

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年11月28日提出
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目 1 2 番 1 号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【電話番号】	03-3241-9511
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券に係るファンドの名称】	野村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
【届出の対象とした募集（売出）内国投資 信託受益証券の金額】	2兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

野村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

（ファンドの愛称を「Funds-i 内外７資産バランス・為替ヘッジ型」とします。なお、「ファンド」という場合、または「野村Funds-i 内外７資産為替ヘッジ」という場合があります。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託・受益権(以下「受益権」といいます。)

■信用格付■

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

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

（３）【発行（売出）価額の総額】

2兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込日の翌営業日の基準価額 とします。

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（５）【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（税抜2.0%）以内 で販売会社が独自に定める率を乗じて

得た額とします。

詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

（６）【申込単位】

1万口以上1万口単位(当初元本1口＝1円)または1万円以上1円単位

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

（７）【申込期間】

2019年11月29日から2020年11月26日まで

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

（８）【申込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（９）【払込期日】

販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社にお支払いください。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

（１０）【払込取扱場所】

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（ １ １ ） 【振替機関に関する事項】

ファンドの受益権に係る振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

（ １ ２ ） 【その他】

該当事項はありません。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

（1）【ファンドの目的及び基本的性格】

国内および外国の各株式、国内、外国および新興国の各債券、国内および外国の各不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とし、信託財産の成長を目的に運用を行なうことを基本とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。

■ 信託金の限度額 ■

受益権の信託金限度額は1兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該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）

《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単 位 型	国 内	株 式	インデックス型
	海 外	債 券	
追 加 型		不動産投信	特 殊 型
	内 外	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				
	年4回	日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	北米	ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	
	年12回 (毎月)	欧州			T O P I X
	日々	アジア			
不動産投信	日々	オセアニア			
	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)資産配分固定 型))		アフリカ			
		中近東 (中東)			
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

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〕

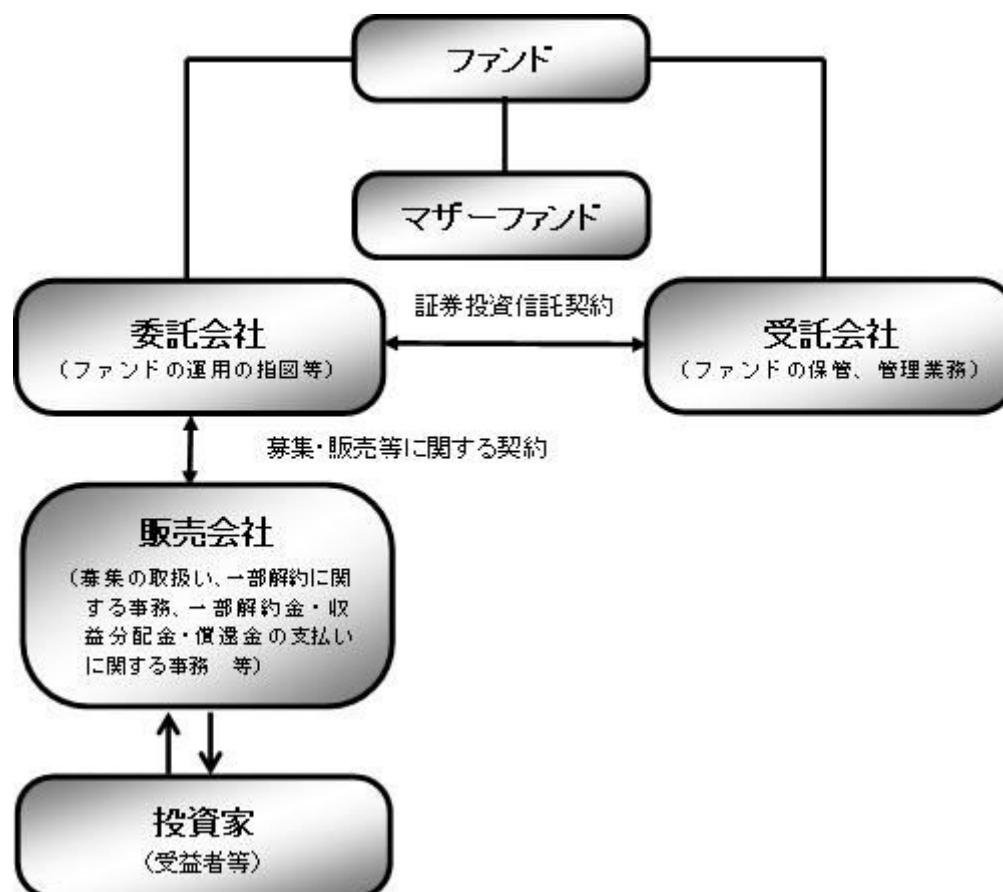
- (1)ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2)条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3)ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、特定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

2013年9月12日

信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

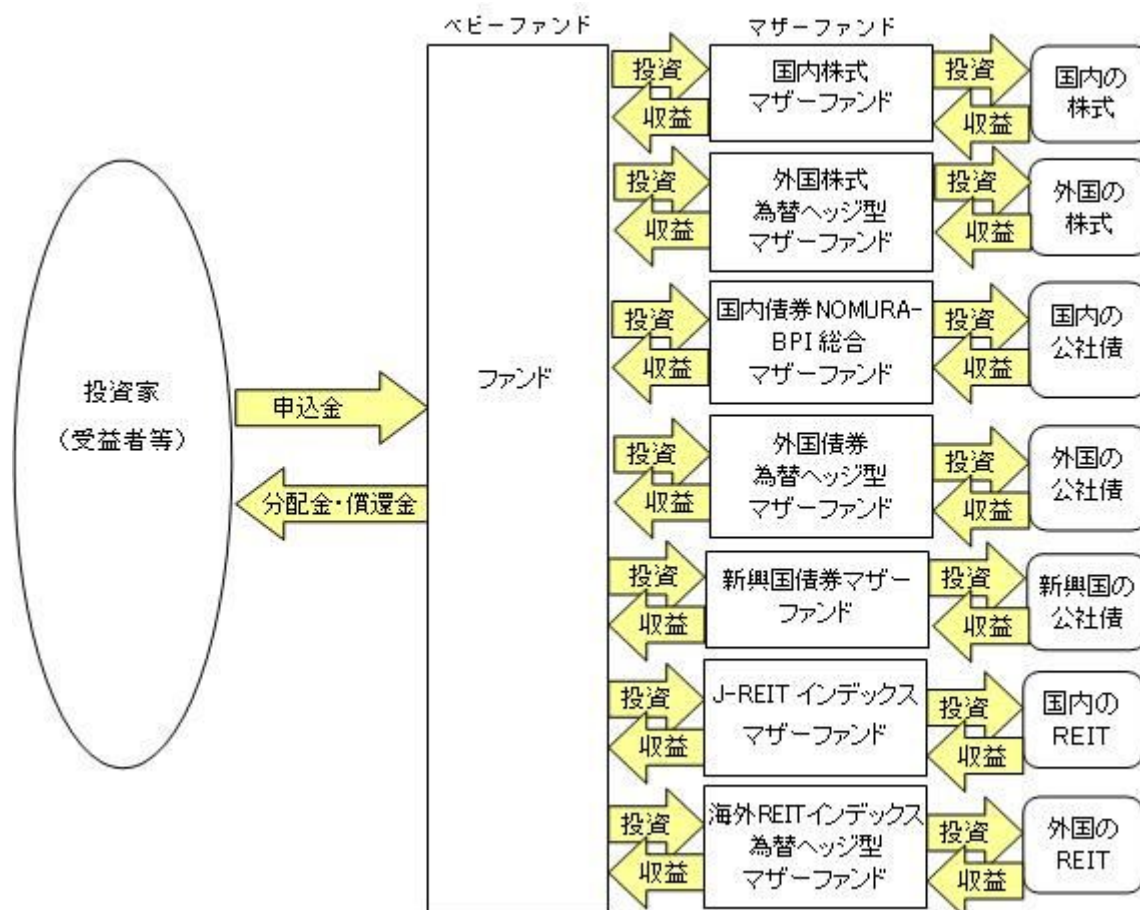
(3)【ファンドの仕組み】



ファンド	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
マザーファンド (親投資信託)	国内株式マザーファンド 外国株式為替ヘッジ型マザーファンド 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド 新興国債券マザーファンド J-REITインデックス マザーファンド 海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社(受託者)	野村信託銀行株式会社

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。



■ 委託会社の概況 (2019年10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】

[1] ファンドにおける各マザーファンドへの投資比率は、以下を基本（「基本投資割合」といいます。）

とし、原則として毎月、リバランスを行ない、各マザーファンドの対象指数の月次リターンに、ファンドの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	基本投資割合	主要投資対象	対象指数
国内株式マザーファンド	1/6	わが国の株式	東証株価指数 (TOPIX)
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1/6	外国の株式	MSCI-KOKUSAI 指数 (円ベース・為替ヘッジあり)
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1/9	わが国の公社債	NOMURA-BPI総合
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1/9	外国の公社債	FTSE 世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)
新興国債券マザーファンド	1/9	新興国の公社債	JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス (円ヘッジベース) [*]
J-REITインデックス マザーファンド	1/6	J - REIT ¹	東証REIT指数 (配当込み)
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	1/6	日本を除く世界各国のREIT ²	S&P先進国REIT指数 (除く日本、配当込み、円ヘッジ)

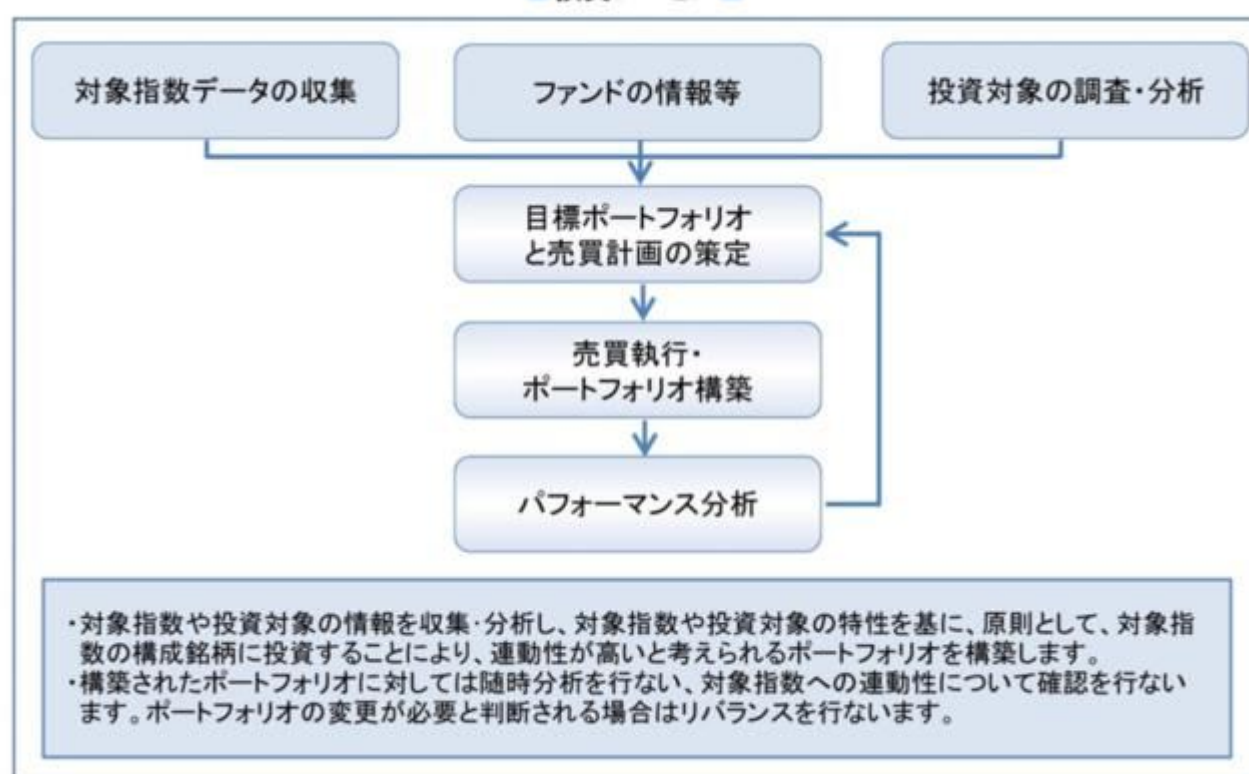
1 わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

2 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。

* JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース) をもとに、委託会社が為替ヘッジコストを考慮して算出したものです。

（新興国債券マザーファンドは「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）」の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないますが、ファンドにおいては、原則として基本投資割合の範囲で為替予約取引等を行ない、「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円ヘッジベース）」に連動する投資成果を目指します。）

■投資プロセス■



* 上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

[2] 合成指数の動きに効率的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。

[3] 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。

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。

■ 各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について ■

○ 東証株価指数(TOPIX)

TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「**㈱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**㈱東京証券取引所**が有します。

㈱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。

㈱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。

㈱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**㈱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、**㈱東京証券取引所**により提供、保証又は販売されるものではありません。

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

㈱東京証券取引所は、野村アセットマネジメント株式会社又は本ファンドの購入者のニーズを、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、**㈱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(円ベース・為替ヘッジあり)

本ファンドは、MSCI Inc.（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が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCIが独占的に所有しています。MSCI及びMSCI指数は、MSCI及びその関係会社のサービスマークであり、野村アセットマネジメント株式会社は特定の目的の為にその使用を許諾されています。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCIとその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、本ファンドまたは本ファンドの発行会社あるいは所有者に関わらず、MSCIにより決定、作成、及び計算されています。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、本ファンドの発行者または所有者の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、本ファンドを現金に償還する方程式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしておりません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

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

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

○ 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、円ヘッジ・円ベース)

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

○ JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(円ヘッジベース)

本書に含まれるJPモルガンのインデックス商品（インデックスのレベルも含みますが、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、信頼できるとされるものですが、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、信頼できるとさ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REIT指数(配当込み)

東証REIT指数の指数値及び東証REIT指数の商標は、株式会社東京証券取引所（以下「**㈱東京証券取引所**」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など東証REIT指数に関するすべての権利及び東証REIT指数の商標に関するすべての権利は**㈱東京証券取引所**が有します。

㈱東京証券取引所は、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の方法の変更、東証REIT指数の指数値の算出若しくは公表の停止又は東証REIT指数の商標の変更若しくは使用の停止を行うことができるものとします。

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

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

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

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

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

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

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

○ S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円ヘッジ)

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

（２）【投資対象】

国内および外国の各株式、国内、外国および新興国の各債券、国内および外国の各不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」、「国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド」各受益証券を主要投資対象とします。

■ 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
国内株式マザーファンド	わが国の株式
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	外国の株式
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	わが国の公社債
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	外国の公社債
新興国債券マザーファンド	新興国の公社債
J-REITインデックス マザーファンド	J - REIT
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	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。

1 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、後述の「（５）投資制限、および」に定めるものに限りま。

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。）

2 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親投資信託である国内株式マザーファンド、外国株式為替ヘッジ型マザーファンド、国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド、外国債券為替ヘッジ型マザーファンド、新興国債券マザーファンド、J - REITインデックス マザーファンド、および海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド（以下「各マザーファンド」といいます。）受益証券のほか、次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資するこ

とを指図します。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券(新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。)
6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
8. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
9. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
10. 特定目的会社に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券および新株予約権証券
13. 外国の者の発行する証券または証書で、第1号もしくは第5号の証券または証書の性質を有するプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの
14. 前号以外の外国または外国の者の発行する証券または証書で、第1号から第12号の証券または証書の性質を有するもの
15. 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
16. 投資証券、新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいいます。）
19. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
20. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
21. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
22. 外国の者に対する権利で、貸付債権信託受益権であって第19号の有価証券に表示されるべき権利の性質を有するもの
23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

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

金融商品の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、上記「有価証券の指図範囲等」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
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¹
 - 4 為替先渡取引²
 - 5 直物為替先渡取引³

1 「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。

2 「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。以下この項において同じ。）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。以下この項において同じ。）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。

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

(参考)各マザーファンドの概要

（国内株式マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

（外国株式為替ヘッジ型マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、株価指数先物取引等のデリバティブ取引ならびに為替予約取引をヘッジ目的外の利用も含め活用する場合があります。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

転換社債型新株予約権付社債とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）をいいます。

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

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

（国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（外国債券為替ヘッジ型マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

（新興国債券マザーファンド）

運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

(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インデックス為替ヘッジ型マザーファンド)

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

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

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

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないます。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

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

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

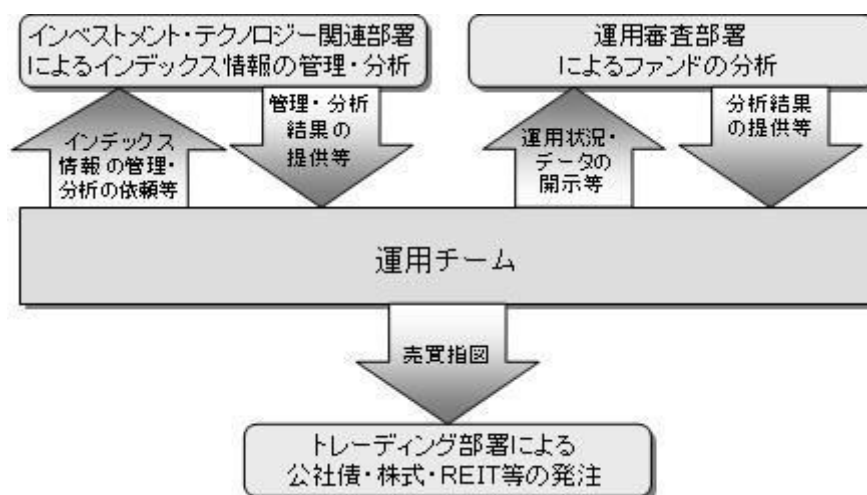
外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

(3) 【運用体制】

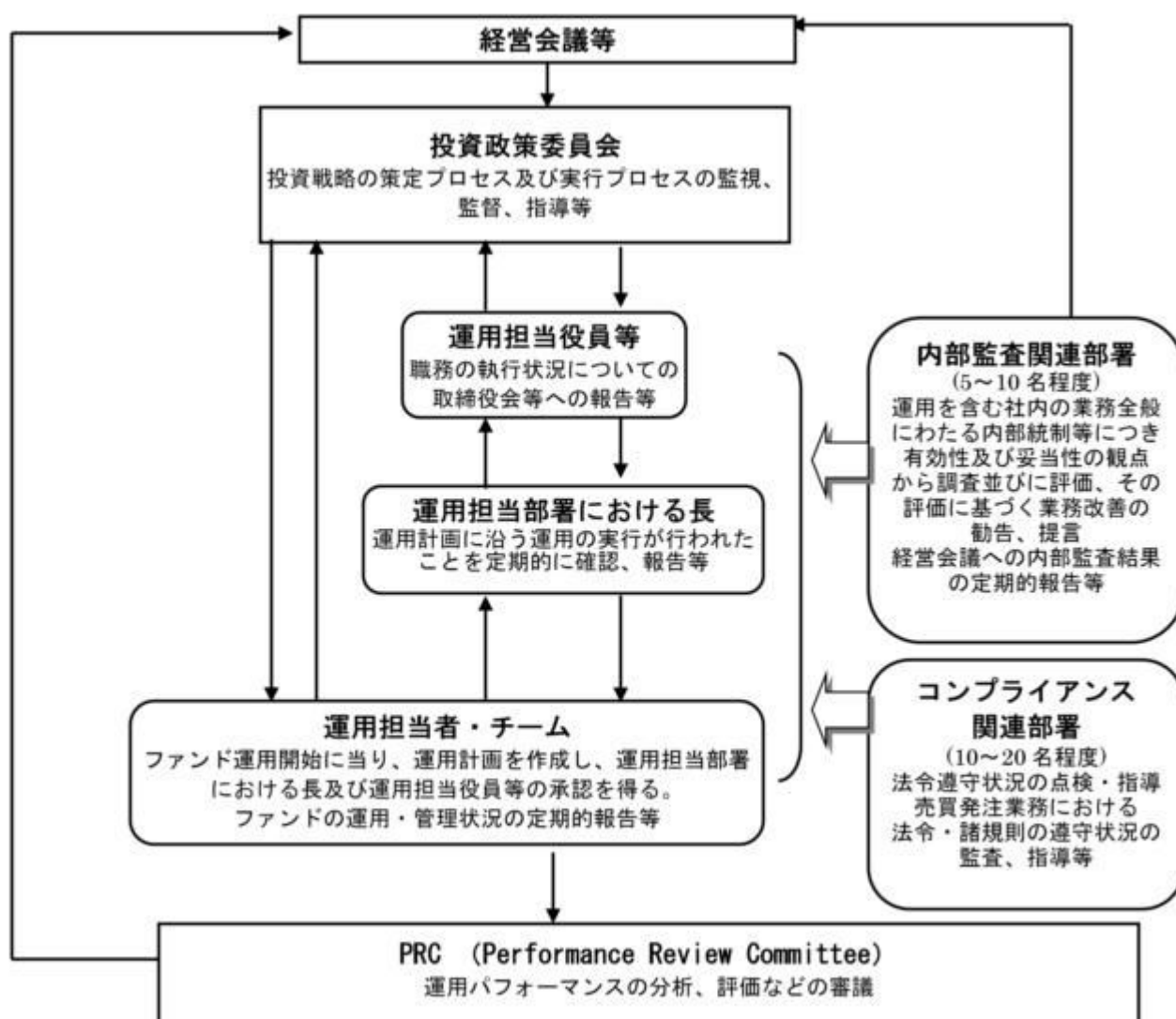
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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、利子・配当等収益等を中心として基準価額水準等を勘案して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9月6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。
- ・ 外国為替予約取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、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。
- ・ 同一銘柄の株式への実質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実質投資割合は、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実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 投資信託証券（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。
- ・ 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。

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書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。

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（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。）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。

[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により為替変動リスクの低減を図ることを基本としますが、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。また、円金利がヘッジ対

象通貨の金利より低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかるため、基準価額の変動要因となります。

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対象指数（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。
- 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。
- ファンドが実質的な投資対象とするREITの中には、流動性の低いものもあり、こうしたREITへの投資は、流動性の高い株式等に比べて制約を受けることが想定されます。
- REITに関する法律（税制度、会計制度等）、不動産を取り巻く規制が変更となった場合、REITの価格や配当に影響が及ぶことが想定されます。
- ファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国においては、政治、経済、社会情勢の変化が金融市場に及ぼす影響は、先進国以上に大きいものになることが予想されます。さらに、当局による海外からの投資規制などが緊急に導入されたり、あるいは政策の変更等により、金融市場が著しい悪影響を被る可能性や運用上の制約を大きく受ける可能性があります。
- 金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、投資信託約款の規定に従い、委託会社の判断でファンドの購入・換金の各受付けを中止すること、およびすでに受付けた購入・換金の各受付けを取り消す場合があります。
- ファンドは、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて分配を行なう場合があります。したがって、ファンドの分配金の水準は必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示唆するものではありません。

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

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

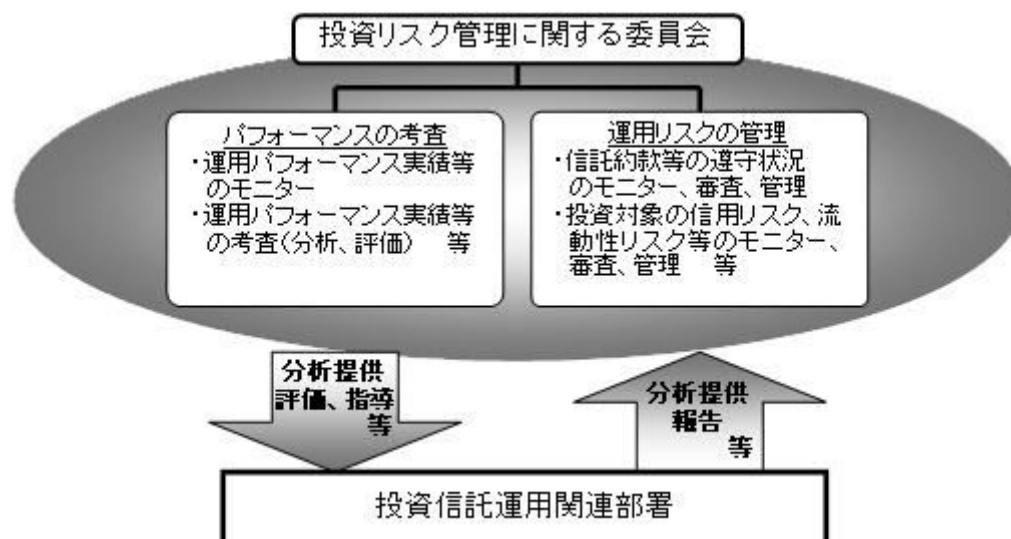
パフォーマンスの考査

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

運用リスクの管理

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

リスク管理体制図



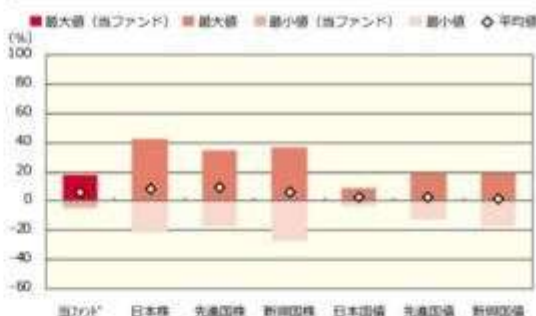
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

■ リスクの定量的比較（2014年10月末～2019年9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 (%)	18.1	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値 (%)	△4.7	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値 (%)	5.5	8.4	9.6	5.9	2.1	2.3	1.2

* 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。2014年10月末を10,000として指数化しております。

* 年間騰落率は、2014年10月から2019年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

* 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
* 2014年10月から2019年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
* 決算日に対応した数値とは異なります。
* 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

<代表的な資産クラスの指数>

- 日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み）
- 先進国株：MSCI-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）
- 新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）
- 日本国債：NOMURA-BPI 国債
- 先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
- 新興国債：JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
- MSCI-KOKUSA1 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-KOKUSA1 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価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は法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。

米国の J.P. Morgan Securities LLC（ここでは「JPMS LLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての提供、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての買値、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。指数は使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。JPMS LLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JP Morgan は JP Morgan Chase Bank, NA、JPSC、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】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、2.2%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相

当する率）（税抜2.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に年0.55%（税抜年0.50%）以内（2019年11月28日現在 年0.55%（税抜年0.50%））の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り（税抜）とします。

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
年0.23%	年0.23%	年0.04%

* 上記配分は、2019年11月28日現在の信託報酬率における配分です。

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。

支払先の役務の内容

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

（４）【その他の手数料等】

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

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

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信託財産から支払われます。

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

ファンドにおいて一部解約の実行に伴い、信託財産留保額 をご負担いただきます。信託財産留保額は、基準価額に0.2%の率を乗じて得た額を1口あたりに換算して、換金する口数に応じてご負担いただきます。

「信託財産留保額」とは、償還時まで投資を続ける投資家との公平性の確保やファンド残高の安定的な推移を図るため、クローズド期間の有無に関係なく、信託期間満了前の解約に対し解約者から徴収する一定の金額をいい、信託財産に繰り入れられます。

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

■個人、法人別の課税について■

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

< 換金（解約）時および償還時の差益（譲渡益）に対する課税 >

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

損益通算について

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

《利子所得》	《上場株式等に係る譲渡所得等》 ^{（注2）}	《配当所得》
・ 特定公社債 ^{（注1）} の利子 ・ 公募公社債投資信託の収益分配金	特定公社債、公募公社債投資信託、上場株式、公募株式投資信託の ・ 譲渡益 ・ 譲渡損	・ 上場株式の配当 ・ 公募株式投資信託の収益分配金

（注1）「特定公社債」とは、国債、地方債、外国国債、公募公社債、上場公社債、2015年12月31日以前に発行された公社債（同族会社が発行した社債を除きます。）などの一定の公社債をいいます。

（注2）株式等に係る譲渡所得等について、上場株式等に係る譲渡所得等とそれ以外の株式等に係る譲渡所得等に区分し、別々の分離課税制度とすることとされ、原則として、これら相互の通算等ができないこととされました。

上場株式、公募株式投資信託は税法上、少額投資非課税制度「愛称：NISA（ニーサ）」の適用対象です。NISAをご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得及び譲渡所得が一定期間非課税となります。他の口座で生じた配当所得や譲渡所得との損益通算はできません。販売会社で非課税口座を開設するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

■換金（解約）時および償還時の課税について■

[個人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の差益 については、譲渡所得とみなして課税が行われます。

換金（解約）時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した利益を譲渡益として課税対象となります。

[法人の投資家の場合]

換金（解約）時および償還時の個別元本超過額が源泉徴収の対象（配当所得）となります。

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

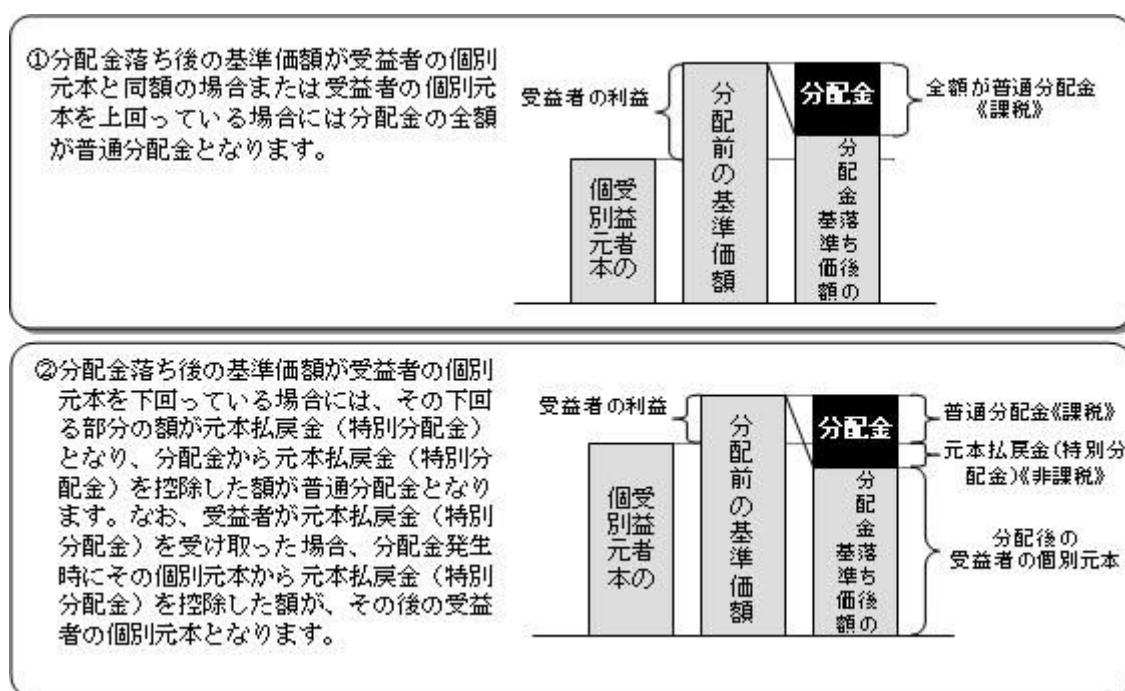
■個別元本について■

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

■分配金の課税について■

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



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

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9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9月30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

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	10,815,897,973	99.90
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	9,877,793	0.09
合計（純資産総額）		10,825,775,766	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	431,514,797,010	97.56
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	10,768,822,098	2.43
合計（純資産総額）		442,283,619,108	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	9,877,360,000	2.23

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	32,502,692,061	66.02
	カナダ	1,853,052,974	3.76
	ドイツ	1,512,574,167	3.07

	イタリア	417,761,873	0.84
	フランス	1,946,698,040	3.95
	オランダ	655,274,825	1.33
	スペイン	517,159,123	1.05
	ベルギー	181,462,631	0.36
	オーストリア	39,583,553	0.08
	ルクセンブルグ	18,415,109	0.03
	フィンランド	175,764,883	0.35
	アイルランド	95,088,383	0.19
	ポルトガル	28,120,507	0.05
	イギリス	2,890,182,289	5.87
	スイス	1,683,777,218	3.42
	スウェーデン	457,380,669	0.92
	ノルウェー	116,382,027	0.23
	デンマーク	316,941,868	0.64
	オーストラリア	1,159,373,494	2.35
	ニュージーランド	42,850,439	0.08
	香港	550,064,875	1.11
	シンガポール	201,665,560	0.40
	イスラエル	59,488,105	0.12
	小計	47,421,754,673	96.33
投資証券	アメリカ	1,129,889,074	2.29
	カナダ	8,387,971	0.01
	フランス	54,296,104	0.11
	イギリス	31,055,097	0.06
	オーストラリア	102,388,164	0.20
	香港	33,695,488	0.06
	シンガポール	24,510,742	0.04
	小計	1,384,222,640	2.81
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	419,387,301	0.85
合計（純資産総額）		49,225,364,614	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	895,574,120	1.81
	買建	カナダ	48,737,539	0.09
	買建	ドイツ	149,979,816	0.30
	買建	イギリス	78,430,404	0.15
	買建	スイス	43,599,906	0.08
	買建	オーストラリア	36,594,870	0.07

（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	567,087,585,560	80.26
地方債証券	日本	46,390,613,372	6.56
特殊債券	日本	59,590,428,626	8.43
社債券	日本	26,961,200,200	3.81
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	6,452,850,537	0.91
合計（純資産総額）		706,482,678,295	100.00

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国 / 地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	27,873,886,103	46.98
	カナダ	1,107,043,019	1.86
	メキシコ	448,119,477	0.75
	ドイツ	3,579,996,414	6.03
	イタリア	5,699,757,586	9.60
	フランス	5,805,226,062	9.78
	オランダ	1,030,729,889	1.73
	スペイン	3,589,810,748	6.05
	ベルギー	1,474,079,847	2.48
	オーストリア	868,377,002	1.46
	フィンランド	351,227,310	0.59
	アイルランド	543,278,427	0.91
	イギリス	3,879,308,665	6.53
	スウェーデン	190,574,140	0.32
	ノルウェー	94,443,119	0.15
	デンマーク	305,746,771	0.51
	ポーランド	362,885,467	0.61
	オーストラリア	1,238,120,397	2.08
	シンガポール	501,564,107	0.84
	南アフリカ	332,630,057	0.56
小計		59,276,804,607	99.92
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	43,430,768	0.07
合計（純資産総額）		59,320,235,375	100.00

（参考）新興国債券マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	20,704,812,181	98.18
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	382,887,998	1.81
合計（純資産総額）		21,087,700,179	100.00

（参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	45,630,870,750	96.93
現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	1,440,498,929	3.06
合計（純資産総額）		47,071,369,679	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

資産の種類	建別	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
REIT指数先物取引	買建	日本	1,034,136,000	2.19

（参考）海外ＲＥＩＴインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	5,038,919,037	73.85
	カナダ	128,939,773	1.88
	ドイツ	17,459,642	0.25
	イタリア	1,443,621	0.02
	フランス	220,393,251	3.23
	オランダ	16,753,648	0.24
	スペイン	43,936,485	0.64
	ベルギー	66,542,036	0.97
	アイルランド	15,862,360	0.23
	イギリス	317,781,350	4.65
	オーストラリア	431,610,446	6.32
	ニュージーランド	27,950,414	0.40
	香港	140,866,348	2.06
	シンガポール	239,164,728	3.50
	イスラエル	5,088,465	0.07
小計		6,712,711,604	98.38

現金・預金・その他資産（負債控除後）	—	109,914,719	1.61
合計（純資産総額）		6,822,626,323	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	221,736,743	3.25

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

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

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	1,157,112,266	1.5370	1,778,481,553	1.6014	1,852,999,582	17.11
2	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	692,091,984	2.5949	1,795,949,772	2.6697	1,847,677,969	17.06
3	日本	親投資信託 受益証券	海外R E I Tインデックス為替 ヘッジ型マザーファンド	1,133,491,152	1.5742	1,784,394,929	1.5975	1,810,752,115	16.72
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファ ンド	913,824,817	1.9669	1,797,427,601	1.9648	1,795,483,000	16.58
5	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券マザーファンド	617,018,456	1.9088	1,177,821,344	1.9082	1,177,394,617	10.87
6	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	963,671,464	1.2115	1,167,549,539	1.2116	1,167,584,345	10.78
7	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	859,870,241	1.3620	1,171,157,801	1.3537	1,164,006,345	10.75

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	99.90
合 計	99.90

（参考）国内株式マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機 器	2,116,400	6,589.50	13,946,019,435	7,216.00	15,271,942,400	3.45
2	日本	株式	ソニー	電気機器	1,274,900	5,479.04	6,985,233,642	6,347.00	8,091,790,300	1.82
3	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	12,894,500	524.82	6,767,397,639	548.40	7,071,343,800	1.59

4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,274,700	4,783.38	6,097,384,776	5,156.00	6,572,353,200	1.48
5	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,478,700	5,362.61	7,929,700,302	4,240.00	6,269,688,000	1.41
6	日本	株式	キーエンス	電気機器	93,200	66,567.41	6,204,082,696	66,900.00	6,235,080,000	1.40
7	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,658,000	4,233.51	7,019,171,680	3,690.00	6,118,020,000	1.38
8	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,320,200	3,862.80	5,099,671,536	3,695.00	4,878,139,000	1.10
9	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,602,100	2,827.80	4,530,430,400	2,798.50	4,483,476,850	1.01
10	日本	株式	任天堂	その他製品	108,700	37,287.43	4,053,143,765	40,020.00	4,350,174,000	0.98
11	日本	株式	K D D I	情報・通信業	1,527,700	2,585.32	3,949,603,348	2,825.00	4,315,752,500	0.97
12	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,300,000	3,287.31	4,273,503,015	3,286.00	4,271,800,000	0.96
13	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	25,453,200	166.81	4,245,953,730	165.60	4,215,049,920	0.95
14	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	669,800	5,486.33	3,674,747,364	5,779.00	3,870,774,200	0.87
15	日本	株式	信越化学工業	化学	327,800	9,625.31	3,155,179,409	11,560.00	3,789,368,000	0.85
16	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	170,100	22,144.99	3,766,864,094	22,220.00	3,779,622,000	0.85
17	日本	株式	第一三共	医薬品	543,500	5,629.79	3,059,795,142	6,804.00	3,697,974,000	0.83
18	日本	株式	ダイキン工業	機械	259,200	13,655.16	3,539,418,030	14,180.00	3,675,456,000	0.83
19	日本	株式	ファナック	電気機器	180,500	19,209.62	3,467,337,516	20,340.00	3,671,370,000	0.83
20	日本	株式	花王	化学	454,700	8,391.36	3,815,552,025	7,984.00	3,630,324,800	0.82
21	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	214,400	12,711.48	2,725,343,359	16,440.00	3,524,736,000	0.79
22	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,312,600	2,830.96	3,715,923,048	2,651.00	3,479,702,600	0.78
23	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	334,300	9,944.00	3,324,280,684	10,310.00	3,446,633,000	0.77
24	日本	株式	日立製作所	電気機器	855,000	3,710.77	3,172,714,353	4,023.00	3,439,665,000	0.77
25	日本	株式	H O Y A	精密機器	382,300	7,807.95	2,984,981,398	8,819.00	3,371,503,700	0.76
26	日本	株式	日本電産	電気機器	228,500	14,835.55	3,389,925,432	14,520.00	3,317,820,000	0.75
27	日本	株式	資生堂	化学	377,400	8,433.63	3,182,855,040	8,629.00	3,256,584,600	0.73
28	日本	株式	N T T ドコモ	情報・通信業	1,180,000	2,441.06	2,880,453,110	2,753.00	3,248,540,000	0.73
29	日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	784,000	3,728.49	2,923,142,731	4,132.00	3,239,488,000	0.73
30	日本	株式	村田製作所	電気機器	597,700	5,028.67	3,005,640,938	5,185.00	3,099,074,500	0.70

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.26
		建設業	2.82
		食料品	3.96
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.09
		医薬品	5.39
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.74

	ガラス・土石製品	0.79
	鉄鋼	0.74
	非鉄金属	0.72
	金属製品	0.55
	機械	4.92
	電気機器	13.69
	輸送用機器	7.66
	精密機器	2.19
	その他製品	2.20
	電気・ガス業	1.60
	陸運業	4.60
	海運業	0.16
	空運業	0.51
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	8.34
	卸売業	4.73
	小売業	4.68
	銀行業	5.73
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	2.26
	その他金融業	1.09
	不動産業	2.48
	サービス業	5.06
合 計		97.56

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （%）
1	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	87,460	13,592.72	1,188,819,535	14,863.82	1,299,989,837	2.64
2	アメリカ	株式	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	55,040	21,618.53	1,189,884,133	23,615.05	1,299,772,594	2.64
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	5,031	203,795.89	1,025,297,126	186,210.56	936,825,348	1.90
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	28,930	20,249.86	585,828,641	19,112.63	552,928,444	1.12
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3,777	125,239.80	473,030,733	132,211.71	499,363,639	1.01
6	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	39,100	12,110.42	473,517,787	12,704.34	496,739,788	1.00
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3,610	125,786.36	454,088,770	132,304.52	477,619,332	0.97

8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	32,010	14,900.24	476,956,723	13,878.51	444,251,169	0.90
9	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	36,910	10,634.09	392,504,400	11,726.37	432,820,538	0.87
10	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	30,260	11,360.33	343,763,690	13,443.59	406,803,167	0.82
11	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	51,100	8,224.08	420,250,584	7,714.12	394,191,614	0.80
12	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	20,980	17,360.00	364,212,932	18,778.07	393,964,118	0.80
13	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	88,100	3,312.04	291,791,012	4,039.44	355,875,157	0.72
14	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	15,700	22,431.64	352,176,782	22,388.00	351,491,663	0.71
15	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	109,100	3,186.35	347,631,789	3,167.45	345,569,013	0.70
16	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	13,290	21,109.24	280,541,874	24,806.49	329,678,268	0.66
17	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	50,000	6,101.22	305,061,447	6,507.57	325,378,800	0.66
18	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	10,980	26,690.18	293,058,177	29,044.50	318,908,715	0.64
19	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	21,740	14,435.54	313,828,710	14,025.28	304,909,657	0.61
20	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	54,200	5,026.47	272,434,956	5,480.17	297,025,626	0.60
21	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	23,030	13,036.07	300,220,852	12,799.31	294,768,155	0.59
22	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	49,000	5,173.62	253,507,684	5,861.13	287,195,625	0.58
23	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	51,700	5,033.30	260,222,071	5,472.62	282,934,619	0.57
24	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	31,130	8,506.33	264,802,222	8,947.64	278,540,257	0.56
25	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	51,800	5,692.34	294,863,364	5,270.81	273,028,103	0.55
26	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	6,470	38,200.41	247,156,658	41,318.25	267,329,085	0.54
27	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	8,500	28,388.81	241,304,920	31,422.76	267,093,528	0.54
28	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	11,490	25,615.93	294,327,087	23,230.85	266,922,572	0.54
29	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	54,800	4,636.11	254,058,917	4,835.89	265,007,057	0.53
30	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	67,200	4,353.82	292,577,133	3,908.86	262,675,553	0.53

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	3.30
		メディア	1.29
		娯楽	1.28
		不動産管理・開発	0.47
		エネルギー設備・サービス	0.28
		石油・ガス・消耗燃料	5.26
		化学	2.25
		建設資材	0.30
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.36
		紙製品・林産品	0.08

航空宇宙・防衛	2.45
建設関連製品	0.39
建設・土木	0.33
電気設備	0.68
コングロマリット	1.27
機械	1.57
商社・流通業	0.26
商業サービス・用品	0.50
航空貨物・物流サービス	0.49
旅客航空輸送業	0.10
海運業	0.05
陸運・鉄道	1.05
運送インフラ	0.20
自動車部品	0.28
自動車	0.77
家庭用耐久財	0.38
レジャー用品	0.05
繊維・アパレル・贅沢品	1.47
ホテル・レストラン・レジャー	1.86
販売	0.05
インターネット販売・通信販売	2.50
複合小売り	0.53
専門小売り	1.74
食品・生活必需品小売り	1.57
飲料	2.07
食品	2.09
タバコ	0.80
家庭用品	1.49
パーソナル用品	0.75
ヘルスケア機器・用品	2.78
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.73
バイオテクノロジー	1.78
医薬品	5.40
銀行	7.84
各種金融サービス	0.95
保険	3.90
情報技術サービス	4.16
ソフトウェア	5.14
通信機器	0.84
コンピュータ・周辺機器	2.92
電子装置・機器・部品	0.51
半導体・半導体製造装置	3.05

		各種電気通信サービス	2.19
		無線通信サービス	0.29
		電力	2.22
		ガス	0.21
		総合公益事業	1.11
		水道	0.09
		消費者金融	0.48
		資本市場	2.85
		各種消費者サービス	0.00
		独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.11
		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	0.74
		専門サービス	0.77
投資証券	—	—	2.81
合 計			99.14

（参考）国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 5 0 回	7,950,000,000	102.10	8,117,583,000	103.65	8,240,493,000	0.1	2028/3/20	1.16
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 3 4 回	7,600,000,000	104.14	7,914,972,000	104.60	7,950,132,000	0.6	2024/6/20	1.12
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 5 年 ）第 1 3 0 回	7,500,000,000	100.83	7,562,325,000	100.96	7,572,075,000	0.1	2021/12/20	1.07
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 5 年 ）第 1 2 6 回	7,500,000,000	100.47	7,535,475,000	100.49	7,537,125,000	0.1	2020/12/20	1.06
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 5 年 ）第 1 2 9 回	7,000,000,000	100.75	7,052,810,000	100.84	7,058,940,000	0.1	2021/9/20	0.99
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 5 1 回	6,600,000,000	102.65	6,774,950,000	103.62	6,839,382,000	0.1	2028/6/20	0.96
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 4 3 回	6,400,000,000	102.36	6,551,204,000	103.20	6,604,928,000	0.1	2026/6/20	0.93
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 5 3 回	6,100,000,000	102.88	6,275,960,000	103.44	6,310,389,000	0.1	2028/12/20	0.89
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 5 年 ）第 1 3 3 回	6,200,000,000	101.25	6,277,820,000	101.36	6,284,630,000	0.1	2022/9/20	0.88
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 1 0 年 ）第 3 4 1 回	6,000,000,000	103.74	6,224,664,000	104.23	6,253,860,000	0.3	2025/12/20	0.88
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 5 年 ）第 1 3 7 回	6,000,000,000	101.58	6,095,130,000	101.85	6,111,120,000	0.1	2023/9/20	0.86
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 （ 5 年 ）第 1 2 7 回	6,000,000,000	100.54	6,032,520,000	100.60	6,036,180,000	0.1	2021/3/20	0.85

13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 7 回	5,700,000,000	102.57	5,846,628,000	103.61	5,905,770,000	0.1	2027/6/20	0.83
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 8 回	5,500,000,000	102.50	5,637,920,000	103.64	5,700,530,000	0.1	2027/9/20	0.80
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 3 2 回	5,400,000,000	103.78	5,604,390,000	104.06	5,619,672,000	0.6	2023/12/20	0.79
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 6 回	5,400,000,000	102.26	5,522,148,000	103.52	5,590,566,000	0.1	2027/3/20	0.79
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 2 9 回	5,300,000,000	104.23	5,524,190,000	104.39	5,532,670,000	0.8	2023/6/20	0.78
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 4 回	5,300,000,000	102.23	5,418,455,000	103.28	5,474,264,000	0.1	2026/9/20	0.77
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 3 5 回	5,200,000,000	103.95	5,405,912,000	104.35	5,426,252,000	0.5	2024/9/20	0.76
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5 年) 第 1 2 8 回	5,200,000,000	100.62	5,232,396,000	100.71	5,237,232,000	0.1	2021/6/20	0.74
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 9 回	5,000,000,000	102.16	5,108,150,000	103.67	5,183,800,000	0.1	2027/12/20	0.73
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 4 5 回	5,000,000,000	102.27	5,113,500,000	103.40	5,170,450,000	0.1	2026/12/20	0.73
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 2 8 回	5,000,000,000	103.17	5,158,800,000	103.36	5,168,450,000	0.6	2023/3/20	0.73
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 4 7 回	4,200,000,000	122.12	5,129,262,000	122.92	5,162,850,000	1.6	2033/12/20	0.73
25	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	101.84	5,041,129,500	1.2	2020/12/20	0.71
26	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	103.54	4,970,064,000	0.1	2028/9/20	0.70
27	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	101.09	4,852,512,000	0.1	2022/3/20	0.68
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (1 0 年) 第 3 5 5 回	4,500,000,000	103.34	4,650,480,000	103.22	4,645,260,000	0.1	2029/6/20	0.65
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2 0 年) 第 1 5 0 回	3,830,000,000	120.08	4,599,276,000	120.59	4,618,826,800	1.4	2034/9/20	0.65
30	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	101.63	4,573,440,000	0.1	2023/3/20	0.64

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	80.26
地方債証券	6.56
特殊債券	8.43
社債券	3.81
合 計	99.08

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,150,000	10,905.40	670,682,111	10,880.94	669,178,347	2.125	2021/8/15	1.12
2	イギリス	国債証券	UK TREASURY	2,080,000	22,968.63	477,747,691	23,709.04	493,148,223	4.25	2046/12/7	0.83
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	11,822.29	496,536,525	11,720.28	492,251,775	2.75	2028/2/15	0.82
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	3,450,000	14,409.00	497,110,697	14,195.69	489,751,490	3.75	2043/11/15	0.82
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,600,000	13,005.20	468,187,302	12,804.53	460,963,388	3	2048/2/15	0.77
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	10,872.94	456,663,480	10,802.96	453,724,335	1.625	2026/5/15	0.76
7	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,500,000	12,931.00	452,585,102	12,872.76	450,546,602	1.75	2023/5/25	0.75
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,218.62	448,744,829	11,148.64	445,945,643	2.25	2024/11/15	0.75
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,065.17	442,606,900	11,003.62	440,144,943	2	2024/6/30	0.74
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,914.67	436,586,949	10,896.12	435,845,021	2.375	2021/4/15	0.73
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,699.25	427,970,229	10,683.23	427,329,443	1.125	2021/8/31	0.72
12	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,180,000	18,322.60	399,432,789	18,810.02	410,058,602	4.75	2044/9/1	0.69
13	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000	13,134.44	407,167,820	13,221.78	409,875,199	2.2	2027/6/1	0.69
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	10,786.09	409,871,718	10,712.74	407,084,337	1.5	2026/8/15	0.68
15	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,010,000	13,479.38	405,729,423	13,413.53	403,747,538	2.25	2024/5/25	0.68
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,700,000	10,743.09	397,494,634	10,736.35	397,245,069	1.375	2021/4/30	0.66
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	11,801.22	401,241,492	11,625.85	395,278,912	2.5	2046/5/15	0.66
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,580,000	10,842.58	388,164,632	10,830.78	387,742,038	2	2021/2/28	0.65
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	11,393.14	387,367,027	11,331.60	385,274,400	2.75	2024/2/15	0.64
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	11,056.74	386,985,925	10,994.35	384,802,250	2	2024/4/30	0.64
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	2,680,000	14,465.91	387,686,554	14,342.82	384,387,590	6.5	2026/11/15	0.64
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,020,000	12,919.20	390,159,947	12,726.12	384,329,072	3	2045/11/15	0.64
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	10,893.17	381,261,125	10,874.62	380,611,900	2.125	2021/6/30	0.64
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	10,704.31	374,651,025	10,664.68	373,264,075	1.25	2023/7/31	0.62
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	10,865.35	369,421,936	10,834.15	368,361,294	1.75	2022/5/31	0.62
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	11,374.59	363,987,154	11,282.69	361,046,343	2.25	2027/8/15	0.60
27	イギリス	国債証券	UK TREASURY	1,550,000	22,544.03	349,432,480	23,130.52	358,523,072	4.5	2042/12/7	0.60
28	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,000,000	11,964.51	358,935,406	11,938.07	358,142,312	0	2021/5/25	0.60
29	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000	11,948.46	358,453,884	11,936.42	358,092,743	0.45	2021/6/1	0.60
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,000,000	11,791.10	353,733,086	11,683.18	350,495,486	2.625	2029/2/15	0.59

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.92
合 計	99.92

（参考）新興国債券マザーファンド

順位	国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	利率 （％）	償還期限	投資 比率 （％）
1	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	4,200,000	11,155.69	468,538,997	12,888.07	541,299,200	5.25	2047/6/23	2.56
2	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000	11,185.90	279,647,700	12,651.02	316,275,748	5	2045/6/15	1.49
3	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,110,000	12,329.86	260,160,046	13,584.53	286,633,750	6.05	2040/1/11	1.35
4	アメリカ	国債証券	TURKEY GLOBAL	2,400,000	10,568.71	253,649,125	11,506.09	276,146,301	7.375	2025/2/5	1.30
5	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,300,000	10,931.10	251,415,504	11,415.34	262,552,956	4.15	2027/3/28	1.24
6	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000	10,974.85	252,421,642	11,411.35	262,461,116	4.25	2025/1/7	1.24
7	アメリカ	国債証券	PHILIPPINES GLOBAL	2,200,000	10,863.57	238,998,660	11,335.55	249,382,287	3	2028/2/1	1.18
8	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000	10,367.06	207,341,300	11,563.73	231,274,718	4.6	2048/2/10	1.09
9	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	10,674.63	202,818,103	12,120.87	230,296,585	5.625	2047/2/21	1.09
10	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000	9,579.96	201,179,186	10,643.36	223,510,597	6	2027/3/25	1.05
11	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,950,000	11,137.36	217,178,613	11,415.50	222,602,402	4	2023/10/2	1.05
12	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	11,993.96	203,897,357	13,058.32	221,991,440	5.55	2045/1/21	1.05
13	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PERU	1,400,000	13,800.27	193,203,780	15,796.89	221,156,571	5.625	2050/11/18	1.04
14	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000	10,875.74	206,639,172	11,485.49	218,224,384	4.625	2028/1/13	1.03
15	アメリカ	国債証券	FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,800,000	10,971.86	197,493,600	12,114.12	218,054,303	5.625	2041/1/7	1.03
16	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000	11,485.46	195,252,965	12,763.02	216,971,351	3.95	2040/1/20	1.02
17	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,900,000	11,075.29	210,430,510	11,388.36	216,378,952	4	2024/2/26	1.02
18	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000	11,993.75	191,900,149	13,363.85	213,821,637	5.625	2042/4/4	1.01
19	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,800,000	11,167.45	201,014,167	11,822.58	212,806,477	4.75	2026/5/27	1.00
20	アメリカ	国債証券	RUSSIAN FEDERATION	1,800,000	11,365.05	204,570,993	11,802.28	212,441,081	4.875	2023/9/16	1.00
21	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000	11,101.28	188,721,819	12,490.56	212,339,637	3.7	2042/2/2	1.00
22	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	2,400,000	7,725.08	185,402,070	8,683.89	208,413,377	4.875	2043/4/16	0.98
23	アメリカ	国債証券	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000	10,325.56	175,534,686	11,510.96	195,686,372	4.6	2046/1/23	0.92
24	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF ARGENTINA	4,100,000	8,343.56	342,086,165	4,762.07	195,245,195	7.5	2026/4/22	0.92
25	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000	11,142.74	189,426,580	11,426.03	194,242,510	3.75	2025/3/16	0.92
26	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000	10,364.22	176,191,854	11,092.58	188,574,023	6.25	2022/9/26	0.89
27	アメリカ	国債証券	COLOMBIA GLOBAL	1,220,000	14,010.71	170,930,711	15,378.70	187,620,237	7.375	2037/9/18	0.88
28	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,320,000	12,779.93	168,695,148	14,083.66	185,904,417	6.125	2041/1/18	0.88

29	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,400,000	11,740.59	164,368,333	13,229.35	185,210,938	5.25	2047/1/8	0.87
30	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,600,000	11,299.00	180,784,130	11,512.32	184,197,165	7.625	2029/4/26	0.87

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）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	4,001	751,959	3,008,591,319	830,000	3,320,830,000	7.05
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	4,132	657,808	2,718,064,639	725,000	2,995,700,000	6.36
3	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,885	167,758	2,161,563,376	195,200	2,515,152,000	5.34
4	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	8,233	198,821	1,636,894,280	236,000	1,942,988,000	4.12
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,277	178,478	1,655,748,291	207,000	1,920,339,000	4.07
6	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,809	218,637	1,707,341,096	228,600	1,785,137,400	3.79
7	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,936	233,631	1,386,837,889	296,100	1,757,649,600	3.73
8	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,570	258,248	1,438,446,094	304,000	1,693,280,000	3.59
9	日本	投資証券	G L P 投資法人 投資証券	10,291	118,572	1,220,224,863	143,400	1,475,729,400	3.13
10	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,919	318,496	1,248,186,451	355,000	1,391,245,000	2.95
11	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,615	472,273	1,234,994,025	513,000	1,341,495,000	2.84
12	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	18,124	60,024	1,087,875,700	66,700	1,208,870,800	2.56
13	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	12,081	78,460	947,881,783	96,900	1,170,648,900	2.48
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	2,070	472,179	977,411,627	552,000	1,142,640,000	2.42
15	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,278	754,448	964,184,774	854,000	1,091,412,000	2.31
16	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,310	87,627	1,166,318,963	80,600	1,072,786,000	2.27
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	1,373	591,249	811,785,439	673,000	924,029,000	1.96
18	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,754	152,359	724,315,541	171,600	815,786,400	1.73
19	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	954	763,728	728,597,275	839,000	800,406,000	1.70
20	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,084	130,453	663,224,475	155,200	789,036,800	1.67
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	2,700	247,737	668,891,061	267,400	721,980,000	1.53
22	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,514	184,626	648,775,974	198,600	697,880,400	1.48

23	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,468	467,145	685,769,476	460,500	676,014,000	1.43
24	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,459	136,437	608,373,563	148,900	663,945,100	1.41
25	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,700	160,909	595,365,520	176,400	652,680,000	1.38
26	日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,342	421,984	566,303,588	451,500	605,913,000	1.28
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	1,720	300,814	517,401,232	347,000	596,840,000	1.26
28	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,842	128,702	494,474,082	154,800	594,741,600	1.26
29	日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	3,732	136,852	510,734,574	158,600	591,895,200	1.25
30	日本	投資証券	M C U B S M i d C i t y 投資法人 投資証券	4,901	105,057	514,886,464	118,700	581,748,700	1.23

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.93
合 計	96.93

（参考）海外 R E I T インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

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	29,580	9,128.91	270,033,423	9,257.37	273,833,229	4.01
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	3,970	61,279.34	243,278,992	62,228.83	247,048,457	3.62
3	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	14,440	16,196.77	233,881,474	17,047.04	246,159,304	3.60
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	7,040	27,865.31	196,171,793	26,441.47	186,148,014	2.72
5	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	18,910	9,830.43	185,893,485	9,744.09	184,260,871	2.70
6	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	16,260	9,280.04	150,893,463	9,308.10	151,349,706	2.21
7	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,510	23,171.50	150,846,486	23,124.01	150,537,360	2.20
8	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	17,380	8,052.99	139,960,973	7,948.30	138,141,593	2.02
9	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	9,720	13,670.22	132,874,600	13,905.49	135,161,382	1.98
10	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	14,850	8,094.00	120,195,900	8,323.86	123,609,464	1.81
11	香港	投資証券	LINK REIT	98,500	1,230.14	121,169,184	1,177.85	116,018,816	1.70
12	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,070	35,043.78	107,584,412	35,219.69	108,124,454	1.58
13	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,460	14,162.40	91,489,104	15,531.43	100,333,051	1.47
14	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	6,710	13,988.59	93,863,441	14,042.55	94,225,513	1.38
15	アメリカ	投資証券	HCP INC	22,930	3,814.97	87,477,308	3,833.31	87,897,991	1.28
16	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,290	16,424.34	86,884,784	16,523.63	87,410,009	1.28
17	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	7,970	9,728.98	77,540,034	9,717.11	77,445,421	1.13
18	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	75,000	1,020.32	76,524,000	1,023.96	76,797,300	1.12
19	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	6,000	13,079.90	78,479,424	12,593.18	75,559,109	1.10
20	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,320	13,851.53	73,690,150	14,065.21	74,826,936	1.09
21	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	250,000	290.06	72,515,600	287.14	71,786,800	1.05
22	アメリカ	投資証券	UDR INC	13,700	5,218.26	71,490,201	5,215.77	71,456,098	1.04
23	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	22,200	3,098.00	68,775,746	3,195.51	70,940,349	1.03
24	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	4,230	16,003.45	67,694,622	16,002.37	67,690,057	0.99

25	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	34,100	1,804.42	61,530,804	1,846.51	62,966,032	0.92
26	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	16,890	3,604.52	60,880,478	3,673.59	62,047,050	0.90
27	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,250	14,569.20	61,919,100	14,398.68	61,194,417	0.89
28	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	7,830	7,185.31	56,261,006	7,455.11	58,373,540	0.85
29	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	50,700	1,042.94	52,877,231	1,070.01	54,249,617	0.79
30	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	4,520	11,817.24	53,413,925	11,961.85	54,067,575	0.79

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.38
合 計	98.38

【投資不動産物件】

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

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）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

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

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （%）
株価指数先物 取引	大阪取引所	TOPIX先物(2019年12月限)	買建	622	日本円	9,971,895,292	9,877,360,000	2.23

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資 比率 （%）
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2019 年12月限)	買建	56	米ドル	8,405,137.5	907,082,439	8,298,500	895,574,120	1.81
	カナダ	モントリ オール取引 所	S&P TSX60株価指 数先物(2019年12 月限)	買建	3	カナダド ル	599,112	48,821,637	598,080	48,737,539	0.09
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指 数先物(2019年12月 限)	買建	36	ユーロ	1,262,100	148,953,042	1,270,800	149,979,816	0.30
	オース トラリア	シドニー先 物取引所	SP1200株価指数先 物(2019年12月限)	買建	3	豪ドル	499,825	36,427,246	502,125	36,594,870	0.07
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指数先 物(2019年12月限)	買建	8	英ポンド	582,615	77,307,184	591,080	78,430,404	0.15
	スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取引 所	SMI株価指数先物 (2019年12月限)	買建	4	スイスフ ラン	399,700	43,519,335	400,440	43,599,906	0.08

（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）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）Ｊ－ＲＥＩＴインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	取引所	名称	買建 / 売建	枚数	通貨	帳簿価額 （円）	評価額 （円）	投資 比率 （％）
REIT指数先物 取引	大阪取引所	REIT指数先物(2019年12月限)	買建	477	日本円	1,016,777,016	1,034,136,000	2.19

（参考）海外ＲＥＩＴインデックス為替ヘッジ型マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国／地域	取引所	名称	買建 / 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 （円）	評価額	評価額 （円）	投資 比率 （％）
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ ボード オブ トレード	ダウ・ジョーンズ 米国不動産指数先 物(2019年12月限)	買建	56	米ドル	2,038,870	220,034,848	2,054,640	221,736,743	3.25

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

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

2019年9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	(2014年 9月 8日)	643	643	1.1364	1.1364
第2計算期間	(2015年 9月 7日)	1,879	1,879	1.1491	1.1491
第3計算期間	(2016年 9月 6日)	2,813	2,813	1.2795	1.2795
第4計算期間	(2017年 9月 6日)	4,900	4,900	1.3162	1.3162
第5計算期間	(2018年 9月 6日)	7,472	7,472	1.3695	1.3695
第6計算期間	(2019年 9月 6日)	10,413	10,413	1.4703	1.4703
	2018年 9月末日	7,667	—	1.3898	—
	10月末日	7,825	—	1.3396	—
	11月末日	8,215	—	1.3600	—
	12月末日	8,054	—	1.3035	—
	2019年 1月末日	8,606	—	1.3694	—

2月末日	8,643	—	1.3885	—
3月末日	8,820	—	1.4108	—
4月末日	8,888	—	1.4160	—
5月末日	8,998	—	1.3983	—
6月末日	9,417	—	1.4300	—
7月末日	9,829	—	1.4555	—
8月末日	10,167	—	1.4551	—
9月末日	10,825	—	1.4882	—

【分配の推移】

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

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2013年 9月12日～2014年 9月 8日	0.0000円
第2計算期間	2014年 9月 9日～2015年 9月 7日	0.0000円
第3計算期間	2015年 9月 8日～2016年 9月 6日	0.0000円
第4計算期間	2016年 9月 7日～2017年 9月 6日	0.0000円
第5計算期間	2017年 9月 7日～2018年 9月 6日	0.0000円
第6計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	0.0000円

【収益率の推移】

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

	計算期間	収益率
第1計算期間	2013年 9月12日～2014年 9月 8日	13.6%
第2計算期間	2014年 9月 9日～2015年 9月 7日	1.1%
第3計算期間	2015年 9月 8日～2016年 9月 6日	11.3%
第4計算期間	2016年 9月 7日～2017年 9月 6日	2.9%
第5計算期間	2017年 9月 7日～2018年 9月 6日	4.0%
第6計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	7.4%

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

（４）【設定及び解約の実績】

野村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

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
--	------	------	------	--------

第1計算期間	2013年 9月12日～2014年 9月 8日	664,849,801	98,191,649	566,658,152
第2計算期間	2014年 9月 9日～2015年 9月 7日	1,605,724,941	536,415,481	1,635,967,612
第3計算期間	2015年 9月 8日～2016年 9月 6日	1,024,082,214	461,295,091	2,198,754,735
第4計算期間	2016年 9月 7日～2017年 9月 6日	2,316,145,480	791,558,944	3,723,341,271
第5計算期間	2017年 9月 7日～2018年 9月 6日	2,702,679,152	969,694,777	5,456,325,646
第6計算期間	2018年 9月 7日～2019年 9月 6日	3,211,652,592	1,585,250,907	7,082,727,331

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9月30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9月	0 円
2018年9月	0 円
2017年9月	0 円
2016年9月	0 円
2015年9月	0 円
設定来累計	0 円

主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

銘柄	投資比率（％）
国内株式マザーファンド	17.1
外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	16.6
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	10.8
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	10.8
新興国債券マザーファンド	10.9
J-REITインデックス マザーファンド	17.1
海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド	16.7

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.6
2	ソニー	電気機器	0.3
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.3
4	日本電信電話	情報・通信業	0.3
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.2

・「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率（％）
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	0.2

・「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	0.1
2	国庫債券 利付（10年）第334回	国債証券	0.1
3	国庫債券 利付（5年）第130回	国債証券	0.1
4	国庫債券 利付（5年）第126回	国債証券	0.1
5	国庫債券 利付（5年）第129回	国債証券	0.1

・「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
2	UK TREASURY	国債証券	0.1
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.1
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.1
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1

・「新興国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）
1	RUSSIAN FEDERATION	国債証券	0.3
2	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.2
3	UNITED MEXICAN STATES	国債証券	0.1
4	TURKEY GLOBAL	国債証券	0.1
5	UNITED MEXICAN STATES	国債証券	0.1

・「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	1.2
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	1.1
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	0.9
4	オリックス不動産投資法人 投資証券	投資証券	0.7
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	投資証券	0.7

・「海外REITインデックス為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率（％）
1	PROLOGIS INC	投資証券	0.7
2	EQUINIX INC	投資証券	0.6
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.6
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.5
5	WELLTOWER INC	投資証券	0.5

■ 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。
- ・2010年から2012年は対象指数（合成指数）の年間収益率。（出所：MSCI他）
- ・2013年は設定日（2013年9月12日）から年末までのファンドの収益率。
- ・2019年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

●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。●対象指数（合成指数）の情報はあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。●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。
- ・取得申込の受付については、午後3時までに、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日の申込み分とします。
- ・販売会社の営業日であっても、下記の条件に該当する日（「申込不可日」といいます。）には、原則とし

て取得の申込みができません。

○申込日当日あるいは申込日の翌営業日が、「ニューヨーク証券取引所」または「ニューヨークの銀行」の休業日と同日の場合

申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。
- ・ 販売の単位は、1万口以上1万口単位(当初元本1口＝1円)または1万円以上1円単位とします。

■ 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。

- ・ 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号ロに規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で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1万口単位、1口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。
- ・ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
- ・ 一部解約の実行の請求の受付けについては、午後3時までに、解約請求のお申込みが行なわれかつ、その

解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。

- ・販売会社の営業日であっても、申込不可日には原則として受益権の一部解約の実行の請求の受付を行いません。（申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。）
- ・換金価額は、解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額から、信託財産留保額を差し引いた価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口解約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。

ただし、金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）により、有価証券の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、一部解約金の支払いを延期する場合があります。

- ・金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受けた一部解約の実行の請求の受付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が中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受けたものとして信託約款の規定に準じて計算された価額とします。

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

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

< 基準価額の計算方法 >

基準価額とは、計算日において、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法

により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除して得た額をいいます。なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 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
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いません。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

（２）【保管】

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

（３）【信託期間】

無期限とします(2013年9月12日設定)。

（４）【計算期間】

原則として、毎年9月7日から翌年9月6日までとします。

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

ただし、最終計算期間の終了日は、信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、信託契約締結日から3年を経過した日以降において、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が30億口を下回った場合、この信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(b) 信託期間の終了

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

()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。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

()上記()の書面決議は議決権を行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うことが困難な場合には適用しません。

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

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

(c) 運用報告書

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

(d) 信託約款の変更

()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)にあってはその変更の内容が重大なものに該当す

る場合に限り、併合事項にあ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。

()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」に従い、新受託者を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、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請求を行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計算期間の末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下さい。

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6期計算期間(2018年9月7日から2019年9月6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) 【貸借対照表】

(単位：円)

	第5期 (2018年 9月 6日現在)	第6期 (2019年 9月 6日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	41,247,548	80,581,239
親投資信託受益証券	7,460,326,261	10,410,395,416
派生商品評価勘定	82,403	-
流動資産合計	7,501,656,212	10,490,976,655
資産合計	7,501,656,212	10,490,976,655
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	2,544,591	10,018,664
未払解約金	7,940,425	41,869,271
未払受託者報酬	1,491,037	2,019,284
未払委託者報酬	17,146,846	23,221,721
未払利息	63	134
その他未払費用	111,763	151,382
流動負債合計	29,234,725	77,280,456
負債合計	29,234,725	77,280,456
純資産の部		
元本等		
元本	5,456,325,646	7,082,727,331
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,016,095,841	3,330,968,868
（ 分配準備積立金 ）	369,436,393	917,619,501
元本等合計	7,472,421,487	10,413,696,199
純資産合計	7,472,421,487	10,413,696,199
負債純資産合計	7,501,656,212	10,490,976,655

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第5期 自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6日	第6期 自 2018年 9月 7日 至 2019年 9月 6日
営業収益		
有価証券売買等損益	283,335,531	710,512,535
為替差損益	30,012,681	10,564,276
営業収益合計	253,322,850	721,076,811
営業費用		
支払利息	14,849	24,013
受託者報酬	2,711,545	3,753,899
委託者報酬	31,182,675	43,169,778
その他費用	214,042	292,219
営業費用合計	34,123,111	47,239,909
営業利益又は営業損失（ ）	219,199,739	673,836,902
経常利益又は経常損失（ ）	219,199,739	673,836,902
当期純利益又は当期純損失（ ）	219,199,739	673,836,902
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（ ）	28,377,012	45,471,231
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	1,177,254,691	2,016,095,841
剰余金増加額又は欠損金減少額	962,042,557	1,270,281,281
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	962,042,557	1,270,281,281
剰余金減少額又は欠損金増加額	314,024,134	583,773,925
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	314,024,134	583,773,925
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,016,095,841	3,330,968,868

（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	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。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3.金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4.その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年 9月 7日から2019年 9月 6日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第5期 2018年 9月 6日現在	第6期 2019年 9月 6日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 5,456,325,646口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 7,082,727,331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 1.3695円 (10,000口当たり純資産額) (13,695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 1.4703円 (10,000口当たり純資産額) (14,703円)

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第5期 自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6日	第6期 自 2018年 9月 7日 至 2019年 9月 6日																																										
1.分配金の計算過程	1.分配金の計算過程																																										
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>155,738,857円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>35,083,870円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>1,646,659,448円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>178,613,666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>2,016,095,841円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>5,456,325,646口</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	155,738,857円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	35,083,870円	収益調整金額	C	1,646,659,448円	分配準備積立金額	D	178,613,666円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,016,095,841円	当ファンドの期末残存口数	F	5,456,325,646口	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>243,720,667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>384,645,004円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>2,413,349,367円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>289,253,830円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>3,330,968,868円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>7,082,727,331口</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	243,720,667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	384,645,004円	収益調整金額	C	2,413,349,367円	分配準備積立金額	D	289,253,830円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,330,968,868円	当ファンドの期末残存口数	F	7,082,727,331口
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	155,738,857円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	35,083,870円																																									
収益調整金額	C	1,646,659,448円																																									
分配準備積立金額	D	178,613,666円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,016,095,841円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	5,456,325,646口																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	243,720,667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	384,645,004円																																									
収益調整金額	C	2,413,349,367円																																									
分配準備積立金額	D	289,253,830円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,330,968,868円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	7,082,727,331口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	3,694円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	4,702円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

（金融商品に関する注記）

(1)金融商品の状況に関する事項

第5期 自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6日	第6期 自 2018年 9月 7日 至 2019年 9月 6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、(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。 当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 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。	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5期 2018年 9月 6日現在	第6期 2019年 9月 6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 親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。	1．貸借対照表計上額、時価及び差額 同左 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5期 自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6日	第6期 自 2018年 9月 7日 至 2019年 9月 6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5期 自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6日	第6期 自 2018年 9月 7日 至 2019年 9月 6日
期首元本額 3,723,341,271円	期首元本額 5,456,325,646円
期中追加設定元本額 2,702,679,152円	期中追加設定元本額 3,211,652,592円
期中一部解約元本額 969,694,777円	期中一部解約元本額 1,585,250,907円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6日	第6期 自 2018年 9月 7日 至 2019年 9月 6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	265,024,413	658,936,171

合計	265,024,413	658,936,171
----	-------------	-------------

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第5期(2018年 9月 6日現在)				第6期(2019年 9月 6日現在)			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年 超				うち1年 超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	820,103,567	-	822,565,755	2,462,188	1,146,034,226	-	1,156,052,890	10,018,664
米ドル	820,103,567	-	822,565,755	2,462,188	1,146,034,226	-	1,156,052,890	10,018,664
合計	820,103,567	-	822,565,755	2,462,188	1,146,034,226	-	1,156,052,890	10,018,664

（注）時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

（４）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年9月6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9月6日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
	日本円	国内株式マザーファンド	1,136,248,997	1,744,823,959	

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	836,082,856	1,138,995,674	
		J - R E I T インデックス マザーファンド	673,147,874	1,746,549,473	
		外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	888,541,821	1,747,584,053	
		新興国債券マザーファンド	608,652,963	1,162,101,102	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	937,425,045	1,135,971,669	
		海外R E I T インデックス為替ヘッジ型マザーファンド	1,101,816,585	1,734,369,486	
	小計	銘柄数：7 組入時価比率：100.0%	6,181,916,141	10,410,395,416 100.0%	
合計				10,410,395,416	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

（参考）

当ファンドは「国内株式マザーファンド」、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」、「国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド」、「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「J - R E I T インデックス マザーファンド」および「海外R E I T インデックス為替ヘッジ型マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2019年 9月 6日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	69,800,911,155
株式	390,459,905,575
派生商品評価勘定	127,109,453
未収入金	34,676,729
未収配当金	200,729,231
未収利息	5,314,163
その他未収収益	37,941,093
差入委託証拠金	196,181,000
流動資産合計	460,862,768,399
資産合計	460,862,768,399
負債の部	
流動負債	
未払金	1,356,723,912
未払解約金	501,664,973
未払利息	116,137
有価証券貸借取引受入金	59,665,769,690

(2019年 9月 6日現在)

流動負債合計	61,524,274,712
負債合計	61,524,274,712
純資産の部	
元本等	
元本	260,061,369,573
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	139,277,124,114
元本等合計	399,338,493,687
純資産合計	399,338,493,687
負債純資産合計	460,862,768,399

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年 9月 6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	1.5356円
(10,000口当たり純資産額)	(15,356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	
	57,927,519,530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 9月 7日 至 2019年 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2018年 9月 7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	232,261,270,335円
同期中における追加設定元本額	55,921,020,426円
同期中における一部解約元本額	28,120,921,188円

期末元本額	260,061,369,573円
期末元本額の内訳＊	
バランスセレクト３０	177,999,974円
バランスセレクト５０	403,271,217円
バランスセレクト７０	506,606,675円
野村世界６資産分散投信（安定コース）	2,720,034,622円
野村世界６資産分散投信（分配コース）	3,898,539,864円
野村世界６資産分散投信（成長コース）	8,208,624,950円
野村資産設計ファンド２０１５	55,157,011円
野村資産設計ファンド２０２０	60,832,548円
野村資産設計ファンド２０２５	96,467,328円
野村資産設計ファンド２０３０	113,731,547円
野村資産設計ファンド２０３５	87,589,053円
野村資産設計ファンド２０４０	193,968,035円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）	98,963,277,981円
のむラップ・ファンド（保守型）	3,079,560,632円
のむラップ・ファンド（普通型）	8,441,251,640円
のむラップ・ファンド（積極型）	2,203,767,481円
野村資産設計ファンド２０４５	29,755,759円
野村インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ	2,142,261,758円
マイ・ロード	4,103,001,086円
ネクストコア	122,618,607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	1,136,248,997円
野村日本株インデックス（野村ＳＭＡ・ＥＷ向け）	2,005,703,963円
野村世界６資産分散投信（配分変更コース）	706,120,598円
野村資産設計ファンド２０５０	48,743,999円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２６－２０２８年目標型	15,333,586円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０２９－２０３１年目標型	6,419,811円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３２－２０３４年目標型	4,728,090円
野村ターゲットデートファンド２０１６ ２０３５－２０３７年目標型	3,012,190円
のむラップ・ファンド（やや保守型）	323,259,137円
のむラップ・ファンド（やや積極型）	287,191,087円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	6,294,460円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,399,127円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	16,288,169円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,535,319円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	21,587,782円
野村６資産均等バランス	756,191,930円
世界６資産分散ファンド	152,240,594円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）日本株式	410,890,609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）	494,119,825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）	366,170,617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）	760,692,889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）	833,680,710円
ワールド・インデックス・ファンドＶＡ安定型（適格機関投資家専用）	4,748,757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）	10,871,228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）	2,577,065円
野村インデックス・バランス６０ＶＡ（適格機関投資家専用）	3,666,913,844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）	18,503,901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）	150,990,543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）	114,725,506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）	46,700,330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）	112,547,048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）	292,927,455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）	4,927,564,954円
野村世界バランス２５ＶＡ（適格機関投資家専用）	700,318,388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）	564,600,630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）	2,874,185,620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）	304,927,089円
ＴＯＰＩＸインデックスファンド（適格機関投資家専用）	617,639円
バランスセレクト３０（確定拠出年金向け）	7,684,967円
バランスセレクト５０（確定拠出年金向け）	33,700,281円
バランスセレクト７０（確定拠出年金向け）	45,044,781円
国内債券・株式バランスファンド（確定拠出年金向け）	125,815,010円
マイバランス３０（確定拠出年金向け）	5,447,204,613円
マイバランス５０（確定拠出年金向け）	16,199,068,914円
マイバランス７０（確定拠出年金向け）	20,924,229,999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）	32,733,898,749円
マイバランスＤＣ３０	3,501,508,701円
マイバランスＤＣ５０	4,989,056,872円
マイバランスＤＣ７０	4,650,360,273円
野村ＤＣ国内株式インデックスファンド・ＴＯＰＩＸ	10,340,154,610円
野村ＤＣ運用戦略ファンド	1,212,871,710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）	736,770,412円
マイターゲット２０３０（確定拠出年金向け）	471,117,871円
マイターゲット２０４０（確定拠出年金向け）	370,380,319円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）安定コース	4,185,350円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）インカムコース	2,496,738円
野村世界６資産分散投信（ＤＣ）成長コース	29,376,838円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０３０	4,018,007円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０４０	2,916,682円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０５０	4,038,955円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	179,867,030円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	115,995,904円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	45,016,167円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	63,717,469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9月6日現在)

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	2,799.00	21,832,200	
		日本水産	241,000	604.00	145,564,000	貸付有価証券 33,500株
		マルハニチロ	34,800	2,701.00	93,994,800	貸付有価証券 4,000株
		カネコ種苗	7,300	1,141.00	8,329,300	貸付有価証券 800株
		サカタのタネ	28,700	3,680.00	105,616,000	貸付有価証券 3,900株
		ホクト	20,200	1,908.00	38,541,600	
		ホクリヨウ	3,300	600.00	1,980,000	
		住石ホールディングス	51,900	132.00	6,850,800	貸付有価証券 1,300株
		日鉄鉱業	5,500	3,880.00	21,340,000	
		三井松島ホールディングス	10,100	1,197.00	12,089,700	貸付有価証券 1,200株
		国際石油開発帝石	967,000	906.60	876,682,200	
		石油資源開発	34,600	2,606.00	90,167,600	貸付有価証券 300株
		K & Oエナジーグループ	11,700	1,349.00	15,783,300	貸付有価証券 1,400株
		ヒノキヤグループ	6,000	1,867.00	11,202,000	貸付有価証券 700株
		ショーボンドホールディングス	34,400	3,660.00	125,904,000	貸付有価証券 17,500株
		ミライト・ホールディングス	67,800	1,560.00	105,768,000	貸付有価証券 43,200株
		タマホーム	11,600	1,474.00	17,098,400	貸付有価証券 7,700株（2,300株）
		サンヨーホームズ	3,500	631.00	2,208,500	貸付有価証券 500株
		日本アクア	9,600	627.00	6,019,200	貸付有価証券 5,000株（200株）
		ファーストコーポレーション	7,400	575.00	4,255,000	貸付有価証券 4,800株（100株）
		ベステラ	4,600	1,290.00	5,934,000	貸付有価証券 1,900株

T A T E R U	48,900	178.00	8,704,200	貸付有価証券 32,600株（10,900株）
スペースバリューホールディングス	29,400	460.00	13,524,000	貸付有価証券 400株
ダイセキ環境ソリューション	4,600	661.00	3,040,600	貸付有価証券 500株
第一カッター興業	3,000	1,563.00	4,689,000	貸付有価証券 400株
安藤・間	154,600	705.00	108,993,000	貸付有価証券 19,100株
東急建設	70,600	745.00	52,597,000	貸付有価証券 100株
コムシスホールディングス	85,500	2,934.00	250,857,000	貸付有価証券 10,800株
ミサワホーム	19,000	1,069.00	20,311,000	
ビーアールホールディングス	26,300	350.00	9,205,000	貸付有価証券 4,100株
高松コンストラクショングループ	15,000	2,294.00	34,410,000	
東建コーポレーション	7,400	6,310.00	46,694,000	貸付有価証券 1,600株
ソネック	2,500	873.00	2,182,500	貸付有価証券 100株
ヤマウラ	9,300	846.00	7,867,800	貸付有価証券 900株
大成建設	198,000	3,770.00	746,460,000	
大林組	596,400	996.00	594,014,400	貸付有価証券 32,900株
清水建設	608,300	905.00	550,511,500	貸付有価証券 75,700株
飛島建設	17,000	1,146.00	19,482,000	貸付有価証券 100株
長谷工コーポレーション	248,600	1,155.00	287,133,000	貸付有価証券 300株
松井建設	21,900	692.00	15,154,800	
銭高組	2,400	3,820.00	9,168,000	
鹿島建設	466,100	1,314.00	612,455,400	貸付有価証券 57,000株
不動テトラ	13,600	1,126.00	15,313,600	
大末建設	7,000	922.00	6,454,000	
鉄建建設	12,100	2,593.00	31,375,300	

西松建設	42,900	1,876.00	80,480,400	
三井住友建設	143,400	524.00	75,141,600	貸付有価証券 500株
大豊建設	13,500	2,695.00	36,382,500	
前田建設工業	141,800	850.00	120,530,000	貸付有価証券 17,300株
佐田建設	12,800	386.00	4,940,800	
ナカノフドー建設	15,200	431.00	6,551,200	貸付有価証券 1,800株
奥村組	32,700	2,797.00	91,461,900	貸付有価証券 200株
東鉄工業	23,900	3,065.00	73,253,500	貸付有価証券 2,900株
イチケン	3,600	1,610.00	5,796,000	
富士ピー・エス	8,200	483.00	3,960,600	貸付有価証券 900株
浅沼組	6,700	3,455.00	23,148,500	
戸田建設	231,100	574.00	132,651,400	貸付有価証券 30,900株
熊谷組	28,400	2,970.00	84,348,000	貸付有価証券 3,400株
青木あすなろ建設	9,800	1,209.00	11,848,200	貸付有価証券 1,000株（400株）
北野建設	4,100	2,333.00	9,565,300	貸付有価証券 100株
植木組	2,500	2,329.00	5,822,500	貸付有価証券 1,400株
矢作建設工業	27,000	662.00	17,874,000	貸付有価証券 300株（100株）
ピーエス三菱	20,900	668.00	13,961,200	貸付有価証券 2,500株
日本ハウスホールディングス	38,000	464.00	17,632,000	貸付有価証券 7,300株
大東建託	70,800	13,655.00	966,774,000	貸付有価証券 10,100株
新日本建設	23,700	734.00	17,395,800	貸付有価証券 2,800株
N I P P O	52,600	1,849.00	97,257,400	貸付有価証券 6,500株
東亜道路工業	3,700	3,215.00	11,895,500	
前田道路	59,000	2,386.00	140,774,000	貸付有価証券

			3,800株
日本道路	5,400	6,040.00	32,616,000 貸付有価証券 600株
東亜建設工業	17,400	1,266.00	22,028,400
日本国土開発	32,500	530.00	17,225,000 貸付有価証券 20,900株
若築建設	10,000	1,485.00	14,850,000
東洋建設	72,800	422.00	30,721,600 貸付有価証券 200株
五洋建設	236,400	557.00	131,674,800 貸付有価証券 30,400株
世紀東急工業	29,000	672.00	19,488,000 貸付有価証券 400株
福田組	6,400	3,850.00	24,640,000 貸付有価証券 700株
住友林業	140,900	1,355.00	190,919,500 貸付有価証券 100株
日本基礎技術	20,400	309.00	6,303,600 貸付有価証券 2,500株
巴コーポレーション	24,700	392.00	9,682,400 貸付有価証券 200株（200株）
大和ハウス工業	550,700	3,369.00	1,855,308,300 貸付有価証券 67,300株
ライト工業	38,200	1,361.00	51,990,200 貸付有価証券 4,600株
積水ハウス	609,000	1,983.00	1,207,647,000 貸付有価証券 407,200株（57,600株）
日特建設	16,900	624.00	10,545,600
北陸電気工事	9,600	860.00	8,256,000 貸付有価証券 1,500株
ユアテック	31,800	652.00	20,733,600 貸付有価証券 3,900株
四電工	3,000	2,697.00	8,091,000
中電工	25,600	2,250.00	57,600,000 貸付有価証券 3,100株
関電工	90,500	911.00	82,445,500 貸付有価証券 900株
きんでん	132,200	1,539.00	203,455,800 貸付有価証券 16,600株
東京エネシス	20,500	860.00	17,630,000 貸付有価証券 2,300株

トーエネック	5,600	3,140.00	17,584,000	
住友電設	13,700	1,979.00	27,112,300	
日本電設工業	33,900	2,096.00	71,054,400	貸付有価証券 4,300株
協和エクシオ	77,900	2,555.00	199,034,500	
新日本空調	16,100	1,714.00	27,595,400	貸付有価証券 2,000株
九電工	39,200	3,275.00	128,380,000	
三機工業	44,900	1,244.00	55,855,600	貸付有価証券 5,600株
日揮	171,300	1,294.00	221,662,200	貸付有価証券 55,800株
中外炉工業	5,600	1,425.00	7,980,000	
ヤマト	17,800	674.00	11,997,200	
太平電業	13,500	2,351.00	31,738,500	貸付有価証券 1,600株
高砂熱学工業	48,300	1,724.00	83,269,200	貸付有価証券 6,000株
三晃金属工業	2,400	2,291.00	5,498,400	
朝日工業社	4,100	2,859.00	11,721,900	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	27,100	3,080.00	83,468,000	貸付有価証券 3,300株
ダイダン	13,300	2,006.00	26,679,800	貸付有価証券 1,600株
日比谷総合設備	17,900	1,818.00	32,542,200	
東芝プラントシステム	43,100	1,724.00	74,304,400	貸付有価証券 5,200株
ＯＳＪＢホールディングス	87,800	228.00	20,018,400	貸付有価証券 1,300株
レイズネクスト	35,700	1,152.00	41,126,400	貸付有価証券 4,400株
日本製粉	56,500	1,641.00	92,716,500	貸付有価証券 7,100株
日清製粉グループ本社	201,300	1,959.00	394,346,700	貸付有価証券 24,600株
日東富士製粉	1,300	6,390.00	8,307,000	
昭和産業	16,400	3,060.00	50,184,000	貸付有価証券 2,600株（2,600株）

鳥越製粉	15,800	810.00	12,798,000	貸付有価証券 1,900株
中部飼料	21,800	1,104.00	24,067,200	
フィード・ワン	119,600	155.00	18,538,000	貸付有価証券 15,300株
東洋精糖	2,700	1,021.00	2,756,700	
日本甜菜製糖	10,100	1,794.00	18,119,400	
三井製糖	14,100	2,193.00	30,921,300	貸付有価証券 1,700株
塩水港精糖	19,300	204.00	3,937,200	
日新製糖	8,400	1,913.00	16,069,200	
森永製菓	44,800	5,100.00	228,480,000	貸付有価証券 200株
中村屋	4,600	4,165.00	19,159,000	貸付有価証券 500株
江崎グリコ	53,600	4,660.00	249,776,000	貸付有価証券 3,000株
名糖産業	8,600	1,263.00	10,861,800	貸付有価証券 3,400株
井村屋グループ	7,600	2,043.00	15,526,800	貸付有価証券 1,100株
不二家	9,900	1,961.00	19,413,900	貸付有価証券 1,200株
山崎製パン	133,500	1,811.00	241,768,500	貸付有価証券 56,700株（500株）
第一屋製パン	3,100	923.00	2,861,300	貸付有価証券 300株
モロゾフ	3,000	4,645.00	13,935,000	貸付有価証券 300株
亀田製菓	11,100	4,670.00	51,837,000	貸付有価証券 1,300株
寿スピリッツ	18,900	6,570.00	124,173,000	貸付有価証券 2,600株
カルビー	81,200	3,170.00	257,404,000	貸付有価証券 800株
森永乳業	35,700	4,380.00	156,366,000	貸付有価証券 900株
六甲バター	11,800	1,616.00	19,068,800	貸付有価証券 1,500株
ヤクルト本社	132,000	6,010.00	793,320,000	
明治ホールディングス	126,200	7,390.00	932,618,000	貸付有価証券

				1,900株
雪印メグミルク	42,900	2,390.00	102,531,000	
プリマハム	25,100	2,123.00	53,287,300	貸付有価証券 3,200株
日本ハム	73,800	4,055.00	299,259,000	貸付有価証券 3,100株
林兼産業	5,900	562.00	3,315,800	貸付有価証券 300株
丸大食品	19,000	2,175.00	41,325,000	貸付有価証券 12,600株
S F o o d s	16,000	2,979.00	47,664,000	貸付有価証券 3,400株（100株）
伊藤ハム米久ホールディングス	114,700	634.00	72,719,800	貸付有価証券 14,700株
サッポロホールディングス	60,800	2,517.00	153,033,600	貸付有価証券 40,500株
アサヒグループホールディングス	373,100	5,080.00	1,895,348,000	貸付有価証券 148,700株（2,600株）
キリンホールディングス	755,500	2,092.50	1,580,883,750	貸付有価証券 505,000株（107,800株）
宝ホールディングス	133,400	1,041.00	138,869,400	貸付有価証券 16,600株
オエノンホールディングス	47,000	374.00	17,578,000	貸付有価証券 6,200株
養命酒製造	5,500	1,895.00	10,422,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	125,000	2,311.00	288,875,000	貸付有価証券 44,400株（2,100株）
サントリー食品インターナショナル	119,200	4,700.00	560,240,000	貸付有価証券 45,500株
ダイドーグループホールディングス	10,000	4,300.00	43,000,000	貸付有価証券 6,400株
伊藤園	54,100	4,915.00	265,901,500	貸付有価証券 13,400株（1,900株）
キーコーヒー	17,500	2,139.00	37,432,500	貸付有価証券 2,100株
ユニカフェ	4,600	979.00	4,503,400	貸付有価証券 600株
ジャパンフーズ	2,500	1,186.00	2,965,000	貸付有価証券 900株
日清オイリオグループ	22,900	3,310.00	75,799,000	
不二製油グループ本社	43,400	2,905.00	126,077,000	貸付有価証券

				7,600株（1,100株）
かどや製油	1,900	3,525.00	6,697,500	貸付有価証券 200株
J - オイルミルズ	9,200	3,950.00	36,340,000	貸付有価証券 1,300株
キッコーマン	117,500	4,775.00	561,062,500	貸付有価証券 14,300株
味の素	393,400	1,891.00	743,919,400	貸付有価証券 5,600株
キューピー	99,200	2,478.00	245,817,600	貸付有価証券 40,700株
ハウス食品グループ本社	66,600	3,985.00	265,401,000	
カゴメ	71,400	2,715.00	193,851,000	貸付有価証券 15,800株（2,500株）
焼津水産化学工業	8,600	1,013.00	8,711,800	
アリアケジャパン	16,300	8,230.00	134,149,000	貸付有価証券 1,900株
ピエトロ	2,300	1,599.00	3,677,700	
エバラ食品工業	4,300	2,031.00	8,733,300	
やまみ	900	1,951.00	1,755,900	
ニチレイ	92,500	2,373.00	219,502,500	貸付有価証券 300株
東洋水産	91,700	4,355.00	399,353,500	貸付有価証券 11,200株
イートアンド	6,200	1,715.00	10,633,000	貸付有価証券 1,200株
大冷	2,000	2,029.00	4,058,000	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	4,900	836.00	4,096,400	貸付有価証券 3,300株（100株）
日清食品ホールディングス	75,700	7,480.00	566,236,000	貸付有価証券 9,200株
永谷園ホールディングス	9,500	2,019.00	19,180,500	
一正蒲鉾	6,900	1,078.00	7,438,200	貸付有価証券 800株
フジッコ	19,300	1,891.00	36,496,300	
ロック・フィールド	19,200	1,340.00	25,728,000	貸付有価証券 12,700株
日本たばこ産業	1,028,600	2,203.50	2,266,520,100	貸付有価証券 685,300株（2,300株）
ケンコーマヨネーズ	10,000	2,123.00	21,230,000	貸付有価証券 1,900株

わらべや日洋ホールディングス	11,700	1,700.00	19,890,000	貸付有価証券 2,000株
なとり	9,900	1,563.00	15,473,700	貸付有価証券 1,200株
イフジ産業	3,100	713.00	2,210,300	
ピックルスコーポレーション	4,200	2,337.00	9,815,400	貸付有価証券 200株
北の達人コーポレーション	70,000	746.00	52,220,000	貸付有価証券 34,400株（5,200株）
ユーグレナ	76,000	882.00	67,032,000	貸付有価証券 30,200株
ミヨシ油脂	6,800	1,078.00	7,330,400	貸付有価証券 800株
理研ビタミン	8,400	3,340.00	28,056,000	貸付有価証券 500株
片倉工業	25,200	1,257.00	31,676,400	貸付有価証券 14,500株
グンゼ	11,700	4,385.00	51,304,500	
東洋紡	73,600	1,388.00	102,156,800	貸付有価証券 28,500株
ユニチカ	50,900	317.00	16,135,300	貸付有価証券 9,600株
富士紡ホールディングス	9,000	2,541.00	22,869,000	貸付有価証券 1,100株
倉敷紡績	16,600	2,031.00	33,714,600	
シキボウ	9,100	897.00	8,162,700	
日本毛織	57,200	929.00	53,138,800	貸付有価証券 8,600株
ダイトウボウ	28,100	81.00	2,276,100	貸付有価証券 4,500株（100株）
トーア紡コーポレーション	6,900	485.00	3,346,500	貸付有価証券 800株
ダイドーリミテッド	20,800	269.00	5,595,200	貸付有価証券 600株（100株）
帝国繊維	19,500	1,684.00	32,838,000	貸付有価証券 2,300株
帝人	141,800	1,955.00	277,219,000	貸付有価証券 17,300株
東レ	1,348,500	760.40	1,025,399,400	貸付有価証券 3,000株
サカイオーベックス	4,300	1,617.00	6,953,100	

住江織物	5,100	2,937.00	14,978,700	貸付有価証券 600株
日本フェルト	9,800	456.00	4,468,800	
イチカワ	2,500	1,367.00	3,417,500	貸付有価証券 200株
日東製網	2,000	1,394.00	2,788,000	貸付有価証券 200株
アツギ	14,300	817.00	11,683,100	貸付有価証券 1,700株
ダイニツク	7,000	672.00	4,704,000	貸付有価証券 700株
セーレン	42,700	1,222.00	52,179,400	貸付有価証券 100株
ソトー	6,900	978.00	6,748,200	貸付有価証券 200株
東海染工	2,400	1,130.00	2,712,000	
小松マテーレ	28,500	744.00	21,204,000	貸付有価証券 3,400株
ワコールホールディングス	49,100	2,529.00	124,173,900	貸付有価証券 400株
ホギメディカル	21,600	2,905.00	62,748,000	
レナウン	50,200	108.00	5,421,600	貸付有価証券 27,500株（800株）
クラウディアホールディングス	4,300	490.00	2,107,000	貸付有価証券 500株
T S I ホールディングス	64,100	541.00	34,678,100	貸付有価証券 14,000株
マツオカコーポレーション	5,500	2,035.00	11,192,500	貸付有価証券 1,100株
ワールド	22,700	2,319.00	52,641,300	
三陽商会	9,000	1,310.00	11,790,000	貸付有価証券 1,300株
ナイガイ	6,300	341.00	2,148,300	貸付有価証券 700株
オンワードホールディングス	104,400	510.00	53,244,000	貸付有価証券 15,800株
ルックホールディングス	5,900	1,015.00	5,988,500	貸付有価証券 700株
ゴールドウイン	15,800	15,890.00	251,062,000	貸付有価証券 8,600株（7,000株）
デサント	42,400	1,432.00	60,716,800	貸付有価証券 600株

キング	9,200	531.00	4,885,200	貸付有価証券 100株
ヤマトインターナショナル	10,600	399.00	4,229,400	貸付有価証券 2,200株
特種東海製紙	11,000	3,660.00	40,260,000	貸付有価証券 1,400株
王子ホールディングス	782,600	503.00	393,647,800	貸付有価証券 1,600株
日本製紙	83,300	1,791.00	149,190,300	貸付有価証券 5,500株（3,000株）
三菱製紙	28,300	485.00	13,725,500	
北越コーポレーション	115,300	546.00	62,953,800	貸付有価証券 200株
中越パルプ工業	7,400	1,488.00	11,011,200	
巴川製紙所	5,700	811.00	4,622,700	貸付有価証券 300株
大王製紙	84,700	1,349.00	114,260,300	貸付有価証券 37,300株（8,000株）
阿波製紙	4,500	399.00	1,795,500	
レンゴー	179,200	774.00	138,700,800	貸付有価証券 4,100株
トーモク	10,700	1,490.00	15,943,000	貸付有価証券 1,300株
ザ・バック	13,200	3,380.00	44,616,000	貸付有価証券 1,600株
クラレ	273,800	1,255.00	343,619,000	貸付有価証券 182,700株（42,300株）
旭化成	1,236,600	983.90	1,216,690,740	貸付有価証券 154,400株
共和レザー	10,800	722.00	7,797,600	貸付有価証券 1,300株
昭和電工	123,700	2,809.00	347,473,300	貸付有価証券 79,800株
住友化学	1,368,300	482.00	659,520,600	
住友精化	8,500	3,265.00	27,752,500	
日産化学	106,000	4,500.00	477,000,000	貸付有価証券 13,000株
ラサ工業	6,100	1,193.00	7,277,300	貸付有価証券 1,600株（900株）
クレハ	16,100	5,750.00	92,575,000	貸付有価証券 1,900株

多木化学	5,100	4,420.00	22,542,000	貸付有価証券 3,300株
テイカ	14,200	1,873.00	26,596,600	貸付有価証券 1,700株
石原産業	33,400	863.00	28,824,200	貸付有価証券 400株
片倉コープアグリ	5,000	1,044.00	5,220,000	貸付有価証券 100株
日本曹達	27,400	2,492.00	68,280,800	貸付有価証券 600株
東ソー	268,700	1,391.00	373,761,700	貸付有価証券 200株
トクヤマ	50,100	2,279.00	114,177,900	貸付有価証券 6,100株
セントラル硝子	37,900	2,264.00	85,805,600	貸付有価証券 4,900株
東亜合成	109,100	1,049.00	114,445,900	貸付有価証券 13,400株
大阪ソーダ	19,100	2,434.00	46,489,400	
関東電化工業	41,200	745.00	30,694,000	貸付有価証券 6,000株
デンカ	68,300	2,838.00	193,835,400	
信越化学工業	306,300	11,170.00	3,421,371,000	貸付有価証券 1,600株
日本カーバイド工業	5,900	1,191.00	7,026,900	
堺化学工業	11,600	2,352.00	27,283,200	貸付有価証券 1,400株
第一稀元素化学工業	18,800	820.00	15,416,000	
エア・ウォーター	142,300	1,823.00	259,412,900	貸付有価証券 17,400株
大陽日酸	143,200	2,106.00	301,579,200	
日本化学工業	5,900	2,208.00	13,027,200	貸付有価証券 300株
東邦アセチレン	2,600	1,220.00	3,172,000	
日本パーカライジング	95,000	1,155.00	109,725,000	
高圧ガス工業	27,600	772.00	21,307,200	
チタン工業	2,200	2,628.00	5,781,600	貸付有価証券 1,100株
四国化成工業	29,200	1,053.00	30,747,600	
戸田工業	3,700	2,035.00	7,529,500	貸付有価証券 2,000株

ステラ ケミファ	10,200	2,639.00	26,917,800	貸付有価証券 600株
保土谷化学工業	6,000	2,778.00	16,668,000	貸付有価証券 200株
日本触媒	29,200	6,190.00	180,748,000	貸付有価証券 4,500株（400株）
大日精化工業	14,400	2,959.00	42,609,600	貸付有価証券 1,700株
カネカ	45,000	3,195.00	143,775,000	
三菱瓦斯化学	176,700	1,303.00	230,240,100	
三井化学	157,800	2,301.00	363,097,800	
J S R	174,400	1,768.00	308,339,200	貸付有価証券 21,300株
東京応化工業	29,800	3,920.00	116,816,000	貸付有価証券 8,200株
大阪有機化学工業	16,100	960.00	15,456,000	貸付有価証券 1,900株
三菱ケミカルホールディングス	1,162,000	778.80	904,965,600	
K Hネオケム	30,600	2,081.00	63,678,600	貸付有価証券 7,300株
ダイセル	256,100	842.00	215,636,200	
住友ベークライト	30,100	3,925.00	118,142,500	貸付有価証券 3,600株
積水化学工業	373,800	1,586.00	592,846,800	貸付有価証券 46,400株
日本ゼオン	156,800	1,263.00	198,038,400	貸付有価証券 20,900株
アイカ工業	52,100	2,982.00	155,362,200	貸付有価証券 6,300株
宇部興産	87,800	2,079.00	182,536,200	
積水樹脂	28,700	1,981.00	56,854,700	貸付有価証券 3,500株
タキロンシーアイ	37,600	614.00	23,086,400	
旭有機材	12,000	1,246.00	14,952,000	
日立化成	80,400	3,455.00	277,782,000	貸付有価証券 28,100株（300株）
ニチバン	9,100	1,516.00	13,795,600	貸付有価証券 4,900株
リケンテクノス	47,400	460.00	21,804,000	貸付有価証券 5,700株

大倉工業	8,200	1,533.00	12,570,600	貸付有価証券 1,000株
積水化成品工業	25,900	703.00	18,207,700	貸付有価証券 3,200株
群栄化学工業	4,500	2,231.00	10,039,500	
タイガースポリマー	9,100	529.00	4,813,900	貸付有価証券 200株
ミライアル	5,000	1,318.00	6,590,000	貸付有価証券 1,200株
ダイキアクシス	6,200	728.00	4,513,600	貸付有価証券 700株
ダイキョーニシカワ	36,600	734.00	26,864,400	
竹本容器	6,200	851.00	5,276,200	貸付有価証券 800株
森六ホールディングス	9,300	2,437.00	22,664,100	
日本化薬	107,600	1,206.00	129,765,600	貸付有価証券 13,500株
カーリットホールディングス	18,600	547.00	10,174,200	
日本精化	14,000	1,105.00	15,470,000	
扶桑化学工業	17,600	2,318.00	40,796,800	貸付有価証券 2,100株
トリケミカル研究所	3,900	6,190.00	24,141,000	貸付有価証券 2,100株
A D E K A	85,700	1,288.00	110,381,600	
日油	65,500	3,465.00	226,957,500	貸付有価証券 8,100株
新日本理化	30,800	181.00	5,574,800	貸付有価証券 4,000株
ハリマ化成グループ	14,400	1,179.00	16,977,600	
花王	425,000	7,715.00	3,278,875,000	貸付有価証券 281,000株（38,500株）
第一工業製薬	6,500	2,660.00	17,290,000	貸付有価証券 800株
石原ケミカル	4,400	1,603.00	7,053,200	貸付有価証券 800株
日華化学	5,900	771.00	4,548,900	貸付有価証券 2,800株
ニイタカ	2,700	1,440.00	3,888,000	貸付有価証券 300株

三洋化成工業	11,700	4,825.00	56,452,500	
有機合成薬品工業	13,300	222.00	2,952,600	貸付有価証券 100株
大日本塗料	19,600	1,049.00	20,560,400	
日本ペイントホールディングス	143,400	5,040.00	722,736,000	貸付有価証券 38,800株
関西ペイント	195,300	2,268.00	442,940,400	貸付有価証券 34,600株
神東塗料	13,700	161.00	2,205,700	貸付有価証券 300株
中国塗料	57,100	847.00	48,363,700	貸付有価証券 7,600株
日本特殊塗料	13,000	1,024.00	13,312,000	
藤倉化成	23,400	525.00	12,285,000	
太陽ホールディングス	14,300	3,370.00	48,191,000	
D I C	73,400	2,840.00	208,456,000	貸付有価証券 48,800株（17,700株）
サカタインクス	37,900	1,001.00	37,937,900	貸付有価証券 4,800株
東洋インキＳＣホールディングス	36,700	2,268.00	83,235,600	貸付有価証券 4,800株（300株）
T & K T O K A	13,500	908.00	12,258,000	貸付有価証券 1,400株
富士フイルムホールディングス	368,700	4,643.00	1,711,874,100	貸付有価証券 2,800株
資生堂	352,700	8,658.00	3,053,676,600	貸付有価証券 235,600株（34,800株）
ライオン	230,800	1,994.00	460,215,200	貸付有価証券 117,900株（2,100株）
高砂香料工業	12,200	2,620.00	31,964,000	貸付有価証券 1,500株
マンダム	39,900	2,571.00	102,582,900	
ミルボン	23,700	4,995.00	118,381,500	貸付有価証券 2,800株
ファンケル	79,000	2,604.00	205,716,000	
コーセー	30,100	17,810.00	536,081,000	貸付有価証券 4,900株
コタ	9,300	1,162.00	10,806,600	
シーボン	2,100	2,349.00	4,932,900	
ポーラ・オルビスホール	75,800	2,437.00	184,724,600	貸付有価証券

ディングス				10,800株
ノエビアホールディングス	16,900	5,450.00	92,105,000	貸付有価証券 2,000株
アジュバンコスメジャパン	4,000	926.00	3,704,000	貸付有価証券 500株
エステー	12,700	1,539.00	19,545,300	貸付有価証券 1,500株
アグロ カネショウ	5,500	1,393.00	7,661,500	貸付有価証券 800株
コニシ	31,400	1,473.00	46,252,200	貸付有価証券 4,100株
長谷川香料	23,500	2,050.00	48,175,000	貸付有価証券 2,900株
星光 P M C	10,200	751.00	7,660,200	貸付有価証券 1,800株
小林製薬	49,700	7,890.00	392,133,000	貸付有価証券 6,400株（200株）
荒川化学工業	15,900	1,351.00	21,480,900	貸付有価証券 2,000株
メック	12,200	1,442.00	17,592,400	貸付有価証券 1,800株
日本高純度化学	4,900	2,404.00	11,779,600	貸付有価証券 500株
タカラバイオ	46,400	2,339.00	108,529,600	貸付有価証券 100株
J C U	23,000	1,878.00	43,194,000	貸付有価証券 2,800株
新田ゼラチン	11,100	647.00	7,181,700	
O A T アグリオ	3,100	1,319.00	4,088,900	貸付有価証券 400株
デクセリアルズ	45,700	727.00	33,223,900	貸付有価証券 100株
アース製薬	13,400	5,020.00	67,268,000	貸付有価証券 1,900株
北興化学工業	18,200	458.00	8,335,600	貸付有価証券 2,200株
大成ラミック	5,800	2,745.00	15,921,000	
クミアイ化学工業	73,400	917.00	67,307,800	貸付有価証券 13,200株
日本農薬	31,600	435.00	13,746,000	
アキレス	12,900	1,660.00	21,414,000	貸付有価証券 600株

有沢製作所	28,000	983.00	27,524,000	貸付有価証券 4,300株
日東電工	122,500	5,225.00	640,062,500	
レック	18,900	978.00	18,484,200	貸付有価証券 2,700株
三光合成	20,300	343.00	6,962,900	
きもと	30,200	175.00	5,285,000	貸付有価証券 700株
藤森工業	15,900	2,943.00	46,793,700	
前澤化成工業	12,100	1,118.00	13,527,800	貸付有価証券 7,700株
未来工業	9,500	1,866.00	17,727,000	貸付有価証券 1,300株
ウェーブロックホールディングス	4,900	723.00	3,542,700	貸付有価証券 800株
J S P	10,400	1,736.00	18,054,400	貸付有価証券 200株
エフピコ	19,500	6,730.00	131,235,000	
天馬	11,800	1,942.00	22,915,600	
信越ポリマー	31,900	721.00	22,999,900	
東リ	44,200	243.00	10,740,600	貸付有価証券 1,300株
ニフコ	71,100	2,457.00	174,692,700	貸付有価証券 1,400株
バルカー	14,400	2,224.00	32,025,600	
ユニ・チャーム	342,100	3,284.00	1,123,456,400	貸付有価証券 97,400株（1,700株）
ショーエイコーポレーション	1,400	738.00	1,033,200	貸付有価証券 100株
協和キリン	178,500	1,986.00	354,501,000	貸付有価証券 119,100株（31,200株）
武田薬品工業	1,549,500	3,690.00	5,717,655,000	貸付有価証券 1,200株
アステラス製薬	1,561,200	1,510.00	2,357,412,000	貸付有価証券 200,400株
大日本住友製薬	131,600	1,800.00	236,880,000	貸付有価証券 16,100株
塩野義製薬	226,900	5,752.00	1,305,128,800	貸付有価証券 27,700株
田辺三菱製薬	185,600	1,171.00	217,337,600	

わかもと製薬	21,100	244.00	5,148,400	貸付有価証券 2,900株（100株）
あすか製薬	21,900	1,029.00	22,535,100	
日本新薬	46,500	8,720.00	405,480,000	
ピオフェルミン製薬	3,000	2,104.00	6,312,000	
中外製薬	185,000	7,780.00	1,439,300,000	貸付有価証券 123,600株（19,300株）
科研製薬	30,400	5,030.00	152,912,000	貸付有価証券 3,900株
エーザイ	212,400	5,288.00	1,123,171,200	貸付有価証券 25,900株
ロート製薬	91,100	2,655.00	241,870,500	貸付有価証券 800株
小野薬品工業	419,200	1,945.50	815,553,600	貸付有価証券 51,800株
久光製薬	52,400	4,385.00	229,774,000	貸付有価証券 7,800株
持田製薬	26,900	4,020.00	108,138,000	
参天製薬	330,500	1,793.00	592,586,500	貸付有価証券 41,300株
扶桑薬品工業	6,200	1,902.00	11,792,400	貸付有価証券 700株
日本ケミファ	2,300	2,786.00	6,407,800	貸付有価証券 1,300株
ツムラ	55,000	2,933.00	161,315,000	貸付有価証券 7,200株
日医工	46,700	1,181.00	55,152,700	貸付有価証券 5,600株
キッセイ薬品工業	31,400	2,457.00	77,149,800	
生化学工業	34,400	1,081.00	37,186,400	貸付有価証券 400株
栄研化学	31,200	1,633.00	50,949,600	
日水製薬	7,500	1,181.00	8,857,500	
鳥居薬品	11,100	2,816.00	31,257,600	貸付有価証券 1,300株
J C R ファーマ	12,500	7,850.00	98,125,000	
東和薬品	25,500	2,368.00	60,384,000	貸付有価証券 1,200株
富士製薬工業	12,100	1,280.00	15,488,000	貸付有価証券 1,100株

沢井製薬	36,400	5,550.00	202,020,000	貸付有価証券 4,400株
ゼリア新薬工業	35,100	1,850.00	64,935,000	貸付有価証券 300株
第一三共	507,900	7,048.00	3,579,679,200	貸付有価証券 62,200株
キョーリン製薬ホールディングス	39,200	1,744.00	68,364,800	
大幸薬品	7,900	2,288.00	18,075,200	
ダイト	10,300	3,005.00	30,951,500	貸付有価証券 1,200株
大塚ホールディングス	338,100	4,429.00	1,497,444,900	貸付有価証券 218,700株（44,700株）
大正製薬ホールディングス	37,500	7,360.00	276,000,000	
ペプチドリーム	89,800	5,470.00	491,206,000	貸付有価証券 18,400株（4,600株）
日本コークス工業	149,900	83.00	12,441,700	貸付有価証券 20,600株
ニチレキ	22,700	1,035.00	23,494,500	
ユシロ化学工業	9,200	1,285.00	11,822,000	
ビーピー・カストロール	6,300	1,345.00	8,473,500	貸付有価証券 700株
富士石油	43,100	233.00	10,042,300	貸付有価証券 5,400株
MORESCO	6,400	1,308.00	8,371,200	貸付有価証券 700株
出光興産	204,900	2,918.00	597,898,200	
JXTGホールディングス	2,936,200	454.30	1,333,915,660	
コスモエネルギーホールディングス	51,400	1,991.00	102,337,400	貸付有価証券 34,300株
横浜ゴム	102,800	2,080.00	213,824,000	貸付有価証券 68,600株（20,800株）
TOYO TIRE	101,900	1,345.00	137,055,500	貸付有価証券 37,300株
ブリヂストン	545,500	4,096.00	2,234,368,000	貸付有価証券 364,200株
住友ゴム工業	159,400	1,231.00	196,221,400	貸付有価証券 63,800株
藤倉コンポジット	15,500	399.00	6,184,500	

オカモト	11,900	3,990.00	47,481,000	
フコク	7,800	667.00	5,202,600	貸付有価証券 100株
ニッタ	20,000	2,744.00	54,880,000	
住友理工	34,400	785.00	27,004,000	
三ツ星ベルト	23,400	1,722.00	40,294,800	
バンドー化学	33,800	833.00	28,155,400	貸付有価証券 100株
日東紡績	26,400	2,963.00	78,223,200	貸付有価証券 3,700株
A G C	175,500	3,185.00	558,967,500	貸付有価証券 117,100株（30,400 株）
日本板硝子	84,900	638.00	54,166,200	貸付有価証券 12,500株（6,000株）
石塚硝子	3,000	1,910.00	5,730,000	
日本山村硝子	7,400	1,241.00	9,183,400	
日本電気硝子	71,300	2,308.00	164,560,400	貸付有価証券 16,100株
オハラ	7,000	1,346.00	9,422,000	貸付有価証券 3,600株（800株）
住友大阪セメント	35,800	4,495.00	160,921,000	貸付有価証券 4,300株
太平洋セメント	112,100	2,762.00	309,620,200	貸付有価証券 13,700株
日本ヒューム	17,800	655.00	11,659,000	
日本コンクリート工業	38,200	240.00	9,168,000	貸付有価証券 300株
三谷セキサン	8,300	2,887.00	23,962,100	
アジアパイルホールディ ングス	25,100	491.00	12,324,100	
東海カーボン	185,900	1,088.00	202,259,200	貸付有価証券 106,900株
日本カーボン	9,100	3,765.00	34,261,500	貸付有価証券 6,100株
東洋炭素	10,400	2,185.00	22,724,000	貸付有価証券 2,000株（600株）
ノリタケカンパニーリミ テド	10,600	3,830.00	40,598,000	
T O T O	136,500	3,920.00	535,080,000	貸付有価証券 16,900株

日本碍子	216,600	1,468.00	317,968,800	
日本特殊陶業	149,700	1,877.00	280,986,900	貸付有価証券 18,300株
ダントーホールディングス	13,200	109.00	1,438,800	貸付有価証券 2,900株
M A R U W A	6,100	6,380.00	38,918,000	貸付有価証券 700株
品川リフラクトリーズ	4,700	2,619.00	12,309,300	貸付有価証券 600株
黒崎播磨	3,500	5,480.00	19,180,000	貸付有価証券 400株
ヨータイ	15,500	576.00	8,928,000	
イソライト工業	9,100	423.00	3,849,300	貸付有価証券 2,400株
東京窯業	22,600	287.00	6,486,200	貸付有価証券 3,600株
ニッカトー	8,000	672.00	5,376,000	貸付有価証券 2,300株
フジミインコーポレーテッド	15,800	2,470.00	39,026,000	貸付有価証券 1,900株
クニミネ工業	8,000	881.00	7,048,000	貸付有価証券 200株
エーアンドエーマテリアル	3,400	973.00	3,308,200	貸付有価証券 500株
ニチアス	48,600	1,801.00	87,528,600	貸付有価証券 1,600株
ニチハ	24,700	2,683.00	66,270,100	
日本製鉄	815,600	1,494.00	1,218,506,400	貸付有価証券 1,800株
神戸製鋼所	321,200	562.00	180,514,400	貸付有価証券 39,300株
中山製鋼所	24,300	441.00	10,716,300	
合同製鐵	8,500	2,101.00	17,858,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	474,000	1,271.00	602,454,000	貸付有価証券 500株
東京製鐵	94,000	831.00	78,114,000	貸付有価証券 11,400株
共英製鋼	19,800	1,890.00	37,422,000	貸付有価証券 3,200株
大和工業	37,300	2,668.00	99,516,400	貸付有価証券 400株

東京鐵鋼	7,200	1,225.00	8,820,000	
大阪製鐵	11,600	1,335.00	15,486,000	貸付有価証券 1,400株
淀川製鋼所	23,700	1,822.00	43,181,400	貸付有価証券 2,800株
丸一鋼管	62,200	2,598.00	161,595,600	貸付有価証券 7,600株
モリ工業	5,300	1,765.00	9,354,500	
大同特殊鋼	28,700	4,085.00	117,239,500	貸付有価証券 4,000株
日本高周波鋼業	6,500	405.00	2,632,500	貸付有価証券 300株
日本冶金工業	145,200	222.00	32,234,400	貸付有価証券 96,900株（100株）
山陽特殊製鋼	22,100	1,418.00	31,337,800	貸付有価証券 2,000株（1,800株）
愛知製鋼	9,900	3,090.00	30,591,000	
日立金属	189,100	1,191.00	225,218,100	貸付有価証券 25,900株
日本金属	4,100	777.00	3,185,700	
大平洋金属	11,900	2,172.00	25,846,800	貸付有価証券 4,600株（100株）
新日本電工	113,100	161.00	18,209,100	貸付有価証券 65,400株（2,100株）
栗本鐵工所	8,900	1,401.00	12,468,900	
虹技	2,600	1,231.00	3,200,600	
日本鑄鉄管	1,800	981.00	1,765,800	貸付有価証券 1,200株（1,000株）
三菱製鋼	13,000	1,085.00	14,105,000	
日亜鋼業	25,700	277.00	7,118,900	貸付有価証券 1,200株（100株）
日本精線	2,500	2,438.00	6,095,000	
エンビプロ・ホールディングス	6,600	586.00	3,867,600	貸付有価証券 3,300株（600株）
シンニッタン	27,300	425.00	11,602,500	貸付有価証券 3,300株
新家工業	4,000	1,343.00	5,372,000	貸付有価証券 400株
大紀アルミニウム工業所	28,800	704.00	20,275,200	貸付有価証券 9,200株
日本軽金属ホールディング	478,300	187.00	89,442,100	貸付有価証券

グス				600株
三井金属鉱業	47,400	2,358.00	111,769,200	貸付有価証券 900株
東邦亜鉛	9,700	1,976.00	19,167,200	
三菱マテリアル	115,900	2,615.00	303,078,500	
住友金属鉱山	240,400	3,220.00	774,088,000	貸付有価証券 29,400株
DOWAホールディングス	41,000	3,425.00	140,425,000	貸付有価証券 400株
古河機械金属	29,000	1,322.00	38,338,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,300	1,606.00	32,601,800	貸付有価証券 5,700株
東邦チタニウム	31,400	801.00	25,151,400	貸付有価証券 6,100株
UACJ	26,600	1,681.00	44,714,600	貸付有価証券 13,000株
CKサンエツ	3,300	2,843.00	9,381,900	貸付有価証券 300株
古河電気工業	50,600	2,375.00	120,175,000	
住友電気工業	656,200	1,290.50	846,826,100	
フジクラ	211,900	355.00	75,224,500	貸付有価証券 600株
昭和電線ホールディングス	20,400	769.00	15,687,600	貸付有価証券 100株
東京特殊電線	2,300	1,804.00	4,149,200	
タツタ電線	34,800	446.00	15,520,800	
カナレ電気	2,900	1,735.00	5,031,500	貸付有価証券 500株
平河ヒューテック	7,300	1,055.00	7,701,500	貸付有価証券 800株
リョービ	21,600	1,652.00	35,683,200	貸付有価証券 2,700株
アーレスティ	21,600	533.00	11,512,800	
アサヒホールディングス	32,900	2,282.00	75,077,800	
稲葉製作所	9,900	1,378.00	13,642,200	貸付有価証券 1,400株
宮地エンジニアリンググループ	5,300	1,467.00	7,775,100	貸付有価証券 400株
トーカロ	45,300	838.00	37,961,400	貸付有価証券 100株
アルファＣｏ	6,200	1,177.00	7,297,400	

SUMCO	210,100	1,450.00	304,645,000	貸付有価証券 140,200株
川田テクノロジーズ	3,900	6,310.00	24,609,000	
RS Technologies	4,900	3,295.00	16,145,500	貸付有価証券 600株
信和	9,300	971.00	9,030,300	
東洋製罐グループホールディングス	111,800	1,604.00	179,327,200	
ホッカンホールディングス	8,900	1,511.00	13,447,900	
コロナ	9,700	994.00	9,641,800	
横河ブリッジホールディングス	32,600	1,511.00	49,258,600	
駒井ハルテック	3,300	1,451.00	4,788,300	貸付有価証券 300株
高田機工	1,600	2,444.00	3,910,400	
三和ホールディングス	181,300	1,180.00	213,934,000	
文化シャッター	51,700	894.00	46,219,800	貸付有価証券 8,400株
三協立山	24,300	1,155.00	28,066,500	貸付有価証券 2,900株
アルインコ	13,900	925.00	12,857,500	
東洋シャッター	4,200	667.00	2,801,400	貸付有価証券 700株
LIXILグループ	259,000	1,765.00	457,135,000	貸付有価証券 33,300株
日本フィルコン	13,400	480.00	6,432,000	貸付有価証券 1,700株
ノーリツ	36,400	1,203.00	43,789,200	貸付有価証券 4,700株
長府製作所	17,800	2,160.00	38,448,000	貸付有価証券 2,100株
リンナイ	31,300	6,900.00	215,970,000	貸付有価証券 3,800株
ダイニチ工業	9,500	616.00	5,852,000	
日東精工	24,200	531.00	12,850,200	貸付有価証券 2,900株
三洋工業	2,300	1,784.00	4,103,200	
岡部	35,600	807.00	28,729,200	貸付有価証券 4,300株
ジーテクト	19,400	1,531.00	29,701,400	貸付有価証券

				200株
中国工業	2,600	586.00	1,523,600	
東ブレ	32,700	1,646.00	53,824,200	
高周波熱錬	33,800	814.00	27,513,200	貸付有価証券 400株
東京製鋼	10,800	927.00	10,011,600	
サンコール	9,900	464.00	4,593,600	貸付有価証券 1,400株
モリテック スチール	13,700	335.00	4,589,500	貸付有価証券 1,900株
パイオラックス	28,100	1,743.00	48,978,300	貸付有価証券 3,400株
エイチワン	17,200	643.00	11,059,600	貸付有価証券 800株
日本発條	174,800	787.00	137,567,600	貸付有価証券 35,600株
中央発條	2,100	2,776.00	5,829,600	
アドバネクス	2,300	1,665.00	3,829,500	
立川ブラインド工業	7,700	1,376.00	10,595,200	貸付有価証券 1,100株
三益半導体工業	15,600	1,798.00	28,048,800	貸付有価証券 2,100株
日本ドライケミカル	4,700	1,113.00	5,231,100	貸付有価証券 2,600株
日本製鋼所	53,200	2,079.00	110,602,800	貸付有価証券 6,500株
三浦工業	75,900	3,040.00	230,736,000	貸付有価証券 7,800株（7,700株）
タクマ	64,000	1,188.00	76,032,000	
ツガミ	39,400	893.00	35,184,200	貸付有価証券 25,100株
オークマ	22,300	5,370.00	119,751,000	貸付有価証券 2,700株
東芝機械	19,800	2,125.00	42,075,000	貸付有価証券 1,500株
アマダホールディングス	263,700	1,148.00	302,727,600	貸付有価証券 33,100株
アイダエンジニアリング	47,400	805.00	38,157,000	
滝澤鉄工所	5,400	1,261.00	6,809,400	
F U J I	70,100	1,485.00	104,098,500	
牧野フライス製作所	20,600	4,535.00	93,421,000	貸付有価証券

				2,500株
オーエスジー	81,100	2,037.00	165,200,700	貸付有価証券 22,700株（5,600株）
ダイジェット工業	2,000	1,429.00	2,858,000	
旭ダイヤモンド工業	46,000	612.00	28,152,000	貸付有価証券 100株
D M G 森精機	111,000	1,460.00	162,060,000	貸付有価証券 74,100株（17,400株）
ソディック	41,200	760.00	31,312,000	貸付有価証券 6,700株
ディスコ	23,800	20,840.00	495,992,000	貸付有価証券 1,100株
日東工器	9,600	2,063.00	19,804,800	
日進工具	5,200	1,867.00	9,708,400	
パンチ工業	12,200	471.00	5,746,200	
富士ダイス	7,700	574.00	4,419,800	
豊和工業	9,700	751.00	7,284,700	貸付有価証券 2,800株
O K K	7,200	700.00	5,040,000	
東洋機械金属	12,500	556.00	6,950,000	
津田駒工業	3,400	1,272.00	4,324,800	貸付有価証券 2,200株（1,800株）
エンシュウ	4,600	1,064.00	4,894,400	貸付有価証券 300株
島精機製作所	24,200	2,506.00	60,645,200	貸付有価証券 2,000株
オプトラ	19,600	3,195.00	62,622,000	貸付有価証券 900株
N C ホールディングス	5,700	453.00	2,582,100	
イワキポンプ	7,400	929.00	6,874,600	貸付有価証券 1,000株
フリー	14,000	921.00	12,894,000	貸付有価証券 1,000株
ヤマシンフィルタ	30,500	704.00	21,472,000	貸付有価証券 20,300株（5,200株）
日阪製作所	21,600	823.00	17,776,800	貸付有価証券 500株
やまびこ	34,000	1,019.00	34,646,000	貸付有価証券 4,100株
平田機工	8,300	6,610.00	54,863,000	貸付有価証券 2,300株

ペガサスミシン製造	16,400	499.00	8,183,600	
マルマエ	7,200	860.00	6,192,000	貸付有価証券 4,600株（3,300株）
タツモ	8,200	1,090.00	8,938,000	貸付有価証券 5,400株
ナブテスコ	103,400	3,245.00	335,533,000	貸付有価証券 68,900株（1,400株）
三井海洋開発	18,600	2,474.00	46,016,400	貸付有価証券 2,200株
レオン自動機	17,200	1,485.00	25,542,000	貸付有価証券 2,100株
S M C	52,000	42,200.00	2,194,400,000	貸付有価証券 6,300株
ヤマハモーターロボティクスホールディング	13,300	415.00	5,519,500	貸付有価証券 8,400株
ホソカワミクロン	6,200	3,725.00	23,095,000	
ユニオンツール	6,500	3,190.00	20,735,000	貸付有価証券 700株
オイレス工業	24,600	1,516.00	37,293,600	
日精エー・エス・ビー機械	5,900	3,140.00	18,526,000	貸付有価証券 3,000株（400株）
サトーホールディングス	21,200	2,671.00	56,625,200	
技研製作所	15,400	3,325.00	51,205,000	貸付有価証券 1,900株
日本エアーテック	5,500	573.00	3,151,500	貸付有価証券 700株
カワタ	4,800	933.00	4,478,400	貸付有価証券 600株
日精樹脂工業	14,700	983.00	14,450,100	
オカダアイヨン	6,000	1,145.00	6,870,000	貸付有価証券 200株
ワイエイシイホールディングス	7,000	690.00	4,830,000	貸付有価証券 2,900株
小松製作所	803,600	2,333.00	1,874,798,800	貸付有価証券 300株
住友重機械工業	101,600	3,120.00	316,992,000	
日立建機	71,100	2,357.00	167,582,700	貸付有価証券 8,600株
日工	4,800	3,170.00	15,216,000	
巴工業	7,500	2,290.00	17,175,000	貸付有価証券 900株

井関農機	17,700	1,362.00	24,107,400	貸付有価証券 2,100株
T O W A	15,200	745.00	11,324,000	貸付有価証券 8,300株（200株）
丸山製作所	3,900	1,152.00	4,492,800	貸付有価証券 100株
北川鉄工所	8,000	1,863.00	14,904,000	
ローツェ	7,800	2,367.00	18,462,600	貸付有価証券 5,200株（200株）
タカキタ	6,200	523.00	3,242,600	貸付有価証券 3,600株
クボタ	950,900	1,563.50	1,486,732,150	貸付有価証券 631,600株（74,700株）
荏原実業	4,400	1,931.00	8,496,400	貸付有価証券 500株
三菱化工機	6,100	1,731.00	10,559,100	
月島機械	35,200	1,285.00	45,232,000	貸付有価証券 4,500株
帝国電機製作所	12,400	1,118.00	13,863,200	
東京機械製作所	6,700	364.00	2,438,800	貸付有価証券 800株
新東工業	42,100	920.00	38,732,000	貸付有価証券 28,100株
澁谷工業	15,500	2,632.00	40,796,000	貸付有価証券 1,800株
アイチ コーポレーション	30,600	652.00	19,951,200	貸付有価証券 3,800株
小森コーポレーション	45,000	1,081.00	48,645,000	貸付有価証券 1,900株
鶴見製作所	13,800	1,967.00	27,144,600	貸付有価証券 1,600株
住友精密工業	2,900	2,903.00	8,418,700	
日本ギア工業	5,300	487.00	2,581,100	貸付有価証券 2,900株
酒井重工業	3,300	2,625.00	8,662,500	貸付有価証券 1,800株
荏原製作所	78,700	2,623.00	206,430,100	貸付有価証券 24,800株（9,900株）
石井鐵工所	2,700	1,990.00	5,373,000	
西島製作所	18,100	1,028.00	18,606,800	貸付有価証券 2,200株

北越工業	18,300	1,214.00	22,216,200	
ダイキン工業	242,300	14,075.00	3,410,372,500	貸付有価証券 31,900株
オルガノ	6,400	4,275.00	27,360,000	貸付有価証券 100株
トーヨーカネツ	6,700	1,774.00	11,885,800	
栗田工業	96,000	2,826.00	271,296,000	貸付有価証券 11,700株
椿本チエイン	23,200	3,245.00	75,284,000	
大同工業	8,400	784.00	6,585,600	貸付有価証券 600株
木村化工機	14,800	359.00	5,313,200	
アネスト岩田	27,600	889.00	24,536,400	
ダイフク	97,700	5,140.00	502,178,000	貸付有価証券 36,300株
サムコ	4,900	806.00	3,949,400	貸付有価証券 600株
加藤製作所	9,100	1,723.00	15,679,300	
油研工業	3,000	1,572.00	4,716,000	
タダノ	85,600	978.00	83,716,800	貸付有価証券 38,400株
フジテック	64,500	1,266.00	81,657,000	貸付有価証券 7,800株
C K D	49,400	1,176.00	58,094,400	貸付有価証券 7,500株
キトー	13,400	1,475.00	19,765,000	
平和	49,500	2,088.00	103,356,000	貸付有価証券 33,000株
理想科学工業	15,700	1,783.00	27,993,100	貸付有価証券 400株
S A N K Y O	44,400	3,635.00	161,394,000	
日本金銭機械	19,600	948.00	18,580,800	貸付有価証券 3,200株（900株）
マースグループホール ディングス	11,300	1,854.00	20,950,200	
福島工業	10,900	3,035.00	33,081,500	
オーイズミ	7,400	415.00	3,071,000	
ダイコク電機	8,100	1,476.00	11,955,600	貸付有価証券 4,300株
竹内製作所	29,700	1,585.00	47,074,500	貸付有価証券

				5,500株
アマノ	50,700	3,230.00	163,761,000	
J U K I	24,700	856.00	21,143,200	貸付有価証券 3,700株
サンデンホールディングス	21,700	521.00	11,305,700	貸付有価証券 11,200株（3,200株）
蛇の目ミシン工業	16,100	379.00	6,101,900	
マックス	27,100	1,715.00	46,476,500	貸付有価証券 100株
グローリー	49,200	2,913.00	143,319,600	貸付有価証券 1,100株
新晃工業	16,500	1,684.00	27,786,000	貸付有価証券 2,000株
大和冷機工業	25,600	1,052.00	26,931,200	貸付有価証券 3,100株
セガサミーホールディングス	176,000	1,489.00	262,064,000	貸付有価証券 100株
日本ピストンリング	6,500	1,231.00	8,001,500	
リケン	8,200	3,645.00	29,889,000	貸付有価証券 1,000株
T P R	23,900	1,682.00	40,199,800	
ツバキ・ナカシマ	36,200	1,629.00	58,969,800	貸付有価証券 4,900株
ホシザキ	51,900	7,610.00	394,959,000	貸付有価証券 6,700株
大豊工業	14,500	769.00	11,150,500	
日本精工	364,500	903.00	329,143,500	貸付有価証券 44,600株
N T N	381,400	299.00	114,038,600	貸付有価証券 5,400株
ジェイテクト	170,200	1,186.00	201,857,200	貸付有価証券 100株
不二越	16,500	4,440.00	73,260,000	貸付有価証券 6,200株
日本トムソン	52,700	429.00	22,608,300	貸付有価証券 6,400株
T H K	103,300	2,651.00	273,848,300	貸付有価証券 68,900株
ユーシン精機	13,700	999.00	13,686,300	
前澤給装工業	6,900	1,880.00	12,972,000	貸付有価証券 100株

イーグル工業	21,900	984.00	21,549,600	
前澤工業	11,800	326.00	3,846,800	貸付有価証券 1,400株
日本ピラー工業	17,900	1,122.00	20,083,800	
キッツ	71,900	677.00	48,676,300	貸付有価証券 9,000株
マキタ	216,000	3,135.00	677,160,000	
日立造船	140,700	319.00	44,883,300	貸付有価証券 5,800株
三菱重工業	297,400	4,109.00	1,222,016,600	
I H I	136,400	2,245.00	306,218,000	貸付有価証券 16,600株
スター精密	27,700	1,470.00	40,719,000	貸付有価証券 6,200株
日清紡ホールディングス	118,300	805.00	95,231,500	貸付有価証券 78,700株（23,100株）
イビデン	108,700	2,127.00	231,204,900	
コニカミノルタ	387,800	764.00	296,279,200	
ブラザー工業	231,200	1,881.00	434,887,200	貸付有価証券 28,200株
ミネベアミツミ	329,500	1,740.00	573,330,000	貸付有価証券 40,300株
日立製作所	799,000	3,923.00	3,134,477,000	
三菱電機	1,774,800	1,333.50	2,366,695,800	
富士電機	115,200	3,160.00	364,032,000	貸付有価証券 200株
東洋電機製造	7,000	1,536.00	10,752,000	貸付有価証券 800株
安川電機	205,700	3,780.00	777,546,000	貸付有価証券 123,900株
シンフォニアテクノロジー	24,600	1,149.00	28,265,400	
明電舎	35,100	1,755.00	61,600,500	
オリジン	4,800	1,373.00	6,590,400	
山洋電気	8,600	4,420.00	38,012,000	貸付有価証券 1,000株
デンヨー	16,400	1,579.00	25,895,600	
東芝テック	22,200	3,060.00	67,932,000	
芝浦メカトロニクス	3,100	2,893.00	8,968,300	
マブチモーター	49,100	3,840.00	188,544,000	貸付有価証券

				11,500株
日本電産	213,600	13,975.00	2,985,060,000	貸付有価証券 27,400株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,600	776.00	7,449,600	貸付有価証券 3,300株
トレックス・セミコンダクター	7,900	1,128.00	8,911,200	貸付有価証券 900株
東光高岳	9,000	1,093.00	9,837,000	
ダブル・スコープ	24,200	632.00	15,294,400	貸付有価証券 11,400株（100株）
ダイヘン	19,400	3,170.00	61,498,000	貸付有価証券 2,300株
ヤーマン	25,700	786.00	20,200,200	貸付有価証券 17,100株（300株）
JVCケンウッド	135,600	305.00	41,358,000	
ミマキエンジニアリング	15,900	509.00	8,093,100	貸付有価証券 1,700株
第一精工	6,500	2,232.00	14,508,000	貸付有価証券 4,200株
日新電機	41,600	1,316.00	54,745,600	貸付有価証券 5,000株
大崎電気工業	35,300	648.00	22,874,400	
オムロン	188,600	5,660.00	1,067,476,000	貸付有価証券 23,000株
日東工業	28,400	1,953.00	55,465,200	貸付有価証券 100株
I D E C	23,800	1,838.00	43,744,400	貸付有価証券 2,900株
正興電機製作所	4,200	710.00	2,982,000	
不二電機工業	1,900	1,187.00	2,255,300	貸付有価証券 1,200株
ジーエス・ユアサ コーポレーション	63,800	1,811.00	115,541,800	
サクサホールディングス	4,500	1,764.00	7,938,000	貸付有価証券 500株
メルコホールディングス	7,400	2,791.00	20,653,400	貸付有価証券 300株（300株）
テクノメディカ	4,000	2,000.00	8,000,000	貸付有価証券 1,100株
日本電気	229,700	4,630.00	1,063,511,000	
富士通	171,100	8,595.00	1,470,604,500	貸付有価証券

				700株
沖電気工業	76,900	1,424.00	109,505,600	
岩崎通信機	8,300	771.00	6,399,300	貸付有価証券 100株
電気興業	9,300	2,881.00	26,793,300	貸付有価証券 100株
サンケン電気	20,700	1,974.00	40,861,800	貸付有価証券 3,200株
ナカヨ	3,400	1,575.00	5,355,000	
アイホン	10,000	1,577.00	15,770,000	
ルネサスエレクトロニクス	844,500	689.00	581,860,500	貸付有価証券 107,600株
セイコーエプソン	220,200	1,446.00	318,409,200	貸付有価証券 27,700株
ワコム	128,500	335.00	43,047,500	貸付有価証券 800株
アルバック	35,400	4,600.00	162,840,000	貸付有価証券 23,500株（800株）
アクセル	7,400	630.00	4,662,000	貸付有価証券 1,600株（700株）
E I Z O	16,300	3,615.00	58,924,500	貸付有価証券 1,900株
ジャパンディスプレイ	419,600	67.00	28,113,200	貸付有価証券 277,500株（13,900株）
日本信号	45,200	1,192.00	53,878,400	貸付有価証券 200株
京三製作所	38,100	352.00	13,411,200	貸付有価証券 700株
能美防災	23,500	2,150.00	50,525,000	
ホーチキ	11,300	1,381.00	15,605,300	
星和電機	9,500	502.00	4,769,000	貸付有価証券 1,400株
エレコム	16,800	4,270.00	71,736,000	貸付有価証券 9,200株
パナソニック	2,027,600	850.30	1,724,068,280	貸付有価証券 900株
シャープ	176,000	1,186.00	208,736,000	貸付有価証券 117,500株
アンリツ	114,200	1,991.00	227,372,200	貸付有価証券 62,400株（1,600株）
富士通ゼネラル	54,200	1,780.00	96,476,000	貸付有価証券

				23,700株（12,400株）
ソニー	1,191,200	6,360.00	7,576,032,000	貸付有価証券 147,500株
T D K	92,800	9,240.00	857,472,000	
帝国通信工業	7,800	1,064.00	8,299,200	
タムラ製作所	68,400	565.00	38,646,000	貸付有価証券 8,300株
アルプスアルパイン	184,800	1,943.00	359,066,400	
池上通信機	5,600	1,025.00	5,740,000	貸付有価証券 100株
日本電波工業	16,000	441.00	7,056,000	貸付有価証券 5,300株
鈴木	9,500	612.00	5,814,000	貸付有価証券 1,700株
日本トリム	3,300	4,470.00	14,751,000	
ローランド ディー . ジー .	9,800	1,952.00	19,129,600	貸付有価証券 1,100株
フォスター電機	20,100	1,799.00	36,159,900	貸付有価証券 100株
S M K	5,000	2,674.00	13,370,000	貸付有価証券 2,700株
ヨコオ	12,600	2,715.00	34,209,000	貸付有価証券 200株
ティアック	12,800	191.00	2,444,800	貸付有価証券 7,200株（300株）
ホシデン	52,200	1,013.00	52,878,600	貸付有価証券 6,300株
ヒロセ電機	25,400	12,860.00	326,644,000	貸付有価証券 3,300株
日本航空電子工業	40,700	1,439.00	58,567,300	貸付有価証券 600株
T O A	19,000	1,229.00	23,351,000	
マクセルホールディング ス	38,200	1,530.00	58,446,000	貸付有価証券 11,200株（3,300株）
古野電気	22,800	895.00	20,406,000	貸付有価証券 3,100株
ユニデンホールディング ス	5,200	1,768.00	9,193,600	
スミダコーポレーション	13,600	1,004.00	13,654,400	
アイコム	9,800	2,153.00	21,099,400	
リオン	8,100	2,270.00	18,387,000	

本多通信工業	15,200	461.00	7,007,200	貸付有価証券 100株
船井電機	17,900	539.00	9,648,100	貸付有価証券 7,700株
横河電機	177,600	1,949.00	346,142,400	
新電元工業	6,300	3,170.00	19,971,000	
アズビル	112,000	2,765.00	309,680,000	貸付有価証券 14,000株
東亜ディーケーケー	8,800	829.00	7,295,200	貸付有価証券 4,800株（200株）
日本光電工業	78,200	2,945.00	230,299,000	
チノー	6,100	1,319.00	8,045,900	
共和電業	18,600	406.00	7,551,600	貸付有価証券 2,200株
日本電子材料	7,000	498.00	3,486,000	貸付有価証券 800株
堀場製作所	35,200	5,750.00	202,400,000	貸付有価証券 8,800株
アドバンテスト	121,000	4,610.00	557,810,000	貸付有価証券 200株
小野測器	7,400	492.00	3,640,800	貸付有価証券 1,000株
エスベック	15,700	1,843.00	28,935,100	
キーエンス	87,100	64,190.00	5,590,949,000	貸付有価証券 10,600株
日置電機	9,300	3,310.00	30,783,000	貸付有価証券 1,100株
シスメックス	138,300	6,901.00	954,408,300	貸付有価証券 24,100株
日本マイクロニクス	30,900	813.00	25,121,700	貸付有価証券 4,300株
メガチップス	14,000	1,635.00	22,890,000	貸付有価証券 6,300株
O B A R A G R O U P	9,200	3,520.00	32,384,000	貸付有価証券 1,100株
澤藤電機	2,100	1,630.00	3,423,000	
原田工業	7,200	829.00	5,968,800	貸付有価証券 4,000株
コーセル	21,600	1,054.00	22,766,400	貸付有価証券 9,600株（800株）
イリソ電子工業	16,300	4,895.00	79,788,500	貸付有価証券

			8,300株（500株）
オブテックスグループ	29,100	1,513.00	44,028,300 貸付有価証券 3,900株
千代田インテグレ	8,200	1,986.00	16,285,200 貸付有価証券 900株
アイ・オー・データ機器	6,500	862.00	5,603,000 貸付有価証券 700株
レーザーテック	36,400	6,490.00	236,236,000 貸付有価証券 5,000株（200株）
スタンレー電気	125,200	2,661.00	333,157,200
岩崎電気	6,900	1,190.00	8,211,000 貸付有価証券 800株
ウシオ電機	103,100	1,452.00	149,701,200 貸付有価証券 12,600株
岡谷電機産業	12,600	365.00	4,599,000 貸付有価証券 4,400株
ヘリオス テクノ ホー ルディング	16,300	538.00	8,769,400 貸付有価証券 2,300株
エノモト	4,900	895.00	4,385,500
日本セラミック	18,000	2,719.00	48,942,000 貸付有価証券 4,300株
遠藤照明	9,000	651.00	5,859,000 貸付有価証券 1,000株
古河電池	12,700	578.00	7,340,600 貸付有価証券 4,400株
双信電機	8,600	428.00	3,680,800 貸付有価証券 4,700株
山一電機	12,900	1,203.00	15,518,700 貸付有価証券 2,500株（1,500株）
図研	11,500	1,833.00	21,079,500 貸付有価証券 1,400株
日本電子	35,000	2,418.00	84,630,000 貸付有価証券 4,200株
カシオ計算機	157,000	1,565.00	245,705,000 貸付有価証券 13,000株（1,000株）
ファナック	168,600	18,605.00	3,136,803,000
日本シイエムケイ	45,200	532.00	24,046,400 貸付有価証券 19,500株
エンプラス	8,000	3,270.00	26,160,000
大真空	6,500	987.00	6,415,500 貸付有価証券 100株
ローム	84,900	8,110.00	688,539,000

浜松ホトニクス	127,300	3,705.00	471,646,500	貸付有価証券 16,300株
三井ハイテック	19,600	1,375.00	26,950,000	貸付有価証券 9,000株（1,200株）
新光電気工業	59,600	895.00	53,342,000	
京セラ	270,500	6,549.00	1,771,504,500	
太陽誘電	78,900	2,245.00	177,130,500	貸付有価証券 52,800株
村田製作所	558,600	4,794.00	2,677,928,400	貸付有価証券 68,300株
双葉電子工業	28,100	1,289.00	36,220,900	
北陸電気工業	6,600	971.00	6,408,600	貸付有価証券 800株
ニチコン	55,900	919.00	51,372,100	貸付有価証券 3,700株
日本ケミコン	12,600	1,422.00	17,917,200	貸付有価証券 4,800株
K O A	26,800	1,261.00	33,794,800	貸付有価証券 3,200株
市光工業	26,500	776.00	20,564,000	貸付有価証券 3,600株
小糸製作所	106,300	5,010.00	532,563,000	
ミツバ	32,700	563.00	18,410,100	貸付有価証券 5,600株
S C R E E Nホールディングス	30,800	6,360.00	195,888,000	貸付有価証券 5,700株
キャノン電子	18,600	1,773.00	32,977,800	貸付有価証券 2,200株
キャノン	955,400	2,792.00	2,667,476,800	貸付有価証券 637,900株（44,200株）
リコー	533,600	960.00	512,256,000	貸付有価証券 70,900株
象印マホービン	52,000	1,343.00	69,836,000	貸付有価証券 34,700株
M U T O Hホールディングス	2,400	1,610.00	3,864,000	
東京エレクトロン	118,300	20,005.00	2,366,591,500	貸付有価証券 14,400株
トヨタ紡織	62,000	1,462.00	90,644,000	貸付有価証券 7,500株
芦森工業	3,700	1,301.00	4,813,700	貸付有価証券

				1,000株
ユニプレス	34,400	1,707.00	58,720,800	貸付有価証券 4,200株
豊田自動織機	143,600	5,960.00	855,856,000	貸付有価証券 20,400株
モリタホールディングス	31,000	1,658.00	51,398,000	貸付有価証券 3,700株
三櫻工業	22,500	485.00	10,912,500	貸付有価証券 8,400株
デンソー	390,800	4,596.00	1,796,116,800	貸付有価証券 47,800株
東海理化電機製作所	46,700	1,734.00	80,977,800	貸付有価証券 1,700株
三井E & Sホールディングス	64,100	836.00	53,587,600	貸付有価証券 17,200株（3,100株）
川崎重工業	138,100	2,156.00	297,743,600	貸付有価証券 700株
名村造船所	53,300	247.00	13,165,100	貸付有価証券 6,600株
サノヤスホールディングス	23,400	177.00	4,141,800	貸付有価証券 4,600株
日本車輛製造	6,500	2,270.00	14,755,000	貸付有価証券 3,100株
三菱ロジスネクスト	29,300	1,093.00	32,024,900	貸付有価証券 2,600株
近畿車輛	2,700	1,279.00	3,453,300	貸付有価証券 600株
日産自動車	2,093,200	674.00	1,410,816,800	貸付有価証券 7,500株
いすゞ自動車	561,000	1,156.00	648,516,000	貸付有価証券 68,800株
トヨタ自動車	1,977,900	7,030.00	13,904,637,000	貸付有価証券 900株
日野自動車	221,600	867.00	192,127,200	貸付有価証券 27,100株
三菱自動車工業	657,000	460.00	302,220,000	貸付有価証券 2,500株
エフテック	12,400	703.00	8,717,200	
レシップホールディングス	6,300	777.00	4,895,100	貸付有価証券 100株
G M B	3,400	732.00	2,488,800	貸付有価証券 100株

ファルテック	3,100	707.00	2,191,700	
武蔵精密工業	43,100	1,301.00	56,073,100	
日産車体	34,700	945.00	32,791,500	貸付有価証券 4,400株
新明和工業	74,400	1,290.00	95,976,000	貸付有価証券 9,000株
極東開発工業	35,300	1,167.00	41,195,100	貸付有価証券 4,300株
日信工業	32,500	1,382.00	44,915,000	
トピー工業	14,600	1,882.00	27,477,200	
ティラド	6,400	1,756.00	11,238,400	
タチエス	29,100	1,244.00	36,200,400	貸付有価証券 4,100株
N O K	95,400	1,552.00	148,060,800	貸付有価証券 16,000株
フタバ産業	49,400	718.00	35,469,200	貸付有価証券 11,100株
K Y B	18,400	2,946.00	54,206,400	貸付有価証券 600株
大同メタル工業	28,800	610.00	17,568,000	
プレス工業	88,000	449.00	39,512,000	
ミクニ	22,500	303.00	6,817,500	
太平洋工業	37,200	1,454.00	54,088,800	貸付有価証券 4,500株
ケーヒン	40,800	1,536.00	62,668,800	貸付有価証券 4,900株
河西工業	21,800	759.00	16,546,200	
アイシン精機	146,100	3,300.00	482,130,000	
マツダ	557,000	926.30	515,949,100	
今仙電機製作所	16,500	846.00	13,959,000	貸付有価証券 200株
本田技研工業	1,497,300	2,734.00	4,093,618,200	貸付有価証券 183,300株
スズキ	324,700	4,196.00	1,362,441,200	貸付有価証券 44,500株
S U B A R U	551,000	2,935.00	1,617,185,000	
安永	8,600	1,355.00	11,653,000	貸付有価証券 5,600株
ヤマハ発動機	231,400	1,790.00	414,206,000	貸付有価証券 154,500株（20,200

				株)
ショーワ	41,900	1,390.00	58,241,000	貸付有価証券 5,100株
T B K	21,100	385.00	8,123,500	貸付有価証券 2,700株(100株)
エクセディ	24,100	2,007.00	48,368,700	
豊田合成	57,300	2,058.00	117,923,400	
愛三工業	27,800	755.00	20,989,000	
盟和産業	2,700	1,023.00	2,762,100	貸付有価証券 300株
日本プラスト	13,900	673.00	9,354,700	
ヨロズ	16,600	1,261.00	20,932,600	
エフ・シー・シー	31,900	2,003.00	63,895,700	
シマノ	66,400	15,490.00	1,028,536,000	貸付有価証券 15,200株(4,900株)
テイ・エス テック	41,200	2,954.00	121,704,800	
ジャムコ	8,900	1,460.00	12,994,000	貸付有価証券 2,700株
テルモ	502,200	3,116.00	1,564,855,200	貸付有価証券 77,400株(6,200株)
クリエートメディック	5,900	903.00	5,327,700	貸付有価証券 700株
日機装	53,200	1,145.00	60,914,000	貸付有価証券 8,000株(700株)
島津製作所	228,400	2,649.00	605,031,600	貸付有価証券 28,200株
J M S	16,400	607.00	9,954,800	
クボテック	3,800	418.00	1,588,400	貸付有価証券 2,500株
長野計器	13,900	687.00	9,549,300	
ブイ・テクノロジー	8,300	5,390.00	44,737,000	貸付有価証券 1,200株
東京計器	11,300	863.00	9,751,900	
愛知時計電機	2,300	3,870.00	8,901,000	
インターアクション	9,500	1,973.00	18,743,500	貸付有価証券 4,900株
オーバル	17,300	223.00	3,857,900	貸付有価証券 2,100株
東京精密	32,100	3,095.00	99,349,500	
マニー	70,700	2,507.00	177,244,900	貸付有価証券

				16,200株（300株）
ニコン	309,300	1,356.00	419,410,800	貸付有価証券 9,200株
トプコン	95,300	1,309.00	124,747,700	貸付有価証券 11,700株
オリンパス	1,057,600	1,395.00	1,475,352,000	貸付有価証券 151,600株
理研計器	15,600	1,880.00	29,328,000	貸付有価証券 1,500株
タムロン	14,300	2,184.00	31,231,200	貸付有価証券 1,900株
H O Y A	357,300	9,000.00	3,215,700,000	
シード	7,500	857.00	6,427,500	貸付有価証券 1,100株
ノーリツ鋼機	14,000	1,848.00	25,872,000	貸付有価証券 1,900株
エー・アンド・デイ	16,200	672.00	10,886,400	貸付有価証券 1,900株
朝日インテック	150,600	2,460.00	370,476,000	貸付有価証券 30,700株
シチズン時計	194,200	513.00	99,624,600	貸付有価証券 23,800株
リズム時計工業	6,000	900.00	5,400,000	貸付有価証券 700株
大研医器	14,000	525.00	7,350,000	貸付有価証券 800株
メニコン	24,300	3,925.00	95,377,500	貸付有価証券 16,000株
シンシア	1,900	655.00	1,244,500	貸付有価証券 1,000株
松風	8,700	1,501.00	13,058,700	
セイコーホールディングス	27,400	2,259.00	61,896,600	貸付有価証券 800株
ニプロ	122,800	1,153.00	141,588,400	
中本パックス	5,000	1,387.00	6,935,000	貸付有価証券 200株
スノーピーク	8,000	1,338.00	10,704,000	貸付有価証券 1,900株
パラマウントベッドホールディングス	20,400	3,990.00	81,396,000	貸付有価証券 300株
トランザクション	11,300	1,118.00	12,633,400	貸付有価証券 2,000株（700株）

SHO - B I	5,200	376.00	1,955,200	貸付有価証券 2,800株
ニホンフラッシュ	7,600	2,443.00	18,566,800	貸付有価証券 300株
前田工織	19,600	1,399.00	27,420,400	貸付有価証券 4,200株
永大産業	23,200	315.00	7,308,000	貸付有価証券 400株
アートネイチャー	19,000	630.00	11,970,000	
バンダイナムコホールディングス	183,500	6,400.00	1,174,400,000	貸付有価証券 30,200株
アイフィスジャパン	4,500	716.00	3,222,000	貸付有価証券 600株
共立印刷	29,600	146.00	4,321,600	
SHOEI	8,500	4,450.00	37,825,000	貸付有価証券 1,000株
フランスベッドホールディングス	25,100	1,007.00	25,275,700	
パイロットコーポレーション	31,000	3,695.00	114,545,000	貸付有価証券 3,700株
萩原工業	9,900	1,385.00	13,711,500	貸付有価証券 1,200株
トッパン・フォームズ	38,000	929.00	35,302,000	貸付有価証券 5,000株
フジシールインターナショナル	39,800	2,782.00	110,723,600	貸付有価証券 4,800株
タカラトミー	74,300	1,100.00	81,730,000	
廣済堂	16,500	698.00	11,517,000	貸付有価証券 2,900株
エステールホールディングス	4,700	614.00	2,885,800	貸付有価証券 2,600株
アーク	67,700	89.00	6,025,300	貸付有価証券 8,800株
タカノ	6,900	727.00	5,016,300	貸付有価証券 3,800株
プロネクサス	15,200	1,040.00	15,808,000	貸付有価証券 1,600株
ホクシン	10,900	145.00	1,580,500	
ウッドワン	6,000	1,031.00	6,186,000	
大建工業	13,400	1,813.00	24,294,200	貸付有価証券 1,600株

凸版印刷	263,800	1,792.00	472,729,600	貸付有価証券 30,600株
大日本印刷	250,100	2,390.00	597,739,000	
共同印刷	5,500	2,630.00	14,465,000	
N I S S H A	36,400	973.00	35,417,200	貸付有価証券 10,600株
光村印刷	1,500	1,688.00	2,532,000	
宝印刷	8,600	1,595.00	13,717,000	貸付有価証券 1,000株
アシックス	146,500	1,489.00	218,138,500	貸付有価証券 97,800株
ツツミ	5,500	1,910.00	10,505,000	
小松ウオール工業	5,400	1,891.00	10,211,400	
ヤマハ	105,600	4,615.00	487,344,000	貸付有価証券 12,900株
河合楽器製作所	5,500	2,840.00	15,620,000	貸付有価証券 100株
クリナップ	16,500	543.00	8,959,500	貸付有価証券 2,100株
ピジョン	107,300	4,200.00	450,660,000	貸付有価証券 71,600株（9,200株）
兼松サステック	1,100	1,763.00	1,939,300	
キングジム	14,800	849.00	12,565,200	貸付有価証券 2,800株
リンテック	42,200	2,046.00	86,341,200	貸付有価証券 500株
イトーキ	37,700	400.00	15,080,000	貸付有価証券 4,900株
任天堂	101,600	41,450.00	4,211,320,000	貸付有価証券 9,300株
三菱鉛筆	29,200	1,684.00	49,172,800	貸付有価証券 3,500株
タカスタンダード	36,700	1,678.00	61,582,600	貸付有価証券 4,500株
コクヨ	85,100	1,396.00	118,799,600	貸付有価証券 11,500株
ナカバヤシ	17,500	503.00	8,802,500	
グローブライド	8,600	2,887.00	24,828,200	
オカムラ	61,900	1,091.00	67,532,900	貸付有価証券 7,500株
美津濃	17,600	2,671.00	47,009,600	

東京電力ホールディングス	1,416,900	508.00	719,785,200	貸付有価証券 765,300株
中部電力	543,000	1,525.50	828,346,500	貸付有価証券 74,600株
関西電力	724,200	1,271.00	920,458,200	貸付有価証券 90,100株
中国電力	245,400	1,351.00	331,535,400	貸付有価証券 80,900株（27,100株）
北陸電力	173,900	652.00	113,382,800	貸付有価証券 15,300株
東北電力	415,700	1,024.00	425,676,800	貸付有価証券 1,200株
四国電力	159,800	990.00	158,202,000	貸付有価証券 10,100株
九州電力	365,800	1,019.00	372,750,200	貸付有価証券 47,200株
北海道電力	166,100	544.00	90,358,400	貸付有価証券 20,600株
沖縄電力	32,900	1,614.00	53,100,600	
電源開発	141,200	2,402.00	339,162,400	
エフオン	8,300	707.00	5,868,100	貸付有価証券 1,100株
イーレックス	30,800	1,110.00	34,188,000	
レノバ	29,200	831.00	24,265,200	貸付有価証券 12,100株
東京瓦斯	348,200	2,616.50	911,065,300	貸付有価証券 42,600株
大阪瓦斯	344,400	1,893.00	651,949,200	貸付有価証券 43,500株
東邦瓦斯	87,900	4,040.00	355,116,000	貸付有価証券 11,600株
北海道瓦斯	9,500	1,496.00	14,212,000	
広島ガス	36,500	327.00	11,935,500	貸付有価証券 3,900株
西部瓦斯	20,000	2,260.00	45,200,000	貸付有価証券 1,700株
静岡ガス	50,400	860.00	43,344,000	貸付有価証券 6,600株
メタウォーター	8,600	3,580.00	30,788,000	
S B S ホールディングス	15,300	1,512.00	23,133,600	貸付有価証券 1,900株

東武鉄道	187,200	3,315.00	620,568,000	貸付有価証券 22,900株
相鉄ホールディングス	60,800	2,776.00	168,780,800	貸付有価証券 33,100株
東急	482,100	1,884.00	908,276,400	貸付有価証券 78,800株
京浜急行電鉄	243,100	1,927.00	468,453,700	貸付有価証券 30,000株
小田急電鉄	284,300	2,396.00	681,182,800	貸付有価証券 100株
京王電鉄	99,200	6,470.00	641,824,000	貸付有価証券 15,900株
京成電鉄	133,000	4,230.00	562,590,000	貸付有価証券 100株
富士急行	24,200	4,430.00	107,206,000	貸付有価証券 16,100株（100株）
新京成電鉄	4,600	2,013.00	9,259,800	貸付有価証券 2,500株
東日本旅客鉄道	315,600	10,005.00	3,157,578,000	貸付有価証券 38,700株
西日本旅客鉄道	159,100	9,077.00	1,444,150,700	貸付有価証券 19,400株
東海旅客鉄道	158,900	20,790.00	3,303,531,000	貸付有価証券 500株（500株）
西武ホールディングス	219,800	1,800.00	395,640,000	貸付有価証券 27,600株
鴻池運輸	28,200	1,654.00	46,642,800	貸付有価証券 3,400株
西日本鉄道	49,200	2,385.00	117,342,000	貸付有価証券 30,800株
ハマキョウレックス	13,600	3,580.00	48,688,000	
サカイ引越センター	9,300	6,040.00	56,172,000	貸付有価証券 1,500株
近鉄グループホールディングス	168,100	5,310.00	892,611,000	貸付有価証券 20,600株
阪急阪神ホールディングス	224,200	4,040.00	905,768,000	貸付有価証券 27,400株
南海電気鉄道	75,000	2,711.00	203,325,000	貸付有価証券 40,800株
京阪ホールディングス	74,800	4,465.00	333,982,000	貸付有価証券 9,100株
神戸電鉄	4,300	3,940.00	16,942,000	貸付有価証券

				2,800株
名古屋鉄道	138,100	3,190.00	440,539,000	貸付有価証券 73,600株
山陽電気鉄道	12,900	2,065.00	26,638,500	貸付有価証券 8,600株
日本通運	64,800	5,460.00	353,808,000	貸付有価証券 8,000株
ヤマトホールディングス	294,700	1,815.00	534,880,500	
山九	46,700	5,180.00	241,906,000	
丸運	9,600	258.00	2,476,800	貸付有価証券 1,100株
丸全昭和運輸	13,600	3,035.00	41,276,000	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	92,700	838.00	77,682,600	貸付有価証券 1,500株
トナミホールディングス	4,000	4,160.00	16,640,000	
ニッコンホールディングス	63,900	2,407.00	153,807,300	貸付有価証券 7,800株
日本石油輸送	2,000	2,862.00	5,724,000	
福山通運	21,500	3,580.00	76,970,000	
セイノーホールディングス	125,900	1,338.00	168,454,200	貸付有価証券 100株
エスライン	5,000	813.00	4,065,000	
神奈川中央交通	4,200	3,740.00	15,708,000	貸付有価証券 2,300株
日立物流	37,000	3,270.00	120,990,000	貸付有価証券 4,600株
丸和運輸機関	8,900	5,260.00	46,814,000	貸付有価証券 3,800株（100株）
C & F ロジホールディングス	17,000	1,200.00	20,400,000	貸付有価証券 2,200株
九州旅客鉄道	141,100	3,190.00	450,109,000	
S Gホールディングス	158,800	2,812.00	446,545,600	貸付有価証券 19,700株
日本郵船	140,600	1,701.00	239,160,600	貸付有価証券 700株
商船三井	99,700	2,708.00	269,987,600	
川崎汽船	51,800	1,227.00	63,558,600	貸付有価証券 34,500株
N S ユナイテッド海運	9,200	2,242.00	20,626,400	貸付有価証券 1,300株

明治海運	17,900	299.00	5,352,100	貸付有価証券 2,300株
飯野海運	79,600	327.00	26,029,200	貸付有価証券 200株
共栄タンカー	1,500	1,336.00	2,004,000	
乾汽船	15,100	944.00	14,254,400	貸付有価証券 2,500株
日本航空	307,700	3,306.00	1,017,256,200	貸付有価証券 19,300株
A N Aホールディングス	307,300	3,597.00	1,105,358,100	貸付有価証券 14,700株（1,900株）
パスコ	3,300	897.00	2,960,100	貸付有価証券 500株
トランコム	4,700	5,710.00	26,837,000	
日新	14,500	1,463.00	21,213,500	
三菱倉庫	58,200	2,644.00	153,880,800	貸付有価証券 9,400株
三井倉庫ホールディングス	20,600	1,608.00	33,124,800	
住友倉庫	61,900	1,405.00	86,969,500	貸付有価証券 7,700株
澁澤倉庫	9,200	1,843.00	16,955,600	貸付有価証券 1,000株
東陽倉庫	30,300	294.00	8,908,200	貸付有価証券 500株（200株）
日本トランスシティ	37,000	442.00	16,354,000	貸付有価証券 4,200株（100株）
ケイヒン	3,200	1,198.00	3,833,600	
中央倉庫	10,200	997.00	10,169,400	貸付有価証券 400株
川西倉庫	3,400	1,043.00	3,546,200	貸付有価証券 1,800株
安田倉庫	13,800	912.00	12,585,600	貸付有価証券 100株
ファイズ	3,000	749.00	2,247,000	貸付有価証券 1,500株（900株）
東洋埠頭	5,100	1,306.00	6,660,600	貸付有価証券 200株
宇徳	14,400	498.00	7,171,200	貸付有価証券 1,700株
上組	103,700	2,419.00	250,850,300	

サンリツ	4,000	641.00	2,564,000	貸付有価証券 400株
キムラユニティー	4,500	1,000.00	4,500,000	貸付有価証券 100株（100株）
キューソー流通システム	4,200	1,760.00	7,392,000	貸付有価証券 700株
近鉄エクスプレス	31,700	1,442.00	45,711,400	
東海運	9,600	280.00	2,688,000	貸付有価証券 1,300株
エーアイティー	10,900	894.00	9,744,600	貸付有価証券 1,400株
内外トランスライン	5,900	1,229.00	7,251,100	貸付有価証券 700株
日本コンセプト	5,300	1,321.00	7,001,300	貸付有価証券 800株
N E C ネットエスアイ	19,200	2,813.00	54,009,600	貸付有価証券 2,300株
クロスキャット	4,600	985.00	4,531,000	貸付有価証券 1,800株
システナ	62,100	1,534.00	95,261,400	
デジタルアーツ	9,300	7,700.00	71,610,000	
日鉄ソリューションズ	26,100	3,570.00	93,177,000	貸付有価証券 100株
キューブシステム	9,300	750.00	6,975,000	貸付有価証券 5,000株
エイジア	3,400	1,232.00	4,188,800	
コア	7,400	1,307.00	9,671,800	貸付有価証券 1,200株
ソリトンシステムズ	7,600	1,045.00	7,942,000	貸付有価証券 2,600株
ソフトクリエイトホールディングス	7,600	1,689.00	12,836,400	
T I S	58,100	6,380.00	370,678,000	
ネオス	7,000	744.00	5,208,000	貸付有価証券 4,600株（500株）
電算システム	6,600	2,811.00	18,552,600	貸付有価証券 800株
グリー	120,100	466.00	55,966,600	貸付有価証券 17,300株（800株）
コーエーテクモホールディングス	35,600	2,227.00	79,281,200	貸付有価証券 4,300株

三菱総合研究所	7,500	3,560.00	26,700,000	貸付有価証券 300株
ボルテージ	3,200	492.00	1,574,400	貸付有価証券 300株
電算	1,900	2,020.00	3,838,000	貸付有価証券 200株
A G S	9,800	657.00	6,438,600	貸付有価証券 300株
ファインデックス	14,700	1,005.00	14,773,500	貸付有価証券 4,600株（2,600株）
ブレインパッド	3,400	6,550.00	22,270,000	貸付有価証券 1,400株
K L a b	33,400	1,347.00	44,989,800	貸付有価証券 22,300株（900株）
ポールトゥウィン・ピット クルーホールディ	23,100	1,203.00	27,789,300	貸付有価証券 2,800株
イーブックイニシアティ ブジャパン	2,800	1,774.00	4,967,200	貸付有価証券 1,800株
ネクソン	494,000	1,405.00	694,070,000	貸付有価証券 329,900株（4,100株）
アイスタイル	44,700	738.00	32,988,600	貸付有価証券 29,800株（1,400株）
エムアップ	6,000	1,930.00	11,580,000	貸付有価証券 4,000株
エイチーム	12,000	1,121.00	13,452,000	貸付有価証券 7,900株（700株）
エニグモ	12,300	1,234.00	15,178,200	貸付有価証券 6,400株（4,800株）
テクノスジャパン	14,600	500.00	7,300,000	貸付有価証券 200株
e n i s h	7,700	1,189.00	9,155,300	貸付有価証券 5,100株（700株）
コロプラ	57,000	669.00	38,133,000	貸付有価証券 20,200株
オルトプラス	11,600	257.00	2,981,200	貸付有価証券 7,700株（1,600株）
ブロードリーフ	86,300	562.00	48,500,600	貸付有価証券 57,600株
クロス・マーケティング グループ	7,700	321.00	2,471,700	貸付有価証券 2,700株
デジタルハーツホール ディングス	7,900	940.00	7,426,000	貸付有価証券 2,000株

システム情報	8,800	1,032.00	9,081,600	貸付有価証券 3,600株（3,100株）
メディアドゥホールディングス	6,200	3,655.00	22,661,000	貸付有価証券 700株
じげん	24,600	581.00	14,292,600	貸付有価証券 4,500株
ブイキューブ	10,700	410.00	4,387,000	貸付有価証券 7,100株（1,500株）
エンカレッジ・テクノロジー	2,300	750.00	1,725,000	
サイバーリンクス	2,700	1,068.00	2,883,600	貸付有価証券 300株
ディー・エル・イー	12,300	179.00	2,201,700	貸付有価証券 8,200株（3,500株）
フィックスターズ	18,500	1,520.00	28,120,000	貸付有価証券 5,500株
CARTA HOLDINGS	8,400	950.00	7,980,000	貸付有価証券 2,700株
オブティム	7,600	2,860.00	21,736,000	貸付有価証券 3,800株（1,500株）
セレス	5,700	1,280.00	7,296,000	貸付有価証券 3,800株
ティーガイア	12,400	2,112.00	26,188,800	
セック	2,800	3,065.00	8,582,000	貸付有価証券 600株
日本アジアグループ	18,400	316.00	5,814,400	
豆蔵ホールディングス	11,800	1,690.00	19,942,000	
テクマトリックス	12,300	2,221.00	27,318,300	
プロシップ	5,000	1,170.00	5,850,000	貸付有価証券 300株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	42,000	2,338.00	98,196,000	貸付有価証券 27,800株
GMOペイメントゲートウェイ	28,700	7,970.00	228,739,000	貸付有価証券 13,500株（100株）
ザップラス	9,000	337.00	3,033,000	貸付有価証券 1,200株
システムリサーチ	2,300	3,920.00	9,016,000	
インターネットイニシアティブ	28,300	2,472.00	69,957,600	
さくらインターネット	20,700	589.00	12,192,300	貸付有価証券 2,500株

ヴィンクス	4,900	1,264.00	6,193,600	貸付有価証券 1,300株
GMOクラウド	3,200	2,584.00	8,268,800	貸付有価証券 2,100株
SRAホールディングス	9,200	2,506.00	23,055,200	
Minorisソリューションズ	3,400	1,804.00	6,133,600	貸付有価証券 100株（100株）
システムインテグレータ	4,900	648.00	3,175,200	貸付有価証券 2,000株
朝日ネット	14,100	695.00	9,799,500	
eBASE	10,400	986.00	10,254,400	
アバント	6,200	1,877.00	11,637,400	貸付有価証券 3,400株
アドソル日進	6,100	2,156.00	13,151,600	
フリービット	10,300	1,135.00	11,690,500	貸付有価証券 5,100株（3,600株）
コムチュア	9,800	3,900.00	38,220,000	貸付有価証券 2,500株（100株）
サイバーコム	3,100	1,671.00	5,180,100	貸付有価証券 1,100株
アステリア	11,600	625.00	7,250,000	貸付有価証券 2,000株（600株）
アイル	3,100	1,758.00	5,449,800	
マークラインズ	8,700	1,864.00	16,216,800	貸付有価証券 1,300株
メディカル・データ・ビジョン	13,200	1,077.00	14,216,400	貸付有価証券 2,600株
gumi	22,300	624.00	13,915,200	貸付有価証券 4,300株
ショーケース	4,100	738.00	3,025,800	貸付有価証券 2,700株
モバイルファクトリー	3,900	1,639.00	6,392,100	貸付有価証券 2,000株
テラスカイ	2,800	1,854.00	5,191,200	貸付有価証券 600株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	7,700	1,552.00	11,950,400	貸付有価証券 2,200株（800株）
PCIホールディングス	3,500	2,032.00	7,112,000	
パイブドHD	2,700	1,254.00	3,385,800	貸付有価証券 1,800株（1,400株）
アイピーシー	3,100	1,054.00	3,267,400	貸付有価証券

				1,200株
ネオジャパン	3,300	1,015.00	3,349,500	貸付有価証券 1,000株
P R T I M E S	1,500	2,988.00	4,482,000	
ランドコンピュータ	2,600	1,008.00	2,620,800	
ダブルスタンダード	1,500	4,380.00	6,570,000	貸付有価証券 400株
オープンドア	8,600	2,140.00	18,404,000	貸付有価証券 4,600株
マイネット	5,600	489.00	2,738,400	貸付有価証券 600株
アカツキ	6,100	7,320.00	44,652,000	貸付有価証券 1,200株
ベネフィットジャパン	1,300	1,633.00	2,122,900	貸付有価証券 800株（700株）
U b i c o mホールディングス	3,200	1,588.00	5,081,600	貸付有価証券 900株（300株）
L I N E	39,800	3,920.00	156,016,000	貸付有価証券 16,900株
カナミックネットワーク	10,600	598.00	6,338,800	
ノムラシステムコーポレーション	3,800	383.00	1,455,400	貸付有価証券 600株
チェンジ	3,500	2,084.00	7,294,000	貸付有価証券 2,200株（1,000株）
シンクロ・フード	7,400	472.00	3,492,800	貸付有価証券 2,100株
オークネット	10,700	1,231.00	13,171,700	貸付有価証券 1,700株
セグエグループ	1,400	1,337.00	1,871,800	貸付有価証券 100株
エイトレッド	1,800	1,753.00	3,155,400	貸付有価証券 1,000株
A O I T Y O H o l d i n g s	17,600	626.00	11,017,600	貸付有価証券 2,300株
マクロミル	30,900	938.00	28,984,200	貸付有価証券 3,900株
ビーグリー	3,400	879.00	2,988,600	
オロ	4,600	2,583.00	11,881,800	貸付有価証券 2,600株（1,400株）
テモナ	2,300	582.00	1,338,600	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
ニーズウェル	2,100	715.00	1,501,500	貸付有価証券

			400株
サインポスト	2,700	2,227.00	6,012,900 貸付有価証券 1,800株（1,100株）
ソルクシーズ	7,400	881.00	6,519,400 貸付有価証券 1,000株
フェイス	6,900	734.00	5,064,600
プロトコーポレーション	15,600	1,164.00	18,158,400
ハイマックス	2,100	1,844.00	3,872,400 貸付有価証券 100株
野村総合研究所	332,300	2,180.00	724,414,000 貸付有価証券 40,500株
サイバネットシステム	12,400	603.00	7,477,200 貸付有価証券 1,500株
C E ホールディングス	5,000	1,022.00	5,110,000 貸付有価証券 2,800株
日本システム技術	2,800	1,189.00	3,329,200 貸付有価証券 300株
インテージホールディングス	21,700	894.00	19,399,800 貸付有価証券 14,400株
東邦システムサイエンス	5,200	960.00	4,992,000 貸付有価証券 3,400株
ソースネクスト	67,500	467.00	31,522,500 貸付有価証券 32,600株（16,800株）
インフォコム	19,000	2,520.00	47,880,000
F I G	18,800	300.00	5,640,000 貸付有価証券 2,700株
アルテリア・ネットワークス	19,300	1,434.00	27,676,200 貸付有価証券 200株
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,900	1,698.00	6,622,200 貸付有価証券 400株
フォーカスシステムズ	11,700	828.00	9,687,600
クレスコ	5,300	3,390.00	17,967,000 貸付有価証券 700株
フジ・メディア・ホールディングス	180,700	1,376.00	248,643,200
オービック	60,400	12,200.00	736,880,000
ジャストシステム	24,800	3,630.00	90,024,000
T D C ソフト	15,200	720.00	10,944,000
ヤフー	1,135,500	284.00	322,482,000 貸付有価証券 4,500株
トレンドマイクロ	77,400	5,060.00	391,644,000 貸付有価証券

				49,500株（6,800株）
I Dホールディングス	6,600	1,193.00	7,873,800	貸付有価証券 1,200株
日本オラクル	35,300	9,110.00	321,583,000	貸付有価証券 12,900株
アルファシステムズ	5,400	2,602.00	14,050,800	貸付有価証券 600株
フューチャー	21,000	1,779.00	37,359,000	貸付有価証券 2,500株
C A C H o l d i n g s	11,300	1,335.00	15,085,500	貸付有価証券 6,800株（1,500株）
ソフトバンク・テクノロ ジー	7,400	2,016.00	14,918,400	貸付有価証券 2,400株
トーセ	4,700	812.00	3,816,400	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	4,330.00	77,074,000	貸付有価証券 3,600株（1,300株）
伊藤忠テクノソリュー ションズ	79,300	3,015.00	239,089,500	貸付有価証券 9,700株
アイティフォー	21,100	844.00	17,808,400	貸付有価証券 2,500株
東計電算	2,600	2,983.00	7,755,800	貸付有価証券 300株
エックスネット	3,200	929.00	2,972,800	
大塚商会	94,200	3,955.00	372,561,000	貸付有価証券 19,900株（900株）
サイボウズ	20,400	1,047.00	21,358,800	貸付有価証券 2,600株
ソフトブレーン	10,200	584.00	5,956,800	貸付有価証券 1,500株
電通国際情報サービス	10,800	3,395.00	36,666,000	貸付有価証券 1,500株
デジタルガレージ	33,900	3,520.00	119,328,000	貸付有価証券 11,400株（800株）
E Mシステムズ	14,200	1,900.00	26,980,000	貸付有価証券 5,100株（2,500株）
ウェザーニューズ	5,900	3,140.00	18,526,000	貸付有価証券 700株
C I J	12,900	820.00	10,578,000	貸付有価証券 1,600株
東洋ビジネスエンジニア リング	1,700	2,619.00	4,452,300	貸付有価証券 200株

日本エンタープライズ	17,700	171.00	3,026,700	貸付有価証券 2,200株
WOWOW	8,300	2,530.00	20,999,000	貸付有価証券 4,500株
スカラ	12,200	1,007.00	12,285,400	貸付有価証券 1,600株（100株）
インテリジェント ウェ イブ	6,500	802.00	5,213,000	貸付有価証券 1,500株
I M A G I C A G R O U P	14,700	464.00	6,820,800	貸付有価証券 6,000株（2,400株）
ネットワンシステムズ	61,600	2,960.00	182,336,000	貸付有価証券 300株
システムソフト	41,200	107.00	4,408,400	貸付有価証券 500株
アルゴグラフィックス	14,800	2,559.00	37,873,200	
マーベラス	26,600	803.00	21,359,800	貸付有価証券 9,000株（4,000株）
エイベックス	29,800	1,248.00	37,190,400	貸付有価証券 3,600株
日本ユニシス	54,400	3,385.00	184,144,000	
兼松エレクトロニクス	9,500	2,974.00	28,253,000	貸付有価証券 1,100株
東京放送ホールディング ス	115,500	1,687.00	194,848,500	貸付有価証券 15,300株
日本テレビホールディン グス	159,900	1,371.00	219,222,900	貸付有価証券 1,900株
朝日放送グループホール ディングス	17,300	703.00	12,161,900	貸付有価証券 9,300株
テレビ朝日ホールディン グス	47,800	1,655.00	79,109,000	貸付有価証券 26,000株
スカパー J S A T ホール ディングス	114,600	420.00	48,132,000	
テレビ東京ホールディン グス	14,300	2,114.00	30,230,200	貸付有価証券 1,700株
日本 B S 放送	5,900	1,055.00	6,224,500	貸付有価証券 800株
ビジョン	5,400	4,790.00	25,866,000	貸付有価証券 2,700株
スマートバリュー	5,100	736.00	3,753,600	貸付有価証券 1,700株
U S E N - N E X T H O L D I N G S	6,600	812.00	5,359,200	貸付有価証券 2,900株（500株）

ワイヤレスゲート	8,200	719.00	5,895,800	貸付有価証券 5,400株（800株）
コネクシオ	12,300	1,359.00	16,715,700	貸付有価証券 1,500株
日本通信	152,500	188.00	28,670,000	貸付有価証券 101,800株（33,200株）
クロップス	3,200	601.00	1,923,200	貸付有価証券 600株
日本電信電話	1,191,200	5,056.00	6,022,707,200	
K D D I	1,427,700	2,821.50	4,028,255,550	
ソフトバンク	1,846,500	1,500.00	2,769,750,000	貸付有価証券 343,000株
光通信	20,500	24,630.00	504,915,000	
N T T ドコモ	1,102,700	2,684.00	2,959,646,800	貸付有価証券 139,000株
エムティーアイ	16,800	691.00	11,608,800	貸付有価証券 2,100株
G M O インターネット	68,600	1,858.00	127,458,800	貸付有価証券 8,700株
ファイバーゲート	3,300	1,681.00	5,547,300	貸付有価証券 1,900株（600株）
アイドママーケティング コミュニケーション	3,700	531.00	1,964,700	
K A D O K A W A	50,800	1,581.00	80,314,800	貸付有価証券 500株
学研ホールディングス	5,800	5,250.00	30,450,000	貸付有価証券 700株
ゼンリン	34,700	1,789.00	62,078,300	
昭文社	8,000	355.00	2,840,000	
インプレスホールディングス	14,400	141.00	2,030,400	貸付有価証券 2,400株
アイネット	9,800	1,347.00	13,200,600	貸付有価証券 600株
松竹	11,500	12,550.00	144,325,000	貸付有価証券 7,500株
東宝	114,600	4,580.00	524,868,000	貸付有価証券 15,500株
東映	7,300	15,000.00	109,500,000	貸付有価証券 4,000株
エヌ・ティ・ティ・データ	463,700	1,374.00	637,123,800	貸付有価証券 56,700株

ピー・シー・エー	2,200	4,035.00	8,877,000	貸付有価証券 1,200株（900株）
ビジネスブレイン太田昭和	3,000	2,506.00	7,518,000	貸付有価証券 100株
D T S	38,900	2,232.00	86,824,800	貸付有価証券 200株
スクウェア・エニックス・ホールディングス	81,000	4,135.00	334,935,000	貸付有価証券 9,900株
シーイーシー	18,600	2,226.00	41,403,600	貸付有価証券 2,200株
カプコン	74,600	2,854.00	212,908,400	
アイ・エス・ビー	3,400	1,534.00	5,215,600	貸付有価証券 400株
ジャステック	11,100	1,065.00	11,821,500	貸付有価証券 1,300株
S C S K	45,900	5,190.00	238,221,000	
日本システムウエア	5,700	2,442.00	13,919,400	
アイネス	22,100	1,083.00	23,934,300	
T K C	14,700	4,475.00	65,782,500	
富士ソフト	22,300	4,545.00	101,353,500	貸付有価証券 2,800株
N S D	28,600	3,150.00	90,090,000	貸付有価証券 7,800株
コナミホールディングス	71,200	5,030.00	358,136,000	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	2,129.00	12,135,300	
J B C C ホールディングス	13,700	1,545.00	21,166,500	
ミロク情報サービス	17,300	2,781.00	48,111,300	貸付有価証券 10,900株（6,700株）
ソフトバンクグループ	1,381,900	4,668.00	6,450,709,200	
ハウスイ	1,400	793.00	1,110,200	貸付有価証券 100株
高千穂交易	6,700	1,070.00	7,169,000	貸付有価証券 1,000株
伊藤忠食品	4,300	4,175.00	17,952,500	貸付有価証券 500株
エレマテック	16,300	971.00	15,827,300	
J A L U X	4,900	2,261.00	11,078,900	貸付有価証券 2,900株

あらた	12,900	3,690.00	47,601,000	
トーメンデバイス	2,600	2,294.00	5,964,400	貸付有価証券 1,400株
東京エレクトロン デバ イス	6,300	2,014.00	12,688,200	
フィールズ	15,300	486.00	7,435,800	貸付有価証券 1,900株
双日	965,500	336.00	324,408,000	貸付有価証券 800株
アルフレッサ ホール ディングス	194,300	2,438.00	473,703,400	貸付有価証券 200株
横浜冷凍	49,000	1,027.00	50,323,000	貸付有価証券 300株
神栄	2,400	791.00	1,898,400	貸付有価証券 200株
ラサ商事	9,200	808.00	7,433,600	貸付有価証券 800株
ラクーンホールディング ス	8,400	631.00	5,300,400	貸付有価証券 1,000株
アルコニックス	18,500	1,177.00	21,774,500	貸付有価証券 1,000株
神戸物産	30,200	5,220.00	157,644,000	貸付有価証券 9,900株
あい ホールディングス	24,900	1,750.00	43,575,000	貸付有価証券 3,100株
ディービーエックス	6,800	758.00	5,154,400	貸付有価証券 900株
ダイワボウホールディン グス	15,900	4,080.00	64,872,000	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	48,500	1,440.00	69,840,000	
ラクト・ジャパン	6,500	3,635.00	23,627,500	貸付有価証券 4,300株
バイタルケーエスケー・ ホールディングス	32,900	1,034.00	34,018,600	貸付有価証券 9,000株
八洲電機	13,500	878.00	11,853,000	貸付有価証券 7,400株
メディアスホールディン グス	9,900	666.00	6,593,400	貸付有価証券 1,600株
レスターホールディング ス	19,200	1,749.00	33,580,800	貸付有価証券 500株
ジューテックホールディ	4,000	926.00	3,704,000	

ングス				
大光	7,400	638.00	4,721,200	貸付有価証券 1,500株
O C H I ホールディングス	5,100	1,139.00	5,808,900	
T O K A I ホールディングス	92,400	992.00	91,660,800	貸付有価証券 2,300株
黒谷	4,000	429.00	1,716,000	貸付有価証券 2,600株
C o m i n i x	3,000	777.00	2,331,000	
三洋貿易	8,800	2,156.00	18,972,800	
ビューティガレージ	2,800	1,875.00	5,250,000	貸付有価証券 400株
ウイン・パートナーズ	11,300	1,059.00	11,966,700	貸付有価証券 800株
ミタチ産業	5,200	657.00	3,416,400	貸付有価証券 700株
シップヘルスケアホールディングス	36,400	4,650.00	169,260,000	貸付有価証券 4,400株
明治電機工業	5,500	1,316.00	7,238,000	
デリカフーズホールディングス	6,100	718.00	4,379,800	貸付有価証券 600株
スターティアホールディングス	3,400	505.00	1,717,000	貸付有価証券 100株
コメダホールディングス	40,600	1,961.00	79,616,600	貸付有価証券 7,100株（100株）
富士興産	6,700	700.00	4,690,000	貸付有価証券 4,400株
協栄産業	2,100	1,317.00	2,765,700	
小野建	15,700	1,306.00	20,504,200	貸付有価証券 400株
南陽	3,600	1,515.00	5,454,000	貸付有価証券 400株
佐鳥電機	12,900	798.00	10,294,200	貸付有価証券 1,700株
エコトレーディング	4,000	517.00	2,068,000	貸付有価証券 1,200株
伯東	12,000	1,118.00	13,416,000	貸付有価証券 1,400株
コンドーテック	13,500	869.00	11,731,500	
中山福	10,000	492.00	4,920,000	

ナガイレーベン	25,300	2,161.00	54,673,300	貸付有価証券 3,700株
三菱食品	19,200	2,551.00	48,979,200	貸付有価証券 2,300株
松田産業	12,700	1,418.00	18,008,600	
第一興商	26,000	4,680.00	121,680,000	
メディカルホールディング グス	188,600	2,304.00	434,534,400	
S P K	3,700	2,363.00	8,743,100	
萩原電気ホールディング ス	6,500	2,747.00	17,855,500	
アズワン	12,500	8,930.00	111,625,000	貸付有価証券 1,500株
スズデン	6,100	1,308.00	7,978,800	貸付有価証券 600株（500株）
尾家産業	5,600	1,128.00	6,316,800	貸付有価証券 500株
シモジマ	10,700	1,051.00	11,245,700	貸付有価証券 1,300株
ドウシシャ	16,500	1,750.00	28,875,000	
小津産業	3,800	1,754.00	6,665,200	貸付有価証券 400株
高速	10,400	1,203.00	12,511,200	
たけびし	6,100	1,264.00	7,710,400	
リックス	3,900	1,478.00	5,764,200	貸付有価証券 200株
丸文	15,500	545.00	8,447,500	
ハビネット	14,600	1,248.00	18,220,800	貸付有価証券 200株
橋本総業ホールディング ス	3,500	1,497.00	5,239,500	貸付有価証券 200株
日本ライフライン	51,800	1,690.00	87,542,000	貸付有価証券 26,100株（2,200株）
タカショー	8,500	454.00	3,859,000	貸付有価証券 300株
エクセル	6,500	1,119.00	7,273,500	
マルカ	6,200	1,915.00	11,873,000	貸付有価証券 600株
I D O M	58,900	417.00	24,561,300	貸付有価証券 14,300株（3,900株）
日本エム・ディ・エム	10,200	1,767.00	18,023,400	貸付有価証券

				900株
進和	10,300	2,037.00	20,981,100	貸付有価証券 1,300株
エスケイジャパン	4,200	399.00	1,675,800	貸付有価証券 2,800株（1,200株）
ダイトロン	7,400	1,214.00	8,983,600	貸付有価証券 900株
シークス	22,200	1,424.00	31,612,800	貸付有価証券 6,000株
田中商事	5,800	615.00	3,567,000	貸付有価証券 800株
オーハシテクニカ	9,800	1,376.00	13,484,800	貸付有価証券 800株
白銅	5,600	1,295.00	7,252,000	
伊藤忠商事	1,222,700	2,190.00	2,677,713,000	
丸紅	1,723,800	695.70	1,199,247,660	
高島	2,800	1,526.00	4,272,800	
長瀬産業	98,300	1,450.00	142,535,000	貸付有価証券 12,000株
蝶理	11,200	1,645.00	18,424,000	貸付有価証券 200株
豊田通商	195,100	3,470.00	676,997,000	
三共生興	29,800	490.00	14,602,000	貸付有価証券 3,800株
兼松	69,800	1,215.00	84,807,000	貸付有価証券 200株
ツカモトコーポレーショ ン	3,100	1,022.00	3,168,200	
三井物産	1,440,200	1,719.00	2,475,703,800	貸付有価証券 147,500株
日本紙パルプ商事	9,900	3,815.00	37,768,500	
日立ハイテクノロジーズ	53,100	5,860.00	311,166,000	
カメイ	22,800	1,022.00	23,301,600	貸付有価証券 700株
東都水産	2,400	2,544.00	6,105,600	貸付有価証券 1,400株
ＯＵＧホールディングス	2,800	2,685.00	7,518,000	貸付有価証券 1,500株
スターゼン	6,400	4,000.00	25,600,000	
山善	68,300	945.00	64,543,500	貸付有価証券 8,300株

椿本興業	3,900	3,275.00	12,772,500	
住友商事	1,033,900	1,655.50	1,711,621,450	貸付有価証券 126,500株
内田洋行	7,500	3,660.00	27,450,000	貸付有価証券 1,000株
三菱商事	1,226,700	2,705.00	3,318,223,500	
第一実業	7,900	2,715.00	21,448,500	貸付有価証券 900株
キヤノンマーケティング ジャパン	50,000	2,140.00	107,000,000	貸付有価証券 13,000株
西華産業	9,900	1,264.00	12,513,600	
佐藤商事	15,600	792.00	12,355,200	貸付有価証券 1,900株
菱洋エレクトロ	17,700	1,798.00	31,824,600	貸付有価証券 2,100株
東京産業	17,400	467.00	8,125,800	
ユアサ商事	17,900	2,957.00	52,930,300	貸付有価証券 2,100株
神鋼商事	3,900	2,221.00	8,661,900	
小林産業	10,400	270.00	2,808,000	貸付有価証券 1,700株
阪和興業	30,300	2,910.00	88,173,000	貸付有価証券 900株
正栄食品工業	11,300	3,020.00	34,126,000	貸付有価証券 7,500株
カナデン	15,800	1,255.00	19,829,000	貸付有価証券 2,000株
菱電商事	13,800	1,605.00	22,149,000	
フルサト工業	9,600	1,377.00	13,219,200	
岩谷産業	38,800	3,540.00	137,352,000	貸付有価証券 16,800株（11,900株）
すてきナイスグループ	7,400	627.00	4,639,800	貸付有価証券 4,000株
昭光通商	5,600	616.00	3,449,600	貸付有価証券 600株
ニチモウ	2,700	1,780.00	4,806,000	
極東貿易	5,400	1,669.00	9,012,600	
イワキ	22,900	483.00	11,060,700	貸付有価証券 2,500株
三愛石油	46,900	988.00	46,337,200	貸付有価証券 5,700株

稲畑産業	42,000	1,297.00	54,474,000	貸付有価証券 27,900株
G S I クレオス	4,600	1,003.00	4,613,800	
明和産業	16,100	569.00	9,160,900	貸付有価証券 10,700株
クワザワ	6,200	398.00	2,467,600	貸付有価証券 700株
ワキタ	37,300	1,036.00	38,642,800	貸付有価証券 4,600株
東邦ホールディングス	51,800	2,493.00	129,137,400	貸付有価証券 20,600株（12,300株）
サンゲツ	51,500	2,003.00	103,154,500	
ミツウロコグループホールディングス	23,200	931.00	21,599,200	貸付有価証券 3,100株
シナネンホールディングス	7,200	1,709.00	12,304,800	貸付有価証券 100株
伊藤忠エネクス	38,600	833.00	32,153,800	貸付有価証券 800株
サンリオ	54,000	2,016.00	108,864,000	貸付有価証券 2,000株
サンワテクノス	10,600	775.00	8,215,000	
リョーサン	19,300	2,690.00	51,917,000	
新光商事	16,400	1,874.00	30,733,600	貸付有価証券 2,500株
トーヨー	7,900	1,725.00	13,627,500	貸付有価証券 900株
三信電気	12,000	1,527.00	18,324,000	
東陽テクニカ	20,100	1,045.00	21,004,500	
モスフードサービス	22,900	2,344.00	53,677,600	貸付有価証券 12,500株
加賀電子	17,400	1,670.00	29,058,000	貸付有価証券 100株
ソーダニッカ	18,000	515.00	9,270,000	貸付有価証券 100株
立花エレクトック	12,900	1,524.00	19,659,600	
フォーバル	7,600	928.00	7,052,800	貸付有価証券 900株
P A L T A C	31,500	5,160.00	162,540,000	貸付有価証券 3,800株
三谷産業	20,400	286.00	5,834,400	貸付有価証券 3,400株

太平洋興発	6,900	748.00	5,161,200	
西本W i s m e t t a c ホールディングス	3,200	3,245.00	10,384,000	
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,400	1,249.00	1,748,600	貸付有価証券 100株
国際紙パルプ商事	40,800	299.00	12,199,200	貸付有価証券 7,000株
ヤマタネ	8,800	1,294.00	11,387,200	
丸紅建材リース	1,700	1,669.00	2,837,300	
日鉄物産	12,500	4,085.00	51,062,500	
泉州電業	5,400	2,572.00	13,888,800	貸付有価証券 700株
トラスコ中山	36,400	2,429.00	88,415,600	貸付有価証券 18,300株（2,300株）
オートバックスセブン	69,500	1,771.00	123,084,500	貸付有価証券 46,200株
モリト	12,700	779.00	9,893,300	貸付有価証券 2,500株
加藤産業	27,300	3,115.00	85,039,500	貸付有価証券 3,000株
北恵	3,300	919.00	3,032,700	貸付有価証券 400株
イノテック	10,400	874.00	9,089,600	貸付有価証券 1,200株
イエローハット	33,000	1,541.00	50,853,000	
J Kホールディングス	15,800	492.00	7,773,600	貸付有価証券 1,700株
日伝	14,500	1,950.00	28,275,000	貸付有価証券 7,900株
北沢産業	13,100	261.00	3,419,100	貸付有価証券 1,800株（200株）
杉本商事	9,400	1,879.00	17,662,600	
因幡電機産業	24,900	4,640.00	115,536,000	
東テク	5,800	2,014.00	11,681,200	
ミスミグループ本社	218,900	2,443.00	534,772,700	貸付有価証券 29,300株
アルテック	13,900	202.00	2,807,800	貸付有価証券 2,700株
タキヒヨー	5,300	1,749.00	9,269,700	貸付有価証券 900株
蔵王産業	2,800	1,363.00	3,816,400	

スズケン	79,700	5,670.00	451,899,000	
ジェコス	12,000	840.00	10,080,000	
グローセル	16,000	403.00	6,448,000	貸付有価証券 1,200株
ローソン	44,200	5,310.00	234,702,000	貸付有価証券 29,500株
サンエー	13,200	4,510.00	59,532,000	貸付有価証券 2,300株
カワチ薬品	13,500	1,973.00	26,635,500	貸付有価証券 1,600株
エービーシー・マート	27,300	6,810.00	185,913,000	貸付有価証券 9,300株
ハードオフコーポレーション	6,900	705.00	4,864,500	
アスクル	18,300	3,035.00	55,540,500	貸付有価証券 7,800株（400株）
ゲオホールディングス	26,600	1,302.00	34,633,200	貸付有価証券 1,900株
アダストリア	24,200	2,260.00	54,692,000	貸付有価証券 9,800株
ジーフット	10,600	614.00	6,508,400	貸付有価証券 1,500株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,200	675.00	1,485,000	貸付有価証券 200株
くら寿司	9,100	4,185.00	38,083,500	貸付有価証券 6,000株（2,600株）
キャンドゥ	8,300	1,611.00	13,371,300	貸付有価証券 1,700株
パルグループホールディングス	8,900	3,375.00	30,037,500	貸付有価証券 1,000株
エディオン	74,100	1,021.00	75,656,100	貸付有価証券 18,000株（3,000株）
サーラコーポレーション	35,500	590.00	20,945,000	貸付有価証券 4,500株
ワッツ	7,700	613.00	4,720,100	貸付有価証券 1,600株
ハローズ	6,600	2,099.00	13,853,400	貸付有価証券 800株
フジオフードシステム	7,400	2,732.00	20,216,800	貸付有価証券 800株
あみやき亭	3,800	3,375.00	12,825,000	
ひらまつ	34,800	340.00	11,832,000	貸付有価証券

				4,200株
大黒天物産	4,200	3,205.00	13,461,000	貸付有価証券 500株
ハニーズホールディングス	15,400	1,421.00	21,883,400	貸付有価証券 1,800株
ファーマライズホールディングス	4,100	554.00	2,271,400	貸付有価証券 500株
アルペン	13,400	1,586.00	21,252,400	貸付有価証券 2,000株
ハブ	5,600	1,142.00	6,395,200	貸付有価証券 600株
クオールホールディングス	25,700	1,404.00	36,082,800	
ジンズホールディングス	9,200	6,280.00	57,776,000	貸付有価証券 1,100株
ビックカメラ	103,700	1,020.00	105,774,000	貸付有価証券 61,900株
D C Mホールディングス	94,300	1,028.00	96,940,400	貸付有価証券 62,900株
ペッパーフードサービス	13,900	1,588.00	22,073,200	貸付有価証券 9,300株（2,900株）
M o n o t a R O	124,300	2,594.00	322,434,200	貸付有価証券 61,800株（12,500株）
東京一番フーズ	4,400	610.00	2,684,000	
D Dホールディングス	7,800	1,468.00	11,450,400	貸付有価証券 1,000株（200株）
きちりホールディングス	4,700	717.00	3,369,900	貸付有価証券 800株
アークランドサービス ホールディングス	12,800	1,909.00	24,435,200	貸付有価証券 1,800株
J・フロント リテイ リング	223,600	1,211.00	270,779,600	貸付有価証券 149,300株（15,300 株）
ドトール・日レスホール ディングス	30,700	2,031.00	62,351,700	貸付有価証券 3,900株
マツモトキヨシホール ディングス	72,300	3,900.00	281,970,000	貸付有価証券 9,300株
ブロンコビリー	9,100	2,275.00	20,702,500	貸付有価証券 6,000株（400株）
Z O Z O	188,900	2,085.00	393,856,500	貸付有価証券 14,400株
トレジャー・ファクト	5,100	1,263.00	6,441,300	貸付有価証券

リー				600株
物語コーポレーション	4,300	9,570.00	41,151,000	貸付有価証券 500株
ココカラファイン	19,700	5,860.00	115,442,000	
三越伊勢丹ホールディングス	327,100	803.00	262,661,300	貸付有価証券 600株
H a m e e	5,300	782.00	4,144,600	貸付有価証券 3,500株
ウエルシアホールディングス	46,200	5,390.00	249,018,000	貸付有価証券 30,800株
クリエイティブ S D ホールディングス	25,800	2,342.00	60,423,600	貸付有価証券 3,100株
丸善 C H I ホールディングス	20,400	372.00	7,588,800	貸付有価証券 2,600株
ミサワ	3,100	441.00	1,367,100	貸付有価証券 1,300株（1,000株）
ティーライフ	2,300	833.00	1,915,900	貸付有価証券 900株
エー・ピーカンパニー	3,300	525.00	1,732,500	貸付有価証券 1,700株
チムニー	5,300	2,395.00	12,693,500	貸付有価証券 3,600株
シュッピン	11,900	953.00	11,340,700	貸付有価証券 2,200株
ネクステージ	24,900	1,104.00	27,489,600	貸付有価証券 3,200株
ジョイフル本田	51,200	1,315.00	67,328,000	貸付有価証券 7,900株
鳥貴族	5,800	2,139.00	12,406,200	貸付有価証券 3,800株（600株）
キリン堂ホールディングス	6,900	1,806.00	12,461,400	貸付有価証券 800株
ホットランド	10,200	1,175.00	11,985,000	貸付有価証券 6,800株（200株）
すかいらくホールディングス	195,900	1,836.00	359,672,400	貸付有価証券 130,700株
S F P ホールディングス	7,500	2,063.00	15,472,500	貸付有価証券 1,900株
綿半ホールディングス	6,500	2,183.00	14,189,500	貸付有価証券 4,100株
ヨシックス	2,800	3,185.00	8,918,000	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	50,800	935.00	47,498,000	貸付有価証券 7,100株
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,100	677.00	5,483,700	貸付有価証券 900株
B E E N O S	6,100	1,231.00	7,509,100	貸付有価証券 3,300株
あさひ	14,500	1,206.00	17,487,000	貸付有価証券 3,600株（1,800株）
日本調剤	6,200	3,715.00	23,033,000	
コスモス薬品	7,700	21,420.00	164,934,000	貸付有価証券 5,100株
トーエル	8,400	680.00	5,712,000	貸付有価証券 1,000株
オンリー	3,000	780.00	2,340,000	貸付有価証券 400株
セブン & アイ・ホールディングス	732,700	3,855.00	2,824,558,500	貸付有価証券 477,600株（92,200株）
クリエイト・レストランツ・ホールディング	47,000	1,616.00	75,952,000	貸付有価証券 13,600株
ツルハホールディングス	38,000	11,560.00	439,280,000	貸付有価証券 15,400株（700株）
サンマルクホールディングス	13,800	2,420.00	33,396,000	
フェリシモ	3,900	999.00	3,896,100	貸付有価証券 500株
トリドールホールディングス	21,600	2,463.00	53,200,800	貸付有価証券 11,200株
T O K Y O B A S E	15,700	890.00	13,973,000	貸付有価証券 5,300株（2,900株）
ウイルプラスホールディングス	2,700	810.00	2,187,000	貸付有価証券 100株
ジャパンミート	8,800	2,059.00	18,119,200	貸付有価証券 1,000株
サッドラホールディングス	2,600	1,733.00	4,505,800	貸付有価証券 500株
デファクトスタンダード	1,500	308.00	462,000	貸付有価証券 300株
アレンザホールディングス	9,400	783.00	7,360,200	貸付有価証券 1,800株
串カツ田中ホールディングス	2,700	2,054.00	5,545,800	貸付有価証券 1,800株

パロックジャパンリミテッド	14,100	1,021.00	14,396,100	貸付有価証券 1,700株
クスリのアオキホールディングス	17,400	8,100.00	140,940,000	貸付有価証券 10,000株
力の源ホールディングス	6,600	860.00	5,676,000	貸付有価証券 4,300株
スシローグローバルホールディングス	19,200	6,990.00	134,208,000	貸付有価証券 12,300株
L I X I L ビバ	14,800	1,407.00	20,823,600	
メディカルシステムネットワーク	18,600	504.00	9,374,400	貸付有価証券 9,500株
はるやまホールディングス	8,200	783.00	6,420,600	貸付有価証券 1,100株
ノジマ	31,100	1,745.00	54,269,500	貸付有価証券 400株
カップ・クリエイト	24,500	1,383.00	33,883,500	貸付有価証券 16,300株（500株）
ライトオン	13,100	640.00	8,384,000	貸付有価証券 8,700株
ジーンズメイト	5,300	312.00	1,653,600	貸付有価証券 2,300株（1,100株）
良品計画	247,600	1,954.00	483,810,400	貸付有価証券 81,700株（5,000株）
三城ホールディングス	21,600	303.00	6,544,800	貸付有価証券 300株（200株）
アドヴァン	26,700	1,139.00	30,411,300	貸付有価証券 3,200株
アルビス	6,600	2,378.00	15,694,800	貸付有価証券 3,600株
コナカ	20,600	425.00	8,755,000	貸付有価証券 100株（100株）
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,580.00	3,318,000	貸付有価証券 200株
G - 7ホールディングス	5,100	3,170.00	16,167,000	
イオン北海道	17,600	730.00	12,848,000	貸付有価証券 2,500株
コジマ	30,100	449.00	13,514,900	貸付有価証券 13,500株
ヒマラヤ	6,100	786.00	4,794,600	貸付有価証券 800株
コーナン商事	22,900	2,323.00	53,196,700	貸付有価証券 2,800株

エコス	6,400	1,543.00	9,875,200	貸付有価証券 700株
ワタミ	23,000	1,426.00	32,798,000	貸付有価証券 12,600株
マルシェ	4,600	776.00	3,569,600	貸付有価証券 2,500株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	418,800	1,655.00	693,114,000	貸付有価証券 86,800株
西松屋チェーン	38,300	895.00	34,278,500	貸付有価証券 5,000株
ゼンショーホールディン グス	85,000	2,369.00	201,365,000	貸付有価証券 56,700株（300株）
幸楽苑ホールディングス	11,100	2,446.00	27,150,600	貸付有価証券 1,800株
ハークスレイ	3,600	1,010.00	3,636,000	
サイゼリヤ	28,800	2,646.00	76,204,800	貸付有価証券 3,900株（400株）
V Tホールディングス	78,900	447.00	35,268,300	貸付有価証券 200株
魚力	4,800	1,544.00	7,411,200	貸付有価証券 2,700株
ポブラ	4,500	479.00	2,155,500	貸付有価証券 3,000株
フジ・コーポレーション	4,600	2,160.00	9,936,000	貸付有価証券 500株
ユナイテッドアローズ	20,000	3,320.00	66,400,000	貸付有価証券 2,800株
ハイデイ日高	25,200	2,097.00	52,844,400	貸付有価証券 3,400株
京都きもの友禅	11,100	339.00	3,762,900	貸付有価証券 5,400株
コロワイド	58,100	2,072.00	120,383,200	貸付有価証券 38,900株（4,500株）
ピーシーデポコーポレー ション	23,200	483.00	11,205,600	貸付有価証券 100株
壱番屋	12,300	5,090.00	62,607,000	貸付有価証券 3,800株
トップカルチャー	6,300	335.00	2,110,500	貸付有価証券 4,200株（2,200株）
P L A N T	4,500	691.00	3,109,500	貸付有価証券 2,400株
スギホールディングス	38,400	5,580.00	214,272,000	貸付有価証券

				10,500株
薬王堂ホールディングス	7,600	2,419.00	18,384,400	貸付有価証券 300株
ヴィア・ホールディングス	21,400	658.00	14,081,200	貸付有価証券 3,700株（900株）
スクロール	26,900	327.00	8,796,300	貸付有価証券 3,300株
ヨンドシーホールディングス	19,400	2,567.00	49,799,800	貸付有価証券 11,400株
ファミリーマート	195,500	2,538.00	496,179,000	貸付有価証券 98,100株（11,500株）
木曽路	21,400	2,604.00	55,725,600	貸付有価証券 11,700株
S R S ホールディングス	20,600	1,030.00	21,218,000	貸付有価証券 11,200株（300株）
千趣会	31,600	301.00	9,511,600	貸付有価証券 21,000株
タカキュー	13,500	172.00	2,322,000	貸付有価証券 4,000株（300株）
ケーヨー	32,300	472.00	15,245,600	貸付有価証券 7,200株（100株）
上新電機	20,600	1,957.00	40,314,200	貸付有価証券 2,500株
日本瓦斯	27,600	3,105.00	85,698,000	
ロイヤルホールディングス	30,500	2,579.00	78,659,500	貸付有価証券 20,200株
東天紅	1,300	1,209.00	1,571,700	貸付有価証券 100株
いなげや	19,500	1,524.00	29,718,000	貸付有価証券 12,900株
島忠	36,900	2,557.00	94,353,300	貸付有価証券 24,600株
チヨダ	18,300	1,535.00	28,090,500	貸付有価証券 2,200株
ライフコーポレーション	13,300	2,062.00	27,424,600	貸付有価証券 1,600株
リンガーハット	21,500	2,484.00	53,406,000	貸付有価証券 3,100株
Mr M a x H D	24,000	435.00	10,440,000	貸付有価証券 3,800株
テンアライド	16,100	439.00	7,067,900	貸付有価証券 10,700株

A O K Iホールディングス	35,000	1,042.00	36,470,000	貸付有価証券 100株
オークワ	24,900	1,138.00	28,336,200	貸付有価証券 7,100株
コメリ	27,000	2,153.00	58,131,000	貸付有価証券 500株
青山商事	30,500	1,860.00	56,730,000	
しまむら	20,300	8,200.00	166,460,000	貸付有価証券 6,300株（200株）
はせがわ	9,200	402.00	3,698,400	貸付有価証券 400株（400株）
高島屋	137,100	1,179.00	161,640,900	貸付有価証券 29,700株（2,900株）
松屋	35,200	767.00	26,998,400	貸付有価証券 5,100株
エイチ・ツー・オー リ テイリング	89,700	1,128.00	101,181,600	
近鉄百貨店	6,700	2,993.00	20,053,100	貸付有価証券 900株
パルコ	16,800	1,258.00	21,134,400	貸付有価証券 6,200株
丸井グループ	147,900	2,115.00	312,808,500	貸付有価証券 18,100株
アクシアル リテイリン グ	14,500	3,840.00	55,680,000	貸付有価証券 1,700株
井筒屋	8,900	219.00	1,949,100	貸付有価証券 1,100株
イオン	672,700	1,888.50	1,270,393,950	貸付有価証券 449,100株（115,500 株）
イズミ	35,500	4,000.00	142,000,000	貸付有価証券 7,100株
平和堂	35,500	1,978.00	70,219,000	貸付有価証券 4,300株
フジ	21,100	1,821.00	38,423,100	貸付有価証券 2,500株
ヤオコー	19,800	4,675.00	92,565,000	貸付有価証券 4,300株
ゼビオホールディングス	21,100	1,126.00	23,758,600	貸付有価証券 2,500株
ケーズホールディングス	181,600	1,123.00	203,936,800	貸付有価証券 600株

O l y m p i c グループ	10,300	605.00	6,231,500	貸付有価証券 3,900株（2,500株）
日産東京販売ホールディングス	25,700	277.00	7,118,900	貸付有価証券 3,300株（100株）
G e n k y D r u g S t o r e s	8,500	2,053.00	17,450,500	貸付有価証券 4,200株（100株）
総合メディカルホールディングス	15,200	1,477.00	22,450,400	
ブックオフグループホールディングス	9,100	1,160.00	10,556,000	貸付有価証券 4,900株
アインホールディングス	23,400	5,760.00	134,784,000	貸付有価証券 4,300株
元気寿司	4,900	2,746.00	13,455,400	貸付有価証券 3,200株
ヤマダ電機	532,600	489.00	260,441,400	貸付有価証券 355,400株
アークランドサカモト	29,600	1,228.00	36,348,800	貸付有価証券 3,600株
ニトリホールディングス	75,700	15,075.00	1,141,177,500	貸付有価証券 50,500株
グルメ杵屋	12,500	1,170.00	14,625,000	貸付有価証券 8,300株
愛眼	13,900	242.00	3,363,800	貸付有価証券 2,800株
ケーユーホールディングス	9,100	810.00	7,371,000	貸付有価証券 1,100株
吉野家ホールディングス	61,000	2,301.00	140,361,000	貸付有価証券 22,300株（1,000株）
松屋フーズホールディングス	8,400	3,825.00	32,130,000	貸付有価証券 1,200株
サガミホールディングス	23,400	1,345.00	31,473,000	貸付有価証券 15,600株
関西スーパーマーケット	13,200	1,102.00	14,546,400	貸付有価証券 1,600株
王将フードサービス	12,800	7,180.00	91,904,000	貸付有価証券 1,500株
プレナス	19,600	1,720.00	33,712,000	貸付有価証券 6,100株
ミニストップ	12,900	1,360.00	17,544,000	貸付有価証券 6,200株
アークス	32,800	2,150.00	70,520,000	貸付有価証券 4,000株

パローホールディングス	37,700	1,774.00	66,879,800	
藤久	1,400	718.00	1,005,200	貸付有価証券 900株
ベルク	8,600	5,030.00	43,258,000	貸付有価証券 1,000株
大庄	9,300	1,555.00	14,461,500	貸付有価証券 4,400株
ファーストリテイリング	23,400	65,150.00	1,524,510,000	貸付有価証券 6,200株（300株）
サンドラッグ	65,800	3,245.00	213,521,000	
サックスパー ホール ディングス	14,800	883.00	13,068,400	
ヤマザワ	3,600	1,623.00	5,842,800	貸付有価証券 400株
やまや	3,000	2,297.00	6,891,000	貸付有価証券 1,700株
ペルーナ	42,900	700.00	30,030,000	貸付有価証券 23,400株（100株）
島根銀行	3,700	702.00	2,597,400	貸付有価証券 1,200株
じもとホールディングス	118,300	92.00	10,883,600	貸付有価証券 2,000株（400株）
めぶきフィナンシャルグ ループ	909,600	241.00	219,213,600	貸付有価証券 1,100株
東京きらぼしフィナン シャルグループ	23,600	1,283.00	30,278,800	貸付有価証券 2,900株
九州フィナンシャルグ ループ	287,300	406.00	116,643,800	貸付有価証券 40,000株
ゆうちょ銀行	495,900	997.00	494,412,300	貸付有価証券 106,400株
富山第一銀行	41,700	268.00	11,175,600	貸付有価証券 5,400株（100株）
コンコルディア・フィナ ンシャルグループ	1,098,200	379.00	416,217,800	貸付有価証券 100株
西日本フィナンシャル ホールディングス	110,200	651.00	71,740,200	
関西みらいフィナンシャ ルグループ	82,200	672.00	55,238,400	貸付有価証券 11,200株
三十三フィナンシャルグ ループ	15,100	1,483.00	22,393,300	
第四北越フィナンシャル グループ	30,400	2,470.00	75,088,000	

新生銀行	128,500	1,437.00	184,654,500	貸付有価証券 82,000株（900株）
あおぞら銀行	97,800	2,481.00	242,641,800	貸付有価証券 12,400株
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	12,050,400	519.80	6,263,797,920	貸付有価証券 5,400株
りそなホールディングス	1,921,000	423.30	813,159,300	貸付有価証券 15,700株
三井住友トラスト・ホールディングス	344,200	3,556.00	1,223,975,200	貸付有価証券 42,100株
三井住友フィナンシャルグループ	1,233,700	3,526.00	4,350,026,200	貸付有価証券 150,900株
千葉銀行	602,100	538.00	323,929,800	貸付有価証券 400株
群馬銀行	350,200	342.00	119,768,400	
武蔵野銀行	26,100	1,757.00	45,857,700	貸付有価証券 3,100株
千葉興業銀行	48,000	292.00	14,016,000	貸付有価証券 2,000株
筑波銀行	72,800	153.00	11,138,400	貸付有価証券 9,800株
七十七銀行	54,900	1,379.00	75,707,100	
青森銀行	13,600	2,451.00	33,333,600	貸付有価証券 1,600株
秋田銀行	11,200	1,858.00	20,809,600	
山形銀行	19,700	1,387.00	27,323,900	貸付有価証券 2,400株
岩手銀行	12,200	2,288.00	27,913,600	
東邦銀行	156,500	235.00	36,777,500	貸付有価証券 19,500株
東北銀行	8,900	936.00	8,330,400	
みちのく銀行	11,200	1,548.00	17,337,600	貸付有価証券 1,300株
ふくおかフィナンシャルグループ	154,200	1,842.00	284,036,400	貸付有価証券 100株
静岡銀行	433,500	732.00	317,322,000	貸付有価証券 500株
十六銀行	23,500	2,137.00	50,219,500	貸付有価証券 1,700株
スルガ銀行	179,100	407.00	72,893,700	貸付有価証券 102,100株

八十二銀行	422,500	397.00	167,732,500	貸付有価証券 51,500株
山梨中央銀行	21,100	951.00	20,066,100	
大垣共立銀行	36,900	2,208.00	81,475,200	貸付有価証券 4,400株
福井銀行	15,000	1,235.00	18,525,000	貸付有価証券 1,800株
北國銀行	18,000	2,348.00	42,264,000	
清水銀行	7,200	1,807.00	13,010,400	
富山銀行	3,400	2,167.00	7,367,800	貸付有価証券 400株
滋賀銀行	35,100	2,290.00	80,379,000	貸付有価証券 12,200株
南都銀行	27,300	2,247.00	61,343,100	
百五銀行	157,500	317.00	49,927,500	貸付有価証券 800株
京都銀行	62,700	3,885.00	243,589,500	
紀陽銀行	62,000	1,464.00	90,768,000	貸付有価証券 8,300株
ほくほくフィナンシャル グループ	116,500	950.00	110,675,000	貸付有価証券 14,200株
広島銀行	258,400	481.00	124,290,400	貸付有価証券 2,300株
山陰合同銀行	103,800	590.00	61,242,000	貸付有価証券 100株
中国銀行	150,600	878.00	132,226,800	貸付有価証券 20,000株
鳥取銀行	6,000	1,369.00	8,214,000	貸付有価証券 100株
伊予銀行	231,900	497.00	115,254,300	貸付有価証券 300株
百十四銀行	18,600	1,943.00	36,139,800	
四国銀行	24,800	900.00	22,320,000	貸付有価証券 3,000株
阿波銀行	26,800	2,202.00	59,013,600	貸付有価証券 4,400株
大分銀行	10,700	2,828.00	30,259,600	貸付有価証券 700株
宮崎銀行	11,700	2,261.00	26,453,700	貸付有価証券 1,400株
佐賀銀行	10,600	1,379.00	14,617,400	

沖縄銀行	16,000	3,035.00	48,560,000	貸付有価証券 1,900株
琉球銀行	40,400	1,027.00	41,490,800	貸付有価証券 100株
セブン銀行	591,500	278.00	164,437,000	貸付有価証券 73,700株
みずほフィナンシャルグループ	23,786,900	158.40	3,767,844,960	貸付有価証券 2,910,700株
高知銀行	6,400	740.00	4,736,000	
山口フィナンシャルグループ	218,500	679.00	148,361,500	貸付有価証券 200株
長野銀行	5,700	1,554.00	8,857,800	貸付有価証券 3,800株
名古屋銀行	14,200	2,945.00	41,819,000	貸付有価証券 1,900株
北洋銀行	263,900	211.00	55,682,900	貸付有価証券 8,300株
愛知銀行	6,300	3,280.00	20,664,000	貸付有価証券 100株
中京銀行	7,200	2,106.00	15,163,200	
大光銀行	6,000	1,583.00	9,498,000	貸付有価証券 600株
愛媛銀行	24,400	1,074.00	26,205,600	貸付有価証券 2,700株
トマト銀行	6,800	1,013.00	6,888,400	貸付有価証券 100株
京葉銀行	74,600	594.00	44,312,400	
栃木銀行	90,600	164.00	14,858,400	貸付有価証券 900株
北日本銀行	5,500	1,637.00	9,003,500	貸付有価証券 200株
東和銀行	30,700	686.00	21,060,200	貸付有価証券 2,400株
福島銀行	15,200	226.00	3,435,200	貸付有価証券 2,800株
大東銀行	8,400	549.00	4,611,600	
トモニホールディングス	135,300	316.00	42,754,800	貸付有価証券 700株
フィデアホールディングス	169,900	111.00	18,858,900	
池田泉州ホールディングス	185,800	178.00	33,072,400	貸付有価証券 24,200株

F P G	55,000	1,084.00	59,620,000	貸付有価証券 9,200株
マーキュリアインベスト メント	7,700	729.00	5,613,300	貸付有価証券 900株
S B I ホールディングス	208,600	2,257.00	470,810,200	貸付有価証券 11,000株
日本アジア投資	14,800	226.00	3,344,800	貸付有価証券 5,600株（1,100株）
ジャフコ	28,700	3,860.00	110,782,000	貸付有価証券 3,500株
大和証券グループ本社	1,404,600	474.40	666,342,240	貸付有価証券 12,100株
野村ホールディングス	3,080,200	442.60	1,363,296,520	
岡三証券グループ	149,200	349.00	52,070,800	貸付有価証券 20,900株
丸三証券	52,000	485.00	25,220,000	貸付有価証券 34,600株（2,600株）
東洋証券	62,600	146.00	9,139,600	貸付有価証券 14,800株（300株）
東海東京フィナンシャ ル・ホールディングス	208,700	290.00	60,523,000	貸付有価証券 13,000株
光世証券	4,200	559.00	2,347,800	貸付有価証券 1,000株
水戸証券	50,600	192.00	9,715,200	貸付有価証券 400株（300株）
いちよし証券	35,100	631.00	22,148,100	
松井証券	85,700	887.00	76,015,900	貸付有価証券 20,400株
だいこう証券ビジネス	7,100	530.00	3,763,000	貸付有価証券 900株
マネックスグループ	161,400	314.00	50,679,600	貸付有価証券 83,600株（31,800株）
極東証券	23,500	805.00	18,917,500	
岩井コスモホールディン グス	17,900	1,072.00	19,188,800	
藍澤證券	31,400	676.00	21,226,400	貸付有価証券 3,800株
マネーパートナーズグ ループ	20,500	263.00	5,391,500	貸付有価証券 8,500株
スパークス・グループ	69,300	240.00	16,632,000	貸付有価証券 8,500株
小林洋行	5,000	243.00	1,215,000	貸付有価証券

				100株
かんぽ生命保険	62,000	1,535.00	95,170,000	貸付有価証券 200株
S O M P Oホールディングス	308,600	4,401.00	1,358,148,600	貸付有価証券 37,700株
アニコム ホールディングス	14,400	3,830.00	55,152,000	貸付有価証券 9,500株（2,000株）
M S & A Dインシュアランスグループホール	457,700	3,420.00	1,565,334,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	143,900	2,318.00	333,560,200	貸付有価証券 25,500株
第一生命ホールディングス	990,500	1,500.00	1,485,750,000	貸付有価証券 600株
東京海上ホールディングス	626,000	5,567.00	3,484,942,000	貸付有価証券 79,500株
T & Dホールディングス	541,400	1,073.00	580,922,200	貸付有価証券 1,000株
アドバンスクリエイト	4,100	1,806.00	7,404,600	貸付有価証券 2,200株
全国保証	49,300	3,975.00	195,967,500	貸付有価証券 5,300株（700株）
ジェイリース	4,800	306.00	1,468,800	
イントラスト	4,900	669.00	3,278,100	貸付有価証券 1,500株
日本モーゲージサービス	3,100	1,064.00	3,298,400	貸付有価証券 500株
C a s a	7,900	1,219.00	9,630,100	貸付有価証券 900株
アルヒ	15,900	2,115.00	33,628,500	貸付有価証券 10,600株（6,800株）
プレミアグループ	10,000	1,842.00	18,420,000	貸付有価証券 1,500株
クレディセゾン	122,600	1,193.00	146,261,800	貸付有価証券 600株（300株）
芙蓉総合リース	20,000	6,140.00	122,800,000	
興銀リース	32,900	2,750.00	90,475,000	貸付有価証券 4,000株
東京センチュリー	35,300	4,370.00	154,261,000	
日本証券金融	77,100	494.00	38,087,400	貸付有価証券 100株
アイフル	267,000	222.00	59,274,000	貸付有価証券 156,200株

リコーリース	13,800	3,315.00	45,747,000	貸付有価証券 1,600株
イオンフィナンシャル サービス	111,800	1,578.00	176,420,400	貸付有価証券 19,000株
アコム	351,800	378.00	132,980,400	貸付有価証券 43,300株
ジャックス	19,300	2,178.00	42,035,400	
オリエントコーポレー ション	473,500	138.00	65,343,000	貸付有価証券 62,900株
日立キャピタル	41,300	2,134.00	88,134,200	貸付有価証券 500株
アプラスフィナンシャル	84,000	69.00	5,796,000	貸付有価証券 24,400株
オリックス	1,167,900	1,608.00	1,877,983,200	
三菱ＵＦＪリース	394,900	587.00	231,806,300	貸付有価証券 600株
九州リースサービス	8,600	585.00	5,031,000	貸付有価証券 1,000株
日本取引所グループ	472,900	1,745.00	825,210,500	
イー・ギャランティ	16,400	1,306.00	21,418,400	
アサックス	7,300	589.00	4,299,700	貸付有価証券 800株
NECキャピタルソ リューション	7,100	2,092.00	14,853,200	貸付有価証券 800株
いちご	222,700	442.00	98,433,400	貸付有価証券 31,900株
日本駐車場開発	192,000	170.00	32,640,000	貸付有価証券 34,900株
スター・マイカ・ホール ディングス	9,000	1,874.00	16,866,000	貸付有価証券 1,100株
ヒューリック	373,821	1,045.00	390,642,945	貸付有価証券 249,500株（19,200 株）
三栄建築設計	7,000	1,430.00	10,010,000	貸付有価証券 800株
野村不動産ホールディン グス	116,700	2,293.00	267,593,100	貸付有価証券 600株
三重交通グループホール ディングス	35,500	525.00	18,637,500	貸付有価証券 23,700株
サムティ	24,800	1,837.00	45,557,600	貸付有価証券 5,400株
ディア・ライフ	22,400	516.00	11,558,400	貸付有価証券

				2,900株
コーセーアールイー	5,100	684.00	3,488,400	貸付有価証券 200株
エー・ディー・ワークス	539,200	34.00	18,332,800	貸付有価証券 263,000株（300株）
日本商業開発	10,900	1,470.00	16,023,000	
プレサンスコーポレーション	27,800	1,575.00	43,785,000	
ユニゾホールディングス	26,400	4,310.00	113,784,000	貸付有価証券 15,500株（1,800株）
THE グローバル社	8,900	421.00	3,746,900	貸付有価証券 1,000株
日本管理センター	11,500	1,360.00	15,640,000	貸付有価証券 1,400株
サンセイランディック	5,100	795.00	4,054,500	貸付有価証券 700株
エストラスト	2,400	721.00	1,730,400	貸付有価証券 300株
フージャースホールディングス	38,100	614.00	23,393,400	貸付有価証券 24,500株（15,900株）
オープンハウス	25,400	5,170.00	131,318,000	貸付有価証券 16,900株
東急不動産ホールディングス	470,800	661.00	311,198,800	貸付有価証券 57,600株
飯田グループホールディングス	146,000	1,670.00	243,820,000	貸付有価証券 18,800株
イーグランド	2,500	684.00	1,710,000	
ムゲンエステート	12,100	604.00	7,308,400	貸付有価証券 1,900株
ピーロット	4,100	1,514.00	6,207,400	
ファーストブラザーズ	4,000	1,048.00	4,192,000	貸付有価証券 2,600株
ハウスドゥ	9,600	1,577.00	15,139,200	貸付有価証券 6,400株（200株）
シーアールイー	4,300	1,041.00	4,476,300	貸付有価証券 500株
プロパティエージェント	2,300	1,189.00	2,734,700	貸付有価証券 400株（400株）
ケイアイスター不動産	4,700	1,935.00	9,094,500	貸付有価証券 2,500株（1,900株）
アグレ都市デザイン	2,800	421.00	1,178,800	貸付有価証券 600株

グッドコムアセット	4,000	1,635.00	6,540,000	貸付有価証券 2,500株（300株）
ジェイ・エス・ビー	1,800	4,120.00	7,416,000	貸付有価証券 200株
テンポイノベーション	1,900	1,554.00	2,952,600	
グローバル・リンク・マ ネジメント	2,900	583.00	1,690,700	貸付有価証券 300株
パーク 2 4	93,900	2,257.00	211,932,300	貸付有価証券 50,100株（6,800株）
パラカ	4,500	2,077.00	9,346,500	貸付有価証券 2,500株
三井不動産	928,700	2,575.00	2,391,402,500	貸付有価証券 113,600株
三菱地所	1,226,400	2,029.50	2,488,978,800	貸付有価証券 150,000株
平和不動産	32,100	2,521.00	80,924,100	
東京建物	191,300	1,463.00	279,871,900	貸付有価証券 124,000株（21,900 株）
ダイビル	51,500	1,038.00	53,457,000	
京阪神ビルディング	30,600	1,214.00	37,148,400	貸付有価証券 3,800株
住友不動産	393,500	3,913.00	1,539,765,500	
テーオーシー	40,100	806.00	32,320,600	貸付有価証券 100株
東京楽天地	2,500	5,450.00	13,625,000	貸付有価証券 300株
レオパレス 2 1	215,900	304.00	65,633,600	貸付有価証券 144,100株（50,700 株）
スターツコーポレーショ ン	23,800	2,402.00	57,167,600	貸付有価証券 2,900株
フジ住宅	22,300	678.00	15,119,400	貸付有価証券 2,700株
空港施設	20,400	527.00	10,750,800	
明和地所	9,600	531.00	5,097,600	貸付有価証券 1,200株
ゴールドクレスト	13,800	2,044.00	28,207,200	貸付有価証券 2,600株
日本エスリード	6,800	1,586.00	10,784,800	
日神不動産	25,900	441.00	11,421,900	貸付有価証券 100株

日本エスコン	31,700	750.00	23,775,000	貸付有価証券 18,800株（13,800株）
タカラレーベン	80,000	400.00	32,000,000	
サンヨーハウジング名古屋	9,800	846.00	8,290,800	貸付有価証券 1,300株
イオンモール	87,800	1,699.00	149,172,200	貸付有価証券 41,900株
毎日コムネット	3,700	722.00	2,671,400	貸付有価証券 200株
ファースト住建	7,500	1,239.00	9,292,500	貸付有価証券 900株
カチタス	19,500	4,215.00	82,192,500	貸付有価証券 2,900株
トーセイ	24,100	1,279.00	30,823,900	貸付有価証券 3,000株
穴吹興産	1,900	2,777.00	5,276,300	貸付有価証券 200株
サンフロンティア不動産	24,200	1,223.00	29,596,600	貸付有価証券 300株
エフ・ジェー・ネクスト	15,300	1,005.00	15,376,500	
インテリックス	4,900	715.00	3,503,500	貸付有価証券 800株
ランドビジネス	7,400	765.00	5,661,000	
日本社宅サービス	4,400	971.00	4,272,400	貸付有価証券 200株
グランディハウス	15,300	446.00	6,823,800	貸付有価証券 1,800株
日本空港ビルデング	55,900	4,225.00	236,177,500	貸付有価証券 37,300株
日本工営	11,400	2,768.00	31,555,200	貸付有価証券 1,600株
L I F U L L	59,200	653.00	38,657,600	貸付有価証券 3,100株
ジェイエイシーリクルートメント	11,400	1,917.00	21,853,800	貸付有価証券 1,300株
日本M & A センター	128,000	3,090.00	395,520,000	貸付有価証券 5,100株
メンバーズ	5,700	1,845.00	10,516,500	貸付有価証券 3,800株
中広	1,700	602.00	1,023,400	
アイティメディア	3,400	645.00	2,193,000	貸付有価証券 1,600株

タケエイ	17,600	944.00	16,614,400	貸付有価証券 400株
E・Jホールディングス	2,100	1,214.00	2,549,400	
トラスト・テック	18,700	1,224.00	22,888,800	貸付有価証券 2,200株
コシダカホールディングス	40,800	1,672.00	68,217,600	貸付有価証券 5,900株
アルトナー	4,100	699.00	2,865,900	
パソナグループ	20,700	1,481.00	30,656,700	貸付有価証券 3,100株
C D S	4,200	1,274.00	5,350,800	貸付有価証券 700株
リンクアンドモチベーション	37,400	607.00	22,701,800	貸付有価証券 24,900株（100株）
G C A	20,000	705.00	14,100,000	貸付有価証券 2,400株
エス・エム・エス	62,300	2,593.00	161,543,900	貸付有価証券 7,700株
サニーサイドアップ	3,800	972.00	3,693,600	
パーソルホールディングス	169,600	2,115.00	358,704,000	
リニカル	9,500	1,013.00	9,623,500	貸付有価証券 1,800株
クックパッド	59,200	289.00	17,108,800	貸付有価証券 17,700株（1,000株）
エスクリ	4,600	835.00	3,841,000	
アイ・ケイ・ケイ	8,300	690.00	5,727,000	貸付有価証券 1,200株（200株）
学情	6,000	1,192.00	7,152,000	貸付有価証券 2,800株
スタジオアリス	8,500	1,892.00	16,082,000	貸付有価証券 1,200株
シミックホールディングス	9,400	1,661.00	15,613,400	
N J S	3,700	1,554.00	5,749,800	貸付有価証券 400株
総合警備保障	67,500	5,340.00	360,450,000	貸付有価証券 8,200株
カカクコム	127,000	2,524.00	320,548,000	貸付有価証券 17,600株
セントケア・ホールディング	12,300	500.00	6,150,000	貸付有価証券 6,800株

サイネックス	2,900	620.00	1,798,000	
ルネサンス	9,400	1,578.00	14,833,200	貸付有価証券 5,100株
ディップ	27,300	2,509.00	68,495,700	貸付有価証券 15,900株（2,800株）
オプトホールディング	9,200	1,532.00	14,094,400	貸付有価証券 4,500株
新日本科学	22,900	686.00	15,709,400	貸付有価証券 8,000株
ツクイ	39,900	431.00	17,196,900	貸付有価証券 200株
キャリアデザインセン ター	4,300	1,294.00	5,564,200	
ベネフィット・ワン	47,000	1,830.00	86,010,000	貸付有価証券 100株
エムスリー	357,000	2,415.00	862,155,000	貸付有価証券 173,700株（13,100 株）
ツカダ・グローバルホー ルディング	10,800	572.00	6,177,600	貸付有価証券 1,500株
プラス	1,900	613.00	1,164,700	貸付有価証券 200株
アウトソーシング	96,900	986.00	95,543,400	貸付有価証券 15,400株
ウェルネット	16,000	707.00	11,312,000	貸付有価証券 2,700株
ワールドホールディング ス	5,600	1,530.00	8,568,000	貸付有価証券 600株
ディー・エヌ・エー	91,400	2,059.00	188,192,600	貸付有価証券 12,200株
博報堂ＤＹホールディ ングス	235,800	1,561.00	368,083,800	貸付有価証券 28,900株
ぐるなび	24,100	688.00	16,580,800	貸付有価証券 1,400株
タカミヤ	17,900	648.00	11,599,200	貸付有価証券 9,100株
ジャパンベストレス キューシステム	11,500	1,139.00	13,098,500	貸付有価証券 6,200株
ファンコミュニケーション ズ	46,600	538.00	25,070,800	貸付有価証券 5,800株
ライク	6,700	1,877.00	12,575,900	貸付有価証券 1,600株

ビジネス・ブレイクスルー	7,100	361.00	2,563,100	貸付有価証券 1,000株
エスプール	6,500	3,035.00	19,727,500	
W D B ホールディングス	7,700	2,467.00	18,995,900	貸付有価証券 900株
ティア	9,900	617.00	6,108,300	貸付有価証券 300株
C D G	1,500	1,420.00	2,130,000	貸付有価証券 500株
バリューコマース	9,500	1,726.00	16,397,000	貸付有価証券 1,200株
インフォマート	92,900	1,611.00	149,661,900	貸付有価証券 45,900株
J P ホールディングス	48,400	273.00	13,213,200	貸付有価証券 300株
E P S ホールディングス	25,500	1,296.00	33,048,000	
レグス	4,200	1,732.00	7,274,400	貸付有価証券 2,800株
プレステージ・インターナショナル	31,700	1,856.00	58,835,200	貸付有価証券 4,300株（500株）
アミューズ	10,300	2,622.00	27,006,600	
ドリームインキュベータ	5,100	1,269.00	6,471,900	貸付有価証券 600株
クイック	10,500	1,279.00	13,429,500	
T A C	9,200	194.00	1,784,800	貸付有価証券 1,100株
ケネディクス	161,400	532.00	85,864,800	貸付有価証券 49,800株（8,800株）
電通	174,800	3,650.00	638,020,000	貸付有価証券 116,300株（18,600株）
テイクアンドグヴィ・ニーズ	6,500	1,123.00	7,299,500	貸付有価証券 700株
ぴあ	4,800	4,165.00	19,992,000	貸付有価証券 1,600株
イオンファンタジー	5,400	2,715.00	14,661,000	貸付有価証券 600株
シーティーエス	19,100	721.00	13,771,100	貸付有価証券 8,700株
ネクシィーズグループ	5,900	1,843.00	10,873,700	貸付有価証券 300株
みらかホールディングス	47,400	2,380.00	112,812,000	

アルプス技研	15,000	1,507.00	22,605,000	貸付有価証券 2,200株
ダイオーズ	3,900	1,433.00	5,588,700	貸付有価証券 2,200株（100株）
日本空調サービス	19,200	696.00	13,363,200	貸付有価証券 2,300株
オリエンタルランド	200,400	15,970.00	3,200,388,000	貸付有価証券 24,800株
ダスキン	43,600	2,758.00	120,248,800	貸付有価証券 5,500株
明光ネットワークジャパン	19,900	892.00	17,750,800	貸付有価証券 3,000株
ファルコホールディングス	9,300	1,600.00	14,880,000	貸付有価証券 5,100株（200株）
秀英予備校	3,700	437.00	1,616,900	
田谷	3,100	605.00	1,875,500	貸付有価証券 2,000株
ラウンドワン	52,600	1,601.00	84,212,600	
リゾートトラスト	71,800	1,640.00	117,752,000	貸付有価証券 100株
ピー・エム・エル	21,800	2,947.00	64,244,600	
ワタベウェディング	2,700	558.00	1,506,600	貸付有価証券 500株
りらいあコミュニケーションズ	30,600	1,330.00	40,698,000	貸付有価証券 3,700株
リソー教育	86,100	460.00	39,606,000	貸付有価証券 10,500株
早稲田アカデミー	4,800	799.00	3,835,200	貸付有価証券 2,700株
ユー・エス・エス	207,100	2,009.00	416,063,900	貸付有価証券 25,300株
東京個別指導学院	6,000	947.00	5,682,000	貸付有価証券 2,000株
サイバーエージェント	97,500	4,400.00	429,000,000	貸付有価証券 14,700株
楽天	790,500	984.00	777,852,000	貸付有価証券 403,700株
クリーク・アンド・リバー社	10,000	1,139.00	11,390,000	貸付有価証券 4,100株（1,500株）
テー・オー・ダブリュー	14,800	723.00	10,700,400	貸付有価証券 1,900株
山田コンサルティンググループ	8,200	1,636.00	13,415,200	貸付有価証券

ループ				1,900株
セントラルスポーツ	6,300	3,035.00	19,120,500	貸付有価証券 3,500株
フルキャストホールディングス	17,000	1,973.00	33,541,000	貸付有価証券 2,000株
エン・ジャパン	24,700	3,825.00	94,477,500	貸付有価証券 5,100株（2,100株）
リソルホールディングス	1,800	3,945.00	7,101,000	
テクノプロ・ホールディングス	34,000	6,140.00	208,760,000	貸付有価証券 4,200株
アトラ	3,900	493.00	1,922,700	貸付有価証券 2,600株
インターワークス	3,200	555.00	1,776,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,900	3,705.00	25,564,500	貸付有価証券 300株
Keepers 技研	6,200	1,368.00	8,481,600	貸付有価証券 1,500株
ファーストロジック	3,900	637.00	2,484,300	貸付有価証券 600株
三機サービス	3,500	903.00	3,160,500	貸付有価証券 1,600株
Gunosy	11,800	1,381.00	16,295,800	貸付有価証券 3,900株（400株）
デザインワン・ジャパン	3,300	279.00	920,700	貸付有価証券 1,500株
イー・ガーディアン	8,600	1,710.00	14,706,000	貸付有価証券 3,900株
リブセンス	10,900	256.00	2,790,400	貸付有価証券 6,900株
ジャパンマテリアル	46,400	1,203.00	55,819,200	貸付有価証券 5,600株
ベクトル	21,100	975.00	20,572,500	貸付有価証券 2,800株
ウチヤマホールディングス	8,300	494.00	4,100,200	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,400	1,942.00	10,486,800	貸付有価証券 200株
ライクキッズネクスト	4,000	920.00	3,680,000	貸付有価証券 500株
キャリアリンク	6,200	566.00	3,509,200	貸付有価証券 3,000株
I B J	11,400	1,100.00	12,540,000	貸付有価証券

				3,000株
アサンテ	6,800	1,961.00	13,334,800	
N・フィールド	11,600	617.00	7,157,200	貸付有価証券 1,700株
バリューHR	3,300	2,839.00	9,368,700	貸付有価証券 600株
M&Aキャピタルパートナーズ	6,000	6,410.00	38,460,000	貸付有価証券 1,200株
ライドオンエクスプレス ホールディングス	7,000	1,530.00	10,710,000	貸付有価証券 2,900株
E R I ホールディングス	4,700	779.00	3,661,300	貸付有価証券 500株
アビスト	2,600	2,585.00	6,721,000	
シグマクシス	8,100	1,228.00	9,946,800	貸付有価証券 200株
ウィルグループ	11,000	836.00	9,196,000	貸付有価証券 400株
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	23,300	221.00	5,149,300	貸付有価証券 7,000株（800株）
リクルートホールディン グス	1,214,900	3,255.00	3,954,499,500	貸付有価証券 105,200株（27,200 株）
エラン	10,000	1,770.00	17,700,000	貸付有価証券 1,400株（200株）
土木管理総合試験所	7,400	417.00	3,085,800	貸付有価証券 800株
ネットマーケティング	6,100	702.00	4,282,200	貸付有価証券 700株
日本郵政	1,390,100	966.00	1,342,836,600	
ベルシステム24ホール ディングス	28,400	1,609.00	45,695,600	貸付有価証券 3,400株
鎌倉新書	12,500	1,682.00	21,025,000	貸付有価証券 7,300株（100株）
ソネット・メディア・ ネットワークス	2,100	609.00	1,278,900	貸付有価証券 1,400株（1,000株）
一蔵	1,800	581.00	1,045,800	
L I T A L I C O	3,900	1,909.00	7,445,100	貸付有価証券 1,200株
グローバルキッズCOM PANY	2,500	857.00	2,142,500	貸付有価証券 600株
エボラブルアジア	7,500	1,995.00	14,962,500	貸付有価証券 2,100株（200株）

アトラエ	4,400	2,613.00	11,497,200	貸付有価証券 2,300株
ストライク	6,400	2,677.00	17,132,800	貸付有価証券 1,600株（400株）
ソラスト	41,500	1,292.00	53,618,000	貸付有価証券 500株
セラク	5,300	719.00	3,810,700	貸付有価証券 400株（400株）
インソース	8,250	2,398.00	19,783,500	貸付有価証券 1,000株
ベイカレント・コンサルティング	12,000	4,460.00	53,520,000	
Orchestra Holdings	3,300	1,131.00	3,732,300	貸付有価証券 1,000株（100株）
アイモパイル	5,300	727.00	3,853,100	貸付有価証券 3,300株（2,400株）
キャリアインデックス	5,800	453.00	2,627,400	貸付有価証券 3,100株
MS - Japan	6,900	1,373.00	9,473,700	貸付有価証券 1,100株（100株）
船場	2,700	890.00	2,403,000	
グレイステクノロジー	6,100	2,931.00	17,879,100	貸付有価証券 3,300株（300株）
ジャパンエレベーター サービスホールディング	13,300	2,633.00	35,018,900	貸付有価証券 3,100株
フルテック	2,400	1,222.00	2,932,800	
グリーンズ	6,400	1,350.00	8,640,000	
ツナググループ・ホール ディングス	2,000	584.00	1,168,000	貸付有価証券 200株
ソウルドアウト	2,600	1,393.00	3,621,800	貸付有価証券 900株（100株）
MS & Consulting	2,500	908.00	2,270,000	
日総工産	11,200	1,037.00	11,614,400	貸付有価証券 2,400株
キュービーネットホール ディングス	10,300	2,171.00	22,361,300	貸付有価証券 100株
RPAホールディングス	7,200	1,653.00	11,901,600	貸付有価証券 4,000株
スプリックス	5,700	1,466.00	8,356,200	貸付有価証券 3,500株（2,200株）
アドバンテッジリスクマ	6,600	794.00	5,240,400	貸付有価証券

ネジメント				2,100株
リログループ	92,700	2,597.00	240,741,900	貸付有価証券 5,300株
東祥	10,600	2,249.00	23,839,400	貸付有価証券 200株
エイチ・アイ・エス	26,400	2,634.00	69,537,600	貸付有価証券 17,600株（2,000株）
ラックランド	3,400	2,257.00	7,673,800	貸付有価証券 500株
共立メンテナンス	25,900	4,215.00	109,168,500	貸付有価証券 4,300株
イチネンホールディングス	17,600	1,059.00	18,638,400	
建設技術研究所	11,700	1,578.00	18,462,600	貸付有価証券 1,400株
スペース	11,000	1,188.00	13,068,000	貸付有価証券 1,300株
長大	6,200	904.00	5,604,800	
燦ホールディングス	3,700	2,082.00	7,703,400	
スバル興業	1,200	6,540.00	7,848,000	貸付有価証券 100株
東京テアトル	6,600	1,364.00	9,002,400	貸付有価証券 4,000株（100株）
タナベ経営	3,300	1,252.00	4,131,600	
ナガワ	4,700	5,090.00	23,923,000	貸付有価証券 700株
よみうりランド	3,700	4,460.00	16,502,000	貸付有価証券 2,000株（100株）
東京都競馬	11,100	3,140.00	34,854,000	貸付有価証券 1,300株
常磐興産	6,800	1,676.00	11,396,800	貸付有価証券 2,000株
カナモト	27,800	2,651.00	73,697,800	貸付有価証券 4,100株（700株）
東京ドーム	63,400	986.00	62,512,400	貸付有価証券 34,700株（3,200株）
西尾レントオール	17,200	2,763.00	47,523,600	
トランス・コスモス	18,800	2,517.00	47,319,600	貸付有価証券 2,300株
乃村工藝社	79,300	1,337.00	106,024,100	貸付有価証券 10,500株
藤田観光	7,400	2,683.00	19,854,200	貸付有価証券

				2,000株
	KNT - CTホールディングス	9,000	1,419.00	12,771,000 貸付有価証券 1,200株
	日本管財	18,200	1,857.00	33,797,400 貸付有価証券 2,200株
	トーカイ	16,400	2,291.00	37,572,400
	白洋舎	1,900	2,791.00	5,302,900 貸付有価証券 200株
	セコム	180,000	9,172.00	1,650,960,000 貸付有価証券 22,000株
	セントラル警備保障	8,200	5,200.00	42,640,000 貸付有価証券 1,700株
	丹青社	32,000	1,257.00	40,224,000 貸付有価証券 4,000株
	メイテック	21,000	5,300.00	111,300,000
	応用地質	18,200	1,048.00	19,073,600 貸付有価証券 2,200株
	船井総研ホールディングス	35,000	2,331.00	81,585,000 貸付有価証券 4,200株
	進学会ホールディングス	7,700	444.00	3,418,800
	オオバ	13,300	599.00	7,966,700 貸付有価証券 1,600株
	いであ	3,100	1,103.00	3,419,300 貸付有価証券 500株
	学究社	5,600	1,215.00	6,804,000
	ベネッセホールディングス	62,100	2,708.00	168,166,800 貸付有価証券 8,100株
	イオンディライト	20,900	3,255.00	68,029,500 貸付有価証券 2,500株
	ナック	10,700	939.00	10,047,300
	ニチイ学館	24,100	1,621.00	39,066,100 貸付有価証券 2,900株
	ダイセキ	28,400	2,621.00	74,436,400 貸付有価証券 4,400株
	ステップ	6,200	1,396.00	8,655,200 貸付有価証券 3,400株
	小計 銘柄数：2,131 組入時価比率：97.8%			390,459,905,575 100.0%
	合計			390,459,905,575

(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9月6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 9月 6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	8,700,255,125	-	8,827,645,000	127,109,453
合計	8,700,255,125	-	8,827,645,000	127,109,453

(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。

外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 9月 6日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,053,645,346
コール・ローン	1,026,839,238
株式	47,131,347,695
投資証券	1,378,975,131
派生商品評価勘定	24,008,511
未収入金	1,670,508
未収配当金	105,137,658
差入委託証拠金	354,733,207
流動資産合計	51,076,357,294
資産合計	51,076,357,294
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	501,052,940
未払金	1,023,448,382
未払解約金	100,137,686
未払利息	1,708
その他未払費用	518,100

(2019年 9月 6日現在)

流動負債合計	1,625,158,816
負債合計	1,625,158,816
純資産の部	
元本等	
元本	25,142,823,196
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	24,308,375,282
元本等合計	49,451,198,478
純資産合計	49,451,198,478
負債純資産合計	51,076,357,294

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 9月 6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	1.9668円
(10,000口当たり純資産額)	(19,668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 9月 7日 至 2019年 9月 6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、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。 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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2018年 9月 7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	24,511,893,185円
同期中における追加設定元本額	7,908,198,423円
同期中における一部解約元本額	7,277,268,412円
期末元本額	25,142,823,196円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型	1,908,584,972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	888,541,821円
野村外国株インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	571,559,028円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,086,980円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,666,394円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	7,856,937円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,619,936円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,887,834円
野村外国株インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	7,119,889,220円
野村外国株（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	2,360,206,689円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数（為替ヘッジあり）連動型上場投信	599,749,668円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国株式	204,637,486円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	8,602,530,047円
野村外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA（適格機関投資家専用）	1,602,414,978円
ノムラ外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA（適格機関投資家専用）	1,196,852,779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）	66,142,214円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスオープン投信・為替ヘッジ型（適格機関投資家専用）	596,213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9月6日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES,A GE CO,LLC	5,200	23.52	122,304.00	
		HALLIBURTON CO	10,600	19.00	201,400.00	
		HELMERICH & PAYNE	1,000	37.61	37,610.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	4,200	22.00	92,400.00	
		SCHLUMBERGER LTD	16,200	34.06	551,772.00	
		TECHNIPFMC PLC	5,200	25.74	133,848.00	
		APACHE CORPORATION	4,400	22.67	99,748.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	4,600	17.40	80,040.00	
		CHENIERE ENERGY INC	2,500	61.87	154,675.00	
		CHEVRON CORP	23,030	117.64	2,709,249.20	
		CIMAREX ENERGY CO	960	43.18	41,452.80	
		CONCHO RESOURCES INC	2,340	70.36	164,642.40	
		CONOCOPHILLIPS	14,000	53.44	748,160.00	
		CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,180	30.17	35,600.60	
		DEVON ENERGY CORP	6,000	23.50	141,000.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	1,800	97.65	175,770.00	
		EOG RESOURCES INC	6,810	75.60	514,836.00	
		EXXON MOBIL CORP	51,100	70.27	3,590,797.00	
		HESS CORP	2,900	64.99	188,471.00	
		HOLLYFRONTIER CORP	1,600	47.62	76,192.00	
		KINDER MORGAN INC	24,600	20.51	504,546.00	
		MARATHON OIL CORP	10,800	12.54	135,432.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	7,600	52.48	398,848.00	
		NOBLE ENERGY INC	5,000	22.68	113,400.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	10,089	45.09	454,913.01	
		ONEOK INC	4,600	71.02	326,692.00	
		PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	3,500	17.65	61,775.00	
		PHILLIPS 66	5,510	99.80	549,898.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	2,200	128.54	282,788.00	
		PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	2,000	21.88	43,760.00	
		TARGA RESOURCES CORP	2,800	36.78	102,984.00	
		VALERO ENERGY CORP	5,150	76.79	395,468.50	
		WILLIAMS COS	14,600	24.07	351,422.00	

AIR PRODUCTS	2,650	224.57	595,110.50	
ALBEMARLE CORP	1,080	62.97	68,007.60	
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,900	29.64	85,956.00	
CELANESE CORP-SERIES A	1,480	117.63	174,092.40	
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,400	48.17	115,608.00	
CORTEVA INC	8,266	28.46	235,250.36	
DOW INC	8,933	43.36	387,334.88	
DUPONT DE NEMOURS INC	8,966	68.94	618,116.04	
EASTMAN CHEMICAL CO.	1,490	67.49	100,560.10	
ECOLAB INC	3,220	205.33	661,162.60	
FMC CORP	1,800	87.48	157,464.00	
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	1,320	114.50	151,140.00	
LINDE PLC	6,630	187.10	1,240,473.00	
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,500	77.60	271,600.00	
MOSAIC CO/THE	3,660	19.38	70,930.80	
PPG INDUSTRIES	2,870	113.34	325,285.80	
SHERWIN-WILLIAMS	960	534.52	513,139.20	
WESTLAKE CHEMICAL CORP	280	60.21	16,858.80	
MARTIN MARIETTA MATERIALS	830	255.72	212,247.60	
VULCAN MATERIALS CO	1,520	142.86	217,147.20	
AMCOR PLC	19,400	9.77	189,538.00	
AVERY DENNISON CORP	810	113.93	92,283.30	
BALL CORP	4,000	78.71	314,840.00	
CROWN HOLDINGS INC	1,800	65.45	117,810.00	
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	4,400	39.37	173,228.00	
PACKAGING CORP OP AMERICA	1,050	100.53	105,556.50	
SEALED AIR CORP	1,500	39.32	58,980.00	
WESTROCK CO	2,900	34.93	101,297.00	
FREEPORT-MCMORAN INC	14,500	9.53	138,185.00	
NEWMONT GOLDCORP CORP	9,656	39.34	379,867.04	
NUCOR CORP	3,300	50.35	166,155.00	
STEEL DYNAMICS	2,100	28.05	58,905.00	
ARCONIC INC	4,400	26.01	114,444.00	
BOEING CO	6,470	360.30	2,331,141.00	
GENERAL DYNAMICS	3,000	192.27	576,810.00	

HEICO CORP	340	144.57	49,153.80
HEICO CORP-CLASS A	1,090	110.21	120,128.90
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	540	214.24	115,689.60
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	2,700	212.13	572,751.00
LOCKHEED MARTIN	3,010	385.15	1,159,301.50
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,940	368.43	714,754.20
RAYTHEON COMPANY	3,390	185.27	628,065.30
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	1,120	81.77	91,582.40
TEXTRON INC	2,800	46.29	129,612.00
TRANSDIGM GROUP INC	600	532.97	319,782.00
UNITED TECHNOLOGIES	9,990	133.03	1,328,969.70
ALLEGION PLC	890	98.62	87,771.80
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	1,740	51.53	89,662.20
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	9,300	42.85	398,505.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	530	251.65	133,374.50
MASCO CORP	3,300	41.26	136,158.00
OWENS CORNING INC	1,050	56.75	59,587.50
SMITH (A.O.) CORP	1,400	47.62	66,668.00
FLUOR CORP	1,400	19.64	27,496.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,900	91.36	173,584.00
ACUITY BRANDS INC	440	124.75	54,890.00
AMETEK INC	2,630	88.33	232,307.90
EATON CORP PLC	5,200	81.95	426,140.00
EMERSON ELEC	6,900	61.84	426,696.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,270	158.70	201,549.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,600	47.37	75,792.00
3M CORP	6,900	164.23	1,133,187.00
GENERAL ELEC CO	107,000	8.81	942,670.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,680	170.37	1,478,811.60
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,500	55.80	139,500.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,600	33.05	85,930.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,200	375.11	450,132.00
CATERPILLAR INC DEL	7,050	122.99	867,079.50
CUMMINS INC	1,760	154.66	272,201.60

DEERE & COMPANY	3,760	156.30	587,688.00	
DOVER CORP	1,700	96.13	163,421.00	
FLOWSERVE CORP	1,480	43.89	64,957.20	
FORTIVE CORP	3,470	68.10	236,307.00	
IDEX CORP	950	168.71	160,274.50	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	3,960	151.48	599,860.80	
INGERSOLL-RAND PLC	2,830	121.41	343,590.30	
MIDDLEBY CORP	660	112.35	74,151.00	
PACCAR	3,890	68.20	265,298.00	
PARKER HANNIFIN CORP	1,400	171.64	240,296.00	
PENTAIR PLC	2,100	36.23	76,083.00	
SNAP-ON INC	550	151.74	83,457.00	
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,990	136.32	271,276.80	
WABCO HOLDINGS INC	620	133.72	82,906.40	
WABTEC CORP	2,200	67.99	149,578.00	
XYLEM INC	2,150	77.75	167,162.50	
AERCAP HOLDINGS NV	1,400	54.62	76,468.00	
FASTENAL CO	7,600	31.06	236,056.00	
GRAINGER(W.W.) INC	570	276.78	157,764.60	
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,700	40.08	68,136.00	
UNITED RENTALS INC	800	116.49	93,192.00	
CINTAS CORP	1,150	267.24	307,326.00	
COPART INC	2,600	80.61	209,586.00	
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	2,860	88.81	253,996.60	
ROLLINS INC	1,500	34.20	51,300.00	
WASTE CONNECTIONS INC	3,000	91.73	275,190.00	
WASTE MANAGEMENT INC	5,110	119.09	608,549.90	
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	1,580	83.94	132,625.20	
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	2,300	72.57	166,911.00	
FEDEX CORPORATION	2,990	164.38	491,496.20	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	8,300	121.20	1,005,960.00	
XPO LOGISTICS INC	1,490	71.83	107,026.70	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	1,100	27.69	30,459.00	
DELTA AIR LINES INC	1,700	58.19	98,923.00	
SOUTHWEST AIRLINES	1,500	52.52	78,780.00	

UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	860	85.84	73,822.40
AMERCO	80	357.51	28,600.80
CSX CORP	8,900	68.06	605,734.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	880	112.44	98,947.20
KANSAS CITY SOUTHERN	1,260	129.92	163,699.20
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	1,300	36.01	46,813.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,320	176.28	585,249.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	920	164.68	151,505.60
UBER TECHNOLOGIES INC	1,600	32.51	52,016.00
UNION PAC CORP	8,630	166.13	1,433,701.90
APTIV PLC	2,950	88.17	260,101.50
AUTOLIV INC	980	74.17	72,686.60
BORGWARNER INC	2,600	35.09	91,234.00
LEAR CORP	810	120.45	97,564.50
FORD MOTOR COMPANY	47,500	9.34	443,650.00
GENERAL MOTORS CO	15,100	38.73	584,823.00
HARLEY-DAVIDSON INC	1,800	32.58	58,644.00
TESLA INC	1,520	229.58	348,961.60
DR HORTON INC	4,300	49.96	214,828.00
GARMIN LTD	1,700	83.05	141,185.00
LEGGETT & PLATT INC	1,400	38.30	53,620.00
LENNAR CORP-A	3,000	51.69	155,070.00
MOHAWK INDUSTRIES	660	117.83	77,767.80
NEWELL BRANDS INC	5,900	17.51	103,309.00
NVR INC	44	3,585.60	157,766.40
PULTEGROUP INC	2,800	34.25	95,900.00
ROKU INC	1,110	166.93	185,292.30
WHIRLPOOL CORP	700	142.96	100,072.00
HASBRO INC	1,640	110.99	182,023.60
POLARIS INC	640	83.35	53,344.00
CAPRI HOLDINGS LTD	1,900	28.30	53,770.00
HANESBRANDS INC	3,400	14.33	48,722.00
LULULEMON ATHLETICA INC	1,450	188.41	273,194.50
NIKE INC-B	15,000	88.42	1,326,300.00
	930	84.56	78,640.80

PVH CORP				
RALPH LAUREN CORPORATION	640	94.26	60,326.40	
TAPESTRY INC	3,300	22.92	75,636.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,100	19.77	41,517.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	2,114	17.91	37,861.74	
V F CORP	3,720	86.51	321,817.20	
ARAMARK	3,000	42.01	126,030.00	
CARNIVAL CORP	4,800	45.11	216,528.00	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	340	838.11	284,957.40	
DARDEN RESTAURANTS INC	1,390	124.06	172,443.40	
DOMINOS PIZZA INC	470	244.83	115,070.10	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	3,400	93.47	317,798.00	
LAS VEGAS SANDS CORP	4,330	56.13	243,042.90	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	3,570	128.46	458,602.20	
MCDONALD'S CORP	9,060	219.49	1,988,579.40	
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,000	20.96	62,880.00	
MGM RESORTS INTERNATIONAL	6,500	27.98	181,870.00	
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,600	52.31	136,006.00	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,940	106.94	207,463.60	
STARBUCKS CORP	14,440	95.56	1,379,886.40	
VAIL RESORTS INC	500	235.80	117,900.00	
WYNN RESORTS LTD	960	111.33	106,876.80	
YUM BRANDS INC	3,740	118.16	441,918.40	
GENUINE PARTS CO	1,560	93.56	145,953.60	
LKQ CORP	2,800	26.91	75,348.00	
AMAZON.COM INC	5,031	1,840.72	9,260,662.32	
BOOKING HOLDINGS INC	513	1,994.44	1,023,147.72	
EBAY INC	9,900	40.80	403,920.00	
EXPEDIA GROUP INC	1,510	131.55	198,640.50	
GRUBHUB INC	800	60.40	48,320.00	
MERCADOLIBRE INC	560	605.69	339,186.40	
QURATE RETAIL INC - A	5,100	11.08	56,508.00	
WAYFAIR INC - CLASS A	840	119.60	100,464.00	
DOLLAR GENERAL CORP	3,060	159.82	489,049.20	
DOLLAR TREE INC	3,070	107.63	330,424.10	
	2,100	48.25	101,325.00	

KOHL'S CORP				
MACYS INC	3,700	15.31	56,647.00	
NORDSTROM INC	1,600	31.07	49,712.00	
TARGET CORP	6,030	108.54	654,496.20	
ADVANCE AUTO PARTS	760	146.55	111,378.00	
AUTOZONE	315	1,134.54	357,380.10	
BEST BUY COMPANY INC	2,700	65.76	177,552.00	
BURLINGTON STORES INC	930	204.18	189,887.40	
CARMAX INC	1,700	86.73	147,441.00	
GAP INC	2,400	16.99	40,776.00	
HOME DEPOT	13,290	228.15	3,032,113.50	
L BRANDS, INC	2,600	16.82	43,732.00	
LOWES COS INC	9,340	114.21	1,066,721.40	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	1,000	396.58	396,580.00	
ROSS STORES INC	4,350	109.36	475,716.00	
TIFFANY & CO	1,390	88.19	122,584.10	
TJX COS INC	14,700	55.77	819,819.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,600	102.98	164,768.00	
ULTA BEAUTY INC	620	236.71	146,760.20	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	5,350	296.97	1,588,789.50	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	4,500	7.00	31,500.00	
KROGER CO	9,500	24.83	235,885.00	
SYSCO CORP	6,200	74.38	461,156.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,900	52.33	465,737.00	
WALMART INC	17,010	115.44	1,963,634.40	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	3,800	60.91	231,458.00	
COCA COLA CO	49,000	55.12	2,700,880.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,700	55.72	150,444.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,910	204.93	391,416.30	
MOLSON COORS BREWING CO-B	1,960	53.18	104,232.80	
MONSTER BEVERAGE CORP	4,800	58.77	282,096.00	
PEPSICO INC	16,610	135.98	2,258,627.80	
ARCHER DANIELS MIDLAND	6,300	38.63	243,369.00	
BUNGE LIMITED	1,700	55.22	93,874.00	
CAMPBELL SOUP CO	2,000	44.62	89,240.00	
	6,100	28.45	173,545.00	

CONAGRA BRANDS INC				
GENERAL MILLS	7,300	54.16	395,368.00	
HERSHEY CO/THE	1,870	160.30	299,761.00	
HORMEL FOODS CORP	3,600	42.55	153,180.00	
INGREDION INC	690	79.47	54,834.30	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	1,230	104.68	128,756.40	
KELLOGG CO	3,100	62.84	194,804.00	
KRAFT HEINZ CO/THE	7,800	26.59	207,402.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,000	71.79	143,580.00	
MCCORMICK & CO INC.	1,450	163.75	237,437.50	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	17,300	56.14	971,222.00	
TYSON FOODS INC-CL A	3,770	85.26	321,430.20	
ALTRIA GROUP INC	22,900	43.85	1,004,165.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	18,300	71.95	1,316,685.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	3,200	77.50	248,000.00	
CLOROX CO	1,610	162.20	261,142.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	9,900	74.29	735,471.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	4,080	139.48	569,078.40	
PROCTER & GAMBLE CO	30,260	122.76	3,714,717.60	
COTY INC-CL A	4,300	9.91	42,613.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,530	204.98	518,599.40	
ABBOTT LABORATORIES	21,000	85.90	1,803,900.00	
ABIOMED INC	500	190.25	95,125.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	810	177.11	143,459.10	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	5,900	87.91	518,669.00	
BECTON,DICKINSON	3,210	258.48	829,720.80	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	16,600	42.61	707,326.00	
DANAHER CORP	7,880	142.95	1,126,446.00	
DENTSPLY SIRONA INC	2,420	51.65	124,993.00	
DEXCOM INC	1,190	167.67	199,527.30	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,550	224.98	573,699.00	
HOLOGIC INC	2,900	49.69	144,101.00	
IDEXX LABORATORIES INC	1,110	289.93	321,822.30	
INTUITIVE SURGICAL INC	1,340	508.17	680,947.80	
MEDTRONIC PLC	15,930	107.72	1,715,979.60	
	1,680	140.33	235,754.40	

RESMED INC				
STERIS PLC	1,160	153.50	178,060.00	
STRYKER CORP	3,970	220.22	874,273.40	
TELEFLEX INC	510	356.48	181,804.80	
THE COOPER COMPANIES, INC.	620	307.73	190,792.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,060	108.09	114,575.40	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,500	139.54	348,850.00	
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,650	86.04	141,966.00	
ANTHEM INC	2,990	251.22	751,147.80	
CARDINAL HEALTH INC	3,500	44.38	155,330.00	
CENTENE CORP	4,400	46.14	203,016.00	
CIGNA CORP	4,380	151.00	661,380.00	
CVS HEALTH CORP	15,900	62.76	997,884.00	
DAVITA INC	1,400	57.98	81,172.00	
HCA HEALTHCARE INC	3,210	124.25	398,842.50	
HENRY SCHEIN INC	2,100	61.83	129,843.00	
HUMANA INC	1,640	274.71	450,524.40	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,050	170.49	179,014.50	
MCKESSON CORP	2,440	141.37	344,942.80	
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,360	102.72	139,699.20	
UNITEDHEALTH GROUP INC	11,490	229.59	2,637,989.10	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	870	145.14	126,271.80	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	690	270.35	186,541.50	
ABBVIE INC	17,700	67.03	1,186,431.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,510	100.28	251,702.80	
ALKERMES PLC	1,640	20.12	32,996.80	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	1,600	83.14	133,024.00	
AMGEN INC	7,300	207.65	1,515,845.00	
BEIGENE, LTD ADR	370	131.03	48,481.10	
BIOGEN INC	2,240	223.96	501,670.40	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	2,140	73.10	156,434.00	
CELGENE CORP	8,370	97.51	816,158.70	
EXACT SCIENCES CORP	1,690	122.49	207,008.10	
GILEAD SCIENCES INC	15,100	64.06	967,306.00	
INCYTE CORP	2,500	79.27	198,175.00	

IONIS PHARMACEUTICALS INC	1,200	62.76	75,312.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	1,050	289.37	303,838.50
SAREPTA THERAPEUTICS INC	1,100	89.02	97,922.00
SEATTLE GENETICS INC	1,100	71.35	78,485.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	3,030	179.86	544,975.80
ALLERGAN PLC	4,000	162.41	649,640.00
BRISTOL MYERS SQUIBB	20,100	48.51	975,051.00
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	5,000	26.49	132,450.00
ELI LILLY & CO.	10,550	114.60	1,209,030.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	550	126.78	69,729.00
JOHNSON & JOHNSON	32,010	128.58	4,115,845.80
MERCK & CO INC	31,130	86.10	2,680,293.00
MYLAN NV	6,100	20.22	123,342.00
NEKTAR THERAPEUTICS	2,200	17.37	38,214.00
PERRIGO CO PLC	1,700	48.16	81,872.00
PFIZER INC	67,200	36.34	2,442,048.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	16,000	6.89	110,240.00
ZOETIS INC	5,760	128.07	737,683.20
BANK OF AMERICA CORP	109,100	28.12	3,067,892.00
BB&T CORPORATION	9,300	48.65	452,445.00
CIT GROUP INC	1,000	43.32	43,320.00
CITIGROUP	27,500	66.34	1,824,350.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,300	34.20	181,260.00
COMERICA INC	1,800	62.38	112,284.00
EAST WEST BANCORP INC	1,900	42.18	80,142.00
FIFTH THIRD BANCORP	10,200	26.75	272,850.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,700	89.67	152,439.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	11,900	13.54	161,126.00
JPMORGAN CHASE & CO	39,100	112.37	4,393,667.00
KEYCORP	12,300	17.04	209,592.00
M & T BANK CORP	1,410	147.10	207,411.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	5,700	14.81	84,417.00
PNC FINANCIAL	5,470	131.56	719,633.20
REGIONS FINANCIAL CORP	12,300	14.81	182,163.00
SIGNATURE BANK	520	116.41	60,533.20
SUNTRUST BKS INC.	5,200	62.91	327,132.00

SVB FINANCIAL GROUP	630	199.78	125,861.40	
US BANCORP	17,800	53.27	948,206.00	
WELLS FARGO CO	51,700	47.62	2,461,954.00	
ZIONS BANCORP NA	2,300	41.14	94,622.00	
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	4,100	21.04	86,264.00	
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	15,700	204.24	3,206,568.00	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	3,000	19.06	57,180.00	
VOYA FINANCIAL INC	2,100	50.95	106,995.00	
AFLAC INC	9,100	51.13	465,283.00	
ALLEGHANY CORP	170	771.09	131,085.30	
ALLSTATE CORP	3,730	104.38	389,337.40	
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	1,130	103.83	117,327.90	
AMERICAN INTL GROUP	10,100	54.68	552,268.00	
AON PLC	2,900	195.60	567,240.00	
ARCH CAPITAL GROUP LTD	5,400	41.13	222,102.00	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	2,400	89.73	215,352.00	
ASSURANT INC	750	123.85	92,887.50	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,000	39.63	79,260.00	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	890	36.39	32,387.10	
CHUBB LTD	5,460	160.63	877,039.80	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	2,050	113.93	233,556.50	
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	200	214.06	42,812.00	
EVEREST RE GROUP LTD	440	248.74	109,445.60	
FNF GROUP	3,500	44.79	156,765.00	
GLOBE LIFE INC	1,230	90.84	111,733.20	
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	4,100	59.99	245,959.00	
LINCOLN NATIONAL CORP	2,200	54.81	120,582.00	
LOEWS CORP	2,800	48.96	137,088.00	
MARKEL CORP	144	1,152.89	166,016.16	
MARSH & MCLENNAN COS	6,360	101.05	642,678.00	
METLIFE INC	10,200	45.95	468,690.00	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,080	53.90	166,012.00	
PROGRESSIVE CO	7,000	76.53	535,710.00	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	5,100	81.92	417,792.00	
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	750	155.07	116,302.50	

RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	490	188.10	92,169.00
TRAVELERS COS INC/THE	3,200	151.74	485,568.00
UNUM GROUP	2,700	26.28	70,956.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,640	197.69	324,211.60
WR BERKLEY CORP	1,485	71.93	106,816.05
ACCENTURE PLC-CL A	7,760	199.49	1,548,042.40
AKAMAI TECHNOLOGIES	1,800	92.54	166,572.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	510	126.99	64,764.90
AUTOMATIC DATA PROCESS	5,240	173.27	907,934.80
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	1,410	131.51	185,429.10
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	7,000	64.26	449,820.00
DXC TECHNOLOGY CO	3,310	34.04	112,672.40
EPAM SYSTEMS INC	530	194.82	103,254.60
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	7,209	139.05	1,002,411.45
FISERV INC	6,950	108.70	755,465.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	950	302.53	287,403.50
GARTNER INC	920	136.80	125,856.00
GLOBAL PAYMENTS INC	1,880	174.84	328,699.20
GODADDY INC - CLASS A	1,800	65.12	117,216.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	10,570	140.97	1,490,052.90
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	970	148.51	144,054.70
LEIDOS HOLDINGS INC	1,800	88.82	159,876.00
MASTERCARD INC	10,980	292.08	3,207,038.40
MONGODB INC	640	150.44	96,281.60
OKTA INC	1,420	124.25	176,435.00
PAYCHEX INC	4,000	83.80	335,200.00
PAYPAL HOLDINGS INC	13,130	111.46	1,463,469.80
SABRE CORP	3,700	23.74	87,838.00
SQUARE INC - A	4,100	63.02	258,382.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	2,120	141.41	299,789.20
TWILIO INC - A	1,460	129.73	189,405.80
VERISIGN INC	1,390	206.58	287,146.20
VISA INC-CLASS A SHARES	20,980	184.73	3,875,635.40
WESTERN UNION CO	5,500	22.60	124,300.00
WIX.COM LTD	530	135.94	72,048.20

ADOBE INC	5,800	287.75	1,668,950.00
ANSYS INC	950	218.09	207,185.50
AUTODESK INC.	2,480	148.22	367,585.60
CADENCE DESIGN SYS INC	3,700	70.61	261,257.00
CDK GLOBAL INC	1,430	44.52	63,663.60
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	1,430	108.00	154,440.00
CITRIX SYSTEMS INC	1,590	94.35	150,016.50
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	560	115.90	64,904.00
DOCUSIGN INC	900	46.25	41,625.00
DROPBOX INC-CLASS A	1,500	18.86	28,290.00
FORTINET INC	1,500	80.39	120,585.00
INTUIT INC	3,090	292.31	903,237.90
MICROSOFT CORP	87,460	140.05	12,248,773.00
ORACLE CORPORATION	28,400	53.84	1,529,056.00
PALO ALTO NETWORKS INC	1,260	212.05	267,183.00
PAYCOM SOFTWARE INC	490	252.69	123,818.10
PTC INC	1,590	66.94	106,434.60
SALESFORCE.COM INC	10,120	153.77	1,556,152.40
SERVICENOW INC	2,180	269.62	587,771.60
SPLUNK INC	1,750	110.68	193,690.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,200	48.82	107,404.00
SYMANTEC CORP	6,700	23.47	157,249.00
SYNOPSYS INC	1,780	145.95	259,791.00
VMWARE INC - CLASS A	900	147.90	133,110.00
WORKDAY INC-CLASS A	1,860	175.90	327,174.00
ARISTA NETWORKS INC	560	235.38	131,812.80
CISCO SYSTEMS	51,800	48.42	2,508,156.00
F5 NETWORKS INC	760	131.27	99,765.20
JUNIPER NETWORKS INC	4,100	23.87	97,867.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,940	173.57	336,725.80
APPLE INC	55,280	213.28	11,790,118.40
DELL TECHNOLOGIES-C	2,200	52.92	116,424.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	16,500	14.40	237,600.00
HP INC	18,400	18.91	347,944.00

NETAPP INC	2,900	51.76	150,104.00
SEAGATE TECHNOLOGY	3,200	54.10	173,120.00
WESTERN DIGITAL CORP	3,040	61.95	188,328.00
XEROX HOLDINGS CORP	2,500	29.85	74,625.00
AMPHENOL CORP-CL A	3,670	89.79	329,529.30
ARROW ELECTRS INC	750	72.18	54,135.00
CDW CORPORATION	1,940	118.47	229,831.80
COGNEX CORP	1,640	47.15	77,326.00
CORNING INC	10,100	28.58	288,658.00
FLEX LTD	4,700	10.38	48,786.00
FLIR SYSTEMS INC	1,200	50.45	60,540.00
IPG PHOTONICS CORP	360	134.37	48,373.20
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	2,300	99.30	228,390.00
TE CONNECTIVITY LTD	4,290	94.51	405,447.90
TRIMBLE INC	2,500	37.89	94,725.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	530	205.85	109,100.50
ADVANCED MICRO DEVICES	12,800	31.50	403,200.00
ANALOG DEVICES INC	4,640	113.02	524,412.80
APPLIED MATERIALS	11,500	50.35	579,025.00
BROADCOM INC	4,720	291.02	1,373,614.40
INTEL CORP	54,200	50.10	2,715,420.00
KLA CORP	2,100	151.00	317,100.00
LAM RESEARCH	1,900	226.74	430,806.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	7,400	24.87	184,038.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,800	56.65	158,620.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	2,660	88.83	236,287.80
MICRON TECHNOLOGY	13,800	49.03	676,614.00
NVIDIA CORP	6,920	179.74	1,243,800.80
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,400	106.00	360,400.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	3,900	18.33	71,487.00
QORVO INC	1,200	75.17	90,204.00
QUALCOMM INC	14,600	78.99	1,153,254.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,950	79.33	154,693.50
TEXAS INSTRUMENTS INC	11,190	126.81	1,419,003.90
XILINX INC	3,270	105.30	344,331.00

AT & T INC	88,100	35.89	3,161,909.00
CENTURYLINK INC	11,200	11.86	132,832.00
VERIZON COMMUNICATIONS	50,000	58.59	2,929,500.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	3,500	33.76	118,160.00
SPRINT CORP	7,300	6.76	49,348.00
T-MOBILE US INC	3,900	77.83	303,537.00
ALLIANT ENERGY CORP	3,300	52.56	173,448.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	6,030	91.53	551,925.90
DUKE ENERGY CORP	8,680	93.41	810,798.80
EDISON INTERNATIONAL	4,500	71.31	320,895.00
ENTERGY CORP	2,420	114.50	277,090.00
EVERGY INC	3,300	64.78	213,774.00
EVERSOURCE ENERGY	4,000	82.03	328,120.00
EXELON CORPORATION	11,900	48.12	572,628.00
FIRSTENERGY CORP	6,800	46.52	316,336.00
NEXTERA ENERGY INC	5,720	219.81	1,257,313.20
OGE ENERGY CORP	2,700	43.00	116,100.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	1,150	94.31	108,456.50
PPL CORPORATION	9,100	30.11	274,001.00
SOUTHERN CO.	12,600	59.50	749,700.00
XCEL ENERGY INC	6,500	65.15	423,475.00
ATMOS ENERGY CORP	1,600	109.68	175,488.00
UGI CORP	2,500	48.07	120,175.00
AMEREN CORPORATION	3,000	77.14	231,420.00
CENTERPOINT ENERGY INC	6,100	27.99	170,739.00
CMS ENERGY CORP	3,800	63.40	240,920.00
CONSOLIDATED EDISON INC	3,800	90.88	345,344.00
DOMINION ENERGY INC	9,500	77.43	735,585.00
DTE ENERGY COMPANY	2,250	129.91	292,297.50
NISOURCE INC	4,700	29.67	139,449.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	5,700	60.87	346,959.00
SEMPRA ENERGY	3,370	141.83	477,967.10
WEC ENERGY GROUP INC	3,600	95.33	343,188.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,180	126.53	275,835.40
ALLY FINANCIAL INC	4,000	32.53	130,120.00

AMERICAN EXPRESS CO	8,700	120.67	1,049,829.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,900	88.32	521,088.00
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,600	81.82	294,552.00
SYNCHRONY FINANCIAL	6,800	33.28	226,304.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	600	78.74	47,244.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,680	133.41	224,128.80
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	9,700	42.82	415,354.00
BLACKROCK INC	1,430	424.72	607,349.60
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,240	119.21	147,820.40
CME GROUP INC	4,260	221.18	942,226.80
E*TRADE FINANCIAL CORP	3,100	42.92	133,052.00
EATON VANCE CORP	1,600	43.64	69,824.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	360	273.84	98,582.40
FRANKLIN RESOURCES INC	3,400	27.03	91,902.00
GOLDMAN SACHS GROUP	4,060	207.05	840,623.00
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6,850	94.73	648,900.50
INVESCO LTD	4,400	16.05	70,620.00
KKR & CO INC-A	6,700	26.76	179,292.00
MARKETAXESS HOLDINGS INC	500	411.96	205,980.00
MOODYS CORP	2,110	219.58	463,313.80
MORGAN STANLEY	15,700	42.47	666,779.00
MSCI INC	1,070	235.43	251,910.10
NASDAQ INC	1,430	102.02	145,888.60
NORTHERN TRUST CORP	2,180	90.02	196,243.60
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,300	79.95	103,935.00
S&P GLOBAL INC	3,040	264.83	805,083.20
SCHWAB(CHARLES)CORP	14,300	39.62	566,566.00
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,400	58.81	82,334.00
STATE STREET CORP	4,500	52.47	236,115.00
T ROWE PRICE GROUP INC	2,730	115.05	314,086.50
TD AMERITRADE HOLDING CORP	3,600	46.15	166,140.00
H & R BLOCK INC	1,800	24.24	43,632.00
AES CORP	9,300	15.44	143,592.00
NRG ENERGY INC	2,800	37.60	105,280.00
VISTRA ENERGY CORP	4,600	25.68	118,128.00
	4,100	67.85	278,185.00

CERNER CORP				
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,500	159.42	239,130.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,590	73.52	263,936.80	
ILLUMINA INC	1,740	271.78	472,897.20	
IQVIA HOLDINGS INC	1,910	154.08	294,292.80	
METTLER-TOLEDO INTL	300	685.78	205,734.00	
PERKINELMER INC	1,010	83.71	84,547.10	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,770	294.02	1,402,475.40	
WATERS CORP	810	218.12	176,677.20	
COSTAR GROUP INC	460	613.19	282,067.40	
EQUIFAX INC	1,600	146.78	234,848.00	
IHS MARKIT LTD	4,500	67.17	302,265.00	
MANPOWERGROUP INC	590	83.09	49,023.10	
NIELSEN HOLDINGS PLC	3,700	21.02	77,774.00	
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	1,430	54.17	77,463.10	
TRUNSON	2,300	84.35	194,005.00	
VERISK ANALYTICS INC	1,720	163.54	281,288.80	
CBRE GROUP INC	4,000	53.15	212,600.00	
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	13,000	5.75	74,750.00	
JONES LANG LASALLE INC	470	136.84	64,314.80	
ALTICE USA INC-A	2,900	29.54	85,666.00	
CBS CORP-CL B	3,700	43.00	159,100.00	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,940	422.05	818,777.00	
COMCAST CORP-CL A	54,800	46.41	2,543,268.00	
DISCOVERY INC - A	2,030	27.40	55,622.00	
DISCOVERY INC - C	5,000	25.77	128,850.00	
DISH NETWORK CORP-A	2,400	34.85	83,640.00	
FOX CORP-CLASS A	3,900	34.25	133,575.00	
FOX CORP-CLASS B	1,900	33.91	64,429.00	
INTERPUBLIC GROUP	3,600	20.44	73,584.00	
LIBERTY BROADBAND CORP-C	1,340	107.73	144,358.20	
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	5,300	26.07	138,171.00	
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,300	26.98	62,054.00	
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	2,030	41.68	84,610.40	
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	1,160	41.36	47,977.60	
	4,300	14.00	60,200.00	

	NEWS CORP/NEW-CL A-W/I				
	OMNICOM GROUP	2,620	77.94	204,202.80	
	SIRIUS XM HOLDINGS INC	17,000	6.28	106,760.00	
	ACTIVISION BLIZZARD INC	9,600	54.58	523,968.00	
	DISNEY (WALT) CO	21,740	138.84	3,018,381.60	
	ELECTRONIC ARTS	3,730	97.45	363,488.50	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	1,900	42.67	81,073.00	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,400	70.98	99,372.00	
	NETFLIX INC	5,200	293.25	1,524,900.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	1,380	131.35	181,263.00	
	VIACOM INC-CLASS B	3,600	25.68	92,448.00	
	ALPHABET INC-CL A	3,610	1,212.19	4,376,005.90	
	ALPHABET INC-CL C	3,777	1,211.38	4,575,382.26	
	FACEBOOK INC-A	28,930	190.90	5,522,737.00	
	IAC/INTERACTIVE CORP	950	244.89	232,645.50	
	SNAP INC-A	9,500	15.87	150,765.00	
	TRIPADVISOR INC	1,300	38.11	49,543.00	
	TWITTER INC	8,300	45.30	375,990.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	1,120	31.99	35,828.80	
小計	銘柄数：610			303,039,038.63	
				(32,446,389,866)	
	組入時価比率：65.6%			68.9%	
カナダドル	CAMECO CORP	5,000	11.92	59,600.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	14,700	32.19	473,193.00	
	CENOVUS ENERGY INC	14,000	12.09	169,260.00	
	ENBRIDGE INC	24,900	45.08	1,122,492.00	
	ENCANA CORP	14,000	6.08	85,120.00	
	HUSKY ENERGY INC	3,779	8.98	33,935.42	
	IMPERIAL OIL	2,900	33.35	96,715.00	
	INTER PIPELINE LTD	3,800	25.20	95,760.00	
	KEYERA CORP	2,020	33.00	66,660.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	6,500	48.67	316,355.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1,800	17.44	31,392.00	
	SUNCOR ENERGY INC	18,500	39.10	723,350.00	
	TC ENERGY CORP	11,100	67.93	754,023.00	

TOURMALINE OIL CORP	2,800	13.40	37,520.00	
VERMILION ENERGY INC	1,410	19.88	28,030.80	
METHANEX CORP	970	45.41	44,047.70	
NUTRIEN LTD	6,700	68.02	455,734.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,450	56.95	82,577.50	
AGNICO EAGLE MINES LTD	3,200	81.18	259,776.00	
BARRICK GOLD	21,700	24.36	528,612.00	
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7,800	9.30	72,540.00	
FRANCO-NEVADA CORP	2,400	129.96	311,904.00	
KINROSS GOLD CORP	10,000	6.73	67,300.00	
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	2,800	63.91	178,948.00	
LUNDIN MINING CORP	8,000	6.63	53,040.00	
TECK RESOURCES LTD-CLS B	6,100	23.46	143,106.00	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	6,000	39.73	238,380.00	
WEST FRASER TIMBER	780	46.37	36,168.60	
BOMBARDIER B SHEARS	19,500	1.80	35,100.00	
CAE INC	3,800	33.75	128,250.00	
SNC-LAVALIN GROUP INC	1,900	15.91	30,229.00	
WSP GLOBAL INC	1,100	72.42	79,662.00	
AIR CANADA	2,000	44.09	88,180.00	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	8,700	124.04	1,079,148.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,740	320.71	558,035.40	
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,900	68.74	268,086.00	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,700	49.58	133,866.00	
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	2,700	99.32	268,164.00	
STARS GROUP INC/THE	1,400	21.44	30,016.00	
CANADIAN TIRE CORP LTD A	660	136.56	90,129.60	
DOLLARAMA INC	3,120	50.95	158,964.00	
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	5,300	83.32	441,596.00	
EMPIRE CO LTD A	1,300	37.18	48,334.00	
LOBLAW COMPANIES	2,400	74.25	178,200.00	
METRO INC	3,400	57.64	195,976.00	
WESTON(GEORGE)LTD	714	110.36	78,797.04	
SAPUTO INC	3,100	40.34	125,054.00	
AURORA CANNABIS INC	9,000	7.75	69,750.00	

BAUSCH HEALTH COS INC	3,900	28.78	112,242.00
CANOPY GROWTH CORP	2,800	34.94	97,832.00
CRONOS GROUP INC	1,600	15.34	24,544.00
BANK OF MONTREAL	7,800	91.77	715,806.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	15,000	71.63	1,074,450.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	5,400	103.27	557,658.00
NATIONAL BANK OF CANADA	4,400	63.51	279,444.00
ROYAL BANK OF CANADA	17,100	100.69	1,721,799.00
TORONTO DOMINION BANK	22,300	72.41	1,614,743.00
ONEX CORPORATION	900	79.37	71,433.00
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	330	591.89	195,323.70
GREAT-WEST LIFE CO INC	3,800	28.75	109,250.00
IA FINANCIAL CORP INC	800	56.74	45,392.00
INTACT FINANCIAL CORP	1,460	129.39	188,909.40
MANULIFE FINANCIAL CORP	22,900	22.64	518,456.00
POWER CORPORATION OF CANADA	3,500	28.49	99,715.00
POWER FINANCIAL CORP	3,300	28.68	94,644.00
SUN LIFE FINANCIAL INC	6,800	55.92	380,256.00
CGI INC	3,000	105.57	316,710.00
SHOPIFY INC - CLASS A	1,220	519.51	633,802.20
BLACKBERRY LTD	4,500	9.66	43,470.00
CONSTELLATION SOFTWARE INC	236	1,320.03	311,527.08
OPEN TEXT CORP	3,100	54.94	170,314.00
BCE INC	2,200	63.30	139,260.00
TELUS CORP	2,600	48.60	126,360.00
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	4,200	65.21	273,882.00
EMERA INC	3,300	57.17	188,661.00
FORTIS INC	5,000	55.65	278,250.00
HYDRO ONE LTD	3,100	24.73	76,663.00
ALTAGAS LTD	3,600	18.52	66,672.00
ATCO LTD CL1	900	47.26	42,534.00
CANADIAN UTILITIES LTD A	1,090	38.72	42,204.80
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	10,200	70.30	717,060.00
CI FINANCIAL CORP	3,700	19.15	70,855.00
	600	37.15	22,290.00

小計	IGM FINANCIAL INC				
	THOMSON REUTERS CORP	2,451	93.55	229,291.05	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	1,100	22.27	24,497.00	
	QUEBECOR INC-CL B	1,400	30.14	42,196.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	6,100	26.10	159,210.00	
	銘柄数：87			22,528,683.29	
	組入時価比率：3.7%			(1,823,021,051)	
ユーロ				3.9%	
	TENARIS SA	5,400	10.04	54,216.00	
	ENI SPA	31,400	13.86	435,455.20	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	5,800	13.28	77,024.00	
	NESTE OYJ	5,500	28.73	158,015.00	
	OMV AG	1,600	46.82	74,912.00	
	REPSOL SA	18,228	13.77	251,090.70	
	TOTAL SA	28,500	46.22	1,317,412.50	
	VOPAK	700	43.55	30,485.00	
	AIR LIQUIDE	5,200	124.30	646,360.00	
	AKZO NOBEL	2,737	81.62	223,393.94	
	ARKEMA	850	81.98	69,683.00	
	BASF SE	11,300	61.01	689,413.00	
	COVESTRO AG	2,240	41.47	92,892.80	
	EVONIK INDUSTRIES AG	1,800	23.41	42,138.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	740	32.48	24,035.20	
	KONINKLIJKE DSM NV	2,200	115.50	254,100.00	
	LANXESS	970	55.22	53,563.40	
	SOLVAY SA	920	93.08	85,633.60	
	SYMRIS AG	1,530	85.44	130,723.20	
	UMICORE	2,400	31.00	74,400.00	
	CRH PLC	10,000	30.63	306,300.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	1,470	64.24	94,432.80	
	IMERYS	450	36.58	16,461.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,500	28.04	70,100.00	
	ARCELORMITTAL	8,000	13.86	110,896.00	
	THYSSENKRUPP AG	4,800	11.68	56,064.00	
	VOESTALPINE AG	1,400	21.38	29,932.00	
	STORA ENSO OYJ-R	6,100	10.58	64,568.50	

UPM-KYMMENE OYJ	6,200	24.83	153,946.00	
AIRBUS SE	7,000	127.32	891,240.00	
DASSAULT AVIATION SA	26	1,400.00	36,400.00	
LEONARDO SPA	4,200	11.22	47,124.00	
MTU AERO ENGINES AG	700	246.00	172,200.00	
SAFRAN SA	4,070	138.00	561,660.00	
THALES SA	1,360	109.95	149,532.00	
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	5,500	33.40	183,700.00	
KINGSPAN GROUP PLC	1,700	42.22	71,774.00	
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	3,292	34.86	114,759.12	
BOUYGUES	2,130	33.42	71,184.60	
EIFPAGE SA	930	94.26	87,661.80	
FERROVIAL SA	6,300	26.10	164,430.00	
HOCHTIEF AG	160	99.55	15,928.00	
VINCI	6,000	100.90	605,400.00	
LEGRAND SA	3,500	65.52	229,320.00	
PRYSMIAN SPA	2,800	20.18	56,504.00	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	6,500	76.14	494,910.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	1,800	12.55	22,590.00	
SIEMENS AG	9,380	91.55	858,739.00	
ALSTOM	2,100	39.06	82,026.00	
ANDRITZ AG	700	33.76	23,632.00	
CNH INDUSTRIAL NV	13,400	9.50	127,353.60	
GEA GROUP AG	1,700	24.83	42,211.00	
KION GROUP AG	970	45.76	44,387.20	
KNORR-BREMSE AG	490	84.72	41,512.80	
KONE OYJ	4,100	54.16	222,056.00	
METSO OYJ	1,600	35.32	56,512.00	
WARTSILA OYJ	4,800	11.16	53,568.00	
BRENNTAG AG	1,900	45.21	85,899.00	
EDENRED	2,900	44.46	128,934.00	
SOCIETE BIC SA	300	58.35	17,505.00	
BOLLORE	7,500	3.87	29,070.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	12,200	30.38	370,697.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	3,000	14.13	42,405.00	

ADP	290	161.50	46,835.00	
AENA SME SA	690	167.10	115,299.00	
ATLANTIA SPA	5,300	24.30	128,790.00	
FRAPORT AG	380	77.12	29,305.60	
GETLINK	6,300	13.17	82,971.00	
CONTINENTAL AG	1,380	116.96	161,404.80	
FAURECIA	750	44.71	33,532.50	
MICHELIN (CGDE)	1,990	99.94	198,880.60	
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,800	25.38	45,684.00	
PIRELLI & C. SPA	3,500	5.09	17,836.00	
VALEO SA	2,400	28.66	68,784.00	
BAYER MOTOREN WERK	4,260	62.32	265,483.20	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	760	51.40	39,064.00	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	10,700	45.35	485,245.00	
FERRARI NV	1,440	146.80	211,392.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	13,400	12.57	168,545.20	
PEUGEOT CITROEN	6,900	21.46	148,074.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	1,600	60.12	96,192.00	
RENAULT SA	2,020	55.45	112,009.00	
VOLKSWAGEN AG	370	153.75	56,887.50	
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,290	150.84	345,423.60	
SEB SA	260	148.30	38,558.00	
ADIDAS AG	2,180	274.80	599,064.00	
ESSILORLUXOTTICA	3,334	134.80	449,423.20	
HERMES INTERNATIONAL	390	646.00	251,940.00	
HUGO BOSS AG	720	51.08	36,777.60	
KERING SA	950	455.40	432,630.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	3,390	376.40	1,275,996.00	
MONCLER SPA	1,700	35.86	60,962.00	
PUMA SE	1,200	68.70	82,440.00	
ACCOR SA	2,100	40.03	84,063.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	890	78.72	70,060.80	
SODEXO	1,110	104.15	115,606.50	
DELIVERY HERO SE	1,700	45.58	77,486.00	
ZALANDO SE	1,800	46.44	83,592.00	

INDITEX SA	13,400	28.54	382,436.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	7,600	16.07	122,132.00	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	700	41.64	29,148.00	
COLRUYT SA	900	47.78	43,002.00	
JERONIMO MARTINS	3,400	15.90	54,077.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	14,300	21.62	309,237.50	
METRO AG	1,700	14.10	23,978.50	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	9,100	84.95	773,045.00	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	5,500	8.65	47,602.50	
HEINEKEN HOLDING NV	1,290	91.00	117,390.00	
HEINEKEN NV	3,140	98.14	308,159.60	
PERNOD RICARD SA	2,450	174.60	427,770.00	
REMY COINTREAU	140	138.80	19,432.00	
DANONE	7,490	81.80	612,682.00	
KERRY GROUP PLC-A	1,980	109.40	216,612.00	
HENKEL AG & CO KGAA	1,450	85.10	123,395.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	2,220	92.98	206,415.60	
BEIERSDORF AG	1,280	114.45	146,496.00	
LOREAL-ORD	3,100	250.70	777,170.00	
UNILEVER NV	17,800	56.89	1,012,642.00	
BIOMERIEUX	420	69.75	29,295.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	390	106.40	41,496.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	11,100	42.96	476,911.50	
SARTORIUS AG-VORZUG	320	178.50	57,120.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,600	35.41	56,664.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	2,300	61.44	141,312.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	5,200	44.62	232,024.00	
GRIFOLS SA	3,600	28.10	101,160.00	
BAYER AG-REG	11,500	66.50	764,750.00	
IPSEN	520	93.25	48,490.00	
MERCK KGAA	1,670	97.28	162,457.60	
ORION OYJ	1,000	33.98	33,980.00	
RECORDATI SPA	1,100	39.94	43,934.00	
SANOFI	13,500	81.19	1,096,065.00	
UCB SA	1,800	67.32	121,176.00	

ABN AMRO BANK NV-CVA	4,400	16.58	72,974.00	
AIB GROUP PLC	8,000	2.46	19,680.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	75,000	4.49	337,200.00	
BANCO DE SABADELL SA	70,000	0.81	56,742.00	
BANCO SANTANDER SA	207,000	3.52	730,089.00	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	11,500	3.84	44,160.00	
BANKIA SA	12,250	1.70	20,837.25	
BANKINTER S.A.	8,200	5.54	45,428.00	
BNP PARIBAS	13,900	42.46	590,194.00	
CAIXABANK	41,000	2.16	88,560.00	
COMMERZBANK AG	11,400	5.46	62,278.20	
CREDIT AGRICOLE SA	14,400	10.67	153,648.00	
ERSTE GROUP BANK AG	3,700	29.62	109,594.00	
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	9,100	9.83	89,525.80	
ING GROEP NV	45,800	9.03	413,757.20	
INTESA SANPAOLO	185,000	2.05	380,360.00	
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	13,429	0.00	0.00	
KBC GROEP NV	2,750	54.98	151,195.00	
MEDIOBANCA S.P.A.	8,600	9.44	81,218.40	
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	1,500	20.04	30,060.00	
SOCIETE GENERALE	9,900	24.17	239,332.50	
UNICREDIT SPA	24,400	10.69	260,836.00	
EURAZEO SE	350	61.40	21,490.00	
EXOR NV	1,300	63.94	83,122.00	
GROUPE BRUXELLES LAM	940	86.18	81,009.20	
WENDEL	260	127.10	33,046.00	
AEGON NV	18,000	3.57	64,314.00	
AGEAS	1,800	50.06	90,108.00	
ALLIANZ SE-REG	5,060	203.05	1,027,433.00	
ASSICURAZIONI GENERALI	12,300	17.04	209,653.50	
AXA	22,900	21.40	490,174.50	
CNP ASSURANCES	1,640	17.02	27,912.80	
HANNOVER RUECK SE	840	148.70	124,908.00	
MAPFRE SA	12,700	2.44	30,988.00	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,730	222.20	384,406.00	

NN GROUP NV	3,700	30.98	114,626.00
POSTE ITALIANE SPA	7,300	10.05	73,365.00
SAMPO OYJ-A SHS	5,600	36.74	205,744.00
SCOR SE	2,200	36.57	80,454.00
ADYEN NV	110	662.80	72,908.00
AMADEUS IT GROUP SA	5,000	68.08	340,400.00
ATOS SE	890	70.08	62,371.20
CAPGEMINI SA	1,980	113.70	225,126.00
WIRECARD AG	1,350	157.50	212,625.00
WORLDLINE SA	1,200	62.60	75,120.00
DASSAULT SYSTEMES SA	1,410	128.85	181,678.50
SAP SE	11,690	111.48	1,303,201.20
NOKIA OYJ	67,000	4.48	300,763.00
INGENICO GROUP	690	89.70	61,893.00
ASML HOLDING NV	5,200	215.10	1,118,520.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	15,700	16.97	266,491.80
STMICROELECTRONICS NV	8,000	17.32	138,600.00
CELLNEX TELECOM SA	2,600	37.25	96,850.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	39,300	15.08	592,644.00
ELISA OYJ	1,600	45.73	73,168.00
ILIAD SA	310	84.00	26,040.00
KONINKLIJKE KPN NV	39,000	2.89	112,788.00
ORANGE SA	24,300	13.71	333,153.00
PROXIMUS	1,550	26.41	40,935.50
TELECOM ITALIA SPA	112,000	0.49	55,081.60
TELECOM ITALIA-RNC	68,000	0.47	31,966.80
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	5,000	2.33	11,675.00
TELEFONICA SA	59,000	6.50	383,913.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,500	30.53	45,795.00
1&1 DRILLISCH AG	570	25.68	14,637.60
ELECTRICITE DE FRANCE	7,400	11.19	82,843.00
ENDESA S.A.	3,500	23.71	82,985.00
ENEL SPA	98,000	6.66	653,170.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	30,000	3.54	106,410.00
FORTUM OYJ	4,900	20.80	101,920.00

IBERDROLA SA	72,100	9.43	680,479.80
RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,200	18.31	76,902.00
TERNA SPA	18,000	5.79	104,292.00
VERBUND AG	1,100	54.15	59,565.00
ENAGAS SA	2,900	20.30	58,870.00
NATURGY ENERGY GROUP SA	4,200	23.75	99,750.00
SNAM SPA	23,000	4.63	106,628.00
E.ON SE	24,800	8.52	211,395.20
ENGIE	22,800	13.75	313,614.00
INNOGY SE	1,600	45.36	72,576.00
RWE AG	6,300	26.47	166,761.00
SUEZ	3,600	14.20	51,120.00
VEOLIA ENVIRONNEMENT	7,000	22.43	157,010.00
AMUNDI SA	600	59.60	35,760.00
DEUTSCHE BANK AG-REG	25,400	7.08	180,035.20
DEUTSCHE BOERSE AG	2,350	136.25	320,187.50
NATIXIS	11,000	3.59	39,567.00
UNIPER SE	2,100	28.68	60,228.00
EUROFINS SCIENTIFIC SE	130	419.80	54,574.00
QIAGEN NV	2,176	30.93	67,303.68
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	220	138.30	30,426.00
BUREAU VERITAS SA	3,100	22.14	68,634.00
RANDSTAD NV	1,500	43.85	65,775.00
TELEPERFORMANCE	790	199.20	157,368.00
WOLTERS KLUWER	3,700	66.06	244,422.00
AROUNDTOWN SA	11,600	7.20	83,520.00
DEUTSCHE WOHNEN SE	4,200	31.56	132,552.00
VONOVIA SE	5,700	43.31	246,867.00
AXEL SPRINGER SE-TEND	360	62.50	22,500.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,200	16.49	36,289.00
JC DECAUX SA	750	24.58	18,435.00
PUBLICIS GROUPE	2,700	43.55	117,585.00
RTL GROUP	310	42.74	13,249.40
SES FDR	3,900	13.98	54,541.50
TELENET GROUP HOLDING NV	690	43.76	30,194.40

小計	UBISOFT ENTERTAINMENT	920	73.26	67,399.20	
	VIVENDI SA	11,300	25.25	285,325.00	
小計	銘柄数：240			46,484,164.29	
				(5,487,920,436)	
英ボンド	組入時価比率：11.1%			11.6%	
	WOOD GROUP (JOHN) PLC	6,500	3.90	25,350.00	
英ボンド	BP PLC	242,000	5.07	1,226,940.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	52,900	22.84	1,208,500.50	
英ボンド	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	45,700	22.79	1,041,503.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	1,464	46.94	68,720.16	
英ボンド	JOHNSON MATTHEY PLC	2,600	31.05	80,730.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	13,000	18.36	238,680.00	
英ボンド	ANTOFAGASTA PLC	5,400	8.88	47,952.00	
	BHP GROUP PLC	25,100	17.50	439,400.60	
英ボンド	EVRAZ PLC	4,000	5.02	20,088.00	
	FRESNILLO PLC	2,700	7.23	19,521.00	
英ボンド	GLENCORE PLC	139,000	2.39	332,905.00	
	RIO TINTO PLC-REG	13,900	42.20	586,649.50	
英ボンド	MONDI PLC	5,400	16.01	86,454.00	
	BAE SYSTEMS PLC	41,000	5.63	230,994.00	
英ボンド	MEGGITT PLC	11,000	6.30	69,300.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	19,000	7.76	147,478.00	
英ボンド	MELROSE INDUSTRIES PLC	56,000	2.01	113,008.00	
	DCC PLC	1,360	71.52	97,267.20	
英ボンド	SMITHS GROUP PLC	4,700	16.87	79,289.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	720	80.60	58,032.00	
英ボンド	WEIR GROUP PLC	2,800	14.86	41,608.00	
	ASHTREAD GROUP PLC	5,900	23.01	135,759.00	
英ボンド	BUNZLE	4,400	20.73	91,212.00	
	FERGUSON PLC	2,548	64.16	163,479.68	
英ボンド	G4S PLC	16,100	1.75	28,207.20	
	RENTOKIL INITIAL PLC	26,000	4.57	118,924.00	
英ボンド	EASYJET PLC	1,900	9.40	17,867.60	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	10,500	6.07	63,756.00	
英ボンド	PERSIMMON PLC	4,200	19.14	80,409.00	

TAYLOR WIMPEY PLC	34,300	1.51	52,050.25
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	1,400	38.73	54,222.00
BURBERRY GROUP PLC	4,800	22.60	108,480.00
CARNIVAL PLC	1,700	34.73	59,041.00
COMPASS GROUP PLC	19,200	20.80	399,360.00
GVC HOLDINGS PLC	5,800	6.82	39,579.20
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	2,300	50.80	116,840.00
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	6,200	4.51	27,999.20
TUI AG-DI	5,400	8.52	46,029.60
WHITBREAD PLC	1,600	44.69	71,504.00
OCADO GROUP PLC	4,300	13.31	57,254.50
MARKS & SPENCER PLC	20,640	1.96	40,557.60
NEXT PLC	1,800	61.44	110,592.00
KINGFISHER PLC	25,000	1.98	49,712.50
MORRISON SUPERMARKETS	20,000	1.86	37,240.00
SAINSBURY	18,000	2.00	36,144.00
TESCO PLC	123,000	2.29	282,039.00
COCA-COLA HBC AG-DI	1,900	28.20	53,580.00
DIAGEO PLC	28,400	34.89	990,876.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	4,700	23.70	111,390.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	28,100	29.10	817,710.00
IMPERIAL BRANDS PLC	12,000	21.42	257,100.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	8,600	64.03	550,658.00
UNILEVER PLC	13,200	51.79	683,628.00
SMITH & NEPHEW PLC	11,100	19.45	215,895.00
NMC HEALTH PLC	800	27.59	22,072.00
ASTRAZENECA PLC	15,620	71.91	1,123,234.20
GLAXOSMITHKLINE PLC	59,500	17.01	1,012,571.00
BARCLAYS PLC	209,000	1.39	292,223.80
HSBC HOLDINGS PLC	245,000	5.98	1,467,060.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	820,000	0.50	410,246.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,000	1.90	108,556.50
STANDARD CHARTERED PLC	34,900	6.45	225,384.20
ADMIRAL GROUP PLC	2,900	20.67	59,943.00
AVIVA PLC	44,100	3.64	160,700.40

	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	12,000	2.84	34,116.00	
	LEGAL & GENERAL	78,000	2.32	181,116.00	
	PRUDENTIAL PLC	31,200	14.23	443,976.00	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	12,100	5.22	63,258.80	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	3,235	10.85	35,099.75	
	SAGE GROUP PLC (THE)	13,500	7.07	95,526.00	
	HALMA PLC	3,800	19.99	75,981.00	
	BT GROUP PLC	99,000	1.67	166,042.80	
	VODAFONE GROUP PLC	315,000	1.53	484,218.00	
	SSE PLC	13,700	11.68	160,084.50	
	CENTRICA PLC	55,000	0.69	38,005.00	
	NATIONAL GRID PLC	41,500	8.45	350,799.50	
	SEVERN TRENT PLC	2,700	20.62	55,674.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,300	8.07	58,969.40	
	3I GROUP PLC	12,400	11.53	142,972.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,600	19.50	70,218.00	
	INVESTEC PLC	6,200	4.37	27,118.80	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	3,600	72.08	259,488.00	
	SCHRODERS PLC	1,100	28.33	31,163.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	6,200	9.71	60,239.20	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	23,447	2.50	58,734.73	
	EXPERIAN PLC	10,400	25.86	268,944.00	
	INTERTEK GROUP PLC	2,200	55.54	122,188.00	
	RELX PLC	22,900	19.40	444,260.00	
	INFORMA PLC	17,000	8.48	144,228.00	
	ITV PLC	41,000	1.21	49,692.00	
	PEARSON	8,800	8.45	74,430.40	
	WPP PLC	17,000	9.71	165,138.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	13,000	5.16	67,132.00	
小計	銘柄数：94			21,340,270.27	
				(2,815,421,856)	
	組入時価比率：5.7%			6.0%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,200	18.77	41,305.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	70	586.00	41,020.00	
	GIVAUDAN-REG	114	2,700.00	307,800.00	
		1,530	143.75	219,937.50	

SIKA AG-REG				
LAFARGEHOLCIM LTD	5,700	47.02	268,014.00	
GEBERIT AG-REG	490	456.00	223,440.00	
ABB LTD	22,100	19.06	421,336.50	
SCHINDLER HOLDING AG-REG	320	225.60	72,192.00	
SCHINDLER HOLDING-PART CERT	580	227.70	132,066.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	630	147.20	92,736.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	6,500	77.88	506,220.00	
THE SWATCH GROUP AG-B	340	275.40	93,636.00	
THE SWATCH GROUP AG-REG	550	51.85	28,517.50	
DUFREY AG-REG	280	81.78	22,898.40	
BARRY CALLEBAUT AG	22	2,004.00	44,088.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	14	7,205.00	100,870.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	80,400.00	80,400.00	
NESTLE SA-REG	36,910	111.90	4,130,229.00	
ALCON INC	4,922	59.50	292,859.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	690	225.00	155,250.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	100	818.60	81,860.00	
NOVARTIS AG-REG	25,980	88.18	2,290,916.40	
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	8,500	271.05	2,303,925.00	
VIFOR PHARMA AG	590	157.55	92,954.50	
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	280	73.90	20,692.00	
BALOISE HOLDING AG	580	168.00	97,440.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	390	479.60	187,044.00	
SWISS RE LTD	3,470	99.30	344,571.00	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,810	365.10	660,831.00	
TEMENOS AG-REG	770	173.85	133,864.50	
SWISSCOM AG-REG	340	490.00	166,600.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	32,300	12.08	390,184.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	2,500	40.92	102,300.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	240	812.80	195,072.00	
UBS GROUP AG	45,500	10.65	484,802.50	
LONZA AG-REG	840	353.10	296,604.00	
ADECCO GROUP AG-REG	1,910	54.10	103,331.00	
SGS SA-REG	57	2,473.00	140,961.00	

	SWISS PRIME SITE-REG	786	97.75	76,831.50	
小計	銘柄数：39			15,445,599.30	
				(1,675,538,612)	
	組入時価比率：3.4%			3.6%	
スウェーデン ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	2,500	309.00	772,500.00	
	BOLIDEN AB	2,600	228.75	594,750.00	
	ASSA ABLOY AB-B	12,300	210.70	2,591,610.00	
	SKANSKA AB-B SHS	4,700	191.90	901,930.00	
	ALFA LAVAL AB	3,000	184.00	552,000.00	
	ATLAS COPCO AB-A	8,800	296.60	2,610,080.00	
	ATLAS COPCO AB-B	4,800	264.90	1,271,520.00	
	EPIROC AB - A	6,900	99.56	686,964.00	
	EPIROC AB - B	3,500	95.14	332,990.00	
	SANDVIK AB	12,800	144.90	1,854,720.00	
	SKF AB-B SHARES	4,600	162.45	747,270.00	
	VOLVO AB-B SHS	19,600	137.25	2,690,100.00	
	SECURITAS AB-B SHS	4,300	147.00	632,100.00	
	ELECTROLUX AB-B	2,600	220.40	573,040.00	
	HUSQVARNA AB-B SHS	4,600	78.60	361,560.00	
	HENNES&MAURITZ AB-B	10,000	187.38	1,873,800.00	
	ICA GRUPPEN AB	900	464.40	417,960.00	
	SWEDISH MATCH AB	1,900	415.80	790,020.00	
	ESSITY AKTIEBOLAG-B	7,400	294.90	2,182,260.00	
	NORDEA BANK ABP	40,000	64.50	2,580,000.00	
	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	18,400	85.30	1,569,520.00	
	SVENSKA HANDELSBANKEN-A	17,100	87.80	1,501,380.00	
	SWEDBANK AB	9,600	129.35	1,241,760.00	
	INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,000	210.40	420,800.00	
	INVESTOR AB-B SHS	5,600	461.70	2,585,520.00	
	KINNEVIK AB - B	3,400	277.70	944,180.00	
	LUNDBERGS AB-B SHS	800	373.60	298,880.00	
	ERICSSON LM-B	37,000	76.94	2,846,780.00	
	HEXAGON AB-B SHS	3,000	435.30	1,305,900.00	
	TELIA CO AB	32,000	42.92	1,373,440.00	
	MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-	570	499.20	284,544.00	

	SDR				
	TELE 2 AB-B SHS	6,900	141.30	974,970.00	
小計	銘柄数：32			40,364,848.00 (446,031,570)	
	組入時価比率：0.9%			0.9%	
ノルウェーク ローネ	AKER AB ASA	1,000	251.50	251,500.00	
	EQUINOR ASA	11,500	166.75	1,917,625.00	
	YARA INTERNATIONAL ASA	2,300	404.40	930,120.00	
	NORSK HYDRO	14,200	30.92	439,064.00	
	MOWI ASA	5,700	216.80	1,235,760.00	
	ORKLA ASA	10,200	82.20	838,440.00	
	DNB ASA	11,700	150.45	1,760,265.00	
	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,600	178.70	464,620.00	
	TELENOR ASA	8,700	185.40	1,612,980.00	
	SCHIBSTED ASA-B SHS	900	261.80	235,620.00	
小計	銘柄数：10			9,685,994.00 (114,972,748)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
デンマークク ローネ	CHR HANSEN HOLDING A/S	1,500	583.20	874,800.00	
	NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,500	290.30	725,750.00	
	VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,300	500.40	1,150,920.00	
	ISS A/S	1,900	170.45	323,855.00	
	A P MOLLER - MAERSK A/S-A	51	7,175.00	365,925.00	
	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	79	7,646.00	604,034.00	
	DSV A/S	2,660	693.20	1,843,912.00	
	PANDORA A/S	1,290	300.20	387,258.00	
	CARLSBERG B	1,270	1,019.00	1,294,130.00	
	COLOPLAST-B	1,290	816.80	1,053,672.00	
	DEMANT A/S	1,300	205.40	267,020.00	
	GENMAB A/S	780	1,430.00	1,115,400.00	
	H LUNDBECK A/S	700	246.50	172,550.00	
	NOVO NORDISK A/S-B	21,400	355.05	7,598,070.00	
	DANSKE BANK AS	7,200	90.56	652,032.00	
	TRYG A/S	1,000	206.80	206,800.00	
	ORSTED A/S	2,300	670.20	1,541,460.00	

小計	銘柄数：17			20,177,588.00 (319,411,218)	
	組入時価比率：0.6%			0.7%	
豪ドル	WORLEYPARSONS LTD	2,600	12.50	32,500.00	
	CALTEX AUSTRALIA LIMITED	3,200	24.22	77,504.00	
	OIL SEARCH LTD	14,000	7.05	98,700.00	
	ORIGIN ENERGY LTD	17,000	7.47	126,990.00	
	SANTOS LTD.	23,000	7.29	167,670.00	
	WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	900	20.85	18,765.00	
	WOODSIDE PETROLEUM	11,500	31.66	364,090.00	
	INCITEC PIVOT LTD	17,000	3.18	54,060.00	
	ORICA LTD	5,600	21.68	121,408.00	
	BORAL LTD	14,000	4.37	61,180.00	
	JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	5,200	22.82	118,664.00	
	ALUMINA LTD	26,200	2.19	57,378.00	
	BHP GROUP LIMITED	36,200	36.07	1,305,734.00	
	BLUESCOPE STEEL LTD	7,300	12.79	93,367.00	
	FORTESCUE METALS GROUP LTD	15,000	8.27	124,050.00	
	NEWCREST MINING	10,100	37.68	380,568.00	
	RIO TINTO LTD	4,600	90.03	414,138.00	
	SOUTH32 LTD	61,000	2.71	165,310.00	
	CIMIC GROUP LTD	1,045	30.18	31,538.10	
	BRAMBLES LTD	21,000	11.32	237,720.00	
	AURIZON HOLDINGS LTD	19,000	5.98	113,620.00	
	SYDNEY AIRPORT	16,000	8.41	134,560.00	
	TRANSURBAN GROUP	30,561	15.05	459,943.05	
	ARISTOCRAT LEISURE LTD	8,000	29.59	236,720.00	
	CROWN RESORTS LTD	4,800	12.10	58,080.00	
	FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	800	48.48	38,784.00	
	TABCORP HOLDINGS	18,320	4.72	86,470.40	
	HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	5,865	4.42	25,923.30	
	WESFARMERS LIMITED	13,000	39.21	509,730.00	
	COLES GROUP LTD	13,000	14.66	190,580.00	
	WOOLWORTHS GROUP LTD	16,000	37.55	600,800.00	
	COCA-COLA AMATIL LTD	4,300	11.00	47,300.00	

	TREASURY WINE ESTATES LTD	9,100	18.86	171,626.00	
	COCHLEAR LTD	740	212.86	157,516.40	
	RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,900	63.56	120,764.00	
	SONIC HEALTHCARE LTD	4,900	29.12	142,688.00	
	CSL LIMITED	5,430	239.65	1,301,299.50	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	35,200	26.88	946,176.00	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	4,126	9.09	37,505.34	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	3,700	10.89	40,293.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	21,100	79.25	1,672,175.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	34,000	27.51	935,340.00	
	WESTPAC BANKING CORP	41,400	28.49	1,179,486.00	
	AMP LIMITED	31,000	1.66	51,460.00	
	CHALLENGER LIMITED	6,000	6.67	40,020.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	27,328	8.12	221,903.36	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	30,000	3.44	103,200.00	
	QBE INSURANCE	16,400	12.37	202,868.00	
	SUNCORP GROUP LTD	13,700	13.68	187,416.00	
	COMPUTERSHARE LTD	6,600	15.28	100,848.00	
	TELSTRA CORP LTD	42,000	3.59	150,780.00	
	TPG TELECOM LTD	4,359	6.41	27,941.19	
	AUSNET SERVICES	25,264	1.78	44,969.92	
	APA GROUP	12,700	10.83	137,541.00	
	AGL ENERGY LTD	6,300	19.02	119,826.00	
	ASX LTD	2,000	84.54	169,080.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	3,910	125.26	489,766.60	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	1,900	52.89	100,491.00	
	SEEK LTD	3,800	20.90	79,420.00	
	REA GROUP LTD	600	106.35	63,810.00	
小計	銘柄数：60			15,550,055.16	
				(1,133,754,521)	
	組入時価比率：2.3%			2.4%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	13,000	4.62	60,060.00	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	13,000	9.44	122,720.00	
	A2 MILK CO LTD	8,000	15.10	120,800.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE	6,500	17.20	111,800.00	

		CORPORATION L				
		RYMAN HEALTHCARE LTD	5,000	13.47	67,350.00	
		SPARK NEW ZEALAND LTD	20,000	4.57	91,400.00	
		MERIDIAN ENERGY LTD	15,300	5.54	84,762.00	
	小計	銘柄数：7			658,892.00	
					(44,956,201)	
		組入時価比率：0.1%			0.1%	
	香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	33,416	69.00	2,305,704.00	
		NWS HOLDINGS LTD	19,000	13.58	258,020.00	
		TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	18,000	57.70	1,038,600.00	
		MTR CORP	19,000	46.70	887,300.00	
		YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	5,500	21.50	118,250.00	
		GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	29,000	51.90	1,505,100.00	
		MGM CHINA HOLDINGS LTD	13,600	12.20	165,920.00	
		SANDS CHINA LTD	27,200	36.45	991,440.00	
		SHANGRI-LA ASIA LTD	7,000	8.05	56,350.00	
		SJM HOLDINGS LIMITED	24,000	7.84	188,160.00	
		WYNN MACAU LTD	18,000	16.30	293,400.00	
		VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	8,000	37.75	302,000.00	
		WH GROUP LIMITED	106,000	6.81	721,860.00	
		BANK OF EAST ASIA	11,540	19.80	228,492.00	
		BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	48,000	26.85	1,288,800.00	
		HANG SENG BANK	8,800	168.00	1,478,400.00	
		AIA GROUP LTD	146,600	78.55	11,515,430.00	
		ASM PACIFIC TECHNOLOGY	3,200	98.15	314,080.00	
		HKT TRUST AND HKT LTD	38,120	12.68	483,361.60	
		PCCW LTD	41,000	4.26	174,660.00	
		CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	9,000	52.60	473,400.00	
		CLP HLDGS	20,500	80.55	1,651,275.00	
		POWER ASSETS HOLDINGS LTD	20,000	52.30	1,046,000.00	
		HONG KONG & CHINA GAS	127,153	15.36	1,953,070.08	
		HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	14,600	247.20	3,609,120.00	
		CK ASSET HOLDINGS LTD	29,416	55.20	1,623,763.20	
		HANG LUNG PROPERTIES LTD	22,000	18.44	405,680.00	

	HENDERSON LAND	17,845	37.50	669,187.50	
	HYSAN DEVELOPMENT	7,000	31.50	220,500.00	
	KERRY PROPERTIES	6,500	26.05	169,325.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	73,333	10.30	755,329.90	
	SINO LAND CO.LTD	31,000	11.66	361,460.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	20,000	115.10	2,302,000.00	
	SWIRE PACIFIC-A	5,000	76.10	380,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	10,800	26.45	285,660.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	16,200	44.85	726,570.00	
	WHARF(HOLDING)	10,200	17.20	175,440.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	8,000	47.10	376,800.00	
小計	銘柄数：38			41,500,408.28	
				(566,895,577)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
シンガポール ド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	18,000	3.96	71,280.00	
	KEPPEL CORP.	16,000	5.90	94,400.00	
	SEBACORP INDUSTRIES	12,000	2.12	25,440.00	
	YANGZIJANG SHIPBUILDING	27,000	0.96	26,055.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	8,000	8.99	71,920.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	21,000	2.49	52,290.00	
	SATS LTD	8,000	4.79	38,320.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	81,000	0.89	72,495.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	1,111	30.67	34,074.37	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	86,000	0.26	22,790.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	18,000	3.83	68,940.00	
	DBS GROUP HLDGS	22,800	24.63	561,564.00	
	OCBC-ORD	39,050	10.77	420,568.50	
	UNITED OVERSEAS BANK	14,600	25.26	368,796.00	
	VENTURE CORP LTD	3,200	15.09	48,288.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	92,000	3.21	295,320.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	12,000	8.50	102,000.00	
	CAPITALAND LIMITED	32,000	3.51	112,320.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	4,000	9.43	37,720.00	
	UOL GROUP LIMITED	3,000	7.48	22,440.00	

		SINGAPORE PRESS HOLDINGS	17,000	1.96	33,320.00	
	小計	銘柄数：21			2,580,340.87	
					(199,537,759)	
		組入時価比率：0.4%			0.4%	
	新シェケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	6,000	16.10	96,600.00	
		ELBIT SYSTEMS LTD	270	569.00	153,630.00	
		BANK HAPOLIM BM	14,000	26.79	375,060.00	
		BANK LEUMI LE-ISRAEL	18,000	24.20	435,600.00	
		ISRAEL DISCOUNT BANK-A	14,000	14.37	201,180.00	
		MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,100	82.25	90,475.00	
		NICE LTD	810	538.00	435,780.00	
		AZRIELI GROUP	400	257.50	103,000.00	
	小計	銘柄数：8			1,891,325.00	
					(57,496,280)	
		組入時価比率：0.1%			0.1%	
	合計				47,131,347,695	
					(47,131,347,695)	

(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9月6日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	6,100	92,049.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,450	220,675.50	
		AMERICAN TOWER CORP	5,220	1,230,615.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	16,800	140,616.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,560	334,947.60	
		BOSTON PROPERTIES	1,660	215,169.20	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	960	105,120.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,930	725,055.10	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,340	296,407.80	
		DUKE REALTY CORP	4,800	160,320.00	
		EQUINIX INC	980	539,980.00	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	1,190	160,650.00	

	EQUITY RESIDENTIAL	4,500	386,955.00	
	ESSEX PROPERTY TRUST INC	860	279,259.20	
	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,610	195,132.00	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	780	104,059.80	
	HCP INC	6,100	215,635.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	7,700	128,744.00	
	INVITATION HOMES INC	5,400	154,494.00	
	IRON MOUNTAIN INC	3,400	112,506.00	
	KIMCO REALTY CORP	5,000	94,550.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	1,400	72,912.00	
	MACERICH CO /THE	800	23,840.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,420	182,257.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,700	93,891.00	
	PROLOGIS INC	7,600	642,884.00	
	PUBLIC STORAGE	1,910	493,276.60	
	REALTY INCOME CORP	4,100	307,500.00	
	REGENCY CENTERS CORP	2,300	153,134.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,290	339,528.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	3,650	547,719.00	
	SL GREEN REALTY CORP	940	75,660.60	
	SUN COMMUNITIES INC	1,210	179,430.90	
	UDR INC	3,400	164,390.00	
	VENTAS INC	4,200	313,404.00	
	VEREIT INC	11,100	107,226.00	
	VORNADO REALTY TRUST	1,770	109,598.40	
	WELLTOWER INC	4,990	454,539.10	
	WEYERHAEUSER CO	8,300	220,697.00	
	WP CAREY INC	1,800	162,270.00	
小計	銘柄数：40	147,220	10,537,097.80	
			(1,128,207,061)	
	組入時価比率：2.3%		81.8%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	1,200	27,096.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,986	51,854.46	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	700	22,351.00	
小計	銘柄数：3	3,886	101,301.46	

			(8,197,314)	
	組入時価比率：0.0%		0.6%	
ユーロ	COVIVIO	560	53,816.00	
	GECINA SA	560	79,016.00	
	ICADE	230	18,664.50	
	KLEPIERRE	2,200	61,336.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,820	218,400.00	
小計	銘柄数：5	5,370	431,232.50	
			(50,911,308)	
	組入時価比率：0.1%		3.7%	
英ポンド	BRITISH LAND	9,100	47,483.80	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	7,312	55,892.92	
	SEGRO PLC	14,700	115,600.80	
小計	銘柄数：3	31,112	218,977.52	
			(28,889,704)	
	組入時価比率：0.1%		2.1%	
豪ドル	DEXUS	13,200	170,676.00	
	GOODMAN GROUP	21,100	295,400.00	
	GPT GROUP	26,000	164,060.00	
	LENDLEASE GROUP	6,600	112,860.00	
	MIRVAC GROUP	54,000	169,560.00	
	SCENTRE GROUP	68,000	270,640.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	25,800	114,810.00	
	VICINITY CENTRES	44,000	113,520.00	
小計	銘柄数：8	258,700	1,411,526.00	
			(102,914,360)	
	組入時価比率：0.2%		7.5%	
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	30,000	225,600.00	
	LINK REIT	26,000	2,324,400.00	
小計	銘柄数：2	56,000	2,550,000.00	
			(34,833,000)	
	組入時価比率：0.1%		2.5%	
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	34,000	109,140.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	37,954	83,119.26	
	CAPITALAND MALL TRUST	27,800	75,060.00	
	SUNTEC REIT	29,000	56,260.00	

	小計	銘柄数：4	128,754	323,579.26 (25,022,384)	
		組入時価比率：0.1%		1.8%	
合計				1,378,975,131 (1,378,975,131)	

(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 9月 6日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	1,423,467,368	-	1,447,453,072	23,985,704
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	47,363,331,967	-	47,864,362,100	501,030,133
米ドル	32,802,126,974	-	33,083,965,500	281,838,526
カナダドル	1,793,990,643	-	1,821,006,600	27,015,957
ユーロ	5,372,536,120	-	5,435,222,400	62,686,280
英ポンド	2,794,884,163	-	2,856,539,400	61,655,237
スイスフラン	1,640,533,216	-	1,658,491,200	17,957,984
スウェーデンクローナ	423,543,951	-	433,049,500	9,505,549
ノルウェークローネ	109,504,077	-	111,721,200	2,217,123
デンマーククローネ	308,599,753	-	312,009,300	3,409,547
豪ドル	1,212,999,146	-	1,238,110,000	25,110,854
ニュージーランドドル	42,097,017	-	42,928,200	831,183
香港ドル	586,359,771	-	591,839,600	5,479,829
シンガポールドル	219,643,208	-	222,364,800	2,721,592
新シェケル	56,513,928	-	57,114,400	600,472
合計	-	-	-	477,044,429

（注）時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券NOMURA - B P I 総合 マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2019年 9月 6日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	5,862,036,828
国債証券	524,239,680,130
地方債証券	45,117,949,332
特殊債券	58,065,386,385
社債券	26,983,713,000
未収利息	1,845,587,982
前払費用	28,306,240
流動資産合計	662,142,659,897
資産合計	662,142,659,897
負債の部	
流動負債	
未払金	100,000,000
未払解約金	755,689,147
未払利息	9,753
流動負債合計	855,698,900
負債合計	855,698,900
純資産の部	
元本等	
元本	485,418,655,642
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	175,868,305,355
元本等合計	661,286,960,997
純資産合計	661,286,960,997
負債純資産合計	662,142,659,897

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 9月 6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	1.3623円
(10,000口当たり純資産額)	(13,623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 9月 7日 至 2019年 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2018年 9月 7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	501,468,969,614円
同期中における追加設定元本額	65,614,795,954円
同期中における一部解約元本額	81,665,109,926円
期末元本額	485,418,655,642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	485,206,910円
野村世界 6 資産分散投信（安定コース）	36,029,411,288円
野村世界 6 資産分散投信（分配コース）	17,211,907,414円
野村世界 6 資産分散投信（成長コース）	2,588,626,185円
野村資産設計ファンド 2 0 1 5	365,274,197円
野村資産設計ファンド 2 0 2 0	347,946,667円
野村資産設計ファンド 2 0 2 5	286,168,592円
野村資産設計ファンド 2 0 3 0	202,082,649円
野村資産設計ファンド 2 0 3 5	100,884,049円
野村資産設計ファンド 2 0 4 0	156,455,927円
野村日本債券インデックスファンド	986,033,111円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）	180,413,741,343円
のむラップ・ファンド（保守型）	12,126,676,482円
のむラップ・ファンド（普通型）	8,126,459,246円
のむラップ・ファンド（積極型）	974,981,927円
野村日本債券インデックス（野村 S M A 向け）	10,890,895,051円
野村資産設計ファンド 2 0 4 5	15,613,711円
野村円債投資インデックスファンド	1,238,447,870円
野村インデックスファンド・国内債券	3,088,216,030円
マイ・ロード	35,195,407,198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	836,082,856円
野村ターゲットブライズ「日経 2 2 5」（国内債券運用移行型）	24,132,577円
野村日本債券インデックス（野村 S M A ・ E W 向け）	11,896,926,962円
野村世界 6 資産分散投信（配分変更コース）	1,560,347,605円
野村資産設計ファンド 2 0 5 0	19,564,327円

野村ターゲットデートファンド2016	2026 - 2028年目標型	15,772,011円
野村ターゲットデートファンド2016	2029 - 2031年目標型	4,026,620円
野村ターゲットデートファンド2016	2032 - 2034年目標型	2,499,040円
野村ターゲットデートファンド2016	2035 - 2037年目標型	1,560,486円
のむラップ・ファンド（やや保守型）		736,917,899円
のむラップ・ファンド（やや積極型）		148,155,225円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		60,542,562円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		21,734,178円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		49,258,758円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		8,519,435円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		13,805,162円
野村6資産均等バランス		834,639,796円
世界6資産分散ファンド		168,053,043円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI 総合連動型上場投信		815,558,196円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型		10,588,332,294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）		654,525,456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）		161,680,784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）		2,100,879,181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）		1,382,361,265円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）		19,220,480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）		10,666,952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）		1,137,893円
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）		4,047,321,553円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）		16,340,548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）		111,114,984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）		103,101,081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）		331,295,606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）		323,315,952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）		777,051,774円
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）		1,546,101,782円
ノムラ日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）		836,752,594円
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）		1,822,293,813円
マイバランス30（確定拠出年金向け）		16,460,777,778円
マイバランス50（確定拠出年金向け）		23,734,777,442円
マイバランス70（確定拠出年金向け）		10,221,331,272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）		47,865,503,099円
マイバランスDC30		10,593,577,532円
マイバランスDC50		7,310,220,242円
マイバランスDC70		2,273,799,563円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI 総合		11,921,180,735円
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）		453,702,144円
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）		866,009,027円
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）		374,354,035円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース		55,434,481円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース		11,024,235円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース		9,264,264円
野村資産設計ファンド（DC）2030		7,139,071円

野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０４０	2,352,538円
野村資産設計ファンド（ＤＣ）２０５０	1,621,076円
マイターゲット２０３５（確定拠出年金向け）	228,737,130円
マイターゲット２０４５（確定拠出年金向け）	92,483,961円
マイターゲット２０５５（確定拠出年金向け）	22,082,744円
マイターゲット２０６０（確定拠出年金向け）	31,256,696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9月6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9月6日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付（２年）第４０２回	1,400,000,000	1,410,178,000	
		国庫債券 利付（２年）第４０３回	1,500,000,000	1,511,415,000	
		国庫債券 利付（５年）第１２６回	7,500,000,000	7,536,525,000	
		国庫債券 利付（５年）第１２７回	6,000,000,000	6,035,820,000	
		国庫債券 利付（５年）第１２８回	5,200,000,000	5,236,712,000	
		国庫債券 利付（５年）第１２９回	4,000,000,000	4,033,080,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３０回	5,000,000,000	5,047,050,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３１回	4,800,000,000	4,850,064,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３２回	3,000,000,000	3,034,440,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３３回	2,200,000,000	2,228,270,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３４回	3,000,000,000	3,042,240,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３５回	4,500,000,000	4,569,840,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３６回	4,300,000,000	4,372,369,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３７回	3,000,000,000	3,053,310,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３８回	3,900,000,000	3,974,490,000	
		国庫債券 利付（５年）第１３９回	1,400,000,000	1,428,308,000	
		国庫債券 利付（５年）第１４０回	1,400,000,000	1,429,918,000	
		国庫債券 利付（４０年）第１回	2,360,000,000	3,802,172,400	
		国庫債券 利付（４０年）第２回	900,000,000	1,415,646,000	
		国庫債券 利付（４０年）第３回	900,000,000	1,430,190,000	
		国庫債券 利付（４０年）第４回	1,300,000,000	2,089,646,000	
		国庫債券 利付（４０年）第５回	1,200,000,000	1,873,956,000	
		国庫債券 利付（４０年）第６回	1,300,000,000	2,006,966,000	
		国庫債券 利付（４０年）第７回	1,400,000,000	2,088,324,000	

国庫債券 利付（４０年）第８回	1,500,000,000	2,104,020,000	
国庫債券 利付（４０年）第９回	1,900,000,000	2,019,035,000	
国庫債券 利付（４０年）第１０回	2,100,000,000	2,608,557,000	
国庫債券 利付（４０年）第１１回	1,500,000,000	1,815,435,000	
国庫債券 利付（４０年）第１２回	100,000,000	109,981,000	
国庫債券 利付（１０年）第３１２回	4,950,000,000	5,044,050,000	
国庫債券 利付（１０年）第３１３回	3,200,000,000	3,277,984,000	
国庫債券 利付（１０年）第３１４回	2,200,000,000	2,246,860,000	
国庫債券 利付（１０年）第３１５回	3,600,000,000	3,695,868,000	
国庫債券 利付（１０年）第３１６回	1,400,000,000	1,434,776,000	
国庫債券 利付（１０年）第３１７回	1,800,000,000	1,851,462,000	
国庫債券 利付（１０年）第３１８回	3,200,000,000	3,284,960,000	
国庫債券 利付（１０年）第３１９回	1,850,000,000	1,909,662,500	
国庫債券 利付（１０年）第３２０回	3,500,000,000	3,604,825,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２１回	3,200,000,000	3,306,304,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２２回	2,400,000,000	2,473,608,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２３回	1,700,000,000	1,757,392,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２４回	3,200,000,000	3,299,072,000	
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	2,170,980,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２７回	3,100,000,000	3,215,041,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２８回	5,000,000,000	5,165,850,000	
国庫債券 利付（１０年）第３２９回	5,300,000,000	5,529,119,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３０回	3,800,000,000	3,975,370,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３１回	1,900,000,000	1,972,162,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３２回	5,400,000,000	5,619,186,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３３回	4,200,000,000	4,380,432,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３４回	7,600,000,000	7,946,940,000	
	4,200,000,000	4,381,650,000	

国庫債券 利付（１０年）第３３５回			
国庫債券 利付（１０年）第３３６回	1,700,000,000	1,777,724,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３７回	1,700,000,000	1,759,432,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３８回	3,700,000,000	3,857,435,000	
国庫債券 利付（１０年）第３３９回	3,000,000,000	3,133,590,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４０回	4,200,000,000	4,395,384,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４１回	3,700,000,000	3,855,622,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４２回	2,750,000,000	2,833,572,500	
国庫債券 利付（１０年）第３４３回	5,400,000,000	5,570,640,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４４回	5,300,000,000	5,473,840,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４５回	5,000,000,000	5,170,000,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４６回	5,400,000,000	5,589,972,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４７回	4,400,000,000	4,560,116,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４８回	4,500,000,000	4,665,375,000	
国庫債券 利付（１０年）第３４９回	5,000,000,000	5,185,200,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５０回	7,950,000,000	8,246,217,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５１回	5,100,000,000	5,288,649,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５２回	4,800,000,000	4,975,872,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５３回	5,100,000,000	5,284,620,000	
国庫債券 利付（１０年）第３５４回	3,850,000,000	3,987,329,500	
国庫債券 利付（３０年）第１回	100,000,000	130,773,000	
国庫債券 利付（３０年）第２回	200,000,000	255,496,000	
国庫債券 利付（３０年）第３回	160,000,000	203,484,800	
国庫債券 利付（３０年）第４回	900,000,000	1,214,685,000	
国庫債券 利付（３０年）第５回	150,000,000	191,953,500	
国庫債券 利付（３０年）第６回	700,000,000	919,492,000	
国庫債券 利付（３０年）第７回	600,000,000	786,648,000	
国庫債券 利付（３０年）第８回	100,000,000	125,336,000	
国庫債券 利付（３０年）第９回	265,000,000	318,280,900	
国庫債券 利付（３０年）第１０回	250,000,000	290,535,000	
国庫債券 利付（３０年）第１１回	160,000,000	199,537,600	

国庫債券 利付（３０年）第１２回	220,000,000	287,438,800	
国庫債券 利付（３０年）第１３回	290,000,000	376,040,100	
国庫債券 利付（３０年）第１４回	800,000,000	1,086,792,000	
国庫債券 利付（３０年）第１５回	900,000,000	1,240,758,000	
国庫債券 利付（３０年）第１６回	915,000,000	1,265,463,300	
国庫債券 利付（３０年）第１７回	1,200,000,000	1,647,600,000	
国庫債券 利付（３０年）第１８回	1,500,000,000	2,041,980,000	
国庫債券 利付（３０年）第１９回	1,600,000,000	2,185,792,000	
国庫債券 利付（３０年）第２０回	1,400,000,000	1,962,618,000	
国庫債券 利付（３０年）第２１回	1,400,000,000	1,924,188,000	
国庫債券 利付（３０年）第２２回	600,000,000	846,486,000	
国庫債券 利付（３０年）第２３回	840,000,000	1,189,339,200	
国庫債券 利付（３０年）第２４回	700,000,000	994,637,000	
国庫債券 利付（３０年）第２５回	500,000,000	695,110,000	
国庫債券 利付（３０年）第２６回	850,000,000	1,199,120,500	
国庫債券 利付（３０年）第２７回	1,550,000,000	2,226,575,000	
国庫債券 利付（３０年）第２８回	1,200,000,000	1,736,472,000	
国庫債券 利付（３０年）第２９回	1,500,000,000	2,156,355,000	
国庫債券 利付（３０年）第３０回	1,700,000,000	2,423,248,000	
国庫債券 利付（３０年）第３１回	1,600,000,000	2,262,016,000	
国庫債券 利付（３０年）第３２回	1,900,000,000	2,740,731,000	
国庫債券 利付（３０年）第３３回	2,100,000,000	2,915,808,000	
国庫債券 利付（３０年）第３４回	2,100,000,000	3,019,737,000	
国庫債券 利付（３０年）第３５回	2,300,000,000	3,228,027,000	
国庫債券 利付（３０年）第３６回	2,300,000,000	3,244,817,000	
国庫債券 利付（３０年）第３７回	2,300,000,000	3,210,294,000	
国庫債券 利付（３０年）第３８回	1,600,000,000	2,207,440,000	
国庫債券 利付（３０年）第３９回	1,600,000,000	2,250,608,000	
国庫債券 利付（３０年）第４０回	1,100,000,000	1,524,501,000	
国庫債券 利付（３０年）第４１回	1,500,000,000	2,047,050,000	
国庫債券 利付（３０年）第４２回	1,600,000,000	2,189,248,000	
国庫債券 利付（３０年）第４３回	1,300,000,000	1,783,509,000	
国庫債券 利付（３０年）第４４回	1,400,000,000	1,925,812,000	
国庫債券 利付（３０年）第４５回	1,700,000,000	2,258,960,000	
国庫債券 利付（３０年）第４６回	1,800,000,000	2,397,402,000	
国庫債券 利付（３０年）第４７回	1,700,000,000	2,311,762,000	
国庫債券 利付（３０年）第４８回	1,900,000,000	2,491,850,000	
国庫債券 利付（３０年）第４９回	1,900,000,000	2,497,303,000	
国庫債券 利付（３０年）第５０回	1,600,000,000	1,858,192,000	
国庫債券 利付（３０年）第５１回	1,600,000,000	1,651,152,000	
国庫債券 利付（３０年）第５２回	1,900,000,000	2,059,372,000	
国庫債券 利付（３０年）第５３回	1,700,000,000	1,888,105,000	

国庫債券	利付（３０年）第５４回	1,700,000,000	1,979,021,000
国庫債券	利付（３０年）第５５回	1,500,000,000	1,748,340,000
国庫債券	利付（３０年）第５６回	1,900,000,000	2,214,317,000
国庫債券	利付（３０年）第５７回	1,400,000,000	1,631,378,000
国庫債券	利付（３０年）第５８回	2,100,000,000	2,449,944,000
国庫債券	利付（３０年）第５９回	1,600,000,000	1,825,136,000
国庫債券	利付（３０年）第６０回	1,050,000,000	1,256,829,000
国庫債券	利付（３０年）第６１回	1,200,000,000	1,369,740,000
国庫債券	利付（３０年）第６２回	1,300,000,000	1,410,695,000
国庫債券	利付（３０年）第６３回	900,000,000	950,580,000
国庫債券	利付（２０年）第４８回	200,000,000	207,154,000
国庫債券	利付（２０年）第４９回	200,000,000	207,352,000
国庫債券	利付（２０年）第５０回	183,000,000	189,163,440
国庫債券	利付（２０年）第５１回	310,000,000	322,706,900
国庫債券	利付（２０年）第５２回	100,000,000	104,908,000
国庫債券	利付（２０年）第５３回	250,000,000	263,800,000
国庫債券	利付（２０年）第５４回	100,000,000	105,750,000
国庫債券	利付（２０年）第５５回	231,000,000	244,568,940
国庫債券	利付（２０年）第５６回	120,000,000	127,749,600
国庫債券	利付（２０年）第５７回	210,000,000	222,973,800
国庫債券	利付（２０年）第５８回	180,000,000	192,196,800
国庫債券	利付（２０年）第５９回	230,000,000	245,396,200
国庫債券	利付（２０年）第６０回	780,000,000	824,460,000
国庫債券	利付（２０年）第６１回	300,000,000	314,232,000
国庫債券	利付（２０年）第６２回	440,000,000	459,021,200
国庫債券	利付（２０年）第６３回	300,000,000	324,384,000
国庫債券	利付（２０年）第６４回	400,000,000	436,344,000
国庫債券	利付（２０年）第６５回	455,000,000	499,039,450
国庫債券	利付（２０年）第６６回	300,000,000	327,735,000
国庫債券	利付（２０年）第６７回	310,000,000	341,762,600
国庫債券	利付（２０年）第６８回	290,000,000	323,709,600
国庫債券	利付（２０年）第６９回	560,000,000	622,524,000
国庫債券	利付（２０年）第７０回	540,000,000	611,712,000
国庫債券	利付（２０年）第７１回	200,000,000	224,618,000
国庫債券	利付（２０年）第７２回	670,000,000	753,468,600
国庫債券	利付（２０年）第７３回	1,600,000,000	1,801,264,000
国庫債券	利付（２０年）第７４回	900,000,000	1,018,053,000
国庫債券	利付（２０年）第７５回	600,000,000	682,446,000
国庫債券	利付（２０年）第７６回	910,000,000	1,024,796,500
国庫債券	利付（２０年）第７７回	700,000,000	792,246,000
国庫債券	利付（２０年）第７８回	800,000,000	905,880,000
国庫債券	利付（２０年）第７９回	860,000,000	978,895,000
国庫債券	利付（２０年）第８０回	900,000,000	1,029,726,000

国庫債券 利付（２０年）第８１回	360,000,000	411,858,000	
国庫債券 利付（２０年）第８２回	820,000,000	943,172,200	
国庫債券 利付（２０年）第８３回	1,370,000,000	1,584,487,200	
国庫債券 利付（２０年）第８４回	1,200,000,000	1,380,168,000	
国庫債券 利付（２０年）第８５回	400,000,000	465,136,000	
国庫債券 利付（２０年）第８６回	1,400,000,000	1,646,666,000	
国庫債券 利付（２０年）第８７回	500,000,000	584,760,000	
国庫債券 利付（２０年）第８８回	1,100,000,000	1,301,476,000	
国庫債券 利付（２０年）第８９回	470,000,000	552,823,400	
国庫債券 利付（２０年）第９０回	1,500,000,000	1,773,765,000	
国庫債券 利付（２０年）第９１回	250,000,000	297,427,500	
国庫債券 利付（２０年）第９２回	1,550,000,000	1,831,604,000	
国庫債券 利付（２０年）第９３回	300,000,000	354,081,000	
国庫債券 利付（２０年）第９４回	200,000,000	237,598,000	
国庫債券 利付（２０年）第９５回	700,000,000	846,965,000	
国庫債券 利付（２０年）第９６回	400,000,000	477,592,000	
国庫債券 利付（２０年）第９７回	1,300,000,000	1,569,997,000	
国庫債券 利付（２０年）第９８回	300,000,000	359,835,000	
国庫債券 利付（２０年）第９９回	2,100,000,000	2,530,059,000	
国庫債券 利付（２０年）第１００回	1,520,000,000	1,852,484,800	
国庫債券 利付（２０年）第１０１回	250,000,000	309,060,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０２回	500,000,000	620,865,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０３回	600,000,000	739,638,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０４回	400,000,000	485,888,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０５回	1,900,000,000	2,316,784,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０６回	400,000,000	491,444,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０７回	300,000,000	367,320,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０８回	1,600,000,000	1,928,624,000	
国庫債券 利付（２０年）第１０９回	900,000,000	1,088,289,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１０回	1,100,000,000	1,351,592,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１１回	800,000,000	994,456,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１２回	1,800,000,000	2,219,526,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１３回	2,000,000,000	2,475,880,000	
	1,700,000,000	2,112,573,000	

国庫債券 利付（２０年）第１１４回			
国庫債券 利付（２０年）第１１５回	1,000,000,000	1,253,200,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１６回	1,100,000,000	1,383,855,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１７回	1,400,000,000	1,746,220,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１８回	500,000,000	620,485,000	
国庫債券 利付（２０年）第１１９回	800,000,000	975,168,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２０回	800,000,000	957,568,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２１回	1,700,000,000	2,097,919,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２２回	1,100,000,000	1,345,102,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２３回	1,500,000,000	1,891,560,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２４回	1,000,000,000	1,249,540,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２５回	900,000,000	1,149,408,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２６回	1,000,000,000	1,253,630,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２７回	1,200,000,000	1,490,268,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２８回	1,800,000,000	2,242,422,000	
国庫債券 利付（２０年）第１２９回	800,000,000	987,040,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３０回	1,400,000,000	1,732,332,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３１回	800,000,000	980,112,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３２回	1,300,000,000	1,597,856,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３３回	1,400,000,000	1,738,254,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３４回	1,400,000,000	1,742,944,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３５回	700,000,000	862,561,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３６回	700,000,000	853,657,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３７回	1,000,000,000	1,235,380,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３８回	800,000,000	967,552,000	
国庫債券 利付（２０年）第１３９回	1,000,000,000	1,222,410,000	
	2,300,000,000	2,848,435,000	

国庫債券 利付（２０年）第１４０回			
国庫債券 利付（２０年）第１４１回	2,600,000,000	3,227,666,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４２回	950,000,000	1,192,117,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４３回	1,300,000,000	1,599,728,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４４回	1,300,000,000	1,581,944,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４５回	2,300,000,000	2,868,353,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４６回	2,400,000,000	2,999,784,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４７回	2,200,000,000	2,725,976,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４８回	2,100,000,000	2,578,149,000	
国庫債券 利付（２０年）第１４９回	2,350,000,000	2,890,124,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５０回	1,830,000,000	2,228,464,200	
国庫債券 利付（２０年）第１５１回	2,500,000,000	2,972,000,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５２回	1,700,000,000	2,023,000,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５３回	2,450,000,000	2,959,526,500	
国庫債券 利付（２０年）第１５４回	3,000,000,000	3,579,930,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５５回	2,800,000,000	3,255,812,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５６回	2,600,000,000	2,767,284,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５７回	2,590,000,000	2,667,933,100	
国庫債券 利付（２０年）第１５８回	2,800,000,000	3,025,540,000	
国庫債券 利付（２０年）第１５９回	2,700,000,000	2,962,008,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６０回	1,500,000,000	1,670,835,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６１回	2,100,000,000	2,303,511,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６２回	1,700,000,000	1,863,744,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６３回	1,900,000,000	2,083,616,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６４回	2,600,000,000	2,804,464,000	
国庫債券 利付（２０年）第１６５回	2,200,000,000	2,373,118,000	
	2,300,000,000	2,567,283,000	

	小計	国庫債券 利付（２０年）第１６６回			
		国庫債券 利付（２０年）第１６７回	2,100,000,000	2,263,149,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６８回	2,000,000,000	2,116,920,000	
		国庫債券 利付（２０年）第１６９回	1,100,000,000	1,142,658,000	
		メキシコ合衆国 第２２回円貨社債（２０１６）	300,000,000	301,707,000	
		メキシコ合衆国 第２５回円貨社債（２０１８）	100,000,000	99,845,000	
		ポーランド共和国 第１５回円貨債券（２０１３）	100,000,000	100,587,000	
		銘柄数：260	461,699,000,000	524,239,680,130	
		組入時価比率：79.3%		80.1%	
	合計			524,239,680,130	
地方債証券	日本円	東京都 公募第６９０回	200,000,000	203,334,000	
		東京都 公募第７０３回	100,000,000	102,275,000	
		東京都 公募第７０７回	100,000,000	102,200,000	
		東京都 公募第７０８回	100,000,000	102,463,000	
		東京都 公募第７１０回	100,000,000	102,244,000	
		東京都 公募第７１２回	100,000,000	102,339,000	
		東京都 公募第７１５回	100,000,000	102,498,000	
		東京都 公募第７１６回	200,000,000	205,062,000	
		東京都 公募第７３１回	100,000,000	102,854,000	
		東京都 公募第７４５回	300,000,000	309,057,000	
		東京都 公募第７６０回	100,000,000	100,105,000	
		東京都 公募第７６１回	100,000,000	100,315,000	
		東京都 公募第７６９回	500,000,000	506,750,000	
		東京都 公募（３０年）第７回	100,000,000	141,675,000	
		東京都 公募第１０回	200,000,000	279,658,000	
		東京都 公募第１回	300,000,000	317,445,000	
		東京都 公募（２０年）第３回	200,000,000	220,434,000	
		東京都 公募第７回	100,000,000	112,938,000	
		東京都 公募（２０年）第１６回	200,000,000	236,148,000	
		東京都 公募（２０年）第１７回	200,000,000	237,628,000	
		東京都 公募第２３回	100,000,000	122,469,000	
		東京都 公募（２０年）第２６回	100,000,000	120,537,000	
		北海道 公募平成２４年度第６回	100,000,000	102,460,000	
		北海道 公募平成２４年度第９回	100,000,000	102,440,000	
		北海道 公募平成２５年度第１回	300,000,000	306,138,000	
		北海道 公募平成２６年度第１３回	100,000,000	102,309,000	
		北海道 公募平成２７年度第７回	100,000,000	102,983,000	
		北海道 公募平成２８年度第１３回	200,000,000	200,036,000	

北海道	公募平成29年度第5回	200,000,000	201,920,000	
北海道	公募平成29年度第6回	700,000,000	699,902,000	
北海道	公募平成29年度第7回	100,000,000	101,193,000	
北海道	公募平成29年度第9回	100,000,000	101,166,000	
宮城県	公募第32回2号	100,000,000	100,525,000	
神奈川県	公募第184回	100,000,000	101,834,000	
神奈川県	公募第188回	200,000,000	205,310,000	
神奈川県	公募第196回	100,000,000	102,396,000	
神奈川県	公募第200回	100,000,000	103,311,000	
神奈川県	公募第205回	100,000,000	102,985,000	
神奈川県	公募第206回	100,000,000	103,106,000	
神奈川県	公募第210回	200,000,000	204,662,000	
神奈川県	公募第231回	200,000,000	202,958,000	
神奈川県	公募（30年）第3回	100,000,000	141,089,000	
神奈川県	公募第7回	300,000,000	349,242,000	
神奈川県	公募（20年）第14回	100,000,000	120,018,000	
神奈川県	公募（20年）第17回	200,000,000	243,580,000	
大阪府	公募第346回	100,000,000	101,757,000	
大阪府	公募第356回	100,000,000	102,454,000	
大阪府	公募第378回	104,000,000	107,054,480	
大阪府	公募第381回	100,000,000	103,035,000	
大阪府	公募第382回	100,000,000	103,048,000	
大阪府	公募第383回	100,000,000	103,198,000	
大阪府	公募第384回	100,000,000	103,143,000	
大阪府	公募第387回	300,000,000	307,644,000	
大阪府	公募第389回	100,000,000	102,675,000	
大阪府	公募第417回	102,000,000	103,613,640	
大阪府	公募第423回	100,000,000	101,155,000	
大阪府	公募第429回	179,000,000	181,357,430	
大阪府	公募第5回	100,000,000	121,526,000	
大阪府	公募第8回	100,000,000	120,556,000	
大阪府	公募（5年）第130回	600,000,000	600,114,000	
大阪府	公募（5年）第137回	1,024,000,000	1,024,030,720	
大阪府	公募（5年）第141回	230,000,000	230,006,900	
京都府	公募平成24年度第2回	100,000,000	102,523,000	
京都府	公募平成24年度第6回	100,000,000	102,498,000	
京都府	公募平成26年度第5回	100,000,000	118,942,000	
京都府	公募平成26年度第7回	200,000,000	205,576,000	
兵庫県	公募平成26年度第17回	100,000,000	102,462,000	
兵庫県	公募平成29年度第22回	100,000,000	101,244,000	
兵庫県	公募（30年）第2回	100,000,000	141,031,000	
兵庫県	公募（15年）第1回	300,000,000	333,648,000	

兵庫県 公募（１５年）第３回	200,000,000	220,580,000	
兵庫県 公募（１２年）第３回	300,000,000	309,243,000	
兵庫県 公募第２回	100,000,000	118,656,000	
兵庫県 公募第９回	100,000,000	121,398,000	
兵庫県 公募（２０年）第１１回	200,000,000	237,010,000	
兵庫県 公募（２０年）第１４回	100,000,000	119,875,000	
静岡県 公募平成２４年度第５回	100,060,000	102,490,457	
静岡県 公募平成２４年度第１０回	100,000,000	102,414,000	
静岡県 公募平成２５年度第５回	101,000,000	104,613,780	
静岡県 公募平成２６年度第３回	165,000,000	170,248,650	
静岡県 公募平成２６年度第８回	100,000,000	102,798,000	
静岡県 公募平成２６年度第９回	200,000,000	205,580,000	
静岡県 公募平成２７年度第１１回	115,400,000	115,994,310	
静岡県 公募平成２８年度第２回	300,000,000	300,957,000	
静岡県 公募平成２９年度第３回	100,000,000	101,007,000	
静岡県 公募（３１年）第１回	174,000,000	174,642,060	
静岡県 公募（２０年）第１１回	100,000,000	119,064,000	
静岡県 公募（２０年）第１４回	100,000,000	120,486,000	
愛知県 公募平成２０年度第８回	100,000,000	118,352,000	
愛知県 公募平成２２年度第９回	100,000,000	101,239,000	
愛知県 公募平成２３年度第１９回	100,000,000	102,488,000	
愛知県 公募平成２４年度第２回	100,000,000	102,586,000	
愛知県 公募（２０年）平成２４年度第４回	100,000,000	119,838,000	
愛知県 公募（１５年）平成２４年度第１４回	400,000,000	441,992,000	
愛知県 公募平成２４年度第１７回	100,000,000	122,036,000	
愛知県 公募（３０年）平成２５年度第８回	120,000,000	165,871,200	
愛知県 公募平成２６年度第８回	100,000,000	134,724,000	
愛知県 公募平成２６年度第１３回	100,000,000	117,910,000	
愛知県 公募（１５年）平成２７年度第２回	100,000,000	106,654,000	
愛知県 公募平成２７年度第１５回	100,000,000	102,836,000	
愛知県 公募平成２９年度第９回	100,000,000	100,874,000	
広島県 公募平成２２年度第６回	300,000,000	305,283,000	
広島県 公募平成２４年度第４回	100,000,000	102,614,000	
広島県 公募平成２５年度第３回	200,000,000	206,440,000	
広島県 公募平成２６年度第５回	109,650,000	111,540,366	
広島県 公募平成２９年度第４回	111,300,000	112,931,658	
埼玉県 公募平成２４年度第４回	300,000,000	307,185,000	
埼玉県 公募平成２５年度第４回	100,000,000	103,556,000	
埼玉県 公募平成２５年度第６回	148,000,000	152,808,520	
埼玉県 公募平成２５年度第１０回	100,000,000	102,974,000	

埼玉県 公募平成 2 5 年度第 1 1 回	100,000,000	102,957,000	
埼玉県 公募平成 2 6 年度第 3 回	100,000,000	103,126,000	
埼玉県 公募平成 2 6 年度第 6 回	200,000,000	205,498,000	
埼玉県 公募平成 2 6 年度第 7 回	400,000,000	409,876,000	
埼玉県 公募平成 2 6 年度第 9 回	100,000,000	102,291,000	
埼玉県 公募平成 2 7 年度第 9 回	100,000,000	101,417,000	
埼玉県 公募平成 3 0 年度第 7 回	200,000,000	200,122,000	
埼玉県 公募（ 2 0 年 ）第 2 0 回	100,000,000	107,313,000	
福岡県 公募平成 2 2 年度第 5 回	100,000,000	101,085,000	
福岡県 公募平成 2 3 年度第 5 回	100,000,000	102,186,000	
福岡県 公募平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	103,115,000	
福岡県 公募平成 2 7 年度第 1 回	300,000,000	309,861,000	
福岡県 公募平成 2 9 年度第 1 回	100,000,000	101,274,000	
福岡県 公募平成 2 3 年度第 1 回	100,000,000	110,507,000	
福岡県 公募（ 3 0 年 ）平成 1 9 年度第 1 回	100,000,000	142,228,000	
福岡県 公募（ 3 0 年 ）平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	135,025,000	
福岡県 公募（ 3 0 年 ・ 定時償還 ）平成 2 9 年度第 2 回	100,000,000	114,901,000	
福岡県 公募（ 2 0 年 ）平成 2 0 年度第 2 回	100,000,000	118,444,000	
福岡県 公募（ 2 0 年 ）平成 2 4 年度第 2 回	100,000,000	119,442,000	
千葉県 公募平成 2 4 年度第 1 回	100,000,000	102,701,000	
千葉県 公募平成 2 4 年度第 2 回	100,000,000	102,461,000	
千葉県 公募平成 2 4 年度第 7 回	100,000,000	102,436,000	
千葉県 公募平成 2 4 年度第 8 回	100,000,000	102,844,000	
千葉県 公募平成 2 5 年度第 3 回	100,000,000	103,361,000	
千葉県 公募平成 2 5 年度第 4 回	100,000,000	103,554,000	
千葉県 公募平成 2 6 年度第 3 回	200,000,000	205,896,000	
千葉県 公募平成 2 8 年度第 4 回	200,000,000	200,770,000	
千葉県 公募（ 2 0 年 ）第 8 回	100,000,000	121,778,000	
千葉県 公募（ 2 0 年 ）第 1 7 回	100,000,000	118,395,000	
群馬県 公募第 8 回	100,000,000	102,295,000	
群馬県 公募第 1 2 回	100,000,000	103,001,000	
群馬県 公募（ 2 0 年 ）第 3 回	100,000,000	119,896,000	
岐阜県 公募平成 2 6 年度第 1 回	186,670,000	191,810,891	
大分県 公募平成 2 3 年度第 1 回	902,000,000	921,438,100	
共同発行市場地方債 公募第 9 2 回	110,000,000	111,394,800	
共同発行市場地方債 公募第 9 3 回	300,000,000	304,920,000	
共同発行市場地方債 公募第 9 4 回	300,000,000	305,199,000	
共同発行市場地方債 公募第 9 6 回	100,000,000	102,012,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 0 1 回	300,000,000	306,231,000	

共同発行市場地方債 公募第 1 0 2 回	150,000,000	153,178,500
共同発行市場地方債 公募第 1 0 3 回	100,000,000	102,144,000
共同発行市場地方債 公募第 1 0 4 回	200,000,000	204,590,000
共同発行市場地方債 公募第 1 0 8 回	200,000,000	205,146,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 0 回	200,000,000	204,832,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 1 回	200,000,000	204,952,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 2 回	100,000,000	102,395,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 3 回	800,000,000	818,272,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 4 回	243,700,000	249,780,315
共同発行市場地方債 公募第 1 1 5 回	100,000,000	102,507,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 6 回	200,000,000	205,150,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 8 回	100,000,000	102,844,000
共同発行市場地方債 公募第 1 1 9 回	200,000,000	205,548,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 0 回	300,000,000	307,239,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 1 回	100,000,000	102,065,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 2 回	400,000,000	409,172,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 4 回	100,000,000	103,517,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 6 回	100,000,000	103,261,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 8 回	300,000,000	308,286,000
共同発行市場地方債 公募第 1 2 9 回	100,000,000	103,032,000
共同発行市場地方債 公募第 1 3 0 回	100,000,000	103,311,000
共同発行市場地方債 公募第 1 3 2 回	100,000,000	102,979,000
共同発行市場地方債 公募第 1 3 6 回	200,000,000	205,896,000
共同発行市場地方債 公募第 1 3 7 回	200,000,000	205,530,000
共同発行市場地方債 公募第 1 3 9 回	155,000,000	159,247,000
共同発行市場地方債 公募第 1 4 3 回	540,000,000	552,933,000
	1,000,000,000	1,022,270,000

共同発行市場地方債 公募第 1 4 5 回			
共同発行市場地方債 公募第 1 5 6 回	100,000,000	100,451,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 5 7 回	300,000,000	300,978,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 6 1 回	300,000,000	300,624,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 7 2 回	200,000,000	202,942,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 8 4 回	100,000,000	101,175,000	
共同発行市場地方債 公募第 1 9 0 回	410,000,000	413,981,100	
堺市 公募平成 2 2 年度第 1 回	100,000,000	120,641,000	
堺市 公募平成 2 2 年度第 2 回	100,000,000	101,639,000	
堺市 公募平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	130,930,000	
島根県 公募平成 2 2 年度第 1 回	100,000,000	101,332,000	
島根県 公募平成 2 8 年度第 3 回	100,000,000	100,013,000	
佐賀県 公募平成 2 8 年度第 1 回	100,000,000	100,332,000	
福島県 公募平成 2 6 年度第 1 回	200,000,000	205,068,000	
滋賀県 公募平成 2 5 年度第 1 回	100,000,000	102,728,000	
滋賀県 公募平成 2 6 年度第 1 回	142,000,000	145,598,280	
栃木県 公募平成 2 4 年度第 1 回	100,000,000	102,553,000	
栃木県 公募平成 2 5 年度第 1 回	100,000,000	102,728,000	
新潟市 公募平成 2 5 年度第 1 回	233,200,000	240,375,564	
新潟市 公募平成 2 9 年度第 1 回	100,000,000	101,398,000	
奈良県 公募平成 2 8 年度第 1 回	100,000,000	100,013,000	
浜松市 公募平成 2 6 年度第 1 回	100,000,000	101,748,000	
大阪市 公募平成 2 5 年度第 6 回	100,000,000	102,901,000	
大阪市 公募平成 2 6 年度第 5 回	100,000,000	102,947,000	
大阪市 公募（ 5 年 ）平成 2 8 年度第 5 回	100,000,000	100,013,000	
大阪市 公募（ 1 5 年 ）第 1 回	100,000,000	111,800,000	
大阪市 公募（ 2 0 年 ）第 1 回	300,000,000	355,374,000	
大阪市 公募（ 2 0 年 ）第 5 回	100,000,000	121,739,000	
大阪市 公募（ 2 0 年 ）第 6 回	100,000,000	119,924,000	
大阪市 公募（ 2 0 年 ）第 1 7 回	100,000,000	120,454,000	
名古屋市 公募第 4 7 8 回	100,000,000	102,688,000	
名古屋市 公募第 4 8 1 回	100,000,000	102,446,000	
名古屋市 公募第 4 8 8 回	300,000,000	308,883,000	
名古屋市 公募（ 1 2 年 ）第 1 回	200,000,000	211,822,000	
名古屋市 公募（ 1 5 年 ）第 2 回	100,000,000	108,046,000	
京都市 公募平成 2 3 年度第 4 回	100,000,000	102,457,000	
京都市 公募平成 2 9 年度第 4 回	101,280,000	102,925,800	
京都市 公募（ 2 0 年 ）第 2 回	100,000,000	112,697,000	

京都市 公募（２０年）第１３回	100,000,000	117,884,000	
神戸市 公募平成２６年度第１７回	300,000,000	304,365,000	
神戸市 公募平成２８年度第１回	200,000,000	200,650,000	
横浜市 公募平成２２年度第５回	100,000,000	101,611,000	
横浜市 公募公債平成２４年度２回	200,000,000	205,072,000	
横浜市 公募公債平成２５年度１回	200,000,000	204,892,000	
横浜市 公募公債平成２５年度５回	200,000,000	205,456,000	
横浜市 公募公債平成２６年度５回	200,000,000	204,856,000	
横浜市 公募平成２８年度第５回	300,000,000	304,335,000	
横浜市 公募平成２９年度第３回	100,000,000	101,433,000	
横浜市 公募（３０年）第２回	200,000,000	270,902,000	
横浜市 公募（２０年）第１８回	100,000,000	120,845,000	
横浜市 公募（２０年）第２６回	100,000,000	121,301,000	
横浜市 公募（２０年）第３０回	100,000,000	118,019,000	
札幌市 公募（１５年）平成２３年度第９回	100,000,000	110,814,000	
札幌市 公募（２０年）平成２４年度第１１回	100,000,000	121,643,000	
札幌市 公募平成２６年度第４回	100,000,000	102,560,000	
札幌市 公募平成２６年度第９回	200,000,000	204,440,000	
川崎市 公募第８５回	100,000,000	102,367,000	
川崎市 公募（２０年）第１７回	100,000,000	118,346,000	
北九州市 公募（２０年）第１４回	100,000,000	120,433,000	
福岡市 公募（２０年）平成２３年度第４回	100,000,000	120,986,000	
福岡市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	119,275,000	
福岡市 公募平成２６年度第５回	100,000,000	102,719,000	
福岡市 公募平成２６年度第８回	160,000,000	164,035,200	
広島市 公募平成２６年度第２回	100,000,000	102,363,000	
広島市 公募平成２７年度第２回	500,000,000	514,135,000	
広島市 公募（１０年）平成３０年度第６回	241,000,000	243,041,270	
千葉市 公募平成２４年度第１回	100,000,000	102,701,000	
三重県 公募平成２４年度第１回	140,660,000	144,190,566	
三重県 公募平成２８年度第１回	155,000,000	156,466,300	
鹿児島県 公募（５年）平成２８年度第１回	100,000,000	100,012,000	
福井県 公募平成２２年度第２回	100,000,000	102,294,000	
福井県 公募平成２４年度第４回	100,000,000	101,667,000	
福井県 公募平成２７年度第４回	200,000,000	200,720,000	
徳島県 公募平成２２年度第１回	400,000,000	405,228,000	
山梨県 公募平成２４年度第１回	200,000,000	205,026,000	
岡山県 公募平成２８年度第２回	168,900,000	171,053,475	
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第９６回	100,000,000	120,847,000	

	小計	愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	300,000,000	367,497,000	
		福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	120,109,000	
		福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	107,783,000	
		銘柄数：255 組入時価比率：6.8%	42,722,820,000	45,117,949,332 6.9%	
		合計		45,117,949,332	
特殊債券	日本円	フランス預金供託公庫 第4回円貨債券（2014）	100,000,000	103,747,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	155,039,250	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	198,095,650	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	109,426,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	200,170,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	108,697,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	307,071,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	109,300,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第86回	300,000,000	303,720,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第96回	100,000,000	100,997,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	104,839,680	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000	163,283,460	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第38回	1,500,000,000	1,504,980,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	304,329,000	
		道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	315,141,000	
		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	138,743,000	
		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	231,244,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第17回	100,000,000	116,165,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回	200,000,000	236,376,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第33回	200,000,000	335,318,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第39回	200,000,000	241,012,000	
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回	100,000,000	122,084,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第80回	100,000,000	102,480,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第84回	400,000,000	410,216,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	204,722,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第89回	100,000,000	120,323,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第100回	200,000,000	205,120,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第102回	100,000,000	102,335,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第103回	350,000,000	424,809,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回	100,000,000	123,557,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第123回	100,000,000	103,080,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第130回	200,000,000	205,212,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第134回	200,000,000	204,916,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第136回	200,000,000	205,616,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第145回	300,000,000	383,793,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第149回	100,000,000	129,940,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第157回	100,000,000	108,115,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第173回	100,000,000	105,892,000	
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	102,960,000	
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	103,114,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回	200,000,000	242,002,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回	200,000,000	242,658,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回	200,000,000	245,120,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回	200,000,000	244,054,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	240,748,000	
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	137,956,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第137回	840,000,000	859,908,000	
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	143,445,400	
	100,000,000	102,402,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回			
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	143,465,000	
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	1,027,280,000	
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	134,227,000	
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	102,710,000	
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	120,129,000	
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	223,842,400	
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	119,306,000	
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	409,632,000	
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	205,618,000	
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	205,598,000	
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	205,502,000	
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	928,539,000	
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	122,102,000	
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	200,541,320	
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	410,436,000	
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	1,037,230,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回	272,000,000	282,058,560	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回	300,000,000	310,161,000	
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	141,621,010	
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	149,877,800	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第216回	100,000,000	120,550,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	100,000,000	134,044,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第219回	100,000,000	120,603,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	100,000,000	103,542,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	100,000,000	134,365,000	
	190,000,000	196,102,800	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	100,000,000	102,663,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第239回	500,000,000	579,405,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第271回	151,000,000	151,487,730	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第321回	500,000,000	507,005,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第335回	100,000,000	114,645,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第342回	131,000,000	132,845,790	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第351回	100,000,000	101,452,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第354回	200,000,000	202,628,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第13回	130,000,000	138,984,300	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	400,000,000	553,192,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回	100,000,000	140,049,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	139,879,000	
地方公営企業等金融機構債券（20年） 第1回	100,000,000	118,300,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	120,788,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	114,525,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	367,485,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	105,910,000	
地方公共団体金融機構債券 第27回	300,000,000	306,156,000	
地方公共団体金融機構債券 第28回	500,000,000	510,840,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	107,020,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	105,657,000	
地方公共団体金融機構債券 F122回	100,000,000	110,425,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第37回	604,000,000	620,658,320	
地方公共団体金融機構債券 第37回	400,000,000	409,488,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回	194,000,000	199,187,560	
	500,000,000	530,955,000	

地方公共団体金融機構債券 F 1 3 2 回			
政保 地方公共団体金融機構債券 第 3 9 回	100,000,000	102,641,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 0 回	101,000,000	103,801,740	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 1 回	102,000,000	104,822,340	
地方公共団体金融機構債券 第 4 1 回	600,000,000	615,006,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 2 回	100,000,000	105,119,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 4 回	200,000,000	201,320,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 5 回	200,000,000	211,306,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 7 回	100,000,000	109,144,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	108,000,000	111,108,240	
地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	100,000,000	102,569,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 3 回	202,000,000	207,502,480	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	145,000,000	149,555,900	
地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	100,000,000	102,666,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 5 回	223,000,000	230,020,040	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 0 回	100,000,000	108,419,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 9 回	13,000,000	13,479,180	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 0 回	100,000,000	103,872,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 1 回	600,000,000	619,818,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 2 回	300,000,000	310,797,000	
地方公共団体金融機構債券（ 1 5 年 ） 第 2 回	200,000,000	219,876,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 6 回	591,000,000	612,695,610	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 9 回	116,000,000	120,063,480	
地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年 ） 第 3 8 回	100,000,000	119,452,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 0 回	300,000,000	330,081,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	102,913,000	
	100,000,000	102,773,000	

地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回			
地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年 ） 第 3 9 回	100,000,000	118,844,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 5 回	400,000,000	411,752,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 9 回	320,000,000	327,843,200	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 2 回	189,000,000	194,874,120	
地方公共団体金融機構債券 第 7 4 回	300,000,000	308,487,000	
地方公共団体金融機構債券 第 7 7 回	100,000,000	102,764,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 8 回	509,000,000	521,994,770	
地方公共団体金融機構債券 第 7 9 回	400,000,000	411,168,000	
政保 地方公共団体金融機構債券（ 8 年 ） 第 5 回	500,000,000	505,800,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 8 3 回	116,000,000	116,378,160	
地方公共団体金融機構債券 第 1 0 1 回	400,000,000	405,312,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 0 回	100,000,000	101,316,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 1 1 3 回	110,000,000	111,931,600	
公営企業債券（ 2 0 年 ） 第 2 回財投機関債	100,000,000	104,750,000	
公営企業債券（ 2 0 年 ） 第 5 回財投機関債	200,000,000	216,954,000	
公営企業債券（ 2 0 年 ） 第 2 5 回財投機関債	100,000,000	121,131,000	
首都高速道路 第 1 7 回	200,000,000	200,160,000	
都市再生債券 財投機関債第 5 5 回	100,000,000	102,189,000	
都市再生債券 財投機関債第 9 6 回	200,000,000	205,776,000	
都市再生債券 財投機関債第 9 7 回	100,000,000	109,200,000	
都市再生債券 財投機関債第 1 0 9 回	100,000,000	108,767,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第 7 回	100,000,000	112,616,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第 1 6 回	360,000,000	371,746,800	
東京交通債券 第 3 4 2 回	200,000,000	213,272,000	
東京交通債券 第 3 4 7 回	157,000,000	170,987,130	
関西国際空港社債 財投機関債第 3 2 回	100,000,000	102,372,000	
福祉医療機構債券 第 3 1 回財投機関債	100,000,000	102,584,000	
中部国際空港債券 政府保証第 1 8 回	368,000,000	377,969,120	

預金保険機構債券 政府保証第209回	2,000,000,000	2,005,200,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	200,000,000	232,640,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	100,000,000	108,639,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	100,000,000	110,487,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	100,000,000	120,415,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回	100,000,000	102,263,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	100,000,000	122,564,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	300,000,000	334,509,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	100,000,000	122,594,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回	100,000,000	102,179,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回	200,000,000	204,266,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	200,000,000	222,432,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回	100,000,000	122,335,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	100,000,000	141,895,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第132回	200,000,000	217,042,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第137回	100,000,000	110,691,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第143回	100,000,000	109,969,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第177回	250,000,000	256,797,500	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第198回	200,000,000	201,524,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第223回	100,000,000	103,701,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第244回	130,000,000	132,078,700	
成田国際空港 第10回	100,000,000	102,229,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	205,458,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	204,612,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第17回	100,000,000	102,178,000	
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	300,651,000	
商工債券 利付第811回い号	300,000,000	301,188,000	
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	100,429,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,448,000	

商工債券 利付第 8 1 9 回い号	300,000,000	301,485,000
しんきん中金債券 利付第 3 1 6 回	100,000,000	100,101,000
しんきん中金債券 利付第 3 1 7 回	800,000,000	800,720,000
しんきん中金債券 利付第 3 2 7 回	200,000,000	200,228,000
しんきん中金債券 利付第 3 3 5 回	200,000,000	200,532,000
商工債券 利付（ 3 年 ）第 2 2 3 回	500,000,000	500,995,000
商工債券 利付（ 1 0 年 ）第 1 5 回	200,000,000	203,278,000
国際協力機構債券 第 6 回財投機関債	100,000,000	122,255,000
東日本高速道路 第 3 4 回	100,000,000	100,368,000
東日本高速道路 第 3 6 回	200,000,000	200,266,000
中日本高速道路 第 6 3 回	100,000,000	103,053,000
中日本高速道路 第 6 6 回	1,200,000,000	1,200,864,000
西日本高速道路 第 2 0 回	200,000,000	205,880,000
西日本高速道路 第 2 2 回	400,000,000	412,736,000
西日本高速道路 第 2 3 回	100,000,000	102,684,000
西日本高速道路 第 3 0 回	300,000,000	301,995,000
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	103,017,000
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	205,580,000
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	118,717,000
貸付債権担保第 6 回住宅金融公庫債券	9,900,000	9,912,573
貸付債権担保第 1 2 回住宅金融公庫債券	33,978,000	34,505,338
貸付債権担保第 1 9 回住宅金融公庫債券	62,425,000	64,272,155
貸付債権担保第 1 0 回住宅金融公庫債券	62,952,000	63,352,374
貸付債権担保第 5 回 S 種住宅金融公庫債券	38,979,000	40,082,105
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融公庫債券	43,104,000	45,327,735
貸付債権担保第 7 回 S 種住宅金融公庫債券	13,433,000	14,004,305
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融公庫債券	28,974,000	30,152,082
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融公庫債券	33,016,000	34,893,289
貸付債権担保第 1 5 回住宅金融公庫債券	37,020,000	38,111,349
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融公庫債券	61,252,000	63,697,179
貸付債権担保第 2 0 回住宅金融公庫債券	63,535,000	65,767,619
貸付債権担保第 4 4 回住宅金融公庫債券	57,284,000	60,378,481

貸付債権担保第 8 回住宅金融支援機構債券	96,534,000	101,492,951	
貸付債権担保第 7 回住宅金融支援機構債券	15,861,000	16,655,794	
貸付債権担保第 2 5 回住宅金融支援機構債券	24,519,000	26,777,445	
貸付債権担保第 2 8 回住宅金融支援機構債券	82,539,000	89,303,071	
貸付債権担保 S 種第 1 6 回住宅金融支援機構債券	17,566,000	18,045,024	
貸付債権担保第 4 2 回住宅金融支援機構債券	87,842,000	93,486,726	
貸付債権担保 S 種第 1 7 回住宅金融支援機構債券	35,410,000	36,397,230	
貸付債権担保第 4 5 回住宅金融支援機構債券	106,173,000	113,871,604	
貸付債権担保第 5 2 回住宅金融支援機構債券	77,490,000	82,509,802	
貸付債権担保第 2 4 回住宅金融支援機構債券	44,226,000	47,945,406	
貸付債権担保第 4 8 回住宅金融支援機構債券	98,430,000	105,492,352	
貸付債権担保第 4 0 回住宅金融支援機構債券	109,392,000	115,426,062	
貸付債権担保第 6 2 回住宅金融支援機構債券	146,286,000	154,912,485	
貸付債権担保第 6 0 回住宅金融支援機構債券	143,148,000	152,501,290	
貸付債権担保第 6 1 回住宅金融支援機構債券	92,150,000	97,814,460	
貸付債権担保第 5 1 回住宅金融支援機構債券	35,747,000	38,137,401	
貸付債権担保第 4 3 回住宅金融支援機構債券	84,766,000	90,726,745	
貸付債権担保第 7 9 回住宅金融支援機構債券	47,956,000	50,431,968	
貸付債権担保第 8 1 回住宅金融支援機構債券	102,320,000	107,581,294	
貸付債権担保第 7 2 回住宅金融支援機構債券	46,404,000	48,739,049	
貸付債権担保第 2 2 回住宅金融公庫債券	26,342,000	27,191,002	
貸付債権担保第 7 0 回住宅金融支援機構債券	138,987,000	147,151,096	
貸付債権担保第 3 3 回住宅金融支援機構債券	30,629,000	33,125,569	
貸付債権担保第 3 4 回住宅金融支援機構債券	32,375,000	35,052,736	
貸付債権担保第 3 5 回住宅金融支援機構債券	32,453,000	34,824,989	
貸付債権担保第 4 6 回住宅金融支援機構債券	34,948,000	37,504,795	
	93,756,000	99,975,773	

貸付債権担保第 5 5 回住宅金融支援 機構債券			
貸付債権担保第 5 6 回住宅金融支援 機構債券	134,178,000	143,024,355	
貸付債権担保第 5 7 回住宅金融支援 機構債券	44,624,000	47,607,114	
貸付債権担保第 7 6 回住宅金融支援 機構債券	90,112,000	95,178,997	
貸付債権担保 S 種第 3 回住宅金融公 庫債券	12,474,000	12,821,899	
貸付債権担保 S 種第 1 4 回住宅金融 支援機構債券	75,435,000	76,982,171	
貸付債権担保 S 種第 1 5 回住宅金融 支援機構債券	30,774,000	31,397,788	
貸付債権担保第 2 3 回住宅金融支援 機構債券	86,576,000	93,581,729	
貸付債権担保第 3 2 回住宅金融支援 機構債券	87,684,000	94,451,451	
貸付債権担保第 3 9 回住宅金融支援 機構債券	173,510,000	183,877,222	
貸付債権担保第 5 8 回住宅金融支援 機構債券	94,382,000	100,749,953	
貸付債権担保第 6 4 回住宅金融支援 機構債券	154,332,000	163,318,752	
貸付債権担保第 7 1 回住宅金融支援 機構債券	134,733,000	141,526,237	
貸付債権担保第 7 3 回住宅金融支援 機構債券	104,506,000	111,149,446	
貸付債権担保第 7 5 回住宅金融支援 機構債券	89,234,000	94,471,143	
貸付債権担保第 8 3 回住宅金融支援 機構債券	216,136,000	227,078,965	
貸付債権担保第 8 4 回住宅金融支援 機構債券	377,384,000	395,962,614	
貸付債権担保第 8 8 回住宅金融支援 機構債券	56,691,000	59,356,610	
貸付債権担保第 8 9 回住宅金融支援 機構債券	59,306,000	62,134,896	
貸付債権担保第 9 0 回住宅金融支援 機構債券	60,531,000	63,182,863	
貸付債権担保第 9 2 回住宅金融支援 機構債券	126,044,000	130,868,964	
貸付債権担保第 9 3 回住宅金融支援 機構債券	132,054,000	136,180,687	
貸付債権担保第 9 4 回住宅金融支援 機構債券	71,117,000	74,081,867	
貸付債権担保第 9 6 回住宅金融支援 機構債券	74,710,000	77,637,884	
貸付債権担保第 9 7 回住宅金融支援 機構債券	221,895,000	231,687,226	
貸付債権担保第 9 8 回住宅金融支援 機構債券	226,929,000	237,991,788	
	151,860,000	159,147,761	

		貸付債権担保第 9 9 回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第 1 0 0 回住宅金融支援機構債券	74,670,000	78,071,965	
		貸付債権担保第 1 0 1 回住宅金融支援機構債券	74,979,000	78,600,485	
		貸付債権担保第 1 1 5 回住宅金融支援機構債券	265,494,000	271,223,360	
		貸付債権担保第 1 1 6 回住宅金融支援機構債券	177,988,000	182,558,731	
		貸付債権担保第 1 1 7 回住宅金融支援機構債券	179,058,000	183,521,915	
		貸付債権担保第 1 1 8 回住宅金融支援機構債券	89,748,000	92,104,782	
		貸付債権担保第 1 1 9 回住宅金融支援機構債券	179,806,000	184,425,216	
		貸付債権担保第 1 2 0 回住宅金融支援機構債券	90,660,000	92,475,919	
		貸付債権担保第 1 2 1 回住宅金融支援機構債券	90,832,000	92,835,753	
		貸付債権担保第 1 2 3 回住宅金融支援機構債券	92,029,000	94,252,420	
		貸付債権担保第 1 2 5 回住宅金融支援機構債券	369,588,000	377,523,054	
		貸付債権担保第 1 2 6 回住宅金融支援機構債券	278,835,000	285,501,944	
		貸付債権担保第 1 2 8 回住宅金融支援機構債券	186,402,000	190,596,045	
		貸付債権担保第 1 2 9 回住宅金融支援機構債券	187,900,000	192,875,592	
		貸付債権担保第 1 3 4 回住宅金融支援機構債券	192,306,000	196,171,350	
		貸付債権担保第 1 3 5 回住宅金融支援機構債券	96,265,000	98,299,079	
		貸付債権担保第 1 3 6 回住宅金融支援機構債券	96,582,000	98,884,514	
		貸付債権担保第 1 4 0 回住宅金融支援機構債券	97,771,000	99,608,117	
		貸付債権担保第 1 4 2 回住宅金融支援機構債券	295,143,000	299,682,299	
		貸付債権担保第 1 4 4 回住宅金融支援機構債券	297,294,000	302,279,620	
		小計			
		銘柄数：289	54,781,662,000	58,065,386,385	
		組入時価比率：8.8%		8.9%	
		合計		58,065,386,385	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（ＢＦＣＭ）第 1 4 回円貨社債	200,000,000	201,882,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第 1 1 回円貨社債	100,000,000	100,430,000	
		ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第 1 4 回円貨社債	100,000,000	100,765,000	

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	201,268,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第6回円貨社債（2014）	100,000,000	103,283,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第15回円貨社債（2018）	100,000,000	99,917,000	
クレディ・アグリコル・エス・ エー 第16回円貨社債（2018）	100,000,000	101,426,000	
スタンダード・チャータード 第3 回円貨社債（2015）	100,000,000	101,572,000	
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	102,258,000	
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	104,836,000	
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	100,425,000	
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	100,143,000	
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	99,403,000	
サントナデル銀行 第1回円貨社 債	100,000,000	100,457,000	
フランス電力 第4回円貨社債（2 017）	100,000,000	103,839,000	
現代キャピタル・サービス・イン ク 第15回円貨社債	200,000,000	201,974,000	
ビー・エヌ・ビー・パリバ 第1回 円貨社債（2017）	100,000,000	102,240,000	
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	201,270,000	
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	201,218,000	
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上 位円貨社債（2017）	100,000,000	100,217,000	
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	100,682,000	
大和ハウス工業 第9回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	102,060,000	
森永乳業 第13回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	103,472,000	
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	100,105,000	
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	100,762,000	
麒麟ホールディングス 第10回 社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,850,000	
味の素 第24回特定社債間限定同 順位特約付	200,000,000	200,896,000	
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	101,458,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,572,000	
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	104,030,000	

森ヒルズリート投資法人 第17回 特定投資法人債間限定同順位特	200,000,000	200,628,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	103,980,000	
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	103,224,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	101,462,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	205,476,000	
王子ホールディングス 第34回社 債間限定同順位特約付	100,000,000	101,761,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,767,000	
住友化学 第56回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,535,000	
三井化学 第47回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,474,000	
三井化学 第48回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,273,000	
三菱ケミカルホールディングス 第 14回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,466,000	
電通 第1回社債間限定同順位特約 付	100,000,000	100,184,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約 付	100,000,000	102,400,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	100,537,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	103,094,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特 約付	100,000,000	100,672,000	
JXホールディングス 第9回社債 間限定同順位特約付	100,000,000	103,273,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,641,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	103,101,000	
日本特殊陶業 第8回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,133,000	
新日鐵住金 第7回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,095,000	
新日鐵住金 第8回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,474,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,405,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	101,912,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	100,512,000	
ジェイ エフ イー ホールディン グス 第22回（JFEス保証	100,000,000	102,733,000	
	100,000,000	100,260,000	

DOWAホールディングス 第4回 社債間限定同順位特約付			
住友電気工業 第26回社債間限定 同順位特約付	200,000,000	202,672,000	
日立製作所 第17回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	221,512,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	100,642,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	102,708,000	
日本電気 第48回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,618,000	
富士通 第34回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,676,000	
パナソニック 第16回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,743,000	
パナソニック 第17回社債間限定 同順位特約付	200,000,000	203,830,000	
ソニー 第32回	200,000,000	201,568,000	
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	101,532,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	103,071,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同 順位特約付	100,000,000	101,181,000	
J A三井リース 第7回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,307,000	
J A三井リース 第8回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	100,766,000	
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	100,429,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定 同等特約付	100,000,000	103,275,000	
アイシン精機 第15回社債間限定 同順位特約付	100,000,000	102,422,000	
ドンキホーテホールディングス 第 12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,761,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同 順位特約付	100,000,000	101,433,000	
大日本印刷 第3回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	101,673,000	
伊藤忠商事 第59回社債間限定同 順位特約付	200,000,000	204,626,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位 特約付	100,000,000	100,705,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	105,460,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順 位特約付	200,000,000	210,696,000	
三井物産 第71回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	109,323,000	
住友商事 第45回社債間限定同順 位特約付	100,000,000	102,772,000	

住友商事 第 4 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	109,740,000	
高島屋 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,520,000	
丸井グループ 第 2 8 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,436,000	
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	103,250,000	
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	103,211,000	
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	102,783,000	
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	99,953,000	
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	100,276,000	
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	206,108,000	
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	117,855,000	
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	106,718,000	
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	101,112,000	
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	201,140,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第 1 回劣後特約付	300,000,000	307,365,000	
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	103,043,000	
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	108,811,000	
三菱ＵＦＪ信託銀行 第 9 回劣後特約付	100,000,000	102,532,000	
三井住友信託銀行 第 1 回劣後特約付	300,000,000	310,227,000	
セブン銀行 第 1 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,443,000	
セブン銀行 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,884,000	
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	205,526,000	
三井住友銀行 第 2 4 回劣後特約付	100,000,000	102,527,000	
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	101,118,000	
リコーリース 第 2 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,355,000	
アコム 第 7 6 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,970,000	
アコム 第 7 7 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,153,000	
ジャックス 第 1 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,027,000	

ジャックス 第 1 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,433,000	
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	100,780,000	
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	102,223,000	
三菱ＵＦＪリース 第 5 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,585,000	
三菱ＵＦＪリース 第 5 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,016,000	
三菱ＵＦＪリース 第 3 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,711,000	
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	103,898,000	
三菱地所 第 5 6 回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	106,543,000	
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	102,596,000	
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	100,845,000	
東京建物 第 2 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,621,000	
ダイビル 第 1 9 回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,742,000	
住友不動産 第 9 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,693,000	
住友不動産 第 9 7 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	206,888,000	
住友不動産 第 1 0 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,194,000	
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	103,753,000	
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	120,310,000	
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	103,025,000	
東武鉄道 第 1 0 2 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,188,000	
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	204,640,000	
東京急行電鉄 第 7 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,567,000	
東京急行電鉄 第 8 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,877,000	
小田急電鉄 第 6 8 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	219,150,000	
小田急電鉄 第 7 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,207,000	
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	211,566,000	
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	111,245,000	
	200,000,000	241,038,000	

東日本旅客鉄道 第 5 7 回社債間限定同順位特約付			
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	118,952,000	
東日本旅客鉄道 第 1 0 6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,726,000	
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	123,011,000	
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	122,590,000	
西日本旅客鉄道 第 1 5 回社債間限定同順位特約付	300,000,000	352,692,000	
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	102,062,000	
東海旅客鉄道 第 5 1 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	243,122,000	
東海旅客鉄道 第 7 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	114,015,000	
東海旅客鉄道 第 7 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	129,210,000	
東京地下鉄 第 2 2 回	100,000,000	100,763,000	
東京地下鉄 第 2 3 回	100,000,000	105,973,000	
東京地下鉄 第 2 4 回	100,000,000	114,795,000	
西武ホールディングス 第 1 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	207,286,000	
名古屋鉄道 第 5 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,147,000	
日本通運 第 1 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,586,000	
日本通運 第 1 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,471,000	
日本郵船 第 3 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,914,000	
横浜高速鉄道 第 2 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,330,000	
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	104,703,000	
三菱倉庫 第 1 4 回	100,000,000	100,610,000	
滋澤倉庫 第 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,508,000	
日本電信電話 第 6 0 回	100,000,000	101,648,000	
K D D I 第 2 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,088,000	
東京電力 第 5 4 8 回	100,000,000	113,937,000	
東京電力 第 5 6 0 回	100,000,000	112,273,000	
中部電力 第 5 0 0 回	200,000,000	207,268,000	
中部電力 第 5 2 4 回	100,000,000	101,978,000	
中部電力 第 5 3 0 回	200,000,000	201,028,000	
関西電力 第 4 8 4 回	100,000,000	101,085,000	
関西電力 第 4 9 6 回	100,000,000	103,888,000	

関西電力 第 4 9 7 回	200,000,000	209,104,000	
関西電力 第 5 1 1 回	100,000,000	101,013,000	
関西電力 第 5 1 4 回	200,000,000	201,046,000	
関西電力 第 5 2 7 回	200,000,000	201,288,000	
中国電力 第 3 3 0 回	100,000,000	103,219,000	
中国電力 第 3 7 7 回	400,000,000	416,388,000	
中国電力 第 3 7 8 回	100,000,000	103,722,000	
中国電力 第 4 0 0 回	100,000,000	101,060,000	
北陸電力 第 3 0 1 回	100,000,000	103,828,000	
北陸電力 第 3 0 4 回	100,000,000	103,660,000	
北陸電力 第 3 0 7 回	100,000,000	105,843,000	
北陸電力 第 3 0 8 回	100,000,000	103,207,000	
東北電力 第 4 7 3 回	100,000,000	100,906,000	
東北電力 第 4 7 5 回	100,000,000	103,201,000	
東北電力 第 4 8 1 回	200,000,000	206,920,000	
東北電力 第 4 8 4 回	100,000,000	104,535,000	
四国電力 第 2 8 1 回	200,000,000	208,118,000	
九州電力 第 4 2 4 回	300,000,000	314,007,000	
九州電力 第 4 2 8 回	105,000,000	108,990,000	
九州電力 第 4 4 9 回	200,000,000	202,678,000	
九州電力 第 4 5 1 回	100,000,000	101,505,000	
北海道電力 第 3 2 3 回	100,000,000	109,624,000	
北海道電力 第 3 3 8 回	100,000,000	105,036,000	
電源開発 第 3 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,811,000	
電源開発 第 3 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,631,000	
電源開発 第 4 0 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,681,000	
電源開発 第 4 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,230,000	
電源開発 第 5 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,607,000	
東京電力パワーグリッド 第 2 回	100,000,000	100,817,000	
東京電力パワーグリッド 第 6 回	100,000,000	101,203,000	
東京電力パワーグリッド 第 1 1 回	300,000,000	301,143,000	
東京電力パワーグリッド 第 1 4 回	100,000,000	100,287,000	
東京瓦斯 第 3 4 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,153,000	
東京瓦斯 第 3 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	135,019,000	
東京瓦斯 第 5 5 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,280,000	
大阪瓦斯 第 3 6 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,539,000	
東邦瓦斯 第 3 1 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	105,116,000	

		有価証券届出書（内国投資信託）		
小計	北海道瓦斯 第 1 7 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,378,000	
	広島ガス 第 1 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,211,000	
	東京都競馬 第 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,478,000	
	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	101,381,000	
	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	103,807,000	
	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	101,384,000	
	銘柄数：210	26,005,000,000	26,983,713,000	
	組入時価比率：4.1%		4.1%	
合計			26,983,713,000	
合計			654,406,728,847	

(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。

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 9月 6日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,528,638,807
コール・ローン	745,129,183
国債証券	59,079,308,478
派生商品評価勘定	2,736,396
未収入金	609,245,639
未収利息	314,494,899
前払費用	21,763,411
差入委託証拠金	273,299
流動資産合計	62,301,590,112
資産合計	62,301,590,112
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	411,388,986
未払金	2,518,228,916
未払解約金	95,692,199
未払利息	1,239
その他未払費用	715,000
流動負債合計	3,026,026,340
負債合計	3,026,026,340
純資産の部	
元本等	
元本	48,914,123,681
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,361,440,091

(2019年 9月 6日現在)

元本等合計	59,275,563,772
純資産合計	59,275,563,772
負債純資産合計	62,301,590,112

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 9月 6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	1.2118円
(10,000口当たり純資産額)	(12,118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 9月 7日 至 2019年 9月 6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、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2018年 9月 7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	44,861,179,119円
同期中における追加設定元本額	21,801,595,426円
同期中における一部解約元本額	17,748,650,864円
期末元本額	48,914,123,681円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	937,425,045円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	728,486,830円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	17,679,500円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	4,514,688円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型	2,801,950円

野村ターゲットデートファンド2016 - 2035 - 2037年目標型	1,749,200円
野村外国債券インデックス Aコース（野村SMA・EW向け）	3,501,353,488円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	16,264,826円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	6,037,756円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	14,347,908円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	2,609,439円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,361,107円
野村外国債券インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	31,138,171,459円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	9,316,909,600円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型	3,001,008,891円
野村国内外マルチアセット（6資産）ファンド（適格機関投資家専用）	220,401,994円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年9月6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9月6日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	70,000.00	82,826.94	
		US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,087,187.40	
		US TREASURY BOND	610,000.00	778,893.75	
		US TREASURY BOND	2,680,000.00	3,592,351.32	
		US TREASURY BOND	1,800,000.00	2,436,890.58	
		US TREASURY BOND	2,280,000.00	3,031,865.56	
		US TREASURY BOND	20,000.00	26,329.68	
		US TREASURY BOND	80,000.00	105,987.49	
		US TREASURY BOND	510,000.00	593,512.50	
		US TREASURY BOND	3,450,000.00	4,606,288.89	
		US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,806,328.08	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,993,359.20	
		US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,394,312.50	
		US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,700,199.07	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,003,281.20	

US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,222,257.62	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,158,980.39	
US TREASURY N/B	3,580,000.00	3,596,781.25	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,045,468.40	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,683,234.19	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,020,038.80	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	995,859.30	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,035,390.60	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,532,812.50	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,037,265.60	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,874,625.00	
US TREASURY N/B	6,150,000.00	6,214,622.97	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,533,456.90	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,965,624.80	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,517,109.30	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,486,992.15	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,157,175.65	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,716,070.27	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,490,390.55	
US TREASURY N/B	800,000.00	822,718.72	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,511,250.00	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,004,453.10	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,010,625.00	
US TREASURY N/B	600,000.00	607,171.86	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,508,906.25	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,221,000.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,019,921.80	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,423,109.12	
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,748,937.50	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,208,906.16	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,045,234.30	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,011,015.60	
US TREASURY N/B	300,000.00	301,359.36	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,136,327.97	
US TREASURY N/B	700,000.00	708,695.26	

US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,518,867.15	
US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,160,581.87	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,308,554.51	
US TREASURY N/B	110,000.00	111,985.14	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,039,062.50	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,101,632.73	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,515,820.20	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,012,031.20	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,491,601.50	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,471,562.50	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,247,625.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,990,859.30	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,623,632.75	
US TREASURY N/B	700,000.00	704,812.50	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,051,953.10	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,081,796.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,115,468.60	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,065,781.20	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,101,250.00	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,589,390.54	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,059,062.40	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,585,859.20	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,071,875.00	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,571,015.55	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,101,250.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,028,125.00	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,094,921.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,040,312.40	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,065,312.40	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,158,124.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,056,562.40	
US TREASURY N/B	800,000.00	828,312.48	
US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,861,010.86	
US TREASURY N/B	600,000.00	643,125.00	
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,712,775.00	

US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,015,000.00	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,231,500.00	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,797,921.78	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,067,343.60	
US TREASURY N/B	700,000.00	736,367.17	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,912,359.24	
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,372,749.76	
US TREASURY N/B	600,000.00	632,953.08	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,600,968.54	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,107,734.30	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,330,507.76	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,266,718.60	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,277,734.30	
US TREASURY N/B	500,000.00	729,453.10	
US TREASURY N/B	340,000.00	507,025.00	
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,938,879.63	
US TREASURY N/B	400,000.00	507,250.00	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	3,206,163.89	
US TREASURY N/B	2,150,000.00	3,151,765.62	
US TREASURY N/B	2,340,000.00	3,134,320.25	
US TREASURY N/B	300,000.00	449,437.50	
US TREASURY N/B	500,000.00	603,906.25	
US TREASURY N/B	800,000.00	968,187.44	
US TREASURY N/B	700,000.00	918,257.76	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,967,625.00	
US TREASURY N/B	2,540,000.00	3,035,300.00	
US TREASURY N/B	2,760,000.00	3,227,043.61	
US TREASURY N/B	3,020,000.00	3,615,270.08	
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,673,317.85	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,717,953.04	
US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,323,381.25	
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,817,562.32	
US TREASURY N/B	2,020,000.00	2,322,210.78	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	4,338,281.16	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,851,093.75	

小計	US TREASURY N/B	500,000.00	603,867.15	
	銘柄数：121	242,860,000.00	259,952,726.34 (27,833,138,409)	
	組入時価比率：47.0%		47.2%	
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	2,570,000.00	2,540,599.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,955,880.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,013,650.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	805,016.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,118,914.80	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,015,650.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	492,838.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	424,780.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	620,000.00	871,844.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	309,520.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	619,808.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	780,000.00	1,137,271.20	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,040,000.00	1,347,944.00	
	銘柄数：13	12,200,000.00	13,653,715.70 (1,104,858,674)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,200,000.00	9,130,908.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,800,000.00	2,816,277.52	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	14,859,150.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,000,000.00	13,155,380.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,100,000.00	10,427,543.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,100,000.00	3,264,207.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	7,594,380.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,000,000.00	5,599,400.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	4,599,480.38	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,300,000.00	9,690,042.00	
	銘柄数：10	78,800,000.00	81,136,767.90 (440,572,649)	
	組入時価比率：0.7%		0.7%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	314,225.40	
	BELGIUM KINGDOM	340,000.00	375,462.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	561,900.00	

BELGIUM KINGDOM	700,000.00	801,080.00	
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	223,047.40	
BELGIUM KINGDOM	400,000.00	415,800.00	
BELGIUM KINGDOM	230,000.00	266,271.00	
BELGIUM KINGDOM	700,000.00	740,310.20	
BELGIUM KINGDOM	800,000.00	881,688.00	
BELGIUM KINGDOM	950,000.00	1,040,685.10	
BELGIUM KINGDOM	800,000.00	890,592.24	
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,357,819.32	
BELGIUM KINGDOM	550,000.00	833,849.88	
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	241,621.80	
BELGIUM KINGDOM	420,000.00	543,897.48	
BELGIUM KINGDOM	300,000.00	540,182.40	
BELGIUM KINGDOM	550,000.00	985,735.30	
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	252,635.00	
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	257,274.80	
BELGIUM KINGDOM	170,000.00	248,783.61	
BELGIUM KINGDOM GOVT	370,000.00	648,937.45	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	420,000.00	446,211.78	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,500,000.00	1,512,808.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	730,000.00	748,023.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	506,290.50	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,490,000.00	1,719,570.40	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	925,290.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,079,238.33	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	308,434.74	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,940,000.00	2,324,626.34	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,120,000.00	1,335,488.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,617,838.60	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	642,221.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,120,000.00	1,271,630.08	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,095,433.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,300,000.00	1,446,770.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000.00	1,230,350.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,001,394.36	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,600,000.00	1,780,640.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	483,417.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,179,389.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,118,160.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,751,290.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	800,000.00	1,531,320.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,150,000.00	1,632,507.80	
BUNDES OblIGATION	1,700,000.00	1,723,545.00	
BUNDES OblIGATION	1,700,000.00	1,731,841.00	
BUNDES OblIGATION	1,100,000.00	1,141,602.00	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,041,230.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	772,845.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	908,199.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,399,112.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,310,000.00	1,428,699.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	781,648.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	526,224.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	683,120.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	780,010.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	481,760.40	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	978,822.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	317,097.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,270,000.00	1,368,691.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	2,058,082.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	935,459.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,103,700.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	424,284.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,884,234.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	1,256,352.72	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	177,782.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	979,725.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	60,000.00	124,254.18	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	1,351,485.45	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,827,414.16	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,110,000.00	1,891,240.20	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	275,664.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	460,000.00	479,356.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,800,000.00	1,820,916.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	180,381.73	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	746,886.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,037,230.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	710,000.00	780,211.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	526,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,450,000.00	1,467,037.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	723,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,030,000.00	1,068,625.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	513,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	939,948.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	234,280.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,400,000.00	2,471,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	173,877.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,636,305.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,020,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	245,430.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,612,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	583,800.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	739,690.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	555,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	436,915.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	359,865.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	587,620.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,600,000.00	2,718,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,449,990.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	882,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,040,000.00	2,741,556.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	597,350.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,411,100.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	1,069,740.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	105,510.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	1,225,471.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,110,000.00	1,640,025.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	558,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,080,000.00	1,471,716.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	482,240.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	231,990.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	464,310.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,180,000.00	3,384,450.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	960,000.00	1,229,472.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	351,420.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	11,540.00	
FINNISH GOVERNMENT	190,000.00	192,203.81	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	306,207.60	
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	322,040.10	
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	162,354.75	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	225,510.00	
FINNISH GOVERNMENT	310,000.00	332,075.72	
FINNISH GOVERNMENT	740,000.00	950,202.92	
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	236,589.00	
FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	252,477.60	
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	3,041,310.00	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	509,819.50	
FRANCE (GOVT OF)	3,500,000.00	3,834,817.00	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	826,080.00	
FRANCE (GOVT OF)	3,010,000.00	3,437,802.27	
FRANCE (GOVT OF)	500,000.00	517,403.50	
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	426,509.60	
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	750,050.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,250,000.00	1,319,450.00	
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	892,040.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,300,000.00	2,530,782.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,700,000.00	1,872,941.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,020,000.00	1,322,847.48	
FRANCE (GOVT OF)	1,350,000.00	1,597,050.00	
FRANCE (GOVT OF)	660,000.00	850,324.20	
FRANCE (GOVT OF)	1,810,000.00	2,521,981.60	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,140,000.00	1,225,135.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,087,614.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,320,000.00	1,454,069.76	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	100,000.00	102,250.92	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	610,000.00	669,218.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	800,000.00	969,120.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	677,205.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	847,674.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	910,000.00	1,161,933.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,900,000.00	2,405,970.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,885,602.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,640,000.00	1,961,708.96	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	532,991.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,490,000.00	2,580,486.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	686,460.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	720,000.00	1,358,468.64	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	2,025,648.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	1,293,835.20	
IRISH GOVERNMENT	800,000.00	869,992.00	
IRISH TSY 0.8% 2022	1,300,000.00	1,347,047.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	550,000.00	660,253.00	
IRISH TSY 1% 2026	650,000.00	706,901.00	
IRISH TSY 2% 2045	250,000.00	324,839.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	500,000.00	589,790.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	538,361.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	510,037.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	266,823.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	385,800.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	330,571.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,138,186.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	432,340.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,106,209.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	910,467.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	850,000.00	1,179,630.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	610,000.00	1,143,642.03	

小計	NETHERLANDS GOVERNMENT	450,000.00	795,099.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	10,000.00	14,340.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	893,440.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	716,467.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,120,000.00	1,236,805.92	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	327,396.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	433,600.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	770,735.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	530,000.00	722,857.56	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	395,163.69	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	683,615.60	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	394,140.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	754,468.44	
	REPUBLIC OF IRELAND	80,000.00	92,761.60	
	SPANISH GOVERNMENT	90,000.00	139,237.47	
	SPANISH GOVERNMENT	500,000.00	838,200.00	
	SPANISH GOVERNMENT	410,000.00	646,003.38	
	銘柄数：195	159,640,000.00	193,883,166.67	
			(22,889,846,657)	
	組入時価比率：38.6%		38.7%	
英債券	UK TREASURY	1,600,000.00	1,621,792.00	
	UK TREASURY	920,000.00	1,002,312.40	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,039,900.00	
	UK TREASURY	900,000.00	911,205.00	
	UK TREASURY	550,000.00	589,957.50	
	UK TREASURY	500,000.00	513,210.00	
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,338,480.00	
	UK TREASURY	1,370,000.00	1,471,092.30	
	UK TREASURY	300,000.00	392,592.00	
	UK TREASURY	900,000.00	987,858.00	
	UK TREASURY	90,000.00	134,804.70	
	UK TREASURY	300,000.00	308,130.00	
	UK TREASURY	600,000.00	870,300.00	
	UK TREASURY	200,000.00	285,740.00	
	UK TREASURY	200,000.00	303,340.00	

小計	UK TREASURY	1,160,000.00	1,753,108.00	
	UK TREASURY	470,000.00	527,904.00	
	UK TREASURY	1,550,000.00	2,633,450.00	
	UK TREASURY	400,000.00	609,000.00	
	UK TREASURY	2,080,000.00	3,600,480.00	
	UK TREASURY	1,700,000.00	1,849,260.00	
	UK TREASURY	600,000.00	692,700.00	
	UK TREASURY	840,000.00	1,511,076.00	
	UK TREASURY	860,000.00	1,486,166.00	
	UK TREASURY	280,000.00	540,708.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	100,000.00	145,100.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	780,000.00	1,518,816.00	
	銘柄数：27	21,450,000.00	28,638,481.90	
			(3,778,274,917)	
	組入時価比率：6.4%		6.4%	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	600,000.00	642,180.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	3,500,000.00	3,898,650.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,269,574.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	250,000.00	293,725.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	2,700,000.00	2,982,841.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,383,683.20	
	SWEDISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,816,705.00	
	銘柄数：7	15,150,000.00	17,287,358.40	
小計			(191,025,310)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,050,000.00	1,096,882.50	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,961,370.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	750,000.00	812,025.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,743,010.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	750,000.00	786,000.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,613,250.00	
	銘柄数：6	7,650,000.00	8,012,537.50	
小計			(95,108,820)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,550,000.00	1,570,615.00	
	KINGDOM OF DENMARK	1,500,000.00	1,629,277.20	

小計	KINGDOM OF DENMARK	1,650,000.00	1,817,805.00	
	KINGDOM OF DENMARK	3,400,000.00	3,952,500.00	
	KINGDOM OF DENMARK	2,300,000.00	2,532,760.00	
	KINGDOM OF DENMARK	3,900,000.00	7,833,259.20	
	銘柄数：6	14,300,000.00	19,336,216.40	
	組入時価比率：0.5%		(306,092,305)	0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,600,000.00	1,559,422.56	
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,700,000.00	4,723,731.24	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,066,292.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,800,000.00	3,007,200.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,149,000.00	
	銘柄数：5	13,100,000.00	13,505,646.40	
小計	組入時価比率：0.6%		(367,488,638)	0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,420,000.00	1,435,084.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,233,354.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	136,584.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,253,520.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	935,508.08	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,086,550.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	385,576.83	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	628,888.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	1,051,889.44	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	1,028,895.21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,820,000.00	3,100,308.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,156,478.60	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	348,120.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,170,000.00	1,675,525.99	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	208,280.86	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	546,000.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	372,187.83	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	347,868.00	
	銘柄数：18	14,750,000.00	16,930,620.24	
小計	組入時価比率：2.1%		(1,234,411,521)	2.1%

	シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	406,275.20	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1,030,000.00	1,022,275.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,459,907.12	
		SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	414,960.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	730,000.00	827,314.11	
		SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	322,933.50	
		SINGAPORE GOVERNMENT	610,000.00	681,980.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	737,450.00	
		SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	577,380.00	
	小計	銘柄数：9	6,070,000.00	6,450,474.93	
				(498,815,226)	
		組入時価比率：0.8%		0.8%	
	ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	801,345.60	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,500,000.00	4,568,597.10	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,900,000.00	7,785,091.29	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,650,000.00	6,278,177.88	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,800,000.00	2,394,840.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,500,000.00	3,332,520.45	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,800,000.00	7,976,320.00	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000.00	5,605,619.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,100,000.00	1,898,050.98	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,250,000.00	6,536,569.55	
	小計	銘柄数：10	49,300,000.00	47,177,132.25	
				(339,675,352)	
		組入時価比率：0.6%		0.6%	
合計				59,079,308,478	
				(59,079,308,478)	

(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 9月 6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	466,643,604	-	469,380,000	2,736,396
米ドル	255,489,600	-	256,872,000	1,382,400
ユーロ	211,154,004	-	212,508,000	1,353,996
売建	59,271,326,779	-	59,682,715,765	411,388,986
米ドル	27,896,844,880	-	28,063,938,800	167,093,920
カナダドル	1,082,771,396	-	1,094,946,870	12,175,474
メキシコペソ	420,043,327	-	431,943,820	11,900,493
ユーロ	23,127,638,398	-	23,226,808,320	99,169,922
英ポンド	3,809,290,158	-	3,877,854,396	68,564,238
スウェーデンクローナ	181,361,802	-	184,380,300	3,018,498
ノルウェークローネ	92,300,956	-	93,800,740	1,499,784
デンマーククローネ	278,218,205	-	279,165,216	947,011
ズロチ	360,772,927	-	366,171,120	5,398,193
豪ドル	1,230,407,454	-	1,255,880,520	25,473,066
シンガポールドル	471,797,489	-	476,408,863	4,611,374
ランド	319,879,787	-	331,416,800	11,537,013
合計	-	-	-	408,652,590

（注）時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2019年 9月 6日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	59,217,126
コール・ローン	278,760,598
国債証券	20,764,928,758
派生商品評価勘定	778,712
未収入金	194,159,666
未収利息	265,276,734
前払費用	10,135,758
流動資産合計	21,573,257,352
資産合計	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	534,778
未払金	206,416,827
未払解約金	278,562,167
未払利息	463
その他未払費用	341,300
流動負債合計	485,855,535
負債合計	
純資産の部	
元本等	
元本	11,044,561,327
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,042,840,490
元本等合計	21,087,401,817
純資産合計	21,087,401,817
負債純資産合計	21,573,257,352

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 9月 6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	1.9093円
(10,000口当たり純資産額)	(19,093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 9月 7日 至 2019年 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2018年 9月 7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	9,102,613,330円
同期中における追加設定元本額	4,446,074,686円
同期中における一部解約元本額	2,504,126,689円
期末元本額	11,044,561,327円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	1,311,801,431円
ネクストコア	93,948,214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	608,652,963円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,687,584円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,179,573円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,744,392円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,064,436円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,681,819円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	1,169,435,233円
野村外国債券（含む新興国）インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	2,054,007,336円
NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（為替ヘッジなし）連動型上場投信	110,424,591円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）外国債券	233,545,683円
野村世界インデックス・バランス40V A（適格機関投資家専用）	9,365,898円
ノムラ新興国債券インデックスファンドV A（適格機関投資家専用）	3,465,685円
新興国債券・インデックスF（適格機関投資家専用）	306,289,646円
野村新興国債券インデックスファンド（確定拠出年金向け）	4,155,347,229円
野村DC運用戦略ファンド	928,887,377円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	50,032,237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9月6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9月6日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	ARGENT-GLOBAL	640,000.00	417,246.46	

ARGENT-GLOBAL	420,000.00	266,162.86	
ARGENT-GLOBAL	2,300,000.00	917,148.00	
BRAZIL GLOBAL	650,000.00	844,187.50	
BRAZIL GLOBAL	1,070,000.00	1,499,348.20	
BRAZIL GLOBAL	900,000.00	1,173,384.00	
COLOMBIA GLOBAL	250,000.00	314,065.00	
COLOMBIA GLOBAL	1,220,000.00	1,785,787.20	
CROATIA	500,000.00	529,250.00	
CROATIA	1,100,000.00	1,227,556.00	
CROATIA	1,000,000.00	1,160,980.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	830,000.00	861,747.50	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,300,000.00	1,306,500.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000.00	2,450,719.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	900,000.00	1,053,882.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	2,050,594.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,800,000.00	2,067,768.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,600,000.00	1,713,016.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	2,193,331.50	
HUNGARY	1,100,000.00	1,216,088.50	
HUNGARY	1,350,000.00	1,541,338.20	
HUNGARY	1,400,000.00	1,593,769.80	
INDONESIA GLOBAL	1,400,000.00	1,592,065.72	
MEXICO GLOBAL	1,080,000.00	1,470,150.00	
PANAMA GLOBAL	300,000.00	384,003.00	
PANAMA GLOBAL	250,000.00	389,377.50	
PANAMA GLOBAL	1,150,000.00	1,696,261.50	
PERU GLOBAL	900,000.00	1,161,909.00	
PERU GLOBAL	670,000.00	1,017,569.20	
PHILIPPINES GLOBAL	2,100,000.00	2,253,923.91	
PHILIPPINES GLOBAL	750,000.00	1,251,565.87	
PHILIPPINES GLOBAL	800,000.00	1,223,318.80	
PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	708,657.35	
REPUBLIC OF ARGENTINA	900,000.00	379,359.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,400,000.00	1,143,000.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,650,000.00	1,166,000.00	
	600,000.00	251,106.00	

REPUBLIC OF ARGENTINA			
REPUBLIC OF ARGENTINA	4,100,000.00	1,768,166.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000.00	960,273.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000.00	939,573.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,500,000.00	626,250.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,100,000.00	871,521.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,150,000.00	924,500.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,300,000.00	539,513.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	1,142,636.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000.00	607,506.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,900,000.00	2,027,775.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	1,109,375.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000.00	1,409,200.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,200,000.00	1,365,000.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,320,000.00	1,768,813.20	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000.00	1,678,638.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000.00	3,018,150.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	800,000.00	998,808.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	1,500,000.00	1,596,190.50	
REPUBLIC OF HUNGARY	600,000.00	1,016,913.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	625,226.58	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,345,304.61	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,398,771.27	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,683,854.55	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	776,380.64	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	431,798.60	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	211,159.68	
REPUBLIC OF INDONESIA	900,000.00	993,462.21	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,282,895.90	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,546,720.00	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,493,108.28	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	924,410.56	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	1,189,146.64	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	988,986.72	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	1,098,880.88	

REPUBLIC OF INDONESIA	1,400,000.00	1,786,376.48	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,260,122.49	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	790,032.42	
REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000.00	1,829,642.00	
REPUBLIC OF PANAMA	1,500,000.00	1,675,327.50	
REPUBLIC OF PANAMA	500,000.00	621,880.00	
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	996,008.00	
REPUBLIC OF PERU	900,000.00	1,031,859.00	
REPUBLIC OF PERU	1,400,000.00	2,138,514.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,000,000.00	1,091,585.90	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	966,384.88	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,000,000.00	1,142,471.50	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,180,156.88	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,069,535.52	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000.00	2,054,685.79	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000.00	2,015,251.06	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	950,000.00	1,019,929.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	743,652.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,350,000.00	1,506,384.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	844,384.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,600,000.00	1,613,440.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	445,654.40	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	415,136.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	501,291.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	747,817.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	575,375.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	1,121,604.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	600,882.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,738,360.50	
REPUBLIC OF TURKEY	700,000.00	647,185.00	
REPUBLIC OF TURKEY	900,000.00	944,660.70	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	358,177.60	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,190,813.00	
REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000.00	2,040,192.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	1,003,359.50	

REPUBLIC OF TURKEY	1,500,000.00	1,446,135.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,600,000.00	1,679,656.00	
REPUBLIC OF TURKEY	950,000.00	914,356.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,056,982.80	
REPUBLIC OF TURKEY	2,400,000.00	1,899,744.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,592,925.50	
REPUBLIC OF TURKEY	1,900,000.00	1,611,209.50	
ROMANIA	1,200,000.00	1,326,024.00	
ROMANIA	600,000.00	644,568.00	
ROMANIA	800,000.00	883,256.00	
ROMANIA	600,000.00	797,268.00	
ROMANIA	600,000.00	711,828.00	
RUSSIA	1,312,500.00	1,482,909.75	
RUSSIAN FEDERATION	1,200,000.00	1,274,263.20	
RUSSIAN FEDERATION	1,800,000.00	1,976,254.20	
RUSSIAN FEDERATION	1,800,000.00	1,983,499.20	
RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,503,383.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,200,000.00	1,304,462.40	
RUSSIAN FEDERATION	1,600,000.00	2,010,214.40	
RUSSIAN FEDERATION	800,000.00	1,039,048.00	
RUSSIAN FEDERATION	4,200,000.00	5,089,875.00	
TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,485,945.00	
TURKEY GLOBAL	2,400,000.00	2,523,842.40	
TURKEY GLOBAL	650,000.00	886,112.50	
UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	651,477.00	
UKRAINE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,448,254.80	
UKRAINE GOVERNMENT	1,600,000.00	1,694,755.20	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	609,000.00	639,659.49	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	709,000.00	756,999.30	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	755,499.50	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,306,650.00	
UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,298,160.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,541,813.00	
UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	408,128.00	
UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,142,900.00	

小計	UNITED MEXICAN STATES	1,950,000.00	2,076,311.25	
	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,258,212.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,388,738.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,300,000.00	2,464,473.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,674,320.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,110,000.00	2,713,481.10	
	UNITED MEXICAN STATES	1,500,000.00	1,653,750.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	2,093,210.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,845,367.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,400,000.00	1,475,264.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000.00	2,187,520.00	
	銘柄数：152	186,940,500.00	193,937,879.50	
			(20,764,928,758)	
	組入時価比率：98.5%		100.0%	
合計			20,764,928,758	
			(20,764,928,758)	

(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 9月 6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	93,416,488	-	94,195,200	778,712
米ドル	93,416,488	-	94,195,200	778,712
売建	99,003,122	-	99,537,900	534,778
米ドル	99,003,122	-	99,537,900	534,778
合計	-	-	-	243,934

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

J - R E I T インデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2019年 9月 6日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	535,959,842
投資証券	43,597,540,850
派生商品評価勘定	104,029,884
未収入金	100,418,510
未収配当金	493,957,269
流動資産合計	44,831,906,355
資産合計	44,831,906,355
負債の部	
流動負債	
前受金	81,185,400
未払金	32,133,804
未払解約金	108,912,291
未払利息	891
流動負債合計	222,232,386
負債合計	222,232,386
純資産の部	
元本等	
元本	17,193,069,107
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,416,604,862
元本等合計	44,609,673,969
純資産合計	44,609,673,969
負債純資産合計	44,831,906,355

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。
--------------------	--

2. 費用・収益の計上基準	先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。 受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	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 9月 6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	2.5946円
(10,000口当たり純資産額)	(25,946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 9月 7日 至 2019年 9月 6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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2018年 9月 7日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	17,609,176,379円
同期中における追加設定元本額	5,166,823,577円
同期中における一部解約元本額	5,582,930,849円
期末元本額	17,193,069,107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）	1,611,487,267円
野村世界 6 資産分散投信（分配コース）	2,309,615,067円
野村世界 6 資産分散投信（成長コース）	694,720,243円
野村資産設計ファンド 2 0 1 5	16,338,373円
野村資産設計ファンド 2 0 2 0	16,382,278円
野村資産設計ファンド 2 0 2 5	17,860,517円
野村資産設計ファンド 2 0 3 0	18,077,912円
野村資産設計ファンド 2 0 3 5	16,921,663円
野村資産設計ファンド 2 0 4 0	30,939,051円
野村資産設計ファンド 2 0 4 5	2,889,872円
野村インデックスファンド・J - R E I T	2,793,286,752円
ネクストコア	132,769,527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	673,147,874円
野村J-REITインデックス（野村SMA・EW向け）	1,927,037,516円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	855,689,904円
野村資産設計ファンド2050	4,375,464円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,558,154円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	864,822円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	3,218,138円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	1,001,867円
インデックス・ブレンド（タイプ ）	4,517,741円
野村6資産均等バランス	447,991,352円
野村世界REITインデックス Aコース（野村投資一任口座向け）	87,479,361円
ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	95,688,163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）	433,066,635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）	1,879,822,457円
J-REITインデックスファンド（適格機関投資家専用）	1,719,611,354円
野村DC運用戦略ファンド	1,312,067,023円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）	76,731,254円
野村世界6資産分散投信（DC）安定コース	2,479,528円
野村世界6資産分散投信（DC）インカムコース	1,479,308円
野村世界6資産分散投信（DC）成長コース	2,486,287円
野村資産設計ファンド（DC）2030	638,624円
野村資産設計ファンド（DC）2040	465,214円
野村資産設計ファンド（DC）2050	362,545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9月6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9月6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	417	48,038,400	
		サンケイリアルエステート投資法 人 投資証券	589	71,151,200	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,351	918,680,000	

MCUBS MidCity 投資法人 投資証券	4,824	542,217,600	
森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,679	784,200,400	
産業ファンド投資法人 投資証券	5,003	755,453,000	
アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,765	1,321,515,000	
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	2,531	518,855,000	
アクティビア・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,038	1,071,988,000	
GLP投資法人 投資証券	10,128	1,371,331,200	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,693	590,857,000	
日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,843	1,692,717,100	
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	619	346,021,000	
Oneリート投資法人 投資証券	634	193,370,000	
イオンリート投資法人 投資証券	4,389	609,632,100	
ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,305	630,924,500	
日本リート投資法人 投資証券	1,321	582,561,000	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	26,125	527,463,750	
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	197	36,248,000	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	11,890	1,095,069,000	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	748	96,566,800	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,490	428,077,000	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	867	118,258,800	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	814	100,691,800	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,682	2,393,093,400	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	674	85,732,800	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,375	507,937,500	
スターアジア不動産投資法人 投資	1,350	152,550,000	

証券			
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	350	42,000,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,001	431,931,500	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	691	60,738,900	
さくら総合リート投資法人 投資証券	880	83,424,000	
投資法人みらい 投資証券	4,411	257,602,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	954	132,510,600	
三菱地所物流リート投資法人 投資証券	649	205,733,000	
C R E ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	571	72,916,700	
ザイマックス・リート投資法人 投資証券	590	78,234,000	
タカラレーベン不動産投資法人 投資証券	1,154	130,979,000	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人 投資証券	629	68,749,700	
日本ビルファンド投資法人 投資証券	3,938	3,091,330,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,067	2,916,039,000	
日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,686	1,649,415,600	
オリックス不動産投資法人 投資証券	8,102	1,891,817,000	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,574	1,274,130,000	
プレミア投資法人 投資証券	3,673	565,642,000	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,726	558,284,800	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,824	431,507,200	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,131	1,853,593,000	
森トラスト総合リート投資法人 投資証券	2,906	582,653,000	
インヴィンシブル投資法人 投資証券	17,838	1,184,443,200	

小計	券			
	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,444	658,464,000	
	平和不動産リート投資法人 投資証券	2,532	342,832,800	
	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,657	733,066,300	
	福岡リート投資法人 投資証券	2,103	376,437,000	
	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,258	1,035,334,000	
	いちごオフィスリート投資法人 投資証券	3,149	334,108,900	
	大和証券オフィス投資法人 投資証券	939	784,065,000	
	阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,837	289,511,200	
	スターツプロシード投資法人 投資証券	633	124,764,300	
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,482	1,603,485,000	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,100	1,074,200,000	
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	4,574	460,144,400	
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,641	626,252,000	
	銘柄数：63	234,035	43,597,540,850	
	組入時価比率：97.7%		100.0%	
合計		43,597,540,850		

(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 9月 6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	-	1,011,001,500	104,029,884
合計	906,920,100	-	1,011,001,500	104,029,884

（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 R E I T インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2019年 9月 6日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	16,875,366
コール・ローン	81,751,887
投資証券	6,557,926,110
派生商品評価勘定	3,694,238
未収入金	313,318
未収配当金	7,357,042
差入委託証拠金	47,128,482
流動資産合計	6,715,046,443
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	68,118,858
未払金	5,351,750
未払解約金	1,953,476
未払利息	136
その他未払費用	253,200
流動負債合計	75,677,420
負債合計	75,677,420
純資産の部	
元本等	
元本	4,217,895,918
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,421,473,105
元本等合計	6,639,369,023
純資産合計	6,639,369,023
負債純資産合計	6,715,046,443

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。 配当株式 配当株式は原則として、配当株式に伴う源泉税等の費用が確定した段階で、株式の配当落ち日に計上した数量に相当する券面額又は発行価額を計上しております。 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 9月 6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	1.5741円
(10,000口当たり純資産額)	(15,741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 9月 7日 至 2019年 9月 6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効率的な運用に資することを目的として、REIT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REIT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、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。

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 9月 6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 9月 6日現在	
期首	2018年 9月 7日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	4,586,999,313円
同期中における追加設定元本額	1,959,920,221円
同期中における一部解約元本額	2,329,023,616円
期末元本額	4,217,895,918円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,101,816,585円
野村インデックスファンド・外国REIT・為替ヘッジ型	655,300,676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）	1,311,053,217円

ファンドラップ（ウエルス・スクエア）REIT	26,370,957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）	1,123,354,483円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年9月6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9月6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	4,100	115,948.00	
		AGREE REALTY CORP	2,070	153,676.80	
		ALEXANDERS INC	195	74,958.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	5,500	837,045.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	2,240	106,467.20	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	6,680	315,162.40	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	2,700	32,238.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	12,900	327,144.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	9,250	343,637.50	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	7,210	368,214.70	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	10,300	166,139.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	4,100	11,808.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	6,770	1,453,586.70	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	1,300	15,613.00	
		BOSTON PROPERTIES	7,460	966,965.20	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	1,300	11,674.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	8,100	117,207.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	14,500	275,935.00	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	3,800	73,340.00	
		BRT APARTMENTS CORP	500	7,125.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	4,630	506,985.00	

CARETRUST REIT INC ACQUIRES	4,400	106,084.00	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	7,700	6,980.05	
CEDAR REALTY TRUST INC	5,000	12,150.00	
CHATHAM LODGING TRUST	2,000	34,280.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	2,700	70,983.00	
CITY OFFICE REIT INC	1,900	25,650.00	
CLIPPER REALTY INC	790	8,342.40	
COLONY CAPITAL INC	24,900	125,247.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	5,700	122,721.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	920	39,247.20	
CORECIVIC INC	5,700	99,123.00	
CORESITE REALTY CORP	1,730	206,129.50	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	5,600	165,200.00	
COUSINS PROPERTIES INC	6,914	240,745.48	
CUBESMART	9,100	326,781.00	
CYRUSONE INC	5,460	402,347.40	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	9,400	92,496.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	10,050	1,273,033.50	
DOUGLAS EMMETT INC	7,860	329,805.60	
DUKE REALTY CORP	17,240	575,816.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	3,800	79,800.00	
EASTGROUP PROPERTIES	1,830	230,488.50	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	6,500	91,780.00	
EPR PROPERTIES	3,570	281,101.80	
EQUITY COMMONWEALTH	5,780	195,421.80	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	4,380	591,300.00	
EQUITY RESIDENTIAL	17,850	1,534,921.50	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	3,500	79,485.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	3,174	1,030,661.28	
EXTRA SPACE STORAGE INC	6,220	753,864.00	
FARMLAND PARTNERS INC	1,500	9,795.00	
FEDERAL REALTY INVS TRUST	3,610	481,610.10	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	6,300	246,897.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	3,160	90,976.40	

FRANKLIN STREET PROPERTIES C	4,700	35,861.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	2,600	28,002.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	9,780	378,486.00	
GEO GROUP INC/THE	5,600	99,960.00	
GETTY REALTY CORP	1,630	51,850.30	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	1,600	36,304.00	
GLADSTONE LAND CORP	700	8,141.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1,000	10,830.00	
GLOBAL NET LEASE INC	4,100	79,622.00	
HCP INC	23,300	823,655.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	6,370	211,802.50	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	9,900	281,853.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	1,700	24,055.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	5,180	225,589.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	7,800	194,142.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	36,200	605,264.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	7,550	257,908.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	3,900	53,898.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	2,900	62,901.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	500	44,125.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	600	42,846.00	
INVITATION HOMES INC	20,500	586,505.00	
IRON MOUNTAIN INC	13,760	455,318.40	
JBG SMITH PROPERTIES	5,870	229,340.90	
KILROY REALTY CORP	4,890	379,659.60	
KIMCO REALTY CORP	20,600	389,546.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	4,400	65,252.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	10,000	98,000.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	7,250	377,580.00	
LIFE STORAGE INC	2,320	242,022.40	
LTC PROPERTIES INC	1,870	92,845.50	
MACERICH CO /THE	5,040	150,192.00	
MACK-CALI REALTY CORP	4,100	85,936.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	59,222	54,188.13	

MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	20,900	396,891.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	5,560	713,626.00	
MONMOUTH REIT-CLASS A	4,100	54,120.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	7,820	431,898.60	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	2,700	92,178.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	2,160	179,301.60	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	3,900	24,570.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	1,100	50,556.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	2,600	44,148.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	2,170	60,412.80	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	10,380	429,628.20	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	750	20,212.50	
PARAMOUNT GROUP INC	10,300	135,754.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	9,900	240,570.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	6,600	182,490.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	3,200	16,320.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	9,100	156,975.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	6,100	121,390.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	1,800	24,948.00	
PROLOGIS INC	30,560	2,585,070.40	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	1,000	180,590.00	
PUBLIC STORAGE	7,280	1,880,132.80	
QTS REALTY TRUST INC CL A	2,570	127,137.90	
REALTY INCOME CORP	15,200	1,140,000.00	
REGENCY CENTERS CORP	7,990	531,974.20	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	5,300	95,347.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	9,900	114,345.00	
RETAIL VALUE INC	821	30,927.07	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	5,230	231,793.60	
RLJ LODGING TRUST	8,000	133,200.00	
RPT REALTY	3,900	48,984.00	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	2,440	198,713.60	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	9,500	208,810.00	
SAFEHOLD INC	400	11,484.00	

	SAUL CENTERS INC	470	24,115.70	
	SENIOR HOUSING PROP TRUST	11,100	97,125.00	
	SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	1,240	50,034.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	14,980	2,247,898.80	
	SITE CENTERS CORP	6,700	95,408.00	
	SL GREEN REALTY CORP	4,130	332,423.70	
	SPIRIT MTA REIT	2,200	18,128.00	
	SPIRIT REALTY CAPITAL INC	4,370	208,143.10	
	STAG INDUSTRIAL INC	6,200	180,234.00	
	STORE CAPITAL CORP	9,740	366,905.80	
	SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	5,100	57,630.00	
	SUN COMMUNITIES INC	4,320	640,612.80	
	SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	11,300	152,211.00	
	TANGER FACTORY OUTLET CENTER	4,400	65,736.00	
	TAUBMAN CENTERS INC	2,840	113,600.00	
	TERRENO REALTY CORP	3,170	161,701.70	
	UDR INC	13,490	652,241.50	
	UMH PROPERTIES INC	1,700	22,355.00	
	UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	560	53,838.40	
	URBAN EDGE PROPERTIES	5,900	109,150.00	
	URSTADT BIDDLE-CL A	1,300	28,262.00	
	VENTAS INC	17,810	1,328,982.20	
	VEREIT INC	46,700	451,122.00	
	VICI PROPERTIES INC	20,200	448,238.00	
	VORNADO REALTY TRUST	8,300	513,936.00	
	WASHINGTON PRIME GROUP INC	7,700	26,026.00	
	WASHINGTON REAL ESTATE INV	3,900	105,027.00	
	WEINGARTEN REALTY INVESTORS	5,700	153,900.00	
	WELLTOWER INC	19,650	1,789,918.50	
	WHITESTONE REIT	1,600	20,016.00	
	WP CAREY INC	8,310	749,146.50	
	XENIA HOTELS & RESORTS INC	5,200	107,016.00	
小計	銘柄数：155	1,100,786	45,271,196.71	
			(4,847,187,031)	
	組入時価比率：73.0%		73.8%	

カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	2,660	140,208.60	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	3,700	46,620.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	1,120	49,347.20	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	3,650	196,114.50	
	CHOICE PROPERTIES REIT	7,800	110,214.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	3,900	48,633.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	2,000	31,740.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	2,000	29,440.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	4,600	67,160.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	2,900	36,830.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	1,400	38,640.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	1,160	74,854.80	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	6,800	153,544.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	3,000	47,940.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	2,300	46,943.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	400	9,312.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	800	15,616.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	1,500	44,535.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	3,000	35,040.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	7,100	185,381.00	
	SLATE OFFICE REIT	2,000	11,600.00	
	SLATE RETAIL REIT	906	11,587.74	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	3,400	108,562.00	
	SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	2,700	35,424.00	
	TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	1,400	9,240.00	
小計	銘柄数：25	72,196	1,584,526.84	
			(128,219,911)	
	組入時価比率：1.9%		2.0%	
ユーロ	AEDIFICA	1,160	124,120.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	7,700	116,963.00	
	ALTAREA	180	33,624.00	
	BEFIMMO S.C.A.	1,100	59,400.00	
	COFINIMMO	1,160	147,784.00	

小計	COVIVIO	3,190	306,559.00	
	EUROCOMMERCIAL PROPERTI-CVA	2,000	46,640.00	
	GECINA SA	2,630	371,093.00	
	GREEN REIT PLC	33,000	62,766.00	
	HAMBORNER REIT AG	4,000	37,468.00	
	HIBERNIA REIT PLC	33,000	49,500.00	
	ICADE	2,130	172,849.50	
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	2,200	12,034.00	
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	13,100	138,991.00	
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	1,000	26,300.00	
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	19,000	32,680.00	
	KLEPIERRE	9,640	268,763.20	
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	3,600	24,264.00	
	MERCIALYS	2,700	29,970.00	
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	17,900	216,411.00	
	MONTEA	460	34,730.00	
	NSI NV	1,000	39,500.00	
	RETAIL ESTATES	400	33,360.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	6,700	804,000.00	
	VASTNED RETAIL NV	700	19,250.00	
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	870	148,422.00	
	WERELDHAVE NV	2,000	36,940.00	
	銘柄数：27	172,520	3,394,381.70	
			(400,740,703)	
	組入時価比率：6.0%		6.1%	
英債券	ASSURA PLC	115,000	81,305.00	
	BIG YELLOW GROUP PLC	8,000	85,120.00	
	BRITISH LAND	47,200	246,289.60	
	CAPITAL & REGIONAL PLC	31,000	4,557.00	
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	28,000	23,156.00	
	DERWENT LONDON PLC	5,400	169,020.00	
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	24,000	22,296.00	
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	12,600	88,678.80	
	HAMMERSON PLC	37,300	90,191.40	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	20,000	19,240.00	
	INTU PROPERTIES PLC	39,000	13,919.10	

小計	LAND SECURITIES GROUP PLC	36,100	275,948.40	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	39,000	81,198.00	
	LXI REIT PLC	27,000	35,316.00	
	NEWRIVER REIT PLC	16,000	27,264.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	24,000	20,784.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	53,000	72,610.00	
	RDI REIT PLC	10,000	10,400.00	
	REGIONAL REIT LTD	19,000	19,722.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	10,200	67,983.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	21,000	11,760.00	
	SEGRO PLC	53,100	417,578.40	
	SHAFTESBURY PLC	10,900	92,650.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	17,000	14,518.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	85,000	120,445.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	35,000	28,175.00	
	UNITE GROUP PLC	14,000	145,600.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	6,500	56,647.50	
	銘柄数：28	844,300	2,342,372.20	
			(309,029,164)	
	組入時価比率：4.7%		4.7%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	16,000	63,520.00	
	APN INDUSTRIA REIT	4,300	12,513.00	
	ARENA REIT	14,000	39,480.00	
	BWP TRUST	23,300	91,336.00	
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	11,000	42,020.00	
	CHARTER HALL GROUP	22,600	289,506.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	14,000	82,600.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	16,200	68,688.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	90,000	113,400.00	
	DEXUS	53,200	687,876.00	
	GDI PROPERTY GROUP	26,000	40,820.00	
	GOODMAN GROUP	77,600	1,086,400.00	
	GPT GROUP	94,100	593,771.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	13,600	59,976.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	7,000	24,570.00	

小計	INGENIA COMMUNITIES GROUP	9,000	36,270.00	
	MIRVAC GROUP	190,000	596,600.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	33,000	59,895.00	
	RURAL FUNDS GROUP	14,000	28,840.00	
	SCENTRE GROUP	260,000	1,034,800.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	47,000	120,320.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	117,400	522,430.00	
	VICINITY CENTRES	155,000	399,900.00	
	VIVA ENERGY REIT	23,000	66,930.00	
	銘柄数：24	1,331,300	6,162,461.00	(449,305,031)
	組入時価比率：6.8%			6.9%
ニュージーランド ドル	ARGOSY PROPERTY LTD	42,000	63,210.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	46,000	101,890.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	72,000	120,600.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	51,000	95,115.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	16,000	37,440.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	17,000	46,750.00	
	銘柄数：6	244,000	465,005.00	(31,727,291)
小計	組入時価比率：0.5%			0.5%
香港ドル	CHAMPION REIT	96,000	498,240.00	
	FORTUNE REIT	65,000	595,400.00	
	LINK REIT	102,500	9,163,500.00	
	PROSPERITY REIT	53,000	155,290.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	52,000	270,920.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	62,000	324,260.00	
	銘柄数：6	430,500	11,007,610.00	(150,363,952)
小計	組入時価比率：2.3%			2.3%
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	29,025	42,086.25	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	33,000	35,310.00	
	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	125,000	401,250.00	
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	58,000	75,400.00	
	CACHE LOGISTICS TRUST	51,000	37,485.00	

		CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	138,069	302,371.11	
		CAPITALAND MALL TRUST	135,000	364,500.00	
		CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	32,696	51,332.72	
		CDL HOSPITALITY TRUSTS	40,000	64,800.00	
		ESR REIT	95,065	49,433.80	
		FAR EAST HOSPITALITY TRUST	50,000	34,000.00	
		FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	27,000	28,350.00	
		FRASERS CENTREPOINT TRUST	30,775	87,708.75	
		FRASERS COMMERCIAL TRUST	34,000	57,800.00	
		FRASERS HOSPITALITY TRUST	39,000	27,690.00	
		FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	80,000	100,000.00	
		KEPPEL DC REIT	49,077	89,320.14	
		KEPPEL REIT	86,000	107,500.00	
		LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	90,000	20,700.00	
		MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	93,000	212,040.00	
		MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	62,000	147,560.00	
		MAPLETREE LOGISTICS TRUST	110,000	174,900.00	
		MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	104,000	138,320.00	
		QUE HOSPITALITY TRUST	59,088	43,134.24	
		PARKWAY LIFE REAL ESTATE	17,000	52,700.00	
		SABANA SHARIAH COMP IND REIT	37,360	17,185.60	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT	28,000	15,120.00	
		SOILBUILD BUSINESS SPACE REIT-RTS	5,040	50.40	
		SPH REIT	30,000	32,700.00	
		STARHILL GLOBAL REIT	63,000	47,250.00	
		SUNTEC REIT	105,000	203,700.00	
	小計	銘柄数：31	1,936,195	3,061,698.01	
				(236,761,107)	
		組入時価比率：3.6%		3.6%	
	新シェケル	REIT 1 LTD	7,500	151,050.00	
	小計	銘柄数：1	7,500	151,050.00	
				(4,591,920)	
		組入時価比率：0.1%		0.1%	
	合計			6,557,926,110	
				(6,557,926,110)	

(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 9月 6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	145,545,605	-	149,238,448	3,692,843
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	9,436,098	-	9,437,430	1,332
米ドル	7,812,525	-	7,813,920	1,395
シンガポールドル	1,623,573	-	1,623,510	63
売建	6,465,259,375	-	6,533,378,170	68,118,795
米ドル	4,783,476,408	-	4,824,704,900	41,228,492
カナダドル	125,303,794	-	127,163,460	1,859,666
ユーロ	393,932,316	-	398,520,000	4,587,684
英ポンド	301,417,120	-	308,063,340	6,646,220
豪ドル	444,826,647	-	453,730,900	8,904,253
ニュージーランドドル	30,738,414	-	31,344,400	605,986
香港ドル	149,400,967	-	150,817,480	1,416,513
シンガポールドル	231,055,719	-	233,869,090	2,813,371
新シェケル	5,107,990	-	5,164,600	56,610
合計	-	-	-	64,424,620

(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

2019年9月30日現在

資産総額	12,009,076,148円
負債総額	1,183,300,382円
純資産総額（ - ）	10,825,775,766円
発行済口数	7,274,631,728口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4882円

（参考）国内株式マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	578,602,890,270円
負債総額	136,319,271,162円
純資産総額（ - ）	442,283,619,108円
発行済口数	276,178,960,587口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6014円

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	96,659,660,085円
負債総額	47,434,295,471円
純資産総額（ - ）	49,225,364,614円
発行済口数	25,053,858,544口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9648円

（参考）国内債券NOMURA - B P I総合 マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	759,083,673,337円
負債総額	52,600,995,042円
純資産総額（ - ）	706,482,678,295円
発行済口数	521,906,822,220口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3537円

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	120,044,250,843円
負債総額	60,724,015,468円
純資産総額（ - ）	59,320,235,375円
発行済口数	48,961,849,201口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2116円

（参考）新興国債券マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	21,284,090,236円
負債総額	196,390,057円
純資産総額（ - ）	21,087,700,179円
発行済口数	11,051,246,465口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9082円

（参考）J - R E I T インデックス マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	48,431,863,137円
負債総額	1,360,493,458円
純資産総額（ - ）	47,071,369,679円
発行済口数	17,631,429,936口
1口当たり純資産額（ / ）	2.6697円

（参考）海外 R E I T インデックス為替ヘッジ型マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	13,381,726,167円
負債総額	6,559,099,844円
純資産総額（ - ）	6,822,626,323円
発行済口数	4,270,926,811口
1口当たり純資産額（ / ）	1.5975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。

上記の振替について、委託者は、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た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り扱い

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付け、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

2019年10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。

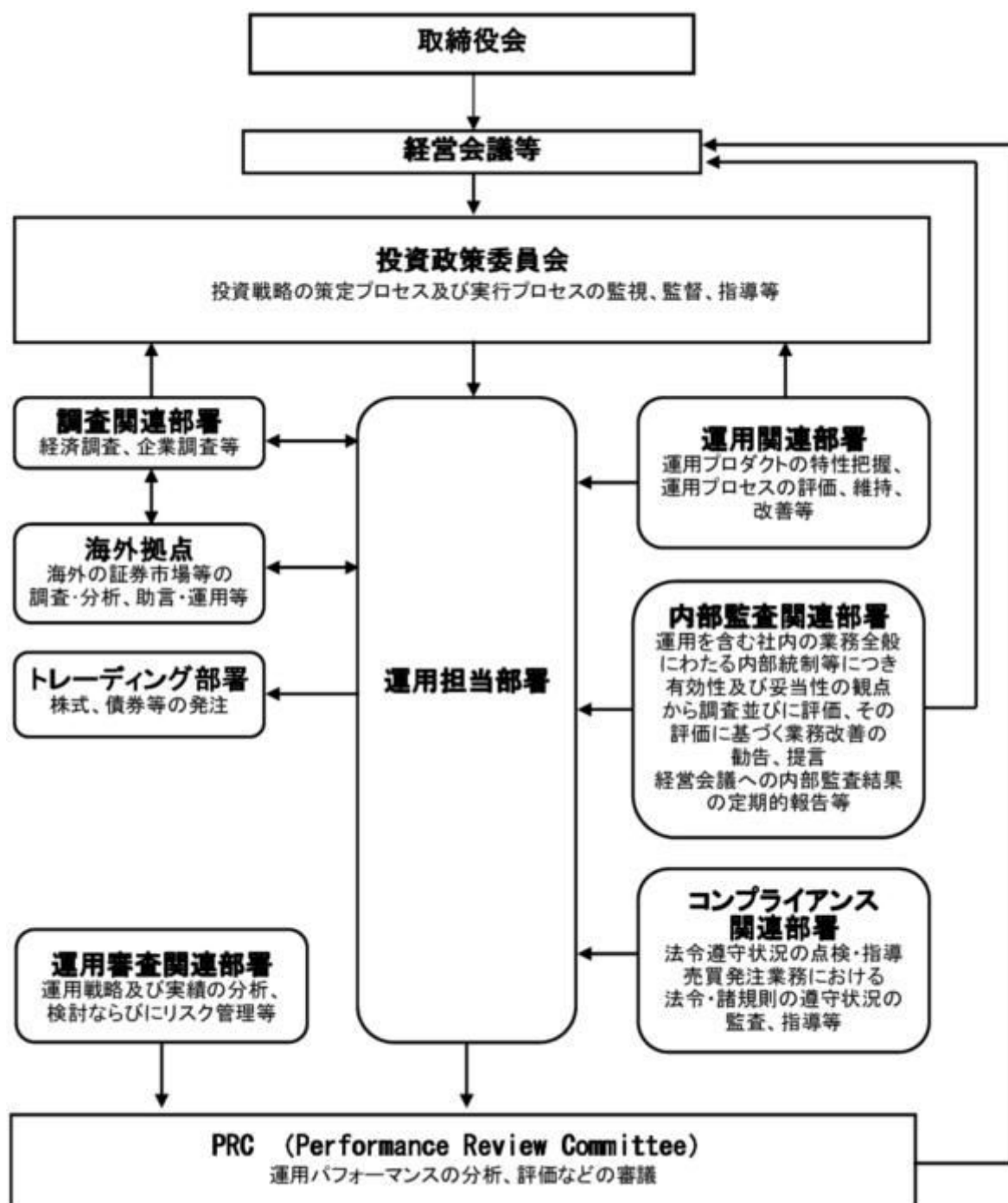
代表取締役・業務執行取締役

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9月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)。

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

追加型株式投資信託	1,013	28,593,648
単位型株式投資信託	176	930,781
追加型公社債投資信託	14	5,282,296
単位型公社債投資信託	432	1,708,940
合計	1,635	36,515,664

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	野村証券株式会社	東京都中央区	10,000 (百万円)	証券業	-	当社投資信託の募集の取扱及び売出の取扱ならびに投資信託に係る事務代行の委託等 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（*2）	37,482	未払手数料	6,691

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

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9月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
-------	-----------------------	----------

野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
今村証券株式会社	857百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
岡三オンライン証券株式会社	2,500百万円	
香川証券株式会社	555百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
株式会社証券ジャパン	3,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
西日本シティ T T 証券株式会社	3,000百万円	
北洋証券株式会社	500百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
丸近証券株式会社	200百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
山和証券株式会社	585百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社岩手銀行	12,089百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	
株式会社新生銀行	512,204百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社但馬銀行	5,481百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社東京スター銀行	26,000百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	
株式会社百五銀行	20,000百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
株式会社北陸銀行	140,409百万円	
岡崎信用金庫	3,203百万円	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

* 2019年9月末現在

岡崎信用金庫の資本金の額の箇所には、出資の総額を記載しております。

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

委託会社は、丸近証券株式会社の株式の10.9%を保有しています。

第3【その他】

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

独立監査人の監査報告書

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10月18日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 亀 井 純 子
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 伊 藤 志 保
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型の2018年9月7日から2019年9月6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・為替ヘッジ型の2019年9月6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。