

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年9月18日提出
【計算期間】	第2期(自 2018年6月23日至 2019年6月24日)
【ファンド名】	野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０４０
【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】	ＣＥＯ兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目１２番１号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都中央区日本橋一丁目１２番１号
【電話番号】	03-3241-9511
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【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。

当ファンドは2019年10月1日に、ファンド名称を「野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040」（愛称：未来時計DC・つみたてNISA 2040）とする投資信託約款の変更を予定しています。

■ 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 追加型	国内	株式	インデックス型 特殊型
	海外	債券	
	内外	不動産投信	
		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)			
	年2回	日本			日経225
	年4回	北米	ファミリーファンド	あり ()	
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	欧州			T O P I X
	年12回 (毎月)	アジア			
	日々	オセアニア			
不動産投信	その他 ()	中南米	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))		アフリカ			
		中近東 (中東)			
		エマージング			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型					

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 〕

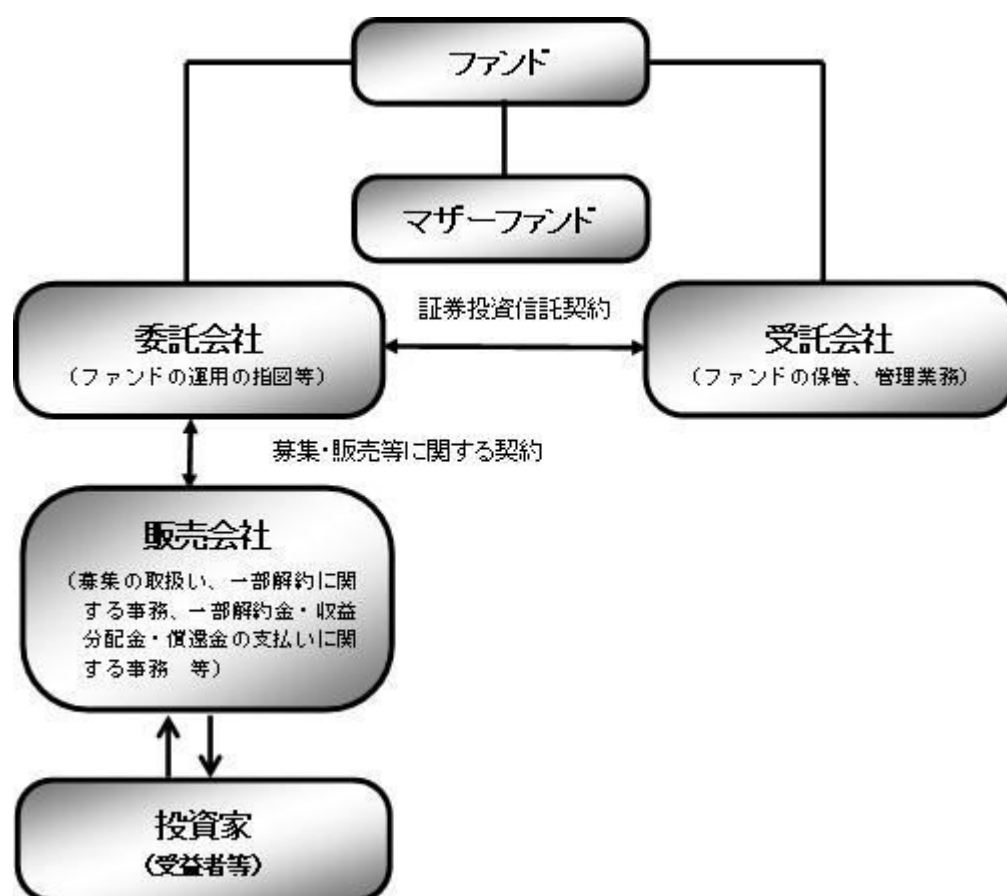
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定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

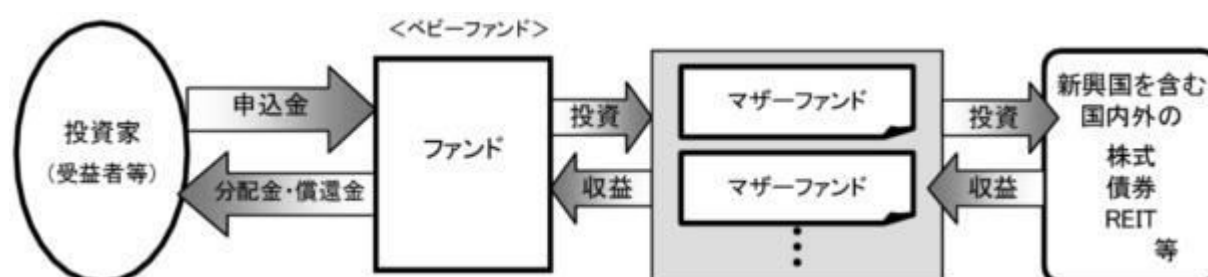
信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(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(2019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 野村證券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更

2000年11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・ 大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

- 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。

マザーファンドへの投資を通じて、金融指標の動きに連動する投資成果を目指すため、有価証券先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引を実質的に投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的または為替相場等の変動リスクを減じる目的で、ヘッジ目的外の利用も含め実質的に活用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（預託証書） ^{*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（預託証書）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。DRI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にしたがって、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。

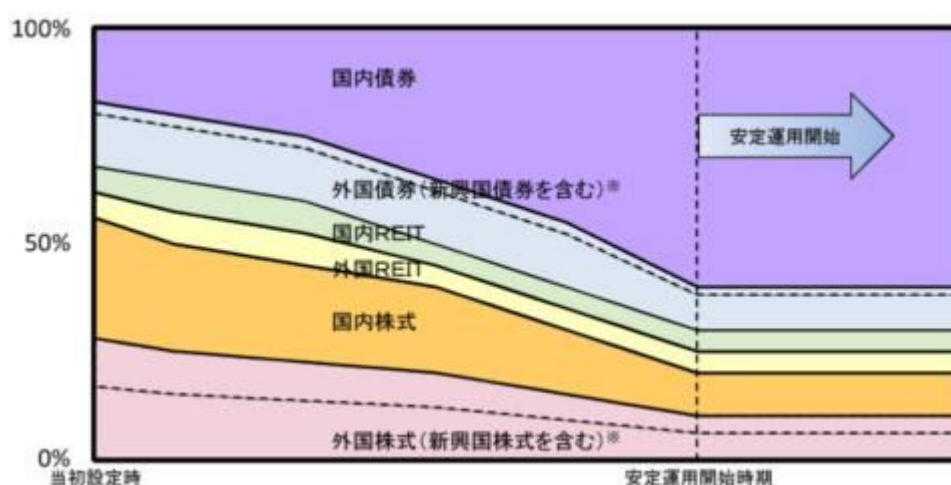
定期的な基本投資割合の変更は、家計や市場の構造変化等を考慮し、原則年1回行なうことを基本とします。

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	2019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%	19.0%
外国債券	外国債券マザーファンド	12.3%	10%	12.2%
	新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	2.7%		2.8%
国内株式	国内株式マザーファンド	28.0%	10%	26.0%
外国株式	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	16.8%	10%	15.1%
	新興国株式マザーファンド	11.2%		10.9%
国内REIT	J-REITインデックス マザーファンド	6.0%	5%	7.0%
外国REIT	海外REITインデックス マザーファンド	6.0%	5%	7.0%

■ 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。

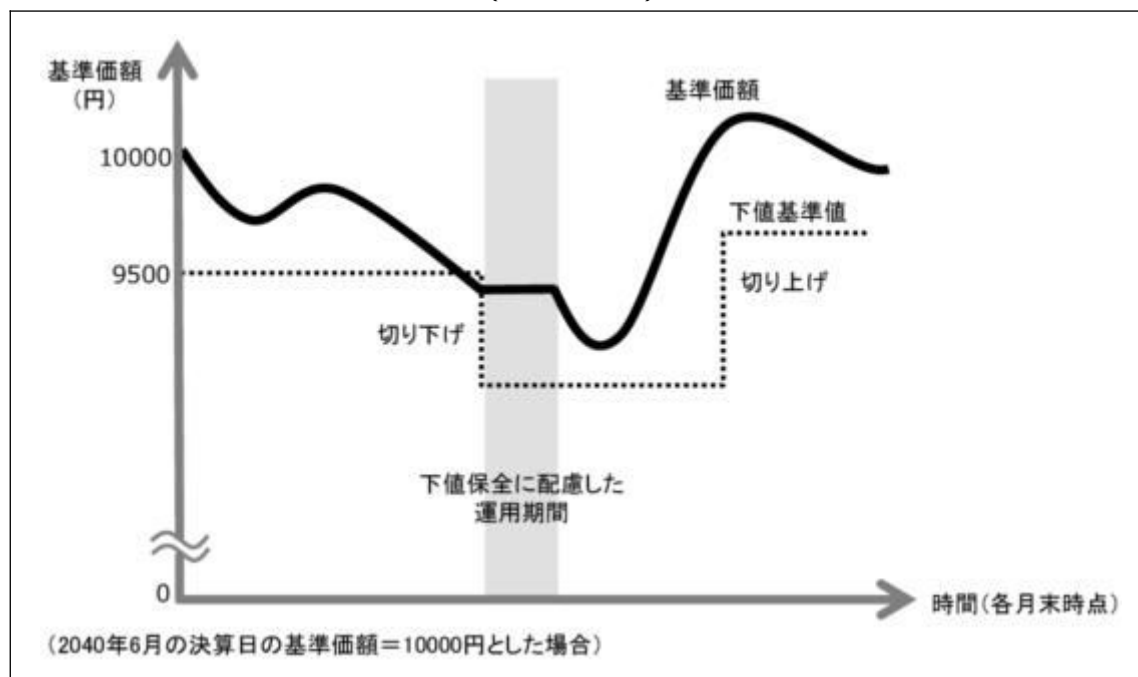
- 安定運用開始時期以降は、各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投資する各資産への実質的なエクスポージャーを引き下げ、短期有価証券等へ投資する運用（「下値保全に配慮した運用」といいます。）を行ないます。

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

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

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

■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・amp・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「（６）投資制限」に定めるものに限り、）に係る権利

ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

- 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ロ．次に掲げるものをすべてみたす資産

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

有価証券の指図範囲等（信託約款）

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

- 株券または新株引受権証券
- 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。なお、社債券のうちで、新株予約権付社債券のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債券についての社債券であって当該社債券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、ならびに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券を総称して以下「転換社債型新株予約

権付社債」といいます。）

6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
9. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
10. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券および新株予約権証券
13. 外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
14. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の性質を有するもの
15. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
16. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。）
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記 に掲げるものを除く。）

3. コール・ローン

4. 手形割引市場において売買される手形

5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの

7. 日本の会社に類似した性質を有しない外国の者が発行する債務証券または証書（上記 に定める証券または証書を除きます。）

8. 流動性のあるプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの（上記 第13号に定める証券または証書を除きます。なお、上記 第13号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。）

9. リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記 各号以外のもの

10. 流動性のある外国の者に対する貸付債権

その他の投資対象

1. 先物取引等

2. スワップ取引

3. 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-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（外国債券マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

２．運用方法

（１）投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

（２）投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（３）投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

スポンジャー、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。

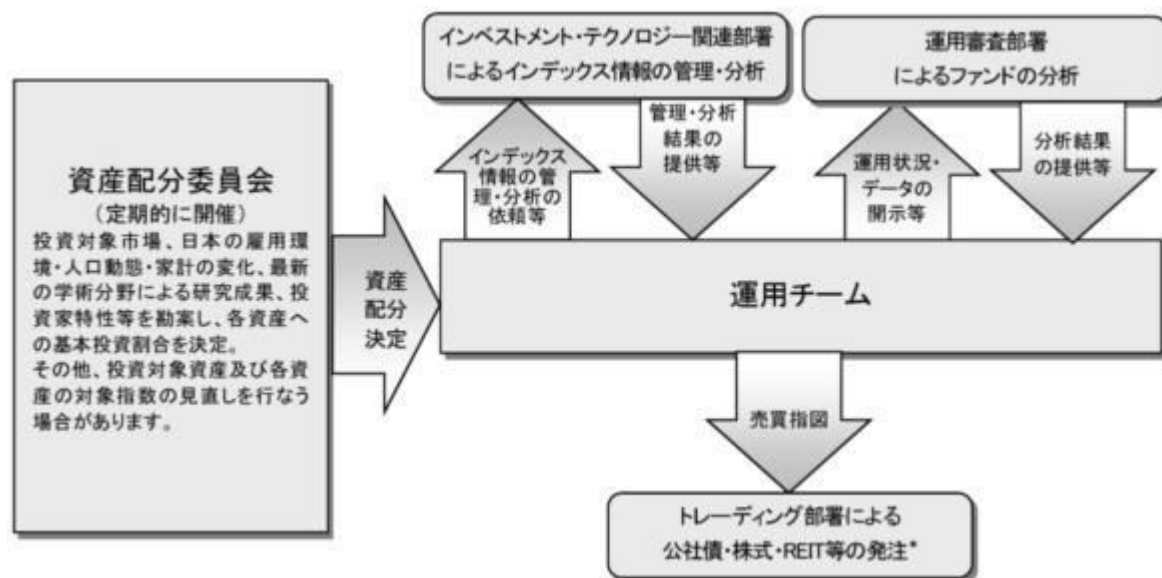
同一銘柄の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の30%以内とします。ただし、S&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における時価の構成割合が30%を超えるREITがある場合には、当該REITをS&P先進国REIT指数（除く日本、配当込み、円換算ベース）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

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。



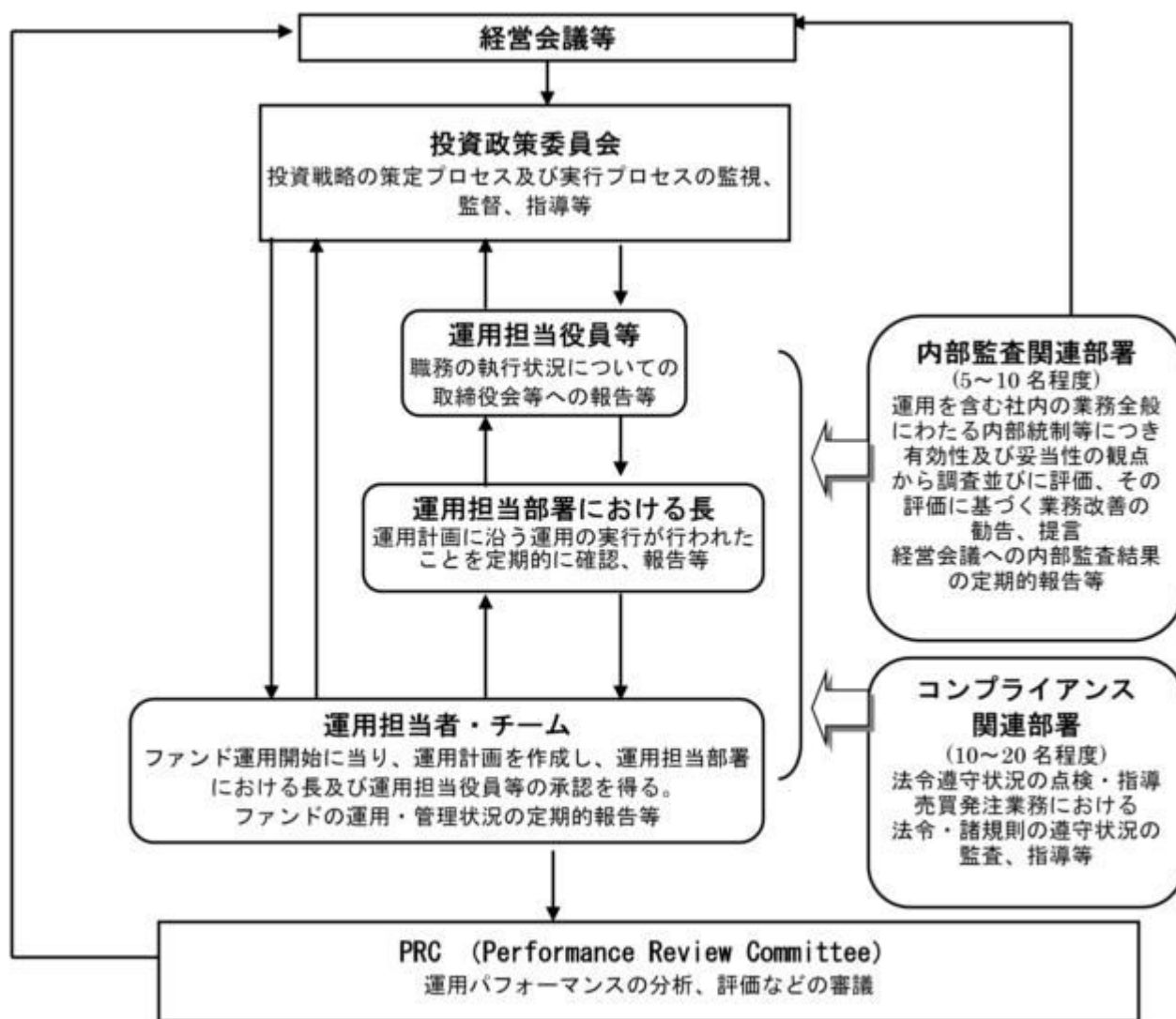
*新興国債券（現地通貨建て）マザーファンドにおける公社債等の発注業務（発注に伴う裁量権は付与しないものとします。）の一部をノムラ・アセット・マネジメントU.K. リミテッドに代行させます。

運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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

す。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行ないます。

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（評価益を含みます。）等の全額とします。

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

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

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

ファンドの決算日

原則として毎年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ます。）の行使により取得可能な株券

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たときは、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たときは、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たときは、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たときは、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たときは、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たときは、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

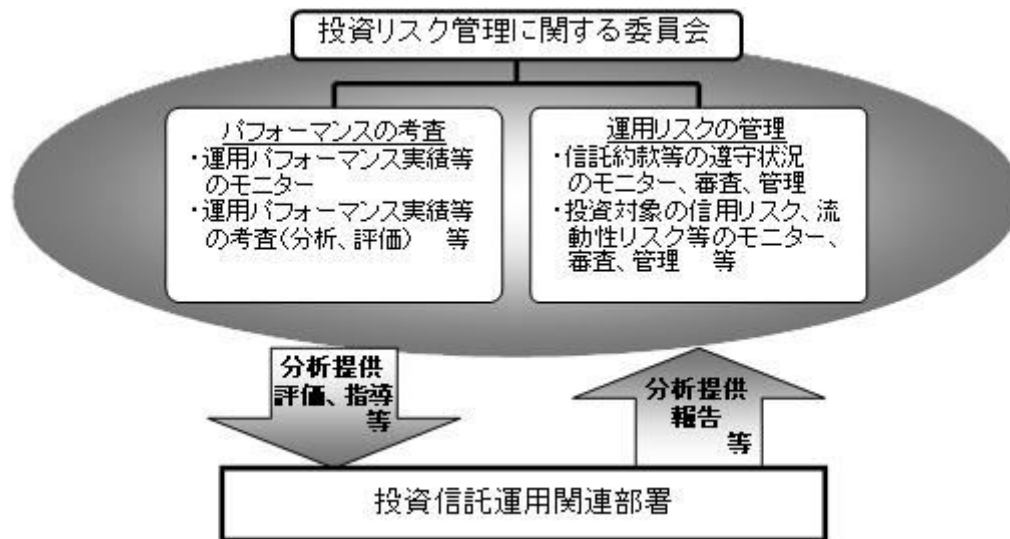
パフォーマンスの考査

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

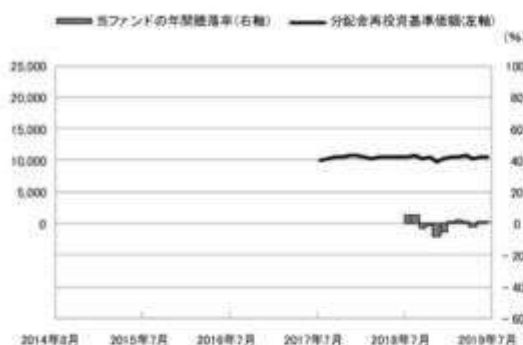


投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

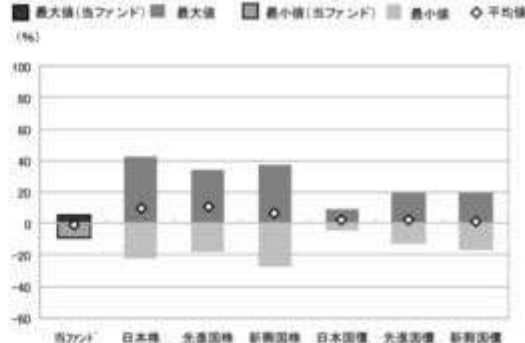
リスクの定量的比較

(2014年8月末～2019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〉



〈ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較〉



当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値(%)	5.5	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3
最小値(%)	△ 8.7	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3
平均値(%)	△ 0.3	9.3	10.6	6.9	2.0	2.7

- ※ 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- ※ 年間騰落率は、2018年8月から2019年7月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。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。

- ※ 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- ※ 2014年8月から2019年7月の5年間(当ファンドは2018年8月から2019年7月)の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- ※ 決算日に対応した数値とは異なります。
- ※ 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
- ※ 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IFIED(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、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI国債・・・NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)・・・FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。
- JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースIFIED(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IFIED(円ベース)」(ここでは「指数」とよびます)についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社(以下、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たり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。米国のJP Morgan Securities LLC(ここでは「JPMSLLC」と呼びます)は「指数スポンサー」は、指数に関する証券、金融商品または取引(ここでは「プロダクト」と呼びます)についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。JPMSLLCは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。また、ファンドが投資するマザーファンドに関する有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が、ファンドから実質的に支払われます。

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

* 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には以下の通りです。

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。

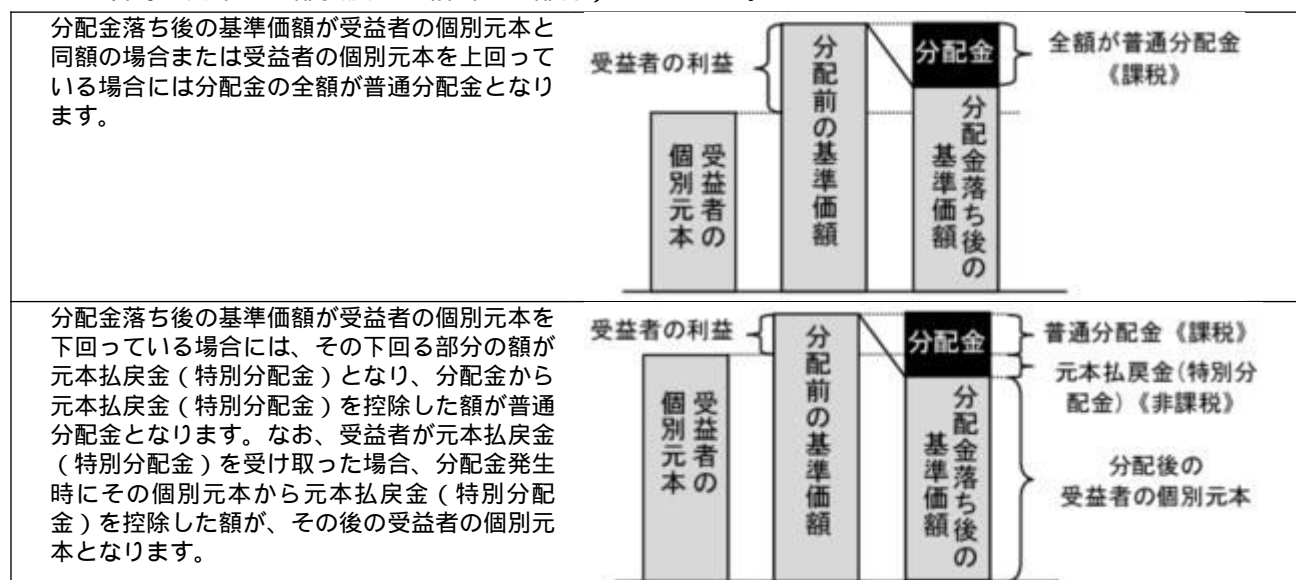
■ 換金（解約）時および償還時の課税について ■

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。

* 2020年1月1日以降の分配時において、外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容(2019年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2019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	12,110,917	99.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	12,159	0.10
合計（純資産総額）		12,123,076	100.00

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	日本	532,998,858,310	79.85
地方債証券	日本	44,549,626,089	6.67
特殊債券	日本	58,902,349,600	8.82
社債券	日本	27,050,101,700	4.05
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	3,925,296,769	0.58
合計（純資産総額）		667,426,232,468	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	284,109,919,619	46.65
	カナダ	11,574,328,129	1.90
	メキシコ	4,672,352,588	0.76
	ドイツ	34,993,336,839	5.74
	イタリア	56,289,443,638	9.24
	フランス	60,097,490,585	9.86
	オランダ	9,468,699,627	1.55
	スペイン	39,739,525,586	6.52
	ベルギー	15,255,944,193	2.50
	オーストリア	8,115,058,989	1.33
	フィンランド	3,175,354,781	0.52
	アイルランド	5,824,115,450	0.95

	イギリス	37,792,648,307	6.20
	スウェーデン	2,133,778,697	0.35
	ノルウェー	1,467,845,412	0.24
	デンマーク	3,206,830,146	0.52
	ポーランド	3,671,975,637	0.60
	オーストラリア	12,093,061,259	1.98
	シンガポール	2,560,538,819	0.42
	マレーシア	2,832,615,493	0.46
	南アフリカ	3,497,092,332	0.57
	小計	602,571,956,126	98.96
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,330,212,825	1.03
合計（純資産総額）		608,902,168,951	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	32,684,275	0.34
	メキシコ	949,175,954	9.88
	ブラジル	997,065,983	10.38
	チリ	329,779,007	3.43
	コロンビア	637,066,927	6.63
	ペルー	332,808,830	3.46
	ウルグアイ	11,439,200	0.11
	ドミニカ共和国	17,640,908	0.18
	トルコ	364,815,121	3.80
	チェコ	398,337,370	4.14
	ハンガリー	403,739,808	4.20
	ポーランド	809,877,207	8.43
	ロシア	745,956,022	7.77
	ルーマニア	223,642,707	2.32
	マレーシア	564,404,858	5.87
	タイ	827,120,538	8.61
	フィリピン	21,531,531	0.22
	インドネシア	964,867,833	10.05
	南アフリカ	793,747,379	8.26
	小計	9,425,701,458	98.18
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	173,966,244	1.81
合計（純資産総額）		9,599,667,702	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	395,118,256,550	99.00
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	3,977,967,349	0.99
合計（純資産総額）		399,096,223,899	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	3,915,000,000	0.98

（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	387,334,472,952	66.05
	カナダ	21,246,466,347	3.62
	ドイツ	17,714,517,719	3.02
	イタリア	4,772,080,209	0.81
	フランス	22,521,962,032	3.84
	オランダ	7,051,865,856	1.20
	スペイン	5,989,638,023	1.02
	ベルギー	2,161,229,747	0.36
	オーストリア	473,947,672	0.08
	ルクセンブルグ	202,665,310	0.03
	フィンランド	2,070,708,330	0.35
	アイルランド	1,119,097,182	0.19
	ポルトガル	326,005,099	0.05
	イギリス	34,234,468,651	5.83
	スイス	19,323,956,331	3.29
	スウェーデン	5,332,366,313	0.90
	ノルウェー	1,353,140,576	0.23
	デンマーク	3,490,867,284	0.59
	オーストラリア	14,052,324,134	2.39
	ニュージーランド	536,407,112	0.09
	香港	7,186,732,195	1.22
	シンガポール	2,550,193,781	0.43
	イスラエル	706,198,555	0.12
	小計	561,751,311,410	95.80
投資証券	アメリカ	12,547,204,583	2.13
	カナダ	114,429,333	0.01
	フランス	617,887,820	0.10

	イギリス	346,336,789	0.05
	オーストラリア	1,157,072,899	0.19
	香港	409,732,776	0.06
	シンガポール	265,730,319	0.04
	小計	15,458,394,519	2.63
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	9,158,856,612	1.56
合計（純資産総額）		586,368,562,541	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	5,514,176,654	0.94
	買建	カナダ	291,629,997	0.04
	買建	ドイツ	892,887,924	0.15
	買建	イギリス	480,793,104	0.08
	買建	スイス	270,457,013	0.04
	買建	オーストラリア	202,377,586	0.03

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	5,104,528,389	13.03
	メキシコ	900,053,391	2.29
	ブラジル	3,033,811,917	7.74
	チリ	161,098,240	0.41
	コロンビア	86,592,767	0.22
	ギリシャ	121,595,981	0.31
	イギリス	20,851,260	0.05
	トルコ	214,164,690	0.54
	チェコ	55,153,011	0.14
	ハンガリー	109,032,167	0.27
	ポーランド	398,796,144	1.01
	香港	8,424,820,425	21.52
	マレーシア	804,474,202	2.05
	タイ	1,114,056,492	2.84
	フィリピン	430,689,296	1.10
	インドネシア	825,103,792	2.10
	韓国	4,487,672,590	11.46
	台湾	4,210,213,283	10.75
	インド	3,190,220,118	8.14

	パキスタン	9,863,371	0.02
	カタール	380,453,400	0.97
	エジプト	51,324,203	0.13
	南アフリカ	2,134,522,436	5.45
	アラブ首長国連邦	273,369,344	0.69
	サウジアラビア	530,602,328	1.35
	小計	37,073,063,237	94.69
投資信託受益証券	アメリカ	637,252,689	1.62
投資証券	メキシコ	28,562,973	0.07
	南アフリカ	66,916,639	0.17
	小計	95,479,612	0.24
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,342,187,362	3.42
合計（純資産総額）		39,147,982,900	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,295,961,118	3.31

（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	42,503,434,240	96.79
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,405,563,971	3.20
合計（純資産総額）		43,908,998,211	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	956,862,000	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	19,811,894,837	72.48

	カナダ	528,555,605	1.93
	ドイツ	74,414,295	0.27
	イタリア	7,089,615	0.02
	フランス	1,013,082,473	3.70
	オランダ	70,556,454	0.25
	スペイン	189,780,146	0.69
	ベルギー	270,967,510	0.99
	アイルランド	71,971,832	0.26
	イギリス	1,295,036,905	4.73
	オーストラリア	1,927,348,464	7.05
	ニュージーランド	134,453,588	0.49
	香港	666,231,558	2.43
	シンガポール	985,733,933	3.60
	韓国	3,946,800	0.01
	イスラエル	19,716,273	0.07
	小計	27,070,780,288	99.03
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	262,408,009	0.96
合計（純資産総額）		27,333,188,297	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	230,099,520	0.84

（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	2,007,855	1.5440	3,100,174	1.5629	3,138,076	25.88
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	1,685,344	1.3482	2,272,349	1.3500	2,275,214	18.76
3	日本	親投資信託 受益証券	外国株式M S C I - K O K U S A Iマザーファンド	657,985	2.7585	1,815,095	2.8200	1,855,517	15.30
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	636,161	2.2807	1,450,900	2.3004	1,463,424	12.07
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,055,331	1.2277	1,295,647	1.2369	1,305,338	10.76
6	日本	親投資信託 受益証券	J - R E I T インデックス マ ザーファンド	355,706	2.3518	836,577	2.4566	873,827	7.20

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	351,813	2.4236	852,655	2.4407	858,669	7.08
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	247,983	1.3419	332,787	1.3745	340,852	2.81

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 （10年）第3 50回	7,950,000,000	102.10	8,117,583,000	102.77	8,170,215,000	0.1	2028/3/20	1.22
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 34回	7,600,000,000	104.14	7,914,972,000	104.17	7,917,452,000	0.6	2024/6/20	1.18
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 （5年）第12 6回	7,500,000,000	100.47	7,535,475,000	100.39	7,529,700,000	0.1	2020/12/20	1.12
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 （5年）第12 5回	7,200,000,000	100.40	7,229,088,000	100.32	7,223,328,000	0.1	2020/9/20	1.08
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 （5年）第12 7回	6,000,000,000	100.54	6,032,520,000	100.48	6,028,980,000	0.1	2021/3/20	0.90
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 45回	5,500,000,000	102.27	5,624,850,000	102.63	5,644,815,000	0.1	2026/12/20	0.84
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 32回	5,400,000,000	103.78	5,604,390,000	103.74	5,602,284,000	0.6	2023/12/20	0.83
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 46回	5,400,000,000	102.26	5,522,148,000	102.68	5,544,882,000	0.1	2027/3/20	0.83
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 43回	5,400,000,000	102.19	5,518,584,000	102.48	5,534,298,000	0.1	2026/6/20	0.82
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 29回	5,300,000,000	104.23	5,524,190,000	104.07	5,516,134,000	0.8	2023/6/20	0.82
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 44回	5,300,000,000	102.23	5,418,455,000	102.58	5,436,740,000	0.1	2026/9/20	0.81
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 51回	5,100,000,000	102.00	5,202,000,000	102.76	5,240,760,000	0.1	2028/6/20	0.78
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 （5年）第12 8回	5,200,000,000	100.62	5,232,396,000	100.56	5,229,484,000	0.1	2021/6/20	0.78
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 28回	5,000,000,000	103.17	5,158,800,000	103.05	5,152,950,000	0.6	2023/3/20	0.77
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 （10年）第3 49回	5,000,000,000	102.16	5,108,150,000	102.82	5,141,050,000	0.1	2027/12/20	0.77

16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 1 2 回	4,950,000,000	102.36	5,067,265,500	101.92	5,045,238,000	1.2	2020/12/20	0.75
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 3 0 回	5,000,000,000	100.76	5,038,200,000	100.74	5,037,150,000	0.1	2021/12/20	0.75
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 5 2 回	4,800,000,000	101.99	4,895,793,000	102.74	4,931,712,000	0.1	2028/9/20	0.73
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 3 1 回	4,800,000,000	100.84	4,840,488,000	100.83	4,840,032,000	0.1	2022/3/20	0.72
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 2 回	4,650,000,000	102.11	4,748,487,000	102.36	4,759,740,000	0.1	2026/3/20	0.71
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 8 回	4,500,000,000	102.23	4,600,440,000	102.77	4,625,055,000	0.1	2027/9/20	0.69
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 3 5 回	4,500,000,000	101.19	4,553,920,000	101.24	4,556,070,000	0.1	2023/3/20	0.68
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 2 5 回	4,400,000,000	103.45	4,552,064,000	103.23	4,542,472,000	0.8	2022/9/20	0.68
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 7 回	4,400,000,000	102.24	4,498,632,000	102.77	4,522,012,000	0.1	2027/6/20	0.67
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 0 回	4,200,000,000	103.93	4,365,102,000	104.05	4,370,142,000	0.4	2025/9/20	0.65
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 3 3 回	4,200,000,000	103.95	4,366,278,000	103.95	4,366,278,000	0.6	2024/3/20	0.65
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 3 5 回	4,200,000,000	103.86	4,362,322,000	103.90	4,363,884,000	0.5	2024/9/20	0.65
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 3 6 回	4,300,000,000	101.27	4,354,825,000	101.37	4,359,039,000	0.1	2023/6/20	0.65
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 3 3 回	4,000,000,000	101.03	4,041,200,000	101.04	4,041,680,000	0.1	2022/9/20	0.60
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 2 9 回	4,000,000,000	100.69	4,027,760,000	100.66	4,026,600,000	0.1	2021/9/20	0.60

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.85
地方債証券	6.67
特殊債券	8.82
社債券	4.05
合 計	99.41

（参考）外国債券マザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	72,200,000	13,408.98	9,681,284,772	13,586.79	9,809,662,380	6	2026/2/15	1.61

2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,808.83	7,598,607,796	11,074.49	7,785,366,470	2.25	2025/11/15	1.27
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,800,000	10,927.89	7,736,953,033	10,956.93	7,757,511,519	2.625	2020/11/15	1.27
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,716.31	7,533,570,821	10,846.17	7,624,861,331	1.75	2022/4/30	1.25
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	40,400,000	13,434.86	5,427,684,845	13,818.49	5,582,673,385	5.25	2028/11/15	0.91
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,800,000	11,115.49	5,424,360,993	11,145.36	5,438,935,786	3.625	2021/2/15	0.89
7	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,140.26	5,162,830,944	15,424.45	5,259,739,922	3.5	2026/4/25	0.86
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	10,676.42	5,114,007,783	10,834.29	5,189,626,576	1.75	2023/1/31	0.85
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,900,000	10,690.85	5,014,010,995	10,933.59	5,127,856,973	2	2025/2/15	0.84
10	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	18,342.10	4,952,368,755	18,915.91	5,107,297,893	5.5	2029/4/25	0.83
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,000,000	10,775.73	4,956,835,800	11,004.89	5,062,250,300	2.125	2024/9/30	0.83
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,400,000	11,050.03	5,016,717,486	11,098.67	5,038,800,128	3.125	2021/5/15	0.82
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	10,913.97	4,922,202,455	11,133.90	5,021,389,783	2.375	2024/8/15	0.82
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,400,000	10,155.79	4,712,287,036	10,711.22	4,970,008,400	2.5	2045/2/15	0.81
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	35,600,000	13,491.73	4,803,055,880	13,883.85	4,942,651,297	5.25	2029/2/15	0.81
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,623.45	4,897,901,890	12,732.09	4,940,054,210	6.25	2023/8/15	0.81
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	34,100,000	13,938.17	4,752,916,637	14,230.99	4,852,767,738	6.5	2026/11/15	0.79
18	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,100,000	20,246.49	4,474,476,119	21,239.97	4,694,035,036	5.75	2032/10/25	0.77
19	イギリス	国債証券	UK TREASURY	23,600,000	18,283.12	4,314,817,217	19,321.72	4,559,927,737	3.5	2045/1/22	0.74
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	11,150.87	4,114,673,597	11,749.24	4,335,471,566	3	2044/11/15	0.71
21	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,300,000	14,633.69	4,287,671,902	14,680.35	4,301,342,740	4.25	2023/10/25	0.70
22	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	30,400,000	13,842.32	4,208,065,827	14,061.67	4,274,749,413	5.5	2022/11/1	0.70
23	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	22,900,000	17,455.67	3,997,348,865	18,437.52	4,222,194,072	3.25	2044/1/22	0.69
24	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	21,200,000	17,621.02	3,735,657,512	19,658.59	4,167,621,816	3.25	2045/5/25	0.68
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,800,000	10,731.45	3,949,176,986	10,792.70	3,971,715,440	1.375	2020/8/31	0.65
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	28,300,000	13,606.31	3,850,585,853	13,982.73	3,957,113,082	5.5	2028/8/15	0.64
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,000,000	11,053.27	3,868,644,652	11,294.31	3,953,010,402	2.625	2025/3/31	0.64
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,200,000	10,835.99	3,922,628,538	10,880.12	3,938,605,408	2.125	2020/8/31	0.64
29	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000	20,337.42	3,559,049,537	22,211.58	3,887,026,852	4.5	2041/4/25	0.63
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	26,700,000	14,186.93	3,787,912,312	14,521.26	3,877,177,349	5.375	2031/2/15	0.63

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.96
合 計	98.96

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （%）	償還期限	投資 比率 （%）
1	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	11,840,000,000	4.07	482,022,561	4.20	497,976,979	9.85	2027/6/28	5.18
2	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	651,000	3,148.87	205,002,235	3,286.04	213,921,826	10	2025/1/1	2.22
3	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	7,000,000	2,866.38	200,647,117	2,957.49	207,024,823	2.75	2028/4/25	2.15
4	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000	3,094.48	188,780,846	3,198.33	195,098,523	10	2023/1/1	2.03
5	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	7,000,000	2,339.39	163,757,969	2,403.64	168,254,808	—	2022/1/1	1.75
6	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	546,000	3,045.29	166,278,950	3,055.34	166,822,080	10	2021/1/1	1.73
7	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5,600,000	2,875.95	161,053,275	2,902.74	162,553,523	2.5	2024/4/25	1.69
8	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	4,740,000	3,061.85	145,131,817	3,069.63	145,500,807	4	2023/10/25	1.51
9	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	16,500,000	839.16	138,462,736	855.48	141,155,761	10.5	2026/12/21	1.47
10	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,040,000,000	3.43	138,797,890	3.44	139,089,948	7.75	2021/4/14	1.44
11	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	28,900,000	448.24	129,542,529	464.34	134,195,939	1	2026/6/26	1.39
12	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	19,500,000	682.55	133,097,632	680.52	132,701,760	8.75	2048/2/28	1.38
13	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	380,000	3,164.76	120,270,257	3,353.71	127,441,241	10	2027/1/1	1.32
14	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	26,900,000	447.00	120,243,369	458.13	123,238,315	0.45	2023/10/25	1.28
15	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	21,150,000	541.32	114,491,084	571.72	120,919,076	7.5	2027/6/3	1.25
16	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	21,100,000	543.27	114,631,213	558.63	117,871,816	6.5	2022/6/9	1.22
17	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,730,000	2,987.55	111,435,916	2,957.30	110,307,295	5.25	2020/10/25	1.14
18	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	60,500,000	169.52	102,565,287	174.52	105,586,173	7.6	2022/7/20	1.09
19	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	61,700,000	159.98	98,710,074	170.76	105,360,345	7.05	2028/1/19	1.09
20	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	59,000,000	168.10	99,179,915	177.41	104,675,393	7.75	2026/9/16	1.09
21	チリ	国債証券	BONOS TESORERIA PESOS	490,000,000	16.77	82,212,168	19.43	95,222,138	5	2035/3/1	0.99
22	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	22,500,000	374.53	84,269,584	422.34	95,027,930	3.4	2036/6/17	0.98
23	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	24,500,000	365.32	89,504,079	383.64	93,991,967	2.875	2028/12/17	0.97
24	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	20,200,000	421.96	85,235,960	455.29	91,969,776	0.95	2030/5/15	0.95

25	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	11,000,000,000	0.77	85,507,422	0.82	90,689,021	8.25	2036/5/15	0.94
26	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	12,500,000,000	0.68	85,608,900	0.72	90,661,350	6.125	2028/5/15	0.94
27	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3,300,000	2,626.16	86,663,391	2,684.16	88,577,416	3.899	2027/11/16	0.92
28	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,300,000	2,600.22	85,807,528	2,650.32	87,460,761	3.733	2028/6/15	0.91
29	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,600,000	566.56	77,052,320	606.81	82,527,017	8.5	2038/11/18	0.85
30	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000	375.51	81,485,723	378.00	82,027,024	3.625	2023/6/16	0.85

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.18
合 計	98.18

（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	1,965,300	6,537.66	12,848,463,198	7,024.00	13,804,267,200	3.45
2	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,373,100	5,450.93	7,484,671,983	5,628.00	7,727,806,800	1.93
3	日本	株式	ソニー	電気機器	1,183,500	5,405.46	6,397,372,462	6,170.00	7,302,195,000	1.82
4	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	11,973,700	523.16	6,264,160,892	524.20	6,276,613,540	1.57
5	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,183,600	4,749.60	5,621,626,560	4,922.00	5,825,679,200	1.45
6	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,539,600	4,277.90	6,586,254,840	3,635.00	5,596,446,000	1.40
7	日本	株式	キーエンス	電気機器	86,600	66,588.58	5,766,571,028	63,130.00	5,467,058,000	1.36
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,226,000	3,878.47	4,755,013,432	3,807.00	4,667,382,000	1.16
9	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,207,200	3,289.57	3,971,168,904	3,718.00	4,488,369,600	1.12
10	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,418,600	2,565.25	3,639,063,650	2,853.50	4,047,975,100	1.01
11	日本	株式	任天堂	その他製品	100,900	37,036.36	3,736,968,724	40,100.00	4,046,090,000	1.01
12	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,487,700	2,830.33	4,210,681,941	2,710.50	4,032,410,850	1.01
13	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	23,635,500	166.99	3,946,892,145	154.40	3,649,321,200	0.91
14	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	622,000	5,460.01	3,396,126,220	5,797.00	3,605,734,000	0.90
15	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,218,900	2,845.03	3,467,807,067	2,936.50	3,579,299,850	0.89
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	157,900	22,150.99	3,497,641,321	21,920.00	3,461,168,000	0.86
17	日本	株式	花王	化学	428,100	8,428.93	3,608,424,933	7,979.00	3,415,809,900	0.85
18	日本	株式	信越化学工業	化学	304,400	9,464.57	2,881,015,108	11,155.00	3,395,582,000	0.85
19	日本	株式	第一三共	医薬品	504,700	5,526.83	2,789,391,101	6,647.00	3,354,740,900	0.84
20	日本	株式	ファナック	電気機器	167,600	19,146.39	3,208,934,964	19,530.00	3,273,228,000	0.82

21	日本	株式	ダイキン工業	機械	240,700	13,621.40	3,278,670,980	13,585.00	3,269,909,500	0.81
22	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	313,600	9,914.35	3,109,140,160	10,005.00	3,137,568,000	0.78
23	日本	株式	日本電産	電気機器	212,200	14,878.00	3,157,111,600	14,715.00	3,122,523,000	0.78
24	日本	株式	日立製作所	電気機器	793,900	3,686.46	2,926,680,594	3,892.00	3,089,858,800	0.77
25	日本	株式	H O Y A	精密機器	355,000	7,723.98	2,742,012,900	8,405.00	2,983,775,000	0.74
26	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	199,100	12,417.61	2,472,346,151	14,440.00	2,875,004,000	0.72
27	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	1,095,700	2,414.12	2,645,151,284	2,615.00	2,865,255,500	0.71
28	日本	株式	キヤノン	電気機器	949,400	3,052.17	2,897,730,198	2,970.50	2,820,192,700	0.70
29	日本	株式	資生堂	化学	350,400	8,419.73	2,950,273,392	8,046.00	2,819,318,400	0.70
30	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	728,000	3,697.90	2,692,071,200	3,728.00	2,713,984,000	0.68

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.26
		建設業	2.73
		食料品	3.98
		繊維製品	0.62
		パルプ・紙	0.26
		化学	7.26
		医薬品	5.53
		石油・石炭製品	0.58
		ゴム製品	0.75
		ガラス・土石製品	0.83
		鉄鋼	0.84
		非鉄金属	0.73
		金属製品	0.57
		機械	4.99
		電気機器	13.73
		輸送用機器	7.66
		精密機器	2.11
		その他製品	2.17
		電気・ガス業	1.68
		陸運業	4.62
		海運業	0.16
		空運業	0.54
		倉庫・運輸関連業	0.19
		情報・通信業	8.94
		卸売業	4.89
		小売業	4.59
		銀行業	5.75

	証券、商品先物取引業	0.71
	保険業	2.35
	その他金融業	1.08
	不動産業	2.40
	サービス業	5.21
合 計		99.00

（参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,008,600	12,827.27	12,937,586,922	15,247.62	15,378,753,566	2.62
2	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	652,500	20,617.34	13,452,814,871	22,681.85	14,799,913,128	2.52
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	57,780	193,549.04	11,183,263,799	206,256.29	11,917,488,968	2.03
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	330,300	18,128.42	5,987,819,568	21,406.42	7,070,542,376	1.20
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	43,530	127,348.20	5,543,467,327	133,099.20	5,793,808,594	0.98
6	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	453,400	11,003.15	4,988,830,431	12,557.69	5,693,660,092	0.97
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	41,460	127,728.47	5,295,622,514	133,409.91	5,531,175,283	0.94
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	368,800	15,174.85	5,596,485,511	14,349.17	5,291,974,339	0.90
9	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	424,200	10,421.38	4,420,752,803	11,537.01	4,894,000,575	0.83
10	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	586,800	8,757.49	5,138,896,168	8,186.02	4,803,558,883	0.81
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	242,400	16,975.99	4,114,982,147	19,721.41	4,780,472,014	0.81
12	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	346,500	11,305.48	3,917,350,898	13,081.34	4,532,685,142	0.77
13	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,271,100	2,996.06	3,808,296,041	3,355.88	4,265,671,271	0.72
14	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	180,600	21,818.68	3,940,453,637	22,576.47	4,077,311,999	0.69
15	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	249,400	12,112.83	3,020,942,102	15,745.19	3,926,851,683	0.66
16	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術 サービス	126,470	25,605.33	3,238,306,748	30,219.30	3,821,835,175	0.65
17	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気 通信サー ビス	1,009,200	3,407.37	3,438,721,611	3,713.31	3,747,477,700	0.63
18	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	609,900	5,863.85	3,576,362,423	6,134.90	3,741,675,998	0.63
19	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売 り	156,500	20,843.88	3,262,067,903	23,613.99	3,695,589,498	0.63

20	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	132,900	26,851.58	3,568,575,731	27,695.59	3,680,744,602	0.62
21	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	263,300	13,366.40	3,519,374,503	13,508.29	3,556,734,758	0.60
22	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	572,500	6,418.74	3,674,728,810	6,152.28	3,522,182,132	0.60
23	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	623,200	5,820.81	3,627,533,272	5,616.68	3,500,319,962	0.59
24	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	562,900	5,097.18	2,869,207,468	5,836.14	3,285,163,656	0.56
25	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	769,200	4,612.92	3,548,261,926	4,214.14	3,241,520,796	0.55
26	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	357,700	9,029.44	3,229,833,441	9,046.45	3,235,916,167	0.55
27	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	599,000	5,244.27	3,141,321,892	5,274.47	3,159,408,728	0.53
28	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	626,000	4,346.02	2,720,610,113	4,788.85	2,997,820,851	0.51
29	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品	300,500	9,251.45	2,780,062,080	9,956.90	2,992,048,510	0.51
30	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	97,380	30,085.20	2,929,697,504	29,221.09	2,845,550,621	0.48

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.34
		メディア	1.26
		娯楽	1.39
		不動産管理・開発	0.52
		エネルギー設備・サービス	0.32
		石油・ガス・消耗燃料	5.42
		化学	2.24
		建設資材	0.27
		容器・包装	0.30
		金属・鉱業	1.42
		紙製品・林産品	0.08
		航空宇宙・防衛	2.30
		建設関連製品	0.38
		建設・土木	0.32
		電気設備	0.68
		コングロマリット	1.33
		機械	1.57
		商社・流通業	0.26
		商業サービス・用品	0.48
		航空貨物・物流サービス	0.49
		旅客航空輸送業	0.09
		海運業	0.04
		陸運・鉄道	1.09

運送インフラ	0.21
自動車部品	0.28
自動車	0.78
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	1.46
ホテル・レストラン・レジャー	1.92
販売	0.06
インターネット販売・通信販売	2.56
複合小売り	0.48
専門小売り	1.69
食品・生活必需品小売り	1.47
飲料	2.05
食品	2.02
タバコ	0.87
家庭用品	1.41
パーソナル用品	0.71
ヘルスケア機器・用品	2.80
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.91
バイオテクノロジー	1.71
医薬品	5.16
銀行	7.72
各種金融サービス	0.92
保険	3.87
情報技術サービス	4.30
ソフトウェア	5.30
通信機器	0.94
コンピュータ・周辺機器	2.80
電子装置・機器・部品	0.52
半導体・半導体製造装置	3.04
各種電気通信サービス	2.02
無線通信サービス	0.29
電力	1.93
ガス	0.16
総合公益事業	1.06
水道	0.08
消費者金融	0.51
資本市場	2.78
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	0.09
ヘルスケア・テクノロジー	0.11
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.75

		専門サービス	0.75
投資証券	—	—	2.63
合 計			98.43

（参考）新興国株式マザーファンド

順位	国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	363,200	5,190.13	1,885,057,600	5,183.74	1,882,737,274	4.80
2	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネット販 売・通信販 売	90,600	19,261.20	1,745,064,774	18,914.22	1,713,628,694	4.37
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	1,566,000	893.90	1,399,854,295	910.00	1,425,060,000	3.64
4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュー タ・周辺機 器	304,490	3,913.78	1,191,707,602	4,282.60	1,304,008,874	3.33
5	南アフリ カ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インター ネット販 売・通信販 売	28,020	26,037.46	729,569,830	27,074.63	758,631,189	1.93
6	アメリカ	投資信託受 益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	—	208,300	2,864.75	596,728,860	3,059.30	637,252,689	1.62
7	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,154,000	89.28	549,478,077	85.42	525,696,219	1.34
8	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	355,000	1,205.93	428,107,969	1,321.63	469,179,893	1.19
9	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信 サービス	390,500	1,009.26	394,116,936	937.57	366,123,038	0.93
10	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵 当・不動産 金融	104,900	3,073.13	322,371,364	3,382.32	354,806,155	0.90
11	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガ ス・消耗燃 料	183,100	2,004.39	367,004,409	1,877.63	343,794,236	0.87

12	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	305,091	935.33	285,361,183	1,024.81	312,660,460	0.79
13	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,184,000	76.51	320,150,208	74.58	312,081,631	0.79
14	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	204,021	1,393.43	284,290,357	1,432.78	292,318,535	0.74
15	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術 サービス	225,200	1,146.32	258,151,920	1,260.39	283,840,504	0.72
16	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	686,300	385.01	264,238,237	403.30	276,786,230	0.70
17	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガ ス・消耗燃 料	338,700	548.21	185,681,622	802.19	271,704,381	0.69
18	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PREF	銀行	259,415	1,004.48	260,577,932	1,014.20	263,101,287	0.67
19	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	35,280	6,920.94	244,170,816	7,258.80	256,090,464	0.65
20	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	5,127,000	48.47	248,549,313	44.86	230,021,317	0.58
21	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガ ス・消耗燃 料	26,230	8,737.70	229,190,073	8,684.68	227,799,198	0.58
22	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	17,910	16,830.91	301,441,744	12,249.16	219,382,456	0.56
23	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・ 機器・部品	805,649	292.23	235,435,780	272.30	219,378,223	0.56
24	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガ ス・消耗燃 料	1,132,000	184.86	209,264,586	182.23	206,292,058	0.52
25	ブラジル	株式	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	石油・ガ ス・消耗燃 料	271,600	768.04	208,602,140	751.77	204,182,362	0.52
26	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術 サービス	58,300	3,447.61	200,996,143	3,464.84	202,000,668	0.51
27	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュ ータ・周辺機 器	53,300	3,199.05	170,509,752	3,500.60	186,581,980	0.47
28	ブラジル	株式	AMBEV SA	飲料	300,256	501.36	150,536,905	582.74	174,971,482	0.44
29	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信 サービス	2,183,000	77.29	168,736,215	78.60	171,590,349	0.43
30	カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	287,720	544.39	156,632,753	583.30	167,827,824	0.42

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	6.15
		メディア	0.33
		娯楽	0.63
		不動産管理・開発	2.58
		エネルギー設備・サービス	0.08
		石油・ガス・消耗燃料	7.35
		化学	2.26
		建設資材	1.09
		容器・包装	0.05
		金属・鉱業	3.17
		紙製品・林産品	0.23
		航空宇宙・防衛	0.14
		建設関連製品	0.01
		建設・土木	0.66
		電気設備	0.22
		コングロマリット	1.23
		機械	0.51
		商社・流通業	0.04
		商業サービス・用品	0.13
		航空貨物・物流サービス	0.15
		旅客航空輸送業	0.22
		海運業	0.08
		陸運・鉄道	0.31
		運送インフラ	0.91
		自動車部品	0.49
		自動車	1.71
		家庭用耐久財	0.28
		レジャー用品	0.05
		繊維・アパレル・贅沢品	0.83
		ホテル・レストラン・レジャー	0.69
		インターネット販売・通信販売	7.37
		複合小売り	0.59
		専門小売り	0.49

		食品・生活必需品小売り	1.72
		飲料	1.15
		食品	1.75
		タバコ	0.52
		家庭用品	0.42
		パーソナル用品	0.59
		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	0.50
		バイオテクノロジー	0.38
		医薬品	1.04
		銀行	16.39
		各種金融サービス	0.86
		保険	3.85
		情報技術サービス	1.76
		ソフトウェア	0.14
		通信機器	0.06
		コンピュータ・周辺機器	4.62
		電子装置・機器・部品	1.84
		半導体・半導体製造装置	5.29
		各種電気通信サービス	1.50
		無線通信サービス	2.81
		電力	1.11
		ガス	0.59
		総合公益事業	0.05
		水道	0.27
		貯蓄・抵当・不動産金融	0.98
		消費者金融	0.23
		資本市場	1.32
		各種消費者サービス	0.57
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.54
		ヘルスケア・テクノロジー	0.05
		ライフサイエンス・ツール/サービス	0.27
		専門サービス	0.02
		その他の業種	0.00
投資信託受益証券	—	—	1.62
投資証券	—	—	0.24

合 計	96.57
-----	-------

（参考）Ｊ－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	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,044	750,235	3,033,952,119	764,000	3,089,616,000	7.03
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,176	655,529	2,737,491,567	681,000	2,843,856,000	6.47
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	13,024	166,794	2,172,337,168	172,900	2,251,849,600	5.12
4	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	8,321	197,574	1,644,019,577	211,300	1,758,227,300	4.00
5	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,893	218,687	1,726,096,491	218,800	1,726,988,400	3.93
6	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,377	177,491	1,664,338,733	184,100	1,726,305,700	3.93
7	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,000	231,325	1,387,954,740	261,700	1,570,200,000	3.57
8	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,630	256,921	1,446,469,339	266,500	1,500,395,000	3.41
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	3,867	316,484	1,223,845,058	337,500	1,305,112,500	2.97
10	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	2,644	471,273	1,246,047,134	481,500	1,273,086,000	2.89
11	日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	10,402	117,859	1,225,972,022	121,400	1,262,802,800	2.87
12	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,454	87,831	1,181,679,888	90,800	1,221,623,200	2.78
13	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	18,320	59,868	1,096,799,347	62,500	1,145,000,000	2.60
14	日本	投資証券	アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,093	469,784	983,258,142	499,500	1,045,453,500	2.38
15	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	12,211	77,904	951,291,849	84,400	1,030,608,400	2.34
16	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,292	751,721	971,224,733	782,000	1,010,344,000	2.30
17	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,388	588,031	816,187,250	641,000	889,708,000	2.02
18	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	964	760,872	733,481,186	805,000	776,020,000	1.76
19	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,805	151,755	729,185,609	160,300	770,241,500	1.75
20	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,138	129,602	665,895,127	142,400	731,651,200	1.66
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	2,729	246,887	673,755,741	261,300	713,087,700	1.62
22	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,421	468,424	665,631,853	469,000	666,449,000	1.51
23	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,395	183,789	623,966,472	194,200	659,309,000	1.50
24	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,740	160,527	600,373,336	162,000	605,880,000	1.37
25	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,287	136,391	584,710,274	141,300	605,753,100	1.37
26	日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,357	421,309	571,716,625	437,000	593,009,000	1.35
27	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,739	299,182	520,278,697	325,500	566,044,500	1.28
28	日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	3,772	136,168	513,625,997	146,700	553,352,400	1.26

29	日本	投資証券	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,800	184,867	517,628,328	197,300	552,440,000	1.25
30	日本	投資証券	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,985	174,883	522,026,202	181,100	540,583,500	1.23

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.79
合 計	96.79

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （%）
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	126,980	8,504.65	1,079,921,019	8,909.56	1,131,336,742	4.13
2	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	62,210	17,742.85	1,103,783,258	17,405.21	1,082,778,388	3.96
3	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	30,230	26,625.66	804,893,825	26,410.38	798,385,908	2.92
4	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	81,700	9,048.76	739,284,083	9,120.32	745,130,798	2.72
5	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	74,770	8,471.07	633,382,078	8,641.22	646,104,438	2.36
6	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	28,130	22,705.82	638,714,903	22,907.83	644,397,269	2.35
7	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	74,300	7,062.72	524,760,207	7,354.92	546,471,150	1.99
8	香港	投資証券	LINK REIT	425,100	1,346.36	572,339,240	1,281.35	544,702,948	1.99
9	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	41,880	12,617.41	528,417,450	12,384.96	518,682,125	1.89
10	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	63,300	7,885.77	499,169,660	7,606.97	481,521,378	1.76
11	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	31,060	14,777.15	458,978,329	14,450.20	448,823,411	1.64
12	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,220	32,235.92	426,158,881	33,317.71	440,460,195	1.61
13	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	27,680	16,507.50	456,927,661	15,179.04	420,156,035	1.53
14	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,790	16,342.85	372,453,553	16,080.89	366,483,547	1.34
15	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	323,400	1,069.00	345,716,887	1,109.89	358,941,401	1.31
16	アメリカ	投資証券	HCP INC	96,500	3,449.18	332,846,813	3,503.64	338,101,260	1.23
17	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	34,410	9,229.30	317,580,274	9,385.40	322,951,944	1.18
18	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,075,000	286.74	308,251,484	295.37	317,529,630	1.16
19	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	25,780	11,892.09	306,578,083	12,156.81	313,402,717	1.14
20	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	23,060	12,759.13	294,225,661	12,952.06	298,674,522	1.09
21	アメリカ	投資証券	UDR INC	56,900	5,011.87	285,175,841	5,062.62	288,063,306	1.05
22	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	149,700	1,991.83	298,176,966	1,920.75	287,537,054	1.05
23	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	72,200	3,420.20	246,938,567	3,658.99	264,179,453	0.96
24	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	18,130	14,103.43	255,695,347	14,498.00	262,848,885	0.96
25	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	84,400	2,910.80	245,672,182	3,015.84	254,537,436	0.93
26	アメリカ	投資証券	VORNADO REALTY TRUST	34,900	7,413.92	258,745,961	7,008.36	244,591,987	0.89
27	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	33,500	7,331.87	245,617,945	7,271.27	243,587,719	0.89
28	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	18,080	13,360.19	241,552,252	13,453.97	243,247,915	0.88
29	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	218,500	945.70	206,635,803	1,032.26	225,550,851	0.82
30	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	19,450	11,539.24	224,438,226	11,525.61	224,173,262	0.82

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	99.03
合 計	99.03

【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 - 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

該当事項はありません。

（参考）外国株式M S C I - K O K U S A I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(2019年09月限)	買建	250	日本円	3,914,464,500	3,915,000,000	0.98

（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(2019 年09月限)	買建	337	米ドル	49,684,400	5,397,713,216	50,756,412.5	5,514,176,654	0.94
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2019年09 月限)	買建	18	カナダド ル	3,519,610	290,966,159	3,527,640	291,629,997	0.04
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指数 先物(2019年09月 限)	買建	213	ユーロ	7,340,910	889,644,881	7,367,670	892,887,924	0.15
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SP1200株価指数先 物(2019年09月限)	買建	16	豪ドル	2,632,250	196,339,527	2,713,200	202,377,586	0.03
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指数先 物(2019年09月限)	買建	48	英ポンド	3,548,240	468,261,237	3,643,200	480,793,104	0.08
	スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取引 所	SMI株価指数先物 (2019年09月限)	買建	25	スイスフ ラン	2,466,200	270,616,126	2,464,750	270,457,013	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エマージングマーケット株価指数先物(2019年09月限)	買建	230	米ドル	11,989,685	1,302,559,375	11,928,950	1,295,961,118	3.31

（参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建／売建	枚数	通貨	帳簿価額（円）	評価額（円）	投資比率（％）
REIT指数先物取引	大阪取引所	REIT指数先物(2019年09月限)	買建	477	日本円	906,971,616	956,862,000	2.17

（参考）海外ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国／地域	取引所	名称	買建／売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額（円）	評価額	評価額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴボード オブトレード	ダウ・ジョーンズ米国不動産指数先物(2019年09月限)	買建	60	米ドル	2,120,360	230,355,915	2,118,000	230,099,520	0.84

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０４０

2019年7月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

		純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額(円)	
		（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間	(2018年 6月22日)	3	3	1.0433	1.0438
第2計算期間	(2019年 6月24日)	11	11	1.0457	1.0462
	2018年 7月末日	4	—	1.0565	—
	8月末日	4	—	1.0526	—
	9月末日	5	—	1.0778	—
	10月末日	5	—	1.0172	—

11月末日	5	—	1.0388	—
12月末日	5	—	0.9779	—
2019年 1月末日	6	—	1.0178	—
2月末日	6	—	1.0437	—
3月末日	8	—	1.0505	—
4月末日	9	—	1.0652	—
5月末日	10	—	1.0230	—
6月末日	11	—	1.0467	—
7月末日	12	—	1.0594	—

【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
第2計算期間	2018年 6月23日～2019年 6月24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%
第2計算期間	2018年 6月23日～2019年 6月24日	0.3%

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

（４）【設定及び解約の実績】

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
第2計算期間	2018年 6月23日～2019年 6月24日	7,911,071	907,263	10,778,835

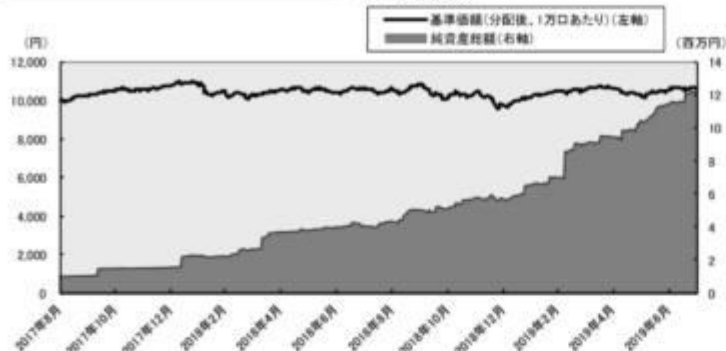
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報

運用実績 (2019年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)

2019年6月	5 円
2018年6月	5 円
—	—
—	—
—	—
設定来累計	10 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	25.9
2	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	18.8
3	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	15.3
4	外国債券マザーファンド	12.1
5	新興国株式マザーファンド	10.8
6	J-REITインデックス マザーファンド	7.2
7	海外REITインデックス マザーファンド	7.1
8	新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド	2.8

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(10年)第350回	国債証券	0.2
2	国庫債券 利付(10年)第334回	国債証券	0.2
3	国庫債券 利付(5年)第126回	国債証券	0.2
4	国庫債券 利付(5年)第125回	国債証券	0.2
5	国庫債券 利付(5年)第127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 BOND	国債証券	0.2
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.2
5	US TREASURY BOND	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	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1
3	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1
4	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1
5	LETRA 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	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.5
3	ソニー	電気機器	0.5
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.4
2	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.4
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.3
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.2
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1

・「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	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.5
2	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	0.5
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.4
4	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.4
5	NASPER LTD-N SHS	インターネット販売・通信販売	0.2

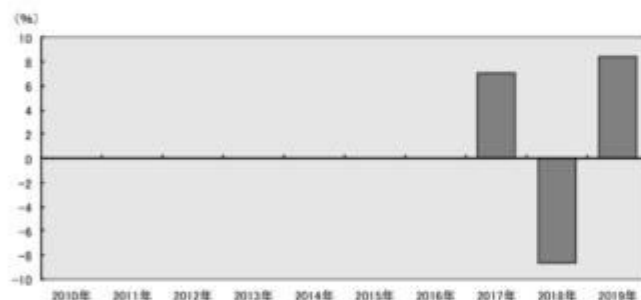
・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じての投資銘柄

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	0.5
2	ジャパニアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.5
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	0.4
4	オリックス不動産投資法人 投資証券	投資証券	0.3
5	日本リテールファンド投資法人 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	PROLOGIS INC	投資証券	0.3
2	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.3
3	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.2
4	WELLTOWER INC	投資証券	0.2
5	EQUITY RESIDENTIAL	投資証券	0.2

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おりません。

・2017年は設定日(2017年8月31日)から年末までの収益率。

・2019年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・ 申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
- ・ 取得申込みの受付けについては、午後3時までに取得申込みが行われかつ当該取得申込みの受付けにかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込み分とします。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 販売の単位は、1円以上1円単位(当初元本1口＝1円)とします。

■ 積立方式 ■

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

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

- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 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」という場合があります。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けを中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付け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けについては、午後3時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付けにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。
- ・ 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付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消す場合があります。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

< 基準価額の計算方法 >

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に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す。

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】

2065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たときは、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於いて存続します。

(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ます。
- () 委託者は、上記()の事項（上記()の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。）について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- () 上記()の書面決議において、受益者（委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- () 上記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- () 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- () 上記()から()までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- () 上記()から()の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決され

た場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

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

して5営業日までに支払いを開始します。販売会社でお受取りください。

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

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

■ 収益分配金請求権の失効 ■

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

■ 償還金の支払い開始日 ■

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

■ 償還金請求権の失効 ■

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第2期計算期間(2018年6月23日から2019年6月24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)	第2期 (2019年 6月24日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	10,512	34,288
親投資信託受益証券	3,933,848	11,259,476
未収入金	643	11,929
流動資産合計	3,945,003	11,305,693
資産合計	3,945,003	11,305,693
負債の部		
流動負債		
未払収益分配金	1,887	5,389
未払解約金	-	10,473
未払受託者報酬	439	1,784
未払委託者報酬	4,157	16,864
その他未払費用	78	143
流動負債合計	6,561	34,653
負債合計	6,561	34,653
純資産の部		
元本等		
元本	3,775,027	10,778,835
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	163,415	492,205
（分配準備積立金）	30,886	154,341
元本等合計	3,938,442	11,271,040
純資産合計	3,938,442	11,271,040
負債純資産合計	3,945,003	11,305,693

（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	第2期 自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日
営業収益		
有価証券売買等損益	43,644	105,204
営業収益合計	43,644	105,204
営業費用		
支払利息	1	-
受託者報酬	791	2,842
委託者報酬	7,265	26,786
その他費用	198	271
営業費用合計	8,255	29,899
営業利益又は営業損失（ ）	35,389	75,305
経常利益又は経常損失（ ）	35,389	75,305
当期純利益又は当期純損失（ ）	35,389	75,305
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	13,010
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-	163,415
剰余金増加額又は欠損金減少額	134,487	309,260
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	309,260
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,958	37,376
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	37,376
分配金	1,887	5,389
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	163,415	492,205

(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、2018年 6月23日から2019年 6月24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	第2期 2019年 6月24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	1. 計算期間の末日における受益権の総数 10,778,835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)	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 1.0457円 (10,000口当たり純資産額) (10,457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	第2期 自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>32,722円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>51円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>132,529円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>0円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>165,302円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>3,775,027口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>437円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>5円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>1,887円</td></tr></table>	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	<table><tr><th>項目</th><th></th><th></th></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>133,485円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>0円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>337,864円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>26,245円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>497,594円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>10,778,835口</td></tr><tr><td>10,000口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F×10,000</td><td>461円</td></tr><tr><td>10,000口当たり分配金額</td><td>H</td><td>5円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F×H/10,000</td><td>5,389円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	133,485円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	337,864円	分配準備積立金額	D	26,245円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	497,594円	当ファンドの期末残存口数	F	10,778,835口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	461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	5,389円
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																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	133,485円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	337,864円																																																											
分配準備積立金額	D	26,245円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	497,594円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	10,778,835口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	461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	5,389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	第2期 自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24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、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 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。 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。	1.金融商品に対する取組方針 同左 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左 3.金融商品に係るリスク管理体制 同左

(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	第2期 2019年 6月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	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。	同左
2. 時価の算定方法 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	2. 時価の算定方法 同左

（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	第2期 自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていないため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第1期 自 2017年 8月31日 至 2018年 6月22日	第2期 自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日
期首元本額 - 円	期首元本額 3,775,027円
期中追加設定元本額 3,834,123円	期中追加設定元本額 7,911,071円
期中一部解約元本額 59,096円	期中一部解約元本額 907,263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	第2期 自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	38,744	87,079
合計	38,744	87,079

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(2019年6月24日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年6月24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	1,971,165	3,041,507	
		外国債券マザーファンド	588,368	1,341,596	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	664,732	1,831,735	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1,477,870	1,993,498	
		J-REITインデックスマザーファンド	308,511	723,797	
		海外REITインデックスマザーファンド	301,377	731,291	
		新興国株式マザーファンド	1,031,063	1,264,804	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	247,090	331,248	
	小計	銘柄数：8 組入時価比率：99.9%	6,590,176	11,259,476 100.0%	
合計				11,259,476	

(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）

（2019年 6月24日現在）

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,080,076,773
国債証券	528,358,819,610
地方債証券	44,075,070,034
特殊債券	57,502,357,687
社債券	26,824,311,250
未収利息	960,769,126
前払費用	10,179,802
流動資産合計	663,811,584,282
資産合計	663,811,584,282
負債の部	
流動負債	
未払金	118,574,000
未払解約金	522,942,678
未払利息	11,182
流動負債合計	641,527,860
負債合計	641,527,860
純資産の部	
元本等	
元本	491,635,597,595
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	171,534,458,827
元本等合計	663,170,056,422
純資産合計	663,170,056,422
負債純資産合計	663,811,584,282

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

（貸借対照表に関する注記）

2019年 6月24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	1.3489円
(10,000口当たり純資産額)	(13,489円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24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

2019年 6月24日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 6月24日現在	
期首	2018年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	504,423,579,973円
同期中における追加設定元本額	62,496,469,046円
同期中における一部解約元本額	75,284,451,424円
期末元本額	491,635,597,595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	462,700,443円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	33,250,783,978円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	17,249,519,739円

野村世界６資産分散投信（成長コース）	2,569,006,826円
野村資産設計ファンド２０１５	372,666,303円
野村資産設計ファンド２０２０	328,181,970円
野村資産設計ファンド２０２５	275,291,675円
野村資産設計ファンド２０３０	191,180,333円
野村資産設計ファンド２０３５	97,673,714円
野村資産設計ファンド２０４０	148,063,499円
野村日本債券インデックスファンド	992,914,828円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	194,822,486,845円
のむラップ・ファンド（保守型）	12,162,813,248円
のむラップ・ファンド（普通型）	7,990,217,705円
のむラップ・ファンド（積極型）	985,666,077円
野村日本債券インデックス（野村ＳＭＡ向け）	10,874,914,004円
野村資産設計ファンド２０４５	14,813,807円
野村円債投資インデックスファンド	1,277,506,443円
野村インデックスファンド・国内債券	2,961,005,925円
マイ・ロード	35,910,428,021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	758,886,057円
野村ターゲットブライズ「日経２２５」（国内債券運用移行型）	24,895,049円
野村日本債券インデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	10,728,662,169円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	2,042,087,145円
野村資産設計ファンド２０５０	18,608,970円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	15,256,425円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	3,832,968円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	2,473,431円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	1,519,119円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	708,478,288円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	144,349,797円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	67,817,917円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	27,097,990円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	50,730,835円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	9,211,909円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	13,833,173円
野村６資産均等バランス	650,618,959円
世界６資産分散ファンド	161,911,001円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI 総合連動型上場投信	757,908,312円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	9,653,315,540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）	672,154,245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）	170,370,287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）	2,157,916,821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）	1,405,683,773円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡ安定型（適格機関投資家専用）	22,507,674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）	12,057,715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）	1,296,081円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	4,160,752,780円
野村ワールド・インデックス・バランス３５ＶＡ（適格機関投資家専用）	17,673,337円
野村ワールド・インデックス・バランス５０ＶＡ（適格機関投資家専用）	114,253,731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）	138,371,348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）	332,326,677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）	346,213,129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）	790,159,349円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,565,842,383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）	697,209,435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）	613,161,629円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	15,976,293,312円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	23,376,564,514円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	10,160,379,635円
野村国内債券インデックスファンド・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合（確定拠出年金向け）	46,960,373,706円
マイバランスＤＣ３０	10,409,267,424円
マイバランスＤＣ５０	7,159,390,534円
マイバランスＤＣ７０	2,279,666,534円
野村ＤＣ国内債券インデックスファンド・ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合	11,519,168,513円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	399,857,347円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	714,432,342円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	299,028,245円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	45,683,668円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	9,736,640円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	7,592,868円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０３０	4,838,266円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０４０	1,477,870円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０５０	1,275,241円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	195,394,343円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	74,802,925円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	17,297,404円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	25,795,433円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年6月24日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年6月24日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付（２年）第３９０回	500,000,000	501,655,000	
		国庫債券 利付（２年）第３９４回	3,000,000,000	3,013,230,000	
		国庫債券 利付（５年）第１２５回	7,200,000,000	7,228,152,000	
		国庫債券 利付（５年）第１２６回	7,500,000,000	7,536,375,000	
		国庫債券 利付（５年）第１２７回	6,000,000,000	6,034,440,000	

国庫債券	利付（５年）第１２８回	5,200,000,000	5,234,736,000	
国庫債券	利付（５年）第１２９回	4,000,000,000	4,030,600,000	
国庫債券	利付（５年）第１３０回	5,000,000,000	5,042,500,000	
国庫債券	利付（５年）第１３１回	4,800,000,000	4,845,552,000	
国庫債券	利付（５年）第１３２回	3,000,000,000	3,031,110,000	
国庫債券	利付（５年）第１３３回	4,000,000,000	4,045,680,000	
国庫債券	利付（５年）第１３４回	3,000,000,000	3,037,470,000	
国庫債券	利付（５年）第１３５回	4,000,000,000	4,054,280,000	
国庫債券	利付（５年）第１３６回	4,300,000,000	4,363,210,000	
国庫債券	利付（５年）第１３７回	3,000,000,000	3,046,920,000	
国庫債券	利付（５年）第１３８回	2,700,000,000	2,744,739,000	
国庫債券	利付（４０年）第１回	2,360,000,000	3,690,568,000	
国庫債券	利付（４０年）第２回	900,000,000	1,368,675,000	
国庫債券	利付（４０年）第３回	900,000,000	1,381,185,000	
国庫債券	利付（４０年）第４回	1,300,000,000	2,015,689,000	
国庫債券	利付（４０年）第５回	1,200,000,000	1,805,364,000	
国庫債券	利付（４０年）第６回	1,300,000,000	1,931,267,000	
国庫債券	利付（４０年）第７回	1,400,000,000	2,003,932,000	
国庫債券	利付（４０年）第８回	1,500,000,000	2,013,030,000	
国庫債券	利付（４０年）第９回	2,100,000,000	2,113,524,000	
国庫債券	利付（４０年）第１０回	2,100,000,000	2,476,719,000	
国庫債券	利付（４０年）第１１回	1,400,000,000	1,603,938,000	
国庫債券	利付（１０年）第３１０回	3,700,000,000	3,755,796,000	
国庫債券	利付（１０年）第３１１回	1,800,000,000	1,822,680,000	
国庫債券	利付（１０年）第３１２回	4,950,000,000	5,055,286,500	
国庫債券	利付（１０年）第３１３回	3,200,000,000	3,285,248,000	
国庫債券	利付（１０年）第３１４回	2,200,000,000	2,250,930,000	
国庫債券	利付（１０年）第３１５回	3,600,000,000	3,703,068,000	
国庫債券	利付（１０年）第３１６回	1,400,000,000	1,437,296,000	
国庫債券	利付（１０年）第３１７回	1,800,000,000	1,854,072,000	
国庫債券	利付（１０年）第３１８回	3,200,000,000	3,288,896,000	
国庫債券	利付（１０年）第３１９回	1,850,000,000	1,911,790,000	
国庫債券	利付（１０年）第３２０回	3,500,000,000	3,608,150,000	
国庫債券	利付（１０年）第３２１回	3,200,000,000	3,309,184,000	
国庫債券	利付（１０年）第３２２回	2,400,000,000	2,475,288,000	

国庫債券 利付（１０年）第３２３回	1,700,000,000	1,758,276,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２４回	3,200,000,000	3,300,096,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２５回	4,400,000,000	4,550,084,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２６回	2,100,000,000	2,170,182,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２７回	3,100,000,000	3,214,514,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２８回	5,000,000,000	5,161,150,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２９回	5,300,000,000	5,526,257,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３０回	3,800,000,000	3,972,596,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３１回	1,900,000,000	1,970,015,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３２回	5,400,000,000	5,612,112,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３３回	4,200,000,000	4,374,174,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３４回	7,600,000,000	7,932,120,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３５回	3,700,000,000	3,850,331,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３６回	1,700,000,000	1,771,910,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３７回	1,700,000,000	1,752,989,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３８回	3,700,000,000	3,842,117,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３９回	3,000,000,000	3,120,390,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４０回	4,200,000,000	4,374,384,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４１回	3,700,000,000	3,835,457,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４２回	4,650,000,000	4,763,088,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４３回	5,400,000,000	5,536,350,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４４回	5,300,000,000	5,438,701,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４５回	5,500,000,000	5,646,850,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４６回	5,400,000,000	5,546,826,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４７回	4,400,000,000	4,519,944,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４８回	4,500,000,000	4,622,760,000	
	5,000,000,000	5,136,150,000	

国庫債券 利付（１０年）第３４９回			
国庫債券 利付（１０年）第３５０回	7,950,000,000	8,165,604,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５１回	5,100,000,000	5,237,598,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５２回	4,300,000,000	4,413,090,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５３回	4,200,000,000	4,309,326,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５４回	2,400,000,000	2,460,480,000	
国庫債券 利付（３０年）第１回	100,000,000	130,065,000	
国庫債券 利付（３０年）第２回	200,000,000	253,998,000	
国庫債券 利付（３０年）第３回	160,000,000	202,211,200	
国庫債券 利付（３０年）第４回	900,000,000	1,208,016,000	
国庫債券 利付（３０年）第５回	150,000,000	190,635,000	
国庫債券 利付（３０年）第６回	700,000,000	913,507,000	
国庫債券 利付（３０年）第７回	600,000,000	780,552,000	
国庫債券 利付（３０年）第８回	100,000,000	124,306,000	
国庫債券 利付（３０年）第９回	265,000,000	315,249,300	
国庫債券 利付（３０年）第１０回	250,000,000	287,570,000	
国庫債券 利付（３０年）第１１回	160,000,000	197,764,800	
国庫債券 利付（３０年）第１２回	220,000,000	284,968,200	
国庫債券 利付（３０年）第１３回	290,000,000	372,409,300	
国庫債券 利付（３０年）第１４回	800,000,000	1,076,552,000	
国庫債券 利付（３０年）第１５回	900,000,000	1,227,987,000	
国庫債券 利付（３０年）第１６回	915,000,000	1,253,074,200	
国庫債券 利付（３０年）第１７回	1,200,000,000	1,629,636,000	
国庫債券 利付（３０年）第１８回	1,500,000,000	2,019,000,000	
国庫債券 利付（３０年）第１９回	1,600,000,000	2,160,656,000	
国庫債券 利付（３０年）第２０回	1,400,000,000	1,939,980,000	
国庫債券 利付（３０年）第２１回	1,400,000,000	1,899,576,000	
国庫債券 利付（３０年）第２２回	600,000,000	836,316,000	
国庫債券 利付（３０年）第２３回	840,000,000	1,173,782,400	
国庫債券 利付（３０年）第２４回	700,000,000	981,365,000	
国庫債券 利付（３０年）第２５回	500,000,000	686,110,000	
国庫債券 利付（３０年）第２６回	850,000,000	1,183,438,000	
国庫債券 利付（３０年）第２７回	1,550,000,000	2,196,629,000	
国庫債券 利付（３０年）第２８回	1,200,000,000	1,709,184,000	
国庫債券 利付（３０年）第２９回	1,500,000,000	2,119,185,000	
国庫債券 利付（３０年）第３０回	1,700,000,000	2,382,278,000	
国庫債券 利付（３０年）第３１回	1,600,000,000	2,222,432,000	
国庫債券 利付（３０年）第３２回	1,900,000,000	2,691,673,000	
国庫債券 利付（３０年）第３３回	2,100,000,000	2,861,334,000	

国庫債券	利付（３０年）第３４回	2,100,000,000	2,965,536,000
国庫債券	利付（３０年）第３５回	2,300,000,000	3,164,616,000
国庫債券	利付（３０年）第３６回	2,300,000,000	3,179,520,000
国庫債券	利付（３０年）第３７回	2,300,000,000	3,143,824,000
国庫債券	利付（３０年）第３８回	1,800,000,000	2,430,540,000
国庫債券	利付（３０年）第３９回	1,600,000,000	2,202,384,000
国庫債券	利付（３０年）第４０回	1,100,000,000	1,491,347,000
国庫債券	利付（３０年）第４１回	1,500,000,000	2,001,870,000
国庫債券	利付（３０年）第４２回	1,200,000,000	1,603,440,000
国庫債券	利付（３０年）第４３回	1,300,000,000	1,741,246,000
国庫債券	利付（３０年）第４４回	1,400,000,000	1,877,470,000
国庫債券	利付（３０年）第４５回	1,700,000,000	2,201,245,000
国庫債券	利付（３０年）第４６回	1,800,000,000	2,335,536,000
国庫債券	利付（３０年）第４７回	1,700,000,000	2,251,752,000
国庫債券	利付（３０年）第４８回	1,900,000,000	2,423,089,000
国庫債券	利付（３０年）第４９回	1,900,000,000	2,427,725,000
国庫債券	利付（３０年）第５０回	1,600,000,000	1,800,208,000
国庫債券	利付（３０年）第５１回	1,600,000,000	1,594,016,000
国庫債券	利付（３０年）第５２回	1,900,000,000	1,990,668,000
国庫債券	利付（３０年）第５３回	1,700,000,000	1,824,865,000
国庫債券	利付（３０年）第５４回	1,700,000,000	1,915,169,000
国庫債券	利付（３０年）第５５回	1,500,000,000	1,689,270,000
国庫債券	利付（３０年）第５６回	1,900,000,000	2,141,737,000
国庫債券	利付（３０年）第５７回	1,400,000,000	1,577,492,000
国庫債券	利付（３０年）第５８回	1,800,000,000	2,027,358,000
国庫債券	利付（３０年）第５９回	1,600,000,000	1,758,944,000
国庫債券	利付（３０年）第６０回	600,000,000	692,118,000
国庫債券	利付（３０年）第６１回	1,200,000,000	1,317,540,000
国庫債券	利付（３０年）第６２回	1,250,000,000	1,302,250,000
国庫債券	利付（２０年）第４７回	1,230,000,000	1,266,961,500
国庫債券	利付（２０年）第４８回	200,000,000	208,150,000
国庫債券	利付（２０年）第４９回	200,000,000	208,138,000
国庫債券	利付（２０年）第５０回	183,000,000	189,807,600
国庫債券	利付（２０年）第５１回	310,000,000	323,844,600
国庫債券	利付（２０年）第５２回	100,000,000	105,260,000
国庫債券	利付（２０年）第５３回	250,000,000	264,605,000
国庫債券	利付（２０年）第５４回	100,000,000	106,093,000
国庫債券	利付（２０年）第５５回	231,000,000	245,255,010
国庫債券	利付（２０年）第５６回	120,000,000	128,084,400
国庫債券	利付（２０年）第５７回	210,000,000	223,515,600
国庫債券	利付（２０年）第５８回	180,000,000	192,571,200
国庫債券	利付（２０年）第５９回	230,000,000	245,778,000
国庫債券	利付（２０年）第６０回	780,000,000	825,279,000

国庫債券 利付（２０年）第６１回	300,000,000	314,193,000	
国庫債券 利付（２０年）第６２回	440,000,000	458,783,600	
国庫債券 利付（２０年）第６３回	300,000,000	324,825,000	
国庫債券 利付（２０年）第６４回	400,000,000	436,932,000	
国庫債券 利付（２０年）第６５回	455,000,000	499,508,100	
国庫債券 利付（２０年）第６６回	300,000,000	327,984,000	
国庫債券 利付（２０年）第６７回	310,000,000	342,010,600	
国庫債券 利付（２０年）第６８回	290,000,000	324,115,600	
国庫債券 利付（２０年）第６９回	560,000,000	623,196,000	
国庫債券 利付（２０年）第７０回	540,000,000	612,408,600	
国庫債券 利付（２０年）第７１回	200,000,000	224,798,000	
国庫債券 利付（２０年）第７２回	670,000,000	753,770,100	
国庫債券 利付（２０年）第７３回	1,600,000,000	1,800,304,000	
国庫債券 利付（２０年）第７４回	900,000,000	1,017,675,000	
国庫債券 利付（２０年）第７５回	600,000,000	682,026,000	
国庫債券 利付（２０年）第７６回	910,000,000	1,023,813,700	
国庫債券 利付（２０年）第７７回	700,000,000	791,623,000	
国庫債券 利付（２０年）第７８回	800,000,000	904,528,000	
国庫債券 利付（２０年）第７９回	860,000,000	977,587,800	
国庫債券 利付（２０年）第８０回	900,000,000	1,028,529,000	
国庫債券 利付（２０年）第８１回	360,000,000	411,199,200	
国庫債券 利付（２０年）第８２回	820,000,000	941,819,200	
国庫債券 利付（２０年）第８３回	1,370,000,000	1,581,788,300	
国庫債券 利付（２０年）第８４回	1,200,000,000	1,377,600,000	
国庫債券 利付（２０年）第８５回	400,000,000	464,068,000	
国庫債券 利付（２０年）第８６回	1,400,000,000	1,643,390,000	
国庫債券 利付（２０年）第８７回	500,000,000	583,505,000	
国庫債券 利付（２０年）第８８回	1,100,000,000	1,298,517,000	
国庫債券 利付（２０年）第８９回	470,000,000	551,483,900	
国庫債券 利付（２０年）第９０回	1,500,000,000	1,769,595,000	
国庫債券 利付（２０年）第９１回	250,000,000	296,775,000	
国庫債券 利付（２０年）第９２回	1,550,000,000	1,825,838,000	
国庫債券 利付（２０年）第９３回	300,000,000	352,677,000	
国庫債券 利付（２０年）第９４回	200,000,000	236,694,000	
国庫債券 利付（２０年）第９５回	700,000,000	843,395,000	
国庫債券 利付（２０年）第９６回	400,000,000	475,436,000	
国庫債券 利付（２０年）第９７回	1,300,000,000	1,562,639,000	
国庫債券 利付（２０年）第９８回	300,000,000	358,095,000	
国庫債券 利付（２０年）第９９回	2,100,000,000	2,517,018,000	
国庫債券 利付（２０年）第１００回	1,520,000,000	1,842,650,400	
国庫債券 利付（２０年）第１０１回	250,000,000	307,507,500	

国庫債券 利付（２０年）第１０２回	500,000,000	617,825,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０３回	600,000,000	735,912,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０４回	400,000,000	483,300,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０５回	1,900,000,000	2,303,712,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０６回	400,000,000	488,744,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０７回	300,000,000	365,142,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０８回	1,600,000,000	1,916,608,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０９回	900,000,000	1,081,719,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１０回	1,100,000,000	1,343,826,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１１回	800,000,000	989,088,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１２回	1,800,000,000	2,207,232,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１３回	2,000,000,000	2,461,500,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１４回	1,700,000,000	2,099,721,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１５回	1,000,000,000	1,245,750,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１６回	1,100,000,000	1,375,264,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１７回	1,400,000,000	1,735,132,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１８回	500,000,000	616,295,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１９回	800,000,000	968,304,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２０回	800,000,000	950,544,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２１回	1,700,000,000	2,082,891,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２２回	1,100,000,000	1,335,268,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２３回	1,500,000,000	1,878,030,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２４回	1,000,000,000	1,240,440,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２５回	900,000,000	1,141,713,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２６回	1,000,000,000	1,244,910,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２７回	1,200,000,000	1,479,684,000	
	1,800,000,000	2,225,934,000	

国庫債券 利付（２０年）第１２８回			
国庫債券 利付（２０年）第１２９回	800,000,000	979,648,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３０回	1,400,000,000	1,718,920,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３１回	800,000,000	972,384,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３２回	1,300,000,000	1,583,881,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３３回	1,400,000,000	1,723,288,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３４回	1,400,000,000	1,727,502,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３５回	700,000,000	854,798,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３６回	700,000,000	845,852,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３７回	1,000,000,000	1,224,740,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３８回	800,000,000	958,944,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３９回	700,000,000	848,197,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４０回	2,300,000,000	2,823,204,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４１回	2,600,000,000	3,198,286,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４２回	950,000,000	1,181,429,500	
国庫債券 利付（２０年）第１４３回	1,300,000,000	1,584,583,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４４回	1,300,000,000	1,566,734,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４５回	2,300,000,000	2,842,869,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４６回	2,400,000,000	2,972,448,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４７回	2,200,000,000	2,698,234,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４８回	2,100,000,000	2,549,085,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４９回	2,350,000,000	2,856,848,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５０回	2,930,000,000	3,522,856,200	
国庫債券 利付（２０年）第１５１回	2,700,000,000	3,167,451,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５２回	1,700,000,000	1,995,851,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５３回	2,450,000,000	2,919,469,000	
	3,000,000,000	3,530,100,000	

		国庫債券 利付（２０年）第１５４回			
		国庫債券 利付（２０年）第１５５回	2,800,000,000	3,206,140,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１５６回	2,600,000,000	2,719,418,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１５７回	1,950,000,000	1,972,678,500	
		国庫債券 利付（２０年）第１５８回	2,800,000,000	2,972,144,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１５９回	2,700,000,000	2,912,004,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６０回	2,300,000,000	2,518,523,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６１回	2,100,000,000	2,261,532,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６２回	1,700,000,000	1,829,302,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６３回	1,900,000,000	2,042,766,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６４回	2,600,000,000	2,745,782,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６５回	2,200,000,000	2,322,848,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６６回	2,300,000,000	2,513,026,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６７回	2,800,000,000	2,952,012,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６８回	1,700,000,000	1,759,534,000	
		メキシコ合衆国 第２２回円貨社債（２０１６）	300,000,000	302,025,000	
		メキシコ合衆国 第２５回円貨社債（２０１８）	100,000,000	100,313,000	
		ポーランド共和国 第１５回円貨債券（２０１３）	100,000,000	100,678,000	
	小計	銘柄数：259	471,139,000,000	528,358,819,610	
		組入時価比率：79.7%		80.4%	
	合計			528,358,819,610	
地方債証券	日本円	東京都 公募第６９０回	200,000,000	203,786,000	
		東京都 公募第７０３回	100,000,000	102,426,000	
		東京都 公募第７０７回	100,000,000	102,332,000	
		東京都 公募第７０８回	100,000,000	102,599,000	
		東京都 公募第７１０回	100,000,000	102,360,000	
		東京都 公募第７１２回	100,000,000	102,429,000	
		東京都 公募第７１５回	100,000,000	102,581,000	
		東京都 公募第７１６回	200,000,000	205,232,000	
		東京都 公募第７３１回	100,000,000	102,909,000	
		東京都 公募第７４５回	300,000,000	309,207,000	
		東京都 公募第７６０回	100,000,000	100,028,000	

東京都	公募第 7 6 1 回	100,000,000	100,245,000	
東京都	公募第 7 6 9 回	500,000,000	506,725,000	
東京都	公募（ 3 0 年 ）第 7 回	100,000,000	139,736,000	
東京都	公募第 1 0 回	200,000,000	274,586,000	
東京都	公募第 1 回	300,000,000	318,180,000	
東京都	公募（ 2 0 年 ）第 3 回	200,000,000	221,194,000	
東京都	公募第 7 回	100,000,000	113,330,000	
東京都	公募（ 2 0 年 ）第 1 6 回	200,000,000	237,266,000	
東京都	公募（ 2 0 年 ）第 1 7 回	200,000,000	238,780,000	
東京都	公募第 2 3 回	100,000,000	123,289,000	
東京都	公募（ 2 0 年 ）第 2 6 回	100,000,000	120,791,000	
北海道	公募平成 2 4 年度第 6 回	100,000,000	102,546,000	
北海道	公募平成 2 4 年度第 9 回	100,000,000	102,512,000	
北海道	公募平成 2 5 年度第 1 回	300,000,000	306,207,000	
北海道	公募平成 2 6 年度第 1 3 回	100,000,000	102,311,000	
北海道	公募平成 2 7 年度第 7 回	100,000,000	103,009,000	
北海道	公募平成 2 8 年度第 1 3 回	200,000,000	199,918,000	
北海道	公募平成 2 9 年度第 5 回	200,000,000	202,220,000	
北海道	公募平成 2 9 年度第 6 回	700,000,000	699,349,000	
北海道	公募平成 2 9 年度第 7 回	100,000,000	101,379,000	
北海道	公募平成 2 9 年度第 9 回	100,000,000	101,367,000	
宮城県	公募第 3 2 回 2 号	100,000,000	100,463,000	
神奈川県	公募第 1 8 4 回	100,000,000	101,993,000	
神奈川県	公募第 1 8 8 回	200,000,000	205,646,000	
神奈川県	公募第 1 9 6 回	100,000,000	102,457,000	
神奈川県	公募第 2 0 0 回	100,000,000	103,409,000	
神奈川県	公募第 2 0 5 回	100,000,000	103,046,000	
神奈川県	公募第 2 0 6 回	100,000,000	103,155,000	
神奈川県	公募第 2 1 0 回	200,000,000	204,722,000	
神奈川県	公募第 2 3 1 回	200,000,000	203,046,000	
神奈川県	公募（ 3 0 年 ）第 3 回	100,000,000	139,689,000	
神奈川県	公募第 7 回	300,000,000	350,418,000	
大阪府	公募第 3 4 6 回	100,000,000	101,972,000	
大阪府	公募第 3 5 6 回	100,000,000	102,620,000	
大阪府	公募第 3 7 8 回	104,000,000	107,129,360	
大阪府	公募第 3 8 1 回	100,000,000	103,100,000	
大阪府	公募第 3 8 2 回	100,000,000	103,109,000	
大阪府	公募第 3 8 3 回	100,000,000	103,261,000	
大阪府	公募第 3 8 4 回	100,000,000	103,197,000	
大阪府	公募第 3 8 7 回	300,000,000	307,452,000	
大阪府	公募第 3 8 9 回	100,000,000	102,615,000	
大阪府	公募第 4 1 7 回	102,000,000	103,615,680	

大阪府 公募第423回	100,000,000	101,174,000
大阪府 公募第429回	179,000,000	181,429,030
大阪府 公募第5回	100,000,000	122,529,000
大阪府 公募第8回	100,000,000	120,818,000
大阪府 公募（5年）第130回	600,000,000	599,838,000
大阪府 公募（5年）第137回	1,024,000,000	1,023,508,480
大阪府 公募（5年）第141回	230,000,000	229,859,700
京都府 公募平成24年度第2回	100,000,000	102,659,000
京都府 公募平成24年度第6回	100,000,000	102,593,000
京都府 公募平成26年度第5回	100,000,000	118,505,000
京都府 公募平成26年度第7回	200,000,000	205,478,000
兵庫県 公募平成26年度第17回	100,000,000	102,378,000
兵庫県 公募（30年）第2回	100,000,000	138,173,000
兵庫県 公募（15年）第1回	300,000,000	334,377,000
兵庫県 公募（15年）第3回	200,000,000	221,040,000
兵庫県 公募（12年）第3回	300,000,000	309,045,000
兵庫県 公募第2回	100,000,000	119,118,000
兵庫県 公募第9回	100,000,000	122,707,000
兵庫県 公募（20年）第11回	200,000,000	238,614,000
兵庫県 公募（20年）第14回	100,000,000	119,891,000
静岡県 公募平成24年度第5回	100,060,000	102,605,526
静岡県 公募平成24年度第10回	100,000,000	102,461,000
静岡県 公募平成25年度第5回	101,000,000	104,733,970
静岡県 公募平成26年度第3回	165,000,000	170,342,700
静岡県 公募平成26年度第8回	100,000,000	102,856,000
静岡県 公募平成26年度第9回	200,000,000	205,690,000
静岡県 公募平成27年度第11回	115,400,000	115,942,380
静岡県 公募平成28年度第2回	300,000,000	300,804,000
静岡県 公募平成29年度第3回	100,000,000	100,994,000
静岡県 公募（31年）第1回	174,000,000	174,826,500
静岡県 公募（20年）第11回	100,000,000	119,948,000
静岡県 公募（20年）第14回	100,000,000	120,585,000
愛知県 公募平成20年度第8回	100,000,000	118,917,000
愛知県 公募平成22年度第9回	100,000,000	101,443,000
愛知県 公募平成23年度第19回	100,000,000	102,655,000
愛知県 公募平成24年度第2回	100,000,000	102,739,000
愛知県 公募（20年）平成24年度第4回	100,000,000	119,929,000
愛知県 公募（15年）平成24年度第14回	400,000,000	443,036,000
愛知県 公募平成24年度第17回	100,000,000	122,431,000
愛知県 公募（30年）平成25年度第8回	120,000,000	163,011,600
愛知県 公募平成26年度第8回	100,000,000	131,817,000

愛知県	公募平成 2 6 年度第 1 3 回	100,000,000	117,178,000	
愛知県	公募平成 2 7 年度第 1 5 回	100,000,000	102,894,000	
愛知県	公募平成 2 9 年度第 9 回	100,000,000	100,894,000	
広島県	公募平成 2 2 年度第 6 回	300,000,000	305,934,000	
広島県	公募平成 2 4 年度第 4 回	100,000,000	102,708,000	
広島県	公募平成 2 5 年度第 3 回	200,000,000	206,628,000	
広島県	公募平成 2 6 年度第 5 回	109,650,000	111,548,041	
広島県	公募平成 2 9 年度第 4 回	111,300,000	112,978,404	
埼玉県	公募平成 2 4 年度第 4 回	300,000,000	307,584,000	
埼玉県	公募平成 2 5 年度第 4 回	100,000,000	103,675,000	
埼玉県	公募平成 2 5 年度第 6 回	148,000,000	152,949,120	
埼玉県	公募平成 2 5 年度第 1 0 回	100,000,000	103,037,000	
埼玉県	公募平成 2 5 年度第 1 1 回	100,000,000	103,015,000	
埼玉県	公募平成 2 6 年度第 3 回	100,000,000	103,181,000	
埼玉県	公募平成 2 6 年度第 6 回	200,000,000	205,610,000	
埼玉県	公募平成 2 6 年度第 7 回	400,000,000	410,020,000	
埼玉県	公募平成 2 6 年度第 9 回	100,000,000	102,318,000	
埼玉県	公募平成 2 7 年度第 9 回	100,000,000	101,298,000	
埼玉県	公募平成 3 0 年度第 7 回	200,000,000	199,996,000	
福岡県	公募平成 2 2 年度第 5 回	100,000,000	101,244,000	
福岡県	公募平成 2 3 年度第 5 回	100,000,000	102,347,000	
福岡県	公募平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	103,166,000	
福岡県	公募平成 2 7 年度第 1 回	300,000,000	310,041,000	
福岡県	公募平成 2 9 年度第 1 回	100,000,000	101,267,000	
福岡県	公募平成 2 3 年度第 1 回	100,000,000	110,741,000	
福岡県	公募（ 3 0 年 ）平成 1 9 年度第 1 回	100,000,000	140,514,000	
福岡県	公募（ 3 0 年 ）平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	132,112,000	
福岡県	公募（ 2 0 年 ）平成 2 0 年度第 2 回	100,000,000	119,011,000	
福岡県	公募（ 2 0 年 ）平成 2 4 年度第 2 回	100,000,000	119,453,000	
千葉県	公募平成 2 4 年度第 1 回	100,000,000	102,926,000	
千葉県	公募平成 2 4 年度第 2 回	100,000,000	102,599,000	
千葉県	公募平成 2 4 年度第 7 回	100,000,000	102,515,000	
千葉県	公募平成 2 4 年度第 8 回	100,000,000	102,941,000	
千葉県	公募平成 2 5 年度第 3 回	100,000,000	103,475,000	
千葉県	公募平成 2 5 年度第 4 回	100,000,000	103,673,000	
千葉県	公募平成 2 6 年度第 3 回	200,000,000	205,998,000	
千葉県	公募平成 2 8 年度第 4 回	200,000,000	200,636,000	
千葉県	公募（ 2 0 年 ）第 8 回	100,000,000	122,854,000	
千葉県	公募（ 2 0 年 ）第 1 7 回	100,000,000	117,765,000	
群馬県	公募第 8 回	100,000,000	102,457,000	

群馬県 公募第 1 2 回	100,000,000	103,058,000
群馬県 公募（ 2 0 年 ）第 3 回	100,000,000	119,988,000
岐阜県 公募平成 2 6 年度第 1 回	186,670,000	191,915,427
大分県 公募平成 2 3 年度第 1 回	902,000,000	922,845,220
共同発行市場地方債 公募第 8 8 回	100,000,000	101,250,000
共同発行市場地方債 公募第 8 9 回	100,000,000	101,199,000
共同発行市場地方債 公募第 9 2 回	110,000,000	111,587,300
共同発行市場地方債 公募第 9 3 回	300,000,000	305,571,000
共同発行市場地方債 公募第 9 4 回	300,000,000	305,838,000
共同発行市場地方債 公募第 9 6 回	100,000,000	102,231,000
共同発行市場地方債 公募第 1 0 1 回	300,000,000	306,735,000
共同発行市場地方債 公募第 1 0 2 回	150,000,000	153,427,500
共同発行市場地方債 公募第 1 0 3 回	100,000,000	102,300,000
共同発行市場地方債 公募第 1 0 4 回	200,000,000	204,914,000
共同発行市場地方債 公募第 1 0 8 回	200,000,000	205,464,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 0 回	200,000,000	205,080,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 1 回	200,000,000	205,218,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 2 回	100,000,000	102,528,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 3 回	800,000,000	819,008,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 4 回	243,700,000	250,024,015
共同発行市場地方債 公募第 1 1 5 回	100,000,000	102,601,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 6 回	200,000,000	205,334,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 8 回	100,000,000	102,941,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 9 回	200,000,000	205,722,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 0 回	300,000,000	307,416,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 1 回	100,000,000	102,108,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 2 回	400,000,000	409,396,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 4 回	100,000,000	103,632,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 6 回	100,000,000	103,357,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 8 回	300,000,000	308,475,000
	100,000,000	103,105,000

共同発行市場地方債 公募第 1 2 9 回			
共同発行市場地方債 公募第 1 3 0 回	100,000,000	103,393,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 2 回	100,000,000	103,038,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 6 回	200,000,000	205,998,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 7 回	200,000,000	205,630,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 3 9 回	155,000,000	159,329,150	
共同発行市場地方債 公募第 1 4 3 回	540,000,000	553,095,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 4 5 回	1,000,000,000	1,022,500,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 6 回	100,000,000	100,403,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 7 回	300,000,000	300,807,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 6 1 回	300,000,000	300,405,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 7 2 回	200,000,000	202,964,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 0 回	410,000,000	414,604,300	
堺市 公募平成 2 2 年度第 1 回	100,000,000	121,355,000	
堺市 公募平成 2 2 年度第 2 回	100,000,000	101,858,000	
堺市 公募平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	127,936,000	
島根県 公募平成 2 2 年度第 1 回	100,000,000	101,517,000	
島根県 公募平成 2 8 年度第 3 回	100,000,000	99,965,000	
佐賀県 公募平成 2 8 年度第 1 回	100,000,000	100,289,000	
福島県 公募平成 2 6 年度第 1 回	200,000,000	205,150,000	
滋賀県 公募平成 2 5 年度第 1 回	100,000,000	102,790,000	
滋賀県 公募平成 2 6 年度第 1 回	142,000,000	145,656,500	
栃木県 公募平成 2 4 年度第 1 回	100,000,000	102,643,000	
栃木県 公募平成 2 5 年度第 1 回	100,000,000	102,790,000	
新潟市 公募平成 2 5 年度第 1 回	233,200,000	240,550,464	
新潟市 公募平成 2 9 年度第 1 回	100,000,000	101,440,000	
奈良県 公募平成 2 8 年度第 1 回	100,000,000	99,964,000	
浜松市 公募平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	101,755,000	
大阪市 公募平成 2 5 年度第 6 回	100,000,000	102,972,000	
大阪市 公募平成 2 6 年度第 5 回	100,000,000	102,903,000	
大阪市 公募（ 5 年 ）平成 2 8 年度第 5 回	100,000,000	99,964,000	
大阪市 公募（ 1 5 年 ）第 1 回	100,000,000	112,061,000	
大阪市 公募（ 2 0 年 ）第 1 回	300,000,000	356,736,000	
大阪市 公募（ 2 0 年 ）第 5 回	100,000,000	122,389,000	

大阪市 公募（２０年）第６回	100,000,000	120,525,000	
大阪市 公募（２０年）第１７回	100,000,000	120,853,000	
名古屋市 公募第４７８回	100,000,000	102,859,000	
名古屋市 公募第４８１回	100,000,000	102,525,000	
名古屋市 公募第４８８回	300,000,000	308,757,000	
名古屋市 公募（１２年）第１回	200,000,000	211,868,000	
名古屋市 公募（１５年）第２回	100,000,000	108,888,000	
京都市 公募平成２３年度第４回	100,000,000	102,624,000	
京都市 公募平成２９年度第４回	101,280,000	102,973,401	
京都市 公募（２０年）第２回	100,000,000	112,940,000	
京都市 公募（２０年）第１３回	100,000,000	117,148,000	
神戸市 公募平成２６年度第１７回	300,000,000	304,014,000	
神戸市 公募平成２８年度第１回	200,000,000	200,538,000	
横浜市 公募平成２２年度第５回	100,000,000	101,832,000	
横浜市 公募公債平成２４年度２回	200,000,000	205,268,000	
横浜市 公募公債平成２５年度１回	200,000,000	205,020,000	
横浜市 公募公債平成２５年度５回	200,000,000	205,582,000	
横浜市 公募公債平成２６年度５回	200,000,000	204,700,000	
横浜市 公募平成２８年度第５回	300,000,000	304,329,000	
横浜市 公募平成２９年度第３回	100,000,000	101,452,000	
横浜市 公募（３０年）第２回	200,000,000	269,484,000	
横浜市 公募（２０年）第２６回	100,000,000	121,673,000	
横浜市 公募（２０年）第３０回	100,000,000	117,385,000	
札幌市 公募（１５年）平成２３年度第９回	100,000,000	111,060,000	
札幌市 公募（２０年）平成２４年度第１１回	100,000,000	122,055,000	
札幌市 公募平成２６年度第４回	100,000,000	102,587,000	
札幌市 公募平成２６年度第９回	200,000,000	204,492,000	
川崎市 公募第８５回	100,000,000	102,442,000	
川崎市 公募（２０年）第１７回	100,000,000	118,561,000	
北九州市 公募（２０年）第１４回	100,000,000	120,918,000	
福岡市 公募（２０年）平成２３年度第４回	100,000,000	121,559,000	
福岡市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	118,936,000	
福岡市 公募平成２６年度第５回	100,000,000	102,770,000	
福岡市 公募平成２６年度第８回	160,000,000	164,089,600	
広島市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	102,395,000	
広島市 公募平成２７年度第２回	500,000,000	513,755,000	
千葉市 公募平成２４年度第１回	100,000,000	102,926,000	
三重県 公募平成２４年度第１回	140,660,000	144,322,786	
三重県 公募平成２８年度第１回	155,000,000	156,436,850	
鹿児島県 公募（５年）平成２８年度第１回	100,000,000	99,966,000	

	小計	福井県 公募平成 2 2 年度第 2 回	100,000,000	102,534,000	
		福井県 公募平成 2 4 年度第 4 回	100,000,000	101,688,000	
		福井県 公募平成 2 7 年度第 4 回	200,000,000	200,608,000	
		徳島県 公募平成 2 2 年度第 1 回	400,000,000	405,940,000	
		山梨県 公募平成 2 4 年度第 1 回	200,000,000	205,214,000	
		岡山県 公募平成 2 8 年度第 2 回	168,900,000	171,045,030	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第 9 6 回	100,000,000	121,353,000	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第 1 0 2 回	300,000,000	367,860,000	
		福岡北九州高速道路債券 第 1 1 7 回	100,000,000	120,371,000	
		福岡北九州高速道路債券 第 1 3 6 回	100,000,000	107,203,000	
		銘柄数：248	41,781,820,000	44,075,070,034	
		組入時価比率：6.6%		6.7%	
		合計		44,075,070,034	
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第 4 回円貨債券（ 2 0 1 4 ）	100,000,000	104,254,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第 1 回	151,000,000	155,043,780	
		新関西国際空港債券 政府保証第 2 回	191,000,000	198,068,910	
		新関西国際空港社債 財投機関債第 1 2 回	100,000,000	109,687,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第 2 2 回	200,000,000	200,088,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第 2 2 回	100,000,000	108,944,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第 3 1 回	300,000,000	307,395,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第 4 7 回	100,000,000	109,726,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第 8 6 回	300,000,000	304,068,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 9 回	141,000,000	142,804,800	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 1 6 回	102,000,000	104,842,740	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 1 9 回	159,000,000	163,197,600	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 3 8 回	1,500,000,000	1,502,235,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第 4 2 回	300,000,000	304,326,000	
		道路債券 財投機関債第 1 7 回	300,000,000	315,795,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第 3 4 4 回	200,000,000	203,480,000	
		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	137,200,000	

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	231,602,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 7 回	100,000,000	116,285,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 2 3 回	200,000,000	237,426,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 3 3 回	200,000,000	326,680,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 3 9 回	100,000,000	121,350,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 4 7 回	100,000,000	122,767,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 8 0 回	100,000,000	102,650,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 8 4 回	400,000,000	410,856,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 8 6 回	200,000,000	205,014,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 8 9 回	100,000,000	119,806,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 0 0 回	200,000,000	205,330,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 0 2 回	100,000,000	102,412,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 0 3 回	350,000,000	421,442,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 0 5 回	100,000,000	122,684,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 2 3 回	100,000,000	103,169,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 3 0 回	200,000,000	204,914,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 3 4 回	200,000,000	204,604,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 3 6 回	200,000,000	205,412,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 4 5 回	300,000,000	373,110,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 4 9 回	100,000,000	126,589,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第 1 7 3 回	100,000,000	99,722,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第 6 回	100,000,000	103,263,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第 9 回	100,000,000	103,412,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第 9 2 回	200,000,000	243,232,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第 9 7 回	200,000,000	243,882,000	
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	246,396,000	
	200,000,000	245,304,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	241,648,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回	100,000,000	135,567,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回	440,000,000	451,052,800	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	140,000,000	143,565,800	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	100,000,000	102,463,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	140,000,000	143,549,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第163回	1,000,000,000	1,027,670,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回	100,000,000	131,529,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第168回	100,000,000	102,724,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回	100,000,000	119,992,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	223,848,940	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回	100,000,000	119,081,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回	300,000,000	401,280,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	200,000,000	205,622,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	200,000,000	205,580,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第180回	200,000,000	205,444,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回	900,000,000	928,404,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回	100,000,000	121,669,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	196,000,000	200,382,560	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回	400,000,000	410,164,000	
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	1,037,090,000	
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	281,974,240	
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	309,942,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	137,000,000	141,499,080	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	145,000,000	149,738,600	
	100,000,000	119,230,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1 6 回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1 7 回	100,000,000	130,961,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 1 9 回	100,000,000	119,498,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 2 0 回	100,000,000	103,404,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 2 4 回	100,000,000	131,096,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 2 5 回	190,000,000	195,829,200	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 3 4 回	100,000,000	102,763,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 3 9 回	500,000,000	577,750,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第2 7 1 回	151,000,000	151,356,360	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 2 1 回	500,000,000	506,925,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第3 3 5 回	100,000,000	110,795,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第2 8 回	400,000,000	549,376,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第3 3 回	100,000,000	139,453,000	
公営企業債券 3 0 年第4 回財投機関債	100,000,000	139,611,000	
地方公営企業等金融機構債券（2 0 年） 第1 回	100,000,000	118,751,000	
地方公共団体金融機構債券 2 0 年第4 回	100,000,000	121,385,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 回	100,000,000	114,615,000	
地方公共団体金融機構債券 2 0 年第6 回	300,000,000	369,579,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 回	100,000,000	106,190,000	
地方公共団体金融機構債券 政府保証第1 6 回	100,000,000	101,280,000	
地方公共団体金融機構債券 第1 6 回	100,000,000	101,457,000	
地方公共団体金融機構債券 第2 7 回	300,000,000	306,648,000	
地方公共団体金融機構債券 第2 8 回	500,000,000	511,685,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 0 4 回	100,000,000	107,157,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 0 6 回	100,000,000	105,861,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 2 2 回	100,000,000	110,737,000	
	604,000,000	620,851,600	

政保 地方公共団体金融機構債券 第 3 7 回			
地方公共団体金融機構債券 第 3 7 回	400,000,000	410,016,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 3 8 回	194,000,000	199,220,540	
地方公共団体金融機構債券 F 1 3 2 回	500,000,000	531,610,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 3 9 回	100,000,000	102,646,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 0 回	101,000,000	103,805,780	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 1 回	102,000,000	104,816,220	
地方公共団体金融機構債券 第 4 1 回	600,000,000	615,666,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 2 回	100,000,000	105,202,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 4 回	200,000,000	201,484,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 5 回	200,000,000	211,480,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 7 回	100,000,000	109,219,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	108,000,000	111,099,600	
地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	100,000,000	102,677,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 3 回	202,000,000	207,447,940	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	145,000,000	149,537,050	
地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	100,000,000	102,770,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 5 回	223,000,000	229,973,210	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 0 回	100,000,000	108,805,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 9 回	13,000,000	13,477,620	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 0 回	100,000,000	103,862,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 1 回	600,000,000	620,556,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 2 回	300,000,000	310,677,000	
地方公共団体金融機構債券（ 1 5 年 ） 第 2 回	200,000,000	220,408,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 6 回	591,000,000	612,305,550	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 9 回	116,000,000	119,954,440	
	100,000,000	118,237,000	

地方公共団体金融機構債券（20年）第38回			
地方公共団体金融機構債券 F240回	300,000,000	331,743,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第64回	100,000,000	103,029,000	
地方公共団体金融機構債券 第64回	100,000,000	102,695,000	
地方公共団体金融機構債券（20年）第39回	100,000,000	117,869,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第65回	400,000,000	412,216,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第69回	320,000,000	328,134,400	
政保 地方公共団体金融機構債券第72回	189,000,000	195,091,470	
地方公共団体金融機構債券 第74回	300,000,000	308,445,000	
地方公共団体金融機構債券 第77回	100,000,000	102,721,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第78回	509,000,000	522,580,120	
地方公共団体金融機構債券 第79回	400,000,000	411,128,000	
政保 地方公共団体金融機構債券（8年）第5回	500,000,000	504,905,000	
政保 地方公共団体金融機構債券第83回	116,000,000	116,273,760	
地方公共団体金融機構債券 第101回	400,000,000	405,792,000	
地方公共団体金融機構債券 第113回	110,000,000	112,192,300	
公営企業債券（20年）第2回財投機関債	100,000,000	104,989,000	
公営企業債券（20年）第5回財投機関債	200,000,000	217,710,000	
公営企業債券（20年）第25回財投機関債	100,000,000	121,824,000	
首都高速道路 第17回	200,000,000	200,058,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	102,364,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	205,578,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	109,625,000	
都市再生債券 財投機関債第109回	100,000,000	109,000,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	112,963,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	360,000,000	371,516,400	
東京交通債券 第342回	200,000,000	214,138,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	171,497,380	
関西国際空港社債 財投機関債第26回	300,000,000	304,209,000	

関西国際空港社債 財投機関債第 3 2 回	100,000,000	102,519,000	
福祉医療機構債券 第 3 1 回財投機 関債	100,000,000	102,718,000	
中部国際空港債券 政府保証第 1 8 回	368,000,000	377,763,040	
預金保険機構債券 政府保証第 2 0 9 回	2,000,000,000	2,004,240,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 3 回	200,000,000	233,060,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 1 8 回	100,000,000	109,025,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 4 2 回	100,000,000	110,588,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 5 9 回	100,000,000	120,718,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 7 3 回	100,000,000	102,461,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 7 5 回	100,000,000	122,961,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 7 7 回	300,000,000	334,467,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 7 8 回	100,000,000	122,986,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 7 9 回	100,000,000	102,353,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 8 6 回	200,000,000	204,602,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 9 0 回	200,000,000	222,370,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 1 2 0 回	100,000,000	122,044,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 1 2 8 回	100,000,000	139,360,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 1 3 2 回	200,000,000	217,834,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 1 7 7 回	250,000,000	256,270,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 1 9 8 回	200,000,000	200,652,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第 2 2 3 回	100,000,000	102,766,000	
成田国際空港 第 1 0 回	100,000,000	102,409,000	
成田国際空港 第 1 3 回一般担保付	200,000,000	205,520,000	
成田国際空港 第 1 7 回	200,000,000	204,550,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第 1 7 回	100,000,000	102,366,000	
商工債券 利付第 8 0 6 回い号	300,000,000	299,814,000	
商工債券 利付第 8 1 1 回い号	300,000,000	300,522,000	
商工債券 利付第 8 1 5 回い号	100,000,000	100,191,000	
商工債券 利付第 8 1 8 回い号	100,000,000	100,161,000	

商工債券 利付第 8 1 9 回い号	300,000,000	300,615,000	
しんきん中金債券 利付第 3 0 8 回	100,000,000	100,240,000	
しんきん中金債券 利付第 3 1 6 回	100,000,000	100,070,000	
しんきん中金債券 利付第 3 1 7 回	800,000,000	800,440,000	
しんきん中金債券 利付第 3 3 5 回	200,000,000	200,400,000	
商工債券 利付（ 3 年 ）第 2 2 3 回	500,000,000	500,595,000	
商工債券 利付（ 1 0 年 ）第 1 5 回	200,000,000	203,374,000	
国際協力機構債券 第 6 回財投機関債	100,000,000	122,582,000	
東日本高速道路 第 3 4 回	100,000,000	100,364,000	
東日本高速道路 第 3 6 回	200,000,000	200,178,000	
中日本高速道路 第 6 2 回	200,000,000	200,506,000	
中日本高速道路 第 6 3 回	100,000,000	103,085,000	
中日本高速道路 第 6 6 回	1,200,000,000	1,199,856,000	
西日本高速道路 第 2 0 回	200,000,000	205,996,000	
西日本高速道路 第 2 2 回	400,000,000	413,112,000	
西日本高速道路 第 2 3 回	100,000,000	102,512,000	
西日本高速道路 第 3 0 回	300,000,000	301,218,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 3 5 回	200,000,000	202,842,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 2 回	100,000,000	103,114,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 8 回	200,000,000	205,308,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第 6 9 回	100,000,000	117,846,000	
貸付債権担保第 6 回住宅金融公庫債券	10,188,000	10,231,604	
貸付債権担保第 1 2 回住宅金融公庫債券	34,545,000	35,149,192	
貸付債権担保第 1 9 回住宅金融公庫債券	63,495,000	65,446,201	
貸付債権担保第 1 0 回住宅金融公庫債券	64,314,000	64,816,935	
貸付債権担保第 5 回 S 種住宅金融公庫債券	39,810,000	41,013,456	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融公庫債券	43,917,000	46,263,924	
貸付債権担保第 7 回 S 種住宅金融公庫債券	13,698,000	14,308,519	
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融公庫債券	29,486,000	30,695,810	
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融公庫債券	33,880,000	35,858,253	
貸付債権担保第 1 5 回住宅金融公庫債券	37,743,000	38,721,675	
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融公庫債券	62,376,000	64,823,010	
	64,330,000	66,707,636	

貸付債権担保第 2 0 回住宅金融公庫 債券			
貸付債権担保第 4 4 回住宅金融公庫 債券	58,544,000	61,814,853	
貸付債権担保第 8 回住宅金融支援機 構債券	98,340,000	103,441,879	
貸付債権担保第 7 回住宅金融支援機 構債券	16,165,000	16,998,305	
貸付債権担保第 2 5 回住宅金融支援 機構債券	24,890,000	27,089,031	
貸付債権担保第 2 8 回住宅金融支援 機構債券	84,258,000	90,865,512	
貸付債権担保 S 種第 1 6 回住宅金融 支援機構債券	18,181,000	18,680,977	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融支援 機構債券	89,240,000	94,882,645	
貸付債権担保 S 種第 1 7 回住宅金融 支援機構債券	36,564,000	37,593,276	
貸付債権担保第 4 5 回住宅金融支援 機構債券	108,015,000	115,739,152	
貸付債権担保第 5 2 回住宅金融支援 機構債券	78,932,000	83,914,977	
貸付債権担保第 2 4 回住宅金融支援 機構債券	44,874,000	48,515,973	
貸付債権担保第 4 8 回住宅金融支援 機構債券	100,284,000	107,523,501	
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融支援 機構債券	111,597,000	117,702,471	
貸付債権担保第 6 2 回住宅金融支援 機構債券	149,055,000	157,464,683	
貸付債権担保第 6 0 回住宅金融支援 機構債券	145,317,000	154,277,246	
貸付債権担保第 6 1 回住宅金融支援 機構債券	93,598,000	99,002,348	
貸付債権担保第 5 1 回住宅金融支援 機構債券	36,453,000	38,894,257	
貸付債権担保第 4 3 回住宅金融支援 機構債券	86,204,000	92,204,660	
貸付債権担保第 7 9 回住宅金融支援 機構債券	48,767,000	51,151,706	
貸付債権担保第 8 1 回住宅金融支援 機構債券	103,868,000	108,993,885	
貸付債権担保第 7 2 回住宅金融支援 機構債券	47,265,000	49,527,102	
貸付債権担保第 2 2 回住宅金融公庫 債券	26,894,000	27,803,555	
貸付債権担保第 7 0 回住宅金融支援 機構債券	142,053,000	149,932,679	
貸付債権担保第 3 3 回住宅金融支援 機構債券	31,221,000	33,639,378	
貸付債権担保第 3 4 回住宅金融支援 機構債券	32,800,000	35,373,160	
	32,833,000	35,205,184	

貸付債権担保第 3 5 回住宅金融支援 機構債券			
貸付債権担保第 4 6 回住宅金融支援 機構債券	35,674,000	38,294,968	
貸付債権担保第 5 5 回住宅金融支援 機構債券	95,300,000	101,398,247	
貸付債権担保第 5 6 回住宅金融支援 機構債券	136,293,000	144,953,057	
貸付債権担保第 5 7 回住宅金融支援 機構債券	45,359,000	48,274,222	
貸付債権担保第 7 6 回住宅金融支援 機構債券	91,144,000	96,080,359	
貸付債権担保 S 種第 3 回住宅金融公 庫債券	12,768,000	13,147,975	
貸付債権担保 S 種第 1 4 回住宅金融 支援機構債券	78,370,000	80,069,845	
貸付債権担保 S 種第 1 5 回住宅金融 支援機構債券	31,992,000	32,676,948	
貸付債権担保第 2 3 回住宅金融支援 機構債券	88,144,000	95,042,149	
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融支援 機構債券	89,331,000	95,885,215	
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融支援 機構債券	177,115,000	187,633,859	
貸付債権担保第 5 8 回住宅金融支援 機構債券	95,922,000	102,044,701	
貸付債権担保第 6 4 回住宅金融支援 機構債券	156,327,000	164,754,588	
貸付債権担保第 7 1 回住宅金融支援 機構債券	136,914,000	143,354,434	
貸付債権担保第 7 3 回住宅金融支援 機構債券	106,180,000	112,787,581	
貸付債権担保第 7 5 回住宅金融支援 機構債券	90,738,000	95,886,474	
貸付債権担保第 8 3 回住宅金融支援 機構債券	219,660,000	230,322,296	
貸付債権担保第 8 4 回住宅金融支援 機構債券	384,517,000	402,458,563	
貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援 機構債券	57,683,000	60,192,787	
貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援 機構債券	60,135,000	62,835,662	
貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援 機構債券	61,472,000	63,989,278	
貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援 機構債券	127,794,000	132,225,895	
貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援 機構債券	133,994,000	137,664,095	
貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援 機構債券	71,793,000	74,559,184	
貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援 機構債券	75,603,000	78,316,391	
	224,700,000	233,899,218	

		貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援機構債券	229,320,000	239,715,075	
		貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援機構債券	153,616,000	160,436,550	
		貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支援機構債券	75,581,000	78,782,611	
		貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支援機構債券	76,000,000	79,433,680	
		貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支援機構債券	267,723,000	272,378,702	
		貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支援機構債券	179,436,000	183,390,769	
		貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券	180,650,000	184,365,970	
		貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支援機構債券	90,504,000	92,429,925	
		貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支援機構債券	181,128,000	184,870,104	
		貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支援機構債券	91,361,000	92,897,692	
		貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支援機構債券	91,745,000	93,440,447	
		貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支援機構債券	92,621,000	94,557,705	
		貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券	372,364,000	379,368,166	
		貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券	280,848,000	286,330,152	
		貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券	187,982,000	191,585,614	
		貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券	189,348,000	193,509,869	
		貸付債権担保第 1 3 4 回住宅金融支援機構債券	193,614,000	196,855,098	
		貸付債権担保第 1 3 5 回住宅金融支援機構債券	96,944,000	98,600,772	
		貸付債権担保第 1 3 6 回住宅金融支援機構債券	97,173,000	99,201,000	
		貸付債権担保第 1 4 0 回住宅金融支援機構債券	98,390,000	99,996,708	
		貸付債権担保第 1 4 2 回住宅金融支援機構債券	297,243,000	300,818,833	
		貸付債権担保第 1 4 4 回住宅金融支援機構債券	299,592,000	303,399,814	
	小計	銘柄数：286	54,353,099,000	57,502,357,687	
		組入時価比率：8.7%		8.8%	
	合計			57,502,357,687	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）第１４回円貸社債	200,000,000	202,020,000	

ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第11回円貨社債	100,000,000	100,487,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第14回円貨社債	100,000,000	100,401,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・ エー 第1回非上位円貨社債	200,000,000	200,960,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第6回円貨社債（2014）	100,000,000	103,212,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第15回円貨社債（2018）	100,000,000	99,837,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第16回円貨社債（2018）	100,000,000	100,759,000	
スタンダード・チャータード 第3 回円貨社債（2015）	100,000,000	101,373,000	
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	102,145,000	
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	104,543,000	
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	100,263,000	
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	99,798,000	
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	98,241,000	
サントナデル銀行 第1回円貨社 債	100,000,000	100,394,000	
フランス電力 第4回円貨社債（2 017）	100,000,000	103,463,000	
ルノー 第19回円貨社債（201 7）	100,000,000	99,758,000	
現代キャピタル・サービス・イン ク 第15回円貨社債	200,000,000	201,910,000	
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回 円貨社債（2017）	100,000,000	102,257,000	
ウエストバック・バンキング・コー ポレーション 第12回円貨社	200,000,000	201,178,000	
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	201,040,000	
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上 位円貨社債（2017）	100,000,000	100,141,000	
大和ハウス工業 第5回特定社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,784,000	
大和ハウス工業 第9回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	101,854,000	
森永乳業 第13回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	103,672,000	
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	100,148,000	
アサヒグループホールディングス 第8回特定社債間限定同順位特	100,000,000	100,860,000	
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	205,786,000	
	200,000,000	201,502,000	

味の素 第 2 4 回特定社債間限定同順位特約付			
日本たばこ産業 第 1 3 回	100,000,000	101,035,000	
トヨタ紡織 第 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,878,000	
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	103,810,000	
森ヒルズリート投資法人 第 1 7 回特定投資法人債間限定同順位特約付	200,000,000	200,604,000	
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	103,227,000	
東レ 第 3 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,062,000	
日本土地建物 第 4 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,204,000	
王子ホールディングス 第 3 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,747,000	
レンゴー 第 1 8 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,951,000	
住友化学 第 5 6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,271,000	
エア・ウォーター 第 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,220,000	
三井化学 第 4 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,584,000	
三井化学 第 4 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,113,000	
三菱ケミカルホールディングス 第 1 4 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,902,000	
電通 第 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,239,000	
電通 第 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,928,000	
武田薬品工業 第 1 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,683,000	
ツムラ 第 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,609,000	
第一三共 第 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,404,000	
J X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	103,361,000	
横浜ゴム 第 1 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,721,000	
住友ゴム工業 第 2 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,385,000	
日本特殊陶業 第 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,222,000	
新日鐵住金 第 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,103,000	
新日鐵住金 第 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,645,000	
新日鐵住金 第 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,159,000	

新日本製鐵 第 6 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,168,000	
神戸製鋼所 第 6 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,504,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第 2 2 回（ＪＦＥス保証	100,000,000	102,896,000	
ＤＯＷＡホールディングス 第 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,360,000	
住友電気工業 第 2 6 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,706,000	
日立製作所 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	221,570,000	
三菱電機 第 4 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,759,000	
日本電産 第 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,154,000	
日本電気 第 4 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,639,000	
富士通 第 3 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,759,000	
パナソニック 第 1 6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,825,000	
パナソニック 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,750,000	
ソニー 第 3 2 回	200,000,000	201,472,000	
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	101,474,000	
三菱重工業 第 2 6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,224,000	
ＪＡ三井リース 第 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,359,000	
ＪＡ三井リース 第 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,589,000	
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	100,456,000	
トヨタ自動車 第 1 4 回社債間限定同等特約付	100,000,000	103,696,000	
アイシン精機 第 1 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,834,000	
ドンキホーテホールディングス 第 1 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,748,000	
ニコン 第 2 0 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,476,000	
大日本印刷 第 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,931,000	
伊藤忠商事 第 5 9 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	205,132,000	
丸紅 第 1 0 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,734,000	
豊田通商 第 1 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,442,000	
豊田通商 第 1 9 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	210,890,000	

三井物産 第 7 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,907,000	
住友商事 第 4 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,998,000	
住友商事 第 4 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,732,000	
高島屋 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,586,000	
丸井グループ 第 2 8 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,758,000	
クレディセゾン 第 5 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,317,000	
クレディセゾン 第 5 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,294,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ 第 1 回劣後特約付	100,000,000	102,999,000	
りそなホールディングス 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,943,000	
りそなホールディングス 第 2 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,291,000	
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	206,268,000	
みずほコーポレート銀行 第 8 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	118,332,000	
東京三菱銀行 第 5 7 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	107,099,000	
三菱東京ＵＦＪ銀行 第 1 1 9 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,289,000	
三菱東京ＵＦＪ銀行 第 1 5 9 回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,208,000	
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	308,052,000	
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	103,214,000	
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	108,415,000	
三菱ＵＦＪ信託銀行 第 9 回劣後特約付	100,000,000	102,837,000	
三井住友信託銀行 第 1 回劣後特約付	300,000,000	310,902,000	
セブン銀行 第 1 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,584,000	
セブン銀行 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,957,000	
みずほフィナンシャルグループ 第 1 回劣後特約付	200,000,000	205,752,000	
三井住友銀行 第 2 4 回劣後特約付	100,000,000	102,815,000	
トヨタファイナンス 第 8 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,982,000	
リコーリース 第 2 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,011,000	
アコム 第 7 6 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,875,000	

アコム 第 7 7 回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	99,998,000	
ジャックス 第 1 2 回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	101,004,000	
ジャックス 第 1 9 回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,299,000	
日立キャピタル 第 5 2 回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	100,953,000	
日立キャピタル 第 5 7 回社債間限 定同順位特約付	100,000,000	102,253,000	
三菱ＵＦＪリース 第 5 2 回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	101,407,000	
三菱ＵＦＪリース 第 5 5 回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,083,000	
三菱ＵＦＪリース 第 3 0 回社債間 限定同順位特約付	100,000,000	100,866,000	
大和証券グループ本社 第 2 2 回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	100,290,000	
大和証券グループ本社 第 2 3 回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	103,722,000	
三菱地所 第 5 6 回担保提供制限等 財務上特約無	100,000,000	107,236,000	
三菱地所 第 1 1 1 回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	103,017,000	
三菱地所 第 1 2 0 回担保提供制限 等財務上特約無	100,000,000	100,889,000	
東京建物 第 2 5 回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,034,000	
住友不動産 第 9 5 回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	103,769,000	
住友不動産 第 9 7 回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	206,940,000	
住友不動産 第 1 0 0 回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	103,162,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発 第 1 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,234,000	
日本ビルファンド投資法人 第 1 3 回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	104,245,000	
野村不動産オフィスファンド投資法 人 第 7 回特定投資法人債間限	100,000,000	120,505,000	
積水ハウス・ＳＩレジデンシャル投 資法人 第 5 回特定投資法人債	100,000,000	102,726,000	
東武鉄道 第 1 0 2 回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	215,432,000	
相鉄ホールディングス 第 3 2 回相 模鉄道株式会社保証付	200,000,000	204,534,000	
東京急行電鉄 第 7 5 回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	102,860,000	
東京急行電鉄 第 8 2 回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	112,380,000	
小田急電鉄 第 6 8 回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	219,052,000	
	100,000,000	104,243,000	

小田急電鉄 第 7 4 回社債間限定同順位特約付			
東日本旅客鉄道 第 1 5 回	100,000,000	103,070,000	
東日本旅客鉄道 第 1 9 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	212,446,000	
東日本旅客鉄道 第 3 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	111,479,000	
東日本旅客鉄道 第 5 7 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	241,580,000	
東日本旅客鉄道 第 7 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	119,164,000	
東日本旅客鉄道 第 1 0 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	121,142,000	
東日本旅客鉄道 第 1 3 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	117,923,000	
西日本旅客鉄道 第 1 5 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	235,194,000	
西日本旅客鉄道 第 3 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,309,000	
東海旅客鉄道 第 5 1 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	243,946,000	
東海旅客鉄道 第 7 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	113,814,000	
東海旅客鉄道 第 7 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	127,400,000	
東京地下鉄 第 2 2 回	100,000,000	100,505,000	
東京地下鉄 第 2 3 回	100,000,000	104,728,000	
東京地下鉄 第 2 4 回	100,000,000	112,032,000	
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	206,738,000	
名古屋鉄道 第 5 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,019,000	
日本通運 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,582,000	
日本通運 第 1 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,023,000	
横浜高速鉄道 第 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,832,000	
A N A ホールディングス 第 3 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,237,000	
三菱倉庫 第 1 4 回	100,000,000	100,659,000	
澁澤倉庫 第 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,300,000	
日本電信電話 第 6 0 回	100,000,000	101,959,000	
K D D I 第 2 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,374,000	
東京電力 第 5 4 7 回	100,000,000	101,888,000	
東京電力 第 5 4 8 回	100,000,000	113,987,000	
東京電力 第 5 6 0 回	100,000,000	112,343,000	
中部電力 第 5 0 0 回	200,000,000	207,422,000	
中部電力 第 5 2 4 回	100,000,000	101,631,000	

関西電力 第482回	100,000,000	101,243,000	
関西電力 第484回	100,000,000	101,225,000	
関西電力 第496回	100,000,000	103,972,000	
関西電力 第497回	200,000,000	209,246,000	
関西電力 第498回	200,000,000	200,928,000	
関西電力 第511回	100,000,000	100,834,000	
関西電力 第514回	200,000,000	200,930,000	
関西電力 第527回	200,000,000	201,196,000	
中国電力 第330回	100,000,000	103,613,000	
中国電力 第377回	400,000,000	417,040,000	
中国電力 第378回	100,000,000	103,835,000	
中国電力 第400回	100,000,000	100,923,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	104,009,000	
北陸電力 第304回	100,000,000	103,681,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	105,972,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	103,200,000	
東北電力 第473回	100,000,000	101,046,000	
東北電力 第475回	100,000,000	103,517,000	
東北電力 第481回	200,000,000	207,496,000	
四国電力 第281回	200,000,000	208,608,000	
九州電力 第424回	300,000,000	314,607,000	
九州電力 第428回	105,000,000	109,079,250	
九州電力 第449回	200,000,000	202,358,000	
九州電力 第451回	100,000,000	101,308,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	109,307,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	103,355,000	
電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,414,000	
電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,118,000	
電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,460,000	
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,476,000	
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,992,000	
電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,632,000	
東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	100,920,000	
東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	100,983,000	
東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	300,768,000	
東京電力パワーグリッド 第14回	100,000,000	100,345,000	
東京瓦斯 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,333,000	
	100,000,000	133,087,000	

	東京瓦斯 第 3 8 回社債間限定同順位特約付			
	東邦瓦斯 第 3 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,494,000	
	北海道瓦斯 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,372,000	
	広島ガス 第 1 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,093,000	
	東京都競馬 第 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,426,000	
	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	101,449,000	
	ファーストリテイリング 第 4 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,637,000	
	ソフトバンクグループ 第 5 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,108,000	
小計	銘柄数：210 組入時価比率：4.0%	25,905,000,000	26,824,311,250 4.1%	
合計			26,824,311,250	
合計			656,760,558,581	

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

第 2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 6月24日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	113,892,844
コール・ローン	433,645,797
国債証券	601,081,709,440
派生商品評価勘定	35,730
未収入金	195,273,337
未収利息	5,262,826,487
前払費用	214,117,109
流動資産合計	607,301,500,744
資産合計	
607,301,500,744	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	138,780
未払金	143,317,045
未払解約金	397,337,100
未払利息	797
その他未払費用	4,675,600
流動負債合計	545,469,322
負債合計	
545,469,322	
純資産の部	
元本等	

(2019年 6月24日現在)

元本	266,092,316,762
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	340,663,714,660
元本等合計	606,756,031,422
純資産合計	606,756,031,422
負債純資産合計	607,301,500,744

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年 6月24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	2.2802円
(10,000口当たり純資産額)	(22,802円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日	
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

○市場リスクの管理

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

○信用リスクの管理

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

○流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 6月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 6月24日現在	
期首	2018年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	275,983,396,164円
同期中における追加設定元本額	28,956,003,283円
同期中における一部解約元本額	38,847,082,685円
期末元本額	266,092,316,762円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト30	87,671,352円
バランスセレクト50	91,013,458円
バランスセレクト70	76,069,676円
野村外国債券インデックスファンド	286,885,732円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,282,079,670円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	25,539,762,695円

野村世界６資産分散投信（成長コース）	1,521,475,314円
野村資産設計ファンド２０１５	29,795,803円
野村資産設計ファンド２０２０	34,913,391円
野村資産設計ファンド２０２５	48,116,525円
野村資産設計ファンド２０３０	44,194,325円
野村資産設計ファンド２０３５	30,432,185円
野村資産設計ファンド２０４０	58,947,245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）	135,700,338,921円
のむラップ・ファンド（保守型）	5,768,727,750円
のむラップ・ファンド（普通型）	10,764,865,582円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,163,296,230円
野村外国債券インデックス（野村ＳＭＡ向け）	970,105,605円
野村資産設計ファンド２０４５	7,081,397円
野村インデックスファンド・外国債券	818,051,228円
マイ・ロード	8,899,668,623円
ネクストコア	356,924,782円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	130,003,351円
野村外国債券インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	4,524,903,763円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	1,618,894,804円
野村資産設計ファンド２０５０	8,912,500円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	5,493,803円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	1,807,030円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	1,391,064円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	1,063,239円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	481,653,078円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	255,749,924円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,248,106円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,672,319円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,797,482円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,480,950円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,573,883円
野村６資産均等バランス	385,323,656円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）	8,810,140,103円
世界６資産分散ファンド	95,890,634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	859,676,712円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	1,008,543,252円
野村外国債券インデックスファンドＶＡ（適格機関投資家専用）	9,034,675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）	1,592,220,019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）	403,602,289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）	1,789,216,359円
グローバル・インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,387,509,946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）	3,634,739円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡバランス型（適格機関投資家専用）	10,709,833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）	767,459円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	4,106,974,786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）	23,550,714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）	101,492,276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）	30,731,438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）	172,211,022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）	204,996,695円
野村グローバル・インデックス・バランス７５ＶＡ（適格機関投資家専用）	1,871,864,204円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	925,299,598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）	1,365,004,820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）	956,675,842円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	3,840,492円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	7,415,638円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	6,734,155円
野村外国債券パッシブファンド（確定拠出年金向け）	563,333,434円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	2,571,573,288円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	3,454,109,047円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	3,006,537,916円
野村外国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	14,716,683,271円
マイバランスＤＣ３０	1,675,757,086円
マイバランスＤＣ５０	1,051,910,590円
マイバランスＤＣ７０	668,800,589円
野村ＤＣ外国債券インデックスファンド	4,992,359,361円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	2,967,063,671円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	311,793,581円
マイターゲット２０５０（確定拠出年金向け）	103,279,540円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	108,970,027円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	54,190,448円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	4,509,304円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	14,416,116円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	4,496,807円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０３０	1,118,441円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０４０	588,368円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０５０	610,770円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	30,368,720円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	15,961,559円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	5,122,066円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	7,638,621円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年6月24日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年6月24日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	25,500,000.00	27,471,267.30	
		US TREASURY BOND	25,300,000.00	28,953,674.20	
		US TREASURY BOND	38,800,000.00	45,674,875.00	
		US TREASURY BOND	47,100,000.00	48,354,772.26	
		US TREASURY BOND	55,700,000.00	69,831,697.13	
		US TREASURY BOND	34,100,000.00	44,742,927.13	
		US TREASURY BOND	23,000,000.00	30,297,108.80	
		US TREASURY BOND	28,300,000.00	36,445,093.75	
		US TREASURY BOND	40,400,000.00	51,409,000.00	
		US TREASURY BOND	35,600,000.00	45,504,030.36	
		US TREASURY BOND	100,000.00	131,273.43	
		US TREASURY BOND	27,500,000.00	29,096,287.00	
		US TREASURY BOND	16,000,000.00	19,497,499.20	
		US TREASURY N/B	13,000,000.00	12,925,351.40	
		US TREASURY N/B	4,500,000.00	4,479,433.20	
		US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,105,242.16	
		US TREASURY N/B	500,000.00	497,792.95	
		US TREASURY N/B	8,500,000.00	8,494,022.80	
		US TREASURY N/B	10,400,000.00	10,366,281.12	
		US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,206,609.36	
		US TREASURY N/B	20,800,000.00	20,709,811.20	
		US TREASURY N/B	13,400,000.00	13,409,421.54	
		US TREASURY N/B	7,700,000.00	7,674,733.99	
		US TREASURY N/B	13,500,000.00	13,602,830.85	
		US TREASURY N/B	15,680,000.00	15,806,786.91	
		US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,094,972.56	
		US TREASURY N/B	36,200,000.00	36,294,739.02	
		US TREASURY N/B	37,700,000.00	37,465,845.30	
		US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,008,437.20	
		US TREASURY N/B	700,000.00	695,406.25	
		US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,175,159.89	
		US TREASURY N/B	300,000.00	299,003.88	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,993,437.20	

US TREASURY N/B	700,000.00	695,460.92	
US TREASURY N/B	55,800,000.00	56,379,795.48	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,298,019.45	
US TREASURY N/B	13,700,000.00	13,727,827.44	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,640.60	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,852,859.12	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,397,921.84	
US TREASURY N/B	300,000.00	302,894.52	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,431,483.60	
US TREASURY N/B	35,300,000.00	35,459,951.36	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,169,156.04	
US TREASURY N/B	47,200,000.00	48,580,968.16	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,436,811.88	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,854,601.27	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	11,889,881.78	
US TREASURY N/B	600,000.00	594,140.58	
US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,403,401.70	
US TREASURY N/B	10,800,000.00	10,889,014.68	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,167,187.50	
US TREASURY N/B	45,400,000.00	46,519,037.36	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,015,273.40	
US TREASURY N/B	22,500,000.00	22,590,526.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	297,656.25	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,016,601.50	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,233,750.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	789,937.44	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,136,011.64	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,702,687.50	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,749,531.06	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	25,184,570.00	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,832,937.16	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,125,000.00	
US TREASURY N/B	9,650,000.00	9,515,050.54	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	16,890,562.08	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,877,140.53	

US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,357,534.77	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,002,460.90	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,698,265.44	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,509,468.44	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,739,781.25	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	7,947,500.00	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,036,093.40	
US TREASURY N/B	33,700,000.00	33,905,357.69	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,297,718.75	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,509,843.75	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,896,906.25	
US TREASURY N/B	500,000.00	501,679.65	
US TREASURY N/B	70,300,000.00	70,283,521.68	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	25,377,084.04	
US TREASURY N/B	11,100,000.00	11,096,531.25	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,705,578.04	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,898,640.48	
US TREASURY N/B	27,100,000.00	27,390,054.01	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,007.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,718.75	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,003,281.20	
US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,256,546.36	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,065,624.00	
US TREASURY N/B	900,000.00	899,367.12	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,511,015.55	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,345,226.42	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	28,532,669.76	
US TREASURY N/B	47,900,000.00	47,855,093.75	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,131,483.10	
US TREASURY N/B	24,200,000.00	23,959,890.02	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,726,764.91	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	10,887,421.60	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	4,971,093.50	
US TREASURY N/B	49,300,000.00	49,230,669.41	
US TREASURY N/B	24,000,000.00	23,865,000.00	

US TREASURY N/B	13,700,000.00	13,409,944.97	
US TREASURY N/B	18,000,000.00	18,507,655.80	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	13,668,694.27	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,109,812.24	
US TREASURY N/B	14,600,000.00	14,490,500.00	
US TREASURY N/B	15,600,000.00	16,222,780.08	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,325,780.56	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,059,062.50	
US TREASURY N/B	27,500,000.00	28,651,562.50	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,723,906.25	
US TREASURY N/B	23,600,000.00	24,355,936.32	
US TREASURY N/B	10,000,000.00	10,143,750.00	
US TREASURY N/B	46,000,000.00	46,657,652.80	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,712,000.00	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	34,897,358.52	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,549,492.10	
US TREASURY N/B	46,900,000.00	47,233,426.17	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,561,234.12	
US TREASURY N/B	35,000,000.00	36,432,812.50	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	31,661,718.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,588,359.05	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,244,921.50	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	27,164,529.90	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	20,454,000.00	
US TREASURY N/B	70,300,000.00	71,727,968.75	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,964,062.40	
US TREASURY N/B	10,200,000.00	10,493,250.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	784,312.48	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,941,406.20	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,044,687.50	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,403,124.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	514,492.15	
US TREASURY N/B	500,000.00	528,925.75	
US TREASURY N/B	4,900,000.00	6,877,609.13	
US TREASURY N/B	26,700,000.00	35,659,099.56	

US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,277,539.00	
US TREASURY N/B	200,000.00	280,140.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	133,398.43	
US TREASURY N/B	300,000.00	353,578.11	
US TREASURY N/B	100,000.00	129,804.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	134,039.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	131,945.31	
US TREASURY N/B	100,000.00	136,210.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	132,085.93	
US TREASURY N/B	200,000.00	247,687.50	
US TREASURY N/B	300,000.00	390,351.54	
US TREASURY N/B	200,000.00	277,531.24	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	4,897,875.00	
US TREASURY N/B	700,000.00	851,703.09	
US TREASURY N/B	4,300,000.00	4,766,617.08	
US TREASURY N/B	500,000.00	553,554.65	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,252,421.80	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,361,437.50	
US TREASURY N/B	17,600,000.00	18,254,500.00	
US TREASURY N/B	24,200,000.00	26,710,750.00	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	16,727,811.80	
US TREASURY N/B	12,700,000.00	15,190,389.99	
US TREASURY N/B	18,900,000.00	21,730,569.84	
US TREASURY N/B	24,000,000.00	26,486,248.80	
US TREASURY N/B	36,900,000.00	39,869,295.03	
US TREASURY N/B	46,400,000.00	45,696,747.68	
US TREASURY N/B	21,700,000.00	23,464,819.77	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,908,748.80	
US TREASURY N/B	14,400,000.00	15,591,373.92	
US TREASURY N/B	30,500,000.00	30,004,375.00	
US TREASURY N/B	25,600,000.00	25,168,000.00	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,306,046.84	
US TREASURY N/B	14,200,000.00	15,008,734.02	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,840,781.25	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,506,250.00	

小計	US TREASURY N/B	100,000.00	103,132.81	
	US TREASURY N/B	8,500,000.00	9,189,296.45	
	US TREASURY N/B	6,100,000.00	6,755,750.00	
	US TREASURY N/B	11,700,000.00	12,662,507.52	
	US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,706,171.70	
	銘柄数：178	2,491,530,000.00	2,625,271,059.03	
	組入時価比率：46.5%		(282,006,617,161) 46.9%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,713,400.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	16,400,000.00	16,676,340.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	701,792.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,762,076.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,207,272.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,923,427.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,400,000.00	7,312,088.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	12,750,000.00	13,192,425.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,803,312.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	295,773.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,538,822.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,617,858.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,621,056.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,621,114.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,127,797.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,665,024.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,589,088.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	5,400,000.00	5,663,196.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,010,360.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,750,000.00	7,062,727.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	193,326.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	104,472.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	14,002,329.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	6,382,824.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	4,843,424.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,200,000.00	11,591,192.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	14,282,008.00	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	371,130.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	643,026.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	267,630.00	
	銘柄数：30	126,780,000.00	145,786,309.10 (11,865,547,697)	
	組入時価比率：2.0%		2.0%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	52,600,000.00	52,690,472.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	95,300,000.00	93,353,974.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	57,100,000.00	56,645,255.60	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	108,100,000.00	105,148,870.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	35,300,000.00	36,027,268.25	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	44,473,128.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	47,700,000.00	43,222,401.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	86,300,000.00	85,836,569.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	49,600,000.00	52,613,200.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,500,000.00	46,837,125.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,031,200.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	68,370,157.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,300,000.00	43,115,358.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	63,550,938.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	15,214,122.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	84,498,980.00	
	銘柄数：16	887,300,000.00	901,629,017.85 (5,076,171,370)	
	組入時価比率：0.8%		0.8%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,793,561.37	
	BELGIUM KINGDOM	5,700,000.00	6,337,545.00	
	BELGIUM KINGDOM	7,400,000.00	8,361,371.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,900,000.00	6,835,150.00	
	BELGIUM KINGDOM	7,900,000.00	8,798,538.10	
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,989,900.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,606,800.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,046,228.60	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,064,200.00	
	BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	11,103,808.80	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,084,370.00	

BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,142,260.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,068,900.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,077,382.00	
BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,627,492.50	
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,124,017.50	
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	556,500.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,131,526.50	
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	605,860.50	
BELGIUM KINGDOM	5,400,000.00	9,125,211.60	
BELGIUM KINGDOM	5,500,000.00	9,138,800.00	
BELGIUM KINGDOM	2,700,000.00	3,106,775.25	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,163,000.80	
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,567,626.00	
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,290,995.70	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	17,070,588.50	
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	18,467,009.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	400,000.00	407,022.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,200,000.00	10,929,381.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,600,000.00	3,625,310.16	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,400,000.00	21,516,055.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,900,000.00	6,042,083.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,028,749.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,550,000.00	16,904,582.85	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,350,000.00	5,461,761.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	5,428,790.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,500,000.00	16,263,235.35	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	5,421,741.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,362,035.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	17,951,913.26	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	9,303,060.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	518,195.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	985,212.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,600,000.00	20,022,054.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,666,225.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,751,602.00	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	31,515,254.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,409,380.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,188,765.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,481,500.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	13,426,410.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,301,073.20	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,400,000.00	7,722,240.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	5,132,340.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,400,000.00	14,184,450.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,100,000.00	14,860,400.13	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	5,389,904.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,300,000.00	5,602,175.88	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	4,623,801.00	
BUNDES OblIGATION	100,000.00	101,254.00	
BUNDES OblIGATION	1,600,000.00	1,620,976.00	
BUNDES OblIGATION	3,300,000.00	3,368,475.00	
BUNDES OblIGATION	1,900,000.00	1,945,733.00	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,027,260.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	103,787.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	103,558.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,100,000.00	6,408,538.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,800,000.00	5,191,536.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,400,000.00	6,825,216.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,300,000.00	15,304,575.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	6,995,950.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,362,500.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	3,245,790.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,000,000.00	11,959,750.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,600,000.00	6,235,208.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,900,000.00	18,336,324.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,893,460.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,659,930.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,875,502.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,869,560.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,991,709.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,800,000.00	9,414,592.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,035,940.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	738,500.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	19,400,000.00	30,399,412.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,076,310.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	12,502,622.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,200,000.00	3,446,656.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,300,000.00	9,265,599.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	11,062,870.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,300,000.00	8,860,381.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,800,000.00	13,506,199.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	5,775,620.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	10,407,732.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	14,165,200.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000.00	6,622,929.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	11,342,608.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	11,418,912.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,600,000.00	7,089,040.00	
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	100,000.00	100,680.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,018,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,806,948.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	9,000,000.00	9,428,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,002,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,015,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,650,000.00	13,402,637.05	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	99,140.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,200,000.00	12,971,406.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	5,110,251.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,551,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,400,000.00	15,721,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	415,920.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	548,058.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	103,730.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	18,701,760.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	303,690.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	406,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	400,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000.00	8,461,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,154,932.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,400,000.00	34,905,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	99,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,240,519.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	571,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	24,854,170.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	18,188,010.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,025,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	892,160.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,704,230.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	19,970,764.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	5,253,890.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	2,996,166.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,073,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	13,548,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,100,000.00	23,548,410.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	21,500,000.00	29,104,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,185,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,700,000.00	25,261,310.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	25,239,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	466,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	14,995,130.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,400,000.00	6,416,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,100,000.00	15,763,880.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,772,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	510,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	10,577,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,300,000.00	17,496,150.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,800,000.00	19,213,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	5,618,530.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,032,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,292,400.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,030,820.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,012,530.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,290,576.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,526,440.50	
FINNISH GOVERNMENT	3,200,000.00	3,432,342.40	
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,295,757.60	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	409,100.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,900,000.00	3,251,915.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,568,040.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	107,738.60	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,109,181.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,157,699.70	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	419,848.40	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	859,688.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,686,636.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	591,656.80	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	967,400.80	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,005,477.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,700,000.00	6,774,872.50	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,100,320.00	
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	407,200.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	3,066,450.00	
FRANCE (GOVT OF)	5,970,000.00	6,523,121.09	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	102,225.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,500,000.00	11,924,913.00	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,570,958.30	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,896,119.46	
FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	2,731,265.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,141,460.00	
FRANCE (GOVT OF)	12,000,000.00	15,096,000.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,129,200.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	111,790.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	120,759.60	
FRANCE (GOVT OF)	7,600,000.00	9,657,646.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,900,000.00	8,231,168.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,100,000.00	1,113,541.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	12,760,874.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,227,250.24	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	10,494,897.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,900,000.00	2,954,963.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,307,481.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	9,748,080.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,300,000.00	35,486,695.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,358,425.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	27,862,560.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,511,200.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	43,156,960.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	8,956,800.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	41,688,000.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	15,554,214.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,100,000.00	38,078,189.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,300,000.00	12,177,203.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,300,000.00	5,373,706.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000.00	31,126,285.75	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	21,200,000.00	33,189,448.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,200,000.00	9,794,865.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,200,000.00	6,255,168.00	
IRISH GOVERNMENT	500,000.00	536,840.00	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,212,946.00	
IRISH GOVERNMENT	6,000,000.00	6,418,320.00	
IRISH TSY 0.8% 2022	400,000.00	414,264.00	
IRISH TSY 1.3% 2033	1,400,000.00	1,525,692.00	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,213,000.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	1,300,000.00	1,491,100.00	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,950,934.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	4,600,000.00	5,607,630.00	
IRISH TSY 2% 2045	2,800,000.00	3,434,765.60	
IRISH TSY 2022	2,200,000.00	2,233,000.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	5,200,000.00	6,131,944.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	200,000.00	208,816.00	

NETHERLANDS GOVERNMENT	650,000.00	703,365.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	305,341.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	545,900.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	695,851.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,500,000.00	4,532,850.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,536,500.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	102,582.90	
NETHERLANDS GOVERNMENT	13,500,000.00	15,255,810.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,565,550.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,254,800.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,342,800.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	10,968,250.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,088,900.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,000,000.00	3,112,200.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,600,000.00	6,134,454.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,100,000.00	5,173,038.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,400,000.00	7,789,408.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,500,000.00	10,647,152.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,265,680.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,800,000.00	1,884,600.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,100,000.00	1,202,960.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,121,800.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,600,000.00	1,634,400.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,200,000.00	4,781,700.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	4,087,600.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,550,000.00	1,704,770.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,800,000.00	5,346,720.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,431,820.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,300,260.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,150,600.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,591,588.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,100,000.00	4,043,640.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,900,000.00	3,106,612.10	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,700,000.00	9,059,380.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,000,000.00	3,593,100.00	

小計	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	1,970,300.00	
	REPUBLIC OF IRELAND	8,150,000.00	9,483,747.50	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	24,493,744.00	
	SPANISH GOVERNMENT	13,900,000.00	22,818,240.00	
	SPANISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,523,839.40	
	銘柄数：261	1,489,750,000.00	1,898,028,914.36	
	組入時価比率：38.2%		(232,015,054,491)	38.6%
英債券	UK TREASURY	490,000.00	496,884.50	
	UK TREASURY	350,000.00	362,873.00	
	UK TREASURY	6,300,000.00	6,387,885.00	
	UK TREASURY	140,000.00	160,210.40	
	UK TREASURY	670,000.00	716,524.80	
	UK TREASURY	4,950,000.00	5,406,340.50	
	UK TREASURY	2,400,000.00	2,394,912.00	
	UK TREASURY	8,500,000.00	8,817,305.00	
	UK TREASURY	21,900,000.00	22,027,677.00	
	UK TREASURY	3,800,000.00	4,060,110.00	
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,220,808.00	
	UK TREASURY	9,050,000.00	10,030,658.00	
	UK TREASURY	11,850,000.00	14,733,697.50	
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,298,532.00	
	UK TREASURY	700,000.00	738,920.00	
	UK TREASURY	9,630,000.00	12,398,432.40	
	UK TREASURY	200,000.00	213,880.00	
	UK TREASURY	6,900,000.00	10,152,867.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	8,052,390.00	
	UK TREASURY	5,250,000.00	7,270,725.00	
	UK TREASURY	6,600,000.00	9,647,220.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	4,213,990.00	
	UK TREASURY	3,300,000.00	5,247,000.00	
	UK TREASURY	4,500,000.00	6,806,700.00	
	UK TREASURY	3,500,000.00	5,363,400.00	
	UK TREASURY	5,900,000.00	9,539,710.00	
	UK TREASURY	24,000,000.00	34,488,000.00	

小計	UK TREASURY	6,700,000.00	10,939,760.00	
	UK TREASURY	2,800,000.00	2,830,520.00	
	UK TREASURY	1,600,000.00	1,714,080.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	9,059,690.00	
	UK TREASURY	8,750,000.00	14,166,250.00	
	UK TREASURY	3,600,000.00	4,001,040.00	
	UK TREASURY	200,000.00	278,580.00	
	UK TREASURY	2,950,000.00	5,209,700.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	22,900,000.00	31,432,540.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,800,000.00	12,365,120.00	
	銘柄数：37	213,530,000.00	284,244,932.10	
	組入時価比率：6.4%		(38,924,501,001)	6.5%
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,700,000.00	1,840,590.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	48,150,000.00	54,055,597.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	29,900,000.00	32,625,956.09	
	SWEDISH GOVERNMENT	34,350,000.00	40,235,872.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	13,109,184.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	18,092,054.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,000,000.00	10,769,300.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,500,000.00	16,478,032.20	
	銘柄数：8	163,400,000.00	187,206,586.69	
	組入時価比率：0.4%		(2,152,875,746)	0.4%
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	20,600,000.00	21,587,770.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	13,702,990.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	48,568,330.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,837,005.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,760,630.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,884,160.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,568,640.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	7,729,500.00	
	銘柄数：8	112,500,000.00	118,639,025.00	
	組入時価比率：0.2%		(1,500,783,666)	0.2%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	2,700,000.00	2,737,935.00	

ネ	KINGDOM OF DENMARK	34,100,000.00	37,182,469.50	
	KINGDOM OF DENMARK	16,070,000.00	17,625,576.00	
	KINGDOM OF DENMARK	36,600,000.00	42,038,760.00	
	KINGDOM OF DENMARK	12,200,000.00	13,141,230.00	
	KINGDOM OF DENMARK	40,500,000.00	77,028,732.00	
	銘柄数：6	142,170,000.00	189,754,702.50	
	組入時価比率：0.5%		(3,106,284,479)	0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	12,200,000.00	12,791,700.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	1,917,860.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	14,755,500.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	19,200,000.00	19,520,947.20	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	11,255,250.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	37,300,000.00	40,537,117.80	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	10,488,150.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,700,000.00	13,895,020.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	3,825,330.47	
	銘柄数：9	118,700,000.00	128,986,875.47	
小計	組入時価比率：0.6%		(3,707,082,801)	0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,200,000.00	5,258,230.12	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,100,000.00	12,104,160.39	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,725,048.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	8,015,700.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,506,200.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,497,240.28	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,799,760.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,200,000.00	14,852,430.12	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	15,361,560.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	15,318,430.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,589,552.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,800,000.00	19,234,680.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,373,614.04	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	11,932,109.70	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,592,640.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	560,448.85	

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,300,000.00	10,121,543.44	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,113,716.96	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	6,662,051.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	877,100.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,759,588.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,500,000.00	5,512,500.00	
	銘柄数：22	139,580,000.00	161,768,305.00 (12,087,327,749)	
	組入時価比率：2.0%		2.0%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,445,359.28	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,780,000.00	2,813,775.33	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	991,505.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,800,000.00	1,805,063.04	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,462,720.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	300,420.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,117,300.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	707,241.92	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,012,480.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,131,240.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	712,250.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,344,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	323,040.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,582,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,366,692.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	791,848.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,154,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	833,600.00	
	銘柄数：18	29,480,000.00	30,896,034.57 (2,451,909,303)	
	組入時価比率：0.4%		0.4%	
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,115,289.12	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	411,034.32	
	MALAYSIA GOVERNMENT	600,000.00	642,445.02	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	434,212.84	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,400,000.00	2,417,935.44	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	603,656.34	

小計	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,000,000.00	6,108,582.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,300,000.00	9,446,674.02	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	503,373.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,605,033.78	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	506,041.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,542,430.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,543,024.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,230,288.72	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	5,991,166.26	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	614,109.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	9,231,349.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,682,501.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	6,933,735.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,808,587.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	3,022,304.40	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,058,405.17	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,577,639.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,213,495.91	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	788,585.84	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	921,712.23	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	10,553,607.76	
	銘柄数：27	103,500,000.00	106,507,219.91	
			(2,760,667,140)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,900,000.00	5,932,863.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	57,700,000.00	58,559,268.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	59,300,000.00	67,136,334.89	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,200,000.00	36,014,062.30	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	25,542,000.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	53,900,000.00	50,008,872.76	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,800,000.00	6,424,848.76	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,100,000.00	27,745,002.93	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00	28,851,200.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000.00	10,933,502.40	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,600,000.00	21,476,469.24	

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	89,000,000.00	79,669,836.30	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	43,200,000.00	38,623,983.84	
	小計	銘柄数：13	496,500,000.00	456,918,244.82	
				(3,426,886,836)	
		組入時価比率：0.6%		0.6%	
合計				601,081,709,440	
				(601,081,709,440)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 6月24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	32,184,270	-	32,220,000	35,730
米ドル	32,184,270	-	32,220,000	35,730
売建	24,309,220	-	24,448,000	138,780
ユーロ	24,309,220	-	24,448,000	138,780
合計	-	-	-	103,050

（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）

(2019年 6月24日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	73,408,746
コール・ローン	6,160,277
国債証券	9,144,302,332
未収利息	124,604,538
前払費用	21,552,776
流動資産合計	9,370,028,669
資産合計	9,370,028,669
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,968
未払解約金	11,703,211
未払利息	11
その他未払費用	539,300
流動負債合計	12,248,490
負債合計	12,248,490
純資産の部	
元本等	
元本	6,980,222,901
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,377,557,278
元本等合計	9,357,780,179
純資産合計	9,357,780,179
負債純資産合計	9,370,028,669

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2.外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3.費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

2019年 6月24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	1.3406円
(10,000口当たり純資産額)	(13,406円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 6月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2. 時価の算定方法

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 6月24日現在	
期首	2018年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	5,896,253,254円
同期中における追加設定元本額	2,465,666,765円
同期中における一部解約元本額	1,381,697,118円
期末元本額	6,980,222,901円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	12,246,640円
野村資産設計ファンド2020	14,505,855円
野村資産設計ファンド2025	20,206,994円
野村資産設計ファンド2030	18,559,830円
野村資産設計ファンド2035	12,780,630円
野村資産設計ファンド2040	24,755,278円
野村資産設計ファンド2045	2,964,900円
野村インデックスファンド・新興国債券	917,934,128円
ネクストコア	81,498,958円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	227,797,866円
野村資産設計ファンド2050	3,694,508円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	2,307,389円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	785,120円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	572,492円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	453,863円
世界6資産分散ファンド	168,001,205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）	4,417,025,890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	371,374,115円
野村DC運用戦略ファンド	648,694,906円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	33,092,375円
野村資産設計ファンド（DC）2030	469,699円
野村資産設計ファンド（DC）2040	247,090円
野村資産設計ファンド（DC）2050	253,170円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年6月24日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年6月24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	3,816,000.00	
		REPUBLIC OF ARGENTINA	13,300,000.00	9,509,500.00	
		小計	銘柄数：2	13,325,500.00	
				(33,447,005)	
			組入時価比率：0.4%	0.4%	
	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,700,000.00	10,481,506.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	14,300,000.00	14,186,114.80	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	21,100,000.00	20,523,970.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,206,025.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,500,000.00	8,338,711.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	13,000,000.00	11,779,690.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	21,150,000.00	21,036,424.50	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8,600,000.00	9,122,450.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,900,000.00	7,957,275.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,200,000.00	6,219,344.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,278,853.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	13,600,000.00	14,550,096.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	9,700,000.00	9,601,933.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,500,000.00	5,578,511.40	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	13,500,000.00	13,743,810.00	
		小計	銘柄数：15	166,604,714.20	
				(937,984,540)	
			組入時価比率：10.0%	10.3%	
	レアル	LETRA TESOURO NACIONAL	5,900,000.00	5,569,726.26	
		LETRA TESOURO NACIONAL	6,200,000.00	5,314,018.76	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	456,000.00	5,031,228.57	
		NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000.00	7,000,009.86	

小計	NOTA DO TESOURO NACIONAL	451,000.00	5,285,860.26	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	280,000.00	3,307,281.32	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	150,000.00	1,798,429.35	
	銘柄数：7	14,047,000.00	33,306,554.38	
	組入時価比率：10.0%		(935,914,178)	10.2%
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	170,000,000.00	178,078,604.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	280,000,000.00	308,543,256.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	275,000,000.00	314,614,877.50	
	BONOS TESORERIA PESOS	490,000,000.00	586,904,752.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	265,000,000.00	371,341,850.00	
	REPUBLIC OF CHILE	300,000,000.00	308,574,000.00	
	銘柄数：6	1,780,000,000.00	2,068,057,339.50	
小計	組入時価比率：3.5%		(324,685,002)	3.6%
	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,040,000,000.00	4,226,203,600.00	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	11,840,000,000.00	14,915,380,800.00	
	銘柄数：2	15,880,000,000.00	19,141,584,400.00	
小計	組入時価比率：6.9%		(641,243,077)	7.0%
	BONOS DE TESORERIA	1,400,000.00	1,528,598.82	
ソル	BONOS DE TESORERIA	1,400,000.00	1,541,688.26	
	BONOS DE TESORERIA	1,600,000.00	1,773,027.20	
	PERU BONO SOBERANO	800,000.00	996,692.32	
	PERU BONO SOBERANO	1,100,000.00	1,299,835.46	
	PERU BONO SOBERANO	1,120,000.00	1,329,210.84	
	REPUBLIC OF PERU	1,300,000.00	1,468,451.40	
	銘柄数：7	8,720,000.00	9,937,504.30	
小計	組入時価比率：3.5%		(323,366,389)	3.5%
	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	3,420,577.60	
ウルグアイペソ	銘柄数：1	4,000,000.00	3,420,577.60	
	組入時価比率：0.1%		(10,432,761)	0.1%
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	950,000.00	855,475.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,149,070.00	

小計	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,092,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,550,000.00	2,096,100.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	1,620,700.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,390,000.00	1,087,675.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,300,000.00	1,982,600.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,270,000.00	1,655,987.70	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,160,000.00	874,930.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	407,056.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,610,000.00	1,186,570.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	698,598.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,016,600.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	926,400.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	1,592,850.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,176,000.00	
	銘柄数：16	24,270,000.00	19,418,611.70	
			(361,962,922)	
	組入時価比率：3.9%		4.0%	
小計	チェココルナ			
	CZECH REPUBLIC	5,000,000.00	4,951,000.00	
	CZECH REPUBLIC	6,700,000.00	6,886,293.50	
	CZECH REPUBLIC	26,900,000.00	25,853,665.32	
	CZECH REPUBLIC	28,900,000.00	28,045,392.32	
	CZECH REPUBLIC	20,200,000.00	18,938,510.00	
小計	銘柄数：5	87,700,000.00	84,674,861.14	
			(404,745,836)	
	組入時価比率：4.3%		4.4%	
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	28,000,000.00	30,910,600.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	25,000,000.00	25,086,150.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	120,000,000.00	125,338,800.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	50,000,000.00	59,154,195.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	152,000,000.00	156,283,132.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	92,708,000.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	142,000,000.00	152,876,447.40	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	76,573,350.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	86,000,000.00	89,938,800.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	182,000,000.00	193,115,195.00	
	銘柄数：10	925,000,000.00	1,001,984,669.40	

			(377,648,021)	
	組入時価比率：4.0%		4.1%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	4,230,000.00	4,435,155.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,580,000.00	2,819,940.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,580,000.00	1,778,329.50	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	1,946,930.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,740,000.00	5,151,365.64	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,800,000.00	4,918,289.76	
	POLAND GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,197,750.00	
小計	銘柄数：7	26,830,000.00	28,247,759.90	
			(811,840,619)	
	組入時価比率：8.7%		8.9%	
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	8,000,000.00	8,067,080.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	31,000,000.00	30,931,800.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	67,000,000.00	67,917,900.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,000,000.00	36,870,500.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	48,000,000.00	46,687,200.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,000,000.00	20,104,900.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	59,000,000.00	60,398,890.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,000,000.00	20,770,200.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	61,700,000.00	61,055,235.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	35,000,000.00	38,154,725.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,500,000.00	38,376,375.00	
小計	銘柄数：11	424,200,000.00	429,334,805.00	
			(729,869,168)	
	組入時価比率：7.8%		8.0%	
レイ	ROMANIA	2,290,000.00	2,284,435.30	
	ROMANIA	300,000.00	313,809.00	
	ROMANIA	500,000.00	503,557.50	
	ROMANIA	400,000.00	396,716.00	
	ROMANIA	1,500,000.00	1,484,370.00	
	ROMANIA	550,000.00	587,457.75	
	ROMANIA	1,100,000.00	1,065,630.50	
	ROMANIA	920,000.00	948,124.40	
	ROMANIA	1,010,000.00	1,110,848.50	
小計	銘柄数：9	8,570,000.00	8,694,948.95	

			(224,851,379)	
	組入時価比率：2.4%		2.5%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	300,000.00	308,275.74	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3,300,000.00	3,358,835.04	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,000,000.00	1,085,532.10	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,609,750.24	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	620,000.00	631,220.14	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,818,891.04	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,530,731.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,685,695.22	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,037,468.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,315,742.98	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	917,000.82	
小計	銘柄数：11	20,920,000.00	21,299,143.42	
			(552,073,797)	
	組入時価比率：5.9%		6.0%	
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,900,000.00	13,483,145.79	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,000,000.00	23,058,990.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	14,100,094.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000.00	23,201,527.16	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	18,600,000.00	19,038,407.58	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,453,112.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	18,900,000.00	19,033,543.62	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	24,500,000.00	25,996,996.55	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	15,446,525.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	17,178,712.50	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,200,000.00	9,502,638.06	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	22,500,000.00	25,576,260.75	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,100,000.00	9,090,542.52	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,000,000.00	9,005,230.80	
小計	銘柄数：14	212,900,000.00	228,165,727.53	
			(796,298,389)	
	組入時価比率：8.5%		8.7%	
フィリピンペソ	REPUBLIC OF PHILIPPINES	10,000,000.00	10,029,200.00	
小計	銘柄数：1	10,000,000.00	10,029,200.00	
			(20,860,736)	

	組入時価比率：0.2%		0.2%	
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	4,100,000,000.00	4,350,100,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,700,000,000.00	1,886,617,330.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	7,780,000,000.00	7,762,495,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	8,700,000,000.00	8,311,311,840.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	9,230,000,000.00	9,735,953,526.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	9,600,000,000.00	10,104,000,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,580,000,000.00	6,605,715,600.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	9,150,000,000.00	8,907,444,480.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	12,500,000,000.00	11,445,831,250.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,530,000,000.00	6,077,107,785.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,400,000,000.00	4,642,000,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,339,303,911.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,698,771,440.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,100,000,000.00	4,199,195,400.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,084,825,920.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,361,085,260.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	8,680,000,000.00	9,009,840,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	11,000,000,000.00	11,365,931,500.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	900,000,000.00	861,322,410.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,500,000,000.00	2,612,500,000.00	
小計	銘柄数：20	117,060,000,000.00	119,361,352,652.00	
			(907,146,280)	
	組入時価比率：9.7%		9.9%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	440,000.00	442,450.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,900,000.00	10,047,430.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,500,000.00	15,283,988.55	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,400,000.00	7,919,322.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	12,060,000.00	10,267,884.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,000,000.00	6,494,658.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	3,779,322.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,700,000.00	4,150,827.21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,800,000.00	7,934,080.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	6,578,632.80	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	3,123,212.03	
		7,300,000.00	6,534,716.91	

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA			
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	19,500,000.00	17,434,437.15	
	小計	銘柄数：13	108,150,000.00	99,990,964.45	
				(749,932,233)	
		組入時価比率：8.0%		8.2%	
合計				9,144,302,332	
				(9,144,302,332)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 6月24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	139,620,000	-	139,620,000	-
米ドル	139,620,000	-	139,620,000	-
売建	8,586,432	-	8,592,400	5,968
米ドル	8,586,432	-	8,592,400	5,968
合計	-	-	-	5,968

(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）

(2019年 6月24日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	60,204,090,035
株式	393,776,671,090
派生商品評価勘定	41,733,640
未収入金	1,240,224
未収配当金	2,007,185,249
未収利息	2,712,149
その他未収収益	47,172,935
差入委託証拠金	86,932,000
流動資産合計	456,167,737,322
資産合計	456,167,737,322
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	363,888
未払解約金	432,416,235
未払利息	110,726
有価証券貸借取引受入金	57,812,037,589
流動負債合計	58,244,928,438
負債合計	58,244,928,438
純資産の部	
元本等	
元本	257,882,366,025
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	140,040,442,859
元本等合計	397,922,808,884
純資産合計	397,922,808,884
負債純資産合計	456,167,737,322

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2.費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。

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

（貸借対照表に関する注記）

2019年 6月24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	1.5430円
(10,000口当たり純資産額)	(15,430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	
	54,594,275,630円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日	
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 6月24日現在	
---------------	--

1．貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2．時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 6月24日現在	
期首	2018年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	222,382,310,373円
同期中における追加設定元本額	59,721,403,954円
同期中における一部解約元本額	24,221,348,302円
期末元本額	257,882,366,025円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	172,684,512円
バランスセレクト５０	400,326,039円
バランスセレクト７０	502,191,631円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	2,463,850,172円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	3,834,529,133円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	7,995,177,995円
野村資産設計ファンド２０１５	55,228,758円
野村資産設計ファンド２０２０	64,848,021円
野村資産設計ファンド２０２５	101,496,948円
野村資産設計ファンド２０３０	115,158,397円
野村資産設計ファンド２０３５	88,728,346円
野村資産設計ファンド２０４０	197,486,365円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	100,587,146,837円
のむラップ・ファンド（保守型）	3,028,791,925円
のむラップ・ファンド（普通型）	8,014,944,191円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,186,446,923円
野村資産設計ファンド２０４５	29,167,033円
野村インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ	2,015,158,817円
マイ・ロード	4,014,542,087円
ネクストコア	133,439,288円
野村インデックスファンド・内外７資産バランス・為替ヘッジ型	1,012,190,077円
野村日本株インデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	1,876,694,923円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	485,463,608円
野村資産設計ファンド２０５０	48,197,622円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	15,404,229円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	6,120,489円

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	4,413,886円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	2,772,802円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	298,303,053円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	270,840,673円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,016,511円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	5,530,326円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	17,161,650円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,916,874円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	22,480,206円
野村6資産均等バランス	578,523,291円
世界6資産分散ファンド	143,969,791円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	562,693,588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）	497,948,912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）	378,729,227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）	767,520,533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）	833,280,617円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	5,456,317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）	12,058,475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）	2,880,301円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	3,699,716,825円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	19,643,858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）	152,354,669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）	166,392,392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）	61,520,074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）	110,797,060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）	307,750,286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）	4,918,215,683円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	691,280,667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）	408,863,076円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX（適格機関投資家専用）	2,769,958,012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）	229,577,767円
TOPIXインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,057,492,484円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	7,623,576円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	33,586,369円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	44,138,948円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	121,954,024円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	5,137,823,389円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	15,531,048,490円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	20,294,919,046円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX（確定拠出年金向け）	32,566,384,694円
マイバランスDC30	3,338,176,269円
マイバランスDC50	4,731,544,638円
マイバランスDC70	4,501,537,441円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,181,547,761円
野村DC運用戦略ファンド	1,112,038,152円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	54,981,097円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	673,507,973円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	414,176,625円

マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	303,599,857円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	3,385,064円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	2,164,431円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	23,630,199円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０３０	2,914,340円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０４０	1,971,165円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０５０	3,303,200円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	157,885,070円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	96,836,607円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	34,604,685円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	51,608,663円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年6月24日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	7,800	2,825.00	22,035,000	貸付有価証券 900株
		日本水産	240,700	690.00	166,083,000	貸付有価証券 30,800株
		マルハニチロ	34,800	3,160.00	109,968,000	貸付有価証券 4,300株
		カネコ種苗	7,300	1,317.00	9,614,100	貸付有価証券 800株
		サカタのタネ	29,300	3,250.00	95,225,000	貸付有価証券 3,600株
		ホクト	20,200	1,824.00	36,844,800	貸付有価証券 2,400株
		ホクリヨウ	3,300	595.00	1,963,500	貸付有価証券 300株
		住石ホールディングス	51,900	127.00	6,591,300	貸付有価証券 17,100株
		日鉄鉱業	5,500	4,660.00	25,630,000	貸付有価証券 600株
		三井松島ホールディングス	10,100	1,284.00	12,968,400	貸付有価証券 1,200株

国際石油開発帝石	965,700	993.10	959,036,670	貸付有価証券 118,400株
石油資源開発	34,600	2,514.00	86,984,400	貸付有価証券 4,200株
K & Oエナジーグループ	11,700	1,574.00	18,415,800	
ヒノキヤグループ	6,700	2,175.00	14,572,500	
ショーボンドホールディングス	17,200	7,710.00	132,612,000	貸付有価証券 400株
ミライト・ホールディングス	67,700	1,626.00	110,080,200	貸付有価証券 45,300株（19,400株）
タマホーム	11,600	1,092.00	12,667,200	貸付有価証券 4,300株
サンヨーホームズ	3,500	647.00	2,264,500	貸付有価証券 1,700株
日本アクア	7,600	585.00	4,446,000	貸付有価証券 5,000株（400株）
ファーストコーポレーション	7,400	755.00	5,587,000	貸付有価証券 2,600株
ベステラ	4,600	1,277.00	5,874,200	貸付有価証券 2,100株
T A T E R U	29,300	171.00	5,010,300	貸付有価証券 19,600株（10,900株）
スペースバリューホールディングス	29,400	502.00	14,758,800	貸付有価証券 3,700株
ダイセキ環境ソリューション	4,600	616.00	2,833,600	貸付有価証券 500株
第一カッター興業	3,000	1,712.00	5,136,000	貸付有価証券 400株
安藤・間	154,400	741.00	114,410,400	貸付有価証券 18,800株
東急建設	70,500	737.00	51,958,500	貸付有価証券 8,600株
コムシスホールディングス	85,400	2,695.00	230,153,000	貸付有価証券 10,400株
ミサワホーム	19,000	1,019.00	19,361,000	貸付有価証券 2,300株
ピーアールホールディングス	26,200	314.00	8,226,800	貸付有価証券 3,100株
高松コンストラクショングループ	15,000	2,187.00	32,805,000	貸付有価証券 1,800株
東建コーポレーション	7,400	6,210.00	45,954,000	貸付有価証券 1,000株

ソネック	2,500	771.00	1,927,500	貸付有価証券 300株
ヤマウラ	9,300	840.00	7,812,000	貸付有価証券 2,300株
大成建設	197,700	3,945.00	779,926,500	貸付有価証券 24,200株
大林組	595,600	1,054.00	627,762,400	貸付有価証券 72,900株
清水建設	607,500	898.00	545,535,000	貸付有価証券 74,400株
飛島建設	17,000	1,329.00	22,593,000	貸付有価証券 2,100株
長谷工コーポレーション	248,300	1,101.00	273,378,300	貸付有価証券 30,400株
松井建設	21,900	618.00	13,534,200	貸付有価証券 2,600株
銭高組	2,400	4,440.00	10,656,000	貸付有価証券 200株
鹿島建設	465,500	1,486.00	691,733,000	貸付有価証券 57,000株
不動テトラ	13,600	1,318.00	17,924,800	貸付有価証券 1,600株
大末建設	7,000	932.00	6,524,000	貸付有価証券 800株
鉄建建設	12,100	3,025.00	36,602,500	貸付有価証券 1,400株
西松建設	42,800	2,056.00	87,996,800	貸付有価証券 8,500株
三井住友建設	143,200	614.00	87,924,800	貸付有価証券 17,700株
大豊建設	13,400	2,705.00	36,247,000	貸付有価証券 1,600株
前田建設工業	141,600	856.00	121,209,600	貸付有価証券 18,200株
佐田建設	12,800	376.00	4,812,800	貸付有価証券 1,500株
ナカノフドー建設	15,200	428.00	6,505,600	貸付有価証券 1,800株
奥村組	32,700	3,240.00	105,948,000	貸付有価証券 4,500株
東鉄工業	23,800	2,939.00	69,948,200	貸付有価証券 2,900株

イチケン	3,600	1,651.00	5,943,600	貸付有価証券 400株
富士ピー・エス	8,200	444.00	3,640,800	貸付有価証券 900株
浅沼組	7,000	3,450.00	24,150,000	貸付有価証券 800株
戸田建設	230,800	595.00	137,326,000	貸付有価証券 28,300株
熊谷組	28,300	3,055.00	86,456,500	貸付有価証券 3,500株
青木あすなろ建設	9,800	814.00	7,977,200	貸付有価証券 1,300株
北野建設	4,100	2,610.00	10,701,000	貸付有価証券 600株
植木組	2,500	2,141.00	5,352,500	貸付有価証券 200株
矢作建設工業	27,000	718.00	19,386,000	貸付有価証券 3,300株
ピーエス三菱	20,900	598.00	12,498,200	貸付有価証券 2,600株
日本ハウスホールディングス	37,900	417.00	15,804,300	貸付有価証券 7,000株
大東建託	70,800	13,800.00	977,040,000	貸付有価証券 8,700株
新日本建設	23,600	919.00	21,688,400	貸付有価証券 2,800株
N I P P O	52,600	2,121.00	111,564,600	貸付有価証券 6,400株
東亜道路工業	3,700	3,195.00	11,821,500	貸付有価証券 400株
前田道路	62,200	2,242.00	139,452,400	貸付有価証券 7,600株
日本道路	5,400	5,970.00	32,238,000	貸付有価証券 600株
東亜建設工業	17,300	1,584.00	27,403,200	貸付有価証券 2,100株
日本国土開発	32,400	505.00	16,362,000	貸付有価証券 20,700株
若築建設	10,000	1,335.00	13,350,000	貸付有価証券 1,200株
東洋建設	72,700	419.00	30,461,300	貸付有価証券 8,900株

五洋建設	236,100	524.00	123,716,400	貸付有価証券 30,300株
世紀東急工業	28,900	637.00	18,409,300	貸付有価証券 3,800株
福田組	6,400	4,645.00	29,728,000	貸付有価証券 2,600株（2,600株）
住友林業	140,800	1,275.00	179,520,000	貸付有価証券 17,200株
日本基礎技術	20,400	343.00	6,997,200	貸付有価証券 2,500株
巴コーポレーション	24,700	375.00	9,262,500	貸付有価証券 3,000株
大和ハウス工業	550,000	3,207.00	1,763,850,000	貸付有価証券 67,300株
ライト工業	38,200	1,386.00	52,945,200	貸付有価証券 5,500株
積水ハウス	608,200	1,800.00	1,094,760,000	貸付有価証券 87,200株
日特建設	16,900	593.00	10,021,700	貸付有価証券 2,000株
北陸電気工事	9,600	902.00	8,659,200	貸付有価証券 1,100株
ユアテック	31,800	750.00	23,850,000	貸付有価証券 3,900株
四電工	3,000	2,649.00	7,947,000	貸付有価証券 300株
中電工	25,600	2,233.00	57,164,800	貸付有価証券 3,100株
関電工	90,400	895.00	80,908,000	貸付有価証券 11,600株
きんでん	132,100	1,638.00	216,379,800	貸付有価証券 16,100株
東京エネシス	20,500	904.00	18,532,000	貸付有価証券 2,500株
トーエネック	5,600	3,080.00	17,248,000	貸付有価証券 600株
住友電設	13,700	1,751.00	23,988,700	貸付有価証券 6,200株
日本電設工業	33,900	2,168.00	73,495,200	貸付有価証券 4,200株
協和エクシオ	77,800	2,652.00	206,325,600	貸付有価証券 9,500株

新日本空調	16,000	1,722.00	27,552,000	貸付有価証券 2,400株
九電工	39,200	3,170.00	124,264,000	貸付有価証券 4,700株
三機工業	44,800	1,245.00	55,776,000	貸付有価証券 5,600株
日揮	171,100	1,433.00	245,186,300	貸付有価証券 36,500株
中外炉工業	5,600	1,610.00	9,016,000	貸付有価証券 600株
ヤマト	17,800	559.00	9,950,200	貸付有価証券 2,100株
太平電業	13,400	2,191.00	29,359,400	貸付有価証券 1,600株
高砂熱学工業	48,300	1,756.00	84,814,800	貸付有価証券 5,900株
三晃金属工業	2,400	2,428.00	5,827,200	貸付有価証券 200株
朝日工業社	4,100	2,741.00	11,238,100	貸付有価証券 500株
明星工業	36,000	709.00	25,524,000	貸付有価証券 4,400株
大気社	27,000	3,290.00	88,830,000	貸付有価証券 3,300株
ダイダン	13,300	2,264.00	30,111,200	貸付有価証券 1,600株
日比谷総合設備	17,900	1,869.00	33,455,100	貸付有価証券 2,100株
東芝プラントシステム	43,000	2,014.00	86,602,000	貸付有価証券 5,400株
ＯＳＪＢホールディングス	87,600	268.00	23,476,800	貸付有価証券 11,400株
千代田化工建設	143,300	308.00	44,136,400	貸付有価証券 96,000株（29,700株）
新興プランテック	35,700	1,257.00	44,874,900	貸付有価証券 4,300株
日本製粉	56,400	1,735.00	97,854,000	貸付有価証券 13,200株
日清製粉グループ本社	201,000	2,480.00	498,480,000	貸付有価証券 24,600株
日東富士製粉	1,300	5,630.00	7,319,000	貸付有価証券 100株

昭和産業	16,300	3,120.00	50,856,000	貸付有価証券 2,100株
鳥越製粉	15,800	863.00	13,635,400	貸付有価証券 1,900株
中部飼料	21,700	1,311.00	28,448,700	貸付有価証券 2,600株
フィード・ワン	119,500	190.00	22,705,000	貸付有価証券 14,600株
東洋精糖	2,700	990.00	2,673,000	貸付有価証券 300株
日本甜菜製糖	10,100	1,936.00	19,553,600	貸付有価証券 1,200株
三井製糖	14,000	2,297.00	32,158,000	貸付有価証券 1,700株
塩水港精糖	19,300	213.00	4,110,900	貸付有価証券 2,400株
日新製糖	8,400	1,850.00	15,540,000	貸付有価証券 1,000株
森永製菓	44,700	5,220.00	233,334,000	貸付有価証券 5,500株
中村屋	4,600	4,205.00	19,343,000	貸付有価証券 500株
江崎グリコ	53,500	4,830.00	258,405,000	貸付有価証券 9,100株
名糖産業	8,600	1,446.00	12,435,600	貸付有価証券 1,000株
井村屋グループ	7,600	2,128.00	16,172,800	貸付有価証券 900株
不二家	9,900	1,931.00	19,116,900	貸付有価証券 6,300株
山崎製パン	145,500	1,562.00	227,271,000	貸付有価証券 34,200株
第一屋製パン	3,100	999.00	3,096,900	貸付有価証券 200株
モロゾフ	3,000	4,960.00	14,880,000	貸付有価証券 300株
亀田製菓	11,100	4,875.00	54,112,500	貸付有価証券 1,300株
寿スピリッツ	18,800	5,210.00	97,948,000	貸付有価証券 2,300株
カルビー	81,100	2,936.00	238,109,600	貸付有価証券 14,500株

森永乳業	35,600	4,235.00	150,766,000	貸付有価証券 9,000株
六甲バター	13,000	1,901.00	24,713,000	貸付有価証券 1,200株
ヤクルト本社	131,800	6,380.00	840,884,000	貸付有価証券 16,100株
明治ホールディングス	126,000	7,640.00	962,640,000	貸付有価証券 15,400株
雪印メグミルク	42,800	2,360.00	101,008,000	貸付有価証券 5,700株
プリマハム	25,000	2,085.00	52,125,000	貸付有価証券 3,000株
日本ハム	73,700	4,645.00	342,336,500	貸付有価証券 9,400株
林兼産業	5,900	653.00	3,852,700	貸付有価証券 700株
丸大食品	19,000	2,010.00	38,190,000	貸付有価証券 2,300株
S Foods	16,000	3,765.00	60,240,000	貸付有価証券 1,900株
伊藤ハム米久ホールディングス	114,500	734.00	84,043,000	貸付有価証券 14,100株
サッポロホールディングス	65,000	2,271.00	147,615,000	貸付有価証券 26,200株（500株）
アサヒグループホールディングス	372,600	4,920.00	1,833,192,000	
キリンホールディングス	804,800	2,323.00	1,869,550,400	
宝ホールディングス	133,200	1,126.00	149,983,200	貸付有価証券 16,300株
オエノンホールディングス	50,500	363.00	18,331,500	貸付有価証券 6,100株
養命酒製造	5,400	2,008.00	10,843,200	貸付有価証券 600株
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	136,200	2,735.00	372,507,000	
サントリー食品インターナショナル	119,000	4,670.00	555,730,000	
ダイドーグループホールディングス	10,000	4,580.00	45,800,000	貸付有価証券 4,000株
伊藤園	54,000	5,140.00	277,560,000	貸付有価証券 9,500株（200株）
キーコーヒー	17,500	2,110.00	36,925,000	貸付有価証券

				2,100株
ユニカフェ	4,900	984.00	4,821,600	貸付有価証券 200株
ジャパンフーズ	2,500	1,183.00	2,957,500	貸付有価証券 1,300株
日清オイリオグループ	22,900	3,045.00	69,730,500	貸付有価証券 3,000株
不二製油グループ本社	43,400	3,030.00	131,502,000	貸付有価証券 5,300株
かどや製油	1,900	3,875.00	7,362,500	貸付有価証券 200株
J - オイルミルズ	9,200	3,935.00	36,202,000	貸付有価証券 1,300株
キッコーマン	117,400	4,645.00	545,323,000	貸付有価証券 16,400株
味の素	392,900	1,848.50	726,275,650	貸付有価証券 53,700株
キューピー	99,100	2,390.00	236,849,000	貸付有価証券 12,100株
ハウス食品グループ本社	66,500	4,100.00	272,650,000	貸付有価証券 8,300株
カゴメ	71,300	2,477.00	176,610,100	貸付有価証券 11,000株
焼津水産化学工業	8,600	1,096.00	9,425,600	貸付有価証券 1,000株
アリアケジャパン	16,200	7,090.00	114,858,000	貸付有価証券 2,300株
ピエトロ	2,300	1,604.00	3,689,200	貸付有価証券 200株
エバラ食品工業	4,300	2,080.00	8,944,000	貸付有価証券 500株
ニチレイ	92,400	2,572.00	237,652,800	貸付有価証券 11,400株
東洋水産	91,500	4,430.00	405,345,000	貸付有価証券 11,200株
イトアンド	6,100	1,620.00	9,882,000	貸付有価証券 1,200株
大冷	2,000	1,824.00	3,648,000	貸付有価証券 200株
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,800	917.00	4,401,600	貸付有価証券 3,200株（100株）
日清食品ホールディング	75,600	6,940.00	524,664,000	貸付有価証券

ス				9,200株
永谷園ホールディングス	9,500	2,075.00	19,712,500	貸付有価証券 1,100株
一正蒲鉾	6,900	1,096.00	7,562,400	貸付有価証券 3,800株
フジッコ	19,300	2,070.00	39,951,000	貸付有価証券 2,300株
ロック・フィールド	19,200	1,407.00	27,014,400	貸付有価証券 2,400株
日本たばこ産業	1,027,300	2,515.50	2,584,173,150	貸付有価証券 1,200株
ケンコーマヨネーズ	10,000	2,210.00	22,100,000	貸付有価証券 1,900株
わらべや日洋ホールディングス	11,600	1,724.00	19,998,400	貸付有価証券 1,400株
なとり	9,900	1,602.00	15,859,800	貸付有価証券 1,200株
イフジ産業	3,100	667.00	2,067,700	貸付有価証券 300株
ピクルスコーポレーション	4,200	1,998.00	8,391,600	貸付有価証券 700株
北の達人コーポレーション	69,900	560.00	39,144,000	貸付有価証券 34,900株
ユーグレナ	75,900	892.00	67,702,800	貸付有価証券 33,400株（5,000株）
ミヨシ油脂	6,800	1,063.00	7,228,400	貸付有価証券 800株
理研ビタミン	8,400	3,465.00	29,106,000	貸付有価証券 1,000株
片倉工業	21,300	1,293.00	27,540,900	貸付有価証券 11,500株
グンゼ	11,700	4,705.00	55,048,500	貸付有価証券 1,400株
東洋紡	73,500	1,257.00	92,389,500	貸付有価証券 9,500株
ユニチカ	50,900	381.00	19,392,900	貸付有価証券 200株
富士紡ホールディングス	9,000	2,351.00	21,159,000	貸付有価証券 1,100株
倉敷紡績	16,600	1,951.00	32,386,600	貸付有価証券 2,000株
シキボウ	9,100	969.00	8,817,900	貸付有価証券

				1,100株
日本毛織	57,100	857.00	48,934,700	貸付有価証券 9,100株
ダイトウボウ	28,100	81.00	2,276,100	貸付有価証券 800株
トーア紡コーポレーショ ン	7,400	455.00	3,367,000	
ダイドーリミテッド	20,700	285.00	5,899,500	貸付有価証券 3,700株
帝国繊維	19,500	2,188.00	42,666,000	貸付有価証券 2,300株
帝人	141,600	1,809.00	256,154,400	貸付有価証券 17,300株
東レ	1,346,800	827.90	1,115,015,720	貸付有価証券 208,400株
サカイオーベックス	4,300	1,733.00	7,451,900	貸付有価証券 500株
住江織物	5,100	2,903.00	14,805,300	貸付有価証券 800株
日本フェルト	9,800	469.00	4,596,200	貸付有価証券 1,200株
イチカワ	2,500	1,521.00	3,802,500	貸付有価証券 200株
日東製網	2,000	1,526.00	3,052,000	貸付有価証券 200株
アツギ	14,300	898.00	12,841,400	貸付有価証券 1,700株
ダイニック	7,000	739.00	5,173,000	貸付有価証券 800株
セーレン	42,700	1,492.00	63,708,400	貸付有価証券 5,200株
ソトー	6,900	970.00	6,693,000	貸付有価証券 800株
東海染工	2,400	1,170.00	2,808,000	貸付有価証券 200株
小松マテーレ	28,500	798.00	22,743,000	貸付有価証券 3,400株
ワコールホールディング ス	50,600	2,848.00	144,108,800	貸付有価証券 6,100株
ホギメディカル	21,600	3,270.00	70,632,000	
レナウン	50,200	102.00	5,120,400	貸付有価証券 23,700株（11,000株）

クラウドシアホールディングス	4,300	518.00	2,227,400	貸付有価証券 2,800株
T S Iホールディングス	64,000	657.00	42,048,000	貸付有価証券 13,900株
マツオカコーポレーション	5,500	2,703.00	14,866,500	貸付有価証券 3,600株
ワールド	22,700	2,040.00	46,308,000	貸付有価証券 2,700株
三陽商会	10,400	1,499.00	15,589,600	貸付有価証券 1,300株
ナイガイ	6,300	472.00	2,973,600	貸付有価証券 700株
オンワードホールディングス	104,300	597.00	62,267,100	貸付有価証券 14,300株
ルックホールディングス	6,300	1,309.00	8,246,700	
ゴールドウイン	15,700	14,250.00	223,725,000	貸付有価証券 9,800株（6,400株）
デサント	42,300	1,905.00	80,581,500	貸付有価証券 9,100株
キング	9,200	608.00	5,593,600	貸付有価証券 1,100株
ヤマトインターナショナル	10,600	418.00	4,430,800	貸付有価証券 6,900株
特種東海製紙	11,000	3,735.00	41,085,000	貸付有価証券 1,300株
王子ホールディングス	781,500	618.00	482,967,000	貸付有価証券 96,100株
日本製紙	83,200	1,869.00	155,500,800	貸付有価証券 11,500株（400株）
三菱製紙	28,300	556.00	15,734,800	貸付有価証券 3,900株
北越コーポレーション	115,200	564.00	64,972,800	貸付有価証券 14,300株
中越パルプ工業	7,300	1,451.00	10,592,300	貸付有価証券 800株
巴川製紙所	5,700	848.00	4,833,600	貸付有価証券 700株
大王製紙	84,600	1,270.00	107,442,000	貸付有価証券 31,200株（8,600株）
阿波製紙	4,500	435.00	1,957,500	貸付有価証券 500株
レンゴー	179,000	882.00	157,878,000	貸付有価証券

				22,700株
トーモク	10,600	1,726.00	18,295,600	貸付有価証券 1,300株
ザ・バック	13,100	3,215.00	42,116,500	貸付有価証券 8,700株
クラレ	292,900	1,300.00	380,770,000	貸付有価証券 3,500株
旭化成	1,235,000	1,157.00	1,428,895,000	貸付有価証券 151,500株
共和レザー	10,800	781.00	8,434,800	貸付有価証券 1,300株
昭和電工	115,300	3,215.00	370,689,500	貸付有価証券 14,300株
住友化学	1,366,600	490.00	669,634,000	貸付有価証券 167,400株
住友精化	8,500	3,265.00	27,752,500	貸付有価証券 1,000株
日産化学	106,600	4,785.00	510,081,000	貸付有価証券 13,000株
ラサ工業	6,100	1,380.00	8,418,000	貸付有価証券 4,000株（2,200株）
クレハ	16,000	7,340.00	117,440,000	貸付有価証券 2,200株
多木化学	5,100	4,165.00	21,241,500	貸付有価証券 3,200株
テイカ	14,200	2,432.00	34,534,400	貸付有価証券 1,700株
石原産業	33,300	1,238.00	41,225,400	貸付有価証券 4,400株
片倉コープアグリ	5,000	1,059.00	5,295,000	貸付有価証券 600株
日東エフシー	12,100	1,195.00	14,459,500	貸付有価証券 3,600株
日本曹達	27,400	2,730.00	74,802,000	貸付有価証券 3,900株
東ソー	268,400	1,486.00	398,842,400	貸付有価証券 32,800株
トクヤマ	50,000	2,812.00	140,600,000	貸付有価証券 6,100株
セントラル硝子	37,800	2,368.00	89,510,400	貸付有価証券 4,600株
東亜合成	109,000	1,151.00	125,459,000	

大阪ソーダ	18,700	2,690.00	50,303,000	貸付有価証券 2,400株
関東電化工業	41,200	719.00	29,622,800	貸付有価証券 10,000株
デンカ	68,200	3,195.00	217,899,000	貸付有価証券 8,300株
信越化学工業	305,900	9,601.00	2,936,945,900	貸付有価証券 39,300株
日本カーバイド工業	5,900	1,319.00	7,782,100	貸付有価証券 700株
堺化学工業	11,600	2,529.00	29,336,400	貸付有価証券 1,400株
第一稀元素化学工業	18,800	840.00	15,792,000	貸付有価証券 2,300株
エア・ウォーター	142,200	1,816.00	258,235,200	貸付有価証券 17,400株
大陽日酸	143,000	2,332.00	333,476,000	貸付有価証券 33,900株（4,000株）
日本化学工業	5,900	1,997.00	11,782,300	貸付有価証券 700株
東邦アセチレン	2,600	1,314.00	3,416,400	貸付有価証券 300株
日本パーカライジング	94,900	1,198.00	113,690,200	貸付有価証券 11,600株
高压ガス工業	27,500	840.00	23,100,000	貸付有価証券 3,300株
チタン工業	2,200	2,890.00	6,358,000	貸付有価証券 900株
四国化成工業	29,200	1,114.00	32,528,800	貸付有価証券 3,500株
戸田工業	3,700	2,152.00	7,962,400	貸付有価証券 1,800株
ステラ ケミファ	10,200	2,927.00	29,855,400	貸付有価証券 2,800株
保土谷化学工業	6,000	2,715.00	16,290,000	貸付有価証券 700株
日本触媒	29,200	7,080.00	206,736,000	貸付有価証券 5,000株
大日精化工業	14,300	2,946.00	42,127,800	貸付有価証券 1,700株
カネカ	44,900	4,010.00	180,049,000	貸付有価証券 5,800株

三菱瓦斯化学	178,500	1,433.00	255,790,500	貸付有価証券 21,800株
三井化学	157,600	2,650.00	417,640,000	貸付有価証券 19,300株
J S R	174,200	1,640.00	285,688,000	貸付有価証券 21,300株
東京応化工業	29,800	3,310.00	98,638,000	
大阪有機化学工業	16,000	1,014.00	16,224,000	貸付有価証券 1,900株
三菱ケミカルホールディングス	1,160,500	752.00	872,696,000	貸付有価証券 142,100株
K H ネオケム	26,400	2,705.00	71,412,000	
ダイセル	255,700	973.00	248,796,100	貸付有価証券 33,000株
住友ベークライト	30,000	3,745.00	112,350,000	貸付有価証券 3,600株
積水化学工業	379,500	1,605.00	609,097,500	貸付有価証券 46,400株
日本ゼオン	156,600	1,169.00	183,065,400	貸付有価証券 19,100株
アイカ工業	52,100	3,660.00	190,686,000	貸付有価証券 11,700株
宇部興産	87,700	2,188.00	191,887,600	貸付有価証券 10,700株
積水樹脂	28,600	2,094.00	59,888,400	貸付有価証券 3,500株
タキロンシーアイ	37,600	657.00	24,703,200	貸付有価証券 4,600株
旭有機材	12,000	1,391.00	16,692,000	貸付有価証券 1,400株
日立化成	80,300	2,943.00	236,322,900	貸付有価証券 41,000株（3,600株）
ニチバン	9,100	2,188.00	19,910,800	貸付有価証券 1,100株
リケンテクノス	47,300	518.00	24,501,400	貸付有価証券 5,700株
大倉工業	8,900	1,640.00	14,596,000	貸付有価証券 1,000株
積水化成品工業	25,900	752.00	19,476,800	貸付有価証券 3,200株
群栄化学工業	4,500	2,483.00	11,173,500	貸付有価証券 500株

タイガースポリマー	9,100	561.00	5,105,100	貸付有価証券 1,100株
ミライアル	5,000	1,223.00	6,115,000	貸付有価証券 600株
ダイキアクシス	6,100	881.00	5,374,100	
ダイキョーニシカワ	36,600	855.00	31,293,000	貸付有価証券 4,400株
竹本容器	6,200	1,216.00	7,539,200	
森六ホールディングス	9,300	2,435.00	22,645,500	貸付有価証券 1,100株
日本化薬	110,500	1,289.00	142,434,500	貸付有価証券 13,500株
カーリットホールディングス	18,500	647.00	11,969,500	貸付有価証券 2,200株
日本精化	14,000	1,240.00	17,360,000	貸付有価証券 1,700株
扶桑化学工業	17,600	2,126.00	37,417,600	貸付有価証券 2,100株
トリケミカル研究所	3,900	4,440.00	17,316,000	貸付有価証券 2,200株
A D E K A	85,600	1,604.00	137,302,400	貸付有価証券 10,400株
日油	65,400	3,950.00	258,330,000	貸付有価証券 8,100株
新日本理化	31,400	213.00	6,688,200	貸付有価証券 5,100株
ハリマ化成グループ	14,400	1,063.00	15,307,200	貸付有価証券 1,700株
花王	430,300	8,400.00	3,614,520,000	貸付有価証券 5,600株
第一工業製薬	6,500	3,620.00	23,530,000	貸付有価証券 700株
石原ケミカル	4,400	1,593.00	7,009,200	貸付有価証券 1,200株
日華化学	5,800	843.00	4,889,400	
ニイタカ	2,700	1,449.00	3,912,300	貸付有価証券 300株
三洋化成工業	11,700	5,530.00	64,701,000	貸付有価証券 7,700株
有機合成薬品工業	13,300	223.00	2,965,900	貸付有価証券 1,600株
大日本塗料	19,600	1,059.00	20,756,400	貸付有価証券

				2,300株
日本ペイントホールディングス	143,300	4,175.00	598,277,500	貸付有価証券 24,100株
関西ペイント	195,000	2,214.00	431,730,000	貸付有価証券 100,000株
神東塗料	13,600	172.00	2,339,200	貸付有価証券 1,600株
中国塗料	57,000	899.00	51,243,000	貸付有価証券 7,600株
日本特殊塗料	13,000	1,306.00	16,978,000	貸付有価証券 1,500株
藤倉化成	23,400	569.00	13,314,600	貸付有価証券 2,800株
太陽ホールディングス	14,300	3,245.00	46,403,500	貸付有価証券 1,700株
D I C	78,600	2,860.00	224,796,000	貸付有価証券 100株
サカタインクス	37,900	986.00	37,369,400	貸付有価証券 100株
東洋インキＳＣホールディングス	36,700	2,345.00	86,061,500	貸付有価証券 100株
T & K T O K A	13,400	975.00	13,065,000	貸付有価証券 1,600株
富士フイルムホールディングス	368,200	5,365.00	1,975,393,000	貸付有価証券 45,100株
資生堂	352,200	8,473.00	2,984,190,600	
ライオン	246,900	2,007.00	495,528,300	
高砂香料工業	12,200	3,045.00	37,149,000	貸付有価証券 1,500株
マンダム	39,800	2,612.00	103,957,600	貸付有価証券 4,800株
ミルボン	21,900	5,220.00	114,318,000	
ファンケル	78,900	2,863.00	225,890,700	貸付有価証券 10,600株
コーセー	30,000	18,000.00	540,000,000	貸付有価証券 3,600株
コタ	9,300	1,157.00	10,760,100	貸付有価証券 1,100株
シーボン	2,100	2,349.00	4,932,900	貸付有価証券 200株
ポーラ・オルビスホールディングス	75,700	3,005.00	227,478,500	

ノエビアホールディングス	16,900	5,850.00	98,865,000	貸付有価証券 2,000株
アジュバンコスメジャパン	3,900	919.00	3,584,100	貸付有価証券 700株
エステー	12,700	1,704.00	21,640,800	貸付有価証券 1,500株
アグロ カネショウ	7,200	1,959.00	14,104,800	貸付有価証券 1,100株
コニシ	31,400	1,600.00	50,240,000	貸付有価証券 4,100株
長谷川香料	23,500	1,872.00	43,992,000	貸付有価証券 2,800株
星光 P M C	11,800	765.00	9,027,000	貸付有価証券 1,100株（100株）
小林製薬	49,700	7,880.00	391,636,000	
荒川化学工業	15,900	1,384.00	22,005,600	貸付有価証券 1,900株
メック	12,200	1,039.00	12,675,800	貸付有価証券 1,100株
日本高純度化学	4,900	2,372.00	11,622,800	貸付有価証券 500株
タカラバイオ	46,400	2,005.00	93,032,000	貸付有価証券 5,600株
J C U	23,000	1,993.00	45,839,000	貸付有価証券 6,400株
新田ゼラチン	11,100	683.00	7,581,300	貸付有価証券 1,400株
O A T アグリオ	2,400	1,376.00	3,302,400	貸付有価証券 200株
デクセリアルズ	45,700	706.00	32,264,200	貸付有価証券 5,800株
アース製薬	13,400	4,765.00	63,851,000	貸付有価証券 2,100株
北興化学工業	18,200	483.00	8,790,600	貸付有価証券 2,200株
大成ラミック	5,800	2,799.00	16,234,200	貸付有価証券 700株
クミアイ化学工業	73,300	713.00	52,262,900	貸付有価証券 9,500株
日本農薬	31,600	418.00	13,208,800	貸付有価証券 5,300株
アキレス	12,900	1,996.00	25,748,400	貸付有価証券

				1,500株
有沢製作所	27,900	858.00	23,938,200	貸付有価証券 3,400株
日東電工	122,300	5,277.00	645,377,100	貸付有価証券 16,400株
レック	18,900	1,151.00	21,753,900	貸付有価証券 6,700株
三光合成	20,300	317.00	6,435,100	貸付有価証券 2,400株
きもと	30,100	159.00	4,785,900	貸付有価証券 4,000株
藤森工業	15,900	2,844.00	45,219,600	貸付有価証券 1,900株
前澤化成工業	12,100	1,066.00	12,898,600	貸付有価証券 1,400株
未来工業	9,500	2,006.00	19,057,000	貸付有価証券 1,100株
ウェーブブロックホールディングス	4,900	659.00	3,229,100	貸付有価証券 1,400株
J S P	10,400	2,076.00	21,590,400	貸付有価証券 2,200株
エフピコ	19,500	6,680.00	130,260,000	貸付有価証券 2,500株
天馬	12,200	1,894.00	23,106,800	貸付有価証券 1,500株
信越ポリマー	31,800	770.00	24,486,000	貸付有価証券 3,900株
東リ	44,100	241.00	10,628,100	貸付有価証券 5,400株
ニフコ	71,000	2,685.00	190,635,000	貸付有価証券 15,800株
バルカー	14,400	2,203.00	31,723,200	貸付有価証券 1,700株
ユニ・チャーム	375,800	3,228.00	1,213,082,400	
ショーエイコーポレーション	1,400	757.00	1,059,800	貸付有価証券 100株
協和発酵キリン	208,000	1,981.00	412,048,000	貸付有価証券 1,100株
武田薬品工業	1,547,500	3,741.00	5,789,197,500	貸付有価証券 207,800株
アステラス製薬	1,634,300	1,462.50	2,390,163,750	貸付有価証券 200,200株

大日本住友製薬	131,400	2,048.00	269,107,200	貸付有価証券 18,400株
塩野義製薬	226,600	6,219.00	1,409,225,400	貸付有価証券 27,700株
田辺三菱製薬	185,400	1,213.00	224,890,200	貸付有価証券 22,700株
わかもと製薬	21,100	269.00	5,675,900	貸付有価証券 2,500株
あすか製薬	21,900	1,209.00	26,477,100	貸付有価証券 2,600株
日本新薬	46,400	7,810.00	362,384,000	貸付有価証券 5,600株
ピオフェルミン製薬	3,000	2,236.00	6,708,000	貸付有価証券 300株
中外製薬	184,800	7,030.00	1,299,144,000	
科研製薬	32,000	5,140.00	164,480,000	貸付有価証券 3,900株
エーザイ	212,200	6,240.00	1,324,128,000	貸付有価証券 26,500株
ロート製薬	90,900	3,000.00	272,700,000	貸付有価証券 11,100株
小野薬品工業	418,600	1,895.00	793,247,000	貸付有価証券 51,200株
久光製薬	52,400	4,270.00	223,748,000	貸付有価証券 6,400株
持田製薬	26,800	4,745.00	127,166,000	貸付有価証券 3,200株
参天製薬	330,000	1,710.00	564,300,000	貸付有価証券 42,700株
扶桑薬品工業	6,200	1,907.00	11,823,400	貸付有価証券 700株
日本ケミファ	2,300	2,971.00	6,833,300	貸付有価証券 200株
ツムラ	54,900	2,977.00	163,437,300	貸付有価証券 9,200株
日医工	46,600	1,199.00	55,873,400	貸付有価証券 7,000株
キッセイ薬品工業	31,400	2,647.00	83,115,800	貸付有価証券 3,800株
生化学工業	34,400	1,238.00	42,587,200	貸付有価証券 4,200株
栄研化学	31,200	1,746.00	54,475,200	貸付有価証券

				3,800株
日水製薬	7,400	1,204.00	8,909,600	貸付有価証券 900株
鳥居薬品	9,500	2,675.00	25,412,500	
J C R ファーマ	12,500	6,350.00	79,375,000	貸付有価証券 1,500株
東和薬品	25,500	2,788.00	71,094,000	貸付有価証券 12,500株
富士製薬工業	12,000	1,413.00	16,956,000	貸付有価証券 1,400株
沢井製薬	36,400	5,790.00	210,756,000	貸付有価証券 4,400株
ゼリア新薬工業	35,100	2,232.00	78,343,200	貸付有価証券 4,200株
第一三共	507,200	5,977.00	3,031,534,400	貸付有価証券 62,200株
キョーリン製薬ホールディングス	39,100	1,879.00	73,468,900	貸付有価証券 4,700株
大幸薬品	7,900	2,085.00	16,471,500	貸付有価証券 900株
ダイト	10,300	3,355.00	34,556,500	貸付有価証券 1,200株
大塚ホールディングス	337,700	3,608.00	1,218,421,600	
大正製薬ホールディングス	39,700	8,440.00	335,068,000	貸付有価証券 4,800株
ペプチドリーム	88,800	5,490.00	487,512,000	貸付有価証券 51,600株
日本コークス工業	149,800	92.00	13,781,600	貸付有価証券 22,400株
ニチレキ	22,700	1,015.00	23,040,500	貸付有価証券 2,700株
ユシロ化学工業	9,200	1,330.00	12,236,000	貸付有価証券 1,100株
ピーピー・カストロール	6,300	1,430.00	9,009,000	貸付有価証券 1,300株
富士石油	43,000	266.00	11,438,000	貸付有価証券 7,700株
M O R E S C O	6,400	1,464.00	9,369,600	貸付有価証券 900株
出光興産	204,600	3,265.00	668,019,000	貸付有価証券 25,000株
J X T G ホールディング	2,981,400	532.30	1,586,999,220	貸付有価証券

ス				365,300株
コスモエネルギーホールディングス	51,300	2,455.00	125,941,500	貸付有価証券 34,300株
横浜ゴム	102,600	1,987.00	203,866,200	
TOYO TIRE	91,000	1,493.00	135,863,000	
ブリヂストン	544,800	4,263.00	2,322,482,400	
住友ゴム工業	159,200	1,252.00	199,318,400	
藤倉コンポジット	15,500	428.00	6,634,000	貸付有価証券 1,800株
オカモト	12,300	4,795.00	58,978,500	貸付有価証券 1,500株
フコク	7,800	735.00	5,733,000	貸付有価証券 1,400株
ニッタ	20,000	2,925.00	58,500,000	貸付有価証券 2,400株
住友理工	34,400	838.00	28,827,200	貸付有価証券 4,200株
三ツ星ベルト	23,300	1,930.00	44,969,000	貸付有価証券 2,800株
パンドー化学	33,800	986.00	33,326,800	貸付有価証券 4,100株
日東紡績	26,400	2,301.00	60,746,400	貸付有価証券 3,200株
A G C	175,200	3,730.00	653,496,000	
日本板硝子	84,800	718.00	60,886,400	貸付有価証券 16,900株
石塚硝子	3,000	2,150.00	6,450,000	貸付有価証券 300株
日本山村硝子	7,400	1,407.00	10,411,800	貸付有価証券 800株
日本電気硝子	76,700	2,757.00	211,461,900	貸付有価証券 200株
オハラ	7,000	1,411.00	9,877,000	貸付有価証券 4,600株（800株）
住友大阪セメント	35,800	4,260.00	152,508,000	貸付有価証券 4,300株
太平洋セメント	111,900	3,235.00	361,996,500	貸付有価証券 13,700株
日本ヒューム	17,800	709.00	12,620,200	貸付有価証券 2,100株
日本コンクリート工業	38,200	283.00	10,810,600	貸付有価証券

			4,800株（200株）
三谷セキサン	8,300	2,819.00	23,397,700 貸付有価証券 1,000株
アジアパイルホールディングス	25,100	598.00	15,009,800 貸付有価証券 3,000株
東海カーボン	160,900	1,134.00	182,460,600 貸付有価証券 107,800株（500株）
日本カーボン	8,500	4,210.00	35,785,000 貸付有価証券 5,600株
東洋炭素	10,400	2,141.00	22,266,400 貸付有価証券 100株
ノリタケカンパニーリミテド	10,600	4,540.00	48,124,000 貸付有価証券 1,200株
ＴＯＴＯ	136,400	4,170.00	568,788,000 貸付有価証券 32,300株
日本碍子	216,300	1,522.00	329,208,600 貸付有価証券 26,700株
日本特殊陶業	149,500	1,968.00	294,216,000 貸付有価証券 18,300株
ダントーホールディングス	14,900	109.00	1,624,100 貸付有価証券 2,300株
ＭＡＲＵＷＡ	6,100	5,310.00	32,391,000 貸付有価証券 700株
品川リフラクトリーズ	4,700	2,948.00	13,855,600 貸付有価証券 500株
黒崎播磨	3,500	5,980.00	20,930,000 貸付有価証券 400株
ヨータイ	15,500	545.00	8,447,500 貸付有価証券 1,800株
イソライト工業	9,100	451.00	4,104,100 貸付有価証券 2,300株
東京窯業	22,500	295.00	6,637,500 貸付有価証券 3,600株
ニッカトー	8,000	655.00	5,240,000 貸付有価証券 3,000株
フジミインコーポレーテッド	15,800	2,148.00	33,938,400 貸付有価証券 1,900株
クニミネ工業	8,000	811.00	6,488,000 貸付有価証券 900株
エーアンドエーマテリアル	3,400	1,025.00	3,485,000 貸付有価証券 500株
ニチアス	48,500	1,920.00	93,120,000 貸付有価証券

				6,300株
ニチハ	24,600	3,030.00	74,538,000	貸付有価証券 3,000株
日本製鉄	814,500	1,844.50	1,502,345,250	貸付有価証券 147,500株
神戸製鋼所	320,800	697.00	223,597,600	貸付有価証券 39,600株
中山製鋼所	24,300	471.00	11,445,300	貸付有価証券 2,900株
合同製鐵	8,500	1,956.00	16,626,000	貸付有価証券 2,300株
ジェイ エフ イー ホールディングス	473,400	1,560.00	738,504,000	貸付有価証券 58,100株
東京製鐵	93,900	807.00	75,777,300	貸付有価証券 17,400株
共英製鋼	19,800	1,854.00	36,709,200	貸付有価証券 2,400株
大和工業	37,200	3,130.00	116,436,000	貸付有価証券 4,500株
東京鐵鋼	7,200	1,202.00	8,654,400	貸付有価証券 800株
大阪製鐵	11,600	1,687.00	19,569,200	貸付有価証券 1,400株
淀川製鋼所	23,700	2,102.00	49,817,400	貸付有価証券 2,800株
丸一鋼管	62,100	2,895.00	179,779,500	貸付有価証券 7,600株
モリ工業	5,200	1,922.00	9,994,400	貸付有価証券 600株
大同特殊鋼	28,700	4,035.00	115,804,500	貸付有価証券 5,000株
日本高周波鋼業	6,500	449.00	2,918,500	貸付有価証券 700株
日本冶金工業	145,000	218.00	31,610,000	貸付有価証券 97,100株（600株）
山陽特殊製鋼	22,100	1,479.00	32,685,900	貸付有価証券 2,700株
愛知製鋼	9,800	3,120.00	30,576,000	貸付有価証券 1,200株
日立金属	188,800	1,241.00	234,300,800	貸付有価証券 39,400株
日本金属	4,100	890.00	3,649,000	貸付有価証券

				600株
大平洋金属	11,900	2,180.00	25,942,000	貸付有価証券 5,700株
新日本電工	105,000	205.00	21,525,000	貸付有価証券 40,500株
栗本鐵工所	8,800	1,421.00	12,504,800	貸付有価証券 1,000株
虹技	2,600	1,277.00	3,320,200	貸付有価証券 300株
日本鑄鉄管	1,800	630.00	1,134,000	貸付有価証券 200株
三菱製鋼	13,000	1,243.00	16,159,000	貸付有価証券 1,500株
日亜鋼業	25,600	338.00	8,652,800	貸付有価証券 4,100株
日本精線	2,500	2,573.00	6,432,500	貸付有価証券 300株
エンビプロ・ホールディ ングス	6,600	619.00	4,085,400	貸付有価証券 4,400株（600株）
シンニッタン	27,200	319.00	8,676,800	貸付有価証券 3,300株
新家工業	4,000	1,478.00	5,912,000	貸付有価証券 400株
大紀アルミニウム工業所	28,800	736.00	21,196,800	貸付有価証券 12,800株
日本軽金属ホールディ ングス	477,600	236.00	112,713,600	貸付有価証券 58,700株
三井金属鉱業	47,300	2,554.00	120,804,200	貸付有価証券 5,700株
東邦亜鉛	9,700	2,508.00	24,327,600	貸付有価証券 1,100株
三菱マテリアル	115,800	3,045.00	352,611,000	貸付有価証券 14,400株
住友金属鉱山	240,100	3,120.00	749,112,000	貸付有価証券 29,400株
DOWAホールディング ス	40,900	3,525.00	144,172,500	貸付有価証券 5,200株
古河機械金属	28,900	1,393.00	40,257,700	貸付有価証券 3,500株
大阪チタニウムテクノ ロジーズ	20,300	1,768.00	35,890,400	貸付有価証券 8,800株（500株）
東邦チタニウム	31,400	1,102.00	34,602,800	貸付有価証券

				3,800株
U A C J	26,600	1,836.00	48,837,600	貸付有価証券 12,900株
C K サンエツ	3,300	2,838.00	9,365,400	貸付有価証券 300株
古河電気工業	50,600	3,050.00	154,330,000	貸付有価証券 6,100株
住友電気工業	655,400	1,384.50	907,401,300	貸付有価証券 80,300株
フジクラ	211,700	388.00	82,139,600	貸付有価証券 30,000株
昭和電線ホールディングス	20,400	825.00	16,830,000	貸付有価証券 2,400株
東京特殊電線	2,200	1,678.00	3,691,600	貸付有価証券 200株
タツタ電線	34,700	478.00	16,586,600	貸付有価証券 4,300株
カナレ電気	2,900	1,929.00	5,594,100	貸付有価証券 1,600株
平河ヒューテック	7,300	1,203.00	8,781,900	貸付有価証券 800株
リョービ	21,600	2,038.00	44,020,800	
アーレスティ	21,500	547.00	11,760,500	貸付有価証券 2,600株
アサヒホールディングス	32,900	2,184.00	71,853,600	貸付有価証券 4,400株
稲葉製作所	9,900	1,422.00	14,077,800	貸付有価証券 6,600株
宮地エンジニアリンググループ	5,300	1,750.00	9,275,000	貸付有価証券 600株
トーカロ	45,200	771.00	34,849,200	貸付有価証券 5,600株
アルファ C o	6,200	1,227.00	7,607,400	貸付有価証券 700株
S U M C O	193,700	1,240.00	240,188,000	貸付有価証券 64,600株
川田テクノロジーズ	3,900	8,150.00	31,785,000	貸付有価証券 400株
R S T e c h n o l o g i e s	3,500	2,820.00	9,870,000	貸付有価証券 2,100株（500株）
信和	9,200	953.00	8,767,600	貸付有価証券 1,100株

東洋製罐グループホールディングス	111,600	2,217.00	247,417,200	貸付有価証券 13,600株
ホッカホールディングス	8,900	1,750.00	15,575,000	貸付有価証券 1,000株
コロナ	9,700	978.00	9,486,600	貸付有価証券 1,100株
横河ブリッジホールディングス	32,600	1,673.00	54,539,800	貸付有価証券 3,900株
駒井ハルテック	3,300	1,692.00	5,583,600	貸付有価証券 300株
高田機工	1,600	2,510.00	4,016,000	貸付有価証券 100株
三和ホールディングス	181,100	1,142.00	206,816,200	貸付有価証券 22,100株
文化シャッター	51,700	808.00	41,773,600	貸付有価証券 7,600株
三協立山	24,300	1,203.00	29,232,900	貸付有価証券 2,900株
アルインコ	13,900	964.00	13,399,600	貸付有価証券 1,700株
東洋シャッター	4,200	650.00	2,730,000	貸付有価証券 500株
L I X I L グループ	258,600	1,475.00	381,435,000	貸付有価証券 31,500株
日本ファイルコン	13,400	505.00	6,767,000	貸付有価証券 1,600株
ノーリツ	39,100	1,299.00	50,790,900	貸付有価証券 500株
長府製作所	17,800	2,181.00	38,821,800	
リンナイ	31,200	6,770.00	211,224,000	貸付有価証券 3,800株
ダイニチ工業	9,400	615.00	5,781,000	貸付有価証券 1,100株
日東精工	24,200	564.00	13,648,800	貸付有価証券 200株
三洋工業	2,300	1,783.00	4,100,900	貸付有価証券 200株
岡部	35,500	965.00	34,257,500	貸付有価証券 19,400株
ジーテクト	19,300	1,498.00	28,911,400	貸付有価証券 2,400株
中国工業	2,600	538.00	1,398,800	貸付有価証券

				300株
東プレ	32,700	1,723.00	56,342,100	貸付有価証券 4,000株
高周波熱錬	33,700	862.00	29,049,400	貸付有価証券 4,400株
東京製鋼	10,700	1,010.00	10,807,000	貸付有価証券 1,300株
サンコール	9,800	519.00	5,086,200	貸付有価証券 1,400株
モリテック スチール	13,700	375.00	5,137,500	貸付有価証券 5,800株
パイオラックス	28,100	1,872.00	52,603,200	貸付有価証券 3,400株
エイチワン	17,200	770.00	13,244,000	貸付有価証券 2,900株
日本発條	174,600	817.00	142,648,200	貸付有価証券 28,000株
中央発條	2,100	2,903.00	6,096,300	貸付有価証券 200株
アドバネクス	2,300	1,673.00	3,847,900	貸付有価証券 900株
立川ブラインド工業	7,700	1,275.00	9,817,500	貸付有価証券 4,200株
三益半導体工業	15,600	1,586.00	24,741,600	貸付有価証券 1,900株
日本ドライケミカル	4,700	1,106.00	5,198,200	貸付有価証券 500株
日本製鋼所	53,200	1,785.00	94,962,000	貸付有価証券 6,500株
三浦工業	75,800	3,355.00	254,309,000	貸付有価証券 9,200株
タクマ	63,900	1,315.00	84,028,500	貸付有価証券 7,800株
ツガミ	39,300	898.00	35,291,400	貸付有価証券 26,300株
オークマ	22,300	5,430.00	121,089,000	貸付有価証券 2,700株
東芝機械	19,800	2,430.00	48,114,000	貸付有価証券 2,400株
アマダホールディングス	263,400	1,216.00	320,294,400	貸付有価証券 33,100株
アイダエンジニアリング	47,300	805.00	38,076,500	貸付有価証券

				5,900株
滝澤鉄工所	5,400	1,403.00	7,576,200	貸付有価証券 600株
F U J I	70,000	1,280.00	89,600,000	貸付有価証券 10,900株
牧野フライス製作所	20,500	4,225.00	86,612,500	貸付有価証券 2,500株
オーエスジー	86,300	2,082.00	179,676,600	貸付有価証券 10,900株
ダイジェット工業	2,000	1,235.00	2,470,000	貸付有価証券 200株
旭ダイヤモンド工業	46,000	646.00	29,716,000	貸付有価証券 5,800株
D M G 森精機	110,900	1,592.00	176,552,800	貸付有価証券 1,500株
ソディック	38,200	928.00	35,449,600	貸付有価証券 3,700株
ディスコ	23,700	16,060.00	380,622,000	貸付有価証券 8,400株
日東工器	9,600	2,237.00	21,475,200	貸付有価証券 1,100株
日進工具	5,200	2,097.00	10,904,400	貸付有価証券 600株
パンチ工業	12,200	518.00	6,319,600	貸付有価証券 1,400株
富士ダイス	7,700	565.00	4,350,500	貸付有価証券 900株
豊和工業	9,700	848.00	8,225,600	貸付有価証券 2,700株
O K K	7,200	755.00	5,436,000	貸付有価証券 900株
東洋機械金属	12,500	593.00	7,412,500	貸付有価証券 1,500株
津田駒工業	3,700	1,534.00	5,675,800	貸付有価証券 400株
エンシュウ	4,500	1,110.00	4,995,000	貸付有価証券 2,100株
島精機製作所	24,200	3,110.00	75,262,000	貸付有価証券 16,000株
オプトラン	17,100	2,162.00	36,970,200	貸付有価証券 4,400株
N C ホールディングス	5,600	485.00	2,716,000	貸付有価証券

				600株
イワキポンプ	7,400	1,035.00	7,659,000	貸付有価証券 1,000株
フリー	14,000	1,181.00	16,534,000	貸付有価証券 1,800株
ヤマシンフィルタ	30,500	618.00	18,849,000	貸付有価証券 19,300株（5,200株）
日阪製作所	21,600	878.00	18,964,800	貸付有価証券 2,600株
やまびこ	34,000	922.00	31,348,000	貸付有価証券 1,000株
平田機工	8,300	5,620.00	46,646,000	貸付有価証券 3,300株
ペガサスミシン製造	16,400	559.00	9,167,600	貸付有価証券 2,000株
マルマエ	7,200	667.00	4,802,400	貸付有価証券 3,000株（2,100株）
タツモ	7,300	767.00	5,599,100	貸付有価証券 800株
ナブテスコ	96,400	2,920.00	281,488,000	
三井海洋開発	18,600	2,997.00	55,744,200	
レオン自動機	17,200	1,762.00	30,306,400	貸付有価証券 2,300株
S M C	51,900	39,170.00	2,032,923,000	貸付有価証券 6,300株
新川	13,200	375.00	4,950,000	貸付有価証券 7,200株（500株）
ホソカワミクロン	6,200	4,495.00	27,869,000	貸付有価証券 1,400株
ユニオンツール	7,600	2,708.00	20,580,800	貸付有価証券 4,100株
オイレス工業	24,500	1,576.00	38,612,000	貸付有価証券 3,000株
日精エー・エス・ピー機 械	5,900	2,524.00	14,891,600	貸付有価証券 3,300株
サトーホールディングス	21,100	2,750.00	58,025,000	貸付有価証券 2,500株
技研製作所	15,300	3,290.00	50,337,000	貸付有価証券 1,900株
日本エアーテック	5,500	570.00	3,135,000	貸付有価証券 700株
カワタ	4,800	986.00	4,732,800	貸付有価証券

				1,800株
日精樹脂工業	14,700	942.00	13,847,400	貸付有価証券 1,700株
オカダアイヨン	6,000	1,217.00	7,302,000	貸付有価証券 900株
ワイエイシイホールディングス	7,000	890.00	6,230,000	貸付有価証券 3,200株
小松製作所	802,600	2,520.00	2,022,552,000	貸付有価証券 98,600株
住友重機械工業	101,500	3,610.00	366,415,000	貸付有価証券 12,400株
日立建機	71,000	2,821.00	200,291,000	貸付有価証券 9,100株
日工	4,800	2,785.00	13,368,000	貸付有価証券 500株
巴工業	7,500	2,361.00	17,707,500	貸付有価証券 900株
井関農機	17,700	1,524.00	26,974,800	
TOWA	15,100	789.00	11,913,900	貸付有価証券 10,100株
丸山製作所	3,900	1,106.00	4,313,400	貸付有価証券 400株
北川鉄工所	8,000	2,121.00	16,968,000	貸付有価証券 900株
ローツェ	7,800	2,155.00	16,809,000	貸付有価証券 5,100株（200株）
タカキタ	6,200	546.00	3,385,200	貸付有価証券 700株
クボタ	949,600	1,767.00	1,677,943,200	
荏原実業	5,200	2,015.00	10,478,000	
三菱化工機	6,100	1,653.00	10,083,300	貸付有価証券 700株
月島機械	35,200	1,320.00	46,464,000	貸付有価証券 4,500株
帝国電機製作所	12,400	1,271.00	15,760,400	貸付有価証券 1,500株
東京機械製作所	7,000	419.00	2,933,000	貸付有価証券 1,800株
新東工業	42,100	949.00	39,952,900	貸付有価証券 5,100株
澁谷工業	15,500	2,932.00	45,446,000	
アイチ コーポレーション	30,600	666.00	20,379,600	貸付有価証券

ン				3,900株
小森コーポレーション	44,900	1,188.00	53,341,200	貸付有価証券 6,000株
鶴見製作所	13,800	2,000.00	27,600,000	貸付有価証券 1,600株
住友精密工業	2,900	2,770.00	8,033,000	貸付有価証券 300株
酒井重工業	3,300	2,514.00	8,296,200	貸付有価証券 2,200株
荏原製作所	78,600	2,939.00	231,005,400	
石井鐵工所	2,700	1,998.00	5,394,600	貸付有価証券 300株
西島製作所	18,100	1,037.00	18,769,700	貸付有価証券 2,200株
北越工業	18,300	1,197.00	21,905,100	貸付有価証券 2,200株
ダイキン工業	242,000	13,850.00	3,351,700,000	貸付有価証券 31,800株
オルガノ	6,400	3,530.00	22,592,000	貸付有価証券 700株
トーヨーカネツ	6,700	2,082.00	13,949,400	貸付有価証券 1,900株
栗田工業	95,900	2,647.00	253,847,300	貸付有価証券 11,700株
椿本チエイン	23,200	3,420.00	79,344,000	貸付有価証券 2,800株
大同工業	8,400	839.00	7,047,600	貸付有価証券 1,100株
木村化工機	14,700	326.00	4,792,200	貸付有価証券 1,800株
アネスト岩田	27,600	969.00	26,744,400	貸付有価証券 3,300株
ダイフク	97,500	5,900.00	575,250,000	貸付有価証券 27,900株
サムコ	4,900	812.00	3,978,800	貸付有価証券 500株
加藤製作所	9,000	1,954.00	17,586,000	貸付有価証券 1,100株
油研工業	3,000	1,663.00	4,989,000	貸付有価証券 300株
タダノ	85,500	1,112.00	95,076,000	貸付有価証券 12,300株

フジテック	64,400	1,419.00	91,383,600	貸付有価証券 7,800株
C K D	49,300	1,049.00	51,715,700	貸付有価証券 6,000株
キトー	13,400	1,701.00	22,793,400	貸付有価証券 1,600株
平和	49,400	2,229.00	110,112,600	貸付有価証券 6,000株
理想科学工業	15,700	1,670.00	26,219,000	貸付有価証券 1,900株
S A N K Y O	44,400	3,955.00	175,602,000	貸付有価証券 5,400株
日本金銭機械	19,600	1,109.00	21,736,400	貸付有価証券 3,800株（900株）
マースグループホールディングス	11,300	2,034.00	22,984,200	貸付有価証券 1,300株
福島工業	10,900	3,535.00	38,531,500	貸付有価証券 1,300株
オーイズミ	7,400	375.00	2,775,000	貸付有価証券 900株
ダイコク電機	8,100	1,302.00	10,546,200	貸付有価証券 5,300株
竹内製作所	29,700	1,877.00	55,746,900	貸付有価証券 4,000株
アマノ	50,600	3,000.00	151,800,000	貸付有価証券 6,100株
J U K I	24,700	959.00	23,687,300	貸付有価証券 1,300株
サンデンホールディングス	21,600	516.00	11,145,600	貸付有価証券 5,200株（300株）
蛇の目マシン工業	16,100	441.00	7,100,100	貸付有価証券 1,900株
マックス	27,000	1,530.00	41,310,000	貸付有価証券 3,300株
グローリー	49,100	2,807.00	137,823,700	貸付有価証券 6,000株
新晃工業	16,500	1,584.00	26,136,000	貸付有価証券 2,000株
大和冷機工業	25,600	1,133.00	29,004,800	
セガサミーホールディングス	175,800	1,316.00	231,352,800	貸付有価証券 22,800株
日本ピストンリング	6,500	1,413.00	9,184,500	貸付有価証券

				700株
リケン	8,200	4,240.00	34,768,000	貸付有価証券 1,000株
T P R	23,800	1,825.00	43,435,000	貸付有価証券 2,900株
ツバキ・ナカシマ	27,000	1,745.00	47,115,000	貸付有価証券 100株
ホシザキ	51,800	8,100.00	419,580,000	貸付有価証券 6,500株
大豊工業	14,400	831.00	11,966,400	貸付有価証券 1,700株
日本精工	364,100	935.00	340,433,500	貸付有価証券 44,600株
N T N	380,900	310.00	118,079,000	貸付有価証券 134,300株（500株）
ジェイテクト	170,000	1,251.00	212,670,000	貸付有価証券 21,900株
不二越	16,500	4,345.00	71,692,500	貸付有価証券 7,200株
日本トムソン	52,600	467.00	24,564,200	貸付有価証券 6,800株
T H K	110,500	2,530.00	279,565,000	貸付有価証券 15,700株
ユーシン精機	13,700	953.00	13,056,100	貸付有価証券 1,600株
前澤給装工業	6,900	1,947.00	13,434,300	貸付有価証券 900株
イーグル工業	21,900	1,028.00	22,513,200	貸付有価証券 2,600株
前澤工業	11,800	354.00	4,177,200	貸付有価証券 1,400株
日本ピラー工業	17,900	1,055.00	18,884,500	貸付有価証券 2,100株
キッツ	71,800	724.00	51,983,200	貸付有価証券 8,800株
マキタ	215,700	3,385.00	730,144,500	貸付有価証券 26,900株
日立造船	140,500	368.00	51,704,000	貸付有価証券 19,500株
三菱重工業	297,100	4,750.00	1,411,225,000	貸付有価証券 36,300株
I H I	136,200	2,586.00	352,213,200	貸付有価証券

				16,600株
スター精密	30,200	1,381.00	41,706,200	貸付有価証券 400株
日清紡ホールディングス	98,400	827.00	81,376,800	
イビデン	108,500	1,809.00	196,276,500	貸付有価証券 14,300株
コニカミノルタ	387,300	1,056.00	408,988,800	貸付有価証券 47,400株
ブラザー工業	230,900	1,960.00	452,564,000	貸付有価証券 28,300株
ミネベアミツミ	329,000	1,730.00	569,170,000	貸付有価証券 40,300株
日立製作所	797,900	3,949.00	3,150,907,100	貸付有価証券 97,700株
三菱電機	1,772,500	1,392.00	2,467,320,000	貸付有価証券 217,100株
富士電機	115,000	3,655.00	420,325,000	貸付有価証券 14,100株
東洋電機製造	7,000	1,348.00	9,436,000	貸付有価証券 800株
安川電機	205,500	3,405.00	699,727,500	貸付有価証券 114,900株
シンフォニアテクノロジー	24,600	1,201.00	29,544,600	貸付有価証券 3,000株
明電舎	35,100	1,634.00	57,353,400	貸付有価証券 4,400株
オリジン	4,800	1,419.00	6,811,200	貸付有価証券 500株
山洋電気	8,600	4,230.00	36,378,000	貸付有価証券 1,000株
デンヨー	16,400	1,451.00	23,796,400	貸付有価証券 2,000株
東芝テック	22,200	3,025.00	67,155,000	貸付有価証券 2,700株
芝浦メカトロニクス	3,100	2,634.00	8,165,400	貸付有価証券 300株
マブチモーター	49,100	3,710.00	182,161,000	貸付有価証券 4,100株
日本電産	213,300	14,230.00	3,035,259,000	貸付有価証券 26,100株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,600	1,330.00	12,768,000	貸付有価証券 4,000株

トレックス・セミコンダクター	7,900	1,160.00	9,164,000	貸付有価証券 3,700株
東光高岳	9,000	1,189.00	10,701,000	貸付有価証券 1,100株
ダブル・スコープ	25,800	1,500.00	38,700,000	貸付有価証券 17,200株（100株）
ダイヘン	19,400	3,070.00	59,558,000	貸付有価証券 2,300株
ヤーマン	25,700	879.00	22,590,300	貸付有価証券 17,200株（1,000株）
JVCケンウッド	135,400	239.00	32,360,600	貸付有価証券 16,500株
ミマキエンジニアリング	15,900	648.00	10,303,200	貸付有価証券 3,600株
第一精工	7,400	1,194.00	8,835,600	貸付有価証券 3,200株（800株）
日新電機	41,500	1,158.00	48,057,000	貸付有価証券 5,000株
大崎電気工業	35,200	719.00	25,308,800	貸付有価証券 4,300株
オムロン	188,400	5,480.00	1,032,432,000	貸付有価証券 24,900株
日東工業	28,400	1,959.00	55,635,600	貸付有価証券 3,500株
I D E C	23,800	1,988.00	47,314,400	貸付有価証券 3,600株
正興電機製作所	3,100	787.00	2,439,700	
不二電機工業	1,900	1,238.00	2,352,200	貸付有価証券 1,200株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	63,700	2,051.00	130,648,700	貸付有価証券 8,700株
サクサホールディングス	4,500	1,876.00	8,442,000	貸付有価証券 500株
メルコホールディングス	7,300	3,045.00	22,228,500	貸付有価証券 800株
テクノメディカ	4,000	2,130.00	8,520,000	貸付有価証券 400株
日本電気	229,400	4,030.00	924,482,000	貸付有価証券 28,000株
富士通	170,900	7,554.00	1,290,978,600	貸付有価証券 21,700株
沖電気工業	76,800	1,321.00	101,452,800	貸付有価証券

			9,600株
岩崎通信機	8,300	795.00	6,598,500 貸付有価証券 1,000株
電気興業	9,300	3,235.00	30,085,500 貸付有価証券 1,200株
サンケン電気	20,700	2,193.00	45,395,100 貸付有価証券 5,300株
ナカヨ	3,400	1,590.00	5,406,000 貸付有価証券 400株
アイホン	10,000	1,679.00	16,790,000 貸付有価証券 1,200株
ルネサスエレクトロニクス	186,100	521.00	96,958,100 貸付有価証券 29,200株
セイコーエプソン	219,900	1,708.00	375,589,200 貸付有価証券 32,600株
ワコム	128,300	347.00	44,520,100 貸付有価証券 17,500株
アルバック	35,300	3,360.00	118,608,000 貸付有価証券 300株
アクセル	7,400	574.00	4,247,600 貸付有価証券 4,800株
E I Z O	16,300	3,850.00	62,755,000 貸付有価証券 1,900株
ジャパンディスプレイ	419,100	66.00	27,660,600 貸付有価証券 280,700株（13,600株）
日本信号	45,100	1,180.00	53,218,000 貸付有価証券 5,600株
京三製作所	38,000	358.00	13,604,000 貸付有価証券 4,700株
能美防災	23,400	2,327.00	54,451,800 貸付有価証券 2,800株
ホーチキ	11,200	1,300.00	14,560,000 貸付有価証券 1,300株
星和電機	9,500	504.00	4,788,000 貸付有価証券 1,100株
エレコム	16,800	3,525.00	59,220,000 貸付有価証券 2,000株
パナソニック	2,025,000	883.30	1,788,682,500 貸付有価証券 249,200株
シャープ	175,800	1,148.00	201,818,400 貸付有価証券 89,600株（1,000株）

アンリツ	114,100	1,884.00	214,964,400	貸付有価証券 76,400株
富士通ゼネラル	54,100	1,649.00	89,210,900	貸付有価証券 7,600株（500株）
ソニー	1,189,300	5,752.00	6,840,853,600	貸付有価証券 157,000株
T D K	92,700	7,780.00	721,206,000	貸付有価証券 11,300株
帝国通信工業	7,800	1,146.00	8,938,800	貸付有価証券 900株
タムラ製作所	68,300	561.00	38,316,300	貸付有価証券 8,300株
アルプスアルパイン	184,500	1,800.00	332,100,000	貸付有価証券 22,800株
池上通信機	5,600	1,084.00	6,070,400	貸付有価証券 2,000株
日本電波工業	16,000	451.00	7,216,000	貸付有価証券 4,900株（800株）
鈴木	9,500	611.00	5,804,500	貸付有価証券 5,200株
日本トリム	3,300	5,260.00	17,358,000	貸付有価証券 400株
ローランド ディー . ジー .	9,100	2,412.00	21,949,200	
フォスター電機	20,000	1,513.00	30,260,000	貸付有価証券 2,400株
S M K	5,000	2,655.00	13,275,000	貸付有価証券 2,700株
ヨコオ	12,600	2,119.00	26,699,400	貸付有価証券 4,900株
ティアック	12,700	181.00	2,298,700	貸付有価証券 6,300株（300株）
ホシデン	52,200	1,140.00	59,508,000	貸付有価証券 7,400株
ヒロセ電機	25,400	11,850.00	300,990,000	貸付有価証券 3,100株
日本航空電子工業	40,600	1,523.00	61,833,800	貸付有価証券 10,500株
T O A	19,000	1,312.00	24,928,000	貸付有価証券 2,300株
マクセルホールディング ス	38,200	1,784.00	68,148,800	貸付有価証券 20,900株（19,100株）

古野電気	22,800	981.00	22,366,800	貸付有価証券 3,900株
ユニデンホールディングス	5,200	1,836.00	9,547,200	貸付有価証券 600株
スミダコーポレーション	15,100	1,137.00	17,168,700	貸付有価証券 7,500株
アイコム	9,800	2,338.00	22,912,400	貸付有価証券 1,200株
リオン	8,100	2,060.00	16,686,000	貸付有価証券 1,000株
本多通信工業	15,100	492.00	7,429,200	貸付有価証券 1,900株
船井電機	17,900	770.00	13,783,000	貸付有価証券 7,900株
横河電機	177,400	2,117.00	375,555,800	貸付有価証券 22,300株
新電元工業	6,300	3,600.00	22,680,000	貸付有価証券 700株
アズビル	114,400	2,592.00	296,524,800	貸付有価証券 14,000株
東亜ディーケーケー	8,800	854.00	7,515,200	貸付有価証券 1,000株
日本光電工業	78,100	2,973.00	232,191,300	貸付有価証券 9,500株
チノー	6,100	1,214.00	7,405,400	貸付有価証券 700株
共和電業	18,500	418.00	7,733,000	貸付有価証券 400株
日本電子材料	7,000	498.00	3,486,000	貸付有価証券 2,700株
堀場製作所	35,100	5,480.00	192,348,000	
アドバンテスト	120,800	2,747.00	331,837,600	貸付有価証券 14,800株
小野測器	8,100	551.00	4,463,100	
エスベック	15,700	2,319.00	36,408,300	貸付有価証券 1,900株
キーエンス	87,000	64,950.00	5,650,650,000	貸付有価証券 13,600株
日置電機	9,300	3,460.00	32,178,000	貸付有価証券 400株（400株）
シスメックス	138,100	7,311.00	1,009,649,100	貸付有価証券 18,100株

日本マイクロニクス	30,800	934.00	28,767,200	貸付有価証券 10,200株
メガチップス	13,900	1,310.00	18,209,000	貸付有価証券 9,300株
O B A R A G R O U P	9,200	3,715.00	34,178,000	貸付有価証券 1,100株
澤藤電機	2,100	1,648.00	3,460,800	貸付有価証券 200株
原田工業	7,200	769.00	5,536,800	貸付有価証券 3,400株
コーセル	22,500	1,073.00	24,142,500	貸付有価証券 11,400株（300株）
イリソ電子工業	16,200	5,390.00	87,318,000	貸付有価証券 10,700株
オブテックスグループ	31,200	1,309.00	40,840,800	貸付有価証券 3,400株
千代田インテグレ	7,400	1,992.00	14,740,800	貸付有価証券 300株
アイ・オー・データ機器	6,500	1,004.00	6,526,000	
レーザーテック	36,300	4,045.00	146,833,500	
スタンレー電気	125,300	2,565.00	321,394,500	貸付有価証券 15,300株
岩崎電気	6,900	1,291.00	8,907,900	貸付有価証券 800株
ウシオ電機	103,000	1,381.00	142,243,000	貸付有価証券 12,600株
岡谷電機産業	12,600	372.00	4,687,200	貸付有価証券 3,300株
ヘリオス テクノ ホー ルディング	16,300	617.00	10,057,100	貸付有価証券 7,400株
エノモト	4,900	759.00	3,719,100	貸付有価証券 700株
日本セラミック	18,000	2,771.00	49,878,000	貸付有価証券 3,500株
遠藤照明	8,900	728.00	6,479,200	貸付有価証券 1,000株
古河電池	12,600	650.00	8,190,000	貸付有価証券 5,900株
双信電機	8,600	509.00	4,377,400	貸付有価証券 3,800株
山一電機	12,800	922.00	11,801,600	貸付有価証券 3,200株

図研	11,500	1,649.00	18,963,500	貸付有価証券 1,400株
日本電子	35,000	2,394.00	83,790,000	貸付有価証券 6,400株
カシオ計算機	156,800	1,346.00	211,052,800	貸付有価証券 19,200株
ファナック	168,400	20,040.00	3,374,736,000	貸付有価証券 21,900株
日本シイエムケイ	45,100	617.00	27,826,700	貸付有価証券 18,600株
エンプラス	8,000	3,125.00	25,000,000	貸付有価証券 1,200株
大真空	6,500	1,062.00	6,903,000	貸付有価証券 800株
ローム	84,800	6,950.00	589,360,000	貸付有価証券 10,400株
浜松ホトニクス	127,100	4,160.00	528,736,000	貸付有価証券 15,500株
三井ハイテック	19,500	1,119.00	21,820,500	貸付有価証券 7,600株
新光電気工業	59,500	910.00	54,145,000	貸付有価証券 7,500株
京セラ	270,200	7,053.00	1,905,720,600	貸付有価証券 38,800株
太陽誘電	78,800	1,871.00	147,434,800	貸付有価証券 52,700株
村田製作所	557,900	4,672.00	2,606,508,800	貸付有価証券 68,300株
ユーシン	9,300	984.00	9,151,200	貸付有価証券 700株
双葉電子工業	29,000	1,395.00	40,455,000	貸付有価証券 3,500株
北陸電気工業	6,600	969.00	6,395,400	貸付有価証券 800株
ニチコン	55,800	832.00	46,425,600	貸付有価証券 10,600株
日本ケミコン	12,600	1,525.00	19,215,000	貸付有価証券 1,500株
K O A	26,700	1,351.00	36,071,700	貸付有価証券 3,200株
市光工業	26,500	695.00	18,417,500	貸付有価証券 900株

小糸製作所	106,200	5,530.00	587,286,000	貸付有価証券 13,500株
ミツバ	32,600	633.00	20,635,800	貸付有価証券 3,900株
S C R E E Nホールディングス	30,700	4,150.00	127,405,000	貸付有価証券 5,100株（1,400株）
キャノン電子	16,300	1,874.00	30,546,200	
キャノン	954,200	3,236.00	3,087,791,200	
リコー	532,900	1,085.00	578,196,500	貸付有価証券 96,400株
象印マホービン	43,900	1,139.00	50,002,100	貸付有価証券 23,900株（1,100株）
M U T O Hホールディングス	2,400	1,686.00	4,046,400	貸付有価証券 200株
東京エレクトロン	118,200	14,810.00	1,750,542,000	貸付有価証券 16,300株
トヨタ紡織	62,000	1,401.00	86,862,000	貸付有価証券 7,500株
芦森工業	3,700	1,590.00	5,883,000	貸付有価証券 1,600株
ユニプレス	34,300	1,720.00	58,996,000	貸付有価証券 4,300株
豊田自動織機	143,500	5,790.00	830,865,000	貸付有価証券 17,500株
モリタホールディングス	31,000	1,895.00	58,745,000	貸付有価証券 3,700株
三櫻工業	22,500	464.00	10,440,000	貸付有価証券 3,100株
デンソー	390,300	4,501.00	1,756,740,300	貸付有価証券 47,800株
東海理化電機製作所	46,700	1,739.00	81,211,300	貸付有価証券 5,700株
三井E & Sホールディングス	64,000	976.00	62,464,000	貸付有価証券 2,200株
川崎重工業	137,900	2,481.00	342,129,900	貸付有価証券 16,800株
名村造船所	53,200	313.00	16,651,600	貸付有価証券 12,300株
サノヤスホールディングス	23,300	218.00	5,079,400	貸付有価証券 5,700株（100株）
日本車輛製造	6,500	2,549.00	16,568,500	貸付有価証券 3,200株

三菱ロジスネクスト	21,100	1,177.00	24,834,700	貸付有価証券 2,600株
近畿車輛	2,700	1,796.00	4,849,200	貸付有価証券 600株
日産自動車	2,090,500	766.50	1,602,368,250	貸付有価証券 260,200株
いすゞ自動車	560,300	1,220.50	683,846,150	貸付有価証券 68,800株
トヨタ自動車	1,975,300	6,693.00	13,220,682,900	貸付有価証券 263,000株
日野自動車	221,300	898.00	198,727,400	貸付有価証券 27,100株
三菱自動車工業	656,100	510.00	334,611,000	貸付有価証券 110,300株
エフテック	12,400	746.00	9,250,400	貸付有価証券 1,500株
レシップホールディングス	6,300	782.00	4,926,600	貸付有価証券 700株
G M B	3,400	867.00	2,947,800	貸付有価証券 400株
ファルテック	3,100	803.00	2,489,300	貸付有価証券 300株
武蔵精密工業	43,000	1,348.00	57,964,000	貸付有価証券 25,500株
日産車体	34,600	1,020.00	35,292,000	貸付有価証券 4,400株
新明和工業	74,300	1,350.00	100,305,000	貸付有価証券 9,000株
極東開発工業	35,300	1,343.00	47,407,900	貸付有価証券 4,300株
日信工業	32,400	1,483.00	48,049,200	貸付有価証券 3,900株
トピー工業	14,600	2,474.00	36,120,400	貸付有価証券 1,700株
ティラド	6,400	1,942.00	12,428,800	貸付有価証券 700株
タチエス	29,100	1,364.00	39,692,400	貸付有価証券 3,600株
N O K	95,300	1,538.00	146,571,400	貸付有価証券 28,300株
フタバ産業	49,300	563.00	27,755,900	貸付有価証券 6,000株

K Y B	18,400	2,970.00	54,648,000	貸付有価証券 3,400株（400株）
大同メタル工業	28,800	669.00	19,267,200	貸付有価証券 3,500株
プレス工業	87,800	476.00	41,792,800	貸付有価証券 10,700株
ミクニ	22,500	377.00	8,482,500	貸付有価証券 2,700株
太平洋工業	37,100	1,537.00	57,022,700	貸付有価証券 4,500株
ケーヒン	40,700	1,520.00	61,864,000	貸付有価証券 4,900株
河西工業	21,700	787.00	17,077,900	貸付有価証券 2,600株
アイシン精機	146,000	3,625.00	529,250,000	貸付有価証券 17,800株
マツダ	556,300	1,119.50	622,777,850	貸付有価証券 74,600株
今仙電機製作所	16,400	925.00	15,170,000	貸付有価証券 2,100株
本田技研工業	1,495,300	2,785.50	4,165,158,150	
スズキ	324,300	4,962.00	1,609,176,600	貸付有価証券 41,400株
S U B A R U	550,300	2,532.50	1,393,634,750	貸付有価証券 67,700株
安永	8,500	1,409.00	11,976,500	貸付有価証券 5,600株
ヤマハ発動機	250,300	1,922.00	481,076,600	
ショーワ	41,800	1,455.00	60,819,000	貸付有価証券 5,100株
T B K	21,100	390.00	8,229,000	貸付有価証券 2,500株
エクセディ	24,100	2,209.00	53,236,900	貸付有価証券 2,900株
豊田合成	57,200	2,030.00	116,116,000	貸付有価証券 7,000株
愛三工業	27,700	669.00	18,531,300	貸付有価証券 3,300株
盟和産業	2,700	1,031.00	2,783,700	貸付有価証券 300株
日本プラスト	13,900	686.00	9,535,400	貸付有価証券 1,700株

ヨロズ	16,500	1,333.00	21,994,500	貸付有価証券 2,000株
エフ・シー・シー	31,900	2,255.00	71,934,500	貸付有価証券 3,900株
シマノ	71,400	16,430.00	1,173,102,000	貸付有価証券 100株
テイ・エス テック	41,200	2,847.00	117,296,400	貸付有価証券 5,000株
ジャムコ	8,900	2,094.00	18,636,600	貸付有価証券 3,700株
テルモ	501,600	3,210.00	1,610,136,000	貸付有価証券 77,100株
クリエートメディック	5,900	944.00	5,569,600	
日機装	57,200	1,444.00	82,596,800	貸付有価証券 100株
島津製作所	228,100	2,805.00	639,820,500	貸付有価証券 28,900株
J M S	16,300	692.00	11,279,600	貸付有価証券 2,000株
クボテック	3,800	439.00	1,668,200	貸付有価証券 2,400株
長野計器	13,900	736.00	10,230,400	貸付有価証券 1,700株
ブイ・テクノロジー	8,300	4,585.00	38,055,500	貸付有価証券 3,900株（500株）
東京計器	11,300	920.00	10,396,000	貸付有価証券 1,300株
愛知時計電機	2,300	4,165.00	9,579,500	貸付有価証券 200株
インターアクション	9,500	1,384.00	13,148,000	貸付有価証券 6,300株（700株）
オーバル	17,300	233.00	4,030,900	貸付有価証券 2,100株
東京精密	32,100	2,688.00	86,284,800	貸付有価証券 3,900株
マニー	23,500	6,950.00	163,325,000	貸付有価証券 15,700株
ニコン	308,900	1,560.00	481,884,000	貸付有価証券 37,800株
トプコン	95,200	1,349.00	128,424,800	貸付有価証券 12,200株
オリンパス	1,056,200	1,205.00	1,272,721,000	貸付有価証券

				135,100株
理研計器	15,600	1,990.00	31,044,000	貸付有価証券 1,900株
タムロン	15,700	2,229.00	34,995,300	貸付有価証券 100株
H O Y A	356,900	8,049.00	2,872,688,100	貸付有価証券 43,700株
シード	7,500	1,044.00	7,830,000	貸付有価証券 1,100株
ノーリツ銅機	13,900	2,050.00	28,495,000	貸付有価証券 4,400株
エー・アンド・デイ	16,200	781.00	12,652,200	貸付有価証券 1,900株
朝日インテック	75,200	5,230.00	393,296,000	貸付有価証券 700株
シチズン時計	193,900	543.00	105,287,700	貸付有価証券 25,000株
リズム時計工業	6,000	1,297.00	7,782,000	貸付有価証券 700株
大研医器	14,000	620.00	8,680,000	貸付有価証券 2,200株
メニコン	24,300	3,650.00	88,695,000	貸付有価証券 11,100株
シンシア	2,600	575.00	1,495,000	貸付有価証券 1,700株
松風	8,600	1,372.00	11,799,200	貸付有価証券 1,000株
セイコーホールディングス	27,300	2,190.00	59,787,000	貸付有価証券 3,300株
ニプロ	122,700	1,182.00	145,031,400	貸付有価証券 15,400株
中本パックス	4,900	1,479.00	7,247,100	貸付有価証券 3,000株
スノーピーク	6,800	1,437.00	9,771,600	貸付有価証券 1,000株
パラマウントベッドホールディングス	20,400	4,185.00	85,374,000	貸付有価証券 2,700株
トランザクション	11,300	900.00	10,170,000	貸付有価証券 1,800株（500株）
S H O - B I	5,200	368.00	1,913,600	貸付有価証券 1,900株
ニホンフラッシュ	7,600	2,583.00	19,630,800	貸付有価証券

				1,600株
前田工織	19,500	1,983.00	38,668,500	貸付有価証券 4,100株（600株）
永大産業	23,200	330.00	7,656,000	貸付有価証券 3,200株
アートネイチャー	18,900	635.00	12,001,500	貸付有価証券 2,400株
パンダイナムコホールディングス	183,300	5,220.00	956,826,000	貸付有価証券 22,400株
アイフィスジャパン	3,900	643.00	2,507,700	貸付有価証券 400株
共立印刷	29,500	181.00	5,339,500	貸付有価証券 3,600株
S H O E I	8,500	4,380.00	37,230,000	貸付有価証券 1,100株
フランスベッドホールディングス	25,100	978.00	24,547,800	貸付有価証券 5,100株
パイロットコーポレーション	30,900	4,015.00	124,063,500	
萩原工業	9,800	1,337.00	13,102,600	貸付有価証券 1,200株
トッパン・フォームズ	38,000	875.00	33,250,000	貸付有価証券 4,600株
フジシールインターナショナル	39,700	3,250.00	129,025,000	貸付有価証券 4,800株
タカラトミー	74,200	1,316.00	97,647,200	貸付有価証券 9,000株
廣済堂	16,500	662.00	10,923,000	貸付有価証券 2,600株
エステールホールディングス	4,700	608.00	2,857,600	貸付有価証券 500株
アーク	67,700	101.00	6,837,700	貸付有価証券 8,400株
タカノ	6,900	777.00	5,361,300	貸付有価証券 800株
プロネクサス	15,200	1,133.00	17,221,600	貸付有価証券 1,800株
ホクシン	10,900	128.00	1,395,200	貸付有価証券 1,700株
ウッドワン	6,000	971.00	5,826,000	貸付有価証券 700株
大建工業	13,400	2,238.00	29,989,200	貸付有価証券

				1,600株
凸版印刷	250,200	1,686.00	421,837,200	貸付有価証券 30,600株
大日本印刷	249,800	2,368.00	591,526,400	貸付有価証券 30,600株
図書印刷	16,600	1,344.00	22,310,400	貸付有価証券 2,200株
共同印刷	5,500	2,812.00	15,466,000	貸付有価証券 600株
N I S S H A	36,400	1,087.00	39,566,800	貸付有価証券 9,500株（400株）
光村印刷	1,500	2,053.00	3,079,500	貸付有価証券 100株
宝印刷	8,500	1,633.00	13,880,500	貸付有価証券 1,000株
アシックス	167,200	1,202.00	200,974,400	貸付有価証券 600株
ツツミ	5,500	1,906.00	10,483,000	貸付有価証券 1,100株
小松ウオール工業	5,400	1,792.00	9,676,800	貸付有価証券 600株
ヤマハ	105,400	5,100.00	537,540,000	貸付有価証券 12,900株
河合楽器製作所	5,500	3,090.00	16,995,000	貸付有価証券 700株
クリナップ	16,500	553.00	9,124,500	貸付有価証券 2,700株
ビジョン	107,100	4,355.00	466,420,500	貸付有価証券 69,800株（200株）
兼松サステック	1,100	1,633.00	1,796,300	貸付有価証券 100株
キングジム	14,700	855.00	12,568,500	貸付有価証券 2,100株
リンテック	42,100	2,240.00	94,304,000	貸付有価証券 5,600株
イトーキ	32,600	445.00	14,507,000	貸付有価証券 4,000株
任天堂	101,400	38,150.00	3,868,410,000	貸付有価証券 13,700株
三菱鉛筆	29,200	1,779.00	51,946,800	
タカラスタンダード	36,600	1,687.00	61,744,200	貸付有価証券 4,500株

コクヨ	85,000	1,489.00	126,565,000	貸付有価証券 100株
ナカバヤシ	17,400	524.00	9,117,600	貸付有価証券 2,100株
グローブライド	8,600	3,630.00	31,218,000	貸付有価証券 1,000株
オカムラ	61,900	1,061.00	65,675,900	貸付有価証券 7,500株
美津濃	17,600	2,484.00	43,718,400	貸付有価証券 2,100株
東京電力ホールディングス	1,415,000	567.00	802,305,000	貸付有価証券 268,300株
中部電力	542,300	1,549.00	840,022,700	貸付有価証券 74,400株
関西電力	723,300	1,232.00	891,105,600	貸付有価証券 90,100株
中国電力	245,000	1,373.00	336,385,000	貸付有価証券 81,900株（21,300株）
北陸電力	173,600	787.00	136,623,200	貸付有価証券 700株
東北電力	415,100	1,090.00	452,459,000	貸付有価証券 50,800株
四国電力	159,600	1,002.00	159,919,200	貸付有価証券 22,400株
九州電力	365,300	1,069.00	390,505,700	貸付有価証券 44,700株
北海道電力	165,900	609.00	101,033,100	貸付有価証券 21,800株
沖縄電力	32,800	1,651.00	54,152,800	貸付有価証券 4,000株
電源開発	141,000	2,431.00	342,771,000	貸付有価証券 17,200株
エフオン	8,300	804.00	6,673,200	貸付有価証券 100株
イーレックス	30,800	1,125.00	34,650,000	貸付有価証券 8,800株
レノバ	29,100	814.00	23,687,400	貸付有価証券 19,400株（4,800株）
東京瓦斯	347,800	2,598.00	903,584,400	貸付有価証券 42,600株
大阪瓦斯	344,000	1,911.00	657,384,000	貸付有価証券 42,100株

東邦瓦斯	87,800	4,025.00	353,395,000	貸付有価証券 12,000株
北海道瓦斯	9,500	1,458.00	13,851,000	貸付有価証券 1,100株
広島ガス	36,500	332.00	12,118,000	貸付有価証券 4,400株
西部瓦斯	20,000	2,066.00	41,320,000	貸付有価証券 2,500株
静岡ガス	54,500	817.00	44,526,500	貸付有価証券 100株
メタウォーター	8,600	3,330.00	28,638,000	貸付有価証券 1,000株
S B S ホールディングス	17,500	1,514.00	26,495,000	貸付有価証券 2,200株
東武鉄道	186,900	3,105.00	580,324,500	貸付有価証券 22,900株
相鉄ホールディングス	60,800	2,978.00	181,062,400	貸付有価証券 7,700株
東京急行電鉄	481,400	1,922.00	925,250,800	貸付有価証券 58,900株
京浜急行電鉄	242,800	1,835.00	445,538,000	貸付有価証券 31,300株
小田急電鉄	283,900	2,648.00	751,767,200	貸付有価証券 37,600株
京王電鉄	99,000	7,280.00	720,720,000	貸付有価証券 15,900株
京成電鉄	132,800	3,960.00	525,888,000	貸付有価証券 16,200株
富士急行	24,200	3,960.00	95,832,000	貸付有価証券 11,200株
新京成電鉄	4,500	2,033.00	9,148,500	貸付有価証券 500株
東日本旅客鉄道	315,200	10,035.00	3,163,032,000	貸付有価証券 39,200株
西日本旅客鉄道	158,900	8,732.00	1,387,514,800	貸付有価証券 24,500株
東海旅客鉄道	158,700	22,100.00	3,507,270,000	貸付有価証券 20,200株
西武ホールディングス	219,600	1,800.00	395,280,000	貸付有価証券 27,600株
鴻池運輸	28,200	1,662.00	46,868,400	貸付有価証券 3,400株

西日本鉄道	49,100	2,290.00	112,439,000	貸付有価証券 7,400株
ハマキョウレックス	13,600	3,695.00	50,252,000	貸付有価証券 1,600株
サカイ引越センター	9,300	6,380.00	59,334,000	貸付有価証券 1,200株
近鉄グループホールディングス	167,900	5,170.00	868,043,000	貸付有価証券 20,500株
阪急阪神ホールディングス	223,900	3,760.00	841,864,000	貸付有価証券 27,400株
南海電気鉄道	74,900	2,636.00	197,436,400	貸付有価証券 9,100株
京阪ホールディングス	74,700	4,750.00	354,825,000	貸付有価証券 9,100株
神戸電鉄	4,300	3,935.00	16,920,500	貸付有価証券 600株
名古屋鉄道	137,900	2,989.00	412,183,100	貸付有価証券 16,700株
山陽電気鉄道	12,900	2,106.00	27,167,400	貸付有価証券 1,500株
日本通運	64,700	5,610.00	362,967,000	貸付有価証券 8,000株
ヤマトホールディングス	294,300	2,174.00	639,808,200	貸付有価証券 36,100株
山九	46,700	5,510.00	257,317,000	貸付有価証券 5,700株
丸運	9,600	280.00	2,688,000	貸付有価証券 1,100株
丸全昭和運輸	13,600	3,330.00	45,288,000	貸付有価証券 1,600株
センコーグループホールディングス	92,500	838.00	77,515,000	貸付有価証券 14,200株
トナミホールディングス	4,000	5,580.00	22,320,000	貸付有価証券 400株
ニッコンホールディングス	63,800	2,519.00	160,712,200	貸付有価証券 7,800株
日本石油輸送	2,000	2,797.00	5,594,000	貸付有価証券 200株
福山通運	21,500	3,855.00	82,882,500	貸付有価証券 2,600株
セイノーホールディングス	125,700	1,401.00	176,105,700	貸付有価証券 15,500株

エスライン	5,000	981.00	4,905,000	貸付有価証券 600株
神奈川中央交通	4,200	3,720.00	15,624,000	貸付有価証券 500株
日立物流	36,900	3,445.00	127,120,500	貸付有価証券 24,100株
丸和運輸機関	8,800	4,910.00	43,208,000	貸付有価証券 2,800株
C & F ロジホールディングス	17,000	1,316.00	22,372,000	貸付有価証券 2,000株
九州旅客鉄道	140,900	3,250.00	457,925,000	貸付有価証券 17,200株
S G ホールディングス	158,600	3,070.00	486,902,000	貸付有価証券 58,100株
日本郵船	140,400	1,669.00	234,327,600	貸付有価証券 78,100株
商船三井	99,600	2,473.00	246,310,800	貸付有価証券 12,200株
川崎汽船	51,700	1,272.00	65,762,400	貸付有価証券 34,600株（2,500株）
N S ユナイテッド海運	9,200	2,230.00	20,516,000	貸付有価証券 1,200株
明治海運	17,800	310.00	5,518,000	貸付有価証券 2,100株
飯野海運	79,500	352.00	27,984,000	貸付有価証券 9,700株
共栄タンカー	1,500	1,442.00	2,163,000	貸付有価証券 100株
乾汽船	15,100	844.00	12,744,400	貸付有価証券 1,900株
日本航空	307,300	3,435.00	1,055,575,500	貸付有価証券 37,600株
A N A ホールディングス	306,900	3,536.00	1,085,198,400	貸付有価証券 41,600株
パスコ	3,300	813.00	2,682,900	貸付有価証券 500株
トランコム	4,700	6,170.00	28,999,000	貸付有価証券 500株
日新	14,500	1,742.00	25,259,000	貸付有価証券 1,700株
三菱倉庫	58,100	3,025.00	175,752,500	貸付有価証券 17,400株

三井倉庫ホールディングス	20,500	1,518.00	31,119,000	貸付有価証券 2,500株
住友倉庫	61,800	1,364.00	84,295,200	貸付有価証券 7,700株
澁澤倉庫	9,200	1,742.00	16,026,400	貸付有価証券 1,100株
東陽倉庫	30,300	322.00	9,756,600	貸付有価証券 3,800株
日本トランスシティ	37,000	481.00	17,797,000	貸付有価証券 4,500株
ケイヒン	3,200	1,182.00	3,782,400	貸付有価証券 300株
中央倉庫	10,200	1,047.00	10,679,400	貸付有価証券 1,200株
川西倉庫	3,400	1,042.00	3,542,800	貸付有価証券 400株
安田倉庫	13,800	864.00	11,923,200	貸付有価証券 1,600株
ファイズ	3,000	713.00	2,139,000	貸付有価証券 500株
東洋埠頭	5,100	1,372.00	6,997,200	貸付有価証券 600株
宇徳	14,300	494.00	7,064,200	貸付有価証券 1,700株
上組	103,500	2,510.00	259,785,000	貸付有価証券 12,600株
サンリツ	4,000	634.00	2,536,000	貸付有価証券 400株
キムラユニティー	4,500	1,084.00	4,878,000	貸付有価証券 500株
キューソー流通システム	4,200	1,983.00	8,328,600	貸付有価証券 500株
近鉄エクスプレス	31,700	1,395.00	44,221,500	貸付有価証券 3,800株
東海運	9,600	253.00	2,428,800	貸付有価証券 1,300株
エーアイテイー	10,900	932.00	10,158,800	貸付有価証券 1,300株
内外トランスライン	5,300	1,186.00	6,285,800	
日本コンセプト	6,100	1,229.00	7,496,900	
N E C ネットスアイ	19,200	2,813.00	54,009,600	貸付有価証券 2,600株

クロスキャット	4,600	922.00	4,241,200	貸付有価証券 1,500株
システナ	62,000	1,829.00	113,398,000	貸付有価証券 7,500株
デジタルアーツ	9,300	10,270.00	95,511,000	貸付有価証券 3,800株（2,600株）
日鉄ソリューションズ	26,100	3,490.00	91,089,000	貸付有価証券 3,100株
キューブシステム	9,200	812.00	7,470,400	貸付有価証券 1,100株
エイジア	3,400	1,209.00	4,110,600	貸付有価証券 2,100株
コア	7,300	1,632.00	11,913,600	貸付有価証券 1,000株
ソリトンシステムズ	9,800	986.00	9,662,800	貸付有価証券 4,700株（100株）
ソフトクリエイトホールディングス	7,600	1,556.00	11,825,600	貸付有価証券 900株
T I S	58,000	5,460.00	316,680,000	貸付有価証券 7,600株
ネオス	7,000	801.00	5,607,000	貸付有価証券 4,600株（500株）
電算システム	6,600	3,385.00	22,341,000	貸付有価証券 200株（200株）
グリー	120,000	509.00	61,080,000	貸付有価証券 3,700株
コーエーテクモホールディングス	35,600	1,966.00	69,989,600	貸付有価証券 4,300株
三菱総合研究所	7,500	3,400.00	25,500,000	貸付有価証券 900株
ボルテージ	3,200	498.00	1,593,600	
電算	1,900	1,998.00	3,796,200	貸付有価証券 200株
A G S	9,800	688.00	6,742,400	貸付有価証券 1,200株
ファインデックス	14,600	852.00	12,439,200	貸付有価証券 4,900株（2,800株）
ブレインパッド	3,300	6,470.00	21,351,000	貸付有価証券 1,800株
K L a b	31,200	887.00	27,674,400	貸付有価証券 20,900株（4,100株）
ポルトウウィン・ピッ	23,100	1,153.00	26,634,300	貸付有価証券

トクルーホールディ				2,800株
イーブックイニシアティブ ジャパン	2,800	2,223.00	6,224,400	貸付有価証券 800株
ネクソン	443,700	1,595.00	707,701,500	貸付有価証券 87,200株
アイスタイル	44,500	714.00	31,773,000	貸付有価証券 29,800株（1,400株）
エムアップ	5,900	2,556.00	15,080,400	貸付有価証券 3,900株（1,200株）
エイチーム	12,000	1,177.00	14,124,000	貸付有価証券 6,900株（2,300株）
エニグモ	6,200	2,557.00	15,853,400	貸付有価証券 3,300株（2,400株）
テクノスジャパン	14,600	559.00	8,161,400	貸付有価証券 2,000株
e n i s h	6,800	546.00	3,712,800	貸付有価証券 4,500株
コロプラ	56,900	662.00	37,667,800	貸付有価証券 17,500株
オルトプラス	11,600	231.00	2,679,600	貸付有価証券 7,700株（100株）
ブロードリーフ	86,200	547.00	47,151,400	貸付有価証券 46,000株
クロス・マーケティング グループ	6,500	357.00	2,320,500	貸付有価証券 2,100株
デジタルハーツホール ディングス	7,900	1,059.00	8,366,100	貸付有価証券 2,500株（1,100株）
システム情報	8,800	936.00	8,236,800	貸付有価証券 1,100株
メディアドゥホールディ ングス	5,400	3,075.00	16,605,000	貸付有価証券 600株
じげん	24,600	771.00	18,966,600	貸付有価証券 3,600株
ブイキューブ	9,300	590.00	5,487,000	
エンカレッジ・テクノロ ジ	2,300	840.00	1,932,000	貸付有価証券 300株
サイバーリンクス	2,700	1,200.00	3,240,000	貸付有価証券 300株
ディー・エル・イー	12,300	192.00	2,361,600	貸付有価証券 8,200株（3,500株）
フィックスターズ	18,500	1,970.00	36,445,000	貸付有価証券 7,800株（100株）

CARTA HOLDINGS	8,400	1,349.00	11,331,600	貸付有価証券 1,400株
オブティム	7,600	3,630.00	27,588,000	貸付有価証券 4,900株（1,500株）
セレス	5,700	2,037.00	11,610,900	貸付有価証券 3,800株
ティーガイア	17,400	1,948.00	33,895,200	貸付有価証券 1,500株
セック	2,800	3,375.00	9,450,000	貸付有価証券 800株
日本アジアグループ	18,300	346.00	6,331,800	貸付有価証券 2,200株
豆蔵ホールディングス	11,800	1,313.00	15,493,400	貸付有価証券 1,400株
テクマトリックス	12,200	2,052.00	25,034,400	貸付有価証券 2,400株
プロシップ	5,000	1,157.00	5,785,000	貸付有価証券 600株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	419,200	297.00	124,502,400	貸付有価証券 225,000株
GMOペイメントゲートウェイ	28,600	7,230.00	206,778,000	貸付有価証券 9,300株
ザッパラス	9,000	363.00	3,267,000	
システムリサーチ	2,300	3,490.00	8,027,000	貸付有価証券 200株
インターネットイニシアティブ	28,300	2,056.00	58,184,800	貸付有価証券 4,200株
さくらインターネット	20,700	519.00	10,743,300	貸付有価証券 2,500株
ヴィンクス	5,900	1,160.00	6,844,000	貸付有価証券 3,900株
GMOクラウド	3,900	3,070.00	11,973,000	貸付有価証券 1,900株
SRAホールディングス	9,200	2,645.00	24,334,000	貸付有価証券 1,100株
Minorityソリューションズ	3,400	1,894.00	6,439,600	貸付有価証券 400株
システムインテグレータ	4,900	688.00	3,371,200	貸付有価証券 3,200株（100株）
朝日ネット	14,100	700.00	9,870,000	貸付有価証券 1,900株
eBASE	10,400	1,101.00	11,450,400	貸付有価証券

				1,200株
アバント	6,200	2,073.00	12,852,600	貸付有価証券 3,400株
アドソル日進	6,100	1,555.00	9,485,500	貸付有価証券 700株
フリービット	10,300	1,319.00	13,585,700	貸付有価証券 6,600株（4,300株）
コムチュア	9,800	4,095.00	40,131,000	貸付有価証券 2,400株
サイバーコム	3,100	1,995.00	6,184,500	貸付有価証券 1,700株（200株）
アステリア	11,600	1,053.00	12,214,800	貸付有価証券 3,600株
マークラインズ	8,000	1,856.00	14,848,000	貸付有価証券 1,700株
メディカル・データ・ビ ジョン	15,400	1,217.00	18,741,800	貸付有価証券 5,200株
g u m i	22,200	524.00	11,632,800	貸付有価証券 3,500株
ショーケース	3,700	529.00	1,957,300	貸付有価証券 2,400株（100株）
モバイルファクトリー	4,800	1,446.00	6,940,800	貸付有価証券 2,700株
テラスカイ	2,700	1,505.00	4,063,500	
デジタル・インフォメー ション・テクノロジー	7,700	1,804.00	13,890,800	貸付有価証券 1,400株（800株）
P C I ホールディングス	3,500	2,003.00	7,010,500	貸付有価証券 400株
パイプドHD	2,700	1,260.00	3,402,000	貸付有価証券 1,800株（100株）
アイビーシー	3,100	1,344.00	4,166,400	貸付有価証券 1,300株
ネオジャパン	3,300	887.00	2,927,100	貸付有価証券 1,600株
P R T I M E S	1,500	2,815.00	4,222,500	貸付有価証券 300株
ランドコンピュータ	2,600	1,138.00	2,958,800	貸付有価証券 300株
ダブルスタンダード	1,500	4,535.00	6,802,500	貸付有価証券 900株
オープンドア	8,600	2,848.00	24,492,800	
マイネット	5,600	707.00	3,959,200	貸付有価証券

				1,200株
アカツキ	6,100	5,360.00	32,696,000	貸付有価証券 3,100株（1,000株）
ベネフィットジャパン	1,300	860.00	1,118,000	貸付有価証券 200株
Ubicomホールディングス	3,200	1,759.00	5,628,800	貸付有価証券 1,700株（300株）
LINE	53,000	3,000.00	159,000,000	貸付有価証券 25,900株（2,800株）
カナミックネットワーク	3,500	2,333.00	8,165,500	貸付有価証券 1,000株
ノムラシステムコーポレーション	1,900	733.00	1,392,700	貸付有価証券 300株
チェンジ	3,400	2,542.00	8,642,800	貸付有価証券 2,000株（1,600株）
シンクロ・フード	7,400	571.00	4,225,400	貸付有価証券 4,900株
オークネット	9,100	1,286.00	11,702,600	貸付有価証券 900株
エイトレッド	1,800	1,834.00	3,301,200	貸付有価証券 800株
AOI TYO Holdings	18,900	760.00	14,364,000	貸付有価証券 10,300株
マクロミル	30,800	1,252.00	38,561,600	貸付有価証券 1,100株
ピーグリー	4,400	814.00	3,581,600	貸付有価証券 100株
オロ	4,600	2,515.00	11,569,000	貸付有価証券 3,000株（1,200株）
テモナ	2,300	465.00	1,069,500	貸付有価証券 200株
ソルクシーズ	7,400	878.00	6,497,200	貸付有価証券 800株
フェイス	6,900	977.00	6,741,300	貸付有価証券 800株
プロトコーポレーション	7,800	1,950.00	15,210,000	貸付有価証券 900株
ハイマックス	2,000	1,720.00	3,440,000	貸付有価証券 200株
野村総合研究所	110,600	5,350.00	591,710,000	貸付有価証券 21,200株
サイバネットシステム	14,100	620.00	8,742,000	

C E ホールディングス	5,000	945.00	4,725,000	貸付有価証券 1,300株
日本システム技術	2,800	1,799.00	5,037,200	貸付有価証券 600株
インテージホールディングス	22,200	998.00	22,155,600	
東邦システムサイエンス	5,200	930.00	4,836,000	貸付有価証券 600株
ソースネクスト	67,400	401.00	27,027,400	貸付有価証券 42,800株（22,100株）
インフォコム	19,000	2,418.00	45,942,000	貸付有価証券 2,300株
F I G	15,400	310.00	4,774,000	貸付有価証券 300株
アルテリア・ネットワークス	19,300	1,248.00	24,086,400	貸付有価証券 2,300株
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,900	1,907.00	7,437,300	貸付有価証券 400株
フォーカスシステムズ	11,700	856.00	10,015,200	貸付有価証券 1,400株
クレスコ	5,300	3,450.00	18,285,000	貸付有価証券 1,000株
フジ・メディア・ホールディングス	180,400	1,506.00	271,682,400	貸付有価証券 22,100株
オービック	60,300	12,760.00	769,428,000	貸付有価証券 7,300株
ジャストシステム	24,700	3,575.00	88,302,500	貸付有価証券 3,000株
T D C ソフト	15,200	870.00	13,224,000	貸付有価証券 1,800株
ヤフー	1,134,000	316.00	358,344,000	貸付有価証券 139,900株
トレンドマイクロ	92,800	4,935.00	457,968,000	貸付有価証券 16,600株
I D ホールディングス	6,600	1,165.00	7,689,000	貸付有価証券 2,000株
日本オラクル	35,200	7,810.00	274,912,000	貸付有価証券 4,300株
アルファシステムズ	5,400	2,783.00	15,028,200	貸付有価証券 600株
フューチャー	23,600	2,069.00	48,828,400	
C A C H o l d i n g	12,400	1,555.00	19,282,000	

S				
ソフトバンク・テクノロジー	7,400	2,409.00	17,826,600	貸付有価証券 1,300株
トーセ	4,700	835.00	3,924,500	貸付有価証券 500株
オービックビジネスコン サルタント	17,800	5,050.00	89,890,000	貸付有価証券 2,800株
伊藤忠テクノソリュー ションズ	79,200	2,808.00	222,393,600	貸付有価証券 9,700株
アイティフォー	21,100	835.00	17,618,500	貸付有価証券 5,300株
東計電算	2,600	3,085.00	8,021,000	
エックスネット	3,200	912.00	2,918,400	貸付有価証券 300株
大塚商会	94,100	4,460.00	419,686,000	
サイボウズ	20,300	1,369.00	27,790,700	貸付有価証券 2,400株
ソフトブレーン	13,600	502.00	6,827,200	貸付有価証券 2,600株
電通国際情報サービス	10,800	3,510.00	37,908,000	貸付有価証券 4,100株（4,100株）
デジタルガレージ	33,900	3,490.00	118,311,000	貸付有価証券 10,300株（500株）
E Mシステムズ	14,100	1,675.00	23,617,500	貸付有価証券 4,700株（2,500株）
ウェザーニューズ	5,900	3,330.00	19,647,000	貸付有価証券 700株
C I J	13,600	992.00	13,491,200	
東洋ビジネスエンジニア リング	1,700	2,046.00	3,478,200	貸付有価証券 1,100株
日本エンタープライズ	17,900	165.00	2,953,500	貸付有価証券 2,100株
WOWOW	8,300	2,701.00	22,418,300	貸付有価証券 1,400株
スカラ	12,100	950.00	11,495,000	貸付有価証券 2,500株
インテリジェント ウェ イブ	6,500	890.00	5,785,000	貸付有価証券 2,200株
I M A G I C A G R O U P	14,700	585.00	8,599,500	貸付有価証券 7,400株（2,000株）
ネットワンシステムズ	61,500	3,160.00	194,340,000	貸付有価証券 7,500株

システムソフト	41,100	91.00	3,740,100	貸付有価証券 5,200株
アルゴグラフィックス	14,800	2,313.00	34,232,400	貸付有価証券 1,800株
マーベラス	26,500	832.00	22,048,000	貸付有価証券 3,600株
エイベックス	29,800	1,408.00	41,958,400	貸付有価証券 3,600株
日本ユニシス	54,300	3,735.00	202,810,500	貸付有価証券 7,000株
兼松エレクトロニクス	9,500	2,979.00	28,300,500	貸付有価証券 1,100株
東京放送ホールディングス	115,400	1,825.00	210,605,000	貸付有価証券 15,000株
日本テレビホールディングス	159,700	1,562.00	249,451,400	貸付有価証券 21,400株
朝日放送グループホールディングス	17,300	720.00	12,456,000	貸付有価証券 2,100株
テレビ朝日ホールディングス	47,800	1,710.00	81,738,000	貸付有価証券 10,800株
スカパーＪＳＡＴホールディングス	132,800	420.00	55,776,000	貸付有価証券 18,300株
テレビ東京ホールディングス	14,300	2,364.00	33,805,200	貸付有価証券 1,900株
日本ＢＳ放送	5,900	1,060.00	6,254,000	貸付有価証券 3,900株（100株）
ビジョン	5,400	4,730.00	25,542,000	
スマートバリュー	5,100	695.00	3,544,500	貸付有価証券 1,800株
USEN-NEXT HOLDINGS	6,600	766.00	5,055,600	貸付有価証券 3,900株
ワイヤレスゲート	7,600	569.00	4,324,400	貸付有価証券 5,000株（800株）
コネクシオ	12,300	1,389.00	17,084,700	貸付有価証券 1,500株
日本通信	150,100	178.00	26,717,800	貸付有価証券 100,700株（32,000株）
クロップス	3,200	612.00	1,958,400	貸付有価証券 600株
日本電信電話	1,189,600	4,989.00	5,934,914,400	貸付有価証券 159,300株

K D D I	1,532,800	2,751.50	4,217,499,200	貸付有価証券 199,800株
ソフトバンク	1,844,100	1,406.00	2,592,804,600	貸付有価証券 633,200株
光通信	20,500	23,380.00	479,290,000	
N T T ドコモ	1,101,300	2,480.00	2,731,224,000	貸付有価証券 134,900株
エムティーアイ	16,800	777.00	13,053,600	貸付有価証券 2,100株
G M O インターネット	63,300	1,979.00	125,270,700	貸付有価証券 42,400株
アイドママーケティング コミュニケーション	3,700	603.00	2,231,100	貸付有価証券 1,900株（1,500株）
カドカワ	50,700	1,421.00	72,044,700	貸付有価証券 6,500株
学研ホールディングス	5,800	5,000.00	29,000,000	貸付有価証券 700株
ゼンリン	34,700	1,982.00	68,775,400	貸付有価証券 6,800株
昭文社	8,000	349.00	2,792,000	貸付有価証券 900株
インプレスホールディン グス	14,400	135.00	1,944,000	貸付有価証券 2,700株
アイネット	9,800	1,180.00	11,564,000	貸付有価証券 1,200株
松竹	11,500	12,600.00	144,900,000	貸付有価証券 7,700株
東宝	114,400	4,765.00	545,116,000	貸付有価証券 14,000株
東映	7,300	15,020.00	109,646,000	貸付有価証券 800株
エヌ・ティ・ティ・デー タ	463,100	1,418.00	656,675,800	貸付有価証券 56,800株
ピー・シー・エー	2,200	3,380.00	7,436,000	貸付有価証券 400株
ビジネスブレイン太田昭 和	3,000	2,129.00	6,387,000	貸付有価証券 300株
D T S	19,400	4,540.00	88,076,000	貸付有価証券 2,400株
スクウェア・エニックス ・ホールディングス	80,900	3,390.00	274,251,000	貸付有価証券 9,900株
シーイーシー	18,600	2,415.00	44,919,000	貸付有価証券

				2,200株
カプコン	74,500	2,084.00	155,258,000	貸付有価証券 9,100株
アイ・エス・ピー	3,400	1,637.00	5,565,800	貸付有価証券 400株
ジャステック	10,100	960.00	9,696,000	貸付有価証券 1,200株
S C S K	45,900	5,310.00	243,729,000	貸付有価証券 5,600株
日本システムウエア	5,700	2,661.00	15,167,700	貸付有価証券 800株
アイネス	22,000	1,163.00	25,586,000	貸付有価証券 2,600株
T K C	14,700	4,675.00	68,722,500	貸付有価証券 1,700株
富士ソフト	26,000	4,720.00	122,720,000	貸付有価証券 100株
N S D	28,600	3,140.00	89,804,000	貸付有価証券 11,300株
コナミホールディングス	71,100	5,120.00	364,032,000	貸付有価証券 8,700株
福井コンピュータホールディングス	5,700	2,510.00	14,307,000	貸付有価証券 900株
J B C C ホールディングス	13,700	1,450.00	19,865,000	貸付有価証券 1,600株
ミロク情報サービス	17,200	3,425.00	58,910,000	貸付有価証券 11,500株（6,700株）
ソフトバンクグループ	726,900	10,305.00	7,490,704,500	貸付有価証券 93,200株
ハウスイ	1,400	850.00	1,190,000	貸付有価証券 100株
高千穂交易	6,700	974.00	6,525,800	貸付有価証券 1,200株
伊藤忠食品	4,300	4,680.00	20,124,000	貸付有価証券 500株
エレマテック	16,300	988.00	16,104,400	貸付有価証券 2,000株
J A L U X	4,900	2,799.00	13,715,100	貸付有価証券 600株
あらた	12,900	3,680.00	47,472,000	貸付有価証券 1,600株
トーメンデバイス	2,600	2,272.00	5,907,200	貸付有価証券

				300株
東京エレクトロン デバイス	6,300	1,904.00	11,995,200	貸付有価証券 700株
フィールズ	15,300	511.00	7,818,300	貸付有価証券 6,800株
双日	964,200	349.00	336,505,800	貸付有価証券 119,000株
アルフレッサ ホールディングス	194,000	2,686.00	521,084,000	貸付有価証券 23,700株
横浜冷凍	48,900	1,004.00	49,095,600	貸付有価証券 5,500株
神栄	2,400	759.00	1,821,600	貸付有価証券 200株
ラサ商事	9,200	797.00	7,332,400	貸付有価証券 1,300株
ラクーンホールディングス	8,400	636.00	5,342,400	貸付有価証券 1,000株
アルコニックス	18,500	1,404.00	25,974,000	貸付有価証券 3,500株（100株）
神戸物産	26,300	5,430.00	142,809,000	貸付有価証券 3,200株
あい ホールディングス	24,900	1,768.00	44,023,200	貸付有価証券 400株（400株）
ディービーエックス	6,800	797.00	5,419,600	貸付有価証券 800株
ダイワボウホールディングス	15,900	4,990.00	79,341,000	貸付有価証券 1,900株
マクニカ・富士エレホールディングス	48,400	1,398.00	67,663,200	貸付有価証券 12,300株
ラクト・ジャパン	7,600	3,705.00	28,158,000	貸付有価証券 2,300株
パイタルケーエスケー・ホールディングス	32,900	1,040.00	34,216,000	貸付有価証券 15,700株
八洲電機	13,500	859.00	11,596,500	貸付有価証券 1,800株
メディアスホールディングス	9,900	730.00	7,227,000	貸付有価証券 6,600株
レスターホールディングス	19,100	1,507.00	28,783,700	貸付有価証券 2,500株
ジューテックホールディングス	4,000	961.00	3,844,000	貸付有価証券 400株
大光	7,400	618.00	4,573,200	貸付有価証券

				1,500株
ＯＣＨＩホールディングス	5,100	1,192.00	6,079,200	貸付有価証券 600株
ＴＯＫＡＩホールディングス	92,200	895.00	82,519,000	貸付有価証券 11,400株
黒谷	3,900	441.00	1,719,900	貸付有価証券 400株
Ｃｏｍｉｎｉｘ	3,000	805.00	2,415,000	貸付有価証券 300株
三洋貿易	8,800	2,384.00	20,979,200	貸付有価証券 1,000株
ビューティガレージ	2,800	1,530.00	4,284,000	貸付有価証券 1,800株
ウイン・パートナーズ	11,300	1,195.00	13,503,500	貸付有価証券 1,300株
ミタチ産業	5,200	705.00	3,666,000	貸付有価証券 800株
シップヘルスケアホールディングス	36,400	4,720.00	171,808,000	貸付有価証券 4,400株
明治電機工業	5,500	1,411.00	7,760,500	貸付有価証券 600株
デリカフーズホールディングス	3,100	1,456.00	4,513,600	貸付有価証券 300株
スターティアホールディングス	3,400	525.00	1,785,000	貸付有価証券 500株
コメダホールディングス	40,400	2,010.00	81,204,000	貸付有価証券 26,400株
富士興産	6,700	948.00	6,351,600	貸付有価証券 1,200株
協栄産業	2,100	1,423.00	2,988,300	貸付有価証券 200株
小野建	15,600	1,404.00	21,902,400	貸付有価証券 1,900株
南陽	3,500	1,498.00	5,243,000	貸付有価証券 400株
佐鳥電機	12,800	866.00	11,084,800	貸付有価証券 2,000株
エコートレーディング	4,000	522.00	2,088,000	貸付有価証券 1,200株
伯東	12,000	1,205.00	14,460,000	貸付有価証券 1,400株
コンドーテック	13,500	941.00	12,703,500	貸付有価証券

				1,600株
中山福	10,000	561.00	5,610,000	貸付有価証券 1,200株
ナガイレーベン	25,300	2,407.00	60,897,100	貸付有価証券 3,000株
三菱食品	19,200	2,760.00	52,992,000	貸付有価証券 2,300株
松田産業	12,700	1,479.00	18,783,300	貸付有価証券 1,500株
第一興商	26,000	4,970.00	129,220,000	貸付有価証券 3,100株
メディopalホールディング グス	188,400	2,321.00	437,276,400	貸付有価証券 23,000株
S P K	3,700	2,395.00	8,861,500	貸付有価証券 400株
萩原電気ホールディング ス	6,500	2,745.00	17,842,500	貸付有価証券 700株
アズワン	12,500	9,590.00	119,875,000	貸付有価証券 1,500株
スズデン	6,000	1,323.00	7,938,000	貸付有価証券 2,700株
尾家産業	5,600	1,325.00	7,420,000	貸付有価証券 600株
シモジマ	10,700	1,109.00	11,866,300	貸付有価証券 1,300株
ドウシシャ	16,500	1,751.00	28,891,500	貸付有価証券 2,000株
小津産業	3,800	1,663.00	6,319,400	貸付有価証券 400株
高速	10,400	1,148.00	11,939,200	貸付有価証券 1,200株
たけびし	6,100	1,328.00	8,100,800	貸付有価証券 700株
リックス	3,900	1,443.00	5,627,700	貸付有価証券 400株
丸文	15,400	559.00	8,608,600	貸付有価証券 1,800株
ハピネット	14,600	1,314.00	19,184,400	貸付有価証券 1,900株
橋本総業ホールディング ス	3,500	1,556.00	5,446,000	貸付有価証券 400株
日本ライフライン	54,700	1,709.00	93,482,300	貸付有価証券

				28,500株（400株）
タカショー	8,500	455.00	3,867,500	貸付有価証券 1,200株
エクセル	6,500	1,597.00	10,380,500	貸付有価証券 700株
マルカ	5,600	1,901.00	10,645,600	貸付有価証券 600株
I D O M	58,800	288.00	16,934,400	貸付有価証券 14,000株
日本エム・ディ・エム	10,200	1,415.00	14,433,000	貸付有価証券 1,200株
進和	10,300	2,189.00	22,546,700	貸付有価証券 6,700株
エスケイジャパン	4,200	503.00	2,112,600	貸付有価証券 2,600株（1,200株）
ダイトロン	8,000	1,202.00	9,616,000	
シークス	22,200	1,260.00	27,972,000	貸付有価証券 2,600株
田中商事	5,800	593.00	3,439,400	貸付有価証券 700株
オーハシテクニカ	9,800	1,432.00	14,033,600	貸付有価証券 1,200株
白銅	5,600	1,342.00	7,515,200	貸付有価証券 600株
伊藤忠商事	1,221,100	2,075.00	2,533,782,500	貸付有価証券 149,600株
丸紅	1,721,600	729.20	1,255,390,720	貸付有価証券 210,900株
高島	2,800	1,686.00	4,720,800	貸付有価証券 300株
長瀬産業	98,200	1,621.00	159,182,200	貸付有価証券 12,000株
蝶理	11,100	1,700.00	18,870,000	貸付有価証券 1,300株
豊田通商	194,800	3,290.00	640,892,000	貸付有価証券 23,800株
三共生興	29,700	528.00	15,681,600	貸付有価証券 3,800株
兼松	69,800	1,218.00	85,016,400	貸付有価証券 8,600株
ツカモトコーポレーショ ン	3,100	1,073.00	3,326,300	貸付有価証券 300株

三井物産	1,438,300	1,784.50	2,566,646,350	貸付有価証券 176,200株
日本紙パルプ商事	9,900	3,640.00	36,036,000	貸付有価証券 1,200株
日立ハイテクノロジーズ	53,100	5,550.00	294,705,000	貸付有価証券 6,500株
カメイ	22,800	1,116.00	25,444,800	貸付有価証券 2,700株
東都水産	2,400	2,579.00	6,189,600	貸付有価証券 200株
ＯＵＧホールディングス	2,800	2,627.00	7,355,600	貸付有価証券 300株
スターゼン	6,400	4,195.00	26,848,000	貸付有価証券 800株
山善	68,200	1,055.00	71,951,000	貸付有価証券 8,300株
椿本興業	3,900	3,290.00	12,831,000	貸付有価証券 400株
住友商事	1,032,500	1,613.00	1,665,422,500	貸付有価証券 127,000株
内田洋行	7,500	3,500.00	26,250,000	貸付有価証券 900株
三菱商事	1,225,100	2,884.50	3,533,800,950	貸付有価証券 150,100株
第一実業	7,900	3,090.00	24,411,000	貸付有価証券 900株
キャノンマーケティング ジャパン	49,900	2,339.00	116,716,100	
西華産業	9,900	1,336.00	13,226,400	貸付有価証券 1,300株
佐藤商事	15,600	887.00	13,837,200	貸付有価証券 1,900株
菱洋エレクトロ	17,700	1,744.00	30,868,800	貸付有価証券 2,100株
東京産業	17,400	487.00	8,473,800	貸付有価証券 3,100株
ユアサ商事	17,800	3,005.00	53,489,000	貸付有価証券 2,100株
神鋼商事	3,900	2,324.00	9,063,600	貸付有価証券 400株
小林産業	10,400	318.00	3,307,200	貸付有価証券 2,100株

阪和興業	30,300	2,853.00	86,445,900	貸付有価証券 4,000株
正栄食品工業	12,200	3,270.00	39,894,000	貸付有価証券 6,500株
カナデン	15,700	1,355.00	21,273,500	貸付有価証券 2,000株
菱電商事	13,800	1,644.00	22,687,200	貸付有価証券 1,600株
フルサト工業	9,600	1,416.00	13,593,600	貸付有価証券 1,100株
岩谷産業	38,700	3,730.00	144,351,000	貸付有価証券 19,800株（12,500株）
すてきナイスグループ	7,400	523.00	3,870,200	貸付有価証券 4,800株
昭光通商	6,200	628.00	3,893,600	
ニチモウ	2,700	1,735.00	4,684,500	貸付有価証券 300株
極東貿易	5,400	1,464.00	7,905,600	貸付有価証券 600株
イワキ	20,900	512.00	10,700,800	貸付有価証券 2,500株
三愛石油	46,900	1,041.00	48,822,900	貸付有価証券 5,700株
稲畑産業	41,900	1,399.00	58,618,100	貸付有価証券 5,100株
G S I クレオス	4,600	1,185.00	5,451,000	貸付有価証券 500株
明和産業	16,100	370.00	5,957,000	貸付有価証券 1,900株
クワザワ	6,200	456.00	2,827,200	貸付有価証券 700株
ワキタ	37,200	1,041.00	38,725,200	貸付有価証券 4,500株
東邦ホールディングス	51,700	2,464.00	127,388,800	貸付有価証券 33,000株（18,300株）
サンゲツ	51,900	2,073.00	107,588,700	貸付有価証券 6,300株
ミツウロコグループホールディングス	23,200	805.00	18,676,000	貸付有価証券 3,100株
シナネンホールディングス	7,200	1,811.00	13,039,200	貸付有価証券 800株
伊藤忠エネクス	38,600	857.00	33,080,200	貸付有価証券

				4,700株
サンリオ	53,900	2,438.00	131,408,200	貸付有価証券 12,400株
サンワテクノス	10,600	839.00	8,893,400	貸付有価証券 1,200株
リョーサン	19,300	2,532.00	48,867,600	貸付有価証券 2,300株
新光商事	16,400	1,896.00	31,094,400	貸付有価証券 2,000株
トーホー	7,900	2,018.00	15,942,200	貸付有価証券 900株
三信電気	12,000	1,798.00	21,576,000	貸付有価証券 2,000株
東陽テクニカ	20,100	928.00	18,652,800	貸付有価証券 2,500株
モスフードサービス	22,900	2,335.00	53,471,500	貸付有価証券 3,900株
加賀電子	17,400	1,518.00	26,413,200	貸付有価証券 2,200株
ソーダニッカ	18,000	604.00	10,872,000	貸付有価証券 2,300株
立花エレテック	12,900	1,772.00	22,858,800	貸付有価証券 1,500株
フォーバル	7,600	893.00	6,786,800	貸付有価証券 900株
P A L T A C	31,500	5,770.00	181,755,000	貸付有価証券 4,000株
三谷産業	20,400	278.00	5,671,200	貸付有価証券 5,900株
太平洋興発	6,900	760.00	5,244,000	貸付有価証券 800株
西本W i s m e t t a c ホールディングス	3,900	3,520.00	13,728,000	
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,400	1,198.00	1,677,200	貸付有価証券 100株
国際紙パルプ商事	40,700	277.00	11,273,900	貸付有価証券 7,800株
ヤマタネ	8,700	1,347.00	11,718,900	貸付有価証券 1,000株
丸紅建材リース	1,700	1,695.00	2,881,500	貸付有価証券 200株
日鉄物産	12,400	4,375.00	54,250,000	貸付有価証券

				1,500株
泉州電業	5,800	2,768.00	16,054,400	貸付有価証券 700株
トラスコ中山	36,300	2,288.00	83,054,400	
オートバックスセブン	69,400	1,784.00	123,809,600	貸付有価証券 9,300株
モリト	12,700	759.00	9,639,300	貸付有価証券 1,700株
加藤産業	27,300	3,310.00	90,363,000	貸付有価証券 3,300株
北恵	3,300	851.00	2,808,300	貸付有価証券 400株
イノテック	10,400	857.00	8,912,800	貸付有価証券 1,200株
イエローハット	33,000	1,448.00	47,784,000	貸付有価証券 4,000株
J Kホールディングス	15,800	562.00	8,879,600	貸付有価証券 1,900株
日伝	14,500	1,915.00	27,767,500	貸付有価証券 1,700株
北沢産業	13,100	264.00	3,458,400	貸付有価証券 1,600株
杉本商事	9,400	2,045.00	19,223,000	貸付有価証券 1,100株
因幡電機産業	24,800	4,450.00	110,360,000	貸付有価証券 3,000株
東テク	5,800	2,220.00	12,876,000	貸付有価証券 700株
ミスミグループ本社	218,600	2,635.00	576,011,000	貸付有価証券 80,700株
アルテック	12,800	211.00	2,700,800	貸付有価証券 2,700株
タキヒヨー	5,300	1,860.00	9,858,000	貸付有価証券 600株
蔵王産業	2,800	1,330.00	3,724,000	貸付有価証券 300株
スズケン	79,600	6,360.00	506,256,000	貸付有価証券 9,700株
ジェコス	12,000	964.00	11,568,000	貸付有価証券 1,400株
ルネサスイーストン	16,000	451.00	7,216,000	貸付有価証券 1,900株

ローソン	44,200	5,190.00	229,398,000	貸付有価証券 20,300株
サンエー	13,200	4,355.00	57,486,000	貸付有価証券 2,100株
カワチ薬品	13,500	1,970.00	26,595,000	貸付有価証券 1,600株
エービーシー・マート	27,300	6,980.00	190,554,000	貸付有価証券 3,300株
ハードオフコーポレーション	6,900	680.00	4,692,000	貸付有価証券 800株
アスクル	18,200	2,506.00	45,609,200	貸付有価証券 8,800株
ゲオホールディングス	26,600	1,367.00	36,362,200	貸付有価証券 3,200株
アダストリア	24,200	2,405.00	58,201,000	貸付有価証券 3,400株
ジーフット	10,500	641.00	6,730,500	貸付有価証券 7,000株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,200	652.00	1,434,400	貸付有価証券 200株
くら寿司	10,300	4,550.00	46,865,000	貸付有価証券 3,700株（1,200株）
キャンドゥ	8,300	1,623.00	13,470,900	貸付有価証券 1,200株
パルグループホールディングス	8,900	3,265.00	29,058,500	貸付有価証券 1,000株
エディオン	74,000	964.00	71,336,000	貸付有価証券 38,000株
サーラコーポレーション	35,400	583.00	20,638,200	貸付有価証券 4,300株
ワッツ	7,700	680.00	5,236,000	貸付有価証券 900株
ハローズ	6,600	2,355.00	15,543,000	貸付有価証券 2,900株
フジオフードシステム	7,300	2,760.00	20,148,000	貸付有価証券 2,700株
あみやき亭	3,800	3,420.00	12,996,000	貸付有価証券 400株
ひらまつ	34,800	343.00	11,936,400	貸付有価証券 4,600株
大黒天物産	4,200	3,385.00	14,217,000	貸付有価証券 500株

ハニーズホールディングス	15,400	1,028.00	15,831,200	貸付有価証券 2,000株
ファーマライズホールディングス	4,100	511.00	2,095,100	貸付有価証券 500株
アルペン	13,400	1,582.00	21,198,800	貸付有価証券 8,900株
ハブ	5,600	1,230.00	6,888,000	貸付有価証券 600株
クオールホールディングス	25,700	1,622.00	41,685,400	貸付有価証券 3,200株
ジンズ	9,200	6,070.00	55,844,000	貸付有価証券 4,800株
ピックカメラ	103,500	1,086.00	112,401,000	貸付有価証券 60,600株
D C Mホールディングス	94,200	1,043.00	98,250,600	貸付有価証券 62,000株（200株）
ペッパーフードサービス	13,800	1,829.00	25,240,200	貸付有価証券 9,200株（2,900株）
M o n o t a R O	110,300	2,600.00	286,780,000	貸付有価証券 6,800株
東京一番フーズ	4,400	600.00	2,640,000	貸付有価証券 1,000株（500株）
D Dホールディングス	3,900	2,143.00	8,357,700	貸付有価証券 700株
きちりホールディングス	4,600	718.00	3,302,800	貸付有価証券 1,800株
アークランドサービス ホールディングス	12,700	1,861.00	23,634,700	貸付有価証券 7,000株
J . フロント リテイ リング	223,300	1,235.00	275,775,500	貸付有価証券 29,800株
ドトール・日レスホール ディングス	30,600	2,044.00	62,546,400	貸付有価証券 4,000株
マツモトキヨシホール ディングス	72,200	3,140.00	226,708,000	貸付有価証券 8,800株
ブロンコピリー	9,100	2,222.00	20,220,200	貸付有価証券 5,000株（200株）
Z O Z O	188,700	1,928.00	363,813,600	貸付有価証券 38,000株
トレジャー・ファクト リー	5,100	840.00	4,284,000	貸付有価証券 1,300株
物語コーポレーション	4,300	8,550.00	36,765,000	貸付有価証券 2,800株

ココカラファイン	19,600	5,580.00	109,368,000	貸付有価証券 2,300株
三越伊勢丹ホールディングス	326,700	867.00	283,248,900	貸付有価証券 42,100株
H a m e e	5,300	707.00	3,747,100	貸付有価証券 600株
ウエルシアホールディングス	46,100	4,350.00	200,535,000	貸付有価証券 28,900株
クリエイト S D ホールディングス	25,700	2,488.00	63,941,600	貸付有価証券 3,100株
丸善 C H I ホールディングス	20,400	378.00	7,711,200	貸付有価証券 13,600株
ミサワ	3,100	432.00	1,339,200	貸付有価証券 1,600株（1,300株）
ティーライフ	2,300	897.00	2,063,100	貸付有価証券 1,500株
エー・ピーカンパニー	3,300	465.00	1,534,500	貸付有価証券 2,200株
チムニー	5,300	2,396.00	12,698,800	貸付有価証券 3,400株
シュッピン	11,900	824.00	9,805,600	貸付有価証券 1,500株
ネクステージ	28,000	1,132.00	31,696,000	貸付有価証券 10,000株（4,100株）
ジョイフル本田	51,100	1,243.00	63,517,300	貸付有価証券 9,900株
鳥貴族	5,800	2,121.00	12,301,800	貸付有価証券 3,700株（600株）
キリン堂ホールディングス	6,900	1,693.00	11,681,700	貸付有価証券 800株
ホットランド	9,200	1,581.00	14,545,200	貸付有価証券 6,100株
すかいらーくホールディングス	162,700	1,911.00	310,919,700	貸付有価証券 89,100株（17,500株）
S F P ホールディングス	7,400	1,787.00	13,223,800	貸付有価証券 900株
綿半ホールディングス	6,500	2,433.00	15,814,500	貸付有価証券 2,000株
ヨシックス	2,800	2,371.00	6,638,800	貸付有価証券 500株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	50,700	944.00	47,860,800	貸付有価証券 33,200株

ゴルフダイジェスト・オンライン	7,000	646.00	4,522,000	貸付有価証券 3,800株
B E E N O S	6,100	1,700.00	10,370,000	貸付有価証券 1,600株
あさひ	14,400	1,239.00	17,841,600	貸付有価証券 1,700株
日本調剤	6,200	3,530.00	21,886,000	貸付有価証券 1,100株
コスモス薬品	7,700	17,990.00	138,523,000	貸付有価証券 5,100株
トーエル	8,400	732.00	6,148,800	貸付有価証券 1,000株
オンリー	3,000	810.00	2,430,000	貸付有価証券 2,000株
セブン & アイ・ホールディングス	731,700	3,648.00	2,669,241,600	貸付有価証券 164,500株
薬王堂	7,600	2,365.00	17,974,000	貸付有価証券 2,300株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	46,900	1,353.00	63,455,700	貸付有価証券 21,400株
ツルハホールディングス	37,900	9,730.00	368,767,000	貸付有価証券 6,000株
サンマルクホールディングス	13,800	2,300.00	31,740,000	貸付有価証券 1,600株
フェリシモ	3,900	1,007.00	3,927,300	貸付有価証券 2,500株
トリドールホールディングス	21,500	1,972.00	42,398,000	貸付有価証券 13,700株
T O K Y O B A S E	15,600	811.00	12,651,600	貸付有価証券 2,200株
ウイルプラスホールディングス	2,700	826.00	2,230,200	貸付有価証券 1,500株
ジャパンミート	8,800	1,737.00	15,285,600	貸付有価証券 1,000株
サツドラホールディングス	2,600	1,852.00	4,815,200	貸付有価証券 500株
デファクトスタンダード	1,500	348.00	522,000	貸付有価証券 400株
アレンザホールディングス	9,400	854.00	8,027,600	貸付有価証券 1,300株
パロックジャパンリミテッド	14,100	884.00	12,464,400	貸付有価証券 2,900株（600株）

クスリのアオキホールディングス	17,300	7,420.00	128,366,000	貸付有価証券 9,600株
力の源ホールディングス	6,500	715.00	4,647,500	貸付有価証券 2,800株
スシローグローバルホールディングス	19,200	6,550.00	125,760,000	貸付有価証券 12,800株（800株）
L I X I L ビバ	14,800	1,167.00	17,271,600	貸付有価証券 1,800株
メディカルシステムネットワーク	18,500	506.00	9,361,000	貸付有価証券 9,500株
はるやまホールディングス	8,200	820.00	6,724,000	貸付有価証券 1,000株
ノジマ	31,000	1,737.00	53,847,000	貸付有価証券 3,800株
カップ・クリエイト	24,500	1,348.00	33,026,000	貸付有価証券 3,000株
ライトオン	13,000	720.00	9,360,000	貸付有価証券 1,500株
ジーンズメイト	5,300	319.00	1,690,700	貸付有価証券 2,700株
良品計画	24,700	18,940.00	467,818,000	貸付有価証券 3,600株
三城ホールディングス	21,600	330.00	7,128,000	貸付有価証券 2,600株
アドヴァン	26,700	1,067.00	28,488,900	貸付有価証券 3,600株
アルピス	6,600	2,329.00	15,371,400	貸付有価証券 800株
コナカ	20,600	411.00	8,466,600	貸付有価証券 2,700株
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,635.00	3,433,500	貸付有価証券 200株
G - 7 ホールディングス	5,100	2,955.00	15,070,500	貸付有価証券 600株
イオン北海道	17,500	734.00	12,845,000	貸付有価証券 2,100株
コジマ	30,000	482.00	14,460,000	貸付有価証券 20,100株
ヒマラヤ	6,100	853.00	5,203,300	貸付有価証券 700株
コーナン商事	22,900	2,238.00	51,250,200	貸付有価証券 2,800株

エコス	6,400	1,392.00	8,908,800	貸付有価証券 800株
ワタミ	22,900	1,429.00	32,724,100	貸付有価証券 15,000株（1,500株）
マルシェ	4,600	769.00	3,537,400	貸付有価証券 1,600株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	104,500	6,830.00	713,735,000	
西松屋チェーン	38,300	822.00	31,482,600	貸付有価証券 25,600株
ゼンショーホールディン グス	82,400	2,116.00	174,358,400	貸付有価証券 10,700株（100株）
幸楽苑ホールディングス	11,100	2,753.00	30,558,300	貸付有価証券 3,800株
ハークスレイ	3,600	1,055.00	3,798,000	貸付有価証券 400株
サイゼリヤ	28,800	2,371.00	68,284,800	貸付有価証券 18,900株
V Tホールディングス	78,800	424.00	33,411,200	貸付有価証券 9,800株
魚力	4,800	1,488.00	7,142,400	貸付有価証券 3,100株
ポプラ	4,500	481.00	2,164,500	貸付有価証券 1,400株
フジ・コーポレーション	4,600	2,098.00	9,650,800	貸付有価証券 600株
ユナイテッドアローズ	20,000	3,370.00	67,400,000	貸付有価証券 2,400株
ハイデイ日高	25,200	1,965.00	49,518,000	貸付有価証券 16,800株
京都きもの友禅	11,100	348.00	3,862,800	貸付有価証券 7,200株
コロワイド	58,000	2,014.00	116,812,000	貸付有価証券 34,800株
ピーシーデポコーポレー ション	23,200	429.00	9,952,800	貸付有価証券 2,900株
壱番屋	12,300	4,455.00	54,796,500	貸付有価証券 8,000株
トップカルチャー	6,300	360.00	2,268,000	貸付有価証券 3,400株（2,200株）
P L A N T	4,500	800.00	3,600,000	貸付有価証券 500株

スギホールディングス	38,300	5,100.00	195,330,000	貸付有価証券 21,600株
ヴィア・ホールディングス	21,400	596.00	12,754,400	貸付有価証券 7,500株
スクロール	26,800	335.00	8,978,000	貸付有価証券 3,300株
ヨンドシーホールディングス	19,400	2,470.00	47,918,000	貸付有価証券 2,500株
ユニー・ファミリーマートホールディングス	195,300	2,615.00	510,709,500	貸付有価証券 45,200株
木曽路	21,400	2,502.00	53,542,800	貸付有価証券 2,600株
S R S ホールディングス	20,600	996.00	20,517,600	貸付有価証券 2,500株
千趣会	31,600	260.00	8,216,000	貸付有価証券 17,300株（400株）
タカキュー	13,500	172.00	2,322,000	貸付有価証券 3,200株
ケーヨー	32,300	469.00	15,148,700	貸付有価証券 3,900株
上新電機	20,600	2,100.00	43,260,000	貸付有価証券 2,500株
日本瓦斯	28,400	2,754.00	78,213,600	貸付有価証券 3,800株
ロイヤルホールディングス	30,500	2,678.00	81,679,000	貸付有価証券 20,400株
東天紅	1,300	1,196.00	1,554,800	貸付有価証券 100株
いなげや	19,500	1,370.00	26,715,000	貸付有価証券 2,500株
島忠	36,900	2,418.00	89,224,200	貸付有価証券 23,800株
チヨダ	18,300	1,604.00	29,353,200	貸付有価証券 2,200株
ライフコーポレーション	13,200	2,099.00	27,706,800	貸付有価証券 1,600株
リンガーハット	21,500	2,235.00	48,052,500	貸付有価証券 14,400株
M r M a x H D	24,000	446.00	10,704,000	貸付有価証券 2,900株
テンアライド	16,100	412.00	6,633,200	貸付有価証券 10,500株

A O K I ホールディングス	34,900	1,080.00	37,692,000	貸付有価証券 4,300株
オークワ	24,900	1,114.00	27,738,600	貸付有価証券 3,000株
コメリ	26,900	2,207.00	59,368,300	貸付有価証券 3,200株
青山商事	30,500	2,060.00	62,830,000	貸付有価証券 4,100株（400株）
しまむら	20,300	7,980.00	161,994,000	貸付有価証券 4,400株
はせがわ	9,200	400.00	3,680,000	貸付有価証券 1,500株（400株）
高島屋	137,000	1,114.00	152,618,000	貸付有価証券 33,300株
松屋	35,200	861.00	30,307,200	貸付有価証券 4,800株
エイチ・ツー・オー リ テイリング	89,600	1,200.00	107,520,000	貸付有価証券 11,300株
近鉄百貨店	6,700	3,210.00	21,507,000	貸付有価証券 1,600株
パルコ	16,800	1,045.00	17,556,000	貸付有価証券 3,600株
丸井グループ	147,700	2,227.00	328,927,900	貸付有価証券 36,700株
アクシアル リテイリン グ	14,500	3,670.00	53,215,000	貸付有価証券 1,700株
井筒屋	8,800	256.00	2,252,800	貸付有価証券 200株
イオン	671,800	1,863.00	1,251,563,400	貸付有価証券 83,100株
イズミ	35,500	4,300.00	152,650,000	貸付有価証券 4,500株
平和堂	35,400	1,882.00	66,622,800	貸付有価証券 4,300株
フジ	21,100	1,765.00	37,241,500	貸付有価証券 2,500株
ヤオコー	19,800	4,890.00	96,822,000	貸付有価証券 9,900株
ゼビオホールディングス	21,100	1,240.00	26,164,000	貸付有価証券 2,500株
ケーズホールディングス	181,400	1,028.00	186,479,200	貸付有価証券 22,200株

O l y m p i c グループ	10,300	674.00	6,942,200	貸付有価証券 4,100株（2,500株）
日産東京販売ホールディングス	25,700	274.00	7,041,800	貸付有価証券 3,100株
G e n k y D r u g S t o r e s	8,500	2,472.00	21,012,000	貸付有価証券 2,000株
総合メディカルホールディングス	15,200	1,690.00	25,688,000	貸付有価証券 1,800株
ブックオフグループホールディングス	9,000	1,076.00	9,684,000	貸付有価証券 5,900株
アインホールディングス	23,400	6,260.00	146,484,000	貸付有価証券 11,000株
元気寿司	4,900	3,270.00	16,023,000	貸付有価証券 700株
ヤマダ電機	531,900	488.00	259,567,200	貸付有価証券 173,600株（27,000株）
アークランドサカモト	29,600	1,317.00	38,983,200	貸付有価証券 3,600株
ニトリホールディングス	75,600	13,390.00	1,012,284,000	貸付有価証券 9,200株
グルメ杵屋	12,400	1,137.00	14,098,800	貸付有価証券 1,500株
愛眼	13,900	241.00	3,349,900	貸付有価証券 3,000株
ケーユーホールディングス	9,100	870.00	7,917,000	貸付有価証券 1,100株
吉野家ホールディングス	60,900	1,801.00	109,680,900	貸付有価証券 40,800株（1,000株）
松屋フーズホールディングス	8,400	3,280.00	27,552,000	貸付有価証券 1,200株
サガミホールディングス	23,300	1,323.00	30,825,900	貸付有価証券 2,800株
関西スーパーマーケット	13,200	1,089.00	14,374,800	貸付有価証券 1,600株
王将フードサービス	12,800	6,420.00	82,176,000	貸付有価証券 1,500株
ブレナス	19,500	1,753.00	34,183,500	貸付有価証券 6,000株
ミニストップ	12,900	1,561.00	20,136,900	貸付有価証券 8,300株
アークス	32,700	2,138.00	69,912,600	貸付有価証券

				19,800株
パローホールディングス	37,700	2,241.00	84,485,700	貸付有価証券 4,600株
藤久	1,400	736.00	1,030,400	貸付有価証券 800株
ベルク	8,600	5,290.00	45,494,000	貸付有価証券 1,000株
大庄	9,300	1,571.00	14,610,300	貸付有価証券 3,700株
ファーストリテイリング	23,400	66,530.00	1,556,802,000	貸付有価証券 2,800株
サンドラッグ	65,700	2,820.00	185,274,000	貸付有価証券 8,000株
サックスパー ホール ディングス	14,800	960.00	14,208,000	貸付有価証券 1,800株
ヤマザワ	3,600	1,668.00	6,004,800	貸付有価証券 400株
やまや	3,000	2,071.00	6,213,000	貸付有価証券 300株
ペルーナ	42,800	725.00	31,030,000	貸付有価証券 5,600株
島根銀行	3,700	717.00	2,652,900	貸付有価証券 800株
じもとホールディングス	118,100	97.00	11,455,700	貸付有価証券 15,700株
めぶきフィナンシャルグ ループ	908,400	275.00	249,810,000	貸付有価証券 128,400株
東京きらぼしフィナン シャルグループ	23,600	1,651.00	38,963,600	貸付有価証券 2,900株
九州フィナンシャルグ ループ	286,900	423.00	121,358,700	貸付有価証券 39,100株
ゆうちょ銀行	495,300	1,083.00	536,409,900	貸付有価証券 159,500株
富山第一銀行	41,700	306.00	12,760,200	貸付有価証券 5,100株
コンコルディア・フィナ ンシャルグループ	1,096,800	399.00	437,623,200	貸付有価証券 143,800株
西日本フィナンシャル ホールディングス	110,000	759.00	83,490,000	貸付有価証券 13,700株
関西みらいフィナンシャ ルグループ	82,100	701.00	57,552,100	貸付有価証券 10,500株
三十三フィナンシャルグ	15,100	1,497.00	22,604,700	貸付有価証券

ループ				1,800株
第四北越フィナンシャルグループ	30,300	2,768.00	83,870,400	貸付有価証券 3,700株
新生銀行	128,300	1,619.00	207,717,700	貸付有価証券 79,200株
あおぞら銀行	97,600	2,615.00	255,224,000	貸付有価証券 11,900株
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	12,034,800	504.30	6,069,149,640	貸付有価証券 1,536,000株
りそなホールディングス	1,918,500	442.90	849,703,650	貸付有価証券 235,000株
三井住友トラスト・ホールディングス	343,700	3,918.00	1,346,616,600	貸付有価証券 42,900株
三井住友フィナンシャルグループ	1,232,200	3,759.00	4,631,839,800	貸付有価証券 168,900株
千葉銀行	601,300	532.00	319,891,600	貸付有価証券 75,900株
群馬銀行	349,700	380.00	132,886,000	貸付有価証券 42,800株
武蔵野銀行	26,000	2,041.00	53,066,000	貸付有価証券 3,100株
千葉興業銀行	47,900	273.00	13,076,700	貸付有価証券 5,900株
筑波銀行	72,700	171.00	12,431,700	貸付有価証券 8,900株
七十七銀行	54,800	1,503.00	82,364,400	貸付有価証券 6,700株
青森銀行	13,500	2,660.00	35,910,000	貸付有価証券 1,700株
秋田銀行	11,200	1,981.00	22,187,200	貸付有価証券 1,300株
山形銀行	19,600	1,634.00	32,026,400	貸付有価証券 2,400株
岩手銀行	12,200	2,912.00	35,526,400	貸付有価証券 1,500株
東邦銀行	156,300	256.00	40,012,800	貸付有価証券 19,500株
東北銀行	8,900	1,072.00	9,540,800	貸付有価証券 1,000株
みちのく銀行	11,200	1,650.00	18,480,000	貸付有価証券 1,300株
ふくおかフィナンシャル	154,000	1,936.00	298,144,000	貸付有価証券

グループ				18,800株
静岡銀行	440,100	788.00	346,798,800	貸付有価証券 64,800株
十六銀行	23,500	2,145.00	50,407,500	貸付有価証券 2,800株
スルガ銀行	178,900	397.00	71,023,300	貸付有価証券 116,900株
八十二銀行	421,900	438.00	184,792,200	貸付有価証券 52,600株
山梨中央銀行	21,000	1,180.00	24,780,000	貸付有価証券 2,500株
大垣共立銀行	36,800	2,381.00	87,620,800	貸付有価証券 6,700株
福井銀行	14,900	1,465.00	21,828,500	貸付有価証券 1,800株
北國銀行	18,000	3,060.00	55,080,000	貸付有価証券 2,700株
清水銀行	7,200	1,880.00	13,536,000	貸付有価証券 800株
富山銀行	3,400	2,616.00	8,894,400	貸付有価証券 400株
滋賀銀行	35,100	2,443.00	85,749,300	貸付有価証券 8,800株
南都銀行	27,300	2,244.00	61,261,200	貸付有価証券 3,300株
百五銀行	157,300	323.00	50,807,900	貸付有価証券 19,600株
京都銀行	62,600	4,110.00	257,286,000	貸付有価証券 7,600株
紀陽銀行	61,900	1,402.00	86,783,800	貸付有価証券 7,900株
ほくほくフィナンシャル グループ	116,400	1,098.00	127,807,200	貸付有価証券 14,200株
広島銀行	258,100	512.00	132,147,200	貸付有価証券 33,600株
山陰合同銀行	103,700	694.00	71,967,800	貸付有価証券 12,900株
中国銀行	150,400	954.00	143,481,600	貸付有価証券 20,000株
鳥取銀行	6,000	1,411.00	8,466,000	貸付有価証券 700株
伊予銀行	231,600	549.00	127,148,400	貸付有価証券

				28,600株
百十四銀行	18,600	2,159.00	40,157,400	貸付有価証券 2,200株
四国銀行	24,800	917.00	22,741,600	貸付有価証券 3,000株
阿波銀行	26,800	2,560.00	68,608,000	貸付有価証券 5,300株
大分銀行	10,700	3,095.00	33,116,500	貸付有価証券 2,300株
宮崎銀行	11,600	2,503.00	29,034,800	貸付有価証券 1,400株
佐賀銀行	10,600	1,537.00	16,292,200	貸付有価証券 1,300株
沖縄銀行	16,000	3,340.00	53,440,000	貸付有価証券 1,900株
琉球銀行	40,300	1,136.00	45,780,800	貸付有価証券 4,900株
セブン銀行	590,600	284.00	167,730,400	貸付有価証券 83,700株
みずほフィナンシャルグループ	23,756,100	154.60	3,672,693,060	貸付有価証券 3,164,800株
高知銀行	6,300	758.00	4,775,400	貸付有価証券 700株
山口フィナンシャルグループ	218,200	728.00	158,849,600	貸付有価証券 27,200株
長野銀行	5,700	1,751.00	9,980,700	貸付有価証券 700株
名古屋銀行	14,100	3,390.00	47,799,000	貸付有価証券 2,000株
北洋銀行	263,500	250.00	65,875,000	貸付有価証券 32,200株
愛知銀行	6,300	3,665.00	23,089,500	貸付有価証券 700株
中京銀行	7,200	2,214.00	15,940,800	貸付有価証券 1,000株
大光銀行	6,000	1,660.00	9,960,000	貸付有価証券 700株
愛媛銀行	24,400	1,073.00	26,181,200	貸付有価証券 5,200株
トマト銀行	6,700	1,027.00	6,880,900	貸付有価証券 800株
京葉銀行	77,200	617.00	47,632,400	貸付有価証券

				9,400株
栃木銀行	90,500	174.00	15,747,000	貸付有価証券 11,600株
北日本銀行	5,400	1,697.00	9,163,800	貸付有価証券 600株
東和銀行	30,700	690.00	21,183,000	貸付有価証券 3,700株
福島銀行	15,200	250.00	3,800,000	貸付有価証券 1,800株
大東銀行	8,400	560.00	4,704,000	貸付有価証券 1,000株
トモニホールディングス	135,200	362.00	48,942,400	貸付有価証券 17,200株
フィデアホールディングス	169,700	113.00	19,176,100	貸付有価証券 21,000株
池田泉州ホールディングス	185,600	204.00	37,862,400	貸付有価証券 24,000株
F P G	54,900	883.00	48,476,700	貸付有価証券 25,500株
マーキュリアインベストメント	6,700	735.00	4,924,500	貸付有価証券 1,000株
S B I ホールディングス	208,300	2,734.00	569,492,200	貸付有価証券 25,500株
日本アジア投資	14,800	231.00	3,418,800	貸付有価証券 4,300株（800株）
ジャフコ	28,700	3,965.00	113,795,500	貸付有価証券 3,500株
大和証券グループ本社	1,402,800	480.50	674,045,400	貸付有価証券 187,100株
野村ホールディングス	3,076,200	379.30	1,166,802,660	貸付有価証券 550,900株
岡三証券グループ	149,000	398.00	59,302,000	貸付有価証券 18,500株
丸三証券	51,900	571.00	29,634,900	貸付有価証券 34,600株
東洋証券	62,500	117.00	7,312,500	貸付有価証券 8,000株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	208,500	336.00	70,056,000	貸付有価証券 42,300株
光世証券	4,200	655.00	2,751,000	貸付有価証券 1,500株
水戸証券	50,600	194.00	9,816,400	貸付有価証券

			6,200株	
いちよし証券	36,700	733.00	26,901,100	貸付有価証券 4,400株
松井証券	85,600	1,014.00	86,798,400	貸付有価証券 27,400株
だいの証券ビジネス	7,100	475.00	3,372,500	貸付有価証券 900株
マネックスグループ	161,200	372.00	59,966,400	貸付有価証券 105,900株（41,700株）
カブドットコム証券	130,500	558.00	72,819,000	貸付有価証券 59,800株（5,900株）
極東証券	23,500	906.00	21,291,000	貸付有価証券 2,800株
岩井コスモホールディングス	17,900	1,170.00	20,943,000	貸付有価証券 2,100株
藍澤證券	31,400	647.00	20,315,800	貸付有価証券 4,100株
マネーパートナーズグループ	20,500	288.00	5,904,000	貸付有価証券 8,500株
スパークス・グループ	69,200	229.00	15,846,800	貸付有価証券 8,500株
小林洋行	5,000	252.00	1,260,000	貸付有価証券 600株
かんぽ生命保険	66,000	1,986.00	131,076,000	貸付有価証券 8,000株
SOMPOホールディングス	308,200	4,146.00	1,277,797,200	貸付有価証券 37,700株
アニコムホールディングス	14,400	3,850.00	55,440,000	貸付有価証券 9,600株（800株）
MS&ADインシュアランスグループホール	457,100	3,416.00	1,561,453,600	貸付有価証券 56,000株
ソニーフィナンシャルホールディングス	143,700	2,608.00	374,769,600	貸付有価証券 21,300株
第一生命ホールディングス	989,100	1,600.50	1,583,054,550	貸付有価証券 121,100株
東京海上ホールディングス	625,200	5,394.00	3,372,328,800	貸付有価証券 78,000株
T&Dホールディングス	540,700	1,132.50	612,342,750	貸付有価証券 66,200株
アドバンスクリエイト	4,100	1,724.00	7,068,400	貸付有価証券 2,600株

全国保証	49,300	4,135.00	203,855,500	貸付有価証券 32,000株（22,000株）
ジェイリース	4,800	311.00	1,492,800	貸付有価証券 500株
イントラスト	4,900	481.00	2,356,900	貸付有価証券 2,100株
日本モーゲージサービス	3,100	1,132.00	3,509,200	貸付有価証券 300株
C a s a	7,900	1,093.00	8,634,700	貸付有価証券 900株
アルヒ	15,900	2,001.00	31,815,900	貸付有価証券 10,600株（6,900株）
プレミアグループ	10,000	1,997.00	19,970,000	貸付有価証券 1,700株
クレディセゾン	122,500	1,256.00	153,860,000	貸付有価証券 15,100株
芙蓉総合リース	20,000	5,960.00	119,200,000	貸付有価証券 2,400株
興銀リース	32,900	2,668.00	87,777,200	貸付有価証券 4,000株
東京センチュリー	35,200	4,530.00	159,456,000	貸付有価証券 4,300株
日本証券金融	77,000	551.00	42,427,000	貸付有価証券 9,500株
アイフル	266,700	211.00	56,273,700	貸付有価証券 119,000株（800株）
リコーリース	13,800	3,300.00	45,540,000	貸付有価証券 1,600株
イオンフィナンシャル サービス	111,700	1,711.00	191,118,700	貸付有価証券 14,300株
アコム	351,400	376.00	132,126,400	貸付有価証券 51,200株
ジャックス	19,300	2,026.00	39,101,800	貸付有価証券 2,300株
オリエントコーポレー ション	472,800	107.00	50,589,600	貸付有価証券 89,800株
日立キャピタル	41,200	2,371.00	97,685,200	貸付有価証券 5,000株
アプラスフィナンシャル	83,900	69.00	5,789,100	貸付有価証券 29,400株
オリックス	1,166,400	1,601.00	1,867,406,400	貸付有価証券 142,900株

三菱ＵＦＪリース	394,400	580.00	228,752,000	貸付有価証券 48,900株
九州リースサービス	8,600	601.00	5,168,600	貸付有価証券 1,000株
日本取引所グループ	472,300	1,730.00	817,079,000	貸付有価証券 58,200株
イー・ギャランティ	16,400	1,341.00	21,992,400	貸付有価証券 2,000株
アサックス	7,300	560.00	4,088,000	貸付有価証券 800株
ＮＥＣキャピタルソリューション	7,100	1,777.00	12,616,700	貸付有価証券 800株
いちご	222,400	323.00	71,835,200	貸付有価証券 103,900株
日本駐車場開発	191,700	169.00	32,397,300	貸付有価証券 25,800株
スター・マイカ・ホールディングス	8,000	1,589.00	12,712,000	貸付有価証券 1,700株
ヒューリック	364,900	869.00	317,098,100	貸付有価証券 17,600株
三栄建築設計	7,000	1,560.00	10,920,000	貸付有価証券 1,800株（1,000株）
野村不動産ホールディングス	116,500	2,322.00	270,513,000	貸付有価証券 14,200株
三重交通グループホールディングス	35,400	575.00	20,355,000	貸付有価証券 5,500株
サムティ	24,300	1,628.00	39,560,400	貸付有価証券 9,800株（1,700株）
ディア・ライフ	22,400	452.00	10,124,800	貸付有価証券 3,300株
コーセーアールイー	5,100	771.00	3,932,100	貸付有価証券 800株
エー・ディー・ワークス	269,400	34.00	9,159,600	貸付有価証券 45,400株
日本商業開発	10,900	1,435.00	15,641,500	貸付有価証券 1,300株
プレサンスコーポレーション	27,700	1,556.00	43,101,200	貸付有価証券 6,300株
ユニゾホールディングス	26,400	1,849.00	48,813,600	貸付有価証券 3,400株
ＴＨＥグローバル社	8,900	576.00	5,126,400	貸付有価証券 3,300株

日本管理センター	11,500	1,196.00	13,754,000	貸付有価証券 1,300株
サンセイランディック	4,600	756.00	3,477,600	貸付有価証券 2,900株
エストラスト	2,400	718.00	1,723,200	貸付有価証券 300株
フージャースホールディングス	38,000	611.00	23,218,000	貸付有価証券 24,900株（15,900株）
オープンハウス	25,400	4,510.00	114,554,000	貸付有価証券 12,300株
東急不動産ホールディングス	470,200	608.00	285,881,600	貸付有価証券 57,600株
飯田グループホールディングス	145,800	1,726.00	251,650,800	貸付有価証券 20,900株
イーグランド	2,500	678.00	1,695,000	貸付有価証券 400株
ムゲンエステート	12,100	588.00	7,114,800	貸付有価証券 4,800株
ビーロット	3,600	2,375.00	8,550,000	
ファーストブラザーズ	4,800	989.00	4,747,200	貸付有価証券 2,700株
ハウスドゥ	9,600	1,590.00	15,264,000	貸付有価証券 6,400株（3,500株）
シーアールイー	4,300	1,013.00	4,355,900	貸付有価証券 500株
プロパティエージェント	2,300	996.00	2,290,800	貸付有価証券 900株（300株）
ケイアイスター不動産	4,700	1,657.00	7,787,900	貸付有価証券 3,100株（1,900株）
アグレ都市デザイン	2,800	456.00	1,276,800	貸付有価証券 500株
グッドコムアセット	4,000	1,431.00	5,724,000	貸付有価証券 2,000株（200株）
ジェイ・エス・ビー	800	4,025.00	3,220,000	貸付有価証券 100株
テンポイノベーション	1,900	1,545.00	2,935,500	貸付有価証券 200株
グローバル・リンク・マネジメント	1,700	581.00	987,700	
パーク 2 4	102,200	2,472.00	252,638,400	貸付有価証券 37,400株（5,800株）
パラカ	4,500	2,000.00	9,000,000	貸付有価証券

				500株
三井不動産	927,500	2,628.00	2,437,470,000	貸付有価証券 113,600株
三菱地所	1,224,800	2,051.50	2,512,677,200	貸付有価証券 150,000株
平和不動産	33,100	2,247.00	74,375,700	貸付有価証券 6,200株
東京建物	191,000	1,266.00	241,806,000	
ダイビル	51,400	1,005.00	51,657,000	貸付有価証券 6,200株
京阪神ビルディング	30,600	1,001.00	30,630,600	貸付有価証券 3,800株
住友不動産	393,000	3,975.00	1,562,175,000	貸付有価証券 50,900株
テーオーシー	40,000	627.00	25,080,000	貸付有価証券 4,900株
東京楽天地	2,500	5,170.00	12,925,000	貸付有価証券 1,500株
レオパレス 2 1	215,600	278.00	59,936,800	貸付有価証券 144,400株（47,500 株）
スターツコーポレーショ ン	23,800	2,553.00	60,761,400	貸付有価証券 3,100株
フジ住宅	22,300	730.00	16,279,000	貸付有価証券 2,700株
空港施設	20,400	510.00	10,404,000	貸付有価証券 2,500株
明和地所	9,600	553.00	5,308,800	貸付有価証券 1,100株
ゴールドクレスト	13,800	1,916.00	26,440,800	貸付有価証券 1,700株
日本エスリード	6,800	1,582.00	10,757,600	貸付有価証券 800株
日神不動産	25,800	466.00	12,022,800	貸付有価証券 3,100株
日本エスコン	31,600	671.00	21,203,600	貸付有価証券 21,100株（13,800株）
タカラレーベン	79,900	384.00	30,681,600	貸付有価証券 13,700株
サンヨーハウジング名古 屋	9,800	896.00	8,780,800	貸付有価証券 6,500株
イオンモール	87,600	1,635.00	143,226,000	貸付有価証券

				10,700株
毎日コムネット	3,700	714.00	2,641,800	貸付有価証券 600株
ファースト住建	6,500	1,211.00	7,871,500	貸付有価証券 900株
カチタス	19,500	4,095.00	79,852,500	貸付有価証券 11,800株（300株）
トーセイ	24,000	980.00	23,520,000	貸付有価証券 2,900株
穴吹興産	1,900	2,991.00	5,682,900	貸付有価証券 1,000株
サンフロンティア不動産	24,100	1,030.00	24,823,000	貸付有価証券 3,700株
エフ・ジェー・ネクスト	15,300	1,142.00	17,472,600	貸付有価証券 10,200株
インテリックス	4,900	669.00	3,278,100	貸付有価証券 800株
ランドビジネス	7,400	785.00	5,809,000	貸付有価証券 2,200株
グランディハウス	15,300	468.00	7,160,400	貸付有価証券 1,800株
日本空港ビルデング	55,800	4,550.00	253,890,000	貸付有価証券 37,200株
日本工営	11,400	2,429.00	27,690,600	
L I F U L L	59,100	479.00	28,308,900	貸付有価証券 10,600株
ジェイエイシーリクルー トメント	13,600	2,505.00	34,068,000	貸付有価証券 2,200株
日本M & A センター	126,200	2,677.00	337,837,400	貸付有価証券 20,300株
メンバーズ	5,700	1,923.00	10,961,100	貸付有価証券 3,800株
中広	1,700	578.00	982,600	貸付有価証券 200株
アイティメディア	3,300	620.00	2,046,000	貸付有価証券 1,000株
タケエイ	17,600	919.00	16,174,400	貸付有価証券 2,200株
E・Jホールディングス	2,100	1,058.00	2,221,800	貸付有価証券 200株
トラスト・テック	9,300	3,245.00	30,178,500	
コシダカホールディング	40,800	1,461.00	59,608,800	貸付有価証券

ス				27,300株（21,400株）
アルトナー	4,100	787.00	3,226,700	貸付有価証券 400株
パソナグループ	20,600	1,619.00	33,351,400	貸付有価証券 12,900株
C D S	4,200	1,341.00	5,632,200	貸付有価証券 200株
リンクアンドモチベー ション	31,100	601.00	18,691,100	貸付有価証券 20,800株（200株）
G C A	17,200	732.00	12,590,400	
エス・エム・エス	62,200	2,574.00	160,102,800	貸付有価証券 7,600株
サニーサイドアップ	1,900	2,192.00	4,164,800	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
パーソルホールディング ス	169,300	2,536.00	429,344,800	貸付有価証券 20,700株
リニカル	9,500	991.00	9,414,500	貸付有価証券 2,500株
クックパッド	53,200	305.00	16,226,000	貸付有価証券 34,900株（2,000株）
エスクリ	4,600	779.00	3,583,400	貸付有価証券 500株
アイ・ケイ・ケイ	8,200	708.00	5,805,600	貸付有価証券 2,200株（200株）
学情	6,900	1,257.00	8,673,300	貸付有価証券 3,600株
スタジオアリス	8,500	2,070.00	17,595,000	貸付有価証券 5,500株
シミックホールディング ス	9,400	2,055.00	19,317,000	貸付有価証券 1,100株
N J S	3,700	1,774.00	6,563,800	
総合警備保障	67,400	5,150.00	347,110,000	貸付有価証券 8,200株
カカココム	126,800	2,022.00	256,389,600	貸付有価証券 64,700株
セントケア・ホールディ ング	12,300	460.00	5,658,000	貸付有価証券 8,000株
サイネックス	2,800	619.00	1,733,200	貸付有価証券 400株
ルネサンス	9,400	1,772.00	16,656,800	貸付有価証券 1,100株
ディップ	27,300	1,825.00	49,822,500	貸付有価証券

				18,200株（9,400株）
オプトホールディング	10,400	1,610.00	16,744,000	貸付有価証券 6,900株
新日本科学	22,900	701.00	16,052,900	貸付有価証券 14,800株
ツクイ	39,900	523.00	20,867,700	貸付有価証券 4,800株
キャリアデザインセン ター	4,300	1,596.00	6,862,800	貸付有価証券 500株
ベネフィット・ワン	46,900	1,895.00	88,875,500	貸付有価証券 9,400株
エムスリー	356,600	1,972.00	703,215,200	貸付有価証券 63,300株
ツカダ・グローバルホー ルディング	10,800	602.00	6,501,600	貸付有価証券 5,900株
プラス	1,900	664.00	1,261,600	貸付有価証券 200株
アウトソーシング	89,300	1,321.00	117,965,300	貸付有価証券 11,400株（2,000株）
ウェルネット	16,000	1,015.00	16,240,000	貸付有価証券 3,700株（1,700株）
ワールドホールディング ス	4,700	1,753.00	8,239,100	
ディー・エヌ・エー	91,300	2,084.00	190,269,200	貸付有価証券 19,200株
博報堂D Yホールディン グス	235,500	1,840.00	433,320,000	貸付有価証券 28,800株
ぐるなび	24,100	688.00	16,580,800	貸付有価証券 16,100株（4,400株）
タカミヤ	17,500	783.00	13,702,500	貸付有価証券 10,600株
ジャパンベストレス キューシステム	11,500	1,539.00	17,698,500	貸付有価証券 7,500株
ファンコミュニケーション ズ	46,600	544.00	25,350,400	貸付有価証券 2,100株（2,000株）
ライク	6,700	1,368.00	9,165,600	貸付有価証券 2,400株
ビジネス・ブレイクス ルー	7,100	350.00	2,485,000	貸付有価証券 800株
W D Bホールディングス	7,700	2,784.00	21,436,800	貸付有価証券 900株
ティア	9,900	635.00	6,286,500	貸付有価証券

				1,200株
C D G	1,500	1,337.00	2,005,500	貸付有価証券 500株
バリューコマース	11,400	2,528.00	28,819,200	貸付有価証券 2,900株（2,800株）
インフォマート	92,800	1,812.00	168,153,600	貸付有価証券 11,500株
J P ホールディングス	48,300	290.00	14,007,000	貸付有価証券 6,200株
E P S ホールディングス	25,500	1,681.00	42,865,500	貸付有価証券 3,100株
レグス	4,200	1,654.00	6,946,800	貸付有価証券 2,100株（2,100株）
プレステージ・インター ナショナル	31,700	1,702.00	53,953,400	貸付有価証券 3,800株
アミューズ	10,200	2,454.00	25,030,800	貸付有価証券 1,400株
ドリームインキュベータ	5,100	1,485.00	7,573,500	
クイック	10,500	1,615.00	16,957,500	貸付有価証券 1,200株
T A C	9,200	190.00	1,748,000	貸付有価証券 1,400株
ケネディクス	148,800	530.00	78,864,000	
電通	206,300	3,850.00	794,255,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	6,500	1,095.00	7,117,500	貸付有価証券 1,900株（900株）
ぴあ	4,800	4,805.00	23,064,000	貸付有価証券 2,000株
イオンファンタジー	5,400	2,210.00	11,934,000	貸付有価証券 3,600株
シーティーエス	19,100	670.00	12,797,000	貸付有価証券 9,200株
ネクシィーズグループ	5,900	2,242.00	13,227,800	貸付有価証券 1,100株（300株）
みらかホールディングス	47,400	2,513.00	119,116,200	貸付有価証券 6,400株
アルプス技研	14,900	1,882.00	28,041,800	
ダイオーズ	3,900	1,384.00	5,397,600	貸付有価証券 2,500株
日本空調サービス	19,200	700.00	13,440,000	貸付有価証券 2,300株
オリエンタルランド	200,100	13,470.00	2,695,347,000	貸付有価証券

				25,800株
ダスキン	43,500	2,862.00	124,497,000	貸付有価証券 5,500株
明光ネットワークジャパン	19,900	957.00	19,044,300	貸付有価証券 13,200株
ファルコホールディングス	9,300	1,716.00	15,958,800	貸付有価証券 1,200株
秀英予備校	3,700	426.00	1,576,200	貸付有価証券 600株
田谷	3,100	602.00	1,866,200	貸付有価証券 1,700株
ラウンドワン	52,500	1,361.00	71,452,500	貸付有価証券 14,000株
リゾートトラスト	71,700	1,638.00	117,444,600	貸付有価証券 12,300株
ピー・エム・エル	21,800	3,100.00	67,580,000	貸付有価証券 2,600株
ワタベウェディング	2,700	603.00	1,628,100	貸付有価証券 300株
りらいあコミュニケーションズ	30,600	1,278.00	39,106,800	貸付有価証券 3,700株
リソー教育	86,000	449.00	38,614,000	貸付有価証券 21,400株
早稲田アカデミー	4,800	770.00	3,696,000	貸付有価証券 500株
ユー・エス・エス	206,900	2,143.00	443,386,700	貸付有価証券 26,100株
東京個別指導学院	6,000	911.00	5,466,000	貸付有価証券 2,400株（400株）
サイバーエージェント	97,400	3,765.00	366,711,000	貸付有価証券 46,500株（100株）
楽天	789,500	1,293.00	1,020,823,500	貸付有価証券 103,100株
クリーク・アンド・リバー社	10,000	1,246.00	12,460,000	貸付有価証券 4,300株（1,500株）
テー・オー・ダブリュー	14,800	809.00	11,973,200	
山田コンサルティンググループ	8,200	2,093.00	17,162,600	貸付有価証券 2,000株
セントラルスポーツ	6,300	3,150.00	19,845,000	貸付有価証券 4,100株
フルキャストホールディングス	16,900	2,391.00	40,407,900	貸付有価証券 300株

エン・ジャパン	24,600	4,130.00	101,598,000	貸付有価証券 14,000株
リソルホールディングス	1,800	3,805.00	6,849,000	貸付有価証券 200株
テクノプロ・ホールディングス	34,000	5,910.00	200,940,000	
アトラ	3,400	274.00	931,600	貸付有価証券 600株
インターワークス	3,200	674.00	2,156,800	貸付有価証券 400株
アイ・アールジャパン ホールディングス	6,900	2,755.00	19,009,500	貸付有価証券 900株
K e e P e r 技研	6,200	1,372.00	8,506,400	貸付有価証券 3,400株
ファーストロジック	3,900	621.00	2,421,900	貸付有価証券 1,100株
三機サービス	3,500	1,199.00	4,196,500	貸付有価証券 600株
G u n o s y	11,800	1,750.00	20,650,000	貸付有価証券 6,900株（600株）
デザインワン・ジャパン	3,300	295.00	973,500	貸付有価証券 1,600株
イー・ガーディアン	8,600	1,817.00	15,626,200	貸付有価証券 3,300株
リブセンス	9,300	247.00	2,297,100	貸付有価証券 1,200株
ジャパンマテリアル	46,300	1,436.00	66,486,800	貸付有価証券 15,300株
ベクトル	20,600	1,004.00	20,682,400	貸付有価証券 9,100株（900株）
ウチヤマホールディングス	8,300	540.00	4,482,000	貸付有価証券 1,000株
チャーム・ケア・コーポ レーション	5,400	1,651.00	8,915,400	
ライクキッズネクスト	4,000	994.00	3,976,000	貸付有価証券 200株（200株）
キャリアリンク	6,200	439.00	2,721,800	貸付有価証券 4,100株
I B J	11,400	917.00	10,453,800	貸付有価証券 6,300株
アサンテ	6,800	2,124.00	14,443,200	貸付有価証券 800株

N・フィールド	10,900	698.00	7,608,200	貸付有価証券 2,000株
バリューHR	3,700	3,320.00	12,284,000	貸付有価証券 100株
M&Aキャピタルパートナーズ	6,000	6,630.00	39,780,000	貸付有価証券 600株
ライドオンエクスプレス ホールディングス	7,000	1,194.00	8,358,000	貸付有価証券 2,500株
E R Iホールディングス	4,700	944.00	4,436,800	貸付有価証券 500株
アビスト	2,600	2,590.00	6,734,000	貸付有価証券 300株
シグマクシス	8,100	1,261.00	10,214,100	貸付有価証券 3,600株（1,700株）
ウィルグループ	11,000	885.00	9,735,000	貸付有価証券 2,000株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	23,300	258.00	6,011,400	貸付有価証券 6,300株
日本ビューホテル	5,400	1,336.00	7,214,400	貸付有価証券 1,400株
リクルートホールディン グス	1,213,300	3,579.00	4,342,400,700	貸付有価証券 170,300株
エラン	11,700	1,843.00	21,563,100	貸付有価証券 1,300株
土木管理総合試験所	7,400	476.00	3,522,400	
ネットマーケティング	6,000	496.00	2,976,000	
日本郵政	1,388,300	1,202.00	1,668,736,600	貸付有価証券 170,000株
ベルシステム24ホール ディングス	28,400	1,509.00	42,855,600	貸付有価証券 3,400株
鎌倉新書	12,400	1,447.00	17,942,800	貸付有価証券 7,600株（100株）
ソネット・メディア・ ネットワークス	2,100	775.00	1,627,500	貸付有価証券 400株
一蔵	1,800	649.00	1,168,200	貸付有価証券 200株
LITALICO	3,900	1,828.00	7,129,200	貸付有価証券 1,100株
グローバルキッズCOM PANY	2,500	974.00	2,435,000	貸付有価証券 600株
エボラブルアジア	7,300	2,373.00	17,322,900	貸付有価証券 1,500株

アトラエ	4,400	2,395.00	10,538,000	貸付有価証券 900株
ストライク	6,400	2,059.00	13,177,600	貸付有価証券 2,700株（800株）
ソラスト	41,400	981.00	40,613,400	貸付有価証券 5,400株
セラク	5,300	617.00	3,270,100	貸付有価証券 600株
インソース	6,600	2,466.00	16,275,600	貸付有価証券 4,400株
ベイカレント・コンサル ティング	12,000	4,085.00	49,020,000	貸付有価証券 1,400株
Orchestra H oldings	2,800	1,391.00	3,894,800	貸付有価証券 800株
アイモバイル	5,300	779.00	4,128,700	貸付有価証券 3,400株（2,300株）
キャリアインデックス	5,800	801.00	4,645,800	貸付有価証券 3,800株
MS - J a p a n	6,900	1,544.00	10,653,600	貸付有価証券 1,200株
船場	2,700	942.00	2,543,400	貸付有価証券 300株
グレイステクノロジー	6,100	2,808.00	17,128,800	貸付有価証券 3,500株（300株）
ジャパンエレベーター サービスホールディン	13,300	2,754.00	36,628,200	貸付有価証券 5,600株（200株）
フルテック	2,400	1,156.00	2,774,400	
グリーンズ	6,400	1,520.00	9,728,000	
ツナググループ・ホール ディングス	2,000	564.00	1,128,000	貸付有価証券 200株
ソウルドアウト	1,700	2,288.00	3,889,600	貸付有価証券 1,100株（100株）
MS & C o n s u l t i n g	2,700	1,112.00	3,002,400	貸付有価証券 300株
日総工産	11,200	1,495.00	16,744,000	貸付有価証券 4,800株
キュービーネットホール ディングス	10,200	2,223.00	22,674,600	貸付有価証券 100株
R P Aホールディングス	3,500	4,915.00	17,202,500	貸付有価証券 100株
スプリックス	5,700	1,777.00	10,128,900	貸付有価証券 2,800株（1,300株）

アドバンテッジリスクマ ネジメント	6,600	715.00	4,719,000	貸付有価証券 2,600株
リログループ	92,600	2,845.00	263,447,000	貸付有価証券 15,100株
東祥	10,500	2,750.00	28,875,000	貸付有価証券 2,500株
エイチ・アイ・エス	30,200	2,720.00	82,144,000	貸付有価証券 4,300株
ラックランド	3,400	2,442.00	8,302,800	貸付有価証券 300株
共立メンテナンス	25,900	5,090.00	131,831,000	貸付有価証券 16,700株（400株）
イチネンホールディング ス	17,600	1,128.00	19,852,800	貸付有価証券 2,100株
建設技術研究所	11,700	1,517.00	17,748,900	
スペース	11,000	1,218.00	13,398,000	
長大	6,200	729.00	4,519,800	貸付有価証券 1,000株（200株）
燦ホールディングス	3,700	2,370.00	8,769,000	貸付有価証券 400株
スバル興業	1,200	6,100.00	7,320,000	貸付有価証券 100株
東京テアトル	6,600	1,327.00	8,758,200	貸付有価証券 800株
タナベ経営	3,300	1,191.00	3,930,300	貸付有価証券 300株
ナガワ	4,700	5,470.00	25,709,000	貸付有価証券 600株
よみうりランド	3,700	5,110.00	18,907,000	貸付有価証券 400株
東京都競馬	11,100	3,275.00	36,352,500	
常磐興産	6,800	1,635.00	11,118,000	貸付有価証券 2,800株
カナモト	25,300	2,749.00	69,549,700	貸付有価証券 3,300株
東京ドーム	63,300	1,074.00	67,984,200	貸付有価証券 12,000株
西尾レントオール	17,200	2,984.00	51,324,800	貸付有価証券 2,100株
トランス・コスモス	18,800	2,456.00	46,172,800	貸付有価証券 2,300株
乃村工藝社	79,200	1,362.00	107,870,400	貸付有価証券

				10,000株
藤田観光	6,700	2,848.00	19,081,600	貸付有価証券 4,400株
KNT - CTホールディングス	9,000	1,405.00	12,645,000	貸付有価証券 100株
日本管財	18,100	1,861.00	33,684,100	貸付有価証券 2,200株
トーカイ	16,400	2,324.00	38,113,600	貸付有価証券 2,000株
白洋舎	1,900	2,960.00	5,624,000	貸付有価証券 1,000株
セコム	179,700	9,420.00	1,692,774,000	貸付有価証券 22,400株
セントラル警備保障	8,200	5,400.00	44,280,000	貸付有価証券 1,000株
丹青社	32,000	1,266.00	40,512,000	貸付有価証券 3,900株
メイテック	21,000	5,720.00	120,120,000	貸付有価証券 2,600株
応用地質	18,200	1,026.00	18,673,200	
船井総研ホールディングス	35,000	2,655.00	92,925,000	
進学会ホールディングス	7,700	598.00	4,604,600	貸付有価証券 900株
オオバ	13,300	620.00	8,246,000	貸付有価証券 1,600株
いであ	3,400	1,152.00	3,916,800	貸付有価証券 500株
学究社	5,600	1,290.00	7,224,000	貸付有価証券 600株
ベネッセホールディングス	62,000	2,447.00	151,714,000	貸付有価証券 8,100株
イオンディライト	20,900	3,155.00	65,939,500	貸付有価証券 2,500株
ナック	10,700	966.00	10,336,200	貸付有価証券 1,300株
ニチイ学館	24,100	1,570.00	37,837,000	貸付有価証券 3,700株
ダイセキ	28,400	2,676.00	75,998,400	貸付有価証券 4,900株
ステップ	6,200	1,482.00	9,188,400	貸付有価証券 700株

小計	銘柄数：2,127			393,776,671,090	
	組入時価比率：99.0%			100.0%	
合計				393,776,671,090	

(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(2019年6月24日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 6月24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	4,093,740,000	-	4,135,240,000	41,369,752
合計	4,093,740,000	-	4,135,240,000	41,369,752

（注）時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2019年 6月24日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	5,218,215,628
コール・ローン	481,573,307
株式	549,786,337,087
投資証券	15,419,888,694
派生商品評価勘定	136,237,213
未収入金	21,013,538
未収配当金	773,918,553
差入委託証拠金	2,120,722,627

(2019年 6月24日現在)

流動資産合計	573,957,906,647
資産合計	573,957,906,647
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	94,400
未払解約金	516,272,063
未払利息	885
その他未払費用	3,746,600
流動負債合計	520,113,948
負債合計	520,113,948
純資産の部	
元本等	
元本	208,101,589,988
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	365,336,202,711
元本等合計	573,437,792,699
純資産合計	573,437,792,699
負債純資産合計	573,957,906,647

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2019年 6月24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	2.7556円
(10,000口当たり純資産額)	(27,556円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 6月24日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。

２．時価の算定方法

株式

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 6月24日現在	
期首	2018年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	186,502,565,565円
同期中における追加設定元本額	44,357,725,514円
同期中における一部解約元本額	22,758,701,091円
期末元本額	208,101,589,988円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	48,999,221円
バランスセレクト５０	151,649,845円
バランスセレクト７０	158,384,621円
野村外国株式インデックスファンド	543,423,953円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	4,206,335,598円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	6,546,386,304円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	4,549,843,673円
野村資産設計ファンド２０１５	18,543,238円
野村資産設計ファンド２０２０	21,834,446円
野村資産設計ファンド２０２５	34,315,772円
野村資産設計ファンド２０３０	38,696,024円
野村資産設計ファンド２０３５	29,865,522円
野村資産設計ファンド２０４０	66,598,061円
野村外国株インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）	34,003,627,064円
のむラップ・ファンド（保守型）	1,041,024,211円
のむラップ・ファンド（普通型）	7,369,543,605円
のむラップ・ファンド（積極型）	4,874,451,960円
野村資産設計ファンド２０４５	9,851,821円
野村インデックスファンド・外国株式	4,248,450,924円
マイ・ロード	1,393,898,428円
ネクストコア	16,152,133円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	111,075,447円
野村外国株インデックスＢコース（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	1,140,079,875円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	973,768,177円
野村資産設計ファンド２０５０	16,210,564円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	5,197,306円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	2,053,957円

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	1,494,400円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型	931,562円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	191,256,381円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	310,931,174円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,420,925円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,845,133円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	12,569,785円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,008,157円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	19,899,410円
野村6資産均等バランス	329,222,270円
野村つみたて外国株投信	2,567,703,876円
野村外国株（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	3,664,146,907円
世界6資産分散ファンド	81,928,798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	288,815,460円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	825,587,475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）	283,357,735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）	215,512,775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）	1,321,397,727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）	2,391,022,116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）	3,104,795円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	8,386,533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）	3,605,845円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	4,471,518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）	57,798,254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）	28,774,744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）	26,257,072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）	42,031,887円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	175,113,179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）	3,198,658,348円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	395,351,382円
野村MSCI - KOKUSAIインデックスファンド（適格機関投資家専用）	37,036,086円
ノムラFOS用インデックスファンド・外国株式（適格機関投資家専用）	680,068,753円
野村FOS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）	17,115,953,726円
バランスセレクト30（確定拠出年金向け）	2,176,804円
バランスセレクト50（確定拠出年金向け）	12,865,333円
バランスセレクト70（確定拠出年金向け）	14,028,691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）	64,216,549,105円
マイバランス30（確定拠出年金向け）	1,464,425,058円
マイバランス50（確定拠出年金向け）	5,895,058,611円
マイバランス70（確定拠出年金向け）	6,425,468,967円
マイバランスDC30	953,112,737円
マイバランスDC50	1,795,463,493円
マイバランスDC70	1,423,570,357円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSAI	19,233,650,473円
野村DC運用戦略ファンド	129,881,261円

野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	6,621,445円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	217,486,570円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	148,463,896円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	106,904,726円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	5,778,883円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	3,695,159円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	13,447,321円
野村資産設計ファンド（DC）2030	979,287円
野村資産設計ファンド（DC）2040	664,732円
野村資産設計ファンド（DC）2050	1,111,024円
マイターゲット2035（確定拠出年金向け）	58,440,628円
マイターゲット2045（確定拠出年金向け）	32,563,313円
マイターゲット2055（確定拠出年金向け）	10,940,000円
マイターゲット2060（確定拠出年金向け）	16,316,176円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年6月24日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES, A GE CO, LLC	68,100	25.17	1,714,077.00	
		HALLIBURTON CO	119,600	22.84	2,731,664.00	
		HELMERICH & PAYNE	14,600	51.11	746,206.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	50,600	21.32	1,078,792.00	
		SCHLUMBERGER LTD	193,100	38.88	7,507,728.00	
		TECHNIPFMC PLC	61,000	24.85	1,515,850.00	
		ANADARKO PETE	69,800	70.31	4,907,638.00	
		APACHE CORPORATION	54,100	29.64	1,603,524.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	58,500	23.43	1,370,655.00	
		CHENIERE ENERGY INC	32,500	68.91	2,239,575.00	
		CHEVRON CORP	263,300	124.93	32,894,069.00	
		CIMAREX ENERGY CO	13,800	56.67	782,046.00	
		CONCHO RESOURCES INC	27,600	106.87	2,949,612.00	
		CONOCOPHILLIPS	155,500	60.33	9,381,315.00	
		CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	13,900	40.89	568,371.00	
		DEVON ENERGY CORP	62,400	28.24	1,762,176.00	

DIAMONDBACK ENERGY INC	21,600	109.79	2,371,464.00	
EOG RESOURCES INC	80,800	92.37	7,463,496.00	
EXXON MOBIL CORP	586,800	77.69	45,588,492.00	
HESS CORP	36,600	61.20	2,239,920.00	
HOLLYFRONTIER CORP	23,600	44.12	1,041,232.00	
KINDER MORGAN INC	284,000	21.38	6,071,920.00	
MARATHON OIL CORP	111,000	14.05	1,559,550.00	
MARATHON PETROLEUM CORP	94,600	52.66	4,981,636.00	
NOBLE ENERGY INC	64,400	21.56	1,388,464.00	
OCCIDENTAL PETE CORP	102,900	50.61	5,207,769.00	
ONEOK INC	56,000	68.94	3,860,640.00	
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	37,000	17.99	665,630.00	
PHILLIPS 66	63,000	90.58	5,706,540.00	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	23,200	155.21	3,600,872.00	
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	19,000	24.80	471,200.00	
TARGA RESOURCES CORP	29,900	38.72	1,157,728.00	
VALERO ENERGY CORP	58,000	81.91	4,750,780.00	
WILLIAMS COS	169,400	27.70	4,692,380.00	
AIR PRODUCTS	30,600	222.14	6,797,484.00	
ALBEMARLE CORP	14,800	68.34	1,011,432.00	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	29,200	29.99	875,708.00	
CELANESE CORP-SERIES A	18,000	105.69	1,902,420.00	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	31,400	46.77	1,468,578.00	
CHEMOURS CO/THE	23,400	24.86	581,724.00	
CORTEVA INC	103,366	27.21	2,812,588.86	
DOW INC	104,700	48.36	5,063,292.00	
DUPONT DE NEMOURS INC	103,366	74.64	7,715,238.24	
EASTMAN CHEMICAL CO.	18,600	76.21	1,417,506.00	
ECOLAB INC	36,200	189.59	6,863,158.00	
FMC CORP	18,000	82.60	1,486,800.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	14,200	145.67	2,068,514.00	
LINDE PLC	76,500	202.13	15,462,945.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	40,600	86.46	3,510,276.00	
MOSAIC CO/THE	48,800	23.42	1,142,896.00	
PPG INDUSTRIES	32,600	116.07	3,783,882.00	

SHERWIN-WILLIAMS	11,330	465.69	5,276,267.70	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5,000	66.46	332,300.00	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	8,300	224.93	1,866,919.00	
VULCAN MATERIALS CO	18,600	134.92	2,509,512.00	
AMCOR PLC	70,000	11.02	771,400.00	
AVERY DENNISON CORP	12,200	112.07	1,367,254.00	
BALL CORP	42,900	67.08	2,877,732.00	
CROWN HOLDINGS INC	19,100	59.32	1,133,012.00	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	52,300	43.61	2,280,803.00	
PACKAGING CORP OP AMERICA	13,200	95.33	1,258,356.00	
SEALED AIR CORP	21,900	41.70	913,230.00	
WESTROCK CO	34,200	36.72	1,255,824.00	
FREEMONT-MCMORAN INC	206,000	11.34	2,336,040.00	
NEWMONT GOLDCORP CORP	111,388	37.49	4,175,936.12	
NUCOR CORP	42,700	53.94	2,303,238.00	
STEEL DYNAMICS	33,400	29.16	973,944.00	
ARCONIC INC	57,000	24.33	1,386,810.00	
BOEING CO	74,390	371.84	27,661,177.60	
GENERAL DYNAMICS	33,500	177.43	5,943,905.00	
HARRIS CORP	16,000	197.22	3,155,520.00	
HEICO CORP	6,300	128.27	808,101.00	
HEICO CORP-CLASS A	10,900	99.94	1,089,346.00	
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,660	222.90	1,261,614.00	
L3 TECHNOLOGIES INC	10,900	256.23	2,792,907.00	
LOCKHEED MARTIN	34,980	359.36	12,570,412.80	
NORTHROP GRUMMAN CORP	22,370	322.16	7,206,719.20	
RAYTHEON COMPANY	39,300	183.13	7,197,009.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	14,600	81.43	1,188,878.00	
TEXTRON INC	33,500	51.91	1,738,985.00	
TRANSDIGM GROUP INC	6,700	497.46	3,332,982.00	
UNITED TECHNOLOGIES	113,600	128.75	14,626,000.00	
ALLEGION PLC	13,600	107.84	1,466,624.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	19,400	55.04	1,067,776.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	110,100	40.09	4,413,909.00	

LENNOX INTERNATIONAL INC	5,100	268.27	1,368,177.00	
MASCO CORP	42,800	38.10	1,630,680.00	
OWENS CORNING INC	14,200	51.39	729,738.00	
SMITH (A.O.) CORP	18,600	45.97	855,042.00	
FLUOR CORP	18,400	32.06	589,904.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	20,000	82.31	1,646,200.00	
ACUITY BRANDS INC	5,000	134.17	670,850.00	
AMETEK INC	31,800	87.76	2,790,768.00	
EATON CORP PLC	58,200	83.22	4,843,404.00	
EMERSON ELEC	84,100	65.63	5,519,483.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	16,800	162.72	2,733,696.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	21,400	48.20	1,031,480.00	
3M CORP	80,000	173.35	13,868,000.00	
GENERAL ELEC CO	1,209,000	10.48	12,670,320.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	101,200	174.31	17,640,172.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	30,700	64.12	1,968,484.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	30,000	38.14	1,144,200.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	14,480	365.38	5,290,702.40	
CATERPILLAR INC DEL	80,000	133.89	10,711,200.00	
CUMMINS INC	20,500	169.96	3,484,180.00	
DEERE & COMPANY	42,400	164.28	6,965,472.00	
DOVER CORP	19,700	97.22	1,915,234.00	
FLOWSERVE CORP	17,200	50.46	867,912.00	
FORTIVE CORP	40,600	80.42	3,265,052.00	
IDEX CORP	10,300	167.54	1,725,662.00	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	45,200	151.93	6,867,236.00	
INGERSOLL-RAND PLC	33,400	125.16	4,180,344.00	
MIDDLEBY CORP	7,500	131.56	986,700.00	
PACCAR	47,800	71.34	3,410,052.00	
PARKER HANNIFIN CORP	18,100	171.04	3,095,824.00	
PENTAIR PLC	23,200	36.61	849,352.00	
SNAP-ON INC	7,400	161.82	1,197,468.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	21,300	143.45	3,055,485.00	
WABCO HOLDINGS INC	7,000	132.35	926,450.00	
WABTEC CORP	22,100	72.76	1,607,996.00	

XYLEM INC	23,900	81.76	1,954,064.00	
AERCAP HOLDINGS NV	16,900	50.30	850,070.00	
FASTENAL CO	77,400	32.60	2,523,240.00	
GRAINGER(W.W.) INC	6,430	274.02	1,761,948.60	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	22,900	39.55	905,695.00	
UNITED RENTALS INC	11,200	129.87	1,454,544.00	
CINTAS CORP	12,700	232.38	2,951,226.00	
COPART INC	27,900	73.94	2,062,926.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	30,800	86.71	2,670,668.00	
ROLLINS INC	21,000	37.58	789,180.00	
WASTE CONNECTIONS INC	37,000	95.38	3,529,060.00	
WASTE MANAGEMENT INC	57,800	115.84	6,695,552.00	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	18,300	83.03	1,519,449.00	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	23,000	75.39	1,733,970.00	
FEDEX CORPORATION	34,400	165.35	5,688,040.00	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	96,800	102.17	9,890,056.00	
XPO LOGISTICS INC	14,900	55.04	820,096.00	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,600	31.57	460,922.00	
DELTA AIR LINES INC	22,400	55.99	1,254,176.00	
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	51.25	1,014,750.00	
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	9,200	86.72	797,824.00	
AMERCO	1,170	380.74	445,465.80	
CSX CORP	106,000	78.67	8,339,020.00	
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	11,800	88.91	1,049,138.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	14,200	119.50	1,696,900.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,700	31.89	532,563.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	37,100	197.19	7,315,749.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,600	145.97	1,255,342.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	26,500	44.00	1,166,000.00	
UNION PAC CORP	100,300	168.87	16,937,661.00	
APTIV PLC	36,700	78.42	2,878,014.00	
AUTOLIV INC	11,900	67.30	800,870.00	
BORGWARNER INC	29,600	42.01	1,243,496.00	
LEAR CORP	8,400	137.76	1,157,184.00	

FORD MOTOR COMPANY	540,000	9.99	5,394,600.00	
GENERAL MOTORS CO	176,900	36.92	6,531,148.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	22,400	36.64	820,736.00	
TESLA INC	17,520	221.86	3,886,987.20	
DR HORTON INC	48,000	44.66	2,143,680.00	
GARMIN LTD	18,600	81.21	1,510,506.00	
LEGGETT & PLATT INC	18,900	38.28	723,492.00	
LENNAR CORP-A	40,700	51.35	2,089,945.00	
MOHAWK INDUSTRIES	8,700	146.03	1,270,461.00	
NEWELL BRANDS INC	67,000	15.36	1,029,120.00	
NVR INC	480	3,313.24	1,590,355.20	
PULTEGROUP INC	37,900	31.90	1,209,010.00	
WHIRLPOOL CORP	8,300	141.67	1,175,861.00	
HASBRO INC	15,800	107.27	1,694,866.00	
POLARIS INDUSTRIES INC	8,300	91.84	762,272.00	
CAPRI HOLDINGS LTD	19,900	34.70	690,530.00	
HANESBRANDS INC	51,000	17.62	898,620.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	15,700	181.87	2,855,359.00	
NIKE INC-B	174,800	85.75	14,989,100.00	
PVH CORP	9,900	93.26	923,274.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	117.78	918,684.00	
TAPESTRY INC	38,300	31.33	1,199,939.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	24,000	26.15	627,600.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	25,000	23.10	577,500.00	
V F CORP	45,400	88.37	4,011,998.00	
ARAMARK	35,400	34.60	1,224,840.00	
CARNIVAL CORP	58,600	46.63	2,732,518.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,710	726.85	2,696,613.50	
DARDEN RESTAURANTS INC	16,600	121.23	2,012,418.00	
DOMINOS PIZZA INC	5,270	280.33	1,477,339.10	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	37,700	96.14	3,624,478.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	47,700	59.23	2,825,271.00	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	39,400	137.07	5,400,558.00	
MCDONALD'S CORP	106,100	204.26	21,671,986.00	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	21.62	735,080.00	

MGM RESORTS INTERNATIONAL	70,000	27.70	1,939,000.00	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	30,200	51.11	1,543,522.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	24,700	114.84	2,836,548.00	
STARBUCKS CORP	172,700	83.82	14,475,714.00	
VAIL RESORTS INC	5,410	230.54	1,247,221.40	
WYNN RESORTS LTD	13,800	121.50	1,676,700.00	
YUM BRANDS INC	42,200	110.27	4,653,394.00	
GENUINE PARTS CO	19,600	103.98	2,038,008.00	
LKQ CORP	45,000	26.64	1,198,800.00	
AMAZON.COM INC	57,780	1,911.30	110,434,914.00	
BOOKING HOLDINGS INC	6,260	1,880.00	11,768,800.00	
EBAY INC	118,900	40.05	4,761,945.00	
EXPEDIA GROUP INC	17,300	130.48	2,257,304.00	
GRUBHUB INC	11,900	71.17	846,923.00	
MERCADOLIBRE INC	6,030	630.65	3,802,819.50	
QURATE RETAIL INC - A	58,000	12.40	719,200.00	
WAYFAIR INC - CLASS A	8,600	153.77	1,322,422.00	
DOLLAR GENERAL CORP	36,100	138.78	5,009,958.00	
DOLLAR TREE INC	32,400	112.19	3,634,956.00	
KOHL'S CORP	22,500	47.51	1,068,975.00	
MACYS INC	43,700	22.30	974,510.00	
NORDSTROM INC	15,000	33.40	501,000.00	
TARGET CORP	72,000	87.60	6,307,200.00	
ADVANCE AUTO PARTS	9,900	153.24	1,517,076.00	
AUTOZONE	3,410	1,118.47	3,813,982.70	
BEST BUY COMPANY INC	33,800	67.54	2,282,852.00	
BURLINGTON STORES INC	8,900	174.84	1,556,076.00	
CARMAX INC	23,900	85.64	2,046,796.00	
GAP INC	31,500	18.22	573,930.00	
HOME DEPOT	156,500	209.39	32,769,535.00	
L BRANDS, INC	30,300	24.59	745,077.00	
LOWES COS INC	111,300	100.84	11,223,492.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	10,720	376.27	4,033,614.40	
ROSS STORES INC	50,500	103.96	5,249,980.00	
TIFFANY & CO	14,400	93.62	1,348,128.00	

TJX COS INC	169,600	52.93	8,976,928.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	16,300	106.76	1,740,188.00	
ULTA BEAUTY INC	7,890	355.81	2,807,340.90	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	61,100	266.13	16,260,543.00	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	7.46	335,700.00	
KROGER CO	107,600	22.24	2,393,024.00	
SYSCO CORP	67,800	70.65	4,790,070.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	110,100	52.45	5,774,745.00	
WALMART INC	201,400	111.13	22,381,582.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	43,100	55.11	2,375,241.00	
COCA COLA CO	562,900	51.55	29,017,495.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	33,300	57.34	1,909,422.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	22,800	183.73	4,189,044.00	
MOLSON COORS BREWING CO-B	25,600	55.42	1,418,752.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	55,900	63.78	3,565,302.00	
PEPSICO INC	194,700	133.96	26,082,012.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	75,500	41.08	3,101,540.00	
BUNGE LIMITED	19,100	57.55	1,099,205.00	
CAMPBELL SOUP CO	24,800	40.69	1,009,112.00	
CONAGRA BRANDS INC	66,700	28.72	1,915,624.00	
GENERAL MILLS	83,600	53.77	4,495,172.00	
HERSHEY CO/THE	20,600	137.13	2,824,878.00	
HORMEL FOODS CORP	39,100	41.41	1,619,131.00	
INGREDION INC	9,600	81.91	786,336.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,900	121.52	1,932,168.00	
KELLOGG CO	35,600	55.59	1,979,004.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	93,400	31.48	2,940,232.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	19,300	60.84	1,174,212.00	
MCCORMICK & CO INC.	16,800	154.41	2,594,088.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	198,500	55.25	10,967,125.00	
TYSON FOODS INC-CL A	41,000	79.29	3,250,890.00	
ALTRIA GROUP INC	260,300	48.00	12,494,400.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	215,700	79.22	17,087,754.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	32,900	75.94	2,498,426.00	
CLOROX CO	17,700	154.92	2,742,084.00	

COLGATE PALMOLIVE CO.	112,700	72.95	8,221,465.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	48,000	135.59	6,508,320.00	
PROCTER & GAMBLE CO	346,500	111.20	38,530,800.00	
COTY INC-CL A	37,000	13.08	483,960.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	29,900	181.31	5,421,169.00	
ABBOTT LABORATORIES	243,600	85.00	20,706,000.00	
ABIOMED INC	6,420	256.04	1,643,776.80	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,680	283.56	3,028,420.80	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	66,600	82.41	5,488,506.00	
BECTON,DICKINSON	37,000	247.30	9,150,100.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	193,000	41.69	8,046,170.00	
DANAHER CORP	87,700	143.73	12,605,121.00	
DENTSPLY SIRONA INC	30,300	58.88	1,784,064.00	
DEXCOM INC	12,900	150.80	1,945,320.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	28,400	193.23	5,487,732.00	
HOLOGIC INC	36,600	49.07	1,795,962.00	
IDEXX LABORATORIES INC	12,100	273.93	3,314,553.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	15,940	527.23	8,404,046.20	
MEDTRONIC PLC	186,000	99.38	18,484,680.00	
RESMED INC	19,200	120.07	2,305,344.00	
STERIS PLC	11,900	144.92	1,724,548.00	
STRYKER CORP	46,700	202.72	9,467,024.00	
TELEFLEX INC	6,320	334.73	2,115,493.60	
THE COOPER COMPANIES, INC.	6,580	328.87	2,163,964.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12,900	137.22	1,770,138.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	28,700	118.29	3,394,923.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	22,000	84.46	1,858,120.00	
ANTHEM INC	35,730	293.76	10,496,044.80	
CARDINAL HEALTH INC	41,000	44.70	1,832,700.00	
CENTENE CORP	55,800	56.37	3,145,446.00	
CIGNA CORP	52,900	161.15	8,524,835.00	
CVS HEALTH CORP	178,400	53.65	9,571,160.00	
DAVITA INC	17,500	53.09	929,075.00	
HCA HEALTHCARE INC	37,500	128.23	4,808,625.00	
HENRY SCHEIN INC	20,500	69.88	1,432,540.00	

HUMANA INC	18,590	270.21	5,023,203.90	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,200	170.80	2,425,360.00	
MCKESSON CORP	27,000	133.06	3,592,620.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	19,100	101.28	1,934,448.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	132,900	252.28	33,528,012.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	11,800	125.31	1,478,658.00	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	7,050	299.29	2,109,994.50	
ABBVIE INC	204,700	78.78	16,126,266.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	30,700	132.39	4,064,373.00	
ALKERMES PLC	20,100	22.59	454,059.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,700	74.37	944,499.00	
AMGEN INC	86,400	187.11	16,166,304.00	
BEIGENE, LTD ADR	4,600	121.38	558,348.00	
BIOGEN INC	26,910	239.09	6,433,911.90	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	24,100	87.91	2,118,631.00	
CELGENE CORP	96,600	98.91	9,554,706.00	
EXACT SCIENCES CORP	17,700	115.66	2,047,182.00	
GILEAD SCIENCES INC	176,200	69.38	12,224,756.00	
INCYTE CORP	24,900	88.70	2,208,630.00	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	18,800	64.33	1,209,404.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,040	320.26	3,535,670.40	
SEATTLE GENETICS INC	15,400	71.74	1,104,796.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	35,000	183.97	6,438,950.00	
ALLERGAN PLC	45,500	130.81	5,951,855.00	
BRISTOL MYERS SQUIBB	226,900	49.34	11,195,246.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	36,136	33.73	1,218,867.28	
ELI LILLY & CO.	124,000	115.49	14,320,760.00	
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,800	134.37	1,048,086.00	
JOHNSON & JOHNSON	368,800	142.09	52,402,792.00	
MERCK & CO INC	357,700	84.57	30,250,689.00	
MYLAN NV	69,300	18.32	1,269,576.00	
NEKTAR THERAPEUTICS	25,000	34.86	871,500.00	
PERRIGO CO PLC	16,500	44.50	734,250.00	
PFIZER INC	769,200	43.67	33,590,964.00	
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	154,000	8.45	1,301,300.00	

ZOETIS INC	66,000	112.88	7,450,080.00	
BANK OF AMERICA CORP	1,271,100	28.12	35,743,332.00	
BB&T CORPORATION	104,900	48.63	5,101,287.00	
CIT GROUP INC	13,400	50.38	675,092.00	
CITIGROUP	326,100	67.97	22,165,017.00	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	63,900	34.79	2,223,081.00	
COMERICA INC	23,000	70.05	1,611,150.00	
EAST WEST BANCORP INC	20,700	44.39	918,873.00	
FIFTH THIRD BANCORP	113,800	27.36	3,113,568.00	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	22,600	95.43	2,156,718.00	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	141,000	13.33	1,879,530.00	
JPMORGAN CHASE & CO	453,400	109.44	49,620,096.00	
KEYCORP	138,000	17.05	2,352,900.00	
M & T BANK CORP	17,900	165.51	2,962,629.00	
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	50,000	16.44	822,000.00	
PNC FINANCIAL	62,700	133.17	8,349,759.00	
REGIONS FINANCIAL CORP	139,000	14.63	2,033,570.00	
SIGNATURE BANK	7,600	117.10	889,960.00	
SUNTRUST BKS INC.	60,700	62.33	3,783,431.00	
SVB FINANCIAL GROUP	7,400	216.19	1,599,806.00	
US BANCORP	211,300	52.26	11,042,538.00	
WELLS FARGO CO	599,000	46.89	28,087,110.00	
ZIONS BANCORP NA	27,500	44.43	1,221,825.00	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	40,000	20.71	828,400.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	180,600	206.21	37,241,526.00	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	35,000	18.53	648,550.00	
VOYA FINANCIAL INC	21,700	54.05	1,172,885.00	
AFLAC INC	102,400	54.95	5,626,880.00	
ALLEGHANY CORP	2,100	686.71	1,442,091.00	
ALLSTATE CORP	46,600	101.21	4,716,386.00	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	10,800	103.00	1,112,400.00	
AMERICAN INTL GROUP	119,800	53.65	6,427,270.00	
AON PLC	32,900	192.02	6,317,458.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,000	36.44	2,040,640.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	24,900	86.54	2,154,846.00	

ASSURANT INC	9,000	106.89	962,010.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,400	42.58	911,212.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	13,900	38.11	529,729.00
CHUBB LTD	63,700	149.64	9,532,068.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	21,600	104.59	2,259,144.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,700	252.71	935,027.00
EVEREST RE GROUP LTD	5,600	250.15	1,400,840.00
FNF GROUP	37,200	40.76	1,516,272.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	48,200	55.72	2,685,704.00
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	62.93	1,881,607.00
LOEWS CORP	39,700	54.07	2,146,579.00
MARKEL CORP	1,860	1,080.26	2,009,283.60
MARSH & MCLENNAN COS	69,100	97.02	6,704,082.00
METLIFE INC	112,800	48.91	5,517,048.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	38,000	57.63	2,189,940.00
PROGRESSIVE CO	81,400	80.12	6,521,768.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	57,100	99.60	5,687,160.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	9,000	152.32	1,370,880.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,900	181.94	1,073,446.00
TORCHMARK CORP	14,000	88.08	1,233,120.00
TRAVELERS COS INC/THE	36,800	151.48	5,574,464.00
UNUM GROUP	31,200	32.40	1,010,880.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	17,800	191.83	3,414,574.00
WR BERKLEY CORP	19,500	66.88	1,304,160.00
ACCENTURE PLC-CL A	88,500	185.56	16,422,060.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	22,500	78.55	1,767,375.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,600	137.12	904,992.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	60,600	168.16	10,190,496.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	16,300	128.72	2,098,136.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	80,400	64.46	5,182,584.00
DXC TECHNOLOGY CO	37,800	54.44	2,057,832.00
EPAM SYSTEMS INC	7,700	174.08	1,340,416.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	45,100	122.70	5,533,770.00
FIRST DATA CORP- CLASS A	80,500	27.33	2,200,065.00
FISERV INC	54,100	91.48	4,949,068.00

FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	12,100	279.11	3,377,231.00	
GARTNER INC	12,700	161.47	2,050,669.00	
GLOBAL PAYMENTS INC	21,200	161.04	3,414,048.00	
GODADDY INC - CLASS A	24,700	72.14	1,781,858.00	
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	123,500	139.20	17,191,200.00	
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	10,600	137.34	1,455,804.00	
LEIDOS HOLDINGS INC	20,000	78.92	1,578,400.00	
MASTERCARD INC	126,470	264.47	33,447,520.90	
MONGODB INC	4,700	169.87	798,389.00	
OKTA INC	14,300	131.15	1,875,445.00	
PAYCHEX INC	45,300	86.52	3,919,356.00	
PAYPAL HOLDINGS INC	154,600	116.21	17,966,066.00	
SABRE CORP	36,000	22.86	822,960.00	
SQUARE INC - A	45,600	72.87	3,322,872.00	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	23,700	128.93	3,055,641.00	
TWILIO INC - A	15,600	144.00	2,246,400.00	
VERISIGN INC	14,700	210.75	3,098,025.00	
VISA INC-CLASS A SHARES	242,400	173.44	42,041,856.00	
WESTERN UNION CO	59,000	20.09	1,185,310.00	
WIX.COM LTD	6,700	148.12	992,404.00	
WORLDPAY INC - CL A	42,000	121.41	5,099,220.00	
ADOBE INC	67,650	299.33	20,249,674.50	
ANSYS INC	11,500	200.96	2,311,040.00	
AUTODESK INC.	30,000	170.89	5,126,700.00	
CADENCE DESIGN SYS INC	37,800	71.37	2,697,786.00	
CDK GLOBAL INC	16,700	49.18	821,306.00	
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	17,200	114.18	1,963,896.00	
CITRIX SYSTEMS INC	18,500	99.79	1,846,115.00	
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5,500	126.19	694,045.00	
DOCUSIGN INC	14,900	52.83	787,167.00	
DROPBOX INC-CLASS A	28,000	25.01	700,280.00	
FORTINET INC	19,900	76.13	1,514,987.00	
INTUIT INC	35,640	261.51	9,320,216.40	
MICROSOFT CORP	1,008,600	136.97	138,147,942.00	

ORACLE CORPORATION	348,500	56.12	19,557,820.00
PALO ALTO NETWORKS INC	12,600	204.49	2,576,574.00
PAYCOM SOFTWARE INC	7,000	228.25	1,597,750.00
PTC INC	14,700	88.85	1,306,095.00
RED HAT INC	24,300	187.55	4,557,465.00
SALESFORCE.COM INC	106,100	156.84	16,640,724.00
SERVICENOW INC	24,880	285.74	7,109,211.20
SPLUNK INC	19,700	124.34	2,449,498.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	30,600	58.87	1,801,422.00
SYMANTEC CORP	91,000	20.84	1,896,440.00
SYNOPSYS INC	20,700	128.84	2,666,988.00
TABLEAU SOFTWARE INC-CL A	10,200	170.86	1,742,772.00
VMWARE INC - CLASS A	11,700	173.39	2,028,663.00
WORKDAY INC-CLASS A	21,100	216.33	4,564,563.00
ARISTA NETWORKS INC	7,400	253.39	1,875,086.00
CISCO SYSTEMS	609,900	57.03	34,782,597.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22,800	16.01	365,028.00
F5 NETWORKS INC	8,100	143.73	1,164,213.00
JUNIPER NETWORKS INC	46,700	26.81	1,252,027.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	22,100	165.09	3,648,489.00
APPLE INC	652,500	198.78	129,703,950.00
DELL TECHNOLOGIES-C	20,790	53.99	1,122,452.10
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	188,000	14.94	2,808,720.00
HP INC	210,000	20.70	4,347,000.00
NETAPP INC	35,200	61.46	2,163,392.00
SEAGATE TECHNOLOGY	34,700	46.46	1,612,162.00
WESTERN DIGITAL CORP	38,300	40.04	1,533,532.00
XEROX CORP	28,900	35.26	1,019,014.00
AMPHENOL CORP-CL A	41,300	95.51	3,944,563.00
ARROW ELECTRS INC	12,100	69.75	843,975.00
CDW CORPORATION	21,100	108.59	2,291,249.00
COGNEX CORP	24,800	46.41	1,150,968.00
CORNING INC	108,000	33.25	3,591,000.00
FLEX LTD	76,000	9.43	716,680.00
FLIR SYSTEMS INC	17,800	53.64	954,792.00

IPG PHOTONICS CORP	4,730	146.48	692,850.40
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	25,200	86.42	2,177,784.00
TE CONNECTIVITY LTD	46,000	95.19	4,378,740.00
TRIMBLE INC	34,900	43.40	1,514,660.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	7,700	200.11	1,540,847.00
ADVANCED MICRO DEVICES	133,900	29.10	3,896,490.00
ANALOG DEVICES INC	51,500	113.67	5,854,005.00
APPLIED MATERIALS	132,300	42.96	5,683,608.00
BROADCOM INC	54,990	273.99	15,066,710.10
INTEL CORP	623,200	47.46	29,577,072.00
KLA TENCOR CORP	21,900	113.93	2,495,067.00
LAM RESEARCH	21,200	183.03	3,880,236.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	86,000	23.97	2,061,420.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	37,400	58.41	2,184,534.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	33,400	85.10	2,842,340.00
MICRON TECHNOLOGY	154,500	33.25	5,137,125.00
NVIDIA CORP	80,000	151.76	12,140,800.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	41,000	98.06	4,020,460.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	59,000	19.48	1,149,320.00
QORVO INC	17,600	63.89	1,124,464.00
QUALCOMM INC	168,200	72.72	12,231,504.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	23,800	75.22	1,790,236.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	130,300	112.32	14,635,296.00
XILINX INC	34,900	112.14	3,913,686.00
AT & T INC	1,009,200	32.45	32,748,540.00
CENTURYLINK INC	136,000	11.34	1,542,240.00
VERIZON COMMUNICATIONS	572,500	57.77	33,073,325.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	33,700	33.04	1,113,448.00
SPRINT CORP	109,000	6.87	748,830.00
T-MOBILE US INC	47,200	75.70	3,573,040.00
ALLIANT ENERGY CORP	31,000	49.96	1,548,760.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	68,800	91.55	6,298,640.00
DUKE ENERGY CORP	100,000	89.53	8,953,000.00
EDISON INTERNATIONAL	45,000	65.41	2,943,450.00
ENTERGY CORP	25,400	104.26	2,648,204.00

EVERGY INC	34,800	61.24	2,131,152.00
EVERSOURCE ENERGY	44,500	77.40	3,444,300.00
EXELON CORPORATION	135,200	50.40	6,814,080.00
FIRSTENERGY CORP	71,400	43.68	3,118,752.00
NEXTERA ENERGY INC	66,400	207.55	13,781,320.00
OGE ENERGY CORP	28,600	43.46	1,242,956.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	15,400	97.62	1,503,348.00
PPL CORPORATION	97,600	31.75	3,098,800.00
SOUTHERN CO.	144,100	56.27	8,108,507.00
XCEL ENERGY INC	70,800	61.54	4,357,032.00
ATMOS ENERGY CORP	15,600	107.46	1,676,376.00
UGI CORP	22,700	53.85	1,222,395.00
AMEREN CORPORATION	32,800	77.45	2,540,360.00
CENTERPOINT ENERGY INC	70,400	29.92	2,106,368.00
CMS ENERGY CORP	37,800	59.15	2,235,870.00
CONSOLIDATED EDISON INC	44,500	89.21	3,969,845.00
DOMINION ENERGY INC	110,000	78.35	8,618,500.00
DTE ENERGY COMPANY	25,100	131.11	3,290,861.00
NISOURCE INC	53,300	29.36	1,564,888.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	69,500	61.05	4,242,975.00
SEMPRA ENERGY	38,300	141.04	5,401,832.00
WEC ENERGY GROUP INC	43,500	85.42	3,715,770.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	24,700	118.07	2,916,329.00
ALLY FINANCIAL INC	57,400	29.90	1,716,260.00
AMERICAN EXPRESS CO	99,600	124.73	12,423,108.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	63,800	91.52	5,838,976.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	46,300	78.38	3,628,994.00
SYNCHRONY FINANCIAL	87,200	34.31	2,991,832.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	7,500	87.98	659,850.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,200	146.77	2,817,984.00
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	117,600	43.41	5,105,016.00
BLACKROCK INC	16,560	468.24	7,754,054.40
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,000	106.44	1,596,600.00
CME GROUP INC	49,800	197.46	9,833,508.00
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	46.23	1,618,050.00

EATON VANCE CORP	16,400	42.13	690,932.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,410	298.08	1,612,612.80	
FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	34.24	1,486,016.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	45,700	195.94	8,954,458.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	79,200	86.77	6,872,184.00	
INVESCO LTD	58,000	20.59	1,194,220.00	
KKR & CO INC-A	68,000	24.59	1,672,120.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5,330	333.08	1,775,316.40	
MOODYS CORP	23,500	194.56	4,572,160.00	
MORGAN STANLEY	175,300	43.58	7,639,574.00	
MSCI INC	12,000	232.40	2,788,800.00	
NASDAQ INC	15,400	98.29	1,513,666.00	
NORTHERN TRUST CORP	28,400	86.69	2,461,996.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,700	82.36	1,457,772.00	
S&P GLOBAL INC	34,400	228.70	7,867,280.00	
SCHWAB(CHARLES)CORP	166,200	40.63	6,752,706.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	54.41	1,039,231.00	
STATE STREET CORP	52,200	55.52	2,898,144.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	32,400	108.32	3,509,568.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	37,900	49.99	1,894,621.00	
H & R BLOCK INC	27,900	27.90	778,410.00	
AES CORP	91,000	16.76	1,525,160.00	
NRG ENERGY INC	40,000	35.17	1,406,800.00	
VISTRA ENERGY CORP	51,600	24.10	1,243,560.00	
CERNER CORP	45,100	72.09	3,251,259.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17,600	168.93	2,973,168.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	42,600	73.34	3,124,284.00	
ILLUMINA INC	20,110	361.56	7,270,971.60	
IQVIA HOLDINGS INC	23,400	158.67	3,712,878.00	
METTLER-TOLEDO INTL	3,420	830.11	2,838,976.20	
PERKINELMER INC	15,700	95.35	1,496,995.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	54,870	294.46	16,157,020.20	
WATERS CORP	9,800	212.81	2,085,538.00	
COSTAR GROUP INC	5,130	560.54	2,875,570.20	
EQUIFAX INC	16,100	134.07	2,158,527.00	
	51,900	59.88	3,107,772.00	

IHS MARKIT LTD				
MANPOWERGROUP INC	8,000	93.36	746,880.00	
NIELSEN HOLDINGS PLC	47,200	23.41	1,104,952.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	56.21	961,191.00	
TRUNION	25,300	71.51	1,809,203.00	
VERISK ANALYTICS INC	20,900	145.07	3,031,963.00	
CBRE GROUP INC	45,500	51.35	2,336,425.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	161,000	6.65	1,070,650.00	
JONES LANG LASALLE INC	6,300	139.55	879,165.00	
ALTICE USA INC-A	20,000	23.35	467,000.00	
CBS CORP-CL B	47,000	50.47	2,372,090.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	21,780	394.69	8,596,348.20	
COMCAST CORP-CL A	626,000	43.56	27,268,560.00	
DISCOVERY INC - A	19,300	30.69	592,317.00	
DISCOVERY INC - C	50,300	28.28	1,422,484.00	
DISH NETWORK CORP-A	31,900	39.01	1,244,419.00	
FOX CORP-CLASS A	48,033	36.18	1,737,833.94	
FOX CORP-CLASS B	25,400	35.88	911,352.00	
INTERPUBLIC GROUP	50,000	22.45	1,122,500.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	13,900	104.07	1,446,573.00	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	69,500	26.84	1,865,380.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	27.50	660,000.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	22,400	37.63	842,912.00	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	37.35	481,815.00	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	13.53	744,150.00	
OMNICOM GROUP	30,300	81.39	2,466,117.00	
SIRIUS XM HOLDINGS INC	229,000	5.60	1,282,400.00	
ACTIVISION BLIZZARD INC	105,700	45.91	4,852,687.00	
DISNEY (WALT) CO	249,400	140.23	34,973,362.00	
ELECTRONIC ARTS	40,800	95.33	3,889,464.00	
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	29,300	37.90	1,110,470.00	
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	20,800	66.69	1,387,152.00	
NETFLIX INC	60,540	369.21	22,351,973.40	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	15,700	112.64	1,768,448.00	
VIACOM INC-CLASS B	50,200	30.80	1,546,160.00	

	ALPHABET INC-CL A	41,460	1,125.37	46,657,840.20	
	ALPHABET INC-CL C	43,530	1,121.88	48,835,436.40	
	FACEBOOK INC-A	330,300	191.14	63,133,542.00	
	IAC/INTERACTIVE CORP	10,400	219.19	2,279,576.00	
	SNAP INC-A	97,000	14.56	1,412,320.00	
	TRIPADVISOR INC	14,600	47.30	690,580.00	
	TWITTER INC	101,000	35.02	3,537,020.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	16,000	45.31	724,960.00	
小計	銘柄数：616			3,490,373,075.14 (374,935,875,731)	
	組入時価比率：65.4%			68.2%	
カナダドル	CAMECO CORP	56,000	14.01	784,560.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	168,200	36.35	6,114,070.00	
	CENOVUS ENERGY INC	140,000	11.66	1,632,400.00	
	ENBRIDGE INC	281,200	46.64	13,115,168.00	
	ENCANA CORP	206,000	6.52	1,343,120.00	
	HUSKY ENERGY INC	52,000	12.68	659,360.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	36.73	1,377,375.00	
	INTER PIPELINE LTD	52,000	20.11	1,045,720.00	
	KEYERA CORP	28,500	33.46	953,610.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	70,900	49.03	3,476,227.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	31,000	18.32	567,920.00	
	SUNCOR ENERGY INC	218,000	41.75	9,101,500.00	
	TC ENERGY CORP	127,200	65.80	8,369,760.00	
	TOURMALINE OIL CORP	33,000	16.80	554,400.00	
	VERMILION ENERGY INC	18,500	28.44	526,140.00	
	METHANEX CORP	8,600	62.32	535,952.00	
	NUTRIEN LTD	83,100	72.32	6,009,792.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	21,200	63.81	1,352,772.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	33,100	66.71	2,208,101.00	
	BARRICK GOLD	247,000	20.56	5,078,320.00	
	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	99,000	11.95	1,183,050.00	
	FRANCO-NEVADA CORP	25,400	110.60	2,809,240.00	
	KINROSS GOLD CORP	174,000	5.15	896,100.00	
	KIRKLAND LAKE GOLD LTD	28,900	55.16	1,594,124.00	

LUNDIN MINING CORP	95,000	6.91	656,450.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	68,000	29.81	2,027,080.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63,000	31.93	2,011,590.00	
WEST FRASER TIMBER	8,400	60.64	509,376.00	
BOMBARDIER B SHEARS	262,000	2.25	589,500.00	
CAE INC	36,000	34.95	1,258,200.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	25,200	27.00	680,400.00	
WSP GLOBAL INC	13,200	71.87	948,684.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	100,700	122.94	12,380,058.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	19,100	317.31	6,060,621.00	
MAGNA INTERNATIONAL INC	45,000	64.39	2,897,550.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	27,800	51.82	1,440,596.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	33,800	92.47	3,125,486.00	
STARS GROUP INC/THE	33,000	21.97	725,010.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	143.00	1,229,800.00	
DOLLARAMA INC	41,800	45.70	1,910,260.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	59,600	82.60	4,922,960.00	
EMPIRE CO LTD A	26,000	31.33	814,580.00	
LOBLAW COMPANIES	26,100	67.34	1,757,574.00	
METRO INC	36,800	49.91	1,836,688.00	
WESTON(GEORGE)LTD	10,700	100.14	1,071,498.00	
SAPUTO INC	32,100	39.20	1,258,320.00	
AURORA CANNABIS INC	97,000	9.65	936,050.00	
BAUSCH HEALTH COS INC	42,500	31.43	1,335,775.00	
CANOPY GROWTH CORP	27,500	53.28	1,465,200.00	
CRONOS GROUP INC	25,000	21.06	526,500.00	
BANK OF MONTREAL	87,600	99.94	8,754,744.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	168,600	71.51	12,056,586.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	62,000	105.10	6,516,200.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	46,000	62.61	2,880,060.00	
ROYAL BANK OF CANADA	199,200	105.00	20,916,000.00	
TORONTO DOMINION BANK	254,200	76.50	19,446,300.00	
ONEX CORPORATION	10,900	78.56	856,304.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,880	655.00	2,541,400.00	

GREAT-WEST LIFE CO INC	36,000	30.32	1,091,520.00	
IA FINANCIAL CORP INC	14,700	53.80	790,860.00	
INTACT FINANCIAL CORP	18,900	122.81	2,321,109.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	275,000	23.85	6,558,750.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	39,000	28.18	1,099,020.00	
POWER FINANCIAL CORP	39,000	30.45	1,187,550.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	83,900	53.70	4,505,430.00	
CGI INC	33,800	101.07	3,416,166.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	13,630	431.50	5,881,345.00	
BLACKBERRY LTD	71,000	11.17	793,070.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,720	1,219.58	3,317,257.60	
OPEN TEXT CORP	38,400	54.59	2,096,256.00	
BCE INC	19,800	59.90	1,186,020.00	
TELUS CORP	29,300	48.27	1,414,311.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	50,200	69.38	3,482,876.00	
EMERA INC	7,600	54.32	412,832.00	
FORTIS INC	58,300	52.83	3,079,989.00	
HYDRO ONE LTD	42,000	23.01	966,420.00	
ALTAGAS LTD	33,800	19.81	669,578.00	
ATCO LTD CL1	9,600	44.22	424,512.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	15,700	37.72	592,204.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	116,600	63.62	7,418,092.00	
CI FINANCIAL CORP	33,600	21.28	715,008.00	
IGM FINANCIAL INC	10,300	37.21	383,263.00	
THOMSON REUTERS CORP	28,247	87.09	2,460,031.23	
FIRST CAPITAL REALTY INC	25,000	22.40	560,000.00	
QUEBECOR INC-CL B	27,000	31.55	851,850.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	63,000	27.15	1,710,450.00	
小計	銘柄数：86		259,017,950.83	
			(21,081,471,018)	
	組入時価比率：3.7%		3.8%	
ユーロ	TENARIS SA	60,000	11.48	689,100.00
	ENAGAS	30,400	25.29	768,816.00
	ENI SPA	355,000	14.60	5,185,130.00
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	67,000	13.43	899,810.00

NESTE OYJ	59,300	29.44	1,745,792.00
OMV AG	21,000	42.01	882,210.00
REPSOL SA	197,000	14.07	2,772,775.00
REPSOL SA-RTS	197,000	0.49	97,318.00
SNAM SPA	298,000	4.79	1,428,612.00
TOTAL SA	329,900	49.11	16,203,038.50
VOPAK	9,000	40.61	365,490.00
AIR LIQUIDE	59,100	122.35	7,230,885.00
AKZO NOBEL	31,022	81.78	2,536,979.16
ARKEMA	9,900	80.76	799,524.00
BASF SE	127,800	62.69	8,011,782.00
COVESTRO AG	27,000	44.01	1,188,270.00
EVONIK INDUSTRIES AG	27,300	25.12	685,776.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	34.76	364,980.00
KONINKLIJKE DSM NV	24,700	109.50	2,704,650.00
LANXESS	12,000	49.24	590,880.00
SOLVAY SA	10,300	89.74	924,322.00
SYMRISE AG	18,100	86.52	1,566,012.00
UMICORE	28,000	27.13	759,640.00
CRH PLC	111,100	28.51	3,167,461.00
HEIDELBERGCEMENT AG	20,300	70.48	1,430,744.00
IMERYS	3,800	45.94	174,572.00
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,000	26.24	839,680.00
ARCELORMITTAL	88,500	15.25	1,349,625.00
THYSSENKRUPP AG	62,000	12.04	746,790.00
VOESTALPINE AG	16,500	25.63	422,895.00
STORA ENSO OYJ-R	85,000	9.68	822,970.00
UPM-KYMMENE OYJ	73,300	23.10	1,693,230.00
AIRBUS SE	80,900	122.78	9,932,902.00
DASSAULT AVIATION SA	330	1,259.00	415,470.00
LEONARDO SPA	55,000	10.99	604,450.00
MTU AERO ENGINES AG	6,900	206.30	1,423,470.00
SAFRAN SA	45,700	131.85	6,025,545.00
THALES SA	15,200	106.70	1,621,840.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	66,900	34.02	2,275,938.00
KINGSPAN GROUP PLC	22,200	47.84	1,062,048.00

ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	35,055	38.04	1,333,492.20	
BOUYGUES	31,400	32.11	1,008,254.00	
EIFPAGE SA	10,800	88.76	958,608.00	
FERROVIAL SA	67,474	22.25	1,501,296.50	
HOCHTIEF AG	3,800	108.00	410,400.00	
VINCI	70,100	91.04	6,381,904.00	
LEGRAND SA	37,000	64.42	2,383,540.00	
PRYSMIAN SPA	30,900	18.18	561,762.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	75,900	78.90	5,988,510.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	30,000	15.32	459,750.00	
SIEMENS AG	106,300	105.74	11,240,162.00	
ALSTOM	20,500	41.40	848,700.00	
ANDRITZ AG	9,200	32.80	301,760.00	
CNH INDUSTRIAL NV	141,000	8.94	1,261,104.00	
GEA GROUP AG	24,200	25.30	612,260.00	
KION GROUP AG	9,900	54.16	536,184.00	
KNORR-BREMSE AG	7,100	97.25	690,475.00	
KONE OYJ	45,600	51.48	2,347,488.00	
METSO OYJ	16,200	34.68	561,816.00	
WARTSILA OYJ	63,000	13.20	831,600.00	
BRENNTAG AG	20,600	43.26	891,156.00	
EDENRED	32,800	44.24	1,451,072.00	
SOCIETE BIC SA	3,800	65.00	247,000.00	
BOLLORE	106,000	3.90	413,400.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	138,500	28.39	3,932,015.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	31,000	14.81	459,265.00	
ADP	3,900	158.50	618,150.00	
AENA SME SA	9,300	175.10	1,628,430.00	
ATLANTIA SPA	65,300	23.29	1,520,837.00	
FRAPORT AG	6,300	76.70	483,210.00	
GETLINK	62,000	13.96	865,520.00	
CONTINENTAL AG	14,600	130.72	1,908,512.00	
FAURECIA	10,500	39.19	411,495.00	
MICHELIN (CGDE)	24,100	113.20	2,728,120.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	15,800	27.44	433,552.00	

PIRELLI & C. SPA	53,000	5.50	291,606.00	
VALEO SA	33,100	26.60	880,460.00	
BAYER MOTOREN WERK	44,900	64.44	2,893,356.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	7,800	54.40	424,320.00	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	125,300	49.62	6,217,386.00	
FERRARI NV	17,100	143.25	2,449,575.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	150,000	12.31	1,846,500.00	
PEUGEOT CITROEN	82,000	21.68	1,777,760.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	20,300	58.00	1,177,400.00	
RENAULT SA	25,500	56.15	1,431,825.00	
VOLKSWAGEN AG	4,500	150.50	677,250.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	25,200	147.18	3,708,936.00	
SEB SA	3,000	155.20	465,600.00	
ADIDAS AG	25,120	268.80	6,752,256.00	
ESSILORLUXOTTICA	38,700	111.20	4,303,440.00	
HERMES INTERNATIONAL	4,460	630.00	2,809,800.00	
HUGO BOSS AG	9,300	56.06	521,358.00	
KERING SA	10,460	516.20	5,399,452.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	38,550	368.30	14,197,965.00	
MONCLER SPA	25,200	37.41	942,732.00	
PUMA SE	10,610	55.60	589,916.00	
ACCOR SA	26,200	36.24	949,488.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	10,900	65.74	716,566.00	
SODEXO	12,100	101.55	1,228,755.00	
DELIVERY HERO SE	16,500	41.16	679,140.00	
ZALANDO SE	18,300	38.55	705,465.00	
INDITEX SA	152,700	25.47	3,889,269.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	80,000	17.00	1,360,000.00	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	8,300	30.00	249,000.00	
COLRUYT SA	8,700	52.60	457,620.00	
JERONIMO MARTINS	38,000	14.29	543,020.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	160,600	20.97	3,368,585.00	
METRO AG	25,000	15.54	388,625.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	106,000	79.79	8,457,740.00	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	76,000	8.96	681,340.00	

HEINEKEN HOLDING NV	16,000	92.65	1,482,400.00	
HEINEKEN NV	35,700	99.40	3,548,580.00	
PERNOD RICARD SA	29,100	162.80	4,737,480.00	
REMY COINTREAU	3,000	120.50	361,500.00	
DANONE	85,900	74.80	6,425,320.00	
KERRY GROUP PLC-A	22,100	105.30	2,327,130.00	
HENKEL AG & CO KGAA	14,400	79.65	1,146,960.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,600	84.84	2,087,064.00	
BEIERSDORF AG	13,700	106.60	1,460,420.00	
LOREAL-ORD	35,070	255.30	8,953,371.00	
UNILEVER NV-CVA	202,400	54.17	10,964,008.00	
BIOMERIEUX	5,900	75.90	447,810.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	6,000	86.90	521,400.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	129,400	38.04	4,923,023.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	4,500	185.70	835,650.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,900	37.76	751,424.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	29,400	70.52	2,073,288.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	57,600	48.19	2,775,744.00	
GRIFOLS SA	40,100	24.71	990,871.00	
BAYER AG-REG	129,800	54.82	7,115,636.00	
IPSEN	5,500	115.30	634,150.00	
MERCK KGAA	17,300	91.74	1,587,102.00	
ORION OYJ	13,000	31.34	407,420.00	
RECORDATI SPA	14,100	37.39	527,199.00	
SANOFI	155,900	77.68	12,110,312.00	
UCB SA	16,500	71.96	1,187,340.00	
ABN AMRO GROUP NV-CVA	58,100	18.95	1,101,285.50	
AIB GROUP PLC	125,000	3.53	441,250.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	921,000	4.91	4,529,017.50	
BANCO DE SABADELL SA	790,000	0.90	712,422.00	
BANCO SANTANDER SA	2,257,000	4.00	9,029,128.50	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	133,000	4.55	605,416.00	
BANKIA SA	151,000	2.04	308,795.00	
BANKINTER S.A.	88,000	5.95	523,600.00	
BNP PARIBAS	156,700	41.05	6,432,535.00	

CAIXABANK	471,000	2.46	1,160,544.00
COMMERZBANK AG	135,000	6.15	831,060.00
CREDIT AGRICOLE SA	154,000	10.37	1,596,980.00
ERSTE GROUP BANK AG	43,000	32.39	1,392,770.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	75,000	9.79	734,550.00
ING GROEP NV	543,000	9.85	5,353,437.00
INTESA SANPAOLO	2,080,000	1.87	3,900,000.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	33,200	56.30	1,869,160.00
MEDIOBANCA S.P.A.	88,000	8.88	781,616.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	20.28	407,628.00
SOCIETE GENERALE	104,300	22.05	2,299,815.00
UNICREDIT SPA	271,000	10.62	2,879,646.00
EURAZEO SE	5,953	63.05	375,336.65
EXOR NV	15,100	60.68	916,268.00
GROUPE BRUXELLES LAM	11,000	86.34	949,740.00
WENDEL	3,400	119.80	407,320.00
AEGON NV	246,000	4.32	1,064,442.00
AGEAS	25,800	44.25	1,141,650.00
ALLIANZ SE-REG	58,900	212.70	12,528,030.00
ASSICURAZIONI GENERALI	153,000	16.68	2,552,040.00
AXA	270,000	23.25	6,278,850.00
CNP ASSURANCES	21,200	20.04	424,848.00
HANNOVER RUECK SE	7,900	141.70	1,119,430.00
MAPFRE SA	163,000	2.62	428,201.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	20,700	225.40	4,665,780.00
NN GROUP NV	42,900	35.12	1,506,648.00
POSTE ITALIANE SPA	77,000	9.51	732,578.00
SAMPO OYJ-A SHS	61,200	41.30	2,527,560.00
SCOR SE	23,200	38.94	903,408.00
ADYEN NV	1,490	680.80	1,014,392.00
AMADEUS IT GROUP SA	61,400	69.58	4,272,212.00
ATOS SE	13,600	71.94	978,384.00
CAPGEMINI SA	21,900	103.20	2,260,080.00
WIRECARD AG	15,900	151.25	2,404,875.00

WORLDLINE SA	10,440	63.25	660,330.00	
DASSAULT SYSTEMES SA	17,800	138.60	2,467,080.00	
SAP SE	136,400	118.50	16,163,400.00	
NOKIA OYJ	781,000	4.55	3,553,550.00	
INGENICO GROUP	8,100	75.68	613,008.00	
ASML HOLDING NV	58,500	178.70	10,453,950.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	155,000	14.87	2,305,160.00	
STMICROELECTRONICS NV	90,000	14.98	1,348,200.00	
CELLNEX TELECOM SA	28,000	33.93	950,040.00	
DEUTSCHE TELEKOM-REG	459,000	15.41	7,074,108.00	
ELISA OYJ	19,500	42.55	829,725.00	
ILIAD SA	3,900	98.58	384,462.00	
KONINKLIJKE KPN NV	505,000	2.82	1,424,100.00	
ORANGE SA	279,000	13.92	3,885,075.00	
PROXIMUS	21,600	25.53	551,448.00	
TELECOM ITALIA SPA	1,290,000	0.50	646,161.00	
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.48	424,688.00	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	97,000	2.41	234,352.00	
TELEFONICA SA	640,000	7.26	4,648,960.00	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	29.15	489,720.00	
1&1 DRILLISCH AG	8,000	28.04	224,320.00	
ELECTRICITE DE FRANCE	82,000	11.39	934,390.00	
ENDESA S.A.	44,400	23.77	1,055,388.00	
ENEL SPA	1,133,000	6.23	7,060,856.00	
ENERGIAS DE PORTUGAL	361,000	3.39	1,225,595.00	
FORTUM OYJ	60,000	18.93	1,136,100.00	
IBERDROLA SA	808,000	8.95	7,231,600.00	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	59,000	19.84	1,170,855.00	
TERNA SPA	185,000	6.01	1,111,850.00	
VERBUND AG	9,000	47.40	426,600.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	42,700	25.33	1,081,591.00	
E.ON SE	309,000	9.92	3,067,752.00	
ENGIE	251,000	13.50	3,388,500.00	
INNOGY SE	19,500	41.96	818,220.00	
RWE AG	78,000	22.73	1,772,940.00	

	SUEZ	52,000	12.76	663,780.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	77,000	21.52	1,657,040.00	
	AMUNDI SA	8,200	60.05	492,410.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	275,000	6.36	1,749,000.00	
	DEUTSCHE BOERSE AG	26,600	126.80	3,372,880.00	
	NATIXIS	128,000	3.40	435,968.00	
	UNIPER SE	26,200	26.60	696,920.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,700	376.00	639,200.00	
	QIAGEN NV	31,400	35.72	1,121,608.00	
	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,100	140.20	574,820.00	
	BUREAU VERITAS SA	41,000	21.73	890,930.00	
	RANDSTAD NV	15,300	50.22	768,366.00	
	TELEPERFORMANCE	7,700	174.40	1,342,880.00	
	WOLTERS KLUWER	39,400	64.92	2,557,848.00	
	AROUNDTOWN SA	107,000	7.65	818,550.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	48,400	33.53	1,622,852.00	
	VONOVIA SE	66,400	42.91	2,849,224.00	
	AXEL SPRINGER SE	5,900	62.10	366,390.00	
	EUTELSAT COMMUNICATIONS	24,100	15.96	384,756.50	
	JC DECAUX SA	9,300	26.58	247,194.00	
	PUBLICIS GROUPE	29,200	47.96	1,400,432.00	
	RTL GROUP	5,400	44.72	241,488.00	
	SES FDR	48,000	13.22	634,800.00	
	TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	48.60	325,620.00	
	UBISOFT ENTERTAINMENT	11,100	68.56	761,016.00	
	VIVENDI SA	125,100	24.73	3,093,723.00	
小計	銘柄数：241			531,304,827.01	
				(64,946,702,053)	
	組入時価比率：11.3%			11.8%	
英ボンド	WOOD GROUP (JOHN) PLC	86,000	4.23	364,296.00	
	BP PLC	2,810,000	5.56	15,629,220.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	614,000	25.84	15,865,760.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	519,700	25.95	13,486,215.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	16,790	53.75	902,462.50	
	JOHNSON MATTHEY PLC	26,700	31.82	849,594.00	

ANGLO AMERICAN PLC	143,300	21.59	3,093,847.00	
ANTOFAGASTA PLC	59,000	8.95	528,522.00	
BHP GROUP PLC	294,000	19.65	5,777,100.00	
EVRAZ PLC	76,000	6.36	483,360.00	
FRESNILLO PLC	26,000	8.83	229,632.00	
GLENCORE PLC	1,533,000	2.80	4,296,232.50	
RIO TINTO PLC-REG	157,800	46.89	7,400,031.00	
MONDI PLC	49,400	17.59	868,946.00	
BAE SYSTEMS PLC	441,000	4.85	2,141,496.00	
MEGGITT PLC	111,000	5.20	577,200.00	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	238,000	8.82	2,099,160.00	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC -C	16,827,000	0.00	16,827.00	
MELROSE INDUSTRIES PLC	680,000	1.75	1,194,420.00	
DCC PLC	12,800	70.90	907,520.00	
SMITHS GROUP PLC	54,000	15.14	817,560.00	
SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,500	91.10	956,550.00	
WEIR GROUP PLC	38,000	15.12	574,750.00	
ASHTED GROUP PLC	63,300	21.65	1,370,445.00	
BUNZLE	44,400	21.02	933,288.00	
FERGUSON PLC	32,900	56.82	1,869,378.00	
G4S PLC	219,000	2.11	462,747.00	
RENTOKIL INTIAL PLC	263,000	3.94	1,036,746.00	
EASYJET PLC	21,000	8.83	185,472.00	
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	145,000	5.62	815,770.00	
PERSIMMON PLC	42,600	19.47	829,422.00	
TAYLOR WIMPEY PLC	450,000	1.57	706,950.00	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	17,100	35.67	609,957.00	
BURBERRY GROUP PLC	55,000	17.83	980,650.00	
CARNIVAL PLC	22,900	34.85	798,065.00	
COMPASS GROUP PLC	222,000	18.50	4,107,000.00	
GVC HOLDINGS PLC	87,000	6.30	548,100.00	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	23,750	51.32	1,218,850.00	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	89,000	3.91	348,791.00	
TUI AG-DI	60,000	7.28	437,160.00	
WHITBREAD PLC	24,500	45.10	1,104,950.00	

OCADO GROUP PLC	65,000	11.48	746,525.00
MARKS & SPENCER PLC	249,600	2.09	523,660.80
NEXT PLC	19,800	56.34	1,115,532.00
KINGFISHER PLC	308,000	2.07	640,024.00
MORRISON SUPERMARKETS	315,000	2.00	630,945.00
SAINSBURY	255,000	1.95	499,417.50
TESCO PLC	1,372,000	2.36	3,247,524.00
COCA-COLA HBC AG-DI	29,000	29.71	861,590.00
DIAGEO PLC	335,700	33.80	11,346,660.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49,400	24.41	1,205,854.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	318,700	27.97	8,914,039.00
IMPERIAL BRANDS PLC	134,000	18.70	2,505,800.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	97,400	62.09	6,047,566.00
UNILEVER PLC	154,400	49.08	7,578,724.00
SMITH & NEPHEW PLC	122,000	17.14	2,091,080.00
NMC HEALTH PLC	13,300	24.38	324,254.00
ASTRAZENECA PLC	176,000	63.78	11,225,280.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	689,000	15.76	10,861,396.00
BARCLAYS PLC	2,370,000	1.48	3,524,190.00
HSBC HOLDINGS PLC	2,780,000	6.49	18,058,880.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	9,940,000	0.58	5,775,140.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	650,000	2.15	1,402,050.00
STANDARD CHARTERED PLC	383,000	7.02	2,691,724.00
ADMIRAL GROUP PLC	27,000	21.12	570,240.00
AVIVA PLC	542,000	4.17	2,260,140.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	183,000	3.23	592,005.00
LEGAL & GENERAL	808,000	2.66	2,152,512.00
PRUDENTIAL PLC	361,000	16.98	6,129,780.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	140,000	5.71	800,240.00
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	48,116	20.02	963,282.32
SAGE GROUP PLC (THE)	143,000	7.90	1,129,700.00
HALMA PLC	54,000	20.08	1,084,320.00
BT GROUP PLC	1,145,000	2.01	2,305,457.50
VODAFONE GROUP PLC	3,730,000	1.26	4,733,370.00
SSE PLC	137,000	11.11	1,522,755.00

	CENTRICA PLC	780,000	0.89	694,980.00	
	NATIONAL GRID PLC	477,000	8.47	4,040,667.00	
	SEVERN TRENT PLC	32,400	20.80	673,920.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	96,000	8.01	768,960.00	
	3I GROUP PLC	132,000	10.63	1,403,160.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	40,100	19.03	763,103.00	
	INVESTEC PLC	92,000	5.05	465,336.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	42,600	55.00	2,343,000.00	
	SCHRODERS PLC	15,800	30.74	485,692.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	70,000	10.98	768,950.00	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	326,000	2.90	946,704.00	
	EXPERIAN PLC	126,200	24.14	3,046,468.00	
	INTERTEK GROUP PLC	21,600	55.64	1,201,824.00	
	RELX PLC	271,000	19.22	5,208,620.00	
	INFORMA PLC	173,000	8.09	1,399,570.00	
	ITV PLC	500,000	1.07	537,250.00	
	PEARSON	109,000	8.16	889,440.00	
	WPP PLC	169,000	9.72	1,643,356.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	121,000	5.62	680,262.00	
小計	銘柄数：95			251,447,361.12	
				(34,433,201,631)	
	組入時価比率：6.0%			6.3%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	25,900	19.34	500,906.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	627.00	764,940.00	
	GIVAUDAN-REG	1,296	2,794.00	3,621,024.00	
	SIKA AG-REG	18,000	164.70	2,964,600.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	67,000	48.64	3,258,880.00	
	GEBERIT AG-REG	5,000	460.10	2,300,500.00	
	ABB LTD	258,000	19.54	5,042,610.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	212.80	638,400.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,500	216.90	1,192,950.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	7,300	137.20	1,001,560.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	71,600	82.42	5,901,272.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,120	271.90	1,120,228.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	51.50	381,100.00	
		6,500	82.46	535,990.00	

	DUFREY AG-REG				
	BARRY CALLEBAUT AG	300	1,941.00	582,300.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	140	6,980.00	977,200.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	15	78,800.00	1,182,000.00	
	NESTLE SA-REG	424,200	101.52	43,064,784.00	
	ALCON INC	59,200	58.00	3,433,600.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	7,600	225.00	1,710,000.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,450	864.40	1,253,380.00	
	NOVARTIS AG-REG	300,500	90.12	27,081,060.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	97,380	277.15	26,988,867.00	
	VIFOR PHARMA AG	6,700	139.95	937,665.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	5,800	75.45	437,610.00	
	BALOISE HOLDING AG	6,600	172.60	1,139,160.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,850	476.60	2,311,510.00	
	SWISS RE LTD	41,400	100.00	4,140,000.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	20,710	340.10	7,043,471.00	
	TEMENOS AG-REG	8,400	174.40	1,464,960.00	
	SWISSCOM AG-REG	3,510	493.10	1,730,781.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	347,000	11.50	3,990,500.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	31,000	42.22	1,308,820.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,630	738.80	1,943,044.00	
	UBS GROUP AG	532,000	11.45	6,091,400.00	
	LONZA AG-REG	10,390	328.20	3,409,998.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	21,500	59.02	1,268,930.00	
	SGS SA-REG	746	2,545.00	1,898,570.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	10,100	83.40	842,340.00	
小計	銘柄数：39			175,456,910.00	
				(19,303,769,238)	
	組入時価比率：3.4%			3.5%	
スウェーデン ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	24,800	285.80	7,087,840.00	
	BOLIDEN AB	36,300	236.00	8,566,800.00	
	ASSA ABLOY AB-B	136,000	206.30	28,056,800.00	
	SKANSKA AB-B SHS	45,000	166.75	7,503,750.00	
	ALFA LAVAL AB	45,000	208.30	9,373,500.00	
	ATLAS COPCO AB-A	94,700	294.50	27,889,150.00	

	ATLAS COPCO AB-B	52,900	266.30	14,087,270.00	
	EPIROC AB - A	92,000	97.50	8,970,000.00	
	EPIROC AB - B	58,000	94.11	5,458,380.00	
	SANDVIK AB	159,000	170.75	27,149,250.00	
	SKF AB-B SHARES	49,000	170.50	8,354,500.00	
	VOLVO AB-B SHS	214,000	149.45	31,982,300.00	
	SECURITAS AB-B SHS	45,000	168.55	7,584,750.00	
	ELECTROLUX AB-B	34,000	239.90	8,156,600.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	55,000	86.78	4,772,900.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	118,000	147.16	17,364,880.00	
	ICA GRUPPEN AB	13,800	400.50	5,526,900.00	
	SWEDISH MATCH AB	23,400	408.20	9,551,880.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	81,700	292.90	23,929,930.00	
	NORDEA BANK ABP	413,000	67.86	28,026,180.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	221,000	88.12	19,474,520.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	212,000	92.48	19,605,760.00	
	SWEDBANK AB	126,000	140.30	17,677,800.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	206.00	5,150,000.00	
	INVESTOR AB-B SHS	61,700	455.00	28,073,500.00	
	KINNEVIK AB - B	33,700	244.90	8,253,130.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	9,200	343.60	3,161,120.00	
	ERICSSON LM-B	417,000	94.08	39,231,360.00	
	HEXAGON AB-B SHS	36,100	512.00	18,483,200.00	
	TELIA CO AB	401,000	41.68	16,713,680.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	9,700	515.00	4,995,500.00	
	TELE 2 AB-B SHS	69,000	135.40	9,342,600.00	
小計	銘柄数：32			479,555,730.00	
				(5,514,890,895)	
	組入時価比率：1.0%			1.0%	
ノルウェーク ローネ	AKER AB ASA	14,100	247.00	3,482,700.00	
	EQUINOR ASA	140,000	172.60	24,164,000.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	23,200	409.10	9,491,120.00	
	NORSK HYDRO	184,000	30.93	5,691,120.00	
	MOWI ASA	62,000	203.80	12,635,600.00	

		ORKLA ASA	115,000	76.56	8,804,400.00	
		DNB ASA	136,000	156.15	21,236,400.00	
		GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	25,000	173.40	4,335,000.00	
		TELENOR ASA	102,000	188.35	19,211,700.00	
		SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	215.80	2,783,820.00	
		小計 銘柄数：10			111,835,860.00	
					(1,414,723,629)	
		組入時価比率：0.2%			0.3%	
	デンマーク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	15,100	739.60	11,167,960.00	
		NOVOZYMES A/S-B SHARES	31,300	306.00	9,577,800.00	
		VESTAS WIND SYSTEMS A/S	26,800	591.80	15,860,240.00	
		ISS A/S	21,800	198.10	4,318,580.00	
		A P MOLLER - MAERSK A/S-A	520	7,500.00	3,900,000.00	
		AP MOLLER-MAERSK A/S-B	880	8,016.00	7,054,080.00	
		DSV A/S	25,100	630.00	15,813,000.00	
		PANDORA A/S	13,700	227.10	3,111,270.00	
		CARLSBERG B	14,500	874.60	12,681,700.00	
		COLOPLAST-B	16,400	749.80	12,296,720.00	
		DEMANT A/S	16,000	210.50	3,368,000.00	
		GENMAB A/S	8,400	1,201.00	10,088,400.00	
		H LUNDBECK A/S	10,500	256.80	2,696,400.00	
		NOVO NORDISK A/S-B	236,500	332.95	78,742,675.00	
		DANSKE BANK AS	97,000	103.90	10,078,300.00	
		TRYG A/S	16,000	217.60	3,481,600.00	
		ORSTED A/S	25,400	552.60	14,036,040.00	
		小計 銘柄数：17			218,272,765.00	
					(3,573,125,163)	
		組入時価比率：0.6%			0.6%	
	豪ドル	WORLEYPARSONS LTD	47,000	14.53	682,910.00	
		CALTEX AUSTRALIA LIMITED	33,300	23.68	788,544.00	
		OIL SEARCH LTD	179,000	7.24	1,295,960.00	
		ORIGIN ENERGY LTD	239,000	7.35	1,756,650.00	
		SANTOS LTD.	232,000	7.20	1,670,400.00	
		WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	22.76	386,920.00	
		WOODSIDE PETROLEUM	127,000	37.11	4,712,970.00	

INCITEC PIVOT LTD	233,000	3.38	787,540.00	
ORICA LTD	50,000	20.69	1,034,500.00	
BORAL LTD	153,000	5.35	818,550.00	
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	58,000	19.08	1,106,640.00	
AMCOR PLC-CDI	155,000	15.54	2,408,700.00	
ALUMINA LTD	350,000	2.37	829,500.00	
BHP GROUP LIMITED	409,400	41.03	16,797,682.00	
BLUESCOPE STEEL LTD	68,000	12.05	819,400.00	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	201,000	8.87	1,782,870.00	
NEWCREST MINING	103,000	32.00	3,296,000.00	
RIO TINTO LTD	51,200	101.54	5,198,848.00	
SOUTH32 LTD	700,000	3.22	2,254,000.00	
CIMIC GROUP LTD	11,700	45.49	532,233.00	
BRAMBLES LTD	218,000	12.91	2,814,380.00	
AURIZON HOLDINGS LTD	273,000	5.46	1,490,580.00	
SYDNEY AIRPORT	144,000	8.28	1,192,320.00	
TRANSURBAN GROUP	371,000	15.26	5,661,460.00	
ARISTOCRAT LEISURE LTD	82,000	31.06	2,546,920.00	
CROWN RESORTS LTD	55,000	11.96	657,800.00	
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	8,500	37.66	320,110.00	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	7,300	40.70	297,110.00	
TABCORP HOLDINGS	287,000	4.55	1,305,850.00	
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	97,117	4.06	394,295.02	
WESFARMERS LIMITED	158,800	36.41	5,781,908.00	
COLES GROUP LTD	163,000	13.42	2,187,460.00	
WOOLWORTHS GROUP LTD	173,000	32.99	5,707,270.00	
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	10.26	790,020.00	
TREASURY WINE ESTATES LTD	100,000	14.89	1,489,000.00	
COCHLEAR LTD	8,100	204.31	1,654,911.00	
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20,500	71.92	1,474,360.00	
SONIC HEALTHCARE LTD	62,000	27.64	1,713,680.00	
CSL LIMITED	63,000	212.50	13,387,500.00	
AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	393,000	28.54	11,216,220.00	
BANK OF QUEENSLAND LTD	56,000	9.53	533,680.00	
BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	67,000	11.59	776,530.00	

	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	245,800	82.24	20,214,592.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	382,000	26.85	10,256,700.00	
	WESTPAC BANKING CORP	480,000	28.23	13,550,400.00	
	AMP LIMITED	390,000	2.07	807,300.00	
	CHALLENGER LIMITED	80,000	6.52	521,600.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	308,000	8.11	2,497,880.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	400,000	3.56	1,424,000.00	
	QBE INSURANCE	179,000	12.14	2,173,060.00	
	SUNCORP GROUP LTD	181,000	13.57	2,456,170.00	
	COMPUTERSHARE LTD	63,000	16.81	1,059,030.00	
	TELSTRA CORP LTD	590,000	3.78	2,230,200.00	
	TPG TELECOM LTD	52,000	6.68	347,360.00	
	AUSNET SERVICES	230,000	1.95	448,500.00	
	APA GROUP	159,000	11.51	1,830,090.00	
	AGL ENERGY LTD	94,000	20.39	1,916,660.00	
	ASX LTD	26,300	82.71	2,175,273.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	45,300	126.00	5,707,800.00	
	SEEK LTD	48,000	21.61	1,037,280.00	
	REA GROUP LTD	6,900	96.22	663,918.00	
小計	銘柄数：61			183,671,994.02	
				(13,723,971,393)	
	組入時価比率：2.4%			2.5%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	112,627	5.43	611,564.61	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,000	9.23	1,200,550.00	
	A2 MILK CO LTD	106,000	14.02	1,486,120.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	74,000	15.06	1,114,440.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	11.55	669,900.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	260,000	3.96	1,029,600.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	159,000	4.73	752,070.00	
小計	銘柄数：7			6,864,244.61	
				(486,400,373)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	371,040	77.55	28,774,152.00	
	NWS HOLDINGS LTD	220,500	16.06	3,541,230.00	

MTR CORP	221,000	51.40	11,359,400.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	197,000	57.95	11,416,150.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	97,000	21.30	2,066,100.00	
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	316,000	51.15	16,163,400.00	
MGM CHINA HOLDINGS LTD	124,000	13.16	1,631,840.00	
SANDS CHINA LTD	336,000	37.30	12,532,800.00	
SHANGRI-LA ASIA LTD	160,333	9.94	1,593,710.02	
SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	8.77	2,367,900.00	
WYNN MACAU LTD	228,000	16.94	3,862,320.00	
VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	102,000	38.75	3,952,500.00	
WH GROUP LIMITED	1,310,000	8.05	10,545,500.00	
BANK OF EAST ASIA	167,060	21.85	3,650,261.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	495,000	30.60	15,147,000.00	
HANG SENG BANK	105,800	196.00	20,736,800.00	
AIA GROUP LTD	1,676,000	82.70	138,605,200.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	38,000	78.15	2,969,700.00	
HKT TRUST AND HKT LTD	519,600	12.84	6,671,664.00	
PCCW LTD	550,000	4.55	2,502,500.00	
CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	89,000	64.00	5,696,000.00	
CLP HLDGS	227,000	86.40	19,612,800.00	
POWER ASSETS HOLDINGS LTD	191,000	56.90	10,867,900.00	
HONG KONG & CHINA GAS	1,430,348	17.50	25,031,090.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	162,400	276.80	44,952,320.00	
CK ASSET HOLDINGS LTD	364,040	60.90	22,170,036.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	251,000	17.98	4,512,980.00	
HENDERSON LAND	204,443	42.25	8,637,716.75	
HYSAN DEVELOPMENT	83,000	39.85	3,307,550.00	
KERRY PROPERTIES	79,000	31.70	2,504,300.00	
NEW WORLD DEVELOPMENT	839,666	12.34	10,361,478.44	
SINO LAND CO.LTD	480,000	13.42	6,441,600.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	217,000	133.00	28,861,000.00	
SWIRE PACIFIC-A	64,000	95.80	6,131,200.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	32.10	5,553,300.00	
WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	164,000	55.00	9,020,000.00	

小計	WHARF(HOLDING)	174,000	20.05	3,488,700.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	117,000	55.85	6,534,450.00	
	銘柄数：38			523,774,548.21	
				(7,201,900,037)	
	組入時価比率：1.3%			1.3%	
シンガポール ドル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	198,000	4.16	823,680.00	
	KEPPEL CORP.	202,000	6.64	1,341,280.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	140,040	2.45	343,098.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	280,000	1.50	420,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,040	9.33	718,783.20	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	310,000	2.69	833,900.00	
	SATS LTD	77,000	5.27	405,790.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	870,000	0.93	809,100.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	36.10	505,400.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	940,020	0.29	277,305.90	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	247,000	3.60	889,200.00	
	DBS GROUP HLDGS	251,000	25.92	6,505,920.00	
	OCBC-ORD	448,000	11.35	5,084,800.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	175,000	26.32	4,606,000.00	
	VENTURE CORP LTD	35,000	17.21	602,350.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,110,000	3.44	3,818,400.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	111,000	7.95	882,450.00	
	CAPITALAND LIMITED	330,000	3.52	1,161,600.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	9.53	667,100.00	
	UOL GROUP LIMITED	65,000	7.43	482,950.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	240,000	2.42	580,800.00	
小計	銘柄数：21			31,759,907.10	
	組入時価比率：0.4%			(2,520,466,227)	
新シェケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	91,000	18.98	1,727,180.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	566.40	2,039,040.00	
	BANK HAPOLIM BM	141,000	26.02	3,668,820.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	195,000	24.60	4,797,000.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	172,000	14.54	2,500,880.00	

		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,000	80.97	1,376,490.00	
		NICE LTD	8,600	497.00	4,274,200.00	
		AZRIELI GROUP	6,500	229.10	1,489,150.00	
	小計	銘柄数：8			21,872,760.00	
					(649,839,699)	
		組入時価比率：0.1%			0.1%	
	合計				549,786,337,087	
					(549,786,337,087)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2019年6月24日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	71,000	1,194,220.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,800	2,295,424.00	
		AMERICAN TOWER CORP	61,300	13,190,534.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	196,000	1,793,400.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,400	4,031,320.00	
		BOSTON PROPERTIES	20,700	2,816,649.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,100	1,390,827.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	56,800	7,712,304.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	29,200	3,595,980.00	
		DUKE REALTY CORP	47,800	1,525,298.00	
		EQUINIX INC	11,270	5,726,174.30	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,100	1,477,410.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	51,800	4,041,954.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,030	2,708,819.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	17,900	1,928,546.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,800	1,311,436.00	
		HCP INC	66,100	2,161,470.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	100,000	1,817,000.00	
		INVITATION HOMES INC	56,300	1,528,545.00	
		IRON MOUNTAIN INC	38,300	1,227,898.00	

小計	KIMCO REALTY CORP	58,000	1,096,200.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	19,800	1,006,830.00	
	MACERICH CO /THE	14,200	479,534.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	15,000	1,786,350.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,000	1,210,000.00	
	PROLOGIS INC	86,300	7,018,779.00	
	PUBLIC STORAGE	21,500	5,170,750.00	
	REALTY INCOME CORP	42,300	3,056,175.00	
	REGENCY CENTERS CORP	23,900	1,661,528.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	15,200	3,525,032.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	42,300	6,941,007.00	
	SL GREEN REALTY CORP	12,500	1,056,500.00	
	SUN COMMUNITIES INC	12,200	1,584,170.00	
	UDR INC	36,700	1,676,456.00	
	VENTAS INC	49,200	3,459,744.00	
	VEREIT INC	125,000	1,187,500.00	
	VORNADO REALTY TRUST	24,200	1,615,834.00	
	WELLTOWER INC	54,100	4,525,465.00	
	WEYERHAEUSER CO	100,500	2,628,075.00	
	WP CAREY INC	23,600	2,019,688.00	
	銘柄数：40	1,702,200	116,180,825.70	
			(12,480,144,296)	
	組入時価比率：2.2%		80.9%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	20,000	461,400.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	586,300.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	374,770.00	
	銘柄数：3	53,000	1,422,470.00	
			(115,774,833)	
ユーロ	COVIVIO	6,600	608,190.00	
	GECINA SA	6,400	865,280.00	
	ICADE	5,100	404,685.00	
	KLEPIERRE	28,000	833,280.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	19,100	2,562,265.00	
	銘柄数：5	65,200	5,273,700.00	
小計			(644,657,088)	

		組入時価比率：0.1%		4.2%	
英ポンド	BRITISH LAND		128,000	691,200.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC		99,000	824,274.00	
	SEGRO PLC		145,000	1,077,060.00	
小計	銘柄数：3		372,000	2,592,534.00	
				(355,021,605)	
		組入時価比率：0.1%		2.3%	
豪ドル	DEXUS		155,000	2,089,400.00	
	GOODMAN GROUP		227,000	3,423,160.00	
	GPT GROUP		256,000	1,605,120.00	
	LENDLEASE GROUP		77,000	1,034,880.00	
	MIRVAC GROUP		490,000	1,543,500.00	
	SCENTRE GROUP		723,000	2,783,550.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP		348,000	1,503,360.00	
	VICINITY CENTRES		470,000	1,231,400.00	
小計	銘柄数：8		2,746,000	15,214,370.00	
				(1,136,817,726)	
		組入時価比率：0.2%		7.4%	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS		370,000	2,997,000.00	
	LINK REIT		288,000	27,676,800.00	
小計	銘柄数：2		658,000	30,673,800.00	
				(421,764,750)	
		組入時価比率：0.1%		2.7%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT		380,000	1,155,200.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST		369,972	791,740.08	
	CAPITALAND MALL TRUST		320,000	819,200.00	
	SUNTEC REIT		300,000	582,000.00	
小計	銘柄数：4		1,369,972	3,348,140.08	
				(265,708,396)	
		組入時価比率：0.0%		1.7%	
合計				15,419,888,694	
				(15,419,888,694)	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 6月24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	7,838,773,757	-	7,975,010,970	136,237,213
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	85,833,600	-	85,928,000	94,400
米ドル	85,833,600	-	85,928,000	94,400
合計	-	-	-	136,142,813

（注）時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2019年 6月24日現在)

資産の部

流動資産

(2019年 6月24日現在)

預金	676,678,939
コール・ローン	34,655,474
株式	36,189,288,986
投資信託受益証券	616,751,500
投資証券	97,487,259
派生商品評価勘定	32,487,753
未収入金	1,432,883
未収配当金	118,305,400
差入委託証拠金	276,699,654
流動資産合計	38,043,787,848
資産合計	38,043,787,848
負債の部	
流動負債	
未払解約金	16,846,399
未払利息	63
その他未払費用	2,726,900
流動負債合計	19,573,362
負債合計	19,573,362
純資産の部	
元本等	
元本	30,998,359,536
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	7,025,854,950
元本等合計	38,024,214,486
純資産合計	38,024,214,486
負債純資産合計	38,043,787,848

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

（貸借対照表に関する注記）

2019年 6月24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	1.2267円
(10,000口当たり純資産額)	(12,267円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。 当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制

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

○市場リスクの管理

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

○信用リスクの管理

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

○流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 6月24日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
投資信託受益証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
投資証券	
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 6月24日現在	
期首	2018年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	25,882,137,620円
同期中における追加設定元本額	7,055,019,272円
同期中における一部解約元本額	1,938,797,356円
期末元本額	30,998,359,536円
期末元本額の内訳＊	
野村資産設計ファンド2015	29,072,509円
野村資産設計ファンド2020	33,997,355円
野村資産設計ファンド2025	52,891,599円
野村資産設計ファンド2030	60,549,187円
野村資産設計ファンド2035	46,524,602円
野村資産設計ファンド2040	103,299,749円
野村資産設計ファンド2045	15,220,575円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,729,715,601円

野村インデックスファンド・海外５資産バランス	250,601,266円
野村資産設計ファンド２０５０	25,297,507円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	8,054,582円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	3,196,463円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	2,316,566円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	1,458,800円
インデックス・ブレード（タイプ ）	2,764,548円
インデックス・ブレード（タイプ ）	1,785,794円
インデックス・ブレード（タイプ ）	7,343,862円
インデックス・ブレード（タイプ ）	2,574,479円
インデックス・ブレード（タイプ ）	11,492,896円
野村つみたて外国株投信	836,127,412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）	526,721,112円
野村外国株（含む新興国）インデックス Ｂコース（野村投資一任口座向け）	1,193,164,671円
世界６資産分散ファンド	184,843,799円
NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIEマージング・マーケット・インデックス（為替ヘッジなし）連動型上場投信	294,373,734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）	19,746,485円
ノムラＦＯＦｓ用インデックスファンド・新興国株式（適格機関投資家専用）	1,305,916,656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）	22,245,010,200円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０３０	1,532,085円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０４０	1,031,063円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０５０	1,734,379円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年6月24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	18.73	273,458.00	
		INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	57,700	1.07	62,142.90	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	25,470	83.02	2,114,519.40	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	5,550	205.00	1,137,750.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	328,900	7.16	2,357,555.20	
		ROSNEFT OJSC - GDR	72,800	6.59	479,752.00	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	112,400	4.00	449,824.80	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	16,260	72.76	1,183,077.60	
		TRANSNEFT PJSC	21	2,570.53	53,981.20	
		TRANSPORTADOR GAS SUR-SP B ADR	4,700	14.70	69,090.00	

YPF S.A. -SPONSORED ADR	10,600	18.22	193,132.00	
PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	7,010	12.90	90,429.00	
QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	7,400	31.26	231,324.00	
CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	12,900	16.53	213,237.00	
MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	10,700	9.10	97,370.00	
NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	7,370	26.62	196,189.40	
PJSC ALROSA	176,000	1.42	250,643.36	
PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	40,800	22.58	921,264.00	
POLYUS PJSC-REG S-GDR	3,960	45.84	181,526.40	
SEVERSTAL-GDR REG S	11,380	17.20	195,736.00	
SOUTHERN COPPER CORP	4,792	39.25	188,086.00	
ZTO EXPRESS CAYMAN INC	19,100	19.03	363,473.00	
LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR	20,300	9.24	187,572.00	
DP WORLD PLC	11,000	16.58	182,380.00	
NIO INC ADR	32,700	2.64	86,328.00	
HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	8,800	35.19	309,672.00	
YUM CHINA HOLDINGS INC	23,160	46.07	1,066,981.20	
ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	88,770	167.55	14,873,413.50	
BAOZUN INC-SPN ADR	2,300	49.41	113,643.00	
CTIP.COM INTERNATIONAL -ADR	26,340	36.05	949,557.00	
JD.COM INC-ADR	45,800	29.06	1,330,948.00	
PINDUODUO INC ADR	11,400	21.05	239,970.00	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	26,600	8.02	213,332.00	
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	20,570	14.25	293,225.35	
X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	8,500	33.90	288,150.00	
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	4,000	27.60	110,400.00	
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD - ADR	3,890	28.61	111,292.90	
BANCO DE CHILE-ADR	10,500	29.50	309,750.00	
BANCO MACRO SA-ADR	2,760	66.46	183,429.60	
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	9,596	29.15	279,723.40	
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	7,330	50.78	372,217.40	
BBVA ARGENTINA SA-ADR	4,300	11.00	47,300.00	
CREDICORP LTD	4,350	225.87	982,534.50	
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	6,200	34.13	211,606.00	
ITAU CORPBANCA-ADR	5,466	12.34	67,450.44	

	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	672,300	3.76	2,528,984.18	
	STATE BANK OF INDIA-GDR	11,070	49.80	551,286.00	
	VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	1.26	110,917.18	
	GDS HOLDINGS LTD-ADR	3,200	34.28	109,696.00	
	GLOBANT SA	2,470	105.01	259,374.70	
	TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	5,300	17.95	95,135.00	
	MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	28,650	9.12	261,288.00	
	ENEL AMERICAS S.A-ADR	37,300	8.38	312,574.00	
	ENEL CHILE SA-ADR	30,925	4.77	147,512.25	
	INTER RAO UES PJSC	2,740,000	0.07	213,281.60	
	PAMPA ENERGIA SA-SPON ADR	3,800	32.90	125,020.00	
	MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	85,170	1.41	120,712.29	
	NOAH HLDS LTD ADR	1,500	41.28	61,920.00	
	NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	9,230	94.60	873,158.00	
	TAL EDUCATION GROUP-ADR	22,990	37.68	866,263.20	
	51JOB INC-ADR	1,300	74.65	97,045.00	
	SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	1.21	106,492.32	
	IQIYI INC-ADR	9,100	18.15	165,165.00	
	NETEASE INC-ADR	4,400	262.43	1,154,692.00	
	TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	7,400	15.00	111,000.00	
	58.COM INC-ADR	5,780	64.15	370,787.00	
	AUTOHOME INC-ADR	3,860	89.46	345,315.60	
	BAIDU INC - SPON ADR	17,140	116.91	2,003,837.40	
	MOMO INC-SPON ADR	8,800	33.72	296,736.00	
	SINA CORP	4,150	42.60	176,790.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,400	43.21	146,914.00	
	YY INC-ADR	3,000	69.89	209,670.00	
小計	銘柄数：72			45,936,004.27	
				(4,934,445,578)	
	組入時価比率：13.0%			13.7%	
メキシコペソ	MEXICHEM SAB DE CV-*	60,458	41.63	2,516,866.54	
	CEMEX SAB - CPO	886,985	7.96	7,060,400.60	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	229,983	50.73	11,667,037.59	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	249.45	2,097,874.50	
	ALFA S.A.B. -A	172,100	19.21	3,306,041.00	

GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	73.30	2,558,170.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,300	324.46	4,639,778.00	
GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	21,400	203.70	4,359,180.00	
PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	12,900	193.23	2,492,667.00	
ALSEA SAB DE CV	30,000	39.70	1,191,000.00	
EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,800	105.34	1,137,672.00	
WALMART DE MEXICO-SER V	323,000	52.85	17,070,550.00	
ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	26,100	103.36	2,697,696.00	
COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	32,495	119.88	3,895,500.60	
FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	118,200	185.18	21,888,276.00	
GRUMA S.A.B. -B	13,400	180.10	2,413,340.00	
GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	90,500	40.02	3,621,810.00	
KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	79,500	35.97	2,859,615.00	
BANCO SANTANDER MEXICO SA INSTITUCION	134,000	29.01	3,887,340.00	
GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	167,300	110.04	18,409,692.00	
GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	140,200	27.98	3,922,796.00	
AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,090,000	14.58	30,472,200.00	
INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	38,700	80.15	3,101,805.00	
GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	153,400	34.19	5,244,746.00	
MEGACABLE HOLDINGS-CPO	23,100	80.31	1,855,161.00	
十銘柄数：25			164,367,214.83	
			(925,387,419)	
組入時価比率：2.4%			2.6%	
COSAN SA	9,100	46.22	420,602.00	
PETROBRAS - PETROLEO BRAS	189,300	31.79	6,017,847.00	
PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	260,400	28.28	7,364,112.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	21.40	1,027,200.00	
BRASKEM SA-PREF A	12,100	35.50	429,550.00	
KLABIN SA-UNIT	42,700	16.18	690,886.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	16.50	762,300.00	
GERDAU SA PFD NPV	74,500	15.22	1,133,890.00	
VALE SA	195,521	52.44	10,253,121.24	
SUZANO SA	32,960	33.76	1,112,729.60	
EMBRAER SA	41,000	19.13	784,330.00	
WEG SA	51,924	21.43	1,112,731.32	

LOCALIZA RENT A CAR	34,634	40.90	1,416,530.60	
RUMO SA	70,600	20.88	1,474,128.00	
CCR SA	69,000	14.52	1,001,880.00	
B2W CIA DIGITAL	13,500	34.55	466,425.00	
LOJAS AMERICANAS S.A.(PREF)	50,492	16.57	836,652.44	
LOJAS RENNER S.A.	47,395	46.98	2,226,617.10	
MAGAZINE LUIZA SA	4,700	212.65	999,455.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	19,000	25.00	475,000.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	29,600	21.95	649,720.00	
CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF	11,103	88.11	978,285.33	
RAIA DROGASIL SA	13,500	74.45	1,005,075.00	
AMBEV SA	300,256	18.45	5,539,723.20	
BRF SA	32,700	28.66	937,182.00	
JBS SA	65,700	22.07	1,449,999.00	
M DIAS BRANCO SA	5,500	39.22	215,710.00	
NATURA COSMETICOS SA	11,600	59.17	686,372.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	20,700	41.02	849,114.00	
HYPERA SA	23,900	29.70	709,830.00	
BANCO BRADESCO S.A.	74,131	33.70	2,498,214.70	
BANCO BRADESCO SA - PREF	248,915	37.63	9,366,671.45	
BANCO DO BRASIL SA	52,300	52.91	2,767,193.00	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	45.70	1,115,080.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	305,091	36.18	11,038,192.38	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	284,017	12.60	3,578,614.20	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	44,100	32.20	1,420,020.00	
IRB BRASIL RESSEGUROS SA	8,400	99.48	835,632.00	
PORTO SEGURO SA	7,000	54.15	379,050.00	
SUL AMERICA SA - UNITS	14,049	34.20	480,475.80	
CIELO SA	73,763	7.28	536,994.64	
TELEFONICA BRASIL-PREF	26,805	49.88	1,337,033.40	
TIM PARTICIPACOES SA	46,552	11.86	552,106.72	
CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	35.15	632,700.00	
CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	11,100	34.73	385,503.00	
CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	60,029	14.74	884,827.46	
ENERGISA SA-UNITS	10,200	45.60	465,120.00	

		EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	10,000	91.19	911,900.00	
		CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	21,300	46.75	995,775.00	
		B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	131,433	39.75	5,224,461.75	
		BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	10,900	50.35	548,815.00	
		KROTON EDUCACIONAL SA	83,456	10.87	907,166.72	
		ENGIE BRASIL SA	12,000	43.19	518,280.00	
		BR MALLS PARTICIPACOES SA	46,700	14.62	682,754.00	
		MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	17,600	27.99	492,624.00	
	小計	銘柄数：55			101,582,203.05	
					(2,854,459,905)	
		組入時価比率：7.5%			7.9%	
チリペソ		EMPRESAS COPEC SA	25,900	7,250.00	187,775,000.00	
		EMPRESAS CMPC SA	71,951	1,890.00	135,987,390.00	
		S.A.C.I. FALABELLA	50,200	4,300.00	215,860,000.00	
		CENCOSUD SA	80,738	1,328.50	107,260,433.00	
		EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	28,800	2,470.00	71,136,000.00	
		BANCO DE CREDITO E INVERSION	2,960	46,770.00	138,439,200.00	
		EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	8,972	6,808.60	61,086,759.20	
		AGUAS ANDINAS SA-A	110,000	402.41	44,265,100.00	
		COLBUN SA	471,000	141.79	66,783,090.00	
	小計	銘柄数：9			1,028,592,972.20	
					(161,489,096)	
		組入時価比率：0.4%			0.4%	
コロンビアペソ		CEMENTOS ARGOS SA	27,600	7,540.00	208,104,000.00	
		GRUPO ARGOS SA	15,600	17,460.00	272,376,000.00	
		BANCOLOMBIA SA	15,900	38,600.00	613,740,000.00	
		GRUPO AVAL ACCIONES-PFD	205,700	1,280.00	263,296,000.00	
		GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	34,440.00	447,720,000.00	
		GRUPO DE INV SURAMERICANA-PREF	7,000	31,780.00	222,460,000.00	
		INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	18,980.00	641,524,000.00	
	小計	銘柄数：7			2,669,220,000.00	
					(89,418,870)	
		組入時価比率：0.2%			0.2%	
ユーロ		MOTOR OIL (HELLAS) SA	3,800	22.92	87,096.00	
		TITAN CEMENT CO	2,570	16.70	42,919.00	
		FF GROUP	2,030	1.92	3,897.60	

	OPAP SA	13,190	9.99	131,834.05	
	JUMBO SA	6,732	16.78	112,962.96	
	ALPHA BANK A.E.	76,409	1.61	123,018.49	
	EUROBANK ERGASIAS SA	162,000	0.81	132,273.00	
	NATIONAL BANK OF GREECE	33,000	2.23	73,656.00	
	HELLENIC TELECOM	16,700	12.17	203,239.00	
小計	銘柄数：9			910,896.10	
				(111,347,939)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
英債券	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	15,800	9.43	149,057.20	
小計	銘柄数：1			149,057.20	
				(20,411,892)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,300	114.10	947,030.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	78,250	7.56	591,570.00	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	20,730	17.95	372,103.50	
	KOC HLDGS	53,000	17.25	914,250.00	
	TURK SISE VE CAM FABRIKALARI AS	42,345	5.09	215,536.05	
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,186	12.83	412,946.38	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,660	26.70	257,922.00	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	3,320	60.30	200,196.00	
	ARCELIK A.S	14,543	19.37	281,697.91	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	12,690	77.70	986,013.00	
	ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYII	12,740	18.78	239,257.20	
	AKBANK T.A.S	205,000	6.72	1,377,600.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	142,160	8.55	1,215,468.00	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	5.62	515,916.00	
	HACI OMER SABANCI HOLDING	47,880	8.37	400,755.60	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	77,000	12.48	960,960.00	
小計	銘柄数：16			9,889,221.64	
				(184,335,091)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	898.00	4,534,900.00	
	MONETA MONEY BANK AS	27,300	77.80	2,123,940.00	
	CEZ AS	9,530	542.00	5,165,260.00	

小計	銘柄数：3			11,824,100.00	
	組入時価比率：0.1%			(56,519,198)	0.2%
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	25,000	3,106.00	77,650,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	8,470	5,125.00	43,408,750.00	
	OTP BANK NYRT	14,190	11,750.00	166,732,500.00	
	小計 銘柄数：3			287,791,250.00	
	組入時価比率：0.3%			(108,468,522)	0.3%
ズロチ	GRUPA LOTOS SA	6,800	86.42	587,656.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	18,800	88.56	1,664,928.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	97,770	5.26	514,759.05	
	JASTRZEBSKA SPOLKA WEGLOWA S	2,570	42.76	109,893.20	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,900	104.40	1,033,560.00	
	CCC SA	1,520	162.20	246,544.00	
	LPP SA	94	7,375.00	693,250.00	
	DINO POLSKA SA	2,410	130.80	315,228.00	
	ALIOR BANK SA	4,843	49.20	238,275.60	
	BANK MILLENNIUM SA	35,830	9.52	341,101.60	
	BANK PEKAO SA	10,520	113.65	1,195,598.00	
	MBANK	900	425.40	382,860.00	
	PKO BANK POLSKI SA	56,200	43.17	2,426,154.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	2,030	370.40	751,912.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	37,500	43.26	1,622,250.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	7.20	281,880.00	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	8.83	456,879.36	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	30.08	568,512.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,080	202.60	826,608.00	
	小計 銘柄数：19			14,257,848.81	
	組入時価比率：1.1%			(409,770,574)	1.1%
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.05	19,451.00	
	LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	100,000	7.50	750,000.00	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	112,000	3.22	360,640.00	

CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,594,900	5.34	8,516,766.00	
CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	203,000	17.02	3,455,060.00	
CNOOC LTD	1,132,000	13.48	15,259,360.00	
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	186,000	6.94	1,290,840.00	
PETROCHINA CO LTD-H	1,284,000	4.36	5,598,240.00	
YANZHOU COAL MINING-H	96,000	7.21	692,160.00	
SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	206,000	3.43	706,580.00	
ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	74,000	47.55	3,518,700.00	
BBMG CORPORATION - H	127,000	2.48	314,960.00	
CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	235,000	6.72	1,579,200.00	
CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	152,000	7.26	1,103,520.00	
ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	2.84	596,400.00	
ANGANG STEEL CO LTD-H	75,400	3.40	256,360.00	
CHINA HONGQIAO GROUP LTD	104,000	5.41	562,640.00	
CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	180,000	2.49	448,200.00	
CHINA ORIENTAL GROUP COMPANY LIMITED	86,000	4.12	354,320.00	
CHINA ZHONGWANG HOLDING LTD	88,800	3.94	349,872.00	
JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	10.42	1,021,160.00	
MAANSHAN IRON & STEEL CO LTD - H	134,000	3.09	414,060.00	
MMG LTD	132,000	2.87	378,840.00	
ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	57,000	8.44	481,080.00	
ZIJIN MINING GROUP CO-H	347,000	3.19	1,106,930.00	
LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	5.57	434,460.00	
NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	6.68	674,680.00	
AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	4.29	866,580.00	
CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	299,000	7.44	2,224,560.00	
CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	6.16	1,074,304.00	
CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	230,000	6.13	1,409,900.00	
CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	135,000	9.97	1,345,950.00	
CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	8.36	1,281,170.00	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	156,000	2.16	336,960.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	6.81	486,915.00	
FULLSHARE HOLDINGS LIMITED	390,000	0.49	193,050.00	

SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	126,000	2.80	352,800.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	39,984	8.61	344,262.24	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	36,300	41.85	1,519,155.00	
CITIC LTD	362,000	11.22	4,061,640.00	
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	165,940	10.26	1,702,544.40	
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	30,000	16.80	504,000.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	99,500	26.75	2,661,625.00	
CRRC CORP LTD-H	275,350	6.68	1,839,338.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	32,000	16.00	512,000.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	37,500	14.68	550,500.00	
WEICHAI POWER CO LTD-H	117,800	13.10	1,543,180.00	
BOC AVIATION LTD	11,300	65.95	745,235.00	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	211,000	7.38	1,557,180.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	72,000	17.66	1,271,520.00	
GREENTOWN SER	60,000	6.36	381,600.00	
SINOTRANS LIMITED-H	111,000	2.84	315,240.00	
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	8.01	817,020.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	76,000	4.73	359,480.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	5.56	589,360.00	
COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION-H	66,000	4.53	298,980.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	140,000	3.14	439,600.00	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	6.82	668,360.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	82,000	13.34	1,093,880.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	7.60	775,200.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	11.36	772,480.00	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	49,500	14.72	728,640.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	8.03	915,420.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	172,000	2.31	397,320.00	
FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	39,200	23.65	927,080.00	
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	43,000	9.83	422,690.00	
BAIC MOTOR CORPORATION LIMITED	96,000	4.78	458,880.00	
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	8.60	1,874,800.00	

BYD CO LTD-H	44,000	47.25	2,079,000.00	
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	5.87	1,080,080.00	
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	301,000	13.10	3,943,100.00	
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	166,500	5.58	929,070.00	
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	199,890	7.89	1,577,132.10	
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	87,000	21.65	1,883,550.00	
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	67,000	51.95	3,480,650.00	
HENG TEN NETWORKS GROUP LTD	1,216,000	0.19	232,256.00	
LI NING CO LTD	140,000	15.16	2,122,400.00	
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	45,000	104.50	4,702,500.00	
MEITUAN DIANPING B	64,700	64.30	4,160,210.00	
GOME RETAIL HOLDINGS LTD	523,360	0.82	429,155.20	
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	31,000	20.45	633,950.00	
SUN ART RETAIL GROUP LTD	127,000	7.18	911,860.00	
CHINA RESOURCES BEER HOLDING	87,333	36.60	3,196,387.80	
TSING TAO BREWERY CO-H	24,000	48.55	1,165,200.00	
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	114,000	2.55	290,700.00	
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.10	15,120.00	
CHINA MENGNIU DAIRY CO	172,000	30.40	5,228,800.00	
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	5.23	583,145.00	
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	118,000	12.90	1,522,200.00	
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	70,000	8.33	583,100.00	
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	288,000	6.28	1,808,640.00	
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	28,000	40.85	1,143,800.00	
HENGAN INTL GROUP CO LTD	44,500	56.70	2,523,150.00	
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	116,000	7.20	835,200.00	
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	15.20	773,680.00	
SINOPHARM GROUP CO-H	69,200	27.25	1,885,700.00	
3SBIO, INC	77,000	13.14	1,011,780.00	
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	81,000	6.32	511,920.00	
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	8.71	810,030.00	
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	124,000	3.91	484,840.00	
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP	292,000	12.22	3,568,240.00	

LIMITED				
LUYE PHARMA GROUP LTD	62,500	5.74	358,750.00	
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	23.10	796,950.00	
SIHUAN PHARMACEUTICAL HLDGS	155,000	1.74	269,700.00	
SINO BIOPHARMACEUTICAL	433,000	7.68	3,325,440.00	
SSY GROUP LTD	82,000	6.91	566,620.00	
TONG REN TANG TECHNOLOGIES-H	31,000	9.56	296,360.00	
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,887,000	3.28	6,189,360.00	
BANK OF CHINA LTD-H	4,906,000	3.27	16,042,620.00	
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	523,790	6.46	3,383,683.40	
CHINA CITIC BANK-H	560,000	4.42	2,475,200.00	
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,028,000	6.57	39,603,960.00	
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	3.60	925,200.00	
CHINA MERCHANTS BANK-H	243,692	42.15	10,271,617.80	
CHINA MINSHENG BANKING-H	419,800	5.79	2,430,642.00	
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	137,000	4.19	574,030.00	
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,096,000	5.93	24,289,280.00	
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	476,000	4.64	2,208,640.00	
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	8.00	1,232,000.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	446,000	19.32	8,616,720.00	
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	172,200	31.00	5,338,200.00	
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	308,000	1.43	440,440.00	
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	20.70	2,141,870.40	
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	47,400	37.50	1,777,500.00	
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	3.10	1,819,700.00	
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	434,420	8.55	3,714,291.00	
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	348,000	93.95	32,694,600.00	
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	25,000	22.75	568,750.00	
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	16.38	1,081,080.00	
KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	142,000	8.52	1,209,840.00	
KINGSOFT CORP LTD	46,000	17.50	805,000.00	
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	33,000	11.16	368,280.00	
ZTE CORP-H	58,052	22.00	1,277,144.00	
LEGEND HLDS CORP	18,100	18.52	335,212.00	

LENOVO GROUP LTD	426,000	5.79	2,466,540.00	
MEITU INC	106,000	2.71	287,260.00	
XIAOMI CORPORATION	206,000	9.80	2,018,800.00	
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	45,000	43.95	1,977,750.00	
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	80,000	5.48	438,400.00	
KINGBOARD HOLDINGS LTD	43,000	20.25	870,750.00	
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	58,500	6.90	403,650.00	
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	43,800	80.00	3,504,000.00	
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	26,000	15.30	397,800.00	
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	176,000	8.45	1,487,200.00	
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	162,000	3.74	605,880.00	
CHINA TELECOM CORP LTD-H	856,000	3.94	3,372,640.00	
CHINA TOWER CORP LTD	2,540,000	2.10	5,334,000.00	
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	378,000	8.55	3,231,900.00	
CHINA MOBILE LTD	382,500	71.00	27,157,500.00	
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	39.65	1,427,400.00	
CHINA GAS HOLDINGS LTD	117,400	27.85	3,269,590.00	
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	52,000	38.25	1,989,000.00	
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	49,600	73.65	3,653,040.00	
TOWNGAS CHINA COMPANY LTD	53,000	5.74	304,220.00	
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	317,000	4.62	1,464,540.00	
GUANGDONG INVESTMENT	184,000	15.74	2,896,160.00	
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.83	1,134,600.00	
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LT	56,000	23.08	1,292,480.00	
CHINA EVERBRIGHT LTD	48,000	11.82	567,360.00	
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.57	1,215,620.00	
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	592,000	1.35	799,200.00	
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO LTD-H	92,400	15.94	1,472,856.00	
CITIC SECURITIES CO LTD-H	123,000	15.90	1,955,700.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	9.26	764,876.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	62,000	13.88	860,560.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	173,600	8.80	1,527,680.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	92,200	13.64	1,257,608.00	

CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS	25,000	12.08	302,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	627,000	2.23	1,398,210.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	218,000	5.02	1,094,360.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	240,000	1.88	451,200.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	108,000	11.22	1,211,760.00	
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN-H	166,000	2.08	345,280.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	88,000	3.21	282,480.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	4.67	1,111,460.00	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	380,000	2.20	836,000.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	212,000	7.69	1,630,280.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	56,000	19.34	1,083,040.00	
WUXI APPTTEC CO LTD	12,460	65.55	816,753.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	33,500	69.05	2,313,175.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	10.20	958,800.00	
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD	98,000	10.36	1,015,280.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	126,000	22.45	2,828,700.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	300,000	4.70	1,410,000.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	234,000	27.80	6,505,200.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	170,444	33.95	5,786,573.80	
CHINA VANKE CO LTD-H	99,300	29.15	2,894,595.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	196,000	4.97	974,120.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	494,380	11.80	5,833,684.00	
FUTURE LAND DEVELOPMENT HLD LTD	96,000	9.78	938,880.00	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	50,400	14.58	734,832.00	
KAISA GROUP HLDS LTD	115,000	3.68	423,200.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	68,500	7.88	539,780.00	
LOGAN PROPERTY HLDS CO LTD	74,000	12.70	939,800.00	
LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	116,500	29.05	3,384,325.00	
SHENZHEN INVESTMENT LTD	176,000	2.88	506,880.00	
SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	72,000	23.70	1,706,400.00	
SHUI ON LAND LTD	197,000	1.76	346,720.00	
SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	146,000	3.26	475,960.00	
SOHO CHINA LTD	106,000	2.60	275,600.00	
SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	148,000	38.70	5,727,600.00	

小計	銘柄数：207	YUEXIU PROPERTY CO LTD	370,000	1.75	647,500.00	
		YUZHOU PROPERTIES CO LTD	91,000	3.53	321,230.00	
		CHINA LITERATURE LTD	20,800	35.40	736,320.00	
		ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	1.71	1,487,700.00	
		TENCENT HOLDINGS LTD	355,800	354.40	126,095,520.00	
					592,177,862.14	
					(8,142,445,604)	
					22.6%	
	組入時価比率：21.4%					
リング		DIALOG GROUP BHD	219,344	3.24	710,674.56	
		PETRONAS DAGANGAN BHD	14,500	25.46	369,170.00	
		PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	144,000	8.56	1,232,640.00	
		PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	81,100	4.48	363,328.00	
		GAMUDA BERHAD	100,200	3.83	383,766.00	
		IJM CORP	152,600	2.41	367,766.00	
		HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	9.90	334,620.00	
		SIME DARBY BERHAD	220,000	2.30	506,000.00	
		AIRASIA GROUP BHD	86,600	2.74	237,284.00	
		MISC BHD	69,060	7.20	497,232.00	
		MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	56,460	8.55	482,733.00	
		WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	3.88	199,432.00	
		GENTING BHD	124,000	7.01	869,240.00	
		GENTING MALAYSIA BHD	163,200	3.35	546,720.00	
		FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	34.54	265,958.00	
		GENTING PLANTATIONS BHD	14,600	10.28	150,088.00	
		IOI CORP	116,700	4.25	495,975.00	
		KUALA LUMPUR KEPONG	26,400	24.54	647,856.00	
		NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	4,400	149.00	655,600.00	
		PPB GROUP BERHAD	35,040	18.70	655,248.00	
		QL RESOURCES BHD	40,000	6.85	274,000.00	
		SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	4.96	715,728.00	
		BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	7,800	27.50	214,500.00	
		HARTALEGA HOLDINGS BHD	74,400	5.25	390,600.00	
		TOP GLOVE CORP BHD	84,200	5.00	421,000.00	
		IHH HEALTHCARE BHD	156,000	5.79	903,240.00	
		ALLIANCE BANK MALAYSIA BHD	54,800	3.76	206,048.00	

小計	AMMB HOLDING	125,000	4.41	551,250.00	
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	289,000	5.23	1,511,470.00	
	HONG LEONG BANK	37,460	19.50	730,470.00	
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	18.56	249,112.32	
	MALAYAN BANKING	246,000	8.94	2,199,240.00	
	PUBLIC BANK BHD	194,460	23.06	4,484,247.60	
	RHB BANK BHD	80,023	5.62	449,729.26	
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	3.95	244,900.00	
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	5.05	984,750.00	
	DIGI.COM BERHAD	186,000	4.95	920,700.00	
	MAXIS BHD	146,200	5.81	849,422.00	
	TENAGA NASIONAL	192,300	13.90	2,672,970.00	
	PETRONAS GAS BERHAD	43,700	17.68	772,616.00	
	YTL CORPORATION	210,847	1.14	240,365.58	
	SIME DARBY PROPERTY BHD	250,000	1.05	262,500.00	
	SP SETIA BHD	87,500	2.25	196,875.00	
	銘柄数：43			30,417,064.32	
				(788,410,307)	
	組入時価比率：2.1%			2.2%	
パーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	263,000	14.60	3,839,800.00	
	IRPC PCL - NVDR	900,000	5.15	4,635,000.00	
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	86,400	135.00	11,664,000.00	
	PTT PCL-NVDR	716,000	49.00	35,084,000.00	
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	64.25	5,332,750.00	
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	47.75	5,298,674.25	
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	64.75	9,841,611.50	
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	50,600	472.00	23,883,200.00	
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	12.00	5,712,000.00	
	AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	257,000	74.50	19,146,500.00	
	BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	11.30	5,052,230.00	
	MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	163,000	39.50	6,438,500.00	
	ROBINSON PCL -NVDR	26,100	56.75	1,481,175.00	
	HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	354,597	18.00	6,382,746.00	
	BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	50.50	3,721,850.00	
	CP ALL PCL-NVDR	375,000	85.50	32,062,500.00	

	CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	213,200	28.00	5,969,600.00	
	THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	18.00	3,596,400.00	
	BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	563,000	25.50	14,356,500.00	
	BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	170.00	5,474,000.00	
	BANGKOK BANK(F)	28,600	202.00	5,777,200.00	
	KASIKORNBANK PCL-NVDR	50,200	192.00	9,638,400.00	
	KASIKORNBANK PCL(F)	72,000	192.00	13,824,000.00	
	KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	19.40	5,180,770.00	
	SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	50,800	135.00	6,858,000.00	
	TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	649,400	2.00	1,298,800.00	
	TRUE CORP PCL-NVDR	597,200	5.55	3,314,460.00	
	ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	71,200	206.00	14,667,200.00	
	INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	125,000	60.00	7,500,000.00	
	TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	43,000	50.75	2,182,250.00	
	MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	56.75	2,780,750.00	
	ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	322.00	5,570,600.00	
	ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	95,000	53.75	5,106,250.00	
	GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	33,000	114.50	3,778,500.00	
	RATCH GROUP PCL-NVDR	43,000	63.50	2,730,500.00	
	CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	133,900	76.25	10,209,875.00	
	LAND & HOUSES PUB - NVDR	429,300	11.10	4,765,230.00	
小計	銘柄数：37			314,155,821.75	
				(1,096,403,817)	
	組入時価比率：2.9%			3.0%	
フィリピン	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	54.85	8,008,100.00	
	ALLIANCE GLOBAL GROUP INC	218,900	15.12	3,309,768.00	
	DMCI HOLDINGS INC	178,000	10.54	1,876,120.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	173,700	66.60	11,568,420.00	
	SM INVESTMENTS CORP	14,405	966.00	13,915,230.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	69,000	144.30	9,956,700.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	24,400	288.00	7,027,200.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	50,800	176.00	8,940,800.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	53,599	80.50	4,314,719.50	
	BDO UNIBANK INC	124,998	141.30	17,662,217.40	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	113,005	74.60	8,430,173.00	

	SECURITY BANK CORP	12,000	170.00	2,040,000.00	
	AYALA CORPORATION	17,002	898.00	15,267,796.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,061	961.00	4,863,621.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	4.77	3,567,006.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	2,230.00	4,616,100.00	
	PLDT INC	4,970	1,280.00	6,361,600.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	380.00	6,422,000.00	
	ABOITIZ POWER CORP	76,700	35.00	2,684,500.00	
	AYALA LAND LTD	441,300	50.75	22,395,975.00	
	MEGAWORLD CORP	910,000	6.07	5,523,700.00	
	ROBINSONS LAND CO	167,968	26.80	4,501,542.40	
	SM PRIME HLDGS	652,975	38.30	25,008,942.50	
小計	銘柄数：23			198,262,230.80	
				(412,385,440)	
	組入時価比率：1.1%			1.1%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	1,225.00	1,028,020,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	220,000	2,900.00	638,000,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	99,150	27,450.00	2,721,667,500.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	430,000	3,200.00	1,376,000,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	101,200	20,250.00	2,049,300,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	11,375.00	2,002,000,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	148,600	9,975.00	1,482,285,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA	100,000	13,000.00	1,300,000,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	113,559	5,850.00	664,320,150.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,212,000	7,450.00	9,029,400,000.00	
	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	10,025.00	1,784,450,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	266,200	7,075.00	1,883,365,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	499,000	4,390.00	2,190,610,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	76,000.00	2,219,200,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	640,000	3,250.00	2,080,000,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	89,100	45,300.00	4,036,230,000.00	
	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,455.00	2,240,700,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	615,000	29,400.00	18,081,000,000.00	
	BANK MANDIRI	1,142,000	7,975.00	9,107,450,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	8,850.00	4,416,150,000.00	

小計	BANK RAKYAT INDONESIA	3,536,000	4,360.00	15,416,960,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	208,000	2,670.00	555,360,000.00	
	TELEKOMUNIKASI	3,080,000	4,040.00	12,443,200,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	593,500	2,050.00	1,216,675,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	428,300	1,535.00	657,440,500.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	920,000	770.00	708,400,000.00	
	SURYA CITRA MEDIA PT TBK	345,500	1,600.00	552,800,000.00	
	銘柄数：27			101,880,983,150.00	
				(774,295,471)	
	組入時価比率：2.0%			2.1%	
ウォン	GS HOLDINGS CORP	3,600	51,200.00	184,320,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,690	83,000.00	223,270,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,580	161,000.00	576,380,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	6,330	22,500.00	142,425,000.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	998	97,500.00	97,305,000.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	384	188,500.00	72,384,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	2,970	348,000.00	1,033,560,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,050	255,000.00	267,750,000.00	
	OCI COMPANY LTD	860	93,200.00	80,152,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,810	55,200.00	99,912,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	4,779	41,700.00	199,284,300.00	
	KOREA ZINC CO LTD	592	474,000.00	280,608,000.00	
	POSCO	5,040	243,500.00	1,227,240,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	4,520	36,500.00	164,980,000.00	
	KCC CORP	309	278,000.00	85,902,000.00	
	DAELIM INDUSTRIAL COMPANY	1,600	117,000.00	187,200,000.00	
	DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	9,690	5,010.00	48,546,900.00	
	GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	40,450.00	170,699,000.00	
	HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	1,566	45,100.00	70,626,600.00	
	HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	4,650	54,000.00	251,100,000.00	
	SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,520	17,150.00	146,118,000.00	
	CJ CORP	1,100	103,000.00	113,300,000.00	
	CJ CORP-CONVERT PREF	165	83,354.00	13,753,533.00	
	HANWHA CORPORATION	2,470	26,700.00	65,949,000.00	
	LG CORP	6,050	76,400.00	462,220,000.00	
		1,620	44,000.00	71,280,000.00	

LOTTE CORP				
SAMSUNG C&T CORP	5,700	95,400.00	543,780,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	2,340	238,500.00	558,090,000.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,900	33,000.00	95,700,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	36,300.00	121,605,000.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	597	318,500.00	190,144,500.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	2,377	122,000.00	289,994,000.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	30,700	8,180.00	251,126,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,900	18,200.00	70,980,000.00	
S-1 CORPORATION	820	100,000.00	82,000,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,140	163,500.00	186,390,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,576	30,500.00	78,568,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	14,890	4,335.00	64,548,150.00	
CJ LOGISTICS	390	154,500.00	60,255,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	35,450.00	188,594,000.00	
HANON SYSTEMS	11,650	12,200.00	142,130,000.00	
HYUNDAI MOBIS	4,410	226,000.00	996,660,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	9,380	140,500.00	1,317,890,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	86,800.00	229,152,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	80,300.00	118,041,000.00	
KIA MOTORS CORP	15,770	42,350.00	667,859,500.00	
LG ELECTRONICS INC	6,370	80,400.00	512,148,000.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	3,340	81,800.00	273,212,000.00	
HLB INC	2,500	70,100.00	175,250,000.00	
FILA KOREA LTD	2,930	81,600.00	239,088,000.00	
KANGWON LAND INC	7,900	31,300.00	247,270,000.00	
CJ ENM CO LTD	657	176,800.00	116,157,600.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,140	84,100.00	95,874,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	800	161,000.00	128,800,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	427	299,500.00	127,886,500.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	1,672	96,700.00	161,682,400.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	203,000.00	98,455,000.00	
E-MART CO	1,181	144,000.00	170,064,000.00	
GS RETAIL CO LTD	1,140	37,350.00	42,579,000.00	

CJ CHEILJEDANG CORP	510	301,500.00	153,765,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,131	91,700.00	103,712,700.00	
OTTOGI CORPORATION	70	699,000.00	48,930,000.00	
KT & G CORP	6,990	99,400.00	694,806,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,930	171,500.00	330,995,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	410	89,500.00	36,695,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	62,500.00	95,000,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	570	1,308,000.00	745,560,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	808,000.00	84,032,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,335	58,800.00	196,098,000.00	
CELLTRION INC	5,540	212,500.00	1,177,250,000.00	
HELIXMITH CO LTD	960	191,800.00	184,128,000.00	
MEDY-TOX INC	226	441,000.00	99,666,000.00	
SILLAJEN INC	3,750	56,800.00	213,000,000.00	
CELLTRION PHARM INC	830	51,500.00	42,745,000.00	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	472	418,500.00	197,532,000.00	
HANMI SCIENCE CO LTD	750	69,700.00	52,275,000.00	
YUHAN CORPORATION	690	251,000.00	173,190,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	12,887	7,310.00	94,203,970.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	18,090	36,650.00	662,998,500.00	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	15,040	13,900.00	209,056,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	25,550	45,350.00	1,158,692,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	28,860	44,900.00	1,295,814,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	29,900	14,000.00	418,600,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	2,850	61,200.00	174,420,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	13,280	3,255.00	43,226,400.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,400	29,750.00	101,150,000.00	
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	1,610	33,000.00	53,130,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	1,890	270,500.00	511,245,000.00	
SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,640	83,000.00	385,120,000.00	
SAMSUNG SDS CO LTD	2,090	216,500.00	452,485,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS	298,280	45,700.00	13,631,396,000.00	
SAMSUNG ELECTRONICS PFD	51,100	37,450.00	1,913,695,000.00	
LG INNOTEK CO LTD	860	105,000.00	90,300,000.00	
LG.DISPLAY CO LTD	16,200	17,450.00	282,690,000.00	

SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	3,320	96,000.00	318,720,000.00	
SAMSUNG SDI CO,LTD	3,580	233,000.00	834,140,000.00	
SK HYNIX INC	33,760	65,900.00	2,224,784,000.00	
LG UPLUS CORP	6,440	14,650.00	94,346,000.00	
SK TELECOM CO LTD	1,270	262,000.00	332,740,000.00	
KOREA ELECTRIC POWER	15,370	26,200.00	402,694,000.00	
KOREA GAS CORPORATION	1,599	41,200.00	65,878,800.00	
SAMSUNG CARD CO	1,360	37,750.00	51,340,000.00	
KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	2,250	80,300.00	180,675,000.00	
MERITZ SECURITIES	24,500	5,490.00	134,505,000.00	
MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	24,737	8,000.00	197,896,000.00	
NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	14,500.00	112,085,000.00	
SAMSUNG SECURITIES	3,565	37,800.00	134,757,000.00	
SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,024	317,000.00	324,608,000.00	
CHEIL WORLDWIDE INC	3,320	29,000.00	96,280,000.00	
NCSOFT CORPORATION	985	485,000.00	477,725,000.00	
NETMARBLE CORP	1,470	126,000.00	185,220,000.00	
PEARL ABYSS CORP	310	223,500.00	69,285,000.00	
KAKAO CORP	3,070	126,500.00	388,355,000.00	
NAVER CORP	9,050	113,000.00	1,022,650,000.00	
小計 銘柄数：114			48,734,524,853.00	
			(4,522,563,906)	
組入時価比率：11.9%			12.5%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	72,360	113.00	8,176,680.00
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	214,998	110.00	23,649,780.00
	FORMOSA PLASTIC	277,424	113.00	31,348,912.00
	NAN YA PLASTICS CORP	324,726	78.80	25,588,408.80
	ASIA CEMENT	126,980	46.65	5,923,617.00
	TAIWAN CEMENT	276,955	45.15	12,504,518.25
	CHINA STEEL	754,544	25.00	18,863,600.00
	FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	229,454	33.10	7,594,927.40
	AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	6,000	353.00	2,118,000.00
	HIWIN TECHNOLOGIES CORP	12,858	264.00	3,394,512.00
	CHINA AIRLINES	133,561	10.30	1,375,678.30

EVA AIRWAYS CORP	175,677	15.00	2,635,155.00	
EVERGREEN MARINE	91,157	12.45	1,134,904.65	
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	46.00	6,578,000.00	
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	107,036	40.55	4,340,309.80	
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	234.50	2,345,000.00	
TATUNG CO LTD	130,000	19.15	2,489,500.00	
GIANT MANUFACTURING	18,752	249.50	4,678,624.00	
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,443	411.00	4,703,073.00	
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	20,315	245.00	4,977,175.00	
FORMOSA TAFFETA CO.	65,000	39.05	2,538,250.00	
POU CHEN CORP	135,468	38.20	5,174,877.60	
RUENTEX INDUSTRIES LTD	20,271	76.50	1,550,731.50	
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	18,000	516.00	9,288,000.00	
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	34,816	305.50	10,636,288.00	
STANDARD FOODS CORP	27,079	60.80	1,646,403.20	
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	296,836	82.30	24,429,602.80	
TAI MED BIOLOGICS INC	11,000	157.00	1,727,000.00	
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	380,185	20.80	7,907,848.00	
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	838,789	9.46	7,934,943.94	
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,139,212	21.10	24,037,373.20	
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	614,718	26.25	16,136,347.50	
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	611,671	22.50	13,762,597.50	
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	464,017	20.75	9,628,352.75	
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	661,380	30.80	20,370,504.00	
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	741,549	12.80	9,491,827.20	
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	651,233	14.35	9,345,193.55	
TAIWAN BUSINESS BANK	305,349	13.50	4,122,211.50	
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	554,672	20.75	11,509,444.00	
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	204,000	57.40	11,709,600.00	
CHAILEASE HOLDING CO LTD	70,924	128.50	9,113,734.00	
CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	480,510	42.30	20,325,573.00	
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	176,754	24.00	4,242,096.00	
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	425,541	44.45	18,915,297.45	
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	676,891	9.12	6,173,245.92	

ACER INC	160,767	19.35	3,110,841.45	
ADVANTECH CO.,LTD.	21,594	258.00	5,571,252.00	
ASUSTEK COMPUTER INC	41,805	225.00	9,406,125.00	
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	40,840	223.50	9,127,740.00	
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	29,645	78.30	2,321,203.50	
COMPAL ELECTRONICS	244,590	20.15	4,928,488.50	
INVENTEC CO.,LTD	136,911	24.20	3,313,246.20	
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,897	44.80	6,536,185.60	
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	83.00	4,316,000.00	
PEGATRON CORP	121,692	53.70	6,534,860.40	
QUANTA COMPUTER INC	175,684	61.30	10,769,429.20	
WISTRON CORP	156,457	23.95	3,747,145.15	
AU OPTRONICS CORP	489,008	9.22	4,508,653.76	
DELTA ELECTRONICS INC	116,681	159.50	18,610,619.50	
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	64.20	3,520,342.80	
HON HAI PRECISION INDUSTRY	772,649	76.80	59,339,443.20	
INNOLUX CORP	505,322	7.38	3,729,276.36	
LARGAN PRECISION CO LTD	6,040	3,810.00	23,012,400.00	
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	77,566	38.45	2,982,412.70	
WALSIN TECHNOLOGY CORP	18,000	162.00	2,916,000.00	
WPG HOLDINGS CO LTD	68,387	40.20	2,749,157.40	
YAGEO CORPORATION	14,377	267.50	3,845,847.50	
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	36,410	97.30	3,542,693.00	
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	217,658	63.20	13,755,985.60	
GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	311.50	4,049,500.00	
MEDIATEK INC	94,538	313.50	29,637,663.00	
NANYA TECHNOLOGY CO	59,000	63.00	3,717,000.00	
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	34,058	170.50	5,806,889.00	
PHISON ELECTRONICS CORP	9,306	291.00	2,708,046.00	
POWERTECH TECHNOLOGY INC	46,147	76.00	3,507,172.00	
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	28,417	229.50	6,521,701.50	
TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,534,000	248.50	381,199,000.00	
UNITED MICROELECTRONICS CORP	704,500	13.70	9,651,650.00	
VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	64.20	4,429,800.00	
WIN SEMICONDUCTORS CORP	21,000	197.00	4,137,000.00	

小計	WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	14.80	3,581,600.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	233,065	113.50	26,452,877.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	105,000	78.20	8,211,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	95,200	122.00	11,614,400.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	670,377	18.90	12,670,125.30	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	39,110	50.00	1,955,500.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	31,006	44.40	1,376,666.40	
	銘柄数：87			1,169,560,657.33	
				(4,046,679,874)	
	組入時価比率：10.6%			11.2%	
インドルピー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	44,705	380.00	16,987,900.00	
	COAL INDIA LTD	76,900	254.25	19,551,825.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	291.90	10,035,522.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	113,000	153.85	17,385,050.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	157,000	170.95	26,839,150.00	
	PETRONET LNG LTD	34,980	241.55	8,449,419.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	179,200	1,279.50	229,286,400.00	
	ASIAN PAINTS LTD	17,000	1,383.00	23,511,000.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	6,620	1,233.00	8,162,460.00	
	UPL LTD	21,400	890.10	19,048,140.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	29,920	212.85	6,368,472.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,700	897.75	15,890,175.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	470	21,154.40	9,942,568.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	6,180	4,595.15	28,398,027.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	71,770	197.65	14,185,340.50	
	JSW STEEL LTD	46,500	267.15	12,422,475.00	
	TATA STEEL LIMITED	18,606	497.65	9,259,275.90	
	VEDANTA LTD	126,000	172.40	21,722,400.00	
	LARSEN&TOUBRO LIMITED	31,100	1,539.75	47,886,225.00	
	HAVELLS INDIA LTD	17,700	786.15	13,914,855.00	
	ASHOK LEYLAND LIMITED	60,650	86.50	5,246,225.00	
	INTERGLOBE AVIATION LTD	5,010	1,552.10	7,776,021.00	
	CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	553.40	6,851,092.00	
	ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	402.00	17,125,200.00	
	BHARAT FORGE LIMITED	12,700	439.25	5,578,475.00	

BOSCH LTD	390	16,466.40	6,421,896.00	
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	57,438	126.50	7,265,907.00	
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	2,875.55	16,074,324.50	
EICHER MOTORS LTD	820	19,719.20	16,169,744.00	
HERO MOTOCORP LTD	3,590	2,606.00	9,355,540.00	
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	43,990	627.45	27,601,525.50	
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	6,400	6,417.25	41,070,400.00	
TATA MOTORS LTD	104,000	158.90	16,525,600.00	
PAGE INDUSTRIES LTD	340	20,887.45	7,101,733.00	
TITAN CO LTD	21,000	1,292.35	27,139,350.00	
AVENUE SUPERMARTS LTD	6,780	1,320.45	8,952,651.00	
UNITED SPIRITS LTD	15,615	551.90	8,617,918.50	
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,000	2,826.70	11,306,800.00	
NESTLE INDIA LIMITED	1,550	11,600.90	17,981,395.00	
ITC LTD	221,100	274.25	60,636,675.00	
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	41,600	1,766.65	73,492,640.00	
DABUR INDIA LTD	37,800	392.60	14,840,280.00	
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	20,175	669.40	13,505,145.00	
MARICO LIMITED	26,340	369.30	9,727,362.00	
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	602.45	11,265,815.00	
CIPLA LIMITED	20,980	551.55	11,571,519.00	
DR.REDDYS LABORATORIES	6,590	2,551.55	16,814,714.50	
GLENMARK PHARMACEUTICALS LTD	6,830	499.95	3,414,658.50	
LUPIN LTD	14,900	712.80	10,620,720.00	
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	4,720	1,890.20	8,921,744.00	
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	49,282	382.80	18,865,149.60	
AXIS BANK LIMITED	118,400	771.05	91,292,320.00	
ICICI BANK LTD	153,400	430.80	66,084,720.00	
YES BANK LTD	114,800	109.60	12,582,080.00	
REC LTD	39,810	154.60	6,154,626.00	
BAJAJ FINSERV LTD	2,320	8,392.45	19,470,484.00	
ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	10,200	1,155.55	11,786,610.00	
HCL TECHNOLOGIES LTD	34,800	1,076.25	37,453,500.00	
INFOSYS LTD	215,700	750.20	161,818,140.00	
TATA CONSULTANCY SVS LTD	55,800	2,249.85	125,541,630.00	

	TECH MAHINDRA LTD	28,300	740.45	20,954,735.00	
	WIPRO LTD	80,400	285.85	22,982,340.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	16,510	275.35	4,546,028.50	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	107,600	343.80	36,992,880.00	
	VODAFONE IDEA LTD	376,151	12.15	4,570,234.65	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	106,000	199.90	21,189,400.00	
	TATA POWER COMPANY LIMITED	63,864	65.25	4,167,126.00	
	GAIL INDIA LTD	47,300	311.60	14,738,680.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	102,800	2,140.80	220,074,240.00	
	INDIABULLS HOUSING FINANCE LTD	17,020	612.00	10,416,240.00	
	LIC HOUSING FINANCE	18,050	536.70	9,687,435.00	
	BAJAJ FINANCE LTD	11,130	3,565.85	39,687,910.50	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	15,160	394.10	5,974,556.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	8,940	1,098.40	9,819,696.00	
	NTPC LIMITED	142,008	134.55	19,107,176.40	
	DIVIS LABORATORIES LTD	5,900	1,545.75	9,119,925.00	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	38,900	345.65	13,445,785.00	
小計	銘柄数：77			2,076,743,397.55	
				(3,218,952,266)	
	組入時価比率：8.5%			8.9%	
パキスタン ビー	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	51,000	136.90	6,981,900.00	
	HABIB BANK LTD	35,600	122.31	4,354,236.00	
	MCB BANK LIMITED	21,900	176.32	3,861,408.00	
	小計	銘柄数：3		15,197,544.00	
				(10,486,305)	
	組入時価比率：0.0%			0.0%	
カタールリアル	QATAR FUEL CO	34,700	21.40	742,580.00	
	MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	30,500	26.49	807,945.00	
	INDUSTRIES QATAR	11,170	116.35	1,299,629.50	
	COMMERCIAL BANK OF QATAR	117,900	4.83	569,457.00	
	MASRAF AL RAYAN	211,600	3.76	795,616.00	
	QATAR ISLAMIC BANK	65,800	17.32	1,139,656.00	
	QATAR NATIONAL BANK	281,920	19.34	5,452,332.80	
	QATAR INSURANCE CO	10,001	35.52	355,235.52	
	OOREDOO QSC	4,310	66.75	287,692.50	

小計	QATAR ELECTRICITY & WATER CO	3,440	168.20	578,608.00	
	BARWA REAL ESTATE CO	11,300	34.85	393,805.00	
	銘柄数：11			12,422,557.32	
	組入時価比率：1.0%			(365,347,410)	1.0%
エジプトバンド	ELSWEDY ELECTRIC CO	41,500	13.53	561,495.00	
	EASTERN TOBACCO	51,525	15.45	796,061.25	
	COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	91,300	74.58	6,809,154.00	
	銘柄数：3			8,166,710.25	
	組入時価比率：0.1%			(52,593,614)	0.1%
ランド	EXXARO RESOURCES LTD	15,000	179.83	2,697,450.00	
	SASOL LTD	36,200	372.06	13,468,572.00	
	ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,960	813.08	2,406,716.80	
	ANGLOGOLD ASHANTI LTD	26,400	241.99	6,388,536.00	
	GOLD FIELDS LTD	58,700	77.09	4,525,183.00	
	KUMBA IRON ORE LTD	3,900	482.53	1,881,867.00	
	MONDI LTD	7,270	319.44	2,322,328.80	
	SAPPI LIMITED	32,090	58.21	1,867,958.90	
	BIDVEST GROUP LTD	17,200	203.63	3,502,436.00	
	NASPERS LTD-N SHS	27,450	3,441.59	94,471,645.50	
	WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	61,610	49.20	3,031,212.00	
	MR PRICE GROUP LTD	16,700	208.13	3,475,771.00	
	THE FOSCHINI GROUP LTD	13,920	184.93	2,574,225.60	
	TRUWORTHS INTERNATIONAL LTD	33,000	75.49	2,491,170.00	
	BID CORP LTD	20,100	326.53	6,563,253.00	
	CLICKS GROUP LTD	15,190	213.00	3,235,470.00	
	PICKN PAY STORES LTD	26,700	69.80	1,863,660.00	
	SHOPRITE HOLDINGS LTD	29,200	163.50	4,774,200.00	
	SPAR GROUP LIMITED/THE	10,860	195.99	2,128,451.40	
	TIGER BRANDS LTD	8,700	231.25	2,011,875.00	
	LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	102,000	22.59	2,304,180.00	
	NETCARE LTD	72,810	17.85	1,299,658.50	
	ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	21,630	104.47	2,259,686.10	
	ABSA GROUP LTD	44,300	181.48	8,039,564.00	
	CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,130	1,310.12	4,100,675.60	

	NEDBANK GROUP LTD	22,200	263.16	5,842,152.00	
	STANDARD BANK GROUP LTD	82,900	206.31	17,103,099.00	
	FIRSTRAND LTD	216,300	70.48	15,244,824.00	
	PSG GROUP LTD	8,660	246.17	2,131,832.20	
	REMGRO LTD	33,200	193.00	6,407,600.00	
	RMB HOLDINGS LTD	43,680	86.84	3,793,171.20	
	DISCOVERY LTD	25,800	153.50	3,960,300.00	
	LIBERTY HOLDINGS LTD	6,360	107.21	681,855.60	
	MMI HOLDINGS LTD	56,462	19.72	1,113,430.64	
	OLD MUTUAL LTD	292,340	22.05	6,446,097.00	
	RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	34.84	1,405,794.00	
	SANLAM LIMITED	108,700	80.55	8,755,785.00	
	TELKOM SA SOC LTD	15,970	95.57	1,526,252.90	
	MTN GROUP LTD	109,700	110.32	12,102,104.00	
	VODACOM GROUP	39,800	124.68	4,962,264.00	
	INVESTEC LTD	15,640	92.69	1,449,671.60	
	REINET INVESTMENTS SCA	8,790	232.89	2,047,103.10	
	NEPI ROCKCASTLE PLC	25,200	131.67	3,318,084.00	
	MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	134.58	3,587,902.80	
小計	銘柄数：44			285,565,069.24	
				(2,141,738,019)	
	組入時価比率：5.6%			5.9%	
U A E ディルハム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	173,870	8.55	1,486,588.50	
	DUBAI ISLAMIC BANK	102,029	5.16	526,469.64	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	161,800	14.74	2,384,932.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	112,500	16.68	1,876,500.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	1.87	517,990.00	
	EMAAR DEVELOPMENT PJSC	43,470	4.02	174,749.40	
	EMAAR MALLS PJSC	211,000	1.97	415,670.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	201,630	4.41	889,188.30	
小計	銘柄数：8			8,272,087.84	
				(242,289,452)	
	組入時価比率：0.6%			0.7%	
サウジアラビア	RABIGH REFINING AND PETROCHE	6,700	20.20	135,340.00	

リヤル					
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	2,900	58.30	169,070.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	10,000	16.88	168,800.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	14,500	20.78	301,310.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	5,100	85.20	434,520.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	24,400	116.80	2,849,920.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	6,700	24.62	164,954.00	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	22,000	12.30	270,600.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	6,900	62.20	429,180.00	
	SAUDI CEMENT	2,300	69.00	158,700.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	12,500	49.65	620,625.00	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	1,200	83.50	100,200.00	
	JARIR MARKETING CO	1,790	165.40	296,066.00	
	ALMARAI CO	7,600	52.60	399,760.00	
	SAVOLA	8,000	33.10	264,800.00	
	AL RAJHI BANK	39,800	70.10	2,789,980.00	
	ALINMA BANK	22,400	24.00	537,600.00	
	BANK AL - JAZIRA	12,200	15.04	183,488.00	
	BANK ALBILAD	11,200	26.75	299,600.00	
	BANQUE SAUDI FRANSI	16,500	40.00	660,000.00	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	36,600	56.90	2,082,540.00	
	RIYAD BANK	36,600	25.25	924,150.00	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	29,800	34.70	1,034,060.00	
	SAUDI BRITISH BANK	6,900	38.55	265,995.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	95.20	76,160.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	1,900	70.70	134,330.00	
	SAUDI TELECOM CO	12,200	106.80	1,302,960.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	11,500	23.70	272,550.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	25,400	17.60	447,040.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	16,000	11.54	184,640.00	
	EMAAR ECONOMIC CITY	12,000	9.88	118,560.00	
小計	銘柄数：31			18,077,498.00	
				(518,643,417)	
	組入時価比率：1.4%			1.4%	
合計				36,189,288,986	
				(36,189,288,986)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2019年6月24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	205,200	5,741,496.00	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：1.6%	205,200	5,741,496.00 (616,751,500) 86.4%	
	合計			616,751,500 (616,751,500)	
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	208,100	5,352,332.00	
	小計	銘柄数：1 組入時価比率：0.1%	208,100	5,352,332.00 (30,133,629) 4.2%	
	ランド	FORTRESS REIT LTD-A	59,650	1,238,334.00	
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	191,000	4,708,150.00	
		REDEFINE PROPERTIES LTD	328,000	3,034,000.00	
	小計	銘柄数：3 組入時価比率：0.2%	578,650	8,980,484.00 (67,353,630) 9.4%	
	合計			97,487,259 (97,487,259)	
	合計			714,238,759 (714,238,759)	

(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

	2019年 6月24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				
株価指数先物取引				
買建	1,044,984,982	-	1,077,461,808	32,476,826
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	6,970,073	-	6,981,000	10,927
米ドル	6,970,073	-	6,981,000	10,927
合計	-	-	-	32,487,753

（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）

(2019年 6月24日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,046,254,510
投資証券	40,341,678,900
派生商品評価勘定	6,960,384
未収入金	14,585,390
未収配当金	190,830,303
差入委託証拠金	4,197,600
流動資産合計	41,604,507,087

(2019年 6月24日現在)

資産合計	41,604,507,087
負債の部	
流動負債	
未払金	326,228,972
未払解約金	21,273,650
未払利息	1,924
流動負債合計	347,504,546
負債合計	347,504,546
純資産の部	
元本等	
元本	17,584,991,977
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	23,672,010,564
元本等合計	41,257,002,541
純資産合計	41,257,002,541
負債純資産合計	41,604,507,087

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年 6月24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	2.3461円

(10,000口当たり純資産額)

(23,461円)

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、REITの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 6月24日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 6月24日現在	
期首	2018年 6月23日

本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	16,449,329,199円
同期中における追加設定元本額	6,120,690,059円
同期中における一部解約元本額	4,985,027,281円
期末元本額	17,584,991,977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）	1,601,822,912円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	2,492,936,437円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	742,556,332円
野村資産設計ファンド2015	17,952,849円
野村資産設計ファンド2020	17,566,492円
野村資産設計ファンド2025	19,407,669円
野村資産設計ファンド2030	21,390,794円
野村資産設計ファンド2035	18,410,670円
野村資産設計ファンド2040	30,908,912円
野村資産設計ファンド2045	3,058,443円
野村インデックスファンド・J-REIT	2,573,422,256円
ネクストコア	149,255,840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	658,054,453円
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	2,036,287,182円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	883,007,894円
野村資産設計ファンド2050	4,676,864円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,751,686円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,090,887円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,820,627円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	961,217円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,200,345円
野村6資産均等バランス	376,115,030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）	88,607,680円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	52,683,835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）	802,637,031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）	1,940,532,544円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,720,165,487円
野村DC運用戦略ファンド	1,249,862,922円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	65,873,713円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	2,200,766円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	1,407,160円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	2,194,673円
野村資産設計ファンド（DC）2030	541,342円
野村資産設計ファンド（DC）2040	308,511円
野村資産設計ファンド（DC）2050	320,522円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年6月24日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年6月24日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	427	46,030,600	
		サンケイリアルエステート投資法 人 投資証券	411	46,895,100	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,382	825,054,000	
		M C U B S M i d C i t y 投資法 人 投資証券	4,685	486,771,500	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,768	719,491,200	
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,102	679,586,400	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	4,052	1,278,406,000	
		ケネディクス・レジデンシャル・ネ クスト投資法人 投資証券	2,570	482,903,000	
		アクティブ・プロパティーズ投資 法人 投資証券	2,184	1,015,560,000	
		G L P 投資法人 投資証券	10,302	1,237,270,200	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	1,724	524,096,000	
		日本プロロジスリート投資法人 投 資証券	5,973	1,489,068,900	
		星野リゾート・リート投資法人 投 資証券	633	347,517,000	
		O n e リート投資法人 投資証券	606	169,437,600	
		イオンリート投資法人 投資証券	4,268	583,008,800	
		ヒューリックリート投資法人 投資 証券	3,361	626,154,300	
		日本リート投資法人 投資証券	1,342	572,363,000	
		インベスコ・オフィス・ジェイリー ト投資法人 投資証券	25,340	461,188,000	
		日本ヘルスケア投資法人 投資証券	190	33,250,000	
		積水ハウス・リート投資法人 投資 証券	12,157	976,207,100	

トーセイ・リート投資法人 投資証券	800	93,200,000	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,524	402,488,400	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	871	110,181,500	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	832	91,520,000	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,936	2,112,448,800	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	727	91,674,700	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,435	434,527,500	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	1,291	153,112,600	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	357	43,696,800	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,009	364,753,500	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	671	56,162,700	
さくら総合リート投資法人 投資証券	900	82,890,000	
投資法人みらい 投資証券	4,479	226,637,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	975	135,427,500	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	440	121,220,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	416	49,795,200	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	383	48,411,200	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	622	62,511,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	643	64,557,200	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,026	3,043,656,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,158	2,735,964,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,858	1,701,257,000	

小計	オリックス不動産投資法人 投資証券	8,284	1,631,119,600	
	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,632	1,276,520,000	
	プレミア投資法人 投資証券	3,953	559,349,500	
	東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,787	517,824,600	
	グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,876	382,220,400	
	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,335	1,679,366,500	
	森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,971	518,439,500	
	インヴィンシブル投資法人 投資証券	14,343	844,802,700	
	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,414	673,771,000	
	平和不動産リート投資法人 投資証券	2,589	323,107,200	
	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,716	669,494,000	
	福岡リート投資法人 投資証券	2,150	373,670,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,286	991,506,000	
	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,449	350,073,500	
	大和証券オフィス投資法人 投資証券	960	756,480,000	
	阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,871	278,966,100	
	スターツプロシード投資法人 投資証券	647	113,289,700	
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,578	1,422,390,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,382	1,156,204,800	
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	4,676	389,510,800	
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,723	607,221,300	
	銘柄数：63	232,452	40,341,678,900	
	組入時価比率：97.8%		100.0%	
	合計		40,341,678,900	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 6月24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	906,920,100	-	913,932,000	6,960,384
合計	906,920,100	-	913,932,000	6,960,384

（注）時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

海外REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2019年 6月24日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	194,415,552
コール・ローン	21,088,108
投資証券	26,017,590,258
派生商品評価勘定	8,470
未収入金	12,099,875
未収配当金	51,597,456
差入委託証拠金	61,841,157
流動資産合計	26,358,640,876
資産合計	26,358,640,876
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	670,301
未払金	123,891,196
未払解約金	4,845,968
未払利息	38
その他未払費用	576,100
流動負債合計	129,983,603
負債合計	129,983,603
純資産の部	
元本等	
元本	10,809,294,964
剰余金	

(2019年 6月24日現在)

期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,419,362,309
元本等合計	26,228,657,273
純資産合計	26,228,657,273
負債純資産合計	26,358,640,876

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年 6月24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	2.4265円
(10,000口当たり純資産額)	(24,265円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年 6月23日 至 2019年 6月24日
1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。 当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。 当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 3.金融商品に係るリスク管理体制 委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。 ○市場リスクの管理 市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。 ○信用リスクの管理 信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。 ○流動性リスクの管理 流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 6月24日現在
1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 2.時価の算定方法 投資証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 6月24日現在	
期首	2018年 6月23日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	9,374,626,241円

同期中における追加設定元本額	3,980,269,612円
同期中における一部解約元本額	2,545,600,889円
期末元本額	10,809,294,964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）	1,564,782,212円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	2,435,294,825円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	725,386,746円
野村資産設計ファンド２０１５	17,537,783円
野村資産設計ファンド２０２０	17,160,306円
野村資産設計ファンド２０２５	18,958,920円
野村資産設計ファンド２０３０	20,896,189円
野村資産設計ファンド２０３５	17,984,323円
野村資産設計ファンド２０４０	30,194,372円
野村資産設計ファンド２０４５	2,987,722円
野村インデックスファンド・外国ＲＥＩＴ	1,363,619,667円
ネクストコア	56,202,690円
野村インデックスファンド・海外５資産バランス	247,924,394円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	858,169,402円
野村資産設計ファンド２０５０	4,568,597円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,676,881円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,573,110円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,976,759円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,727,244円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	6,468,748円
野村６資産均等バランス	367,417,991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	609,391,914円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）ＲＥＩＴ	584,973,620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）	354,419,194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）	1,018,532,081円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	446,821,056円
野村ＤＣ運用戦略ファンド（マイルド）	22,836,531円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	2,149,831円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	1,374,622円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	2,143,923円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０３０	528,823円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０４０	301,377円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０５０	313,111円

＊は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年6月24日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年6月24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	16,200	459,756.00	
		AGREE REALTY CORP	7,400	494,098.00	
		ALEXANDERS INC	750	280,237.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,000	3,196,160.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	7,600	360,924.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	26,400	1,234,992.00	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	10,000	106,700.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	50,600	1,264,494.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	37,200	1,264,056.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	29,400	1,504,398.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	42,400	671,192.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,600	48,204.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	27,130	5,637,614.00	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	49,056.00	
		BOSTON PROPERTIES	29,980	4,079,378.60	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,000	58,800.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	35,000	526,400.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	57,900	1,066,518.00	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	19,800	387,486.00	
		BRT APARTMENTS CORP	1,600	21,008.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	18,850	2,001,304.50	
		CARETRUST REIT INC ACQUIRES	18,900	466,263.00	
		CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	31,000	29,586.40	
		CEDAR REALTY TRUST INC	16,000	42,560.00	
		CHATHAM LODGING TRUST	9,500	182,400.00	
		CHESAPEAKE LODGING TRUST	11,300	324,084.00	
		CITY OFFICE REIT INC	8,000	99,040.00	
		CLIPPER REALTY INC	2,400	29,352.00	
		COLONY CAPITAL INC	96,000	496,320.00	
		COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23,200	511,560.00	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,500	138,180.00	

CORECIVIC INC	23,600	527,932.00	
CORESITRE REALTY CORP	7,170	841,542.90	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	21,500	609,095.00	
COUSINS PROPERTIES INC	28,050	1,072,912.50	
CUBESMART	36,800	1,257,088.00	
CYRUSONE INC	22,000	1,320,440.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	39,000	398,190.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	40,410	4,976,491.50	
DOUGLAS EMMETT INC	31,200	1,275,456.00	
DUKE REALTY CORP	69,700	2,224,127.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	12,900	236,328.00	
EASTGROUP PROPERTIES	7,130	831,358.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	28,000	434,560.00	
EPR PROPERTIES	14,470	1,124,608.40	
EQUITY COMMONWEALTH	23,700	786,129.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	17,450	2,130,645.00	
EQUITY RESIDENTIAL	71,900	5,610,357.00	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	9,100	190,190.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	12,750	3,824,745.00	
EXTRA SPACE STORAGE INC	24,640	2,654,713.60	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	37,400.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	14,510	1,941,728.20	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	24,700	911,430.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,700	387,984.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	20,100	152,358.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,000	121,900.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	39,500	1,591,455.00	
GEO GROUP INC/THE	23,700	521,163.00	
GETTY REALTY CORP	6,400	199,744.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	5,400	115,992.00	
GLADSTONE LAND CORP	2,500	29,000.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,000	56,450.00	
GLOBAL NET LEASE INC	16,600	328,846.00	
HCP INC	93,300	3,050,910.00	

HEALTHCARE REALTY TRUST INC	25,100	816,503.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	39,700	1,126,289.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	6,600	111,210.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	20,200	878,700.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	32,100	798,648.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	144,900	2,632,833.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	29,900	1,015,105.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	18,700	221,221.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	12,500	253,875.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,000	235,040.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,200	131,274.00	
INVITATION HOMES INC	74,400	2,019,960.00	
IRON MOUNTAIN INC	55,900	1,792,154.00	
JBG SMITH PROPERTIES	23,300	943,417.00	
KILROY REALTY CORP	19,790	1,503,248.40	
KIMCO REALTY CORP	82,600	1,561,140.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	17,200	267,632.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	41,300	401,436.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	28,500	1,449,225.00	
LIFE STORAGE INC	9,060	879,273.00	
LTC PROPERTIES INC	7,400	344,026.00	
MACERICH CO /THE	20,700	699,039.00	
MACK-CALI REALTY CORP	18,000	429,120.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	253,007	218,851.05	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	76,700	1,396,707.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	22,290	2,654,516.10	
MONMOUTH REIT-CLASS A	18,000	248,940.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	31,600	1,738,000.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	10,500	310,905.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,400	675,864.00	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	15,000	103,650.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	4,100	168,059.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	9,700	154,812.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	9,250	242,257.50	

OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	41,300	1,571,465.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,800	87,080.00	
PARAMOUNT GROUP INC	39,600	580,140.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	38,800	1,094,548.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	25,500	725,730.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	11,500	71,530.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	35,800	640,462.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	24,900	511,944.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	8,000	119,360.00	
PROLOGIS INC	122,940	9,998,710.20	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	3,930	692,701.80	
PUBLIC STORAGE	29,230	7,029,815.00	
QTS REALTY TRUST INC CL A	10,900	506,850.00	
REALTY INCOME CORP	61,250	4,425,312.50	
REGENCY CENTERS CORP	32,600	2,266,352.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	22,400	387,520.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	42,000	510,720.00	
RETAIL VALUE INC	2,751	94,001.67	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	20,200	821,938.00	
RLJ LODGING TRUST	34,600	616,918.00	
RPT REALTY	15,700	197,506.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10,020	807,712.20	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	35,000	684,950.00	
SAFEHOLD INC	1,500	42,915.00	
SAUL CENTERS INC	2,400	132,624.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	46,200	377,454.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	5,300	226,469.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	60,260	9,888,063.40	
SITE CENTERS CORP	26,700	361,251.00	
SL GREEN REALTY CORP	16,500	1,394,580.00	
SPIRIT MTA REIT	7,210	63,087.50	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	16,800	754,320.00	
STAG INDUSTRIAL INC	24,300	759,132.00	
STORE CAPITAL CORP	39,300	1,375,107.00	

小計	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	20,300	232,029.00	
	SUN COMMUNITIES INC	17,540	2,277,569.00	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	45,000	610,650.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	18,400	296,608.00	
	TAUBMAN CENTERS INC	11,900	502,180.00	
	TERRENO REALTY CORP	12,000	575,400.00	
	UDR INC	54,800	2,503,264.00	
	UMH PROPERTIES INC	7,200	94,248.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,630	227,679.10	
	URBAN EDGE PROPERTIES	23,900	428,527.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	6,000	128,760.00	
	VENTAS INC	71,900	5,056,008.00	
	VEREIT INC	189,300	1,798,350.00	
	VICI PROPERTIES INC	70,600	1,608,974.00	
	VORNADO REALTY TRUST	33,700	2,250,149.00	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	37,000	146,520.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	16,000	442,560.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	23,400	663,858.00	
	WELLTOWER INC	78,790	6,590,783.50	
	WHITESTONE REIT	7,400	95,090.00	
	WP CAREY INC	33,230	2,843,823.40	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	22,000	461,120.00	
	銘柄数：155	4,419,968	176,880,740.42	
			(19,000,529,135)	
	組入時価比率：72.4%		73.0%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	10,200	489,600.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	14,700	172,578.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	4,200	170,688.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	14,500	715,140.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	30,100	422,303.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	16,500	205,095.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	8,200	130,134.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,500	138,130.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	17,300	242,373.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE	12,000	145,200.00	

	INVESTMENT			
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	5,100	124,440.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	4,400	274,076.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	27,800	641,346.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,000	155,100.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	8,200	161,130.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,500	47,900.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	60,423.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	5,800	158,572.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12,000	142,800.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	29,400	783,510.00	
	SLATE OFFICE REIT	5,900	35,341.00	
	SLATE RETAIL REIT	4,300	54,266.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	12,900	439,503.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	12,800	170,240.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,000	33,400.00	
小計	銘柄数：25	287,600	6,113,288.00	
			(497,560,510)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
ユーロ	AEDIFICA	4,840	400,752.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	31,300	439,765.00	
	ALTAREA	680	122,536.00	
	BEFIMMO S.C.A.	4,200	216,720.00	
	COFINIMMO	4,190	469,280.00	
	COVIVIO	11,980	1,103,957.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	8,400	206,640.00	
	GECINA SA	10,720	1,449,344.00	
	GREEN REIT PLC	126,000	221,004.00	
	HAMBORNER REIT AG	15,400	137,368.00	
	HIBERNIA REIT PLC	131,000	183,924.00	
	ICADE	8,830	700,660.50	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,000	59,400.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	52,000	531,440.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	4,114	104,907.00	

小計	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	70,000	116,340.00	
	KLEPIERRE	40,300	1,199,328.00	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,000	96,040.00	
	MERCIALYS	10,400	118,976.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	71,500	883,740.00	
	MONTEA	2,120	157,940.00	
	NSI NV	3,800	142,120.00	
	RETAIL ESTATES	1,500	117,450.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	26,820	3,597,903.00	
	VASTNED RETAIL NV	3,100	85,870.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,390	488,160.00	
	WERELDHAVE NV	7,700	180,334.00	
	銘柄数：27	678,284	13,531,898.50	
			(1,654,139,272)	
	組入時価比率：6.3%		6.4%	
英ボンド	ASSURA PLC	442,000	280,228.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	29,200	290,832.00	
	BRITISH LAND	187,000	1,009,800.00	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	93,000	12,815.40	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	122,000	96,136.00	
	DERWENT LONDON PLC	21,600	680,832.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	108,000	99,252.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	51,300	358,279.20	
	HAMMERSON PLC	152,000	423,472.00	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	82,000	78,146.00	
	INTU PROPERTIES PLC	158,000	119,858.80	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	144,600	1,203,939.60	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	140,000	282,240.00	
	LXI REIT PLC	79,360	99,200.00	
	NEWRIVER REIT PLC	63,000	117,810.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	104,000	100,672.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	221,000	292,604.00	
	RDI REIT PLC	56,000	57,792.00	
	REGIONAL REIT LTD	56,000	60,704.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	41,900	259,361.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM	110,000	61,270.00	

小計	TRUST			
	SEGRO PLC	212,200	1,576,221.60	
	SHAFTESBURY PLC	45,400	371,599.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	63,000	52,542.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	336,000	517,440.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	140,000	122,640.00	
	UNITE GROUP PLC	51,700	499,939.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	24,900	220,614.00	
	銘柄数：28	3,335,160	9,346,239.60	
	組入時価比率：4.9%		(1,279,874,050)	4.9%
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	60,000	258,600.00	
	APN INDUSTRIA REIT	20,000	59,000.00	
	ARENA REIT	52,000	149,240.00	
	ASTRO JAPAN PROPERTY GROUP	9,800	0.00	
	BWP TRUST	92,000	356,040.00	
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	54,000	207,360.00	
	CHARTER HALL GROUP	90,000	999,900.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	48,000	245,280.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	73,000	338,720.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	312,000	390,000.00	
	DEXUS	211,600	2,852,368.00	
	GDI PROPERTY GROUP	90,000	128,700.00	
	GOODMAN GROUP	311,300	4,694,404.00	
	GPT GROUP	349,000	2,188,230.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	50,000	215,000.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	27,000	94,770.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,000	125,970.00	
	MIRVAC GROUP	768,000	2,419,200.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	130,000	237,900.00	
	RURAL FUNDS GROUP	60,000	141,000.00	
	SCENTRE GROUP	1,037,000	3,992,450.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	176,000	450,560.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	478,000	2,064,960.00	
	VICINITY CENTRES	626,000	1,640,120.00	
	VIVA ENERGY REIT	92,000	250,240.00	

小計	銘柄数：25	5,255,700	24,500,012.00	
			(1,830,640,896)	
	組入時価比率：7.0%		7.0%	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	160,000	216,800.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	191,000	368,630.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	288,000	463,680.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	220,000	382,800.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	69,000	151,800.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	64,000	155,520.00	
小計	銘柄数：6	992,000	1,739,230.00	
			(123,241,837)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
香港ドル	CHAMPION REIT	386,000	2,505,140.00	
	FORTUNE REIT	281,000	3,001,080.00	
	LINK REIT	410,100	39,410,610.00	
	PROSPERITY REIT	220,000	748,000.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	195,000	1,160,250.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	268,000	1,436,480.00	
小計	銘柄数：6	1,760,100	48,261,560.00	
			(663,596,450)	
	組入時価比率：2.5%		2.6%	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	112,000	163,520.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	150,000	147,000.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	492,000	1,495,680.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	223,000	289,900.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	209,860	167,888.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	541,964	1,159,802.96	
	CAPITALAND MALL TRUST	544,000	1,392,640.00	
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	128,000	197,120.00	
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	145,000	233,450.00	
	ESR REIT	390,000	208,650.00	
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	162,000	109,350.00	
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	120,000	122,400.00	
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	136,596	346,953.84	
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	139,000	219,620.00	

有価証券報告書（内国投資信託）

小計	FRASERS HOSPITALITY TRUST	140,000	99,400.00	
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	320,000	390,400.00	
	KEPPEL DC REIT	190,956	309,348.72	
	KEPPEL REIT	334,000	420,840.00	
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	340,000	78,200.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	369,025	749,120.75	
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	264,000	570,240.00	
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	463,000	726,910.00	
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	426,000	613,440.00	
	QUE HOSPITALITY TRUST	220,043	156,230.53	
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	72,000	220,320.00	
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	133,764	60,193.80	
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	136,700	83,387.00	
	SPH REIT	124,000	131,440.00	
	STARHILL GLOBAL REIT	260,000	201,500.00	
	SUNTEC REIT	443,000	859,420.00	
	銘柄数：30	7,729,908	11,924,365.60	
			(946,317,654)	
	組入時価比率：3.6%		3.6%	
	ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	40,740,000.00
小計	銘柄数：1	6,000	40,740,000.00	
		(3,780,672)		
組入時価比率：0.0%		0.0%		
新シェケル	REIT 1 LTD	34,000	602,820.00	
小計	銘柄数：1	34,000	602,820.00	
		(17,909,782)		
組入時価比率：0.1%		0.1%		
合計			26,017,590,258	
			(26,017,590,258)	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 6月24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	198,353,178	-	197,682,877	670,301
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	7,510,230	-	7,518,700	8,470
米ドル	7,510,230	-	7,518,700	8,470
合計	-	-	-	661,831

（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

2019年7月31日現在

資産総額	12,128,464円
負債総額	5,388円
純資産総額（ - ）	12,123,076円
発行済口数	11,443,821口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0594円

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

2019年7月31日現在

資産総額	670,905,595,971円
負債総額	3,479,363,503円
純資産総額（ - ）	667,426,232,468円
発行済口数	494,382,764,814口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3500円

（参考）外国債券マザーファンド

2019年7月31日現在

資産総額	610,505,266,126円
負債総額	1,603,097,175円
純資産総額（ - ）	608,902,168,951円
発行済口数	264,695,611,356口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3004円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2019年7月31日現在

資産総額	9,667,265,697円
負債総額	67,597,995円
純資産総額（ - ）	9,599,667,702円
発行済口数	6,983,946,647口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3745円

（参考）国内株式マザーファンド

2019年7月31日現在

資産総額	489,720,657,814円
負債総額	90,624,433,915円
純資産総額（ - ）	399,096,223,899円
発行済口数	255,354,877,859口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5629円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2019年7月31日現在

資産総額	587,973,573,490円
負債総額	1,605,010,949円
純資産総額（ - ）	586,368,562,541円
発行済口数	207,931,091,585口
1口当たり純資産額（ / ）	2.8200円

（参考）新興国株式マザーファンド

2019年7月31日現在

資産総額	39,455,430,425円
負債総額	307,447,525円
純資産総額（ - ）	39,147,982,900円
発行済口数	31,650,451,362口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2369円

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2019年7月31日現在

資産総額	45,650,618,710円
負債総額	1,741,620,499円
純資産総額（ - ）	43,908,998,211円
発行済口数	17,873,948,853口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4566円

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2019年7月31日現在

資産総額	27,400,394,998円
負債総額	67,206,701円
純資産総額（ - ）	27,333,188,297円
発行済口数	11,199,084,239口
1口当たり純資産額（ / ）	2.4407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。

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

2019年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年間ににおける主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

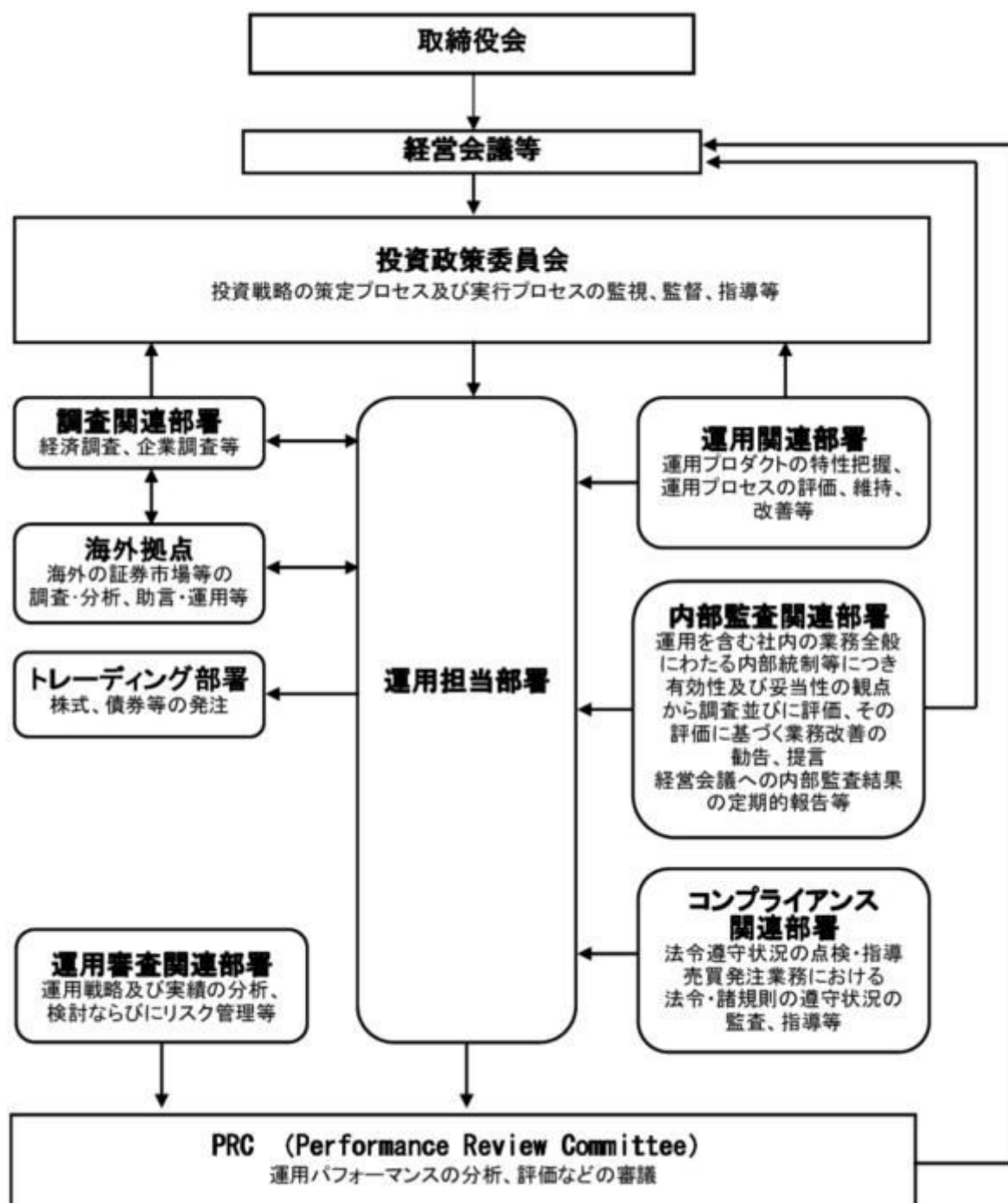
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2019年6月28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	1,025	28,005,123
単位型株式投資信託	178	1,004,188
追加型公社債投資信託	14	5,223,933
単位型公社債投資信託	426	1,725,132
合計	1,643	35,958,375

3【委託会社等の経理状況】

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

2．財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。

3．委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けている新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日に名称を変更し、EY新日本有限責任監査法人となりました。

(1)【貸借対照表】

		前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
区分	注記 番号	金額(百万円)	金額(百万円)
(資産の部)			
流動資産			
現金・預金		919	1,562
金銭の信託		47,936	45,493
有価証券		22,600	19,900
前払金		0	-
前払費用		26	27
未収入金		464	500
未収委託者報酬		24,059	25,246
未収運用受託報酬		6,764	5,933
その他		181	269
貸倒引当金		15	15
流動資産計		102,937	98,917
固定資産			
有形固定資産		874	714
建物	2	348	320
器具備品	2	525	393
無形固定資産		7,157	6,438

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

		前事業年度 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
区分	注記 番号	金額(百万円)		金額(百万円)	
(負債の部)					
流動負債					
預り金			133		145
未払金	1		17,853		16,709
未払収益分配金		1		0	
未払償還金		31		25	
未払手数料		7,884		7,724	
関係会社未払金		7,930		7,422	
その他未払金		2,005		1,535	
未払費用	1		12,441		11,704
未払法人税等			2,241		1,560
前受収益			33		29
賞与引当金			4,626		3,792
流動負債計			37,329		33,942
固定負債					
退職給付引当金			2,938		3,219
時効後支払損引当金			548		558
固定負債計			3,486		3,777
負債合計			40,816		37,720
(純資産の部)					
株主資本			86,078		86,924
資本金			17,180		17,180
資本剰余金			13,729		13,729
資本準備金		11,729		11,729	
その他資本剰余金		2,000		2,000	
利益剰余金			55,168		56,014
利益準備金		685		685	
その他利益剰余金		54,483		55,329	
別途積立金		24,606		24,606	
繰越利益剰余金		29,876		30,723	
評価・換算差額等			11		33

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

(2) 【損益計算書】

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

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月 1 日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837
当期変動額									
剰余金の配当							25,598	25,598	25,598
当期純利益							24,840	24,840	24,840

株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	758	758	758
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株 主 資 本 合 計
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				
		資 本 準備金	その他 資 本 剰余金	資 本 剰余金 合 計	利 益 準備金	その他利益剰余金		利 益 剰余金 合 計	
						別 途 積立金	繰 越 利 益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078
当期変動額									
剰余金の配当							24,826	24,826	24,826
当期純利益							25,672	25,672	25,672
株主資本以外の 項目の当期変動 額（純額）									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	846	846	846
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,723	56,014	86,924

(単位：百万円)

	評価・換算差額等	
--	----------	--

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

[重要な会計方針]

1．有価証券の評価基準及び評価方法	(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法 (2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、 売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法
2．金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法
3．固定資産の減価償却の方法	(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。 建物 38～50年 附属設備 8～15年 構築物 20年 器具備品 4～15年 (2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。
4．引当金の計上基準	(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。 (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。

5. 消費税等の会計処理方法 6. 連結納税制度の適用	(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。 (4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。 (5) 投資損失引当金 子会社等に対する投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要額を計上しております。 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おります。 連結納税制度を適用しております。
---	--

【未適用の会計基準等】

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

【表示方法の変更に関する注記】

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更）

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

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

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

[注記事項]

貸借対照表関係

前事業年度末 (2018年3月31日)	当事業年度末 (2019年3月31日)
1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払費用 1,781百万円	1. 関係会社に対する資産及び負債 区分掲記されたもの以外で各科目に含まれているものは、次のとおりであります。 未払費用 1,434百万円
2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 708百万円 器具備品 3,491 合計 4,200	2. 有形固定資産より控除した減価償却累計額 建物 736百万円 器具備品 3,106 合計 3,842

損益計算書関係

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 4,026百万円 支払利息 2	1. 関係会社に係る注記 区分掲記されたもの以外で関係会社に対するものは、次のとおりであります。 受取配当金 6,531百万円 支払利息 1
2. 固定資産除却損 建物 4百万円 器具備品 0 ソ フ ト ウ エ 53 ア 合計 58	2. 固定資産除却損 建物 -百万円 器具備品 3 ソ フ ト ウ エ 307 ア 合計 310
	3. 関係会社清算益 関係会社清算益は、関係会社の清算にともなう清算配当です。

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

（１）金融商品に対する取組方針

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

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

（２）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

	貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	919	919	-
(2)金銭の信託	47,936	47,936	-
(3)未収委託者報酬	24,059	24,059	-
(4)未収運用受託報酬	6,764	6,764	-
(5)有価証券及び投資有価証券	22,600	22,600	-

その他有価証券	22,600	22,600	-
資産計	102,279	102,279	-
(6)未払金	17,853	17,853	-
未払収益分配金	1	1	-
未払償還金	31	31	-
未払手数料	7,884	7,884	-
関係会社未払金	7,930	7,930	-
その他未払金	2,005	2,005	-
(7)未払費用	12,441	12,441	-
(8)未払法人税等	2,241	2,241	-
負債計	32,536	32,536	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

また、営業債権である未収委託者報酬は、投資信託約款に基づき、信託財産から委託者に対して支払われる信託報酬の未払金額であり、信託財産は受託銀行において分別保管されているため、信用リスクはほとんどないと認識しております。同じく営業債権である未収運用受託報酬は、投資顧問契約

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

2019年3月31日における貸借対照表計上額、時価、及びこれらの差額については次のとおりです。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含めておりません。

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

ます。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

注2：非上場株式等（貸借対照表計上額：投資有価証券1,562百万円、関係会社株式12,631百万円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュフローを見積もることなどができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「有価証券及び投資有価証券」には含めておりません。なお、当事業年度において、非上場株式について1,100百万円（投資有価証券938百万円、関係会社株式161百万円）減損処理を行っております。

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	1,562	-	-	-
金銭の信託	45,493	-	-	-
未収委託者報酬	25,246	-	-	-
未収運用受託報酬	5,933	-	-	-
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券	19,900	-	-	-
合計	98,136	-	-	-

有価証券関係

前事業年度（自 2017年4月 1 日 至 2018年3月31日）

1．売買目的有価証券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

３．子会社株式及び関連会社株式(2018年3月31日)

該当事項はありません。

４．その他有価証券(2018年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月 1 日 至 2019年3月31日）

１．売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

２．満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

３．子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

４．その他有価証券(2019年3月31日)

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

譲渡性預金	19,900	19,900	-
小計	19,900	19,900	-
合計	19,900	19,900	-

５．事業年度中に売却したその他有価証券（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2017年4月 1 日 至 2018年3月31日)																							
1．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として確定給付型企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 <table> <tr> <td>退職給付債務の期首残高</td><td>19,546 百万円</td></tr> <tr> <td>勤務費用</td><td>929</td></tr> <tr> <td>利息費用</td><td>167</td></tr> <tr> <td>数理計算上の差異の発生額</td><td>1,415</td></tr> <tr> <td>退職給付の支払額</td><td>660</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0</td></tr> <tr> <td>退職給付債務の期末残高</td><td>21,398</td></tr> </table>		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								
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 <table> <tr> <td>年金資産の期首残高</td><td>16,572 百万円</td></tr> <tr> <td>期待運用収益</td><td>414</td></tr> <tr> <td>数理計算上の差異の発生額</td><td>395</td></tr> <tr> <td>事業主からの拠出額</td><td>510</td></tr> <tr> <td>退職給付の支払額</td><td>518</td></tr> <tr> <td>年金資産の期末残高</td><td>17,373</td></tr> </table>		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										
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 <table> <tr> <td>積立型制度の退職給付債務</td><td>18,163 百万円</td></tr> <tr> <td>年金資産</td><td>17,373</td></tr> <tr> <td></td><td>790</td></tr> <tr> <td>非積立型制度の退職給付債務</td><td>3,235</td></tr> <tr> <td>未積立退職給付債務</td><td>4,025</td></tr> <tr> <td>未認識数理計算上の差異</td><td>3,768</td></tr> <tr> <td>未認識過去勤務費用</td><td>331</td></tr> <tr> <td>貸借対照表上に計上された負債と資産の純額</td><td>588</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>2,938</td></tr> <tr> <td>前払年金費用</td><td>2,350</td></tr> <tr> <td>貸借対照表上に計上された負債と資産の純額</td><td>588</td></tr> </table>		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
積立型制度の退職給付債務	18,163 百万円																						
年金資産	17,373																						
	790																						
非積立型制度の退職給付債務	3,235																						
未積立退職給付債務	4,025																						
未認識数理計算上の差異	3,768																						
未認識過去勤務費用	331																						
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588																						
退職給付引当金	2,938																						
前払年金費用	2,350																						
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588																						

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	20,181 百万円
年金資産	17,469

	2,712
--	-------

非積立型制度の退職給付債務	3,369
---------------	-------

未積立退職給付債務	6,082
-----------	-------

未認識数理計算上の差異	5,084
-------------	-------

未認識過去勤務費用	220
-----------	-----

貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218
----------------------	-------

退職給付引当金	3,219
---------	-------

前払年金費用	2,001
--------	-------

貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218
----------------------	-------

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	951 百万円
------	---------

利息費用	179
------	-----

期待運用収益	434
--------	-----

数理計算上の差異の費用処理額	598
----------------	-----

過去勤務費用の費用処理額	38
--------------	----

確定給付制度に係る退職給付費用	1,255
-----------------	-------

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	47%
----	-----

株式	41%
----	-----

生保一般勘定	12%
--------	-----

その他	0%
-----	----

合計	100%
----	------

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	0.7%
-----------------	------

退職一時金制度の割引率	0.4%
-------------	------

長期期待運用収益率	2.5%
-----------	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

税効果会計関係

前事業年度末 (2018年3月31日)	当事業年度末 (2019年3月31日)
------------------------	------------------------

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳 <table> <tr> <td>繰延税金資産</td><td>百万円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金</td><td>1,434</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>910</td></tr> <tr> <td>投資有価証券評価減</td><td>417</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>409</td></tr> <tr> <td>投資損失引当金</td><td>-</td></tr> <tr> <td>ゴルフ会員権評価減</td><td>207</td></tr> <tr> <td>時効後支払損引当金</td><td>169</td></tr> <tr> <td>減価償却超過額</td><td>171</td></tr> <tr> <td>子会社株式売却損</td><td>148</td></tr> <tr> <td>未払社会保険料</td><td>107</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>566</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>4,543</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>735</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>3,808</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr> <td> その他有価証券評価差額金</td><td>5</td></tr> <tr> <td> 前払年金費用</td><td>728</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>733</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td><td>3,074</td></tr> </table>	繰延税金資産	百万円	賞与引当金	1,434	退職給付引当金	910	投資有価証券評価減	417	未払事業税	409	投資損失引当金	-	ゴルフ会員権評価減	207	時効後支払損引当金	169	減価償却超過額	171	子会社株式売却損	148	未払社会保険料	107	その他	566	繰延税金資産小計	4,543	評価性引当額	735	繰延税金資産合計	3,808	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	5	前払年金費用	728	繰延税金負債合計	733	繰延税金資産の純額	3,074	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 <table> <tr> <td>繰延税金資産</td><td>百万円</td></tr> <tr> <td>賞与引当金</td><td>1,175</td></tr> <tr> <td>退職給付引当金</td><td>998</td></tr> <tr> <td>投資有価証券評価減</td><td>708</td></tr> <tr> <td>未払事業税</td><td>288</td></tr> <tr> <td>投資損失引当金</td><td>219</td></tr> <tr> <td>ゴルフ会員権評価減</td><td>192</td></tr> <tr> <td>時効後支払損引当金</td><td>172</td></tr> <tr> <td>減価償却超過額</td><td>171</td></tr> <tr> <td>子会社株式売却損</td><td>148</td></tr> <tr> <td>未払社会保険料</td><td>82</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>466</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産小計</td><td>4,625</td></tr> <tr> <td>評価性引当額</td><td>1,295</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産合計</td><td>3,329</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債</td><td></td></tr> <tr> <td> その他有価証券評価差額金</td><td>15</td></tr> <tr> <td> 前払年金費用</td><td>620</td></tr> <tr> <td>繰延税金負債合計</td><td>635</td></tr> <tr> <td>繰延税金資産の純額</td><td>2,694</td></tr> </table>	繰延税金資産	百万円	賞与引当金	1,175	退職給付引当金	998	投資有価証券評価減	708	未払事業税	288	投資損失引当金	219	ゴルフ会員権評価減	192	時効後支払損引当金	172	減価償却超過額	171	子会社株式売却損	148	未払社会保険料	82	その他	466	繰延税金資産小計	4,625	評価性引当額	1,295	繰延税金資産合計	3,329	繰延税金負債		その他有価証券評価差額金	15	前払年金費用	620	繰延税金負債合計	635	繰延税金資産の純額	2,694
繰延税金資産	百万円																																																																																
賞与引当金	1,434																																																																																
退職給付引当金	910																																																																																
投資有価証券評価減	417																																																																																
未払事業税	409																																																																																
投資損失引当金	-																																																																																
ゴルフ会員権評価減	207																																																																																
時効後支払損引当金	169																																																																																
減価償却超過額	171																																																																																
子会社株式売却損	148																																																																																
未払社会保険料	107																																																																																
その他	566																																																																																
繰延税金資産小計	4,543																																																																																
評価性引当額	735																																																																																
繰延税金資産合計	3,808																																																																																
繰延税金負債																																																																																	
その他有価証券評価差額金	5																																																																																
前払年金費用	728																																																																																
繰延税金負債合計	733																																																																																
繰延税金資産の純額	3,074																																																																																
繰延税金資産	百万円																																																																																
賞与引当金	1,175																																																																																
退職給付引当金	998																																																																																
投資有価証券評価減	708																																																																																
未払事業税	288																																																																																
投資損失引当金	219																																																																																
ゴルフ会員権評価減	192																																																																																
時効後支払損引当金	172																																																																																
減価償却超過額	171																																																																																
子会社株式売却損	148																																																																																
未払社会保険料	82																																																																																
その他	466																																																																																
繰延税金資産小計	4,625																																																																																
評価性引当額	1,295																																																																																
繰延税金資産合計	3,329																																																																																
繰延税金負債																																																																																	
その他有価証券評価差額金	15																																																																																
前払年金費用	620																																																																																
繰延税金負債合計	635																																																																																
繰延税金資産の純額	2,694																																																																																
2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳 <table> <tr> <td>法定実効税率</td><td>31.0%</td></tr> <tr> <td>(調整)</td><td></td></tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>0.2%</td></tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>3.4%</td></tr> <tr> <td>タックスヘイブン税制</td><td>1.8%</td></tr> <tr> <td>外国税額控除</td><td>0.2%</td></tr> <tr> <td>外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税</td><td>0.3%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>0.4%</td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>29.3%</td></tr> </table>	法定実効税率	31.0%	(調整)		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	3.4%	タックスヘイブン税制	1.8%	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	0.3%	その他	0.4%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.3%	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 <table> <tr> <td>法定実効税率</td><td>31.0%</td></tr> <tr> <td>(調整)</td><td></td></tr> <tr> <td>交際費等永久に損金に算入されない項目</td><td>0.1%</td></tr> <tr> <td>受取配当金等永久に益金に算入されない項目</td><td>5.6%</td></tr> <tr> <td>タックスヘイブン税制</td><td>2.6%</td></tr> <tr> <td>外国税額控除</td><td>0.6%</td></tr> <tr> <td>外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税</td><td>0.3%</td></tr> <tr> <td>その他</td><td>1.3%</td></tr> <tr> <td>税効果会計適用後の法人税等の負担率</td><td>29.1%</td></tr> </table>	法定実効税率	31.0%	(調整)		交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%	受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%	タックスヘイブン税制	2.6%	外国税額控除	0.6%	外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%	その他	1.3%	税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%																																												
法定実効税率	31.0%																																																																																
(調整)																																																																																	
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	3.4%																																																																																
タックスヘイブン税制	1.8%																																																																																
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	0.3%																																																																																
その他	0.4%																																																																																
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.3%																																																																																
法定実効税率	31.0%																																																																																
(調整)																																																																																	
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.1%																																																																																
受取配当金等永久に益金に算入されない項目	5.6%																																																																																
タックスヘイブン税制	2.6%																																																																																
外国税額控除	0.6%																																																																																
外国子会社からの受取配当に係る外国源泉税	0.3%																																																																																
その他	1.3%																																																																																
税効果会計適用後の法人税等の負担率	29.1%																																																																																

セグメント情報等

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	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。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (百万円)	科目	期末残高 (百万円)
親会社の子会社	野村證券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*2）	34,646	未払手数料	6,410

（エ）役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

（1）親会社情報

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

（2）重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1 株当たり情報

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
1株当たり純資産額	16,714円33銭	1株当たり純資産額	16,882円89銭
1株当たり当期純利益	4,822円68銭	1株当たり当期純利益	4,984円30銭
潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。		潜在株式調整後1株当たり当期純利益については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。	
1株当たり当期純利益の算定上の基礎		1株当たり当期純利益の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益	24,840百万円	損益計算書上の当期純利益	25,672百万円
普通株式に係る当期純利益	24,840百万円	普通株式に係る当期純利益	25,672百万円
普通株主に帰属しない金額の主要な内訳		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。		該当事項はありません。	
普通株式の期中平均株式数	5,150,693株	普通株式の期中平均株式数	5,150,693株

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託者の親法人等(委託者の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下 において同じ。)又は子法人等(委託者が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は店頭デリバティブ取引を行うこと。

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託者

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

* 2019年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 野村信託銀行株式会社	3,500,000百万円 35,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
--------------------------	---------------------------	--------------------

* 2019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・連絡等を行ないます。

(2)販売会社

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

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【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2018年 9月13日	有価証券届出書
2018年 9月13日	有価証券報告書
2019年 3月14日	有価証券届出書の訂正届出書
2019年 3月14日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	亀井 純子
--------------------	-------	-------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	櫻井 雄一郎
--------------------	-------	--------

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	津村 健二郎
--------------------	-------	--------

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2018年4月1日から2019年3月31日までの第60期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村アセットマネジメント株式会社の2019年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2019年8月14日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

亀 井 純 子

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊 藤 志 保

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村資産設計ファンド（ＤＣ）2040の2018年6月23日から2019年6月24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2019年6月24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。