,553.62	3,766,385,164	18,786.72	3,813,705,276	3.25	2044/1/22	0.61
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,000,000	10,907.59	3,708,583,826	10,904.13	3,707,404,345	2.125	2021/6/30	0.60
25	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,700,000	13,932.39	3,719,949,171	13,862.88	3,701,389,320	2.5	2020/10/25	0.59
26	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000	20,827.44	3,644,802,207	20,867.01	3,651,728,126	4.5	2041/4/25	0.59
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	34,200,000	10,651.75	3,642,900,501	10,676.90	3,651,501,947	2.25	2024/11/15	0.59
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	33,700,000	10,800.05	3,639,619,731	10,804.82	3,641,227,255	2	2022/2/15	0.58
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	32,400,000	11,267.94	3,650,815,132	11,231.52	3,639,013,561	3.625	2019/8/15	0.58
30	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000	18,394.59	3,642,129,391	18,350.79	3,633,457,109	6	2025/10/25	0.58

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.90

合 計	98.90
-----	-------

(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	7,780,000,000	4.83	376,288,111	4.89	381,174,938	9.85	2027/6/28	4.85
2	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	6,170,000,000	4.10	253,532,956	4.07	251,237,094	7.75	2021/4/14	3.20
3	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	8,500,000	2,491.31	211,761,839	2,483.61	211,107,060		2020/7/1	2.68
4	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	23,000,000	574.79	132,202,774	573.64	131,938,196	6.5	2022/6/9	1.68
5	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	430,000	3,109.17	133,702,912	2,989.30	128,540,063	10	2023/1/1	1.63
6	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,700,000	2,601.63	122,276,887	2,597.28	122,072,411		2020/1/1	1.55
7	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	67,000,000	186.50	124,955,067	180.48	120,925,419	7.6	2022/7/20	1.54
8	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	66,000,000	189.27	124,922,525	180.79	119,324,944	7.75	2026/9/16	1.52
9	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	18,450,000	603.63	111,370,644	601.13	110,908,935	8	2020/6/11	1.41
10	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,400,000	958.08	109,221,278	938.19	106,953,674	10.5	2026/12/21	1.36
11	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,200,000	800.60	105,679,828	782.29	103,263,493	8.75	2048/2/28	1.31
12	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	26,500,000	368.99	97,784,411	363.53	96,337,137	3.85	2025/12/12	1.22
13	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	18,000,000	530.69	95,524,611	530.85	95,553,318	5.75	2026/3/5	1.21
14	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,400,000	2,136.80	94,019,438	2,137.74	94,060,589		2022/1/1	1.19
15	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	306,000	3,114.90	95,323,835	3,071.39	93,984,625	10	2021/1/1	1.19
16	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	19,900,000	488.81	97,273,351	470.89	93,707,735	1	2026/6/26	1.19
17	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	18,300,000	516.17	94,460,720	510.69	93,456,709	1.5	2019/10/29	1.19
18	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,650,000	590.55	92,421,716	589.52	92,261,415	7.5	2027/6/3	1.17
19	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	53,000,000	177.41	94,031,492	172.02	91,174,813	7.05	2028/1/19	1.16
20	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	301,000	3,068.41	92,359,291	2,914.50	87,726,462	10	2025/1/1	1.11
21	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	18,100,000	486.86	88,121,662	477.71	86,466,980	0.45	2023/10/25	1.10
22	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,830,000	3,034.79	85,884,659	3,042.39	86,099,677	1.5	2020/4/25	1.09
23	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	10,180,000,000	0.80	81,645,717	0.75	77,062,060	7	2022/5/15	0.98
24	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,450,000	633.85	78,915,188	613.50	76,381,159	6.5	2041/2/28	0.97
25	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000	2,747.21	74,174,912	2,745.81	74,137,094	3.659	2020/10/15	0.94
26	チリ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS	420,000,000	17.65	74,131,088	17.64	74,110,795	5	2035/3/1	0.94
27	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	10,050,000,000	0.79	79,551,780	0.73	73,573,789	7	2027/5/15	0.93

28	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,230,000,000	0.84	78,196,994	0.79	73,290,128	8.375	2024/3/15	0.93
29	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	22,000,000	334.64	73,621,791	330.78	72,773,363	1.875	2022/6/17	0.92
30	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,400,000,000	0.84	79,443,980	0.77	72,530,840	8.25	2036/5/15	0.92

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.67
合計	97.67

(参考)国内株式マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	1,860,500	7,578.54	14,099,881,529	7,305.00	13,590,952,500	3.51
2	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	10,567,100	716.12	7,567,324,073	689.40	7,284,958,740	1.88
3	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	679,900	8,354.17	5,680,006,539	9,260.00	6,295,874,000	1.62
4	日本	株式	ソニー	電気機器	1,025,200	5,128.64	5,257,889,427	5,828.00	5,974,865,600	1.54
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,077,700	5,259.81	5,668,499,438	5,168.00	5,569,553,600	1.43
6	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,142,500	4,487.47	5,126,943,047	4,445.00	5,078,412,500	1.31
7	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,377,100	3,540.90	4,876,179,784	3,355.00	4,620,170,500	1.19
8	日本	株式	キーエンス	電気機器	75,100	67,500.15	5,069,261,804	58,910.00	4,424,141,000	1.14
9	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,323,400	2,890.58	3,825,404,651	3,113.00	4,119,744,200	1.06
10	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	20,510,500	197.74	4,055,813,320	194.60	3,991,343,300	1.03
11	日本	株式	任天堂	その他製品	94,200	45,177.54	4,255,724,317	36,760.00	3,462,792,000	0.89
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,128,100	2,780.31	3,136,473,307	3,055.00	3,446,345,500	0.89
13	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,057,700	3,184.61	3,368,363,717	3,117.00	3,296,850,900	0.85
14	日本	株式	ファナック	電気機器	145,400	22,986.93	3,342,300,158	21,920.00	3,187,168,000	0.82
15	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	137,000	21,404.74	2,932,450,532	23,245.00	3,184,565,000	0.82
16	日本	株式	村田製作所	電気機器	160,600	14,594.85	2,343,933,793	19,500.00	3,131,700,000	0.80
17	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,078,300	2,794.28	3,013,076,762	2,873.00	3,097,955,900	0.80
18	日本	株式	花王	化学	376,300	7,685.95	2,892,224,490	8,137.00	3,061,953,100	0.79
19	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	568,700	5,252.63	2,987,173,731	5,301.00	3,014,678,700	0.77
20	日本	株式	日本電産	電気機器	184,200	16,921.50	3,116,941,973	16,180.00	2,980,356,000	0.76
21	日本	株式	キヤノン	電気機器	823,800	3,782.84	3,116,306,538	3,617.00	2,979,684,600	0.76
22	日本	株式	信越化学工業	化学	264,100	11,243.43	2,969,391,684	11,270.00	2,976,407,000	0.76
23	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	631,800	4,760.09	3,007,430,859	4,555.00	2,877,849,000	0.74
24	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	274,900	10,700.94	2,941,689,538	10,440.00	2,869,956,000	0.74

25	日本	株式	日立製作所	電気機器	3,675,000	861.39	3,165,639,434	778.60	2,861,355,000	0.73
26	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	886,900	2,994.86	2,656,141,334	3,176.00	2,816,794,400	0.72
27	日本	株式	ダイキン工業	機械	208,900	13,121.39	2,741,059,038	13,320.00	2,782,548,000	0.71
28	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,505,100	1,658.45	2,496,142,178	1,817.50	2,735,519,250	0.70
29	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	563,800	4,616.24	2,602,640,285	4,675.00	2,635,765,000	0.68
30	日本	株式	パナソニック	電気機器	1,748,300	1,558.37	2,724,503,079	1,438.00	2,514,055,400	0.64

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.30
		建設業	3.14
		食料品	4.17
		繊維製品	0.62
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.41
		医薬品	4.73
		石油・石炭製品	0.81
		ゴム製品	0.76
		ガラス・土石製品	1.00
		鉄鋼	1.03
		非鉄金属	0.83
		金属製品	0.64
		機械	5.11
		電気機器	13.42
		輸送用機器	8.59
		精密機器	1.73
		その他製品	2.02
		電気・ガス業	1.72
		陸運業	4.25
		海運業	0.19
		空運業	0.58
		倉庫・運輸関連業	0.18
		情報・通信業	7.68
		卸売業	4.69
		小売業	4.76
銀行業	6.85		
証券、商品先物取引業	0.89		
保険業	2.25		
その他金融業	1.18		
不動産業	2.36		
サービス業	4.47		

合 計	98.89
-----	-------

(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	615,400	18,659.87	11,483,287,816	21,081.90	12,973,806,860	2.52
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	887,200	10,152.25	9,007,084,029	11,697.12	10,377,688,147	2.01
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	49,910	161,387.56	8,054,853,427	197,511.21	9,857,784,601	1.91
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インター ネットソ フトウェ ア・サー ビス	290,700	17,858.93	5,191,591,786	18,989.37	5,520,210,033	1.07
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	416,500	12,197.16	5,080,117,260	12,958.19	5,397,089,175	1.04
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インター ネットソ フトウェ ア・サー ビス	38,210	114,790.30	4,386,137,383	135,403.33	5,173,761,522	1.00
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インター ネットソ フトウェ ア・サー ビス	36,230	115,410.50	4,181,322,453	136,546.74	4,947,088,405	0.96
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	325,600	14,199.79	4,623,452,209	14,672.19	4,777,265,618	0.92
9	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	514,300	8,299.63	4,268,500,960	9,073.95	4,666,736,291	0.90
10	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,181,300	3,325.59	3,928,526,887	3,475.72	4,105,871,698	0.79
11	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	568,000	5,821.45	3,306,585,029	6,492.97	3,688,009,743	0.71
12	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	377,900	8,491.45	3,208,921,789	9,112.39	3,443,574,448	0.66
13	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	155,100	22,102.94	3,428,166,887	22,100.98	3,427,862,138	0.66
14	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	218,900	13,312.52	2,914,112,161	15,150.64	3,316,476,147	0.64
15	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケ ア・プロ バイダー/ ヘルスケ ア・サー ビス	117,490	23,865.68	2,803,979,880	28,178.77	3,310,724,674	0.64
16	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	231,900	12,695.35	2,944,053,739	14,190.40	3,290,755,685	0.63
17	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気 通信サー ビス	881,500	3,867.20	3,408,944,346	3,552.32	3,131,370,080	0.60
18	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売 り	141,800	19,825.70	2,811,285,184	21,900.05	3,105,427,487	0.60
19	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	722,900	3,940.82	2,848,819,804	4,283.87	3,096,813,888	0.60
20	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・ 半導体製 造装置	568,300	5,776.71	3,282,909,560	5,294.06	3,008,618,219	0.58
21	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	501,300	5,308.57	2,661,189,218	5,826.91	2,921,032,439	0.56

22	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	585,100	4,758.45	2,784,173,398	4,681.29	2,739,023,774	0.53
23	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	306,200	8,792.03	2,692,122,026	8,903.00	2,726,099,212	0.52
24	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	67,910	36,413.28	2,472,826,503	38,971.17	2,646,532,195	0.51
25	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	2,431,000	971.64	2,362,062,578	1,057.41	2,570,583,207	0.49
26	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	492,300	4,819.73	2,372,753,838	5,131.99	2,526,479,809	0.49
27	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	270,300	8,666.69	2,342,608,936	9,332.62	2,522,607,619	0.49
28	アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	312,200	7,490.45	2,338,521,562	8,024.91	2,505,377,807	0.48
29	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	113,400	19,493.90	2,210,608,335	21,965.54	2,490,893,223	0.48
30	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	327,600	6,056.72	1,984,181,607	7,194.55	2,356,937,234	0.45

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	不動産管理・開発	0.53
		エネルギー設備・サービス	0.52
		石油・ガス・消耗燃料	6.57
		化学	2.48
		建設資材	0.29
		容器・包装	0.29
		金属・鉱業	1.48
		紙製品・林産品	0.11
		航空宇宙・防衛	2.29
		建設関連製品	0.37
		建設・土木	0.35
		電気設備	0.72
		コングロマリット	1.50
		機械	1.53
		商社・流通業	0.32
		商業サービス・用品	0.41
		航空貨物・物流サービス	0.58
		旅客航空輸送業	0.12
		海運業	0.05
		陸運・鉄道	1.02
		運送インフラ	0.19
		自動車部品	0.42
		自動車	0.90
家庭用耐久財	0.39		
レジャー用品	0.06		
繊維・アパレル・贅沢品	1.37		
ホテル・レストラン・レジャー	1.75		
メディア	1.94		
販売	0.06		
インターネット販売・通信販売	2.65		

	複合小売り	0.41
	専門小売り	1.60
	食品・生活必需品小売り	1.48
	飲料	1.89
	食品	1.75
	タバコ	1.09
	家庭用品	1.14
	パーソナル用品	0.69
	ヘルスケア機器・用品	2.37
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.18
	バイオテクノロジー	2.10
	医薬品	5.31
	銀行	8.98
	各種金融サービス	0.94
	保険	3.77
	インターネットソフトウェア・サービス	3.44
	情報技術サービス	3.31
	ソフトウェア	4.60
	通信機器	0.87
	コンピュータ・周辺機器	2.84
	電子装置・機器・部品	0.49
	半導体・半導体製造装置	3.00
	各種電気通信サービス	2.01
	無線通信サービス	0.31
	電力	1.74
	ガス	0.14
	総合公益事業	0.97
	水道	0.07
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.01
	消費者金融	0.46
	資本市場	2.93
	各種消費者サービス	0.01
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06
	ヘルスケア・テクノロジー	0.07
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.63
	専門サービス	0.66
投資証券		2.33
合 計		98.20

(参考) 新興国株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インター ネットソフ トウェア・ サービス	321,200	5,570.76	1,789,330,846	5,192.20	1,667,737,210	4.87
2	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネットソフ トウェア・ サービス	65,200	21,666.07	1,412,628,155	20,516.86	1,337,699,807	3.91
3	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュ ータ・周辺機 器	271,490	5,037.21	1,367,553,176	4,617.44	1,253,591,500	3.66
4	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	1,389,000	833.16	1,157,260,676	891.16	1,237,828,185	3.62
5	南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	メディア	24,780	26,042.06	645,322,307	27,946.12	692,504,963	2.02
6	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	5,440,000	113.82	619,199,926	100.67	547,681,792	1.60
7	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インター ネットソフ トウェア・ サービス	15,600	28,958.63	451,754,733	27,907.91	435,363,458	1.27
8	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信 サービス	348,500	1,037.05	361,415,060	989.09	344,698,910	1.00
9	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	3,943,000	94.92	374,277,185	82.29	324,488,396	0.94
10	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	296,000	1,083.67	320,768,860	1,042.82	308,676,200	0.90
11	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガ ス・消耗燃 料	158,800	1,592.86	252,946,627	1,876.78	298,032,982	0.87
12	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵 当・不動産 金融	89,840	3,100.07	278,510,929	3,306.86	297,088,527	0.86
13	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・ 機器・部品	935,812	297.97	278,846,253	305.64	286,027,195	0.83
14	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	176,721	1,493.94	264,011,381	1,616.31	285,637,245	0.83
15	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	33,130	8,296.31	274,857,011	8,529.86	282,594,593	0.82
16	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	180,394	1,407.76	253,951,524	1,397.35	252,074,909	0.73
17	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,429,000	58.57	259,411,149	52.31	231,716,422	0.67
18	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	606,300	395.44	239,758,081	376.94	228,544,109	0.66
19	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術 サービス	97,560	1,916.47	186,970,822	2,202.13	214,839,803	0.62
20	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガ ス・消耗燃 料	24,310	7,436.85	180,789,875	7,832.86	190,416,963	0.55
21	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュ ータ・周辺機 器	48,070	4,010.35	192,777,949	3,808.15	183,058,011	0.53
22	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガ ス・消耗燃 料	1,000,000	190.58	190,586,479	182.68	182,688,800	0.53
23	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信 サービス	1,886,300	100.42	189,435,006	95.54	180,218,045	0.52
24	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PREF	銀行	192,313	971.61	186,855,155	926.11	178,104,435	0.52
25	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術 サービス	51,560	2,855.01	147,204,725	3,169.69	163,429,629	0.47

26	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インターネット販売・通信販売	41,400	4,115.61	170,386,667	3,903.11	161,588,820	0.47
27	ブラジル	株式	AMBEV SA	飲料	270,256	647.93	175,107,153	586.07	158,390,285	0.46
28	香港	株式	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	石油・ガス・消耗燃料	1,464,900	111.18	162,876,486	106.19	155,559,782	0.45
29	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	299,200	505.94	151,378,178	492.10	147,238,513	0.43
30	韓国	株式	POSCO	金属・鉱業	4,420	34,562.65	152,766,933	32,620.05	144,180,621	0.42

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	不動産管理・開発	2.44
		エネルギー設備・サービス	0.08
		石油・ガス・消耗燃料	7.16
		化学	2.48
		建設資材	1.20
		容器・包装	0.07
		金属・鉱業	3.31
		紙製品・林産品	0.55
		航空宇宙・防衛	0.17
		建設関連製品	0.02
		建設・土木	0.76
		電気設備	0.18
		コングロメリット	1.42
		機械	0.74
		商社・流通業	0.04
		商業サービス・用品	0.09
		航空貨物・物流サービス	0.06
		旅客航空輸送業	0.26
		海運業	0.10
		陸運・鉄道	0.23
		運送インフラ	0.87
		自動車部品	0.59
		自動車	1.94
		家庭用耐久財	0.33
レジャー用品	0.05		
繊維・アパレル・贅沢品	0.61		
ホテル・レストラン・レジャー	0.71		
メディア	2.40		
販売	0.04		
インターネット販売・通信販売	0.90		
複合小売り	0.58		

専門小売り	0.42
食品・生活必需品小売り	1.77
飲料	1.24
食品	1.66
タバコ	0.63
家庭用品	0.43
パーソナル用品	0.73
ヘルスケア機器・用品	0.09
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.44
バイオテクノロジー	0.55
医薬品	1.42
銀行	15.63
各種金融サービス	1.18
保険	3.50
インターネットソフトウェア・サービス	11.40
情報技術サービス	1.73
ソフトウェア	0.35
通信機器	0.03
コンピュータ・周辺機器	5.07
電子装置・機器・部品	2.76
半導体・半導体製造装置	5.48
各種電気通信サービス	1.23
無線通信サービス	2.89
電力	0.99
ガス	0.64
総合公益事業	0.06
水道	0.20
貯蓄・抵当・不動産金融	1.02
消費者金融	0.26
資本市場	1.09
各種消費者サービス	0.52
独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.51
ヘルスケア・テクノロジー	0.07
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.22
専門サービス	0.03
投資信託受益証券	0.33
投資証券	0.38
合計	97.68

(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	3,827	620,148	2,373,308,239	622,000	2,380,394,000	6.93
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	3,952	567,343	2,242,142,752	585,000	2,311,920,000	6.73
3	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	11,714	153,864	1,802,364,778	158,400	1,855,497,600	5.40
4	日本	投資証券	日本リートファンド投資法人 投資証券	7,469	200,825	1,499,967,305	203,900	1,522,929,100	4.43
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,716	170,955	1,490,046,289	173,400	1,511,354,400	4.40
6	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	7,874	172,863	1,361,127,697	174,200	1,371,650,800	3.99
7	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	4,948	262,471	1,298,708,388	276,000	1,365,648,000	3.97
8	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,301	230,963	1,224,339,371	226,100	1,198,556,100	3.49
9	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,852	283,025	1,090,214,187	290,900	1,120,546,800	3.26
10	日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	8,737	120,783	1,055,286,138	119,400	1,043,197,800	3.03
11	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,502	407,930	1,020,642,272	402,500	1,007,055,000	2.93
12	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	1,894	481,979	912,869,760	499,000	945,106,000	2.75
13	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	11,443	81,336	930,729,673	81,900	937,181,700	2.72
14	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,223	674,273	824,636,505	678,000	829,194,000	2.41
15	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	10,197	70,461	718,494,861	72,200	736,223,400	2.14
16	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,313	487,931	640,654,633	529,000	694,577,000	2.02
17	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	912	636,090	580,114,563	681,000	621,072,000	1.80
18	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	12,388	50,046	619,972,945	49,350	611,347,800	1.78
19	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,344	448,979	603,428,752	450,000	604,800,000	1.76
20	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,374	138,267	604,783,777	138,100	604,049,400	1.75

21	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,639	222,245	586,505,574	216,000	570,024,000	1.66
22	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	4,604	120,133	553,092,980	120,600	555,242,400	1.61
23	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,539	143,613	508,249,155	143,700	508,554,300	1.48
24	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	2,850	167,884	478,469,628	172,900	492,765,000	1.43
25	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,057	122,908	498,640,798	119,500	484,811,500	1.41
26	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,825	159,033	449,269,115	162,100	457,932,500	1.33
27	日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,276	321,945	410,802,113	346,500	442,134,000	1.28
28	日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	3,757	106,809	401,283,742	112,800	423,789,600	1.23
29	日本	投資証券	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	4,445	86,743	385,575,064	91,000	404,495,000	1.17
30	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,650	147,664	391,311,926	152,500	404,125,000	1.17

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	97.82
合計	97.82

(参考) 海外REITインデックス マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	53,890	18,402.98	991,736,831	19,078.17	1,028,123,045	4.63
2	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	92,840	7,311.15	678,767,692	7,215.65	669,900,946	3.01
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	26,090	24,103.05	628,848,638	23,811.64	621,245,818	2.80
4	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	23,490	24,921.81	585,413,500	24,608.74	578,059,350	2.60
5	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	35,880	12,180.28	437,028,531	13,404.45	480,951,935	2.16
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	24,080	18,663.42	449,415,370	19,112.59	460,231,208	2.07
7	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	64,150	7,165.41	459,661,638	7,079.10	454,124,759	2.04
8	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	64,810	6,458.58	418,580,911	6,849.31	443,904,235	2.00
9	香港	投資証券	LINK REIT	375,100	1,036.13	388,655,396	1,099.38	412,379,313	1.85
10	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	62,100	6,101.24	378,887,454	6,152.17	382,050,018	1.72
11	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	26,910	13,633.25	366,870,810	13,550.99	364,657,160	1.64
12	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	929,000	343.18	318,822,447	349.39	324,585,633	1.46
13	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	49,600	5,923.37	293,799,400	6,146.62	304,872,536	1.37
14	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	11,520	26,706.15	307,654,935	25,954.13	298,991,670	1.34

15	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	129,300	2,443.45	315,939,122	2,296.79	296,975,839	1.33
16	アメリカ	投資証券	GGP INC	110,400	2,294.80	253,346,245	2,348.97	259,326,465	1.16
17	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,980	14,107.11	253,645,995	13,634.24	245,143,783	1.10
18	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	30,210	7,960.07	240,473,903	7,777.36	234,954,064	1.05
19	アメリカ	投資証券	HCP INC	82,000	2,709.96	222,217,043	2,828.53	231,939,854	1.04
20	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	22,020	10,886.64	239,723,819	10,380.54	228,579,603	1.03
21	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	280,100	775.79	217,300,879	798.25	223,592,374	1.00
22	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	19,870	10,716.19	212,930,812	10,951.13	217,599,082	0.98
23	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	62,400	3,190.24	199,071,347	3,171.55	197,905,076	0.89
24	アメリカ	投資証券	UDR INC	46,800	4,157.70	194,580,548	4,112.92	192,484,679	0.86
25	アメリカ	投資証券	IRON MOUNTAIN INC	49,200	3,847.00	189,272,827	3,875.35	190,667,668	0.85
26	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	25,760	6,629.00	170,763,164	6,960.32	179,298,024	0.80
27	イギリス	投資証券	LAND SECURITIES GROUP PLC	131,400	1,369.68	179,976,979	1,357.39	178,361,536	0.80
28	アメリカ	投資証券	FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,800	13,450.19	172,162,534	13,592.06	173,978,424	0.78
29	アメリカ	投資証券	SL GREEN REALTY CORP	15,460	10,959.76	169,437,938	11,159.83	172,531,054	0.77
30	イギリス	投資証券	SEGRE PLC	176,600	977.71	172,664,235	970.58	171,405,625	0.77

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.09
合計	99.09

【投資不動産物件】

野村資産設計ファンド(DC)2040

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)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)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)新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外R E I Tインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

野村資産設計ファンド（DC）2040

該当事項はありません。

（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）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）国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2018年09月限)	買建	243	日本円	4,182,130,101	4,247,640,000	1.09

（参考）外国株式M S C I - K O K U S A Iマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2018 年09月限)	買建	353	米ドル	48,887,727.5	5,427,026,629	49,477,362.5	5,492,482,000	1.06

カナダ	モントル オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2018年09 月限)	買建	19	カナダド ル	3,673,402	312,863,649	3,692,080	314,454,447	0.06
ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指 数先物(2018年09 月限)	買建	230	ユーロ	7,914,470	1,028,327,095	8,073,000	1,048,924,890	0.20
オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SP1200株価指数先 物(2018年09月限)	買建	19	豪ドル	2,915,300	239,666,812	2,957,350	243,123,739	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(2018年09月限)	買建	51	英ポンド	3,868,710	563,632,361	3,897,930	567,889,411	0.11
スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取引 所	SMI株価指数先物 (2018年09月限)	買建	25	スイスフ ラン	2,170,670	243,896,480	2,286,500	256,911,129	0.04

(参考)新興国株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリ カ	インター コンチ ネンタ ル取引 所	E-mini MSCIエ マージングマ ケット株価指 数先物(2018年09月限)	買建	126	米ドル	6,701,675	743,952,944	6,873,300	763,005,026	2.23

(参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資 比率 (%)
REIT指 数先物 取引	大阪取引 所	REIT指数先物(2018年09月限)	買建	424	日本円	727,796,000	745,392,000	2.17

(参考)海外R E I Tインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

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

株価指 数先物 取引	アメリ カ	シカゴ ボード オ ブ トレー ド	ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2018年09月限)	買建	36	米ドル	1,129,230	125,355,821	1,138,320	126,364,901	0.56
	フラン ス	Euronext	FTSE EPRA/NAREIT 欧州指数先物(2018 年09月限)	買建	6	ユーロ	133,560	17,353,451	134,880	17,524,958	0.07

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

野村資産設計ファンド(DC)2040

2018年7月末日及び同日前1年以内における各月末(設定来)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 (2018年 6月22日)	3	3	1.0433	1.0438
2017年 8月末日	0.9		1.0000	
9月末日	1		1.0223	
10月末日	1		1.0449	
11月末日	1		1.0552	
12月末日	1		1.0713	
2018年 1月末日	2		1.0761	
2月末日	2		1.0427	
3月末日	2		1.0262	
4月末日	3		1.0496	
5月末日	3		1.0399	
6月末日	3		1.0386	
7月末日	4		1.0565	

【分配の推移】

野村資産設計ファンド(DC)2040

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2017年 8月31日 ~ 2018年 6月22日	0.0005円

【収益率の推移】

野村資産設計ファンド(DC)2040

	計算期間	収益率
第1計算期間	2017年 8月31日 ~ 2018年 6月22日	4.4%

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

(4)【設定及び解約の実績】

野村資産設計ファンド(DC)2040

	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 8月31日 ~ 2018年 6月22日	3,834,123	59,096	3,775,027

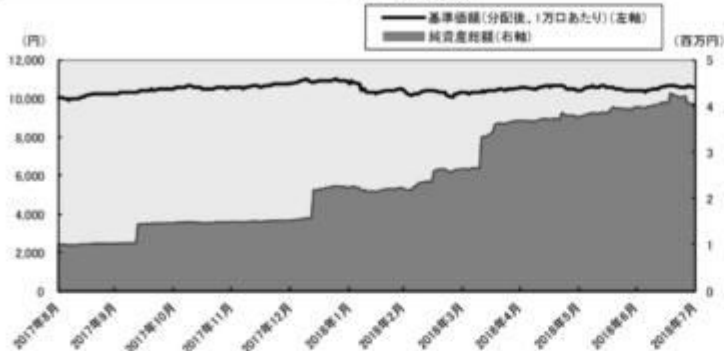
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

運用実績 (2018年7月31日現在)

基準価額・純資産の推移

(日次:設定来)



分配の推移

(1万口あたり、課税前)

2018年6月	5 円
—	—
—	—
—	—
—	—
設定来累計	5 円

主要な資産の状況

銘柄別投資比率

順位	銘柄	投資比率(%)
1	国内株式マザーファンド	20.9
2	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	17.6
3	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	16.3
4	外国債券マザーファンド	12.0
5	新興国株式マザーファンド	11.4
6	J-REITインデックス マザーファンド	6.4
7	海外REITインデックス マザーファンド	6.4
8	新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	2.9

実質的な銘柄別投資比率(上位)

・「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	国庫債券 利付(5年)第122回	国債証券	0.3
2	国庫債券 利付(5年)第123回	国債証券	0.2
3	国庫債券 利付(5年)第125回	国債証券	0.2
4	国庫債券 利付(10年)第345回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付(10年)第347回	国債証券	0.2

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
5	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	国債証券	0.1

・「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1
2	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1
3	LETRA TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1
4	MEX BONOS DESARR FIX RT	国債証券	0.0
5	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.0

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.9
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.5
3	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.4
4	ソニー	電気機器	0.4
5	日本電信電話	情報・通信業	0.4

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率(%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.4
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.3
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.3
4	FACEBOOK INC-A	インターネットソフトウェア・サービス	0.2
5	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	0.2

・「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(%)
1	TENCENT HOLDINGS LTD	インターネットソフトウェア・サービス	0.6
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネットソフトウェア・サービス	0.4
3	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.4
4	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.4
5	NASPERS LTD-N SHS	メディア	0.2

・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

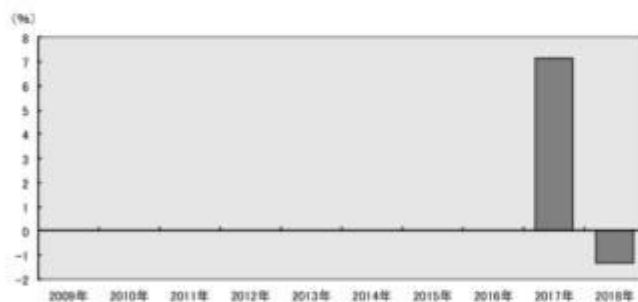
順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.4
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.4
3	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.3
4	日本リテールファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.3
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	投資証券	0.3

・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率(%)
1	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.3
2	PROLOGIS INC	投資証券	0.2
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.2
4	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	投資証券	0.2
5	DIGITAL REALTY TRUST INC	投資証券	0.1

年間収益率の推移

(暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドは合成指数をベンチマークとしていますが、年1回基本投資割合を変更するため、暦年ベースで収益率を表示した場合、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマークは掲載していません。
- ・2017年は設定日(2017年8月31日)から年末までの収益率。
- ・2018年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

●ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。●ファンドの運用状況は、別途、委託会社ホームページで開示している場合があります。

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

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 販売の単位は、1円以上1円単位(当初元本1口 = 1円)とします。
- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 取得申込日の翌々営業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。なお、販売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。
- ・ 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、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があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

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

2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、委託者に1口単位で一部解約の実行を請求することができます。
- ・ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
- ・ 一部解約の実行の請求の受付については、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込み分とします。
- ・ 換金価額は、換金申込日の翌営業日の基準価額となります。

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5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、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があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

< 基準価額の計算方法 >

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当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
公社債等	原則として、基準価額計算日 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) 価格情報会社の提供する価額
株式	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
REIT (不動産投資信託)	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行ないません。

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】

2050年6月22日までとします(2017年8月31日設定)。

なお、委託者は、信託期間満了前に、信託期間の延長が受益者に有利であると認めるときは、受託者と協議のうえ、信託期間を延長することができます。

（４）【計算期間】

原則として、毎年6月23日から翌年6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、信託終了前に、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が30億口を下回った場合、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。

（ ）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

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、知れている受益者に対して交付します。

(d)信託約款の変更等

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

(e)公告

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

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

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

(f)受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

() 委託者が新受託者を選任できないときは、委託者はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

受益者は、委託者または受託者に対し、次に掲げる事項の開示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、原則、自動的に無手数料で再投資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)、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】

(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1期計算期間(2017年8月31日から2018年6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】

【野村資産設計ファンド（DC）2040】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

		第1期 (2018年 6月22日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		10,512
親投資信託受益証券		3,933,848
未収入金		643
流動資産合計		3,945,003
資産合計		3,945,003
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金		1,887
未払受託者報酬		439
未払委託者報酬		4,157
その他未払費用		78
流動負債合計		6,561
負債合計		6,561
純資産の部		
元本等		
元本		3,775,027
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		163,415
（分配準備積立金）		30,886
元本等合計		3,938,442
純資産合計		3,938,442
負債純資産合計		3,945,003

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第1期 自 2017年 8月31日 至 2018年 6月22日
営業収益	
有価証券売買等損益	43,644
営業収益合計	43,644
営業費用	
支払利息	1
受託者報酬	791
委託者報酬	7,265
その他費用	198
営業費用合計	8,255
営業利益又は営業損失（ ）	35,389
経常利益又は経常損失（ ）	35,389
当期純利益又は当期純損失（ ）	35,389
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（ ）	2,616
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	134,487
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	134,487
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,958
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,958
分配金	1,887
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	163,415

(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。
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。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2017年 8月31日から2018年 6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1期 2018年 6月22日現在	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	3,775,027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	1.0433円
(10,000口当たり純資産額)	(10,433円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2017年 8月31日 至 2018年 6月22日		
1.分配金の計算過程		
項目	項目	
費用控除後の配当等収益額	A	32,722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	51円
収益調整金額	C	132,529円
分配準備積立金額	D	0円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	165,302円
当ファンドの期末残存口数	F	3,775,027口
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	437円
10,000口当たり分配金額	H	5円
収益分配金金額	I=F × H/10,000	1,887円
2.追加情報		

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

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第1期 自 2017年 8月31日 至 2018年 6月22日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(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>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

第1期 2018年 6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>親投資信託受益証券</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>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>

(関連当事者との取引に関する注記)

第1期 自 2017年 8月31日 至 2018年 6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。

(その他の注記)

1 元本の移動

第1期 自 2017年 8月31日 至 2018年 6月22日	
期首元本額	- 円
期中追加設定元本額	3,834,123円
期中一部解約元本額	59,096円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第1期 自 2017年 8月31日 至 2018年 6月22日
	損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	38,744
合計	38,744

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年6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(2018年6月22日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	645,034	1,095,590	
		外国債券マザーファンド	220,078	486,966	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	253,605	668,731	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	507,155	666,401	
		J-REITインデックスマザーファンド	116,740	238,803	
		海外REITインデックスマザーファンド	108,764	241,630	
		新興国株式マザーファンド	343,203	432,264	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	81,480	103,463	
	小計	銘柄数：8 組入時価比率：99.9%	2,276,059	3,933,848 100.0%	
合計			3,933,848		

(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

該当事項はありません。

（参考）

当ファンドは「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」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックスマザーファンド」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。

国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2018年6月22日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,776,546,660
国債証券	529,297,982,680
地方債証券	44,129,686,112

特殊債券	56,080,031,024
社債券	28,579,737,940
未収利息	970,204,709
前払費用	7,743,223
流動資産合計	663,841,932,348
資産合計	663,841,932,348
負債の部	
流動負債	
未払金	200,000,000
未払解約金	825,691,319
未払利息	10,940
流動負債合計	1,025,702,259
負債合計	1,025,702,259
純資産の部	
元本等	
元本	504,423,579,973
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	158,392,650,116
元本等合計	662,816,230,089
純資産合計	662,816,230,089
負債純資産合計	663,841,932,348

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6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	1.3140円
(10,000口当たり純資産額)	(13,140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 2017年 8月31日
至 2018年 6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っております。

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2018年 6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

2018年 6月22日現在

期首	2017年 8月31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	534,903,008,008円
同期中における追加設定元本額	46,279,532,576円
同期中における一部解約元本額	76,758,960,611円
期末元本額	504,423,579,973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	451,310,898円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	21,621,142,450円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	17,615,784,723円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	2,537,939,286円
野村資産設計ファンド2015	411,513,032円
野村資産設計ファンド2020	323,119,294円
野村資産設計ファンド2025	260,463,171円

野村資産設計ファンド2030	172,128,919円
野村資産設計ファンド2035	88,828,938円
野村資産設計ファンド2040	147,406,991円
野村日本債券インデックスファンド	1,016,804,144円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	237,162,316,019円
のむらっぴ・ファンド(保守型)	11,736,369,208円
のむらっぴ・ファンド(普通型)	6,925,628,519円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	853,262,792円
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	12,372,706,432円
野村資産設計ファンド2045	13,648,061円
野村円債投資インデックスファンド	1,500,872,683円
野村インデックスファンド・国内債券	2,605,199,996円
マイ・ロード	38,412,755,805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	580,926,806円
野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)	36,064,133円
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	5,454,978,365円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,343,525,276円
野村資産設計ファンド2050	15,860,788円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	11,850,997円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	3,059,591円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	2,096,697円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,360,022円
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	623,271,034円
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	116,907,670円
インデックス・ブレンド(タイプ)	23,756,850円
インデックス・ブレンド(タイプ)	16,615,276円
インデックス・ブレンド(タイプ)	35,132,544円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,816,768円
インデックス・ブレンド(タイプ)	15,313,197円
野村6資産均等バランス	124,882,482円
世界6資産分散ファンド	48,248,635円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信	129,495,946円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	2,585,516,198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)	771,339,195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)	234,654,364円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	3,448,132,828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)	1,564,194,436円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	18,111,413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)	18,155,836円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	1,376,904円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	5,256,832,993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)	63,264,966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)	335,180,852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)	765,502,954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)	390,412,584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)	375,458,799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)	887,918,877円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,679,525,658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)	889,693,446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)	477,419,331円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	14,739,480,256円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	22,334,915,867円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	10,204,141,262円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合(確定拠出年金向け)	43,494,449,927円
マイバランスDC30	9,700,683,784円
マイバランスDC50	6,532,352,186円
マイバランスDC70	2,144,662,825円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	10,249,403,755円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	245,250,715円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	74,798,292円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	78,811,043円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	10,650,917円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	3,090,816円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	1,857,906円
野村資産設計ファンド(DC)2030	765,716円
野村資産設計ファンド(DC)2040	507,155円
野村資産設計ファンド(DC)2050	598,635円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	10,814,548円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	4,323,087円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	505,373円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	11,459,836円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年6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(2018年6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380回	4,000,000,000	4,011,760,000	
		国庫債券 利付(2年)第385回	1,000,000,000	1,003,950,000	
		国庫債券 利付(2年)第387回	100,000,000	100,434,000	
		国庫債券 利付(5年)第120回	5,500,000,000	5,523,155,000	
		国庫債券 利付(5年)第121回	3,500,000,000	3,510,395,000	

国庫債券 利付(5年)第122回	9,800,000,000	9,834,300,000	
国庫債券 利付(5年)第123回	7,300,000,000	7,329,127,000	
国庫債券 利付(5年)第124回	5,100,000,000	5,123,358,000	
国庫債券 利付(5年)第125回	7,200,000,000	7,237,152,000	
国庫債券 利付(5年)第126回	5,500,000,000	5,531,570,000	
国庫債券 利付(5年)第127回	6,000,000,000	6,037,860,000	
国庫債券 利付(5年)第128回	6,200,000,000	6,241,788,000	
国庫債券 利付(5年)第129回	4,000,000,000	4,029,240,000	
国庫債券 利付(5年)第130回	5,000,000,000	5,039,400,000	
国庫債券 利付(5年)第131回	4,000,000,000	4,033,760,000	
国庫債券 利付(5年)第132回	6,000,000,000	6,052,860,000	
国庫債券 利付(5年)第133回	5,000,000,000	5,046,850,000	
国庫債券 利付(5年)第134回	1,000,000,000	1,009,920,000	
国庫債券 利付(5年)第135回	2,500,000,000	2,526,175,000	
国庫債券 利付(40年)第1回	2,460,000,000	3,572,781,000	
国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,265,454,000	
国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,270,332,000	
国庫債券 利付(40年)第4回	1,300,000,000	1,841,385,000	
国庫債券 利付(40年)第5回	1,300,000,000	1,770,860,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,735,864,000	
国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,789,942,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	1,700,000,000	2,015,333,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	2,000,000,000	1,723,160,000	
国庫債券 利付(40年)第10回	2,200,000,000	2,245,122,000	
国庫債券 利付(10年)第303回	2,300,000,000	2,343,930,000	
国庫債券 利付(10年)第304回	1,000,000,000	1,017,860,000	
国庫債券 利付(10年)第305回	4,100,000,000	4,187,699,000	
国庫債券 利付(10年)第306回	3,000,000,000	3,080,040,000	
国庫債券 利付(10年)第307回	1,700,000,000	1,742,398,000	
国庫債券 利付(10年)第308回	1,700,000,000	1,748,586,000	
国庫債券 利付(10年)第309回	3,000,000,000	3,073,770,000	

国庫債券 利付(10年)第310回	3,700,000,000	3,793,832,000	
国庫債券 利付(10年)第311回	1,800,000,000	1,837,782,000	
国庫債券 利付(10年)第312回	4,950,000,000	5,114,934,000	
国庫債券 利付(10年)第313回	3,200,000,000	3,325,536,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	2,200,000,000	2,274,250,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	3,600,000,000	3,742,956,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	1,400,000,000	1,451,394,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,871,694,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,317,024,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,929,383,500	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,637,900,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,334,432,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,491,824,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	2,700,000,000	2,810,295,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,317,920,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,400,000,000	4,572,436,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,177,679,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,228,681,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,000,000,000	5,170,150,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,541,786,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	3,981,108,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,970,547,000	

回			
国庫債券 利付(10年)第332回	5,400,000,000	5,606,982,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	4,200,000,000	4,367,034,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	4,100,000,000	4,268,961,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	3,700,000,000	3,834,532,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	1,700,000,000	1,763,716,000	
国庫債券 利付(10年)第337回	1,700,000,000	1,741,548,000	
国庫債券 利付(10年)第338回	3,400,000,000	3,508,120,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	3,700,000,000	3,820,731,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	4,500,000,000	4,650,480,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	4,700,000,000	4,825,443,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	5,300,000,000	5,361,692,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	5,900,000,000	5,966,139,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,862,234,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	6,800,000,000	6,869,360,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	5,800,000,000	5,855,738,000	
国庫債券 利付(10年)第347回	6,800,000,000	6,861,064,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	5,500,000,000	5,548,235,000	
国庫債券 利付(10年)第349回	3,500,000,000	3,528,175,000	
国庫債券 利付(10年)第350回	4,500,000,000	4,532,760,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	130,295,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	252,860,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	201,044,800	

国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,204,353,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	188,799,000	
国庫債券 利付(30年)第6回	700,000,000	904,596,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	770,940,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	122,069,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	65,000,000	75,715,250	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	280,395,000	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	193,651,200	
国庫債券 利付(30年)第12回	220,000,000	279,743,200	
国庫債券 利付(30年)第13回	290,000,000	364,851,900	
国庫債券 利付(30年)第14回	800,000,000	1,057,184,000	
国庫債券 利付(30年)第15回	900,000,000	1,205,721,000	
国庫債券 利付(30年)第16回	915,000,000	1,228,588,800	
国庫債券 利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,595,904,000	
国庫債券 利付(30年)第18回	1,500,000,000	1,974,870,000	
国庫債券 利付(30年)第19回	1,600,000,000	2,110,368,000	
国庫債券 利付(30年)第20回	1,900,000,000	2,572,467,000	
国庫債券 利付(30年)第21回	1,400,000,000	1,851,402,000	
国庫債券 利付(30年)第22回	600,000,000	815,400,000	
国庫債券 利付(30年)第23回	840,000,000	1,143,651,600	
国庫債券 利付(30年)第24回	700,000,000	954,737,000	
国庫債券 利付(30年)第25回	500,000,000	665,255,000	
国庫債券 利付(30年)第26回	850,000,000	1,147,279,000	
国庫債券 利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,125,763,000	
国庫債券 利付(30年)第28回	1,200,000,000	1,651,848,000	
国庫債券 利付(30年)第29回	1,500,000,000	2,044,455,000	
国庫債券 利付(30年)第30回	1,700,000,000	2,292,093,000	
国庫債券 利付(30年)第31回	1,600,000,000	2,132,448,000	
国庫債券 利付(30年)第32回	1,900,000,000	2,580,561,000	
国庫債券 利付(30年)第33回	2,100,000,000	2,730,399,000	
国庫債券 利付(30年)第34回	2,100,000,000	2,825,886,000	
国庫債券 利付(30年)第35回	2,300,000,000	3,002,627,000	
国庫債券 利付(30年)第36回	2,300,000,000	3,009,619,000	
国庫債券 利付(30年)第37回	2,300,000,000	2,967,230,000	
国庫債券 利付(30年)第38回	1,900,000,000	2,414,463,000	
国庫債券 利付(30年)第39回	1,600,000,000	2,072,208,000	

国庫債券 利付（30年）第40回	1,100,000,000	1,400,069,000	
国庫債券 利付（30年）第41回	1,500,000,000	1,875,120,000	
国庫債券 利付（30年）第42回	1,200,000,000	1,500,948,000	
国庫債券 利付（30年）第43回	1,300,000,000	1,626,963,000	
国庫債券 利付（30年）第44回	1,400,000,000	1,753,080,000	
国庫債券 利付（30年）第45回	1,900,000,000	2,288,208,000	
国庫債券 利付（30年）第46回	1,800,000,000	2,168,226,000	
国庫債券 利付（30年）第47回	1,900,000,000	2,338,558,000	
国庫債券 利付（30年）第48回	1,900,000,000	2,245,344,000	
国庫債券 利付（30年）第49回	1,800,000,000	2,127,222,000	
国庫債券 利付（30年）第50回	1,600,000,000	1,648,640,000	
国庫債券 利付（30年）第51回	1,800,000,000	1,623,906,000	
国庫債券 利付（30年）第52回	1,900,000,000	1,808,268,000	
国庫債券 利付（30年）第53回	1,700,000,000	1,659,608,000	
国庫債券 利付（30年）第54回	1,700,000,000	1,746,920,000	
国庫債券 利付（30年）第55回	1,800,000,000	1,847,826,000	
国庫債券 利付（30年）第56回	1,500,000,000	1,538,265,000	
国庫債券 利付（30年）第57回	1,300,000,000	1,331,772,000	
国庫債券 利付（30年）第58回	500,000,000	511,675,000	
国庫債券 利付（20年）第43回	400,000,000	415,084,000	
国庫債券 利付（20年）第44回	150,000,000	156,870,000	
国庫債券 利付（20年）第45回	242,000,000	252,662,520	
国庫債券 利付（20年）第46回	90,000,000	94,196,700	
国庫債券 利付（20年）第47回	1,230,000,000	1,294,415,100	
国庫債券 利付（20年）第48回	200,000,000	213,142,000	
国庫債券 利付（20年）第49回	200,000,000	212,292,000	
国庫債券 利付（20年）第50回	183,000,000	193,240,680	
国庫債券 利付（20年）第51回	310,000,000	329,812,100	
国庫債券 利付（20年）第52回	100,000,000	107,223,000	
国庫債券 利付（20年）第53回	250,000,000	269,437,500	
国庫債券 利付（20年）第54回	250,000,000	270,312,500	
国庫債券 利付（20年）第55回	231,000,000	249,382,980	
国庫債券 利付（20年）第56回	120,000,000	130,162,800	
国庫債券 利付（20年）第57回	210,000,000	226,944,900	
国庫債券 利付（20年）第58回	180,000,000	195,447,600	
国庫債券 利付（20年）第59回	230,000,000	248,830,100	

国庫債券 利付(20年)第60回	780,000,000	833,305,200	
国庫債券 利付(20年)第61回	300,000,000	315,921,000	
国庫債券 利付(20年)第62回	440,000,000	460,072,800	
国庫債券 利付(20年)第63回	300,000,000	328,728,000	
国庫債券 利付(20年)第64回	400,000,000	442,124,000	
国庫債券 利付(20年)第65回	455,000,000	505,072,750	
国庫債券 利付(20年)第66回	300,000,000	331,359,000	
国庫債券 利付(20年)第67回	310,000,000	345,457,800	
国庫債券 利付(20年)第68回	290,000,000	328,181,400	
国庫債券 利付(20年)第69回	560,000,000	630,504,000	
国庫債券 利付(20年)第70回	540,000,000	620,740,800	
国庫債券 利付(20年)第71回	200,000,000	227,496,000	
国庫債券 利付(20年)第72回	670,000,000	761,568,900	
国庫債券 利付(20年)第73回	1,600,000,000	1,816,432,000	
国庫債券 利付(20年)第74回	1,300,000,000	1,484,327,000	
国庫債券 利付(20年)第75回	600,000,000	688,092,000	
国庫債券 利付(20年)第76回	910,000,000	1,031,293,900	
国庫債券 利付(20年)第77回	700,000,000	798,035,000	
国庫債券 利付(20年)第78回	800,000,000	910,000,000	
国庫債券 利付(20年)第79回	860,000,000	984,287,200	
国庫債券 利付(20年)第80回	900,000,000	1,036,377,000	
国庫債券 利付(20年)第81回	360,000,000	413,762,400	
国庫債券 利付(20年)第82回	820,000,000	948,420,200	
国庫債券 利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,591,364,600	
国庫債券 利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,384,884,000	
国庫債券 利付(20年)第85回	400,000,000	466,772,000	
国庫債券 利付(20年)第86回	1,400,000,000	1,655,444,000	
国庫債券 利付(20年)第87回	500,000,000	587,345,000	
国庫債券 利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,306,217,000	
国庫債券 利付(20年)第89回	470,000,000	554,346,200	
国庫債券 利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,776,255,000	
国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	298,105,000	
国庫債券 利付(20年)第92回	1,550,000,000	1,829,372,000	
国庫債券 利付(20年)第93回	300,000,000	352,713,000	
国庫債券 利付(20年)第94回	200,000,000	236,890,000	
国庫債券 利付(20年)第95回	700,000,000	844,676,000	

国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	475,484,000	
国庫債券 利付(20年)第97回	1,300,000,000	1,563,484,000	
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	358,035,000	
国庫債券 利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,514,813,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,841,024,000	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	307,655,000	
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	617,675,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	735,240,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	482,196,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,297,917,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	487,848,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	363,972,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,907,808,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,076,040,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,338,612,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	984,704,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,195,964,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,447,240,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	1,700,000,000	2,087,328,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	1,500,000,000	1,858,800,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,367,124,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,400,000,000	1,723,736,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	611,430,000	

国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	958,808,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	939,904,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	1,700,000,000	2,063,715,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,322,090,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	1,500,000,000	1,861,965,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,229,030,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,131,246,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,231,160,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	800,000,000	974,936,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,300,000,000	1,587,768,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	800,000,000	966,912,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	1,600,000,000	1,937,648,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	958,464,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,560,195,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,698,648,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,701,686,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	841,477,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	832,104,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,203,260,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	940,856,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	700,000,000	832,769,000	
国庫債券 利付(20年)第140回	2,300,000,000	2,771,845,000	

回			
国庫債券 利付(20年)第141回	1,700,000,000	2,051,798,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	1,250,000,000	1,527,287,500	
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,552,707,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,500,000,000	1,768,965,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,600,000,000	3,146,832,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	2,908,680,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	2,500,000,000	2,994,275,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,700,000,000	3,196,395,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	2,400,000,000	2,843,664,000	
国庫債券 利付(20年)第150回	2,430,000,000	2,841,666,300	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,700,000,000	3,072,114,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	2,400,000,000	2,731,104,000	
国庫債券 利付(20年)第153回	2,450,000,000	2,827,692,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	3,000,000,000	3,411,780,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	2,800,000,000	3,089,716,000	
国庫債券 利付(20年)第156回	2,900,000,000	2,900,000,000	
国庫債券 利付(20年)第157回	3,200,000,000	3,082,240,000	
国庫債券 利付(20年)第158回	2,800,000,000	2,837,940,000	
国庫債券 利付(20年)第159回	2,700,000,000	2,778,597,000	
国庫債券 利付(20年)第160回	2,600,000,000	2,716,974,000	
国庫債券 利付(20年)第161回	2,400,000,000	2,460,816,000	

小計	国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,738,981,000		
	国庫債券 利付(20年)第163回	1,900,000,000	1,940,622,000		
	国庫債券 利付(20年)第164回	1,800,000,000	1,801,602,000		
	メキシコ合衆国 第22回円貨社債(2016)	300,000,000	302,265,000		
	ポーランド共和国 第15回円貨債券(2013)	100,000,000	100,840,000		
	銘柄数:259 組入時価比率:79.9%	482,721,000,000	529,297,982,680	80.5%	
合計			529,297,982,680		
地方債証券	日本円	東京都 公募第685回	100,000,000	102,189,000	
		東京都 公募第690回	200,000,000	206,270,000	
		東京都 公募第703回	100,000,000	103,372,000	
		東京都 公募第707回	100,000,000	103,136,000	
		東京都 公募第708回	100,000,000	103,429,000	
		東京都 公募第710回	100,000,000	103,110,000	
		東京都 公募第712回	100,000,000	103,160,000	
		東京都 公募第715回	100,000,000	103,300,000	
		東京都 公募第716回	200,000,000	206,690,000	
		東京都 公募第731回	100,000,000	103,406,000	
		東京都 公募第745回	300,000,000	309,774,000	
		東京都 公募第760回	100,000,000	99,509,000	
		東京都 公募第761回	100,000,000	99,795,000	
		東京都 公募第769回	500,000,000	503,550,000	
		東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	134,460,000	
		東京都 公募第10回	200,000,000	262,946,000	
		東京都 公募第1回	300,000,000	322,683,000	
		東京都 公募(20年)第3回	200,000,000	225,422,000	
		東京都 公募第7回	100,000,000	115,102,000	
		東京都 公募(20年)第16回	200,000,000	237,338,000	
		東京都 公募(20年)第17回	200,000,000	238,984,000	
		東京都 公募第23回	100,000,000	122,216,000	
		東京都 公募(20年)第26回	100,000,000	118,622,000	
		北海道 公募平成21年度第6回	100,000,000	101,857,000	
北海道 公募平成21年度第10回	100,000,000	102,105,000			

北海道	公募平成24年度第6回	100,000,000	103,385,000	
北海道	公募平成24年度第9回	100,000,000	103,308,000	
北海道	公募平成25年度第1回	300,000,000	307,911,000	
北海道	公募(5年)平成26年度第8回	200,000,000	200,372,000	
北海道	公募(5年)平成26年度第10回	100,000,000	100,167,000	
北海道	公募平成27年度第7回	100,000,000	103,096,000	
北海道	公募平成28年度第13回	200,000,000	199,912,000	
北海道	公募平成29年度第5回	200,000,000	200,266,000	
北海道	公募平成29年度第6回	700,000,000	699,328,000	
宮城県	公募第32回2号	100,000,000	99,836,000	
神奈川県	公募第184回	100,000,000	102,956,000	
神奈川県	公募第188回	200,000,000	207,616,000	
神奈川県	公募第196回	100,000,000	103,092,000	
神奈川県	公募第200回	100,000,000	104,139,000	
神奈川県	公募第205回	100,000,000	103,513,000	
神奈川県	公募第206回	100,000,000	103,578,000	
神奈川県	公募第210回	200,000,000	204,992,000	
神奈川県	公募第231回	200,000,000	201,028,000	
神奈川県	公募(30年)第3回	100,000,000	135,965,000	
神奈川県	公募第7回	300,000,000	354,171,000	
大阪府	公募第337回	200,000,000	205,212,000	
大阪府	公募第346回	100,000,000	103,172,000	
大阪府	公募第356回	100,000,000	103,635,000	
大阪府	公募第378回	104,000,000	107,634,800	
大阪府	公募第381回	100,000,000	103,529,000	
大阪府	公募第382回	100,000,000	103,526,000	
大阪府	公募第383回	100,000,000	103,697,000	
大阪府	公募第384回	100,000,000	103,575,000	
大阪府	公募第387回	300,000,000	308,328,000	
大阪府	公募第389回	100,000,000	102,878,000	
大阪府	公募第417回	102,000,000	102,944,520	
大阪府	公募第429回	179,000,000	179,204,060	
大阪府	公募第5回	100,000,000	121,492,000	
大阪府	公募第8回	100,000,000	118,937,000	
大阪府	公募(5年)第130回	600,000,000	599,484,000	

大阪府	公募(5年)第137回	1,024,000,000	1,022,648,320
大阪府	公募(5年)第141回	230,000,000	229,707,900
京都府	公募平成24年度第2回	100,000,000	103,509,000
京都府	公募平成24年度第6回	100,000,000	103,353,000
京都府	公募平成26年度第5回	100,000,000	115,210,000
京都府	公募平成26年度第7回	200,000,000	206,268,000
兵庫県	公募平成21年度第13回	100,000,000	101,549,000
兵庫県	公募平成21年度第25回	100,000,000	102,133,000
兵庫県	公募平成22年度第1回	100,000,000	102,597,000
兵庫県	公募平成26年度第17回	100,000,000	102,530,000
兵庫県	公募(30年)第2回	100,000,000	132,438,000
兵庫県	公募(15年)第1回	300,000,000	337,059,000
兵庫県	公募(15年)第3回	100,000,000	110,385,000
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	309,774,000
兵庫県	公募第2回	100,000,000	119,842,000
兵庫県	公募第9回	100,000,000	121,854,000
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	117,724,000
静岡県	公募平成21年度第7回	100,000,000	102,154,000
静岡県	公募平成24年度第5回	100,060,000	103,402,004
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	103,096,000
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	105,602,570
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	171,083,550
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	103,142,000
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	206,238,000
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	115,487,704
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	299,538,000
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	118,527,000
静岡県	公募(20年)第14回	100,000,000	118,410,000
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	118,856,000
愛知県	公募平成21年度第17回	100,000,000	102,321,000
愛知県	公募平成22年度第3回	100,000,000	102,575,000
愛知県	公募平成22年度第9回	100,000,000	102,551,000
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	103,600,000
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	103,657,000
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	117,735,000

愛知県 公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	443,080,000	
愛知県 公募平成24年度第17回	100,000,000	120,090,000	
愛知県 公募平成26年度第8回	100,000,000	123,304,000	
愛知県 公募平成26年度第13回	100,000,000	113,772,000	
愛知県 公募平成27年度第15回	100,000,000	102,812,000	
広島県 公募平成22年度第6回	300,000,000	309,564,000	
広島県 公募平成24年度第4回	100,000,000	103,477,000	
広島県 公募平成25年度第3回	200,000,000	208,036,000	
広島県 公募平成26年度第5回	109,650,000	111,525,015	
広島県 公募平成29年度第4回	111,300,000	111,867,630	
埼玉県 公募平成21年度第5回	100,000,000	101,738,000	
埼玉県 公募平成22年度第2回	200,000,000	205,158,000	
埼玉県 公募平成24年度第4回	300,000,000	309,948,000	
埼玉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	104,529,000	
埼玉県 公募平成25年度第6回	148,000,000	153,999,920	
埼玉県 公募平成25年度第10回	100,000,000	103,512,000	
埼玉県 公募平成25年度第11回	100,000,000	103,473,000	
埼玉県 公募平成26年度第3回	100,000,000	103,622,000	
埼玉県 公募平成26年度第6回	200,000,000	206,162,000	
埼玉県 公募平成26年度第7回	400,000,000	410,656,000	
埼玉県 公募平成26年度第9回	100,000,000	102,391,000	
福岡県 公募平成22年度第5回	100,000,000	102,137,000	
福岡県 公募平成23年度第5回	100,000,000	103,324,000	
福岡県 公募平成26年度第1回	100,000,000	103,588,000	
福岡県 公募平成26年度第4回	100,000,000	100,132,000	
福岡県 公募平成27年度第1回	300,000,000	310,521,000	
福岡県 公募平成23年度第1回	100,000,000	111,397,000	
福岡県 公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	135,986,000	
福岡県 公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	123,587,000	
福岡県 公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	118,958,000	
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	117,088,000	
千葉県 公募平成21年度第11回	180,000,000	183,981,600	

千葉県 公募平成24年度第1回	100,000,000	103,912,000	
千葉県 公募平成24年度第2回	100,000,000	103,447,000	
千葉県 公募平成24年度第7回	100,000,000	103,214,000	
千葉県 公募平成24年度第8回	100,000,000	103,740,000	
千葉県 公募平成25年度第3回	100,000,000	104,300,000	
千葉県 公募平成25年度第4回	100,000,000	104,527,000	
千葉県 公募平成26年度第3回	200,000,000	206,748,000	
千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	122,025,000	
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	114,403,000	
新潟県 公募平成21年度第2回	150,000,000	153,265,500	
群馬県 公募第8回	100,000,000	103,443,000	
群馬県 公募第12回	100,000,000	103,083,000	
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	117,702,000	
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	192,432,502	
大分県 公募平成23年度第1回	902,000,000	931,477,360	
共同発行市場地方債 公募第82回	300,000,000	306,636,000	
共同発行市場地方債 公募第84回	500,000,000	511,850,000	
共同発行市場地方債 公募第85回	100,000,000	102,591,000	
共同発行市場地方債 公募第88回	100,000,000	102,378,000	
共同発行市場地方債 公募第89回	100,000,000	102,195,000	
共同発行市場地方債 公募第92回	110,000,000	112,667,500	
共同発行市場地方債 公募第93回	300,000,000	309,177,000	
共同発行市場地方債 公募第94回	300,000,000	309,408,000	
共同発行市場地方債 公募第96回	100,000,000	103,470,000	
共同発行市場地方債 公募第101回	300,000,000	309,744,000	
共同発行市場地方債 公募第102回	150,000,000	154,908,000	
共同発行市場地方債 公募第103回	100,000,000	103,257,000	
共同発行市場地方債 公募第104回	200,000,000	206,886,000	
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	207,352,000	
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	206,736,000	
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	206,878,000	

共同発行市場地方債 公募第112回	100,000,000	103,316,000
共同発行市場地方債 公募第113回	800,000,000	824,800,000
共同発行市場地方債 公募第114回	243,700,000	251,927,312
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	103,361,000
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	206,854,000
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	103,740,000
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	207,238,000
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	309,327,000
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	102,636,000
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	411,612,000
共同発行市場地方債 公募第124回	100,000,000	104,476,000
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	104,071,000
共同発行市場地方債 公募第128回	300,000,000	309,984,000
共同発行市場地方債 公募第129回	100,000,000	103,654,000
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	103,960,000
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	103,500,000
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	206,748,000
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	206,220,000
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	159,688,750
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	553,591,800
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,022,560,000
共同発行市場地方債 公募第156回	100,000,000	99,961,000

回			
共同発行市場地方債 公募第157回	100,000,000	99,805,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	120,128,000	
堺市 公募平成22年度第2回	100,000,000	103,071,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	119,389,000	
島根県 公募平成22年度第1回	100,000,000	102,549,000	
島根県 公募平成28年度第3回	100,000,000	99,919,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	205,510,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,282,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	145,912,100	
栃木県 公募平成24年度第1回	100,000,000	103,393,000	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	103,282,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	241,854,052	
奈良県 公募平成28年度第1回	100,000,000	99,919,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,740,000	
大阪市 公募平成21年度第6回	100,000,000	102,197,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	103,537,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	103,326,000	
大阪市 公募(5年)平成28年度第5回	100,000,000	99,919,000	
大阪市 公募(15年)第1回	100,000,000	113,137,000	
大阪市 公募(20年)第1回	300,000,000	359,442,000	
大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	122,855,000	
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	120,602,000	
大阪市 公募(20年)第17回	100,000,000	118,505,000	
名古屋市 公募第469回	100,000,000	101,958,000	
名古屋市 公募第478回	100,000,000	103,856,000	
名古屋市 公募第481回	100,000,000	103,228,000	
名古屋市 公募第488回	300,000,000	310,041,000	
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	213,328,000	
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	107,149,000	
京都市 公募平成23年度第4回	100,000,000	103,646,000	
京都市 公募平成29年度第4回	101,280,000	101,805,643	
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	114,690,000	
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	113,731,000	
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	304,146,000	

神戸市	公募平成28年度第1回	200,000,000	199,612,000	
横浜市	公募平成21年度第4回	200,000,000	203,290,000	
横浜市	公募平成22年度第5回	100,000,000	103,049,000	
横浜市	公募公債平成24年度2回	200,000,000	206,818,000	
横浜市	公募公債平成25年度1回	200,000,000	206,218,000	
横浜市	公募公債平成25年度5回	200,000,000	206,634,000	
横浜市	公募公債平成26年度5回	200,000,000	205,236,000	
横浜市	公募平成28年度第5回	300,000,000	302,310,000	
横浜市	公募(20年)第26回	100,000,000	119,316,000	
横浜市	公募(20年)第30回	100,000,000	114,007,000	
札幌市	公募平成22年度第4回	100,000,000	102,030,000	
札幌市	公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	119,595,000	
札幌市	公募平成26年度第4回	100,000,000	102,897,000	
札幌市	公募平成26年度第9回	200,000,000	204,720,000	
川崎市	公募第82回	100,000,000	101,856,000	
川崎市	公募第85回	100,000,000	103,120,000	
川崎市	公募(20年)第17回	100,000,000	115,831,000	
北九州市	公募(20年)第14回	100,000,000	118,606,000	
福岡市	公募平成26年度第2回	100,000,000	115,773,000	
福岡市	公募平成26年度第5回	100,000,000	102,997,000	
福岡市	公募平成26年度第8回	160,000,000	164,259,200	
広島市	公募平成21年度第3回	100,000,000	101,976,000	
広島市	公募平成26年度第2回	100,000,000	102,534,000	
広島市	公募平成27年度第2回	500,000,000	513,945,000	
千葉市	公募平成24年度第1回	100,000,000	103,912,000	
三重県	公募平成24年度第1回	140,660,000	145,393,209	
鹿児島県	公募(5年)平成28年度第1回	100,000,000	99,921,000	
福井県	公募平成22年度第2回	100,000,000	103,881,000	
福井県	公募平成24年度第4回	100,000,000	102,106,000	
福井県	公募平成27年度第4回	200,000,000	199,688,000	
徳島県	公募平成22年度第1回	400,000,000	409,952,000	
山梨県	公募平成21年度第1回	100,000,000	101,816,000	
山梨県	公募平成24年度第1回	200,000,000	206,734,000	
岡山県	公募平成21年度第2回	100,000,000	102,410,000	
岡山県	公募平成28年度第2回	168,900,000	169,776,591	

小計	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	100,000,000	120,944,000		
	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	300,000,000	365,394,000		
	福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	119,884,000		
	福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	105,037,000		
	銘柄数：253 組入時価比率：6.7%	41,952,820,000	44,129,686,112	6.7%	
	合計		44,129,686,112		
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	100,000,000	103,625,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	156,281,980	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	199,703,870	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	108,591,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	111,124,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	309,357,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	108,155,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	301,233,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第9回	141,000,000	144,254,280	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	105,703,620	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000	164,253,360	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	301,266,000	
		道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	320,121,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第344回	200,000,000	206,748,000	
		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	133,616,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第8回	200,000,000	235,548,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第17回	100,000,000	117,906,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回	200,000,000	239,466,000	
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	303,912,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第39回	100,000,000	121,418,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回	100,000,000	122,834,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第80回	100,000,000	103,650,000	
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	414,476,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	206,672,000	
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	117,607,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第102回	100,000,000	102,938,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第103回	350,000,000	411,726,000	
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	119,981,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第130回	200,000,000	205,542,000	
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	205,172,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第136回	200,000,000	205,996,000	
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	347,805,000	
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	117,838,000	
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	85,352,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第6回	100,000,000	105,194,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第9回	100,000,000	105,343,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	242,214,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	200,000,000	242,648,000	

券 政府保証債第 9 7 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 9 8 回	300,000,000	306,453,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 9 9 回	200,000,000	244,836,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 0 0 回	400,000,000	409,692,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 0 6 回	200,000,000	243,296,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 1 4 回	200,000,000	239,056,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 2 3 回	100,000,000	129,286,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 3 7 回	440,000,000	456,442,800	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 4 9 回	140,000,000	145,019,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 5 5 回	100,000,000	103,372,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 5 7 回	140,000,000	144,811,800	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 6 5 回	100,000,000	124,196,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 6 8 回	100,000,000	103,576,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 6 9 回	100,000,000	117,654,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 0 回	218,000,000	225,636,540	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 1 回	100,000,000	116,673,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 2 回	300,000,000	378,771,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 3 回	200,000,000	207,308,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 7 5 回	200,000,000	207,210,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 8 0 回	200,000,000	206,958,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 8 2 回	900,000,000	935,892,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債 券 政府保証債第 1 8 3 回	100,000,000	119,212,000	

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	201,388,040	
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	412,476,000	
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	1,045,640,000	
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	284,093,120	
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	311,640,000	
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	142,116,950	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	145,000,000	150,392,550	
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	116,138,000	
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	122,411,000	
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	116,761,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	100,000,000	103,843,000	
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	122,444,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	190,000,000	196,414,400	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	100,000,000	102,935,000	
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	558,560,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回	151,000,000	150,707,060	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第321回	500,000,000	502,730,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第335回	100,000,000	101,304,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	300,000,000	405,456,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回	100,000,000	137,103,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	137,271,000	
公営企業債券 政府保証15年第1	300,000,000	309,813,000	

回			
地方公営企業等金融機構債券（20年）第1回	100,000,000	118,676,000	
地方公共団体金融機構債券 第2回	100,000,000	101,509,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保証第5回	200,000,000	203,268,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	120,532,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	115,911,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	367,038,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	107,728,000	
地方公共団体金融機構債券 第13回	200,000,000	204,994,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保証第16回	100,000,000	102,308,000	
地方公共団体金融機構債券 第16回	100,000,000	102,546,000	
地方公共団体金融機構債券 第27回	300,000,000	309,513,000	
地方公共団体金融機構債券 第28回	500,000,000	516,455,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	108,056,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	106,674,000	
地方公共団体金融機構債券 第37回	400,000,000	413,024,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回	194,000,000	200,863,720	
地方公共団体金融機構債券 F132回	500,000,000	534,345,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	103,463,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	104,656,200	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	105,647,520	
地方公共団体金融機構債券 第41回	600,000,000	619,692,000	
地方公共団体金融機構債券 F14	100,000,000	105,856,000	

2回			
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 4回	200,000,000	202,474,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 5回	200,000,000	212,708,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 7回	100,000,000	109,699,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第4 2回	108,000,000	111,993,840	
地方公共団体金融機構債券 第4 2 回	100,000,000	103,346,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第4 3回	202,000,000	208,975,060	
政保 地方公共団体金融機構債券 第4 4回	145,000,000	150,744,900	
地方公共団体金融機構債券 第4 4 回	100,000,000	103,424,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第4 5回	223,000,000	231,786,200	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 0回	100,000,000	108,133,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第4 9回	13,000,000	13,588,770	
政保 地方公共団体金融機構債券 第5 0回	100,000,000	104,719,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (6年) 第1 0回	300,000,000	301,368,000	
地方公共団体金融機構債券 第5 1 回	600,000,000	623,748,000	
地方公共団体金融機構債券 第5 2 回	300,000,000	312,906,000	
地方公共団体金融機構債券(1 5 年) 第2回	200,000,000	218,566,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第5 6回	591,000,000	615,762,900	
政保 地方公共団体金融機構債券 第5 9回	116,000,000	120,504,280	
政保 地方公共団体金融機構債券 (6年) 第1 4回	300,000,000	301,395,000	
地方公共団体金融機構債券(2 0 年) 第3 8回	100,000,000	115,225,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第6 4回	100,000,000	103,323,000	

地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	102,951,000	
地方公共団体金融機構債券(20年) 第39回	100,000,000	114,273,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回	400,000,000	413,228,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回	320,000,000	328,393,600	
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	189,000,000	195,320,160	
地方公共団体金融機構債券 第74回	300,000,000	308,532,000	
地方公共団体金融機構債券 第77回	100,000,000	102,740,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	522,203,460	
地方公共団体金融機構債券 第79回	400,000,000	410,836,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	116,000,000	115,773,800	
地方公共団体金融機構債券 第101回	400,000,000	401,652,000	
公営企業債券(20年) 第2回財投機関債	100,000,000	106,303,000	
公営企業債券(20年) 第5回財投機関債	200,000,000	221,330,000	
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債	100,000,000	122,532,000	
首都高速道路社債 第13回	100,000,000	100,228,000	
首都高速道路 第17回	200,000,000	199,820,000	
首都高速道路債券 政府保証第8回	100,000,000	102,111,000	
阪神高速道路 第13回	100,000,000	100,161,000	
阪神高速道路 第15回	200,000,000	199,924,000	
阪神高速道路債券 政府保証第5回	100,000,000	102,321,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	103,345,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	206,194,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	108,046,000	
都市再生債券 財投機関債第109回	100,000,000	106,968,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	114,921,000	

民間都市開発推進機構 政府保証第 16回	360,000,000	373,708,800	
東京交通債券 第342回	200,000,000	218,440,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	174,180,510	
関西国際空港社債 財投機関債第2 6回	300,000,000	307,458,000	
関西国際空港社債 財投機関債第3 2回	100,000,000	103,569,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機 関債	100,000,000	103,547,000	
中部国際空港債券 政府保証第18 回	368,000,000	380,210,240	
預金保険機構債券 政府保証第20 9回	2,000,000,000	2,006,660,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第3回	200,000,000	235,990,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第18回	100,000,000	110,816,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第41回	100,000,000	102,213,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	112,210,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	119,414,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第73回	100,000,000	103,661,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	121,520,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	338,055,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	121,442,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第79回	100,000,000	103,362,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第86回	200,000,000	206,574,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	223,942,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第120回	100,000,000	119,537,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	132,048,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	250,000,000	256,565,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	99,568,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	206,616,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	204,482,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第17回	100,000,000	103,486,000	
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	299,043,000	
農林債券 利付第773回い号	300,000,000	300,762,000	
農林債券 利付第777回い号	300,000,000	301,062,000	
農林債券 利付第781回い号	100,000,000	100,421,000	
しんきん中金債券 利付第302回	100,000,000	100,256,000	
しんきん中金債券 利付第308回	100,000,000	100,376,000	
しんきん中金債券 利付第316回	100,000,000	100,000,000	
しんきん中金債券 利付第317回	800,000,000	799,768,000	
しんきん中金債券 利付第335回	200,000,000	199,956,000	
商工債券 利付(3年)第202回	1,100,000,000	1,098,581,000	
商工債券 利付(3年)第203回	1,100,000,000	1,098,658,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関 債	100,000,000	121,406,000	
東日本高速道路 第34回	100,000,000	100,506,000	
東日本高速道路 第36回	200,000,000	200,000,000	
中日本高速道路社債 第44回	100,000,000	100,605,000	
中日本高速道路社債 第61回	100,000,000	100,412,000	
中日本高速道路 第62回	200,000,000	200,802,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	103,039,000	
中日本高速道路 第66回	1,200,000,000	1,198,836,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	206,720,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	102,776,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	299,766,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第35回	200,000,000	205,058,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第62回	100,000,000	103,440,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債 券 財投機関債第68回	200,000,000	205,974,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債	100,000,000	114,468,000	

券 財投機関債第 6 9 回			
貸付債権担保第 6 回住宅金融公庫債券	11,478,000	11,695,852	
貸付債権担保第 1 2 回住宅金融公庫債券	38,676,000	39,695,112	
貸付債権担保第 1 9 回住宅金融公庫債券	71,765,000	74,165,539	
貸付債権担保第 1 0 回住宅金融公庫債券	72,498,000	73,756,565	
貸付債権担保第 5 回 S 種住宅金融公庫債券	44,502,000	46,154,804	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融公庫債券	49,797,000	52,649,372	
貸付債権担保第 7 回 S 種住宅金融公庫債券	15,573,000	16,435,432	
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融公庫債券	33,772,000	35,204,608	
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融公庫債券	38,884,000	41,062,670	
貸付債権担保第 1 5 回住宅金融公庫債券	43,050,000	44,392,729	
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融公庫債券	72,548,000	75,327,313	
貸付債権担保第 2 0 回住宅金融公庫債券	74,530,000	77,985,956	
貸付債権担保第 4 4 回住宅金融公庫債券	66,076,000	69,938,142	
貸付債権担保第 8 回住宅金融支援機構債券	112,812,000	118,796,676	
貸付債権担保第 7 回住宅金融支援機構債券	18,346,000	19,366,404	
貸付債権担保第 2 5 回住宅金融支援機構債券	28,266,000	30,722,315	
貸付債権担保第 2 8 回住宅金融支援機構債券	96,141,000	103,281,392	
貸付債権担保 S 種第 1 6 回住宅金融支援機構債券	22,385,000	23,117,213	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融支援機構債券	100,058,000	105,367,077	
貸付債権担保 S 種第 1 7 回住宅金融支援機構債券	45,378,000	46,959,877	
貸付債権担保第 4 5 回住宅金融支援機構債券	122,769,000	130,769,855	

貸付債権担保第5 2 回住宅金融支援 機構債券	88,590,000	93,561,670	
貸付債権担保第2 4 回住宅金融支援 機構債券	52,372,000	56,794,815	
貸付債権担保第4 8 回住宅金融支援 機構債券	115,323,000	123,224,931	
貸付債権担保第4 0 回住宅金融支援 機構債券	127,566,000	133,514,402	
貸付債権担保第6 2 回住宅金融支援 機構債券	167,073,000	174,908,723	
貸付債権担保第6 0 回住宅金融支援 機構債券	162,378,000	170,763,199	
貸付債権担保第6 1 回住宅金融支援 機構債券	104,568,000	109,629,091	
貸付債権担保第5 1 回住宅金融支援 機構債券	41,391,000	43,885,635	
貸付債権担保第4 3 回住宅金融支援 機構債券	97,410,000	103,315,968	
貸付債権担保第7 9 回住宅金融支援 機構債券	54,352,000	56,570,105	
貸付債権担保第8 1 回住宅金融支援 機構債券	116,380,000	121,210,933	
貸付債権担保第7 2 回住宅金融支援 機構債券	53,988,000	56,164,796	
貸付債権担保第2 2 回住宅金融公庫 債券	30,326,000	31,528,729	
貸付債権担保第7 0 回住宅金融支援 機構債券	159,060,000	166,745,779	
貸付債権担保第3 3 回住宅金融支援 機構債券	34,976,000	37,392,491	
貸付債権担保第3 4 回住宅金融支援 機構債券	36,889,000	39,462,745	
貸付債権担保第3 5 回住宅金融支援 機構債券	37,028,000	39,417,787	
貸付債権担保第4 6 回住宅金融支援 機構債券	40,802,000	43,556,135	
貸付債権担保第5 5 回住宅金融支援 機構債券	106,240,000	112,088,512	
貸付債権担保第5 6 回住宅金融支援 機構債券	152,514,000	160,897,694	
貸付債権担保第5 7 回住宅金融支援 機構債券	50,502,000	53,318,496	
貸付債権担保第7 6 回住宅金融支援 機構債券	103,598,000	108,422,558	

機構債券			
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	14,396,000	14,952,981	
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	99,270,000	101,995,954	
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	40,544,000	41,615,172	
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	41,440,000	41,899,569	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	101,836,000	110,083,697	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	101,025,000	107,775,490	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	202,035,000	212,427,680	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	106,944,000	112,781,003	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	172,893,000	180,607,485	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	154,353,000	160,448,399	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	118,890,000	125,269,637	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	103,684,000	108,786,289	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	243,548,000	253,358,113	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	430,059,000	446,771,092	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	63,849,000	66,083,715	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	66,821,000	69,246,602	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	67,308,000	69,455,125	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	139,322,000	142,752,107	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	145,662,000	148,027,550	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	77,247,000	79,423,820	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	81,361,000	83,429,196	

		貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援機構債券	240,861,000	248,462,573	
		貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援機構債券	245,616,000	254,460,632	
		貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援機構債券	164,564,000	170,290,827	
		貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支援機構債券	81,406,000	84,034,599	
		貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支援機構債券	81,749,000	84,672,344	
		貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支援機構債券	281,247,000	282,653,235	
		貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支援機構債券	188,678,000	190,534,591	
		貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券	189,478,000	191,018,456	
		貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支援機構債券	95,076,000	95,996,335	
		貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支援機構債券	190,314,000	191,992,569	
		貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支援機構債券	95,760,000	96,152,616	
		貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支援機構債券	96,177,000	96,797,341	
		貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支援機構債券	96,806,000	97,619,170	
		貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券	389,676,000	391,686,728	
		貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券	293,271,000	295,054,087	
		貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券	196,426,000	197,451,343	
		貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券	197,444,000	199,029,475	
		貸付債権担保第 1 3 4 回住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,236,000	
	小計	銘柄数：284 組入時価比率：8.5%	53,196,666,000	56,080,031,024 8.5%	
	合計			56,080,031,024	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（B F C M）第 1 4 回円貨社債	200,000,000	202,546,000	

ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第7回円貨社債	100,000,000	100,471,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第11回円貨社債	100,000,000	100,748,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第14回円貨社債	100,000,000	100,239,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第1回非上位円貨社債	100,000,000	100,654,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第6回円貨社債(2014)	100,000,000	103,480,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第15回円貨社債(2018)	100,000,000	100,012,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第16回円貨社債(2018)	100,000,000	100,008,000	
マラヤン・バンキング・ベルハッ ド 第2回円貨社債(2015)	200,000,000	200,598,000	
スタンダード・チャータード 第2 回円貨社債(2015)	100,000,000	100,262,000	
スタンダード・チャータード 第3 回円貨社債(2015)	100,000,000	102,076,000	
エイチエスピーシー・ホールディン グス・ピーエルシー 第2回円	100,000,000	102,202,000	
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	104,475,000	
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	100,658,000	
ロイズ・バンキング・グループ・ ピーエルシー 第6回円貨社債	100,000,000	99,915,000	
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	100,042,000	
サントナール銀行 第1回円貨社 債	100,000,000	98,983,000	
ルノー 第19回円貨社債(201 7)	100,000,000	100,083,000	
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回 円貨社債(2017)	100,000,000	101,758,000	
ナショナル・オーストラリア銀行 第11回円貨社債(2015)	200,000,000	200,422,000	
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	200,278,000	
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上 位円貨社債(2017)	100,000,000	99,658,000	
大和ハウス工業 第5回特定社債間	100,000,000	100,895,000	

限定同順位特約付			
森永乳業 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,662,000	
明治ホールディングス 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,103,000	
アサヒグループホールディングス 第7回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,314,000	
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約付	100,000,000	100,801,000	
麒麟ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,898,000	
味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,226,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,792,000	
野村不動産ホールディングス 第5回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,460,000	
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約付	200,000,000	197,704,000	
森ビル 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,478,000	
東急不動産ホールディングス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,983,000	
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	100,594,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,935,000	
住友化学 第43回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,610,000	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,126,000	
クレハ 第5回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,302,000	
エア・ウォーター 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,191,000	
三井化学 第47回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,028,000	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,136,000	
三菱ケミカルホールディングス 第14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,082,000	
花王 第4回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,053,000	

武田薬品工業 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,238,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,845,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,576,000	
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	103,031,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,659,000	
ブリヂストン 第8回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,478,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,071,000	
住友大阪セメント 第14回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,352,000	
日本特殊陶業 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,990,000	
新日鐵住金 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,039,000	
新日鐵住金 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,959,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,040,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,224,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,207,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第22回(JFEス保証)	100,000,000	102,587,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,494,000	
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,216,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	218,984,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,869,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,258,000	
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,624,000	
富士通 第34回社債間限定同順位	100,000,000	101,151,000	

特約付			
パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,016,000	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,535,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,908,000	
ソニー 第32回	200,000,000	200,992,000	
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,166,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,542,000	
明治安田生命2014基金特定目的会社 第1回特定社債	300,000,000	300,963,000	
J A三井リース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,862,000	
J A三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,809,000	
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス 第2回社債間限定	100,000,000	100,161,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	103,999,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,379,000	
ドンキホーテホールディングス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,935,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,661,000	
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,900,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,686,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,593,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,855,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	209,032,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,717,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,295,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位	100,000,000	107,152,000	

位特約付			
三菱商事 第74回担保提供制限等 財務上特約無	100,000,000	101,714,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位 特約付	200,000,000	201,162,000	
丸井グループ 第28回社債間限定 同順位特約付	200,000,000	201,912,000	
クレディセゾン 第50回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	102,807,000	
クレディセゾン 第51回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	102,762,000	
あおぞら銀行 第9回社債間限定同 順位特約付	300,000,000	300,069,000	
あおぞら銀行 第10回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,010,000	
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	103,040,000	
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	99,670,000	
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	205,702,000	
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	120,247,000	
三菱東京UFJ銀行 第9回特定社 債間限定同順位特約付	100,000,000	104,418,000	
東京三菱銀行 第57回特定社債間 限定同順位特約付	100,000,000	109,153,000	
三菱東京UFJ銀行 第119回特 定社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,241,000	
三菱東京UFJ銀行 第159回特 定社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,616,000	
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	307,689,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	102,635,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	100,000,000	106,793,000	
りそな銀行 第6回劣後特約付	300,000,000	309,807,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特 約付	100,000,000	104,127,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約 付	300,000,000	314,652,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同	100,000,000	103,234,000	

順位特約付			
セブン銀行 第11回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	102,048,000	
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	206,252,000	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	104,028,000	
みずほ銀行 第38回特定社債間限 定同順位特約付	1,000,000,000	1,002,650,000	
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	100,046,000	
リコーリース 第28回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	99,729,000	
ジャックス 第12回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,845,000	
ジャックス 第19回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,039,000	
オリエントコーポレーション 第2 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,350,000	
日立キャピタル 第52回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,669,000	
日立キャピタル 第56回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	99,974,000	
日立キャピタル 第57回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	101,908,000	
オリックス 第164回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,132,000	
三井住友ファイナンス&リース 第 13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,121,000	
三菱UFJリース 第52回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,343,000	
三菱UFJリース 第55回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	99,902,000	
三菱UFJリース 第30回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,787,000	
大和証券グループ本社 第17回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	100,282,000	
大和証券グループ本社 第22回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	100,433,000	
大和証券グループ本社 第23回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	103,311,000	
野村ホールディングス 第21回	100,000,000	103,022,000	
野村ホールディングス 第46回	100,000,000	100,379,000	

三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	108,849,000	
三菱地所 第98回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	101,987,000	
三菱地所 第110回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	100,498,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	103,089,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	99,685,000	
東京建物 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,791,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,328,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,858,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,800,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,878,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,980,000	
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	104,095,000	
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	101,761,000	
東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,512,000	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	203,940,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,303,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,380,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,444,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,224,000	
東日本旅客鉄道 第15回	100,000,000	105,706,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	216,818,000	
東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,228,000	

東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	118,569,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,751,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	119,082,000	
西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,665,000	
東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,319,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	243,428,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,196,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	118,691,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	100,000,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	101,130,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	102,643,000	
西武ホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,106,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,615,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,558,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,707,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,538,000	
A N A ホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,128,000	
三菱倉庫 第14回	100,000,000	100,797,000	
澁澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,990,000	
日本電信電話 第60回	100,000,000	102,903,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,654,000	
東京電力 第547回	100,000,000	103,579,000	
東京電力 第548回	100,000,000	115,947,000	
東京電力 第559回	100,000,000	101,636,000	
東京電力 第560回	100,000,000	114,349,000	

東京電力 第565回	300,000,000	306,576,000	
中部電力 第500回	200,000,000	207,534,000	
中部電力 第524回	100,000,000	100,346,000	
関西電力 第482回	100,000,000	102,364,000	
関西電力 第484回	100,000,000	102,136,000	
関西電力 第496回	100,000,000	103,918,000	
関西電力 第497回	200,000,000	209,330,000	
関西電力 第498回	200,000,000	201,612,000	
中国電力 第330回	100,000,000	105,555,000	
中国電力 第377回	200,000,000	209,440,000	
中国電力 第378回	100,000,000	104,168,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	104,609,000	
北陸電力 第304回	100,000,000	104,144,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	105,862,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	103,262,000	
東北電力 第473回	100,000,000	101,376,000	
東北電力 第475回	100,000,000	103,254,000	
東北電力 第481回	200,000,000	207,126,000	
四国電力 第281回	200,000,000	209,488,000	
九州電力 第400回	100,000,000	103,163,000	
九州電力 第409回	100,000,000	101,693,000	
九州電力 第424回	300,000,000	315,615,000	
九州電力 第451回	100,000,000	100,517,000	
北海道電力 第316回	207,000,000	211,433,940	
北海道電力 第323回	100,000,000	109,237,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	101,052,000	
電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,431,000	
電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,798,000	
電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,754,000	
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,703,000	
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,063,000	
東京電力パワーグリッド 第1回	100,000,000	100,351,000	

	東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	100,907,000	
	東京電力パワーグリッド 第11回	200,000,000	201,694,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	125,728,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,297,000	
	北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,104,000	
	ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,192,000	
	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	100,069,000	
小計	銘柄数：218 組入時価比率：4.3%	27,807,000,000	28,579,737,940 4.3%	
合計			28,579,737,940	
合計			658,087,437,756	

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2018年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	643,639,931
コール・ローン	314,416,782
国債証券	604,735,659,523
派生商品評価勘定	72,726
未収入金	171,450,314
未収利息	5,616,453,525
前払費用	176,662,078
流動資産合計	611,658,354,879
資産合計	611,658,354,879
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	173,486
未払金	520,747,015
未払解約金	458,213,641
未払利息	720
その他未払費用	3,761,500
流動負債合計	982,896,362

負債合計	982,896,362
純資産の部	
元本等	
元本	275,983,396,164
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	334,692,062,353
元本等合計	610,675,458,517
純資産合計	610,675,458,517
負債純資産合計	611,658,354,879

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)

2018年 6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	2.2127円
(10,000口当たり純資産額)	(22,127円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2017年 8月31日 至 2018年 6月22日	
1. 金融商品に対する取組方針	
<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>	

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

これらは、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

2018年 6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

2018年 6月22日現在

期首	2017年 8月31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	291,047,642,594円
同期中における追加設定元本額	27,863,535,509円
同期中における一部解約元本額	42,927,781,939円
期末元本額	275,983,396,164円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	93,261,640円
バランスセレクト50	95,996,526円
バランスセレクト70	80,697,449円
野村外国債券インデックスファンド	289,046,272円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,161,348,156円

野村世界6資産分散投信（分配コース）	26,413,879,988円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,522,199,014円
野村資産設計ファンド2015	33,732,120円
野村資産設計ファンド2020	40,659,934円
野村資産設計ファンド2025	49,270,229円
野村資産設計ファンド2030	43,787,599円
野村資産設計ファンド2035	29,786,966円
野村資産設計ファンド2040	63,969,336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）	154,500,482,602円
のむらップ・ファンド（保守型）	5,551,444,997円
のむらップ・ファンド（普通型）	9,222,425,196円
のむらップ・ファンド（積極型）	1,974,213,786円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	1,041,080,043円
野村資産設計ファンド2045	6,730,658円
野村インデックスファンド・外国債券	771,775,203円
マイ・ロード	8,828,375,168円
ネクストコア	438,607,926円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	111,993,042円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	1,944,607,921円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	596,363,804円
野村資産設計ファンド2050	7,783,306円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	4,911,647円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,574,651円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,299,784円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,062,748円
のむらップ・ファンド（やや保守型）	425,994,094円
のむらップ・ファンド（やや積極型）	207,921,082円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,307,090円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,198,538円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,166,898円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	785,358円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,928,892円
野村6資産均等バランス	74,902,919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）	6,621,398,851円
世界6資産分散ファンド	28,936,612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	295,910,401円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	240,727,881円
野村外国債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	11,474,193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）	1,850,527,725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）	562,976,025円
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	2,895,408,941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）	1,563,640,624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）	2,962,069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）	16,331,486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）	825,691円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	5,255,016,313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）	85,375,633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)	301,549,503円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	172,174,152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)	204,913,516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)	225,195,574円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	2,130,251,543円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,005,232,684円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,688,202,595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)	986,042,307円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	4,091,754円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,667,360円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	7,241,651円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	545,746,861円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,403,648,838円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	3,334,219,487円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	3,039,041,528円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	13,284,451,454円
マイバランスDC30	1,574,226,314円
マイバランスDC50	960,756,871円
マイバランスDC70	630,154,310円
野村DC外国債券インデックスファンド	4,168,977,873円
野村DC運用戦略ファンド	2,917,932,127円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	209,577,648円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	66,801,375円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	11,486,687円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	14,886,930円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	1,064,699円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	4,634,622円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	1,114,350円
野村資産設計ファンド(DC)2030	194,781円
野村資産設計ファンド(DC)2040	220,078円
野村資産設計ファンド(DC)2050	293,766円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	1,763,987円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	966,194円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	151,547円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	3,436,171円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年6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(2018年6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	19,840,000.00	21,121,074.75	
		US TREASURY BOND	12,700,000.00	14,331,651.55	
		US TREASURY BOND	22,100,000.00	25,903,615.53	
		US TREASURY BOND	13,800,000.00	16,098,562.50	
		US TREASURY BOND	47,100,000.00	45,882,022.26	
		US TREASURY BOND	39,200,000.00	47,628,000.00	
		US TREASURY BOND	18,800,000.00	23,876,000.00	
		US TREASURY BOND	21,400,000.00	27,065,147.10	
		US TREASURY BOND	17,000,000.00	20,867,500.00	
		US TREASURY BOND	6,300,000.00	7,620,538.59	
		US TREASURY BOND	2,600,000.00	3,155,343.62	
		US TREASURY BOND	100,000.00	120,968.75	
		US TREASURY BOND	19,500,000.00	18,954,608.40	
		US TREASURY BOND	16,000,000.00	18,013,748.80	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,384,250.00	
		US TREASURY N/B	20,500,000.00	20,340,643.25	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,078,753.88	
		US TREASURY N/B	900,000.00	887,238.27	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,380,859.34	
		US TREASURY N/B	7,900,000.00	7,841,366.99	
		US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,878,699.10	
		US TREASURY N/B	10,500,000.00	10,320,760.80	
		US TREASURY N/B	14,500,000.00	14,378,788.70	
		US TREASURY N/B	600,000.00	593,343.72	
		US TREASURY N/B	32,400,000.00	32,840,435.88	
		US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,814,453.00	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,950,195.20	
		US TREASURY N/B	26,750,000.00	26,501,307.92	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,945,742.00	
		US TREASURY N/B	18,500,000.00	18,335,233.45	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,270,261.69			
US TREASURY N/B	50,800,000.00	51,421,106.20			
US TREASURY N/B	8,800,000.00	8,616,780.48			

US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,775,179.62	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,755,311.60	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,329,546.74	
US TREASURY N/B	600,000.00	589,617.18	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,964,765.60	
US TREASURY N/B	5,400,000.00	5,294,109.24	
US TREASURY N/B	51,800,000.00	52,708,520.20	
US TREASURY N/B	5,300,000.00	5,202,901.88	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,643,257.61	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,905,468.50	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,923,632.50	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,903,124.80	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	20,877,327.06	
US TREASURY N/B	600,000.00	589,007.76	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,561,288.56	
US TREASURY N/B	46,200,000.00	47,010,301.80	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,823,124.80	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,097,625.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	489,941.40	
US TREASURY N/B	16,600,000.00	16,379,530.42	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,174,280.32	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,787,890.00	
US TREASURY N/B	13,400,000.00	13,245,062.50	
US TREASURY N/B	32,180,000.00	32,211,423.77	
US TREASURY N/B	36,200,000.00	35,852,139.72	
US TREASURY N/B	900,000.00	877,078.08	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,922,655.80	
US TREASURY N/B	300,000.00	293,519.52	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,569,124.96	
US TREASURY N/B	700,000.00	680,531.25	
US TREASURY N/B	52,600,000.00	52,626,710.28	
US TREASURY N/B	13,700,000.00	13,505,202.44	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	977,031.20	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,761,218.24	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,370,687.50	

US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,210,608.60	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,271,250.00	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,840,476.42	
US TREASURY N/B	45,800,000.00	46,959,312.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,967,656.20	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,402,929.50	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	11,678,312.50	
US TREASURY N/B	600,000.00	577,875.00	
US TREASURY N/B	10,100,000.00	9,992,687.50	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	43,172,437.50	
US TREASURY N/B	22,500,000.00	22,090,428.00	
US TREASURY N/B	300,000.00	289,242.18	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	33,482,030.40	
US TREASURY N/B	800,000.00	764,624.96	
US TREASURY N/B	9,700,000.00	9,581,781.25	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	24,883,931.38	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,149,152.07	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	15,722,499.20	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	16,429,874.16	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	24,739,642.95	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,786,874.40	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,585,820.22	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,161,686.88	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,811,874.40	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,668,749.60	
US TREASURY N/B	13,600,000.00	13,211,124.32	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	32,875,927.16	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,053,625.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	485,312.50	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,557,366.94	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,260,695.28	
US TREASURY N/B	63,400,000.00	61,136,417.12	
US TREASURY N/B	21,300,000.00	20,637,702.06	
US TREASURY N/B	4,700,000.00	4,530,909.98	
US TREASURY N/B	27,100,000.00	26,473,312.50	

US TREASURY N/B	600,000.00	577,593.72	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	966,484.30	
US TREASURY N/B	10,300,000.00	9,849,776.70	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,920,000.00	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,694,531.00	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,439,804.44	
US TREASURY N/B	29,800,000.00	29,003,779.76	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	21,042,654.60	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	16,439,530.40	
US TREASURY N/B	24,200,000.00	22,859,545.06	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,217,327.41	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,380,389.80	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,741,015.50	
US TREASURY N/B	49,600,000.00	47,286,621.28	
US TREASURY N/B	34,400,000.00	32,585,936.64	
US TREASURY N/B	20,900,000.00	19,379,851.04	
US TREASURY N/B	19,400,000.00	19,137,795.42	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	12,954,148.09	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	16,760,624.16	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,056,609.06	
US TREASURY N/B	26,800,000.00	26,716,250.00	
US TREASURY N/B	6,900,000.00	6,646,640.28	
US TREASURY N/B	30,100,000.00	29,561,489.93	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	9,606,250.00	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	5,755,312.20	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,408,374.72	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	33,016,358.52	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,352,890.45	
US TREASURY N/B	44,700,000.00	42,405,629.46	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,380,343.58	
US TREASURY N/B	35,000,000.00	34,516,013.00	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	30,046,875.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,203,945.15	
US TREASURY N/B	24,500,000.00	23,144,843.75	
US TREASURY N/B	50,300,000.00	48,229,053.43	

US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,828,593.60	
US TREASURY N/B	800,000.00	729,250.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,798,906.20	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,136,718.10	
US TREASURY N/B	26,200,000.00	24,912,513.66	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,727,015.58	
US TREASURY N/B	500,000.00	493,671.85	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	4,001,952.90	
US TREASURY N/B	11,100,000.00	13,973,424.81	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	9,720,000.00	
US TREASURY N/B	700,000.00	907,921.84	
US TREASURY N/B	100,000.00	123,062.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,080,937.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	119,726.56	
US TREASURY N/B	100,000.00	123,742.18	
US TREASURY N/B	100,000.00	121,875.00	
US TREASURY N/B	100,000.00	125,953.12	
US TREASURY N/B	13,500,000.00	16,484,764.95	
US TREASURY N/B	200,000.00	228,218.74	
US TREASURY N/B	7,800,000.00	9,375,234.18	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	17,990,000.00	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	8,204,359.04	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,615,272.95	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,579,804.35	
US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,482,421.65	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	8,760,843.52	
US TREASURY N/B	17,600,000.00	16,750,249.12	
US TREASURY N/B	24,200,000.00	24,585,687.50	
US TREASURY N/B	15,400,000.00	16,991,733.22	
US TREASURY N/B	12,700,000.00	14,028,538.11	
US TREASURY N/B	18,900,000.00	20,042,858.43	
US TREASURY N/B	21,000,000.00	21,334,687.50	
US TREASURY N/B	36,900,000.00	36,657,843.75	
US TREASURY N/B	27,600,000.00	24,889,591.68	
US TREASURY N/B	21,700,000.00	21,549,115.56	

	US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,939,218.60	
	US TREASURY N/B	14,400,000.00	14,295,373.92	
	US TREASURY N/B	16,000,000.00	14,383,748.80	
	US TREASURY N/B	15,700,000.00	14,100,562.50	
	US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,106,218.75	
	US TREASURY N/B	12,700,000.00	12,296,179.37	
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,169,367.13	
	US TREASURY N/B	900,000.00	848,671.83	
	US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,280,953.01	
	US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,097,030.80	
小計	銘柄数：183	2,422,770,000.00	2,433,819,392.41	
			(267,841,824,134)	
	組入時価比率：43.9%		44.4%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,664,615.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,600,000.00	7,747,440.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	550,000.00	544,428.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,000,000.00	8,002,720.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,065,830.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	16,300,000.00	16,216,544.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,800,000.00	8,044,296.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,416,945.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	7,954,574.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,050,000.00	10,429,789.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	289,131.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,656,808.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,439,437.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,582,160.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,489,968.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,900,000.00	8,094,419.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,456,214.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,293,320.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,650,000.00	5,384,261.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	726,640.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	98,725.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,680,000.00	7,657,719.20	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	6,101,928.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,200,000.00	7,424,664.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,100,000.00	8,042,850.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	9,300,000.00	11,751,201.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	335,580.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	1,998,234.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	233,310.00	
	銘柄数：29	141,930,000.00	154,143,751.20	(12,752,312,536)
組入時価比率：2.1%			2.1%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	107,000,000.00	102,859,100.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	52,600,000.00	52,868,260.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	126,000,000.00	121,637,880.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	33,000,000.00	32,426,361.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	71,100,000.00	67,872,771.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	39,000,000.00	43,400,370.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,000,000.00	7,061,680.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	86,300,000.00	84,704,313.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	49,600,000.00	52,142,992.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,500,000.00	46,197,750.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	9,899,900.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,000,000.00	55,538,100.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	57,300,000.00	60,899,013.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	63,265,248.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	15,178,515.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	83,620,010.00	
	銘柄数：16	894,600,000.00	899,572,263.00	(4,875,681,665)
組入時価比率：0.8%			0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	3,600,000.00	3,762,180.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,800,000.00	6,371,126.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,200,000.00	6,004,180.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,800,000.00	2,099,727.00	
	BELGIUM KINGDOM	6,400,000.00	7,646,720.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,000,000.00	5,604,865.00	
	BELGIUM KINGDOM	7,000,000.00	8,050,000.00	

BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,035,800.00	
BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	11,073,308.40	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,045,089.20	
BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,036,286.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,006,100.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,001,057.10	
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	4,854,559.50	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,014,900.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,010,955.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,080,625.00	
BELGIUM KINGDOM	5,400,000.00	8,254,229.40	
BELGIUM KINGDOM	5,500,000.00	8,036,248.00	
BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,659,905.50	
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,312,660.80	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,050,601.00	
BELGIUM KINGDOM GOVT	10,900,000.00	15,962,352.40	
BELGIUM KINGDOM GOVT	10,000,000.00	15,716,550.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,000,000.00	8,436,104.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,900,000.00	12,647,082.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,800,000.00	3,901,767.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	26,250,000.00	28,295,284.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	200,000.00	205,725.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,900,000.00	12,182,875.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,600,000.00	3,613,802.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,900,000.00	18,441,339.93	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,900,000.00	6,054,273.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,550,000.00	17,603,448.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,250,000.00	5,314,260.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	11,900,000.00	14,706,048.56	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,400,000.00	8,947,121.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,900,000.00	17,188,500.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,700,000.00	7,963,620.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	508,656.28	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	950,166.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,600,000.00	19,722,020.76	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,440,030.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,425,293.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	18,400,000.00	25,326,186.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,152,799.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	12,730,770.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,077,076.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	423,400.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,400,000.00	7,917,651.18	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,400,000.00	12,058,572.96	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,300,000.00	11,195,966.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,500,000.00	3,798,788.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,500,000.00	4,085,501.70	
BUNDES OblIGATION	100,000.00	101,254.00	
BUNDES OblIGATION	800,000.00	810,272.00	
BUNDES OblIGATION	2,000,000.00	2,042,340.00	
BUNDES OblIGATION	1,600,000.00	1,627,152.00	
BUNDES OblIGATION	3,300,000.00	3,360,225.00	
BUNDES OblIGATION	900,000.00	915,453.00	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,015,020.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	208,680.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,592,460.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,408,607.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,162,505.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,300,000.00	14,369,719.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	7,820,820.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,400,000.00	9,159,360.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,300,000.00	15,579,278.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	7,083,765.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,408,850.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	3,262,620.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000.00	5,668,728.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,600,000.00	12,971,584.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	15,400,000.00	20,948,928.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,700,000.00	5,213,240.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,645,200.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,300,000.00	10,997,310.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,500,000.00	10,872,750.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,100,000.00	4,388,640.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	309,240.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	986,600.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	701,260.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000.00	30,265,164.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,018,700.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,000,000.00	9,006,600.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,013,300.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	4,876,280.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	10,743,200.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	8,495,900.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,800,000.00	12,566,112.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,500,000.00	6,959,203.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,000,000.00	11,498,683.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	12,720,088.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000.00	5,807,149.92	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	8,673,093.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	8,320,400.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,500,000.00	4,632,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	303,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,730,000.00	15,359,707.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	402,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,100,000.00	8,574,579.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	29,200,000.00	30,861,772.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,780,956.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,200,000.00	7,670,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	1,982,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,400,000.00	12,186,098.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,909,388.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000,000.00	10,714,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	97,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,594,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,400,000.00	15,936,480.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	2,550,000.00	2,473,908.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,400,000.00	1,436,960.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	18,891,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	296,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	794,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000.00	8,532,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,082,674.16	
BUONI POLIENNALI DEL TES	20,100,000.00	23,269,770.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	674,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,234,420.88	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,600,000.00	5,236,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,700,000.00	15,855,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	17,912,940.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,954,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,501,020.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,400,000.00	8,022,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	19,622,685.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,843,154.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,922,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,500,000.00	12,009,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,200,000.00	16,515,140.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,500,000.00	21,626,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,300,000.00	8,515,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,700,000.00	24,069,460.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	23,987,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	428,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,900,000.00	10,296,860.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,781,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,900,000.00	10,978,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,446,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	857,105.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	9,911,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,300,000.00	16,405,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,600,000.00	14,024,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	5,163,260.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	1,983,806.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,200,000.00	2,733,120.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	105,221.03	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	107,289.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,021,975.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,227,574.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,465,853.12	
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,299,330.72	
FINNISH GOVERNMENT	2,400,000.00	2,412,938.88	
FINNISH GOVERNMENT	2,900,000.00	3,241,330.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,266,700.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,047,424.20	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,029,260.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,700,000.00	3,277,532.70	
FINNISH GOVERNMENT	700,000.00	695,370.20	
FINNISH GOVERNMENT	1,600,000.00	2,099,676.80	
FRANCE (GOVT OF)	10,300,000.00	10,460,968.40	
FRANCE (GOVT OF)	2,800,000.00	2,827,107.92	
FRANCE (GOVT OF)	1,100,000.00	1,111,860.42	
FRANCE (GOVT OF)	2,700,000.00	2,733,866.10	
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	3,023,100.00	
FRANCE (GOVT OF)	7,000,000.00	7,153,334.30	
FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	2,608,742.50	
FRANCE (GOVT OF)	12,000,000.00	14,288,340.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,020,081.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	100,100.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,140,642.00	
FRANCE (GOVT OF)	4,000,000.00	4,325,752.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	500,000.00	561,055.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,500,000.00	5,819,588.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,800,000.00	15,908,687.24	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	26,700,000.00	28,593,030.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,000,000.00	2,037,100.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	13,221,310.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	15,100,000.00	16,968,096.50	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	14,500,000.00	16,380,070.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,539,982.88	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	10,248,631.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	31,300,000.00	38,613,245.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,317,805.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	28,228,028.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,325,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	33,100,000.00	41,391,550.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,200,000.00	11,061,160.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	24,500,000.00	36,862,700.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,000,000.00	9,639,898.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	16,100,000.00	26,493,202.05	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,300,000.00	11,389,825.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,300,000.00	7,887,619.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000.00	28,116,112.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,700,000.00	24,314,490.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,200,000.00	8,366,810.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,700,000.00	6,101,300.00	
IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	100,000.00	104,775.00	
IRISH GOVERNMENT	400,000.00	433,656.00	
IRISH GOVERNMENT	680,000.00	743,314.80	
IRISH GOVERNMENT	500,000.00	564,970.00	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,250,732.50	
IRISH GOVERNMENT	2,200,000.00	2,214,740.00	
IRISH TSY 0.8% 2022	4,600,000.00	4,785,104.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	1,800,000.00	1,860,606.00	
IRISH TSY 1% 2026	3,000,000.00	3,108,930.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	4,600,000.00	5,297,222.00	
IRISH TSY 2% 2045	3,500,000.00	3,705,145.50	
IRISH TSY 2022	9,100,000.00	9,167,613.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	6,600,000.00	7,853,340.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	5,900,000.00	6,195,295.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,900,000.00	2,943,658.34	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,800,000.00	5,214,480.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,350,000.00	7,097,243.87	

NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	406,265.12	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,663,530.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,969,125.25	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,300,000.00	5,854,020.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,538,740.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,005,441.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,178,351.05	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,009,531.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,074,400.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,000,000.00	2,066,163.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	10,785,020.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,025,180.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,400,000.00	5,444,410.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	6,134,360.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,200,000.00	9,762,701.04	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,900,000.00	5,458,736.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,421,206.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	100,000.00	102,510.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	500,000.00	505,650.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,300,000.00	2,514,015.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,261,600.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,463,350.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,000,000.00	5,823,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,010,900.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,550,000.00	2,803,184.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	5,279,040.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,388,530.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,308,900.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,054,200.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,519,852.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,197,800.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,300,000.00	6,470,871.34	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,503,093.72	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,002,600.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	450,000.00	756,000.00	

小計	REPUBLIC OF IRELAND	6,150,000.00	7,329,693.00	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	23,222,848.00	
	SPANISH GOVERNMENT	12,500,000.00	18,817,500.00	
	SPANISH GOVERNMENT	3,000,000.00	4,008,207.00	
	銘柄数：256 組入時価比率：39.7%	1,558,390,000.00	1,897,058,909.10 (242,330,305,048) 40.1%	
英ポンド	UK TREASURY	1,880,000.00	1,902,184.00	
	UK TREASURY	100,000.00	103,742.00	
	UK TREASURY	800,000.00	855,872.00	
	UK TREASURY	19,890,000.00	20,417,482.80	
	UK TREASURY	7,050,000.00	7,523,619.00	
	UK TREASURY	4,700,000.00	4,791,697.00	
	UK TREASURY	7,540,000.00	9,143,456.40	
	UK TREASURY	670,000.00	732,946.50	
	UK TREASURY	4,250,000.00	4,744,997.50	
	UK TREASURY	9,200,000.00	9,053,996.00	
	UK TREASURY	10,100,000.00	10,451,177.00	
	UK TREASURY	2,500,000.00	2,466,050.00	
	UK TREASURY	5,100,000.00	5,419,260.00	
	UK TREASURY	9,750,000.00	10,722,660.00	
	UK TREASURY	11,850,000.00	14,834,304.00	
	UK TREASURY	9,630,000.00	12,175,690.50	
	UK TREASURY	6,400,000.00	9,290,880.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	7,807,290.00	
	UK TREASURY	5,750,000.00	7,672,800.00	
	UK TREASURY	6,600,000.00	9,267,060.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	4,037,670.00	
	UK TREASURY	1,800,000.00	1,802,520.00	
	UK TREASURY	4,300,000.00	6,553,200.00	
	UK TREASURY	5,800,000.00	8,389,120.00	
	UK TREASURY	2,800,000.00	4,106,200.00	
	UK TREASURY	5,900,000.00	9,124,940.00	
	UK TREASURY	20,100,000.00	27,480,720.00	
UK TREASURY	6,400,000.00	9,973,120.00		

小計	UK TREASURY	2,800,000.00	2,645,440.00
	UK TREASURY	5,350,000.00	8,635,970.00
	UK TREASURY	8,750,000.00	13,454,000.00
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,556,700.00
	UK TREASURY	400,000.00	524,080.00
	UK TREASURY	4,750,000.00	7,923,000.00
	UK TSY 3 1/4% 2044	20,300,000.00	26,479,320.00
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	7,100,000.00	12,297,910.00
	銘柄数：36	230,410,000.00	294,361,074.70 (42,953,168,020)
組入時価比率：7.0%		7.1%	
スイスフラン	SWITZERLAND GOVERNMENT	2,800,000.00	3,020,360.00
	SWITZERLAND GOVERNMENT	3,150,000.00	4,402,125.00
小計	銘柄数：2	5,950,000.00	7,422,485.00 (823,821,610)
組入時価比率：0.1%		0.1%	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	9,700,000.00	11,041,510.00
	SWEDISH GOVERNMENT	47,050,000.00	54,196,895.00
	SWEDISH GOVERNMENT	29,900,000.00	32,541,416.83
	SWEDISH GOVERNMENT	33,750,000.00	39,312,000.00
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,691,428.00
	SWEDISH GOVERNMENT	15,000,000.00	15,381,300.00
	SWEDISH GOVERNMENT	17,800,000.00	25,499,924.00
	小計	銘柄数：7	165,200,000.00
組入時価比率：0.4%		0.4%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	20,600,000.00	22,152,210.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	17,000,000.00	17,495,550.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	48,626,700.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,750,760.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,647,595.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,606,240.00
	小計	銘柄数：6	101,500,000.00
組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーククロー	KINGDOM OF DENMARK	10,300,000.00	10,972,590.00

ネ	KINGDOM OF DENMARK	5,000,000.00	5,103,000.00	
	KINGDOM OF DENMARK	37,100,000.00	41,451,830.00	
	KINGDOM OF DENMARK	32,470,000.00	35,405,288.00	
	KINGDOM OF DENMARK	31,400,000.00	35,252,780.00	
	KINGDOM OF DENMARK	12,200,000.00	12,367,140.00	
	KINGDOM OF DENMARK	42,000,000.00	71,742,636.00	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：0.6%	170,470,000.00	212,295,264.00 (3,638,740,824) 0.6%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	100,000.00	102,092.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,700,000.00	6,004,380.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	6,100,000.00	6,098,170.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	30,700,000.00	33,228,452.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	15,156,450.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	700,000.00	702,660.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	11,411,900.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,400,000.00	3,427,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	13,434,375.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	19,700,000.00	20,148,175.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,500,000.00	11,065,875.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,095,940.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,200,000.00	2,133,890.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,604,576.00	
小計	銘柄数：14 組入時価比率：0.6%	122,000,000.00	129,614,135.00 (3,826,209,265) 0.6%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	302,816.07	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,850,000.00	13,404,387.55	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,300,000.00	12,202,379.82	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	11,340,577.07	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,066,969.34	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	10,000,320.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	600,000.00	599,250.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,263,408.67	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,326,360.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,500,000.00	13,061,450.00	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	14,298,264.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,700,000.00	13,634,534.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,222,287.36	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,300,000.00	9,947,740.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,207,414.20	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	10,631,939.73	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,409,380.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	8,984,598.75	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,748,495.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,979,310.92	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,444,240.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,400,000.00	3,301,060.00	
小計	銘柄数：22	148,230,000.00	158,377,182.80	
			(12,879,232,505)	
	組入時価比率：2.1%		2.1%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,500,000.00	2,517,245.75	
	SINGAPORE GOVERNMENT	4,200,000.00	4,314,240.84	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,980,000.00	2,995,794.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	974,000.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,084,710.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,456,700.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,066,210.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,200,000.00	2,283,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,096,370.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,211,220.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,448,720.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	850,000.00	908,488.50	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,300,000.00	3,209,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	773,168.00	
小計	銘柄数：14	30,730,000.00	31,339,717.09	
			(2,540,710,864)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	800,000.00	802,400.00	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	398,202.36	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	396,186.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,406,000.00	

	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,720,000.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,600,000.00	6,594,522.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,416,949.52	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,075,698.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,700,000.00	8,795,700.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,513,011.24	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	497,955.65	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,000,000.00	12,747,800.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,181,300.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,815,080.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	588,568.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	8,843,398.96	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,555,824.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,727,760.96	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	2,860,708.05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	5,598,680.22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,198,040.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,410,461.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	361,017.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	829,350.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	9,758,784.91	
小計	銘柄数：25	110,100,000.00	109,093,399.61	
			(2,995,704,753)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,300,000.00	9,256,387.65	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	20,300,000.00	19,738,625.83	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	26,700,000.00	26,164,929.33	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	71,300,000.00	77,904,818.46	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	28,000,000.00	25,398,324.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	24,711,000.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	46,400,000.00	41,966,809.44	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,800,000.00	6,396,076.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,100,000.00	27,386,036.16	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00	28,867,200.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,800,000.00	8,240,718.64	

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,600,000.00	21,672,474.48	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	71,100,000.00	64,515,720.51	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	50,200,000.00	45,421,733.08	
	小計	銘柄数：14	469,600,000.00	427,640,854.18	
		組入時価比率：0.6%		(3,463,890,918)	0.6%
	合計			604,735,659,523	(604,735,659,523)

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2018年 6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	182,737,240	-	182,838,000	100,760
米ドル	77,081,130	-	77,014,000	67,130
ユーロ	76,583,776	-	76,644,000	60,224
英ポンド	29,072,334	-	29,180,000	107,666
合計	182,737,240	-	182,838,000	100,760

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2018年 6月22日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	110,904,559
コール・ローン	28,588,221
国債証券	7,321,884,214
派生商品評価勘定	88,164
未収入金	5,680,896
未収利息	102,226,560
前払費用	19,607,874
流動資産合計	7,588,980,488
資産合計	7,588,980,488
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	254,840
未払金	100,229,304
未払解約金	881,528
未払利息	65
その他未払費用	361,600
流動負債合計	101,727,337
負債合計	101,727,337
純資産の部	
元本等	
元本	5,896,253,254
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	1,590,999,897
元本等合計	7,487,253,151
純資産合計	7,487,253,151
負債純資産合計	7,588,980,488

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6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	1,2698円
(10,000口当たり純資産額)	(12,698円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2017年 8月31日 至 2018年 6月22日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p 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

2018年 6月22日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法</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。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2018年 6月22日現在		2017年 8月31日
期首		2017年 8月31日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		4,028,777,243円
同期中における追加設定元本額		2,486,594,460円
同期中における一部解約元本額		619,118,449円
期末元本額		5,896,253,254円
期末元本額の内訳*		
野村資産設計ファンド2015		12,484,347円
野村資産設計ファンド2020		14,735,245円
野村資産設計ファンド2025		18,250,652円
野村資産設計ファンド2030		16,205,276円
野村資産設計ファンド2035		11,023,737円
野村資産設計ファンド2040		23,695,494円
野村資産設計ファンド2045		2,455,734円
野村インデックスファンド・新興国債券		659,990,075円
ネクストコア		61,999,701円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		188,984,620円
野村資産設計ファンド2050		2,916,058円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		1,817,700円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		579,344円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		484,210円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		397,418円
世界6資産分散ファンド		48,839,792円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）		4,051,602,879円
野村DC新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド		368,331,775円
野村DC運用戦略ファンド		400,177,928円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）		11,017,603円
野村資産設計ファンド（DC）2030		72,125円
野村資産設計ファンド（DC）2040		81,480円
野村資産設計ファンド（DC）2050		110,061円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年6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(2018年6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
国債証券	アルゼンチンペソ	REPUBLIC OF ARGENTINA	5,300,000.00	5,021,750.00		
		REPUBLIC OF ARGENTINA	13,300,000.00	12,551,875.00		
		小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.9%	18,600,000.00	17,573,625.00 (70,294,500) 1.0%	
	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,900,000.00	12,400,770.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	18,450,000.00	18,544,095.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,400,000.00	7,143,812.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	23,000,000.00	21,956,030.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,800,000.00	6,454,414.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	15,900,000.00	14,035,089.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	19,650,000.00	19,286,671.50		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	1,200,000.00	1,261,524.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,900,000.00	7,848,650.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	4,000,000.00	3,959,960.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,259,845.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,400,000.00	6,801,984.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	9,700,000.00	9,558,768.00		
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,000,000.00	2,023,802.00		
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	5,000,000.00	5,037,350.00		
		小計	銘柄数：15 組入時価比率：10.1%	142,000,000.00	139,572,764.50 (756,484,383) 10.3%	
		レアル	LETRA TESOURO NACIONAL	3,700,000.00	3,257,550.30	
LETRA TESOURO NACIONAL	8,500,000.00		7,108,431.00			
LETRA TESOURO NACIONAL	3,600,000.00		2,529,399.60			
NOTA DO TESOURO NACIONAL	266,000.00		2,799,022.24			

小計	NOTA DO TESOURO NACIONAL	430,000.00	4,356,897.60	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	381,000.00	3,722,194.74	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	210,000.00	1,997,765.70	
	銘柄数：7	17,087,000.00	25,771,261.18	(752,520,826)
	組入時価比率：10.1%			10.3%
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	210,000,000.00	217,466,340.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	420,000,000.00	425,539,800.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	185,000,000.00	210,892,970.00	
	REPUBLIC OF CHILE	300,000,000.00	311,904,000.00	
	銘柄数：4	1,115,000,000.00	1,165,803,110.00	(200,284,974)
組入時価比率：2.7%			2.7%	
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	5,470,000,000.00	5,772,491,000.00	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	7,460,000,000.00	9,390,722,600.00	
	銘柄数：2	12,930,000,000.00	15,163,213,600.00	(565,587,867)
	組入時価比率：7.6%			7.7%
ソル	BONOS DE TESORERIA	1,100,000.00	1,135,834.70	
	BONOS DE TESORERIA	1,300,000.00	1,320,161.70	
	PERU BONO SOBERANO	480,000.00	530,532.00	
	PERU BONO SOBERANO	200,000.00	236,056.80	
	PERU BONO SOBERANO	900,000.00	976,405.50	
	PERU BONO SOBERANO	620,000.00	659,171.60	
	REPUBLIC OF PERU	1,200,000.00	1,254,592.80	
	銘柄数：7	5,800,000.00	6,112,755.10	(205,388,571)
組入時価比率：2.7%			2.8%	
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	3,505,000.00	
	銘柄数：1	4,000,000.00	3,505,000.00	(12,232,450)
組入時価比率：0.2%			0.2%	
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,188,200.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	710,000.00	637,225.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,380,000.00	1,177,830.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	950,000.00	812,250.00	

	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,190,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,550,000.00	2,019,600.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	992,400.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,390,000.00	1,043,890.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	862,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,270,000.00	1,572,542.50	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,160,000.00	843,320.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	403,005.20	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	610,000.00	443,470.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	673,200.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	1,489,020.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	748,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	1,387,237.50	
小計	銘柄数：17	22,360,000.00	17,483,190.20	
			(406,134,508)	
	組入時価比率：5.4%		5.5%	
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	18,300,000.00	18,479,340.00	
	CZECH REPUBLIC	3,000,000.00	2,978,090.40	
	CZECH REPUBLIC	18,100,000.00	17,107,305.50	
	CZECH REPUBLIC	19,900,000.00	18,419,539.50	
	CZECH REPUBLIC	8,700,000.00	7,420,230.00	
小計	銘柄数：5	68,000,000.00	64,404,505.40	
			(318,158,256)	
	組入時価比率：4.2%		4.3%	
フォロント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	58,000,000.00	59,091,560.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	58,000,000.00	60,636,343.60	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	81,000,000.00	92,604,060.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	120,000,000.00	122,863,200.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	50,000,000.00	59,412,500.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	49,000,000.00	48,281,449.30	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	90,983,200.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	138,000,000.00	140,460,222.60	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	37,000,000.00	43,129,050.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	122,000,000.00	117,854,501.00	
小計	銘柄数：10	790,000,000.00	835,316,086.50	
			(327,026,247)	

	組入時価比率：4.4%		4.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,690,000.00	1,725,354.80
	POLAND GOVERNMENT BOND	380,000.00	400,292.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,430,000.00	2,429,271.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,230,000.00	1,331,302.80
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,010,200.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,792,440.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	680,000.00	763,436.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,800,000.00	1,806,840.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	980,000.00	1,118,366.20
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,016,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,140,000.00	1,225,215.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,534,125.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,050,000.00	1,972,612.50
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,143,240.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,700,000.00	1,648,915.00
	小計	銘柄数：15	22,580,000.00
	組入時価比率：9.0%		9.2%
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,700,000.00	20,660,670.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	40,500,000.00	40,050,450.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	67,000,000.00	67,763,800.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	31,000,000.00	30,562,900.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	66,000,000.00	66,877,800.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	53,000,000.00	51,146,590.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	23,000,000.00	24,752,600.00
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	19,500,000.00	19,646,250.00
	小計	銘柄数：8	320,700,000.00
	組入時価比率：7.4%		7.6%
レイ	ROMANIA	340,000.00	332,807.30
	ROMANIA	2,490,000.00	2,433,091.05
	ROMANIA	300,000.00	313,722.00
	ROMANIA	1,100,000.00	1,049,257.00
	ROMANIA	250,000.00	262,541.25
	ROMANIA	1,100,000.00	1,012,511.50

小計	ROMANIA	920,000.00	913,983.20
	ROMANIA	610,000.00	644,007.50
	銘柄数：8	7,110,000.00	6,961,920.80 (190,617,391)
	組入時価比率：2.5%		2.6%
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,065,742.04
	MALAYSIA GOVERNMENT	600,000.00	594,279.90
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,560,000.00	1,579,500.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,703,277.26
	MALAYSIAN GOVERNMENT	620,000.00	627,822.16
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,999,319.60
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,050,000.00	1,030,143.87
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,280,000.00	1,255,168.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,606,760.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	340,000.00	341,676.77
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,939,997.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	200,000.00	196,444.92
	小計	銘柄数：12	15,050,000.00
	組入時価比率：5.5%		5.6%
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,500,000.00	9,652,141.55
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	15,865,618.50
	THAILAND GOVERNMENT BOND	22,000,000.00	21,870,470.60
	THAILAND GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	13,938,612.80
	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,100,000.00	18,245,405.88
	THAILAND GOVERNMENT BOND	26,500,000.00	28,888,190.60
	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,000,000.00	20,154,355.20
	THAILAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	11,824,118.00
	THAILAND GOVERNMENT BOND	13,000,000.00	13,730,034.50
	THAILAND GOVERNMENT BOND	20,500,000.00	20,779,460.10
	小計	銘柄数：10	168,600,000.00
	組入時価比率：7.8%		8.0%
フィリピンペソ	REPUBLIC OF PHILIPPINES	10,000,000.00	9,950,000.00
小計	銘柄数：1	10,000,000.00	9,950,000.00 (20,497,000)

	組入時価比率：0.3%		0.3%
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	5,100,000,000.00	5,534,830,080.00
	INDONESIA GOVERNMENT	1,700,000,000.00	1,958,825,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	10,180,000,000.00	10,139,280,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	9,230,000,000.00	9,610,737,500.00
	INDONESIA GOVERNMENT	5,580,000,000.00	6,687,172,998.00
	INDONESIA GOVERNMENT	10,050,000,000.00	9,838,950,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	10,300,000,000.00	9,352,400,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	4,030,000,000.00	4,392,700,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,330,057,500.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,706,227,760.00
	INDONESIA GOVERNMENT	4,100,000,000.00	4,221,484,640.00
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,144,800,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,361,000,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	4,280,000,000.00	4,373,090,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	9,400,000,000.00	9,705,500,000.00
小計	銘柄数：15	85,560,000,000.00	87,357,055,478.00 (681,385,032)
	組入時価比率：9.1%		9.3%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,940,000.00	3,831,043.63
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,500,000.00	6,369,739.35
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,400,000.00	12,456,029.88
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,200,000.00	3,809,748.60
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,760,000.00	8,039,312.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,200,000.00	4,703,176.92
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	3,762,398.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,700,000.00	2,659,536.32
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,800,000.00	5,232,180.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,450,000.00	8,817,722.46
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,600,000.00	4,174,012.86
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,100,000.00	9,138,635.54
	小計	銘柄数：12	81,650,000.00
	組入時価比率：7.9%		8.1%
合計			7,321,884,214 (7,321,884,214)

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2018年 6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	58,336,181	-	58,084,600	251,581
米ドル	25,412,632	-	25,304,600	108,032
メキシコペソ	10,816,741	-	10,820,000	3,259
ループル	10,386,894	-	10,260,000	126,894
ルピア	11,719,914	-	11,700,000	19,914
売建	32,923,549	-	32,838,644	84,905
米ドル	32,923,549	-	32,838,644	84,905
合計	-	-	-	166,676

(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。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2018年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	18,351,858,316
株式	370,964,908,710
派生商品評価勘定	1,082,224
未収配当金	1,877,559,657
未収利息	930,532
その他未収収益	44,305,859
差入委託証拠金	258,367,500
流動資産合計	391,499,012,798
資産合計	
391,499,012,798	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	89,042,806
未払解約金	215,467,390
未払利息	42,033
有価証券貸借取引受入金	13,483,151,953
流動負債合計	13,787,704,182
負債合計	
13,787,704,182	
純資産の部	
元本等	
元本	222,382,310,373
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	155,328,998,243
元本等合計	377,711,308,616
純資産合計	377,711,308,616
負債純資産合計	391,499,012,798

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6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	1.6985円
(10,000口当たり純資産額)	(16,985円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	12,816,058,540円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2017年 8月31日 至 2018年 6月22日	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	<p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p>
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っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2018年 6月22日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	<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>

2. 時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2018年 6月22日現在	
期首	2017年 8月31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	216,549,093,164円
同期中における追加設定元本額	34,155,796,491円
同期中における一部解約元本額	28,322,579,282円
期末元本額	222,382,310,373円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	159,535,659円
バランスセレクト50	371,026,178円
バランスセレクト70	463,578,752円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,391,274,270円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	3,400,470,183円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	6,858,929,205円
野村資産設計ファンド2015	52,959,974円
野村資産設計ファンド2020	63,596,472円
野村資産設計ファンド2025	92,826,040円
野村資産設計ファンド2030	98,535,168円
野村資産設計ファンド2035	74,823,677円
野村資産設計ファンド2040	187,474,707円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	81,533,721,980円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	2,483,736,610円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	5,835,072,115円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	1,657,156,057円
野村資産設計ファンド2045	24,590,259円
野村インデックスファンド・TOPIX	1,522,219,846円
マイ・ロード	3,426,548,033円
ネクストコア	153,012,589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	672,865,155円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）	1,346,097,284円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,252,644,243円
野村資産設計ファンド2050	37,853,603円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	12,697,708円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	4,023,912円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,792,513円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	1,811,910円

のむラップ・ファンド(やや保守型)	226,185,004円
のむラップ・ファンド(やや積極型)	188,075,817円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,846,229円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,997,687円
インデックス・ブレンド(タイプ)	13,848,084円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,911,525円
インデックス・ブレンド(タイプ)	22,072,636円
野村6資産均等バランス	96,431,030円
世界6資産分散ファンド	37,257,765円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	178,492,690円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	496,319,262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)	452,983,685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)	1,065,024,647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)	805,220,656円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	3,813,600円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	15,769,529円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	2,657,701円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,059,053,350円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	61,061,563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)	388,208,563円
野村日本株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	839,613,781円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	1,440,743,612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)	295,538,056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)	113,044,702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)	289,919,734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)	4,799,398,879円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	649,935,267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)	465,680,443円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	1,832,084,012円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	1,282,479,670円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,080,788,417円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,000,192円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	29,625,375円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	41,623,910円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	101,292,469円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	4,113,899,039円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	12,888,302,547円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	17,657,638,566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)	31,947,157,576円
マイバランスDC30	2,701,646,242円
マイバランスDC50	3,725,331,105円
マイバランスDC70	3,647,634,993円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	9,546,956,418円
野村DC運用戦略ファンド	1,014,380,773円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	30,581,826円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	379,620,837円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	40,737,061円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	72,908,454円

野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	685,337円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	596,659円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	5,021,195円
野村資産設計ファンド(DC)2030	438,346円
野村資産設計ファンド(DC)2040	645,034円
野村資産設計ファンド(DC)2050	1,428,713円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	7,924,566円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	5,115,168円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	877,914円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	19,908,360円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年6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	6,600	3,640.00	24,024,000	貸付有価証券 2,000株
		日本水産	187,500	536.00	100,500,000	貸付有価証券 500株
		マルハニチロ	31,600	4,385.00	138,566,000	貸付有価証券 1,100株
		カネコ種苗	5,700	1,644.00	9,370,800	
		サカタのタネ	24,600	4,090.00	100,614,000	
		ホクト	16,900	1,942.00	32,819,800	
		ホクリヨウ	2,700	871.00	2,351,700	
		住石ホールディングス	43,500	146.00	6,351,000	貸付有価証券 20,400株(14,800株)
		日鉄鉱業	4,600	5,230.00	24,058,000	
		三井松島産業	8,400	1,538.00	12,919,200	
		国際石油開発帝石	810,300	1,110.00	899,433,000	
		日本海洋掘削	5,800	1,279.00	7,418,200	貸付有価証券 2,700株(300株)
		石油資源開発	26,400	2,681.00	70,778,400	貸付有価証券 1,500株
K&Oエナジーグループ	9,800	1,860.00	18,228,000			

ヒノキヤグループ	4,200	2,866.00	12,037,200	
ショーボンドホールディングス	15,700	7,510.00	117,907,000	貸付有価証券 200株
ミライト・ホールディングス	51,300	1,728.00	88,646,400	貸付有価証券 24,100株（16,700株）
タマホーム	12,500	1,041.00	13,012,500	貸付有価証券 1,300株（800株）
サンヨーホームズ	2,900	1,257.00	3,645,300	貸付有価証券 1,300株
日本アクア	4,800	365.00	1,752,000	
ファーストコーポレーション	5,500	1,102.00	6,061,000	貸付有価証券 1,500株
ベストテラ	3,100	1,286.00	3,986,600	貸付有価証券 1,400株
T A T E R U	15,900	2,022.00	32,149,800	貸付有価証券 7,400株（4,700株）
ダイセキ環境ソリューション	3,900	1,101.00	4,293,900	貸付有価証券 1,700株
第一カッター興業	2,200	2,836.00	6,239,200	
安藤・間	129,600	987.00	127,915,200	貸付有価証券 8,800株
東急建設	64,100	1,040.00	66,664,000	貸付有価証券 3,100株
コムシスホールディングス	58,600	2,987.00	175,038,200	貸付有価証券 1,600株
ミサワホーム	13,900	964.00	13,399,600	貸付有価証券 100株
ビーアールホールディングス	16,500	484.00	7,986,000	貸付有価証券 100株
高松コンストラクショングループ	10,800	3,190.00	34,452,000	
東建コーポレーション	6,200	9,890.00	61,318,000	
ソネック	2,100	857.00	1,799,700	
ヤマウラ	7,800	901.00	7,027,800	貸付有価証券 600株
大成建設	165,900	6,030.00	1,000,377,000	
大林組	499,700	1,138.00	568,658,600	
清水建設	509,700	1,104.00	562,708,800	
飛島建設	151,600	195.00	29,562,000	貸付有価証券 2,400株（2,400株）
長谷工コーポレーション	194,400	1,514.00	294,321,600	

松井建設	18,400	968.00	17,811,200	
銭高組	2,400	5,790.00	13,896,000	
鹿島建設	732,000	852.00	623,664,000	
不動テトラ	126,100	206.00	25,976,600	
大末建設	5,400	1,440.00	7,776,000	
鉄建建設	10,100	3,010.00	30,401,000	
西松建設	38,500	3,125.00	120,312,500	
三井住友建設	120,200	775.00	93,155,000	
大豊建設	60,000	650.00	39,000,000	
前田建設工業	118,800	1,290.00	153,252,000	
佐田建設	10,800	479.00	5,173,200	
ナカノフドー建設	12,700	662.00	8,407,400	貸付有価証券 100株(100株)
奥村組	27,400	3,655.00	100,147,000	
東鉄工業	20,000	3,470.00	69,400,000	貸付有価証券 9,400株
イチケン	3,000	2,553.00	7,659,000	
浅沼組	59,000	395.00	23,305,000	
戸田建設	194,000	961.00	186,434,000	
熊谷組	26,200	3,870.00	101,394,000	
青木あすなろ建設	10,900	1,003.00	10,932,700	
北野建設	35,000	421.00	14,735,000	
植木組	2,100	2,663.00	5,592,300	
三井ホーム	21,000	688.00	14,448,000	
矢作建設工業	22,700	915.00	20,770,500	
ピーエス三菱	19,700	611.00	12,036,700	
日本ハウスホールディングス	31,800	540.00	17,172,000	貸付有価証券 1,200株
大東建託	59,400	18,540.00	1,101,276,000	
新日本建設	19,800	1,295.00	25,641,000	
N I P P O	38,600	2,007.00	77,470,200	
東亜道路工業	3,400	3,830.00	13,022,000	
前田道路	52,200	2,114.00	110,350,800	
日本道路	4,500	5,740.00	25,830,000	
東亜建設工業	13,500	2,872.00	38,772,000	貸付有価証券 700株
若築建設	9,000	1,656.00	14,904,000	

東洋建設	52,300	481.00	25,156,300	
五洋建設	198,100	719.00	142,433,900	
世紀東急工業	22,400	731.00	16,374,400	
福田組	5,400	6,800.00	36,720,000	
住友林業	106,500	1,618.00	172,317,000	貸付有価証券 100株
日本基礎技術	18,500	377.00	6,974,500	
日成ビルド工業	24,600	1,136.00	27,945,600	
ヤマダ・エスバイエル ホーム	75,000	70.00	5,250,000	貸付有価証券 35,000株
巴コーポレーション	20,700	468.00	9,687,600	貸付有価証券 200株
大和ハウス工業	492,200	3,727.00	1,834,429,400	
ライト工業	32,000	1,150.00	36,800,000	
積水ハウス	542,200	1,924.00	1,043,192,800	
日特建設	14,200	628.00	8,917,600	
北陸電気工事	9,200	1,196.00	11,003,200	
ユアテック	23,300	927.00	21,599,100	
西部電気工業	2,800	3,885.00	10,878,000	
四電工	2,500	2,676.00	6,690,000	
中電工	21,500	2,815.00	60,522,500	貸付有価証券 300株
関電工	66,400	1,220.00	81,008,000	
きんでん	110,800	1,788.00	198,110,400	
東京エネシス	18,900	1,245.00	23,530,500	
トーエネック	4,700	3,155.00	14,828,500	
住友電設	13,200	2,017.00	26,624,400	
日本電設工業	25,600	2,490.00	63,744,000	
協和エクシオ	59,800	3,035.00	181,493,000	貸付有価証券 5,200株
新日本空調	12,800	1,775.00	22,720,000	
N D S	2,600	6,100.00	15,860,000	
九電工	32,900	5,460.00	179,634,000	
三機工業	35,300	1,053.00	37,170,900	
日揮	143,500	2,112.00	303,072,000	貸付有価証券 1,800株
中外炉工業	5,000	2,750.00	13,750,000	
ヤマト	13,700	712.00	9,754,400	

太平電業	11,300	2,864.00	32,363,200	
高砂熱学工業	45,900	2,077.00	95,334,300	
三晃金属工業	1,800	3,495.00	6,291,000	
朝日工業社	3,500	3,480.00	12,180,000	
明星工業	30,200	825.00	24,915,000	
大気社	21,100	3,375.00	71,212,500	
ダイダン	11,100	2,490.00	27,639,000	
日比谷総合設備	18,600	2,196.00	40,845,600	
東芝プラントシステム	36,100	2,466.00	89,022,600	
OSJBホールディングス	73,500	282.00	20,727,000	貸付有価証券 7,400株
東洋エンジニアリング	19,600	779.00	15,268,400	貸付有価証券 9,200株（8,700株）
千代田化工建設	108,200	908.00	98,245,600	貸付有価証券 18,400株（200株）
新興プランテック	32,100	1,033.00	33,159,300	
日本製粉	49,500	1,928.00	95,436,000	貸付有価証券 22,200株（22,200株）
日清製粉グループ本社	182,700	2,361.00	431,354,700	
日東富士製粉	1,100	5,090.00	5,599,000	
昭和産業	13,700	2,919.00	39,990,300	貸付有価証券 100株
鳥越製粉	13,200	995.00	13,134,000	
中部飼料	18,200	2,035.00	37,037,000	
フィード・ワン	100,300	216.00	21,664,800	
東洋精糖	2,500	1,238.00	3,095,000	
日本甜菜製糖	8,500	2,306.00	19,601,000	
三井製糖	11,800	3,470.00	40,946,000	
塩水港精糖	17,800	261.00	4,645,800	
日新製糖	7,100	2,168.00	15,392,800	
森永製菓	35,000	5,360.00	187,600,000	
中村屋	3,900	4,820.00	18,798,000	
江崎グリコ	41,700	5,260.00	219,342,000	貸付有価証券 19,500株
名糖産業	7,200	1,770.00	12,744,000	
井村屋グループ	5,900	3,420.00	20,178,000	
不二家	9,500	2,507.00	23,816,500	
山崎製パン	122,100	2,821.00	344,444,100	

第一屋製パン	2,600	1,176.00	3,057,600	
モロゾフ	2,500	6,730.00	16,825,000	
亀田製菓	9,300	6,130.00	57,009,000	
寿スピリッツ	14,400	5,990.00	86,256,000	
カルビー	68,000	4,160.00	282,880,000	貸付有価証券 31,900株(2,000株)
森永乳業	29,900	4,105.00	122,739,500	
六甲バター	9,900	2,342.00	23,185,800	貸付有価証券 2,900株
ヤクルト本社	86,900	7,250.00	630,025,000	貸付有価証券 800株
明治ホールディングス	98,700	9,260.00	913,962,000	
雪印メグミルク	35,900	2,867.00	102,925,300	
プリマハム	105,000	629.00	66,045,000	
日本ハム	64,500	4,365.00	281,542,500	
林兼産業	5,300	797.00	4,224,100	
丸大食品	80,000	488.00	39,040,000	
S Foods	10,400	4,450.00	46,280,000	貸付有価証券 700株
伊藤ハム米久ホールディングス	96,100	945.00	90,814,500	
サッポロホールディングス	54,600	2,784.00	152,006,400	貸付有価証券 9,200株
アサヒグループホールディングス	312,600	5,652.00	1,766,815,200	貸付有価証券 19,500株
キリンホールディングス	717,500	3,026.00	2,171,155,000	
宝ホールディングス	111,800	1,482.00	165,687,600	貸付有価証券 1,500株
オエノンホールディングス	42,400	413.00	17,511,200	
養命酒製造	4,600	2,494.00	11,472,400	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	104,800	4,390.00	460,072,000	貸付有価証券 3,800株
サントリー食品インターナショナル	114,100	4,755.00	542,545,500	
ダイトーグループホールディングス	7,700	6,380.00	49,126,000	貸付有価証券 1,200株
伊藤園	49,400	5,280.00	260,832,000	貸付有価証券 1,100株
キーコーヒー	14,700	2,197.00	32,295,900	

ユニカフェ	4,500	1,201.00	5,404,500	
ジャパンフーズ	2,100	1,475.00	3,097,500	
日清オイリオグループ	17,600	3,140.00	55,264,000	
不二製油グループ本社	40,400	3,865.00	156,146,000	
かどや製油	1,600	6,190.00	9,904,000	
J - オイルミルズ	7,700	3,975.00	30,607,500	
キッコーマン	116,600	5,680.00	662,288,000	
味の素	343,300	2,072.00	711,317,600	貸付有価証券 100株
キューピー	83,100	2,811.00	233,594,100	
ハウス食品グループ本社	56,900	3,860.00	219,634,000	
カゴメ	59,800	3,705.00	221,559,000	貸付有価証券 900株
焼津水産化学工業	7,200	1,238.00	8,913,600	
アリアケジャパン	13,600	9,650.00	131,240,000	貸付有価証券 400株
ピエトロ	2,000	1,654.00	3,308,000	貸付有価証券 700株
エバラ食品工業	3,300	2,275.00	7,507,500	
ニチレイ	71,100	2,820.00	200,502,000	
東洋水産	81,900	3,885.00	318,181,500	
イトアアンド	4,100	2,135.00	8,753,500	貸付有価証券 400株
大冷	1,700	1,993.00	3,388,100	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	3,000	1,251.00	3,753,000	貸付有価証券 1,400株
日清食品ホールディングス	65,100	8,220.00	535,122,000	貸付有価証券 100株
永谷園ホールディングス	16,000	1,509.00	24,144,000	
一正蒲鉾	5,800	1,401.00	8,125,800	貸付有価証券 2,700株
フジッコ	16,200	2,941.00	47,644,200	貸付有価証券 300株
ロック・フィールド	16,100	1,982.00	31,910,200	
日本たばこ産業	923,500	3,214.00	2,968,129,000	
ケンコーマヨネーズ	9,900	4,155.00	41,134,500	貸付有価証券 200株
わらべや日洋ホールディングス	9,800	2,567.00	25,156,600	貸付有価証券 3,800株

なとり	8,300	1,906.00	15,819,800	
イフジ産業	2,600	785.00	2,041,000	
ピクルスコーポレーション	3,000	2,253.00	6,759,000	貸付有価証券 200株
北の達人コーポレーション	45,600	819.00	37,346,400	貸付有価証券 21,700株（400株）
ユーグレナ	59,400	874.00	51,915,600	貸付有価証券 27,900株（6,500株）
ミヨシ油脂	5,700	1,390.00	7,923,000	
理研ビタミン	5,600	4,520.00	25,312,000	
片倉工業	17,900	1,318.00	23,592,200	貸付有価証券 8,100株
グンゼ	11,600	7,130.00	82,708,000	
東洋紡	57,600	1,805.00	103,968,000	
ユニチカ	45,300	625.00	28,312,500	貸付有価証券 100株
富士紡ホールディングス	8,700	3,625.00	31,537,500	
倉敷紡績	157,000	368.00	57,776,000	
シキボウ	7,600	1,298.00	9,864,800	
日本毛織	43,900	1,043.00	45,787,700	
ダイトウボウ	23,500	99.00	2,326,500	貸付有価証券 4,000株（300株）
トーア紡コーポレーション	6,600	567.00	3,742,200	
ダイドーリミテッド	17,400	450.00	7,830,000	
帝国繊維	16,300	2,330.00	37,979,000	
帝人	128,000	1,996.00	255,488,000	貸付有価証券 900株
東レ	1,130,000	871.00	984,230,000	貸付有価証券 43,700株
サカイオーボックス	3,900	2,285.00	8,911,500	
住江織物	3,900	2,780.00	10,842,000	
日本フェルト	8,200	514.00	4,214,800	
イチカワ	10,000	358.00	3,580,000	
日東製網	1,700	1,832.00	3,114,400	貸付有価証券 400株
アツギ	10,400	1,197.00	12,448,800	
ダイニック	5,900	1,038.00	6,124,200	
セーレン	35,800	1,759.00	62,972,200	貸付有価証券

				600株
ソトー	5,800	1,037.00	6,014,600	
東海染工	2,200	1,444.00	3,176,800	
小松精練	23,900	980.00	23,422,000	
ワコールホールディングス	43,000	3,200.00	137,600,000	
ホギメディカル	19,600	4,865.00	95,354,000	
レナウン	42,100	150.00	6,315,000	貸付有価証券 19,500株(6,900株)
クラウドシアホールディングス	3,600	590.00	2,124,000	
T S Iホールディングス	53,700	774.00	41,563,800	貸付有価証券 1,800株
マツオカコーポレーション	3,700	3,765.00	13,930,500	貸付有価証券 600株
三陽商会	8,200	2,321.00	19,032,200	貸付有価証券 1,400株
ナイガイ	5,700	554.00	3,157,800	貸付有価証券 300株
オンワードホールディングス	90,300	839.00	75,761,700	貸付有価証券 2,100株
ルックホールディングス	26,000	294.00	7,644,000	貸付有価証券 12,000株(2,000株)
キムラタン	71,200	38.00	2,705,600	貸付有価証券 20,800株(200株)
ゴールドウイン	8,800	10,220.00	89,936,000	貸付有価証券 200株
デサント	35,500	2,000.00	71,000,000	
キング	7,700	522.00	4,019,400	
ヤマトインターナショナル	9,600	620.00	5,952,000	
特種東海製紙	8,500	4,545.00	38,632,500	
王子ホールディングス	656,000	649.00	425,744,000	
日本製紙	69,800	1,745.00	121,801,000	貸付有価証券 32,800株
三菱製紙	22,100	644.00	14,232,400	
北越紀州製紙	87,000	557.00	48,459,000	貸付有価証券 2,200株
中越パルプ工業	6,200	1,650.00	10,230,000	
巴川製紙所	24,000	251.00	6,024,000	

大王製紙	62,100	1,534.00	95,261,400	貸付有価証券 29,100株（17,900株）
阿波製紙	3,800	638.00	2,424,400	
レンゴー	150,200	931.00	139,836,200	貸付有価証券 100株
トモク	8,900	2,082.00	18,529,800	貸付有価証券 500株（500株）
ザ・パックス	11,000	3,705.00	40,755,000	貸付有価証券 5,100株
クラレ	262,200	1,527.00	400,379,400	
旭化成	971,500	1,394.00	1,354,271,000	
共和レザー	9,100	1,017.00	9,254,700	
昭和電工	103,700	4,860.00	503,982,000	
住友化学	1,147,000	612.00	701,964,000	
住友精化	6,500	5,670.00	36,855,000	
日産化学工業	90,600	5,160.00	467,496,000	
ラサ工業	5,500	2,938.00	16,159,000	
クレハ	13,400	7,720.00	103,448,000	
多木化学	2,100	4,985.00	10,468,500	
テイカ	11,900	2,393.00	28,476,700	
石原産業	28,000	1,034.00	28,952,000	貸付有価証券 200株
片倉コープアグリ	3,800	1,219.00	4,632,200	
日東エフシー	9,100	755.00	6,870,500	
日本曹達	108,000	593.00	64,044,000	
東ソー	225,200	1,703.00	383,515,600	
トクヤマ	45,200	3,425.00	154,810,000	貸付有価証券 4,500株
セントラル硝子	31,800	2,302.00	73,203,600	貸付有価証券 7,700株
東亜合成	91,400	1,331.00	121,653,400	
大阪ソーダ	15,100	3,145.00	47,489,500	貸付有価証券 1,500株
関東電化工業	37,200	969.00	36,046,800	貸付有価証券 9,900株
デンカ	57,200	3,610.00	206,492,000	
信越化学工業	259,400	9,983.00	2,589,590,200	貸付有価証券 6,900株
日本カーバイド工業	4,900	1,944.00	9,525,600	

堺化学工業	10,700	2,931.00	31,361,700	
エア・ウォーター	128,500	1,966.00	252,631,000	
大陽日酸	120,000	1,631.00	195,720,000	
日本化学工業	5,800	4,680.00	27,144,000	
東邦アセチレン	2,200	1,530.00	3,366,000	
日本パーカライジング	79,600	1,595.00	126,962,000	
高圧ガス工業	23,100	1,025.00	23,677,500	
チタン工業	1,700	2,505.00	4,258,500	貸付有価証券 700株
四国化成工業	22,500	1,560.00	35,100,000	
戸田工業	3,100	2,861.00	8,869,100	貸付有価証券 1,400株
ステラ ケミファ	7,900	3,865.00	30,533,500	貸付有価証券 3,700株
保土谷化学工業	5,100	3,420.00	17,442,000	貸付有価証券 100株
日本触媒	24,500	7,880.00	193,060,000	
大日精化工業	12,000	3,560.00	42,720,000	
カネカ	210,000	1,003.00	210,630,000	
三菱瓦斯化学	128,400	2,482.00	318,688,800	
三井化学	141,600	2,851.00	403,701,600	
J S R	156,600	1,818.00	284,698,800	
東京応化工業	27,100	4,185.00	113,413,500	
大阪有機化学工業	13,500	1,512.00	20,412,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,043,300	897.00	935,840,100	
K Hネオケム	23,800	3,395.00	80,801,000	
ダイセル	210,100	1,185.00	248,968,500	貸付有価証券 300株
住友ベークライト	126,000	1,038.00	130,788,000	
積水化学工業	323,600	1,810.00	585,716,000	
日本ゼオン	131,400	1,293.00	169,900,200	
アイカ工業	43,700	3,905.00	170,648,500	
宇部興産	78,500	2,872.00	225,452,000	
積水樹脂	24,000	2,321.00	55,704,000	
タキロンシーアイ	31,500	610.00	19,215,000	
旭有機材	9,100	2,316.00	21,075,600	
日立化成	77,000	2,198.00	169,246,000	

ニチバン	7,700	3,145.00	24,216,500	
リケンテクノス	33,600	576.00	19,353,600	貸付有価証券 2,200株
大倉工業	37,000	563.00	20,831,000	
積水化成工業	19,500	1,135.00	22,132,500	
群栄化学工業	3,700	3,575.00	13,227,500	
タイガースポリマー	7,700	771.00	5,936,700	
ミライアル	5,100	1,305.00	6,655,500	貸付有価証券 2,300株
ダイキアクシス	5,200	1,384.00	7,196,800	貸付有価証券 2,000株
ダイキョーニシカワ	30,700	1,659.00	50,931,300	
竹本容器	2,300	3,115.00	7,164,500	
森六ホールディングス	7,800	3,230.00	25,194,000	
日本化薬	101,100	1,202.00	121,522,200	貸付有価証券 700株
カーリットホールディングス	14,400	992.00	14,284,800	貸付有価証券 100株
日本精化	12,900	1,269.00	16,370,100	
扶桑化学工業	14,800	2,820.00	41,736,000	貸付有価証券 2,300株（400株）
トリケミカル研究所	3,600	4,405.00	15,858,000	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
A D E K A	67,000	1,776.00	118,992,000	
日油	60,100	3,560.00	213,956,000	
新日本理化	24,600	248.00	6,100,800	貸付有価証券 100株
ハリマ化成グループ	12,000	867.00	10,404,000	
花王	365,700	8,401.00	3,072,245,700	
第一工業製薬	30,000	731.00	21,930,000	
石原ケミカル	3,700	2,225.00	8,232,500	
日華化学	4,900	1,195.00	5,855,500	
ニイタカ	2,300	1,731.00	3,981,300	
三洋化成工業	9,800	4,830.00	47,334,000	
有機合成薬品工業	10,100	284.00	2,868,400	
大日本塗料	17,800	1,487.00	26,468,600	
日本ペイントホールディングス	120,200	4,605.00	553,521,000	
関西ペイント	163,600	2,250.00	368,100,000	貸付有価証券

				47,000株
神東塗料	11,500	229.00	2,633,500	貸付有価証券 200株(200株)
中国塗料	44,600	1,046.00	46,651,600	貸付有価証券 8,200株
日本特殊塗料	9,800	2,446.00	23,970,800	
藤倉化成	19,600	668.00	13,092,800	
太陽ホールディングス	12,000	4,560.00	54,720,000	
D I C	61,500	3,425.00	210,637,500	
サカタインクス	31,800	1,489.00	47,350,200	
東洋インキ S C ホール ディングス	154,000	573.00	88,242,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
T & K T O K A	10,400	1,222.00	12,708,800	
富士フイルムホールディ ングス	308,900	4,213.00	1,301,395,700	
資生堂	277,000	9,008.00	2,495,216,000	
ライオン	207,200	2,025.00	419,580,000	
高砂香料工業	9,300	3,810.00	35,433,000	
マンダム	29,000	3,335.00	96,715,000	貸付有価証券 800株
ミルボン	19,900	5,040.00	100,296,000	
ファンケル	36,100	5,570.00	201,077,000	貸付有価証券 600株
コーセー	25,200	25,590.00	644,868,000	貸付有価証券 2,900株
コタ	7,100	1,512.00	10,735,200	
シーズ・ホールディング ス	18,000	5,150.00	92,700,000	
シーボン	1,800	3,010.00	5,418,000	
ポーラ・オルビスホール ディングス	63,500	4,975.00	315,912,500	
ノエビアホールディング ス	9,500	7,910.00	75,145,000	
アジュバンコスメジャパ ン	3,300	1,091.00	3,600,300	貸付有価証券 1,500株(400株)
エステー	10,600	3,130.00	33,178,000	
アグロ カネショウ	6,000	2,803.00	16,818,000	
コニシ	24,400	1,843.00	44,969,200	
長谷川香料	17,700	2,112.00	37,382,400	貸付有価証券 100株

星光 P M C	8,500	1,056.00	8,976,000	貸付有価証券 2,600株(200株)
小林製薬	41,700	9,620.00	401,154,000	貸付有価証券 6,800株
荒川化学工業	13,400	1,918.00	25,701,200	
メック	10,200	2,066.00	21,073,200	
日本高純度化学	4,100	2,486.00	10,192,600	
タカラバイオ	38,900	2,406.00	93,593,400	貸付有価証券 100株
J C U	18,000	2,548.00	45,864,000	
新田ゼラチン	10,200	826.00	8,425,200	
O A T アグリオ	2,300	3,445.00	7,923,500	
デクセリアルズ	38,200	1,052.00	40,186,400	
アース製薬	11,200	5,730.00	64,176,000	貸付有価証券 5,200株
北興化学工業	15,200	632.00	9,606,400	貸付有価証券 500株
大成ラミック	4,600	3,190.00	14,674,000	貸付有価証券 100株
クミアイ化学工業	67,600	820.00	55,432,000	貸付有価証券 2,000株
日本農薬	35,600	648.00	23,068,800	貸付有価証券 4,900株
アキレス	11,300	2,290.00	25,877,000	
有沢製作所	25,000	1,144.00	28,600,000	
日東電工	112,300	8,284.00	930,293,200	
レック	8,800	4,700.00	41,360,000	貸付有価証券 4,000株
きもと	25,300	305.00	7,716,500	
藤森工業	12,500	3,800.00	47,500,000	
前澤化成工業	10,200	1,240.00	12,648,000	
ウェーブロックホールディングス	3,900	1,089.00	4,247,100	貸付有価証券 1,800株(1,000株)
J S P	8,700	3,305.00	28,753,500	貸付有価証券 800株(100株)
エフピコ	12,300	6,090.00	74,907,000	貸付有価証券 2,400株
天馬	11,600	1,969.00	22,840,400	
信越ポリマー	30,500	1,063.00	32,421,500	
東リ	37,000	345.00	12,765,000	

ニフコ	54,600	3,550.00	193,830,000	
日本バルカー工業	12,100	3,155.00	38,175,500	
ユニ・チャーム	315,300	3,331.00	1,050,264,300	貸付有価証券 700株
協和発酵キリン	186,300	2,294.00	427,372,200	
武田薬品工業	547,900	4,468.00	2,448,017,200	貸付有価証券 157,600株
アステラス製薬	1,528,400	1,758.00	2,686,927,200	貸付有価証券 34,000株
大日本住友製薬	110,200	2,338.00	257,647,600	貸付有価証券 39,500株
塩野義製薬	209,500	5,667.00	1,187,236,500	
田辺三菱製薬	181,500	1,883.00	341,764,500	
わかもと製薬	17,700	294.00	5,203,800	
あすか製薬	16,900	1,332.00	22,510,800	
日本新薬	38,900	6,460.00	251,294,000	
ピオフェルミン製薬	2,500	2,923.00	7,307,500	
中外製薬	155,100	6,020.00	933,702,000	
科研製薬	26,800	5,890.00	157,852,000	
エーザイ	178,000	7,995.00	1,423,110,000	
ロート製薬	81,700	3,480.00	284,316,000	
小野薬品工業	351,200	2,691.00	945,079,200	貸付有価証券 10,200株
久光製薬	43,900	9,920.00	435,488,000	
持田製薬	10,300	8,200.00	84,460,000	
参天製薬	281,800	1,948.00	548,946,400	貸付有価証券 1,300株
扶桑薬品工業	5,200	2,973.00	15,459,600	
日本ケミファ	2,000	4,790.00	9,580,000	
ツムラ	53,200	3,735.00	198,702,000	貸付有価証券 3,200株
日医工	39,200	1,685.00	66,052,000	貸付有価証券 13,100株
キッセイ薬品工業	26,300	2,991.00	78,663,300	
生化学工業	28,900	1,527.00	44,130,300	
栄研化学	24,100	2,556.00	61,599,600	
日水製薬	6,200	1,402.00	8,692,400	
鳥居薬品	9,300	2,717.00	25,268,100	

J C R ファーマ	10,500	7,300.00	76,650,000	
東和薬品	7,100	5,970.00	42,387,000	
富士製薬工業	5,100	3,925.00	20,017,500	
沢井製薬	29,900	5,020.00	150,098,000	貸付有価証券 10,400株
ゼリア新薬工業	31,900	2,345.00	74,805,500	貸付有価証券 300株
第一三共	425,600	4,315.00	1,836,464,000	
キョーリン製薬ホールディングス	41,500	2,356.00	97,774,000	
大幸薬品	7,900	2,077.00	16,408,300	
ダイト	8,700	3,580.00	31,146,000	
大塚ホールディングス	309,100	5,528.00	1,708,704,800	
大正製薬ホールディングス	33,300	12,970.00	431,901,000	
ペプチドリーム	68,000	5,000.00	340,000,000	貸付有価証券 31,900株
日本コークス工業	125,600	122.00	15,323,200	
昭和シェル石油	139,200	1,637.00	227,870,400	貸付有価証券 400株
ニチレキ	19,000	1,272.00	24,168,000	
ユシロ化学工業	8,300	1,751.00	14,533,300	
ピーピー・カストロール	6,400	1,654.00	10,585,600	貸付有価証券 2,900株
富士石油	36,100	372.00	13,429,200	
MORESCO	5,400	1,765.00	9,531,000	貸付有価証券 200株
出光興産	124,900	3,575.00	446,517,500	
J X T Gホールディングス	2,373,600	740.30	1,757,176,080	
コスモエネルギーホールディングス	43,100	3,565.00	153,651,500	
横浜ゴム	86,100	2,341.00	201,560,100	
東洋ゴム工業	88,100	1,648.00	145,188,800	貸付有価証券 6,400株
ブリヂストン	492,300	4,401.00	2,166,612,300	
住友ゴム工業	153,100	1,793.00	274,508,300	貸付有価証券 100株
藤倉ゴム工業	13,000	638.00	8,294,000	
オカモト	52,000	1,303.00	67,756,000	

フコク	6,500	978.00	6,357,000	
ニッタ	15,400	4,390.00	67,606,000	
住友理工	28,800	1,133.00	32,630,400	貸付有価証券 1,000株
三ツ星ベルト	36,000	1,586.00	57,096,000	
バンドー化学	28,300	1,248.00	35,318,400	
日東紡績	22,100	2,637.00	58,277,700	貸付有価証券 300株
旭硝子	150,000	4,290.00	643,500,000	
日本板硝子	75,200	1,071.00	80,539,200	貸付有価証券 35,300株
石塚硝子	2,000	2,408.00	4,816,000	
日本山村硝子	62,000	187.00	11,594,000	
日本電気硝子	64,300	2,979.00	191,549,700	貸付有価証券 200株
オハラ	5,900	3,235.00	19,086,500	貸付有価証券 2,700株（800株）
住友大阪セメント	289,000	511.00	147,679,000	貸付有価証券 64,000株
太平洋セメント	93,900	3,765.00	353,533,500	
日本ヒューム	14,900	906.00	13,499,400	
日本コンクリート工業	32,000	341.00	10,912,000	
三谷セキサン	7,800	2,739.00	21,364,200	
アジアパイルホールディングス	19,100	740.00	14,134,000	
東海カーボン	135,000	1,988.00	268,380,000	貸付有価証券 9,600株
日本カーボン	7,600	6,340.00	48,184,000	貸付有価証券 100株
東洋炭素	9,700	3,220.00	31,234,000	
ノリタケカンパニーリミテド	8,200	5,980.00	49,036,000	
TOTO	114,400	5,450.00	623,480,000	
日本碍子	181,500	1,944.00	352,836,000	
日本特殊陶業	127,600	3,045.00	388,542,000	
ダントーホールディングス	11,100	145.00	1,609,500	
MARUWA	5,100	8,950.00	45,645,000	
品川リフラクトリーズ	3,900	3,610.00	14,079,000	

黒崎播磨	2,900	6,520.00	18,908,000	
ヨータイ	11,800	686.00	8,094,800	貸付有価証券 5,500株
イソライト工業	7,600	667.00	5,069,200	貸付有価証券 200株
東京窯業	18,900	381.00	7,200,900	貸付有価証券 8,800株
ニッカトー	6,700	1,305.00	8,743,500	貸付有価証券 2,100株
フジインコーポレー テッド	13,300	2,475.00	32,917,500	
クニミネ工業	4,000	1,078.00	4,312,000	
エーアンドエーマテリア ル	3,200	1,212.00	3,878,400	貸付有価証券 100株
ニチアス	81,000	1,425.00	115,425,000	
ニチハ	22,400	4,140.00	92,736,000	
新日鐵住金	658,200	2,169.00	1,427,635,800	貸付有価証券 7,300株
神戸製鋼所	269,200	1,030.00	277,276,000	
中山製鋼所	20,400	704.00	14,361,600	
合同製鐵	7,900	2,195.00	17,340,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	397,200	2,135.00	848,022,000	
日新製鋼	40,600	1,526.00	61,955,600	貸付有価証券 100株
東京製鐵	78,800	988.00	77,854,400	貸付有価証券 15,800株
共英製鋼	16,600	2,169.00	36,005,400	貸付有価証券 7,800株
大和工業	31,200	3,365.00	104,988,000	貸付有価証券 400株
東京鐵鋼	6,100	1,641.00	10,010,100	
大阪製鐵	9,800	2,040.00	19,992,000	
淀川製鋼所	21,500	2,812.00	60,458,000	
東洋鋼鈹	37,200	720.00	26,784,000	貸付有価証券 5,000株(4,200株)
丸一鋼管	52,100	3,775.00	196,677,500	貸付有価証券 13,500株
モリ工業	4,800	3,115.00	14,952,000	
大同特殊鋼	26,100	5,210.00	135,981,000	貸付有価証券

				1,000株
日本高周波鋼業	5,400	822.00	4,438,800	貸付有価証券 400株
日本冶金工業	121,600	320.00	38,912,000	貸付有価証券 2,100株
山陽特殊製鋼	17,000	2,597.00	44,149,000	貸付有価証券 7,900株
愛知製鋼	8,300	4,245.00	35,233,500	
日立金属	158,400	1,127.00	178,516,800	貸付有価証券 3,100株
日本金属	3,700	1,904.00	7,044,800	
大平洋金属	9,000	3,885.00	34,965,000	貸付有価証券 3,000株
新日本電工	88,100	317.00	27,927,700	貸付有価証券 41,400株(1,800株)
栗本鐵工所	7,400	2,099.00	15,532,600	
虹技	2,200	1,914.00	4,210,800	
日本鑄鉄管	15,000	161.00	2,415,000	
三菱製鋼	10,900	2,138.00	23,304,200	
日亜鋼業	21,500	350.00	7,525,000	
日本精線	2,400	4,355.00	10,452,000	貸付有価証券 200株
シンニッタン	22,900	473.00	10,831,700	
新家工業	3,300	2,093.00	6,906,900	
大紀アルミニウム工業所	24,200	699.00	16,915,800	貸付有価証券 11,300株
日本軽金属ホールディングス	429,400	245.00	105,203,000	
三井金属鉱業	39,700	4,690.00	186,193,000	貸付有価証券 200株
東邦亜鉛	8,200	4,105.00	33,661,000	貸付有価証券 100株
三菱マテリアル	97,100	2,991.00	290,426,100	
住友金属鉱山	188,000	4,260.00	800,880,000	
DOWAホールディングス	37,200	3,445.00	128,154,000	
古河機械金属	24,300	1,581.00	38,418,300	
大阪チタニウムテクノロジーズ	15,300	1,619.00	24,770,700	貸付有価証券 6,100株
東邦チタニウム	26,300	967.00	25,432,100	貸付有価証券

				12,400株(100株)
U A C J	22,300	2,403.00	53,586,900	貸付有価証券 10,400株(100株)
C Kサンエツ	2,800	3,585.00	10,038,000	貸付有価証券 100株
古河電気工業	48,900	3,825.00	187,042,500	
住友電気工業	549,900	1,641.00	902,385,900	
フジクラ	177,600	701.00	124,497,600	
昭和電線ホールディングス	18,500	745.00	13,782,500	
東京特殊電線	1,900	2,684.00	5,099,600	
タツタ電線	29,200	576.00	16,819,200	貸付有価証券 1,600株
カナレ電気	2,400	2,380.00	5,712,000	貸付有価証券 1,100株
平河ヒューテック	7,300	1,450.00	10,585,000	
リョービ	18,100	3,600.00	65,160,000	
アーレスティ	18,000	1,037.00	18,666,000	
アサヒホールディングス	25,200	2,151.00	54,205,200	貸付有価証券 300株
稲葉製作所	8,300	1,468.00	12,184,400	貸付有価証券 3,900株
宮地エンジニアリンググループ	4,200	2,038.00	8,559,600	
トーカロ	40,900	1,197.00	48,957,300	
アルファC o	5,200	1,603.00	8,335,600	
S U M C O	135,400	2,231.00	302,077,400	
川田テクノロジーズ	3,000	7,760.00	23,280,000	
R S T e c h n o l o g i e s	2,300	5,640.00	12,972,000	貸付有価証券 500株(200株)
東洋製罐グループホールディングス	100,600	1,847.00	185,808,200	
ホッカシホールディングス	37,000	389.00	14,393,000	
コロナ	8,100	1,232.00	9,979,200	
横河ブリッジホールディングス	27,400	2,631.00	72,089,400	
駒井ハルテック	3,200	2,304.00	7,372,800	
高田機工	1,300	3,205.00	4,166,500	
三和ホールディングス	141,100	1,173.00	165,510,300	

文化シャッター	43,300	956.00	41,394,800	
三協立山	20,400	1,479.00	30,171,600	貸付有価証券 100株
アルインコ	10,700	1,072.00	11,470,400	
東洋シャッター	3,800	685.00	2,603,000	
L I X I Lグループ	216,800	2,237.00	484,981,600	
日本ファイルコン	11,300	612.00	6,915,600	
ノーリツ	32,800	1,803.00	59,138,400	
長府製作所	16,600	2,403.00	39,889,800	貸付有価証券 300株
リンナイ	26,200	10,030.00	262,786,000	
ダイニチ工業	7,900	809.00	6,391,100	
日東精工	20,300	733.00	14,879,900	
三洋工業	1,800	2,170.00	3,906,000	
岡部	29,800	1,034.00	30,813,200	
ジーテクト	16,200	1,978.00	32,043,600	
中国工業	2,200	673.00	1,480,600	貸付有価証券 900株
東プレ	27,400	2,757.00	75,541,800	
高周波熱錬	28,300	984.00	27,847,200	
東京製綱	10,500	1,920.00	20,160,000	貸付有価証券 1,500株（500株）
サンコール	8,300	716.00	5,942,800	
モリテック スチール	11,500	608.00	6,992,000	貸付有価証券 4,300株
パイオラックス	21,800	2,690.00	58,642,000	
エイチワン	14,400	1,230.00	17,712,000	貸付有価証券 600株
日本発條	146,500	1,055.00	154,557,500	
中央発條	1,800	3,745.00	6,741,000	
アドバネクス	2,300	2,125.00	4,887,500	
立川ブラインド工業	6,500	1,429.00	9,288,500	貸付有価証券 3,000株
三益半導体工業	11,500	1,788.00	20,562,000	
日本ドライケミカル	2,000	2,350.00	4,700,000	
日本製鋼所	48,000	2,840.00	136,320,000	
三浦工業	63,600	2,767.00	175,981,200	貸付有価証券 4,600株

タクマ	49,800	1,368.00	68,126,400	
ツガミ	39,000	1,015.00	39,585,000	
オークマ	17,100	5,790.00	99,009,000	
東芝機械	83,000	529.00	43,907,000	
アマダホールディングス	227,000	1,070.00	242,890,000	
アイダエンジニアリング	37,400	1,073.00	40,130,200	貸付有価証券 800株
滝澤鉄工所	4,600	1,813.00	8,339,800	
F U J I	44,000	1,958.00	86,152,000	
牧野フライス製作所	75,000	867.00	65,025,000	
オーエスジー	67,800	2,269.00	153,838,200	貸付有価証券 2,400株(2,300株)
ダイジェット工業	1,800	1,754.00	3,157,200	貸付有価証券 100株(100株)
旭ダイヤモンド工業	43,700	802.00	35,047,400	
D M G 森精機	81,400	1,589.00	129,344,600	
ソディック	32,100	1,022.00	32,806,200	貸付有価証券 14,800株(14,800株)
ディスコ	19,900	19,370.00	385,463,000	貸付有価証券 2,600株
日東工器	9,100	2,679.00	24,378,900	
日進工具	3,900	2,633.00	10,268,700	貸付有価証券 300株
パンチ工業	12,300	1,036.00	12,742,800	貸付有価証券 100株
富士ダイス	7,400	869.00	6,430,600	
豊和工業	8,100	976.00	7,905,600	貸付有価証券 3,800株
O K K	5,600	1,197.00	6,703,200	貸付有価証券 100株
東洋機械金属	11,500	698.00	8,027,000	
津田駒工業	3,500	1,883.00	6,590,500	貸付有価証券 1,500株
エンシュウ	38,000	148.00	5,624,000	貸付有価証券 16,000株
島精機製作所	18,600	5,500.00	102,300,000	貸付有価証券 8,700株
オプトラン	14,300	4,010.00	57,343,000	
N C ホールディングス	4,700	766.00	3,600,200	
フリー	10,500	997.00	10,468,500	貸付有価証券

				100株
ヤマシンフィルタ	22,400	1,040.00	23,296,000	貸付有価証券 10,500株(5,200株)
日阪製作所	21,200	1,054.00	22,344,800	
やまびこ	28,500	1,316.00	37,506,000	
平田機工	5,500	7,630.00	41,965,000	貸付有価証券 2,500株
ペガサスマシン製造	13,800	935.00	12,903,000	貸付有価証券 1,100株
ナプテスコ	80,900	3,380.00	273,442,000	
三井海洋開発	15,600	2,906.00	45,333,600	貸付有価証券 200株
レオン自動機	13,100	2,119.00	27,758,900	
S M C	46,700	42,500.00	1,984,750,000	
新川	12,000	936.00	11,232,000	貸付有価証券 5,500株(500株)
ホソカワミクロン	5,200	7,170.00	37,284,000	
ユニオンツール	6,700	3,600.00	24,120,000	貸付有価証券 3,100株
オイレス工業	19,000	2,167.00	41,173,000	
日精エー・エス・ビー機 械	4,300	5,840.00	25,112,000	貸付有価証券 900株
サトーホールディングス	19,300	3,135.00	60,505,500	貸付有価証券 800株
技研製作所	10,100	2,604.00	26,300,400	貸付有価証券 4,700株
日本エアーテック	5,000	859.00	4,295,000	貸付有価証券 100株
カワタ	3,000	1,607.00	4,821,000	貸付有価証券 1,200株
日精樹脂工業	12,300	1,219.00	14,993,700	
オカダアイオン	4,900	1,664.00	8,153,600	貸付有価証券 2,300株
ワイエイシイホールディ ングス	4,900	890.00	4,361,000	貸付有価証券 2,300株
小松製作所	718,100	3,112.00	2,234,727,200	
住友重機械工業	85,100	3,705.00	315,295,500	
日立建機	69,500	3,545.00	246,377,500	貸付有価証券 600株
日工	4,100	2,524.00	10,348,400	

巴工業	6,300	2,317.00	14,597,100	
井関農機	14,900	2,003.00	29,844,700	
TOWA	11,600	1,176.00	13,641,600	貸付有価証券 3,000株(3,000株)
丸山製作所	3,300	1,819.00	6,002,700	
北川鉄工所	7,100	2,613.00	18,552,300	
ローツェ	7,300	2,138.00	15,607,400	貸付有価証券 3,400株
タカキタ	5,200	769.00	3,998,800	貸付有価証券 400株
クボタ	797,800	1,809.50	1,443,619,100	貸付有価証券 2,100株
荏原実業	4,300	2,271.00	9,765,300	
三菱化工機	5,100	2,055.00	10,480,500	
月島機械	29,500	1,685.00	49,707,500	
帝国電機製作所	10,400	1,388.00	14,435,200	
東京機械製作所	5,800	463.00	2,685,400	貸付有価証券 2,400株
新東工業	35,300	983.00	34,699,900	
澁谷工業	13,000	3,425.00	44,525,000	
アイチ コーポレーショ ン	25,700	662.00	17,013,400	
小森コーポレーション	37,400	1,342.00	50,190,800	貸付有価証券 600株
鶴見製作所	12,500	1,863.00	23,287,500	
住友精密工業	25,000	367.00	9,175,000	
酒井重工業	2,800	3,605.00	10,094,000	貸付有価証券 1,000株
荏原製作所	61,100	3,315.00	202,546,500	
石井鐵工所	2,300	2,045.00	4,703,500	
西島製作所	15,200	1,062.00	16,142,400	
北越工業	16,700	1,091.00	18,219,700	
ダイキン工業	203,000	13,575.00	2,755,725,000	貸付有価証券 5,000株
オルガノ	5,400	3,315.00	17,901,000	
トーヨーカネツ	6,300	4,075.00	25,672,500	貸付有価証券 1,100株
栗田工業	80,500	3,025.00	243,512,500	
椿本チエイン	88,000	866.00	76,208,000	

大同工業	5,700	1,488.00	8,481,600	
木村化工機	12,400	428.00	5,307,200	
アネスト岩田	25,100	1,241.00	31,149,100	
ダイフク	75,700	5,120.00	387,584,000	
サムコ	4,100	1,197.00	4,907,700	貸付有価証券 500株
加藤製作所	7,000	2,813.00	19,691,000	貸付有価証券 400株
油研工業	2,900	2,691.00	7,803,900	
タダノ	71,800	1,392.00	99,945,600	
フジテック	47,600	1,360.00	64,736,000	
C K D	41,400	1,878.00	77,749,200	貸付有価証券 300株
キトー	11,200	2,218.00	24,841,600	
平和	46,100	2,611.00	120,367,100	
理想科学工業	14,800	2,263.00	33,492,400	
S A N K Y O	37,200	4,410.00	164,052,000	
日本金銭機械	13,700	1,232.00	16,878,400	貸付有価証券 5,700株（900株）
マースエンジニアリング	9,400	2,641.00	24,825,400	
福島工業	9,200	5,190.00	47,748,000	
オーイズミ	6,200	579.00	3,589,800	貸付有価証券 700株
ダイコク電機	6,800	1,865.00	12,682,000	貸付有価証券 1,300株（100株）
竹内製作所	24,900	2,297.00	57,195,300	貸付有価証券 100株
アマノ	46,000	2,553.00	117,438,000	
J U K I	22,100	1,093.00	24,155,300	
サンデンホールディングス	18,100	1,488.00	26,932,800	
蛇の目マシン工業	13,500	716.00	9,666,000	
マックス	22,900	1,422.00	32,563,800	
グローリー	44,400	3,140.00	139,416,000	
新晃工業	15,100	1,880.00	28,388,000	
大和冷機工業	23,900	1,298.00	31,022,200	
セガサミーホールディングス	147,500	1,942.00	286,445,000	貸付有価証券 2,800株
日本ピストンリング	5,400	2,325.00	12,555,000	

リケン	6,900	5,860.00	40,434,000	
T P R	16,700	2,619.00	43,737,300	
ツバキ・ナカシマ	14,900	2,678.00	39,902,200	貸付有価証券 100株
ホシザキ	46,800	11,860.00	555,048,000	貸付有価証券 1,100株
大豊工業	12,100	1,290.00	15,609,000	
日本精工	305,500	1,148.00	350,714,000	
N T N	344,200	446.00	153,513,200	貸付有価証券 9,700株
ジェイテクト	158,500	1,501.00	237,908,500	
不二越	13,800	4,905.00	67,689,000	貸付有価証券 4,400株
日本トムソン	47,500	881.00	41,847,500	貸付有価証券 9,200株
T H K	92,700	3,335.00	309,154,500	
ユースン精機	13,200	1,329.00	17,542,800	貸付有価証券 2,900株（200株）
前澤給装工業	5,800	2,000.00	11,600,000	
イーグル工業	18,400	1,782.00	32,788,800	
前澤工業	10,900	463.00	5,046,700	貸付有価証券 100株
日本ピラー工業	15,000	1,518.00	22,770,000	
キッツ	60,300	916.00	55,234,800	
マキタ	193,900	5,080.00	985,012,000	
日立造船	117,900	510.00	60,129,000	貸付有価証券 2,600株
三菱重工業	249,200	3,984.00	992,812,800	貸付有価証券 10,800株
I H I	114,300	3,925.00	448,627,500	
スター精密	23,800	1,728.00	41,126,400	貸付有価証券 7,400株
日清紡ホールディングス	90,800	1,176.00	106,780,800	
イビデン	91,100	1,768.00	161,064,800	貸付有価証券 42,100株
コニカミノルタ	348,200	1,039.00	361,779,800	貸付有価証券 1,500株
ブラザー工業	181,600	2,152.00	390,803,200	
ミネベアミツミ	276,100	1,875.00	517,687,500	貸付有価証券 1,400株

日立製作所	3,571,000	783.00	2,796,093,000	
三菱電機	1,487,200	1,460.50	2,172,055,600	
富士電機	448,000	851.00	381,248,000	
東洋電機製造	5,800	1,857.00	10,770,600	貸付有価証券 2,700株
安川電機	172,400	4,035.00	695,634,000	貸付有価証券 45,400株
シンフォニアテクノロジー	96,000	385.00	36,960,000	貸付有価証券 29,000株（20,000株）
明電舎	126,000	390.00	49,140,000	
オリジン電気	4,300	2,206.00	9,485,800	
山洋電気	7,200	7,940.00	57,168,000	
デンヨー	13,700	1,768.00	24,221,600	
東芝テック	106,000	665.00	70,490,000	貸付有価証券 1,000株
芝浦メカトロニクス	22,000	373.00	8,206,000	
マブチモーター	41,200	5,330.00	219,596,000	貸付有価証券 4,200株
日本電産	179,000	16,935.00	3,031,365,000	
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	6,200	2,620.00	16,244,000	貸付有価証券 2,700株
トレックス・セミコンダクター	4,200	1,434.00	6,022,800	
東光高岳	7,500	2,007.00	15,052,500	
ダブル・スコープ	21,600	1,797.00	38,815,200	貸付有価証券 6,500株（100株）
ダイヘン	81,000	669.00	54,189,000	
田淵電機	20,600	244.00	5,026,400	貸付有価証券 9,600株（100株）
ヤーマン	21,600	2,042.00	44,107,200	貸付有価証券 10,100株
JVCケンウッド	109,100	315.00	34,366,500	貸付有価証券 51,200株（50,600株）
ミマキエンジニアリング	13,300	907.00	12,063,100	
第一精工	6,900	1,860.00	12,834,000	貸付有価証券 300株
日新電機	34,900	1,034.00	36,086,600	貸付有価証券 200株
大崎電気工業	31,800	845.00	26,871,000	
オムロン	158,100	5,330.00	842,673,000	

日東工業	23,800	2,188.00	52,074,400	
I D E C	18,400	2,571.00	47,306,400	貸付有価証券 1,700株
不二電機工業	1,600	1,425.00	2,280,000	貸付有価証券 400株
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	267,000	498.00	132,966,000	貸付有価証券 5,000株(5,000株)
サクサホールディングス	3,700	2,356.00	8,717,200	貸付有価証券 500株
メルコホールディングス	7,200	4,150.00	29,880,000	
テクノメディカ	3,600	2,020.00	7,272,000	
日本電気	192,400	3,085.00	593,554,000	
富士通	1,529,000	676.00	1,033,604,000	
沖電気工業	60,400	1,215.00	73,386,000	貸付有価証券 11,200株
岩崎通信機	6,500	819.00	5,323,500	
電気興業	8,500	3,425.00	29,112,500	
サンケン電気	87,000	585.00	50,895,000	
ナカヨ	2,900	1,838.00	5,330,200	
アイホン	8,400	1,752.00	14,716,800	
ルネサスエレクトロニク ス	77,000	1,107.00	85,239,000	貸付有価証券 2,200株
セイコーエプソン	221,400	1,890.00	418,446,000	
ワコム	115,400	624.00	72,009,600	貸付有価証券 14,300株
アルバック	34,200	4,325.00	147,915,000	
アクセル	6,200	853.00	5,288,600	
E I Z O	13,600	4,315.00	58,684,000	
ジャパニーズディスプレイ	305,500	150.00	45,825,000	貸付有価証券 108,800株
日本信号	41,000	1,042.00	42,722,000	貸付有価証券 600株
京三製作所	34,800	761.00	26,482,800	
能美防災	19,700	2,439.00	48,048,300	
ホーチキ	10,800	2,250.00	24,300,000	
星和電機	5,000	553.00	2,765,000	
エレコム	12,900	2,611.00	33,681,900	
パナソニック	1,699,000	1,505.50	2,557,844,500	
シャープ	138,100	2,625.00	362,512,500	貸付有価証券

				66,200株(18,500株)
アンリツ	108,400	1,543.00	167,261,200	貸付有価証券 100株
富士通ゼネラル	45,400	1,620.00	73,548,000	貸付有価証券 20,400株
ソニー	995,600	5,496.00	5,471,817,600	貸付有価証券 20,200株
T D K	77,800	11,490.00	893,922,000	貸付有価証券 1,900株
帝国通信工業	6,600	1,284.00	8,474,400	
タムラ製作所	57,300	679.00	38,906,700	貸付有価証券 7,300株
アルプス電気	128,100	2,738.00	350,737,800	貸付有価証券 700株
池上通信機	47,000	152.00	7,144,000	貸付有価証券 13,000株
パイオニア	247,800	158.00	39,152,400	貸付有価証券 116,400株
日本電波工業	13,400	578.00	7,745,200	貸付有価証券 5,000株(1,200株)
鈴木	7,000	972.00	6,804,000	貸付有価証券 3,200株
日本トリム	3,200	4,870.00	15,584,000	貸付有価証券 800株
ローランド ディー . ジー .	7,600	2,453.00	18,642,800	
フォスター電機	17,400	1,569.00	27,300,600	
クラリオン	78,000	285.00	22,230,000	貸付有価証券 5,000株(1,000株)
S M K	38,000	367.00	13,946,000	
ヨコオ	9,600	1,937.00	18,595,200	貸付有価証券 1,900株
ティアック	107,000	43.00	4,601,000	貸付有価証券 50,000株(3,000株)
ホシデン	37,500	950.00	35,625,000	貸付有価証券 4,200株
ヒロセ電機	25,200	13,720.00	345,744,000	貸付有価証券 2,200株
日本航空電子工業	38,000	1,757.00	66,766,000	
T O A	15,900	1,268.00	20,161,200	
マクセルホールディング	29,600	1,787.00	52,895,200	貸付有価証券

ス				2,700株
古野電気	17,700	916.00	16,213,200	
ユニデンホールディングス	41,000	324.00	13,284,000	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
アルパイン	35,400	2,022.00	71,578,800	貸付有価証券 100株
スミダコーポレーション	15,200	1,192.00	18,118,400	貸付有価証券 1,700株(1,200株)
アイコム	8,200	2,707.00	22,197,400	
リオン	6,200	2,391.00	14,824,200	
本多通信工業	11,500	961.00	11,051,500	貸付有価証券 1,600株
船井電機	15,000	652.00	9,780,000	貸付有価証券 7,100株
横河電機	148,800	1,924.00	286,291,200	
新電元工業	5,300	5,360.00	28,408,000	
アズビル	44,600	4,895.00	218,317,000	
東亜ディーケーケー	7,300	1,185.00	8,650,500	
日本光電工業	62,100	3,080.00	191,268,000	
チノー	5,100	1,662.00	8,476,200	
共和電業	16,800	432.00	7,257,600	
日本電子材料	5,900	727.00	4,289,300	貸付有価証券 2,700株
堀場製作所	29,500	7,750.00	228,625,000	貸付有価証券 500株
アドバンテスト	82,900	2,297.00	190,421,300	貸付有価証券 3,800株
小野測器	6,300	877.00	5,525,100	
エスベック	13,200	2,137.00	28,208,400	
キーエンス	73,000	66,560.00	4,858,880,000	
日置電機	7,800	4,425.00	34,515,000	
シスメックス	115,800	10,960.00	1,269,168,000	貸付有価証券 13,100株
日本マイクロニクス	24,000	986.00	23,664,000	貸付有価証券 1,100株
メガチップス	11,700	3,085.00	36,094,500	貸付有価証券 5,500株
O B A R A G R O U P	8,700	6,260.00	54,462,000	貸付有価証券 200株
澤藤電機	1,600	2,299.00	3,678,400	

コーセル	20,600	1,381.00	28,448,600	
イリソ電子工業	12,500	6,540.00	81,750,000	
新日本無線	9,000	754.00	6,786,000	
オブテックスグループ	24,200	3,095.00	74,899,000	貸付有価証券 2,300株
千代田インテグレ	6,900	2,599.00	17,933,100	
アイ・オー・データ機器	6,200	1,229.00	7,619,800	貸付有価証券 1,200株（700株）
レーザーテック	30,500	3,360.00	102,480,000	
スタンレー電気	113,800	3,845.00	437,561,000	
岩崎電気	5,800	1,636.00	9,488,800	
ウシオ電機	90,300	1,354.00	122,266,200	
岡谷電機産業	10,600	528.00	5,596,800	貸付有価証券 4,700株（500株）
ヘリオス テクノ ホールディング	12,600	704.00	8,870,400	貸付有価証券 5,900株（5,200株）
日本セラミック	15,100	2,968.00	44,816,800	
遠藤照明	7,500	899.00	6,742,500	貸付有価証券 300株
古河電池	10,600	890.00	9,434,000	貸付有価証券 4,900株
双信電機	6,500	570.00	3,705,000	貸付有価証券 1,700株
山一電機	10,800	1,571.00	16,966,800	貸付有価証券 1,500株
図研	9,700	1,917.00	18,594,900	
日本電子	54,000	1,143.00	61,722,000	
カシオ計算機	119,600	1,801.00	215,399,600	貸付有価証券 3,100株
ファナック	141,300	22,230.00	3,141,099,000	貸付有価証券 1,600株
日本シイエムケイ	26,200	718.00	18,811,600	貸付有価証券 6,200株
エンプラス	6,700	3,110.00	20,837,000	
大真空	5,400	1,351.00	7,295,400	貸付有価証券 100株
ローム	66,800	9,370.00	625,916,000	
浜松ホトニクス	106,700	4,630.00	494,021,000	貸付有価証券 1,000株
三井ハイテック	19,600	1,366.00	26,773,600	貸付有価証券

				9,200株
新光電気工業	56,200	972.00	54,626,400	貸付有価証券 3,100株
京セラ	244,100	6,201.00	1,513,664,100	貸付有価証券 6,800株
太陽誘電	66,800	2,920.00	195,056,000	貸付有価証券 2,600株
村田製作所	156,000	18,245.00	2,846,220,000	貸付有価証券 1,100株
ユーシン	22,400	725.00	16,240,000	貸付有価証券 7,100株(5,200株)
双葉電子工業	24,300	1,948.00	47,336,400	貸付有価証券 1,800株
北陸電気工業	6,000	1,253.00	7,518,000	
ニチコン	46,800	1,350.00	63,180,000	
日本ケミコン	12,100	4,070.00	49,247,000	
K O A	20,600	2,662.00	54,837,200	貸付有価証券 1,600株
市光工業	22,200	1,328.00	29,481,600	貸付有価証券 10,400株
小糸製作所	89,100	7,620.00	678,942,000	
ミツバ	27,400	989.00	27,098,600	貸付有価証券 1,900株
S C R E E Nホールディングス	28,100	8,330.00	234,073,000	
キヤノン電子	13,600	2,232.00	30,355,200	
キヤノン	800,600	3,693.00	2,956,615,800	
リコー	447,100	1,005.00	449,335,500	貸付有価証券 101,500株
象印マホービン	27,700	1,611.00	44,624,700	貸付有価証券 13,000株
M U T O Hホールディングス	2,000	2,387.00	4,774,000	貸付有価証券 200株(200株)
東京エレクトロン	99,200	18,955.00	1,880,336,000	貸付有価証券 2,400株
トヨタ紡織	43,300	2,115.00	91,579,500	
芦森工業	3,100	2,470.00	7,657,000	貸付有価証券 1,200株
ユニプレス	28,700	2,264.00	64,976,800	
豊田自動織機	120,400	6,050.00	728,420,000	貸付有価証券 300株

モリタホールディングス	23,800	2,260.00	53,788,000	貸付有価証券 100株
三櫻工業	18,900	736.00	13,910,400	
デンソー	330,000	5,450.00	1,798,500,000	
東海理化電機製作所	39,200	2,089.00	81,888,800	
三井E & Sホールディングス	53,700	1,388.00	74,535,600	貸付有価証券 13,600株（1,800株）
川崎重工業	115,700	3,240.00	374,868,000	貸付有価証券 800株
名村造船所	44,600	442.00	19,713,200	貸付有価証券 5,700株
サノヤスホールディングス	18,100	230.00	4,163,000	貸付有価証券 8,500株
日本車輛製造	54,000	282.00	15,228,000	貸付有価証券 19,000株（1,000株）
三菱ロジスネクスト	17,700	1,332.00	23,576,400	
近畿車輛	2,200	2,447.00	5,383,400	貸付有価証券 300株
日産自動車	1,754,000	1,078.50	1,891,689,000	貸付有価証券 2,800株
いすゞ自動車	430,900	1,497.00	645,057,300	
トヨタ自動車	1,808,000	7,199.00	13,015,792,000	貸付有価証券 124,700株
日野自動車	212,200	1,171.00	248,486,200	貸付有価証券 200株
三菱自動車工業	550,500	891.00	490,495,500	貸付有価証券 92,200株
エフテック	9,500	1,464.00	13,908,000	
レシップホールディングス	5,300	890.00	4,717,000	
G M B	2,400	1,475.00	3,540,000	
ファルテック	2,600	1,205.00	3,133,000	
武蔵精密工業	15,900	3,805.00	60,499,500	貸付有価証券 7,400株（7,200株）
日産車体	58,100	1,003.00	58,274,300	貸付有価証券 800株
新明和工業	64,600	1,343.00	86,757,800	
極東開発工業	27,600	1,681.00	46,395,600	
日信工業	30,200	2,038.00	61,547,600	
トピー工業	12,200	2,962.00	36,136,400	

ティラド	5,400	3,765.00	20,331,000	
曙ブレーキ工業	69,100	298.00	20,591,800	貸付有価証券 33,200株（800株）
タチエス	25,200	1,856.00	46,771,200	
N O K	79,900	2,135.00	170,586,500	貸付有価証券 1,900株
フタバ産業	45,500	739.00	33,624,500	
K Y B	15,500	5,080.00	78,740,000	
大同メタル工業	18,700	1,108.00	20,719,600	
プレス工業	79,000	643.00	50,797,000	
ミクニ	18,900	573.00	10,829,700	
太平洋工業	31,100	1,692.00	52,621,200	貸付有価証券 3,600株
ケーヒン	34,200	2,217.00	75,821,400	貸付有価証券 500株
河西工業	18,200	1,460.00	26,572,000	
アイシン精機	122,500	5,110.00	625,975,000	
マツダ	466,800	1,368.50	638,815,800	
今仙電機製作所	13,800	1,212.00	16,725,600	
本田技研工業	1,338,300	3,342.00	4,472,598,600	
スズキ	294,700	6,321.00	1,862,798,700	貸付有価証券 6,700株
S U B A R U	461,700	3,280.00	1,514,376,000	
安永	7,200	1,994.00	14,356,800	貸付有価証券 3,300株（1,500株）
ヤマハ発動機	210,000	2,857.00	599,970,000	
ショーワ	38,600	1,964.00	75,810,400	
T B K	17,700	528.00	9,345,600	
エクセディ	18,000	3,555.00	63,990,000	
豊田合成	54,000	2,799.00	151,146,000	貸付有価証券 200株
愛三工業	26,200	972.00	25,466,400	
盟和産業	2,300	1,287.00	2,960,100	
日本プラスト	8,100	978.00	7,921,800	貸付有価証券 300株（300株）
ヨロズ	15,000	1,685.00	25,275,000	
エフ・シー・シー	24,300	3,180.00	77,274,000	
シマノ	59,900	16,300.00	976,370,000	

テイ・エス テック	34,500	4,665.00	160,942,500	
ジャムコ	7,400	2,437.00	18,033,800	貸付有価証券 3,200株
テルモ	228,000	6,680.00	1,523,040,000	貸付有価証券 6,900株
クリエートメディック	4,900	1,465.00	7,178,500	
日機装	51,500	1,154.00	59,431,000	
島津製作所	177,700	3,245.00	576,636,500	
JMS	13,700	674.00	9,233,800	
クボテック	3,200	494.00	1,580,800	
長野計器	11,700	1,315.00	15,385,500	
ブイ・テクノロジー	3,500	21,220.00	74,270,000	貸付有価証券 1,600株
東京計器	9,500	1,226.00	11,647,000	貸付有価証券 2,800株
愛知時計電機	2,000	4,155.00	8,310,000	
インターアクション	7,900	1,479.00	11,684,100	貸付有価証券 3,100株（700株）
オーバル	14,500	322.00	4,669,000	
東京精密	26,900	3,815.00	102,623,500	
マニー	18,100	5,230.00	94,663,000	
ニコン	259,100	1,750.00	453,425,000	
トプコン	79,900	1,840.00	147,016,000	貸付有価証券 300株
オリンパス	221,500	4,115.00	911,472,500	
理研計器	14,200	2,612.00	37,090,400	
タムロン	12,000	2,060.00	24,720,000	
HOYA	299,400	6,359.00	1,903,884,600	
シード	2,100	6,640.00	13,944,000	貸付有価証券 900株
ノーリツ鋼機	15,000	1,879.00	28,185,000	貸付有価証券 7,000株（100株）
エー・アンド・デイ	13,600	1,051.00	14,293,600	
シチズン時計	177,500	719.00	127,622,500	
リズム時計工業	5,600	2,293.00	12,840,800	
大研医器	13,200	760.00	10,032,000	貸付有価証券 1,000株
メニコン	20,400	3,020.00	61,608,000	
シンシア	1,600	644.00	1,030,400	貸付有価証券

				700株
松風	7,300	1,445.00	10,548,500	
セイコーホールディングス	22,900	2,382.00	54,547,800	貸付有価証券 3,900株
ニプロ	102,900	1,289.00	132,638,100	貸付有価証券 48,300株
中本パックス	3,800	1,789.00	6,798,200	
スノーピーク	4,600	1,559.00	7,171,400	貸付有価証券 2,100株(1,000株)
パラマウントベッドホールディングス	15,700	4,725.00	74,182,500	
トランザクション	8,000	1,014.00	8,112,000	貸付有価証券 3,200株
S H O - B I	4,300	441.00	1,896,300	貸付有価証券 1,300株
ニホンフラッシュ	6,900	2,788.00	19,237,200	
前田工織	16,400	1,932.00	31,684,800	
永大産業	19,400	552.00	10,708,800	
アートネイチャー	15,900	677.00	10,764,300	
バンダイナムコホールディングス	153,800	4,665.00	717,477,000	
アイフィスジャパン	3,300	741.00	2,445,300	
共立印刷	24,700	381.00	9,410,700	
S H O E I	7,200	3,855.00	27,756,000	貸付有価証券 2,400株
フランスベッドホールディングス	17,600	947.00	16,667,200	
パイロットコーポレーション	25,900	6,400.00	165,760,000	
萩原工業	8,300	1,887.00	15,662,100	
トッパン・フォームズ	31,900	1,134.00	36,174,600	
フジシールインターナショナル	33,300	3,930.00	130,869,000	
タカラトミー	62,200	903.00	56,166,600	
廣済堂	13,800	519.00	7,162,200	
A s - m e エステール	4,400	786.00	3,458,400	
アーク	75,700	125.00	9,462,500	貸付有価証券 27,200株
タカノ	6,500	1,014.00	6,591,000	
プロネクサス	13,900	1,325.00	18,417,500	

ホクシン	10,500	171.00	1,795,500	貸付有価証券 500株（500株）
ウッドワン	5,000	1,412.00	7,060,000	
大建工業	11,600	2,480.00	28,768,000	
凸版印刷	420,000	850.00	357,000,000	
大日本印刷	194,600	2,449.00	476,575,400	
図書印刷	10,000	1,023.00	10,230,000	
共同印刷	4,600	2,839.00	13,059,400	
N I S S H A	30,500	2,207.00	67,313,500	貸付有価証券 4,500株（400株）
光村印刷	1,300	2,244.00	2,917,200	
宝印刷	7,800	1,820.00	14,196,000	
アシックス	147,700	1,808.00	267,041,600	
ツツミ	4,600	1,870.00	8,602,000	
小松ウオール工業	5,000	2,027.00	10,135,000	
ヤマハ	100,200	5,770.00	578,154,000	
河合楽器製作所	5,000	5,570.00	27,850,000	貸付有価証券 800株
クリナップ	13,800	812.00	11,205,600	
ピジョン	89,900	5,430.00	488,157,000	貸付有価証券 1,400株
兼松サステック	1,100	1,949.00	2,143,900	
キングジム	12,400	1,087.00	13,478,800	貸付有価証券 1,900株
リンテック	35,400	3,215.00	113,811,000	
イトーキ	31,300	654.00	20,470,200	
任天堂	91,600	36,480.00	3,341,568,000	貸付有価証券 29,900株
三菱鉛筆	24,500	2,336.00	57,232,000	
タカラスタンダード	30,700	1,851.00	56,825,700	貸付有価証券 13,300株
コクヨ	71,300	2,007.00	143,099,100	
ナカバヤシ	14,600	697.00	10,176,200	
グローブライド	6,600	4,195.00	27,687,000	
オカムラ	51,900	1,651.00	85,686,900	
美津濃	14,700	4,080.00	59,976,000	
東京電力ホールディングス	1,187,300	511.00	606,710,300	

中部電力	455,000	1,649.00	750,295,000	貸付有価証券 10,400株
関西電力	606,800	1,569.50	952,372,600	
中国電力	205,600	1,411.00	290,101,600	貸付有価証券 96,600株（46,300株）
北陸電力	145,700	1,106.00	161,144,200	貸付有価証券 50,100株
東北電力	348,300	1,331.00	463,587,300	
四国電力	133,900	1,494.00	200,046,600	貸付有価証券 100株
九州電力	328,400	1,215.00	399,006,000	貸付有価証券 103,300株（101,400株）
北海道電力	149,100	733.00	109,290,300	貸付有価証券 1,300株
沖縄電力	30,000	2,159.00	64,770,000	
電源開発	118,300	2,763.00	326,862,900	
エフオン	7,400	1,659.00	12,276,600	貸付有価証券 1,000株
イーレックス	23,500	1,153.00	27,095,500	貸付有価証券 7,900株（500株）
レノバ	7,700	1,424.00	10,964,800	貸付有価証券 3,500株
東京瓦斯	317,300	2,844.50	902,559,850	
大阪瓦斯	288,600	2,226.50	642,567,900	
東邦瓦斯	73,700	3,820.00	281,534,000	
北海道瓦斯	40,000	316.00	12,640,000	
広島ガス	30,600	382.00	11,689,200	
西部瓦斯	18,000	3,045.00	54,810,000	
静岡ガス	42,200	1,025.00	43,255,000	
メタウォーター	8,400	3,105.00	26,082,000	
SBSホールディングス	14,700	1,208.00	17,757,600	貸付有価証券 300株
東武鉄道	156,900	3,485.00	546,796,500	
相鉄ホールディングス	47,600	3,445.00	163,982,000	
東京急行電鉄	403,900	1,954.00	789,220,600	
京浜急行電鉄	203,700	1,862.00	379,289,400	貸付有価証券 600株
小田急電鉄	221,200	2,378.00	526,013,600	
京王電鉄	83,100	5,430.00	451,233,000	

京成電鉄	103,500	3,870.00	400,545,000	貸付有価証券 1,200株
富士急行	20,300	3,450.00	70,035,000	貸付有価証券 300株
新京成電鉄	3,800	2,214.00	8,413,200	
東日本旅客鉄道	267,100	10,815.00	2,888,686,500	貸付有価証券 100株
西日本旅客鉄道	134,200	8,156.00	1,094,535,200	貸付有価証券 200株
東海旅客鉄道	133,200	24,245.00	3,229,434,000	
西武ホールディングス	189,600	1,904.00	360,998,400	貸付有価証券 300株
鴻池運輸	21,000	1,743.00	36,603,000	
西日本鉄道	41,200	3,095.00	127,514,000	貸付有価証券 200株
ハマキョウレックス	10,500	3,490.00	36,645,000	
サカイ引越センター	7,800	5,770.00	45,006,000	貸付有価証券 3,600株
近鉄グループホールディングス	140,900	4,590.00	646,731,000	
阪急阪神ホールディングス	187,900	4,560.00	856,824,000	
南海電気鉄道	66,800	3,140.00	209,752,000	
京阪ホールディングス	62,700	3,985.00	249,859,500	
神戸電鉄	3,400	4,005.00	13,617,000	貸付有価証券 100株
名古屋鉄道	112,100	2,972.00	333,161,200	貸付有価証券 500株
山陽電気鉄道	10,800	2,720.00	29,376,000	
日本通運	55,300	8,340.00	461,202,000	
ヤマトホールディングス	246,900	3,441.00	849,582,900	貸付有価証券 1,500株
山九	36,100	6,090.00	219,849,000	貸付有価証券 100株
丸運	8,000	358.00	2,864,000	
丸全昭和運輸	50,000	518.00	25,900,000	
センコーグループホールディングス	84,700	912.00	77,246,400	貸付有価証券 100株
トナミホールディングス	3,400	6,680.00	22,712,000	
ニッコンホールディング	53,600	3,060.00	164,016,000	

ス				
日本石油輸送	1,700	3,275.00	5,567,500	
福山通運	20,600	5,890.00	121,334,000	
セイノーホールディングス	105,500	2,040.00	215,220,000	
エスライン	3,800	1,187.00	4,510,600	
神奈川中央交通	3,500	3,750.00	13,125,000	
日立物流	31,000	2,979.00	92,349,000	
丸和運輸機関	7,400	3,985.00	29,489,000	貸付有価証券 400株
C & F ロジホールディングス	15,400	1,388.00	21,375,200	
九州旅客鉄道	118,200	3,545.00	419,019,000	
S Gホールディングス	133,100	2,354.00	313,317,400	
日本郵船	117,800	2,199.00	259,042,200	
商船三井	89,100	2,642.00	235,402,200	貸付有価証券 8,500株
川崎汽船	65,100	2,082.00	135,538,200	貸付有価証券 30,500株（200株）
N S ユナイテッド海運	6,600	2,172.00	14,335,200	
明治海運	15,000	399.00	5,985,000	
飯野海運	71,800	494.00	35,469,200	
共栄タンカー	1,100	1,894.00	2,083,400	
乾汽船	10,800	1,158.00	12,506,400	
日本航空	261,300	4,096.00	1,070,284,800	
A N A ホールディングス	273,600	4,206.00	1,150,761,600	貸付有価証券 38,800株（38,500株）
パスコ	14,000	305.00	4,270,000	貸付有価証券 1,000株
ランコム	3,900	7,760.00	30,264,000	
日新	12,200	2,680.00	32,696,000	
三菱倉庫	48,700	2,363.00	115,078,100	貸付有価証券 1,100株
三井倉庫ホールディングス	80,000	340.00	27,200,000	
住友倉庫	98,000	688.00	67,424,000	
澁澤倉庫	7,700	1,711.00	13,174,700	
東陽倉庫	25,400	369.00	9,372,600	
日本トランスシティ	34,100	553.00	18,857,300	

ケイヒン	2,700	1,642.00	4,433,400	
中央倉庫	8,600	1,246.00	10,715,600	
川西倉庫	2,900	1,966.00	5,701,400	貸付有価証券 100株
安田倉庫	12,600	928.00	11,692,800	
東洋埠頭	4,300	1,729.00	7,434,700	
宇徳	12,000	529.00	6,348,000	
上組	86,900	2,366.00	205,605,400	
サンリツ	3,600	802.00	2,887,200	
キムラユニティー	3,800	1,152.00	4,377,600	
キューソー流通システム	4,100	2,740.00	11,234,000	
近鉄エクスプレス	26,600	2,340.00	62,244,000	
東海運	8,000	378.00	3,024,000	
エーアイティー	10,000	1,241.00	12,410,000	
内外トランスライン	4,900	1,590.00	7,791,000	
日本コンセプト	2,700	1,457.00	3,933,900	貸付有価証券 1,200株
NEC ネットエスアイ	16,100	2,485.00	40,008,500	
システナ	46,800	1,263.00	59,108,400	
デジタルアーツ	7,200	5,690.00	40,968,000	貸付有価証券 2,800株（2,600株）
新日鉄住金ソリューションズ	21,900	2,873.00	62,918,700	
キューブシステム	8,500	998.00	8,483,000	
エイジア	2,900	1,619.00	4,695,100	
コア	6,200	1,407.00	8,723,400	貸付有価証券 200株
ソリトンシステムズ	6,400	1,038.00	6,643,200	貸付有価証券 3,000株
ソフトクリエイティブホールディングス	7,000	1,774.00	12,418,000	
T I S	48,600	5,040.00	244,944,000	貸付有価証券 3,700株
ネオス	4,400	465.00	2,046,000	
電算システム	5,100	2,117.00	10,796,700	
グリー	78,200	608.00	47,545,600	
コーエーテクモホールディングス	24,900	2,265.00	56,398,500	
三菱総合研究所	5,700	4,955.00	28,243,500	

ポルテージ	2,900	848.00	2,459,200	貸付有価証券 1,300株（200株）
電算	1,600	2,214.00	3,542,400	
A G S	8,200	884.00	7,248,800	
ファインデックス	12,100	860.00	10,406,000	貸付有価証券 5,300株（2,800株）
ヒト・コミュニケーションズ	3,300	2,126.00	7,015,800	貸付有価証券 1,500株（200株）
ブレインパッド	3,100	3,975.00	12,322,500	貸付有価証券 1,400株（100株）
K L a b	27,700	1,513.00	41,910,100	貸付有価証券 4,300株
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	10,600	2,390.00	25,334,000	貸付有価証券 200株
イーブックイニシアティブジャパン	2,300	1,204.00	2,769,200	
ネクソン	328,500	1,651.00	542,353,500	
アイスタイル	37,100	1,121.00	41,589,100	貸付有価証券 17,400株（800株）
エムアップ	4,800	1,701.00	8,164,800	貸付有価証券 2,200株（1,900株）
エイチーム	9,100	2,499.00	22,740,900	貸付有価証券 100株
テクノスジャパン	13,200	984.00	12,988,800	貸付有価証券 3,600株
e n i s h	5,000	889.00	4,445,000	貸付有価証券 2,300株（200株）
コロプラ	41,600	738.00	30,700,800	貸付有価証券 17,800株
モバイルクリエイイト	11,800	318.00	3,752,400	
オルトプラス	8,300	742.00	6,158,600	貸付有価証券 3,800株（100株）
ブロードリーフ	72,300	615.00	44,464,500	
クロス・マーケティンググループ	4,100	693.00	2,841,300	貸付有価証券 1,900株
ハーツユニテッドグループ	7,700	1,680.00	12,936,000	貸付有価証券 1,200株
メディアドゥホールディングス	4,700	2,440.00	11,468,000	貸付有価証券 2,200株
ブイキューブ	9,000	581.00	5,229,000	貸付有価証券 3,100株（1,100株）

サイバーリンクス	2,200	1,120.00	2,464,000	
ディー・エル・イー	9,400	591.00	5,555,400	貸付有価証券 3,500株(200株)
フィックスターズ	14,000	1,620.00	22,680,000	貸付有価証券 6,600株(900株)
VOYAGE GROUP	7,700	1,201.00	9,247,700	
オブティム	2,500	2,878.00	7,195,000	貸付有価証券 1,100株(300株)
セレス	4,500	1,774.00	7,983,000	貸付有価証券 2,000株
ベリサーブ	1,900	3,510.00	6,669,000	貸付有価証券 300株
ティーガイア	14,600	3,015.00	44,019,000	
セック	1,900	3,285.00	6,241,500	貸付有価証券 500株
日本アジアグループ	15,300	484.00	7,405,200	貸付有価証券 100株(100株)
豆蔵ホールディングス	10,800	993.00	10,724,400	貸付有価証券 100株
テクマトリックス	8,000	2,424.00	19,392,000	貸付有価証券 2,300株
プロシップ	2,100	2,591.00	5,441,100	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	395,700	279.00	110,400,300	貸付有価証券 185,900株
GMOペイメントゲートウェイ	12,000	13,160.00	157,920,000	貸付有価証券 5,000株(400株)
ザッパラス	6,900	376.00	2,594,400	
システムリサーチ	1,900	3,120.00	5,928,000	
インターネットイニシアティブ	23,700	2,280.00	54,036,000	
さくらインターネット	17,400	853.00	14,842,200	貸付有価証券 7,600株
ヴィンクス	4,100	1,111.00	4,555,100	貸付有価証券 1,900株(1,500株)
GMOクラウド	3,200	3,255.00	10,416,000	貸付有価証券 1,500株(500株)
SRAホールディングス	7,700	2,914.00	22,437,800	
Minorityソリューションズ	2,800	1,581.00	4,426,800	
システムインテグレータ	2,000	1,048.00	2,096,000	

朝日ネット	13,300	516.00	6,862,800	
e B A S E	3,800	1,652.00	6,277,600	
アバント	3,900	945.00	3,685,500	
アドソル日進	5,600	1,721.00	9,637,600	
フリービット	9,700	1,387.00	13,453,900	貸付有価証券 4,500株（4,200株）
コムチュア	7,400	2,871.00	21,245,400	貸付有価証券 3,400株（2,900株）
サイバーコム	2,600	1,930.00	5,018,000	貸付有価証券 1,200株（200株）
インフォテリア	7,300	1,045.00	7,628,500	貸付有価証券 3,400株（2,900株）
メディカル・データ・ビ ジョン	11,100	1,593.00	17,682,300	貸付有価証券 5,200株（3,200株）
g u m i	16,800	760.00	12,768,000	貸付有価証券 6,400株
ショーケース・ティー ビー	2,800	1,350.00	3,780,000	貸付有価証券 1,300株
モバイルファクトリー	3,600	1,695.00	6,102,000	貸付有価証券 1,600株
デジタル・インフォメー ション・テクノロジー	6,400	1,125.00	7,200,000	貸付有価証券 2,900株（800株）
P C Iホールディングス	2,600	3,115.00	8,099,000	
パイプドHD	2,200	1,052.00	2,314,400	
アイピーシー	2,400	1,917.00	4,600,800	貸付有価証券 1,100株
ネオジャパン	3,400	1,852.00	6,296,800	貸付有価証券 1,500株
オープンドア	5,800	2,206.00	12,794,800	貸付有価証券 900株
マイネット	3,900	1,328.00	5,179,200	貸付有価証券 900株（100株）
アカツキ	3,800	4,325.00	16,435,000	貸付有価証券 1,700株（100株）
ベネフィットジャパン	800	1,323.00	1,058,400	
U b i c o mホールディ ングス	2,100	1,043.00	2,190,300	貸付有価証券 900株（300株）
L I N E	44,100	4,750.00	209,475,000	貸付有価証券 20,700株（10,400株）
シンクロ・フード	4,900	1,143.00	5,600,700	
オークネット	6,200	1,473.00	9,132,600	貸付有価証券

				1,300株
AOI TYO Holdings	12,000	1,396.00	16,752,000	貸付有価証券 5,600株
マクロミル	18,300	2,712.00	49,629,600	貸付有価証券 200株
ピーグリー	3,300	1,636.00	5,398,800	貸付有価証券 1,500株
オロ	1,400	3,135.00	4,389,000	貸付有価証券 600株(100株)
ソルクシーズ	5,600	1,463.00	8,192,800	貸付有価証券 2,600株
フェイス	5,100	1,437.00	7,328,700	
ハイマックス	1,900	1,852.00	3,518,800	
野村総合研究所	92,700	5,530.00	512,631,000	
サイバネットシステム	12,000	913.00	10,956,000	貸付有価証券 100株(100株)
CEホールディングス	3,800	820.00	3,116,000	貸付有価証券 1,600株
日本システム技術	2,300	1,526.00	3,509,800	
インテージホールディングス	17,200	1,217.00	20,932,400	
東邦システムサイエンス	4,800	874.00	4,195,200	
ソースネクスト	20,500	808.00	16,564,000	貸付有価証券 9,700株(8,000株)
フォーカスシステムズ	8,300	838.00	6,955,400	貸付有価証券 900株(100株)
クレスコ	3,300	3,385.00	11,170,500	
フジ・メディア・ホールディングス	152,800	1,853.00	283,138,400	
オービック	46,000	9,360.00	430,560,000	
ジャストシステム	23,700	2,299.00	54,486,300	
TDCソフト	6,400	1,650.00	10,560,000	
ヤフー	1,052,200	369.00	388,261,800	貸付有価証券 504,000株(16,300株)
トレンドマイクロ	71,300	6,310.00	449,903,000	
インフォメーション・ディベロプメント	4,600	1,359.00	6,251,400	貸付有価証券 1,800株
日本オラクル	23,600	8,580.00	202,488,000	
アルファシステムズ	4,800	2,343.00	11,246,400	

フューチャー	19,800	1,405.00	27,819,000	
C A C H o l d i n g s	10,900	1,081.00	11,782,900	
ソフトバンク・テクノロジー	6,100	1,625.00	9,912,500	貸付有価証券 200株
トーセ	3,900	1,100.00	4,290,000	貸付有価証券 1,700株(1,600株)
オービックビジネスコンサルタント	7,500	7,970.00	59,775,000	貸付有価証券 600株
伊藤忠テクノソリューションズ	66,500	1,960.00	130,340,000	
アイティフォー	17,700	1,315.00	23,275,500	
東計電算	2,600	3,130.00	8,138,000	
エクスネット	2,300	905.00	2,081,500	
大塚商会	87,700	4,540.00	398,158,000	貸付有価証券 100株
サイボウズ	19,500	553.00	10,783,500	
ソフトブレーン	11,400	656.00	7,478,400	貸付有価証券 100株
電通国際情報サービス	9,000	3,395.00	30,555,000	
デジタルガレージ	26,200	4,485.00	117,507,000	
E Mシステムズ	10,100	1,169.00	11,806,900	貸付有価証券 1,800株
ウェザーニューズ	4,900	3,300.00	16,170,000	貸付有価証券 2,300株(200株)
C I J	11,400	697.00	7,945,800	
東洋ビジネスエンジニアリング	1,500	2,011.00	3,016,500	貸付有価証券 700株
日本エンタープライズ	15,000	219.00	3,285,000	貸付有価証券 2,300株
WOWOW	7,000	3,505.00	24,535,000	貸付有価証券 3,200株
スカラ	11,700	990.00	11,583,000	
イマジカ・ロボットホールディングス	12,300	931.00	11,451,300	貸付有価証券 5,700株(2,000株)
ネットワンシステムズ	59,600	1,874.00	111,690,400	
システムソフト	34,500	140.00	4,830,000	貸付有価証券 11,800株(200株)
アルゴグラフィックス	6,700	3,690.00	24,723,000	
マーベラス	24,700	908.00	22,427,600	貸付有価証券

				9,100株(500株)
エイベックス	27,000	1,479.00	39,933,000	貸付有価証券 300株
日本ユニシス	40,500	2,739.00	110,929,500	
兼松エレクトロニクス	9,300	4,100.00	38,130,000	
東京放送ホールディングス	80,700	2,458.00	198,360,600	
日本テレビホールディングス	134,000	1,867.00	250,178,000	
朝日放送グループホールディングス	14,500	835.00	12,107,500	
テレビ朝日ホールディングス	40,100	2,421.00	97,082,100	貸付有価証券 7,200株
スカパーJ S A Tホールディングス	111,400	515.00	57,371,000	貸付有価証券 100株
テレビ東京ホールディングス	12,000	3,415.00	40,980,000	
日本BS放送	4,900	1,349.00	6,610,100	
ビジョン	3,800	3,950.00	15,010,000	貸付有価証券 1,700株
USEN-NEXT HOLDINGS	3,800	1,165.00	4,427,000	貸付有価証券 1,700株
ワイレスゲート	6,900	1,356.00	9,356,400	貸付有価証券 2,700株
コネクシオ	10,300	1,836.00	18,910,800	
日本通信	131,600	202.00	26,583,200	貸付有価証券 62,400株(29,600株)
クロップス	3,100	884.00	2,740,400	貸付有価証券 600株
日本電信電話	1,047,300	5,157.00	5,400,926,100	
KDDI	1,314,100	3,037.00	3,990,921,700	貸付有価証券 23,200株
光通信	17,600	20,320.00	357,632,000	
NTTドコモ	1,047,900	2,830.00	2,965,557,000	
エムティーアイ	16,900	584.00	9,869,600	貸付有価証券 5,200株(5,200株)
GMOインターネット	53,100	2,736.00	145,281,600	貸付有価証券 14,800株(2,700株)
アイドマーケティングコミュニケーション	3,100	894.00	2,771,400	
カドカワ	42,600	1,219.00	51,929,400	貸付有価証券

				2,200株
学研ホールディングス	4,900	5,240.00	25,676,000	
ゼンリン	26,500	2,620.00	69,430,000	貸付有価証券 2,900株(2,900株)
昭文社	6,700	787.00	5,272,900	
インプレスホールディングス	12,100	173.00	2,093,300	貸付有価証券 3,400株
アイネット	8,200	1,866.00	15,301,200	
松竹	9,700	16,240.00	157,528,000	
東宝	96,000	3,825.00	367,200,000	
東映	5,500	11,500.00	63,250,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	453,300	1,264.00	572,971,200	
ピー・シー・エー	2,100	1,866.00	3,918,600	
ビジネスブレイン太田昭和	2,500	2,318.00	5,795,000	
D T S	15,100	4,260.00	64,326,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	67,800	5,710.00	387,138,000	
シーイーシー	8,700	4,300.00	37,410,000	
カブコン	62,500	2,853.00	178,312,500	貸付有価証券 500株
アイ・エス・ビー	2,800	2,007.00	5,619,600	貸付有価証券 700株
ジャステック	8,400	1,212.00	10,180,800	
S C S K	33,700	5,210.00	175,577,000	
日本システムウエア	4,800	2,275.00	10,920,000	
アイネス	18,500	1,096.00	20,276,000	
T K C	12,300	4,225.00	51,967,500	
富士ソフト	20,200	4,650.00	93,930,000	
N S D	24,000	2,561.00	61,464,000	
コナミホールディングス	59,600	5,620.00	334,952,000	
福井コンピュータホールディングス	4,200	1,962.00	8,240,400	貸付有価証券 900株
J B C Cホールディングス	11,500	1,182.00	13,593,000	
ミロク情報サービス	12,900	2,903.00	37,448,700	
ソフトバンクグループ	660,700	8,397.00	5,547,897,900	貸付有価証券 8,700株

ハウスイ	1,200	1,153.00	1,383,600	
高千穂交易	5,600	1,178.00	6,596,800	貸付有価証券 200株
伊藤忠食品	3,600	6,110.00	21,996,000	
エレマテック	6,800	2,767.00	18,815,600	
JALUX	4,100	3,065.00	12,566,500	
あらた	7,200	6,430.00	46,296,000	
トーメンデバイス	2,200	2,890.00	6,358,000	貸付有価証券 100株（100株）
東京エレクトロン デバ イス	5,300	1,999.00	10,594,700	
フィールズ	11,200	963.00	10,785,600	貸付有価証券 3,100株
双日	866,800	403.00	349,320,400	
アルフレッサ ホール ディングス	162,800	2,684.00	436,955,200	
横浜冷凍	37,300	1,019.00	38,008,700	貸付有価証券 13,300株（12,500株）
神栄	2,000	1,444.00	2,888,000	
ラサ商事	6,500	958.00	6,227,000	貸付有価証券 200株
ラクーン	8,600	572.00	4,919,200	貸付有価証券 1,800株
アルコニックス	15,500	1,648.00	25,544,000	貸付有価証券 1,000株
神戸物産	9,500	5,170.00	49,115,000	貸付有価証券 1,700株（1,700株）
ペッパーフードサービス	10,500	4,930.00	51,765,000	貸付有価証券 4,900株（3,600株）
あい ホールディングス	23,500	2,482.00	58,327,000	
ディーブイエックス	5,200	1,402.00	7,290,400	
ダイワボウホールディン グス	12,500	5,990.00	74,875,000	
マクニカ・富士エレホー ルディングス	28,000	1,748.00	48,944,000	貸付有価証券 3,400株
ラクト・ジャパン	2,700	6,000.00	16,200,000	貸付有価証券 1,200株
バイタルケーエスケー・ ホールディングス	27,600	1,120.00	30,912,000	貸付有価証券 3,300株（2,300株）
八洲電機	11,300	944.00	10,667,200	
メディアスホールディン	8,100	1,040.00	8,424,000	貸付有価証券

グス				3,800株
U K Cホールディングス	9,400	2,359.00	22,174,600	
ジューテックホールディングス	3,300	1,180.00	3,894,000	
大光	3,700	786.00	2,908,200	貸付有価証券 700株
O C H Iホールディングス	4,200	1,492.00	6,266,400	
T O K A Iホールディングス	77,400	1,091.00	84,443,400	
C o m i n i x	2,200	947.00	2,083,400	貸付有価証券 100株(100株)
三洋貿易	7,400	2,188.00	16,191,200	
ビューティガレージ	2,000	2,313.00	4,626,000	貸付有価証券 900株
ウイン・パートナーズ	10,600	1,495.00	15,847,000	
ミタチ産業	3,400	973.00	3,308,200	貸付有価証券 1,500株
シップヘルスケアホールディングス	30,500	4,145.00	126,422,500	
明治電機工業	5,000	2,022.00	10,110,000	
デリカフーズホールディングス	2,800	1,620.00	4,536,000	
スターティアホールディングス	3,300	688.00	2,270,400	貸付有価証券 200株(100株)
コメダホールディングス	27,200	2,168.00	58,969,600	
富士興産	5,700	629.00	3,585,300	
協栄産業	1,800	2,076.00	3,736,800	貸付有価証券 700株
小野建	13,000	1,902.00	24,726,000	
佐鳥電機	10,800	1,092.00	11,793,600	
エコトレーディング	3,300	714.00	2,356,200	貸付有価証券 800株
伯東	8,900	1,666.00	14,827,400	貸付有価証券 200株
コンドーテック	11,600	1,037.00	12,029,200	貸付有価証券 100株
中山福	8,400	753.00	6,325,200	
ナガイレーベン	21,200	2,824.00	59,868,800	
三菱食品	16,100	3,035.00	48,863,500	
松田産業	10,700	1,668.00	17,847,600	

第一興商	21,800	5,180.00	112,924,000	
メディバルホールディングス	146,800	2,280.00	334,704,000	
S P K	3,100	2,809.00	8,707,900	
萩原電気ホールディングス	5,300	3,315.00	17,569,500	貸付有価証券 100株
アズワン	11,500	8,010.00	92,115,000	
スズデン	5,100	1,614.00	8,231,400	
尾家産業	4,300	1,428.00	6,140,400	
シモジマ	9,000	1,138.00	10,242,000	
ドウシヤ	15,500	2,522.00	39,091,000	
小津産業	3,200	2,080.00	6,656,000	
高速	8,700	1,349.00	11,736,300	
たけびし	5,100	1,698.00	8,659,800	
リックス	3,300	1,951.00	6,438,300	
丸文	13,000	876.00	11,388,000	
ハピネット	10,000	1,357.00	13,570,000	貸付有価証券 200株
橋本総業ホールディングス	3,000	1,807.00	5,421,000	
日本ライフライン	41,800	2,713.00	113,403,400	貸付有価証券 200株
エクセル	5,900	2,718.00	16,036,200	貸付有価証券 200株
マルカキカイ	4,700	1,981.00	9,310,700	
I D O M	44,400	641.00	28,460,400	貸付有価証券 1,000株
日本エム・ディ・エム	9,800	1,089.00	10,672,200	
進和	8,700	2,525.00	21,967,500	貸付有価証券 2,900株
エスケイジャパン	3,500	465.00	1,627,500	貸付有価証券 1,600株
ダイトロン	6,700	2,391.00	16,019,700	
シークス	18,600	2,343.00	43,579,800	貸付有価証券 4,900株（500株）
田中商事	4,500	715.00	3,217,500	
オーハシテクニカ	8,200	1,849.00	15,161,800	
白銅	5,200	2,386.00	12,407,200	
伊藤忠商事	1,075,000	2,004.00	2,154,300,000	

丸紅	1,203,700	829.90	998,950,630	
高島	2,500	2,188.00	5,470,000	
長瀬産業	88,200	1,747.00	154,085,400	
蝶理	9,300	1,969.00	18,311,700	
豊田通商	163,500	3,745.00	612,307,500	
三共生興	24,900	476.00	11,852,400	
兼松	62,400	1,653.00	103,147,200	
ツカモトコーポレーション	2,600	1,222.00	3,177,200	
三井物産	1,206,800	1,801.00	2,173,446,800	
日本紙パルプ商事	7,600	5,180.00	39,368,000	
日立ハイテクノロジーズ	50,900	4,445.00	226,250,500	
カメイ	19,100	1,755.00	33,520,500	
東都水産	2,200	1,904.00	4,188,800	
OUGホールディングス	2,300	2,772.00	6,375,600	
スターゼン	5,700	6,220.00	35,454,000	貸付有価証券 2,500株（2,500株）
山善	57,200	1,112.00	63,606,400	
椿本興業	3,300	3,955.00	13,051,500	
住友商事	923,900	1,826.50	1,687,503,350	
内田洋行	6,700	3,615.00	24,220,500	
三菱商事	1,027,900	3,092.00	3,178,266,800	
第一実業	6,700	3,450.00	23,115,000	
キャノンマーケティング ジャパン	41,900	2,270.00	95,113,000	貸付有価証券 800株
西華産業	8,900	2,463.00	21,920,700	
佐藤商事	13,100	1,519.00	19,898,900	
菱洋エレクトロ	13,600	1,743.00	23,704,800	
東京産業	14,600	627.00	9,154,200	
ユアサ商事	13,900	3,655.00	50,804,500	
神鋼商事	3,300	3,030.00	9,999,000	
小林産業	9,700	346.00	3,356,200	貸付有価証券 400株
阪和興業	27,400	4,225.00	115,765,000	
正栄食品工業	8,100	3,940.00	31,914,000	貸付有価証券 3,800株（200株）
カナデン	14,000	1,446.00	20,244,000	
菱電商事	10,500	1,897.00	19,918,500	

フルサト工業	8,100	1,819.00	14,733,900	
岩谷産業	32,500	3,815.00	123,987,500	貸付有価証券 13,300株（11,300株）
すてきナイスグループ	6,200	1,338.00	8,295,600	
昭光通商	52,000	105.00	5,460,000	
ニチモウ	2,300	1,713.00	3,939,900	
極東貿易	21,000	439.00	9,219,000	
イワキ	20,600	445.00	9,167,000	貸付有価証券 1,300株
三愛石油	39,300	1,360.00	53,448,000	
稲畑産業	35,200	1,559.00	54,876,800	
G S I クレオス	3,900	1,532.00	5,974,800	貸付有価証券 1,800株
明和産業	13,500	509.00	6,871,500	貸付有価証券 100株（100株）
ワキタ	31,200	1,176.00	36,691,200	
東邦ホールディングス	43,400	2,710.00	117,614,000	貸付有価証券 20,200株（19,700株）
サンゲツ	48,800	2,267.00	110,629,600	
ミツウロコグループホールディングス	21,200	893.00	18,931,600	
シナネンホールディングス	6,000	2,793.00	16,758,000	
伊藤忠エネクス	32,400	1,053.00	34,117,200	
サンリオ	41,100	2,076.00	85,323,600	貸付有価証券 18,300株（7,500株）
サンワテクノス	9,500	1,586.00	15,067,000	
リョーサン	18,400	3,630.00	66,792,000	貸付有価証券 200株
新光商事	16,100	1,750.00	28,175,000	
トーヨー	6,600	2,602.00	17,173,200	
三信電気	13,500	1,910.00	25,785,000	貸付有価証券 2,300株
東陽テクニカ	16,900	902.00	15,243,800	
モスフードサービス	19,200	3,275.00	62,880,000	
加賀電子	13,300	2,614.00	34,766,200	
ソーダニッカ	15,100	731.00	11,038,100	
立花エレテック	9,900	2,134.00	21,126,600	
フォーバル	6,400	890.00	5,696,000	

PALTAC	20,500	6,350.00	130,175,000	
三谷産業	16,900	346.00	5,847,400	貸付有価証券 3,500株
太平洋興発	6,100	972.00	5,929,200	
西本Wismettac ホールディングス	4,000	5,640.00	22,560,000	貸付有価証券 100株
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,200	1,509.00	1,810,800	
ヤマタネ	7,300	2,277.00	16,622,100	
丸紅建材リース	14,000	242.00	3,388,000	
日鉄住金物産	11,400	5,540.00	63,156,000	
泉州電業	4,900	3,430.00	16,807,000	
トラスコ中山	30,500	2,824.00	86,132,000	
オートバックスセブン	58,200	1,974.00	114,886,800	貸付有価証券 2,400株
モリト	11,700	1,021.00	11,945,700	
加藤産業	22,900	3,890.00	89,081,000	
イノテック	12,600	1,430.00	18,018,000	
イエローハット	13,800	3,260.00	44,988,000	
J Kホールディングス	14,700	887.00	13,038,900	
日伝	12,100	2,136.00	25,845,600	
北沢産業	12,100	266.00	3,218,600	貸付有価証券 900株
杉本商事	7,900	1,950.00	15,405,000	
因幡電機産業	19,400	4,560.00	88,464,000	
バイテックホールディン グス	6,600	2,252.00	14,863,200	貸付有価証券 1,500株
東テク	4,800	2,686.00	12,892,800	
ミスミグループ本社	170,200	3,255.00	554,001,000	
アルテック	12,500	315.00	3,937,500	
タキヒヨー	4,900	2,390.00	11,711,000	
蔵王産業	2,400	1,682.00	4,036,800	
スズケン	66,800	4,780.00	319,304,000	
ジェコス	10,100	1,114.00	11,251,400	
ルネサスイーストン	13,400	575.00	7,705,000	貸付有価証券 200株（200株）
ローソン	37,100	6,920.00	256,732,000	貸付有価証券 17,400株

サンエー	11,100	5,490.00	60,939,000	
カワチ薬品	11,400	2,290.00	26,106,000	
エービーシー・マート	26,700	6,400.00	170,880,000	
ハードオフコーポレーション	6,400	982.00	6,284,800	
アスクル	12,800	3,475.00	44,480,000	貸付有価証券 5,900株（700株）
ゲオホールディングス	26,800	1,503.00	40,280,400	貸付有価証券 12,500株（2,100株）
アダストリア	22,500	1,429.00	32,152,500	貸付有価証券 10,500株
ジーフット	8,800	758.00	6,670,400	貸付有価証券 4,100株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	1,900	792.00	1,504,800	
くらコーポレーション	8,600	7,340.00	63,124,000	
キャンドウ	7,000	1,794.00	12,558,000	貸付有価証券 100株（100株）
パルグループホールディングス	7,500	2,700.00	20,250,000	
エディオン	56,900	1,086.00	61,793,400	貸付有価証券 4,800株
サーラコーポレーション	25,200	710.00	17,892,000	
ワッツ	4,800	1,117.00	5,361,600	
ハローズ	5,500	2,689.00	14,789,500	貸付有価証券 2,100株
あみやき亭	3,200	4,780.00	15,296,000	
ひらまつ	20,200	514.00	10,382,800	貸付有価証券 9,400株（1,500株）
大黒天物産	3,500	5,190.00	18,165,000	
ハニーズホールディングス	14,200	968.00	13,745,600	貸付有価証券 4,400株
ファーマライズホールディングス	3,300	675.00	2,227,500	貸付有価証券 1,400株
アルペン	11,200	2,443.00	27,361,600	貸付有価証券 5,200株
ハブ	3,600	1,216.00	4,377,600	貸付有価証券 400株
クオール	16,200	2,165.00	35,073,000	
ジンズ	10,000	6,720.00	67,200,000	貸付有価証券 2,700株

ビックカメラ	78,000	1,709.00	133,302,000	
D C Mホールディングス	78,900	1,069.00	84,344,100	貸付有価証券 37,000株
M o n o t a R O	52,100	5,050.00	263,105,000	貸付有価証券 24,400株
東京一番フーズ	3,600	686.00	2,469,600	
D Dホールディングス	3,300	2,797.00	9,230,100	貸付有価証券 1,500株
きちり	3,900	1,155.00	4,504,500	
アークランドサービス ホールディングス	12,200	2,544.00	31,036,800	貸付有価証券 5,600株
J . フロント リテイリ ング	174,900	1,673.00	292,607,700	
ドトール・日レスホール ディングス	25,700	2,188.00	56,231,600	貸付有価証券 1,100株
マツモトキヨシホール ディングス	60,500	5,100.00	308,550,000	
ブロンコビリー	7,700	4,820.00	37,114,000	貸付有価証券 3,600株
スタートトゥデイ	143,900	4,345.00	625,245,500	
トレジャー・ファクト リー	4,300	741.00	3,186,300	貸付有価証券 1,900株
物語コーポレーション	4,200	11,120.00	46,704,000	貸付有価証券 1,900株
ココカラファイン	15,300	7,070.00	108,171,000	
三越伊勢丹ホールディ ングス	273,900	1,368.00	374,695,200	貸付有価証券 15,300株
H a m e e	3,700	1,577.00	5,834,900	貸付有価証券 1,700株
ウエルシアホールディ ングス	38,700	5,970.00	231,039,000	貸付有価証券 100株
クリエイティブSDホー ルディングス	21,600	3,265.00	70,524,000	
丸善C H I ホールディ ングス	17,100	380.00	6,498,000	貸付有価証券 7,900株
ミサワ	2,600	487.00	1,266,200	貸付有価証券 1,000株
ティーライフ	2,000	1,373.00	2,746,000	
エー・ピーカンパニー	2,700	703.00	1,898,100	貸付有価証券 800株
チムニー	4,500	2,931.00	13,189,500	

シュッピン	8,800	1,636.00	14,396,800	貸付有価証券 4,100株（400株）
ネクステージ	15,600	1,335.00	20,826,000	貸付有価証券 7,300株
ジョイフル本田	42,800	1,757.00	75,199,600	貸付有価証券 20,000株（2,000株）
鳥貴族	4,800	2,631.00	12,628,800	貸付有価証券 2,200株（500株）
キリン堂ホールディングス	5,200	2,735.00	14,222,000	
ホットランド	8,500	1,399.00	11,891,500	貸付有価証券 3,900株
すかいらーく	91,000	1,666.00	151,606,000	貸付有価証券 43,500株（500株）
綿半ホールディングス	5,500	3,285.00	18,067,500	貸付有価証券 1,100株
ヨシックス	2,400	3,395.00	8,148,000	
ユナイテッド・スーパー マーケット・ホール	48,600	1,414.00	68,720,400	貸付有価証券 5,400株
ブックオフコーポレー ション	8,300	805.00	6,681,500	
ゴルフダイジェスト・オ ンライン	5,900	1,171.00	6,908,900	貸付有価証券 2,700株
B E E N O S	3,400	1,631.00	5,545,400	
あさひ	10,900	1,430.00	15,587,000	
日本調剤	5,200	2,931.00	15,241,200	貸付有価証券 800株
コスモス薬品	7,400	23,130.00	171,162,000	
トーエル	7,100	979.00	6,950,900	貸付有価証券 500株（500株）
一六堂	3,100	409.00	1,267,900	貸付有価証券 100株（100株）
オンリー	2,500	938.00	2,345,000	
セブン＆アイ・ホール ディングス	614,000	4,820.00	2,959,480,000	貸付有価証券 36,900株
薬王堂	6,400	3,865.00	24,736,000	貸付有価証券 1,700株
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	39,400	1,643.00	64,734,200	
ツルハホールディングス	31,700	14,540.00	460,918,000	
サンマルクホールディン	10,500	2,811.00	29,515,500	

グス				
フェリシモ	3,700	1,388.00	5,135,600	
トリドールホールディングス	18,100	2,746.00	49,702,600	貸付有価証券 8,500株(2,900株)
T O K Y O B A S E	13,000	943.00	12,259,000	貸付有価証券 6,000株
ウイルプラスホールディングス	1,300	1,187.00	1,543,100	貸付有価証券 600株
サツドラホールディングス	2,400	2,310.00	5,544,000	貸付有価証券 300株
ダイユー・リックホールディングス	6,800	1,182.00	8,037,600	
バロックジャパンリミテッド	11,700	1,005.00	11,758,500	貸付有価証券 3,800株(600株)
クスリのアオキホールディングス	11,600	7,830.00	90,828,000	
力の源ホールディングス	3,200	1,510.00	4,832,000	貸付有価証券 1,500株(100株)
スシローグローバルホールディングス	16,100	6,790.00	109,319,000	
L I X I L ビバ	18,600	1,773.00	32,977,800	
メディカルシステムネットワーク	16,900	499.00	8,433,100	貸付有価証券 7,300株
総合メディカル	12,700	2,381.00	30,238,700	
はるやまホールディングス	6,900	1,037.00	7,155,300	
ノジマ	25,800	2,592.00	66,873,600	
カッパ・クリエイト	18,300	1,471.00	26,919,300	貸付有価証券 300株(300株)
ライトオン	12,300	1,016.00	12,496,800	貸付有価証券 4,800株
ジーンズメイト	4,500	735.00	3,307,500	
良品計画	19,400	39,650.00	769,210,000	
三城ホールディングス	18,100	503.00	9,104,300	
アドヴァン	14,900	957.00	14,259,300	
アルビス	4,700	3,395.00	15,956,500	
コナカ	18,700	519.00	9,705,300	
ハウス オブ ローゼ	1,800	1,764.00	3,175,200	貸付有価証券 100株
G - 7ホールディングス	4,300	3,130.00	13,459,000	

イオン北海道	14,700	805.00	11,833,500	貸付有価証券 500株
コジマ	21,600	556.00	12,009,600	貸付有価証券 300株
ヒマラヤ	4,600	1,187.00	5,460,200	貸付有価証券 300株（300株）
コーナン商事	20,800	2,637.00	54,849,600	
エコス	5,900	1,752.00	10,336,800	貸付有価証券 100株
ワタミ	17,300	1,489.00	25,759,700	貸付有価証券 8,100株（600株）
マルシェ	3,800	820.00	3,116,000	貸付有価証券 1,400株
ドンキホーテホールディングス	95,000	5,460.00	518,700,000	
西松屋チェーン	32,100	1,342.00	43,078,200	貸付有価証券 100株
ゼンショーホールディングス	76,000	2,894.00	219,944,000	貸付有価証券 700株
幸楽苑ホールディングス	9,300	1,744.00	16,219,200	貸付有価証券 2,600株
ハークスレイ	3,600	1,107.00	3,985,200	
サイゼリヤ	24,100	2,542.00	61,262,200	貸付有価証券 200株
V Tホールディングス	49,600	577.00	28,619,200	貸付有価証券 1,100株（1,100株）
魚力	4,100	1,488.00	6,100,800	貸付有価証券 100株
ポブラ	3,800	880.00	3,344,000	
フジ・コーポレーション	2,500	2,714.00	6,785,000	
ユナイテッドアローズ	18,100	4,170.00	75,477,000	
ハイデイ日高	19,200	2,777.00	53,318,400	
京都きもの友禅	9,300	638.00	5,933,400	貸付有価証券 4,300株
コロワイド	48,700	3,055.00	148,778,500	貸付有価証券 500株
ピーシーデポコーポレーション	21,900	562.00	12,307,800	貸付有価証券 3,000株
壱番屋	10,300	5,260.00	54,178,000	貸付有価証券 800株
トップカルチャー	5,300	418.00	2,215,400	貸付有価証券

				2,200株(2,200株)
P L A N T	3,400	1,312.00	4,460,800	貸付有価証券 600株
スギホールディングス	32,200	6,530.00	210,266,000	
ヴィア・ホールディングス	17,600	730.00	12,848,000	貸付有価証券 6,800株
スクロール	22,500	572.00	12,870,000	
ヨンドシーホールディングス	14,900	2,650.00	39,485,000	貸付有価証券 100株
ユニー・ファミリーマートホールディングス	46,800	12,320.00	576,576,000	貸付有価証券 15,700株(2,300株)
木曽路	17,900	2,842.00	50,871,800	
S R S ホールディングス	17,300	1,037.00	17,940,100	貸付有価証券 7,100株
千趣会	26,500	556.00	14,734,000	貸付有価証券 12,400株
タカキュー	11,300	215.00	2,429,500	貸付有価証券 400株
ケーヨー	27,100	571.00	15,474,100	貸付有価証券 9,400株(1,400株)
上新電機	17,300	3,710.00	64,183,000	
日本瓦斯	26,900	6,320.00	170,008,000	貸付有価証券 200株
ロイヤルホールディングス	26,000	3,050.00	79,300,000	貸付有価証券 12,200株
東天紅	1,100	1,765.00	1,941,500	
いなげや	16,300	1,873.00	30,529,900	
島忠	33,200	3,460.00	114,872,000	
チヨダ	17,300	2,527.00	43,717,100	
ライフコーポレーション	11,100	2,773.00	30,780,300	
リンガーハット	18,100	2,634.00	47,675,400	貸付有価証券 900株
さが美グループホールディングス	13,000	149.00	1,937,000	
M r M a x H D	18,300	705.00	12,901,500	
テンアライド	13,500	478.00	6,453,000	貸付有価証券 800株(700株)
A O K I ホールディングス	29,300	1,602.00	46,938,600	貸付有価証券 1,100株
オークワ	21,000	1,165.00	24,465,000	

コメリ	22,600	2,856.00	64,545,600	
青山商事	28,100	3,850.00	108,185,000	
しまむら	17,000	11,430.00	194,310,000	
はせがわ	7,700	497.00	3,826,900	貸付有価証券 400株(400株)
高島屋	230,000	914.00	210,220,000	貸付有価証券 3,000株(2,000株)
松屋	29,500	1,696.00	50,032,000	貸付有価証券 7,200株
エイチ・ツー・オー リテイリング	69,400	1,703.00	118,188,200	
近鉄百貨店	5,600	4,130.00	23,128,000	
パルコ	14,100	1,247.00	17,582,700	
丸井グループ	140,300	2,321.00	325,636,300	貸付有価証券 5,100株
アクシアル リテイリング	12,100	4,215.00	51,001,500	
井筒屋	8,000	348.00	2,784,000	
イオン	563,700	2,369.00	1,335,405,300	
イズミ	26,500	7,140.00	189,210,000	
東武ストア	1,800	3,110.00	5,598,000	
平和堂	29,700	2,635.00	78,259,500	
フジ	17,500	2,327.00	40,722,500	
ヤオコー	16,600	6,090.00	101,094,000	
ゼビオホールディングス	19,900	1,792.00	35,660,800	貸付有価証券 200株
ケーズホールディングス	128,500	1,172.00	150,602,000	
Olympicグループ	8,600	789.00	6,785,400	貸付有価証券 4,000株(4,000株)
日産東京販売ホールディングス	21,500	361.00	7,761,500	
Genky Drugs Stores	5,700	4,520.00	25,764,000	貸付有価証券 2,400株
アインホールディングス	19,600	8,420.00	165,032,000	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
元気寿司	3,700	3,555.00	13,153,500	
ヤマダ電機	490,900	538.00	264,104,200	貸付有価証券 234,400株(17,000 株)
アークランドサカモト	24,800	1,699.00	42,135,200	

ニトリホールディングス	58,100	19,345.00	1,123,944,500	
グルメ杵屋	10,000	1,239.00	12,390,000	
愛眼	11,700	458.00	5,358,600	貸付有価証券 1,900株
ケーユーホールディングス	7,600	968.00	7,356,800	
吉野家ホールディングス	48,100	2,229.00	107,214,900	貸付有価証券 100株
松屋フーズ	7,000	3,770.00	26,390,000	
サガミチェーン	19,600	1,423.00	27,890,800	
関西スーパーマーケット	11,100	1,238.00	13,741,800	貸付有価証券 1,500株（1,300株）
王将フードサービス	10,800	6,330.00	68,364,000	
プレナス	16,400	1,849.00	30,323,600	貸付有価証券 6,800株（100株）
ミニストップ	10,900	2,225.00	24,252,500	
アークス	27,500	2,990.00	82,225,000	
バローホールディングス	34,000	2,500.00	85,000,000	貸付有価証券 300株
藤久	1,200	1,513.00	1,815,600	貸付有価証券 500株
ベルク	6,500	5,960.00	38,740,000	
大庄	7,800	1,788.00	13,946,400	貸付有価証券 3,500株
ファーストリテイリング	19,600	52,140.00	1,021,944,000	貸付有価証券 1,100株
サンドラッグ	62,000	4,580.00	283,960,000	
サックスパーホールディングス	13,800	950.00	13,110,000	貸付有価証券 2,200株
ヤマザワ	3,000	1,878.00	5,634,000	
やまや	3,000	3,405.00	10,215,000	貸付有価証券 900株
ベルーナ	35,900	1,415.00	50,798,500	
島根銀行	3,100	1,236.00	3,831,600	
じもとホールディングス	99,100	171.00	16,946,100	
めぶきフィナンシャルグループ	762,200	366.00	278,965,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	19,800	2,477.00	49,044,600	
九州フィナンシャルグループ	240,700	522.00	125,645,400	貸付有価証券

ループ				13,000株
ゆうちょ銀行	415,600	1,282.00	532,799,200	貸付有価証券 35,700株
富山第一銀行	37,300	482.00	17,978,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	875,900	571.00	500,138,900	
西日本フィナンシャルホールディングス	94,000	1,205.00	113,270,000	
関西みらいフィナンシャルグループ	64,200	804.00	51,616,800	
三十三フィナンシャルグループ	12,300	2,107.00	25,916,100	
新生銀行	127,000	1,694.00	215,138,000	貸付有価証券 58,400株
あおぞら銀行	87,400	4,295.00	375,383,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	10,269,300	625.30	6,421,393,290	貸付有価証券 1,146,000株
りそなホールディングス	1,609,700	582.90	938,294,130	
三井住友トラスト・ホールディングス	288,400	4,391.00	1,266,364,400	
三井住友フィナンシャルグループ	1,110,300	4,278.00	4,749,863,400	
第四銀行	18,000	4,425.00	79,650,000	
北越銀行	14,700	2,271.00	33,383,700	
千葉銀行	519,500	777.00	403,651,500	貸付有価証券 700株
群馬銀行	297,900	595.00	177,250,500	
武蔵野銀行	23,400	3,355.00	78,507,000	
千葉興業銀行	40,200	482.00	19,376,400	
筑波銀行	61,000	269.00	16,409,000	
七十七銀行	46,000	2,461.00	113,206,000	
青森銀行	11,400	3,270.00	37,278,000	貸付有価証券 5,200株(500株)
秋田銀行	9,400	3,180.00	29,892,000	
山形銀行	16,500	2,363.00	38,989,500	貸付有価証券 7,000株(2,100株)
岩手銀行	10,200	4,205.00	42,891,000	
東邦銀行	131,200	408.00	53,529,600	貸付有価証券 300株
東北銀行	7,500	1,372.00	10,290,000	

みちのく銀行	9,400	1,777.00	16,703,800	貸付有価証券 1,800株(1,800株)
ふくおかフィナンシャル グループ	595,000	549.00	326,655,000	
静岡銀行	387,300	1,017.00	393,884,100	
十六銀行	19,700	2,954.00	58,193,800	貸付有価証券 200株
スルガ銀行	150,100	954.00	143,195,400	貸付有価証券 100株
八十二銀行	265,500	488.00	129,564,000	
山梨中央銀行	91,000	423.00	38,493,000	
大垣共立銀行	23,200	2,821.00	65,447,200	
福井銀行	12,500	2,479.00	30,987,500	貸付有価証券 500株
北國銀行	16,600	4,545.00	75,447,000	
清水銀行	5,900	2,141.00	12,631,900	貸付有価証券 2,600株
富山銀行	2,800	4,345.00	12,166,000	
滋賀銀行	138,000	567.00	78,246,000	貸付有価証券 1,000株
南都銀行	17,200	2,909.00	50,034,800	
百五銀行	140,800	442.00	62,233,600	
京都銀行	56,000	5,150.00	288,400,000	
紀陽銀行	55,200	1,822.00	100,574,400	
ほくほくフィナンシャル グループ	97,600	1,499.00	146,302,400	
広島銀行	216,500	746.00	161,509,000	
山陰合同銀行	87,000	1,002.00	87,174,000	
中国銀行	101,400	1,175.00	119,145,000	
鳥取銀行	4,700	1,710.00	8,037,000	
伊予銀行	209,300	744.00	155,719,200	貸付有価証券 5,100株
百十四銀行	156,000	366.00	57,096,000	
四国銀行	22,500	1,362.00	30,645,000	
阿波銀行	118,000	693.00	81,774,000	貸付有価証券 3,000株
大分銀行	8,400	3,765.00	31,626,000	貸付有価証券 3,400株
宮崎銀行	9,800	3,530.00	34,594,000	

佐賀銀行	8,900	2,575.00	22,917,500	
十八銀行	90,000	288.00	25,920,000	
沖縄銀行	14,300	4,125.00	58,987,500	
琉球銀行	28,400	1,672.00	47,484,800	
セブン銀行	550,200	343.00	188,718,600	貸付有価証券 164,500株
みずほフィナンシャルグループ	19,930,100	186.10	3,708,991,610	
高知銀行	5,300	1,202.00	6,370,600	
山口フィナンシャルグループ	183,000	1,265.00	231,495,000	貸付有価証券 63,000株（4,000株）
長野銀行	4,800	1,837.00	8,817,600	貸付有価証券 2,000株（200株）
名古屋銀行	11,900	3,895.00	46,350,500	貸付有価証券 1,900株（900株）
北洋銀行	221,100	363.00	80,259,300	貸付有価証券 2,000株
愛知銀行	4,900	4,905.00	24,034,500	
中京銀行	6,000	2,351.00	14,106,000	
大光銀行	5,000	2,199.00	10,995,000	
愛媛銀行	20,500	1,322.00	27,101,000	貸付有価証券 5,800株（600株）
トマト銀行	5,700	1,520.00	8,664,000	
京葉銀行	130,000	476.00	61,880,000	貸付有価証券 3,000株
栃木銀行	75,900	399.00	30,284,100	
北日本銀行	4,600	2,628.00	12,088,800	
東和銀行	25,800	1,145.00	29,541,000	
福島銀行	13,800	716.00	9,880,800	
大東銀行	7,000	1,245.00	8,715,000	
トモニホールディングス	121,000	466.00	56,386,000	貸付有価証券 3,700株
フィデアホールディングス	142,400	174.00	24,777,600	
池田泉州ホールディングス	155,700	376.00	58,543,200	
F P G	46,900	1,501.00	70,396,900	貸付有価証券 200株
マーキュリアインベストメント	4,000	1,071.00	4,284,000	貸付有価証券 1,700株

S B I ホールディングス	165,900	2,948.00	489,073,200	貸付有価証券 70,800株（32,300株）
日本アジア投資	13,200	353.00	4,659,600	貸付有価証券 2,600株（100株）
ジャフコ	21,000	4,640.00	97,440,000	
大和証券グループ本社	1,255,500	619.80	778,158,900	
野村ホールディングス	2,523,600	538.40	1,358,706,240	
岡三証券グループ	125,000	538.00	67,250,000	貸付有価証券 4,000株
丸三証券	46,700	1,036.00	48,381,200	貸付有価証券 4,000株
東洋証券	52,000	261.00	13,572,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	162,400	715.00	116,116,000	
光世証券	3,500	1,305.00	4,567,500	貸付有価証券 1,500株
水戸証券	42,400	414.00	17,553,600	貸付有価証券 100株
いちよし証券	30,800	1,229.00	37,853,200	
松井証券	71,800	1,045.00	75,031,000	貸付有価証券 400株
だいこう証券ビジネス	7,100	596.00	4,231,600	
マネックスグループ	149,400	645.00	96,363,000	貸付有価証券 70,200株（31,800株）
カブドットコム証券	93,800	365.00	34,237,000	
極東証券	19,700	1,438.00	28,328,600	貸付有価証券 600株
岩井コスモホールディングス	15,000	1,421.00	21,315,000	
藍澤證券	27,400	793.00	21,728,200	
マネーパートナーズグループ	18,700	405.00	7,573,500	貸付有価証券 8,400株
小林洋行	4,200	293.00	1,230,600	貸付有価証券 300株
かんぽ生命保険	55,400	2,326.00	128,860,400	貸付有価証券 16,100株
S O M P Oホールディングス	287,700	4,564.00	1,313,062,800	
アニコムホールディングス	10,000	4,405.00	44,050,000	貸付有価証券 3,600株
M S & A D インシュアラ	383,500	3,423.00	1,312,720,500	

ンスグループホール				
ソニーフィナンシャル ホールディングス	120,500	2,146.00	258,593,000	貸付有価証券 900株
第一生命ホールディング ス	829,800	1,946.00	1,614,790,800	
東京海上ホールディング ス	552,600	5,332.00	2,946,463,200	
アドバンテッジリスクマ ネジメント	4,800	1,251.00	6,004,800	貸付有価証券 2,200株
T & Dホールディングス	453,700	1,677.00	760,854,900	貸付有価証券 2,100株
アドバンスクリエイト	3,400	2,287.00	7,775,800	貸付有価証券 100株
全国保証	41,300	5,150.00	212,695,000	貸付有価証券 300株
ジェイリース	2,700	805.00	2,173,500	
イントラスト	3,100	802.00	2,486,200	貸付有価証券 1,400株
アルヒ	16,700	2,326.00	38,844,200	貸付有価証券 1,200株（1,200株）
クレディセゾン	111,300	1,709.00	190,211,700	
アクリーティブ	8,000	288.00	2,304,000	貸付有価証券 200株（200株）
芙蓉総合リース	16,800	7,620.00	128,016,000	
興銀リース	27,600	2,881.00	79,515,600	
東京センチュリー	29,500	6,370.00	187,915,000	貸付有価証券 1,400株
日本証券金融	60,000	617.00	37,020,000	
アイフル	246,100	346.00	85,150,600	貸付有価証券 106,800株
リコーリース	11,500	3,610.00	41,515,000	貸付有価証券 2,400株
イオンフィナンシャル サービス	104,100	2,358.00	245,467,800	
アコム	294,800	434.00	127,943,200	貸付有価証券 7,100株
ジャックス	17,800	2,354.00	41,901,200	
オリエントコーポレー ション	317,400	150.00	47,610,000	貸付有価証券 149,100株（100株）
日立キャピタル	40,300	2,889.00	116,426,700	貸付有価証券 2,400株

アプラスフィナンシャル	70,400	112.00	7,884,800	貸付有価証券 32,700株
オリックス	978,500	1,788.50	1,750,047,250	貸付有価証券 7,100株
三菱UFJリース	372,300	694.00	258,376,200	
九州リースサービス	6,300	770.00	4,851,000	
日本取引所グループ	421,000	2,130.00	896,730,000	貸付有価証券 1,000株
イー・ギャランティ	7,800	2,163.00	16,871,400	
アサックス	2,000	1,910.00	3,820,000	
NECキャピタルソ リューション	6,000	1,949.00	11,694,000	
いちご	209,700	530.00	111,141,000	貸付有価証券 1,300株
日本駐車場開発	177,000	186.00	32,922,000	
ヒューリック	306,200	1,185.00	362,847,000	
三栄建築設計	5,900	1,870.00	11,033,000	貸付有価証券 300株
スター・マイカ	7,100	2,571.00	18,254,100	貸付有価証券 200株
野村不動産ホールディン グス	97,600	2,502.00	244,195,200	
三重交通グループホール ディングス	29,700	525.00	15,592,500	貸付有価証券 1,700株（500株）
サムティ	12,500	2,144.00	26,800,000	貸付有価証券 1,500株（1,400株）
ディア・ライフ	16,400	514.00	8,429,600	貸付有価証券 400株
コーセーアールイー	3,300	834.00	2,752,200	貸付有価証券 500株
エー・ディー・ワークス	194,500	40.00	7,780,000	貸付有価証券 91,400株
日本商業開発	8,200	1,854.00	15,202,800	貸付有価証券 1,300株
プレサンスコーポレー ション	20,200	1,766.00	35,673,200	
ユニゾホールディングス	20,100	2,139.00	42,993,900	貸付有価証券 700株
THEグローバル社	6,900	864.00	5,961,600	貸付有価証券 3,200株
日本管理センター	9,700	1,321.00	12,813,700	貸付有価証券

				1,300株
サンセイランディック	4,300	1,187.00	5,104,100	貸付有価証券 2,000株
エストラスト	2,000	922.00	1,844,000	貸付有価証券 100株
フージャースホールディングス	35,600	809.00	28,800,400	貸付有価証券 1,700株
オープンハウス	23,900	6,520.00	155,828,000	
東急不動産ホールディングス	355,100	789.00	280,173,900	貸付有価証券 600株
飯田グループホールディングス	122,400	2,122.00	259,732,800	貸付有価証券 3,200株
イーグランド	2,400	1,196.00	2,870,400	貸付有価証券 100株
ムゲンエステート	9,000	1,110.00	9,990,000	貸付有価証券 4,200株
ビーロット	2,200	1,661.00	3,654,200	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
ファーストブラザーズ	4,000	1,431.00	5,724,000	
ハウスドゥ	2,600	5,270.00	13,702,000	貸付有価証券 1,200株(100株)
シーアールイー	2,400	2,128.00	5,107,200	
ケイアイスター不動産	5,300	2,603.00	13,795,900	貸付有価証券 100株
グッドコムアセット	1,700	1,869.00	3,177,300	
パーク24	85,600	3,025.00	258,940,000	
パラカ	3,800	2,553.00	9,701,400	
三井不動産	732,500	2,730.00	1,999,725,000	
三菱地所	1,091,800	1,980.50	2,162,309,900	
平和不動産	25,900	2,197.00	56,902,300	
東京建物	160,300	1,536.00	246,220,800	貸付有価証券 500株
ダイビル	37,800	1,153.00	43,583,400	
京阪神ビルディング	24,300	954.00	23,182,200	
住友不動産	352,000	4,192.00	1,475,584,000	
大京	23,400	2,524.00	59,061,600	
テーオーシー	50,600	835.00	42,251,000	
東京楽天地	2,400	5,830.00	13,992,000	貸付有価証券 1,100株
レオパレス21	175,000	630.00	110,250,000	貸付有価証券

				1,800株
スターツコーポレーション	19,900	2,652.00	52,774,800	
フジ住宅	18,700	959.00	17,933,300	
空港施設	14,700	615.00	9,040,500	
明和地所	8,000	661.00	5,288,000	
ゴールドクレスト	11,600	1,760.00	20,416,000	
日本エスリード	5,700	1,942.00	11,069,400	
日神不動産	19,500	725.00	14,137,500	
日本エスコン	26,500	655.00	17,357,500	貸付有価証券 700株
タカラレーベン	68,700	407.00	27,960,900	貸付有価証券 3,100株(700株)
サンヨーハウジング名古屋	8,200	1,207.00	9,897,400	
イオンモール	94,500	2,021.00	190,984,500	
ファースト住建	5,500	1,453.00	7,991,500	
カチタス	20,000	4,475.00	89,500,000	貸付有価証券 800株
トーセイ	17,900	1,273.00	22,786,700	
穴吹興産	1,600	3,415.00	5,464,000	貸付有価証券 700株
エヌ・ティ・ティ都市開発	91,200	1,204.00	109,804,800	貸付有価証券 2,500株
サンフロンティア不動産	17,700	1,304.00	23,080,800	貸付有価証券 200株(200株)
エフ・ジェー・ネクスト	11,200	1,098.00	12,297,600	
インテリックス	4,100	978.00	4,009,800	
ランドビジネス	7,400	334.00	2,471,600	
グランディハウス	12,800	514.00	6,579,200	
日本空港ビルデング	42,900	5,470.00	234,663,000	
日本工営	9,500	2,937.00	27,901,500	貸付有価証券 400株
L I F U L L	49,400	710.00	35,074,000	貸付有価証券 22,700株
ジェイエイシーリクルートメント	11,400	2,342.00	26,698,800	貸付有価証券 3,400株
日本M&Aセンター	98,400	3,470.00	341,448,000	
メンバーズ	4,700	1,450.00	6,815,000	貸付有価証券 100株

中広	1,500	798.00	1,197,000	
タケエイ	14,700	1,254.00	18,433,800	貸付有価証券 700株
トラスト・テック	6,700	3,945.00	26,431,500	貸付有価証券 200株
コシダカホールディングス	38,000	1,709.00	64,942,000	
パソナグループ	13,500	1,776.00	23,976,000	貸付有価証券 6,200株（1,600株）
C D S	3,800	1,354.00	5,145,200	貸付有価証券 200株
リンクアンドモチベーション	26,100	1,430.00	37,323,000	貸付有価証券 6,400株（200株）
G C A	16,100	895.00	14,409,500	貸付有価証券 1,800株
エス・エム・エス	28,100	4,295.00	120,689,500	貸付有価証券 6,800株（1,000株）
パーソルホールディングス	131,100	2,529.00	331,551,900	
リニカル	9,100	2,386.00	21,712,600	貸付有価証券 1,200株
クックパッド	44,600	547.00	24,396,200	貸付有価証券 19,700株（1,000株）
エスクリ	5,000	818.00	4,090,000	
アイ・ケイ・ケイ	8,300	840.00	6,972,000	
学情	6,500	1,755.00	11,407,500	貸付有価証券 2,100株
スタジオアリス	7,100	2,676.00	18,999,600	
シミックホールディングス	7,900	2,368.00	18,707,200	貸付有価証券 400株
N J S	3,500	1,790.00	6,265,000	
総合警備保障	56,500	5,230.00	295,495,000	貸付有価証券 100株
カカコム	107,000	2,505.00	268,035,000	貸付有価証券 26,000株
セントケア・ホールディング	6,000	723.00	4,338,000	貸付有価証券 2,400株
サイネックス	2,100	843.00	1,770,300	貸付有価証券 100株
ルネサンス	6,900	2,592.00	17,884,800	
ディップ	20,000	2,929.00	58,580,000	貸付有価証券

				1,200株
オプトホールディング	9,900	2,253.00	22,304,700	貸付有価証券 4,200株
新日本科学	17,300	504.00	8,719,200	貸付有価証券 5,900株
ツクイ	33,500	959.00	32,126,500	
キャリアデザインセン ター	3,600	2,047.00	7,369,200	
エムスリー	149,600	4,610.00	689,656,000	貸付有価証券 10,000株
ツカダ・グローバルホー ルディング	11,300	644.00	7,277,200	貸付有価証券 5,300株
プラス	1,100	844.00	928,400	
アウトソーシング	42,400	2,128.00	90,227,200	
ウェルネット	14,300	1,203.00	17,202,900	貸付有価証券 2,200株（1,500株）
ワールドホールディング ス	4,700	3,495.00	16,426,500	
ディー・エヌ・エー	76,600	2,088.00	159,940,800	
博報堂D Yホールディン グス	197,500	1,778.00	351,155,000	
ぐるなび	22,500	914.00	20,565,000	貸付有価証券 10,500株
エスアールジータカミヤ	16,800	723.00	12,146,400	貸付有価証券 700株（500株）
ジャパンベストレス キューシステム	11,200	951.00	10,651,200	貸付有価証券 200株
ファンコミュニケーション ズ	39,500	721.00	28,479,500	貸付有価証券 400株
ライク	5,600	1,857.00	10,399,200	貸付有価証券 2,600株
ビジネス・ブレイクス ルー	6,600	450.00	2,970,000	貸付有価証券 500株
W D Bホールディングス	6,500	3,280.00	21,320,000	貸付有価証券 200株
ティア	6,500	1,090.00	7,085,000	
C D G	1,300	1,698.00	2,207,400	貸付有価証券 600株
バリューコマース	12,700	1,527.00	19,392,900	貸付有価証券 1,300株
インフォマート	71,900	1,452.00	104,398,800	貸付有価証券

				32,100株(1,000株)
J Pホールディングス	44,600	388.00	17,304,800	貸付有価証券 700株
E P Sホールディングス	21,400	2,449.00	52,408,600	
レグス	3,500	1,050.00	3,675,000	
プレステージ・インター ナショナル	29,500	1,532.00	45,194,000	貸付有価証券 1,900株
アミューズ	9,500	3,120.00	29,640,000	貸付有価証券 100株
ドリームインキュベータ	4,800	2,241.00	10,756,800	
クイック	8,800	1,758.00	15,470,400	
T A C	8,500	339.00	2,881,500	貸付有価証券 3,700株(3,700株)
ケネディクス	188,200	680.00	127,976,000	
電通	173,100	5,280.00	913,968,000	
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	6,600	1,813.00	11,965,800	
ぴあ	4,700	6,570.00	30,879,000	貸付有価証券 1,000株
イオンファンタジー	4,600	6,630.00	30,498,000	
シーティーエス	14,000	1,228.00	17,192,000	貸付有価証券 600株
ネクシィーズグループ	4,300	1,672.00	7,189,600	貸付有価証券 400株
みらかホールディングス	42,400	3,245.00	137,588,000	
アルプス技研	12,500	2,458.00	30,725,000	
ダイオーズ	2,800	1,336.00	3,740,800	
日本空調サービス	14,900	808.00	12,039,200	
オリエンタルランド	167,900	11,830.00	1,986,257,000	貸付有価証券 2,600株
ダスキン	38,200	2,784.00	106,348,800	
明光ネットワークジャ パン	18,000	1,213.00	21,834,000	
ファルコホールディン グス	7,300	1,921.00	14,023,300	
秀英予備校	3,100	490.00	1,519,000	貸付有価証券 200株
田谷	2,600	693.00	1,801,800	
ラウンドワン	44,100	1,801.00	79,424,100	貸付有価証券 5,600株

リゾートトラスト	60,100	1,986.00	119,358,600	
ビー・エム・エル	18,300	2,900.00	53,070,000	
ワタベウェディング	2,300	512.00	1,177,600	
りらいあコミュニケーションズ	22,500	1,616.00	36,360,000	
リソー教育	24,000	815.00	19,560,000	貸付有価証券 7,700株
早稲田アカデミー	2,000	2,474.00	4,948,000	
ユー・エス・エス	173,600	2,109.00	366,122,400	
東京個別指導学院	5,000	948.00	4,740,000	
サイバーエージェント	87,600	6,680.00	585,168,000	貸付有価証券 7,100株
楽天	728,700	704.40	513,296,280	貸付有価証券 1,100株
クリーク・アンド・リバー社	7,300	1,144.00	8,351,200	貸付有価証券 2,500株
テー・オー・ダブリュー	13,600	854.00	11,614,400	
セントラルスポーツ	5,300	4,220.00	22,366,000	
フルキャストホールディングス	12,400	2,818.00	34,943,200	
リソルホールディングス	1,500	4,395.00	6,592,500	
テクノプロ・ホールディングス	26,800	6,910.00	185,188,000	貸付有価証券 600株
アトラ	2,400	698.00	1,675,200	
インターワークス	3,200	1,015.00	3,248,000	
K e e P e r 技研	4,600	1,335.00	6,141,000	貸付有価証券 2,100株
ファーストロジック	2,700	708.00	1,911,600	貸付有価証券 1,200株（600株）
三機サービス	2,100	1,854.00	3,893,400	貸付有価証券 400株
G u n o s y	8,500	1,454.00	12,359,000	貸付有価証券 3,900株（1,000株）
デザインワン・ジャパン	2,800	1,289.00	3,609,200	貸付有価証券 1,100株
イー・ガーディアン	6,700	3,215.00	21,540,500	貸付有価証券 3,100株（2,300株）
リブセンス	9,100	583.00	5,305,300	貸付有価証券 4,200株（2,300株）
ジャパンマテリアル	38,800	1,845.00	71,586,000	貸付有価証券

				10,800株
ベクトル	17,100	2,342.00	40,048,200	貸付有価証券 1,000株
ウチヤマホールディングス	7,000	555.00	3,885,000	
ライクキッズネクスト	2,900	1,458.00	4,228,200	貸付有価証券 600株
キャリアリンク	4,600	546.00	2,511,600	貸付有価証券 1,500株
I B J	11,400	682.00	7,774,800	貸付有価証券 5,300株(700株)
アサンテ	5,100	2,137.00	10,898,700	
N・フィールド	7,900	1,721.00	13,595,900	貸付有価証券 3,100株
バリューHR	3,200	2,075.00	6,640,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	3,600	10,620.00	38,232,000	貸付有価証券 800株
ライドオンエクスプレスホールディングス	5,800	2,050.00	11,890,000	貸付有価証券 1,400株
E R Iホールディングス	4,000	1,096.00	4,384,000	貸付有価証券 900株
アビスト	2,200	4,945.00	10,879,000	
シグマクシス	7,500	1,284.00	9,630,000	貸付有価証券 2,800株(2,800株)
ウィルグループ	6,100	1,072.00	6,539,200	貸付有価証券 1,400株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	19,500	452.00	8,814,000	貸付有価証券 9,100株(100株)
日本ビューホテル	4,500	1,410.00	6,345,000	貸付有価証券 500株
リクルートホールディングス	1,096,300	3,187.00	3,493,908,100	貸付有価証券 32,200株
エラン	3,500	2,707.00	9,474,500	貸付有価証券 1,500株(1,200株)
土木管理総合試験所	4,600	560.00	2,576,000	貸付有価証券 200株
日本郵政	806,400	1,206.00	972,518,400	
ベルシステム24ホールディングス	23,800	1,884.00	44,839,200	
鎌倉新書	2,600	3,555.00	9,243,000	貸付有価証券 1,200株(100株)
一蔵	1,800	803.00	1,445,400	

LITALICO	3,200	2,045.00	6,544,000	貸付有価証券 1,500株（400株）
グローバルグループ	1,700	1,913.00	3,252,100	貸付有価証券 600株
エポラブルアジア	4,000	2,555.00	10,220,000	貸付有価証券 1,800株（600株）
ストライク	3,600	4,715.00	16,974,000	貸付有価証券 1,600株（800株）
ソラスト	8,600	3,820.00	32,852,000	貸付有価証券 300株
セラク	3,200	933.00	2,985,600	貸付有価証券 1,500株
インソース	4,700	2,400.00	11,280,000	貸付有価証券 400株
キャリアインデックス	1,900	3,270.00	6,213,000	
MS - Japan	1,400	7,580.00	10,612,000	
船場	2,700	1,180.00	3,186,000	
フルテック	1,500	1,169.00	1,753,500	貸付有価証券 600株
グリーンズ	3,100	1,602.00	4,966,200	貸付有価証券 200株
日総工産	2,300	5,980.00	13,754,000	
キュービーネットホールディングス	7,100	2,040.00	14,484,000	貸付有価証券 3,300株
リログループ	77,700	2,993.00	232,556,100	貸付有価証券 2,800株
東祥	8,800	4,255.00	37,444,000	貸付有価証券 1,200株
エイチ・アイ・エス	22,100	3,280.00	72,488,000	
ラックランド	2,700	2,706.00	7,306,200	貸付有価証券 1,200株
共立メンテナンス	25,300	6,100.00	154,330,000	貸付有価証券 3,700株（400株）
イチネンホールディングス	15,900	1,421.00	22,593,900	
建設技術研究所	9,800	1,544.00	15,131,200	
スペース	9,200	1,441.00	13,257,200	
長大	5,700	892.00	5,084,400	貸付有価証券 1,800株（200株）
燦ホールディングス	3,400	2,547.00	8,659,800	
スバル興業	1,000	6,450.00	6,450,000	

東京テアトル	5,900	1,446.00	8,531,400	
タナベ経営	2,700	2,107.00	5,688,900	
ナガワ	2,800	4,785.00	13,398,000	
よみうりランド	3,100	4,760.00	14,756,000	
東京都競馬	10,600	4,845.00	51,357,000	
常磐興産	5,700	1,872.00	10,670,400	貸付有価証券 2,000株
カナモト	21,700	3,605.00	78,228,500	
東京ドーム	57,500	975.00	56,062,500	
西尾レントオール	14,400	3,625.00	52,200,000	
トランス・コスモス	15,800	2,644.00	41,775,200	貸付有価証券 400株
乃村工藝社	33,200	2,484.00	82,468,800	貸付有価証券 200株
藤田観光	5,600	3,470.00	19,432,000	貸付有価証券 2,600株
KNT-CTホールディングス	8,800	1,594.00	14,027,200	
日本管財	15,200	2,248.00	34,169,600	
トーカイ	13,700	2,480.00	33,976,000	
白洋舎	1,600	3,435.00	5,496,000	貸付有価証券 700株
セコム	150,800	8,365.00	1,261,442,000	貸付有価証券 100株
セントラル警備保障	6,800	5,300.00	36,040,000	
丹青社	29,100	1,484.00	43,184,400	
メイテック	16,600	5,040.00	83,664,000	
応用地質	15,300	1,466.00	22,429,800	
船井総研ホールディングス	29,500	2,575.00	75,962,500	貸付有価証券 600株
進学会ホールディングス	6,500	624.00	4,056,000	
オオバ	11,200	631.00	7,067,200	貸付有価証券 1,200株
いであ	2,900	1,134.00	3,288,600	
学究社	5,100	1,856.00	9,465,600	貸付有価証券 100株
ベネッセホールディングス	52,000	4,040.00	210,080,000	貸付有価証券 3,600株
イオンディライト	17,500	3,810.00	66,675,000	

	ナック	9,500	941.00	8,939,500	
	ニチイ学館	27,000	1,322.00	35,694,000	貸付有価証券 800株
	ダイセキ	23,800	3,245.00	77,231,000	
	ステップ	5,200	1,705.00	8,866,000	
小計	銘柄数：2,074			370,964,908,710	
	組入時価比率：98.2%			100.0%	
合計				370,964,908,710	

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

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

(2) 株式以外の有価証券(2018年6月22日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2018年 6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	6,829,312,500	-	6,741,540,000	87,960,582
合計	6,829,312,500	-	6,741,540,000	87,960,582

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2018年 6月22日現在)

資産の部

流動資産	
預金	2,502,681,552
コール・ローン	772,070,046
株式	474,492,959,163
投資証券	11,638,024,148
派生商品評価勘定	4,974,843
未収入金	189,242,652
未収配当金	740,465,373
差入委託証拠金	1,858,682,646
流動資産合計	492,199,100,423
資産合計	
	492,199,100,423
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	77,437,073
未払金	114,809,411
未払解約金	206,969,503
未払利息	1,768
その他未払費用	2,181,500
流動負債合計	401,399,255
負債合計	401,399,255
純資産の部	
元本等	
元本	186,502,565,565
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	305,295,135,603
元本等合計	491,797,701,168
純資産合計	491,797,701,168
負債純資産合計	492,199,100,423

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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)

2018年 6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	2.6369円
(10,000口当たり純資産額)	(26,369円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2017年 8月31日 至 2018年 6月22日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <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

2018年 6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

2018年 6月22日現在

	2017年 8月31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	170,340,594,263円
同期中における追加設定元本額	35,401,005,212円
同期中における一部解約元本額	19,239,033,910円
期末元本額	186,502,565,565円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	52,048,072円
バランスセレクト50	160,220,968円
バランスセレクト70	167,438,328円
野村外国株式インデックスファンド	542,481,914円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	2,735,105,443円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	6,684,626,076円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	4,494,643,416円
野村資産設計ファンド2015	20,821,967円
野村資産設計ファンド2020	25,003,520円
野村資産設計ファンド2025	36,497,337円
野村資産設計ファンド2030	38,739,981円
野村資産設計ファンド2035	29,417,585円
野村資産設計ファンド2040	73,711,293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）	32,546,490,648円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	1,015,201,477円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	6,165,137,185円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	4,425,661,949円
野村資産設計ファンド2045	9,668,396円
野村インデックスファンド・外国株式	3,681,836,805円
マイ・ロード	1,433,270,668円
ネクストコア	71,672,291円

野村インデックスファンド・海外5資産バランス	94,482,011円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	944,538,038円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	900,771,210円
野村資産設計ファンド2050	14,882,477円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,985,472円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	1,587,975円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,096,440円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	712,344円
のむラップ・ファンド(やや保守型)	166,789,865円
のむラップ・ファンド(やや積極型)	241,172,490円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,809,518円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,878,116円
インデックス・ブレンド(タイプ)	11,649,181円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,644,697円
インデックス・ブレンド(タイプ)	20,590,946円
野村6資産均等バランス	63,191,238円
野村つみたて外国株投信	776,170,382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)	2,484,186,144円
世界6資産分散ファンド	24,414,306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	214,039,098円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	336,838,431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)	325,220,583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)	296,813,985円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	2,088,819,141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)	2,632,114,535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)	2,498,847円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	12,629,254円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	3,831,504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)	16,004,583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)	169,586,122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)	361,800,799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)	145,241,754円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	49,385,669円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	189,984,369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)	3,594,337,812円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	428,709,051円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	74,891,142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)	615,066,386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)	8,938,844,756円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,319,442円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	12,968,219円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	15,031,678円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	60,928,627,476円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,349,334,577円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,626,567,558円

マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,400,923,455円
マイバランスDC30	886,117,833円
マイバランスDC50	1,619,066,625円
マイバランスDC70	1,327,097,082円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	16,968,513,008円
野村DC運用戦略ファンド	480,407,584円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	14,522,071円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	140,037,279円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	17,187,186円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	29,261,729円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	1,347,230円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,172,869円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	3,290,389円
野村資産設計ファンド(DC)2030	172,343円
野村資産設計ファンド(DC)2040	253,605円
野村資産設計ファンド(DC)2050	561,711円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	3,348,123円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	1,962,941円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	319,627円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	7,247,935円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES, A GE CO, LLC	51,500	32.32	1,664,480.00	
		HALLIBURTON CO	105,000	44.92	4,716,600.00	
		HELMERICH & PAYNE	12,800	63.14	808,192.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	44,200	41.69	1,842,698.00	
		SCHLUMBERGER LTD	166,900	64.79	10,813,451.00	
		TECHNIPFMC PLC	51,600	30.76	1,587,216.00	
		ANADARKO PETE	64,000	69.46	4,445,440.00	
		ANDEAVOR	17,700	135.06	2,390,562.00	
		ANTERO RESOURCES CORP	27,000	20.71	559,170.00	
		APACHE CORPORATION	46,900	44.36	2,080,484.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	53,300	24.16	1,287,728.00	
		CHENIERE ENERGY INC	24,300	65.86	1,600,398.00	

CHEVRON CORP	229,800	122.59	28,171,182.00
CIMAREX ENERGY CO	12,000	93.77	1,125,240.00
CONCHO RESOURCES INC	18,300	124.47	2,277,801.00
CONOCOPHILLIPS	140,400	65.11	9,141,444.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	11,400	62.85	716,490.00
DEVON ENERGY CORP	63,700	41.15	2,621,255.00
DIAMONDBACK ENERGY INC	12,000	123.73	1,484,760.00
EOG RESOURCES INC	69,200	116.60	8,068,720.00
EQT CORP	30,700	55.95	1,717,665.00
EXXON MOBIL CORP	509,500	79.69	40,602,055.00
HESS CORP	34,600	61.71	2,135,166.00
HOLLYFRONTIER CORP	19,700	72.00	1,418,400.00
KINDER MORGAN INC	241,000	17.16	4,135,560.00
MARATHON OIL CORP	99,000	19.92	1,972,080.00
MARATHON PETROLEUM CORP	57,200	72.48	4,145,856.00
NEWFIELD EXPLORATION CO	22,900	29.23	669,367.00
NOBLE ENERGY INC	59,800	34.96	2,090,608.00
OCCIDENTAL PETE CORP	91,600	82.09	7,519,444.00
ONEOK INC	49,500	68.78	3,404,610.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	26,100	27.27	711,747.00
PHILLIPS 66	53,100	111.45	5,917,995.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	20,500	178.02	3,649,410.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	19,000	24.66	468,540.00
TARGA RESOURCES CORP	24,900	48.24	1,201,176.00
VALERO ENERGY CORP	52,000	111.22	5,783,440.00
WILLIAMS COS	97,600	27.69	2,702,544.00
AIR PRODUCTS	26,000	156.47	4,068,220.00
ALBEMARLE CORP	13,500	91.97	1,241,595.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	24,900	30.44	757,956.00
CELANESE CORP-SERIES A	16,700	111.30	1,858,710.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	29,000	44.91	1,302,390.00
CHEMOURS CO/THE	20,600	46.61	960,166.00
DOWDUPONT INC	280,400	65.28	18,304,512.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	17,100	100.95	1,726,245.00
ECOLAB INC	31,200	141.56	4,416,672.00

FMC CORP	16,400	86.59	1,420,076.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	9,600	124.67	1,196,832.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	39,900	108.02	4,309,998.00
MOSAIC CO/THE	45,100	28.38	1,279,938.00
PPG INDUSTRIES	29,900	104.30	3,118,570.00
PRAXAIR INC	34,800	155.87	5,424,276.00
SHERWIN-WILLIAMS	10,030	395.38	3,965,661.40
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5,000	105.87	529,350.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	7,500	224.64	1,684,800.00
VULCAN MATERIALS CO	16,200	129.86	2,103,732.00
AVERY DENNISON CORP	11,000	100.22	1,102,420.00
BALL CORP	39,700	35.28	1,400,616.00
CROWN HOLDINGS INC	16,700	44.60	744,820.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	47,100	52.87	2,490,177.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	10,900	114.14	1,244,126.00
SEALED AIR CORP	21,900	43.46	951,774.00
WESTROCK CO	31,400	57.44	1,803,616.00
FREEMONT-MCMORAN INC	165,000	16.36	2,699,400.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	63,900	37.02	2,365,578.00
NUCOR CORP	38,500	64.87	2,497,495.00
STEEL DYNAMICS	27,100	46.51	1,260,421.00
ARCONIC INC	51,600	16.96	875,136.00
BOEING CO	67,270	337.66	22,714,388.20
GENERAL DYNAMICS	30,110	188.43	5,673,627.30
HARRIS CORP	14,300	143.15	2,047,045.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,120	211.69	1,083,852.80
L3 TECHNOLOGIES INC	9,600	192.90	1,851,840.00
LOCKHEED MARTIN	31,010	300.38	9,314,783.80
NORTHROP GRUMMAN CORP	19,820	313.45	6,212,579.00
RAYTHEON COMPANY	34,900	194.70	6,795,030.00
ROCKWELL COLLINS INC	19,200	134.22	2,577,024.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	13,200	85.50	1,128,600.00
TEXTRON INC	31,300	66.68	2,087,084.00
TRANSDIGM GROUP INC	5,590	340.76	1,904,848.40
UNITED TECHNOLOGIES	90,800	123.48	11,211,984.00

ALLEGION PLC	10,800	77.88	841,104.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	17,100	55.50	949,050.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	112,500	34.33	3,862,125.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	4,500	201.96	908,820.00	
MASCO CORP	38,800	37.75	1,464,700.00	
OWENS CORNING INC	12,400	65.18	808,232.00	
SMITH (A.O.) CORP	16,500	60.06	990,990.00	
FLUOR CORP	16,400	48.69	798,516.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	16,000	64.55	1,032,800.00	
ACUITY BRANDS INC	5,000	117.96	589,800.00	
AMETEK INC	28,400	72.49	2,058,716.00	
EATON CORP PLC	52,500	76.36	4,008,900.00	
EMERSON ELEC	76,300	69.20	5,279,960.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	15,400	168.14	2,589,356.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	19,400	51.84	1,005,696.00	
3M CORP	71,700	195.52	14,018,784.00	
GENERAL ELEC CO	1,046,000	12.76	13,346,960.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	90,600	143.97	13,043,682.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	25,500	62.74	1,599,870.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	26,600	36.73	977,018.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	12,390	276.12	3,421,126.80	
AGCO CORP	7,800	60.49	471,822.00	
CATERPILLAR INC DEL	71,400	139.53	9,962,442.00	
CUMMINS INC	18,900	135.24	2,556,036.00	
DEERE & COMPANY	36,800	142.01	5,225,968.00	
DOVER CORP	18,100	72.47	1,311,707.00	
FLOWSERVE CORP	15,000	40.20	603,000.00	
FORTIVE CORP	36,900	78.10	2,881,890.00	
IDEX CORP	9,300	138.75	1,290,375.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	36,600	140.76	5,151,816.00	
INGERSOLL-RAND PLC	29,300	89.87	2,633,191.00	
MIDDLEBY CORP	6,500	104.86	681,590.00	
PACCAR	41,500	61.51	2,552,665.00	
PARKER HANNIFIN CORP	15,700	158.50	2,488,450.00	

PENTAIR PLC	20,500	42.15	864,075.00
SNAP-ON INC	6,700	158.75	1,063,625.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	18,100	133.60	2,418,160.00
WABCO HOLDINGS INC	6,000	117.57	705,420.00
WABTEC CORP	10,300	100.43	1,034,429.00
XYLEM INC	22,200	66.51	1,476,522.00
AERCAP HOLDINGS NV	16,900	54.24	916,656.00
FASTENAL CO	34,100	50.88	1,735,008.00
GRAINGER(W.W.) INC	5,680	313.18	1,778,862.40
HD SUPPLY HOLDINGS INC	22,900	43.48	995,692.00
UNITED RENTALS INC	10,100	153.18	1,547,118.00
CINTAS CORP	10,700	189.46	2,027,222.00
COPART INC	25,600	59.57	1,524,992.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	27,600	69.16	1,908,816.00
ROLLINS INC	12,000	52.43	629,160.00
STERICYCLE INC	10,800	63.17	682,236.00
WASTE CONNECTIONS INC	31,900	75.75	2,416,425.00
WASTE MANAGEMENT INC	51,700	81.27	4,201,659.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	16,900	89.79	1,517,451.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	21,300	75.17	1,601,121.00
FEDEX CORPORATION	30,460	246.72	7,515,091.20
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	83,000	113.42	9,413,860.00
XPO LOGISTICS INC	14,700	112.14	1,648,458.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,600	41.49	605,754.00
DELTA AIR LINES INC	20,100	53.73	1,079,973.00
SOUTHWEST AIRLINES	17,600	53.15	935,440.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	9,200	74.42	684,664.00
AMERCO	1,170	362.37	423,972.90
CSX CORP	100,900	64.05	6,462,645.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	10,700	128.20	1,371,740.00
KANSAS CITY SOUTHERN	11,800	108.28	1,277,704.00
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,700	41.69	696,223.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	34,400	149.98	5,159,312.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	7,700	160.80	1,238,160.00

UNION PAC CORP	94,800	143.10	13,565,880.00
APTIV PLC	31,900	97.28	3,103,232.00
AUTOLIV INC	10,500	151.86	1,594,530.00
BORGWARNER INC	26,200	45.94	1,203,628.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	28,300	24.57	695,331.00
LEAR CORP	7,700	198.84	1,531,068.00
FORD MOTOR COMPANY	441,000	11.71	5,164,110.00
GENERAL MOTORS CO	152,700	41.12	6,279,024.00
HARLEY-DAVIDSON INC	19,400	45.24	877,656.00
TESLA INC	15,230	347.51	5,292,577.30
DR HORTON INC	42,000	41.31	1,735,020.00
GARMIN LTD	13,300	60.12	799,596.00
LEGGETT & PLATT INC	15,900	44.23	703,257.00
LENNAR CORP-A	35,000	51.68	1,808,800.00
MOHAWK INDUSTRIES	7,800	210.91	1,645,098.00
NEWELL BRANDS INC	56,500	25.78	1,456,570.00
NVR INC	433	3,065.51	1,327,365.83
PULTEGROUP INC	33,800	29.17	985,946.00
TOLL BROTHERS INC	18,500	37.40	691,900.00
WHIRLPOOL CORP	8,200	143.98	1,180,636.00
HASBRO INC	14,500	91.60	1,328,200.00
MATTEL INC	40,000	17.52	700,800.00
POLARIS INDUSTRIES INC	7,100	124.39	883,169.00
HANESBRANDS INC	43,300	22.04	954,332.00
LULULEMON ATHLETICA INC	12,100	127.71	1,545,291.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	17,900	67.27	1,204,133.00
NIKE INC-B	155,300	73.94	11,482,882.00
PVH CORP	9,000	154.40	1,389,600.00
RALPH LAUREN CORPORATION	6,800	135.09	918,612.00
TAPESTRY INC	33,000	48.04	1,585,320.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	24,000	22.76	546,240.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	25,000	21.08	527,000.00
V F CORP	41,000	82.94	3,400,540.00
ARAMARK	28,600	37.88	1,083,368.00
CARNIVAL CORP	51,600	62.40	3,219,840.00

CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	2,890	463.16	1,338,532.40	
DARDEN RESTAURANTS INC	14,300	107.06	1,530,958.00	
DOMINOS PIZZA INC	5,270	290.76	1,532,305.20	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	34,200	81.02	2,770,884.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,900	79.40	3,803,260.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	36,200	133.73	4,841,026.00	
MCDONALD'S CORP	95,700	160.53	15,362,721.00	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	28,300	29.65	839,095.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	65,400	30.31	1,982,274.00	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	24,500	51.90	1,271,550.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	20,600	110.22	2,270,532.00	
STARBUCKS CORP	168,500	50.62	8,529,470.00	
VAIL RESORTS INC	4,950	278.83	1,380,208.50	
WYNN RESORTS LTD	11,700	172.00	2,012,400.00	
YUM BRANDS INC	40,100	79.73	3,197,173.00	
CBS CORP-CL B	42,200	56.40	2,380,080.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	20,030	291.86	5,845,955.80	
COMCAST CORP-CL A	558,100	32.79	18,300,099.00	
DISCOVERY INC - A	19,300	27.94	539,242.00	
DISCOVERY INC - C	35,331	25.94	916,486.14	
DISH NETWORK CORP-A	28,000	33.75	945,000.00	
DISNEY (WALT) CO	181,000	105.89	19,166,090.00	
INTERPUBRIC GROUP	44,300	23.54	1,042,822.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	12,400	75.09	931,116.00	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	64,600	28.32	1,829,472.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	29.34	704,160.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	22,400	33.64	753,536.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	22,400	45.70	1,023,680.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	9,870	45.65	450,565.50	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	16,100	47.03	757,183.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	46,000	15.79	726,340.00	
OMNICOM GROUP	26,800	75.49	2,023,132.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	182,000	7.16	1,303,120.00	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	126,600	48.35	6,121,110.00	
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	53,800	48.04	2,584,552.00	

CLASS B			
VIACOM INC-CLASS B	41,300	30.40	1,255,520.00
GENUINE PARTS CO	17,200	92.59	1,592,548.00
LKQ CORP	36,300	32.21	1,169,223.00
AMAZON.COM INC	49,450	1,730.22	85,559,379.00
BOOKING HOLDINGS INC	5,770	2,122.49	12,246,767.30
EXPEDIA GROUP INC	15,400	123.63	1,903,902.00
NETFLIX INC	52,230	415.44	21,698,431.20
QURATE RETAIL INC - A	53,200	21.20	1,127,840.00
TRIPADVISOR INC	12,300	57.03	701,469.00
DOLLAR GENERAL CORP	32,700	98.68	3,226,836.00
DOLLAR TREE INC	28,000	86.22	2,414,160.00
KOHL'S CORP	19,600	77.33	1,515,668.00
MACYS INC	35,900	39.32	1,411,588.00
NORDSTROM INC	15,000	52.78	791,700.00
TARGET CORP	61,500	76.14	4,682,610.00
ADVANCE AUTO PARTS	9,200	139.50	1,283,400.00
AUTOZONE	3,240	688.50	2,230,740.00
BEST BUY COMPANY INC	31,900	77.23	2,463,637.00
CARMAX INC	22,200	71.05	1,577,310.00
GAP INC	27,100	33.75	914,625.00
HOME DEPOT	140,500	200.31	28,143,555.00
L BRANDS, INC	27,000	37.14	1,002,780.00
LOWES COS INC	100,100	99.06	9,915,906.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	9,880	287.07	2,836,251.60
ROSS STORES INC	46,000	86.62	3,984,520.00
TIFFANY & CO	13,300	135.00	1,795,500.00
TJX COS INC	75,700	96.29	7,289,153.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	14,900	77.55	1,155,495.00
ULTA BEAUTY INC	7,000	250.35	1,752,450.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	52,500	209.96	11,022,900.00
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	8.83	397,350.00
KROGER CO	105,700	28.73	3,036,761.00
SYSCO CORP	59,700	68.08	4,064,376.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	101,800	67.79	6,901,022.00
	178,400	84.21	15,023,064.00

WALMART INC				
BROWN-FORMAN CORP-CL B	30,900	49.98	1,544,382.00	
COCA COLA CO	487,800	43.09	21,019,302.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	26,700	39.09	1,043,703.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	20,490	231.36	4,740,566.40	
DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC	21,100	122.15	2,577,365.00	
MOLSON COORS BREWING CO-B	22,000	67.47	1,484,340.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	51,200	55.97	2,865,664.00	
PEPSICO INC	171,000	107.24	18,338,040.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	66,900	46.00	3,077,400.00	
BUNGE LIMITED	17,200	71.05	1,222,060.00	
CAMPBELL SOUP CO	21,600	37.46	809,136.00	
CONAGRA BRANDS INC	47,200	38.28	1,806,816.00	
GENERAL MILLS	67,900	44.97	3,053,463.00	
HERSHEY CO/THE	16,600	91.91	1,525,706.00	
HORMEL FOODS CORP	36,200	35.67	1,291,254.00	
INGREDION INC	8,400	114.30	960,120.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	13,500	105.39	1,422,765.00	
KELLOGG CO	30,200	66.84	2,018,568.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	72,500	62.57	4,536,325.00	
MCCORMICK & CO INC.	13,900	105.07	1,460,473.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	177,200	40.74	7,219,128.00	
TYSON FOODS INC-CL A	34,900	69.27	2,417,523.00	
ALTRIA GROUP INC	229,000	56.69	12,982,010.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	187,100	79.47	14,868,837.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	28,700	50.69	1,454,803.00	
CLOROX CO	15,000	126.95	1,904,250.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	98,900	63.49	6,279,161.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	42,200	100.14	4,225,908.00	
PROCTER & GAMBLE CO	303,400	76.44	23,191,896.00	
COTY INC-CL A	55,000	14.47	795,850.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	27,000	151.87	4,100,490.00	
ABBOTT LABORATORIES	210,500	61.75	12,998,375.00	
ABIOMED INC	5,120	438.27	2,243,942.40	
ALIGN TECHNOLOGY INC	9,260	359.60	3,329,896.00	

BAXTER INTERNATIONAL INC.	61,700	73.74	4,549,758.00
BECTON,DICKINSON	31,880	233.24	7,435,691.20
BOSTON SCIENTIFIC CORP	165,100	32.15	5,307,965.00
DANAHER CORP	75,200	97.91	7,362,832.00
DENTSPLY SIRONA INC	27,200	44.57	1,212,304.00
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	24,900	152.18	3,789,282.00
HOLOGIC INC	34,300	39.57	1,357,251.00
IDEXX LABORATORIES INC	10,200	221.91	2,263,482.00
INTUITIVE SURGICAL INC	13,460	487.08	6,556,096.80
MEDTRONIC PLC	163,300	86.30	14,092,790.00
RESMED INC	16,900	107.03	1,808,807.00
STRYKER CORP	40,400	169.81	6,860,324.00
TELEFLEX INC	5,360	279.57	1,498,495.20
THE COOPER COMPANIES, INC.	5,630	233.98	1,317,307.40
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	10,700	117.24	1,254,468.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	23,900	111.51	2,665,089.00
AETNA INC	39,200	189.15	7,414,680.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	19,200	93.21	1,789,632.00
ANTHEM INC	30,460	243.08	7,404,216.80
CARDINAL HEALTH INC	38,600	53.54	2,066,644.00
CENTENE CORP	24,300	124.61	3,028,023.00
CIGNA CORP	29,300	175.00	5,127,500.00
CVS HEALTH CORP	122,500	71.08	8,707,300.00
DAVITA INC	17,500	72.08	1,261,400.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC- COMMON	67,700	79.36	5,372,672.00
HCA HEALTHCARE INC	33,300	107.57	3,582,081.00
HENRY SCHEIN INC	19,100	72.06	1,376,346.00
HUMANA INC	16,660	298.67	4,975,842.20
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	12,500	187.58	2,344,750.00
MCKESSON CORP	24,900	146.46	3,646,854.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	16,500	111.18	1,834,470.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	116,400	251.89	29,319,996.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	10,900	115.53	1,259,277.00
ABBVIE INC	182,600	95.55	17,447,430.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	26,300	125.81	3,308,803.00

ALKERMES PLC	17,400	43.65	759,510.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	11,100	102.69	1,139,859.00
AMGEN INC	81,200	185.99	15,102,388.00
BIOGEN INC	25,330	297.34	7,531,622.20
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	21,600	98.43	2,126,088.00
CELGENE CORP	90,100	79.14	7,130,514.00
GILEAD SCIENCES INC	156,600	71.52	11,200,032.00
INCYTE CORP	21,200	72.49	1,536,788.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	9,670	329.04	3,181,816.80
SEATTLE GENETICS INC	13,400	66.61	892,574.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	5,200	116.73	606,996.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	30,500	156.57	4,775,385.00
ALLERGAN PLC	39,500	172.49	6,813,355.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	196,900	53.94	10,620,786.00
ELI LILLY & CO.	118,900	86.07	10,233,723.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,000	180.13	1,260,910.00
JOHNSON & JOHNSON	322,600	121.45	39,179,770.00
MERCK & CO INC	324,600	61.18	19,859,028.00
MYLAN NV	62,400	38.63	2,410,512.00
NEKTAR THERAPEUTICS	19,700	55.86	1,100,442.00
PERRIGO CO PLC	16,500	75.35	1,243,275.00
PFIZER INC	716,200	36.30	25,998,060.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	115,000	24.01	2,761,150.00
ZOETIS INC	58,300	87.02	5,073,266.00
BANK OF AMERICA CORP	1,170,300	29.29	34,278,087.00
BB&T CORPORATION	93,800	52.06	4,883,228.00
CIT GROUP INC	13,800	50.86	701,868.00
CITIGROUP	309,400	67.63	20,924,722.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	57,800	41.93	2,423,554.00
COMERICA INC	20,400	96.01	1,958,604.00
EAST WEST BANCORP INC	18,000	69.99	1,259,820.00
FIFTH THIRD BANCORP	81,300	30.63	2,490,219.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	19,900	100.94	2,008,706.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	135,000	15.61	2,107,350.00
JPMORGAN CHASE & CO	412,600	107.51	44,358,626.00

KEYCORP	130,000	20.67	2,687,100.00
M & T BANK CORP	17,200	174.53	3,001,916.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	41,000	18.71	767,110.00
PNC FINANCIAL	56,400	141.34	7,971,576.00
REGIONS FINANCIAL CORP	137,000	18.92	2,592,040.00
SIGNATURE BANK	6,500	131.98	857,870.00
SUNTRUST BKS INC.	56,700	68.67	3,893,589.00
SVB FINANCIAL GROUP	6,400	316.08	2,022,912.00
US BANCORP	187,700	50.99	9,570,823.00
WELLS FARGO CO	562,700	54.37	30,593,999.00
ZIONS BANCORPORATION	22,600	56.51	1,277,126.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	153,600	188.86	29,008,896.00
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	36,600	22.97	840,702.00
VOYA FINANCIAL INC	21,700	49.27	1,069,159.00
AFLAC INC	92,400	44.43	4,105,332.00
ALLEGHANY CORP	1,920	578.00	1,109,760.00
ALLSTATE CORP	42,700	92.23	3,938,221.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	8,400	107.22	900,648.00
AMERICAN INTL GROUP	108,200	54.25	5,869,850.00
AON PLC	29,800	136.55	4,069,190.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	47,700	26.36	1,257,372.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	21,400	65.52	1,402,128.00
ASSURANT INC	6,300	102.20	643,860.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	18,900	44.52	841,428.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	10,500	55.52	582,960.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	13,900	45.01	625,639.00
CHUBB LTD	56,100	124.94	7,009,134.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	18,400	67.77	1,246,968.00
EVEREST RE GROUP LTD	5,010	228.67	1,145,636.70
FNF GROUP	33,800	36.99	1,250,262.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	42,400	51.47	2,182,328.00
LINCOLN NATIONAL CORP	25,800	64.97	1,676,226.00
LOEWS CORP	33,300	48.57	1,617,381.00
MARKEL CORP	1,630	1,101.24	1,795,021.20
MARSH & MCLENNAN COS	60,700	80.76	4,902,132.00

METLIFE INC	106,400	45.66	4,858,224.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	35,600	55.64	1,980,784.00
PROGRESSIVE CO	70,000	61.05	4,273,500.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	51,100	96.42	4,927,062.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	8,100	138.99	1,125,819.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,000	121.99	609,950.00
TORCHMARK CORP	12,500	83.70	1,046,250.00
TRAVELERS COS INC/THE	32,600	123.45	4,024,470.00
UNUM GROUP	27,300	37.88	1,034,124.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	16,000	152.40	2,438,400.00
WR BERKLEY CORP	11,500	73.44	844,560.00
XL GROUP LTD	30,900	56.20	1,736,580.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	20,700	81.69	1,690,983.00
ALPHABET INC-CL A	35,890	1,169.44	41,971,201.60
ALPHABET INC-CL C	37,850	1,157.66	43,817,431.00
EBAY INC	115,700	38.01	4,397,757.00
FACEBOOK INC-A	288,000	201.50	58,032,000.00
GODADDY INC - CLASS A	18,400	73.58	1,353,872.00
IAC/INTERACTIVE CORP	9,100	160.84	1,463,644.00
MERCADOLIBRE INC	4,980	287.37	1,431,102.60
TWITTER INC	81,700	45.24	3,696,108.00
VERISIGN INC	10,100	140.32	1,417,232.00
ZILLOW GROUP INC - C	13,300	61.84	822,472.00
ACCENTURE PLC-CL A	73,700	160.03	11,794,211.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	5,960	236.58	1,410,016.80
AUTOMATIC DATA PROCESS	53,600	138.21	7,408,056.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	14,100	116.79	1,646,739.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	70,000	77.68	5,437,600.00
DXC TECHNOLOGY CO	34,800	81.08	2,821,584.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	39,800	107.39	4,274,122.00
FIRST DATA CORP- CLASS A	56,000	21.80	1,220,800.00
FISERV INC	49,700	75.78	3,766,266.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	10,800	218.82	2,363,256.00
GARTNER INC	11,000	135.82	1,494,020.00
GLOBAL PAYMENTS INC	18,900	114.70	2,167,830.00

INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	110,900	141.25	15,664,625.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	8,800	131.03	1,153,064.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	18,000	57.92	1,042,560.00	
MASTERCARD INC	112,300	200.78	22,547,594.00	
PAYCHEX INC	39,500	69.71	2,753,545.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	137,500	85.97	11,820,875.00	
SABRE CORP	31,300	25.81	807,853.00	
SQUARE INC - A	34,500	67.10	2,314,950.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	19,500	87.33	1,702,935.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	216,800	134.53	29,166,104.00	
WESTERN UNION CO	52,800	21.08	1,113,024.00	
WORLDPAY INC - CL A	35,000	85.40	2,989,000.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	86,400	76.05	6,570,720.00	
ADOBE SYSTEMS INC.	59,220	248.83	14,735,712.60	
ANSYS INC	9,900	181.90	1,800,810.00	
AUTODESK INC.	26,600	137.74	3,663,884.00	
CA INC	38,300	36.13	1,383,779.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	35,000	44.90	1,571,500.00	
CDK GLOBAL INC	14,600	65.87	961,702.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	16,200	98.33	1,592,946.00	
CITRIX SYSTEMS INC	16,200	107.13	1,735,506.00	
DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	23,300	89.09	2,075,797.00	
ELECTRONIC ARTS	37,100	143.15	5,310,865.00	
FORTINET INC	17,000	64.74	1,100,580.00	
INTUIT INC	28,900	209.80	6,063,220.00	
MICROSOFT CORP	879,000	101.14	88,902,060.00	
ORACLE CORPORATION	373,900	43.10	16,115,090.00	
RED HAT INC	21,100	165.73	3,496,903.00	
SALESFORCE.COM INC	82,700	137.88	11,402,676.00	
SERVICENOW INC	21,000	180.27	3,785,670.00	
SPLUNK INC	17,400	113.17	1,969,158.00	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	25,500	54.51	1,390,005.00	
SYMANTEC CORP	77,000	20.80	1,601,600.00	
SYNOPSIS INC	18,000	89.23	1,606,140.00	

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	13,500	116.50	1,572,750.00
VMWARE INC - CLASS A	8,400	152.03	1,277,052.00
WORKDAY INC-CLASS A	16,500	125.76	2,075,040.00
ARISTA NETWORKS INC	6,330	279.32	1,768,095.60
CISCO SYSTEMS	579,600	43.16	25,015,536.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22,800	29.38	669,864.00
F5 NETWORKS INC	7,300	180.20	1,315,460.00
JUNIPER NETWORKS INC	42,400	26.92	1,141,408.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	19,000	117.05	2,223,950.00
PALO ALTO NETWORKS INC	11,200	212.70	2,382,240.00
APPLE INC	609,700	185.46	113,074,962.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	186,000	15.42	2,868,120.00
HP INC	194,200	23.50	4,563,700.00
NETAPP INC	32,200	77.75	2,503,550.00
SEAGATE TECHNOLOGY	32,200	58.44	1,881,768.00
WESTERN DIGITAL CORP	35,900	80.89	2,903,951.00
XEROX CORP	28,900	26.45	764,405.00
AMPHENOL CORP-CL A	37,200	88.46	3,290,712.00
ARROW ELECTRS INC	10,500	77.89	817,845.00
AVNET INC	15,000	42.66	639,900.00
CDW CORPORATION	18,200	84.06	1,529,892.00
COGNEX CORP	21,800	45.42	990,156.00
CORNING INC	104,000	28.29	2,942,160.00
FLEX LTD	62,000	14.50	899,000.00
FLIR SYSTEMS INC	15,600	54.22	845,832.00
IPG PHOTONICS CORP	4,730	234.65	1,109,894.50
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	23,100	60.53	1,398,243.00
TE CONNECTIVITY LTD	42,600	95.50	4,068,300.00
TRIMBLE INC	28,400	34.25	972,700.00
ADVANCED MICRO DEVICES	113,000	15.65	1,768,450.00
ANALOG DEVICES INC	44,900	99.16	4,452,284.00
APPLIED MATERIALS	126,500	48.99	6,197,235.00
BROADCOM INC	49,470	259.65	12,844,885.50
INTEL CORP	562,900	52.19	29,377,751.00
KLA TENCOR CORP	18,300	110.31	2,018,673.00

LAM RESEARCH	19,600	176.05	3,450,580.00	
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	55,100	21.24	1,170,324.00	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	32,900	59.94	1,972,026.00	
MICROCHIP TECHNOLOGY	28,100	98.70	2,773,470.00	
MICRON TECHNOLOGY	139,600	59.44	8,297,824.00	
NVIDIA CORP	69,310	257.11	17,820,294.10	
NXP SEMICONDUCTORS NV	41,000	112.84	4,626,440.00	
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	52,600	24.69	1,298,694.00	
QORVO INC	15,700	82.23	1,291,011.00	
QUALCOMM INC	176,900	58.75	10,392,875.00	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	22,400	98.86	2,214,464.00	
TEXAS INSTRUMENTS INC	118,600	112.11	13,296,246.00	
XILINX INC	30,200	67.68	2,043,936.00	
AT & T INC	873,291	31.60	27,595,995.60	
CENTURYLINK INC	116,000	18.45	2,140,200.00	
VERIZON COMMUNICATIONS	496,700	48.63	24,154,521.00	
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	26,400	36.43	961,752.00	
SPRINT CORP	90,000	5.35	481,500.00	
T-MOBILE US INC	41,500	60.00	2,490,000.00	
ALLIANT ENERGY CORP	28,300	40.97	1,159,451.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	59,200	67.47	3,994,224.00	
DUKE ENERGY CORP	83,900	76.91	6,452,749.00	
EDISON INTERNATIONAL	39,100	60.67	2,372,197.00	
ENTERGY CORP	21,000	79.84	1,676,640.00	
EVERGY INC	32,800	54.17	1,776,776.00	
EVERSOURCE ENERGY	38,500	55.70	2,144,450.00	
EXELON CORPORATION	114,300	41.43	4,735,449.00	
FIRSTENERGY CORP	57,900	35.15	2,035,185.00	
NEXTERA ENERGY INC	56,800	163.37	9,279,416.00	
OGE ENERGY CORP	22,500	34.80	783,000.00	
PG&E CORP	61,600	40.53	2,496,648.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	14,000	77.53	1,085,420.00	
PPL CORPORATION	81,500	27.84	2,268,960.00	
SOUTHERN CO.	122,100	45.29	5,529,909.00	
XCEL ENERGY INC	60,000	43.85	2,631,000.00	

ATMOS ENERGY CORP	13,000	88.85	1,155,050.00	
UGI CORP	20,400	51.29	1,046,316.00	
AMEREN CORPORATION	28,700	58.51	1,679,237.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	49,800	26.52	1,320,696.00	
CMS ENERGY CORP	33,000	45.33	1,495,890.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	37,500	75.45	2,829,375.00	
DOMINION ENERGY INC	78,900	66.60	5,254,740.00	
DTE ENERGY COMPANY	22,000	100.07	2,201,540.00	
NISOURCE INC	38,200	24.78	946,596.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	59,700	53.12	3,171,264.00	
SCANA CORP	17,100	36.55	625,005.00	
SEMPRA ENERGY	29,300	113.09	3,313,537.00	
WEC ENERGY GROUP INC	37,900	62.03	2,350,937.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	20,800	82.36	1,713,088.00	
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	56,000	11.49	643,440.00	
ALLY FINANCIAL INC	52,700	26.21	1,381,267.00	
AMERICAN EXPRESS CO	87,400	96.63	8,445,462.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	58,900	95.26	5,610,814.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	42,800	73.03	3,125,684.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	87,200	34.22	2,983,984.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	6,500	153.43	997,295.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	17,300	146.45	2,533,585.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	122,100	57.15	6,978,015.00	
BLACKROCK INC	14,560	524.98	7,643,708.80	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	13,900	103.95	1,444,905.00	
CME GROUP INC	40,800	168.22	6,863,376.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	32,700	65.21	2,132,367.00	
EATON VANCE CORP	13,800	53.81	742,578.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	39,700	32.94	1,307,718.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	43,140	226.98	9,791,917.20	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	70,500	74.93	5,282,565.00	
INVESCO LTD	46,900	27.03	1,267,707.00	
MOODYS CORP	20,900	172.43	3,603,787.00	
MORGAN STANLEY	160,600	49.79	7,996,274.00	
MSCI INC	10,400	170.76	1,775,904.00	

	NASDAQ INC	14,000	94.13	1,317,820.00	
	NORTHERN TRUST CORP	25,900	107.73	2,790,207.00	
	RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	16,200	96.50	1,563,300.00	
	S&P GLOBAL INC	30,300	206.67	6,262,101.00	
	SCHWAB(CHARLES)CORP	146,400	55.31	8,097,384.00	
	SEI INVESTMENTS COMPANY	16,700	66.05	1,103,035.00	
	STATE STREET CORP	43,500	98.19	4,271,265.00	
	T ROWE PRICE GROUP INC	29,700	123.67	3,672,999.00	
	TD AMERITRADE HOLDING CORP	33,400	59.16	1,975,944.00	
	H & R BLOCK INC	23,500	23.48	551,780.00	
	AES CORP	83,000	12.89	1,069,870.00	
	VISTRA ENERGY CORP	43,000	24.07	1,035,010.00	
	CERNER CORP	36,400	59.93	2,181,452.00	
	VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	14,100	83.56	1,178,196.00	
	AGILENT TECHNOLOGIES INC	38,600	63.04	2,433,344.00	
	ILLUMINA INC	17,660	286.05	5,051,643.00	
	IQVIA HOLDINGS INC	19,000	104.73	1,989,870.00	
	METTLER-TOLEDO INTL	3,010	576.33	1,734,753.30	
	THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	48,500	206.54	10,017,190.00	
	WATERS CORP	9,300	192.99	1,794,807.00	
	COSTAR GROUP INC	4,440	415.09	1,842,999.60	
	EQUIFAX INC	13,900	127.22	1,768,358.00	
	IHS MARKIT LTD	46,900	50.78	2,381,582.00	
	MANPOWERGROUP INC	8,000	89.65	717,200.00	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	42,700	30.90	1,319,430.00	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	15,100	69.53	1,049,903.00	
	TRUNSION	21,800	72.42	1,578,756.00	
	VERISK ANALYTICS INC	18,400	107.57	1,979,288.00	
	CBRE GROUP INC	39,300	48.72	1,914,696.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	143,000	7.20	1,029,600.00	
	JONES LANG LASALLE INC	5,400	169.88	917,352.00	
小計	銘柄数：599			2,881,511,799.07	
				(317,110,373,487)	
	組入時価比率：64.5%			66.8%	
カナダドル	ALTAGAS LTD	20,800	26.42	549,536.00	
		40,000	13.08	523,200.00	

ARC RESOURCES LTD				
CAMECO CORP	48,000	14.76	708,480.00	
CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	144,800	41.94	6,072,912.00	
CENOVUS ENERGY INC	129,000	12.24	1,578,960.00	
CRESCENT POINT ENERGY CORP	65,000	9.13	593,450.00	
ENBRIDGE INC	203,200	41.59	8,451,088.00	
ENCANA CORP	117,000	16.22	1,897,740.00	
HUSKY ENERGY INC	43,000	19.67	845,810.00	
IMPERIAL OIL	34,400	42.90	1,475,760.00	
INTER PIPELINE LTD	46,000	24.91	1,145,860.00	
KEYERA CORP	24,500	36.58	896,210.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	60,600	45.98	2,786,388.00	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	24,600	25.70	632,220.00	
SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	29,000	13.94	404,260.00	
SUNCOR ENERGY INC	196,300	52.19	10,244,897.00	
TOURMALINE OIL CORP	33,000	23.32	769,560.00	
TRANSCANADA CORP	106,900	57.56	6,153,164.00	
VERMILION ENERGY INC	18,500	44.83	829,355.00	
METHANEX CORP	8,600	90.84	781,224.00	
NUTRIEN LTD	76,800	70.13	5,385,984.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	18,600	64.41	1,198,026.00	
AGNICO EAGLE MINES LTD	28,100	58.66	1,648,346.00	
BARRICK GOLD	144,000	17.10	2,462,400.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	80,000	20.27	1,621,600.00	
FRANCO-NEVADA CORP	22,200	91.40	2,029,080.00	
GOLDCORP INC	101,000	17.91	1,808,910.00	
KINROSS GOLD CORP	140,000	4.91	687,400.00	
LUNDIN MINING CORP	73,000	7.89	575,970.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	62,700	34.51	2,163,777.00	
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	126,000	3.73	469,980.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	51,200	28.51	1,459,712.00	
WEST FRASER TIMBER	8,400	84.35	708,540.00	
BOMBARDIER B SHEARS	262,000	5.30	1,388,600.00	
CAE INC	31,000	26.93	834,830.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	22,100	59.85	1,322,685.00	

WSP GLOBAL INC	13,200	72.05	951,060.00
FINNING INTERNATIONAL INC	19,600	33.19	650,524.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	88,500	106.07	9,387,195.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	17,300	247.75	4,286,075.00
LINAMAR CORP	6,500	60.04	390,260.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	41,200	83.03	3,420,836.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	27,800	38.21	1,062,238.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	28,300	79.83	2,259,189.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	52,000	27.51	1,430,520.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	7,700	173.39	1,335,103.00
DOLLARAMA INC	38,400	52.86	2,029,824.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	53,000	57.15	3,028,950.00
EMPIRE CO LTD A	21,000	25.46	534,660.00
LOBLAW COMPANIES	24,000	67.38	1,617,120.00
METRO INC	30,300	44.40	1,345,320.00
WESTON(GEORGE)LTD	5,900	105.95	625,105.00
SAPUTO INC	28,900	43.58	1,259,462.00
VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL	38,000	32.86	1,248,680.00
BANK OF MONTREAL	77,000	102.87	7,920,990.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	144,800	76.80	11,120,640.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	53,300	116.83	6,227,039.00
NATIONAL BANK OF CANADA	41,600	63.98	2,661,568.00
ROYAL BANK OF CANADA	174,000	100.66	17,514,840.00
TORONTO DOMINION BANK	222,100	76.98	17,097,258.00
ONEX CORPORATION	10,900	95.82	1,044,438.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,430	743.16	2,549,038.80
GREAT-WEST LIFE CO INC	37,400	33.20	1,241,680.00
INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	12,100	51.88	627,748.00
INTACT FINANCIAL CORP	16,300	95.39	1,554,857.00
MANULIFE FINANCIAL CORP	236,000	24.89	5,874,040.00
POWER CORPORATION OF CANADA	40,900	30.15	1,233,135.00
POWER FINANCIAL CORP	27,800	31.76	882,928.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	72,100	54.22	3,909,262.00
	10,400	218.60	2,273,440.00

	SHOPIFY INC - CLASS A			
	CGI GROUP INC - CLASS A	30,000	83.84	2,515,200.00
	BLACKBERRY LTD	60,000	15.61	936,600.00
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,400	1,050.98	2,522,352.00
	OPEN TEXT CORP	32,500	47.52	1,544,400.00
	BCE INC	17,400	53.98	939,252.00
	TELUS CORP	19,300	46.30	893,590.00
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	43,600	62.45	2,722,820.00
	EMERA INC	7,600	42.05	319,580.00
	FORTIS INC	49,000	42.11	2,063,390.00
	HYDRO ONE LTD	42,000	20.00	840,000.00
	ATCO LTD CL1	9,600	40.01	384,096.00
	CANADIAN UTILITIES LTD A	15,700	32.39	508,523.00
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	100,100	54.78	5,483,478.00
	CI FINANCIAL CORP	33,600	24.84	834,624.00
	IGM FINANCIAL INC	10,300	39.67	408,601.00
	THOMSON REUTERS CORP	34,100	53.84	1,835,944.00
	FIRST CAPITAL REALTY INC	18,000	21.11	379,980.00
小計	銘柄数：87			218,833,366.80
				(18,104,084,435)
	組入時価比率：3.7%			3.8%
ユ-口	TENARIS SA	53,000	14.96	792,880.00
	ENAGAS	26,700	24.40	651,480.00
	ENI SPA	302,000	15.16	4,578,924.00
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	57,000	15.61	889,770.00
	NESTE OYJ	14,600	65.52	956,592.00
	OMV AG	17,100	47.86	818,406.00
	REPSOL SA	160,000	16.25	2,600,000.00
	REPSOL SA-RTS	160,000	0.47	75,840.00
	SNAM SPA	274,000	3.44	942,560.00
	TOTAL SA	290,100	50.80	14,737,080.00
	VOPAK	9,000	40.08	360,720.00
	AIR LIQUIDE	51,300	107.55	5,517,315.00
	AKZO NOBEL	30,900	74.36	2,297,724.00
	ARKEMA	8,600	100.55	864,730.00
	BASF SE	110,800	83.40	9,240,720.00

COVESTRO AG	23,200	72.70	1,686,640.00
EVONIK INDUSTRIES AG	19,500	29.51	575,445.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	8,200	42.82	351,124.00
K+S AG	23,400	21.57	504,738.00
KONINKLIJKE DSM NV	22,000	86.26	1,897,720.00
LANXESS	10,300	68.64	706,992.00
LINDE AG - TENDER	22,090	200.60	4,431,254.00
SOLVAY SA	8,700	109.90	956,130.00
SYMRISE AG	15,100	73.94	1,116,494.00
UMICORE	24,700	49.39	1,219,933.00
CRH PLC	102,600	30.96	3,176,496.00
HEIDELBERGCEMENT AG	17,300	73.30	1,268,090.00
IMERYS	3,800	66.30	251,940.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	29,000	34.78	1,008,620.00
ARCELORMITTAL	79,600	26.99	2,148,802.00
THYSSENKRUPP AG	51,800	21.65	1,121,470.00
VOESTALPINE AG	14,300	42.38	606,034.00
STORA ENSO OYJ-R	67,000	16.85	1,129,285.00
UPM-KYMMENE OYJ	64,000	30.31	1,939,840.00
AIRBUS SE	70,100	98.59	6,911,159.00
DASSAULT AVIATION SA	270	1,649.00	445,230.00
LEONARDO SPA	47,000	8.65	406,550.00
MTU AERO ENGINES AG	6,400	159.60	1,021,440.00
SAFRAN SA	39,700	98.98	3,929,506.00
THALES SA	12,400	108.50	1,345,400.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	60,800	38.91	2,365,728.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	31,000	35.99	1,115,690.00
BOUYGUES	25,700	37.48	963,236.00
EIFFAGE SA	9,700	93.54	907,338.00
FERROVIAL SA	60,053	18.16	1,090,862.74
HOCHTIEF AG	2,600	152.30	395,980.00
VINCI	60,900	82.48	5,023,032.00
LEGRAND SA	31,900	62.74	2,001,406.00
OSRAM LICHT AG	11,600	48.07	557,612.00
PRYSMIAN SPA	23,000	22.96	528,080.00

SCHNEIDER ELECTRIC SE	64,500	71.32	4,600,140.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	30,000	12.31	369,450.00	
SIEMENS AG	92,200	114.78	10,582,716.00	
ALSTOM	18,100	39.37	712,597.00	
ANDRITZ AG	9,200	42.64	392,288.00	
CNH INDUSTRIAL NV	121,000	9.19	1,112,232.00	
GEA GROUP AG	20,700	30.61	633,627.00	
KION GROUP AG	8,000	66.38	531,040.00	
KONE OYJ	40,700	44.46	1,809,522.00	
MAN SE	4,600	92.95	427,570.00	
METSO OYJ	12,400	28.78	356,872.00	
WARTSILA OYJ	52,500	16.52	867,562.50	
BRENNTAG AG	18,600	48.71	906,006.00	
REXEL SA	35,000	12.85	449,750.00	
EDENRED	29,400	26.80	787,920.00	
SOCIETE BIC SA	3,800	79.50	302,100.00	
BOLLORE	106,000	4.11	435,872.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	118,100	29.32	3,462,692.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	26,700	22.69	605,823.00	
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	75,000	8.20	615,150.00	
ADP	3,400	193.10	656,540.00	
AENA SME SA	8,000	156.65	1,253,200.00	
ATLANTIA SPA	60,500	24.39	1,475,595.00	
FRAPORT AG	4,900	83.30	408,170.00	
GETLINK	53,000	12.12	642,360.00	
CONTINENTAL AG	13,380	210.70	2,819,166.00	
FAURECIA	8,500	66.84	568,140.00	
MICHELIN (CGDE)	20,800	107.60	2,238,080.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	13,400	34.95	468,330.00	
PIRELLI & C. SPA	53,000	7.24	383,720.00	
SCHAEFFLER AG	21,000	12.06	253,260.00	
VALEO SA	29,500	50.80	1,498,600.00	
BAYER MOTOREN WERK	39,400	81.22	3,200,068.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	6,400	70.25	449,600.00	

DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	108,800	57.84	6,292,992.00
FERRARI NV	15,100	121.60	1,836,160.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	129,000	16.90	2,181,132.00
PEUGEOT CITROEN	71,900	20.37	1,464,603.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	18,600	58.40	1,086,240.00
RENAULT SA	22,700	76.62	1,739,274.00
VOLKSWAGEN AG	3,810	148.40	565,404.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	22,300	149.64	3,336,972.00
SEB SA	2,450	147.60	361,620.00
ADIDAS AG	22,810	190.15	4,337,321.50
HERMES INTERNATIONAL	3,800	526.20	1,999,560.00
HUGO BOSS AG	7,600	77.60	589,760.00
KERING SA	9,020	480.00	4,329,600.00
LUXOTTICA GROUP SPA	20,300	54.40	1,104,320.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	33,620	285.20	9,588,424.00
MONCLER SPA	22,300	39.78	887,094.00
PUMA SE	1,061	483.50	512,993.50
ACCOR SA	23,500	42.66	1,002,510.00
PADDY POWER PLC	11,100	94.70	1,051,170.00
SODEXO	11,100	85.86	953,046.00
AXEL SPRINGER SE	5,900	60.80	358,720.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	20,000	17.10	342,100.00
JC DECAUX SA	9,300	29.16	271,188.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	28,700	23.64	678,468.00
PUBLICIS GROUPE	25,600	60.32	1,544,192.00
RTL GROUP	3,900	63.90	249,210.00
SES FDR	43,000	15.89	683,270.00
TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	38.50	257,950.00
VIVENDI SA	125,200	21.25	2,660,500.00
ZALANDO SE	13,400	46.41	621,894.00
INDITEX SA	131,200	29.61	3,884,832.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	67,400	14.61	984,714.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	5,900	33.05	194,995.00
COLRUYT SA	7,300	48.23	352,079.00
JERONIMO MARTINS	31,000	13.08	405,635.00

KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	149,500	20.56	3,074,467.50
METRO AG	18,200	10.92	198,744.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	92,000	83.89	7,717,880.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	65,000	6.83	443,950.00
HEINEKEN HOLDING NV	13,500	82.35	1,111,725.00
HEINEKEN NV	31,600	85.44	2,699,904.00
PERNOD RICARD SA	25,300	139.85	3,538,205.00
REMY COINTREAU	3,000	116.00	348,000.00
DANONE	71,700	63.66	4,564,422.00
KERRY GROUP PLC-A	19,300	88.50	1,708,050.00
HENKEL AG & CO KGAA	12,300	96.05	1,181,415.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	21,800	107.65	2,346,770.00
BEIERSDORF AG	11,800	93.90	1,108,020.00
LOREAL-ORD	30,170	207.00	6,245,190.00
UNILEVER NV-CVA	184,500	46.89	8,651,205.00
BIOMERIEUX	4,600	76.20	350,520.00
ESSILOR INTERNATIONAL	25,100	118.90	2,984,390.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	112,000	35.93	4,024,720.00
SARTORIUS AG-VORZUG	4,500	122.50	551,250.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	17,400	36.71	638,754.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	25,500	86.76	2,212,380.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	50,100	69.48	3,480,948.00
GRIFOLS SA	36,600	26.72	977,952.00
BAYER AG-REG	108,312	96.39	10,440,193.68
IPSEN	4,700	133.05	625,335.00
MERCK KGAA	15,100	82.84	1,250,884.00
ORION OYJ	13,000	23.44	304,720.00
RECORDATI SPA	11,200	34.16	382,592.00
SANOFI	136,100	67.71	9,215,331.00
UCB SA	15,100	67.12	1,013,512.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	48,900	22.08	1,079,712.00
AIB GROUP PLC	105,000	4.77	501,480.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	791,000	5.97	4,723,852.00
BANCO DE SABADELL SA	700,000	1.41	990,850.00
BANCO SANTANDER SA	1,946,000	4.67	9,104,361.00

BANK OF IRELAND GROUP PLC	119,000	6.98	830,620.00
BANKIA SA	151,000	3.24	489,542.00
BANKINTER S.A.	75,000	8.51	638,700.00
BNP PARIBAS	135,700	53.20	7,219,240.00
CAIXABANK	413,000	3.64	1,506,624.00
COMMERZBANK AG	124,000	8.57	1,062,928.00
CREDIT AGRICOLE SA	137,000	11.63	1,593,995.00
ERSTE GROUP BANK AG	37,200	35.06	1,304,232.00
ING GROEP NV	470,000	12.46	5,859,960.00
INTESA SANPAOLO	1,634,000	2.56	4,186,308.00
INTESA SANPAOLO-RSP	118,000	2.67	315,532.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	30,000	65.46	1,963,800.00
MEDIOBANCA S.P.A.	77,000	8.22	633,402.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	16,900	27.46	464,074.00
SOCIETE GENERALE	91,200	35.94	3,277,728.00
UNICREDIT SPA	244,000	14.38	3,509,696.00
EURAZEO SE	5,670	65.60	371,952.00
EXOR NV	13,400	58.18	779,612.00
GROUPE BRUXELLES LAM	10,000	90.32	903,200.00
WENDEL	3,400	120.80	410,720.00
AEGON NV	208,000	5.23	1,087,840.00
AGEAS	23,500	43.45	1,021,075.00
ALLIANZ SE-REG	52,770	173.48	9,154,539.60
ASSICURAZIONI GENERALI	147,000	14.43	2,121,945.00
AXA	234,800	21.26	4,993,022.00
CNP ASSURANCES	21,200	19.35	410,220.00
HANNOVER RUECK SE	7,100	107.20	761,120.00
MAPFRE SA	126,000	2.53	319,662.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	18,460	176.50	3,258,190.00
NN GROUP NV	37,100	35.57	1,319,647.00
POSTE ITALIANE SPA	64,000	7.33	469,632.00
SAMPO OYJ-A SHS	52,700	41.21	2,171,767.00
SCOR SE	20,600	31.64	651,784.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	14,400	56.60	815,040.00

AMADEUS IT GROUP SA	52,800	69.24	3,655,872.00
ATOS SE	11,200	121.30	1,358,560.00
CAPGEMINI SA	19,000	112.70	2,141,300.00
WIRECARD AG	14,000	147.00	2,058,000.00
DASSAULT SYSTEMES SA	15,900	122.80	1,952,520.00
DELIVERY HERO AG	11,900	43.98	523,362.00
SAP SE	118,400	101.42	12,008,128.00
UBISOFT ENTERTAINMENT	9,700	96.42	935,274.00
NOKIA OYJ	680,000	5.07	3,447,600.00
INGENICO GROUP	6,700	73.00	489,100.00
ASML HOLDING NV	49,000	176.80	8,663,200.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	136,800	23.69	3,240,792.00
STMICROELECTRONICS NV	83,100	20.50	1,703,550.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	400,000	13.38	5,354,000.00
ELISA OYJ	17,200	39.23	674,756.00
ILIAD SA	3,150	132.30	416,745.00
KONINKLIJKE KPN NV	400,000	2.37	950,400.00
ORANGE SA	240,000	14.25	3,421,200.00
PROXIMUS	18,400	20.57	378,488.00
TELECOM ITALIA SPA	1,360,000	0.66	905,760.00
TELECOM ITALIA-RNC	680,000	0.57	389,640.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	97,000	3.45	335,523.00
TELEFONICA SA	555,000	7.39	4,101,450.00
1&1 DRILLISCH AG	5,900	60.35	356,065.00
ELECTRICITE DE FRANCE	67,000	11.80	790,935.00
ENDESA S.A.	35,600	19.23	684,588.00
ENEL SPA	966,000	4.71	4,552,758.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	316,000	3.34	1,056,704.00
FORTUM OYJ	55,200	19.66	1,085,232.00
IBERDROLA SA	702,000	6.43	4,516,668.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	54,000	17.80	961,470.00
TERNA SPA	163,000	4.44	723,720.00
GAS NATURAL SDG	41,200	21.49	885,388.00
E.ON SE	260,000	9.09	2,365,220.00
ENGIE	220,000	13.15	2,893,000.00

	INNOGY SE	17,100	36.75	628,425.00	
	RWE AG	62,800	19.36	1,215,808.00	
	SUEZ	45,000	11.47	516,150.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	65,600	18.69	1,226,064.00	
	AMUNDI SA	6,700	60.44	404,948.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	241,000	9.37	2,260,098.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	23,100	115.30	2,663,430.00	
	NATIXIS	111,000	6.06	673,104.00	
	UNIPER SE	22,400	25.12	562,688.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,430	424.80	607,464.00	
	QIAGEN NV	28,400	31.27	888,068.00	
	BUREAU VERITAS SA	30,100	23.00	692,300.00	
	RANDSTAD NV	15,000	51.88	778,200.00	
	RELX NV	116,000	18.19	2,110,040.00	
	TELEPERFORMANCE	7,100	149.40	1,060,740.00	
	WOLTERS KLUWER	35,100	47.80	1,677,780.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	43,500	41.11	1,788,285.00	
	VONOVIA SE	58,000	40.86	2,369,880.00	
小計	銘柄数：242			473,185,212.02	
				(60,444,678,983)	
	組入時価比率：12.3%			12.7%	
英ボンド	WOOD GROUP (JOHN) PLC	86,000	6.16	530,448.00	
	BP PLC	2,398,000	5.59	13,416,810.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	553,500	25.23	13,967,572.50	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	451,100	26.17	11,805,287.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	15,500	47.75	740,125.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	24,100	36.70	884,470.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	127,200	16.52	2,101,598.40	
	ANTOFAGASTA PLC	48,000	10.08	484,080.00	
	BHP BILLITON PLC	251,000	16.34	4,101,842.00	
	FRESNILLO PLC	26,000	11.41	296,660.00	
	GLENCORE PLC	1,382,000	3.71	5,135,512.00	
	RANDGOLD RESOURCES LTD	10,900	56.10	611,490.00	
	RIO TINTO PLC-REG	143,700	41.02	5,895,292.50	
	MONDI PLC	44,800	19.98	895,104.00	

BAE SYSTEMS PLC	388,000	6.20	2,407,152.00
MEGGITT PLC	95,000	4.84	460,370.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	199,000	9.26	1,842,740.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC -C	14,129,000	0.00	14,129.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	584,000	2.23	1,302,320.00
DCC PLC	11,000	67.85	746,350.00
SMITHS GROUP PLC	47,000	17.11	804,170.00
WEIR GROUP PLC	30,600	19.35	592,110.00
ASHTED GROUP PLC	59,000	22.46	1,325,140.00
BUNZLE	40,500	22.80	923,400.00
FERGUSON PLC	27,568	60.08	1,656,285.44
TRAVIS PERKINS PLC	30,200	13.96	421,743.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	25,900	8.23	213,312.40
G4S PLC	179,000	2.66	477,035.00
ROYAL MAIL PLC	108,000	4.94	534,060.00
EASYJET PLC	21,000	17.84	374,640.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	128,000	5.17	662,784.00
PERSIMMON PLC	35,500	25.30	898,150.00
TAYLOR WIMPEY PLC	406,000	1.78	723,695.00
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	14,800	37.80	559,440.00
BURBERRY GROUP PLC	50,400	21.05	1,060,920.00
CARNIVAL PLC	22,000	47.04	1,034,880.00
COMPASS GROUP PLC	191,000	16.03	3,061,730.00
GVC HOLDINGS PLC	63,000	10.24	645,120.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	21,300	47.90	1,020,270.00
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	89,000	3.80	338,645.00
TUI AG-DI	53,900	17.14	923,846.00
WHITBREAD PLC	22,600	39.93	902,418.00
INFORMA PLC	150,000	8.15	1,222,800.00
ITV PLC	450,000	1.73	781,425.00
PEARSON	91,000	8.60	782,964.00
SKY PLC	121,000	14.05	1,700,050.00
WPP PLC	151,000	12.08	1,824,835.00
MARKS & SPENCER PLC	181,000	2.93	530,330.00
NEXT PLC	17,900	59.36	1,062,544.00

KINGFISHER PLC	246,000	3.00	738,000.00
MORRISON SUPERMARKETS	280,000	2.47	691,600.00
SAINSBURY	199,000	3.10	617,895.00
TESCO PLC	1,161,000	2.56	2,972,160.00
COCA-COLA HBC AG-CDI	25,500	25.55	651,525.00
DIAGEO PLC	295,400	27.30	8,064,420.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	42,200	28.06	1,184,132.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	276,400	38.39	10,610,996.00
IMPERIAL BRANDS PLC	114,700	26.74	3,067,078.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	80,100	61.58	4,932,558.00
UNILEVER PLC	148,800	40.79	6,070,296.00
CONVATEC GROUP PLC-WI	157,000	2.23	350,110.00
SMITH & NEPHEW PLC	102,000	13.83	1,410,660.00
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	37,500	5.40	202,500.00
NMC HEALTH PLC	13,300	35.34	470,022.00
SHIRE PLC	110,100	40.88	4,500,888.00
ASTRAZENECA PLC	151,300	52.55	7,950,815.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	598,000	15.38	9,199,632.00
BARCLAYS PLC	2,067,000	1.90	3,931,434.00
HSBC HOLDINGS PLC	2,408,000	7.08	17,051,048.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	8,710,000	0.61	5,344,456.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	575,000	2.56	1,477,175.00
STANDARD CHARTERED PLC	338,000	7.03	2,376,478.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	311,000	3.39	1,055,845.00
ADMIRAL GROUP PLC	22,900	18.80	430,634.50
AVIVA PLC	479,000	5.03	2,409,370.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	157,000	3.43	539,295.00
LEGAL & GENERAL	704,000	2.65	1,867,008.00
PRUDENTIAL PLC	312,600	17.83	5,575,221.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	124,000	6.68	828,816.00
AUTO TRADER GROUP PLC	119,000	4.23	503,370.00
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	51,600	13.66	704,856.00
SAGE GROUP PLC (THE)	129,000	6.34	818,634.00
BT GROUP PLC	993,000	2.15	2,135,446.50
VODAFONE GROUP PLC	3,222,000	1.84	5,941,368.00

	SSE PLC	122,000	13.33	1,626,260.00	
	CENTRICA PLC	650,000	1.55	1,009,125.00	
	NATIONAL GRID PLC	409,000	8.23	3,369,751.00	
	SEVERN TRENT PLC	27,700	18.83	521,591.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	86,000	7.39	635,712.00	
	3I GROUP PLC	114,000	9.19	1,048,344.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	35,600	19.65	699,540.00	
	INVESTEC PLC	75,000	5.38	404,100.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	38,200	44.50	1,699,900.00	
	SCHRODERS PLC	15,800	31.19	492,802.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	62,000	11.68	724,160.00	
	EXPERIAN PLC	111,100	18.25	2,028,130.50	
	INTERTEK GROUP PLC	19,700	56.38	1,110,686.00	
	RELX PLC	127,000	16.07	2,041,525.00	
小計	銘柄数：98			228,785,462.74	
				(33,384,374,723)	
	組入時価比率：6.8%			7.0%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	25,900	23.37	605,283.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	980	628.00	615,440.00	
	GIVAUDAN-REG	1,091	2,191.00	2,390,381.00	
	SIKA AG-REG	14,940	132.90	1,985,526.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	58,600	49.54	2,903,044.00	
	GEBERIT AG-REG	4,360	426.50	1,859,540.00	
	ABB LTD	223,300	21.94	4,899,202.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	2,450	206.60	506,170.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	4,990	211.00	1,052,890.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	6,500	148.50	965,250.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	62,000	86.16	5,341,920.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	3,790	463.60	1,757,044.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	6,000	85.10	510,600.00	
	DUFREY AG-REG	4,400	134.75	592,900.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	230	1,779.00	409,170.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	125	6,315.00	789,375.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	12	75,400.00	904,800.00	
	NESTLE SA-REG	374,400	73.72	27,600,768.00	

	SONOVA HOLDING AG-REG	6,900	172.90	1,193,010.00
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,280	736.00	942,080.00
	NOVARTIS-REG	267,800	73.44	19,667,232.00
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	84,600	215.50	18,231,300.00
	VIFOR PHARMA AG	5,700	156.85	894,045.00
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	4,300	84.40	362,920.00
	BALOISE HOLDING AG	5,800	143.70	833,460.00
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,240	336.40	1,426,336.00
	SWISS RE LTD	37,500	85.22	3,195,750.00
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	18,160	292.50	5,311,800.00
	TEMENOS AG-REG	7,500	148.60	1,114,500.00
	SWISSCOM AG-REG	2,990	435.20	1,301,248.00
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	307,000	14.95	4,589,650.00
	JULIUS BAER GROUP LTD	25,900	57.98	1,501,682.00
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,060	720.00	1,483,200.00
	UBS GROUP AG	462,000	15.07	6,964,650.00
	LONZA AG-REG	9,110	269.50	2,455,145.00
	ADECCO GROUP AG-REG	19,300	58.64	1,131,752.00
	SGS SA-REG	647	2,550.00	1,649,850.00
	SWISS PRIME SITE-REG	8,100	90.55	733,455.00
小計	銘柄数：38			130,672,368.00 (14,503,326,124)
	組入時価比率：2.9%			3.1%
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	21,700	273.50	5,934,950.00
	BOLIDEN AB	32,700	294.30	9,623,610.00
	ASSA ABLOY AB-B	118,400	186.85	22,123,040.00
	SKANSKA AB-B SHS	38,200	157.85	6,029,870.00
	ALFA LAVAL AB	35,000	214.90	7,521,500.00
	ATLAS COPCO AB-A	81,000	264.50	21,424,500.00
	ATLAS COPCO AB-B	48,500	240.00	11,640,000.00
	EPIROC AB - A	81,000	88.06	7,132,860.00
	EPIROC AB - B	45,000	80.00	3,600,000.00
	SANDVIK AB	137,000	152.80	20,933,600.00
	SKF AB-B SHARES	48,000	165.30	7,934,400.00
	VOLVO AB-B SHS	189,000	142.00	26,838,000.00

	SECURITAS AB-B SHS	39,000	144.10	5,619,900.00	
	ELECTROLUX AB-B	29,700	208.00	6,177,600.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	55,000	84.74	4,660,700.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	107,000	138.24	14,791,680.00	
	ICA GRUPPEN AB	10,500	274.50	2,882,250.00	
	SWEDISH MATCH AB	21,500	429.80	9,240,700.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	73,000	217.50	15,877,500.00	
	NORDEA BANK AB	362,000	84.92	30,741,040.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	199,000	81.80	16,278,200.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	181,000	97.00	17,557,000.00	
	SWEDBANK AB	106,900	188.20	20,118,580.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	20,600	173.90	3,582,340.00	
	INVESTOR AB-B SHS	53,900	358.50	19,323,150.00	
	KINNEVIK AB - B	29,400	307.60	9,043,440.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	9,200	276.20	2,541,040.00	
	ERICSSON LM-B	369,000	68.60	25,313,400.00	
	HEXAGON AB-B SHS	30,200	504.00	15,220,800.00	
	TELIA CO AB	330,000	41.49	13,691,700.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR- SDR	8,200	529.50	4,341,900.00	
	TELE 2 AB-B SHS	42,000	111.90	4,699,800.00	
小計	銘柄数：32			392,439,050.00	
				(4,858,395,439)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
ノルウェーク ローネ	AKER AB ASA	14,100	293.80	4,142,580.00	
	EQUINOR ASA	141,400	209.00	29,552,600.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	20,600	339.00	6,983,400.00	
	NORSK HYDRO	161,000	51.54	8,297,940.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	236.50	3,050,850.00	
	MARINE HARVEST ASA	46,700	165.15	7,712,505.00	
	ORKLA ASA	91,000	73.54	6,692,140.00	
	DNB ASA	117,000	156.35	18,292,950.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,000	127.90	3,197,500.00	
	TELENOR ASA	90,300	166.50	15,034,950.00	
小計	銘柄数：10			102,957,415.00	

				(1,395,072,973)	
				0.3%	
デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	11,400	623.00	7,102,200.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	27,100	322.00	8,726,200.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	25,200	408.30	10,289,160.00	
	ISS A/S	18,600	221.40	4,118,040.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	440	8,610.00	3,788,400.00	
	A P MOLLER-MAERSK A/S	800	9,162.00	7,329,600.00	
	DSV A/S	23,400	531.00	12,425,400.00	
	PANDORA A/S	14,000	483.80	6,773,200.00	
	CARLSBERG B	12,600	742.20	9,351,720.00	
	COLOPLAST-B	14,200	628.40	8,923,280.00	
	WILLIAM DEMANT HOLDING	13,000	254.00	3,302,000.00	
	GENMAB A/S	7,700	988.20	7,609,140.00	
	H LUNDBECK A/S	8,200	470.00	3,854,000.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	211,200	299.20	63,191,040.00	
	DANSKE BANK AS	91,400	205.70	18,800,980.00	
	TRYG A/S	16,000	150.90	2,414,400.00	
	ORSTED A/S	21,800	376.20	8,201,160.00	
小計	銘柄数：17			186,199,920.00	
				(3,191,466,628)	
				0.7%	
豪ドル	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	33,300	32.32	1,076,256.00	
	OIL SEARCH LTD	162,000	8.50	1,377,000.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	205,000	9.89	2,027,450.00	
	SANTOS LTD.	212,000	6.15	1,303,800.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	110,700	34.90	3,863,430.00	
	INCITEC PIVOT LTD	196,000	3.47	680,120.00	
	ORICA LTD	42,000	17.98	755,160.00	
	BORAL LTD	133,000	6.58	875,140.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	52,000	22.20	1,154,400.00	
	AMCOR	143,000	14.38	2,056,340.00	
	ALUMINA LTD	290,000	2.77	803,300.00	
	BHP BILLITON LIMITED	387,600	32.76	12,697,776.00	
BLUESCOPE STEEL LTD	67,000	18.57	1,244,190.00		

FORTESCUE METALS GROUP LTD	187,000	4.55	850,850.00
NEWCREST MINING	89,000	21.34	1,899,260.00
RIO TINTO LTD	49,800	83.10	4,138,380.00
SOUTH32 LTD	614,000	3.76	2,308,640.00
CIMIC GROUP LTD	11,700	42.10	492,570.00
BRAMBLES LTD	189,000	9.00	1,701,000.00
AURIZON HOLDINGS LTD	239,000	4.44	1,061,160.00
SYDNEY AIRPORT	125,000	7.52	940,000.00
TRANSURBAN GROUP	267,000	12.17	3,249,390.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	70,300	31.91	2,243,273.00
CROWN RESORTS LTD	43,000	13.72	589,960.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	8,500	53.86	457,810.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	7,300	63.43	463,039.00
TABCORP HOLDINGS	218,400	4.57	998,088.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	53,000	3.41	180,730.00
WESFARMERS LIMITED	135,000	48.78	6,585,300.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	157,000	29.94	4,700,580.00
COCA-COLA AMATIL LTD	60,000	9.01	540,600.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	89,000	18.82	1,674,980.00
COCHLEAR LTD	6,700	203.15	1,361,105.00
HEALTHSCOPE LTD	230,000	2.25	517,500.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	18,000	57.49	1,034,820.00
SONIC HEALTHCARE LTD	49,000	25.12	1,230,880.00
CSL LIMITED	54,600	198.50	10,838,100.00
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	353,000	27.85	9,831,050.00
BANK OF QUEENSLAND LTD	42,000	10.50	441,000.00
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	54,000	10.74	579,960.00
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	211,400	72.90	15,411,060.00
NATIONAL AUSTRALIA BANK	326,000	27.31	8,903,060.00
WESTPAC BANKING CORP	407,000	29.07	11,831,490.00
AMP LIMITED	344,000	3.62	1,245,280.00
CHALLENGER LIMITED	66,000	12.46	822,360.00
INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	277,000	8.65	2,396,050.00
MEDIBANK PRIVATE LTD	308,000	2.91	896,280.00
QBE INSURANCE	166,000	9.68	1,606,880.00

	SUNCORP GROUP LTD	159,000	14.71	2,338,890.00	
	REA GROUP LTD	6,900	93.11	642,459.00	
	COMPUTERSHARE LTD	56,000	18.75	1,050,000.00	
	TELSTRA CORP LTD	487,000	2.72	1,324,640.00	
	TPG TELECOM LTD	35,964	5.29	190,249.56	
	AUSNET SERVICES	230,000	1.58	363,400.00	
	APA GROUP	144,000	9.96	1,434,240.00	
	AGL ENERGY LTD	79,000	21.82	1,723,780.00	
	ASX LTD	24,000	64.56	1,549,440.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	39,000	122.73	4,786,470.00	
	SEEK LTD	40,000	22.50	900,000.00	
小計	銘柄数：59			150,240,415.56	
				(12,217,550,593)	
	組入時価比率：2.5%			2.6%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	112,627	6.88	774,873.76	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	108,000	6.90	745,200.00	
	A2 MILK CO LTD	93,000	12.15	1,129,950.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	64,000	15.20	972,800.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	45,000	12.04	541,800.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	229,000	3.69	845,010.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	159,000	3.15	500,850.00	
小計	銘柄数：7			5,510,483.76	
				(417,033,410)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	322,040	84.75	27,292,890.00	
	NWS HOLDINGS LTD	159,500	14.16	2,258,520.00	
	MTR CORP	181,000	42.10	7,620,100.00	
	MINTH GROUP LTD	82,000	33.50	2,747,000.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	156,000	43.60	6,801,600.00	
	LI & FUNG LTD	749,600	3.01	2,256,296.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	97,000	21.95	2,129,150.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	284,000	63.10	17,920,400.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	124,000	20.55	2,548,200.00	
	SANDS CHINA LTD	286,400	43.25	12,386,800.00	

	SHANGRI-LA ASIA LTD	160,333	15.38	2,465,921.54	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	10.26	2,770,200.00	
	WYNN MACAU LTD	184,000	26.55	4,885,200.00	
	WH GROUP LIMITED	1,020,000	6.40	6,528,000.00	
	BANK OF EAST ASIA	140,060	31.20	4,369,872.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	445,000	38.25	17,021,250.00	
	HANG SENG BANK	92,000	193.70	17,820,400.00	
	AIA GROUP LTD	1,455,000	67.65	98,430,750.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	38,000	99.65	3,786,700.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	449,600	10.00	4,496,000.00	
	PCCW LTD	550,000	4.46	2,453,000.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	75,000	57.35	4,301,250.00	
	CLP HLDGS	198,000	80.05	15,849,900.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	163,000	54.30	8,850,900.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,122,317	14.84	16,655,184.28	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	141,500	244.00	34,526,000.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	313,040	64.60	20,222,384.00	
	HANG LUNG GROUP LTD	103,000	22.70	2,338,100.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	251,000	16.78	4,211,780.00	
	HENDERSON LAND	166,858	42.45	7,083,122.10	
	HYSAN DEVELOPMENT	83,000	45.75	3,797,250.00	
	KERRY PROPERTIES	79,000	43.00	3,397,000.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	759,666	11.36	8,629,805.76	
	SINO LAND CO.LTD	360,000	12.98	4,672,800.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	192,000	121.30	23,289,600.00	
	SWIRE PACIFIC-A	64,000	85.95	5,500,800.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	146,000	30.35	4,431,100.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	147,000	60.00	8,820,000.00	
	WHARF(HOLDING)	134,000	25.95	3,477,300.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	98,000	56.95	5,581,100.00	
小計	銘柄数：40			434,623,625.68	
				(6,097,769,468)	
	組入時価比率：1.2%			1.3%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	198,000	3.36	665,280.00	

	KEPPEL CORP.	178,000	7.09	1,262,020.00	
	SEBPCORP INDUSTRIES	99,040	2.73	270,379.20	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	270,000	0.94	255,150.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	63,040	11.01	694,070.40	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	250,000	2.23	557,500.00	
	SATS LTD	77,000	4.90	377,300.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	720,000	1.23	885,600.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	187,000	2.60	486,200.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	10,000	32.77	327,700.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	940,020	0.31	296,106.30	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	247,000	3.07	758,290.00	
	DBS GROUP HLDGS	214,000	27.03	5,784,420.00	
	OCBC-ORD	383,000	11.87	4,546,210.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	160,000	26.53	4,244,800.00	
	VENTURE CORP LTD	35,000	18.09	633,150.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	965,000	3.16	3,049,400.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	93,000	7.25	674,250.00	
	CAPITALAND LIMITED	285,000	3.25	926,250.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	51,000	11.13	567,630.00	
	UOL GROUP LIMITED	65,000	7.55	490,750.00	
	小計 銘柄数：21			27,752,455.90	
				(2,249,891,599)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
新シェケル	FRUTAROM	4,800	358.50	1,720,800.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	91,000	17.07	1,553,370.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	2,800	436.00	1,220,800.00	
	BANK HAPOLIM BM	125,000	24.50	3,062,500.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	178,000	21.43	3,814,540.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,000	67.91	1,154,470.00	
	NICE LTD	6,800	395.00	2,686,000.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	280,000	4.02	1,126,160.00	
	AZRIELI GROUP	4,100	182.60	748,660.00	
	小計 銘柄数：9			17,087,300.00	
				(518,941,301)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	

合計			474,492,959,163	
			(474,492,959,163)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2018年6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	52,000	982,800.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	12,400	1,567,484.00	
		AMERICAN TOWER CORP	52,800	7,480,704.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	144,000	1,524,960.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	16,300	2,769,533.00	
		BOSTON PROPERTIES	18,700	2,288,319.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	10,500	962,535.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	48,300	4,970,553.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	24,300	2,606,418.00	
		DUKE REALTY CORP	43,600	1,252,628.00	
		EQUINIX INC	9,540	3,997,260.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	43,400	2,728,124.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	8,120	1,905,033.20	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	15,300	1,525,257.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	8,900	1,100,841.00	
		GGP INC	82,000	1,701,500.00	
		HCP INC	57,100	1,405,802.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	88,000	1,903,440.00	
		INVITATION HOMES INC	39,400	890,834.00	
		IRON MOUNTAIN INC	31,300	1,086,110.00	
		KIMCO REALTY CORP	51,000	887,400.00	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	16,900	742,924.00	
		MACERICH CO /THE	14,200	812,240.00	
		MID-AMERICA APARTMENT COMM	13,700	1,353,971.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	17,100	736,668.00			
PROLOGIS INC	63,400	4,054,430.00			

	PUBLIC STORAGE	19,000	4,214,960.00	
	REALTY INCOME CORP	34,600	1,851,792.00	
	REGENCY CENTERS CORP	19,200	1,176,768.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	13,800	2,215,866.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	38,400	6,508,032.00	
	SL GREEN REALTY CORP	11,000	1,102,200.00	
	UDR INC	30,800	1,134,672.00	
	VENTAS INC	42,800	2,356,140.00	
	VEREIT INC	109,000	804,420.00	
	VORNADO REALTY TRUST	20,500	1,499,165.00	
	WELLTOWER INC	43,500	2,557,800.00	
	WEYERHAEUSER CO	92,000	3,289,000.00	
小計	銘柄数：38	1,456,860	81,948,583.20	
			(9,018,441,581)	
	組入時価比率：1.8%		77.6%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	13,600	277,440.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	16,900	410,163.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	6,900	209,415.00	
小計	銘柄数：3	37,400	897,018.00	
			(74,210,299)	
	組入時価比率：0.0%		0.6%	
ユーロ	COVIVIO	4,000	354,800.00	
	GECINA SA	5,600	806,400.00	
	ICADE	3,700	298,775.00	
	KLEPIERRE	24,900	815,973.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	16,470	3,109,536.00	
小計	銘柄数：5	54,670	5,385,484.00	
			(687,941,726)	
	組入時価比率：0.1%		5.9%	
英ポンド	BRITISH LAND	114,000	773,832.00	
	HAMMERSON PLC	89,000	472,590.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	89,000	839,448.00	
	SEGRO PLC	118,000	778,800.00	
小計	銘柄数：4	410,000	2,864,670.00	
			(418,012,646)	
	組入時価比率：0.1%		3.6%	

豪ドル	DEXUS	126,000	1,265,040.00	
	GOODMAN GROUP	199,000	1,972,090.00	
	GPT GROUP	229,000	1,193,090.00	
	LENDLEASE GROUP	69,000	1,362,750.00	
	MIRVAC GROUP	430,000	963,200.00	
	SCENTRE GROUP	642,000	2,799,120.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	307,000	1,283,260.00	
	VICINITY CENTRES	373,000	1,007,100.00	
小計	銘柄数：8 組入時価比率：0.2%	2,375,000	11,845,650.00 (963,288,258) 8.3%	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	260,000	1,939,600.00	
	LINK REIT	264,000	18,334,800.00	
小計	銘柄数：2 組入時価比率：0.1%	524,000	20,274,400.00 (284,449,832) 2.4%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	282,000	736,020.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	299,972	491,954.08	
	CAPITALAND MALL TRUST	310,000	632,400.00	
	SUNTEC REIT	300,000	504,000.00	
小計	銘柄数：4 組入時価比率：0.0%	1,191,972	2,364,374.08 (191,679,806) 1.6%	
合計			11,638,024,148 (11,638,024,148)	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2018年 6月22日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
	うち1年超		
			評価損益(円)
市場取引			

株価指数先物取引				
買建	5,502,598,236	-	5,432,405,056	70,193,180
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	511,627,150	-	509,358,100	2,269,050
米ドル	511,627,150	-	509,358,100	2,269,050
合計	-	-	-	72,462,230

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2018年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	802,335,242
コール・ローン	49,468,113
株式	31,413,324,870
投資信託受益証券	120,350,680
投資証券	118,673,508
派生商品評価勘定	156,250
未収入金	658,541
未収配当金	80,199,627
差入委託証拠金	135,728,828
流動資産合計	32,720,895,659
資産合計	32,720,895,659
負債の部	

流動負債	
派生商品評価勘定	53,038,047
未払解約金	66,864,988
未払利息	113
その他未払費用	1,522,800
流動負債合計	121,425,948
負債合計	121,425,948
純資産の部	
元本等	
元本	25,882,137,620
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	6,717,332,091
元本等合計	32,599,469,711
純資産合計	32,599,469,711
負債純資産合計	32,720,895,659

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> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6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	1,2595円
(10,000口当たり純資産額)	(12,595円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2017年 8月31日 至 2018年 6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 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なっております。</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なっております。</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なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2018年 6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

2018年 6月22日現在		2017年 8月31日
期首		2017年 8月31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		21,029,577,819円
同期中における追加設定元本額		6,359,982,387円
同期中における一部解約元本額		1,507,422,586円
期末元本額		25,882,137,620円
期末元本額の内訳*		
野村資産設計ファンド2015		28,180,978円
野村資産設計ファンド2020		33,847,665円
野村資産設計ファンド2025		49,394,461円
野村資産設計ファンド2030		52,435,731円
野村資産設計ファンド2035		39,820,242円
野村資産設計ファンド2040		99,758,756円
野村資産設計ファンド2045		13,084,929円
野村インデックスファンド・新興国株式		3,507,175,064円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		191,803,841円
野村資産設計ファンド2050		20,146,676円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		6,771,759円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		2,128,929円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		1,488,768円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		964,105円
インデックス・ブレンド(タイプ)		747,404円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,374,722円
インデックス・ブレンド(タイプ)		5,210,324円
インデックス・ブレンド(タイプ)		1,443,896円
インデックス・ブレンド(タイプ)		10,924,232円
野村つみたて外国株投信		233,829,045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)		314,037,726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)		748,385,773円
世界6資産分散ファンド		49,557,816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)	98,308,111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)	595,922,926円
野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け)	19,774,056,920円
野村資産設計ファンド(DC)2030	233,233円
野村資産設計ファンド(DC)2040	343,203円
野村資産設計ファンド(DC)2050	760,385円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年6月22日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	14,600	19.35	282,510.00	
		INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	57,700	1.33	77,144.90	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	23,120	65.06	1,504,187.20	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	4,750	139.30	661,675.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	283,700	4.17	1,183,029.00	
		ROSNEFT OJSC - GDR	65,150	6.13	399,760.40	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	73,300	4.50	329,850.00	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	14,080	62.82	884,505.60	
		TRANSNEFT PJSC	21	2,653.70	55,727.70	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	7,010	12.82	89,868.20	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	6,200	47.78	296,236.00	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	11,100	14.72	163,392.00	
		MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	8,400	9.24	77,616.00	
		NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	7,370	24.75	182,407.50	
		PJSC ALROSA	140,000	1.53	215,373.20	
		PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	34,849	17.65	615,084.85	
		POLYUS PJSC-REG S-GDR	2,700	30.35	81,945.00	
		SEVERSTAL-GDR REG S	11,380	15.11	171,951.80	
		SOUTHERN COPPER CORP	4,242	46.67	197,974.14	
		LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR	15,800	10.99	173,642.00	
DP WORLD LTD	8,460	22.47	190,096.20			
HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	7,100	47.16	334,836.00			

YUM CHINA HOLDINGS INC	19,200	40.18	771,456.00	
CTRIP.COM INTERNATIONAL -ADR	20,800	49.00	1,019,200.00	
JD.COM INC-ADR	39,200	40.82	1,600,144.00	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	21,800	11.37	247,866.00	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	20,570	16.74	344,444.65	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	6,640	27.92	185,388.80	
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	4,000	25.25	101,000.00	
BANCO DE CHILE-ADR	2,251	94.25	212,156.75	
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	9,596	32.00	307,072.00	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	6,400	46.74	299,136.00	
CREDICORP LTD	3,600	219.85	791,460.00	
ITAU CORPBANCA-ADR	5,466	15.14	82,755.24	
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	586,300	3.30	1,936,431.64	
STATE BANK OF INDIA-GDR	9,700	39.50	383,150.00	
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	1.45	128,143.62	
58.COM INC-ADR	5,000	78.71	393,550.00	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	62,700	202.21	12,678,567.00	
AUTOHOME INC-ADR	3,200	114.52	366,464.00	
BAIDU INC - SPON ADR	14,900	260.50	3,881,450.00	
FANG HOLDINGS LTD-ADR	11,400	4.19	47,766.00	
MOMO INC-SPON ADR	5,500	50.88	279,840.00	
NETEASE INC-ADR	4,400	254.19	1,118,436.00	
SINA CORP	3,400	88.00	299,200.00	
WEIBO CORP-SPON ADR	2,500	98.65	246,625.00	
YY INC-ADR	2,400	112.02	268,848.00	
GDS HOLDINGS LTD-ADR	3,200	43.02	137,664.00	
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	28,650	8.69	248,968.50	
ENEL AMERICAS S.A-ADR	31,741	9.38	297,730.58	
ENEL CHILE SA-ADR	30,925	5.08	157,099.00	
INTER RAO UES PJSC	1,669,000	0.06	107,817.40	
PJSC RUSHYDRO	4,691,000	0.01	49,443.14	
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	85,170	1.72	146,893.55	
NOAH HLDS LTD ADR	1,500	55.87	83,805.00	
NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	7,700	102.53	789,481.00	
TAL EDUCATION GROUP-ADR	17,400	39.37	685,038.00	

	51JOB INC-ADR	1,300	104.63	136,019.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	40,840	1.40	57,380.20	
小計	銘柄数：59			39,056,702.76	
				(4,298,190,138)	
	組入時価比率：13.2%			13.7%	
メキシコペソ	MEXICHEM SAB DE CV-*	60,458	55.93	3,381,415.94	
	CEMEX SAB - CPO	795,885	12.55	9,988,356.75	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	180,383	57.42	10,357,591.86	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	341.40	2,871,174.00	
	ALFA S.A.B.-A	172,100	22.03	3,791,363.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	20,700	62.21	1,287,747.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	11,200	321.87	3,604,944.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	21,400	186.16	3,983,824.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	12,900	179.97	2,321,613.00	
	ALSEA SAB DE CV	30,000	63.68	1,910,400.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	137,100	71.04	9,739,584.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,800	120.10	1,297,080.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	292,300	52.42	15,322,366.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	26,100	122.87	3,206,907.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB-SER L	25,995	113.27	2,944,453.65	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	102,500	168.93	17,315,325.00	
	GRUMA S.A.B.-B	10,500	238.32	2,502,360.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	90,500	36.78	3,328,590.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	79,500	31.12	2,474,040.00	
	BANCO SANTANDER MEXICO-B	93,100	26.76	2,491,356.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	141,700	111.47	15,795,299.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	140,200	28.16	3,948,032.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	1,796,800	16.17	29,054,256.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	26,100	83.28	2,173,608.00	
小計	銘柄数：24			155,091,686.20	
				(840,596,939)	
	組入時価比率：2.6%			2.7%	
リアル	COSAN SA INDUSTRIA E COMERCIO	9,100	35.00	318,500.00	
	PETROBRAS - PETROLEO BRAS	168,100	17.65	2,966,965.00	
	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	220,600	15.10	3,331,060.00	
	ULTRAPAR PARTICIPACOES	19,600	45.20	885,920.00	

BRASKEM SA-PREF A	8,400	51.22	430,248.00
KLABIN SA-UNIT	30,200	19.65	593,430.00
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	30,300	7.55	228,765.00
GERDAU SA PFD NPV	56,100	13.99	784,839.00
VALE SA	170,421	47.21	8,045,575.41
FIBRIA CELULOSE SA	14,873	71.21	1,059,106.33
SUZANO PAPEL E CELULOSE SA	26,100	43.58	1,137,438.00
EMBRAER SA	41,000	24.12	988,920.00
WEG SA	40,924	15.47	633,094.28
LOCALIZA RENT A CAR	30,334	22.20	673,414.80
RUMO SA	58,100	13.00	755,300.00
CCR SA	69,000	9.80	676,200.00
LOJAS AMERICANAS S.A. (PREF)	38,792	15.70	609,034.40
LOJAS RENNER S.A.	40,250	28.57	1,149,942.50
MAGAZINE LUIZA SA	4,100	121.61	498,601.00
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	19,000	16.97	322,430.00
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	19,000	15.12	287,280.00
CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF	8,403	77.34	649,888.02
RAIA DROGASIL SA	13,500	68.23	921,105.00
AMBEV SA	251,356	18.13	4,557,084.28
BRF SA	22,700	19.11	433,797.00
JBS SA	48,400	9.32	451,088.00
M DIAS BRANCO SA	5,500	38.00	209,000.00
NATURA COSMETICOS SA	8,700	30.40	264,480.00
ODONTOPREV S.A.	10,600	12.50	132,500.00
HYPERA SA	17,500	28.04	490,700.00
BANCO BRADESCO S.A.	55,176	23.11	1,275,117.36
BANCO BRADESCO SA - PREF	179,213	25.65	4,596,813.45
BANCO DO BRASIL SA	47,300	26.01	1,230,273.00
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	29.35	716,140.00
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	173,294	39.04	6,765,397.76
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	232,217	8.91	2,069,053.47
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	36,800	24.13	887,984.00
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	5,900	47.42	279,778.00
PORTO SEGURO SA	7,000	39.33	275,310.00

	SUL AMERICA SA - UNITS	9,149	18.00	164,682.00	
	CIELO SA	73,763	15.88	1,171,356.44	
	TELEFONICA BRASIL-PREF	25,105	44.76	1,123,699.80	
	TIM PARTICIPACOES SA	46,552	12.85	598,193.20	
	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	11,800	14.72	173,696.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	11,100	12.38	137,418.00	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	40,229	6.61	265,913.69	
	EDP - ENERGIAS DO BRASIL SA	15,600	13.45	209,820.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	11,700	57.35	670,995.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	19,000	23.09	438,710.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	115,233	19.57	2,255,109.81	
	KROTON EDUCACIONAL SA	83,456	9.64	804,515.84	
	ENGIE BRASIL SA	9,600	33.42	320,832.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	46,700	9.00	420,300.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	3,800	52.94	201,172.00	
小計	銘柄数：54			61,537,986.84	
				(1,796,909,215)	
	組入時価比率：5.5%			5.7%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	22,100	9,901.60	218,825,360.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	2,413.70	173,668,128.70	
	S.A.C.I. FALABELLA	36,800	5,948.60	218,908,480.00	
	CENCOSUD SA	80,738	1,684.20	135,978,939.60	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	15,400	2,635.70	40,589,780.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,223	42,357.00	94,159,611.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	8,972	6,200.40	55,629,988.80	
	AGUAS ANDINAS SA-A	125,600	365.95	45,963,320.00	
	COLBUN SA	471,000	139.84	65,864,640.00	
小計	銘柄数：9			1,049,588,248.10	
				(180,319,261)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
コロンビアペソ	CEMENTOS ARGOS SA	21,600	9,520.00	205,632,000.00	
	GRUPO ARGOS SA	15,600	19,320.00	301,392,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	12,000	34,060.00	408,720,000.00	
	GRUPO AVAL ACCIONES-PFD	205,700	1,205.00	247,868,500.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	36,600.00	475,800,000.00	

	GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF	5,200	34,840.00	181,168,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	23,500	13,700.00	321,950,000.00	
小計	銘柄数：7			2,142,530,500.00	
				(79,916,387)	
	組入時価比率：0.2%			0.3%	
ユーロ	TITAN CEMENT CO	2,570	21.85	56,154.50	
	OPAP SA	13,190	9.37	123,590.30	
	FF GROUP	2,030	4.80	9,744.00	
	JUMBO SA	5,202	13.30	69,186.60	
	ALPHA BANK A.E.	76,409	1.96	149,761.64	
	EUROBANK ERGASIAS SA	106,978	0.96	103,233.77	
	NATIONAL BANK OF GREECE	297,986	0.28	85,164.39	
	PIRAEUS BANK S.A.	13,081	3.04	39,766.24	
	HELLENIC TELECOM	13,060	10.25	133,865.00	
小計	銘柄数：9			770,466.44	
				(98,419,383)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	6,730	111.70	751,741.00	
	PETKIM PETROKIMYA HOLDING AS	37,600	4.69	176,344.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	78,250	10.46	818,495.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	10,040	21.26	213,450.40	
	KOC HLDGS	40,504	14.40	583,257.60	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	42,345	4.08	172,767.60	
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,186	12.96	417,130.56	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,660	22.78	220,054.80	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	3,320	66.20	219,784.00	
	TOFAS TURK OTOMOBIL FABRIKA	5,920	25.18	149,065.60	
	ARCELIK A.S	14,543	16.05	233,415.15	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	12,690	65.25	828,022.50	
	ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYI I	12,740	23.40	298,116.00	
	COCA-COLA ICECEK AS	4,510	33.08	149,190.80	
	ULKER BISKUVI SANAYI AS	8,970	18.50	165,945.00	
	AKBANK T.A.S	119,500	7.25	866,375.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	112,160	8.39	941,022.40	
	TURKIYE HALK BANKASI	32,890	7.41	243,714.90	

	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	5.94	545,292.00	
	TURKIYE VAKIFLAR BANKASI T-D	41,720	4.88	203,593.60	
	YAPI VE KREDI BANKASI A.S.	84,782	2.34	198,389.88	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	47,880	8.70	416,556.00	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	59,780	11.70	699,426.00	
小計	銘柄数：23			9,511,149.79	
				(220,944,009)	
	組入時価比率：0.7%			0.7%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	4,010	911.00	3,653,110.00	
	MONETA MONEY BANK AS	27,300	75.50	2,061,150.00	
	O2 CZECH REPUBLIC AS	2,750	255.00	701,250.00	
	CEZ AS	9,530	556.00	5,298,680.00	
小計	銘柄数：4			11,714,190.00	
				(57,868,098)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	20,520	2,582.00	52,982,640.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	8,470	5,065.00	42,900,550.00	
	OTP BANK NYRT	11,960	9,850.00	117,806,000.00	
小計	銘柄数：3			213,689,190.00	
				(83,659,317)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
ズロチ	GRUPA LOTOS SA	4,709	54.28	255,604.52	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	17,050	83.00	1,415,150.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	97,770	5.68	555,333.60	
	GRUPA AZOTY SA	2,330	44.54	103,778.20	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	2,570	79.72	204,880.40	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	7,630	86.06	656,637.80	
	CCC SA	1,520	218.20	331,664.00	
	LPP SA	70	8,990.00	629,300.00	
	CYFROWY POLSAT SA	11,670	22.60	263,742.00	
	DINO POLSKA SA	2,410	102.00	245,820.00	
	ALIOR BANK SA	4,843	67.50	326,902.50	
	BANK HANDLOWY W WARSZAWIE SA	2,010	67.30	135,273.00	
	BANK MILLENNIUM SA	35,830	8.00	286,640.00	
	BANK PEKAO SA	8,920	114.50	1,021,340.00	
	BANK ZACHODNI WBK SA	2,030	340.00	690,200.00	

	MBANK	900	399.20	359,280.00	
	PKO BANK POLSKI SA	44,810	37.86	1,696,506.60	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	33,010	38.77	1,279,797.70	
	CD PROJEKT RED SA	4,080	164.10	669,528.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	4.65	182,047.50	
	PLAY COMMUNICATIONS SA	5,600	26.12	146,272.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	9.46	489,365.80	
小計	銘柄数：22			11,945,063.62	
				(352,618,278)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
香港ドル	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	100,000	7.11	711,000.00	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	112,000	3.37	377,440.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,404,900	7.10	9,974,790.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	181,000	20.55	3,719,550.00	
	CNOOC LTD	954,000	12.44	11,867,760.00	
	KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	186,000	6.92	1,287,120.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,114,000	5.77	6,427,780.00	
	YANZHOU COAL MINING-H	96,000	10.78	1,034,880.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	206,000	4.90	1,009,400.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	73,000	46.65	3,405,450.00	
	BBMG CORPORATION - H	127,000	2.98	378,460.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	235,000	8.80	2,068,000.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	106,000	8.63	914,780.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	3.63	762,300.00	
	ANGANG STEEL CO LTD-H	58,000	7.99	463,420.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	180,000	3.93	707,400.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDING LTD	88,800	4.20	372,960.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	60,000	10.54	632,400.00	
	MMG LTD	132,000	5.83	769,560.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	57,000	5.93	338,010.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO-H	347,000	3.14	1,089,580.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	8.25	643,500.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	10.92	1,102,920.00	
	AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	112,000	4.53	507,360.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	249,000	8.12	2,021,880.00	

CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	230,000	6.16	1,416,800.00
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	96,000	8.32	798,720.00
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	101,250	9.05	916,312.50
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	156,000	2.27	354,120.00
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	8.01	572,715.00
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	126,000	2.70	340,200.00
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	33,600	10.00	336,000.00
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	28,500	37.65	1,073,025.00
CITIC LTD	331,000	10.94	3,621,140.00
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	133,940	15.70	2,102,858.00
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	30,000	19.14	574,200.00
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	99,500	29.00	2,885,500.00
CHINA INTERNATIONAL MARINE CONTAINERS -H	23,300	10.36	241,388.00
CRRC CORP LTD-H	223,350	6.26	1,398,171.00
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	32,000	19.32	618,240.00
SINOTRUK HONG KONG LTD	37,500	13.82	518,250.00
WEICHAI POWER CO LTD-H	117,800	10.94	1,288,732.00
BOC AVIATION LTD	11,300	49.80	562,740.00
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	122,000	10.24	1,249,280.00
SINOTRANS LIMITED-H	111,000	4.12	457,320.00
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	8.97	914,940.00
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	76,000	6.18	469,680.00
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	7.90	837,400.00
COSCO SHIPPING DEVELOPMENT CO-H	204,000	1.38	281,520.00
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION-H	66,000	3.87	255,420.00
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	140,000	3.78	529,200.00
CAR INC	41,000	7.88	323,080.00
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	8.80	862,400.00
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	70,000	16.56	1,159,200.00
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	7.13	727,260.00
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.26	697,680.00
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	49,500	15.98	791,010.00

ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	64,000	7.23	462,720.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	172,000	4.15	713,800.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	24,800	27.70	686,960.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	43,000	11.60	498,800.00	
BAIC MOTOR CORPORATION LIMITED	96,000	8.05	772,800.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	160,000	14.50	2,320,000.00	
BYD CO LTD-H	35,500	47.70	1,693,350.00	
CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD-B	39,200	8.13	318,696.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	136,000	8.75	1,190,000.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	275,000	21.90	6,022,500.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	166,500	6.77	1,127,205.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	153,890	8.16	1,255,742.40	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	66,000	27.25	1,798,500.00	
SKYWORTH DIGITAL HLDGS LTD	100,000	3.76	376,000.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	62,000	43.40	2,690,800.00	
HENGTEN NETWORKS GROUP LTD	1,216,000	0.29	352,640.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	44,000	95.70	4,210,800.00	
CHINA TRAVEL INTL INV HK	118,000	3.14	370,520.00	
ALIBABA PICTURES GROUP LTD	580,000	0.90	522,000.00	
CHINA LITERATURE LTD	9,800	72.90	714,420.00	
GOME RETAIL HODINGS LTD	523,360	0.77	402,987.20	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	31,000	25.25	782,750.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	127,000	11.32	1,437,640.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	73,333	37.90	2,779,320.70	
TSING TAO BREWERY CO-H	20,000	44.95	899,000.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	114,000	3.00	342,000.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.21	30,240.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	154,000	27.70	4,265,800.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	6.03	672,345.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	118,000	18.34	2,164,120.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	70,000	9.54	667,800.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	288,000	7.37	2,122,560.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	41,000	76.10	3,120,100.00	

SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	116,000	5.74	665,840.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	21.70	1,104,530.00
SINOPHARM GROUP CO-H	69,200	32.45	2,245,540.00
3SBIO, INC	51,000	19.12	975,120.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	81,000	17.46	1,414,260.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	10.88	1,011,840.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	124,000	7.00	868,000.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	264,000	23.75	6,270,000.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	62,500	8.28	517,500.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	24,500	44.50	1,090,250.00
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	155,000	1.87	289,850.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	381,000	12.46	4,747,260.00
SSY GROUP LTD	82,000	9.14	749,480.00
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	31,000	13.14	407,340.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,587,000	3.78	5,998,860.00
BANK OF CHINA LTD-H	4,268,000	3.92	16,730,560.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	516,790	6.17	3,188,594.30
CHINA CITIC BANK-H	488,000	5.07	2,474,160.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	5,254,000	7.42	38,984,680.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	134,000	3.73	499,820.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	205,692	30.05	6,181,044.60
CHINA MINSHENG BANKING-H	289,000	7.02	2,028,780.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	137,000	5.02	687,740.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	3,743,000	6.06	22,682,580.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	151,000	5.35	807,850.00
FAR EAST HORIZON LTD	106,000	7.90	837,400.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	395,000	21.00	8,295,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	143,400	31.90	4,574,460.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	308,000	1.71	526,680.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	88,872	26.80	2,381,769.60
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	47,400	34.55	1,637,670.00
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	423,000	3.75	1,586,250.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	260,280	13.24	3,446,107.20

PING AN INSURANCE GROUP CO-H	280,500	76.10	21,346,050.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	8,900	51.90	461,910.00	
TENCENT HOLDINGS LTD	309,300	396.80	122,730,240.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	48,000	21.90	1,051,200.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	108,000	8.00	864,000.00	
KINGSOFT CORP LTD	46,000	23.40	1,076,400.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	33,000	11.56	381,480.00	
ZTE CORP-H	33,852	11.70	396,068.40	
LEGEND HLDS CORP	18,100	22.95	415,395.00	
LENOVO GROUP LTD	426,000	4.18	1,780,680.00	
MEITU INC	63,000	6.80	428,400.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	41,000	115.40	4,731,400.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	80,000	5.34	427,200.00	
KINGBOARD CHEMICAL HOLDINGS	32,000	29.45	942,400.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	58,500	9.60	561,600.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	39,000	143.00	5,577,000.00	
GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	724,200	0.73	528,666.00	
HANERGY THIN FILM POWER GROUP LTD	367,000	0.05	19,451.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	176,000	11.16	1,964,160.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	162,000	2.59	419,580.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	126,400	4.82	609,248.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	766,000	3.53	2,703,980.00	
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	340,000	9.68	3,291,200.00	
CHINA MOBILE LTD	331,000	68.55	22,690,050.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	27,000	39.95	1,078,650.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	100,000	31.80	3,180,000.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	52,000	30.10	1,565,200.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	44,000	75.45	3,319,800.00	
TOWNGAS CHINA COMPANY LTD	53,000	7.35	389,550.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	317,000	4.29	1,359,930.00	
GUANGDONG INVESTMENT	154,000	12.52	1,928,080.00	
CHONG SING HOLDINGS FINTECH	920,000	0.90	828,000.00	

GROUP LTD				
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	443,000	2.69	1,191,670.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	48,000	15.64	750,720.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	183,500	4.21	772,535.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	592,000	2.48	1,468,160.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	56,400	14.48	816,672.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	123,000	16.30	2,004,900.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	11.54	953,204.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	32,600	16.54	539,204.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	172,400	8.21	1,415,404.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	92,200	13.06	1,204,132.00	
CGN POWER CO LTD-H	627,000	2.08	1,304,160.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	159,000	6.82	1,084,380.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	240,000	1.94	465,600.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	108,000	14.16	1,529,280.00	
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN-H	166,000	2.40	398,400.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	88,000	3.10	272,800.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	5.28	1,256,640.00	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	226,000	2.80	632,800.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	156,000	7.26	1,132,560.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	42,000	22.75	955,500.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	26,500	86.70	2,297,550.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	15.28	1,436,320.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	134,000	21.80	2,921,200.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	300,000	4.22	1,266,000.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	210,000	26.90	5,649,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	156,444	27.60	4,317,854.40	
CHINA VANKE CO LTD-H	64,400	29.35	1,890,140.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	196,000	5.94	1,164,240.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	412,380	15.52	6,400,137.60	
FULLSHARE HOLDINGS LIMITED	390,000	3.56	1,388,400.00	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HLD LTD	96,000	7.65	734,400.00	
GREENTOWN CHINA HOLDINGS	47,000	11.28	530,160.00	

	GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	50,400	17.10	861,840.00	
	JIAYUAN INTL GROUP LTD	54,000	14.08	760,320.00	
	KAISA GROUP HLDS LTD	115,000	3.81	438,150.00	
	KWG PROPERTY HOLDING LTD	68,500	11.50	787,750.00	
	LOGAN PROPERTY HLDS CO LTD	74,000	11.80	873,200.00	
	LONGFOR PROPERTIES	80,000	22.75	1,820,000.00	
	SHENZHEN INVESTMENT LTD	176,000	2.99	526,240.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	72,000	23.10	1,663,200.00	
	SHUI ON LAND LTD	197,000	2.08	409,760.00	
	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	146,000	4.99	728,540.00	
	SOHO CHINA LTD	106,000	3.87	410,220.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	140,000	30.65	4,291,000.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	370,000	1.58	584,600.00	
	YUZHOU PROPERTIES CO LTD	91,000	5.01	455,910.00	
小計	銘柄数：201			549,255,754.90	
				(7,706,058,241)	
	組入時価比率：23.6%			24.6%	
リング	DIALOG GROUP BHD	219,344	3.11	682,159.84	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	14,500	24.12	349,740.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	138,200	8.40	1,160,880.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	81,100	4.18	338,998.00	
	GAMUDA BERHAD	100,200	3.22	322,644.00	
	IJM CORP	152,600	1.81	276,206.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	9.73	328,874.00	
	SIME DARBY BERHAD	122,800	2.43	298,404.00	
	AIRASIA GROUP BHD	86,600	3.12	270,192.00	
	MISC BHD	41,960	6.00	251,760.00	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	41,660	8.79	366,191.40	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	3.34	171,676.00	
	UMW HOLDINGS BHD	21,300	6.24	132,912.00	
	GENTING BHD	124,000	8.57	1,062,680.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	163,200	4.93	804,576.00	
	ASTRO MALAYSIA HOLDINGS BHD	69,300	1.60	110,880.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	38.30	294,910.00	
	FELDA GLOBAL VENTURES	73,300	1.50	109,950.00	

	GENTING PLANTATIONS BHD	14,600	9.56	139,576.00	
	IOI CORP	79,500	4.61	366,495.00	
	KUALA LUMPUR KEPONG	18,900	23.78	449,442.00	
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	3,600	147.00	529,200.00	
	PPB GROUP BERHAD	29,200	19.52	569,984.00	
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	5.35	772,005.00	
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	7,800	36.08	281,424.00	
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	74,400	5.80	431,520.00	
	TOP GLOVE CORP BHD	42,100	11.36	478,256.00	
	IHH HEALTHCARE BHD	124,900	5.90	736,910.00	
	ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	54,800	4.17	228,516.00	
	AMMB HOLDING	80,800	3.70	298,960.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	252,500	5.83	1,472,075.00	
	HONG LEONG BANK	37,460	17.90	670,534.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	17.90	240,253.80	
	MALAYAN BANKING	195,800	9.17	1,795,486.00	
	PUBLIC BANK BHD	162,460	22.62	3,674,845.20	
	RHB BANK BHD	46,223	5.48	253,302.04	
	MY EG SERVICES BHD	129,400	1.00	129,400.00	
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	3.14	194,680.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	144,800	4.33	626,984.00	
	DIGI.COM BERHAD	175,400	4.28	750,712.00	
	MAXIS BHD	116,600	5.57	649,462.00	
	TENAGA NASIONAL	162,100	13.94	2,259,674.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	36,500	17.24	629,260.00	
	YTL CORPORATION	210,847	1.13	238,257.11	
	IOI PROPERTIES GROUP BHD	70,540	1.56	110,042.40	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	122,800	1.17	143,676.00	
	SP SETIA BHD	87,500	2.93	256,375.00	
小計	銘柄数：47			26,710,939.79	
				(733,482,406)	
	組入時価比率：2.2%			2.3%	
パーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	122,000	20.00	2,440,000.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	63,100	33.50	2,113,850.00	
	IRPC PCL - NVDR	527,900	6.00	3,167,400.00	

	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	75,500	126.00	9,513,000.00	
	PTT PCL-NVDR	583,000	47.50	27,692,500.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	60,300	78.25	4,718,475.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	84,867	54.50	4,625,251.50	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	128,294	80.25	10,295,593.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	22,800	408.00	9,302,400.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	311,600	9.25	2,882,300.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	220,200	64.25	14,147,850.00	
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	7.70	3,442,670.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	116,200	32.50	3,776,500.00	
	ROBINSON PCL -NVDR	26,100	57.25	1,494,225.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	242,597	13.60	3,299,319.20	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	51.25	3,777,125.00	
	CP ALL PCL-NVDR	262,700	76.75	20,162,225.00	
	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	151,400	24.60	3,724,440.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	112,800	16.30	1,838,640.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	208,300	25.50	5,311,650.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	20,800	181.00	3,764,800.00	
	BANGKOK BANK(F)	13,500	201.00	2,713,500.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	36,500	194.00	7,081,000.00	
	KASIKORNBANK PCL(F)	65,200	203.00	13,235,600.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	184,250	17.10	3,150,675.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	93,400	129.50	12,095,300.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	649,400	2.32	1,506,608.00	
	DELTA ELECTRONICS THAI-NVDR	30,700	60.50	1,857,350.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	597,200	6.05	3,613,060.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	56,200	186.00	10,453,200.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	6,700	229.00	1,534,300.00	
	GLOW ENERGY PCL - NVDR	26,100	94.25	2,459,925.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	75,900	70.25	5,331,975.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	162,300	11.50	1,866,450.00	
小計	銘柄数：34			208,389,157.20	
				(696,019,785)	
	組入時価比率：2.1%			2.2%	
フィリピンペン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	100,500	57.00	5,728,500.00	

	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	218,900	12.34	2,701,226.00	
	DMCI HOLDINGS INC	178,000	9.99	1,778,220.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	173,700	50.50	8,771,850.00	
	SM INVESTMENTS CORP	13,415	866.00	11,617,390.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	26,960	79.00	2,129,840.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	24,400	270.00	6,588,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	50,800	112.80	5,730,240.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	53,599	90.50	4,850,709.50	
	BDO UNIBANK INC	106,298	126.00	13,393,548.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	47,545	72.50	3,447,012.50	
	SECURITY BANK CORP	12,000	200.00	2,400,000.00	
	AYALA CORPORATION	14,472	901.00	13,039,272.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	4,890	920.00	4,498,800.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	4.62	3,454,836.00	
	GLOBE TELECOM INC	1,470	1,580.00	2,322,600.00	
	PLDT INC	4,970	1,150.00	5,715,500.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	11,000	337.00	3,707,000.00	
	ABOITIZ POWER CORP	76,700	36.00	2,761,200.00	
	AYALA LAND LTD	365,200	37.05	13,530,660.00	
	MEGAWORLD CORP	558,000	4.43	2,471,940.00	
	ROBINSONS LAND CO	92,868	19.26	1,788,637.68	
	SM PRIME HLDGS	527,075	32.90	17,340,767.50	
小計	銘柄数：23			139,767,749.18	
				(287,921,563)	
	組入時価比率：0.9%			0.9%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	2,010.00	1,686,792,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	99,150	33,375.00	3,309,131,250.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	101,200	14,700.00	1,487,640,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	148,900	7,775.00	1,157,697,500.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	148,600	20,025.00	2,975,715,000.00	
	WASKITA KARYA PERSERO TBK PT	258,500	2,130.00	550,605,000.00	
	AKR CORPORINDO TBK PT	75,300	4,150.00	312,495,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	113,559	4,420.00	501,930,780.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,047,100	6,675.00	6,989,392,500.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	345,500	2,220.00	767,010,000.00	

	MATAHARI DEPARTMENT STORE TBK	142,800	8,575.00	1,224,510,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	119,600	8,250.00	986,700,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	266,200	6,525.00	1,736,955,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	410,500	3,750.00	1,539,375,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	67,550.00	1,972,460,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	485,300	3,430.00	1,664,579,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	89,100	44,200.00	3,938,220,000.00	
	KALBE FARMA PT	1,100,000	1,250.00	1,375,000,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	519,400	21,150.00	10,985,310,000.00	
	BANK DANAMON PT	165,196	6,000.00	991,176,000.00	
	BANK MANDIRI	1,022,700	6,700.00	6,852,090,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	413,600	7,400.00	3,060,640,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,114,500	2,910.00	9,063,195,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	208,000	2,800.00	582,400,000.00	
	TELEKOMUNIKASI	2,636,300	3,610.00	9,517,043,000.00	
	TOWER BERSAMA INFRASTRUCTURE	88,700	4,900.00	434,630,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA PT	593,500	2,090.00	1,240,415,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	428,300	1,615.00	691,704,500.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	920,000	525.00	483,000,000.00	
小計	銘柄数：29			78,077,811,530.00	
				(609,006,929)	
	組入時価比率：1.9%			1.9%	
ウォン	GS HOLDINGS CORP	2,530	54,500.00	137,885,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,690	111,000.00	298,590,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,710	204,000.00	756,840,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	6,330	21,900.00	138,627,000.00	
	HYOSUNG CORPORATION	1,210	134,000.00	162,140,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	998	111,000.00	110,778,000.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	384	208,500.00	80,064,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	2,536	349,500.00	886,332,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	850	345,500.00	293,675,000.00	
	OCI COMPANY LTD	860	107,500.00	92,450,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	4,779	54,700.00	261,411,300.00	
	KOREA ZINC CO LTD	460	376,500.00	173,190,000.00	
	POSCO	4,170	339,000.00	1,413,630,000.00	
		3,370	40,750.00	137,327,500.00	

KOREA AEROSPACE INDUSTRIES				
KCC CORP	309	326,000.00	100,734,000.00	
DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	1,600	79,300.00	126,880,000.00	
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	9,690	5,830.00	56,492,700.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	2,888	44,500.00	128,516,000.00	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	2,366	56,000.00	132,496,000.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	4,650	60,800.00	282,720,000.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,520	14,900.00	126,948,000.00	
DOOSAN HEAVY INDUSTRIES	1,770	15,500.00	27,435,000.00	
CJ CORP	687	140,000.00	96,180,000.00	
HANWHA CORPORATION	2,470	31,850.00	78,669,500.00	
LG CORP	5,290	70,600.00	373,474,000.00	
LOTTE CORP	1,620	56,300.00	91,206,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	4,248	115,500.00	490,644,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	1,622	257,500.00	417,665,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	1,430	31,000.00	44,330,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES	1,917	106,500.00	204,160,500.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	597	367,500.00	219,397,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	17,117	6,960.00	119,134,320.00	
POSCO DAEWOO CORP	1,809	20,350.00	36,813,150.00	
KEPCO PLANT SERVICE & ENGINEERING CO LTD	1,340	34,950.00	46,833,000.00	
S-1 CORPORATION	820	93,800.00	76,916,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,140	120,000.00	136,800,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,576	28,100.00	72,385,600.00	
PAN OCEAN CO LTD	8,710	4,795.00	41,764,450.00	
CJ LOGISTICS	390	158,500.00	61,815,000.00	
HANKOOK TIRE CO LTD/NEW	3,923	43,700.00	171,435,100.00	
HANON SYSTEMS	8,590	10,700.00	91,913,000.00	
HYUNDAI MOBIS	3,790	217,000.00	822,430,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	8,170	127,000.00	1,037,590,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	1,920	89,000.00	170,880,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	81,700.00	120,099,000.00	
KIA MOTORS CORP	13,410	30,800.00	413,028,000.00	
COWAY CO LTD	2,690	86,700.00	233,223,000.00	

HANSSEM CO LTD	560	106,000.00	59,360,000.00	
LG ELECTRONICS INC	6,045	82,000.00	495,690,000.00	
HLB INC	1,680	96,500.00	162,120,000.00	
KANGWON LAND INC	6,200	27,300.00	169,260,000.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	3,320	20,300.00	67,396,000.00	
CJ E&M CORP	1,090	95,400.00	103,986,000.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	600	109,500.00	65,700,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	544	203,500.00	110,704,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	427	389,000.00	166,103,000.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,672	122,500.00	204,820,000.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	192,000.00	93,120,000.00	
DONGSUH COMPANIES INC	1,650	26,050.00	42,982,500.00	
E-MART CO	1,181	238,000.00	281,078,000.00	
GS RETAIL CO LTD	1,140	40,850.00	46,569,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	400	350,000.00	140,000,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,131	152,000.00	171,912,000.00	
OTTOGI CORPORATION	70	821,000.00	57,470,000.00	
KT & G CORP	6,050	102,000.00	617,100,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,830	306,500.00	560,895,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	410	147,500.00	60,475,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	118,500.00	180,120,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	519	1,449,000.00	752,031,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	752,000.00	78,208,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	2,043	108,800.00	222,278,400.00	
CELLTRION INC	4,510	292,000.00	1,316,920,000.00	
MEDY-TOX INC	220	742,200.00	163,284,000.00	
SILLAJEN INC	3,060	71,100.00	217,566,000.00	
VIROMED CO LTD	740	231,000.00	170,940,000.00	
CELLTRION PHARM INC	830	85,500.00	70,965,000.00	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	330	403,000.00	132,990,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	736	63,000.00	46,368,000.00	
YUHAN CORPORATION	420	215,000.00	90,300,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	12,887	9,130.00	117,658,310.00	
DGB FINANCIAL GROUP INC	8,359	10,050.00	84,007,950.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	16,525	42,700.00	705,617,500.00	

INDUSTRIAL BK OF KOREA	15,040	15,600.00	234,624,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	21,060	52,700.00	1,109,862,000.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	22,570	43,800.00	988,566,000.00	
WOORI BANK	26,340	16,300.00	429,342,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	2,850	60,500.00	172,425,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	13,280	5,500.00	73,040,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,400	35,600.00	121,040,000.00	
ING LIFE INSURANCE KOREA LTD	1,610	40,800.00	65,688,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	1,680	262,000.00	440,160,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,000	98,800.00	395,200,000.00	
KAKAO CORP	2,610	107,000.00	279,270,000.00	
NAVER CORP	1,480	699,000.00	1,034,520,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,040	203,000.00	414,120,000.00	
NCSOFT CORPORATION	1,010	363,000.00	366,630,000.00	
NETMARBLE CORP	1,470	150,500.00	221,235,000.00	
PEARL ABYSS CORP	310	216,200.00	67,022,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS	261,180	47,050.00	12,288,519,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	45,960	37,150.00	1,707,414,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	860	146,000.00	125,560,000.00	
LG.DISPLAY CO LTD	13,100	18,950.00	248,245,000.00	
SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	3,320	154,500.00	512,940,000.00	
SAMSUNG SDI CO,LTD	3,185	226,000.00	719,810,000.00	
SK HYNIX INC	31,350	88,500.00	2,774,475,000.00	
KT CORP	880	27,950.00	24,596,000.00	
SK TELECOM CO LTD	1,080	243,000.00	262,440,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER	13,740	32,900.00	452,046,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	1,599	60,400.00	96,579,600.00	
SAMSUNG CARD CO	1,360	36,750.00	49,980,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	2,250	84,600.00	190,350,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	18,677	8,690.00	162,303,130.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	15,150.00	117,109,500.00	
SAMSUNG SECURITIES	3,565	35,700.00	127,270,500.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	890	415,000.00	369,350,000.00	
小計銘柄数：115			46,261,674,010.00	
			(4,598,410,396)	

	組入時価比率：14.1%			14.6%
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	72,360	119.50	8,647,020.00
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	197,998	115.50	22,868,769.00
	FORMOSA PLASTIC	238,424	108.50	25,869,004.00
	NAN YA PLASTICS CORP	289,726	84.20	24,394,929.20
	ASIA CEMENT	126,980	33.25	4,222,085.00
	TAIWAN CEMENT	196,323	44.75	8,785,454.25
	CHINA STEEL	691,544	23.65	16,355,015.60
	TECO ELECTRIC & MACHINERY	91,000	23.25	2,115,750.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	176,454	28.80	5,081,875.20
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	6,000	436.00	2,616,000.00
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	12,082	355.50	4,295,151.00
	CHINA AIRLINES	133,561	9.95	1,328,931.95
	EVA AIRWAYS CORP	88,197	15.25	1,345,004.25
	EVERGREEN MARINE	82,138	14.25	1,170,466.50
	TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	101,000	23.60	2,383,600.00
	CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	107,036	45.20	4,838,027.20
	NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	7,000	268.00	1,876,000.00
	GIANT MANUFACTURING	13,752	125.00	1,719,000.00
	ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,443	350.00	4,005,050.00
	FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	20,315	138.00	2,803,470.00
	FORMOSA TAFFETA CO.	32,000	33.90	1,084,800.00
	POU CHEN CORP	135,468	35.80	4,849,754.40
	RUENTEX INDUSTRIES LTD	33,785	62.90	2,125,076.50
	HOTAI MOTOR COMPANY LTD	16,000	278.00	4,448,000.00
	PRESIDENT CHAIN STORE CORP	32,816	334.00	10,960,544.00
	STANDARD FOODS CORP	27,079	62.60	1,695,145.40
	UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	251,836	77.00	19,391,372.00
	TAIMED BIOLOGICS INC	11,000	301.00	3,311,000.00
	CHANG HWA COMMERCIAL BANK	280,948	17.65	4,958,732.20
	CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	710,789	11.10	7,889,757.90
CTBC FINANCIAL HOLDING	979,212	21.70	21,248,900.40	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	459,565	21.05	9,673,843.25	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	536,308	20.50	10,994,314.00	

HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	345,036	17.60	6,072,633.60	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	601,380	26.60	15,996,708.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	591,715	11.15	6,597,622.25	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	521,128	14.50	7,556,356.00	
TAIWAN BUSINESS BANK	172,451	9.53	1,643,458.03	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	462,789	17.75	8,214,504.75	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	64,632	104.50	6,754,044.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	367,541	53.90	19,810,459.90	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	447,510	55.90	25,015,809.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	120,949	31.95	3,864,320.55	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	440,547	11.80	5,198,454.60	
ACER INC	160,767	26.35	4,236,210.45	
ADVANTECH CO.,LTD.	18,594	203.50	3,783,879.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	38,805	278.50	10,807,192.50	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	37,840	342.50	12,960,200.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	29,498	69.30	2,044,211.40	
COMPAL ELECTRONICS	244,590	19.45	4,757,275.50	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	74.00	4,057,716.00	
HTC CORPORATION	32,792	56.50	1,852,748.00	
INVENTEC CO.,LTD	136,911	24.90	3,409,083.90	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	108,897	38.00	4,138,086.00	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	33,000	104.50	3,448,500.00	
PEGATRON CORP	94,692	66.00	6,249,672.00	
QUANTA COMPUTER INC	148,684	54.00	8,028,936.00	
WISTRON CORP	151,993	22.85	3,473,040.05	
AU OPTRONICS CORP	489,008	13.25	6,479,356.00	
DELTA ELECTRONICS INC	107,681	110.50	11,898,750.50	
GENERAL INTERFACE SOLUTION H	8,000	199.00	1,592,000.00	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	903,812	82.70	74,745,252.40	
INNOLUX CORP	505,322	11.35	5,735,404.70	
LARGAN PRECISION CO LTD	5,040	4,495.00	22,654,800.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	77,566	46.50	3,606,819.00	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	18,000	350.00	6,300,000.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	83,030	43.40	3,603,502.00	
YAGEO CORPORATION	12,000	987.00	11,844,000.00	

	ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	20,410	69.10	1,410,331.00	
	ASE INDUSTRIAL HOLDING CO LTD	191,658	72.60	13,914,370.80	
	GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	514.00	6,682,000.00	
	MACRONIX INTERNATIONAL	89,000	45.05	4,009,450.00	
	MEDIATEK INC	83,538	312.00	26,063,856.00	
	NANYA TECHNOLOGY CO	59,000	92.50	5,457,500.00	
	NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	34,058	142.00	4,836,236.00	
	PHISON ELECTRONICS CORP	9,306	266.00	2,475,396.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	34,147	87.80	2,998,106.60	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	21,417	114.00	2,441,538.00	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,336,000	226.50	302,604,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	602,500	17.65	10,634,125.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	46,000	68.10	3,132,600.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	21,000	238.50	5,008,500.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	144,000	19.40	2,793,600.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	209,065	109.50	22,892,617.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	85,000	77.70	6,604,500.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	88,200	111.00	9,790,200.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	575,377	13.90	7,997,740.30	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	39,110	46.15	1,804,926.50	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	51,678	36.00	1,860,408.00	
小計	銘柄数：89			1,023,194,850.98	
				(3,714,197,309)	
	組入時価比率：11.4%			11.8%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	44,705	421.95	18,863,274.75	
	COAL INDIA LTD	33,740	267.70	9,032,198.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	315.20	10,836,576.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	87,120	170.25	14,832,180.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	73,910	159.70	11,803,427.00	
	PETRONET LNG LTD	34,980	209.85	7,340,553.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	152,970	1,031.95	157,857,391.50	
	ASIAN PAINTS LTD	17,000	1,253.00	21,301,000.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	6,620	1,038.30	6,873,546.00	
	UPL LTD	19,540	646.00	12,622,840.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	29,920	197.00	5,894,240.00	

GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,490	1,011.95	17,699,005.50
SHREE CEMENT LIMITED	470	15,306.30	7,193,961.00
ULTRATECH CEMENT LTD	5,220	3,616.90	18,880,218.00
HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	71,770	222.30	15,954,471.00
JSW STEEL LTD	46,500	332.85	15,477,525.00
TATA STEEL LIMITED	18,606	557.75	10,377,496.50
VEDANTA LTD	63,514	229.05	14,547,881.70
LARSEN&TOUBRO LIMITED	24,575	1,289.80	31,696,835.00
BHARAT HEAVY ELECTRICALS	35,970	75.45	2,713,936.50
HAVELLS INDIA LTD	12,350	532.85	6,580,697.50
SIEMENS INDIA LIMITED	3,220	991.30	3,191,986.00
ASHOK LEYLAND LIMITED	60,650	135.10	8,193,815.00
EICHER MOTORS LTD	670	29,424.90	19,714,683.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	5,010	1,175.95	5,891,509.50
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	4,952	1,256.30	6,221,197.60
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	23,319	366.90	8,555,741.10
BHARAT FORGE LIMITED	12,700	607.45	7,714,615.00
BOSCH LTD	390	17,985.60	7,014,384.00
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	38,292	306.65	11,742,241.80
BAJAJ AUTO LIMITED	4,300	2,830.10	12,169,430.00
HERO MOTOCORP LTD	2,430	3,635.20	8,833,536.00
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	38,400	883.60	33,930,240.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	5,880	8,863.05	52,114,734.00
TATA MOTORS LTD	85,479	307.00	26,242,053.00
TITAN CO LTD	17,890	868.40	15,535,676.00
ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	27,550	563.45	15,523,047.50
AVENUE SUPERMARTS LTD	6,780	1,490.35	10,104,573.00
UNITED SPIRITS LTD	15,615	653.75	10,208,306.25
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	1,410	5,962.70	8,407,407.00
NESTLE INDIA LIMITED	1,220	9,850.40	12,017,488.00
ITC LTD	179,025	260.85	46,698,671.25
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	36,580	1,593.45	58,288,401.00
DABUR INDIA LTD	28,756	385.60	11,088,313.60
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	13,450	1,166.70	15,692,115.00
MARICO LIMITED	26,340	335.25	8,830,485.00

AUROBINDO PHARMA LTD	14,046	608.55	8,547,693.30	
CADILA HEALTHCARE LTD	8,880	412.30	3,661,224.00	
CIPLA LIMITED	20,980	603.50	12,661,430.00	
DR.REDDYS LABORATORIES	6,590	2,316.40	15,265,076.00	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	6,830	602.05	4,112,001.50	
LUPIN LTD	10,930	899.65	9,833,174.50	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	4,720	2,536.40	11,971,808.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	41,992	554.50	23,284,564.00	
AXIS BANK LIMITED	98,320	513.05	50,443,076.00	
ICICI BANK LTD	129,190	297.95	38,492,160.50	
YES BANK LTD	96,880	332.95	32,256,196.00	
RURAL ELECTRIFICATION CORP	39,810	110.50	4,399,005.00	
BAJAJ FINSERV LTD	2,320	5,991.55	13,900,396.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	30,910	902.55	27,897,820.50	
INFOSYS LTD	93,480	1,246.55	116,527,494.00	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	48,900	1,819.35	88,966,215.00	
TECH MAHINDRA LTD	26,970	685.30	18,482,541.00	
VAKRANGEE LIMITED	20,780	50.00	1,039,000.00	
WIPRO LTD	62,456	258.65	16,154,244.40	
BHARTI INFRATEL LTD	16,510	279.60	4,616,196.00	
BHARTI AIRTEL LIMITED	78,330	368.70	28,880,271.00	
IDEA CELLULAR LIMITED	114,350	60.80	6,952,480.00	
POWER GRID CORP OF INDIA LTD	85,270	195.45	16,666,021.50	
TATA POWER COMPANY LIMITED	63,864	74.55	4,761,061.20	
GAIL INDIA LTD	43,977	339.30	14,921,396.10	
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	84,540	1,858.90	157,151,406.00	
INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	13,570	1,173.25	15,921,002.50	
LIC HOUSING FINANCE	18,050	502.35	9,067,417.50	
BAJAJ FINANCE LTD	10,330	2,257.45	23,319,458.50	
MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	15,160	491.00	7,443,560.00	
SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	8,940	1,483.40	13,261,596.00	
NTPC LIMITED	118,340	155.25	18,372,285.00	
小計銘柄数：78			1,661,533,174.55	
			(2,708,299,074)	
組入時価比率：8.3%				8.6%

パキスタン ピー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	31,900	159.66	5,093,154.00	
	LUCKY CEMENT	7,800	512.26	3,995,628.00	
	HABIB BANK LTD	35,600	167.79	5,973,324.00	
	MCB BANK LIMITED	21,900	198.19	4,340,361.00	
	UNITED BANK LTD	24,200	168.73	4,083,266.00	
	小計	銘柄数：5			23,485,733.00
	組入時価比率：0.1%				0.1%
カタール リヤル	INDUSTRIES QATAR	8,930	106.90	954,617.00	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	11,790	36.50	430,335.00	
	DOHA BANK LTD	6,730	27.01	181,777.30	
	MASRAF AL RAYAN	21,160	34.65	733,194.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	6,580	117.00	769,860.00	
	QATAR NATIONAL BANK	25,056	152.00	3,808,512.00	
	QATAR INSURANCE CO	10,001	35.72	357,235.72	
	OOREDOO QSC	4,310	68.71	296,140.10	
	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	2,500	182.00	455,000.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	4,990	33.52	167,264.80	
	EZDAN HOLDING GROUP	44,190	8.10	357,939.00	
	小計	銘柄数：11			8,511,874.92
	組入時価比率：0.8%				0.8%
エジプト ポンド	ELSWEDY ELECTRIC CO	4,150	198.21	822,571.50	
	EASTERN TOBACCO	6,870	162.45	1,116,031.50	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	53,181	85.73	4,559,207.13	
	小計	銘柄数：3			6,497,810.13
	組入時価比率：0.1%				0.1%
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	13,110	122.70	1,608,597.00	
	SASOL LTD	29,430	470.84	13,856,821.20	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,960	320.31	948,117.60	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	21,570	111.09	2,396,211.30	
	GOLD FIELDS LTD	44,630	48.29	2,155,182.70	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,100	288.37	893,947.00	
	MONDI LTD	7,270	356.94	2,594,953.80	

SAPPI LIMITED	32,090	91.27	2,928,854.30
BIDVEST GROUP LTD	18,030	200.61	3,616,998.30
NASPERS LTD-N SHS	23,740	3,207.87	76,154,833.80
IMPERIAL HOLDINGS LTD	9,010	196.16	1,767,401.60
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	48,520	54.49	2,643,854.80
MR PRICE GROUP LTD	13,990	227.50	3,182,725.00
THE FOSCHINI GROUP LTD	10,440	183.34	1,914,069.60
TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	22,670	80.21	1,818,360.70
BID CORP LTD	19,200	275.00	5,280,000.00
CLICKS GROUP LTD	15,190	202.46	3,075,367.40
PICKN PAY STORES LTD	17,600	77.50	1,364,000.00
SHOPRITE HOLDINGS LTD	24,980	223.00	5,570,540.00
SPAR GROUP LIMITED/THE	10,860	186.91	2,029,842.60
PIONEER FOODS LTD	7,240	112.95	817,758.00
TIGER BRANDS LTD	8,700	330.00	2,871,000.00
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	69,273	24.94	1,727,668.62
NETCARE LTD	50,580	27.73	1,402,583.40
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	21,630	261.82	5,663,166.60
BARCLAYS AFRICA GROUP LTD	39,740	161.49	6,417,612.60
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	2,030	862.32	1,750,509.60
NEDBANK GROUP LTD	12,320	254.73	3,138,273.60
STANDARD BANK GROUP LTD	68,780	188.45	12,961,591.00
FIRSTRAND LTD	187,310	59.85	11,210,503.50
PSG GROUP LTD	8,660	214.00	1,853,240.00
REMGRO LTD	29,770	201.01	5,984,067.70
RMB HOLDINGS LTD	33,720	72.54	2,446,048.80
DISCOVERY LTD	19,790	142.55	2,821,064.50
LIBERTY HOLDINGS LTD	6,360	118.75	755,250.00
MMI HOLDINGS LTD	56,462	17.83	1,006,717.46
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	36.88	1,488,108.00
SANLAM LIMITED	98,700	71.52	7,059,024.00
TELKOM SA SOC LTD	15,970	49.09	783,967.30
MTN GROUP LTD	89,240	106.99	9,547,787.60
VODACOM GROUP	33,890	123.15	4,173,553.50
CORONATION FUND MANAGERS LTD	10,450	59.86	625,537.00

		INVESTECH LTD	15,640	95.30	1,490,492.00	
		REINET INVESTMENTS SCA	8,790	241.00	2,118,390.00	
		NEPI ROCKCASTLE PLC	19,770	121.22	2,396,519.40	
	小計	銘柄数：45			228,311,112.88	
		組入時価比率：5.7%			(1,849,320,014)	5.9%
UAE ディール ム		DUBAI INVESTMENTS PJSC	80,000	2.00	160,000.00	
		ABU DHABI COMMERCIAL BANK	119,870	7.20	863,064.00	
		DUBAI ISLAMIC BANK	102,029	5.01	511,165.29	
		FIRST ABU DHABI BANK PJSC	74,683	11.95	892,461.85	
		EMIRATES TELECOM CORPORATION	99,980	16.05	1,604,679.00	
		ALDAR PROPERTIES PJSC	177,340	2.03	360,000.20	
		DAMAC PROPERTIES DUBAI CO PJSC	100,980	2.31	233,263.80	
		EMAAR DEVELOPMENT PJSC	43,470	5.16	224,305.20	
		EMAAR MALLS PJSC	89,700	2.15	192,855.00	
		EMAAR PROPERTIES PJSC	201,630	5.20	1,048,476.00	
		小計	銘柄数：10			6,090,270.34
		組入時価比率：0.6%			(182,159,985)	0.6%
合計					31,413,324,870	
					(31,413,324,870)	

(注1)外貨建所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、外貨建所有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2) 株式以外の有価証券(2018年6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	40,000	1,093,600.00	
	小計	銘柄数：1	40,000	1,093,600.00	
		組入時価比率：0.4%		(120,350,680)	50.3%
	合計			120,350,680	
				(120,350,680)	

投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	163,100	4,398,807.00		
	小計	銘柄数：1	163,100	4,398,807.00		
		組入時価比率：0.1%			(23,841,533)	10.0%
	トルコリラ	EMLAK KONUT GAYRIMENKUL YATI	106,400	213,864.00		
	小計	銘柄数：1	106,400	213,864.00		
		組入時価比率：0.0%			(4,968,060)	2.1%
	ランド	FORTRESS REIT LTD-A		59,650	926,961.00	
		FORTRESS REIT LTD-B		43,946	659,190.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD		161,350	4,146,695.00	
		HYPROP INVESTMENTS LTD-UTS		13,650	1,385,475.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD		303,590	3,142,156.50	
		RESILIENT REIT LTD		15,092	833,833.00	
		小計	銘柄数：6	597,278	11,094,310.50	
		組入時価比率：0.3%			(89,863,915)	37.6%
合計				118,673,508		
				(118,673,508)		
合計				239,024,188		
				(239,024,188)		

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2018年 6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	978,943,722	-	925,905,675	53,038,047
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	27,661,250	-	27,505,000	156,250

米ドル	27,661,250	-	27,505,000	156,250
合計	-	-	-	52,881,797

(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。

J - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2018年 6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	591,933,530
投資証券	32,905,831,871
派生商品評価勘定	9,070,208
未収入金	10,280,900
未収配当金	150,227,902
差入委託証拠金	7,420,000
流動資産合計	33,674,764,411
資産合計	33,674,764,411
負債の部	
流動負債	
未払解約金	26,319,598
未払利息	1,355
流動負債合計	26,320,953
負債合計	26,320,953
純資産の部	
元本等	
元本	16,449,329,199
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	17,199,114,259

元本等合計	33,648,443,458
純資産合計	33,648,443,458
負債純資産合計	33,674,764,411

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 6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	2.0456円
(10,000口当たり純資産額)	(20,456円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2017年 8月31日 至 2018年 6月22日	
1. 金融商品に対する取組方針	<p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p>
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2018年 6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

2018年 6月22日現在

期首	2017年 8月31日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	14,251,841,683円
同期中における追加設定元本額	6,836,874,300円
同期中における一部解約元本額	4,639,386,784円
期末元本額	16,449,329,199円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,175,321,435円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,872,685,447円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	827,755,730円
野村資産設計ファンド2015	22,369,764円
野村資産設計ファンド2020	20,663,732円
野村資産設計ファンド2025	21,782,627円

野村資産設計ファンド2030	25,166,061円
野村資産設計ファンド2035	19,753,187円
野村資産設計ファンド2040	33,937,455円
野村資産設計ファンド2045	3,297,360円
野村インデックスファンド・J-REIT ネクストコア	2,793,656,660円 181,398,401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	568,423,387円
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	509,653,777円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	791,732,783円
野村資産設計ファンド2050	4,702,693円
インデックス・ブレンド(タイプ)	477,355円
インデックス・ブレンド(タイプ)	583,694円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,660,183円
インデックス・ブレンド(タイプ)	390,401円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,842,744円
野村6資産均等バランス	81,463,111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)	62,288,737円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	7,298,801円
ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT(適格機関投資家専用)	1,277,460,344円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	2,167,220,220円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,736,191,835円
野村DC運用戦略ファンド	1,200,458,754円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	36,597,337円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	578,967円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	504,069円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	605,974円
野村資産設計ファンド(DC)2030	111,939円
野村資産設計ファンド(DC)2040	116,740円
野村資産設計ファンド(DC)2050	177,495円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年6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(2018年6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	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,323	666,792,000	
		M C U B S M i d C i t y 投資法人 投資証券	4,441	373,044,000	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,275	607,905,000	
		産業ファンド投資法人 投資証券	4,622	560,186,400	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,685	1,050,593,500	
		ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人 投資証券	2,025	337,162,500	
		アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	1,801	907,704,000	
		G L P 投資法人 投資証券	8,262	965,001,600	
		コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,509	395,961,600	
		日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,305	1,213,784,000	
		星野リゾート・リート投資法人 投資証券	629	361,046,000	
		Oneリート投資法人 投資証券	435	110,403,000	
		イオンリート投資法人 投資証券	3,779	465,950,700	
		ヒューリックリート投資法人 投資証券	2,703	462,213,000	
		日本リート投資法人 投資証券	1,069	344,752,500	
		日本リート投資法人 投資証券（権利落ち）	37	11,622,181	
		インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	23,451	349,185,390	
		日本ヘルスケア投資法人 投資証券	193	32,752,100	
		積水ハウス・リート投資法人 投資証券	9,972	724,964,400	
		トーセイ・リート投資法人 投資証券	640	72,256,000	
		ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,447	352,778,600	
		ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	490	53,949,000	
		サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	691	66,197,800	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	11,778	1,845,612,600			
いちごホテルリート投資法人 投資	623	83,606,600			

証券			
ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,003	332,131,800	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	933	101,323,800	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	319	37,418,700	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	753	256,773,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	668	58,316,400	
さくら総合リート投資法人 投資証券	957	88,139,700	
投資法人みらい 投資証券	581	109,983,300	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	862	127,058,800	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	369	99,666,900	
CREロジスティクスファンド投資法人 投資証券	398	45,133,200	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	367	41,727,900	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,854	2,412,604,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	3,960	2,300,760,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,515	1,527,799,500	
オリックス不動産投資法人 投資証券	7,897	1,399,348,400	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,513	1,026,560,500	
プレミア投資法人 投資証券	3,595	396,528,500	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,668	401,267,200	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,528	279,849,600	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	8,778	1,515,082,800	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,844	451,911,600	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	10,916	552,349,600	

券			
フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,354	612,008,000	
平和不動産リート投資法人 投資証券	2,478	272,332,200	
日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,651	599,126,000	
福岡リート投資法人 投資証券	2,058	358,092,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,228	839,952,000	
いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,082	264,127,400	
大和証券オフィス投資法人 投資証券	858	548,262,000	
阪急リート投資法人 投資証券	1,737	236,926,800	
スターツプロシード投資法人 投資証券	627	102,138,300	
大和ハウスリート投資法人 投資証券	4,631	1,223,510,200	
ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	11,487	962,610,600	
日本賃貸住宅投資法人 投資証券	4,477	391,737,500	
ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,564	517,849,200	
小計	銘柄数：60 組入時価比率：97.8%	201,695 32,905,831,871 100.0%	
合計		32,905,831,871	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2018年 6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	728,432,000	-	737,548,000	9,070,208
合計	728,432,000	-	737,548,000	9,070,208

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

海外REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2018年6月22日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	149,705,667
コール・ローン	28,537,814
投資証券	20,679,785,053
派生商品評価勘定	820,973
未収入金	187,345
未収配当金	45,667,439
差入委託証拠金	24,596,559
流動資産合計	20,929,300,850
資産合計	20,929,300,850
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	143,113
未払金	96,994,747
未払解約金	5,169,057
未払利息	65
その他未払費用	489,200
流動負債合計	102,796,182
負債合計	102,796,182
純資産の部	
元本等	
元本	9,374,626,241
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	11,451,878,427
元本等合計	20,826,504,668
純資産合計	20,826,504,668
負債純資産合計	20,929,300,850

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	投資証券 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
--------------------	---

	<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)

2018年 6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	2.2216円
(10,000口当たり純資産額)	(22,216円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2017年 8月31日 至 2018年 6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>

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2018年 6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

2018年 6月22日現在

期首	2017年 8月31日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	9,324,436,841円
同期中における追加設定元本額	2,584,852,415円
同期中における一部解約元本額	2,534,663,015円
期末元本額	9,374,626,241円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信（安定コース）	1,095,003,063円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,676,304,862円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	771,188,530円
野村資産設計ファンド2015	20,841,081円
野村資産設計ファンド2020	19,251,133円
野村資産設計ファンド2025	20,294,104円
野村資産設計ファンド2030	23,445,676円
野村資産設計ファンド2035	18,402,874円
野村資産設計ファンド2040	31,618,298円
野村資産設計ファンド2045	3,072,028円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,430,751,038円

ネクストコア	38,169,570円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	226,955,984円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	482,167,057円
野村資産設計ファンド2050	4,381,219円
インデックス・ブレンド(タイプ)	584,311円
インデックス・ブレンド(タイプ)	670,314円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,668,632円
インデックス・ブレンド(タイプ)	643,344円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,312,580円
野村6資産均等バランス	75,896,089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	452,968,038円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	120,074,407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)	347,466,683円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT(適格機関投資家専用)	1,242,141,554円
野村DC運用戦略ファンド	255,622,919円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,778,900円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	539,387円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	469,588円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	564,563円
野村資産設計ファンド(DC)2030	104,290円
野村資産設計ファンド(DC)2040	108,764円
野村資産設計ファンド(DC)2050	165,361円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年6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(2018年6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	14,000	392,700.00	
		AGREE REALTY CORP	4,900	262,983.00	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	10,800	231,984.00	
		ALEXANDERS INC	620	238,693.80	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	17,070	2,157,818.70	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	6,900	262,476.00	

AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	22,700	972,241.00	
AMERICAN HOMES 4 RENT-A	43,300	945,239.00	
AMERICOLD REALTY TRUST	7,400	164,650.00	
APARTMENT INVT&MGMT CO-A	26,200	1,101,448.00	
APPLE HOSPITALITY REIT INC	34,900	641,811.00	
ARMADA HOFFLER PROPERTIES INC	7,600	115,140.00	
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,600	110,448.00	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	22,780	3,870,549.80	
BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	38,346.00	
BOSTON PROPERTIES	25,470	3,116,763.90	
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	4,800	51,216.00	
BRANDYWINE REALTY TRUST	30,100	496,650.00	
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	50,500	889,810.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	15,380	1,409,884.60	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	12,000	201,240.00	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	28,400	171,252.00	
CEDAR REALTY TRUST INC	12,000	56,400.00	
CHATHAM LODGING TRUST	7,400	151,848.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	10,000	320,700.00	
CITY OFFICE REIT INC	6,300	79,317.00	
CLIPPER REALTY INC	2,400	20,520.00	
COLONY NORTHSTAR INC-CLASS A	82,800	531,576.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	20,000	450,400.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	2,900	84,651.00	
CORECIVIC INC	19,600	441,588.00	
CORESITE REALTY CORP	5,710	630,955.00	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	17,200	482,288.00	
COUSINS PROPERTIES INC	70,000	663,600.00	
CUBESMART	30,200	963,380.00	
CYRUSONE INC	16,520	958,655.60	
DCT INDUSTRIAL TRUST INC	15,500	1,011,530.00	
DDR CORP	25,200	450,576.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	33,500	413,725.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	34,130	3,660,783.80	
DOUGLAS EMMETT INC	26,400	1,057,320.00	

DUKE REALTY CORP	59,100	1,697,943.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	7,400	143,930.00	
EASTGROUP PROPERTIES	5,880	551,779.20	
EDUCATION REALTY TRUST INC	12,600	509,166.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	21,700	371,070.00	
EPR PROPERTIES	10,780	705,119.80	
EQUITY COMMONWEALTH	20,100	630,738.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	14,700	1,339,905.00	
EQUITY RESIDENTIAL	60,720	3,816,859.20	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	10,900	2,557,249.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	20,850	2,078,536.50	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	49,885.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	12,140	1,501,596.60	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	21,000	694,680.00	
FOREST CITY REALTY TRUST- A	44,200	1,018,810.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	10,300	242,050.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	17,700	146,910.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	33,400	1,175,346.00	
GEO GROUP INC/THE	20,700	539,442.00	
GETTY REALTY CORP	5,500	149,710.00	
GGP INC	104,500	2,168,375.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	4,700	88,595.00	
GLADSTONE LAND CORP	1,600	19,984.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	3,000	27,600.00	
GLOBAL NET LEASE INC	10,700	211,753.00	
GOVERNMENT PROPERTIES INCOME	16,300	239,284.00	
GRAMERCY PROPERTY TRUST	26,700	737,721.00	
HCP INC	77,600	1,910,512.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	20,800	592,800.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	33,900	892,587.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6,600	140,910.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	17,100	853,290.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	27,200	768,400.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	122,800	2,656,164.00	

HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	25,700	895,645.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	14,400	148,752.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	3,500	79,380.00	
INFREIT INC	6,200	133,548.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	18,100	107,514.00	
INVITATION HOMES INC	47,200	1,067,192.00	
IRON MOUNTAIN INC	46,700	1,620,490.00	
ISTAR INC	11,300	125,656.00	
JBG SMITH PROPERTIES	15,600	584,376.00	
KILROY REALTY CORP	16,460	1,237,462.80	
KIMCO REALTY CORP	70,400	1,224,960.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	13,700	238,380.00	
LASALLE HOTEL PROPERTIES	18,800	654,240.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	35,800	317,188.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	24,400	1,072,624.00	
LIFE STORAGE INC	7,750	742,605.00	
LTC PROPERTIES INC	6,500	274,885.00	
MACERICH CO /THE	17,940	1,026,168.00	
MACK-CALI REALTY CORP	14,300	292,864.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	202,507	174,156.02	
MEDEQUITIES REALTY TRUST INC	5,600	59,360.00	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	60,400	850,432.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	18,830	1,860,968.90	
MONMOUTH REIT-CLASS A	12,300	194,094.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	25,500	1,098,540.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	8,200	243,376.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	6,700	499,150.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	15,000	113,250.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	3,200	86,912.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	7,900	115,261.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32,900	1,045,562.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,800	74,732.00	
PARAMOUNT GROUP INC	32,900	507,647.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	32,800	1,026,968.00	

PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	11,400	451,440.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	11,500	132,825.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	29,900	479,297.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	20,600	403,966.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	6,800	105,264.00	
PROLOGIS INC	88,290	5,646,145.50	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,280	414,100.00	
PUBLIC STORAGE	24,700	5,479,448.00	
QTS REALTY TRUST INC CL A	8,600	338,840.00	
QUALITY CARE PROPERTIES	15,600	342,264.00	
RAMCO-GERSHENSON PROPERTIES	12,300	157,686.00	
REALTY INCOME CORP	46,900	2,510,088.00	
REGENCY CENTERS CORP	24,250	1,486,282.50	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	18,400	357,144.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	37,900	493,079.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	13,000	406,120.00	
RLJ LODGING TRUST	29,100	658,242.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	8,530	705,942.80	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	29,500	629,825.00	
SAUL CENTERS INC	2,070	107,060.40	
SELECT INCOME REIT	10,500	229,845.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	39,600	708,840.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	4,600	198,950.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	51,260	8,687,544.80	
SL GREEN REALTY CORP	14,740	1,476,948.00	
SPIRIT MTA REIT	7,210	75,272.40	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	72,100	599,151.00	
STAG INDUSTRIAL INC	16,400	442,636.00	
STORE CAPITAL CORP	28,800	782,208.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	16,500	237,765.00	
SUN COMMUNITIES INC	13,320	1,284,181.20	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	37,600	634,688.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	15,100	351,226.00	
TAUBMAN CENTERS INC	9,800	582,120.00	

	TERRENO REALTY CORP	8,900	332,326.00	
	TIER REIT INC	8,200	196,718.00	
	UDR INC	44,500	1,639,380.00	
	UMH PROPERTIES INC	5,000	73,450.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	1,930	128,846.80	
	URBAN EDGE PROPERTIES	17,400	396,024.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	5,000	112,450.00	
	VENTAS INC	58,800	3,236,940.00	
	VEREIT INC	158,700	1,171,206.00	
	VORNADO REALTY TRUST	28,600	2,091,518.00	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	30,400	249,584.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	12,600	372,204.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	19,900	621,875.00	
	WELLTOWER INC	61,600	3,622,080.00	
	WHEELER REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,250	4,662.50	
	WHITESTONE REIT	6,600	81,312.00	
	WP CAREY INC	17,840	1,173,158.40	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	17,200	430,000.00	
小計	銘柄数：161	3,898,907	134,826,366.52	
			(14,837,641,635)	
	組入時価比率：71.2%		71.7%	
カナダドル	AGELLAN COMMERCIAL REAL ESTATE INVESTMEN	3,200	42,784.00	
	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	7,500	318,000.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	12,400	165,664.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	3,600	165,636.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,300	487,030.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	21,300	258,156.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	14,500	185,165.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	6,700	87,502.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	4,900	63,749.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	14,100	205,155.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	6,600	68,046.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE	5,000	118,850.00	

	INVESTMENT TRUS			
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	3,900	210,405.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	24,000	489,600.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	7,300	79,497.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	6,300	94,500.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	50,457.00	
	MORGUARD REAL ESTATE-TR UTS	4,300	57,276.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	3,700	96,089.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	7,500	85,050.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	26,300	638,301.00	
	SLATE OFFICE REIT	5,900	45,076.00	
	SLATE RETAIL REIT	4,300	55,900.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	10,700	324,745.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	6,000	52,020.00	
小計	銘柄数：25	224,600	4,444,653.00	
			(367,706,142)	
	組入時価比率：1.8%		1.8%	
ユ-口	AEDIFICA	2,870	223,860.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	24,000	308,880.00	
	ALTAREA	600	120,000.00	
	AXIARE PATRIMONIO SOCIMI SA	2,200	38,192.00	
	BEFIMMO S.C.A.	3,840	198,912.00	
	BENI STABILI SPA	160,000	119,680.00	
	COFINIMMO	3,290	340,515.00	
	COFINIMMO-RIGHTS	3,290	2,303.00	
	COVIVIO	8,920	791,204.00	
	CROMWELL EUROPEAN REAL ESTATE	82,000	47,150.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	8,300	300,792.00	
	GECINA SA	8,010	1,153,440.00	
	GREEN REIT PLC	116,000	175,624.00	
	HAMBORNER REIT AG	13,700	125,081.00	
	HIBERNIA REIT PLC	115,000	177,100.00	
	HISPANIA ACTIVOS INMOBILIARI	18,000	318,060.00	
	ICADE	7,510	606,432.50	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	8,300	57,294.90	

	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	52,100	491,563.50	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	2,700	58,995.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	54,000	74,304.00	
	KLEPIERRE	34,400	1,127,288.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	15,100	141,940.00	
	MERCIALYS	9,300	139,035.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	55,200	686,412.00	
	NSI NV	2,900	103,095.00	
	RETAIL ESTATES	1,296	98,496.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	22,270	4,204,576.00	
	VASTNED RETAIL NV	2,700	110,025.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	2,750	295,900.00	
	WERELDHAVE NV	6,400	212,416.00	
小計	銘柄数：31	846,946	12,848,565.90 (1,641,275,808)	
	組入時価比率：7.9%		7.9%	
英ボンド	AEW UK LONG LEASE REIT PLC	15,000	13,740.00	
	ASSURA PLC	387,000	223,686.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	23,600	218,536.00	
	BRITISH LAND	164,500	1,116,626.00	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	93,000	48,267.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	29,000	29,725.00	
	DERWENT LONDON PLC	18,400	562,672.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	93,857	82,218.73	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	47,200	336,111.20	
	HAMMERSON PLC	129,000	684,990.00	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	70,000	74,340.00	
	INTU PROPERTIES PLC	144,000	273,672.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	124,800	1,177,113.60	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	114,000	212,040.00	
	LXI REIT PLC	39,000	43,290.00	
	NEWRIVER REIT PLC	50,000	135,250.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	123,000	140,466.00	
	RDI REIT PLC	230,000	79,810.00	
	REGIONAL REIT LTD	46,000	43,516.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	35,400	185,850.00	

小計	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	88,000	54,560.00	
	SEGRO PLC	166,700	1,100,220.00	
	SHAFTESBURY PLC	40,800	380,460.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	244,000	371,856.00	
	UNITE GROUP PLC	42,400	352,980.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	19,600	214,620.00	
	銘柄数 : 26 組入時価比率 : 5.7%	2,578,257	8,156,615.53 (1,190,213,338) 5.8%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	54,000	212,220.00	
	ARENA REIT	43,220	95,516.20	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	9,800	0.00	
	BWP TRUST	81,000	268,110.00	
	CHARTER HALL GROUP	76,000	501,600.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	27,702	122,719.86	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	55,000	239,250.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	256,000	286,720.00	
	DEXUS	164,600	1,652,584.00	
	FOLKESTONE EDUCATION TRUST	42,000	113,820.00	
	GDI PROPERTY GROUP	74,000	96,570.00	
	GOODMAN GROUP	265,300	2,629,123.00	
	GPT GROUP	297,000	1,547,370.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	41,000	149,650.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	22,680	75,524.40	
	INDUSTRIA REIT	20,000	51,800.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,000	106,080.00	
	INVESTA OFFICE FUND	82,000	428,040.00	
	MIRVAC GROUP	603,000	1,350,720.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	89,000	145,070.00	
	PROPERTYLINK GROUP	66,000	70,620.00	
	RURAL FUNDS GROUP	40,000	84,800.00	
	SCENTRE GROUP	879,000	3,832,440.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	121,000	304,920.00	
STOCKLAND TRUST GROUP	404,000	1,688,720.00		
VICINITY CENTRES	535,000	1,444,500.00		

小計	VIVA ENERGY REIT	71,000	154,780.00	
	銘柄数：27	4,458,302	17,653,267.46	(1,435,563,709)
	組入時価比率：6.9%			6.9%
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	138,000	149,730.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	175,000	252,000.00	
	INVESTORE PROPERTY LTD	32,000	47,360.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	237,000	319,950.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	153,000	202,725.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	56,000	103,600.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	53,000	107,855.00	
小計	銘柄数：7	844,000	1,183,220.00	(89,546,089)
	組入時価比率：0.4%			0.4%
香港ドル	CHAMPION REIT	324,000	1,749,600.00	
	FORTUNE REIT	228,000	2,120,400.00	
	LINK REIT	355,600	24,696,420.00	
	PROSPERITY REIT	180,000	579,600.00	
	SPRING REAL ESTATE INVESTMEN	170,000	566,100.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	174,000	944,820.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	194,000	1,043,720.00	
小計	銘柄数：7	1,625,600	31,700,660.00	(444,760,259)
	組入時価比率：2.1%			2.2%
シンガポールドル	AIMS AMP CAPITAL INDUSTRIAL REIT	94,000	130,660.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	129,000	98,685.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	401,000	1,046,610.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	198,000	215,820.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	180,860	135,645.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	452,964	742,860.96	
	CAPITALAND MALL TRUST	446,000	909,840.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	96,000	141,120.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	128,000	207,360.00	
	ESR REIT	239,800	116,303.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	142,000	90,880.00	

	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	91,000	122,850.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	94,000	205,860.00	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	104,000	141,440.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	248,000	257,920.00	
	KEPPEL DC REIT	146,756	196,653.04	
	KEPPEL REIT	285,000	313,500.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	340,000	107,100.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	317,025	488,218.50	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	206,000	391,400.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	327,000	398,940.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	340,000	387,600.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	183,043	143,688.75	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	62,000	160,580.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	133,764	58,187.34	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	106,700	68,821.50	
	SPH REIT	104,000	103,480.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	227,000	147,550.00	
	SUNTEC REIT	372,000	624,960.00	
小計	銘柄数：29	6,194,912	8,154,533.09	
			(661,087,997)	
	組入時価比率：3.2%		3.2%	
新シェケル	REIT 1 LTD	28,000	394,800.00	
小計	銘柄数：1	28,000	394,800.00	
			(11,990,076)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
合計			20,679,785,053	
			(20,679,785,053)	

(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

	2018年 6月22日現在
--	---------------

種類	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	120,237,231	-	121,000,721	763,490
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	16,943,030	-	16,857,400	85,630
米ドル	14,385,670	-	14,302,600	83,070
ユーロ	2,557,360	-	2,554,800	2,560
合計	-	-	-	677,860

（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】

野村資産設計ファンド（DC）2040

2018年7月31日現在

資産総額	4,047,987円
負債総額	12,582円
純資産総額（ - ）	4,035,405円
発行済口数	3,819,736口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0565円

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

2018年7月31日現在

資産総額	668,676,963,409円
負債総額	7,326,692,217円
純資産総額（ - ）	661,350,271,192円
発行済口数	504,252,973,109口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3115円

（参考）外国債券マザーファンド

2018年7月31日現在

資産総額	618,473,477,861円
負債総額	1,302,683,285円
純資産総額（ - ）	617,170,794,576円
発行済口数	275,633,004,578口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2391円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2018年7月31日現在

資産総額	8,111,744,702円
負債総額	262,174,377円
純資産総額（ - ）	7,849,570,325円
発行済口数	5,978,250,684口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3130円

（参考）国内株式マザーファンド

2018年7月31日現在

資産総額	414,043,725,788円
負債総額	26,939,788,937円
純資産総額（ - ）	387,103,936,851円
発行済口数	226,510,511,054口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7090円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2018年7月31日現在

資産総額	516,367,540,224円
負債総額	1,617,117,724円
純資産総額（ - ）	514,750,422,500円
発行済口数	189,219,213,087口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7204円

（参考）新興国株式マザーファンド

2018年7月31日現在

資産総額	34,417,203,274円
負債総額	235,062,948円
純資産総額（ - ）	34,182,140,326円
発行済口数	26,500,033,482口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2899円

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2018年7月31日現在

資産総額	35,845,354,731円
負債総額	1,509,919,618円
純資産総額（ - ）	34,335,435,113円
発行済口数	16,610,693,826口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0671円

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2018年7月31日現在

資産総額	22,202,559,449円
負債総額	16,363,216円
純資産総額（ - ）	22,186,196,233円
発行済口数	9,834,154,905口
1口当たり純資産額（ / ）	2.2560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、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

2018年7月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

取締役により構成され、当社の業務につき意思決定を行います。また執行役・代表執行役、各委員会の委員等を選任し、取締役および執行役の職務の執行を監督します。

代表執行役・執行役

各執行役は、当社の業務の執行を行います。代表執行役は当社を代表いたします。また取締役会により委任された一定の事項について、代表執行役および執行役で構成される経営会議および執行役会が意思決定を行います。なお、当社は執行役員制度を導入しており、経営会議の構成員には執行役会で選定された執行役員が含まれます。

委員会

取締役3名以上（但し、各委員につき過半数は社外取締役であって執行役でない者）で構成され、イ）指名委員会は、株主総会に提出する取締役の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定し、ロ）報酬委員会は取締役・執行役が受ける個人別の報酬の決定に関する方針を定め、かつそれに従って各報酬の内容を決定し、ハ）監査委員会は取締役・執行役の職務執行の適法性ならびに妥当性に関する監査を行うとともに、株主総会に提出する会計監査人の選任・解任・不再任に関する議案の内容を決定します。

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2018年6月29日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

種類	本数	純資産総額(百万円)
----	----	------------

追加型株式投資信託	1,004	26,665,866
単位型株式投資信託	122	647,421
追加型公社債投資信託	14	5,592,272
単位型公社債投資信託	392	1,787,916
合計	1,532	34,693,475

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2017年4月1日から2018年3月31日まで)の財務諸表について、新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(2017年3月31日)	(2018年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		127	919
金銭の信託		52,247	47,936
有価証券		15,700	22,600
前払金		33	0
前払費用		2	26
未収入金		495	464
未収委託者報酬		16,287	24,059
未収運用受託報酬		7,481	6,764
繰延税金資産		1,661	2,111
その他		42	181
貸倒引当金		11	15
流動資産計		94,066	105,048
固定資産			
有形固定資産		1,001	874
建物	2	377	348
器具備品	2	624	525
無形固定資産		7,185	7,157
ソフトウェア		7,184	7,156

その他		0		0
投資その他の資産			13,165	13,825
投資有価証券		1,233		1,184
関係会社株式		8,124		9,033
従業員長期貸付金		-		36
長期差入保証金		44		54
長期前払費用		37		36
前払年金費用		2,594		2,350
繰延税金資産		960		962
その他		170		168
貸倒引当金		-		0
固定資産計			21,353	21,857
資産合計			115,419	126,906

区分	注記 番号	前事業年度 (2017年3月31日)		当事業年度 (2018年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			98		133
未払金	1		10,401		17,853
未払収益分配金		1		1	
未払償還金		31		31	
未払手数料		5,242		7,884	
関係会社未払金		4,438		7,930	
その他未払金		687		2,005	
未払費用	1		9,461		12,441
未払法人税等			714		2,241
前受収益			39		33
賞与引当金			4,339		4,626
流動負債計			25,055		37,329
固定負債					
退職給付引当金			2,947		2,938
時効後支払損引当金			538		548
固定負債計			3,485		3,486
負債合計			28,540		40,816
(純資産の部)					
株主資本			86,837		86,078
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			55,927		55,168
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		55,242		54,483	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		30,635		29,876	
評価・換算差額等			41		11
その他有価証券評価差額金			41		11
純資産合計			86,878		86,090

負債・純資産合計		115,419	126,906
----------	--	---------	---------

(2)【損益計算書】

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)
営業収益			
委託者報酬		96,594	115,907
運用受託報酬		28,466	26,200
その他営業収益		266	338
営業収益計		125,327	142,447
営業費用			
支払手数料		39,785	45,252
広告宣伝費		1,011	1,079
公告費		0	0
調査費		26,758	30,516
調査費		5,095	5,830
委託調査費		21,662	24,685
委託計算費		1,290	1,376
営業雑経費		4,408	5,464
通信費		162	125
印刷費		940	966
協会費		76	79
諸経費		3,228	4,293
営業費用計		73,254	83,689
一般管理費			
給料		11,269	11,716
役員報酬	2	301	425
給料・手当		6,923	6,856
賞与		4,044	4,433
交際費		126	132
旅費交通費		469	482
租税公課		898	1,107
不動産賃借料		1,222	1,221
退職給付費用		1,223	1,119
固定資産減価償却費		2,730	2,706
諸経費		8,118	9,122
一般管理費計		26,059	27,609
営業利益		26,012	31,148

区分	注記 番号	前事業年度	当事業年度
		(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
		金額(百万円)	金額(百万円)

営業外収益					
受取配当金	1	7,397		4,031	
受取利息		0		4	
金銭の信託運用益		684		-	
その他		379		362	
営業外収益計			8,461		4,398
営業外費用					
支払利息		17		2	
金銭の信託運用損		-		312	
時効後支払損引当金繰入額		16		13	
為替差損		33		46	
その他		9		31	
営業外費用計			77		405
經常利益			34,397		35,141
特別利益					
投資有価証券等売却益		26		20	
関係会社清算益		41		-	
株式報酬受入益		59		75	
特別利益計			126		95
特別損失					
投資有価証券等評価損		6		2	
固定資産除却損	3	9		58	
特別損失計			15		60
税引前当期純利益			34,507		35,176
法人税、住民税及び事業税			7,147		10,775
法人税等調整額			1,722		439
当期純利益			25,637		24,840

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	43,405	68,696	99,606
当期変動額									
剰余金の配当							38,407	38,407	38,407
当期純利益							25,637	25,637	25,637

株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	12,769	12,769	12,769
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837

(単位:百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	5,349	5,349	104,956
当期変動額			
剰余金の配当			38,407
当期純利益			25,637
株主資本以外の項目 の当期変動額(純 額)	5,308	5,308	5,308
当期変動額合計	5,308	5,308	18,078
当期末残高	41	41	86,878

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 準備金	利益剰余金			
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金		利益 剰余金 合計	
						別途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837
当期変動額									
剰余金の配当							25,598	25,598	25,598
当期純利益							24,840	24,840	24,840
株主資本以外 の項目の当期 変動額(純 額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	758	758	758
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

(単位:百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	41	41	86,878
当期変動額			
剰余金の配当			25,598
当期純利益			24,840
株主資本以外の項目 の当期変動額（純額）	29	29	29
当期変動額合計	29	29	788
当期末残高	11	11	86,090

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>								
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>								

<p>5. 消費税等の会計処理方法</p> <p>6. 連結納税制度の適用</p>	<p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企业年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企业年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。 退職一時金及び確定給付型企业年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当期の費用として処理していません。</p> <p>連結納税制度を適用しております。</p>
---	---

【未適用の会計基準等】

- ・「税効果会計に係る会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第28号 平成30年2月16日）
- ・「繰延税金資産の回収可能性に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第26号 平成30年2月16日）

日）

(1) 概要

個別財務諸表における子会社株式等に係る将来加算一時差異の取扱いが見直され、また（分類1）に該当する企業における繰延税金資産の回収可能性に関する取扱いの明確化が行われております。

(2) 適用予定日

2019年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日）

(1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[表示方法の変更に関する注記]

(貸借対照表)

前事業年度において、流動負債の「その他未払金」に含めて表示していた「関係会社未払金」は、金額的重要性が増したため、当事業年度より区分掲記しております。この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動負債」の「その他未払金」に表示していた4,438百万円は、「関係会社未払金」4,438百万円として組み替えております。

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2017年3月31日)	当事業年度末 (2018年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 938百万円	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれている ものは、次のとおりであります。 未払費用 1,781百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 681百万円 器具備品 3,331 合計 4,013	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 708百万円 器具備品 3,491 合計 4,200

損益計算書関係

前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)	当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するもの は、次のとおりであります。 受取配当金 5,252百万円 支払利息 17	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するもの は、次のとおりであります。 受取配当金 4,026百万円 支払利息 2
2. 役員報酬の範囲額 役員報酬は報酬委員会決議に基づき支給されてお ります。	2. 役員報酬の範囲額 (同左)

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

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2016年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 34,973百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 6,790円

基準日 2016年3月31日

効力発生日 2016年6月24日

配当財産が金銭以外である場合における当該財産の総額

2016年10月27日開催の臨時株主総会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当財産の種類 株式会社野村総合研究所の株式

配当財産の帳簿価額 3,064百万円

1株当たり配当額 594円87銭

効力発生日 2016年10月27日

配当財産の種類 株式会社ジャフコの株式

配当財産の帳簿価額 282百万円

1株当たり配当額 54円93銭

効力発生日 2016年10月27日

配当財産の種類 朝日火災海上保険株式会社の株式

配当財産の帳簿価額 87百万円

1株当たり配当額 16円89銭

効力発生日 2016年10月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,598百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,970円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23日

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

株式の種類	当事業年度期首株式数	当事業年度増加株式数	当事業年度減少株式数	当事業年度末株式数
普通株式	5,150,693株	-	-	5,150,693株

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	25,598百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,970円
基準日	2017年3月31日
効力発生日	2017年6月23日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額	24,826百万円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	4,820円
基準日	2018年3月31日
効力発生日	2018年6月25日

金融商品関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自らが運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されており、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2017年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	127	127	-
(2)金銭の信託	52,247	52,247	-
(3)未収委託者報酬	16,287	16,287	-
(4)未収運用受託報酬	7,481	7,481	-
(5)有価証券及び投資有価証券	15,700	15,700	-
その他有価証券	15,700	15,700	-
資産計	91,843	91,843	-
(6)未払金	10,401	10,401	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	5,242	5,242	-
関係会社未払金	4,438	4,438	-
その他未払金	687	687	-
(7)未払費用	9,461	9,461	-
(8)未払法人税等	714	714	-

負債計	20,578	20,578	-
-----	--------	--------	---

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,233百万円、関係会社株式8,124百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	127	-	-	-
金銭の信託	52,247	-	-	-
未収委託者報酬	16,287	-	-	-
未収運用受託報酬	7,481	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	15,700	-	-	-

合計	91,843	-	-	-
----	--------	---	---	---

当事業年度（自 2017年 4月 1日 至 2018年 3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

当社は、投資信託の運用を業として行っており、自社が運用する投資信託の商品性維持等を目的として、当該投資信託を特定金外信託を通じ保有しております。特定金外信託を通じ行っているデリバティブ取引については、保有する投資信託にかかる将来の為替及び価格の変動によるリスクの軽減を目的としているため、投資信託保有残高の範囲内で行うこととし、投機目的のためのデリバティブ取引は行わない方針であります。

なお、余資運用に関しては、譲渡性預金等安全性の高い金融資産で運用し、資金調達に関しては、親会社である野村ホールディングス株式会社及びその他の金融機関からの短期借入による方針であります。

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

特定金外信託を通じ保有している投資信託につきましては、為替変動リスクや価格変動リスクに晒されておりますが、その大部分については為替予約、株価指数先物、債券先物などのデリバティブ取引によりヘッジしております。また、株式につきましては、政策投資として、あるいは業務上の関係維持を目的として保有しておりますが、価格変動リスクに晒されております。有価証券及び投資有価証券並びに金銭の信託については財務部が管理しており、定期的に時価や発行体の財務状況を把握し、その内容を経営に報告しております。

デリバティブ取引の実行及び管理については、財務部及び運用調査本部で行っております。デリバティブ取引については、取引相手先として高格付を有する金融機関に限定しているため信用リスクはほとんどないと認識しております。財務部は月に一度デリバティブ取引の内容を含んだ財務報告を経営会議で行っております。

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約に基づき、運用受託者に対して支払われる報酬の未払金額であります。この未収運用受託報酬は、信託財産から運用受託者に対して支払われる場合は、信託財産が信託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しており、顧客から直接運用受託者に対して支払われる場合は、当該顧客の信用リスクにさらされておりますが、顧客ごとに決済期日および残高を管理することにより、回収懸念の早期把握や回収リスクの軽減を図っております。

2. 金融商品の時価等に関する事項

2018年 3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
--	----------	----	----

(1)現金・預金	919	919	-
(2)金銭の信託	47,936	47,936	-
(3)未収委託者報酬	24,059	24,059	-
(4)未収運用受託報酬	6,764	6,764	-
(5)有価証券及び投資有価証券	22,600	22,600	-
その他有価証券	22,600	22,600	-
資産計	102,279	102,279	-
(6)未払金	17,853	17,853	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	7,884	7,884	-
関係会社未払金	7,930	7,930	-
その他未払金	2,005	2,005	-
(7)未払費用	12,441	12,441	-
(8)未払法人税等	2,241	2,241	-
負債計	32,536	32,536	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

信託財産は、主として投資信託、デリバティブ取引、その他の資産（コールローン・委託証拠金等）で構成されております。これらの時価について投資信託については基準価額、デリバティブ取引に関しては、上場デリバティブ取引は取引所の価格、為替予約取引は先物為替相場、店頭デリバティブ取引は取引先金融機関から提示された価格等によっております。また、その他の資産については短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

譲渡性預金は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額とほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。また、保有目的ごとの有価証券に関する注記事項については、「有価証券関係」注記を参照ください。

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

ます。

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 2016年 4月 1日 至 2017年 3月 31日）

1．売買目的有価証券(2017年 3月 31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2017年 3月 31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2017年 3月 31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2017年 3月 31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 譲渡性預金	15,700	15,700	-
小計	15,700	15,700	-

合計	15,700	15,700	-
----	--------	--------	---

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2016年4月1日 至 2017年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1．売買目的有価証券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2018年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2018年3月31日)

区分	貸借対照表 計上額 (百万円)	取得原価 (百万円)	差額 (百万円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
小計	-	-	-
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
譲渡性預金	22,600	22,600	-
小計	22,600	22,600	-
合計	22,600	22,600	-

5．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)
1．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。
2．確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	18,692 百万円
勤務費用	889
利息費用	125
数理計算上の差異の発生額	464
退職給付の支払額	634
その他	8
退職給付債務の期末残高	19,546
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	15,764 百万円
期待運用収益	394
数理計算上の差異の発生額	468
事業主からの拠出額	507
退職給付の支払額	562
年金資産の期末残高	16,572
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	16,578 百万円
年金資産	16,572
	5
非積立型制度の退職給付債務	2,967
未積立退職給付債務	2,973
未認識数理計算上の差異	2,992
未認識過去勤務費用	371
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352
退職給付引当金	2,947
前払年金費用	2,594
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352
(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額	
勤務費用	889 百万円
利息費用	125
期待運用収益	394
数理計算上の差異の費用処理額	412
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	993
(5) 年金資産に関する事項	
年金資産の主な内容	
年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。	
債券	49%
株式	39%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%
長期期待運用収益率の設定方法	
年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と、年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。	
(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項	
当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎	
確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	19,546 百万円
勤務費用	929
利息費用	167
数理計算上の差異の発生額	1,415
退職給付の支払額	660
その他	0
退職給付債務の期末残高	21,398

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	16,572 百万円
期待運用収益	414
数理計算上の差異の発生額	395
事業主からの拠出額	510
退職給付の支払額	518
年金資産の期末残高	17,373

(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.5%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2017年3月31日)	当事業年度末 (2018年3月31日)
1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳	1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳
繰延税金資産 百万円	繰延税金資産 百万円
賞与引当金 1,345	賞与引当金 1,434
退職給付引当金 913	退職給付引当金 910
投資有価証券評価減 417	投資有価証券評価減 417
未払事業税 110	未払事業税 409
関係会社株式評価減 247	関係会社株式評価減 247
ゴルフ会員権評価減 212	ゴルフ会員権評価減 207
減価償却超過額 171	減価償却超過額 171
時効後支払損引当金 166	時効後支払損引当金 169
子会社株式売却損 148	子会社株式売却損 148
未払子会社役務提供費用 -	未払子会社役務提供費用 121
未払社会保険料 85	未払社会保険料 107
関係会社株式譲渡益 88	関係会社株式譲渡益 -
その他 274	その他 197
繰延税金資産小計 4,183	繰延税金資産小計 4,543
評価性引当額 739	評価性引当額 735
繰延税金資産合計 3,444	繰延税金資産合計 3,808
繰延税金負債	繰延税金負債
その他有価証券評価差額金 18	その他有価証券評価差額金 5
前払年金費用 804	前払年金費用 728
繰延税金負債合計 822	繰延税金負債合計 733
繰延税金資産の純額 2,621	繰延税金資産の純額 3,074
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳	2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳
法定実効税率 31.0%	法定実効税率 31.0%
(調整)	(調整)
交際費等永久に損金に算入されない項目 0.1%	交際費等永久に損金に算入されない項目 0.2%
受取配当金等永久に益金に算入されない項目 6.2%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目 3.4%
タックスヘイブン税制 0.7%	タックスヘイブン税制 1.8%
外国税額控除 0.2%	外国税額控除 0.2%
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.5%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税 0.3%
その他 0.2%	その他 0.4%
税効果会計適用後の法人税等の負担率 25.7%	税効果会計適用後の法人税等の負担率 29.3%

セグメント情報等

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社	野村ホールディングス株式会社	東京都中央区	594,492 (百万円)	持株会社	(被所有) 直接 100%	資産の賃貸借及び購入等 役員の兼任	資金の借入(*1)	24,500	短期借入金	-
							資金の返済	24,500		
							借入金利息の支払	17	未払費用	-

(イ) 子会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
関連会社	株式会社野村総合研究所	東京都千代田区	18,600 (百万円)	情報サービス業	-	サービス・製品の購入	自社利用ソフトウェア開発の委託等(*2)	787	未払費用	-

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売上の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払(*3)	33,019	未払手数料	4,486

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

野村ホールディングス㈱（東京証券取引所、名古屋証券取引所、シンガポール証券取引所、

ニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1 株当たり情報

前事業年度 (自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)		当事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,867円41銭	1株当たり純資産額	16,714円33銭
1株当たり当期純利益	4,977円49銭	1株当たり当期純利益	4,822円68銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	25,637百万円	損益計算書上の当期純利益	24,840百万円
普通株式に係る当期純利益	25,637百万円	普通株式に係る当期純利益	24,840百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	該当事項はありません。	普通株主に帰属しない金額の主要な内訳	該当事項はありません。
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

【重要な後発事象】

当社は、2018年4月6日付で、香港の金融持株会社である8 Limited（エイト・リミテッド、以下「エイト・リミテッド」）の株式の14.9%を取得するとともに、同社の子会社であったエイト証券株式会社（以下「エイト証券」）の株式の78.3%を取得しました。当社のエイト・リミテッド及びエイト証券に対する出資額は、それぞれ約11億円及び約16億円であり、いずれも4月上旬に払込みを行っております。

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

又は子法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)

券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託者

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

* 2018年6月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
株式会社 ゆうちょ銀行	3,500,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
野村信託銀行株式会社	35,000百万円	

* 2018年6月末現在

2【関係業務の概要】

(1)受託者

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

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1)受託者

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

2018年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森 重 俊 寛指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 櫻 井 雄一郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津 村 健二郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2017年4月1日から2018年3月31日までの第59期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2018年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

強調事項

重要な後発事象に記載されているとおり、会社は2018年4月6日付でエイト・リミテッドの株式を取得するとともに、同社の子会社であったエイト証券株式会社の株式を取得している。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2018年8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

指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 志保
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 森 重俊寛
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村資産設計ファンド（DC）2040の2017年8月31日から2018年6月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村資産設計ファンド（DC）2040の2018年6月22日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

野村アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。