

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年3月19日提出
【計算期間】	第4期(自 2018年12月27日至 2019年12月26日)
【ファンド名】	野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型 野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	CEO兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【電話番号】	03-3241-9511
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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

投資対象とする別に定める親投資信託証券とは「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「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」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」とします。なお、別に定める親投資信託証券については後述の《マザーファンドの概要》をご覧ください。

信託金の限度額

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

<商品分類>

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

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

- （野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型）
- （野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型）
- （野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型）
- （野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型）

《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
追加型	海外	債券	特殊型
	内外	不動産投信	
		その他資産 ()	
		資産複合	

《属性区分表》

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス
--------	------	--------	------	-------	----------

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

< 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。

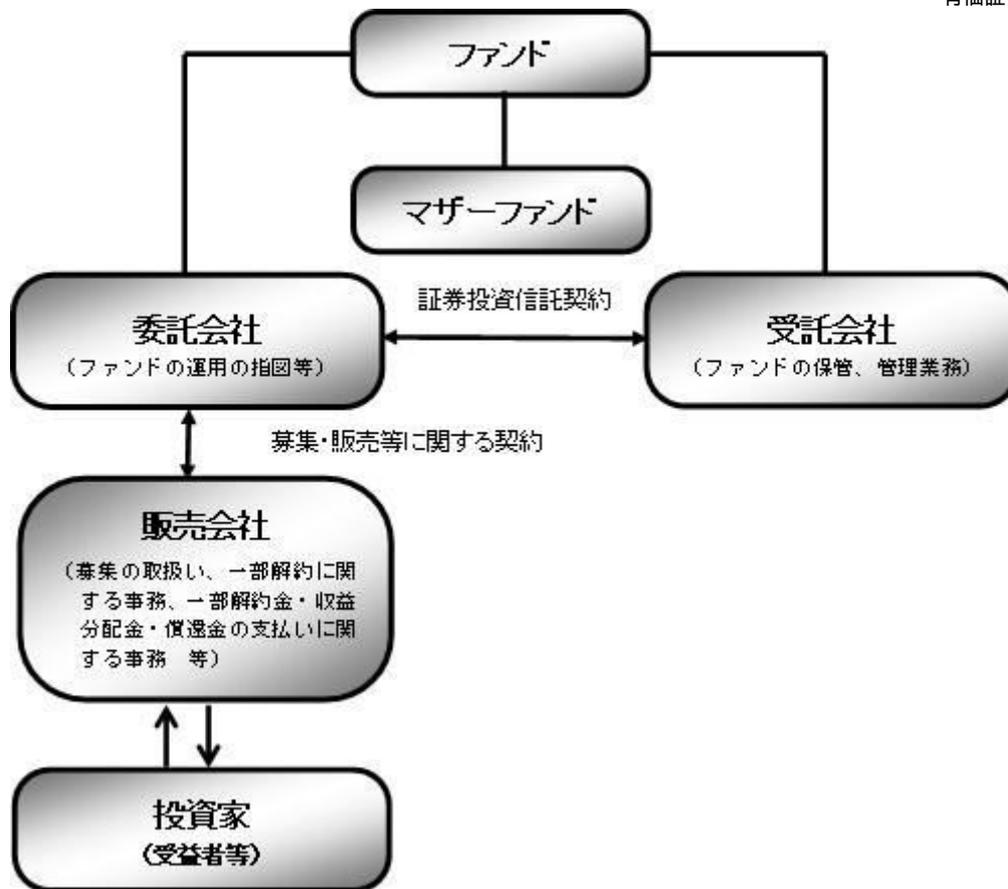
〔特殊型〕

- (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】

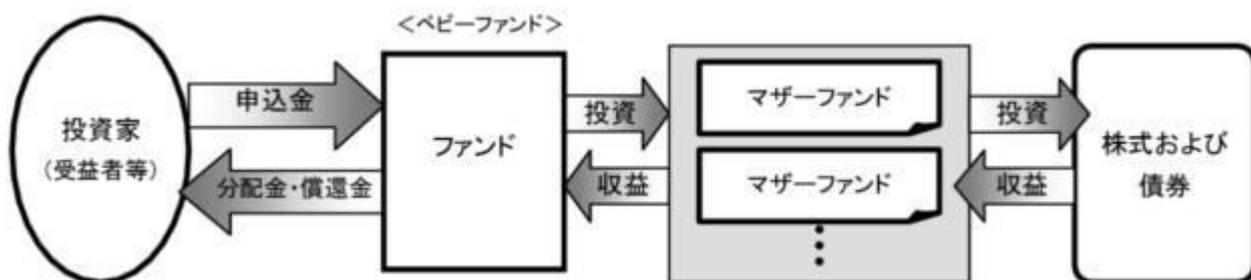
2016年4月1日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3)【ファンドの仕組み】



《ファミリーファンド方式について》

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



ファンド	野村ターゲットデ トファンド2016 2026-2028年目標型	野村ターゲットデ トファンド2016 2029-2031年目標型	野村ターゲットデ トファンド2016 2032-2034年目標型	野村ターゲットデ トファンド2016 2035-2037年目標型
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MSCI-KOKUSAI マザーファンド			
	新興国株式マザーファンド			
	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			
	外国債券マザーファンド			
	新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド			
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社			

受託会社(受託者)

野村信託銀行株式会社

委託会社の概況(2020年1月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

・資本金の額

17,180百万円

・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

「野村ターゲットデートファンド2016」は、ターゲット時期の異なる4本のファンド(「2026-2028年目標型」、「2029-2031年目標型」、「2032-2034年目標型」、「2035-2037年目標型」)で構成されています。

「2026-2028年目標型」は2026年から2028年、「2029-2031年目標型」は2029年から2031年、「2032-2034年目標型」は2032年から2034年、「2035-2037年目標型」は2035年から2037年をターゲット時期とします。

各ファンドは、「投資基礎期」、「資産形成期」、ターゲット時期を含む「目標前準備期」を定め、各期間毎に株式および債券の配分比率(「株式・債券配分」といいます。)を変化させます。また、各期間において、株式・債券配分を変化させることに合わせて、各マザーファンドへの基本投資割合を定期的に変更します。

株式・債券配分および各マザーファンドへの基本投資割合の変更は、当面、原則毎月行なうことを基本とします。

当面の株式・債券配分は「株式・債券配分のイメージ図」をご覧ください。

各期間における株式・債券配分および各マザーファンドへの基本投資割合の最終決定は、家計や市場の構造変化等を考慮した上で行ないます。

各ファンドの「投資基礎期」、「資産形成期」、「目標前準備期」の期間はそれぞれ以下のとおりとします。

ファンド名	投資基礎期	資産形成期	目標前準備期
2026-2028年目標型	当初設定日から 2017年12月	2018年1月から 2022年12月	2023年1月以降
2029-2031年目標型	当初設定日から 2018年12月	2019年1月から 2025年12月	2026年1月以降
2032-2034年目標型	当初設定日から 2019年12月	2020年1月から 2028年12月	2029年1月以降
2035-2037年目標型	当初設定日から 2020年12月	2021年1月から 2031年12月	2032年1月以降

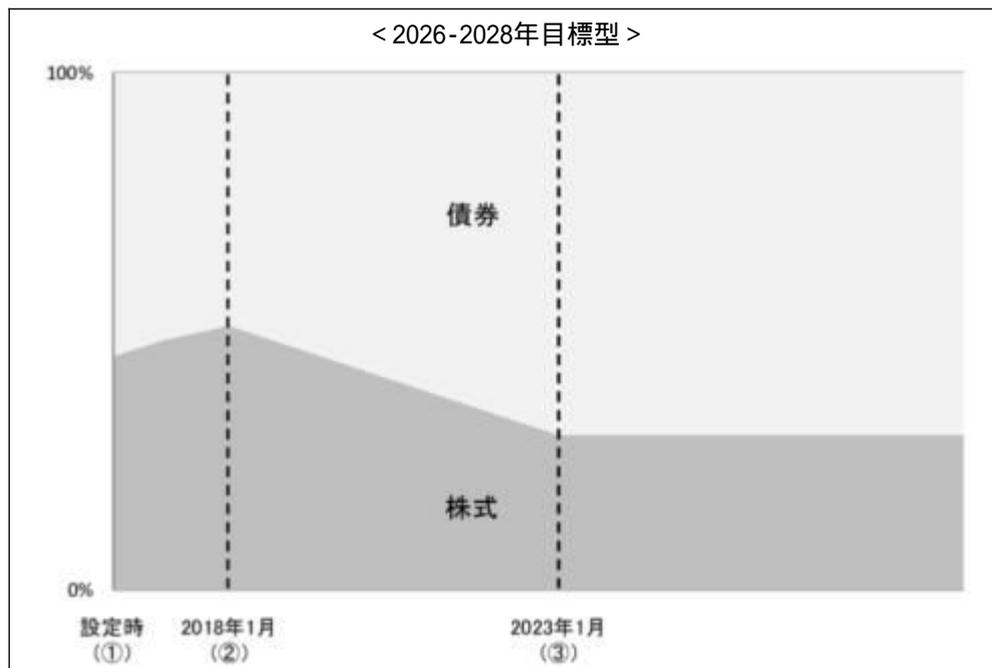
「投資基礎期」は、株式への実質投資割合を徐々に増やし、債券への実質投資割合を徐々に減らすことを基本とし、株式・債券配分を定期的に変化させます。

「資産形成期」は、株式への実質投資割合を徐々に減らし、債券への実質投資割合を徐々に増やすことを基本とし、株式・債券配分を定期的に変化させます。

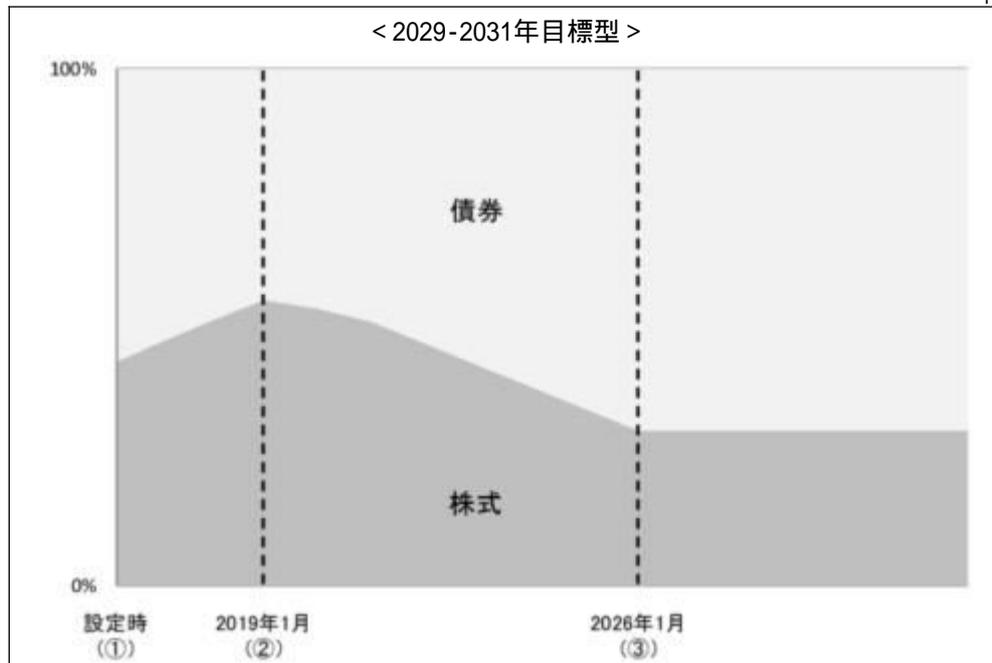
「目標前準備期」は、株式・債券配分を一定とすることを基本とします。

・期間中は、安定運用を行なう場合があります。

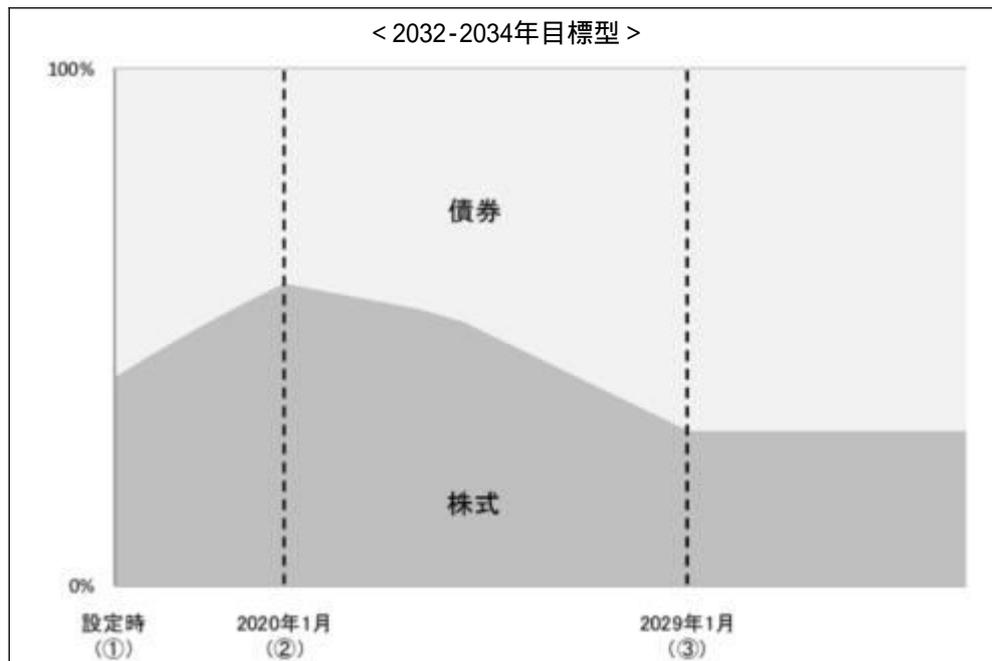
株式・債券配分のイメージ図



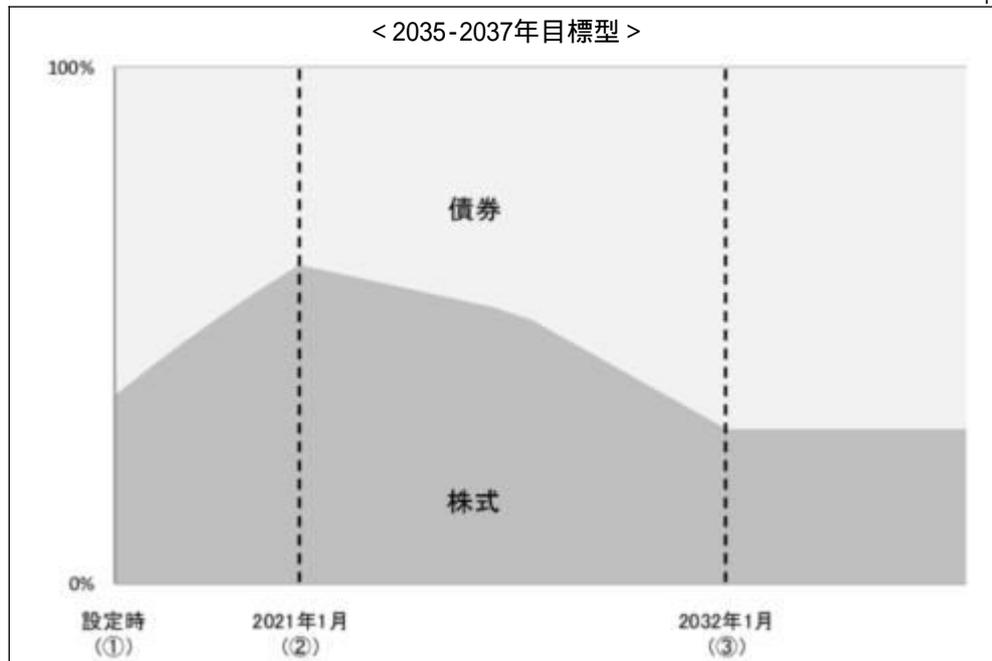
投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式45.2%	株式51.1%	株式30.0%
債券54.8%	債券48.9%	債券70.0%



投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式43.2%	株式55.2%	株式30.0%
債券56.8%	債券44.8%	債券70.0%



投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式40.5%	株式58.5%	株式30.0%
債券59.5%	債券41.5%	債券70.0%



投資基礎期開始日	資産形成期開始日	目標前準備期開始日
株式36.5%	株式61.8%	株式30.0%
債券63.5%	債券38.2%	債券70.0%

各マザーファンドへの基本投資割合

		2026-2028年 目標型		2029-2031年 目標型		2032-2034年 目標型		2035-2037年 目標型		各ファンド 共通 目標前 準備期 開始日
		2020年 3月	資産 形成期 開始日	2020年 3月	資産 形成期 開始日	2020年 3月	資産 形成期 開始日	2020年 3月	資産 形成期 開始日	
株式	国内株式マザーファンド	21.0%	25.5%	26.6%	27.6%	29.1%	29.2%	28.9%	30.9%	15.0%
	外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド	12.2%	15.4%	15.4%	16.6%	16.9%	17.6%	16.8%	18.6%	9.0%
	新興国株式マザーファンド	8.8%	10.2%	11.1%	11.0%	12.2%	11.7%	12.1%	12.3%	6.0%
債券	国内債券NOMURA-BPI 総合 マザーファンド	21.6%	17.0%	15.9%	14.9%	13.4%	13.2%	12.5%	11.6%	30.0%
	外国債券為替ヘッジ型 マザーファンド	21.6%	17.0%	15.9%	14.9%	13.4%	13.2%	12.5%	11.6%	30.0%
	外国債券マザーファンド	12.1%	12.2%	12.2%	12.3%	12.2%	12.3%	14.0%	12.3%	8.2%
	新興国債券（現地通貨建て） マザーファンド	2.7%	2.7%	2.9%	2.7%	2.8%	2.8%	3.2%	2.7%	1.8%

上記の株式・債券配分および各マザーファンドへの基本投資割合は、2020年3月現在のものであり、家計や市場の構造変化等により変更する場合があります。

「目標前準備期」の各月末時点において、基準価額が委託会社の定める下値基準値を下回る場合、一定期間、マザーファンドを通じて投資する株式および債券の実質的なエクスポージャーを引き下げ、短期有価証券等へ投資する安定運用を行ないます。なお、安定運用を行なうにあたっては、国内外の株価指

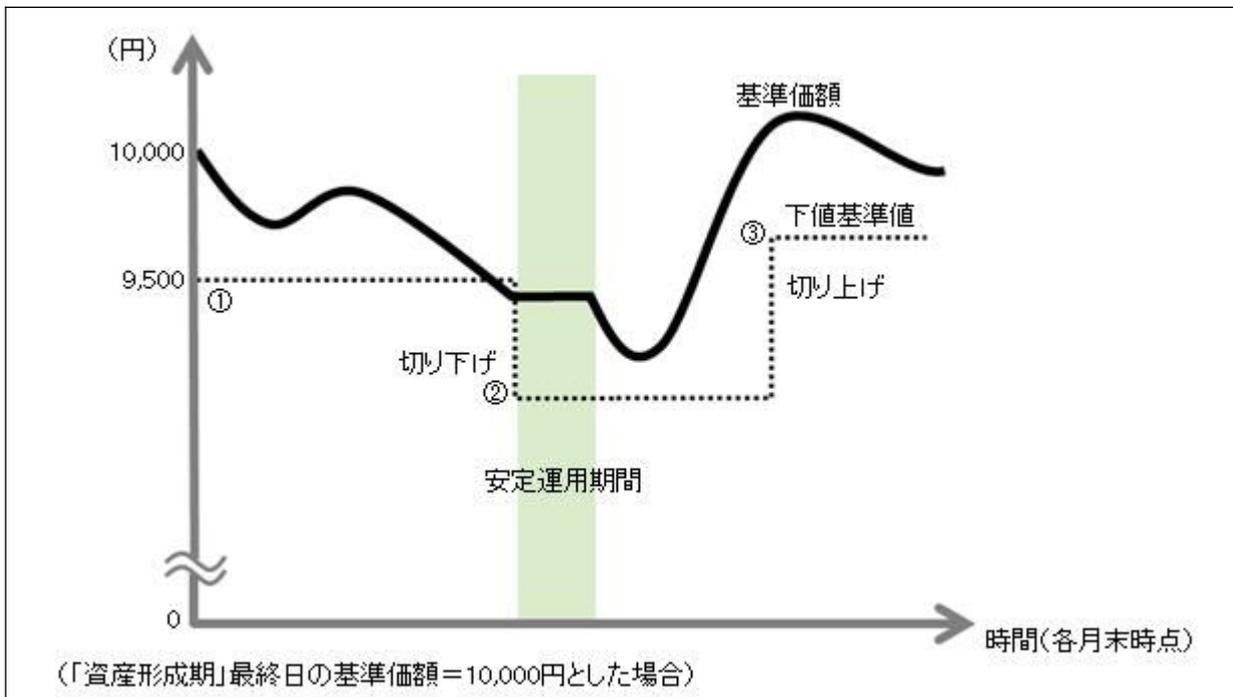
数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等の売建てを行なう場合があります。

株式および債券の実質的なエクスポージャーをゼロに近づけることを基本とします。

*各ファンドにおいては、上記のような運用を「下値保全に配慮した運用」という場合があります。

- ・委託会社の定める下値基準値は、当初、各ファンドの「資産形成期」最終日の基準価額の95%程度とします。毎月末の基準価額を勘案して下値基準値を見直すことを基本とし、原則として、月末の基準価額が下値基準値を下回った場合には切り下げを行ない、月末の基準価額が直近の下値基準値改定時（一度も改定されていない場合は各ファンドの「資産形成期」最終日）の基準価額を一定水準上回った場合には切り上げを行ないます。
- ・安定運用に切り替えた場合の、安定運用を行なう一定期間は、3ヵ月程度を基本とします。なお、当該期間は、市況動向等により見直される場合があります。
- ・安定運用期間終了後は、「目標前準備期」における株式・債券配分となるよう、株式および債券の実質的なエクスポージャーを引き上げます。

基準価額と下値保全に配慮した運用（イメージ図）



<ご参考例>

「資産形成期」最終日の基準価額が10,000円の場合、当初の下値基準値は当該基準価額の95%程度の9,500円程度となります。

「目標前準備期」の月末における基準価額が でめた下値基準値（9,500円程度）を下回った場合、安定運用を行ない、下値基準値（9,500円程度）を見直します。

例えば、月末の基準価額が9,400円の場合、当該基準価額の95%程度の8,930円程度が新たな下値基準値となります。

安定運用期間終了後の月末における基準価額が で下値基準値の見直しを行なった時点の基準価額（9,400円）を一定水準上回った場合、下値基準値（8,930円程度）を見直します。

例えば、月末の基準価額が10,200円の場合、当該基準価額の95%程度の9,690円程度が新たな下値基準値となります。

別に定めるマザーファンドの中から、市場構造等を勘案し、各期間の株式・債券配分の範囲内で各マザーファンドへの投資比率を決定します。投資を行なうマザーファンドは、原則として、金融指標の動きに連動する投資成果を目指すものとします。

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

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

《マザーファンドの概要》

マザーファンド名	主要投資対象	対象指数
国内株式マザーファンド	わが国の株式	東証株価指数（TOPIX）
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式	MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし） ^{*2}
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証券） ^{*1} を含みます）	MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース） ^{*3}
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	わが国の公社債	NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）
外国債券マザーファンド	外国の公社債	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債	JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース） ^{*4}

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

*2 MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が円換算したものです。

*3 MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

*4 JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets (GBI-EM) Global Diversified (USドルベース)をもとに、委託会社が円換算したものです。

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

実質組入外貨建資産については、為替ヘッジを行なうマザーファンドを通じて投資する部分を除き、原則として為替ヘッジを行ないません。

ただし、「目標前準備期」で安定運用を行なう場合においては為替ヘッジを行なう場合があります。

各マザーファンドの投資方針等について

[国内株式マザーファンド]

- ・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。

東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所第一部に上場している内国普通株式全銘柄を対象とした指数です。新規上場銘柄や有償増資などに対しては、修正を加えることで指数の連続性を維持しています。

[外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド]

- ・主として外国の株式に投資することにより、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジなし）は、MSCI-KOKUSAI指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。MSCI-KOKUSAI指数は、MSCIが開発した、日本を除く先進国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。

[新興国株式マザーファンド]

- ・新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行いません。
- ・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 エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）は、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み・ドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。
MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]

- ・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。
NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

[外国債券為替ヘッジ型マザーファンド]

- ・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いません。
- ・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。
「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。

[外国債券マザーファンド]

- ・主として外国の公社債に投資することにより、FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指します。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」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。

[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]

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

ります。

- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円換算ベース）は、JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets(GBI-EM)Global Diversified（USドルベース）をもとに、委託会社が円換算したものです。

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（JP Morgan Government Bond Index-Emerging Markets(GBI-EM)Global Diversified）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建てのエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数です（ただし、国別の組入比率には上限が設定されています）。

各マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について

東証株価指数(TOPIX)

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

株東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

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

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

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

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

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

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

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

「MSCI-KOKUSAI指数」、「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」

MSCI-KOKUSAI指数、MSCIエマージング・マーケット・インデックスの著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

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

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

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

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

NOMURA-BPI総合

NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)」、

「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」

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

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディ バーシファイド

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

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

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

当情報に関して追加で必要な情報がありましたらお問い合わせください。当情報に関するご連絡は、

index.research@jpmorgan.com宛にお願いします。当情報に関する追加の情報については、www.morganmarkets.comもご覧ください。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

（２）【投資対象】

別に定めるマザーファンドを主要投資対象とし、実質的に国内および外国（新興国を含む）の各株式、国内および外国（新興国を含む）の各債券を投資対象とします。なお、株式、公社債および短期有価証券等に直接投資する場合があります。また、国内外の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等を取引対象とします。

別に定めるマザーファンドと、主要投資対象は以下の通りです。

マザーファンド名	主要投資対象
国内株式マザーファンド	わが国の株式
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証書）を含みます）
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
外国債券マザーファンド	外国の公社債
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債

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、下記「（５）投資制限」、「及び」に定めるものに限りません。）に係る権利
 - ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
 - ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）
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だす資産
 - ・リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティー・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するもの
 - ・流動性に考慮し、時価の取得が可能なもの
 - ・前号または本号イに掲げるものに該当しないもの

有価証券の指図範囲等（信託約款）

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

1. 株券または新株引受権証書
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. 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。）
 8. 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。）
 9. 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。）
 10. コマーシャル・ペーパー
 11. 新株引受権証券および新株予約権証券
 12. 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
 13. 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11号の証券または証書の性質を有するもの
 14. 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。）
 15. 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。）
 16. 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。）
 17. 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。）
 18. 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。）
 19. 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。）
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 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18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
 22. 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12号、第13号、第18号および第19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6号までの証券ならびに第12号、第13号、第18号および第19号の証券または証書のうち第2号から第6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14号および第15号の証券ならびに第18号の証券または証書のうち第14号および第15号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記 に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
7. 日本の会社に類似した性質を有しない外国の者が発行する債務証券または証書（上記 に定める証券または証書を除きます。）
8. 流動性のあるプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの（上記 第12号に定める証券または証書を除きます。なお、上記 第12号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。）
9. リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記 各号以外のもの
10. 流動性のある外国の者に対する貸付債権

その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引
3. 金利先渡取引

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

4. 為替先渡取引

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

5. 直物為替先渡取引

「直物為替先渡取引」とは、当事者間において、あらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行なった先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で

反対売買したときの差金の授受を約する取引その他これに類似する取引をいいます。

(参考)各マザーファンドの概要

「国内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いません。

2.運用方法

(1)投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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

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

「新興国株式マザーファンド」

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

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

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

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。

「外国債券マザーファンド」

運 用 の 基 本 方 針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

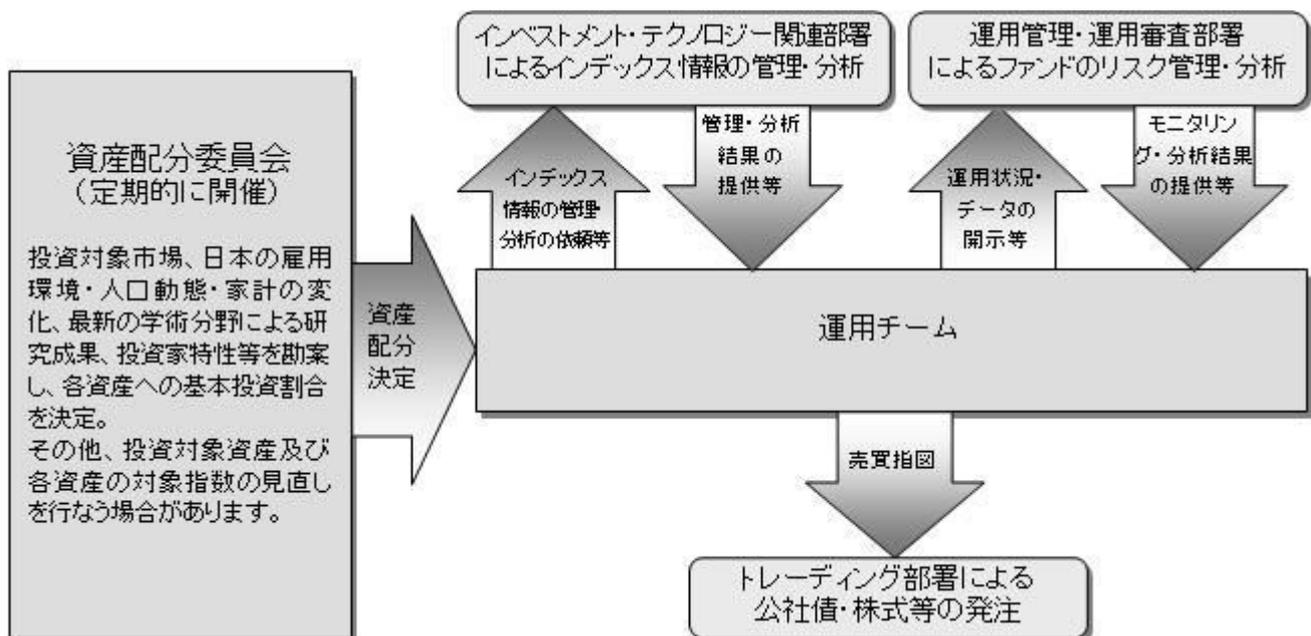
一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をい

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。

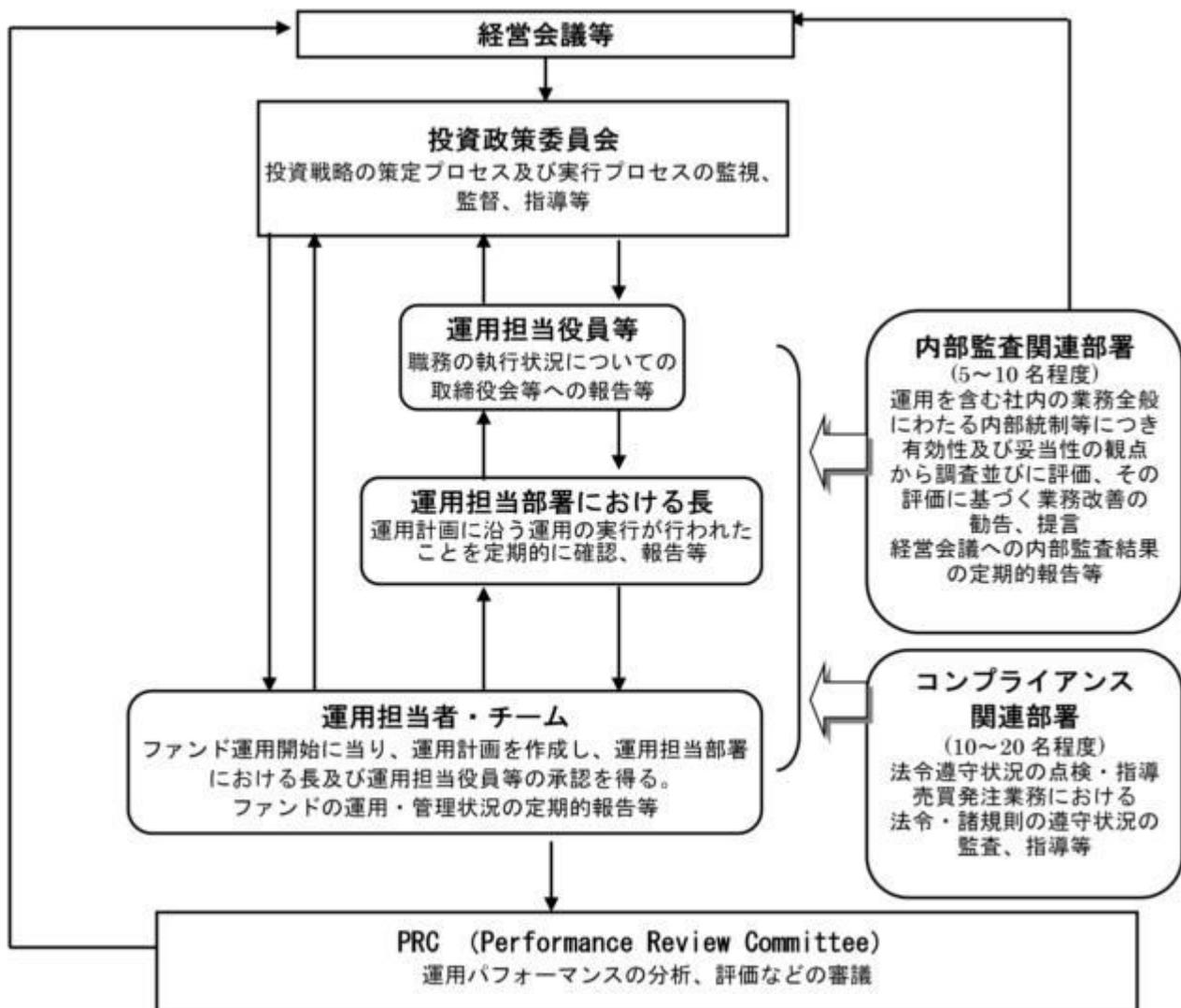


運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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いません。

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

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

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

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

ファンドの決算日

原則として**毎年12月26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。
- ・ 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。
- ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

信用取引の指図範囲(信託約款)

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

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

先物取引等の運用指図(信託約款)

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

スワップ取引の運用指図(信託約款)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

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

公社債の借入れ(信託約款)

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

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

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

額等、法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って評価するものとします。

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

資金の借入れ(信託約款)

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

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

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

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

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

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

[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、為替ヘッジを行なうマザーファンドを通じて投資する部

分を除き、原則として為替ヘッジを行ないませんので、為替変動の影響を受けます。特にファンドの実質的な投資対象に含まれる新興国の通貨については、先進国の通貨に比べ流動性が低い状況となる可能性が高いこと等から、当該通貨の為替変動は先進国以上に大きいものになることも想定されま

す。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

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

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

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

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

投資対象とするマザーファンドにおいて、他のベビーファンドの資金変動等に伴う売買等が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

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

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

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

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

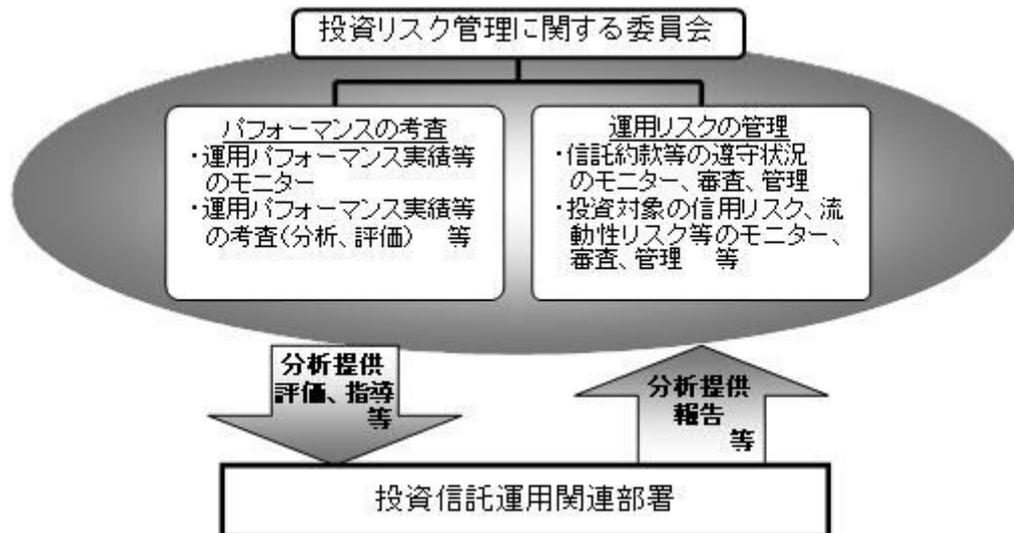
パフォーマンスの考査

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

運用リスクの管理

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

リスク管理体制図



投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

■ リスクの定量的比較（2015年2月末～2020年1月末：月次）

2026-2028年目標型

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 (%)	15.0	41.9	34.1	37.2	9.3	15.3	19.3
最小値 (%)	△ 8.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	4.6	8.1	9.1	5.3	2.0	1.5	0.9

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017年4月から2020年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2015年2月から2020年1月の5年間の（当ファンドは2017年4月から2020年1月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
- * 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

2029-2031年目標型

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 (%)	15.0	41.9	34.1	37.2	9.3	15.3	19.3
最小値 (%)	△ 9.4	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	4.4	8.1	9.1	5.3	2.0	1.5	0.9

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を10,000として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017年4月から2020年1月の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2015年2月から2020年1月の5年間の（当ファンドは2017年4月から2020年1月）の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
- * 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

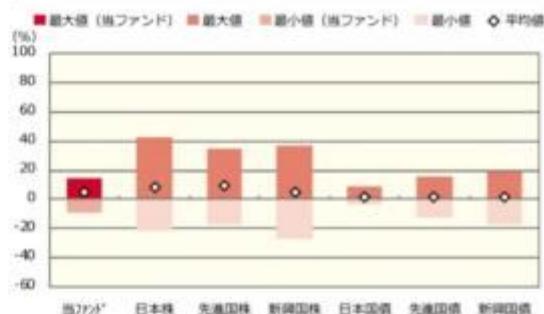
2032-2034年目標型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2015年2月 2016年1月 2017年1月 2018年1月 2019年1月 2020年1月

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	14.8	41.9	34.1	37.2	9.3	15.3	19.3
最小値 (%)	△ 9.3	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	4.3	8.1	9.1	5.3	2.0	1.5	0.9

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を 10,000 として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017 年 4 月から 2020 年 1 月の各月末における 1 年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2015 年 2 月から 2020 年 1 月の 5 年間（当ファンドは 2017 年 4 月から 2020 年 1 月）の各月末における 1 年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
- * 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

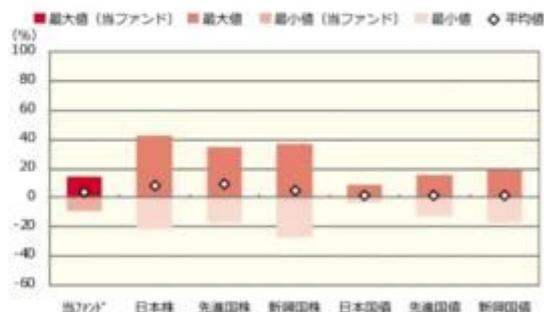
2035-2037年目標型

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



2015年2月 2016年1月 2017年1月 2018年1月 2019年1月 2020年1月

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	14.4	41.9	34.1	37.2	9.3	15.3	19.3
最小値 (%)	△ 9.1	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値 (%)	4.2	8.1	9.1	5.3	2.0	1.5	0.9

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。設定日前日を 10,000 として指数化し、設定日の属する月末より表示しております。
- * 年間騰落率は、2017 年 4 月から 2020 年 1 月の各月末における 1 年間の騰落率を表示したものです。なお、当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

- * 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- * 2015 年 2 月から 2020 年 1 月の 5 年間（当ファンドは 2017 年 4 月から 2020 年 1 月）の各月末における 1 年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。
- * 決算日に対応した数値とは異なります。
- * 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。
- * 当ファンドは基本投資割合を変更することから、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマーク（合成指数）の騰落率は掲載しておりません。

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

<p><代表的な資産クラスの指数></p> <ul style="list-style-type: none"> ○日本株：東証株価指数（TOPIX）（配当込み） ○先進国株：MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース） ○新興国株：MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース） ○日本国債：NOMURA-BPI 国債 ○先進国債：FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース） ○新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）
<p style="text-align: center;">■代表的な資産クラスの指数の著作権等について■</p> <ul style="list-style-type: none"> ○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（旧東京証券取引所）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、旧東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、旧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、旧東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を負いません。 ○MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。 ○NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。 ○FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。 ○JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価値を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または鍵主になっている可能性もあります。 <p>米国のJP Morgan Securities LLC（ここでは「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての提供、保証または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。</p> <p>JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JP MorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, 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。</p>

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

4【手数料等及び税金】

（1）【申込手数料】

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

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

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

（2）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（3）【信託報酬等】

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

信託報酬率の配分については次の通り（税抜）とします。

計算期間	信託報酬率	< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
	年1.045% (税抜年0.95%)	年0.45%	年0.45%	年0.05%
	年0.979% (税抜年0.89%)	年0.42%	年0.42%	年0.05%

ファンド名		
2026-2028年目標型	(1~7期) 設定日~2022年決算日	(8期以降) 2022年決算日翌日以降
2029-2031年目標型	(1~10期) 設定日~2025年決算日	(11期以降) 2025年決算日翌日以降
2032-2034年目標型	(1~13期) 設定日~2028年決算日	(14期以降) 2028年決算日翌日以降
2035-2037年目標型	(1~16期) 設定日~2031年決算日	(17期以降) 2031年決算日翌日以降

支払先の役務の内容

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

(4)【その他の手数料等】

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

ファンドに関する租税、信託事務の処理に要する諸費用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、ファンドから支払われます。

ファンドに関する組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用はファンドから支払われます。また、ファンドが投資するマザーファンドに関する有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が、ファンドから実質的に支払われます。

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

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0.3%の率を乗じて得た額を1口当たりに換算して、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》
<ul style="list-style-type: none"> ・ 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 <ul style="list-style-type: none"> ・ 譲渡益 ・ 譲渡損 	<ul style="list-style-type: none"> ・ 上場株式の配当 ・ 公募株式投資信託の収益分配金

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

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

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

法人の投資家に対する課税

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

源泉税は所有期間に応じて法人税額から控除

税金の取扱いの詳細については税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

換金（解約）時および償還時の課税について

〔個人の投資家の場合〕

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

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

〔法人の投資家の場合〕

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

なお、買取りによるご換金について、詳しくは販売会社にお問い合わせください。

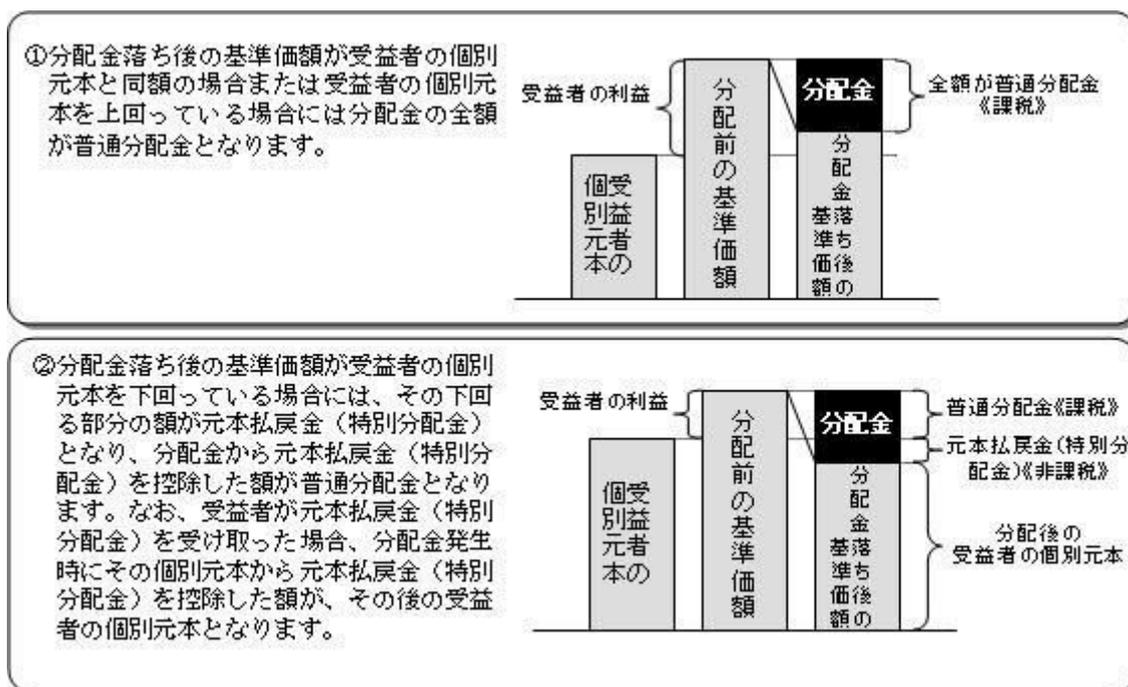
個別元本について

追加型投資信託を保有する受益者毎の取得元本をいいます。

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

分配金の課税について

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



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

- * 外貨建資産への投資により外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。
- * 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2020年1月末現在）が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2020年1月31日現在の運用状況であります。

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

(1)【投資状況】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

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	114,954,685	99.90
現金・預金・その他資産(負債控除後)		104,549	0.09
合計(純資産総額)		115,059,234	100.00

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

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	40,166,591	99.90
現金・預金・その他資産(負債控除後)		39,343	0.09
合計(純資産総額)		40,205,934	100.00

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

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	29,335,611	99.91
現金・預金・その他資産(負債控除後)		23,613	0.08
合計(純資産総額)		29,359,224	100.00

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

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	19,092,270	99.91
現金・預金・その他資産(負債控除後)		15,402	0.08
合計(純資産総額)		19,107,672	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	440,493,146,920	98.18

現金・預金・その他資産(負債控除後)		8,163,171,730	1.81
合計(純資産総額)		448,656,318,650	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	8,143,150,000	1.81

(参考)外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	アメリカ	444,373,235,841	66.53
	カナダ	23,900,755,757	3.57
	ドイツ	19,817,528,408	2.96
	イタリア	5,475,095,887	0.81
	フランス	25,213,572,086	3.77
	オランダ	8,493,085,024	1.27
	スペイン	6,557,331,355	0.98
	ベルギー	2,248,559,782	0.33
	オーストリア	494,031,559	0.07
	ルクセンブルグ	236,300,478	0.03
	フィンランド	2,265,622,531	0.33
	アイルランド	1,342,347,821	0.20
	ポルトガル	376,525,767	0.05
	イギリス	37,197,099,116	5.56
	スイス	22,333,026,300	3.34
	スウェーデン	6,188,978,732	0.92
	ノルウェー	1,379,512,371	0.20
	デンマーク	4,386,439,043	0.65
	オーストラリア	14,892,144,497	2.22
	ニュージーランド	653,024,407	0.09
香港	6,922,842,988	1.03	
シンガポール	2,586,235,623	0.38	
イスラエル	804,477,028	0.12	
小計		638,137,772,401	95.54
投資証券	アメリカ	14,904,571,237	2.23
	カナダ	212,942,557	0.03
	フランス	668,718,226	0.10
	イギリス	449,474,734	0.06
	オーストラリア	1,227,099,600	0.18

	香港	375,332,724	0.05
	シンガポール	350,816,457	0.05
	小計	18,188,955,535	2.72
現金・預金・その他資産（負債控除後）		11,599,931,959	1.73
合計（純資産総額）		667,926,659,895	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	8,126,370,052	1.21
	買建	カナダ	431,017,675	0.06
	買建	ドイツ	1,287,918,567	0.19
	買建	イギリス	668,951,624	0.10
	買建	スイス	395,238,695	0.05
	買建	オーストラリア	279,707,616	0.04

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	6,085,185,980	14.44
	メキシコ	974,372,085	2.31
	ブラジル	3,029,371,449	7.19
	チリ	121,113,424	0.28
	コロンビア	75,074,512	0.17
	ギリシャ	118,882,733	0.28
	イギリス	20,076,949	0.04
	トルコ	212,588,353	0.50
	チェコ	58,827,888	0.13
	ハンガリー	116,787,240	0.27
	ポーランド	354,470,378	0.84
	香港	8,413,597,842	19.97
	マレーシア	742,998,600	1.76
	タイ	1,008,839,443	2.39
	フィリピン	384,705,881	0.91
	インドネシア	823,236,691	1.95
	韓国	4,827,115,669	11.45
	台湾	4,697,840,981	11.15
	インド	3,681,235,274	8.73
	パキスタン	12,548,155	0.02
カタール	388,292,025	0.92	

	エジプト	62,074,175	0.14
	南アフリカ	1,834,752,206	4.35
	アラブ首長国連邦	244,282,277	0.57
	サウジアラビア	1,068,580,039	2.53
	小計	39,356,850,249	93.41
新株予約権証券	タイ	0	0.00
投資信託受益証券	アメリカ	1,568,056,718	3.72
投資証券	メキシコ	37,867,790	0.08
	南アフリカ	61,421,184	0.14
	小計	99,288,974	0.23
現金・預金・その他資産（負債控除後）		1,104,829,303	2.62
合計（純資産総額）		42,129,025,244	100.00

その他の資産の投資状況

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

資産の種類	建別	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	アメリカ	1,068,749,829	2.53

（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	570,132,148,610	79.81
地方債証券	日本	47,623,941,803	6.66
特殊債券	日本	61,976,534,364	8.67
社債券	日本	29,806,683,650	4.17
現金・預金・その他資産（負債控除後）		4,778,553,381	0.66
合計（純資産総額）		714,317,861,808	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	30,516,766,943	47.15
	カナダ	1,191,336,414	1.84
	メキシコ	554,695,672	0.85
	ドイツ	3,655,147,580	5.64
	イタリア	6,021,656,330	9.30
	フランス	6,555,524,056	10.12
	オランダ	1,068,071,333	1.65
	スペイン	3,747,019,041	5.78

	ベルギー	1,586,437,279	2.45
	オーストリア	869,802,704	1.34
	フィンランド	329,812,812	0.50
	アイルランド	675,580,140	1.04
	イギリス	4,162,417,069	6.43
	スウェーデン	193,105,196	0.29
	ノルウェー	131,390,156	0.20
	デンマーク	302,898,341	0.46
	ポーランド	376,134,830	0.58
	オーストラリア	1,178,314,374	1.82
	シンガポール	544,794,567	0.84
	南アフリカ	343,955,996	0.53
	小計	64,004,860,833	98.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）		716,324,370	1.10
合計（純資産総額）		64,721,185,203	100.00

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	アメリカ	295,892,415,269	47.84
	カナダ	11,724,626,107	1.89
	メキシコ	5,489,708,263	0.88
	ドイツ	34,046,919,803	5.50
	イタリア	56,993,144,126	9.21
	フランス	58,408,785,887	9.44
	オランダ	8,809,415,315	1.42
	スペイン	38,599,605,145	6.24
	ベルギー	14,398,784,610	2.32
	オーストリア	7,742,680,521	1.25
	フィンランド	2,647,233,970	0.42
	アイルランド	5,617,917,081	0.90
	イギリス	40,738,576,141	6.58
	スウェーデン	1,713,036,395	0.27
	ノルウェー	1,396,983,159	0.22
	デンマーク	3,028,536,868	0.48
	ポーランド	3,477,530,430	0.56
	オーストラリア	11,794,875,511	1.90
	シンガポール	2,580,597,415	0.41
	マレーシア	2,962,765,792	0.47
南アフリカ	3,563,745,702	0.57	
小計	611,627,883,510	98.89	

現金・預金・その他資産(負債控除後)		6,825,441,173	1.10
合計(純資産総額)		618,453,324,683	100.00

(参考)新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	メキシコ	817,298,048	9.98
	ブラジル	800,720,697	9.78
	チリ	212,901,296	2.60
	コロンビア	483,592,977	5.90
	ペルー	273,173,936	3.33
	ウルグアイ	10,310,745	0.12
	ドミニカ共和国	16,737,676	0.20
	トルコ	305,093,006	3.72
	チェコ	296,987,846	3.62
	ハンガリー	293,583,840	3.58
	ポーランド	709,450,975	8.66
	ロシア	703,935,688	8.60
	ルーマニア	212,243,501	2.59
	マレーシア	512,552,654	6.26
	タイ	749,093,552	9.15
	フィリピン	21,625,770	0.26
	インドネシア	821,720,976	10.04
南アフリカ	730,565,834	8.92	
	小計	7,971,589,017	97.39
現金・預金・その他資産(負債控除後)		212,869,947	2.60
合計(純資産総額)		8,184,458,964	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型

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	外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	20,577,962	1.1867	24,419,868	1.2100	24,899,334	21.64
2	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	18,241,388	1.3378	24,403,329	1.3454	24,541,963	21.32
3	日本	親投資信託 受益証券	国内株式マザーファンド	14,121,742	1.7464	24,662,211	1.7019	24,033,792	20.88
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	4,653,233	3.0539	14,210,509	3.0768	14,317,067	12.44

5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	5,956,070	2.3478	13,983,662	2.3811	14,181,998	12.32
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	7,632,184	1.3347	10,186,676	1.2822	9,785,986	8.50
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	2,262,426	1.4194	3,211,288	1.4120	3,194,545	2.77

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

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

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	6,229,950	1.7466	10,881,231	1.7019	10,602,751	26.37
2	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	5,343,255	1.1868	6,341,376	1.2100	6,465,338	16.08
3	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	4,736,606	1.3379	6,337,106	1.3454	6,372,629	15.84
4	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	2,052,572	3.0550	6,270,608	3.0768	6,315,353	15.70
5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	2,088,331	2.3482	4,903,819	2.3811	4,972,524	12.36
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	3,367,571	1.3351	4,496,045	1.2822	4,317,899	10.73
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	793,270	1.4197	1,126,206	1.4120	1,120,097	2.78

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

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

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	4,966,453	1.7465	8,674,350	1.7019	8,452,406	28.78
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド	1,636,643	3.0555	5,000,842	3.0768	5,035,623	17.15
3	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	3,285,784	1.1868	3,899,716	1.2100	3,975,798	13.54
4	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	2,913,850	1.3378	3,898,436	1.3454	3,920,293	13.35

5	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,527,498	2.3482	3,587,001	2.3811	3,637,125	12.38
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	2,703,743	1.3353	3,610,429	1.2822	3,466,739	11.80
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	600,303	1.4199	852,406	1.4120	847,627	2.88

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	99.91
合計	99.91

野村ターゲットデットファンド2016 2035 - 2037年目標型

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	3,142,665	1.7465	5,488,678	1.7019	5,348,501	27.99
2	日本	親投資信託 受益証券	外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	1,039,751	3.0540	3,175,408	3.0768	3,199,105	16.74
3	日本	親投資信託 受益証券	外国債券マザーファンド	1,173,006	2.3477	2,753,915	2.3811	2,793,044	14.61
4	日本	親投資信託 受益証券	外国債券為替ヘッジ型マザーファ ンド	2,056,771	1.1867	2,440,851	1.2100	2,488,692	13.02
5	日本	親投資信託 受益証券	国内債券NOMURA-BPI総 合マザーファンド	1,823,952	1.3378	2,440,264	1.3454	2,453,945	12.84
6	日本	親投資信託 受益証券	新興国株式マザーファンド	1,716,164	1.3345	2,290,318	1.2822	2,200,465	11.51
7	日本	親投資信託 受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マ ザーファンド	430,962	1.4194	611,741	1.4120	608,518	3.18

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	99.91
合計	99.91

(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	2,071,300	6,603.00	13,676,813,192	7,652.00	15,849,587,600	3.53
2	日本	株式	ソニー	電気機器	1,173,900	5,482.06	6,435,392,265	7,718.00	9,060,160,200	2.01
3	日本	株式	三菱UFJフィナン シャル・グループ	銀行業	12,603,800	525.52	6,623,673,186	568.50	7,165,260,300	1.59
4	日本	株式	日本電信電話	情報・通 信業	2,435,000	2,392.09	5,824,761,153	2,786.50	6,785,127,500	1.51
5	日本	株式	ソフトバンクグル ープ	情報・通 信業	1,445,300	5,344.55	7,724,491,848	4,524.00	6,538,537,200	1.45

6	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	1,544,500	4,233.68	6,538,930,026	4,227.00	6,528,601,500	1.45
7	日本	株式	キーエンス	電気機器	168,200	33,289.42	5,599,280,529	37,370.00	6,285,634,000	1.40
8	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	1,270,700	3,292.15	4,183,336,286	4,304.00	5,469,092,800	1.21
9	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1,266,300	3,862.93	4,891,629,992	3,884.00	4,918,309,200	1.09
10	日本	株式	任天堂	その他製品	113,800	37,386.99	4,254,640,291	40,770.00	4,639,626,000	1.03
11	日本	株式	KDDI	情報・通信業	1,357,500	2,585.98	3,510,476,296	3,271.00	4,440,382,500	0.98
12	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	1,345,600	2,515.37	3,384,694,015	3,107.00	4,180,779,200	0.93
13	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	1,461,600	2,828.03	4,133,452,625	2,831.00	4,137,789,600	0.92
14	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	24,879,200	166.85	4,151,117,492	162.50	4,042,870,000	0.90
15	日本	株式	信越化学工業	化学	312,200	9,659.67	3,015,748,979	12,715.00	3,969,623,000	0.88
16	日本	株式	第一三共	医薬品	531,200	5,650.27	3,001,428,449	7,441.00	3,952,659,200	0.88
17	日本	株式	HOYA	精密機器	370,700	7,834.30	2,904,175,767	10,600.00	3,929,420,000	0.87
18	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	654,700	5,490.80	3,594,830,994	5,985.00	3,918,379,500	0.87
19	日本	株式	花王	化学	444,500	8,393.70	3,731,003,449	8,782.00	3,903,599,000	0.87
20	日本	株式	日立製作所	電気機器	892,000	3,754.64	3,349,143,200	4,230.00	3,773,160,000	0.84
21	日本	株式	ダイキン工業	機械	236,500	13,656.82	3,229,838,269	15,635.00	3,697,677,500	0.82
22	日本	株式	三菱商事	卸売業	1,283,000	2,830.13	3,631,066,260	2,823.00	3,621,909,000	0.80
23	日本	株式	ファナック	電気機器	176,400	19,240.62	3,394,045,404	20,320.00	3,584,448,000	0.79
24	日本	株式	村田製作所	電気機器	545,300	5,030.26	2,743,005,614	6,328.00	3,450,658,400	0.76
25	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	154,300	22,145.06	3,416,983,458	21,585.00	3,330,565,500	0.74
26	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	1,278,800	1,980.87	2,533,145,728	2,568.00	3,283,958,400	0.73
27	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	1,632,900	1,459.26	2,382,829,532	1,950.50	3,184,971,450	0.70
28	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	326,700	9,943.93	3,248,684,077	9,700.00	3,168,990,000	0.70
29	日本	株式	三井物産	卸売業	1,607,000	1,680.00	2,699,769,788	1,960.50	3,150,523,500	0.70
30	日本	株式	日本電産	電気機器	223,400	14,851.42	3,317,809,203	14,040.00	3,136,536,000	0.69

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.09
		鉱業	0.26
		建設業	2.79
		食料品	3.76
		繊維製品	0.56
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.00
		医薬品	6.00
		石油・石炭製品	0.46
		ゴム製品	0.66
		ガラス・土石製品	0.81
		鉄鋼	0.73
		非鉄金属	0.70

	金属製品	0.56
	機械	4.99
	電気機器	14.27
	輸送用機器	7.49
	精密機器	2.39
	その他製品	2.21
	電気・ガス業	1.45
	陸運業	4.26
	海運業	0.15
	空運業	0.46
	倉庫・運輸関連業	0.17
	情報・通信業	8.66
	卸売業	4.96
	小売業	4.47
	銀行業	5.60
	証券、商品先物取引業	0.84
	保険業	2.23
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.49
	サービス業	5.09
合 計		98.18

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	657,600	20,888.26	13,736,120,960	35,321.26	23,227,262,023	3.47
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,055,500	13,045.75	13,769,796,724	18,843.38	19,889,194,767	2.97
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	61,170	194,208.59	11,879,739,756	204,016.36	12,479,680,790	1.86
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	349,900	18,348.25	6,420,054,215	22,851.34	7,995,684,496	1.19
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	45,460	128,170.58	5,826,634,740	158,773.91	7,217,861,967	1.08
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	43,560	128,541.38	5,599,262,853	158,600.50	6,908,637,998	1.03

7	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	465,000	11,160.10	5,189,451,057	14,820.16	6,891,375,981	1.03
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	383,800	15,144.07	5,812,294,680	16,398.26	6,293,652,802	0.94
9	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	251,100	17,205.30	4,320,252,236	22,707.38	5,701,823,771	0.85
10	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	432,700	10,791.49	4,669,480,536	12,115.26	5,242,276,637	0.78
11	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	363,800	11,502.55	4,184,630,674	13,736.10	4,997,195,727	0.74
12	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	191,400	21,970.13	4,205,084,222	24,852.59	4,756,786,262	0.71
13	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,285,500	3,018.78	3,880,642,718	3,651.32	4,693,783,172	0.70
14	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	643,800	5,810.71	3,740,939,476	7,249.21	4,667,046,677	0.69
15	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	131,220	26,009.71	3,412,995,379	35,385.60	4,643,299,429	0.69
16	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	615,100	8,697.53	5,349,853,779	7,065.99	4,346,295,001	0.65
17	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	1,062,100	3,464.83	3,680,002,528	4,082.11	4,335,615,191	0.64
18	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	137,700	26,825.48	3,693,869,725	30,643.67	4,219,634,571	0.63
19	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	159,100	21,165.27	3,367,395,125	25,388.07	4,039,243,114	0.60
20	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	261,800	12,360.86	3,236,073,252	15,029.55	3,934,738,441	0.58
21	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	601,100	6,437.81	3,869,768,673	6,473.80	3,891,402,142	0.58
22	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	590,200	5,174.89	3,054,224,209	6,419.27	3,788,654,098	0.56
23	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	102,080	30,878.63	3,152,091,418	36,788.93	3,755,414,689	0.56
24	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	372,100	9,073.79	3,376,358,003	9,433.69	3,510,276,049	0.52
25	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	275,800	13,376.20	3,689,158,442	12,149.28	3,350,772,527	0.50
26	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	803,600	4,572.88	3,674,771,029	4,042.85	3,248,837,635	0.48
27	スイス	株式	NOVARTIS AG-REG	医薬品	312,100	9,508.21	2,967,513,527	10,373.10	3,237,447,038	0.48
28	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	621,900	5,847.79	3,636,745,078	5,151.99	3,204,025,317	0.47
29	アメリカ	株式	PEPSICO INC	飲料	203,100	13,470.00	2,735,757,121	15,686.09	3,185,846,869	0.47
30	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	608,200	5,269.77	3,205,079,710	5,225.06	3,177,884,290	0.47

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	3.51
		メディア	1.20
		娯楽	1.31
		不動産管理・開発	0.47
		エネルギー設備・サービス	0.24
		石油・ガス・消耗燃料	4.54
		化学	2.09
		建設資材	0.27

容器・包装	0.28
金属・鉱業	1.27
紙製品・林産品	0.08
航空宇宙・防衛	2.30
建設関連製品	0.38
建設・土木	0.31
電気設備	0.73
コングロマリット	1.27
機械	1.56
商社・流通業	0.27
商業サービス・用品	0.47
航空貨物・物流サービス	0.49
旅客航空輸送業	0.10
海運業	0.04
陸運・鉄道	1.01
運送インフラ	0.20
自動車部品	0.25
自動車	0.81
家庭用耐久財	0.38
レジャー用品	0.04
繊維・アパレル・贅沢品	1.42
ホテル・レストラン・レジャー	1.73
販売	0.06
インターネット販売・通信販売	2.39
複合小売り	0.47
専門小売り	1.65
食品・生活必需品小売り	1.45
飲料	1.94
食品	1.94
タバコ	0.84
家庭用品	1.33
パーソナル用品	0.67
ヘルスケア機器・用品	2.86
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.90
バイオテクノロジー	1.72
医薬品	5.51
銀行	7.31
各種金融サービス	0.97
保険	3.72
情報技術サービス	4.35
ソフトウェア	5.79
通信機器	0.73

	コンピュータ・周辺機器	3.74
	電子装置・機器・部品	0.51
	半導体・半導体製造装置	3.35
	各種電気通信サービス	1.95
	無線通信サービス	0.26
	電力	2.17
	ガス	0.19
	総合公益事業	1.12
	水道	0.12
	消費者金融	0.47
	資本市場	2.98
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.10
	ヘルスケア・テクノロジー	0.10
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.77
	専門サービス	0.78
投資証券		2.72
合計		98.26

(参考) 新興国株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インター ネット販 売・通信販 売	106,190	19,458.42	2,066,289,764	22,747.73	2,415,581,958	5.73
2	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	360,400	5,235.37	1,886,829,366	5,265.00	1,897,506,000	4.50
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半 導体製造装 置	1,548,000	920.16	1,424,407,680	1,139.40	1,763,791,200	4.18
4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュ ータ・周辺機 器	299,470	3,926.13	1,175,758,420	5,268.11	1,577,643,896	3.74
5	アメリカ	投資信託受 益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF		533,900	2,971.27	1,586,362,461	2,936.98	1,568,056,718	3.72
6	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,004,000	89.99	540,338,386	84.24	505,776,960	1.20

7	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インターネット販売・通信販売	27,350	18,410.46	503,526,081	18,203.63	497,869,281	1.18
8	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	351,000	1,221.62	428,788,760	1,263.60	443,523,600	1.05
9	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	177,700	1,939.09	344,576,471	2,223.37	395,093,738	0.93
10	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	102,000	2,982.81	304,246,681	3,719.10	379,348,200	0.90
11	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信サービス	386,000	1,017.61	392,801,011	906.98	350,095,824	0.83
12	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	686,300	386.50	265,259,777	442.33	303,571,765	0.72
13	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,046,000	77.07	311,864,062	73.99	299,366,777	0.71
14	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半導体製造装置	33,870	6,944.43	235,207,915	8,657.40	293,226,138	0.69
15	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガス・消耗燃料	24,370	8,781.51	214,005,428	11,058.68	269,500,129	0.63
16	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガス・消耗燃料	330,500	558.38	184,546,970	789.37	260,888,861	0.61
17	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	196,421	1,246.81	244,901,513	1,321.48	259,568,387	0.61
18	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	300,691	838.56	252,150,091	858.32	258,091,204	0.61
19	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術サービス	210,800	1,110.26	234,043,440	1,202.27	253,440,202	0.60
20	インド	株式	ICICI BANK LTD	銀行	295,600	682.55	201,764,172	819.58	242,270,213	0.57
21	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラクティブ・メディアおよびサービス	17,100	16,895.57	288,914,336	13,713.20	234,495,795	0.55
22	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・機器・部品	772,649	300.56	232,230,474	299.16	231,145,675	0.54
23	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュータ・周辺機器	50,820	3,202.50	162,751,111	4,416.19	224,431,030	0.53
24	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PREF	銀行	249,215	899.63	224,203,683	858.32	213,907,963	0.50

25	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	4,912,000	48.71	239,306,745	42.54	208,962,374	0.49
26	アメリカ	株式	JD.COM INC-ADR	インター ネット販 売・通信販 売	47,700	3,010.15	143,584,396	4,197.71	200,231,215	0.47
27	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信 サービス	2,074,000	78.78	163,397,186	93.25	193,401,537	0.45
28	ブラジル	株式	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	石油・ガ ス・消耗燃 料	259,300	687.68	178,317,499	742.60	192,556,284	0.45
29	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガ ス・消耗燃 料	1,101,000	185.74	204,509,869	168.48	185,496,480	0.44
30	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術 サービス	55,500	3,339.19	185,325,455	3,292.28	182,722,039	0.43

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	5.94
		メディア	0.28
		娯楽	0.74
		不動産管理・開発	2.33
		エネルギー設備・サービス	0.08
		石油・ガス・消耗燃料	6.72
		化学	2.20
		建設資材	1.04
		容器・包装	0.05
		金属・鋳業	3.28
		紙製品・林産品	0.20
		航空宇宙・防衛	0.11
		建設関連製品	0.02
		建設・土木	0.55
		電気設備	0.22
		コングロマリット	1.21
		機械	0.52
商社・流通業	0.04		
商業サービス・用品	0.17		
航空貨物・物流サービス	0.16		

旅客航空輸送業	0.18
海運業	0.08
陸運・鉄道	0.33
運送インフラ	0.88
自動車部品	0.41
自動車	1.63
家庭用耐久財	0.27
レジャー用品	0.06
繊維・アパレル・贅沢品	0.79
ホテル・レストラン・レジャー	0.65
インターネット販売・通信販売	8.15
複合小売り	0.62
専門小売り	0.50
食品・生活必需品小売り	1.57
飲料	0.97
食品	1.75
タバコ	0.42
家庭用品	0.45
パーソナル用品	0.69
ヘルスケア機器・用品	0.11
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.57
バイオテクノロジー	0.30
医薬品	1.09
銀行	15.35
各種金融サービス	0.64
保険	3.66
情報技術サービス	1.54
ソフトウェア	0.15
通信機器	0.12
コンピュータ・周辺機器	5.23
電子装置・機器・部品	1.94
半導体・半導体製造装置	5.96
各種電気通信サービス	1.37
無線通信サービス	2.69
電力	1.07
ガス	0.60

	総合公益事業	0.05
	水道	0.22
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.92
	消費者金融	0.31
	資本市場	1.23
	各種消費者サービス	0.67
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.55
	ヘルスケア・テクノロジー	0.11
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.34
	専門サービス	0.02
	その他の業種	0.00
新株予約権証券		0.00
投資信託受益証券		3.72
投資証券		0.23
合 計		97.37

(参考) 国内債券NOMURA - BPI総合 マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	7,600,000,000	104.14	7,914,972,000	103.41	7,859,692,000	0.6	2024/6/20	1.10
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	7,500,000,000	100.83	7,562,325,000	100.48	7,536,675,000	0.1	2021/12/20	1.05
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	7,000,000,000	100.75	7,052,810,000	100.42	7,029,680,000	0.1	2021/9/20	0.98
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	6,850,000,000	102.06	6,991,386,000	101.97	6,985,082,000	0.1	2028/3/20	0.97
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 51回	6,600,000,000	102.65	6,774,950,000	101.90	6,725,664,000	0.1	2028/6/20	0.94
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	6,400,000,000	102.36	6,551,204,000	101.77	6,513,472,000	0.1	2026/6/20	0.91
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 3回	6,200,000,000	101.25	6,277,820,000	100.73	6,245,818,000	0.1	2022/9/20	0.87
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 53回	6,100,000,000	102.88	6,275,960,000	101.83	6,211,996,000	0.1	2028/12/20	0.86
9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	6,000,000,000	103.74	6,224,664,000	102.82	6,169,200,000	0.3	2025/12/20	0.86
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 7回	6,000,000,000	101.58	6,095,130,000	101.02	6,061,320,000	0.1	2023/9/20	0.84

11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 7回	6,000,000,000	100.54	6,032,520,000	100.28	6,017,160,000	0.1	2021/3/20	0.84
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 8回	5,900,000,000	101.43	5,984,760,000	101.09	5,964,487,000	0.1	2023/12/20	0.83
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	5,800,000,000	102.19	5,927,485,000	101.84	5,906,894,000	0.1	2026/9/20	0.82
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 55回	5,600,000,000	102.76	5,754,816,000	101.74	5,697,888,000	0.1	2029/6/20	0.79
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 48回	5,500,000,000	102.50	5,637,920,000	102.00	5,610,385,000	0.1	2027/9/20	0.78
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	5,400,000,000	103.78	5,604,390,000	103.02	5,563,296,000	0.6	2023/12/20	0.77
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	5,400,000,000	102.26	5,522,148,000	101.94	5,505,084,000	0.1	2027/3/20	0.77
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	5,300,000,000	104.23	5,524,190,000	103.31	5,475,430,000	0.8	2023/6/20	0.76
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	5,200,000,000	103.95	5,405,912,000	103.14	5,363,696,000	0.5	2024/9/20	0.75
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	5,200,000,000	100.62	5,232,396,000	100.35	5,218,252,000	0.1	2021/6/20	0.73
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 28回	5,000,000,000	103.17	5,158,800,000	102.43	5,121,650,000	0.6	2023/3/20	0.71
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 49回	5,000,000,000	102.16	5,108,150,000	101.99	5,099,600,000	0.1	2027/12/20	0.71
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	5,000,000,000	102.27	5,113,500,000	101.91	5,095,700,000	0.1	2026/12/20	0.71
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 47回	4,200,000,000	122.12	5,129,262,000	121.19	5,090,106,000	1.6	2033/12/20	0.71
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	4,900,000,000	102.62	5,028,636,000	101.97	4,996,922,000	0.1	2027/6/20	0.69
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	4,800,000,000	101.99	4,895,793,000	101.87	4,889,904,000	0.1	2028/9/20	0.68
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	4,800,000,000	100.84	4,840,488,000	100.56	4,827,072,000	0.1	2022/3/20	0.67
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (20年)第1 50回	3,830,000,000	120.08	4,599,276,000	119.08	4,560,917,200	1.4	2034/9/20	0.63
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 5回	4,500,000,000	101.19	4,553,920,000	100.87	4,539,555,000	0.1	2023/3/20	0.63
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 25回	4,400,000,000	103.45	4,552,064,000	102.56	4,512,640,000	0.8	2022/9/20	0.63

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	79.81
地方債証券	6.66
特殊債券	8.67

社債券	4.17
合計	99.33

(参考) 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	6,150,000	11,020.59	677,766,781	11,016.76	677,530,956	2.125	2021/8/15	1.04
2	イギリス	国債証券	UK TREASURY	2,180,000	24,740.79	539,349,251	25,006.53	545,142,487	4.25	2046/12/7	0.84
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	4,500,000	11,364.86	511,418,966	11,384.84	512,317,845	2.375	2024/8/15	0.79
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	11,947.18	501,781,629	11,937.80	501,387,979	2.75	2028/2/15	0.77
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	3,450,000	14,561.21	502,361,866	14,485.38	499,745,713	3.75	2043/11/15	0.77
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	12,313.76	492,550,729	12,334.00	493,360,175	3.125	2028/11/15	0.76
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,200,000	10,987.79	461,487,390	11,025.28	463,061,944	1.625	2026/5/15	0.71
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,337.12	453,485,091	11,343.94	453,757,741	2.25	2024/11/15	0.70
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,182.05	447,282,325	11,199.09	447,963,950	2	2024/6/30	0.69
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	11,029.96	441,198,783	11,022.30	440,892,063	2.375	2021/4/15	0.68
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	4,000,000	10,812.27	432,491,041	10,850.61	434,024,686	1.125	2021/8/31	0.67
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,800,000	10,900.03	414,201,350	10,937.52	415,625,946	1.5	2026/8/15	0.64
13	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000	13,388.18	415,033,797	13,383.37	414,884,625	2.2	2027/6/1	0.64
14	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2,180,000	18,676.57	407,149,335	18,944.84	412,997,599	4.75	2044/9/1	0.63
15	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	3,010,000	13,739.78	413,567,614	13,501.81	406,404,492	2.25	2024/5/25	0.62
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	11,925.88	405,479,958	11,919.06	405,248,206	2.5	2046/5/15	0.62
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,700,000	10,856.58	401,693,520	10,892.36	403,017,597	1.375	2021/4/30	0.62
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,020,000	13,055.67	394,281,355	13,015.62	393,072,007	3	2045/11/15	0.60
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,580,000	10,957.12	392,264,963	10,964.78	392,539,477	2	2021/2/28	0.60
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	11,173.53	391,073,804	11,188.87	391,610,603	2	2024/4/30	0.60
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	11,513.49	391,458,933	11,498.16	390,937,471	2.75	2024/2/15	0.60
22	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	2,680,000	14,618.72	391,781,835	14,489.64	388,322,429	6.5	2026/11/15	0.59
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	11,008.24	385,288,531	11,003.98	385,139,397	2.125	2021/6/30	0.59
24	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,500,000	10,817.38	378,608,607	10,866.80	380,338,211	1.25	2023/7/31	0.58
25	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,100,000	12,003.19	372,099,081	12,087.76	374,720,762	2.875	2028/8/15	0.57
26	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,400,000	10,980.12	373,324,281	10,998.87	373,961,619	1.75	2022/5/31	0.57
27	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,800,000	13,141.73	367,968,440	13,158.77	368,445,578	3	2048/2/15	0.56
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	3,200,000	11,494.75	367,832,089	11,504.97	368,159,269	2.25	2027/8/15	0.56
29	フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2,800,000	13,180.06	369,041,904	12,974.27	363,279,582	1.75	2023/5/25	0.56
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	2,820,000	12,406.14	349,853,387	12,563.20	354,282,254	2.75	2047/8/15	0.54

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.89

合 計	98.89
-----	-------

(参考) 外国債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	72,200,000	13,460.82	9,718,712,418	13,802.05	9,965,082,555	6	2026/2/15	1.61
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,000,000	11,070.40	8,856,322,783	11,134.76	8,907,815,767	2.5	2022/1/15	1.44
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,850.61	7,627,983,857	11,406.99	8,019,117,046	2.25	2025/11/15	1.29
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	49,300,000	13,627.17	6,718,195,223	14,272.80	7,036,490,931	5.25	2028/11/15	1.13
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	44,500,000	14,594.36	6,494,494,414	15,111.62	6,724,673,681	5.375	2031/2/15	1.08
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	43,300,000	13,902.93	6,019,968,797	14,397.62	6,234,170,983	5.5	2028/8/15	1.00
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	51,400,000	10,288.99	5,288,542,849	11,884.98	6,108,881,588	2.5	2045/2/15	0.98
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,800,000	11,158.46	5,445,331,462	11,143.29	5,437,925,797	3.625	2021/2/15	0.87
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	10,717.70	5,133,778,433	11,031.24	5,283,967,685	1.75	2023/1/31	0.85
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,900,000	10,732.18	5,033,395,058	11,234.03	5,268,760,895	2	2025/2/15	0.85
11	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	10,956.16	4,941,231,588	11,384.84	5,134,563,299	2.375	2024/8/15	0.83
12	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	15,029.07	5,124,915,939	14,992.38	5,112,404,138	3.5	2026/4/25	0.82
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	35,600,000	13,543.88	4,821,624,395	14,337.12	5,104,017,933	5.25	2029/2/15	0.82
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,400,000	11,092.75	5,036,112,012	11,133.06	5,054,412,051	3.125	2021/5/15	0.81
15	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	18,207.40	4,915,999,350	18,479.80	4,989,546,078	5.5	2029/4/25	0.80
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,672.26	4,916,837,077	12,746.38	4,945,598,350	6.25	2023/8/15	0.79
17	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	34,100,000	13,992.05	4,771,291,315	14,489.64	4,940,968,226	6.5	2026/11/15	0.79
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,600,000	11,322.24	4,823,274,473	11,460.67	4,882,246,070	2.75	2023/11/15	0.78
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	43,000,000	11,139.28	4,789,892,690	11,274.07	4,847,853,325	2.25	2023/12/31	0.78
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	10,816.57	4,618,675,731	11,275.78	4,814,758,494	2.125	2024/9/30	0.77
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	11,193.98	4,130,580,840	12,950.87	4,778,872,875	3	2044/11/15	0.77
22	イギリス	国債証券	UK TREASURY	21,340,000	19,793.20	4,223,870,971	21,999.12	4,694,612,763	3.5	2045/1/22	0.75
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,100,000	11,283.89	4,637,680,180	11,420.62	4,693,877,646	2.75	2023/7/31	0.75
24	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	22,200,000	18,942.07	4,205,141,143	20,976.17	4,656,710,495	3.25	2044/1/22	0.75
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	31,100,000	13,742.33	4,273,867,544	13,857.35	4,309,638,027	5.5	2022/11/1	0.69
26	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000	20,097.31	4,039,560,918	20,893.09	4,199,511,184	5.75	2032/10/25	0.67
27	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,700,000	17,561.88	3,635,310,211	19,880.89	4,115,345,948	3.25	2045/5/25	0.66
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	27,900,000	14,128.98	3,941,987,921	14,660.90	4,090,391,351	6.125	2027/11/15	0.66
29	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,000,000	11,096.00	3,883,600,753	11,575.69	4,051,493,606	2.625	2025/3/31	0.65
30	ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	21,500,000	18,735.73	4,028,183,305	18,440.30	3,964,665,747	6.5	2027/7/4	0.64

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.89
合 計	98.89

(参考) 新興国債券(現地通貨建て) マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	8,590,000,000	3.94	339,073,585	4.03	346,665,337	9.85	2027/6/28	4.23
2	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	6,800,000	2,812.64	191,260,037	2,813.76	191,335,870	1.75	2021/7/25	2.33
3	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000	2,771.53	169,079,110	2,886.27	176,062,652	10	2023/1/1	2.15
4	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5,600,000	2,858.60	160,082,043	2,883.30	161,465,037	2.5	2024/4/25	1.97
5	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5,250,000	2,849.07	149,576,364	2,926.08	153,619,412	2.75	2028/4/25	1.87
6	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	16,700,000	825.41	137,844,218	834.78	139,409,795	10.5	2026/12/21	1.70
7	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	6,100,000	2,221.00	135,481,305	2,258.21	137,751,152		2022/1/1	1.68
8	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	411,000	2,887.53	118,685,695	2,991.75	122,961,197	10	2025/1/1	1.50
9	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	5,200,000	2,177.65	113,237,842	2,213.83	115,119,578		2022/7/1	1.40
10	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	59,000,000	169.08	99,759,914	188.87	111,434,173	7.75	2026/9/16	1.36
11	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000	2,898.26	101,439,406	2,881.43	100,850,295	2.5	2026/7/25	1.23
12	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000	2,843.12	90,983,913	3,069.69	98,230,109	10	2027/1/1	1.20
13	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	20,900,000	452.00	94,470,007	461.24	96,399,449	1	2026/6/26	1.17
14	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3,300,000	2,663.08	87,881,684	2,811.97	92,795,056	3.899	2027/11/16	1.13
15	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,600,000	574.40	89,606,853	587.93	91,717,288	7.25	2021/12/9	1.12
16	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	20,200,000	425.53	85,958,298	450.77	91,055,944	0.95	2030/5/15	1.11
17	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2,900,000	3,046.17	88,338,961	3,028.68	87,831,772	4	2023/10/25	1.07
18	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	19,000,000	451.43	85,771,843	457.28	86,883,935	0.45	2023/10/25	1.06
19	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000	372.31	80,793,210	378.64	82,165,368	3.625	2023/6/16	1.00
20	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	13,500,000	576.67	77,851,443	608.52	82,151,250	8	2023/12/7	1.00
21	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,000,000	349.29	80,338,855	356.14	81,913,757	1.875	2022/6/17	1.00
22	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000	678.53	80,067,278	692.12	81,670,352	8	2030/1/31	0.99
23	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,230,000,000	0.81	75,273,973	0.86	80,190,240	8.375	2024/3/15	0.97
24	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	250,000	2,926.77	73,172,826	3,134.04	78,351,200	10	2029/1/1	0.95

25	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	44,000,000	161.45	71,040,816	177.03	77,896,289	6.5	2024/2/28	0.95
26	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	8,680,000,000	0.81	71,034,509	0.88	76,522,880	8.375	2034/3/15	0.93
27	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000	2,673.43	74,856,250	2,704.15	75,716,445	3.62	2021/11/30	0.92
28	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,150,000,000	0.75	68,650,788	0.81	74,890,920	7	2027/5/15	0.91
29	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,200,000	656.34	73,510,613	653.79	73,224,480	8.5	2037/1/31	0.89
30	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	18,500,000	370.98	68,631,855	395.39	73,148,748	2.875	2028/12/17	0.89

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	97.39
合計	97.39

【投資不動産物件】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

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MSCI - KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 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) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

該当事項はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

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(2020年03月限)	買建	485	日本円	8,319,736,873	8,143,150,000	1.81

（参考）外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリ カ	シカゴ マーカ ンタイ ル取引 所	E-mini S&P500株 価指数先物(2020 年03月限)	買建	453	米ドル	73,529,537.5	8,019,131,356	74,512,837.5	8,126,370,052	1.21
	カナダ	モン トル オー ル取 引所	S&P TSX60株価 指数先物(2020年03 月限)	買建	25	カナダ ドル	5,135,852	424,272,739	5,217,500	431,017,675	0.06

ドイツ	ユーロレックス・ドイツ金融先物取引所	ユーロ50株価指数先物(2020年03月限)	買建	291	ユーロ	10,907,920	1,312,222,776	10,705,890	1,287,918,567	0.19
オーストラリア	シドニー先物取引所	SP1200株価指数先物(2020年03月限)	買建	22	豪ドル	3,751,375	274,938,271	3,816,450	279,707,616	0.04
イギリス	ロンドン国際金融先物オプション取引所	FT100株価指数先物(2020年03月限)	買建	64	英ポンド	4,801,615	686,006,737	4,682,240	668,951,624	0.10
スイス	ユーロレックス・チューリッヒ取引所	SMI株価指数先物(2020年03月限)	買建	33	スイスフラン	3,492,070	392,753,111	3,514,170	395,238,695	0.05

(参考) 新興国株式マザーファンド

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額(円)	評価額	評価額(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	E-mini MSCIエマージングマーケット株価指数先物(2020年03月限)	買建	183	米ドル	10,046,350	1,095,654,935	9,799,650	1,068,749,829	2.53

(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) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

2020年1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 (2016年12月26日)	55	55	1.0544	1.0544
第2計算期間 (2017年12月26日)	87	87	1.1699	1.1699
第3計算期間 (2018年12月26日)	88	88	1.0553	1.0553
第4計算期間 (2019年12月26日)	114	114	1.1863	1.1863
2019年 1月末日	93		1.1024	
2月末日	96		1.1245	
3月末日	98		1.1304	
4月末日	100		1.1422	
5月末日	101		1.1071	
6月末日	105		1.1318	
7月末日	105		1.1394	
8月末日	104		1.1234	
9月末日	107		1.1439	
10月末日	110		1.1657	
11月末日	112		1.1751	
12月末日	115		1.1888	
2020年 1月末日	115		1.1839	

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

2020年1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 (2016年12月26日)	10	10	1.0514	1.0514
第2計算期間 (2017年12月26日)	21	21	1.1664	1.1664
第3計算期間 (2018年12月26日)	27	27	1.0377	1.0377
第4計算期間 (2019年12月26日)	40	40	1.1878	1.1878
2019年 1月末日	29		1.0915	
2月末日	31		1.1170	
3月末日	32		1.1216	
4月末日	34		1.1368	
5月末日	33		1.0935	
6月末日	34		1.1204	
7月末日	35		1.1289	
8月末日	35		1.1051	
9月末日	36		1.1319	
10月末日	38		1.1598	

11月末日	39		1.1723	
12月末日	40		1.1903	
2020年 1月末日	40		1.1813	

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

2020年1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	(2016年12月26日)	7	7	1.0472	1.0472
第2計算期間	(2017年12月26日)	15	15	1.1589	1.1589
第3計算期間	(2018年12月26日)	19	19	1.0320	1.0320
第4計算期間	(2019年12月26日)	28	28	1.1848	1.1848
	2019年 1月末日	20		1.0845	
	2月末日	22		1.1098	
	3月末日	23		1.1143	
	4月末日	23		1.1296	
	5月末日	23		1.0855	
	6月末日	24		1.1126	
	7月末日	25		1.1214	
	8月末日	24		1.0955	
	9月末日	25		1.1239	
	10月末日	27		1.1540	
	11月末日	27		1.1676	
	12月末日	28		1.1873	
	2020年 1月末日	29		1.1764	

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

2020年1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	(2016年12月26日)	6	6	1.0409	1.0409
第2計算期間	(2017年12月26日)	10	10	1.1478	1.1478
第3計算期間	(2018年12月26日)	13	13	1.0248	1.0248
第4計算期間	(2019年12月26日)	18	18	1.1734	1.1734
	2019年 1月末日	14		1.0749	
	2月末日	14		1.0997	
	3月末日	14		1.1042	
	4月末日	15		1.1189	
	5月末日	15		1.0761	

6月末日	15	1.1029
7月末日	16	1.1115
8月末日	16	1.0864
9月末日	16	1.1141
10月末日	17	1.1436
11月末日	18	1.1567
12月末日	18	1.1760
2020年 1月末日	19	1.1656

【分配の推移】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日 ~ 2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日 ~ 2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日 ~ 2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日 ~ 2019年12月26日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日 ~ 2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日 ~ 2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日 ~ 2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日 ~ 2019年12月26日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日 ~ 2016年12月26日	0.0000円
第2計算期間	2016年12月27日 ~ 2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日 ~ 2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日 ~ 2019年12月26日	0.0000円

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2016年 4月 1日 ~ 2016年12月26日	0.0000円

第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	0.0000円
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	0.0000円
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	0.0000円

【収益率の推移】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	5.4%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	11.0%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	9.8%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	12.4%

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。

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	5.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.9%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	11.0%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.5%

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

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.7%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.7%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	11.0%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.8%

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

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

	計算期間	収益率

第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	4.1%
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	10.3%
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	10.7%
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	14.5%

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

(4)【設定及び解約の実績】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	55,225,894	2,600,834	52,625,060
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	24,780,288	2,633,235	74,772,113
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	18,821,572	10,010,450	83,583,235
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	16,232,168	3,027,760	96,787,643

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	9,846,136	172	9,845,964
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	8,525,619	19,110	18,352,473
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	8,382,826	156,480	26,578,819
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	7,806,968	403,555	33,982,232

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2016年 4月 1日～2016年12月26日	6,747,567	22	6,747,545
第2計算期間	2016年12月27日～2017年12月26日	6,892,208	7,296	13,632,457
第3計算期間	2017年12月27日～2018年12月26日	5,291,632	64,250	18,859,839
第4計算期間	2018年12月27日～2019年12月26日	5,443,331	88,292	24,214,878

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数

第1計算期間	2016年 4月 1日 ~ 2016年12月26日	6,671,960	59,305	6,612,655
第2計算期間	2016年12月27日 ~ 2017年12月26日	2,418,017	29,744	9,000,928
第3計算期間	2017年12月27日 ~ 2018年12月26日	4,410,696	625,991	12,785,633
第4計算期間	2018年12月27日 ~ 2019年12月26日	3,370,205	55,192	16,100,646

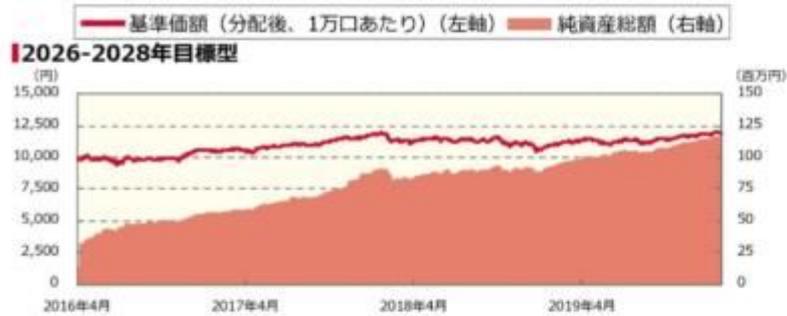
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報



運用実績（2020年1月31日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次：設定来）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2026-2028年目標型

2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
--	--
設定来累計	0 円

2029-2031年目標型

2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
--	--
設定来累計	0 円

2032-2034年目標型

2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
--	--
設定来累計	0 円

2035-2037年目標型

2019年12月	0 円
2018年12月	0 円
2017年12月	0 円
2016年12月	0 円
--	--
設定来累計	0 円

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

	投資比率 (%)			
	野村ターゲットデートファンド2016			
	2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
国内株式マザーファンド	20.9	26.4	28.8	28.0
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	12.4	15.7	17.2	16.7
新興国株式マザーファンド	8.5	10.7	11.8	11.5
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	21.3	15.8	13.4	12.8
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	21.6	16.1	13.5	13.0
外国債券マザーファンド	12.3	12.4	12.4	14.6
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	2.8	2.8	2.9	3.2

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 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.7	0.9	1.0	1.0
2	ソニー	電気機器	0.4	0.5	0.6	0.6
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.3	0.4	0.5	0.4
4	日本電信電話	情報・通信業	0.3	0.4	0.4	0.4
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.3	0.4	0.4	0.4

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.4	0.5	0.6	0.6
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.4	0.5	0.5	0.5
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.2	0.3	0.3	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	0.1	0.2	0.2	0.2
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.1	0.2	0.2	0.2

・「新興国株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	0.5	0.6	0.7	0.7
2	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.4	0.5	0.5	0.5
3	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	0.4	0.4	0.5	0.5
4	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	0.3	0.4	0.4	0.4
5	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	—	0.3	0.4	0.4	0.4

・「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 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	国庫債券 利付（10年）第334回	国債証券	0.2	0.2	0.1	0.1
2	国庫債券 利付（5年）第130回	国債証券	0.2	0.2	0.1	0.1
3	国庫債券 利付（5年）第129回	国債証券	0.2	0.2	0.1	0.1
4	国庫債券 利付（10年）第350回	国債証券	0.2	0.2	0.1	0.1
5	国庫債券 利付（10年）第351回	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1

・「外国債券為替ヘッジ型マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.2	0.1	0.1
2	UK TREASURY	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1
3	US TREASURY BOND	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1
5	US TREASURY BOND	国債証券	0.2	0.1	0.1	0.1

・「外国債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

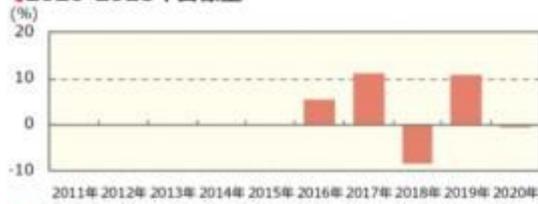
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	US TREASURY BOND	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.2	0.2	0.2	0.2
4	US TREASURY BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.2
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.2

・「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」を通じての投資銘柄

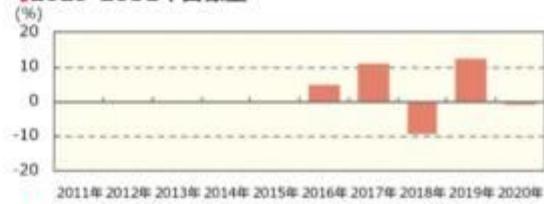
順位	銘柄	種類	投資比率 (%)			
			野村ターゲットデートファンド2016			
			2026-2028年 目標型	2029-2031年 目標型	2032-2034年 目標型	2035-2037年 目標型
1	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
2	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
3	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
4	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1
5	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1	0.1	0.1	0.1

■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)

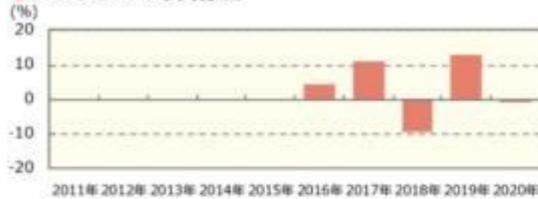
■ 2026-2028年目標型



■ 2029-2031年目標型



■ 2032-2034年目標型



■ 2035-2037年目標型



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドは合成指数をベンチマークとしていますが、毎月基本投資割合を変更するため、暦年ベースで収益率を表示した場合、投資者に誤解を生じさせる懸念があるためベンチマークは掲載しておりません。
- ・2016年は設定日（2016年4月1日）から年末までの収益率。
- ・2020年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

申込日当日またはその翌営業日が以下のいずれかの休業日と同日の場合

- ・ ニューヨーク証券取引所
- ・ ニューヨークの銀行

申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 購入コースには、分配金を受取る「一般コース」と、分配金が再投資される「自動けいぞく投資コース」
があります。販売会社によっては、どちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。また、原
則として、お買付け後のコース変更はできません。
- ・ 販売の単位は、1万口以上1口単位（当初元本1口＝1円）または1万円以上1円単位とします。ただ
し、「自動けいぞく投資コース」を選択した受益者が収益分配金を再投資する場合は1口単位とします。
- ・ スイッチングのお取扱いはありません。

積立方式

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

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

- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 取得申込日から起算して7営業日目までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。なお、販
売会社が別に定める所定の方法により、上記の期日以前に申込代金をお支払いいただく場合があります。
- ・ 金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8
項第3号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」
という場合があります、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項
第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）
等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受
益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

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

2【換金（解約）手続等】

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。
 - ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して7営業日目から販売会社において支払います。
 - ・金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受け付けを中止することおよびすでに受け付けた一部解約の実行の請求の受け付けを取り消す場合があります。
- また、一部解約の実行の請求の受け付けが中止された場合には、受益者は当該受け付け中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受け付けたものとして信託約款の規定に準じて計算された価額とします。

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

3【資産管理等の概要】

（1）【資産の評価】

< 基準価額の計算方法 >

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 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
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】

2026-2028年目標型：2029年3月16日までとします(2016年4月1日設定)。

2029-2031年目標型：2032年3月16日までとします(2016年4月1日設定)。

2032-2034年目標型：2035年3月16日までとします(2016年4月1日設定)。

2035-2037年目標型：2038年3月16日までとします(2016年4月1日設定)。

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

（４）【計算期間】

原則として、毎年12月27日から翌年12月26日までとします。

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

（５）【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

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

(b) 信託期間の終了

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

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

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

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

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

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

(c) 運用報告書

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

(d) 信託約款の変更等

()委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。）を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとし、

()委託者は、上記()の事項（上記()の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当す

る場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

- ()上記()の書面決議において、受益者(委託者およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託者を除きます。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- ()上記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ()書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- ()上記()から()までの規定は、委託者が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- ()上記()から()の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっても、当該併合にかかる一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行なうことはできません。

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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

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

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

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

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

なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

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

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第4期計算期間(2018年12月27日から2019年12月26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】

【野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2018年12月26日現在)	第4期 (2019年12月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	544,972	655,248
親投資信託受益証券	88,111,368	114,701,262
未収入金	17,160	27,748
流動資産合計	88,673,500	115,384,258
資産合計	88,673,500	115,384,258
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	24,555	29,594
未払委託者報酬	441,849	532,604
未払利息	1	-
その他未払費用	1,423	1,724
流動負債合計	467,828	563,922
負債合計	467,828	563,922
純資産の部		
元本等		
元本	83,583,235	96,787,643
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	4,622,437	18,032,693
(分配準備積立金)	10,157,241	11,895,922
元本等合計	88,205,672	114,820,336
純資産合計	88,205,672	114,820,336
負債純資産合計	88,673,500	115,384,258

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2017年12月27日	自	2018年12月27日
	至	2018年12月26日	至	2019年12月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		8,522,196		12,812,646
営業収益合計		8,522,196		12,812,646
営業費用				
支払利息		111		60
受託者報酬		48,023		55,987
委託者報酬		864,181		1,007,619
その他費用		2,770		3,246
営業費用合計		915,085		1,066,912
営業利益又は営業損失()		9,437,281		11,745,734
経常利益又は経常損失()		9,437,281		11,745,734
当期純利益又は当期純損失()		9,437,281		11,745,734
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()		315,268		209,464
期首剰余金又は期首欠損金()		12,706,010		4,622,437
剰余金増加額又は欠損金減少額		2,698,379		2,056,298
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		2,698,379		2,056,298
剰余金減少額又は欠損金増加額		1,659,939		182,312
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		1,659,939		182,312
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		4,622,437		18,032,693

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年12月27日から2019年12月26日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第3期 2018年12月26日現在	第4期 2019年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 83,583,235口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 96,787,643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 1.0553円 (10,000口当たり純資産額) (10,553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 1.1863円 (10,000口当たり純資産額) (11,863円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>956,051円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>4,457,692円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>9,201,190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>14,614,933円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>83,583,235口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>1,748円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	956,051円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	4,457,692円	分配準備積立金額	D	9,201,190円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,614,933円	当ファンドの期末残存口数	F	83,583,235口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,748円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>2,059,551円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>7,125,542円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>9,836,371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>19,021,464円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>96,787,643口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>1,965円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	2,059,551円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	7,125,542円	分配準備積立金額	D	9,836,371円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,021,464円	当ファンドの期末残存口数	F	96,787,643口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,965円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	956,051円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	4,457,692円																																																											
分配準備積立金額	D	9,201,190円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	14,614,933円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	83,583,235口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,748円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	2,059,551円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	7,125,542円																																																											
分配準備積立金額	D	9,836,371円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	19,021,464円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	96,787,643口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,965円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 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。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第3期 2018年12月26日現在	第4期 2019年12月26日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載して おります。 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。	同左
---	----

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般 の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
期首元本額 74,772,113円	期首元本額 83,583,235円
期中追加設定元本額 18,821,572円	期中追加設定元本額 16,232,168円
期中一部解約元本額 10,010,450円	期中一部解約元本額 3,027,760円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26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	8,059,899	11,271,940
合計	8,059,899	11,271,940

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年12月26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12月26日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	14,239,133	24,868,645	
		外国債券マザーファンド	5,891,604	13,831,718	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	4,759,073	14,532,305	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	17,739,054	23,733,080	
		新興国株式マザーファンド	8,085,670	10,791,135	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	2,308,433	3,276,589	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	19,944,207	23,667,790	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	72,967,174	114,701,262 100.0%	
合計			114,701,262		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2018年12月26日現在)	第4期 (2019年12月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	170,279	224,672
親投資信託受益証券	27,554,351	40,321,608
未収入金	-	9,770
流動資産合計	27,724,630	40,556,050
資産合計	27,724,630	40,556,050
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	7,529	10,139
未払委託者報酬	135,413	182,255
その他未払費用	393	563
流動負債合計	143,335	192,957
負債合計	143,335	192,957
純資産の部		
元本等		
元本	26,578,819	33,982,232
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	1,002,476	6,380,861
(分配準備積立金)	2,781,281	3,802,025
元本等合計	27,581,295	40,363,093
純資産合計	27,581,295	40,363,093
負債純資産合計	27,724,630	40,556,050

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2017年12月27日	自	2018年12月27日
	至	2018年12月26日	至	2019年12月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,907,342		4,853,896
営業収益合計		2,907,342		4,853,896
営業費用				
支払利息		1		2
受託者報酬		14,088		18,794
委託者報酬		253,332		337,985
その他費用		733		1,015
営業費用合計		268,154		357,796
営業利益又は営業損失()		3,175,496		4,496,100
経常利益又は経常損失()		3,175,496		4,496,100
当期純利益又は当期純損失()		3,175,496		4,496,100
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()		7,699		21,590
期首剰余金又は期首欠損金()		3,053,825		1,002,476
剰余金増加額又は欠損金減少額		1,141,261		923,179
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		1,141,261		923,179
剰余金減少額又は欠損金増加額		24,813		19,304
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		24,813		19,304
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		1,002,476		6,380,861

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年12月27日から2019年12月26日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第3期 2018年12月26日現在	第4期 2019年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 26,578,819口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 33,982,232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 1.0377円 (10,000口当たり純資産額) (10,377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 1.1878円 (10,000口当たり純資産額) (11,878円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>295,366円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,961,387円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,485,915円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>4,742,668円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>26,578,819口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>1,784円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	295,366円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	1,961,387円	分配準備積立金額	D	2,485,915円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,742,668円	当ファンドの期末残存口数	F	26,578,819口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,784円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>724,758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>330,270円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>3,334,615円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>2,746,997円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>7,136,640円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>33,982,232口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F×10,000</td> <td>2,100円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F×H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	724,758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	330,270円	収益調整金額	C	3,334,615円	分配準備積立金額	D	2,746,997円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,136,640円	当ファンドの期末残存口数	F	33,982,232口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,100円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	295,366円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	1,961,387円																																																											
分配準備積立金額	D	2,485,915円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,742,668円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	26,578,819口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	1,784円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	724,758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	330,270円																																																											
収益調整金額	C	3,334,615円																																																											
分配準備積立金額	D	2,746,997円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	7,136,640円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	33,982,232口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	2,100円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F×H/10,000	0円																																																											

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 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。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第3期 2018年12月26日現在	第4期 2019年12月26日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載して おります。 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。	同左
---	----

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般 の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
期首元本額 18,352,473円	期首元本額 26,578,819円
期中追加設定元本額 8,382,826円	期中追加設定元本額 7,806,968円
期中一部解約元本額 156,480円	期中一部解約元本額 403,555円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,843,448	4,476,773
合計	2,843,448	4,476,773

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年12月26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12月26日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	6,239,999	10,898,158	
		外国債券マザーファンド	2,063,577	4,844,659	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	2,080,291	6,352,376	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	4,615,544	6,175,136	
		新興国株式マザーファンド	3,555,815	4,745,590	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	808,532	1,147,630	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	5,189,230	6,158,059	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	24,552,988	40,321,608 100.0%	
合計			40,321,608		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2018年12月26日現在)	第4期 (2019年12月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	120,179	158,625
親投資信託受益証券	19,443,985	28,659,353
未収入金	-	6,958
流動資産合計	19,564,164	28,824,936
資産合計	19,564,164	28,824,936
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	5,326	7,155
未払委託者報酬	95,781	128,700
その他未払費用	237	380
流動負債合計	101,344	136,235
負債合計	101,344	136,235
純資産の部		
元本等		
元本	18,859,839	24,214,878
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	602,981	4,473,823
(分配準備積立金)	1,882,275	2,683,561
元本等合計	19,462,820	28,688,701
純資産合計	19,462,820	28,688,701
負債純資産合計	19,564,164	28,824,936

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2017年12月27日	自	2018年12月27日
	至	2018年12月26日	至	2019年12月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		2,064,160		3,525,282
営業収益合計		2,064,160		3,525,282
営業費用				
支払利息		-		1
受託者報酬		9,977		13,276
委託者報酬		179,533		238,746
その他費用		449		709
営業費用合計		189,959		252,732
営業利益又は営業損失()		2,254,119		3,272,550
経常利益又は経常損失()		2,254,119		3,272,550
当期純利益又は当期純損失()		2,254,119		3,272,550
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		2,253		5,150
期首剰余金又は期首欠損金()		2,166,835		602,981
剰余金増加額又は欠損金減少額		697,777		607,135
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		697,777		607,135
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,765		3,693
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		9,765		3,693
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		602,981		4,473,823

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年12月27日から2019年12月26日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第3期 2018年12月26日現在	第4期 2019年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 18,859,839口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 24,214,878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 1.0320円 (10,000口当たり純資産額) (10,320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 1.1848円 (10,000口当たり純資産額) (11,848円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>216,686円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,256,568円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,665,589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>3,138,843円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>18,859,839口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>1,664円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	216,686円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	1,256,568円	分配準備積立金額	D	1,665,589円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,138,843円	当ファンドの期末残存口数	F	18,859,839口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,664円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>520,368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>288,052円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>2,165,629円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,875,141円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの分配対象収益額</td> <td>E=A+B+C+D</td> <td>4,849,190円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>24,214,878口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>2,002円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	520,368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	288,052円	収益調整金額	C	2,165,629円	分配準備積立金額	D	1,875,141円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,849,190円	当ファンドの期末残存口数	F	24,214,878口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,002円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	216,686円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	1,256,568円																																																											
分配準備積立金額	D	1,665,589円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,138,843円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	18,859,839口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,664円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	520,368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	288,052円																																																											
収益調整金額	C	2,165,629円																																																											
分配準備積立金額	D	1,875,141円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	4,849,190円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	24,214,878口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	2,002円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 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。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第3期 2018年12月26日現在	第4期 2019年12月26日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載して おります。 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。	同左
---	----

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般 の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
期首元本額 13,632,457円	期首元本額 18,859,839円
期中追加設定元本額 5,291,632円	期中追加設定元本額 5,443,331円
期中一部解約元本額 64,250円	期中一部解約元本額 88,292円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	2,017,768	3,355,496
合計	2,017,768	3,355,496

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年12月26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12月26日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	4,790,839	8,367,200	
		外国債券マザーファンド	1,488,569	3,494,713	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,599,457	4,884,101	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	2,792,777	3,736,456	
		新興国株式マザーファンド	2,724,626	3,636,285	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	573,828	814,491	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	3,139,890	3,726,107	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	17,109,986	28,659,353 100.0%	
合計			28,659,353		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型】

(1) 【貸借対照表】

(単位:円)

	第3期 (2018年12月26日現在)	第4期 (2019年12月26日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	81,276	103,681
親投資信託受益証券	13,089,535	18,873,776
未収入金	-	14,657
流動資産合計	13,170,811	18,992,114
資産合計	13,170,811	18,992,114
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	10,970
未払受託者報酬	3,601	4,679
未払委託者報酬	64,864	84,113
その他未払費用	183	216
流動負債合計	68,648	99,978
負債合計	68,648	99,978
純資産の部		
元本等		
元本	12,785,633	16,100,646
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	316,530	2,791,490
(分配準備積立金)	1,285,216	1,821,641
元本等合計	13,102,163	18,892,136
純資産合計	13,102,163	18,892,136
負債純資産合計	13,170,811	18,992,114

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期		第4期	
	自	2017年12月27日	自	2018年12月27日
	至	2018年12月26日	至	2019年12月26日
営業収益				
有価証券売買等損益		1,343,115		2,290,517
営業収益合計		1,343,115		2,290,517
営業費用				
支払利息		2		1
受託者報酬		6,578		8,669
委託者報酬		118,542		155,831
その他費用		342		415
営業費用合計		125,464		164,916
営業利益又は営業損失()		1,468,579		2,125,601
経常利益又は経常損失()		1,468,579		2,125,601
当期純利益又は当期純損失()		1,468,579		2,125,601
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()		31,094		4,063
期首剰余金又は期首欠損金()		1,330,135		316,530
剰余金増加額又は欠損金減少額		512,313		355,325
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		512,313		355,325
剰余金減少額又は欠損金増加額		88,433		1,903
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		88,433		1,903
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		316,530		2,791,490

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2018年12月27日から2019年12月26日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第3期 2018年12月26日現在	第4期 2019年12月26日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 12,785,633口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 16,100,646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 1.0248円 (10,000口当たり純資産額) (10,248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 1.1734円 (10,000口当たり純資産額) (11,734円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>148,817円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>794,533円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,136,399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>2,079,749円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>12,785,633口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>1,626円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	148,817円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	794,533円	分配準備積立金額	D	1,136,399円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,079,749円	当ファンドの期末残存口数	F	12,785,633口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,626円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円	<table border="1"> <thead> <tr> <th>項目</th> <th></th> <th></th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>費用控除後の配当等収益額</td> <td>A</td> <td>345,372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>195,614円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>1,345,095円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>1,280,655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>3,166,736円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>16,100,646口</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり収益分配対象額</td> <td>G=E/F × 10,000</td> <td>1,966円</td> </tr> <tr> <td>10,000口当たり分配金額</td> <td>H</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益分配金金額</td> <td>I=F × H/10,000</td> <td>0円</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	345,372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	195,614円	収益調整金額	C	1,345,095円	分配準備積立金額	D	1,280,655円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,166,736円	当ファンドの期末残存口数	F	16,100,646口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,966円	10,000口当たり分配金額	H	0円	収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	148,817円																																																											
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																																											
収益調整金額	C	794,533円																																																											
分配準備積立金額	D	1,136,399円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	2,079,749円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	12,785,633口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,626円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × H/10,000	0円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	345,372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	195,614円																																																											
収益調整金額	C	1,345,095円																																																											
分配準備積立金額	D	1,280,655円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	3,166,736円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	16,100,646口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F × 10,000	1,966円																																																											
10,000口当たり分配金額	H	0円																																																											
収益分配金金額	I=F × 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

<p style="text-align: center;">第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日</p>	<p style="text-align: center;">第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日</p>
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。 これらは、株価変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 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。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制 同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

<p style="text-align: center;">第3期 2018年12月26日現在</p>	<p style="text-align: center;">第4期 2019年12月26日現在</p>
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法</p>	<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 同左</p> <p>2.時価の算定方法</p>

親投資信託受益証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載して おります。 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。	同左
---	----

（関連当事者との取引に関する注記）

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般 の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
期首元本額 9,000,928円	期首元本額 12,785,633円
期中追加設定元本額 4,410,696円	期中追加設定元本額 3,370,205円
期中一部解約元本額 625,991円	期中一部解約元本額 55,192円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第3期 自 2017年12月27日 至 2018年12月26日	第4期 自 2018年12月27日 至 2019年12月26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	1,289,480	2,184,772
合計	1,289,480	2,184,772

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年12月26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12月26日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	3,068,813	5,359,681	
		外国債券マザーファンド	1,154,422	2,710,236	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	1,028,572	3,140,847	
		国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	1,756,523	2,350,052	
		新興国株式マザーファンド	1,750,490	2,336,203	
		新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	445,717	632,650	
		外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1,975,316	2,344,107	
	小計	銘柄数:7 組入時価比率:99.9%	11,179,853	18,873,776	100.0%
合計			18,873,776		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

「野村ターゲットデートファンド2016」の各ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「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」、「外国債券マザーファンド」および「新興国債券(現地通貨建て)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12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	16,681,993,229
株式	453,292,571,690
派生商品評価勘定	43,850,042
未収入金	9,803,516

(2019年12月26日現在)

未収配当金	31,438,300
未収利息	1,013,626
その他未収収益	10,840,521
差入委託証拠金	144,054,998
流動資産合計	470,215,565,922
資産合計	470,215,565,922
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,203,960
未払解約金	694,030,753
未払利息	24,593
有価証券貸借取引受入金	10,752,744,854
流動負債合計	11,448,004,160
負債合計	11,448,004,160
純資産の部	
元本等	
元本	262,681,989,592
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	196,085,572,170
元本等合計	458,767,561,762
純資産合計	458,767,561,762
負債純資産合計	470,215,565,922

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。 先物取引 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。 有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 派生商品取引等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等による場合、当該価額が異なることもあります。 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12月26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	1.7465円
(10,000口当たり純資産額)	(17,465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	
	10,222,520,620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12月27日 至 2019年12月26日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年12月26日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2. 時価の算定方法</p> <p> 株式</p> <p> (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p> 派生商品評価勘定</p> <p> デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p> コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p> これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており</p> <p>ます。</p>

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年12月26日現在		2018年12月27日
期首		2018年12月27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		243,944,785,614円
同期中における追加設定元本額		61,213,124,201円
同期中における一部解約元本額		42,475,920,223円
期末元本額		262,681,989,592円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		159,439,605円
バランスセレクト50		374,256,438円
バランスセレクト70		474,590,915円
野村世界6資産分散投信（安定コース）		2,548,463,708円
野村世界6資産分散投信（分配コース）		3,469,012,185円
野村世界6資産分散投信（成長コース）		7,704,155,883円
野村資産設計ファンド2015		48,089,059円
野村資産設計ファンド2020		54,113,071円
野村資産設計ファンド2025		87,730,042円
野村資産設計ファンド2030		104,080,456円
野村資産設計ファンド2035		81,989,356円
野村資産設計ファンド2040		180,691,582円
野村日本株インデックス（野村投資一任口座向け）		89,851,125,510円
のむらっぴ・ファンド（保守型）		2,634,154,684円
のむらっぴ・ファンド（普通型）		7,755,817,255円
のむらっぴ・ファンド（積極型）		2,038,366,580円
野村資産設計ファンド2045		26,512,574円
野村インデックスファンド・TOPIX		1,567,968,844円
マイ・ロード		3,507,526,729円
ネクストコア		43,203,016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		1,290,142,046円
野村日本株インデックス（野村SMA・EW向け）		3,169,675,263円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）		1,625,172,511円
野村資産設計ファンド2050		45,274,109円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		14,239,133円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		6,239,999円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		4,790,839円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		3,068,813円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）		309,338,327円
のむらっぴ・ファンド（やや積極型）		253,203,196円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		4,180,276円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		3,763,377円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		17,361,413円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		4,719,601円
インデックス・ブレンド（タイプ ）		21,601,509円
野村6資産均等バランス		895,953,191円
世界6資産分散ファンド		124,502,995円

野村資産設計ファンド2060	4,706,974円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	510,908,336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)	422,676,261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)	328,970,903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)	667,688,383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)	751,048,457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)	4,299,221円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	9,911,927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)	2,483,472円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,196,331,222円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	15,929,870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)	135,231,006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)	91,831,355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)	33,417,539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)	101,853,562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)	266,468,504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)	4,614,461,165円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	75,189,478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)	514,664,678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)	2,610,617,542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)	872,796,891円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	6,631,447円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	30,340,374円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	38,107,969円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	117,517,032円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	9,577,372,248円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	23,966,573,165円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	26,375,726,130円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	31,571,402,067円
マイバランスDC30	3,223,621,766円
マイバランスDC50	4,740,685,649円
マイバランスDC70	4,533,888,028円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	9,817,609,644円
野村DC運用戦略ファンド	636,976,890円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	44,557,662円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	763,428,463円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	544,083,211円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	411,801,364円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	5,177,899円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	2,759,682円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	34,905,708円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	6,559,460円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	4,448,082円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	5,297,206円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	208,981,916円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	149,003,507円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	61,037,037円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	66,784,470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12月26日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	8,800	2,839.00	24,983,200	
		日本水産	251,900	654.00	164,742,600	
		マルハニチロ	36,400	2,801.00	101,956,400	
		カネコ種苗	7,600	1,491.00	11,331,600	
		サカタのタネ	30,000	3,670.00	110,100,000	貸付有価証券 100株
		ホクト	19,200	1,997.00	38,342,400	貸付有価証券 700株
		ホクリヨウ	3,900	689.00	2,687,100	
		住石ホールディングス	50,900	154.00	7,838,600	
		日鉄鉱業	5,800	5,080.00	29,464,000	
		三井松島ホールディングス	9,800	1,208.00	11,838,400	
		国際石油開発帝石	1,010,800	1,149.50	1,161,914,600	
		石油資源開発	32,900	3,035.00	99,851,500	貸付有価証券 1,200株
		K&Oエナジーグループ	12,200	1,609.00	19,629,800	
		ヒノキヤグループ	6,300	2,248.00	14,162,400	
		ショーボンドホールディングス	36,000	4,620.00	166,320,000	
		ミライト・ホールディングス	74,900	1,660.00	124,334,000	貸付有価証券 14,500株(2,100株)
		タマホーム	12,100	1,678.00	20,303,800	貸付有価証券 4,600株(2,300株)
		サンヨーホームズ	2,200	677.00	1,489,400	
日本アクア	10,000	651.00	6,510,000	貸付有価証券 2,400株		

ファーストコーポレーション	7,700	594.00	4,573,800	貸付有価証券 100株
ベステラ	4,300	1,240.00	5,332,000	貸付有価証券 2,000株
T A T E R U	51,900	215.00	11,158,500	貸付有価証券 18,600株(10,900株)
スペースバリューホールディングス	30,700	526.00	16,148,200	
ダイセキ環境ソリューション	4,800	1,035.00	4,968,000	
第一カッター興業	3,100	1,775.00	5,502,500	
安藤・間	150,000	952.00	142,800,000	
東急建設	73,800	781.00	57,637,800	
コムシスホールディングス	89,300	3,170.00	283,081,000	
ミサワホーム	17,400	1,194.00	20,775,600	
ピーアールホールディングス	27,400	490.00	13,426,000	
高松コンストラクショングループ	15,700	2,844.00	44,650,800	
東建コーポレーション	7,800	7,460.00	58,188,000	貸付有価証券 100株
ソネック	2,600	846.00	2,199,600	
ヤマウラ	10,900	904.00	9,853,600	
大成建設	194,000	4,585.00	889,490,000	
大林組	581,800	1,238.00	720,268,400	貸付有価証券 300株
清水建設	590,400	1,130.00	667,152,000	貸付有価証券 2,600株
飛島建設	16,700	1,488.00	24,849,600	
長谷工コーポレーション	225,200	1,478.00	332,845,600	貸付有価証券 3,800株
松井建設	22,900	820.00	18,778,000	
銭高組	2,500	4,060.00	10,150,000	
鹿島建設	456,800	1,474.00	673,323,200	
不動テトラ	15,200	1,683.00	25,581,600	
大末建設	6,700	1,003.00	6,720,100	
鉄建建設	12,600	2,832.00	35,683,200	
西松建設	44,800	2,480.00	111,104,000	貸付有価証券 500株

三井住友建設	140,600	634.00	89,140,400	
大豊建設	13,100	2,897.00	37,950,700	
前田建設工業	145,700	1,064.00	155,024,800	貸付有価証券 2,900株
佐田建設	12,500	479.00	5,987,500	
ナカノフード建設	15,900	472.00	7,504,800	
奥村組	31,600	2,989.00	94,452,400	
東鉄工業	25,000	3,230.00	80,750,000	
イチケン	4,200	1,798.00	7,551,600	
富士ピー・エス	8,600	601.00	5,168,600	
浅沼組	6,500	4,665.00	30,322,500	
戸田建設	241,600	729.00	176,126,400	貸付有価証券 4,400株
熊谷組	27,000	3,290.00	88,830,000	
北野建設	3,500	2,641.00	9,243,500	
植木組	2,600	2,570.00	6,682,000	
矢作建設工業	25,700	844.00	21,690,800	
ピーエス三菱	19,100	727.00	13,885,700	
日本ハウスホールディングス	39,700	494.00	19,611,800	貸付有価証券 6,000株
大東建託	69,700	13,540.00	943,738,000	貸付有価証券 400株
新日本建設	24,700	955.00	23,588,500	
N I P P O	48,100	2,345.00	112,794,500	
東亜道路工業	3,600	3,610.00	12,996,000	
前田道路	61,600	2,698.00	166,196,800	
日本道路	5,600	6,990.00	39,144,000	
東亜建設工業	18,100	1,645.00	29,774,500	貸付有価証券 8,500株(1,100株)
日本国土開発	34,000	660.00	22,440,000	貸付有価証券 17,000株
若築建設	10,500	1,745.00	18,322,500	
東洋建設	65,200	526.00	34,295,200	貸付有価証券 200株
五洋建設	230,600	682.00	157,269,200	貸付有価証券 600株
世紀東急工業	27,900	908.00	25,333,200	
福田組	6,700	4,995.00	33,466,500	貸付有価証券 3,100株

住友林業	147,400	1,612.00	237,608,800	貸付有価証券 4,500株
日本基礎技術	19,500	404.00	7,878,000	
巴コーポレーション	25,800	457.00	11,790,600	貸付有価証券 3,100株
大和ハウス工業	575,600	3,401.00	1,957,615,600	
ライト工業	33,300	1,581.00	52,647,300	貸付有価証券 1,000株
積水ハウス	636,500	2,351.50	1,496,729,750	貸付有価証券 3,300株
日特建設	15,200	853.00	12,965,600	
北陸電気工事	10,100	1,091.00	11,019,100	
ユアテック	33,300	692.00	23,043,600	
四電工	3,200	2,888.00	9,241,600	
中電工	23,400	2,567.00	60,067,800	
関電工	82,800	1,058.00	87,602,400	貸付有価証券 800株
きんでん	138,200	1,721.00	237,842,200	貸付有価証券 300株
東京エネシス	19,300	925.00	17,852,500	
トーエネック	5,800	3,885.00	22,533,000	
住友電設	16,400	2,919.00	47,871,600	
日本電設工業	31,900	2,301.00	73,401,900	
協和エクシオ	88,200	2,806.00	247,489,200	
新日本空調	15,400	2,183.00	33,618,200	
九電工	40,800	3,295.00	134,436,000	
三機工業	41,900	1,534.00	64,274,600	
日揮ホールディングス	179,100	1,747.00	312,887,700	貸付有価証券 5,800株
中外炉工業	6,300	1,827.00	11,510,100	
ヤマト	18,600	778.00	14,470,800	
太平電業	14,100	2,333.00	32,895,300	
高砂熱学工業	50,500	1,966.00	99,283,000	貸付有価証券 200株
三晃金属工業	2,500	2,620.00	6,550,000	
朝日工業社	3,900	3,510.00	13,689,000	
明星工業	37,600	974.00	36,622,400	
大気社	28,300	3,940.00	111,502,000	

ダイダン	13,900	2,830.00	39,337,000	
日比谷総合設備	18,700	2,014.00	37,661,800	
東芝プラントシステム	45,000	2,671.00	120,195,000	貸付有価証券 7,100株（200株）
OSJBホールディングス	91,700	266.00	24,392,200	
レイズネクスト	31,200	1,349.00	42,088,800	
日本製粉	54,500	1,707.00	93,031,500	
日清製粉グループ本社	210,400	1,954.00	411,121,600	
日東富士製粉	1,400	6,300.00	8,820,000	
昭和産業	17,100	3,200.00	54,720,000	貸付有価証券 2,900株
鳥越製粉	16,500	905.00	14,932,500	貸付有価証券 7,700株
中部飼料	22,700	1,635.00	37,114,500	
フィード・ワン	125,100	183.00	22,893,300	
東洋精糖	3,100	1,174.00	3,639,400	
日本甜菜製糖	9,700	2,039.00	19,778,300	
三井製糖	16,300	2,299.00	37,473,700	
塩水港精糖	20,200	219.00	4,423,800	
日新製糖	8,800	2,043.00	17,978,400	
森永製菓	43,700	5,350.00	233,795,000	貸付有価証券 900株
中村屋	4,800	4,325.00	20,760,000	
江崎グリコ	55,200	5,030.00	277,656,000	
名糖産業	9,000	1,329.00	11,961,000	
井村屋グループ	7,900	1,955.00	15,444,500	
不二家	10,400	2,192.00	22,796,800	貸付有価証券 5,700株
山崎製パン	139,600	1,976.00	275,849,600	貸付有価証券 7,000株
第一屋製パン	3,200	997.00	3,190,400	貸付有価証券 1,500株
モロゾフ	3,200	5,140.00	16,448,000	
亀田製菓	10,600	5,040.00	53,424,000	
寿スピリッツ	17,900	8,170.00	146,243,000	
カルビー	84,900	3,605.00	306,064,500	貸付有価証券 2,000株
森永乳業	34,400	4,450.00	153,080,000	

六甲バター	12,400	1,774.00	21,997,600	貸付有価証券 100株
ヤクルト本社	128,100	6,080.00	778,848,000	
明治ホールディングス	123,100	7,480.00	920,788,000	貸付有価証券 300株
雪印メグミルク	44,800	2,529.00	113,299,200	
プリマハム	29,100	2,557.00	74,408,700	
日本ハム	71,200	4,570.00	325,384,000	貸付有価証券 100株
林兼産業	6,200	714.00	4,426,800	
丸大食品	19,800	2,318.00	45,896,400	
S Foods	14,900	2,870.00	42,763,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	119,900	710.00	85,129,000	
サッポロホールディングス	63,500	2,674.00	169,799,000	貸付有価証券 4,500株
アサヒグループホールディングス	390,000	5,080.00	1,981,200,000	
キリンホールディングス	789,700	2,458.00	1,941,082,600	
宝ホールディングス	139,400	1,029.00	143,442,600	貸付有価証券 300株
オエノンホールディングス	49,100	401.00	19,689,100	
養命酒製造	5,700	1,981.00	11,291,700	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	130,700	2,843.00	371,580,100	貸付有価証券 2,400株
サントリー食品インターナショナル	124,600	4,610.00	574,406,000	
ダイドーグループホールディングス	9,500	4,640.00	44,080,000	貸付有価証券 4,700株
伊藤園	56,500	5,560.00	314,140,000	貸付有価証券 2,500株
キーコーヒー	18,300	2,334.00	42,712,200	
ユニカフェ	4,800	1,030.00	4,944,000	貸付有価証券 2,200株
ジャパンフーズ	2,600	1,277.00	3,320,200	
日清オイリオグループ	24,000	3,845.00	92,280,000	
不二製油グループ本社	45,400	2,977.00	135,155,800	
かどや製油	2,000	3,795.00	7,590,000	
J - オイルミルズ	9,700	4,410.00	42,777,000	

キッコーマン	134,000	5,500.00	737,000,000	貸付有価証券 400株
味の素	411,200	1,841.50	757,224,800	
キューピー	103,700	2,478.00	256,968,600	
ハウス食品グループ本社	69,600	3,800.00	264,480,000	貸付有価証券 800株
カゴメ	70,700	2,681.00	189,546,700	貸付有価証券 1,900株
焼津水産化学工業	9,000	1,040.00	9,360,000	
アリアケジャパン	17,000	8,120.00	138,040,000	貸付有価証券 100株
ピエトロ	2,400	1,638.00	3,931,200	
エバラ食品工業	4,500	2,220.00	9,990,000	
やまみ	900	2,336.00	2,102,400	
ニチレイ	88,700	2,567.00	227,692,900	
東洋水産	95,800	4,700.00	450,260,000	
イトアンド	6,400	1,784.00	11,417,600	
大冷	2,400	1,967.00	4,720,800	
ヨシムラ・フード・ホールディングス	10,200	1,196.00	12,199,200	貸付有価証券 700株（100株）
日清食品ホールディングス	79,100	8,190.00	647,829,000	貸付有価証券 200株
永谷園ホールディングス	9,100	2,208.00	20,092,800	
一正蒲鉾	7,200	1,005.00	7,236,000	
フジッコ	20,200	1,953.00	39,450,600	
ロック・フィールド	20,100	1,536.00	30,873,600	貸付有価証券 2,300株
日本たばこ産業	1,075,200	2,538.00	2,728,857,600	
ケンコーマヨネーズ	10,400	2,544.00	26,457,600	貸付有価証券 500株
わらべや日洋ホールディングス	12,200	1,746.00	21,301,200	貸付有価証券 100株
なとり	10,400	1,704.00	17,721,600	
イフジ産業	3,200	782.00	2,502,400	
ピクルスコーポレーション	4,100	2,771.00	11,361,100	
北の達人コーポレーション	65,000	714.00	46,410,000	貸付有価証券 17,000株（1,700株）
ユーグレナ	79,400	774.00	61,455,600	貸付有価証券

				5,700株
ミヨシ油脂	7,100	1,319.00	9,364,900	
理研ビタミン	8,800	4,190.00	36,872,000	
片倉工業	26,400	1,371.00	36,194,400	貸付有価証券 12,300株
グンゼ	13,300	4,890.00	65,037,000	
東洋紡	71,800	1,625.00	116,675,000	貸付有価証券 100株
ユニチカ	53,200	381.00	20,269,200	
富士紡ホールディングス	8,800	3,545.00	31,196,000	
倉敷紡績	18,700	2,558.00	47,834,600	
シキボウ	9,500	1,017.00	9,661,500	
日本毛織	59,800	1,145.00	68,471,000	貸付有価証券 700株
ダイトウボウ	29,400	85.00	2,499,000	貸付有価証券 500株
トーア紡コーポレーション	7,200	579.00	4,168,800	
ダイドーリミテッド	23,900	276.00	6,596,400	貸付有価証券 100株
帝国繊維	20,400	2,129.00	43,431,600	貸付有価証券 9,700株
帝人	148,200	2,063.00	305,736,600	貸付有価証券 1,500株
東レ	1,315,600	751.50	988,673,400	貸付有価証券 4,100株
サカイオーベックス	4,800	1,880.00	9,024,000	
住江織物	5,300	2,902.00	15,380,600	
日本フェルト	10,300	492.00	5,067,600	
イチカワ	2,600	1,541.00	4,006,600	
日東製網	2,100	1,699.00	3,567,900	
アツギ	15,000	852.00	12,780,000	
ダイニック	6,900	804.00	5,547,600	
セーレン	44,700	1,578.00	70,536,600	
ソトー	7,200	975.00	7,020,000	
東海染工	2,500	1,134.00	2,835,000	
小松マテーレ	29,800	818.00	24,376,400	
ワコールホールディングス	47,400	2,952.00	139,924,800	

ホギメディカル	20,700	3,635.00	75,244,500	
レナウン	46,700	113.00	5,277,100	貸付有価証券 2,400株
クラウドシアホールディングス	4,500	485.00	2,182,500	
T S Iホールディングス	60,900	556.00	33,860,400	
マツオカコーポレーション	5,200	2,510.00	13,052,000	
ワールド	25,800	2,650.00	68,370,000	貸付有価証券 1,200株
三陽商会	9,500	1,381.00	13,119,500	
ナイガイ	6,600	474.00	3,128,400	貸付有価証券 500株
オンワードホールディングス	109,200	649.00	70,870,800	
ルックホールディングス	6,200	1,217.00	7,545,400	貸付有価証券 2,900株
ゴールドウイン	32,900	8,070.00	265,503,000	貸付有価証券 17,100株（17,100株）
デサント	35,400	2,058.00	72,853,200	
キング	8,600	528.00	4,540,800	
ヤマトインターナショナル	11,000	409.00	4,499,000	
特種東海製紙	11,500	4,105.00	47,207,500	
王子ホールディングス	759,600	596.00	452,721,600	貸付有価証券 10,600株
日本製紙	80,400	1,828.00	146,971,200	貸付有価証券 23,600株
三菱製紙	20,600	489.00	10,073,400	
北越コーポレーション	120,500	563.00	67,841,500	
中越パルプ工業	7,700	1,664.00	12,812,800	
巴川製紙所	5,400	864.00	4,665,600	
大王製紙	79,700	1,482.00	118,115,400	貸付有価証券 38,200株（27,800株）
阿波製紙	4,700	574.00	2,697,800	
レンゴー	171,700	825.00	141,652,500	貸付有価証券 11,900株
トーモク	11,100	1,882.00	20,890,200	
ザ・パック	13,800	4,030.00	55,614,000	貸付有価証券 800株

クラレ	286,200	1,366.00	390,949,200	貸付有価証券 5,300株
旭化成	1,204,400	1,246.50	1,501,284,600	
共和レザー	9,900	811.00	8,028,900	
昭和電工	129,400	3,025.00	391,435,000	貸付有価証券 60,800株
住友化学	1,335,000	504.00	672,840,000	貸付有価証券 1,100株
住友精化	8,000	3,550.00	28,400,000	
日産化学	101,600	4,730.00	480,568,000	貸付有価証券 1,500株
ラサ工業	6,400	1,554.00	9,945,600	
クレハ	15,600	6,590.00	102,804,000	貸付有価証券 200株
多木化学	5,300	4,715.00	24,989,500	貸付有価証券 2,400株
テイカ	13,300	1,953.00	25,974,900	
石原産業	32,600	1,054.00	34,360,400	
片倉コープアグリ	4,700	1,208.00	5,677,600	
日本曹達	26,900	3,025.00	81,372,500	
東ソー	280,900	1,722.00	483,709,800	
トクヤマ	52,400	2,873.00	150,545,200	貸付有価証券 400株
セントラル硝子	37,100	2,722.00	100,986,200	
東亜合成	114,000	1,329.00	151,506,000	
大阪ソーダ	18,500	3,170.00	58,645,000	貸付有価証券 900株
関東電化工業	43,100	1,015.00	43,746,500	貸付有価証券 1,500株
デンカ	66,300	3,305.00	219,121,500	
信越化学工業	312,000	12,175.00	3,798,600,000	貸付有価証券 500株
日本カーバイド工業	6,100	1,476.00	9,003,600	
堺化学工業	11,800	2,562.00	30,231,600	
第一稀元素化学工業	19,700	880.00	17,336,000	
エア・ウォーター	169,000	1,618.00	273,442,000	
大陽日酸	174,600	2,445.00	426,897,000	貸付有価証券 1,900株
日本化学工業	5,700	3,205.00	18,268,500	貸付有価証券

				600株
東邦アセチレン	2,700	1,313.00	3,545,100	
日本パーカラライジング	91,700	1,180.00	108,206,000	
高圧ガス工業	28,800	881.00	25,372,800	
チタン工業	2,300	2,701.00	6,212,300	貸付有価証券 1,000株
四国化成工業	28,000	1,390.00	38,920,000	
戸田工業	4,200	2,115.00	8,883,000	貸付有価証券 1,300株
ステラ ケミファ	9,900	3,190.00	31,581,000	貸付有価証券 700株
保土谷化学工業	6,800	4,050.00	27,540,000	
日本触媒	28,200	6,760.00	190,632,000	貸付有価証券 4,100株
大日精化工業	16,100	3,225.00	51,922,500	
カネカ	47,000	3,560.00	167,320,000	貸付有価証券 100株
三菱瓦斯化学	171,500	1,676.00	287,434,000	
三井化学	165,000	2,720.00	448,800,000	貸付有価証券 400株
J S R	169,300	2,040.00	345,372,000	貸付有価証券 14,000株
東京応化工業	31,200	4,380.00	136,656,000	
大阪有機化学工業	16,800	1,597.00	26,829,600	貸付有価証券 200株
三菱ケミカルホールディングス	1,214,700	821.80	998,240,460	貸付有価証券 7,500株
K Hネオケム	32,000	2,370.00	75,840,000	
ダイセル	248,600	1,055.00	262,273,000	
住友ベークライト	28,600	4,145.00	118,547,000	
積水化学工業	390,700	1,918.00	749,362,600	
日本ゼオン	163,900	1,374.00	225,198,600	
アイカ工業	54,500	3,620.00	197,290,000	貸付有価証券 200株
宇部興産	91,800	2,390.00	219,402,000	
積水樹脂	32,700	2,318.00	75,798,600	
タキロンシーアイ	39,300	740.00	29,082,000	
旭有機材	10,300	1,779.00	18,323,700	
日立化成	84,000	4,580.00	384,720,000	貸付有価証券

				7,500株(7,500株)
ニチバン	9,600	1,881.00	18,057,600	
リケンテクノス	45,700	536.00	24,495,200	
大倉工業	8,600	1,994.00	17,148,400	
積水化成成品工業	24,400	827.00	20,178,800	
群栄化学工業	4,100	2,589.00	10,614,900	
タイガースポリマー	9,600	610.00	5,856,000	
ミライアル	6,400	1,428.00	9,139,200	
ダイキアクシス	6,400	1,009.00	6,457,600	貸付有価証券 3,000株
ダイキョーニシカワ	38,300	839.00	32,133,700	
竹本容器	6,500	999.00	6,493,500	貸付有価証券 3,000株
森六ホールディングス	9,800	2,353.00	23,059,400	
日本化薬	112,500	1,370.00	154,125,000	
カーリットホールディングス	19,400	622.00	12,066,800	
日本精化	14,600	1,277.00	18,644,200	
扶桑化学工業	18,400	3,080.00	56,672,000	
トリケミカル研究所	4,000	8,600.00	34,400,000	貸付有価証券 1,800株(300株)
A D E K A	83,600	1,667.00	139,361,200	
日油	68,400	3,705.00	253,422,000	
新日本理化	30,100	205.00	6,170,500	
ハリマ化成グループ	15,000	1,213.00	18,195,000	
花王	444,200	9,148.00	4,063,541,600	
第一工業製薬	6,800	4,485.00	30,498,000	貸付有価証券 800株
石原ケミカル	4,900	2,070.00	10,143,000	
日華化学	6,100	964.00	5,880,400	貸付有価証券 2,900株
ニイタカ	2,800	1,864.00	5,219,200	貸付有価証券 100株
三洋化成工業	10,800	5,410.00	58,428,000	
有機合成薬品工業	13,900	297.00	4,128,300	
大日本塗料	20,500	1,218.00	24,969,000	
日本ペイントホールディングス	149,900	5,560.00	833,444,000	貸付有価証券 17,900株
関西ペイント	204,100	2,680.00	546,988,000	貸付有価証券

				16,900株
神東塗料	14,300	208.00	2,974,400	
中国塗料	51,700	1,057.00	54,646,900	
日本特殊塗料	13,600	1,553.00	21,120,800	
藤倉化成	24,500	581.00	14,234,500	
太陽ホールディングス	13,300	4,435.00	58,985,500	
D I C	76,700	3,080.00	236,236,000	
サカタインクス	39,700	1,203.00	47,759,100	
東洋インキ S C ホールディングス	38,400	2,729.00	104,793,600	
T & K T O K A	14,100	1,012.00	14,269,200	
富士フイルムホールディングス	355,700	5,231.00	1,860,666,700	貸付有価証券 500株
資生堂	368,600	7,837.00	2,888,718,200	貸付有価証券 5,500株
ライオン	241,200	2,157.00	520,268,400	貸付有価証券 700株
高砂香料工業	11,600	2,600.00	30,160,000	
マンダム	41,700	3,010.00	125,517,000	
ミルボン	24,800	6,330.00	156,984,000	
ファンケル	75,100	2,951.00	221,620,100	貸付有価証券 18,700株
コーセー	34,900	16,090.00	561,541,000	貸付有価証券 15,100株
コタ	9,700	1,532.00	14,860,400	
シーボン	2,400	2,496.00	5,990,400	
ポーラ・オルビスホールディングス	79,200	2,687.00	212,810,400	貸付有価証券 1,200株
ノエビアホールディングス	17,700	5,960.00	105,492,000	
アジュバンコスメジャパン	4,100	953.00	3,907,300	
エステー	11,900	1,722.00	20,491,800	
アグロ カネショウ	5,800	1,586.00	9,198,800	貸付有価証券 2,700株
コニシ	30,500	1,559.00	47,549,500	
長谷川香料	24,600	2,145.00	52,767,000	
星光 P M C	10,600	996.00	10,557,600	
小林製薬	52,000	9,360.00	486,720,000	貸付有価証券

				100株
荒川化学工業	16,700	1,691.00	28,239,700	
メック	12,700	1,545.00	19,621,500	貸付有価証券 5,900株
日本高純度化学	5,100	2,659.00	13,560,900	
タカラバイオ	48,600	2,075.00	100,845,000	貸付有価証券 800株
J C U	22,500	3,200.00	72,000,000	
新田ゼラチン	11,600	674.00	7,818,400	
O A T アグリオ	3,200	1,681.00	5,379,200	貸付有価証券 1,500株
デクセリアルズ	47,800	1,071.00	51,193,800	
アース製薬	14,000	5,730.00	80,220,000	
北興化学工業	19,000	587.00	11,153,000	
大成ラミック	6,100	2,938.00	17,921,800	
クミアイ化学工業	76,700	998.00	76,546,600	貸付有価証券 1,100株
日本農薬	33,000	578.00	19,074,000	
アキレス	12,800	1,839.00	23,539,200	
有沢製作所	29,300	1,006.00	29,475,800	
日東電工	128,000	6,310.00	807,680,000	
レック	19,800	1,334.00	26,413,200	貸付有価証券 100株
三光合成	21,200	417.00	8,840,400	
きもと	31,500	173.00	5,449,500	
藤森工業	16,600	3,485.00	57,851,000	
前澤化成工業	11,800	1,213.00	14,313,400	
未来工業	10,000	2,148.00	21,480,000	
ウェーブロックホールディングス	6,400	819.00	5,241,600	貸付有価証券 800株
J S P	10,900	1,939.00	21,135,100	
エフピコ	20,400	6,560.00	133,824,000	
天馬	12,400	2,025.00	25,110,000	
信越ポリマー	33,300	1,071.00	35,664,300	
東リ	46,200	326.00	15,061,200	
ニフコ	68,100	3,000.00	204,300,000	貸付有価証券 24,800株
バルカー	15,100	2,640.00	39,864,000	

ユニ・チャーム	357,600	3,691.00	1,319,901,600	
ショーエイコーポレーション	2,100	745.00	1,564,500	
協和キリン	186,600	2,553.00	476,389,800	貸付有価証券 1,100株
武田薬品工業	1,543,600	4,338.00	6,696,136,800	貸付有価証券 4,400株
アステラス製薬	1,632,000	1,871.00	3,053,472,000	貸付有価証券 1,200株
大日本住友製薬	137,500	2,153.00	296,037,500	
塩野義製薬	237,200	6,765.00	1,604,658,000	貸付有価証券 100株
田辺三菱製薬	226,400	2,008.00	454,611,200	貸付有価証券 17,700株(3,500株)
わかもと製薬	22,100	275.00	6,077,500	貸付有価証券 100株
あすか製薬	21,100	1,249.00	26,353,900	
日本新薬	48,600	9,420.00	457,812,000	
ピオフェルミン製薬	3,200	2,399.00	7,676,800	
中外製薬	193,400	10,160.00	1,964,944,000	
科研製薬	31,800	6,080.00	193,344,000	
エーザイ	222,100	8,374.00	1,859,865,400	
ロート製薬	95,200	3,340.00	317,968,000	貸付有価証券 1,300株
小野薬品工業	426,100	2,490.00	1,060,989,000	
久光製薬	54,800	5,410.00	296,468,000	貸付有価証券 400株
持田製薬	25,700	4,435.00	113,979,500	
参天製薬	345,500	2,115.00	730,732,500	貸付有価証券 300株
扶桑薬品工業	6,500	2,050.00	13,325,000	
日本ケミファ	2,500	2,885.00	7,212,500	
ツムラ	57,500	3,245.00	186,587,500	
日医工	52,500	1,360.00	71,400,000	
キッセイ薬品工業	32,800	3,155.00	103,484,000	
生化学工業	36,000	1,242.00	44,712,000	
栄研化学	32,600	2,039.00	66,471,400	
日水製薬	7,800	1,284.00	10,015,200	
鳥居薬品	11,600	2,991.00	34,695,600	貸付有価証券

				100株
J C R ファーマ	13,100	8,660.00	113,446,000	貸付有価証券 200株
東和薬品	23,700	2,946.00	69,820,200	貸付有価証券 4,200株
富士製薬工業	12,600	1,340.00	16,884,000	
沢井製薬	38,100	6,970.00	265,557,000	貸付有価証券 300株
ゼリア新薬工業	33,700	2,119.00	71,410,300	
第一三共	530,900	7,367.00	3,911,140,300	
キョーリン製薬ホールディングス	40,900	1,926.00	78,773,400	
大幸薬品	7,500	3,190.00	23,925,000	
ダイト	10,900	3,190.00	34,771,000	
大塚ホールディングス	353,400	5,006.00	1,769,120,400	貸付有価証券 500株
大正製薬ホールディングス	39,200	8,240.00	323,008,000	
ペプチドリーム	93,800	5,660.00	530,908,000	貸付有価証券 18,800株
日本コークス工業	156,700	80.00	12,536,000	貸付有価証券 500株
ニチレキ	21,900	1,374.00	30,090,600	
ユシロ化学工業	10,400	1,470.00	15,288,000	
ビーピー・カストロール	6,600	1,600.00	10,560,000	
富士石油	49,500	242.00	11,979,000	
MORESCO	6,700	1,420.00	9,514,000	
出光興産	208,700	3,045.00	635,491,500	貸付有価証券 3,400株
J X T Gホールディングス	2,877,400	500.60	1,440,426,440	貸付有価証券 4,000株
コスモエネルギーホールディングス	53,700	2,541.00	136,451,700	貸付有価証券 800株
横浜ゴム	107,400	2,189.00	235,098,600	
TOYO TIRE	106,500	1,588.00	169,122,000	貸付有価証券 13,300株
ブリヂストン	570,200	4,200.00	2,394,840,000	
住友ゴム工業	166,700	1,376.00	229,379,200	
藤倉コンポジット	16,200	491.00	7,954,200	
オカモト	11,300	4,005.00	45,256,500	貸付有価証券

				300株
フコク	8,100	734.00	5,945,400	
ニッタ	20,900	3,260.00	68,134,000	
住友理工	36,000	1,000.00	36,000,000	
三ツ星ベルト	24,400	2,132.00	52,020,800	
バンドー化学	32,600	948.00	30,904,800	貸付有価証券 100株
日東紡績	27,600	4,595.00	126,822,000	貸付有価証券 4,200株
A G C	183,400	4,035.00	740,019,000	貸付有価証券 300株
日本板硝子	88,700	700.00	62,090,000	貸付有価証券 100株
石塚硝子	3,400	2,557.00	8,693,800	
日本山村硝子	7,700	1,329.00	10,233,300	
日本電気硝子	74,500	2,515.00	187,367,500	
オハラ	7,300	1,409.00	10,285,700	貸付有価証券 3,400株(900株)
住友大阪セメント	35,100	4,850.00	170,235,000	貸付有価証券 1,500株
太平洋セメント	117,200	3,285.00	385,002,000	
日本ヒューム	18,600	850.00	15,810,000	
日本コンクリート工業	39,900	276.00	11,012,400	
三谷セキサン	8,600	3,710.00	31,906,000	
アジアパイルホールディングス	26,300	600.00	15,780,000	
東海カーボン	194,400	1,132.00	220,060,800	貸付有価証券 91,500株(900株)
日本カーボン	9,500	4,350.00	41,325,000	貸付有価証券 5,000株
東洋炭素	10,900	2,364.00	25,767,600	貸付有価証券 100株(100株)
ノリタケカンパニーリミテド	10,300	4,625.00	47,637,500	
T O T O	132,500	4,700.00	622,750,000	貸付有価証券 18,000株
日本碍子	226,400	1,919.00	434,461,600	
日本特殊陶業	144,400	2,134.00	308,149,600	貸付有価証券 6,600株
ダントーホールディング	13,800	113.00	1,559,400	

ス				
MARUWA	7,100	8,270.00	58,717,000	
品川リフラクトリーズ	4,900	3,515.00	17,223,500	
黒崎播磨	3,700	6,480.00	23,976,000	
ヨータイ	14,700	722.00	10,613,400	
イソライト工業	9,500	666.00	6,327,000	貸付有価証券 200株
東京窯業	23,600	344.00	8,118,400	
ニッカトー	8,400	763.00	6,409,200	貸付有価証券 2,100株
フジミインコーポレー テッド	16,500	3,090.00	50,985,000	貸付有価証券 300株
クニミネ工業	7,500	1,364.00	10,230,000	
エーアンドエーマテリア ル	3,100	1,451.00	4,498,100	
ニチアス	50,800	2,744.00	139,395,200	
ニチハ	25,800	2,738.00	70,640,400	
日本製鉄	821,100	1,648.00	1,353,172,800	
神戸製鋼所	335,800	578.00	194,092,400	貸付有価証券 35,000株
中山製鋼所	25,400	550.00	13,970,000	
合同製鐵	9,900	2,790.00	27,621,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	495,500	1,402.00	694,691,000	
東京製鐵	89,300	793.00	70,814,900	貸付有価証券 200株
共英製鋼	20,700	2,130.00	44,091,000	
大和工業	39,000	2,728.00	106,392,000	
東京鐵鋼	7,600	1,565.00	11,894,000	
大阪製鐵	9,700	1,435.00	13,919,500	
淀川製鋼所	24,800	2,048.00	50,790,400	
丸一鋼管	59,600	3,090.00	184,164,000	
モリ工業	5,500	2,590.00	14,245,000	
大同特殊鋼	30,000	4,805.00	144,150,000	
日本高周波鋼業	6,800	422.00	2,869,600	
日本冶金工業	15,200	2,282.00	34,686,400	貸付有価証券 5,000株
山陽特殊製鋼	13,200	1,568.00	20,697,600	貸付有価証券 3,600株

愛知製鋼	10,300	3,850.00	39,655,000	
日立金属	197,600	1,596.00	315,369,600	貸付有価証券 8,700株
日本金属	4,200	935.00	3,927,000	
大平洋金属	12,400	2,569.00	31,855,600	貸付有価証券 3,600株
新日本電工	118,200	172.00	20,330,400	貸付有価証券 42,600株
栗本鐵工所	9,300	2,197.00	20,432,100	
虹技	2,700	1,448.00	3,909,600	
日本鋳鉄管	1,900	1,279.00	2,430,100	貸付有価証券 1,000株（1,000株）
三菱製鋼	13,600	1,088.00	14,796,800	
日亜鋼業	26,800	350.00	9,380,000	
日本精線	3,000	3,275.00	9,825,000	
エンビプロ・ホールディングス	6,900	865.00	5,968,500	貸付有価証券 200株
シンニッタン	28,500	448.00	12,768,000	
新家工業	4,200	1,447.00	6,077,400	
大紀アルミニウム工業所	30,200	772.00	23,314,400	
日本軽金属ホールディングス	464,200	234.00	108,622,800	
三井金属鉱業	49,500	2,872.00	142,164,000	
東邦亜鉛	9,400	2,045.00	19,223,000	
三菱マテリアル	121,200	2,983.00	361,539,600	
住友金属鉱山	234,500	3,499.00	820,515,500	
DOWAホールディングス	46,400	4,075.00	189,080,000	貸付有価証券 200株
古河機械金属	32,600	1,447.00	47,172,200	
大阪チタニウムテクノロジーズ	19,100	1,525.00	29,127,500	貸付有価証券 100株
東邦チタニウム	32,800	917.00	30,077,600	貸付有価証券 700株
UACJ	27,800	2,498.00	69,444,400	
CKサンエツ	3,800	3,330.00	12,654,000	
古河電気工業	57,000	2,825.00	161,025,000	貸付有価証券 1,300株
住友電気工業	686,000	1,652.50	1,133,615,000	
フジクラ	221,500	457.00	101,225,500	

昭和電線ホールディングス	21,300	1,497.00	31,886,100	
東京特殊電線	2,700	2,268.00	6,123,600	
タツタ電線	36,400	599.00	21,803,600	
カナレ電気	3,000	1,886.00	5,658,000	貸付有価証券 1,400株
平河ヒューテック	6,900	1,582.00	10,915,800	
リョービ	22,600	2,035.00	45,991,000	
アーレスティ	24,000	562.00	13,488,000	
アサヒホールディングス	32,100	2,695.00	86,509,500	
稲葉製作所	10,300	1,426.00	14,687,800	貸付有価証券 400株
宮地エンジニアリンググループ	5,600	2,003.00	11,216,800	貸付有価証券 400株
トーカロ	51,000	1,130.00	57,630,000	
アルファC o	6,500	1,330.00	8,645,000	
SUMCO	219,600	1,864.00	409,334,400	
川田テクノロジーズ	3,700	6,710.00	24,827,000	
RS Technologies	5,200	3,940.00	20,488,000	貸付有価証券 1,400株
信和	7,900	1,101.00	8,697,900	貸付有価証券 1,100株
東洋製罐グループホールディングス	116,800	1,898.00	221,686,400	貸付有価証券 100株
ホッカンホールディングス	10,100	2,100.00	21,210,000	
コロナ	10,100	1,042.00	10,524,200	
横河ブリッジホールディングス	34,100	2,000.00	68,200,000	
駒井ハルテック	3,400	1,915.00	6,511,000	
高田機工	1,700	2,737.00	4,652,900	
三和ホールディングス	176,000	1,246.00	219,296,000	
文化シャッター	54,100	972.00	52,585,200	貸付有価証券 13,400株（10,600株）
三協立山	25,400	1,254.00	31,851,600	
アルインコ	13,300	1,303.00	17,329,900	
東洋シャッター	4,400	705.00	3,102,000	
LIXILグループ	270,700	1,954.00	528,947,800	貸付有価証券 73,500株

日本ファイルコン	14,000	518.00	7,252,000	
ノーリツ	38,000	1,502.00	57,076,000	
長府製作所	18,700	2,492.00	46,600,400	
リンナイ	35,700	8,630.00	308,091,000	貸付有価証券 1,200株
ダイニチ工業	9,900	682.00	6,751,800	
日東精工	25,300	645.00	16,318,500	
三洋工業	2,400	2,022.00	4,852,800	
岡部	37,200	946.00	35,191,200	
ジーテクト	22,800	1,757.00	40,059,600	
東プレ	34,200	1,795.00	61,389,000	貸付有価証券 100株
高周波熱錬	35,300	915.00	32,299,500	
東京製綱	13,100	1,317.00	17,252,700	
サンコール	10,300	564.00	5,809,200	
モリテック スチール	14,300	388.00	5,548,400	
パイオラックス	27,100	2,129.00	57,695,900	
エイチワン	18,000	822.00	14,796,000	
日本発條	196,800	1,005.00	197,784,000	貸付有価証券 10,300株
中央発條	2,200	3,100.00	6,820,000	
アドバネクス	2,600	1,677.00	4,360,200	
立川ブラインド工業	8,100	1,341.00	10,862,100	貸付有価証券 3,700株
三益半導体工業	16,400	2,204.00	36,145,600	
日本ドライケミカル	4,600	1,606.00	7,387,600	
日本製鋼所	55,700	2,164.00	120,534,800	
三浦工業	79,400	3,775.00	299,735,000	貸付有価証券 800株
タクマ	62,200	1,303.00	81,046,600	
ツガミ	38,000	1,099.00	41,762,000	
オークマ	21,400	5,850.00	125,190,000	貸付有価証券 300株
東芝機械	20,700	2,956.00	61,189,200	
アマダホールディングス	233,200	1,259.00	293,598,800	
アイダエンジニアリング	49,500	976.00	48,312,000	
滝澤鉄工所	5,700	1,358.00	7,740,600	
F U J I	78,900	2,032.00	160,324,800	貸付有価証券

				29,000株(28,000株)
牧野フライス製作所	21,500	5,090.00	109,435,000	
オーエスジー	84,800	2,140.00	181,472,000	貸付有価証券 4,100株
ダイジェット工業	2,100	1,490.00	3,129,000	
旭ダイヤモンド工業	48,100	644.00	30,976,400	
D M G 森精機	116,100	1,736.00	201,549,600	貸付有価証券 100株
ソディック	43,100	990.00	42,669,000	貸付有価証券 2,900株
ディスコ	24,800	26,150.00	648,520,000	貸付有価証券 400株
日東工器	10,000	2,368.00	23,680,000	
日進工具	5,400	2,736.00	14,774,400	
パンチ工業	16,600	509.00	8,449,400	
富士ダイス	8,100	804.00	6,512,400	
豊和工業	10,100	815.00	8,231,500	貸付有価証券 100株
O K K	7,500	671.00	5,032,500	
東洋機械金属	13,100	544.00	7,126,400	
津田駒工業	3,500	1,255.00	4,392,500	貸付有価証券 1,600株(1,500株)
エンシュウ	4,400	1,353.00	5,953,200	
島精機製作所	29,500	2,599.00	76,670,500	
オプトラン	20,400	3,040.00	62,016,000	貸付有価証券 300株
N C ホールディングス	5,500	671.00	3,690,500	
イワキポンプ	8,700	1,213.00	10,553,100	
フリー	17,900	1,070.00	19,153,000	
ヤマシンフィルタ	39,900	874.00	34,872,600	貸付有価証券 18,700株(8,200株)
日阪製作所	22,600	1,001.00	22,622,600	
やまびこ	35,600	1,228.00	43,716,800	
平田機工	8,700	7,090.00	61,683,000	
ペガサスミシン製造	18,600	506.00	9,411,600	貸付有価証券 200株
マルマエ	7,500	1,059.00	7,942,500	貸付有価証券 3,500株(3,300株)
タツモ	8,600	1,479.00	12,719,400	貸付有価証券

				300株
ナブテスコ	108,100	3,390.00	366,459,000	
三井海洋開発	19,500	2,668.00	52,026,000	
レオン自動機	18,000	1,578.00	28,404,000	
S M C	58,200	51,050.00	2,971,110,000	
ヤマハモーターロボティクスホールディング	16,000	620.00	9,920,000	貸付有価証券 5,400株
ホソカワミクロン	6,500	4,630.00	30,095,000	
ユニオンツール	6,800	3,240.00	22,032,000	
オイレス工業	23,700	1,679.00	39,792,300	
日精エー・エス・ビー機械	6,200	4,615.00	28,613,000	貸付有価証券 1,900株
サトーホールディングス	26,100	3,430.00	89,523,000	
技研製作所	16,100	5,080.00	81,788,000	
日本エアーテック	5,800	749.00	4,344,200	
カワタ	5,400	1,123.00	6,064,200	
日精樹脂工業	15,400	1,026.00	15,800,400	
オカダアイヨン	5,800	1,321.00	7,661,800	貸付有価証券 200株
ワイエイシイホールディングス	7,900	758.00	5,988,200	貸付有価証券 3,600株(600株)
小松製作所	840,300	2,666.00	2,240,239,800	貸付有価証券 2,100株
住友重機械工業	106,200	3,180.00	337,716,000	
日立建機	74,300	3,315.00	246,304,500	貸付有価証券 2,700株
日工	25,300	826.00	20,897,800	
巴工業	7,900	2,283.00	18,035,700	
井関農機	18,500	1,686.00	31,191,000	
T O W A	18,700	1,186.00	22,178,200	貸付有価証券 4,700株
丸山製作所	4,100	1,229.00	5,038,900	
北川鉄工所	8,300	2,394.00	19,870,200	
ローツェ	8,100	4,300.00	34,830,000	貸付有価証券 1,500株
タカキタ	6,500	624.00	4,056,000	
クボタ	984,300	1,739.50	1,712,189,850	
荏原実業	4,600	2,266.00	10,423,600	
三菱化工機	6,400	1,912.00	12,236,800	

月島機械	34,200	1,684.00	57,592,800	
帝国電機製作所	15,300	1,424.00	21,787,200	
東京機械製作所	7,500	366.00	2,745,000	
新東工業	44,000	1,015.00	44,660,000	
澁谷工業	16,200	3,145.00	50,949,000	
アイチ コーポレーション	32,000	756.00	24,192,000	
小森コーポレーション	47,000	1,122.00	52,734,000	
鶴見製作所	14,400	2,071.00	29,822,400	
住友精密工業	2,800	3,365.00	9,422,000	
日本ギア工業	5,600	397.00	2,223,200	
酒井重工業	3,500	2,873.00	10,055,500	
荏原製作所	76,700	3,390.00	260,013,000	貸付有価証券 400株
石井鐵工所	2,400	2,550.00	6,120,000	
西島製作所	18,700	933.00	17,447,100	
北越工業	19,100	1,336.00	25,517,600	
ダイキン工業	236,400	15,670.00	3,704,388,000	貸付有価証券 100株
オルガノ	6,700	6,670.00	44,689,000	
トーヨーカネツ	8,100	2,405.00	19,480,500	
栗田工業	100,400	3,255.00	326,802,000	
椿本チエイン	26,500	3,940.00	104,410,000	
大同工業	8,800	820.00	7,216,000	
木村化工機	15,400	702.00	10,810,800	貸付有価証券 7,200株
アネスト岩田	28,900	1,055.00	30,489,500	
ダイフク	94,800	6,700.00	635,160,000	貸付有価証券 8,800株
サムコ	5,100	1,761.00	8,981,100	貸付有価証券 100株（100株）
加藤製作所	10,100	1,679.00	16,957,900	
油研工業	3,100	1,744.00	5,406,400	
タダノ	89,500	996.00	89,142,000	貸付有価証券 12,100株
フジテック	67,400	1,779.00	119,904,600	
C K D	51,600	1,857.00	95,821,200	
キトー	14,000	1,686.00	23,604,000	

平和	51,700	2,278.00	117,772,600	貸付有価証券 13,600株
理想科学工業	16,400	1,930.00	31,652,000	
SANKYO	41,300	3,645.00	150,538,500	貸付有価証券 600株
日本金銭機械	20,500	899.00	18,429,500	貸付有価証券 900株(900株)
マースグループホールディングス	11,800	2,060.00	24,308,000	
フクシマガリレイ	11,400	4,130.00	47,082,000	
オーイズミ	7,800	603.00	4,703,400	
ダイコク電機	8,500	1,676.00	14,246,000	
竹内製作所	31,000	1,655.00	51,305,000	
アマノ	48,600	3,380.00	164,268,000	貸付有価証券 200株
JUKI	25,800	889.00	22,936,200	
サンデンホールディングス	24,200	859.00	20,787,800	貸付有価証券 5,900株(2,200株)
蛇の目ミシン工業	16,900	410.00	6,929,000	
マックス	28,300	2,177.00	61,609,100	
グローリー	51,400	3,250.00	167,050,000	貸付有価証券 200株
新晃工業	17,200	1,937.00	33,316,400	貸付有価証券 500株
大和冷機工業	26,800	1,270.00	34,036,000	
セガサミーホールディングス	184,000	1,598.00	294,032,000	
日本ピストンリング	6,800	1,580.00	10,744,000	
リケン	8,600	4,320.00	37,152,000	
T P R	25,000	2,144.00	53,600,000	
ツバキ・ナカシマ	37,800	1,649.00	62,332,200	
ホシザキ	54,200	9,900.00	536,580,000	貸付有価証券 200株
大豊工業	15,100	857.00	12,940,700	
日本精工	349,300	1,045.00	365,018,500	貸付有価証券 200株
NTN	429,400	348.00	149,431,200	貸付有価証券 12,200株
ジェイテクト	178,000	1,323.00	235,494,000	
不二越	17,200	4,830.00	83,076,000	

日本トムソン	55,000	512.00	28,160,000	
T H K	107,900	3,030.00	326,937,000	
ユーシン精機	14,400	1,032.00	14,860,800	
前澤給装工業	6,700	2,191.00	14,679,700	
イーグル工業	22,900	1,138.00	26,060,200	
前澤工業	12,300	378.00	4,649,400	
日本ピラー工業	18,800	1,475.00	27,730,000	
キッツ	75,200	756.00	56,851,200	
マキタ	241,900	3,795.00	918,010,500	貸付有価証券 100株
日立造船	147,100	414.00	60,899,400	
三菱重工業	310,900	4,291.00	1,334,071,900	
I H I	133,600	2,582.00	344,955,200	貸付有価証券 1,400株
スター精密	29,000	1,626.00	47,154,000	貸付有価証券 1,900株
日清紡ホールディングス	123,700	1,068.00	132,111,600	
イビデン	113,600	2,612.00	296,723,200	
コニカミノルタ	405,400	710.00	287,834,000	貸付有価証券 11,200株
ブラザー工業	226,600	2,272.00	514,835,200	
ミネベアミツミ	344,400	2,307.00	794,530,800	貸付有価証券 3,500株
日立製作所	891,500	4,596.00	4,097,334,000	貸付有価証券 800株
三菱電機	1,855,200	1,526.50	2,831,962,800	貸付有価証券 1,800株
富士電機	111,800	3,410.00	381,238,000	
東洋電機製造	7,300	1,532.00	11,183,600	
安川電機	199,700	4,285.00	855,714,500	貸付有価証券 22,800株
シンフォニアテクノロ ジー	24,000	1,351.00	32,424,000	
明電舎	34,100	2,396.00	81,703,600	
オリジン	5,000	1,493.00	7,465,000	
山洋電気	9,000	5,400.00	48,600,000	
デンヨー	15,800	2,057.00	32,500,600	
東芝テック	23,200	4,590.00	106,488,000	
芝浦メカトロニクス	3,300	3,955.00	13,051,500	

マブチモーター	51,300	4,305.00	220,846,500	貸付有価証券 200株
日本電産	223,300	15,150.00	3,382,995,000	貸付有価証券 2,800株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	11,100	426.00	4,728,600	貸付有価証券 3,900株
トレックス・セミコンダクター	10,600	1,613.00	17,097,800	
東光高岳	10,300	1,182.00	12,174,600	
ダブル・スコープ	28,100	1,003.00	28,184,300	貸付有価証券 13,200株（1,700株）
ダイヘン	20,300	3,605.00	73,181,500	
ヤーマン	26,900	724.00	19,475,600	貸付有価証券 12,600株（300株）
JVCケンウッド	151,100	271.00	40,948,100	貸付有価証券 9,800株
ミマキエンジニアリング	16,600	509.00	8,449,400	
第一精工	7,500	2,600.00	19,500,000	貸付有価証券 3,300株
日新電機	43,500	1,346.00	58,551,000	
大崎電気工業	36,900	694.00	25,608,600	貸付有価証券 200株
オムロン	172,500	6,500.00	1,121,250,000	貸付有価証券 200株
日東工業	27,200	2,525.00	68,680,000	
I D E C	26,800	2,272.00	60,889,600	
正興電機製作所	4,400	914.00	4,021,600	貸付有価証券 1,700株
不二電機工業	2,300	1,300.00	2,990,000	貸付有価証券 1,000株
ジーエス・ユアサコーポレーション	61,900	2,377.00	147,136,300	
サクサホールディングス	4,300	1,936.00	8,324,800	
メルコホールディングス	6,400	3,040.00	19,456,000	
テクノメディカ	4,200	2,056.00	8,635,200	
ダイヤモンドエレクトリックホールディング	3,000	1,004.00	3,012,000	
日本電気	225,100	4,465.00	1,005,071,500	
富士通	178,900	10,310.00	1,844,459,000	貸付有価証券 100株

沖電気工業	75,400	1,523.00	114,834,200	貸付有価証券 900株
岩崎通信機	8,100	850.00	6,885,000	
電気興業	8,900	3,290.00	29,281,000	
サンケン電気	20,200	3,390.00	68,478,000	貸付有価証券 700株
ナカヨ	3,600	1,690.00	6,084,000	
アイホン	10,500	1,858.00	19,509,000	
ルネサスエレクトロニクス	885,100	761.00	673,561,100	貸付有価証券 23,400株
セイコーエプソン	230,200	1,663.00	382,822,600	貸付有価証券 2,000株
ワコム	124,700	447.00	55,740,900	貸付有価証券 100株
アルバック	37,000	4,305.00	159,285,000	貸付有価証券 200株
アクセル	7,700	931.00	7,168,700	
E I Z O	14,400	3,895.00	56,088,000	
日本信号	47,200	1,477.00	69,714,400	
京三製作所	43,400	634.00	27,515,600	貸付有価証券 20,200株
能美防災	24,500	2,431.00	59,559,500	
ホーチキ	13,400	1,764.00	23,637,600	
星和電機	9,200	594.00	5,464,800	
エレコム	20,100	4,425.00	88,942,500	
パナソニック	2,119,700	1,018.50	2,158,914,450	貸付有価証券 2,000株
シャープ	214,700	1,655.00	355,328,500	貸付有価証券 38,000株（33,500株）
アンリツ	119,400	2,153.00	257,068,200	貸付有価証券 65,400株（7,000株）
富士通ゼネラル	50,400	2,446.00	123,278,400	貸付有価証券 13,400株
ソニー	1,172,600	7,427.00	8,708,900,200	貸付有価証券 11,400株
T D K	89,600	12,490.00	1,119,104,000	
帝国通信工業	8,200	1,227.00	10,061,400	
タムラ製作所	62,000	685.00	42,470,000	
アルプスアルパイン	164,200	2,525.00	414,605,000	
池上通信機	5,900	1,045.00	6,165,500	

日本電波工業	16,700	526.00	8,784,200	貸付有価証券 300株
鈴木	9,900	830.00	8,217,000	
日本トリム	2,500	4,520.00	11,300,000	
ローランド ディー ジー	10,200	2,276.00	23,215,200	貸付有価証券 4,800株
フォスター電機	19,500	1,948.00	37,986,000	
S M K	4,800	2,937.00	14,097,600	
ヨコオ	12,000	3,300.00	39,600,000	貸付有価証券 4,200株
ティアック	13,300	210.00	2,793,000	貸付有価証券 2,600株
ホシデン	50,700	1,379.00	69,915,300	貸付有価証券 600株
ヒロセ電機	28,700	13,930.00	399,791,000	
日本航空電子工業	42,500	2,239.00	95,157,500	
T O A	19,900	1,177.00	23,422,300	
マクセルホールディング ス	39,900	1,447.00	57,735,300	貸付有価証券 4,200株
古野電気	23,900	1,355.00	32,384,500	
ユニデンホールディング ス	5,100	1,903.00	9,705,300	
スミダコーポレーション	14,200	1,286.00	18,261,200	
アイコム	10,300	2,708.00	27,892,400	
リオン	7,800	3,155.00	24,609,000	
本多通信工業	15,800	553.00	8,737,400	
船井電機	18,700	673.00	12,585,100	貸付有価証券 5,400株
横河電機	170,200	1,976.00	336,315,200	貸付有価証券 200株
新電元工業	6,600	3,795.00	25,047,000	
アズビル	117,100	3,150.00	368,865,000	
東亜ディーケーケー	9,200	1,043.00	9,595,600	
日本光電工業	76,700	3,085.00	236,619,500	
チノー	6,400	1,427.00	9,132,800	
共和電業	19,400	458.00	8,885,200	
日本電子材料	7,300	849.00	6,197,700	貸付有価証券 3,400株
堀場製作所	36,700	7,520.00	275,984,000	

アドバンテスト	137,900	6,210.00	856,359,000	
小野測器	7,700	555.00	4,273,500	
エスペック	16,400	2,289.00	37,539,600	
キーエンス	168,100	38,730.00	6,510,513,000	貸付有価証券 700株
日置電機	9,700	3,940.00	38,218,000	
シスメックス	132,500	7,490.00	992,425,000	
日本マイクロニクス	32,300	1,230.00	39,729,000	貸付有価証券 500株
メガチップス	17,300	1,900.00	32,870,000	貸付有価証券 4,400株
O B A R A G R O U P	9,600	3,675.00	35,280,000	
澤藤電機	2,200	2,218.00	4,879,600	
原田工業	8,800	1,011.00	8,896,800	貸付有価証券 300株
コーセル	22,600	1,174.00	26,532,400	貸付有価証券 700株
イリソ電子工業	15,600	4,930.00	76,908,000	貸付有価証券 6,300株
オブテックスグループ	30,400	1,615.00	49,096,000	貸付有価証券 1,800株
千代田インテグレ	8,600	2,454.00	21,104,400	
アイ・オー・データ機器	6,800	1,076.00	7,316,800	
レーザーテック	38,000	11,120.00	422,560,000	
スタンレー電気	130,900	3,150.00	412,335,000	
岩崎電気	7,200	1,495.00	10,764,000	
ウシオ電機	107,800	1,632.00	175,929,600	
岡谷電機産業	14,500	380.00	5,510,000	
ヘリオス テクノ ホールディング	17,100	460.00	7,866,000	貸付有価証券 700株
エノモト	5,500	1,470.00	8,085,000	
日本セラミック	18,800	2,795.00	52,546,000	
遠藤照明	9,400	706.00	6,636,400	
古河電池	13,200	839.00	11,074,800	貸付有価証券 4,000株
双信電機	9,000	477.00	4,293,000	貸付有価証券 2,900株
山一電機	13,400	1,682.00	22,538,800	貸付有価証券 1,500株(1,500株)

図研	12,100	2,508.00	30,346,800	
日本電子	36,600	3,295.00	120,597,000	貸付有価証券 200株
カシオ計算機	164,100	2,186.00	358,722,600	貸付有価証券 11,100株
ファナック	176,300	20,700.00	3,649,410,000	
日本シイエムケイ	43,600	662.00	28,863,200	
エンプラス	9,500	3,625.00	34,437,500	
大真空	6,800	1,756.00	11,940,800	貸付有価証券 900株
ローム	82,400	8,770.00	722,648,000	貸付有価証券 6,600株(3,500株)
浜松ホトニクス	133,100	4,570.00	608,267,000	貸付有価証券 4,700株
三井ハイテック	20,500	1,714.00	35,137,000	貸付有価証券 6,700株(1,500株)
新光電気工業	62,300	1,277.00	79,557,100	貸付有価証券 29,200株
京セラ	261,000	7,560.00	1,973,160,000	
太陽誘電	82,500	3,350.00	276,375,000	貸付有価証券 43,200株
村田製作所	545,000	6,761.00	3,684,745,000	貸付有価証券 1,400株
双葉電子工業	29,300	1,365.00	39,994,500	
北陸電気工業	7,500	1,153.00	8,647,500	
ニチコン	62,900	1,138.00	71,580,200	貸付有価証券 13,900株(2,600株)
日本ケミコン	14,100	2,134.00	30,089,400	貸付有価証券 800株
K O A	28,000	1,371.00	38,388,000	
市光工業	27,700	759.00	21,024,300	貸付有価証券 100株
小糸製作所	111,100	5,140.00	571,054,000	貸付有価証券 2,900株
ミツバ	34,100	760.00	25,916,000	貸付有価証券 100株
S C R E E Nホールディングス	32,200	7,510.00	241,822,000	貸付有価証券 500株
キヤノン電子	19,400	2,132.00	41,360,800	
キヤノン	998,700	3,079.00	3,074,997,300	貸付有価証券 10,600株

リコー	472,000	1,179.00	556,488,000	
象印マホービン	54,400	2,004.00	109,017,600	貸付有価証券 25,500株
MUTOHホールディングス	2,500	1,673.00	4,182,500	
東京エレクトロン	123,700	23,955.00	2,963,233,500	貸付有価証券 100株
トヨタ紡織	54,000	1,759.00	94,986,000	
芦森工業	3,800	1,388.00	5,274,400	
ユニプレス	35,900	1,536.00	55,142,400	
豊田自動織機	150,100	6,400.00	960,640,000	
モリタホールディングス	32,400	1,804.00	58,449,600	
三櫻工業	23,500	1,273.00	29,915,500	貸付有価証券 11,000株(3,500株)
デンソー	408,500	5,021.00	2,051,078,500	貸付有価証券 200株
東海理化電機製作所	48,900	2,142.00	104,743,800	
三井E & Sホールディングス	67,000	886.00	59,362,000	貸付有価証券 3,800株
川崎重工業	144,400	2,409.00	347,859,600	貸付有価証券 2,700株
名村造船所	59,700	268.00	15,999,600	貸付有価証券 400株
サノヤスホールディングス	22,500	175.00	3,937,500	貸付有価証券 300株
日本車輛製造	6,800	3,260.00	22,168,000	貸付有価証券 1,400株
三菱ロジスネクスト	24,500	1,334.00	32,683,000	貸付有価証券 2,300株
近畿車輛	2,800	1,535.00	4,298,000	
日産自動車	2,188,000	635.40	1,390,255,200	貸付有価証券 625,400株
いすゞ自動車	537,600	1,321.00	710,169,600	
トヨタ自動車	2,067,400	7,725.00	15,970,665,000	貸付有価証券 3,600株
日野自動車	231,700	1,163.00	269,467,100	貸付有価証券 1,500株
三菱自動車工業	686,700	460.00	315,882,000	貸付有価証券 43,700株
エフテック	12,900	809.00	10,436,100	
レシップホールディング	7,300	657.00	4,796,100	貸付有価証券

ス				1,400株
G M B	3,300	800.00	2,640,000	
ファルテック	3,200	1,186.00	3,795,200	貸付有価証券 1,500株(1,500株)
武蔵精密工業	41,300	1,501.00	61,991,300	貸付有価証券 9,300株
日産車体	36,200	1,044.00	37,792,800	
新明和工業	50,000	1,493.00	74,650,000	貸付有価証券 2,400株
極東開発工業	34,500	1,627.00	56,131,500	貸付有価証券 100株
日信工業	37,700	2,218.00	83,618,600	貸付有価証券 2,300株(2,200株)
トピー工業	15,300	2,016.00	30,844,800	
ティラド	6,700	2,010.00	13,467,000	
タチエス	30,500	1,454.00	44,347,000	貸付有価証券 500株
N O K	99,700	1,652.00	164,704,400	
フタバ産業	51,600	770.00	39,732,000	
K Y B	20,800	3,295.00	68,536,000	貸付有価証券 500株
大同メタル工業	35,600	757.00	26,949,200	
プレス工業	91,900	444.00	40,803,600	
ミクニ	23,500	355.00	8,342,500	
太平洋工業	38,800	1,494.00	57,967,200	
ケーヒン	42,600	2,562.00	109,141,200	
河西工業	25,000	854.00	21,350,000	
アイシン精機	152,800	4,110.00	628,008,000	貸付有価証券 100株
マツダ	545,900	930.00	507,687,000	
今仙電機製作所	17,200	972.00	16,718,400	
本田技研工業	1,460,700	3,142.00	4,589,519,400	貸付有価証券 8,400株
スズキ	367,700	4,609.00	1,694,729,300	貸付有価証券 3,600株
S U B A R U	576,000	2,719.50	1,566,432,000	
安永	8,900	1,221.00	10,866,900	貸付有価証券 1,400株
ヤマハ発動機	241,900	2,275.00	550,322,500	
ショーワ	43,800	2,266.00	99,250,800	

T B K	22,000	458.00	10,076,000	
エクセディ	25,200	2,476.00	62,395,200	貸付有価証券 400株
豊田合成	59,900	2,741.00	164,185,900	貸付有価証券 500株
愛三工業	29,000	795.00	23,055,000	
盟和産業	2,800	1,149.00	3,217,200	
日本プラスト	14,500	717.00	10,396,500	
ヨロズ	17,300	1,487.00	25,725,100	
エフ・シー・シー	30,300	2,373.00	71,901,900	
シマノ	69,400	17,830.00	1,237,402,000	
テイ・エス テック	43,100	3,460.00	149,126,000	貸付有価証券 1,100株
ジャムコ	9,300	1,440.00	13,392,000	貸付有価証券 2,200株
テルモ	525,000	3,932.00	2,064,300,000	貸付有価証券 5,100株
クリエートメディック	6,100	1,095.00	6,679,500	
日機装	55,600	1,422.00	79,063,200	
日本エム・ディ・エム	10,700	2,392.00	25,594,400	
島津製作所	221,700	3,480.00	771,516,000	
J M S	15,700	814.00	12,779,800	
クボテック	4,800	399.00	1,915,200	貸付有価証券 500株
長野計器	13,400	892.00	11,952,800	
ブイ・テクノロジー	8,700	5,570.00	48,459,000	貸付有価証券 2,800株
東京計器	11,800	1,024.00	12,083,200	
愛知時計電機	2,400	4,430.00	10,632,000	
インターアクション	9,900	3,140.00	31,086,000	貸付有価証券 4,700株(4,600株)
オーバル	16,600	249.00	4,133,400	
東京精密	33,600	4,315.00	144,984,000	貸付有価証券 1,200株
マニー	73,900	3,195.00	236,110,500	貸付有価証券 11,000株
ニコン	300,200	1,349.00	404,969,800	貸付有価証券 300株
トプコン	93,400	1,428.00	133,375,200	

オリンパス	1,026,500	1,691.50	1,736,324,750	
理研計器	16,400	2,354.00	38,605,600	
タムロン	14,900	2,547.00	37,950,300	
H O Y A	373,500	10,435.00	3,897,472,500	
シード	7,900	1,086.00	8,579,400	貸付有価証券 400株
ノーリツ銅機	12,500	1,529.00	19,112,500	貸付有価証券 200株
エー・アンド・デイ	16,900	1,054.00	17,812,600	
朝日インテック	157,500	3,230.00	508,725,000	貸付有価証券 1,600株
シチズン時計	217,300	601.00	130,597,300	
リズム時計工業	5,800	938.00	5,440,400	
大研医器	12,800	645.00	8,256,000	
メニコン	25,400	4,615.00	117,221,000	
シンシア	2,000	628.00	1,256,000	貸付有価証券 500株
松風	8,400	1,760.00	14,784,000	
セイコーホールディングス	26,200	2,919.00	76,477,800	貸付有価証券 5,100株
ニプロ	128,400	1,310.00	168,204,000	
中本パックス	4,700	1,577.00	7,411,900	
スノーピーク	8,500	1,100.00	9,350,000	貸付有価証券 600株
パラマウントベッドホールディングス	19,600	4,645.00	91,042,000	
トランザクション	11,800	1,002.00	11,823,600	
S H O - B I	5,400	398.00	2,149,200	
ニホンフラッシュ	8,700	2,988.00	25,995,600	
前田工織	20,400	2,161.00	44,084,400	貸付有価証券 2,900株(700株)
永大産業	24,300	354.00	8,602,200	
アートネイチャー	19,800	819.00	16,216,200	
バンダイナムコホールディングス	191,800	6,510.00	1,248,618,000	貸付有価証券 200株
アイフィスジャパン	4,700	760.00	3,572,000	貸付有価証券 2,200株(1,600株)
共立印刷	30,900	165.00	5,098,500	
S H O E I	8,900	5,270.00	46,903,000	

フランスベッドホールディングス	26,200	967.00	25,335,400	
パイロットコーポレーション	32,400	4,485.00	145,314,000	貸付有価証券 100株
萩原工業	10,300	1,721.00	17,726,300	
トッパン・フォームズ	39,700	1,226.00	48,672,200	貸付有価証券 100株
フジシールインターナショナル	41,600	2,472.00	102,835,200	
タカラトミー	83,200	1,448.00	120,473,600	
廣済堂	12,900	820.00	10,578,000	
エステールホールディングス	5,000	689.00	3,445,000	
アーク	70,800	93.00	6,584,400	
タカノ	7,200	826.00	5,947,200	
プロネクサス	15,900	1,265.00	20,113,500	
ホクシン	11,400	157.00	1,789,800	
ウッドワン	6,200	1,221.00	7,570,200	
大建工業	12,500	1,999.00	24,987,500	
凸版印刷	261,900	2,284.00	598,179,600	
大日本印刷	242,800	3,010.00	730,828,000	
共同印刷	5,700	2,941.00	16,763,700	
N I S S H A	38,100	1,137.00	43,319,700	
光村印刷	1,600	1,722.00	2,755,200	
TAKARA & COMPANY	8,900	1,769.00	15,744,100	
アシックス	153,100	1,828.00	279,866,800	貸付有価証券 2,100株
ツツミ	5,800	2,104.00	12,203,200	
小松ウオール工業	5,700	2,324.00	13,246,800	貸付有価証券 100株
ヤマハ	110,300	6,170.00	680,551,000	
河合楽器製作所	5,700	3,890.00	22,173,000	
クリナップ	17,300	718.00	12,421,400	
ビジョン	112,100	4,070.00	456,247,000	貸付有価証券 2,100株
オリバー	3,900	3,660.00	14,274,000	貸付有価証券 1,200株
兼松サステック	1,200	1,706.00	2,047,200	

キングジム	15,400	883.00	13,598,200	貸付有価証券 300株
リンテック	44,100	2,467.00	108,794,700	
イトーキ	39,500	558.00	22,041,000	
任天堂	113,800	43,550.00	4,955,990,000	貸付有価証券 100株
三菱鉛筆	30,500	1,671.00	50,965,500	
タカラスタンド	38,300	1,983.00	75,948,900	
コクヨ	89,000	1,686.00	150,054,000	
ナカバヤシ	18,200	625.00	11,375,000	
グロープライド	8,300	2,675.00	22,202,500	
オカムラ	64,700	1,129.00	73,046,300	
美津濃	16,800	2,754.00	46,267,200	
東京電力ホールディングス	1,481,000	467.00	691,627,000	貸付有価証券 674,700株
中部電力	567,600	1,545.50	877,225,800	貸付有価証券 700株
関西電力	702,900	1,271.50	893,737,350	貸付有価証券 100株
中国電力	256,500	1,429.00	366,538,500	貸付有価証券 120,500株（83,500株）
北陸電力	169,600	783.00	132,796,800	貸付有価証券 19,400株
東北電力	463,500	1,088.00	504,288,000	
四国電力	167,000	1,075.00	179,525,000	貸付有価証券 14,100株
九州電力	382,400	952.00	364,044,800	貸付有価証券 8,400株
北海道電力	173,600	530.00	92,008,000	
沖縄電力	34,400	2,041.00	70,210,400	
電源開発	147,600	2,634.00	388,778,400	貸付有価証券 1,300株
エフオン	8,700	767.00	6,672,900	
イーレックス	26,400	1,825.00	48,180,000	
レノバ	30,600	1,187.00	36,322,200	貸付有価証券 200株
東京瓦斯	356,800	2,662.00	949,801,600	貸付有価証券 600株
大阪瓦斯	360,000	2,108.00	758,880,000	貸付有価証券

				1,300株
東邦瓦斯	91,900	4,485.00	412,171,500	貸付有価証券 1,700株
北海道瓦斯	10,000	1,636.00	16,360,000	
広島ガス	38,200	360.00	13,752,000	
西部瓦斯	20,900	2,597.00	54,277,300	
静岡ガス	52,700	990.00	52,173,000	
メタウォーター	9,000	4,260.00	38,340,000	
SBSホールディングス	16,000	1,940.00	31,040,000	
東武鉄道	195,700	4,025.00	787,692,500	
相鉄ホールディングス	59,400	2,990.00	177,606,000	
東急	467,900	2,022.00	946,093,800	
京浜急行電鉄	238,300	2,118.00	504,719,400	貸付有価証券 1,800株
小田急電鉄	275,900	2,569.00	708,787,100	貸付有価証券 2,000株
京王電鉄	96,300	6,660.00	641,358,000	貸付有価証券 3,400株
京成電鉄	129,100	4,265.00	550,611,500	
富士急行	25,300	4,255.00	107,651,500	貸付有価証券 8,200株
新京成電鉄	4,800	2,384.00	11,443,200	
東日本旅客鉄道	326,500	9,869.00	3,222,228,500	貸付有価証券 3,200株
西日本旅客鉄道	165,300	9,495.00	1,569,523,500	
東海旅客鉄道	154,300	22,095.00	3,409,258,500	
西武ホールディングス	248,900	1,811.00	450,757,900	
鴻池運輸	29,500	1,656.00	48,852,000	
西日本鉄道	51,400	2,513.00	129,168,200	貸付有価証券 1,400株
ハマキョウレックス	14,200	3,595.00	51,049,000	
サカイ引越センター	9,800	7,000.00	68,600,000	
近鉄グループホールディングス	175,700	5,920.00	1,040,144,000	貸付有価証券 300株
阪急阪神ホールディングス	234,300	4,735.00	1,109,410,500	
南海電気鉄道	83,300	2,970.00	247,401,000	
京阪ホールディングス	78,200	5,360.00	419,152,000	貸付有価証券 1,900株

神戸電鉄	4,200	3,975.00	16,695,000	貸付有価証券 100株
名古屋鉄道	144,500	3,435.00	496,357,500	貸付有価証券 1,100株
山陽電気鉄道	12,500	2,199.00	27,487,500	
日本通運	62,100	6,450.00	400,545,000	
ヤマトホールディングス	308,000	1,901.00	585,508,000	貸付有価証券 200株
山九	48,800	5,480.00	267,424,000	
丸運	10,000	312.00	3,120,000	
丸全昭和運輸	14,200	3,195.00	45,369,000	
センコーグループホールディングス	96,900	935.00	90,601,500	貸付有価証券 200株
トナミホールディングス	4,200	5,360.00	22,512,000	
ニッコンホールディングス	62,900	2,767.00	174,044,300	
日本石油輸送	1,900	2,895.00	5,500,500	
福山通運	22,500	4,045.00	91,012,500	
セイノーホールディングス	131,600	1,490.00	196,084,000	
エスライン	5,300	1,051.00	5,570,300	
神奈川中央交通	4,400	4,050.00	17,820,000	
日立物流	32,200	3,040.00	97,888,000	
丸和運輸機関	18,500	2,419.00	44,751,500	貸付有価証券 5,400株
C & F ロジホールディングス	17,800	1,489.00	26,504,200	
九州旅客鉄道	156,700	3,660.00	573,522,000	貸付有価証券 2,600株
S Gホールディングス	184,400	2,534.00	467,269,600	貸付有価証券 4,300株
日本郵船	146,900	1,983.00	291,302,700	貸付有価証券 2,900株
商船三井	111,200	2,988.00	332,265,600	
川崎汽船	54,100	1,822.00	98,570,200	貸付有価証券 6,200株（600株）
N S ユナイテッド海運	9,700	2,259.00	21,912,300	貸付有価証券 100株
明治海運	18,700	366.00	6,844,200	
飯野海運	83,200	370.00	30,784,000	貸付有価証券

				200株
共栄タンカー	1,500	1,850.00	2,775,000	貸付有価証券 700株(700株)
乾汽船	10,100	1,169.00	11,806,900	貸付有価証券 1,200株
日本航空	321,700	3,415.00	1,098,605,500	
ANAホールディングス	321,200	3,645.00	1,170,774,000	貸付有価証券 4,300株
パスコ	3,400	2,074.00	7,051,600	貸付有価証券 1,500株
トランコム	4,900	8,290.00	40,621,000	
日新	15,200	1,932.00	29,366,400	
三菱倉庫	55,700	2,881.00	160,471,700	
三井倉庫ホールディングス	20,100	2,053.00	41,265,300	貸付有価証券 500株
住友倉庫	64,700	1,490.00	96,403,000	
澁澤倉庫	9,600	2,358.00	22,636,800	
東陽倉庫	31,700	340.00	10,778,000	貸付有価証券 100株
日本トランスシティ	38,700	548.00	21,207,600	
ケイヒン	3,400	1,356.00	4,610,400	
中央倉庫	10,700	1,245.00	13,321,500	
川西倉庫	3,200	1,047.00	3,350,400	
安田倉庫	14,400	1,043.00	15,019,200	
ファイズホールディングス	3,700	611.00	2,260,700	
東洋埠頭	5,300	1,422.00	7,536,600	
宇徳	15,000	551.00	8,265,000	
上組	100,600	2,420.00	243,452,000	
サンリツ	4,200	745.00	3,129,000	
キムラユニティー	4,700	1,143.00	5,372,100	
キューソー流通システム	4,400	1,899.00	8,355,600	
近鉄エクスプレス	37,300	1,911.00	71,280,300	
東海運	10,000	291.00	2,910,000	貸付有価証券 100株
エーアイティー	12,400	977.00	12,114,800	
内外トランスライン	6,200	1,522.00	9,436,400	貸付有価証券 2,900株
日本コンセプト	5,600	1,505.00	8,428,000	貸付有価証券

				100株
NEC ネットエスアイ	17,200	3,760.00	64,672,000	
クロスキャット	4,800	1,179.00	5,659,200	貸付有価証券 1,300株
システナ	64,900	1,775.00	115,197,500	
デジタルアーツ	9,000	5,630.00	50,670,000	貸付有価証券 2,300株(400株)
日鉄ソリューションズ	27,300	3,650.00	99,645,000	
キューブシステム	9,700	800.00	7,760,000	
エイジア	3,300	1,450.00	4,785,000	
コア	7,700	1,421.00	10,941,700	
ソリトンシステムズ	8,000	1,278.00	10,224,000	貸付有価証券 200株
ソフトクリエイトホールディングス	7,900	1,825.00	14,417,500	
T I S	60,700	6,500.00	394,550,000	貸付有価証券 400株
ネオス	7,300	817.00	5,964,100	貸付有価証券 3,200株
電算システム	6,900	3,000.00	20,700,000	貸付有価証券 3,200株(100株)
グリー	125,600	496.00	62,297,600	
コーエーテクモホールディングス	37,200	2,820.00	104,904,000	貸付有価証券 100株
三菱総合研究所	7,800	4,205.00	32,799,000	
ボルテージ	3,300	728.00	2,402,400	貸付有価証券 1,500株
電算	2,000	2,270.00	4,540,000	
A G S	10,300	839.00	8,641,700	
ファインデックス	15,300	1,323.00	20,241,900	
ブレインパッド	3,700	5,630.00	20,831,000	貸付有価証券 1,600株
K L a b	35,200	833.00	29,321,600	貸付有価証券 14,600株(1,900株)
ポールトゥウィン・ピットクルーホールディ	22,000	982.00	21,604,000	
イーブクイニシアティブジャパン	2,600	1,919.00	4,989,400	
ネクソン	517,900	1,477.00	764,938,300	貸付有価証券 39,900株

アイスタイル	47,000	694.00	32,618,000	貸付有価証券 19,400株（900株）
エムアップ	5,200	2,639.00	13,722,800	貸付有価証券 2,000株
エイチーム	12,500	1,127.00	14,087,500	貸付有価証券 1,300株（1,300株）
エニグモ	12,900	928.00	11,971,200	貸付有価証券 5,200株（4,800株）
テクノスジャパン	14,100	499.00	7,035,900	
e n i s h	8,100	679.00	5,499,900	貸付有価証券 3,800株（1,400株）
コロプラ	59,600	1,277.00	76,109,200	貸付有価証券 33,800株（2,200株）
オルトプラス	13,400	888.00	11,899,200	貸付有価証券 4,400株（1,600株）
ブロードリーフ	90,200	678.00	61,155,600	貸付有価証券 48,400株
クロス・マーケティング グループ	8,100	378.00	3,061,800	貸付有価証券 1,800株
デジタルハーツホール ディングス	9,600	1,007.00	9,667,200	
システム情報	9,200	1,066.00	9,807,200	
メディアドゥホールディ ングス	5,700	4,225.00	24,082,500	
じげん	45,000	553.00	24,885,000	
ブイキューブ	11,200	653.00	7,313,600	貸付有価証券 5,200株（1,500株）
エンカレッジ・テクノロ ジ	3,000	919.00	2,757,000	貸付有価証券 1,400株
サイバーリンクス	2,800	1,269.00	3,553,200	貸付有価証券 1,300株
ディー・エル・イー	12,900	197.00	2,541,300	貸付有価証券 6,600株（3,500株）
フィックスターズ	19,400	1,555.00	30,167,000	
C A R T A H O L D I N G S	8,800	1,174.00	10,331,200	貸付有価証券 1,400株
オブティム	4,800	3,390.00	16,272,000	貸付有価証券 700株（700株）
セレス	6,000	1,266.00	7,596,000	貸付有価証券 800株
S H I F T	4,800	7,950.00	38,160,000	貸付有価証券 100株

ティーガイア	16,100	2,655.00	42,745,500	
セック	2,700	3,690.00	9,963,000	
日本アジアグループ	19,200	393.00	7,545,600	
豆蔵ホールディングス	12,400	1,489.00	18,463,600	貸付有価証券 200株
テクマトリックス	12,800	2,389.00	30,579,200	
プロシップ	5,200	1,398.00	7,269,600	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	43,900	2,403.00	105,491,700	貸付有価証券 1,600株
GMOペイメントゲート ウェイ	30,000	7,550.00	226,500,000	貸付有価証券 11,700株
ザッパラス	9,400	406.00	3,816,400	
システムリサーチ	4,800	1,827.00	8,769,600	
インターネットイニシア ティブ	26,900	3,005.00	80,834,500	
さくらインターネット	19,500	696.00	13,572,000	貸付有価証券 500株
ヴィンクス	5,100	1,258.00	6,415,800	
GMOクラウド	3,400	2,594.00	8,819,600	貸付有価証券 1,100株
SRAホールディングス	9,700	2,665.00	25,850,500	
システムインテグレータ	5,700	879.00	5,010,300	貸付有価証券 300株
朝日ネット	12,900	642.00	8,281,800	
eBASE	10,900	1,166.00	12,709,400	貸付有価証券 100株
アバント	13,000	1,033.00	13,429,000	貸付有価証券 5,200株
アドソル日進	6,400	2,337.00	14,956,800	
フリービット	10,800	970.00	10,476,000	貸付有価証券 6,100株(5,800株)
コムチュア	20,400	2,408.00	49,123,200	貸付有価証券 1,800株(700株)
サイバーコム	3,200	2,253.00	7,209,600	
アステリア	11,100	637.00	7,070,700	
アイル	6,500	1,983.00	12,889,500	貸付有価証券 3,000株(2,100株)
マークラインズ	9,100	2,051.00	18,664,100	
メディカル・データ・ビ ジョン	13,800	895.00	12,351,000	貸付有価証券 6,000株

g u m i	23,300	840.00	19,572,000	貸付有価証券 5,500株（2,800株）
ショーケース	4,300	714.00	3,070,200	
モバイルファクトリー	4,100	1,359.00	5,571,900	貸付有価証券 1,300株（100株）
テラスカイ	6,500	2,493.00	16,204,500	貸付有価証券 1,100株
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	8,000	1,741.00	13,928,000	
P C Iホールディングス	3,700	2,150.00	7,955,000	
パイブドHD	2,300	1,920.00	4,416,000	貸付有価証券 600株
アイピーシー	3,300	1,242.00	4,098,600	
ネオジャパン	3,400	1,058.00	3,597,200	貸付有価証券 100株
P R T I M E S	1,600	2,399.00	3,838,400	貸付有価証券 700株（700株）
ランドコンピュータ	2,800	1,100.00	3,080,000	
ダブルスタンダード	2,300	4,930.00	11,339,000	貸付有価証券 200株
オープンドア	9,000	1,573.00	14,157,000	貸付有価証券 4,000株（2,100株）
マイネット	5,900	723.00	4,265,700	貸付有価証券 800株（100株）
アカツキ	6,400	5,810.00	37,184,000	貸付有価証券 1,200株
ベネフィットジャパン	1,400	2,265.00	3,171,000	貸付有価証券 600株
U b i c o mホールディングス	4,000	1,218.00	4,872,000	貸付有価証券 300株（300株）
L I N E	41,600	5,340.00	222,144,000	貸付有価証券 19,500株（8,400株）
カナミックネットワーク	11,100	784.00	8,702,400	
ノムラシステムコーポレーション	4,000	586.00	2,344,000	貸付有価証券 1,200株
チェンジ	3,600	2,883.00	10,378,800	貸付有価証券 1,600株
シンクロ・フード	7,700	576.00	4,435,200	貸付有価証券 100株
オークネット	11,200	1,436.00	16,083,200	貸付有価証券 200株

セグエグループ	3,000	931.00	2,793,000	
エイトレッド	2,300	1,704.00	3,919,200	
A O I T Y O H o l d i n g s	18,400	728.00	13,395,200	
マクロミル	32,500	1,004.00	32,630,000	貸付有価証券 2,500株
ピーグリー	3,500	1,388.00	4,858,000	貸付有価証券 500株
オロ	4,800	3,845.00	18,456,000	貸付有価証券 1,600株(1,000株)
テモナ	2,400	467.00	1,120,800	貸付有価証券 1,100株
ニーズウェル	2,200	745.00	1,639,000	
サインポスト	2,800	2,069.00	5,793,200	貸付有価証券 1,500株(1,200株)
ソルクシーズ	7,700	966.00	7,438,200	
フェイス	6,400	781.00	4,998,400	
プロトコーポレーション	16,300	1,209.00	19,706,700	
ハイマックス	2,100	2,036.00	4,275,600	
野村総合研究所	304,300	2,364.00	719,365,200	貸付有価証券 1,600株
サイバネットシステム	12,900	867.00	11,184,300	
C E ホールディングス	10,400	494.00	5,137,600	貸付有価証券 2,200株
日本システム技術	2,900	1,429.00	4,144,100	
インテージホールディング ス	22,700	929.00	21,088,300	
東邦システムサイエンス	4,800	922.00	4,425,600	
ソースネクスト	86,300	470.00	40,561,000	貸付有価証券 39,900株(16,800株)
インフォコム	19,900	2,620.00	52,138,000	
ラクスル	9,600	3,725.00	35,760,000	貸付有価証券 4,200株
F I G	19,700	307.00	6,047,900	貸付有価証券 4,600株
システムサポート	1,500	2,323.00	3,484,500	貸付有価証券 300株
イーソル	6,500	2,026.00	13,169,000	貸付有価証券 3,000株
アルテリア・ネットワー	20,200	1,696.00	34,259,200	

クス				
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	4,100	1,525.00	6,252,500	
フォーカスシステムズ	11,300	923.00	10,429,900	
クレスコ	5,500	3,655.00	20,102,500	
フジ・メディア・ホールディングス	175,400	1,562.00	273,974,800	
オービック	63,100	14,910.00	940,821,000	貸付有価証券 600株
ジャストシステム	29,600	6,240.00	184,704,000	
TDCソフト	15,900	1,079.00	17,156,100	
Zホールディングス	2,500,000	449.00	1,122,500,000	貸付有価証券 8,500株
トレンドマイクロ	80,900	5,790.00	468,411,000	貸付有価証券 1,400株
IDホールディングス	6,900	1,521.00	10,494,900	
日本オラクル	36,900	10,030.00	370,107,000	
アルファシステムズ	5,700	2,893.00	16,490,100	
フューチャー	22,000	1,864.00	41,008,000	
CAC Holdings	11,800	1,644.00	19,399,200	
SBテクノロジー	6,500	2,016.00	13,104,000	
トーセ	4,900	879.00	4,307,100	
オービックビジネスコンサルタント	18,600	5,200.00	96,720,000	貸付有価証券 400株
伊藤忠テクノソリューションズ	82,900	3,115.00	258,233,500	
アイティフォー	22,000	912.00	20,064,000	
東計電算	2,700	3,785.00	10,219,500	貸付有価証券 1,200株
エクスネット	2,900	964.00	2,795,600	
大塚商会	98,500	4,565.00	449,652,500	貸付有価証券 600株
サイボウズ	21,300	1,416.00	30,160,800	
ソフトブレーン	10,700	633.00	6,773,100	貸付有価証券 3,300株
電通国際情報サービス	11,300	4,355.00	49,211,500	貸付有価証券 300株
デジタルガレージ	32,700	4,545.00	148,621,500	貸付有価証券 800株

E Mシステムズ	12,700	1,987.00	25,234,900	貸付有価証券 3,000株(2,700株)
ウェザーニューズ	6,100	3,390.00	20,679,000	
C I J	13,500	947.00	12,784,500	
ビジネスエンジニアリン グ	2,100	3,210.00	6,741,000	
日本エンタープライズ	18,500	239.00	4,421,500	
WOWOW	8,700	2,775.00	24,142,500	貸付有価証券 400株
スカラ	12,900	781.00	10,074,900	
インテリジェント ウェ イブ	6,800	781.00	5,310,800	
I M A G I C A G R O U P	15,400	590.00	9,086,000	貸付有価証券 700株(700株)
ネットワンシステムズ	69,400	2,813.00	195,222,200	貸付有価証券 900株
システムソフト	43,100	102.00	4,396,200	貸付有価証券 200株
アルゴグラフィックス	15,500	3,410.00	52,855,000	
マーベラス	27,800	736.00	20,460,800	
エイベックス	31,300	1,261.00	39,469,300	
日本ユニシス	56,800	3,510.00	199,368,000	
兼松エレクトロニクス	9,900	3,685.00	36,481,500	
東京放送ホールディング ス	110,700	1,878.00	207,894,600	
日本テレビホールディン グス	152,000	1,470.00	223,440,000	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	18,100	775.00	14,027,500	
テレビ朝日ホールディン グス	50,000	2,055.00	102,750,000	貸付有価証券 8,100株
スカパーJ S A Tホール ディングス	119,800	491.00	58,821,800	
テレビ東京ホールディン グス	14,900	2,455.00	36,579,500	貸付有価証券 700株
日本BS放送	6,200	1,168.00	7,241,600	
ビジョン	16,900	1,785.00	30,166,500	貸付有価証券 2,800株
スマートバリュー	5,300	812.00	4,303,600	貸付有価証券 100株
U S E N - N E X T H	6,900	1,458.00	10,060,200	貸付有価証券

OLDINGS				1,600株(500株)
ワイヤレスゲート	8,500	691.00	5,873,500	貸付有価証券 4,400株(800株)
コネクシオ	10,300	1,626.00	16,747,800	
日本通信	140,700	250.00	35,175,000	貸付有価証券 72,200株(31,700株)
ク Robbins	3,300	733.00	2,418,900	
日本電信電話	1,216,800	5,550.00	6,753,240,000	
KDDI	1,356,700	3,274.00	4,441,835,800	貸付有価証券 500株
ソフトバンク	1,654,400	1,434.50	2,373,236,800	貸付有価証券 1,500株
光通信	18,800	27,610.00	519,068,000	
NTTドコモ	1,344,800	3,050.00	4,101,640,000	
エムティーアイ	17,600	704.00	12,390,400	貸付有価証券 8,300株(8,300株)
GMOインターネット	71,800	2,092.00	150,205,600	
ファイバーゲート	3,400	1,480.00	5,032,000	貸付有価証券 2,000株(800株)
アイドママーケティング コミュニケーション	5,500	670.00	3,685,000	
KADOKAWA	49,000	2,058.00	100,842,000	
学研ホールディングス	6,100	7,630.00	46,543,000	貸付有価証券 300株
ゼンリン	36,300	1,851.00	67,191,300	
昭文社	8,400	394.00	3,309,600	
インプレスホールディング ス	15,100	188.00	2,838,800	貸付有価証券 100株
アイネット	9,400	1,513.00	14,222,200	
松竹	12,000	16,670.00	200,040,000	貸付有価証券 5,100株
東宝	108,900	4,520.00	492,228,000	貸付有価証券 33,500株
東映	6,800	16,370.00	111,316,000	貸付有価証券 2,300株
エヌ・ティ・ティ・デー タ	484,700	1,492.00	723,172,400	貸付有価証券 200株
ピー・シー・エー	2,300	5,080.00	11,684,000	貸付有価証券 1,200株(900株)
ビジネスブレイン太田昭 和	3,100	2,323.00	7,201,300	

DT S	40,700	2,548.00	103,703,600	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	77,600	5,530.00	429,128,000	
シーイーシー	19,500	2,081.00	40,579,500	
カブコン	85,800	2,997.00	257,142,600	
アイ・エス・ビー	3,500	1,962.00	6,867,000	
ジャステック	11,600	1,107.00	12,841,200	
S C S K	42,000	5,720.00	240,240,000	
日本システムウエア	6,000	2,510.00	15,060,000	
アイネス	17,900	1,348.00	24,129,200	
T K C	15,400	5,180.00	79,772,000	
富士ソフト	23,300	4,260.00	99,258,000	
N S D	29,900	3,595.00	107,490,500	貸付有価証券 8,000株
コナミホールディングス	66,100	4,535.00	299,763,500	貸付有価証券 100株
福井コンピュータホールディングス	7,200	3,585.00	25,812,000	貸付有価証券 200株
J B C Cホールディングス	12,300	1,895.00	23,308,500	
ミロク情報サービス	16,000	3,330.00	53,280,000	貸付有価証券 7,000株(5,400株)
ソフトバンクグループ	1,444,500	4,701.00	6,790,594,500	貸付有価証券 600株
ハウスイ	1,400	852.00	1,192,800	
高千穂交易	7,000	1,138.00	7,966,000	
伊藤忠食品	4,500	5,280.00	23,760,000	
エレマテック	17,100	1,169.00	19,989,900	
J A L U X	5,200	2,458.00	12,781,600	
あらた	14,500	4,440.00	64,380,000	貸付有価証券 100株
トーメンデバイス	2,700	3,240.00	8,748,000	
東京エレクトロン デバイス	6,600	2,645.00	17,457,000	
フィールズ	14,000	607.00	8,498,000	貸付有価証券 2,200株
双日	1,009,200	353.00	356,247,600	
アルフレッサ ホールディングス	203,100	2,290.00	465,099,000	貸付有価証券 1,600株

横浜冷凍	51,200	1,014.00	51,916,800	
神栄	2,500	729.00	1,822,500	
ラサ商事	9,700	973.00	9,438,100	
ラクーンホールディングス	8,800	828.00	7,286,400	
アルコニックス	19,400	1,445.00	28,033,000	
神戸物産	63,000	3,715.00	234,045,000	
あい ホールディングス	26,100	1,980.00	51,678,000	
ディーブイエックス	6,500	874.00	5,681,000	
ダイワボウホールディングス	15,500	6,460.00	100,130,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	43,600	1,897.00	82,709,200	貸付有価証券 200株
ラクト・ジャパン	6,800	3,545.00	24,106,000	貸付有価証券 3,100株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	34,400	1,062.00	36,532,800	貸付有価証券 16,000株
八洲電機	14,100	915.00	12,901,500	
メディアスホールディングス	10,400	829.00	8,621,600	
レスターホールディングス	19,100	2,029.00	38,753,900	
ジュテックホールディングス	4,200	1,150.00	4,830,000	
大光	7,700	653.00	5,028,100	
OCHIホールディングス	5,300	1,480.00	7,844,000	
TOKAIホールディングス	96,500	1,105.00	106,632,500	貸付有価証券 1,500株
黒谷	4,100	519.00	2,127,900	
Cominix	3,200	826.00	2,643,200	
三洋貿易	9,200	2,579.00	23,726,800	
ビューティガレージ	2,900	2,565.00	7,438,500	
ウイン・パートナーズ	13,200	1,456.00	19,219,200	
ミタチ産業	5,500	765.00	4,207,500	
シップヘルスケアホールディングス	29,300	5,060.00	148,258,000	貸付有価証券 900株
明治電機工業	5,700	1,663.00	9,479,100	
デリカフーズホールディングス	6,400	712.00	4,556,800	

スターティアホールディングス	4,100	730.00	2,993,000	貸付有価証券 200株
コメダホールディングス	39,800	2,125.00	84,575,000	
アセンテック	1,500	2,141.00	3,211,500	貸付有価証券 600株
富士興産	5,500	688.00	3,784,000	貸付有価証券 100株
協栄産業	2,000	1,537.00	3,074,000	
小野建	16,400	1,411.00	23,140,400	
南陽	4,000	1,912.00	7,648,000	
佐鳥電機	13,400	944.00	12,649,600	
エコートレーディング	4,200	545.00	2,289,000	
伯東	11,100	1,365.00	15,151,500	
コンドーテック	14,100	1,180.00	16,638,000	
中山福	10,500	539.00	5,659,500	
ナガイレーベン	26,400	2,654.00	70,065,600	
三菱食品	20,100	3,125.00	62,812,500	
松田産業	13,300	1,622.00	21,572,600	
第一興商	27,200	5,730.00	155,856,000	
メディカルホールディングス	197,200	2,429.00	478,998,800	貸付有価証券 1,100株
S P K	3,900	2,914.00	11,364,600	
萩原電気ホールディングス	6,800	2,832.00	19,257,600	
アズワン	11,900	10,370.00	123,403,000	
スズデン	6,300	1,494.00	9,412,200	
尾家産業	5,300	1,478.00	7,833,400	
シモジマ	11,200	1,231.00	13,787,200	
ドウシシャ	17,200	1,778.00	30,581,600	
小津産業	4,000	1,747.00	6,988,000	
高速	10,900	1,287.00	14,028,300	
たけびし	6,400	1,525.00	9,760,000	
リックス	4,100	1,750.00	7,175,000	
丸文	16,200	618.00	10,011,600	
ハビネット	15,200	1,403.00	21,325,600	
橋本総業ホールディングス	3,700	1,949.00	7,211,300	
日本ライフライン	54,100	1,516.00	82,015,600	貸付有価証券

				2,200株
タカショー	8,900	508.00	4,521,200	
エクセル	5,200	1,593.00	8,283,600	
マルカ	6,400	2,335.00	14,944,000	
I D O M	49,300	618.00	30,467,400	貸付有価証券 11,800株(7,900株)
進和	10,800	2,411.00	26,038,800	
エスケイジャパン	3,900	449.00	1,751,100	
ダイトロン	7,700	1,935.00	14,899,500	
シークス	23,200	1,556.00	36,099,200	貸付有価証券 600株
田中商事	5,600	716.00	4,009,600	
オーハシテクニカ	10,300	1,527.00	15,728,100	
白銅	6,500	1,520.00	9,880,000	
伊藤忠商事	1,278,100	2,539.50	3,245,734,950	
丸紅	1,902,000	815.10	1,550,320,200	貸付有価証券 1,700株
高島	2,900	1,825.00	5,292,500	
長瀬産業	102,700	1,650.00	169,455,000	
蝶理	11,700	2,240.00	26,208,000	
豊田通商	203,900	3,920.00	799,288,000	貸付有価証券 100株
三共生興	27,600	603.00	16,642,800	
兼松	68,100	1,473.00	100,311,300	
ツカモトコーポレーション	3,300	1,100.00	3,630,000	
三井物産	1,606,100	1,959.50	3,147,152,950	貸付有価証券 3,200株
日本紙パルプ商事	10,400	4,225.00	43,940,000	
日立ハイテクノロジーズ	63,500	7,780.00	494,030,000	
カメイ	23,800	1,353.00	32,201,400	
東都水産	2,300	2,705.00	6,221,500	
O U Gホールディングス	2,900	2,700.00	7,830,000	
スターゼン	6,700	4,415.00	29,580,500	貸付有価証券 300株(300株)
山善	71,400	1,108.00	79,111,200	
椿本興業	3,400	4,215.00	14,331,000	
住友商事	1,152,900	1,639.50	1,890,179,550	

内田洋行	7,800	7,390.00	57,642,000	
三菱商事	1,282,200	2,922.00	3,746,588,400	
第一実業	8,900	3,745.00	33,330,500	
キャノンマーケティング ジャパン	52,200	2,599.00	135,667,800	
西華産業	10,300	1,365.00	14,059,500	
佐藤商事	15,100	1,020.00	15,402,000	
菱洋エレクトロ	18,500	2,029.00	37,536,500	
東京産業	16,500	600.00	9,900,000	
ユアサ商事	17,300	3,690.00	63,837,000	
神鋼商事	4,600	2,808.00	12,916,800	
小林産業	10,900	286.00	3,117,400	
阪和興業	34,100	2,853.00	97,287,300	
正栄食品工業	11,800	4,060.00	47,908,000	貸付有価証券 2,300株
カナデン	14,800	1,371.00	20,290,800	
菱電商事	13,100	1,640.00	21,484,000	
フルサト工業	10,100	1,748.00	17,654,800	
岩谷産業	40,500	3,775.00	152,887,500	貸付有価証券 9,000株（5,700株）
すてきナイスグループ	7,800	1,278.00	9,968,400	貸付有価証券 100株
昭光通商	5,800	722.00	4,187,600	
ニチモウ	2,800	2,020.00	5,656,000	
極東貿易	5,200	2,238.00	11,637,600	
イワキ	23,900	460.00	10,994,000	
三愛石油	45,000	1,213.00	54,585,000	
稲畑産業	40,200	1,668.00	67,053,600	貸付有価証券 3,200株
G S Iクレオス	4,500	1,294.00	5,823,000	
明和産業	16,800	618.00	10,382,400	
クワザワ	6,500	630.00	4,095,000	
ワキタ	39,000	1,145.00	44,655,000	
東邦ホールディングス	58,600	2,444.00	143,218,400	貸付有価証券 200株
サンゲツ	50,200	2,088.00	104,817,600	
ミツウロコグループホー ルディングス	26,900	1,302.00	35,023,800	貸付有価証券 100株

シナネンホールディングス	7,500	2,024.00	15,180,000	
伊藤忠エネクス	40,400	925.00	37,370,000	
サンリオ	51,300	2,149.00	110,243,700	
サンワテクノス	12,900	1,119.00	14,435,100	
リョーサン	20,200	2,842.00	57,408,400	
新光商事	28,600	895.00	25,597,000	
トーホー	8,200	1,937.00	15,883,400	貸付有価証券 3,800株
三信電気	9,800	1,783.00	17,473,400	
東陽テクニカ	21,000	1,344.00	28,224,000	
モスフードサービス	24,000	3,060.00	73,440,000	貸付有価証券 1,100株
加賀電子	18,200	2,573.00	46,828,600	
ソーダニッカ	18,800	646.00	12,144,800	
立花エレテック	13,500	1,895.00	25,582,500	
フォーバル	8,000	1,059.00	8,472,000	
PALTAC	29,300	5,380.00	157,634,000	
三谷産業	24,000	344.00	8,256,000	
太平洋興発	7,200	792.00	5,702,400	
西本Wismettac ホールディングス	3,300	3,735.00	12,325,500	貸付有価証券 1,500株
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,500	1,536.00	2,304,000	
国際紙パルプ商事	43,200	299.00	12,916,800	
ヤマタネ	9,100	1,597.00	14,532,700	
丸紅建材リース	1,800	1,741.00	3,133,800	
日鉄物産	13,000	5,260.00	68,380,000	
泉州電業	5,600	3,455.00	19,348,000	
トラスコ中山	38,000	2,851.00	108,338,000	貸付有価証券 17,800株
オートバックスセブン	67,800	1,724.00	116,887,200	
モリト	13,300	787.00	10,467,100	
加藤産業	28,600	3,750.00	107,250,000	
北恵	3,500	963.00	3,370,500	
イノテック	10,900	1,082.00	11,793,800	
イエローハット	34,500	1,958.00	67,551,000	
J Kホールディングス	16,500	663.00	10,939,500	

日伝	16,500	2,085.00	34,402,500	
北沢産業	13,700	277.00	3,794,900	
杉本商事	9,800	2,085.00	20,433,000	
因幡電機産業	52,000	2,798.00	145,496,000	
東テク	6,000	2,660.00	15,960,000	
ミスミグループ本社	228,900	2,750.00	629,475,000	
アルテック	14,500	224.00	3,248,000	
タキヒヨー	5,500	1,980.00	10,890,000	
蔵王産業	3,500	1,470.00	5,145,000	
スズケン	77,400	4,545.00	351,783,000	
ジェコス	12,600	1,085.00	13,671,000	
グローセル	18,300	445.00	8,143,500	
ローソン	46,200	6,210.00	286,902,000	貸付有価証券 600株
サンエー	15,200	4,860.00	73,872,000	
カワチ薬品	14,200	2,234.00	31,722,800	
エービーシー・マート	28,500	7,500.00	213,750,000	貸付有価証券 800株
ハードオフコーポレーション	7,200	816.00	5,875,200	
アスクル	19,100	3,360.00	64,176,000	貸付有価証券 4,800株
ゲオホールディングス	32,900	1,339.00	44,053,100	貸付有価証券 5,200株
アダストリア	25,300	2,641.00	66,817,300	貸付有価証券 1,100株
ジーフット	11,000	620.00	6,820,000	
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,600	681.00	1,770,600	
くら寿司	9,500	5,290.00	50,255,000	貸付有価証券 2,000株
キャンドゥ	8,700	1,653.00	14,381,100	
パルグループホールディングス	9,300	3,760.00	34,968,000	
エディオン	83,900	1,215.00	101,938,500	貸付有価証券 29,300株（1,500株）
サーラコーポレーション	37,100	634.00	23,521,400	貸付有価証券 1,000株
ワッツ	8,000	602.00	4,816,000	貸付有価証券 200株

ハローズ	6,900	2,738.00	18,892,200	
フジオフードシステム	7,700	3,780.00	29,106,000	貸付有価証券 1,900株
あみやき亭	3,900	3,660.00	14,274,000	
ひらまつ	33,600	285.00	9,576,000	
大黒天物産	4,400	3,195.00	14,058,000	
ハニーズホールディングス	16,100	1,724.00	27,756,400	
ファーマライズホールディングス	4,300	650.00	2,795,000	
アルペン	14,000	1,795.00	25,130,000	貸付有価証券 6,600株
ハブ	5,200	1,013.00	5,267,600	貸付有価証券 200株
クオールホールディングス	26,900	1,563.00	42,044,700	
ジンズホールディングス	9,700	7,330.00	71,101,000	
ビックカメラ	108,400	1,245.00	134,958,000	貸付有価証券 100株
DCMホールディングス	98,600	1,070.00	105,502,000	貸付有価証券 46,200株(1,800株)
ペッパーフードサービス	14,600	1,332.00	19,447,200	貸付有価証券 6,900株(2,900株)
MonotaRO	129,900	2,910.00	378,009,000	貸付有価証券 17,100株(12,800株)
東京一番フーズ	4,600	627.00	2,884,200	
DDホールディングス	7,200	1,548.00	11,145,600	貸付有価証券 100株
きちりホールディングス	4,900	851.00	4,169,900	貸付有価証券 2,300株
アークランドサービスホールディングス	13,300	1,919.00	25,522,700	貸付有価証券 6,200株
J.フロントリテイリング	218,200	1,436.00	313,335,200	貸付有価証券 5,700株
ドトール・日レスホールディングス	29,200	2,168.00	63,305,600	
マツモトキヨシホールディングス	75,500	4,245.00	320,497,500	
ブロンコビリー	9,600	2,836.00	27,225,600	貸付有価証券 4,500株
ZOZO	125,700	2,073.00	260,576,100	貸付有価証券

				33,600株
トレジャー・ファクトリー	5,300	1,046.00	5,543,800	貸付有価証券 100株(100株)
物語コーポレーション	4,500	8,360.00	37,620,000	貸付有価証券 2,100株
ココカラファイン	19,100	6,380.00	121,858,000	
三越伊勢丹ホールディングス	319,300	969.00	309,401,700	貸付有価証券 100株
H a m e e	5,600	1,541.00	8,629,600	貸付有価証券 700株
ウエルシアホールディングス	54,300	6,860.00	372,498,000	貸付有価証券 4,100株
クリエイティブSDホールディングス	26,900	2,776.00	74,674,400	
丸善CHIホールディングス	21,300	373.00	7,944,900	
ミサワ	3,700	792.00	2,930,400	貸付有価証券 1,700株
ティールライフ	2,400	885.00	2,124,000	
エー・ピーカンパニー	3,400	556.00	1,890,400	貸付有価証券 1,000株
チムニー	5,600	2,307.00	12,919,200	
シュッピン	12,400	1,171.00	14,520,400	貸付有価証券 500株(500株)
ネクステージ	26,100	1,244.00	32,468,400	
ジョイフル本田	53,500	1,438.00	76,933,000	
鳥貴族	6,000	2,299.00	13,794,000	貸付有価証券 2,600株(500株)
キリン堂ホールディングス	7,200	2,109.00	15,184,800	
ホットランド	12,200	1,352.00	16,494,400	貸付有価証券 5,700株
すかいらーくホールディングス	204,800	2,235.00	457,728,000	貸付有価証券 104,000株
SFPホールディングス	7,800	2,316.00	18,064,800	
綿半ホールディングス	6,800	1,900.00	12,920,000	
ヨシックス	3,000	2,724.00	8,172,000	貸付有価証券 400株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	53,100	960.00	50,976,000	
ゴルフダイジェスト・オ	8,400	693.00	5,821,200	貸付有価証券

ンライン				3,900株
B E E N O S	6,400	1,401.00	8,966,400	貸付有価証券 700株(700株)
あさひ	13,600	1,383.00	18,808,800	貸付有価証券 2,100株(1,500株)
日本調剤	5,500	3,900.00	21,450,000	
コスモス薬品	8,100	22,750.00	184,275,000	貸付有価証券 4,200株
トーエル	8,800	786.00	6,916,800	
オンリー	3,100	803.00	2,489,300	
セブン & アイ・ホール ディングス	714,800	4,022.00	2,874,925,600	貸付有価証券 100株
クリエイト・レストラン ツ・ホールディング	49,100	1,875.00	92,062,500	貸付有価証券 2,300株
ツルハホールディングス	39,700	13,870.00	550,639,000	
サンマルクホールディ ングス	14,400	2,339.00	33,681,600	
フェリシモ	4,000	1,034.00	4,136,000	
トリドールホールディ ングス	22,600	2,812.00	63,551,200	貸付有価証券 8,600株
T O K Y O B A S E	16,500	621.00	10,246,500	貸付有価証券 1,400株
ウイルプラスホールディ ングス	2,800	906.00	2,536,800	貸付有価証券 1,300株
ジャパンミート	9,200	2,231.00	20,525,200	貸付有価証券 500株
サツドラホールディ ングス	2,700	1,789.00	4,830,300	貸付有価証券 200株
デファクトスタンダード	1,600	401.00	641,600	
アレンザホールディ ングス	9,100	924.00	8,408,400	
串カツ田中ホールディ ングス	2,800	2,230.00	6,244,000	貸付有価証券 1,300株
パロックジャパンリミ テッド	12,700	955.00	12,128,500	貸付有価証券 1,700株
クスリのアオキホール ディングス	18,200	6,790.00	123,578,000	貸付有価証券 4,500株
力の源ホールディングス	8,200	945.00	7,749,000	
スシローグローバルホー ルディングス	20,100	9,210.00	185,121,000	貸付有価証券 300株
L I X I L ビバ	18,000	1,957.00	35,226,000	

メディカルシステムネットワーク	17,700	536.00	9,487,200	貸付有価証券 7,300株
はるやまホールディングス	8,500	861.00	7,318,500	
ノジマ	32,500	2,274.00	73,905,000	
カップ・クリエイト	25,600	1,503.00	38,476,800	貸付有価証券 400株(400株)
ライトオン	13,700	602.00	8,247,400	貸付有価証券 7,200株
ジーンズメイト	5,600	301.00	1,685,600	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
良品計画	242,600	2,544.00	617,174,400	貸付有価証券 62,200株
三城ホールディングス	19,400	310.00	6,014,000	
アドヴァン	27,900	1,265.00	35,293,500	
アルビス	6,900	2,284.00	15,759,600	
コナカ	21,500	417.00	8,965,500	
ハウス オブ ローゼ	2,200	1,678.00	3,691,600	
G - 7ホールディングス	5,400	4,835.00	26,109,000	貸付有価証券 100株(100株)
イオン北海道	18,400	794.00	14,609,600	
コジマ	31,400	519.00	16,296,600	貸付有価証券 2,900株
ヒマラヤ	6,400	838.00	5,363,200	
コーナン商事	26,000	2,569.00	66,794,000	
エコス	6,700	1,709.00	11,450,300	
ワタミ	21,600	1,292.00	27,907,200	
マルシェ	4,800	779.00	3,739,200	貸付有価証券 1,100株
パン・パシフィック・インターナショナルホ	438,000	1,833.00	802,854,000	貸付有価証券 400株
西松屋チェーン	40,100	935.00	37,493,500	貸付有価証券 18,800株
ゼンショーホールディングス	87,500	2,485.00	217,437,500	
幸楽苑ホールディングス	11,600	2,089.00	24,232,400	貸付有価証券 5,100株
ハークスレイ	3,800	1,083.00	4,115,400	
サイゼリヤ	30,100	2,707.00	81,480,700	
V Tホールディングス	75,600	473.00	35,758,800	貸付有価証券

				800株
魚力	5,100	1,579.00	8,052,900	
ポブラ	4,800	530.00	2,544,000	貸付有価証券 700株
フジ・コーポレーション	4,800	2,399.00	11,515,200	
ユナイテッドアローズ	19,100	3,185.00	60,833,500	貸付有価証券 1,100株
ハイデイ日高	26,400	2,112.00	55,756,800	貸付有価証券 1,500株
京都きもの友禅	11,600	340.00	3,944,000	貸付有価証券 2,900株
コロワイド	60,700	2,248.00	136,453,600	貸付有価証券 30,900株(4,500株)
ピーシーデポコーポレーション	24,200	535.00	12,947,000	
壱番屋	12,900	5,880.00	75,852,000	
トップカルチャー	6,600	335.00	2,211,000	貸付有価証券 3,700株(2,200株)
P L A N T	4,700	639.00	3,003,300	
スギホールディングス	36,500	5,800.00	211,700,000	
薬王堂ホールディングス	8,000	2,415.00	19,320,000	
ヴィア・ホールディングス	22,400	657.00	14,716,800	貸付有価証券 1,200株
スクロール	28,100	403.00	11,324,300	
ヨンドシーホールディングス	18,600	2,600.00	48,360,000	
ファミリーマート	146,000	2,673.00	390,258,000	貸付有価証券 17,500株
木曽路	23,900	2,979.00	71,198,100	
S R Sホールディングス	21,500	1,041.00	22,381,500	
千趣会	33,000	533.00	17,589,000	貸付有価証券 15,500株
タカキュー	14,100	187.00	2,636,700	貸付有価証券 1,900株(300株)
ケーヨー	37,500	551.00	20,662,500	
上新電機	21,600	2,620.00	56,592,000	
日本瓦斯	28,900	3,525.00	101,872,500	
ロイヤルホールディングス	31,900	2,549.00	81,313,100	貸付有価証券 17,100株
東天紅	1,300	1,231.00	1,600,300	

いなげや	22,600	1,467.00	33,154,200	
島忠	34,400	3,000.00	103,200,000	貸付有価証券 8,100株
チヨダ	19,200	1,617.00	31,046,400	貸付有価証券 100株
ライフコーポレーション	13,900	2,527.00	35,125,300	
リンガーハット	22,500	2,539.00	57,127,500	貸付有価証券 100株
MrMaxHD	25,100	487.00	12,223,700	
テンアライド	16,800	438.00	7,358,400	貸付有価証券 100株
AOKIホールディングス	36,600	1,146.00	41,943,600	
オークワ	28,700	1,457.00	41,815,900	貸付有価証券 3,900株
コメリ	28,200	2,345.00	66,129,000	
青山商事	37,700	1,538.00	57,982,600	
しまむら	21,300	8,330.00	177,429,000	貸付有価証券 1,200株
はせがわ	9,700	395.00	3,831,500	
高島屋	133,100	1,214.00	161,583,400	貸付有価証券 1,800株
松屋	36,800	862.00	31,721,600	貸付有価証券 200株
エイチ・ツー・オー リテイリング	86,500	1,222.00	105,703,000	
近鉄百貨店	7,000	3,840.00	26,880,000	
パルコ	17,500	1,378.00	24,115,000	貸付有価証券 300株
丸井グループ	167,500	2,650.00	443,875,000	貸付有価証券 7,800株
アクシアル リテイリング	15,200	3,860.00	58,672,000	
井筒屋	9,900	251.00	2,484,900	貸付有価証券 100株
イオン	703,100	2,274.50	1,599,200,950	貸付有価証券 175,100株（115,500 株）
イズミ	37,200	3,885.00	144,522,000	
平和堂	37,100	2,073.00	76,908,300	貸付有価証券 17,400株

フジ	22,100	1,948.00	43,050,800	
ヤオコー	20,700	5,500.00	113,850,000	貸付有価証券 1,300株
ゼビオホールディングス	22,100	1,314.00	29,039,400	
ケーズホールディングス	176,300	1,435.00	252,990,500	
Olympicグループ	9,400	643.00	6,044,200	
日産東京販売ホールディングス	26,900	282.00	7,585,800	
Genky Drug Stores	8,900	2,313.00	20,585,700	貸付有価証券 3,200株(2,400株)
ナルミヤ・インターナショナル	3,000	1,368.00	4,104,000	貸付有価証券 100株
総合メディカルホールディングス	15,900	1,966.00	31,259,400	
ブックオフグループホールディングス	10,700	1,052.00	11,256,400	貸付有価証券 5,200株(400株)
アインホールディングス	24,500	6,850.00	167,825,000	貸付有価証券 100株
元気寿司	4,600	2,968.00	13,652,800	貸付有価証券 2,500株
ヤマダ電機	556,700	574.00	319,545,800	貸付有価証券 4,600株
アークランドサカモト	28,600	1,264.00	36,150,400	
ニトリホールディングス	79,100	16,805.00	1,329,275,500	貸付有価証券 14,500株
グルメ杵屋	13,000	1,218.00	15,834,000	
愛眼	14,600	241.00	3,518,600	
ケーユーホールディングス	9,500	940.00	8,930,000	
吉野家ホールディングス	60,000	2,847.00	170,820,000	貸付有価証券 3,400株
松屋フーズホールディングス	8,800	4,545.00	39,996,000	
サガミホールディングス	24,400	1,375.00	33,550,000	
関西スーパーマーケット	15,200	1,059.00	16,096,800	
王将フードサービス	13,400	6,500.00	87,100,000	
プレナス	20,500	1,943.00	39,831,500	貸付有価証券 100株
ミニストップ	13,500	1,451.00	19,588,500	貸付有価証券 200株
アークス	37,400	2,307.00	86,281,800	貸付有価証券

				500株
パローホールディングス	40,400	2,107.00	85,122,800	
藤久	1,500	750.00	1,125,000	貸付有価証券 700株
ベルク	9,000	5,700.00	51,300,000	
大庄	9,800	1,660.00	16,268,000	
ファーストリテイリング	24,400	67,220.00	1,640,168,000	貸付有価証券 100株
サンドラッグ	68,700	3,980.00	273,426,000	
サックスパーホールディングス	15,500	921.00	14,275,500	
ヤマザワ	4,300	1,687.00	7,254,100	
やまや	3,700	2,295.00	8,491,500	
ベルーナ	39,200	714.00	27,988,800	
島根銀行	3,600	663.00	2,386,800	
じもとホールディングス	123,600	114.00	14,090,400	
めぶきフィナンシャルグループ	950,800	279.00	265,273,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	24,700	1,520.00	37,544,000	
九州フィナンシャルグループ	300,300	468.00	140,540,400	
ゆうちょ銀行	518,400	1,040.00	539,136,000	貸付有価証券 172,600株
富山第一銀行	43,600	345.00	15,042,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,076,200	452.00	486,442,400	貸付有価証券 33,100株
西日本フィナンシャルホールディングス	124,700	859.00	107,117,300	
関西みらいフィナンシャルグループ	107,400	711.00	76,361,400	貸付有価証券 200株
三十三フィナンシャルグループ	17,000	1,736.00	29,512,000	
第四北越フィナンシャルグループ	31,800	3,055.00	97,149,000	貸付有価証券 200株
新生銀行	134,300	1,676.00	225,086,800	貸付有価証券 1,000株
あおぞら銀行	109,000	2,894.00	315,446,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	12,596,300	593.80	7,479,682,940	貸付有価証券 3,200株
りそなホールディングス	2,008,100	477.90	959,670,990	貸付有価証券

				3,400株
三井住友トラスト・ホールディングス	345,900	4,345.00	1,502,935,500	貸付有価証券 19,000株
三井住友フィナンシャルグループ	1,265,500	4,042.00	5,115,151,000	
千葉銀行	629,400	635.00	399,669,000	貸付有価証券 29,200株
群馬銀行	359,600	389.00	139,884,400	
武蔵野銀行	27,300	1,895.00	51,733,500	
千葉興業銀行	50,200	381.00	19,126,200	
筑波銀行	76,100	240.00	18,264,000	
七十七銀行	61,800	1,828.00	112,970,400	
青森銀行	14,200	2,944.00	41,804,800	
秋田銀行	11,700	2,201.00	25,751,700	
山形銀行	20,600	1,603.00	33,021,800	
岩手銀行	12,000	2,911.00	34,932,000	
東邦銀行	163,600	275.00	44,990,000	貸付有価証券 700株
東北銀行	8,800	1,062.00	9,345,600	
みちのく銀行	11,800	1,508.00	17,794,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	154,100	2,098.00	323,301,800	
静岡銀行	453,100	819.00	371,088,900	貸付有価証券 3,300株
十六銀行	22,900	2,563.00	58,692,700	
スルガ銀行	187,200	503.00	94,161,600	貸付有価証券 62,000株
八十二銀行	441,600	477.00	210,643,200	
山梨中央銀行	21,200	1,174.00	24,888,800	
大垣共立銀行	36,100	2,367.00	85,448,700	
福井銀行	15,600	1,980.00	30,888,000	
北國銀行	18,900	3,580.00	67,662,000	
清水銀行	7,500	2,176.00	16,320,000	
富山銀行	3,500	2,397.00	8,389,500	
滋賀銀行	36,700	2,770.00	101,659,000	
南都銀行	30,400	2,769.00	84,177,600	
百五銀行	164,700	353.00	58,139,100	
京都銀行	65,500	4,705.00	308,177,500	

紀陽銀行	64,800	1,664.00	107,827,200	
ほくほくフィナンシャルグループ	121,800	1,143.00	139,217,400	
広島銀行	270,100	532.00	143,693,200	
山陰合同銀行	108,500	667.00	72,369,500	
中国銀行	157,500	1,099.00	173,092,500	貸付有価証券 4,600株
鳥取銀行	6,200	1,379.00	8,549,800	
伊予銀行	261,100	613.00	160,054,300	貸付有価証券 200株
百十四銀行	19,400	2,150.00	41,710,000	
四国銀行	27,800	1,053.00	29,273,400	
阿波銀行	29,900	2,462.00	73,613,800	貸付有価証券 800株
大分銀行	10,500	2,772.00	29,106,000	
宮崎銀行	12,200	2,705.00	33,001,000	
佐賀銀行	11,100	1,769.00	19,635,900	
沖縄銀行	16,800	3,675.00	61,740,000	
琉球銀行	42,200	1,213.00	51,188,600	
セブン銀行	611,300	356.00	217,622,800	貸付有価証券 12,300株
みずほフィナンシャルグループ	24,864,500	167.80	4,172,263,100	貸付有価証券 944,600株
高知銀行	6,600	915.00	6,039,000	
山口フィナンシャルグループ	228,400	745.00	170,158,000	
長野銀行	6,000	1,677.00	10,062,000	
名古屋銀行	14,800	3,425.00	50,690,000	
北洋銀行	275,800	242.00	66,743,600	貸付有価証券 300株
愛知銀行	6,600	3,685.00	24,321,000	
中京銀行	7,500	2,255.00	16,912,500	
大光銀行	6,300	1,715.00	10,804,500	
愛媛銀行	25,500	1,178.00	30,039,000	
トマト銀行	7,100	1,091.00	7,746,100	
京葉銀行	78,000	634.00	49,452,000	
栃木銀行	88,400	234.00	20,685,600	
北日本銀行	5,700	2,221.00	12,659,700	
東和銀行	32,100	879.00	28,215,900	

福島銀行	17,200	276.00	4,747,200	貸付有価証券 3,100株
大東銀行	9,500	649.00	6,165,500	
トモニホールディングス	141,500	418.00	59,147,000	
フィデアホールディングス	177,600	137.00	24,331,200	
池田泉州ホールディングス	210,400	206.00	43,342,400	貸付有価証券 200株
F P G	57,500	1,043.00	59,972,500	
マーキュリアインベストメント	8,100	752.00	6,091,200	
S B Iホールディングス	204,400	2,300.00	470,120,000	貸付有価証券 13,200株
日本アジア投資	15,500	286.00	4,433,000	貸付有価証券 7,200株（2,000株）
ジャフコ	28,100	4,325.00	121,532,500	
大和証券グループ本社	1,468,300	552.90	811,823,070	貸付有価証券 1,400株
野村ホールディングス	3,219,700	558.20	1,797,236,540	貸付有価証券 400株
岡三証券グループ	155,900	392.00	61,112,800	
丸三証券	54,400	483.00	26,275,200	貸付有価証券 13,000株
東洋証券	65,400	149.00	9,744,600	貸付有価証券 300株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	210,100	325.00	68,282,500	貸付有価証券 5,500株
光世証券	4,400	621.00	2,732,400	貸付有価証券 800株
水戸証券	52,900	220.00	11,638,000	貸付有価証券 1,700株
いちよし証券	34,200	631.00	21,580,200	
松井証券	104,500	855.00	89,347,500	貸付有価証券 19,100株
だいこう証券ビジネス	8,900	681.00	6,060,900	貸付有価証券 200株
マネックスグループ	138,100	262.00	36,182,200	貸付有価証券 47,000株（32,000株）
極東証券	24,500	738.00	18,081,000	
岩井コスモホールディングス	17,300	1,270.00	21,971,000	

藍澤証券	32,800	739.00	24,239,200	
マネーパートナーズグループ	19,500	240.00	4,680,000	貸付有価証券 4,200株
スパークス・グループ	63,400	250.00	15,850,000	
小林洋行	5,200	260.00	1,352,000	
かんぼ生命保険	64,800	1,848.00	119,750,400	貸付有価証券 1,600株
S O M P Oホールディングス	344,100	4,318.00	1,485,823,800	貸付有価証券 200株
アニコム ホールディングス	15,100	3,655.00	55,190,500	貸付有価証券 7,000株(2,000株)
M S & A Dインシュアランスグループホール	478,400	3,631.00	1,737,070,400	
ソニーフィナンシャルホールディングス	150,400	2,654.00	399,161,600	貸付有価証券 200株
第一生命ホールディングス	1,035,500	1,833.00	1,898,071,500	
東京海上ホールディングス	654,300	6,146.00	4,021,327,800	貸付有価証券 400株
T & Dホールディングス	565,900	1,406.00	795,655,400	
アドバンスクリエイト	4,300	1,894.00	8,144,200	貸付有価証券 600株
全国保証	51,600	4,635.00	239,166,000	貸付有価証券 12,500株(5,900株)
ジェイリース	5,100	325.00	1,657,500	
イントラスト	6,400	730.00	4,672,000	
日本モーゲージサービス	3,700	1,651.00	6,108,700	
C a s a	6,300	1,374.00	8,656,200	貸付有価証券 400株
アルヒ	29,100	2,231.00	64,922,100	貸付有価証券 13,600株(5,800株)
プレミアグループ	9,900	2,331.00	23,076,900	
クレディセゾン	128,200	1,877.00	240,631,400	
芙蓉総合リース	19,200	7,360.00	141,312,000	
みずほリース	28,200	3,400.00	95,880,000	
東京センチュリー	36,800	5,830.00	214,544,000	貸付有価証券 500株
日本証券金融	80,600	525.00	42,315,000	
アイフル	279,100	237.00	66,146,700	貸付有価証券 3,600株

リコーリース	14,400	4,035.00	58,104,000	
イオンフィナンシャルサービス	112,000	1,730.00	193,760,000	貸付有価証券 2,700株
アコム	367,800	489.00	179,854,200	
ジャックス	20,200	2,747.00	55,489,400	
オリエントコーポレーション	494,900	159.00	78,689,100	
日立キャピタル	43,100	2,906.00	125,248,600	貸付有価証券 1,600株
アプラスフィナンシャル	87,800	88.00	7,726,400	貸付有価証券 6,000株
オリックス	1,144,500	1,803.50	2,064,105,750	
三菱UFJリース	464,400	703.00	326,473,200	
九州リースサービス	9,000	594.00	5,346,000	
日本取引所グループ	525,200	1,928.00	1,012,585,600	貸付有価証券 5,300株
イー・ギャランティ	19,600	1,285.00	25,186,000	
アサックス	9,500	686.00	6,517,000	
NECキャピタルソリューション	7,400	2,466.00	18,248,400	
いちご	232,800	459.00	106,855,200	
日本駐車場開発	200,700	156.00	31,309,200	貸付有価証券 8,800株
スター・マイカ・ホールディングス	9,400	1,712.00	16,092,800	貸付有価証券 4,100株
ヒューリック	390,700	1,332.00	520,412,400	貸付有価証券 95,400株
三栄建築設計	7,300	1,631.00	11,906,300	
野村不動産ホールディングス	110,900	2,632.00	291,888,800	貸付有価証券 1,800株
三重交通グループホールディングス	37,100	625.00	23,187,500	貸付有価証券 100株
サムティ	25,900	2,240.00	58,016,000	貸付有価証券 400株
ディア・ライフ	23,500	586.00	13,771,000	
コーセーアールイー	5,400	825.00	4,455,000	貸付有価証券 100株
エー・ディー・ワークス	339,500	30.00	10,185,000	貸付有価証券 13,000株
日本商業開発	11,600	1,645.00	19,082,000	

プレサンスコーポレーション	29,500	1,349.00	39,795,500	貸付有価証券 13,800株
ユニゾホールディングス	27,600	5,160.00	142,416,000	貸付有価証券 6,000株
THEグローバル社	9,400	464.00	4,361,600	
ハウスコム	2,400	1,579.00	3,789,600	
日本管理センター	12,100	1,318.00	15,947,800	
サンセイランディック	5,400	927.00	5,005,800	
エストラスト	2,500	790.00	1,975,000	
フージャースホールディングス	36,500	715.00	26,097,500	貸付有価証券 6,500株（6,400株）
オープンハウス	53,100	3,145.00	166,999,500	貸付有価証券 200株
東急不動産ホールディングス	497,600	766.00	381,161,600	貸付有価証券 10,100株
飯田グループホールディングス	152,600	1,931.00	294,670,600	貸付有価証券 1,700株
イーグラント	2,900	856.00	2,482,400	
ムゲンエステート	12,600	805.00	10,143,000	貸付有価証券 400株
ビーロット	4,300	2,059.00	8,853,700	貸付有価証券 300株
ファーストブラザーズ	4,200	1,347.00	5,657,400	
ハウズドゥ	10,100	1,507.00	15,220,700	貸付有価証券 200株（200株）
シーアールイー	4,500	1,115.00	5,017,500	
プロパティエージェント	2,900	1,131.00	3,279,900	貸付有価証券 300株（300株）
ケイアイスター不動産	5,700	2,117.00	12,066,900	貸付有価証券 1,900株（1,900株）
アグレ都市デザイン	3,000	553.00	1,659,000	貸付有価証券 200株
グッドコムアセット	4,200	2,065.00	8,673,000	貸付有価証券 800株
ジェイ・エス・ビー	2,000	5,460.00	10,920,000	
テンポイノベーション	4,100	985.00	4,038,500	貸付有価証券 1,200株
グローバル・リンク・マネジメント	3,000	674.00	2,022,000	貸付有価証券 1,400株
パーク24	98,200	2,681.00	263,274,200	貸付有価証券 10,100株（5,700株）

パラカ	4,700	2,090.00	9,823,000	
三井不動産	913,700	2,697.00	2,464,248,900	
三菱地所	1,282,100	2,123.50	2,722,539,350	貸付有価証券 6,700株
平和不動産	33,600	2,950.00	99,120,000	
東京建物	200,000	1,713.00	342,600,000	貸付有価証券 5,200株
ダイビル	47,100	1,225.00	57,697,500	
京阪神ビルディング	29,700	1,435.00	42,619,500	
住友不動産	411,300	3,846.00	1,581,859,800	
テーオーシー	35,900	896.00	32,166,400	貸付有価証券 100株
東京楽天地	3,000	6,440.00	19,320,000	貸付有価証券 1,400株
レオパレス 2 1	239,800	349.00	83,690,200	貸付有価証券 113,100株（54,500 株）
スターツコーポレーショ ン	24,900	2,792.00	69,520,800	
フジ住宅	21,200	703.00	14,903,600	
空港施設	18,300	552.00	10,101,600	
明和地所	10,000	609.00	6,090,000	
ゴールドクレスト	14,400	2,109.00	30,369,600	貸付有価証券 6,500株（1,700株）
エスリード	7,100	2,184.00	15,506,400	
日神不動産	27,000	550.00	14,850,000	
日本エスコン	33,100	1,000.00	33,100,000	貸付有価証券 8,500株（8,200株）
タカラレーベン	83,600	506.00	42,301,600	
サンヨーハウジング名古 屋	10,300	1,008.00	10,382,400	
イオンモール	91,700	1,929.00	176,889,300	
毎日コムネット	3,900	886.00	3,455,400	
ファースト住建	7,800	1,262.00	9,843,600	
カチタス	22,700	4,845.00	109,981,500	貸付有価証券 500株
トーセイ	25,200	1,492.00	37,598,400	
穴吹興産	2,000	3,600.00	7,200,000	
サンフロンティア不動産	25,300	1,326.00	33,547,800	

エフ・ジェー・ネクスト	16,000	1,147.00	18,352,000	貸付有価証券 7,500株
インテリックス	5,100	712.00	3,631,200	
ランドビジネス	7,700	737.00	5,674,900	
日本社宅サービス	4,700	1,202.00	5,649,400	
グランディハウス	14,200	487.00	6,915,400	貸付有価証券 100株
日本空港ビルデング	58,400	6,130.00	357,992,000	貸付有価証券 22,400株
日本工営	11,900	3,750.00	44,625,000	貸付有価証券 100株
L I F U L L	61,900	579.00	35,840,100	貸付有価証券 19,400株
ジェイエシーリクルー トメント	11,900	2,071.00	24,644,900	貸付有価証券 2,100株(2,100株)
日本M&Aセンター	133,900	3,765.00	504,133,500	
メンバーズ	5,200	2,272.00	11,814,400	貸付有価証券 1,800株
中広	1,800	540.00	972,000	
アイティメディア	5,300	776.00	4,112,800	
タケエイ	17,000	1,242.00	21,114,000	
E・Jホールディングス	2,200	1,668.00	3,669,600	
トラスト・テック	19,500	1,317.00	25,681,500	
コシダカホールディング ス	42,700	1,650.00	70,455,000	貸付有価証券 1,100株
アルトナー	4,300	784.00	3,371,200	
パソナグループ	21,600	1,634.00	35,294,400	
C D S	4,400	1,631.00	7,176,400	
リンクアンドモチベー ション	39,100	649.00	25,375,900	貸付有価証券 18,300株
G C A	21,300	1,017.00	21,662,100	
エス・エム・エス	55,100	3,075.00	169,432,500	
サニーサイドアップ	3,900	1,095.00	4,270,500	
パーソルホールディング ス	177,200	2,075.00	367,690,000	貸付有価証券 1,100株
リニカル	8,600	1,095.00	9,417,000	貸付有価証券 3,700株
クックパッド	61,900	353.00	21,850,700	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
エスクリ	5,500	776.00	4,268,000	

アイ・ケイ・ケイ	8,600	726.00	6,243,600	
学情	6,300	2,319.00	14,609,700	貸付有価証券 1,300株
スタジオアリス	8,900	1,904.00	16,945,600	
シミックホールディングス	9,800	1,778.00	17,424,400	
エプロ	2,800	1,512.00	4,233,600	貸付有価証券 700株
N J S	3,900	1,849.00	7,211,100	
総合警備保障	70,500	5,930.00	418,065,000	
カカコム	132,700	2,815.00	373,550,500	貸付有価証券 1,300株
セントケア・ホールディング	11,400	481.00	5,483,400	貸付有価証券 6,600株
サイネックス	3,000	675.00	2,025,000	
ルネサンス	9,900	1,715.00	16,978,500	
ディップ	25,000	3,230.00	80,750,000	貸付有価証券 8,400株（5,900株）
オプトホールディング	9,600	1,672.00	16,051,200	
新日本科学	19,200	639.00	12,268,800	貸付有価証券 9,000株
ツクイ	41,700	633.00	26,396,100	
キャリアデザインセンター	4,500	1,388.00	6,246,000	
ベネフィット・ワン	48,600	2,248.00	109,252,800	貸付有価証券 200株
エムスリー	390,800	3,295.00	1,287,686,000	貸付有価証券 47,500株
ツカダ・グローバルホールディング	11,300	606.00	6,847,800	貸付有価証券 5,300株
プラス	2,000	826.00	1,652,000	
アウトソーシング	101,400	1,205.00	122,187,000	貸付有価証券 4,400株
ウェルネット	16,800	753.00	12,650,400	
ワールドホールディングス	5,900	2,011.00	11,864,900	
ディー・エヌ・エー	86,900	1,765.00	153,378,500	
博報堂D Yホールディングス	246,600	1,802.00	444,373,200	貸付有価証券 2,900株
ぐるなび	30,800	998.00	30,738,400	貸付有価証券

				100株
タカミヤ	18,800	702.00	13,197,600	貸付有価証券 100株
ジャパンベストレス キューシステム	12,000	1,166.00	13,992,000	貸付有価証券 6,200株
ファンコミュニケーションズ	48,700	498.00	24,252,600	
ライク	7,000	1,550.00	10,850,000	貸付有価証券 1,100株(600株)
ビジネス・ブレイクス ルー	7,400	343.00	2,538,200	
エスプール	34,100	821.00	27,996,100	貸付有価証券 300株
W D Bホールディングス	8,100	2,667.00	21,602,700	
ティア	10,300	591.00	6,087,300	貸付有価証券 100株
C D G	1,900	1,404.00	2,667,600	貸付有価証券 700株
バリューコマース	9,900	2,310.00	22,869,000	貸付有価証券 2,600株
インフォマート	97,100	1,979.00	192,160,900	貸付有価証券 300株(300株)
J Pホールディングス	55,700	324.00	18,046,800	
E P Sホールディングス	26,700	1,407.00	37,566,900	
レグス	4,400	1,662.00	7,312,800	貸付有価証券 2,000株(1,800株)
プレステージ・インター ナショナル	66,300	1,017.00	67,427,100	貸付有価証券 300株
アミューズ	9,700	3,005.00	29,148,500	貸付有価証券 100株
ドリームインキュベータ	5,400	1,571.00	8,483,400	
クイック	11,000	1,630.00	17,930,000	
T A C	10,700	222.00	2,375,400	
ケネディクス	168,700	581.00	98,014,700	貸付有価証券 100株
電通	182,700	3,845.00	702,481,500	貸付有価証券 2,800株
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	6,800	1,232.00	8,377,600	
ぴあ	5,100	4,905.00	25,015,500	
イオンファンタジー	6,800	2,908.00	19,774,400	

シーティーエス	20,000	779.00	15,580,000	貸付有価証券 600株
ネクシィーズグループ	6,200	1,849.00	11,463,800	
みらかホールディングス	49,600	2,690.00	133,424,000	貸付有価証券 17,000株
アルプス技研	15,700	2,034.00	31,933,800	
ダイオーズ	3,500	1,346.00	4,711,000	貸付有価証券 2,100株
日本空調サービス	18,600	863.00	16,051,800	
オリエンタルランド	188,500	14,975.00	2,822,787,500	貸付有価証券 600株
ダスキン	45,500	3,060.00	139,230,000	
明光ネットワークジャ パン	20,800	1,023.00	21,278,400	
ファルコホールディング ス	9,700	1,851.00	17,954,700	
秀英予備校	3,900	452.00	1,762,800	
田谷	3,200	611.00	1,955,200	
ラウンドワン	49,500	1,077.00	53,311,500	
リゾートトラスト	81,300	1,842.00	149,754,600	
ビー・エム・エル	22,800	3,170.00	72,276,000	
ワタベウェディング	2,900	560.00	1,624,000	
りらいあコミュニケー ションズ	32,000	1,390.00	44,480,000	
リソー教育	81,000	386.00	31,266,000	貸付有価証券 300株
早稲田アカデミー	5,800	970.00	5,626,000	
ユー・エス・エス	198,500	2,077.00	412,284,500	貸付有価証券 600株
東京個別指導学院	6,300	717.00	4,517,100	貸付有価証券 2,900株
サイバーエージェント	102,000	3,785.00	386,070,000	貸付有価証券 11,000株
楽天	826,300	940.00	776,722,000	貸付有価証券 26,400株
クリーク・アンド・リ バー社	9,100	1,116.00	10,155,600	貸付有価証券 300株
テー・オー・ダブリュー	15,500	920.00	14,260,000	
山田コンサルティンググ ループ	8,600	1,638.00	14,086,800	

セントラルスポーツ	6,600	3,265.00	21,549,000	
フルキャストホールディングス	17,700	2,498.00	44,214,600	貸付有価証券 300株
エン・ジャパン	31,500	4,850.00	152,775,000	貸付有価証券 7,600株
リソルホールディングス	1,900	4,100.00	7,790,000	
テクノプロ・ホールディングス	35,500	7,830.00	277,965,000	貸付有価証券 100株
アトラ	4,100	367.00	1,504,700	貸付有価証券 1,000株
インターワークス	3,400	534.00	1,815,600	
アイ・アールジャパン ホールディングス	7,200	4,990.00	35,928,000	
K e e P e r 技研	6,500	1,369.00	8,898,500	
ファーストロジック	4,100	624.00	2,558,400	貸付有価証券 200株
三機サービス	3,700	1,088.00	4,025,600	
G u n o s y	12,300	1,500.00	18,450,000	貸付有価証券 5,400株
デザインワン・ジャパン	3,500	326.00	1,141,000	貸付有価証券 1,100株
イー・ガーディアン	9,000	2,037.00	18,333,000	貸付有価証券 700株
リブセンス	11,300	302.00	3,412,600	貸付有価証券 3,000株
ジャパンマテリアル	54,500	1,781.00	97,064,500	
ベクトル	22,100	1,044.00	23,072,400	貸付有価証券 4,100株
ウチヤマホールディングス	8,700	538.00	4,680,600	
チャーム・ケア・コーポ レーション	6,500	1,964.00	12,766,000	貸付有価証券 2,500株
ライクキッズ	4,200	833.00	3,498,600	貸付有価証券 400株
キャリアリンク	5,800	611.00	3,543,800	
I B J	12,000	1,221.00	14,652,000	貸付有価証券 5,600株（3,900株）
アサンテ	7,100	2,034.00	14,441,400	
N・フィールド	12,200	674.00	8,222,800	貸付有価証券 4,900株
パリュールHR	3,500	3,600.00	12,600,000	貸付有価証券

				1,600株
M & Aキャピタルパートナーズ	12,600	4,330.00	54,558,000	
ライドオンエクスプレスホールディングス	6,700	2,194.00	14,699,800	貸付有価証券 1,200株
E R Iホールディングス	5,000	785.00	3,925,000	
アビスト	2,800	2,626.00	7,352,800	
シグマクシス	12,100	2,059.00	24,913,900	
ウィルグループ	11,600	1,217.00	14,117,200	
エスクロー・エージェン ト・ジャパン	24,400	219.00	5,343,600	
リクルートホールディング ス	1,269,900	4,143.00	5,261,195,700	貸付有価証券 200株
エラン	10,500	1,639.00	17,209,500	貸付有価証券 1,000株(300株)
土木管理総合試験所	7,700	456.00	3,511,200	貸付有価証券 100株(100株)
ネットマーケティング	6,400	957.00	6,124,800	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
日本郵政	1,453,000	1,020.00	1,482,060,000	貸付有価証券 2,800株
ベルシステム24ホール ディングス	29,700	1,700.00	50,490,000	
鎌倉新書	13,200	1,703.00	22,479,600	貸付有価証券 6,200株(100株)
S M N	2,800	812.00	2,273,600	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
一蔵	1,900	760.00	1,444,000	
L I T A L I C O	6,100	2,365.00	14,426,500	貸付有価証券 700株
グローバルキッズCOM P A N Y	2,600	745.00	1,937,000	
エボラブルアジア	7,900	1,996.00	15,768,400	貸付有価証券 3,700株(2,900株)
アトラエ	4,600	3,715.00	17,089,000	
ストライク	6,700	5,470.00	36,649,000	貸付有価証券 800株
ソラスト	48,800	1,293.00	63,098,400	貸付有価証券 3,500株
セラク	5,600	836.00	4,681,600	
インソース	8,600	3,585.00	30,831,000	貸付有価証券

				500株
ベイカレント・コンサルティング	10,700	5,590.00	59,813,000	
Orchestra Holdings	3,500	1,152.00	4,032,000	貸付有価証券 1,600株
アイモバイル	5,600	664.00	3,718,400	貸付有価証券 2,600株
キャリアインデックス	7,200	425.00	3,060,000	貸付有価証券 2,700株
MS - Japan	5,700	1,501.00	8,555,700	
船場	2,900	1,198.00	3,474,200	
グレイステクノロジー	8,100	2,823.00	22,866,300	貸付有価証券 2,400株(300株)
ジャパンエレベーター サービスホールディング	18,700	2,759.00	51,593,300	
フルテック	2,500	1,437.00	3,592,500	貸付有価証券 1,100株
グリーンズ	6,700	1,163.00	7,792,100	貸付有価証券 3,100株
ツナググループ・ホール ディングス	2,100	801.00	1,682,100	
GameWith	3,900	740.00	2,886,000	貸付有価証券 1,800株(100株)
ソウルドアウト	2,700	1,981.00	5,348,700	貸付有価証券 600株(100株)
MS&Consulting	2,500	1,035.00	2,587,500	
日総工産	11,700	1,138.00	13,314,600	貸付有価証券 200株
キュービーネットホール ディングス	10,800	2,526.00	27,280,800	
RPAホールディングス	10,000	1,152.00	11,520,000	貸付有価証券 4,800株(3,600株)
スプリックス	6,000	1,187.00	7,122,000	貸付有価証券 2,700株(2,200株)
マネジメントソリューションズ	1,900	3,290.00	6,251,000	貸付有価証券 800株(100株)
アドバンテッジリスクマ ネジメント	8,900	1,035.00	9,211,500	貸付有価証券 1,500株
リログループ	96,900	3,020.00	292,638,000	貸付有価証券 2,300株
東祥	11,000	2,520.00	27,720,000	

エイチ・アイ・エス	27,600	3,075.00	84,870,000	貸付有価証券 100株
ラックランド	4,100	2,280.00	9,348,000	貸付有価証券 1,900株
共立メンテナンス	29,400	5,230.00	153,762,000	貸付有価証券 3,000株
イチネンホールディングス	19,800	1,569.00	31,066,200	
建設技術研究所	12,200	2,238.00	27,303,600	
スペース	11,500	1,331.00	15,306,500	
長大	6,500	1,296.00	8,424,000	
燦ホールディングス	7,700	1,422.00	10,949,400	
スバル興業	1,100	8,990.00	9,889,000	貸付有価証券 500株
東京テアトル	6,900	1,400.00	9,660,000	
タナベ経営	3,400	1,291.00	4,389,400	
ナガワ	5,700	8,120.00	46,284,000	貸付有価証券 300株
よみうりランド	3,800	4,585.00	17,423,000	貸付有価証券 100株（100株）
東京都競馬	11,600	3,530.00	40,948,000	貸付有価証券 5,400株
常磐興産	7,100	1,670.00	11,857,000	貸付有価証券 2,000株
カナモト	29,000	2,893.00	83,897,000	貸付有価証券 2,800株
東京ドーム	71,800	1,108.00	79,554,400	貸付有価証券 33,700株
西尾レントオール	18,000	3,140.00	56,520,000	
トランス・コスモス	16,900	2,920.00	49,348,000	貸付有価証券 900株
乃村工藝社	76,000	1,472.00	111,872,000	貸付有価証券 3,100株
藤田観光	7,700	2,852.00	21,960,400	貸付有価証券 3,600株
KNT-CTホールディングス	11,000	1,495.00	16,445,000	
日本管財	19,000	1,982.00	37,658,000	
トーカイ	17,100	2,860.00	48,906,000	
白洋舎	2,000	2,906.00	5,812,000	貸付有価証券 900株

セコム	188,100	9,859.00	1,854,477,900	
セントラル警備保障	8,500	6,320.00	53,720,000	
丹青社	33,500	1,316.00	44,086,000	
メイテック	21,900	6,160.00	134,904,000	
応用地質	19,100	1,525.00	29,127,500	
船井総研ホールディングス	36,600	2,550.00	93,330,000	
進学会ホールディングス	6,900	517.00	3,567,300	
オオバ	13,900	886.00	12,315,400	
いであ	3,200	3,020.00	9,664,000	貸付有価証券 1,500株
学究社	5,200	1,403.00	7,295,600	
ベネッセホールディングス	59,000	2,878.00	169,802,000	
イオンディライト	21,800	3,975.00	86,655,000	
ナック	9,800	1,008.00	9,878,400	
ニチイ学館	25,200	1,643.00	41,403,600	貸付有価証券 2,300株
ダイセキ	29,700	3,185.00	94,594,500	貸付有価証券 600株
ステップ	6,500	1,585.00	10,302,500	
小計	銘柄数：2,139 組入時価比率：98.8%		453,292,571,690 100.0%	
合計			453,292,571,690	

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

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

(2)株式以外の有価証券(2019年12月26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12月26日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
	うち1年超		
市場取引			
			評価損益(円)

株価指数先物取引				
買建	5,414,517,498	-	5,457,320,000	42,646,082
合計	5,414,517,498	-	5,457,320,000	42,646,082

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国株式MSCI - KOKUSA Iマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	2,280,169,344
コール・ローン	124,527,085
株式	634,684,826,032
投資証券	17,598,452,212
派生商品評価勘定	45,408,019
未収入金	4,003,458,951
未収配当金	587,341,088
差入委託証拠金	2,861,244,761
流動資産合計	662,185,427,492
資産合計	
662,185,427,492	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,362,538
未払解約金	950,234,466
未払利息	183
その他未払費用	4,188,900
流動負債合計	961,786,087
負債合計	
961,786,087	
純資産の部	
元本等	
元本	216,536,356,000
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	444,687,285,405
元本等合計	661,223,641,405
純資産合計	
661,223,641,405	
負債純資産合計	
662,185,427,492	

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
-------------------	----

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年12月26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	3.0536円
(10,000口当たり純資産額)	(30,536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12月27日 至 2019年12月26日	
1. 金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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12月26日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

2. 時価の算定方法

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12月26日現在

期首	2018年12月27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	204,627,601,300円
同期中における追加設定元本額	44,546,508,361円
同期中における一部解約元本額	32,637,753,661円
期末元本額	216,536,356,000円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	46,549,009円
バランスセレクト50	144,191,688円
バランスセレクト70	152,203,932円

野村外国株式インデックスファンド	512,297,912円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	4,394,774,961円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	5,982,258,780円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,428,554,525円
野村資産設計ファンド2015	16,033,986円
野村資産設計ファンド2020	18,097,877円
野村資産設計ファンド2025	29,312,189円
野村資産設計ファンド2030	34,730,022円
野村資産設計ファンド2035	27,459,676円
野村資産設計ファンド2040	60,322,481円
野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	34,194,974,743円
のむらップ・ファンド(保守型)	957,402,261円
のむらップ・ファンド(普通型)	7,241,706,277円
のむらップ・ファンド(積極型)	4,767,841,456円
野村資産設計ファンド2045	8,844,277円
野村インデックスファンド・外国株式	4,293,523,405円
マイ・ロード	1,233,335,701円
ネクストコア	43,064,241円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	116,978,105円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,355,386,393円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,001,204,020円
野村資産設計ファンド2050	15,142,737円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,759,073円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,080,291円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,599,457円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,028,572円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	200,647,063円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	313,697,033円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,601,282円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,174,965円
インデックス・ブレンド(タイプ)	14,481,131円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,569,628円
インデックス・ブレンド(タイプ)	22,611,041円
野村6資産均等バランス	515,017,829円
野村つみたて外国株投信	3,633,734,844円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	3,604,351,343円
世界6資産分散ファンド	71,567,645円
野村資産設計ファンド2060	1,569,305円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信	327,619,168円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	910,379,430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)	242,965,574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)	189,102,896円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	1,149,796,893円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,155,560,035円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,471,256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)	6,963,943円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	3,140,642円

野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	3,662,848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)	51,822,917円
野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	14,028,333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)	14,407,788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)	39,032,291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)	153,173,239円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	3,031,446,036円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	42,867,905円
野村MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	143,417,895円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)	646,790,296円
野村FOFs用・外国株式MSCI-KOKUSAIインデックスファンド(適格機関投資家専用)	14,828,792,820円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	1,945,738円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	11,681,795円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	12,105,232円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI(確定拠出年金向け)	65,984,560,274円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,773,405,354円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	9,296,359,699円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	8,539,173,198円
マイバランスDC30	930,127,015円
マイバランスDC50	1,840,542,845円
マイバランスDC70	1,462,687,576円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI-KOKUSAI	20,788,571,805円
野村DC運用戦略ファンド	619,784,010円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	44,181,453円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	251,061,575円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	193,000,338円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	147,614,049円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	8,929,796円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	4,759,347円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	20,066,129円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	2,188,761円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	1,484,956円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,771,623円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	79,090,739円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	51,082,466円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	19,492,076円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	21,327,499円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	237,291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12月26日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES CO	91,000	25.48	2,318,680.00	
		HALLIBURTON CO	128,000	24.86	3,182,080.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	58,000	24.94	1,446,520.00	
		SCHLUMBERGER LTD	199,800	40.65	8,121,870.00	
		TECHNIPFMC PLC	61,000	21.14	1,289,540.00	
		APACHE CORPORATION	54,100	26.17	1,415,797.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	58,500	17.44	1,020,240.00	
		CHENIERE ENERGY INC	32,700	61.92	2,024,784.00	
		CHEVRON CORP	275,800	120.34	33,189,772.00	
		CONCHO RESOURCES INC	29,700	85.52	2,539,944.00	
		CONOCOPHILLIPS	162,700	64.67	10,521,809.00	
		CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	13,900	34.55	480,245.00	
		DEVON ENERGY CORP	62,400	26.54	1,656,096.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	23,100	90.18	2,083,158.00	
		EOG RESOURCES INC	83,800	83.81	7,023,278.00	
		EXXON MOBIL CORP	615,100	70.02	43,069,302.00	
		HESS CORP	39,400	67.24	2,649,256.00	
		HOLLYFRONTIER CORP	23,600	51.62	1,218,232.00	
		KINDER MORGAN INC	296,000	21.13	6,254,480.00	
		MARATHON OIL CORP	123,000	13.62	1,675,260.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	95,400	60.97	5,816,538.00	
		NOBLE ENERGY INC	71,000	24.61	1,747,310.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	132,300	39.89	5,277,447.00	
		ONEOK INC	61,200	75.60	4,626,720.00	
		PHILLIPS 66	65,600	113.20	7,425,920.00	
		PIONEER NATURAL RESOURCES CO	24,500	151.80	3,719,100.00	
		TARGA RESOURCES CORP	34,800	40.31	1,402,788.00	
		VALERO ENERGY CORP	60,500	95.10	5,753,550.00	
		WILLIAMS COS	175,000	23.84	4,172,000.00	
		AIR PRODUCTS	31,800	235.05	7,474,590.00	
ALBEMARLE CORP	14,800	72.32	1,070,336.00			
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	29,200	30.32	885,344.00			
CELANESE CORP-SERIES A	17,800	123.39	2,196,342.00			

CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	31,400	47.94	1,505,316.00
CORTEVA INC	109,200	28.81	3,146,052.00
DOW INC	107,800	54.90	5,918,220.00
DUPONT DE NEMOURS INC	108,300	63.78	6,907,374.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	20,800	79.02	1,643,616.00
ECOLAB INC	37,400	191.45	7,160,230.00
FMC CORP	19,600	100.92	1,978,032.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	15,500	125.09	1,938,895.00
LINDE PLC	78,900	211.62	16,696,818.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	39,900	94.59	3,774,141.00
MOSAIC CO/THE	56,000	21.45	1,201,200.00
PPG INDUSTRIES	34,200	133.54	4,567,068.00
RPM INTERNATIONAL INC	19,100	75.42	1,440,522.00
SHERWIN-WILLIAMS	11,980	581.14	6,962,057.20
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5,000	70.10	350,500.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	9,000	274.54	2,470,860.00
VULCAN MATERIALS CO	19,700	142.65	2,810,205.00
AMCOR PLC	234,000	10.79	2,524,860.00
AVERY DENNISON CORP	12,200	133.22	1,625,284.00
BALL CORP	45,300	65.23	2,954,919.00
CROWN HOLDINGS INC	19,100	72.64	1,387,424.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	55,900	46.08	2,575,872.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	14,500	112.27	1,627,915.00
SEALED AIR CORP	21,900	40.28	882,132.00
WESTROCK CO	38,700	42.76	1,654,812.00
FREEMONT-MCMORAN INC	208,000	12.99	2,701,920.00
NEWMONT GOLDCORP CORP	121,500	42.18	5,124,870.00
NUCOR CORP	43,100	56.66	2,442,046.00
STEEL DYNAMICS	33,400	34.63	1,156,642.00
ARCONIC INC	57,000	31.31	1,784,670.00
BOEING CO	77,630	333.00	25,850,790.00
GENERAL DYNAMICS	35,400	178.82	6,330,228.00
HEICO CORP	6,300	117.03	737,289.00
HEICO CORP-CLASS A	10,900	91.78	1,000,402.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,800	253.99	1,473,142.00

L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	32,700	201.22	6,579,894.00
LOCKHEED MARTIN	36,840	390.17	14,373,862.80
NORTHROP GRUMMAN CORP	23,230	347.08	8,062,668.40
RAYTHEON COMPANY	40,500	219.35	8,883,675.00
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	14,600	73.58	1,074,268.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	5,360	345.58	1,852,308.80
TEXTRON INC	33,500	45.04	1,508,840.00
TRANSDIGM GROUP INC	7,010	592.63	4,154,336.30
UNITED TECHNOLOGIES	118,900	149.57	17,783,873.00
ALLEGION PLC	13,600	123.87	1,684,632.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	19,400	65.31	1,267,014.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	115,200	41.12	4,737,024.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,100	243.96	1,244,196.00
MASCO CORP	42,800	47.99	2,053,972.00
OWENS CORNING INC	16,800	65.26	1,096,368.00
SMITH (A.O.) CORP	21,800	47.50	1,035,500.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	20,000	89.57	1,791,400.00
ACUITY BRANDS INC	6,200	136.55	846,610.00
AMETEK INC	33,500	99.71	3,340,285.00
EATON CORP PLC	60,900	94.48	5,753,832.00
EMERSON ELEC	88,800	76.10	6,757,680.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	16,900	202.84	3,427,996.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	24,500	53.59	1,312,955.00
3M CORP	83,400	176.68	14,735,112.00
GENERAL ELEC CO	1,265,000	11.19	14,155,350.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	104,400	176.31	18,406,764.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	33,500	55.00	1,842,500.00
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	33,300	31.05	1,033,965.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	15,060	353.24	5,319,794.40
CATERPILLAR INC DEL	82,500	147.48	12,167,100.00
CUMMINS INC	21,600	181.16	3,913,056.00
DEERE & COMPANY	43,500	174.50	7,590,750.00
DOVER CORP	21,400	115.26	2,466,564.00
FLOWSERVE CORP	20,600	50.00	1,030,000.00

FORTIVE CORP	43,400	76.39	3,315,326.00
IDEX CORP	11,300	171.89	1,942,357.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	47,000	180.18	8,468,460.00
INGERSOLL-RAND PLC	34,900	134.59	4,697,191.00
MIDDLEBY CORP	8,700	111.02	965,874.00
PACCAR	50,000	79.49	3,974,500.00
PARKER HANNIFIN CORP	19,100	206.44	3,943,004.00
PENTAIR PLC	23,200	45.91	1,065,112.00
SNAP-ON INC	8,400	168.92	1,418,928.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	22,600	165.09	3,731,034.00
WABCO HOLDINGS INC	7,000	135.26	946,820.00
WABTEC CORP	26,100	77.63	2,026,143.00
XYLEM INC	26,000	78.64	2,044,640.00
AERCAP HOLDINGS NV	17,000	62.17	1,056,890.00
FASTENAL CO	82,600	37.01	3,057,026.00
GRAINGER(W.W.) INC	7,000	337.38	2,361,660.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	26,800	40.40	1,082,720.00
UNITED RENTALS INC	11,200	168.44	1,886,528.00
CINTAS CORP	12,600	268.81	3,387,006.00
COPART INC	30,200	90.91	2,745,482.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	32,800	89.58	2,938,224.00
ROLLINS INC	21,000	32.98	692,580.00
WASTE CONNECTIONS INC	38,700	90.42	3,499,254.00
WASTE MANAGEMENT INC	61,200	112.60	6,891,120.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	20,100	77.54	1,558,554.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	25,300	77.30	1,955,690.00
FEDEX CORPORATION	36,600	150.78	5,518,548.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	101,100	118.33	11,963,163.00
XPO LOGISTICS INC	14,300	78.86	1,127,698.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,600	29.18	426,028.00
DELTA AIR LINES INC	25,200	59.39	1,496,628.00
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	54.94	1,087,812.00
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	9,200	89.15	820,180.00
AMERCO	1,170	372.15	435,415.50
CSX CORP	110,900	72.98	8,093,482.00

HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	13,200	116.56	1,538,592.00	
KANSAS CITY SOUTHERN	14,200	153.26	2,176,292.00	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	20,800	35.65	741,520.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	38,300	194.91	7,465,053.00	
OLD DOMINION FREIGHT LINE	9,600	187.99	1,804,704.00	
UBER TECHNOLOGIES INC	26,500	30.44	806,660.00	
UNION PAC CORP	102,800	179.89	18,492,692.00	
APTIV PLC	37,100	94.89	3,520,419.00	
AUTOLIV INC	11,900	85.28	1,014,832.00	
BORGWARNER INC	29,600	43.88	1,298,848.00	
LEAR CORP	8,400	139.28	1,169,952.00	
FORD MOTOR COMPANY	580,000	9.47	5,492,600.00	
GENERAL MOTORS CO	188,500	36.58	6,895,330.00	
HARLEY-DAVIDSON INC	22,400	37.89	848,736.00	
TESLA INC	19,400	425.25	8,249,850.00	
DR HORTON INC	51,200	53.20	2,723,840.00	
GARMIN LTD	18,900	98.44	1,860,516.00	
LEGGETT & PLATT INC	18,900	50.90	962,010.00	
LENNAR CORP-A	40,700	56.79	2,311,353.00	
MOHAWK INDUSTRIES	8,700	135.14	1,175,718.00	
NEWELL BRANDS INC	57,000	19.39	1,105,230.00	
NVR INC	521	3,817.15	1,988,735.15	
PULTEGROUP INC	37,900	39.15	1,483,785.00	
WHIRLPOOL CORP	9,400	145.18	1,364,692.00	
HASBRO INC	18,200	105.10	1,912,820.00	
POLARIS INC	8,300	101.50	842,450.00	
CAPRI HOLDINGS LTD	19,900	37.53	746,847.00	
HANESBRANDS INC	51,000	14.71	750,210.00	
LULULEMON ATHLETICA INC	16,500	229.03	3,778,995.00	
NIKE INC-B	182,700	100.14	18,295,578.00	
PVH CORP	11,600	104.67	1,214,172.00	
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	118.34	923,052.00	
TAPESTRY INC	45,000	26.74	1,203,300.00	
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	24,000	21.64	519,360.00	

UNDER ARMOUR INC-CLASS C	25,000	19.40	485,000.00
V F CORP	50,100	98.90	4,954,890.00
ARAMARK	35,400	43.68	1,546,272.00
CARNIVAL CORP	62,100	50.94	3,163,374.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,930	828.89	3,257,537.70
DARDEN RESTAURANTS INC	17,900	108.50	1,942,150.00
DOMINOS PIZZA INC	5,900	289.64	1,708,876.00
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	39,600	111.37	4,410,252.00
LAS VEGAS SANDS CORP	50,700	69.29	3,513,003.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	40,600	151.50	6,150,900.00
MCDONALD'S CORP	110,900	196.67	21,810,703.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	28,000	24.20	677,600.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	70,700	33.42	2,362,794.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	30,300	58.38	1,768,914.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	26,600	132.96	3,536,736.00
STARBUCKS CORP	173,600	88.52	15,367,072.00
VAIL RESORTS INC	6,000	244.21	1,465,260.00
WYNN RESORTS LTD	13,800	139.44	1,924,272.00
YUM BRANDS INC	43,700	100.33	4,384,421.00
GENUINE PARTS CO	21,500	105.52	2,268,680.00
LKQ CORP	45,000	35.89	1,615,050.00
AMAZON.COM INC	61,170	1,789.21	109,445,975.70
BOOKING HOLDINGS INC	6,160	2,044.00	12,591,040.00
EBAY INC	115,800	36.21	4,193,118.00
EXPEDIA GROUP INC	20,700	108.77	2,251,539.00
GRUBHUB INC	14,500	48.58	704,410.00
MERCADOLIBRE INC	6,410	594.53	3,810,937.30
WAYFAIR INC - CLASS A	8,600	90.61	779,246.00
DOLLAR GENERAL CORP	37,500	156.25	5,859,375.00
DOLLAR TREE INC	34,000	93.23	3,169,820.00
KOHL'S CORP	25,300	50.79	1,284,987.00
NORDSTROM INC	15,000	40.42	606,300.00
TARGET CORP	74,400	128.55	9,564,120.00
ADVANCE AUTO PARTS	10,900	160.57	1,750,213.00
AUTOZONE	3,550	1,219.31	4,328,550.50
BEST BUY COMPANY INC	34,300	87.93	3,015,999.00

BURLINGTON STORES INC	9,800	227.76	2,232,048.00
CARMAX INC	23,900	88.86	2,123,754.00
GAP INC	31,500	17.64	555,660.00
HOME DEPOT	159,100	220.67	35,108,597.00
LOWES COS INC	112,500	119.77	13,474,125.00
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,140	439.83	4,899,706.20
ROSS STORES INC	52,900	115.12	6,089,848.00
TIFFANY & CO	16,100	133.59	2,150,799.00
TJX COS INC	176,100	60.38	10,632,918.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	17,800	93.56	1,665,368.00
ULTA BEAUTY INC	8,500	252.49	2,146,165.00
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	64,210	294.23	18,892,508.30
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	5.77	259,650.00
KROGER CO	116,000	29.10	3,375,600.00
SYSCO CORP	70,700	85.38	6,036,366.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	112,200	58.35	6,546,870.00
WALMART INC	207,300	119.51	24,774,423.00
BROWN-FORMAN CORP-CL B	45,400	66.73	3,029,542.00
COCA COLA CO	590,200	54.71	32,289,842.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	32,500	50.53	1,642,225.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	24,800	186.83	4,633,384.00
MOLSON COORS BREWING CO-B	28,400	53.28	1,513,152.00
MONSTER BEVERAGE CORP	58,900	63.47	3,738,383.00
PEPSICO INC	203,100	136.89	27,802,359.00
ARCHER DANIELS MIDLAND	80,700	46.08	3,718,656.00
BUNGE LIMITED	22,000	57.05	1,255,100.00
CAMPBELL SOUP CO	24,800	49.23	1,220,904.00
CONAGRA BRANDS INC	72,100	34.05	2,455,005.00
GENERAL MILLS	86,700	52.98	4,593,366.00
HERSHEY CO/THE	21,500	146.09	3,140,935.00
HORMEL FOODS CORP	42,800	45.35	1,940,980.00
INGREDION INC	9,600	92.55	888,480.00
JM SMUCKER CO/THE-NEW	17,400	103.75	1,805,250.00
KELLOGG CO	38,300	68.93	2,640,019.00
KRAFT HEINZ CO/THE	99,000	31.98	3,166,020.00

LAMB WESTON HOLDINGS INC	21,700	85.14	1,847,538.00	
MCCORMICK & CO INC.	17,800	168.25	2,994,850.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	211,500	54.99	11,630,385.00	
TYSON FOODS INC-CL A	42,500	91.15	3,873,875.00	
ALTRIA GROUP INC	270,800	50.28	13,615,824.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	227,200	86.11	19,564,192.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	35,100	70.35	2,469,285.00	
CLOROX CO	18,700	152.48	2,851,376.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	117,800	68.55	8,075,190.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	49,700	137.23	6,820,331.00	
PROCTER & GAMBLE CO	363,800	125.22	45,555,036.00	
COTY INC-CL A	49,000	10.94	536,060.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	32,400	205.45	6,656,580.00	
ABBOTT LABORATORIES	256,600	87.28	22,396,048.00	
ABIOMED INC	6,420	172.30	1,106,166.00	
ALIGN TECHNOLOGY INC	11,000	277.89	3,056,790.00	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	71,600	84.69	6,063,804.00	
BECTON,DICKINSON	39,100	273.01	10,674,691.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	201,500	45.31	9,129,965.00	
DANAHER CORP	90,600	153.34	13,892,604.00	
DENTSPLY SIRONA INC	31,800	57.21	1,819,278.00	
DEXCOM INC	13,200	216.40	2,856,480.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	30,000	235.79	7,073,700.00	
HOLOGIC INC	39,800	52.59	2,093,082.00	
IDEXX LABORATORIES INC	12,610	263.26	3,319,708.60	
INSULET CORP	8,900	171.61	1,527,329.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	16,680	598.81	9,988,150.80	
MEDTRONIC PLC	196,000	113.77	22,298,920.00	
RESMED INC	20,700	156.70	3,243,690.00	
STERIS PLC	12,900	152.03	1,961,187.00	
STRYKER CORP	49,400	211.58	10,452,052.00	
TELEFLEX INC	6,740	373.98	2,520,625.20	
THE COOPER COMPANIES, INC.	7,120	322.05	2,292,996.00	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12,900	142.90	1,843,410.00	
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	10,900	150.73	1,642,957.00	

ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	30,400	150.87	4,586,448.00
AMERISOURCEBERGEN CORP	22,200	85.42	1,896,324.00
ANTHEM INC	37,300	304.50	11,357,850.00
CARDINAL HEALTH INC	44,300	51.29	2,272,147.00
CENTENE CORP	59,600	63.23	3,768,508.00
CIGNA CORP	55,000	204.01	11,220,550.00
CVS HEALTH CORP	188,500	74.51	14,045,135.00
DAVITA INC	14,800	75.02	1,110,296.00
HCA HEALTHCARE INC	39,500	147.98	5,845,210.00
HENRY SCHEIN INC	20,700	66.53	1,377,171.00
HUMANA INC	19,500	368.34	7,182,630.00
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,200	168.99	2,399,658.00
MCKESSON CORP	26,900	138.81	3,733,989.00
QUEST DIAGNOSTICS INC	19,000	107.22	2,037,180.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	137,700	294.54	40,558,158.00
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	11,800	143.32	1,691,176.00
WELLCARE HEALTH PLANS INC	7,190	331.30	2,382,047.00
ABBVIE INC	214,500	89.85	19,272,825.00
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	32,500	110.28	3,584,100.00
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	16,500	117.69	1,941,885.00
AMGEN INC	87,100	242.33	21,106,943.00
BEIGENE, LTD ADR	5,500	168.70	927,850.00
BIOGEN INC	26,990	304.07	8,206,849.30
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	26,300	86.37	2,271,531.00
EXACT SCIENCES CORP	20,700	96.64	2,000,448.00
GILEAD SCIENCES INC	184,600	66.72	12,316,512.00
INCYTE CORP	26,700	91.43	2,441,181.00
IONIS PHARMACEUTICALS INC	18,800	61.87	1,163,156.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	12,800	109.06	1,395,968.00
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,700	376.51	4,405,167.00
SAREPTA THERAPEUTICS INC	11,200	134.30	1,504,160.00
SEATTLE GENETICS INC	17,500	115.45	2,020,375.00
VERTEX PHARMACEUTICALS	37,100	220.56	8,182,776.00
ALLERGAN PLC	47,400	191.42	9,073,308.00
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	340,300	63.16	21,493,348.00

ELANCO ANIMAL HEALTH INC	53,000	29.43	1,559,790.00
ELI LILLY & CO.	126,800	131.11	16,624,748.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,800	153.73	1,199,094.00
JOHNSON & JOHNSON	383,800	145.93	56,007,934.00
MERCK & CO INC	372,100	91.44	34,024,824.00
MYLAN NV	77,000	19.84	1,527,680.00
PERRIGO CO PLC	19,600	53.50	1,048,600.00
PFIZER INC	803,600	39.29	31,573,444.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	154,000	10.05	1,547,700.00
ZOETIS INC	69,100	132.92	9,184,772.00
BANK OF AMERICA CORP	1,285,500	35.22	45,275,310.00
CITIGROUP	328,100	78.59	25,785,379.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	64,400	40.51	2,608,844.00
COMERICA INC	23,000	71.79	1,651,170.00
EAST WEST BANCORP INC	20,700	49.10	1,016,370.00
FIFTH THIRD BANCORP	105,200	30.96	3,256,992.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	24,100	117.25	2,825,725.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	154,000	15.15	2,333,100.00
JPMORGAN CHASE & CO	465,000	137.58	63,974,700.00
KEYCORP	147,000	20.35	2,991,450.00
M & T BANK CORP	18,900	169.34	3,200,526.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	61,000	16.86	1,028,460.00
PNC FINANCIAL	65,200	160.42	10,459,384.00
REGIONS FINANCIAL CORP	150,000	17.20	2,580,000.00
SIGNATURE BANK	7,600	136.42	1,036,792.00
SVB FINANCIAL GROUP	7,400	252.07	1,865,318.00
TRUIST FINANCIAL CORP	195,400	56.16	10,973,664.00
US BANCORP	218,300	59.67	13,025,961.00
WELLS FARGO CO	608,200	53.82	32,733,324.00
ZIONS BANCORP NA	27,500	51.53	1,417,075.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	62,000	24.62	1,526,440.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	191,400	225.47	43,154,958.00
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	35,000	21.16	740,600.00
VOYA FINANCIAL INC	21,700	60.39	1,310,463.00
AFLAC INC	107,300	52.76	5,661,148.00

ALLEGHANY CORP	2,100	791.51	1,662,171.00
ALLSTATE CORP	48,000	111.17	5,336,160.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	10,800	109.08	1,178,064.00
AMERICAN INTL GROUP	128,400	50.94	6,540,696.00
AON PLC	34,500	207.70	7,165,650.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	59,700	42.01	2,507,997.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	26,600	94.56	2,515,296.00
ASSURANT INC	9,000	129.03	1,161,270.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,200	46.96	995,552.00
BROWN & BROWN INC	35,200	39.17	1,378,784.00
CHUBB LTD	66,000	153.94	10,160,040.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	22,900	103.27	2,364,883.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,700	167.61	620,157.00
EVEREST RE GROUP LTD	6,200	274.50	1,701,900.00
FNF GROUP	40,500	44.82	1,815,210.00
GLOBE LIFE INC	15,700	106.14	1,666,398.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	52,000	60.06	3,123,120.00
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	59.05	1,765,595.00
LOEWS CORP	39,700	51.45	2,042,565.00
MARKEL CORP	2,000	1,124.05	2,248,100.00
MARSH & MCLENNAN COS	73,600	111.57	8,211,552.00
METLIFE INC	116,100	50.99	5,919,939.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	40,800	54.72	2,232,576.00
PROGRESSIVE CO	86,300	71.87	6,202,381.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	58,200	93.81	5,459,742.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	9,000	161.81	1,456,290.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	6,700	193.20	1,294,440.00
TRAVELERS COS INC/THE	37,900	135.83	5,147,957.00
UNUM GROUP	31,200	29.18	910,416.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	18,600	201.99	3,757,014.00
WR BERKLEY CORP	21,700	68.42	1,484,714.00
ACCENTURE PLC-CL A	93,000	211.61	19,679,730.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	24,300	85.73	2,083,239.00
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,600	110.99	732,534.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	63,200	169.91	10,738,312.00

BLACK KNIGHT INC	22,000	63.88	1,405,360.00
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	20,700	71.16	1,473,012.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	16,400	123.06	2,018,184.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	80,500	62.40	5,023,200.00
DXC TECHNOLOGY CO	37,800	37.41	1,414,098.00
EPAM SYSTEMS INC	7,700	211.66	1,629,782.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	88,900	137.88	12,257,532.00
FISERV INC	84,800	116.63	9,890,224.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	12,630	285.47	3,605,486.10
GARTNER INC	12,800	153.60	1,966,080.00
GLOBAL PAYMENTS INC	43,400	182.84	7,935,256.00
GODADDY INC - CLASS A	26,900	68.40	1,839,960.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	128,500	134.98	17,344,930.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	11,700	146.42	1,713,114.00
LEIDOS HOLDINGS INC	20,000	98.03	1,960,600.00
MASTERCARD INC	131,220	297.48	39,035,325.60
MONGODB INC	6,300	132.55	835,065.00
OKTA INC	15,400	119.02	1,832,908.00
PAYCHEX INC	48,100	84.65	4,071,665.00
PAYPAL HOLDINGS INC	162,200	108.69	17,629,518.00
SABRE CORP	42,000	22.69	952,980.00
SQUARE INC - A	48,900	63.96	3,127,644.00
TWILIO INC - A	17,100	100.55	1,719,405.00
VERISIGN INC	15,500	192.75	2,987,625.00
VISA INC-CLASS A SHARES	251,100	187.57	47,098,827.00
WESTERN UNION CO	60,000	27.07	1,624,200.00
WIX.COM LTD	6,700	120.18	805,206.00
ADOBE INC	70,910	329.64	23,374,772.40
ANSYS INC	12,200	256.49	3,129,178.00
AUTODESK INC.	31,600	183.91	5,811,556.00
CADENCE DESIGN SYS INC	40,100	69.65	2,792,965.00
CDK GLOBAL INC	16,700	54.78	914,826.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	17,500	111.58	1,952,650.00
CITRIX SYSTEMS INC	18,600	110.67	2,058,462.00

CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5,500	117.38	645,590.00
DOCUSIGN INC	14,900	73.70	1,098,130.00
DROPBOX INC-CLASS A	28,000	17.78	497,840.00
FORTINET INC	21,600	107.78	2,328,048.00
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	12,100	107.51	1,300,871.00
INTUIT INC	38,200	264.33	10,097,406.00
MICROSOFT CORP	1,055,500	157.38	166,114,590.00
NORTONLIFELOCK INC	91,000	25.68	2,336,880.00
ORACLE CORPORATION	338,800	53.44	18,105,472.00
PALO ALTO NETWORKS INC	14,300	231.79	3,314,597.00
PAYCOM SOFTWARE INC	7,000	264.64	1,852,480.00
PTC INC	17,000	74.43	1,265,310.00
RINGCENTRAL INC-CLASS A	10,600	168.56	1,786,736.00
SALESFORCE.COM INC	120,900	163.25	19,736,925.00
SERVICENOW INC	27,300	284.20	7,758,660.00
SPLUNK INC	21,600	150.35	3,247,560.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	33,700	61.14	2,060,418.00
SYNOPSYS INC	21,800	138.21	3,012,978.00
TYLER TECHNOLOGIES INC	5,700	298.39	1,700,823.00
VMWARE INC - CLASS A	11,700	151.02	1,766,934.00
WORKDAY INC-CLASS A	24,400	166.19	4,055,036.00
ARISTA NETWORKS INC	8,100	204.64	1,657,584.00
CISCO SYSTEMS	621,900	47.78	29,714,382.00
F5 NETWORKS INC	9,300	138.59	1,288,887.00
JUNIPER NETWORKS INC	53,000	24.29	1,287,370.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	24,500	161.68	3,961,160.00
APPLE INC	657,600	284.27	186,935,952.00
DELL TECHNOLOGIES-C	23,500	50.83	1,194,505.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	189,000	15.92	3,008,880.00
HP INC	216,000	20.59	4,447,440.00
NETAPP INC	35,200	62.86	2,212,672.00
SEAGATE TECHNOLOGY	34,700	59.49	2,064,303.00
WESTERN DIGITAL CORP	44,400	62.23	2,763,012.00
XEROX HOLDINGS CORP	28,900	37.37	1,079,993.00
AMPHENOL CORP-CL A	43,300	107.23	4,643,059.00

ARROW ELECTRS INC	12,100	84.46	1,021,966.00
CDW CORPORATION	21,100	142.97	3,016,667.00
COGNEX CORP	24,800	55.77	1,383,096.00
CORNING INC	114,100	28.82	3,288,362.00
FLEX LTD	76,000	12.78	971,280.00
FLIR SYSTEMS INC	20,700	52.42	1,085,094.00
IPG PHOTONICS CORP	5,900	144.65	853,435.00
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,100	103.22	2,797,262.00
TE CONNECTIVITY LTD	48,600	95.20	4,626,720.00
TRIMBLE INC	38,800	42.30	1,641,240.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	7,700	254.33	1,958,341.00
ADVANCED MICRO DEVICES	150,200	46.54	6,990,308.00
ANALOG DEVICES INC	53,300	119.72	6,381,076.00
APPLIED MATERIALS	135,200	61.50	8,314,800.00
BROADCOM INC	57,760	320.50	18,512,080.00
INTEL CORP	643,800	59.41	38,248,158.00
KLA CORP	23,500	178.11	4,185,585.00
LAM RESEARCH	21,100	294.48	6,213,528.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	93,000	26.55	2,469,150.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	40,300	61.29	2,469,987.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	35,500	105.05	3,729,275.00
MICRON TECHNOLOGY	159,600	55.42	8,845,032.00
NVIDIA CORP	84,000	238.62	20,044,080.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	40,600	129.20	5,245,520.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	59,000	24.47	1,443,730.00
QORVO INC	17,600	117.96	2,076,096.00
QUALCOMM INC	176,300	88.77	15,650,151.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	25,700	122.16	3,139,512.00
TERADYNE INC	25,000	68.99	1,724,750.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	136,300	128.53	17,518,639.00
XILINX INC	36,400	98.49	3,585,036.00
AT & T INC	1,062,100	38.96	41,379,416.00
CENTURYLINK INC	148,000	13.16	1,947,680.00
VERIZON COMMUNICATIONS	601,100	61.28	36,835,408.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	33,700	34.51	1,162,987.00

SPRINT CORP	109,000	5.26	573,340.00	
T-MOBILE US INC	49,300	77.32	3,811,876.00	
ALLIANT ENERGY CORP	34,300	54.27	1,861,461.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	71,300	93.84	6,690,792.00	
DUKE ENERGY CORP	105,400	90.23	9,510,242.00	
EDISON INTERNATIONAL	53,200	74.82	3,980,424.00	
ENTERGY CORP	28,600	119.44	3,415,984.00	
EVERGY INC	33,800	64.22	2,170,636.00	
EVERSOURCE ENERGY	46,500	83.96	3,904,140.00	
EXELON CORPORATION	143,400	45.32	6,498,888.00	
FIRSTENERGY CORP	80,000	48.48	3,878,400.00	
NEXTERA ENERGY INC	69,500	240.51	16,715,445.00	
OGE ENERGY CORP	28,600	43.89	1,255,254.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	17,000	88.86	1,510,620.00	
PPL CORPORATION	104,100	35.62	3,708,042.00	
SOUTHERN CO.	153,300	63.13	9,677,829.00	
XCEL ENERGY INC	76,200	62.86	4,789,932.00	
ATMOS ENERGY CORP	17,000	110.58	1,879,860.00	
UGI CORP	30,900	44.41	1,372,269.00	
AMEREN CORPORATION	35,000	75.75	2,651,250.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	75,400	26.76	2,017,704.00	
CMS ENERGY CORP	40,900	62.28	2,547,252.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	49,100	89.67	4,402,797.00	
DOMINION ENERGY INC	118,900	81.36	9,673,704.00	
DTE ENERGY COMPANY	26,600	128.16	3,409,056.00	
NISOURCE INC	53,300	27.43	1,462,019.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	74,900	58.51	4,382,399.00	
SEMPRA ENERGY	39,800	150.65	5,995,870.00	
WEC ENERGY GROUP INC	45,500	91.62	4,168,710.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	26,000	121.62	3,162,120.00	
AQUA AMERICA INC	31,800	46.21	1,469,478.00	
ALLY FINANCIAL INC	57,400	30.69	1,761,606.00	
AMERICAN EXPRESS CO	102,800	124.74	12,823,272.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	67,900	102.95	6,990,305.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	46,200	85.28	3,939,936.00	

SYNCHRONY FINANCIAL	86,400	36.32	3,138,048.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	18,900	167.72	3,169,908.00	
BANK OF NEWYORK MELLON CORP	123,900	50.35	6,238,365.00	
BLACKROCK INC	16,760	499.64	8,373,966.40	
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	97,500	55.40	5,401,500.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	16,400	118.97	1,951,108.00	
CME GROUP INC	51,800	203.36	10,534,048.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	45.78	1,602,300.00	
EATON VANCE CORP	16,400	47.32	776,048.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,410	267.06	1,444,794.60	
FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	26.14	1,134,476.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	47,400	229.91	10,897,734.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	81,400	92.19	7,504,266.00	
INVESCO LTD	58,000	17.79	1,031,820.00	
KKR & CO INC-A	73,600	29.00	2,134,400.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5,340	374.08	1,997,587.20	
MOODYS CORP	24,500	238.18	5,835,410.00	
MORGAN STANLEY	181,500	50.69	9,200,235.00	
MSCI INC	12,200	260.36	3,176,392.00	
NASDAQ INC	17,100	106.69	1,824,399.00	
NORTHERN TRUST CORP	30,200	106.71	3,222,642.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,700	90.21	1,596,717.00	
S&P GLOBAL INC	35,600	272.50	9,701,000.00	
SCHWAB(CHARLES)CORP	172,200	48.71	8,387,862.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	65.98	1,260,218.00	
STATE STREET CORP	53,500	79.64	4,260,740.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	34,200	122.20	4,179,240.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	41,200	50.74	2,090,488.00	
AES CORP	101,000	19.76	1,995,760.00	
NRG ENERGY INC	35,800	39.89	1,428,062.00	
VISTRA ENERGY CORP	51,600	23.49	1,212,084.00	
CERNER CORP	47,300	73.29	3,466,617.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	18,600	141.67	2,635,062.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	44,900	85.30	3,829,970.00	
BIO-RAD LABORATORIES-A	3,280	368.76	1,209,532.80	

ILLUMINA INC	21,220	335.49	7,119,097.80
IQVIA HOLDINGS INC	24,100	154.70	3,728,270.00
METTLER-TOLEDO INTL	3,660	790.47	2,893,120.20
PERKINELMER INC	15,700	97.45	1,529,965.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	58,110	326.51	18,973,496.10
WATERS CORP	9,600	233.09	2,237,664.00
COSTAR GROUP INC	5,370	600.27	3,223,449.90
EQUIFAX INC	17,400	139.50	2,427,300.00
IHS MARKIT LTD	55,000	75.13	4,132,150.00
MANPOWERGROUP INC	8,000	96.76	774,080.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	54,000	20.11	1,085,940.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	62.20	1,063,620.00
TRUNSION	27,400	85.55	2,344,070.00
VERISK ANALYTICS INC	22,400	149.17	3,341,408.00
CBRE GROUP INC	45,800	60.59	2,775,022.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	160,000	5.74	918,400.00
JONES LANG LASALLE INC	7,600	171.66	1,304,616.00
ALTICE USA INC-A	20,000	27.04	540,800.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	22,730	480.86	10,929,947.80
COMCAST CORP-CL A	658,900	44.53	29,340,817.00
DISCOVERY INC - A	24,500	33.03	809,235.00
DISCOVERY INC - C	50,300	30.80	1,549,240.00
DISH NETWORK CORP-A	37,100	35.82	1,328,922.00
FOX CORP-CLASS A	52,800	37.30	1,969,440.00
FOX CORP-CLASS B	25,400	36.50	927,100.00
INTERPUBRIC GROUP	58,000	23.02	1,335,160.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	15,600	123.97	1,933,932.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	64,000	21.78	1,393,920.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	22.79	546,960.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	22,800	47.92	1,092,576.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	48.30	623,070.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	13.98	768,900.00
OMNICOM GROUP	32,200	80.84	2,603,048.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	229,000	7.14	1,635,060.00
VIACOMCBS INC-CLASS B	80,931	42.02	3,400,720.62

	ACTIVISION BLIZZARD INC	110,600	58.81	6,504,386.00	
	DISNEY (WALT) CO	261,800	145.29	38,036,922.00	
	ELECTRONIC ARTS	42,900	108.55	4,656,795.00	
	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	29,300	45.90	1,344,870.00	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	20,800	70.61	1,468,688.00	
	NETFLIX INC	63,560	333.20	21,178,192.00	
	ROKU INC	12,100	145.57	1,761,397.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	16,900	123.93	2,094,417.00	
	ALPHABET INC-CL A	43,560	1,344.43	58,563,370.80	
	ALPHABET INC-CL C	45,460	1,343.56	61,078,237.60	
	FACEBOOK INC-A	349,900	205.12	71,771,488.00	
	IAC/INTERACTIVE CORP	11,200	246.57	2,761,584.00	
	MATCH GROUP INC	8,400	80.94	679,896.00	
	PINTEREST INC- CLASS A	22,000	18.48	406,560.00	
	SNAP INC-A	106,000	15.61	1,654,660.00	
	TRIPADVISOR INC	14,600	30.15	440,190.00	
	TWITTER INC	109,700	32.50	3,565,250.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	17,200	44.99	773,828.00	
小計	銘柄数：609			3,995,831,697.07	
				(437,863,237,364)	
	組入時価比率：66.2%			69.1%	
カナダドル	CAMECO CORP	56,000	11.65	652,400.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	175,000	41.90	7,332,500.00	
	CENOVUS ENERGY INC	156,000	13.19	2,057,640.00	
	ENBRIDGE INC	293,100	52.08	15,264,648.00	
	ENCANA CORP	205,000	5.99	1,227,950.00	
	HUSKY ENERGY INC	52,000	10.57	549,640.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	34.56	1,296,000.00	
	INTER PIPELINE LTD	60,000	22.75	1,365,000.00	
	KEYERA CORP	34,000	34.38	1,168,920.00	
	PARKLAND FUEL CORP	21,700	48.41	1,050,497.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	74,400	48.63	3,618,072.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	31,000	15.24	472,440.00	
	SUNCOR ENERGY INC	227,700	42.61	9,702,297.00	
	TC ENERGY CORP	134,100	69.84	9,365,544.00	

METHANEX CORP	8,600	51.29	441,094.00
NUTRIEN LTD	83,200	64.12	5,334,784.00
CCL INDUSTRIES INC - CL B	21,200	56.62	1,200,344.00
AGNICO EAGLE MINES LTD	35,400	80.74	2,858,196.00
BARRICK GOLD	263,000	24.11	6,340,930.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	99,000	12.75	1,262,250.00
FRANCO-NEVADA CORP	27,000	133.46	3,603,420.00
KINROSS GOLD CORP	174,000	6.07	1,056,180.00
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	28,900	57.03	1,648,167.00
LUNDIN MINING CORP	95,000	7.80	741,000.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	69,000	22.68	1,564,920.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63,000	38.92	2,451,960.00
WEST FRASER TIMBER	8,400	57.49	482,916.00
BOMBARDIER B SHEARS	280,000	1.92	537,600.00
CAE INC	41,000	34.88	1,430,080.00
WSP GLOBAL INC	15,700	90.35	1,418,495.00
AIR CANADA	20,400	49.60	1,011,840.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	104,500	119.16	12,452,220.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	20,100	336.50	6,763,650.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	42,300	72.82	3,080,286.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	31,800	38.53	1,225,254.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	39,200	84.59	3,315,928.00
STARS GROUP INC/THE	33,000	33.30	1,098,900.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	141.07	1,213,202.00
DOLLARAMA INC	41,800	44.57	1,863,026.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	125,500	42.25	5,302,375.00
EMPIRE CO LTD A	26,000	30.87	802,620.00
LOBLAW COMPANIES	25,900	67.67	1,752,653.00
METRO INC	36,800	54.14	1,992,352.00
WESTON(GEORGE)LTD	10,700	104.37	1,116,759.00
SAPUTO INC	36,600	40.77	1,492,182.00
AURORA CANNABIS INC	97,000	2.62	254,140.00
BAUSCH HEALTH COS INC	44,400	39.28	1,744,032.00
CANOPY GROWTH CORP	33,000	26.27	866,910.00
CRONOS GROUP INC	25,000	9.36	234,000.00

BANK OF MONTREAL	92,200	101.12	9,323,264.00	
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	176,600	73.42	12,965,972.00	
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	64,100	108.72	6,968,952.00	
NATIONAL BANK OF CANADA	49,000	72.94	3,574,060.00	
ROYAL BANK OF CANADA	209,300	103.43	21,647,899.00	
TORONTO DOMINION BANK	265,400	73.55	19,520,170.00	
ONEX CORPORATION	13,200	83.15	1,097,580.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,830	608.19	2,329,367.70	
GREAT-WEST LIFE CO INC	42,000	33.36	1,401,120.00	
IA FINANCIAL CORP INC	14,700	71.55	1,051,785.00	
INTACT FINANCIAL CORP	20,400	140.02	2,856,408.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	284,000	26.32	7,474,880.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	46,000	33.47	1,539,620.00	
POWER FINANCIAL CORP	39,000	35.47	1,383,330.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	85,300	59.51	5,076,203.00	
CGI INC	35,700	109.95	3,925,215.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	14,480	525.39	7,607,647.20	
BLACKBERRY LTD	71,000	8.37	594,270.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,910	1,276.02	3,713,218.20	
OPEN TEXT CORP	38,400	57.44	2,205,696.00	
BCE INC	22,700	60.70	1,377,890.00	
TELUS CORP	29,300	50.47	1,478,771.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	52,700	64.78	3,413,906.00	
EMERA INC	35,300	55.23	1,949,619.00	
FORTIS INC	65,200	54.17	3,531,884.00	
HYDRO ONE LTD	49,000	24.89	1,219,610.00	
ALTAGAS LTD	42,000	20.00	840,000.00	
ALGONQUIN POWER & UTILITIES	77,000	18.61	1,432,970.00	
ATCO LTD CL1	9,600	49.88	478,848.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	20,300	39.13	794,339.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	130,500	75.84	9,897,120.00	
CI FINANCIAL CORP	33,600	21.96	737,856.00	
IGM FINANCIAL INC	10,300	38.03	391,709.00	
THOMSON REUTERS CORP	30,100	94.27	2,837,527.00	
	25,000	20.74	518,500.00	

	FIRST CAPITAL REALTY INC				
	QUEBECOR INC-CL B	27,000	33.25	897,750.00	
	SHAW COMMUNICATIONS INC-B	70,000	26.46	1,852,200.00	
小計	銘柄数：86			284,985,369.10	
				(23,736,431,392)	
	組入時価比率：3.6%			3.7%	
ユ-口	TENARIS SA	71,000	10.25	727,750.00	
	ENI SPA	366,000	14.01	5,129,856.00	
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	69,000	15.22	1,050,180.00	
	NESTE OYJ	59,800	30.92	1,849,016.00	
	OMV AG	21,000	50.50	1,060,500.00	
	REPSOL SA	214,000	14.15	3,029,170.00	
	REPSOL SA-RTS	214,000	0.42	91,570.60	
	TOTAL SA	348,300	49.47	17,232,142.50	
	VOPAK	9,000	48.70	438,300.00	
	AIR LIQUIDE SA	68,200	126.00	8,593,200.00	
	AKZO NOBEL	32,800	91.86	3,013,008.00	
	ARKEMA	9,900	96.44	954,756.00	
	BASF SE	132,900	67.54	8,976,066.00	
	COVESTRO AG	26,900	41.81	1,124,689.00	
	EVONIK INDUSTRIES AG	27,300	27.36	746,928.00	
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	44.00	462,000.00	
	KONINKLIJKE DSM NV	26,100	117.40	3,064,140.00	
	LANXESS	12,000	60.46	725,520.00	
	SOLVAY SA	10,300	104.00	1,071,200.00	
	SYMRISE AG	18,200	93.22	1,696,604.00	
	UMICORE	28,000	43.59	1,220,520.00	
	CRH PLC	115,200	35.95	4,141,440.00	
	HEIDELBERGCEMENT AG	22,600	65.00	1,469,000.00	
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	35,300	34.38	1,213,614.00	
	ARCELORMITTAL	99,000	15.90	1,574,694.00	
	THYSSENKRUPP AG	62,000	12.11	751,130.00	
	VOESTALPINE AG	16,500	25.00	412,500.00	
	STORA ENSO OYJ-R	85,000	12.89	1,095,650.00	
	UPM-KYMMENE OYJ	78,000	31.24	2,436,720.00	
	AIRBUS SE	84,500	133.14	11,250,330.00	

DASSAULT AVIATION SA	330	1,196.00	394,680.00
LEONARDO SPA	54,000	10.77	581,850.00
MTU AERO ENGINES AG	7,600	256.00	1,945,600.00
SAFRAN SA	48,300	140.85	6,803,055.00
THALES SA	16,300	93.84	1,529,592.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	70,700	37.07	2,620,849.00
KINGSPAN GROUP PLC	22,200	55.00	1,221,000.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	39,800	35.38	1,408,124.00
BOUYGUES	31,300	38.12	1,193,156.00
EIFFAGE SA	11,000	102.05	1,122,550.00
FERROVIAL SA	72,838	27.18	1,979,736.84
HOCHTIEF AG	3,800	114.10	433,580.00
VINCI	73,800	98.76	7,288,488.00
LEGRAND SA	38,900	73.76	2,869,264.00
PRYSMIAN SPA	37,000	22.06	816,220.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	81,200	92.20	7,486,640.00
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	38,000	15.68	595,840.00
SIEMENS AG	110,900	117.52	13,032,968.00
ALSTOM	27,400	42.45	1,163,130.00
ANDRITZ AG	11,700	39.20	458,640.00
CNH INDUSTRIAL NV	154,000	10.00	1,540,000.00
GEA GROUP AG	24,200	30.15	729,630.00
KION GROUP AG	9,900	62.20	615,780.00
KNORR-BREMSE AG	7,100	91.27	648,017.00
KONE OYJ	49,200	59.02	2,903,784.00
METSO OYJ	16,200	35.49	574,938.00
WARTSILA OYJ	63,000	9.94	626,346.00
BRENTAG AG	23,800	48.76	1,160,488.00
EDENRED	35,300	46.66	1,647,098.00
BOLLORE	138,000	3.95	545,652.00
DEUTSCHE POST AG-REG	143,300	34.01	4,874,349.50
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	31,000	16.46	510,260.00
ADP	4,700	176.90	831,430.00
AENA SME SA	9,900	173.85	1,721,115.00
ATLANTIA SPA	72,000	21.00	1,512,000.00

FRAPORT AG	6,300	75.42	475,146.00
GETLINK	62,000	15.64	969,680.00
CONTINENTAL AG	15,900	115.82	1,841,538.00
FAURECIA	10,500	48.40	508,200.00
MICHELIN (CGDE)	25,500	109.25	2,785,875.00
NOKIAN RENKAAT OYJ	16,000	25.73	411,680.00
PIRELLI & C. SPA	53,000	5.21	276,448.00
VALEO SA	37,300	31.83	1,187,259.00
BAYER MOTOREN WERK	47,800	73.54	3,515,212.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	7,800	55.45	432,510.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	133,200	49.78	6,631,362.00
FERRARI NV	17,400	152.10	2,646,540.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	161,000	13.50	2,174,466.00
PEUGEOT CITROEN	88,000	21.83	1,921,040.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	22,700	67.24	1,526,348.00
RENAULT SA	28,100	43.23	1,214,903.50
VOLKSWAGEN AG	4,500	174.05	783,225.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	26,700	176.16	4,703,472.00
SEB SA	3,000	135.00	405,000.00
ADIDAS AG	26,430	291.10	7,693,773.00
ESSILORLUXOTTICA	41,500	138.60	5,751,900.00
HERMES INTERNATIONAL	4,650	678.00	3,152,700.00
KERING SA	10,940	587.40	6,426,156.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	40,340	414.10	16,704,794.00
MONCLER SPA	25,200	40.79	1,027,908.00
PUMA SE	12,600	68.60	864,360.00
ACCOR SA	26,200	42.02	1,100,924.00
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	11,000	107.95	1,187,450.00
SODEXO	13,200	105.80	1,396,560.00
DELIVERY HERO SE	16,500	69.74	1,150,710.00
PROSUS NV	72,100	66.55	4,798,255.00
ZALANDO SE	21,500	45.06	968,790.00
INDITEX SA	159,100	31.77	5,054,607.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	88,000	15.10	1,328,800.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	8,300	42.99	356,817.00

COLRUYT SA	8,700	46.75	406,725.00
JERONIMO MARTINS	38,000	14.85	564,300.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	176,000	22.77	4,008,400.00
METRO AG	25,000	14.50	362,500.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	111,600	74.10	8,269,560.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	91,000	8.29	754,845.00
HEINEKEN HOLDING NV	17,200	87.85	1,511,020.00
HEINEKEN NV	38,500	95.94	3,693,690.00
PERNOD RICARD SA	30,800	162.55	5,006,540.00
REMY COINTREAU	3,000	110.70	332,100.00
DANONE	91,100	74.34	6,772,374.00
KERRY GROUP PLC-A	23,400	113.00	2,644,200.00
HENKEL AG & CO KGAA	14,600	83.95	1,225,670.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	26,300	92.32	2,428,016.00
BEIERSDORF AG	14,800	106.85	1,581,380.00
LOREAL-ORD	37,100	264.50	9,812,950.00
UNILEVER NV	212,600	51.45	10,938,270.00
BIOMERIEUX	5,900	81.40	480,260.00
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	6,000	114.90	689,400.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	132,100	44.04	5,817,684.00
SARTORIUS AG-VORZUG	5,300	195.00	1,033,500.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	20,700	42.78	885,546.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	31,600	65.36	2,065,376.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	60,700	49.90	3,029,233.50
GALAPAGOS NV	6,400	189.95	1,215,680.00
GRIFOLS SA	43,700	31.98	1,397,526.00
BAYER AG-REG	135,000	73.60	9,936,000.00
IPSEN	5,500	79.00	434,500.00
MERCK KGAA	18,700	105.30	1,969,110.00
ORION OYJ	16,500	41.67	687,555.00
RECORDATI SPA	16,800	37.96	637,728.00
SANOFI	163,400	90.63	14,808,942.00
UCB SA	18,500	72.68	1,344,580.00
ABN AMRO BANK NV-CVA	58,100	16.27	945,577.50
AIB GROUP PLC	125,000	3.17	396,250.00

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	960,000	5.06	4,858,560.00
BANCO DE SABADELL SA	801,933	1.04	840,024.81
BANCO SANTANDER SA	2,435,000	3.75	9,143,425.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	133,000	4.91	653,030.00
BANKIA SA	151,000	1.92	290,750.50
BANKINTER S.A.	91,000	6.59	600,236.00
BNP PARIBAS	162,700	52.98	8,619,846.00
CAIXABANK	530,000	2.82	1,497,250.00
COMMERZBANK AG	135,000	5.43	733,185.00
CREDIT AGRICOLE SA	168,000	13.01	2,186,520.00
ERSTE GROUP BANK AG	42,400	34.11	1,446,264.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	91,000	10.91	993,265.00
ING GROEP NV	576,000	10.81	6,226,560.00
INTESA SANPAOLO	2,170,000	2.40	5,209,085.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	36,100	67.14	2,423,754.00
MEDIOBANCA S.P.A.	88,000	9.99	879,120.00
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	22.73	456,873.00
SOCIETE GENERALE	121,000	31.17	3,772,175.00
UNICREDIT SPA	290,000	13.34	3,868,600.00
EURAZEO SE	5,953	61.65	367,002.45
EXOR NV	15,100	70.90	1,070,590.00
GROUPE BRUXELLES LAM	12,400	93.56	1,160,144.00
WENDEL	4,300	120.80	519,440.00
AEGON NV	246,000	4.09	1,006,386.00
AGEAS	25,800	53.24	1,373,592.00
ALLIANZ SE-REG	61,500	220.60	13,566,900.00
ASSICURAZIONI GENERALI	159,000	18.68	2,970,120.00
AXA	281,000	25.26	7,098,060.00
CNP ASSURANCES	28,000	17.83	499,240.00
HANNOVER RUECK SE	8,900	174.90	1,556,610.00
MAPFRE SA	163,000	2.40	391,363.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	20,900	266.70	5,574,030.00
NN GROUP NV	42,900	34.22	1,468,038.00
POSTE ITALIANE SPA	77,000	10.29	792,715.00

SAMPO OYJ-A SHS	64,600	39.13	2,527,798.00
SCOR SE	23,200	37.56	871,392.00
ADYEN NV	1,490	736.80	1,097,832.00
AMADEUS IT GROUP SA	62,400	73.70	4,598,880.00
ATOS SE	13,700	75.86	1,039,282.00
CAPGEMINI SA	23,200	112.00	2,598,400.00
WIRECARD AG	16,700	105.30	1,758,510.00
WORLDLINE SA	13,800	63.80	880,440.00
DASSAULT SYSTEMES SA	18,900	148.30	2,802,870.00
SAP SE	143,500	120.76	17,329,060.00
NOKIA OYJ	837,000	3.28	2,748,708.00
INGENICO GROUP	9,500	98.00	931,000.00
ASML HOLDING NV	61,800	264.90	16,370,820.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	182,000	20.34	3,702,790.00
STMICROELECTRONICS NV	99,000	24.28	2,403,720.00
CELLNEX TELECOM SA	36,127	38.40	1,387,276.80
DEUTSCHE TELEKOM-REG	482,000	14.72	7,095,040.00
ELISA OYJ	19,800	49.32	976,536.00
ILIAD SA	3,900	115.40	450,060.00
KONINKLIJKE KPN NV	505,000	2.64	1,333,200.00
ORANGE SA	291,000	13.28	3,864,480.00
PROXIMUS	21,600	25.83	557,928.00
TELECOM ITALIA SPA	1,290,000	0.57	739,428.00
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.55	491,040.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	150,000	2.58	388,200.00
TELEFONICA SA	672,000	6.41	4,308,864.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	29.71	499,128.00
ELECTRICITE DE FRANCE	94,000	9.97	937,180.00
ENDESA S.A.	44,000	25.20	1,108,800.00
ENEL SPA	1,177,000	7.17	8,444,975.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	361,000	3.82	1,379,742.00
FORTUM OYJ	65,000	22.34	1,452,100.00
IBERDROLA SA	885,000	9.24	8,182,710.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	65,000	18.00	1,170,000.00
TERNA SPA	207,000	5.94	1,231,236.00

VERBUND AG	11,000	46.34	509,740.00	
ENAGAS SA	31,000	23.40	725,400.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	42,700	22.81	973,987.00	
SNAM SPA	298,000	4.68	1,395,832.00	
E.ON SE	328,000	9.51	3,120,592.00	
ENGIE	271,000	14.62	3,962,020.00	
RWE AG	82,900	26.98	2,236,642.00	
SUEZ	52,000	13.71	713,180.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	76,000	23.91	1,817,160.00	
AMUNDI SA	8,200	70.20	575,640.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	295,000	6.90	2,037,565.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	27,800	139.95	3,890,610.00	
NATIXIS	128,000	3.94	504,832.00	
UNIPER SE	31,100	29.77	925,847.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,700	508.50	864,450.00	
QIAGEN NV	31,400	37.03	1,162,742.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,100	148.40	608,440.00	
BUREAU VERITAS SA	41,000	23.86	978,260.00	
RANDSTAD NV	18,400	54.90	1,010,160.00	
TELEPERFORMANCE	8,400	218.60	1,836,240.00	
WOLTERS KLUWER	41,800	66.14	2,764,652.00	
AROWNTOWN SA	135,000	7.92	1,069,470.00	
DEUTSCHE WOHNEN SE	52,600	36.20	1,904,120.00	
VONOVIA SE	73,900	47.69	3,524,291.00	
ALTICE EUROPE N.V.	99,000	5.63	557,370.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	24,100	14.90	359,090.00	
JC DECAUX SA	9,300	27.66	257,238.00	
PUBLICIS GROUPE	32,100	41.25	1,324,125.00	
SES FDR	56,000	12.73	713,160.00	
TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	39.94	267,598.00	
UBISOFT ENTERTAINMENT	12,600	61.00	768,600.00	
VIVENDI SA	124,000	25.99	3,222,760.00	
小計銘柄数：237			611,803,433.50	
			(74,315,763,067)	
組入時価比率：11.2%				11.7%

英ボンド	BP PLC	2,956,000	4.87	14,416,412.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	621,000	22.78	14,146,380.00	
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	545,000	22.75	12,401,475.00	
	CRODA INTERNATIONAL PLC	19,300	51.25	989,125.00	
	JOHNSON MATTHEY PLC	30,200	30.78	929,556.00	
	ANGLO AMERICAN PLC	153,000	21.70	3,320,100.00	
	ANTOFAGASTA PLC	59,000	9.30	548,700.00	
	BHP GROUP PLC	305,000	17.91	5,463,770.00	
	EVRAZ PLC	76,000	3.95	300,884.00	
	GLENCORE PLC	1,580,000	2.34	3,709,050.00	
	RIO TINTO PLC-REG	164,500	45.35	7,460,075.00	
	MONDI PLC	68,000	17.74	1,206,320.00	
	BAE SYSTEMS PLC	466,000	5.78	2,697,208.00	
	MEGGITT PLC	111,000	6.60	732,822.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	253,000	6.98	1,765,940.00	
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC -C	11,638,000	0.00	11,638.00	
	MELROSE INDUSTRIES PLC	730,000	2.41	1,765,140.00	
	DCC PLC	14,500	65.46	949,170.00	
	SMITHS GROUP PLC	55,000	16.95	932,525.00	
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,500	90.55	950,775.00	
	WEIR GROUP PLC	38,000	15.49	588,810.00	
	ASHTAD GROUP PLC	68,700	24.37	1,674,219.00	
	BUNZLE	50,000	21.50	1,075,000.00	
	FERGUSON PLC	32,900	70.70	2,326,030.00	
	G4S PLC	219,000	2.14	469,755.00	
	RENTOKIL INTIAL PLC	263,000	4.60	1,211,904.00	
	EASYJET PLC	21,000	14.19	297,990.00	
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	145,000	7.43	1,078,220.00	
	PERSIMMON PLC	48,000	26.25	1,260,000.00	
	TAYLOR WIMPEY PLC	450,000	1.92	866,700.00	
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	17,100	49.47	845,937.00		
BURBERRY GROUP PLC	60,000	22.23	1,333,800.00		
CARNIVAL PLC	22,900	37.12	850,048.00		
COMPASS GROUP PLC	229,000	19.18	4,393,365.00		
GVC HOLDINGS PLC	87,000	8.88	772,560.00		

INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	25,800	52.40	1,351,920.00
TUI AG-DI	70,000	9.60	672,140.00
WHITBREAD PLC	18,500	48.98	906,130.00
OCADO GROUP PLC	65,000	12.69	825,175.00
MARKS & SPENCER PLC	310,000	2.16	670,220.00
NEXT PLC	19,800	71.14	1,408,572.00
JD SPORTS FASHION PLC	59,000	8.34	492,296.00
KINGFISHER PLC	308,000	2.20	678,524.00
MORRISON SUPERMARKETS	370,000	2.02	748,140.00
SA INSBURY	255,000	2.34	597,210.00
TESCO PLC	1,407,000	2.53	3,565,338.00
COCA-COLA HBC AG-DI	29,000	25.77	747,330.00
DIAGEO PLC	345,000	32.20	11,109,000.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	54,100	26.12	1,413,092.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	332,500	32.71	10,877,737.50
IMPERIAL BRANDS PLC	136,000	18.60	2,530,688.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	102,500	61.83	6,337,575.00
UNILEVER PLC	162,800	43.89	7,146,106.00
SMITH & NEPHEW PLC	130,000	18.80	2,444,000.00
NMC HEALTH PLC	13,300	17.82	237,006.00
ASTRAZENECA PLC	191,500	77.14	14,772,310.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	728,000	18.17	13,232,128.00
BARCLAYS PLC	2,490,000	1.80	4,482,000.00
HSBC HOLDINGS PLC	2,949,000	5.99	17,676,306.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	10,260,000	0.63	6,506,892.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	710,000	2.42	1,723,170.00
STANDARD CHARTERED PLC	395,000	7.27	2,871,650.00
M&G PLC	378,000	2.38	899,640.00
ADMIRAL GROUP PLC	27,000	23.00	621,000.00
AVIVA PLC	572,000	4.22	2,417,272.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	219,000	3.17	696,201.00
LEGAL & GENERAL	858,000	3.09	2,651,220.00
PRUDENTIAL PLC	378,000	14.41	5,448,870.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	143,000	5.65	807,950.00
AVEVA GROUP PLC	8,500	47.16	400,860.00

	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	48,116	11.01	529,853.39
	SAGE GROUP PLC (THE)	159,000	7.57	1,204,266.00
	HALMA PLC	54,000	21.44	1,157,760.00
	BT GROUP PLC	1,210,000	1.96	2,371,600.00
	VODAFONE GROUP PLC	3,870,000	1.50	5,820,480.00
	SSE PLC	149,000	14.67	2,186,575.00
	CENTRICA PLC	780,000	0.90	702,468.00
	NATIONAL GRID PLC	511,000	9.59	4,901,512.00
	SEVERN TRENT PLC	37,000	25.13	929,810.00
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	96,000	9.50	912,768.00
	3I GROUP PLC	143,000	11.00	1,573,000.00
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	40,100	19.75	792,175.50
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	45,200	76.80	3,471,360.00
	SCHRODERS PLC	19,700	33.85	666,845.00
	ST JAMES S PLACE PLC	81,000	11.76	952,965.00
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	366,000	3.36	1,233,054.00
	EXPERIAN PLC	131,600	26.05	3,428,180.00
	INTERTEK GROUP PLC	23,900	58.50	1,398,150.00
	RELX PLC	282,000	19.22	5,421,450.00
	INFORMA PLC	186,000	8.70	1,618,572.00
	ITV PLC	500,000	1.52	763,750.00
	PEARSON	109,000	6.58	717,220.00
	WPP PLC	183,000	10.69	1,956,270.00
	AUTO TRADER GROUP PLC	141,000	5.98	843,744.00
小計	銘柄数：94			269,260,899.39 (38,259,281,194)
	組入時価比率：5.8%			6.0%
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	25,900	21.57	558,663.00
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	642.50	783,850.00
	GIVAUDAN-REG	1,354	3,042.00	4,118,868.00
	SIKA AG-REG	19,100	183.85	3,511,535.00
	LAFARGEHOLCIM LTD	70,500	53.90	3,799,950.00
	GEBERIT AG-REG	5,340	545.00	2,910,300.00
	ABB LTD	269,000	23.58	6,343,020.00
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	238.00	714,000.00

SCHINDLER HOLDING-PART CERT	6,100	247.70	1,510,970.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	8,400	163.35	1,372,140.00	
CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	77,200	76.72	5,922,784.00	
THE SWATCH GROUP AG-B	4,120	269.80	1,111,576.00	
THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	51.30	379,620.00	
DUFREY AG-REG	6,500	97.40	633,100.00	
BARRY CALLEBAUT AG	460	2,142.00	985,320.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	161	7,540.00	1,213,940.00	
CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	15	85,800.00	1,287,000.00	
NESTLE SA-REG	432,700	106.60	46,125,820.00	
ALCON INC	60,300	56.00	3,376,800.00	
SONOVA HOLDING AG-REG	8,200	223.40	1,831,880.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,450	954.20	1,383,590.00	
NOVARTIS AG-REG	312,100	93.20	29,087,720.00	
ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	102,080	315.50	32,206,240.00	
VIFOR PHARMA AG	6,700	178.70	1,197,290.00	
PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	5,800	80.35	466,030.00	
BALOISE HOLDING AG	7,400	176.00	1,302,400.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	4,830	493.80	2,385,054.00	
SWISS RE LTD	42,900	109.95	4,716,855.00	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	21,900	402.40	8,812,560.00	
TEMENOS AG-REG	9,300	154.05	1,432,665.00	
SWISSCOM AG-REG	3,810	516.00	1,965,960.00	
CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	379,000	13.07	4,955,425.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	31,400	50.42	1,583,188.00	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,650	883.80	2,342,070.00	
UBS GROUP AG	557,000	12.24	6,817,680.00	
LONZA AG-REG	10,730	355.50	3,814,515.00	
ADECCO GROUP AG-REG	21,800	61.78	1,346,804.00	
SGS SA-REG	750	2,654.00	1,990,500.00	
SWISS PRIME SITE-REG	11,400	111.70	1,273,380.00	
小計 銘柄数：39			197,571,062.00	
			(22,064,736,204)	
組入時価比率：3.3%			3.5%	
スウェーデン ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	28,800	316.60	9,118,080.00

BOLIDEN AB	38,000	246.50	9,367,000.00	
ASSA ABLOY AB-B	146,000	224.70	32,806,200.00	
SKANSKA AB-B SHS	51,000	214.90	10,959,900.00	
ALFA LAVAL AB	45,000	241.70	10,876,500.00	
ATLAS COPCO AB-A	96,800	382.50	37,026,000.00	
ATLAS COPCO AB-B	58,000	333.20	19,325,600.00	
EPIROC AB - A	92,000	117.80	10,837,600.00	
EPIROC AB - B	58,000	114.65	6,649,700.00	
SANDVIK AB	161,000	185.50	29,865,500.00	
SKF AB-B SHARES	58,000	193.40	11,217,200.00	
VOLVO AB-B SHS	215,000	159.10	34,206,500.00	
SECURITAS AB-B SHS	45,000	163.20	7,344,000.00	
ELECTROLUX AB-B	34,000	233.40	7,935,600.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	55,000	76.10	4,185,500.00	
HENNES&MAURITZ AB-B	118,000	192.46	22,710,280.00	
ICA GRUPPEN AB	13,800	439.30	6,062,340.00	
SWEDISH MATCH AB	23,600	483.10	11,401,160.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	87,700	306.00	26,836,200.00	
NORDEA BANK ABP	471,000	76.74	36,144,540.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	239,000	88.42	21,132,380.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	230,000	101.65	23,379,500.00	
SWEDBANK AB	137,000	138.80	19,015,600.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	228.30	5,707,500.00	
INVESTOR AB-B SHS	66,100	519.40	34,332,340.00	
KINNEVIK AB - B	33,700	230.30	7,761,110.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	12,600	413.80	5,213,880.00	
ERICSSON LM-B	440,000	83.06	36,546,400.00	
HEXAGON AB-B SHS	39,300	531.40	20,884,020.00	
TELIA CO AB	401,000	40.90	16,400,900.00	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	12,900	454.00	5,856,600.00	
TELE 2 AB-B SHS	69,000	136.90	9,446,100.00	
小計 銘柄数：32			550,551,730.00	
			(6,413,927,654)	
組入時価比率：1.0%			1.0%	
ノルウェーク	AKER AB ASA	14,100	288.00	4,060,800.00

ローネ					
		EQUINOR ASA	143,000	176.85	25,289,550.00
		YARA INTERNATIONAL ASA	26,200	369.00	9,667,800.00
		NORSK HYDRO	184,000	32.71	6,018,640.00
		MOWI ASA	62,000	231.50	14,353,000.00
		ORKLA ASA	115,000	90.24	10,377,600.00
		DNB ASA	137,000	163.60	22,413,200.00
		GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	184.85	5,730,350.00
		TELENOR ASA	108,000	159.95	17,274,600.00
		SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	251.40	3,243,060.00
小計	銘柄数：10			118,428,600.00	(1,456,671,780)
	組入時価比率：0.2%				0.2%
デンマーク ローネ		CHR HANSEN HOLDING A/S	15,100	536.40	8,099,640.00
		NOVOZYMES A/S-B SHARES	31,300	326.90	10,231,970.00
		VESTAS WIND SYSTEMS A/S	28,400	674.00	19,141,600.00
		ISS A/S	21,800	162.80	3,549,040.00
		DSV PANALPINA A S	32,500	766.00	24,895,000.00
		A P MOLLER - MAERSK A/S-A	520	9,060.00	4,711,200.00
		AP MOLLER-MAERSK A/S-B	920	9,626.00	8,855,920.00
		PANDORA A/S	13,700	290.10	3,974,370.00
		CARLSBERG B	15,300	1,007.00	15,407,100.00
		COLOPLAST-B	17,600	837.80	14,745,280.00
		DEMANT A/S	16,000	211.00	3,376,000.00
		GENMAB A/S	9,400	1,464.50	13,766,300.00
		H LUNDBECK A/S	10,500	259.30	2,722,650.00
		NOVO NORDISK A/S-B	256,500	390.90	100,265,850.00
		DANSKE BANK AS	97,000	107.00	10,379,000.00
		TRYG A/S	19,900	198.50	3,950,150.00
		ORSTED A/S	27,300	679.20	18,542,160.00
小計	銘柄数：17			266,613,230.00	(4,335,131,119)
	組入時価比率：0.7%				0.7%
豪ドル		WORLEY LTD	47,000	15.34	720,980.00
		CALTEX AUSTRALIA LIMITED	34,000	34.13	1,160,420.00

OIL SEARCH LTD	204,000	7.38	1,505,520.00
ORIGIN ENERGY LTD	265,000	8.61	2,281,650.00
SANTOS LTD.	261,000	8.35	2,179,350.00
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	21.94	372,980.00
WOODSIDE PETROLEUM	135,000	35.04	4,730,400.00
INCITEC PIVOT LTD	233,000	3.24	754,920.00
ORICA LTD	59,000	22.99	1,356,410.00
BORAL LTD	153,000	4.50	688,500.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	67,000	28.50	1,909,500.00
ALUMINA LTD	350,000	2.37	829,500.00
BHP GROUP LIMITED	427,000	39.23	16,751,210.00
BLUESCOPE STEEL LTD	70,000	15.40	1,078,000.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	201,000	10.91	2,192,910.00
NEWCREST MINING	110,000	29.23	3,215,300.00
RIO TINTO LTD	55,300	102.00	5,640,600.00
SOUTH32 LTD	700,000	2.69	1,883,000.00
CIMIC GROUP LTD	11,700	33.63	393,471.00
BRAMBLES LTD	235,000	12.08	2,838,800.00
QANTAS AIRWAYS LIMITED	108,000	7.33	791,640.00
AURIZON HOLDINGS LTD	305,000	5.36	1,634,800.00
SYDNEY AIRPORT	168,000	9.10	1,528,800.00
TRANSURBAN GROUP	402,000	15.58	6,263,160.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	82,000	34.63	2,839,660.00
CROWN RESORTS LTD	55,000	12.22	672,100.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	7,300	44.64	325,872.00
TABCORP HOLDINGS	287,000	4.65	1,334,550.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	97,117	4.21	408,862.57
WESFARMERS LIMITED	164,000	41.79	6,853,560.00
COLES GROUP LTD	163,000	15.25	2,485,750.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	182,000	37.37	6,801,340.00
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	11.25	866,250.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	111,000	16.65	1,848,150.00
COCHLEAR LTD	8,100	232.74	1,885,194.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	25,000	74.23	1,855,750.00
SONIC HEALTHCARE LTD	69,000	29.47	2,033,430.00

	CSL LIMITED	65,700	282.29	18,546,453.00	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	409,000	24.73	10,114,570.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	67,000	9.92	664,640.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	256,600	80.71	20,710,186.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	416,000	24.86	10,341,760.00	
	WESTPAC BANKING CORP	506,000	24.21	12,250,260.00	
	AMP LIMITED	530,000	1.89	1,001,700.00	
	CHALLENGER LIMITED	80,000	8.31	664,800.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	335,000	7.84	2,626,400.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	400,000	3.23	1,292,000.00	
	QBE INSURANCE	195,000	13.03	2,540,850.00	
	SUNCORP GROUP LTD	190,316	13.21	2,514,074.36	
	COMPUTERSHARE LTD	76,000	17.07	1,297,320.00	
	WISETECH GLOBAL LTD	21,000	24.66	517,860.00	
	TELSTRA CORP LTD	590,000	3.65	2,153,500.00	
	TPG TELECOM LTD	52,000	7.00	364,000.00	
	AUSNET SERVICES	230,000	1.76	405,950.00	
	APA GROUP	180,000	11.56	2,080,800.00	
	AGL ENERGY LTD	94,000	21.05	1,978,700.00	
	ASX LTD	28,600	81.06	2,318,316.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	47,100	139.22	6,557,262.00	
	MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD	19,200	57.72	1,108,224.00	
	SEEK LTD	48,000	23.00	1,104,000.00	
	REA GROUP LTD	6,900	107.46	741,474.00	
小計	銘柄数：61			196,807,388.93	
				(14,937,680,819)	
	組入時価比率：2.3%			2.4%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	112,627	5.29	595,796.83	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	152,000	9.20	1,398,400.00	
	A2 MILK CO LTD	106,000	15.38	1,630,280.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	86,000	22.48	1,933,280.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	16.80	974,400.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	260,000	4.44	1,155,700.00	
	MERCURY NZ LTD	100,000	5.15	515,000.00	

	MERIDIAN ENERGY LTD	201,000	5.22	1,049,220.00	
小計	銘柄数：8			9,252,076.83	
				(673,366,151)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	387,040	74.65	28,892,536.00	
	NWS HOLDINGS LTD	220,500	11.16	2,460,780.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	197,000	62.20	12,253,400.00	
	MTR CORP	221,000	46.10	10,188,100.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	97,000	23.30	2,260,100.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	316,000	56.10	17,727,600.00	
	SANDS CHINA LTD	364,000	40.35	14,687,400.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	8.80	2,376,000.00	
	WYNN MACAU LTD	228,000	18.66	4,254,480.00	
	BUDWEISER BREWING CO APAC LT	177,000	27.40	4,849,800.00	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	102,000	28.60	2,917,200.00	
	WH GROUP LIMITED	1,460,000	8.01	11,694,600.00	
	BANK OF EAST ASIA	170,060	17.46	2,969,247.60	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	536,000	27.30	14,632,800.00	
	HANG SENG BANK	112,000	162.20	18,166,400.00	
	AIA GROUP LTD	1,765,000	79.40	140,141,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	48,000	108.20	5,193,600.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	509,600	11.06	5,636,176.00	
	PCCW LTD	550,000	4.71	2,590,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	89,000	55.15	4,908,350.00	
	CLP HLDGS	240,000	82.35	19,764,000.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	209,000	57.10	11,933,900.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,490,348	15.10	22,504,254.80	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	173,200	253.40	43,888,880.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	387,040	54.80	21,209,792.00	
	HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	16.94	5,251,400.00	
	HENDERSON LAND	202,443	37.90	7,672,589.70	
	KERRY PROPERTIES	114,000	25.15	2,867,100.00	
	NEW WORLD DEVELOPMENT	939,666	10.46	9,828,906.36	

	SINO LAND CO.LTD	480,000	11.36	5,452,800.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	228,000	117.60	26,812,800.00	
	SWIRE PACIFIC-A	75,000	71.80	5,385,000.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	25.55	4,420,150.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	183,000	45.80	8,381,400.00	
	WHEELLOCK & COMPANY LTD	117,000	51.70	6,048,900.00	
小計	銘柄数：35			510,221,942.46	
				(7,178,822,730)	
	組入時価比率：1.1%				1.1%
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	249,000	3.95	983,550.00	
	KEPPEL CORP.	202,000	6.75	1,363,500.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	140,040	2.27	317,890.80	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	280,000	1.15	322,000.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,040	9.07	698,752.80	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	310,000	2.35	728,500.00	
	SATS LTD	115,000	5.07	583,050.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	870,000	0.93	809,100.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	30.26	423,640.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	289,000	4.10	1,184,900.00	
	DBS GROUP HLDGS	262,000	25.99	6,809,380.00	
	OCBC-ORD	475,000	10.98	5,215,500.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	183,000	26.33	4,818,390.00	
	VENTURE CORP LTD	35,000	15.97	558,950.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,160,000	3.37	3,909,200.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	111,000	8.99	997,890.00	
	CAPITALAND LIMITED	380,000	3.73	1,417,400.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	10.96	767,200.00	
	UOL GROUP LIMITED	65,000	8.32	540,800.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	240,000	2.14	513,600.00	
小計	銘柄数：20			32,963,193.60	
				(2,666,722,362)	
	組入時価比率：0.4%				0.4%
新シェケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	91,000	16.45	1,496,950.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	560.00	2,016,000.00	

	BANK HAPOALIM BM	167,000	28.10	4,692,700.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	221,000	24.72	5,463,120.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	172,000	15.96	2,745,120.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	23,000	91.30	2,099,900.00	
	NICE LTD	8,700	534.00	4,645,800.00	
	AZRIELI GROUP	6,500	259.00	1,683,500.00	
	小計 銘柄数：8			24,843,090.00	
				(783,054,196)	
				0.1%	
	組入時価比率：0.1%				
	合計			634,684,826,032	
				(634,684,826,032)	

(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12月26日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	80,000	1,429,600.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	16,900	2,705,690.00	
		AMERICAN TOWER CORP	64,200	14,578,536.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	214,000	2,069,380.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	20,200	4,200,388.00	
		BOSTON PROPERTIES	22,200	3,017,868.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	14,500	1,525,110.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	60,100	8,416,404.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	30,500	3,560,570.00	
		DUKE REALTY CORP	52,300	1,783,430.00	
		EQUINIX INC	12,410	7,113,908.40	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	24,200	1,674,398.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	53,600	4,308,368.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,560	2,853,086.40	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	19,400	2,025,360.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	11,100	1,408,812.00	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	70,500	2,361,750.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	109,000	2,040,480.00			

	INVITATION HOMES INC	79,300	2,315,560.00	
	IRON MOUNTAIN INC	43,100	1,368,856.00	
	KIMCO REALTY CORP	65,000	1,323,400.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	22,400	1,333,024.00	
	MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	75,000	1,531,500.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,500	2,134,440.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	24,400	1,271,728.00	
	OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	32,200	1,332,436.00	
	PROLOGIS INC	91,200	8,012,832.00	
	PUBLIC STORAGE	23,200	4,868,752.00	
	REALTY INCOME CORP	45,900	3,321,324.00	
	REGENCY CENTERS CORP	23,900	1,478,693.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	16,800	4,034,520.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	44,400	6,472,188.00	
	SL GREEN REALTY CORP	12,500	1,146,000.00	
	SUN COMMUNITIES INC	13,300	1,972,789.00	
	UDR INC	43,000	1,980,150.00	
	VENTAS INC	53,900	3,092,243.00	
	VEREIT INC	160,000	1,462,400.00	
	VICI PROPERTIES INC	68,000	1,713,600.00	
	VORNADO REALTY TRUST	24,200	1,626,482.00	
	WELLTOWER INC	58,600	4,683,898.00	
	WEYERHAEUSER CO	106,500	3,179,025.00	
	WP CAREY INC	25,200	1,977,948.00	
小計	銘柄数：42	2,053,170	130,706,926.80	
			(14,322,865,038)	
	組入時価比率：2.2%		81.4%	
カナダドル	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	11,500	613,295.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	20,000	423,400.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	590,920.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	346,940.00	
小計	銘柄数：4	64,500	1,974,555.00	
			(164,460,685)	
	組入時価比率：0.0%		0.9%	
ユーロ	COVIVIO	6,600	673,200.00	
	GECINA SA	6,400	1,022,720.00	

小計	ICADE	3,800	365,180.00	
	KLEPIERRE	28,000	936,600.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	20,100	2,801,940.00	
	銘柄数：5	64,900	5,799,640.00	(704,482,270)
	組入時価比率：0.1%			4.0%
英ポンド	BRITISH LAND	128,000	793,600.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	99,000	959,904.00	
	SEGRO PLC	162,000	1,442,772.00	
	銘柄数：3	389,000	3,196,276.00	(454,158,856)
	組入時価比率：0.1%			2.6%
豪ドル	DEXUS	155,000	1,847,600.00	
	GOODMAN GROUP	241,000	3,304,110.00	
	GPT GROUP	285,000	1,664,400.00	
	LENLEASE GROUP	88,000	1,594,560.00	
	MIRVAC GROUP	570,000	1,846,800.00	
	SCENTRE GROUP	769,000	3,006,790.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	348,000	1,670,400.00	
	VICINITY CENTRES	470,000	1,217,300.00	
	銘柄数：8	2,926,000	16,151,960.00	(1,225,933,764)
	組入時価比率：0.2%			7.0%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	370,000	2,930,400.00	
	LINK REIT	301,000	24,381,000.00	
	銘柄数：2	671,000	27,311,400.00	(384,271,398)
	組入時価比率：0.1%			2.2%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	440,800	1,300,360.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	369,972	728,844.84	
	CAPITALAND MALL TRUST	390,000	947,700.00	
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	300,000	705,000.00	
	SUNTEC REIT	300,000	549,000.00	
	銘柄数：5	1,800,772	4,230,904.84	(342,280,201)
	組入時価比率：0.1%			1.9%

合計		17,598,452,212	
		(17,598,452,212)	

(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12月26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	8,652,051,953	-	8,692,013,994	39,962,041
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	896,564,440	-	898,481,000	1,916,560
米ドル	360,921,000	-	361,581,000	660,000
ユーロ	327,428,622	-	327,942,000	513,378
英ポンド	84,878,808	-	85,248,000	369,192
スイスフラン	77,945,728	-	78,176,000	230,272
豪ドル	45,390,282	-	45,534,000	143,718
合計	-	-	-	38,045,481

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国株式マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2019年12月26日現在)	
資産の部	
流動資産	
預金	606,795,352
コール・ローン	15,044,373
株式	40,923,966,262
投資信託受益証券	1,649,109,526
投資証券	101,934,785
派生商品評価勘定	15,360,377
未収入金	623,766
未収配当金	41,512,412
差入委託証拠金	390,406,441
流動資産合計	43,744,753,294
資産合計	43,744,753,294
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	62,752
未払解約金	46,636,369
未払利息	22
その他未払費用	2,286,300
流動負債合計	48,985,443
負債合計	48,985,443
純資産の部	
元本等	
元本	32,739,805,679
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,955,962,172
元本等合計	43,695,767,851
純資産合計	43,695,767,851
負債純資産合計	43,744,753,294

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	<p>株式</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>新株予約権証券</p> <p>原則として時価で評価しております。</p> <p>時価評価にあたっては、市場価格のある有価証券についてはその最終相場(計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場)で評価しております。</p> <p>投資信託受益証券</p>
-------------------	--

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

（貸借対照表に関する注記）

2019年12月26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	1,3346円
(10,000口当たり純資産額)	(13,346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12月27日 至 2019年12月26日
1. 金融商品に対する取組方針

当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。

当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

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12月26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。

新株予約権証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資信託受益証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

投資証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年12月26日現在

期首

2018年12月27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

28,550,422,461円

同期中における追加設定元本額	6,874,332,897円
同期中における一部解約元本額	2,684,949,679円
期末元本額	32,739,805,679円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	27,398,316円
野村資産設計ファンド2020	30,703,930円
野村資産設計ファンド2025	49,854,464円
野村資産設計ファンド2030	59,236,303円
野村資産設計ファンド2035	46,433,939円
野村資産設計ファンド2040	102,806,352円
野村資産設計ファンド2045	15,099,523円
野村インデックスファンド・新興国株式	3,719,317,104円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	276,036,183円
野村資産設計ファンド2050	25,683,977円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	8,085,670円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	3,555,815円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	2,724,626円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,750,490円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,830,207円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,370,555円
インデックス・ブレンド(タイプ)	8,277,708円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,468,446円
インデックス・ブレンド(タイプ)	10,302,422円
野村つみたて外国株投信	1,259,007,693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)	547,725,953円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	1,249,291,248円
世界6資産分散ファンド	168,958,720円
野村資産設計ファンド2060	2,682,835円
NEXT FUNDS 新興国株式・MSCIエマージング・マーケット・インデックス(為替ヘッジなし)連動型上場投信	336,990,613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)	11,332,946円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国株式(適格機関投資家専用)	1,485,991,986円
野村新興国株式インデックスファンド(確定拠出年金向け)	23,275,212,283円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	3,734,339円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	2,530,624円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	3,006,166円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	404,243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12月26日現在)

				評価額
--	--	--	--	-----

種類	通貨	銘柄	株式数	単価	金額	備考
株式	米ドル	ECOPETROL SA-SPONSORED ADR	13,700	20.70	283,590.00	
		INNER MONGOLIA YITAI COAL-B	57,700	0.77	44,948.30	
		LUKOIL PJSC-SPON ADR	24,370	97.80	2,383,386.00	
		NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S	5,790	204.60	1,184,634.00	
		PJSC GAZPROM-ADR	330,500	8.19	2,708,778.00	
		ROSNEFT OJSC - GDR	72,800	7.23	526,635.20	
		SURGUTNEFTEGAZ-SP ADR	75,600	8.21	620,676.00	
		TATNEFT-SPONSORED ADR	16,260	76.00	1,235,760.00	
		TRANSNEFT PJSC	21	2,848.74	59,823.64	
		YPF S.A. -SPONSORED ADR	10,600	11.61	123,066.00	
		PJSC PHOSAGRO-GDR REG S	7,010	12.50	87,625.00	
		QUIMICA Y MINERA CHIL-SP ADR	7,400	27.72	205,128.00	
		CIA DE MINAS BUENAVENTUR-ADR	12,900	14.92	192,468.00	
		MAGNITOGORS-SPON GDR REGS	10,700	8.54	91,378.00	
		NOVOLIPET STEEL - GDR REG S	7,370	22.76	167,741.20	
		PJSC ALROSA	176,000	1.35	238,184.32	
		PJSC MMC NORILSK NICKEL-ADR	40,800	30.52	1,245,216.00	
		POLYUS PJSC-REG S-GDR	3,960	56.15	222,354.00	
		SEVERSTAL-GDR REG S	15,800	15.00	237,000.00	
		SOUTHERN COPPER CORP	4,992	42.59	212,609.28	
		BEST INC - ADR	8,600	5.37	46,182.00	
		ZTO EXPRESS CAYMAN INC	18,400	22.99	423,016.00	
		LATAM AIRLINES GROUP-SP ADR	20,300	10.85	220,255.00	
		DP WORLD PLC	11,000	12.90	141,900.00	
		NIO INC ADR	52,000	2.53	131,560.00	
		HUAZHU GROUP LTD-SPON ADR	8,800	40.83	359,304.00	
		YUM CHINA HOLDINGS INC	23,160	48.38	1,120,480.80	
		ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	106,190	214.26	22,752,269.40	
		BAOZUN INC-SPN ADR	2,300	33.36	76,728.00	
		JD.COM INC-ADR	47,700	36.28	1,730,556.00	
		PINDUODUO INC ADR	11,340	38.04	431,373.60	
		TRIP.COM GROUP LTD-ADR	30,740	34.47	1,059,607.80	
VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	26,600	14.61	388,626.00			
MAGNIT PJSC-SPON GDR REGS	19,700	12.21	240,537.00			

X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR	8,500	33.91	288,235.00
CIA CERVECERIAS UNIDAS-ADR	4,000	19.23	76,920.00
HUTCHISON CHINA MEDITECH LTD - ADR	3,890	24.64	95,849.60
BANCO DE CHILE-ADR	14,300	21.60	308,880.00
BANCO MACRO SA-ADR	2,760	36.72	101,347.20
BANCO SANTANDER CHILE-ADR	9,000	23.50	211,500.00
BANCOLOMBIA S.A.-SPONS ADR	7,330	55.37	405,862.10
CREDICORP LTD	4,350	213.60	929,160.00
GRUPO FINANCIERO GALICIA-ADR	7,430	16.48	122,446.40
ITAU CORPBANCA-ADR	5,466	8.79	48,057.07
PJSC SBERBANK OF RUSSIA	686,300	4.00	2,749,098.18
STATE BANK OF INDIA-GDR	11,070	46.40	513,648.00
VTB BANK OJSC-GDR-REG S/WI	87,890	1.46	129,110.41
GDS HOLDINGS LTD-ADR	3,200	51.28	164,096.00
GLOBANT SA	2,470	108.15	267,130.50
TELECOM ARGENTINA SA-SP ADR	5,300	11.48	60,844.00
MOBILE TELESYSTEMS PJSC-ADR	28,650	10.09	289,078.50
ENEL AMERICAS S.A-ADR	48,400	11.02	533,368.00
ENEL CHILE SA-ADR	26,500	4.77	126,405.00
INTER RAO UES PJSC	2,740,000	0.08	220,707.00
QUDIAN INC SPON ADR	6,600	4.63	30,558.00
MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC	85,170	1.72	146,924.21
NOAH HLDS LTD ADR	1,500	35.00	52,500.00
NEW ORIENTAL EDUCATION-SP ADR	9,230	124.70	1,150,981.00
TAL EDUCATION GROUP-ADR	23,470	47.58	1,116,702.60
51JOB INC-ADR	1,300	85.79	111,527.00
SHANGHAI LUJIAZUI FIN&TRAD-B	87,648	0.94	83,090.30
HUYA INC-ADR	2,700	17.69	47,763.00
IQIYI INC-ADR	9,100	21.18	192,738.00
NETEASE INC-ADR	4,350	300.87	1,308,784.50
TENCENT MUSIC ENTERTAINM-ADR	7,400	11.67	86,358.00
58.COM INC-ADR	5,780	65.19	376,798.20
AUTOHOME INC-ADR	3,860	81.83	315,863.80
BAIDU INC - SPON ADR	17,100	128.49	2,197,179.00
MOMO INC-SPON ADR	8,800	35.32	310,816.00

	SINA CORP	4,150	38.58	160,107.00	
	WEIBO CORP-SPON ADR	3,400	47.21	160,514.00	
	YY INC-ADR	4,250	55.49	235,832.50	
小計	銘柄数：72			56,920,176.61	
				(6,237,312,952)	
	組入時価比率：14.3%			15.3%	
メキシコペソ	ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV	60,458	41.87	2,531,376.46	
	CEMEX SAB - CPO	861,985	7.23	6,232,151.55	
	GRUPO MEXICO SAB DE CV- SER B	229,983	53.40	12,281,092.20	
	INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV	8,410	193.62	1,628,344.20	
	ALFA S.A.B. -A	172,100	15.87	2,731,227.00	
	GRUPO CARSO SAB DE CV-SER A1	34,900	71.44	2,493,256.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DE SUR-B	14,300	353.16	5,050,188.00	
	GRUPO AEROPORTUARIO DEL-B SH	21,400	226.99	4,857,586.00	
	PROMOTORA Y OPERADORA DE INF	12,900	197.46	2,547,234.00	
	ALSEA SAB DE CV	30,000	50.94	1,528,200.00	
	EL PUERTO DE LIVERPOOL-C1	10,800	99.98	1,079,784.00	
	WALMART DE MEXICO-SER V	318,000	55.36	17,604,480.00	
	ARCA CONTINENTAL SAB DE CV	26,100	101.55	2,650,455.00	
	COCA-COLA FEMSA SAB DE CV	32,495	114.88	3,733,025.60	
	FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD	118,700	178.52	21,190,324.00	
	GRUMA S.A.B. -B	13,400	196.53	2,633,502.00	
	GRUPO BIMBO SAB-SERIES A	124,000	33.81	4,192,440.00	
	KIMBERLY-CLARK DE MEXICO-A	115,000	38.83	4,465,450.00	
	GRUPO FINANCIERO BANORTE-O	167,300	110.20	18,436,460.00	
	GRUPO FINANCIERO INBURSA-O	140,200	23.79	3,335,358.00	
	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	2,074,000	15.20	31,524,800.00	
	INFRAESTRUCTURA ENERGETICA N	38,700	87.32	3,379,284.00	
	GRUPO TELEVISA SAB - SER CPO	153,400	44.38	6,807,892.00	
	MEGACABLE HOLDINGS-CPO	23,100	78.08	1,803,648.00	
小計	銘柄数：24			164,717,558.01	
				(952,067,485)	
	組入時価比率：2.2%			2.3%	
リアル	NATURA &CO HOLDING SA	23,200	39.85	924,520.00	
	COSAN SA	9,100	69.20	629,720.00	

PETROBRAS - PETROLEO BRAS	182,700	32.40	5,919,480.00	
PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	259,300	30.50	7,908,650.00	
ULTRAPAR PARTICIPACOES	48,000	25.33	1,215,840.00	
BRASKEM SA-PREF A	12,100	29.25	353,925.00	
KLABIN SA-UNIT	42,700	18.59	793,793.00	
CIA SIDERURGICA NACIONAL SA	46,200	14.53	671,286.00	
GERDAU SA PFD NPV	74,500	19.46	1,449,770.00	
VALE SA	196,421	54.58	10,720,658.18	
SUZANO SA	32,960	40.04	1,319,718.40	
EMBRAER SA	41,000	19.73	808,930.00	
WEG SA	51,924	33.79	1,754,511.96	
LOCALIZA RENT A CAR	42,560	46.80	1,991,808.00	
RUMO SA	70,600	25.94	1,831,364.00	
CCR SA	87,000	19.23	1,673,010.00	
B2W CIA DIGITAL	13,500	62.60	845,100.00	
LOJAS AMERICANAS SA-PREF	50,492	26.40	1,332,988.80	
LOJAS RENNER S.A.	52,895	56.10	2,967,409.50	
MAGAZINE LUIZA SA	46,000	48.74	2,242,040.00	
PETROBRAS DISTRIBUIDORA SA	48,800	30.20	1,473,760.00	
ATACADAO DISTRIBUICAO COMERC	29,600	23.23	687,608.00	
CIA BRASILEIRA DE DISTR-PREF	11,103	89.04	988,611.12	
RAIA DROGASIL SA	13,300	108.36	1,441,188.00	
AMBEV SA	288,656	18.96	5,472,917.76	
BRF SA	39,700	34.53	1,370,841.00	
JBS SA	63,400	26.32	1,668,688.00	
HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS	13,900	63.20	878,480.00	
NOTRE DAME INTERMED PAR SA	30,300	66.39	2,011,617.00	
HYPERA SA	23,900	35.75	854,425.00	
BANCO BRADESCO S.A.	71,631	33.99	2,434,737.69	
BANCO BRADESCO SA - PREF	249,215	35.91	8,949,310.65	
BANCO DO BRASIL SA	56,900	52.60	2,992,940.00	
BANCO SANTANDER (BRASIL) SA	24,400	47.37	1,155,828.00	
ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	300,691	36.84	11,077,456.44	
ITAUSA-INVESTIMENTOS ITAU-PR	284,017	13.95	3,962,037.15	
BB SEGURIDADE PARTICIPACOES	44,100	37.95	1,673,595.00	

	IRB BRASIL RESSEGUROS SA	44,700	39.12	1,748,664.00	
	PORTO SEGURO SA	7,000	63.29	443,030.00	
	SUL AMERICA SA - UNITS	18,149	57.39	1,041,571.11	
	CIELO SA	73,763	8.53	629,198.39	
	TELEFONICA BRASIL-PREF	26,805	58.38	1,564,875.90	
	TIM PARTICIPACOES SA	46,552	15.39	716,435.28	
	CENTRAIS ELECTRICAS BRASILEIRAS-PREF B	18,000	38.51	693,180.00	
	CENTRAIS ELETRICAS BRASILIER	16,500	38.50	635,250.00	
	CIA ENERGETICA DE MINAS GER-PREF	60,029	13.70	822,397.30	
	ENERGISA SA-UNITS	10,200	52.63	536,826.00	
	EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	50,000	22.40	1,120,000.00	
	CIA SANEAMENTO BASICO DE SP	21,300	60.03	1,278,639.00	
	B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	131,433	46.87	6,160,264.71	
	BANCO BTG PACTUAL SA - UNIT	16,100	74.80	1,204,280.00	
	COGNA EDUCACAO	103,956	11.20	1,164,307.20	
	ENGIE BRASIL SA	12,000	49.85	598,200.00	
	BR MALLS PARTICIPACOES SA	46,700	18.16	848,072.00	
	MULTIPLAN EMPREENDIMENTOS	17,600	32.17	566,192.00	
小計	銘柄数：55			118,219,946.54	
				(3,178,934,362)	
	組入時価比率：7.3%			7.8%	
チリペソ	EMPRESAS COPEC SA	25,900	6,700.00	173,530,000.00	
	EMPRESAS CMPC SA	71,951	1,886.00	135,699,586.00	
	S.A.C.I. FALABELLA	50,200	3,274.90	164,399,980.00	
	CENCOSUD SA	80,738	986.00	79,607,668.00	
	EMBOTELLADORA ANDINA-PREF B	28,800	2,120.00	61,056,000.00	
	BANCO DE CREDITO E INVERSION	3,085	33,994.00	104,871,490.00	
	EMPRESA NACIONAL DE TELECOM	8,972	5,335.60	47,871,003.20	
	AGUAS ANDINAS SA-A	216,000	328.59	70,975,440.00	
	COLBUN SA	471,000	119.00	56,049,000.00	
小計	銘柄数：9			894,060,167.20	
				(130,264,566)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
コロンビアペソ	GRUPO ARGOS SA	15,600	18,340.00	286,104,000.00	
	BANCOLOMBIA SA	15,900	45,500.00	723,450,000.00	

	GRUPO AVAL ACCIONES-PFD	205,700	1,460.00	300,322,000.00	
	GRUPO DE INV SURAMERICANA	13,000	34,000.00	442,000,000.00	
	INTERCONEXION ELECTRICA SA	33,800	19,300.00	652,340,000.00	
小計	銘柄数：5			2,404,216,000.00	
				(79,819,971)	
	組入時価比率：0.2%			0.2%	
ユーロ	MOTOR OIL (HELLAS) SA	3,800	20.70	78,660.00	
	TITANCEMENT INTERNATIONAL	2,570	18.82	48,367.40	
	FF GROUP	2,030	0.96	1,948.80	
	OPAP SA	13,190	11.73	154,718.70	
	JUMBO SA	6,732	18.72	126,023.04	
	ALPHA BANK A.E.	72,000	1.91	138,024.00	
	EUROBANK ERGASIAS SA	162,000	0.89	144,180.00	
	NATIONAL BANK OF GREECE	33,000	2.96	97,977.00	
	HELLENIC TELECOM	16,700	14.25	237,975.00	
小計	銘柄数：9			1,027,873.94	
				(124,855,847)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
英ポンド	POLYMETAL INTERNATIONAL PLC	11,100	11.70	129,870.00	
小計	銘柄数：1			129,870.00	
				(18,453,228)	
	組入時価比率：0.0%			0.0%	
トルコリラ	TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE	8,300	126.20	1,047,460.00	
	EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK	78,250	8.77	686,252.50	
	ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI	20,730	19.70	408,381.00	
	KOC HLDGS	53,000	19.91	1,055,230.00	
	TURK HAVA YOLLARI AO	32,186	13.97	449,638.42	
	TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS	9,660	29.26	282,651.60	
	FORD OTOMOTIVE SANAYI AS	3,320	68.20	226,424.00	
	ARCELIK A.S	14,543	20.06	291,732.58	
	BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS	22,600	46.44	1,049,544.00	
	ANADOLU EFES BIRACTLIK VE MALT SANAYII	12,740	23.02	293,274.80	
	AKBANK T.A.S	205,000	8.23	1,687,150.00	
	TURKIYE GARANTI BANKASI	142,160	11.00	1,563,760.00	
	TURKIYE IS BANKASI AS-C	91,800	6.32	580,176.00	

	HACI OMER SABANCI HOLDING	47,880	9.53	456,296.40	
	TURKCELL ILETISIM HIZMET AS	77,000	13.83	1,064,910.00	
小計	銘柄数：15			11,142,881.30	
				(205,586,159)	
	組入時価比率：0.5%			0.5%	
チェココルナ	KOMERCNI BANKA AS	5,050	821.50	4,148,575.00	
	MONETA MONEY BANK AS	27,300	85.30	2,328,690.00	
	CEZ AS	12,000	509.50	6,114,000.00	
小計	銘柄数：3			12,591,265.00	
				(60,060,334)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
フォリント	MOL HUNGARIAN OIL AND GAS PLC	25,000	2,940.00	73,500,000.00	
	RICHTER GEDEON NYRT	8,470	6,450.00	54,631,500.00	
	OTP BANK NYRT	14,400	15,350.00	221,040,000.00	
小計	銘柄数：3			349,171,500.00	
				(127,796,769)	
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
ズロチ	GRUPA LOTOS SA	6,800	84.34	573,512.00	
	POLSKI KONCERN NAFTOWY S.A.	18,800	85.14	1,600,632.00	
	POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I	97,770	4.24	414,544.80	
	KGHM POLSKA MIEDZ S.A.	9,900	95.00	940,500.00	
	CCC SA	1,520	107.40	163,248.00	
	LPP SA	94	8,750.00	822,500.00	
	AMREST HOLDINGS SE	4,800	43.95	210,960.00	
	DINO POLSKA SA	2,200	141.30	310,860.00	
	BANK MILLENNIUM SA	35,830	5.81	208,172.30	
	BANK PEKAO SA	10,520	101.25	1,065,150.00	
	MBANK	900	389.80	350,820.00	
	PKO BANK POLSKI SA	56,200	34.67	1,948,454.00	
	SANTANDER BANK POLSKA SA	1,820	301.40	548,548.00	
	POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZE	37,500	40.33	1,512,375.00	
	ORANGE POLSKA SA	39,150	7.05	276,007.50	
	POLSKA GRUPA ENERGETYCZNA SA	51,730	7.97	412,288.10	
	CYFROWY POLSAT SA	18,900	27.96	528,444.00	
	CD PROJEKT RED SA	4,080	280.00	1,142,400.00	
小計	銘柄数：18			13,029,415.70	

				(371,729,229)	
	組入時価比率：0.9%			0.9%	
香港ドル	CHINA COMMON RICH RENEWABLE ENERGY	367,000	0.05	19,451.00	
	LEGEND HLDS CORP-RTS	18,100	0.00	0.00	
	CHINA OILFIELD SERVICES LTD-H	100,000	11.78	1,178,000.00	
	CHINA COAL ENERGY CO-H	112,000	3.03	339,360.00	
	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL-H	1,546,900	4.62	7,146,678.00	
	CHINA SHENHUA ENERGY CO - H	231,000	16.06	3,709,860.00	
	CNOOC LTD	1,101,000	12.62	13,894,620.00	
	COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION-H	66,000	3.51	231,660.00	
	PETROCHINA CO LTD-H	1,400,000	3.82	5,348,000.00	
	YANZHOU COAL MINING-H	96,000	6.88	660,480.00	
	SINOPEC SHANGHAI PETROCHEM-H	206,000	2.27	467,620.00	
	ANHUI CONCH CEMENT CO.LTD-H	83,500	53.90	4,500,650.00	
	BBMG CORPORATION - H	127,000	2.28	289,560.00	
	CHINA NATIONAL BUILDING MA-H	235,000	7.84	1,842,400.00	
	CHINA RESOURCES CEMENT HOLDINGS LTD	152,000	9.52	1,447,040.00	
	ALUMINUM CORP OF CHINA LTD-H	210,000	2.56	537,600.00	
	CHINA HONGQIAO GROUP LTD	104,000	4.39	456,560.00	
	CHINA MOLYBDENUM CO LTD-H	180,000	3.05	549,000.00	
	CHINA ZHONGWANG HOLDING LTD	88,800	3.07	272,616.00	
	JIANGXI COPPER COMPANY LTD-H	98,000	10.24	1,003,520.00	
	MAANSHAN IRON & STEEL CO LTD - H	134,000	3.00	402,000.00	
	ZHAOJIN MINING INDUSTRY-H	57,000	8.33	474,810.00	
	ZIJIN MINING GROUP CO-H	347,000	3.31	1,148,570.00	
	LEE & MAN PAPER MANUFACTURIN	78,000	6.03	470,340.00	
	NINE DRAGONS PAPER HOLDINGS	101,000	8.15	823,150.00	
	AVICHINA INDUSTRY&TECH-H	202,000	3.46	698,920.00	
	CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD	48,000	9.74	467,520.00	
	CHINA COMMUNICATIONS CONST-H	299,000	6.13	1,832,870.00	
	CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD H	174,400	5.36	934,784.00	
	CHINA RAILWAY GROUP LTD-H	230,000	4.76	1,094,800.00	
	CHINA RAILWAYS CONSTRUCTIO-H	135,000	8.40	1,134,000.00	

CHINA STATE CONSTRUCTION INT	153,250	6.85	1,049,762.50	
METALLURGICAL CORP OF CHIN-H	156,000	1.72	268,320.00	
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H	71,500	4.62	330,330.00	
SHANGHAI ELECTRIC GRP CO L-H	126,000	2.53	318,780.00	
XINJIANG GOLDWIND SCI&TEC-H	39,984	8.54	341,463.36	
ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC-H	36,300	27.95	1,014,585.00	
CITIC LTD	362,000	10.26	3,714,120.00	
FOSUN INTERNATIONAL LIMITED	165,940	10.92	1,812,064.80	
SHANGHAI INDUSTRIAL HOLDINGS	30,000	14.72	441,600.00	
CHINA CONCH VENTURE HOLDINGS	99,500	32.30	3,213,850.00	
CRRC CORP LTD-H	275,350	5.70	1,569,495.00	
HAITIAN INTERNATIONAL HLDGS	32,000	19.20	614,400.00	
SINOTRUK HONG KONG LTD	37,500	15.48	580,500.00	
WEICHAJ POWER CO LTD-H	117,800	15.46	1,821,188.00	
ZOOMLION HEAVY INDUSTRY-H	61,000	6.40	390,400.00	
BOC AVIATION LTD	11,300	77.05	870,665.00	
A-LIVING SERVICES CO LTD	17,250	26.55	457,987.50	
CHINA EVERBRIGHT INTL LTD	281,000	6.25	1,756,250.00	
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLD	72,000	26.00	1,872,000.00	
GREENTOWN SER	60,000	8.12	487,200.00	
SINOTRANS LIMITED-H	111,000	2.60	288,600.00	
AIR CHINA LIMITED-H	102,000	7.58	773,160.00	
CHINA EASTERN AIRLINES CO-H	76,000	4.12	313,120.00	
CHINA SOUTHERN AIRLINES H	106,000	5.21	552,260.00	
COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H	140,000	3.07	429,800.00	
BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT-H	98,000	7.30	715,400.00	
CHINA MERCHANTS PORT HOLDING	82,000	12.94	1,061,080.00	
COSCO SHIPPING PORTS LTD	102,000	6.33	645,660.00	
JIANGSU EXPRESS CO LTD-H	68,000	10.76	731,680.00	
SHENZHEN EXPRESSWAY-H	32,000	11.42	365,440.00	
SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	79,000	17.54	1,385,660.00	
ZHEJIANG EXPRESSWAY-H	114,000	7.10	809,400.00	
CHINA FIRST CAPITAL GROUP LTD	172,000	0.27	47,300.00	

FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD	39,200	23.80	932,960.00
NEXTEER AUTOMOTIVE GROUP LTD	43,000	6.98	300,140.00
BAIC MOTOR CORPORATION LIMITED	96,000	4.27	409,920.00
BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE	218,000	7.87	1,715,660.00
BYD CO LTD-H	44,000	37.30	1,641,200.00
DONGFENG MOTOR GRP CO LTD-H	184,000	7.35	1,352,400.00
GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LT	298,000	14.78	4,404,440.00
GREAT WALL MOTOR COMPANY-H	238,000	5.71	1,358,980.00
GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP-H	199,890	9.35	1,868,971.50
HAIER ELECTRONICS GROUP CO	87,000	24.30	2,114,100.00
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	70,000	74.10	5,187,000.00
BOSIDENG INTL HLDGS LTD	204,000	3.12	636,480.00
LI NING CO LTD	113,000	24.75	2,796,750.00
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP	50,100	110.00	5,511,000.00
H Aidilao INTERNATIONAL HOLDING LTD.	24,000	32.15	771,600.00
MEITUAN DIANPING B	64,700	102.30	6,618,810.00
GOME RETAIL HODINGS LTD	523,360	0.74	387,286.40
ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS	31,000	31.10	964,100.00
SUN ART RETAIL GROUP LTD	185,000	9.45	1,748,250.00
CHINA RESOURCES BEER HOLDIN	93,333	43.45	4,055,318.85
TSING TAO BREWERY CO-H	24,000	50.75	1,218,000.00
CHINA AGRI-INDUSTRIES HLDGS	114,000	4.14	471,960.00
CHINA HUIZHAN DAIRY HOLDINGS CO LTD	144,000	0.10	15,120.00
CHINA MENGNIU DAIRY CO	180,000	31.40	5,652,000.00
DALI FOODS GROUP CO LTD	111,500	5.77	643,355.00
TINGYI(CAYMAN ISLN)HLDG CO	118,000	13.32	1,571,760.00
UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD	70,000	8.35	584,500.00
WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD	364,000	7.26	2,642,640.00
YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD	28,000	46.10	1,290,800.00
HENGAN INTL GROUP CO LTD	44,500	56.40	2,509,800.00
SHANDONG WEIGAO GP MEDICAL-H	116,000	9.10	1,055,600.00
SHANGHAI PHARMACEUTICALS-H	50,900	15.10	768,590.00
SINOPHARM GROUP CO-H	87,200	28.10	2,450,320.00

3SBIO, INC	77,000	9.82	756,140.00
INNOVENT BIOLOGICS INC	37,000	27.10	1,002,700.00
CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDING	81,000	11.06	895,860.00
CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD	93,000	7.04	654,720.00
CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE	124,000	3.67	455,080.00
CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LIMITED	306,000	18.50	5,661,000.00
HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP	30,000	23.80	714,000.00
LUYE PHARMA GROUP LTD	62,500	5.76	360,000.00
SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTI-H	34,500	23.10	796,950.00
SINO BIOPHARMACEUTICAL	412,000	11.02	4,540,240.00
SSY GROUP LTD	82,000	6.35	520,700.00
AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	1,887,000	3.42	6,453,540.00
BANK OF CHINA LTD-H	4,912,000	3.33	16,356,960.00
BANK OF COMMUNICATIONS CO-H	597,790	5.50	3,287,845.00
CHINA CITIC BANK-H	560,000	4.69	2,626,400.00
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	6,004,000	6.63	39,806,520.00
CHINA EVERBRIGHT BANK CO L-H	257,000	3.61	927,770.00
CHINA MERCHANTS BANK-H	238,692	40.40	9,643,156.80
CHINA MINSHENG BANKING-H	397,800	5.82	2,315,196.00
CHONGQING RURAL COMMERCIAL-H	137,000	3.95	541,150.00
IND & COMM BK OF CHINA-H	4,046,000	5.94	24,033,240.00
POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA-H	449,000	5.27	2,366,230.00
FAR EAST HORIZON LTD	154,000	7.42	1,142,680.00
CHINA LIFE INSURANCE CO-H	455,000	21.20	9,646,000.00
CHINA PACIFIC INSURANCE GR-H	172,200	30.40	5,234,880.00
CHINA REINSURANCE GROUP CO-H	308,000	1.27	391,160.00
CHINA TAIPING INSURANCE HOLDING	103,472	19.02	1,968,037.44
NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	59,100	32.80	1,938,480.00
PEOPLE S INSURANCE CO GROU-H	587,000	3.25	1,907,750.00
PICC PROPERTY & CASUALTY -H	434,420	9.55	4,148,711.00
PING AN INSURANCE GROUP CO-H	351,000	91.30	32,046,300.00
ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE-H	25,000	28.40	710,000.00
TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD-H	66,000	18.92	1,248,720.00

KINGDEE INTL SOFTWARE GROUP CO LTD	142,000	8.10	1,150,200.00
KINGSOFT CORP LTD	46,000	19.20	883,200.00
BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD	33,000	15.70	518,100.00
ZTE CORP-H	58,052	22.95	1,332,293.40
LEGEND HLDS CORP	18,100	17.58	318,198.00
LENOVO GROUP LTD	498,000	5.18	2,579,640.00
XIAOMI CORPORATION	495,000	10.56	5,227,200.00
AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	45,000	65.65	2,954,250.00
CHINA RAILWAY SIGNAL & COM-H	80,000	4.41	352,800.00
KINGBOARD HOLDINGS LTD	43,000	23.45	1,008,350.00
KINGBOARD LAMINATES HOLDING	58,500	9.38	548,730.00
SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD	42,700	137.40	5,866,980.00
HUA HONG SEMICONDUCTOR LTD	26,000	17.52	455,520.00
SEMICONDUCTOR MANUFACTURING	166,000	11.42	1,895,720.00
XINYI SOLAR HOLDINGS LTD	262,000	5.35	1,401,700.00
CHINA TELECOM CORP LTD-H	976,000	3.15	3,074,400.00
CHINA TOWER CORP LTD	2,790,000	1.69	4,715,100.00
CHINA UNICOM HONGKONG LTD	378,000	7.19	2,717,820.00
CHINA MOBILE LTD	386,000	64.25	24,800,500.00
BEIJING ENTERPRISES HOLDINGS LTD	36,000	35.55	1,279,800.00
CHINA GAS HOLDINGS LTD	117,400	29.55	3,469,170.00
CHINA RESOURCES GAS GROUP LT	56,000	41.85	2,343,600.00
ENN ENERGY HOLDINGS LTD	49,600	84.60	4,196,160.00
KUNLUN ENERGY COMPANY LTD	186,000	6.84	1,272,240.00
TOWNGAS CHINA COMPANY LTD	53,000	5.37	284,610.00
BEIJING ENTERPRISES WATER GR	247,000	3.90	963,300.00
GUANGDONG INVESTMENT	184,000	16.48	3,032,320.00
CHINA CINDA ASSET MANAGEME-H	620,000	1.72	1,066,400.00
CHINA DING YI FENG HOLDINGS LT	56,000	20.71	1,159,760.00
CHINA EVERBRIGHT LTD	48,000	13.18	632,640.00
CHINA GALAXY SECURITIES CO-H	266,000	4.41	1,173,060.00
CHINA HUARONG ASSET MANAGEMENT CO LTD	592,000	1.20	710,400.00
CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CO	92,400	14.18	1,310,232.00

LTD-H				
CITIC SECURITIES CO LTD-H	123,000	16.60	2,041,800.00	
GF SECURITIES CO LTD-H	82,600	9.15	755,790.00	
GUOTAI JUNAN SECURITIES CO LTD	62,000	13.24	820,880.00	
HAITONG SECURITIES CO LTD-H	173,600	8.80	1,527,680.00	
HUATAI SECURITIES CO LTD-H	127,000	13.00	1,651,000.00	
CHINA EAST EDUCATION HOLDING	19,000	15.10	286,900.00	
CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS	25,000	10.24	256,000.00	
CGN POWER CO LTD-H	627,000	2.04	1,279,080.00	
CHINA LONGYUAN POWER GROUP-H	218,000	4.89	1,066,020.00	
CHINA POWER INTERNATIONAL DEVELOPMENT	240,000	1.67	400,800.00	
CHINA RESOURCES POWER HOLDING	150,000	10.52	1,578,000.00	
DATANG INTERNATIONAL POWER GEN-H	166,000	1.48	245,680.00	
HUADIAN POWER INTL CORP-H	88,000	2.88	253,440.00	
HUANENG POWER INTL INC-H	238,000	3.90	928,200.00	
HUANENG RENEWABLES CORP-H	380,000	3.04	1,155,200.00	
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LT	212,000	9.25	1,961,000.00	
PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD	15,600	55.70	868,920.00	
GENSCRIPT BIOTECH CORP	56,000	17.74	993,440.00	
WUXI APPTec CO LTD	12,460	96.30	1,199,898.00	
WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC	36,000	98.80	3,556,800.00	
AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	94,000	11.20	1,052,800.00	
CHINA AOYUAN PROPERTY GROUP LTD	98,000	12.10	1,185,800.00	
CHINA EVERGRANDE GROUP	126,000	20.70	2,608,200.00	
CHINA JINMAO HOLDINGS GROUP LTD	394,000	5.73	2,257,620.00	
CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	244,000	29.50	7,198,000.00	
CHINA RESOURCES LAND LTD	176,444	37.15	6,554,894.60	
CHINA VANKE CO LTD-H	99,300	32.60	3,237,180.00	
CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD	196,000	6.43	1,260,280.00	
COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	494,380	12.02	5,942,447.60	
GUANGZHOU R&F PROPERTIES-H	80,000	14.16	1,132,800.00	
KAISA GROUP HLDS LTD	115,000	3.47	399,050.00	
KWG GROUP HOLDINGS LTD	68,500	10.62	727,470.00	

	LOGAN PROPERTY HLDS CO LTD	74,000	12.76	944,240.00	
	LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD	116,500	35.00	4,077,500.00	
	SEAZEN GROUP LTD	96,000	9.12	875,520.00	
	SHENZHEN INVESTMENT LTD	176,000	3.13	550,880.00	
	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	72,000	29.80	2,145,600.00	
	SHUI ON LAND LTD	197,000	1.69	332,930.00	
	SINO-OCEAN GROUP HOLDING LTD	146,000	3.04	443,840.00	
	SOHO CHINA LTD	106,000	2.91	308,460.00	
	SUNAC CHINA HOLDINGS LTD	154,000	44.05	6,783,700.00	
	WHARF(HOLDING)	53,000	19.70	1,044,100.00	
	YUEXIU PROPERTY CO LTD	370,000	1.75	647,500.00	
	YUZHOU PROPERTIES CO LTD	91,000	4.11	374,010.00	
	ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD	67,000	5.52	369,840.00	
	CHINA LITERATURE LTD	20,800	32.40	673,920.00	
	ALIBABA PICTURES GROUP LTD	870,000	1.37	1,191,900.00	
	TENCENT HOLDINGS LTD	360,400	376.80	135,798,720.00	
小計	銘柄数：211			632,808,011.75	
				(8,903,608,725)	
	組入時価比率：20.4%			21.9%	
リンギ	DIALOG GROUP BHD	219,344	3.46	758,930.24	
	PETRONAS DAGANGAN BHD	14,500	23.32	338,140.00	
	PETRONAS CHEMICALS GROUP BHD	144,000	7.37	1,061,280.00	
	PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS	81,100	4.64	376,304.00	
	GAMUDA BERHAD	100,200	3.93	393,786.00	
	IJM CORP	152,600	2.12	323,512.00	
	HAP SENG CONSOLIDATED	33,800	9.98	337,324.00	
	SIME DARBY BERHAD	220,000	2.30	506,000.00	
	AIRASIA GROUP BHD	86,600	1.72	148,952.00	
	MISC BHD	69,060	8.43	582,175.80	
	MALAYSIA AIRPORTS HLDGS BHD	56,460	7.73	436,435.80	
	WESTPORTS HOLDINGS BHD	51,400	4.15	213,310.00	
	GENTING BHD	112,000	6.04	676,480.00	
	GENTING MALAYSIA BHD	229,000	3.23	739,670.00	
	FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD	7,700	34.68	267,036.00	
	GENTING PLANTATIONS BHD	14,600	10.60	154,760.00	

	IOI CORP	116,700	4.56	532,152.00
	KUALA LUMPUR KEPONG	26,400	24.80	654,720.00
	NESTLE (MALAYSIA) BERHAD	4,400	147.40	648,560.00
	PPB GROUP BERHAD	35,040	19.46	681,878.40
	QL RESOURCES BHD	40,000	8.02	320,800.00
	SIME DARBY PLANTATION BHD	144,300	5.37	774,891.00
	BRITISH AMERICAN TOBACCO BHD	7,800	15.30	119,340.00
	HARTALEGA HOLDINGS BHD	121,000	5.42	655,820.00
	TOP GLOVE CORP BHD	84,200	4.79	403,318.00
	IHH HEALTHCARE BHD	156,000	5.60	873,600.00
	AMMB HOLDING	125,000	3.90	487,500.00
	CIMB GROUP HOLDINGS BERHAD	280,000	5.29	1,481,200.00
	HONG LEONG BANK	37,460	17.54	657,048.40
	HONG LEONG FINANCIAL GROUP	13,422	16.96	227,637.12
	MALAYAN BANKING	246,000	8.60	2,115,600.00
	PUBLIC BANK BHD	188,260	19.82	3,731,313.20
	RHB BANK BHD	125,023	5.77	721,382.71
	TELEKOM MALAYSIA	62,000	3.88	240,560.00
	AXIATA GROUP BERHAD	195,000	4.20	819,000.00
	DIGI.COM BERHAD	186,000	4.50	837,000.00
	MAXIS BHD	146,200	5.39	788,018.00
	TENAGA NASIONAL	209,000	13.32	2,783,880.00
	PETRONAS GAS BERHAD	43,700	18.00	786,600.00
	YTL CORPORATION	210,847	0.85	179,219.95
	小計銘柄数：40			28,835,134.62 (763,842,716)
	組入時価比率：1.7%			1.9%
パーツ	BANPU PUBLIC CO LTD-NVDR	263,000	11.80	3,103,400.00
	IRPC PCL - NVDR	900,000	3.68	3,312,000.00
	PTT EXPLOR & PROD PCL-NVDR	86,400	124.50	10,756,800.00
	PTT PCL-NVDR	696,000	44.25	30,798,000.00
	THAI OIL PCL-NVDR	83,000	69.50	5,768,500.00
	INDORAMA VENTURES PCL-NVDR	110,967	35.25	3,911,586.75
	PTT GLOBAL CHEMICAL PCL-NVDR	151,994	56.75	8,625,659.50
	SIAM CEMENT PCL-NVDR	50,600	389.00	19,683,400.00
	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR	476,000	13.20	6,283,200.00

AIRPORTS OF THAILAND PCL NVDR	257,000	74.00	19,018,000.00	
BANGKOK EXPRESS AND METRO NVDR	447,100	11.00	4,918,100.00	
MINOR INTERNATIONAL PCL-NVDR	163,000	35.75	5,827,250.00	
ROBINSON PCL -NVDR	26,100	64.00	1,670,400.00	
HOME PRODUCT CENTER PCL-NVDR	354,597	15.90	5,638,092.30	
BERLI JUCKER PUBLIC CO-NVDR	73,700	41.50	3,058,550.00	
CP ALL PCL-NVDR	375,000	74.75	28,031,250.00	
OSOTSPA PCL-NVDR	33,000	39.75	1,311,750.00	
CHAROEN POKPHAND FOODS-NVDR	279,000	27.75	7,742,250.00	
THAI UNION GROUP PCL-NVDR	199,800	13.30	2,657,340.00	
BANGKOK DUSIT MED SERVI-NVDR	550,000	26.00	14,300,000.00	
BUMRUNGRAD HOSPITAL PU-NVDR	32,200	147.00	4,733,400.00	
BANGKOK BANK(F)	28,600	161.00	4,604,600.00	
KASIKORNBANK PCL-NVDR	50,200	151.00	7,580,200.00	
KASIKORNBANK PCL(F)	72,000	150.50	10,836,000.00	
KRUNG THAI BANK-NVDR	267,050	16.30	4,352,915.00	
SIAM COMMERCIAL BANK P-NVDR	50,800	119.50	6,070,600.00	
TMB BANK PUBLIC CORP-NVDR	1,098,957	1.62	1,780,310.34	
TRUE CORP PCL-NVDR	920,000	4.62	4,250,400.00	
ADVANCED INFO SERVICE-NVDR	80,300	215.00	17,264,500.00	
INTOUCH HOLDINGS PCL - NVDR	161,000	57.50	9,257,500.00	
TOTAL ACCESS COMMUNICA-NVDR	43,000	53.25	2,289,750.00	
MUANGTHAI CAPITAL PCL-NVDR	49,000	62.75	3,074,750.00	
SRISAWAD CORP PCL-NVDR	32,000	67.50	2,160,000.00	
B GRIMM POWER PCL-NVDR	34,000	52.50	1,785,000.00	
ELECTRICITY GENERATING PCL-NVDR	17,300	330.00	5,709,000.00	
ENERGY ABSOLUTE PCL-NVDR	95,000	43.00	4,085,000.00	
GLOBAL POWER SYNERGY-NVDR	33,000	84.50	2,788,500.00	
GULF ENERGY DEVELOPMENT-NVDR	33,000	164.50	5,428,500.00	
RATCH GROUP PCL-NVDR	43,000	69.50	2,988,500.00	
CENTRAL PATTANA PCL-NVDR	133,900	62.50	8,368,750.00	
LAND & HOUSES PUB - NVDR	620,000	9.75	6,045,000.00	
小計銘柄数：41			301,868,703.89	
			(1,095,783,395)	
組入時価比率：2.5%				2.7%

フィリピンペソ	ABOITIZ EQUITY VENTURES INC	146,000	52.00	7,592,000.00	
	AYALA CORPORATION	15,702	779.00	12,231,858.00	
	GT CAPITAL HOLDINGS INC	5,465	854.00	4,667,110.00	
	JG SUMMIT HOLDINGS INC	173,700	81.70	14,191,290.00	
	SM INVESTMENTS CORP	13,600	1,078.00	14,660,800.00	
	INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SVCS	69,000	128.30	8,852,700.00	
	JOLLIBEE FOODS CORPORATION	24,400	220.00	5,368,000.00	
	UNIVERSAL ROBINA CORP	67,000	151.90	10,177,300.00	
	BANK OF PHILIPPINE ISLANDS	53,599	87.50	4,689,912.50	
	BDO UNIBANK INC	124,998	157.00	19,624,686.00	
	METROPOLITAN BANK & TRUST	127,695	66.60	8,504,487.00	
	SECURITY BANK CORP	12,000	186.60	2,239,200.00	
	METRO PACIFIC INVESTMENTS CO	747,800	3.42	2,557,476.00	
	GLOBE TELECOM INC	2,070	2,012.00	4,164,840.00	
	PLDT INC	4,970	1,020.00	5,069,400.00	
	MANILA ELECTRIC COMPANY	16,900	299.80	5,066,620.00	
	ABOITIZ POWER CORP	76,700	33.50	2,569,450.00	
	AYALA LAND LTD	499,000	47.25	23,577,750.00	
	MEGAWORLD CORP	910,000	4.03	3,667,300.00	
	ROBINSONS LAND CO	132,000	27.80	3,669,600.00	
	SM PRIME HLDGS	652,975	41.95	27,392,301.25	
小計	銘柄数：21			190,534,080.75	
				(411,553,614)	
	組入時価比率：0.9%			1.0%	
ルピア	ADARO ENERGY PT	839,200	1,580.00	1,325,936,000.00	
	BUKIT ASAM TBK PT	220,000	2,610.00	574,200,000.00	
	UNITED TRACTORS TBK PT	99,150	21,200.00	2,101,980,000.00	
	BARITO PACIFIC TBK PT	2,150,000	1,510.00	3,246,500,000.00	
	INDOCEMENT TUNGGAL PRAKARSA	136,000	19,775.00	2,689,400,000.00	
	SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT	176,000	12,250.00	2,156,000,000.00	
	INDAH KIAT PULP&PAPER	148,600	7,800.00	1,159,080,000.00	
	PABRIK KERTAS TJIWI KIMIA	100,000	10,700.00	1,070,000,000.00	
	JASA MARGA (PERSERO) TBK PT	113,559	5,375.00	610,379,625.00	
	PT ASTRA INTERNATIONAL TBK	1,335,000	6,900.00	9,211,500,000.00	
	ACE HARDWARE INDONESIA	300,000	1,550.00	465,000,000.00	

	INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR T	178,000	11,400.00	2,029,200,000.00	
	INDOFOOD SUKSES MAK TBK	266,200	7,950.00	2,116,290,000.00	
	PT CHAROEN POKPHAND INDONESIA	499,000	6,775.00	3,380,725,000.00	
	GUDANG GARAM TBK	29,200	53,575.00	1,564,390,000.00	
	HM SAMPOERNA TBK PT	640,000	2,150.00	1,376,000,000.00	
	UNILEVER INDONESIA TBK PT	104,700	41,650.00	4,360,755,000.00	
	KALBE FARMA PT	1,540,000	1,625.00	2,502,500,000.00	
	BANK CENTRAL ASIA	605,000	33,300.00	20,146,500,000.00	
	BANK MANDIRI	1,107,000	7,725.00	8,551,575,000.00	
	BANK NEGARA INDONESIA PT	499,000	7,925.00	3,954,575,000.00	
	BANK RAKYAT INDONESIA	3,536,000	4,450.00	15,735,200,000.00	
	BANK TABUNGAN NEGARA TBK PT	208,000	2,120.00	440,960,000.00	
	TELEKOMUNIKASI	3,000,000	4,020.00	12,060,000,000.00	
	XL AXIATA TBK PT	160,000	3,310.00	529,600,000.00	
	PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT	593,500	2,170.00	1,287,895,000.00	
	BUMI SERPONG DAMAI PT	428,300	1,270.00	543,941,000.00	
	PAKUWON JATI TBK PT	920,000	565.00	519,800,000.00	
小計	銘柄数：28			105,709,881,625.00	
				(835,108,064)	
	組入時価比率：1.9%			2.0%	
ウォン	GS HOLDINGS CORP	3,600	53,200.00	191,520,000.00	
	S-OIL CORPORATION	2,690	97,200.00	261,468,000.00	
	SK INNOVATION CO LTD	3,580	154,000.00	551,320,000.00	
	HANWHA CHEMICAL CORP	6,330	18,850.00	119,320,500.00	
	KUMHO PETRO CHEMICAL CO	998	77,400.00	77,245,200.00	
	LG CHEM LTD - PREFERRED	384	172,500.00	66,240,000.00	
	LG CHEMICALS LTD	2,970	312,500.00	928,125,000.00	
	LOTTE CHEMICAL CORPORATION	1,050	232,000.00	243,600,000.00	
	OCI COMPANY LTD	1,580	61,800.00	97,644,000.00	
	POSCO CHEMICAL CO LTD	1,810	46,100.00	83,441,000.00	
	HYUNDAI STEEL CO	4,779	31,900.00	152,450,100.00	
	KOREA ZINC CO LTD	592	429,500.00	254,264,000.00	
	POSCO	5,040	240,000.00	1,209,600,000.00	
	KOREA AEROSPACE INDUSTRIES	4,520	33,850.00	153,002,000.00	
	KCC CORP	309	233,000.00	71,997,000.00	
		1,600	91,000.00	145,600,000.00	

DAELIM INDUSTRIAL COMPANY				
DAEWOO ENGINEERING & CONSTR	9,690	4,590.00	44,477,100.00	
GS ENGINEERING & CONSTRUCT	4,220	31,650.00	133,563,000.00	
HDC HYUNDAI DEVELOPMENT CO-E	1,566	25,850.00	40,481,100.00	
HYUNDAI ENGINEERING & CONSTR	4,650	42,450.00	197,392,500.00	
SAMSUNG ENGINEERING CO LTD	8,520	19,100.00	162,732,000.00	
CJ CORP	1,100	96,000.00	105,600,000.00	
HANWHA CORPORATION	2,470	25,350.00	62,614,500.00	
LG CORP	6,050	74,900.00	453,145,000.00	
LOTTE CORP	1,620	38,750.00	62,775,000.00	
SAMSUNG C&T CORP	5,700	108,000.00	615,600,000.00	
SK HOLDINGS CO LTD	2,340	262,000.00	613,080,000.00	
DAEWOO SHIPBUILDING & MARINE	2,900	27,600.00	80,040,000.00	
DOOSAN BOBCAT INC	3,350	35,350.00	118,422,500.00	
HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD	597	358,000.00	213,726,000.00	
KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERIN	2,377	125,500.00	298,313,500.00	
SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES	30,700	7,110.00	218,277,000.00	
POSCO INTERNATIONAL CORP	3,900	19,200.00	74,880,000.00	
S-1 CORPORATION	1,450	94,900.00	137,605,000.00	
HYUNDAI GLOVIS CO LTD	1,140	145,500.00	165,870,000.00	
KOREAN AIR LINES CO LTD	2,576	28,000.00	72,128,000.00	
PAN OCEAN CO LTD	14,890	4,540.00	67,600,600.00	
CJ LOGISTICS	780	150,000.00	117,000,000.00	
HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO	5,320	33,900.00	180,348,000.00	
HANON SYSTEMS	11,650	11,350.00	132,227,500.00	
HYUNDAI MOBIS	4,040	257,500.00	1,040,300,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD	9,090	122,000.00	1,108,980,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-2ND PFD	2,640	83,500.00	220,440,000.00	
HYUNDAI MOTOR CO LTD-PFD	1,470	75,400.00	110,838,000.00	
KIA MOTORS CORP	17,640	44,700.00	788,508,000.00	
LG ELECTRONICS INC	6,150	71,900.00	442,185,000.00	
WOONGJIN COWAY CO LTD	3,340	91,300.00	304,942,000.00	
HLB INC	1,830	100,100.00	183,183,000.00	
FILA KOREA LTD	2,930	54,000.00	158,220,000.00	

KANGWON LAND INC	7,900	30,300.00	239,370,000.00	
CJ ENM CO LTD	657	155,900.00	102,426,300.00	
HYUNDAI DEPT STORE CO	1,140	81,700.00	93,138,000.00	
LOTTE SHOPPING CO	800	137,000.00	109,600,000.00	
SHINSEGAE CO LTD	427	277,500.00	118,492,500.00	
HOTEL SHILLA CO LTD	2,500	84,000.00	210,000,000.00	
BGF RETAIL CO LTD /NEW	485	165,500.00	80,267,500.00	
E-MART CO	1,181	129,000.00	152,349,000.00	
GS RETAIL CO LTD	1,140	39,450.00	44,973,000.00	
CJ CHEILJEDANG CORP	510	242,000.00	123,420,000.00	
ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA	1,140	108,000.00	123,120,000.00	
OTTOGI CORPORATION	70	549,000.00	38,430,000.00	
KT & G CORP	7,810	97,400.00	760,694,000.00	
AMOREPACIFIC CORP	1,930	198,000.00	382,140,000.00	
AMOREPACIFIC CORP-PREF	410	91,100.00	37,351,000.00	
AMOREPACIFIC GROUP	1,520	83,000.00	126,160,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE	625	1,259,000.00	786,875,000.00	
LG HOUSEHOLD & HEALTH-PREF	104	777,000.00	80,808,000.00	
CELLTRION HEALTHCARE CO LTD	3,335	55,200.00	184,092,000.00	
CELLTRION INC	5,440	185,000.00	1,006,400,000.00	
HELIXMITH CO LTD	1,200	85,300.00	102,360,000.00	
MEDY-TOX INC	226	302,300.00	68,319,800.00	
HANMI PHARMACEUTICAL CO., LTD	472	304,000.00	143,488,000.00	
YUHAN CORPORATION	690	242,000.00	166,980,000.00	
BNK FINANCIAL GROUP INC	22,800	7,850.00	178,980,000.00	
HANA FINANCIAL HOLDINGS	20,100	38,250.00	768,825,000.00	
INDUSTRIAL BK OF KOREA	15,040	12,400.00	186,496,000.00	
KB FINANCIAL GROUP INC	25,550	49,450.00	1,263,447,500.00	
SHINHAN FINANCIAL GROUP	28,860	45,550.00	1,314,573,000.00	
WOORI FINANCIAL GROUP INC	29,900	12,050.00	360,295,000.00	
DB INSURANCE CO LTD	2,850	54,500.00	155,325,000.00	
HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD	13,280	2,350.00	31,208,000.00	
HYUNDAI MARINE & FIRE INS CO	3,400	27,900.00	94,860,000.00	
ORANGE LIFE INSURANCE LTD	1,610	29,600.00	47,656,000.00	
SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE	1,890	249,500.00	471,555,000.00	

	SAMSUNG LIFE INSURANCE CO	4,640	76,300.00	354,032,000.00	
	SAMSUNG SDS CO LTD	2,000	195,000.00	390,000,000.00	
	KMW CO.LTD.	1,140	48,350.00	55,119,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS	299,470	55,000.00	16,470,850,000.00	
	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	50,820	44,900.00	2,281,818,000.00	
	LG INNOTEK CO LTD	860	135,500.00	116,530,000.00	
	LG.DISPLAY CO LTD	16,200	15,650.00	253,530,000.00	
	SAMSUNG ELECTRO MECHANICS	3,180	121,000.00	384,780,000.00	
	SAMSUNG SDI CO,LTD	3,580	225,000.00	805,500,000.00	
	SK HYNIX INC	33,870	93,800.00	3,177,006,000.00	
	LG UPLUS CORP	6,440	14,350.00	92,414,000.00	
	SK TELECOM CO LTD	1,270	242,500.00	307,975,000.00	
	KOREA ELECTRIC POWER	14,800	27,900.00	412,920,000.00	
	KOREA GAS CORPORATION	1,599	38,550.00	61,641,450.00	
	SAMSUNG CARD CO	1,360	40,350.00	54,876,000.00	
	KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO	3,140	73,000.00	229,220,000.00	
	MERITZ SECURITIES	24,500	3,995.00	97,877,500.00	
	MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD	24,737	7,700.00	190,474,900.00	
	NH INVESTMENT & SECURITIES CO LTD	7,730	13,100.00	101,263,000.00	
	SAMSUNG SECURITIES	3,565	39,450.00	140,639,250.00	
	SAMSUNG BIOLOGICS CO LTD	1,024	417,000.00	427,008,000.00	
	CHEIL WORLDWIDE INC	5,900	24,700.00	145,730,000.00	
	NCISOFT CORPORATION	965	533,000.00	514,345,000.00	
	NETMARBLE CORP	1,470	91,700.00	134,799,000.00	
	PEARL ABYSS CORP	310	184,000.00	57,040,000.00	
	KAKAO CORP	3,070	146,500.00	449,755,000.00	
	NAVER CORP	9,050	182,000.00	1,647,100,000.00	
小計	銘柄数：111			52,841,048,800.00	
				(4,998,763,216)	
	組入時価比率：11.4%			12.2%	
新台湾ドル	FORMOSA PETROCHEMICAL CORP	67,360	97.50	6,567,600.00	
	FORMOSA CHEMICAL&FIBRE CO	233,998	88.90	20,802,422.20	
	FORMOSA PLASTIC	270,424	100.00	27,042,400.00	
	NAN YA PLASTICS CORP	309,726	73.00	22,609,998.00	
	ASIA CEMENT	126,980	47.25	5,999,805.00	

TAIWAN CEMENT	285,371	43.10	12,299,490.10
CHINA STEEL	754,544	23.80	17,958,147.20
FAR EASTERN NEW CENTURY CORPORATION	229,454	30.10	6,906,565.40
AIRTAC INTERNATIONAL GROUP	6,000	436.00	2,616,000.00
HIWIN TECHNOLOGIES CORP	13,243	278.00	3,681,554.00
CHINA AIRLINES	133,561	9.14	1,220,747.54
EVA AIRWAYS CORP	180,918	13.80	2,496,668.40
EVERGREEN MARINE	202,375	12.55	2,539,806.25
TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP	143,000	38.80	5,548,400.00
CHENG SHIN RUBBER IND CO LTD	99,036	42.00	4,159,512.00
NIEN MADE ENTERPRISE CO LTD	10,000	277.00	2,770,000.00
TATUNG CO LTD	130,000	20.40	2,652,000.00
GIANT MANUFACTURING	18,752	212.00	3,975,424.00
ECLAT TEXTILE COMPANY LTD	11,443	408.00	4,668,744.00
FENG TAY ENTERPRISE CO LTD	22,346	197.00	4,402,162.00
FORMOSA TAFFETA CO.	65,000	34.30	2,229,500.00
POU CHEN CORP	135,468	39.75	5,384,853.00
RUENTEX INDUSTRIES LTD	20,271	73.70	1,493,972.70
HOTAI MOTOR COMPANY LTD	18,000	693.00	12,474,000.00
PRESIDENT CHAIN STORE CORP	37,816	310.00	11,722,960.00
STANDARD FOODS CORP	27,079	71.60	1,938,856.40
UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CO	318,836	74.80	23,848,932.80
CHANG HWA COMMERCIAL BANK	387,788	22.95	8,899,734.60
CTBC FINANCIAL HOLDING	1,119,212	22.45	25,126,309.40
E.SUN FINANCIAL HOLDINGS CO	658,425	27.90	18,370,057.50
FIRST FINANCIAL HOLDING CO	617,787	23.85	14,734,219.95
HUA NAN FINANCIAL HOLDINGS C	489,305	21.95	10,740,244.75
MEGA FINANCIAL HOLDING CO LT	651,380	30.80	20,062,504.00
SINOPAC FINANCIAL HOLDINGS	741,549	13.10	9,714,291.90
TAISHIN FINANCIAL HOLDINGS	664,776	14.55	9,672,490.80
TAIWAN BUSINESS BANK	320,616	12.55	4,023,730.80
TAIWAN COOPERATIVE FINANCIAL	571,312	20.90	11,940,420.80
THE SHANGHAI COMMERCIAL & SAVINGS BANK	220,574	51.90	11,447,790.60
CHAILEASE HOLDING CO LTD	73,051	138.50	10,117,563.50

CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD	497,035	42.60	21,173,691.00
CHINA DEVELOPMENT FINANCIAL HOLDING	838,789	9.81	8,228,520.09
CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	176,754	25.75	4,551,415.50
FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD	425,541	46.45	19,766,379.45
SHIN KONG FINANCIAL HOLDINGS	691,009	10.45	7,221,044.05
ACCTON TECHNOLOGY CORPORATION	32,000	160.00	5,120,000.00
ACER INC	160,767	18.10	2,909,882.70
ADVANTECH CO.,LTD.	21,594	307.00	6,629,358.00
ASUSTEK COMPUTER INC	45,805	232.50	10,649,662.50
CATCHER TECHNOLOGY CO LTD	40,840	243.00	9,924,120.00
CHICONY ELECTRONICS CO LTD	48,645	89.90	4,373,185.50
COMPAL ELECTRONICS	244,590	18.95	4,634,980.50
INVENTEC CO.,LTD	136,911	23.30	3,190,026.30
LITE-ON TECHNOLOGY CORP	145,897	49.55	7,229,196.35
MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD	52,000	87.20	4,534,400.00
PEGATRON CORP	121,692	69.30	8,433,255.60
QUANTA COMPUTER INC	175,684	64.20	11,278,912.80
WISTRON CORP	144,457	29.10	4,203,698.70
WIWYNN CORP	5,000	622.00	3,110,000.00
AU OPTRONICS CORP	489,008	10.15	4,963,431.20
DELTA ELECTRONICS INC	123,681	147.00	18,181,107.00
FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD	54,834	67.50	3,701,295.00
HON HAI PRECISION INDUSTRY	772,649	91.00	70,311,059.00
INNOLUX CORP	505,322	8.44	4,264,917.68
LARGAN PRECISION CO LTD	6,040	4,900.00	29,596,000.00
SYNNEX TECHNOLOGY INTL CORP	77,566	37.70	2,924,238.20
WALSIN TECHNOLOGY CORP	18,000	211.50	3,807,000.00
WPG HOLDINGS CO LTD	120,387	39.10	4,707,131.70
YAGEO CORPORATION	14,377	403.50	5,801,119.50
ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING	36,410	140.50	5,115,605.00
ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD	217,658	83.90	18,261,506.20
GLOBALWAFERS CO LTD	13,000	388.00	5,044,000.00
MEDIATEK INC	94,538	452.00	42,731,176.00
NANYA TECHNOLOGY CO	63,000	84.10	5,298,300.00
NOVATEK MICROELECTRONICS LTD	34,058	219.00	7,458,702.00

	PHISON ELECTRONICS CORP	9,306	336.00	3,126,816.00	
	POWERTECH TECHNOLOGY INC	46,147	102.00	4,706,994.00	
	REALTEK SEMICONDUCTOR CORP	28,417	235.50	6,692,203.50	
	TAIWAN SEMICONDUCTOR	1,548,000	333.00	515,484,000.00	
	UNITED MICROELECTRONICS CORP	704,500	16.65	11,729,925.00	
	VANGUARD INTERNATIONAL SEMI	69,000	78.30	5,402,700.00	
	WIN SEMICONDUCTORS CORP	21,000	295.00	6,195,000.00	
	WINBOND ELECTRONICS CORPORATION	242,000	19.65	4,755,300.00	
	CHUNGHWA TELECOM CO LTD	242,065	110.50	26,748,182.50	
	FAR EASTONE TELECOMM CO LTD	105,000	73.00	7,665,000.00	
	TAIWAN MOBILE CO LTD	102,200	113.00	11,548,600.00	
	YUANTA FINANCIAL HOLDING CO	670,377	20.25	13,575,134.25	
	HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP	39,110	46.20	1,806,882.00	
	RUENTEX DEVELOPMENT CO LTD	31,006	45.20	1,401,471.20	
小計	銘柄数：88			1,375,026,405.56	
				(4,991,345,852)	
	組入時価比率：11.4%			12.2%	
インドルビー	BHARAT PETROLEUM CORP LTD	44,705	477.80	21,360,049.00	
	COAL INDIA LTD	76,900	198.95	15,299,255.00	
	HINDUSTAN PETROLEUM CORP	34,380	262.45	9,023,031.00	
	INDIAN OIL CORPORATION LTD	113,000	127.40	14,396,200.00	
	OIL&NATURAL GAS CORP LTD	157,000	126.00	19,782,000.00	
	PETRONET LNG LTD	34,980	272.35	9,526,803.00	
	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	177,700	1,546.45	274,804,165.00	
	ASIAN PAINTS LTD	16,700	1,803.45	30,117,615.00	
	BERGER PAINTS INDIA LTD	10,300	520.20	5,358,060.00	
	PIDILITE INDUSTRIES LTD	6,620	1,376.90	9,115,078.00	
	UPL LTD	32,100	569.15	18,269,715.00	
	AMBUJA CEMENTS LTD	29,920	196.55	5,880,776.00	
	GRASIM INDUSTRIES LIMITED	17,700	738.50	13,071,450.00	
	SHREE CEMENT LIMITED	470	20,269.30	9,526,571.00	
	ULTRATECH CEMENT LTD	6,180	4,097.35	25,321,623.00	
	HINDALCO INDUSTRIES LIMITED	71,770	216.25	15,520,262.50	
	JSW STEEL LTD	65,700	266.75	17,525,475.00	
	TATA STEEL LIMITED	18,606	463.00	8,614,578.00	

VEDANTA LTD	126,000	148.05	18,654,300.00
LARSEN&TOUBRO LIMITED	31,100	1,301.00	40,461,100.00
HAVELLS INDIA LTD	17,700	648.10	11,471,370.00
SIEMENS LIMITED	3,100	1,535.70	4,760,670.00
ASHOK LEYLAND LIMITED	60,650	79.90	4,845,935.00
INTERGLOBE AVIATION LTD	5,010	1,306.95	6,547,819.50
CONTAINER CORP OF INDIA LTD	12,380	575.20	7,120,976.00
ADANI PORTS AND SPECIAL ECONOMIC ZONE	42,600	368.60	15,702,360.00
BHARAT FORGE LIMITED	12,700	486.20	6,174,740.00
BOSCH LTD	390	15,363.75	5,991,862.50
MOTHERSON SUMI SYSTEMS LTD	57,438	146.50	8,414,667.00
BAJAJ AUTO LIMITED	5,590	3,226.75	18,037,532.50
EICHER MOTORS LTD	820	21,868.65	17,932,293.00
HERO MOTOCORP LTD	6,210	2,432.65	15,106,756.50
MAHINDRA&MAHINDRA LIMITED	50,800	527.50	26,797,000.00
MARUTI SUZUKI INDIA LTD	7,060	7,327.80	51,734,268.00
TATA MOTORS LTD	104,000	175.50	18,252,000.00
PAGE INDUSTRIES LTD	340	21,930.45	7,456,353.00
TITAN CO LTD	21,000	1,204.10	25,286,100.00
AVENUE SUPERMARTS LTD	9,600	1,907.40	18,311,040.00
UNITED SPIRITS LTD	22,600	591.30	13,363,380.00
BRITANNIA INDUSTRIES LTD	4,530	3,091.05	14,002,456.50
NESTLE INDIA LIMITED	1,550	14,586.00	22,608,300.00
ITC LTD	221,100	238.75	52,787,625.00
HINDUSTAN UNILEVER LIMITED	41,600	1,946.40	80,970,240.00
COLGATE-PALMOLIVE(INDIA)	2,900	1,474.20	4,275,180.00
DABUR INDIA LTD	37,800	457.70	17,301,060.00
GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD	27,200	691.30	18,803,360.00
MARICO LIMITED	26,340	333.60	8,787,024.00
AUROBINDO PHARMA LTD	18,700	465.05	8,696,435.00
CIPLA LIMITED	20,980	478.70	10,043,126.00
DR.REDDYS LABORATORIES	8,340	2,895.95	24,152,223.00
LUPIN LTD	14,900	765.15	11,400,735.00
PIRAMAL ENTERPRISES LTD	7,000	1,648.35	11,538,450.00
SUN PHARMACEUTICAL INDUS LTD	60,100	429.80	25,830,980.00

	AXIS BANK LIMITED	127,900	740.65	94,729,135.00	
	BANDHAN BANK LTD	28,900	498.40	14,403,760.00	
	ICICI BANK LTD	295,600	541.10	159,949,160.00	
	REC LTD	39,810	137.35	5,467,903.50	
	BAJAJ FINSERV LTD	2,320	9,294.85	21,564,052.00	
	HDFC LIFE INSURANCE CO LTD	32,000	625.30	20,009,600.00	
	ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE COMPANY	10,200	1,431.90	14,605,380.00	
	ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD	17,100	499.95	8,549,145.00	
	SBI LIFE INSURANCE CO LTD	19,600	994.75	19,497,100.00	
	HCL TECHNOLOGIES LTD	69,600	560.55	39,014,280.00	
	INFOSYS LTD	210,800	733.40	154,600,720.00	
	TATA CONSULTANCY SVS LTD	55,500	2,215.60	122,965,800.00	
	TECH MAHINDRA LTD	28,300	772.05	21,849,015.00	
	WIPRO LTD	80,400	252.25	20,280,900.00	
	BHARTI INFRATEL LTD	16,510	255.30	4,215,003.00	
	BHARTI AIRTEL LIMITED	123,300	457.15	56,366,595.00	
	POWER GRID CORP OF INDIA LTD	127,000	187.15	23,768,050.00	
	TATA POWER COMPANY LIMITED	63,864	56.10	3,582,770.40	
	GAIL INDIA LTD	94,600	119.75	11,328,350.00	
	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	102,000	2,412.75	246,100,500.00	
	LIC HOUSING FINANCE	18,050	423.75	7,648,687.50	
	BAJAJ FINANCE LTD	11,130	4,139.50	46,072,635.00	
	MAHINDRA & MAHINDRA FIN SECS	15,160	322.05	4,882,278.00	
	SHRIRAM TRANSPORT FINANCE	13,200	1,154.00	15,232,800.00	
	HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD	1,990	3,211.20	6,390,288.00	
	NTPC LIMITED	142,008	115.20	16,359,321.60	
	DIVIS LABORATORIES LTD	5,900	1,816.90	10,719,710.00	
	DLF LIMITED	26,000	228.65	5,944,900.00	
	ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE	38,900	297.25	11,563,025.00	
	INFO EDGE INDIA LTD	2,980	2,563.55	7,639,379.00	
小計	銘柄数：83			2,371,432,667.00	
				(3,675,720,633)	
	組入時価比率：8.4%			9.0%	
パキスタン	OIL & GAS DEVELOPMENT CO LTD	51,000	140.99	7,190,490.00	

ピー					
		HABIB BANK LTD	35,600	157.34	5,601,304.00
		MCB BANK LIMITED	21,900	207.42	4,542,498.00
	小計	銘柄数：3			17,334,292.00 (12,307,347) 0.0%
カタールリヤル		QATAR FUEL CO	34,700	22.80	791,160.00
		MESAIEED PETROCHEMICAL HOLDING	305,000	2.51	765,550.00
		INDUSTRIES QATAR	111,700	10.31	1,151,627.00
		COMMERCIAL BANK OF QATAR	117,900	4.50	530,550.00
		MASRAF AL RAYAN	211,600	3.97	840,052.00
		QATAR INTERNATIONAL ISLAMIC	47,000	9.53	447,910.00
		QATAR ISLAMIC BANK	80,400	15.37	1,235,748.00
		QATAR NATIONAL BANK	278,300	20.70	5,760,810.00
		QATAR INSURANCE CO	100,010	3.20	320,032.00
		OOREDOO QSC	43,100	7.20	310,320.00
		QATAR ELECTRICITY & WATER CO	34,400	16.28	560,032.00
		BARWA REAL ESTATE CO	113,000	3.58	404,540.00
	小計	銘柄数：12			13,118,331.00 (391,319,813) 1.0%
	エジプトポンド		ELSWEDY ELECTRIC CO	41,500	11.21
		EASTERN TOBACCO	51,525	14.81	763,085.25
		COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK	91,300	81.51	7,441,863.00
小計		銘柄数：3			8,670,163.25 (59,130,513) 0.1%
ランド		EXXARO RESOURCES LTD	15,000	129.00	1,935,000.00
		SASOL LTD	36,200	309.00	11,185,800.00
		ANGLO AMERICAN PLATINUM LTD	2,980	1,320.00	3,933,600.00
		ANGLOGOLD ASHANTI LTD	26,400	302.00	7,972,800.00
		GOLD FIELDS LTD	58,700	90.75	5,327,025.00
		IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD	45,800	142.34	6,519,172.00
		KUMBA IRON ORE LTD	3,900	417.99	1,630,161.00
		NORTHAM PLATINUM LTD	17,900	121.49	2,174,671.00
		SIBANYE GOLD LTD	126,000	34.60	4,359,600.00

BIDVEST GROUP LTD	17,200	202.90	3,489,880.00
NASPERS LTD-N SHS	27,350	2,326.00	63,616,100.00
WOOLWORTHS HOLDINGS LTD	61,610	48.92	3,013,961.20
MR PRICE GROUP LTD	16,700	184.37	3,078,979.00
PEPKOR HOLDINGS LTD	38,000	18.30	695,400.00
THE FOSCHINI GROUP LTD	13,920	151.78	2,112,777.60
BID CORP LTD	22,800	332.00	7,569,600.00
CLICKS GROUP LTD	14,600	258.40	3,772,640.00
PICKN PAY STORES LTD	26,700	63.53	1,696,251.00
SHOPRITE HOLDINGS LTD	29,200	128.12	3,741,104.00
SPAR GROUP LIMITED/THE	15,300	197.57	3,022,821.00
TIGER BRANDS LTD	12,800	215.71	2,761,088.00
LIFE HEALTHCARE GROUP HOLDIN	102,000	24.60	2,509,200.00
ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LT	21,630	118.58	2,564,885.40
ABSA GROUP LTD	42,300	149.48	6,323,004.00
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD	3,130	1,454.36	4,552,146.80
NEDBANK GROUP LTD	21,300	215.98	4,600,374.00
STANDARD BANK GROUP LTD	78,600	168.25	13,224,450.00
FIRSTRAND LTD	216,300	63.42	13,717,746.00
PSG GROUP LTD	8,660	232.82	2,016,221.20
REMGRO LTD	33,200	193.21	6,414,572.00
RMB HOLDINGS LTD	54,800	80.85	4,430,580.00
DISCOVERY LTD	25,800	120.25	3,102,450.00
LIBERTY HOLDINGS LTD	6,360	113.13	719,506.80
MOMENTUM METROPOLITAN HOLDINGS	56,462	22.05	1,244,987.10
OLD MUTUAL LTD	335,000	19.79	6,629,650.00
RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD	40,350	30.69	1,238,341.50
SANLAM LIMITED	119,300	80.48	9,601,264.00
TELKOM SA SOC LTD	15,970	36.00	574,920.00
MTN GROUP LTD	109,700	84.20	9,236,740.00
VODACOM GROUP	39,800	117.00	4,656,600.00
INVESTEC LTD	15,640	83.60	1,307,504.00
REINET INVESTMENTS SCA	8,790	278.61	2,448,981.90
NEPI ROCKCASTLE PLC	25,200	125.20	3,155,040.00
MULTICHOICE GROUP LTD	26,660	115.85	3,088,561.00

小計	銘柄数：44			250,966,156.50	
				(1,939,968,389)	
	組入時価比率：4.4%			4.7%	
U A E ディール ム	ABU DHABI COMMERCIAL BANK	173,870	7.89	1,371,834.30	
	DUBAI ISLAMIC BANK	102,029	5.51	562,179.79	
	FIRST ABU DHABI BANK PJSC	173,200	15.32	2,653,424.00	
	EMIRATES TELECOM CORPORATION	112,500	16.62	1,869,750.00	
	ALDAR PROPERTIES PJSC	277,000	2.18	603,860.00	
	EMAAR MALLS PJSC	211,000	1.89	398,790.00	
	EMAAR PROPERTIES PJSC	201,630	4.01	808,536.30	
小計	銘柄数：7			8,268,374.39	
				(246,314,873)	
	組入時価比率：0.6%			0.6%	
サウジアラビア リヤル	RABIGH REFINING AND PETROCHE	9,600	21.58	207,168.00	
	SAUDI ARABIAN OIL CO	63,000	35.20	2,217,600.00	
	ADVANCED PETROCHEMICALS CO	9,020	48.75	439,725.00	
	NATIONAL INDUSTRIALIZATION C	10,000	13.38	133,800.00	
	SAHARA INTERNATIONAL PETROCH	14,500	17.54	254,330.00	
	SAUDI ARABIAN FERTILIZER CO	11,900	77.10	917,490.00	
	SAUDI BASIC INDUSTRIES CORP	45,800	92.10	4,218,180.00	
	SAUDI IND INVESTMENT GROUP	18,700	23.66	442,442.00	
	SAUDI KAYAN PETROCHEMICAL CO	47,000	10.70	502,900.00	
	YANBU NATIONAL PETROCHEMICAL	14,300	56.50	807,950.00	
	SAUDI CEMENT	6,400	70.80	453,120.00	
	SAUDI ARABIAN MINING CO	28,200	43.95	1,239,390.00	
	SAUDI AIRLINES CATERING CO	1,200	98.30	117,960.00	
	JARIR MARKETING CO	3,730	164.20	612,466.00	
	ALMARAI CO	18,000	50.30	905,400.00	
	SAVOLA	16,600	33.40	554,440.00	
	AL RAJHI BANK	75,100	65.20	4,896,520.00	
	ALINMA BANK	51,300	25.80	1,323,540.00	
	ARAB NATIONAL BANK	32,800	28.45	933,160.00	
BANK AL - JAZIRA	34,100	15.08	514,228.00		
BANK ALBILAD	23,300	27.20	633,760.00		

	BANQUE SAUDI FRANSI	37,400	36.70	1,372,580.00	
	NATIONAL COMMERCIAL BANK	72,700	49.10	3,569,570.00	
	RIYAD BANK	80,300	24.48	1,965,744.00	
	SAMBA FINANCIAL GROUP	65,800	33.35	2,194,430.00	
	SAUDI BRITISH BANK	41,600	35.00	1,456,000.00	
	BUPA ARABIA FOR COOPERATIVE	800	103.80	83,040.00	
	CO FOR COOPERATIVE INSURANCE	2,700	77.00	207,900.00	
	SAUDI TELECOM CO	26,400	102.20	2,698,080.00	
	ETIHAD ETISALAT CO	23,900	24.88	594,632.00	
	SAUDI ELECTRICITY CO	58,200	20.44	1,189,608.00	
	DAR AL ARKAN REAL ESTATE DEV	23,000	11.02	253,460.00	
	EMAAR ECONOMIC CITY	12,000	9.78	117,360.00	
	小計 銘柄数：33			38,027,973.00	
				(1,112,318,210)	
				2.7%	
	組入時価比率：2.5%				
合計				40,923,966,262	
				(40,923,966,262)	

(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12月26日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考	
新株予約権証券	パーツ	BTS GROUP HOLDINGS PCL-NVDR-CW	47,600.00	0.00		
		小計	銘柄数：1	47,600.00	0.00	(0)
					組入時価比率：0.0%	0.0%
	合計			0	(0)	
投資信託受益証券	米ドル	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF	525,100	15,049,366.00		
		小計	銘柄数：1	525,100	15,049,366.00	(1,649,109,526)
					組入時価比率：3.8%	94.2%
合計				1,649,109,526		

				(1,649,109,526)		
投資証券	メキシコペソ	FIBRA UNO ADMINISTRACION SA	208,100	6,132,707.00		
	小計	銘柄数：1	208,100	6,132,707.00		
		組入時価比率：0.1%			(35,447,046)	2.0%
	ランド	FORTRESS REIT LTD-A	100,000	1,930,000.00		
		GROWTHPOINT PROPERTIES LTD	191,000	4,221,100.00		
		REDEFINE PROPERTIES LTD	328,000	2,450,160.00		
	小計	銘柄数：3	619,000	8,601,260.00		
組入時価比率：0.2%				(66,487,739)	3.8%	
合計				101,934,785		
				(101,934,785)		
合計				1,751,044,311		
				(1,751,044,311)		

(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12月26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				
株値指数先物取引				
買建	979,973,939	-	995,334,316	15,360,377
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	40,478,148	-	40,540,900	62,752
米ドル	40,478,148	-	40,540,900	62,752
合計	-	-	-	15,297,625

(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12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	6,915,433,070
国債証券	563,264,699,980
地方債証券	47,023,952,961
特殊債券	60,592,864,730
社債券	28,600,109,400
未収利息	987,304,377
前払費用	14,758,857
流動資産合計	707,399,123,375
資産合計	707,399,123,375
負債の部	
流動負債	
未払解約金	550,727,890
未払利息	10,195
流動負債合計	550,738,085
負債合計	550,738,085
純資産の部	
元本等	
元本	528,330,983,939
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	178,517,401,351
元本等合計	706,848,385,290
純資産合計	706,848,385,290
負債純資産合計	707,399,123,375

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12月26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	1.3379円
(10,000口当たり純資産額)	(13,379円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年12月26日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p>

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12月26日現在		2018年12月27日
期首		498,063,924,662円
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		105,986,003,158円
同期中における追加設定元本額		75,718,943,881円
同期中における一部解約元本額		528,330,983,939円
期末元本額		
期末元本額の内訳*		
野村国内債券インデックスファンド		509,997,495円
野村世界6資産分散投信（安定コース）		39,009,950,420円
野村世界6資産分散投信（分配コース）		17,699,032,217円
野村世界6資産分散投信（成長コース）		2,807,842,365円
野村資産設計ファンド2015		368,013,207円
野村資産設計ファンド2020		357,682,699円
野村資産設計ファンド2025		300,754,762円
野村資産設計ファンド2030		213,715,204円
野村資産設計ファンド2035		109,127,159円
野村資産設計ファンド2040		168,431,164円
野村日本債券インデックスファンド		967,403,311円
野村日本債券インデックス（野村投資一任口座向け）		169,864,177,675円
のむらっぴ・ファンド（保守型）		12,570,368,448円
のむらっぴ・ファンド（普通型）		8,713,910,574円
のむらっぴ・ファンド（積極型）		1,066,737,360円
野村日本債券インデックス（野村SMA向け）		10,961,344,130円
野村資産設計ファンド2045		16,078,144円
野村円債投資インデックスファンド		1,143,270,484円
野村インデックスファンド・国内債券		3,331,934,788円
マイ・ロード		35,439,714,522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		1,097,016,503円
野村ターゲットプライス「日経225」（国内債券運用移行型）		23,143,146円
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）		14,195,379,074円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）		991,457,469円
野村資産設計ファンド2050		20,998,503円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		17,739,054円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		4,615,544円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		2,792,777円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		1,756,523円
のむらっぴ・ファンド（やや保守型）		838,681,593円

のむラップ・ファンド(やや積極型)	157,402,756円
インデックス・ブレンド(タイプ)	46,051,514円
インデックス・ブレンド(タイプ)	21,388,509円
インデックス・ブレンド(タイプ)	58,764,982円
インデックス・ブレンド(タイプ)	10,120,353円
インデックス・ブレンド(タイプ)	15,423,339円
野村6資産均等バランス	1,142,881,154円
世界6資産分散ファンド	158,816,440円
野村資産設計ファンド2060	1,715,501円
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA - BPI総合連動型上場投信	860,725,044円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	13,312,324,475円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	647,000,374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)	167,832,380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)	2,128,978,999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)	1,437,059,251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)	20,106,937円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	11,238,205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)	1,267,079円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,076,782,314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)	16,255,020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)	115,000,617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)	85,245,324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)	346,439,826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)	339,908,506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)	840,888,586円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	191,521,858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)	883,852,618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)	1,752,606,123円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	34,068,286,470円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	41,341,117,767円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	15,192,299,370円
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合(確定拠出年金向け)	48,506,413,478円
マイバランスDC30	11,527,863,311円
マイバランスDC50	8,193,509,597円
マイバランスDC70	2,633,409,057円
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA - BPI総合	12,383,914,757円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	543,319,776円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	1,155,864,073円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	481,028,812円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	79,251,137円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	14,079,438円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	12,720,239円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	13,469,264円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	4,146,381円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	2,457,141円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	307,144,303円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	137,299,569円

マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	34,604,124円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	37,862,462円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	259,015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12月26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12月26日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付(2年)第402回	1,400,000,000	1,404,760,000	
		国庫債券 利付(2年)第403回	1,500,000,000	1,505,385,000	
		国庫債券 利付(2年)第406回	4,000,000,000	4,016,640,000	
		国庫債券 利付(5年)第127回	6,000,000,000	6,016,920,000	
		国庫債券 利付(5年)第128回	5,200,000,000	5,217,316,000	
		国庫債券 利付(5年)第129回	7,000,000,000	7,027,300,000	
		国庫債券 利付(5年)第130回	7,500,000,000	7,533,450,000	
		国庫債券 利付(5年)第131回	4,800,000,000	4,824,096,000	
		国庫債券 利付(5年)第132回	3,000,000,000	3,016,770,000	
		国庫債券 利付(5年)第133回	6,200,000,000	6,239,060,000	
		国庫債券 利付(5年)第134回	3,000,000,000	3,020,190,000	
		国庫債券 利付(5年)第135回	4,500,000,000	4,533,525,000	
		国庫債券 利付(5年)第136回	4,300,000,000	4,334,529,000	
		国庫債券 利付(5年)第137回	6,000,000,000	6,051,720,000	
		国庫債券 利付(5年)第138回	5,900,000,000	5,953,100,000	
		国庫債券 利付(5年)第139回	4,400,000,000	4,442,064,000	
		国庫債券 利付(5年)第140回	1,400,000,000	1,413,860,000	
		国庫債券 利付(5年)第141回	4,000,000,000	4,041,840,000	
		国庫債券 利付(40年)第1回	2,360,000,000	3,607,472,400	
		国庫債券 利付(40年)第2回	900,000,000	1,339,695,000	
		国庫債券 利付(40年)第3回	900,000,000	1,349,595,000	
		国庫債券 利付(40年)第4回	1,300,000,000	1,968,707,000	
		国庫債券 利付(40年)第5回	1,200,000,000	1,760,664,000	
		国庫債券 利付(40年)第6回	1,300,000,000	1,882,959,000	
		国庫債券 利付(40年)第7回	1,400,000,000	1,956,752,000	
		国庫債券 利付(40年)第8回	1,500,000,000	1,963,140,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	2,850,000,000	2,801,236,500			

国庫債券 利付(40年)第10回	2,100,000,000	2,420,607,000	
国庫債券 利付(40年)第11回	1,500,000,000	1,679,445,000	
国庫債券 利付(40年)第12回	1,600,000,000	1,623,952,000	
国庫債券 利付(10年)第313回	3,200,000,000	3,256,224,000	
国庫債券 利付(10年)第314回	2,200,000,000	2,233,264,000	
国庫債券 利付(10年)第315回	3,600,000,000	3,670,668,000	
国庫債券 利付(10年)第316回	1,400,000,000	1,425,410,000	
国庫債券 利付(10年)第317回	1,800,000,000	1,838,250,000	
国庫債券 利付(10年)第318回	3,200,000,000	3,262,464,000	
国庫債券 利付(10年)第319回	1,850,000,000	1,894,807,000	
国庫債券 利付(10年)第320回	3,500,000,000	3,577,805,000	
国庫債券 利付(10年)第321回	3,200,000,000	3,280,032,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	2,400,000,000	2,454,672,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	1,700,000,000	1,743,112,000	
国庫債券 利付(10年)第324回	3,200,000,000	3,273,184,000	
国庫債券 利付(10年)第325回	4,400,000,000	4,510,924,000	
国庫債券 利付(10年)第326回	2,100,000,000	2,151,513,000	
国庫債券 利付(10年)第327回	3,100,000,000	3,185,312,000	
国庫債券 利付(10年)第328回	5,000,000,000	5,117,450,000	
国庫債券 利付(10年)第329回	5,300,000,000	5,471,296,000	
国庫債券 利付(10年)第330回	3,800,000,000	3,931,746,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	1,900,000,000	1,951,642,000	
国庫債券 利付(10年)第332回	5,400,000,000	5,556,600,000	
国庫債券 利付(10年)第333回	4,200,000,000	4,329,402,000	
国庫債券 利付(10年)第334回	7,600,000,000	7,846,392,000	
国庫債券 利付(10年)第335回	5,200,000,000	5,353,400,000	
国庫債券 利付(10年)第336回	1,700,000,000	1,752,802,000	
	3,700,000,000	3,777,848,000	

国庫債券 利付(10年)第337回			
国庫債券 利付(10年)第338回	3,700,000,000	3,802,194,000	
国庫債券 利付(10年)第339回	3,000,000,000	3,086,880,000	
国庫債券 利付(10年)第340回	4,200,000,000	4,327,260,000	
国庫債券 利付(10年)第341回	6,000,000,000	6,153,600,000	
国庫債券 利付(10年)第342回	2,750,000,000	2,787,950,000	
国庫債券 利付(10年)第343回	6,400,000,000	6,491,904,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	5,800,000,000	5,884,564,000	
国庫債券 利付(10年)第345回	5,000,000,000	5,073,850,000	
国庫債券 利付(10年)第346回	5,400,000,000	5,482,566,000	
国庫債券 利付(10年)第347回	4,900,000,000	4,975,705,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	5,500,000,000	5,585,690,000	
国庫債券 利付(10年)第349回	5,000,000,000	5,078,400,000	
国庫債券 利付(10年)第350回	6,850,000,000	6,954,942,000	
国庫債券 利付(10年)第351回	6,600,000,000	6,698,538,000	
国庫債券 利付(10年)第352回	4,800,000,000	4,869,504,000	
国庫債券 利付(10年)第353回	6,100,000,000	6,182,533,000	
国庫債券 利付(10年)第354回	4,350,000,000	4,406,376,000	
国庫債券 利付(10年)第355回	4,000,000,000	4,049,400,000	
国庫債券 利付(10年)第356回	4,400,000,000	4,451,480,000	
国庫債券 利付(30年)第1回	100,000,000	127,372,000	
国庫債券 利付(30年)第2回	200,000,000	248,976,000	
国庫債券 利付(30年)第3回	160,000,000	198,251,200	
国庫債券 利付(30年)第4回	900,000,000	1,181,871,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	150,000,000	186,856,500	
国庫債券 利付(30年)第6回	700,000,000	894,572,000	
国庫債券 利付(30年)第7回	600,000,000	764,880,000	
国庫債券 利付(30年)第8回	100,000,000	121,968,000	
国庫債券 利付(30年)第9回	265,000,000	309,739,950	
国庫債券 利付(30年)第10回	250,000,000	282,820,000	
国庫債券 利付(30年)第11回	160,000,000	194,048,000	

国庫債券	利付(30年)第12回	220,000,000	279,221,800
国庫債券	利付(30年)第13回	290,000,000	365,214,400
国庫債券	利付(30年)第14回	800,000,000	1,055,144,000
国庫債券	利付(30年)第15回	900,000,000	1,203,138,000
国庫債券	利付(30年)第16回	915,000,000	1,227,564,000
国庫債券	利付(30年)第17回	1,200,000,000	1,597,932,000
国庫債券	利付(30年)第18回	1,500,000,000	1,981,590,000
国庫債券	利付(30年)第19回	1,600,000,000	2,120,400,000
国庫債券	利付(30年)第20回	1,400,000,000	1,902,698,000
国庫債券	利付(30年)第21回	1,400,000,000	1,865,388,000
国庫債券	利付(30年)第22回	600,000,000	820,764,000
国庫債券	利付(30年)第23回	840,000,000	1,152,816,000
国庫債券	利付(30年)第24回	700,000,000	962,990,000
国庫債券	利付(30年)第25回	500,000,000	672,990,000
国庫債券	利付(30年)第26回	850,000,000	1,161,414,500
国庫債券	利付(30年)第27回	1,550,000,000	2,154,934,000
国庫債券	利付(30年)第28回	1,200,000,000	1,677,996,000
国庫債券	利付(30年)第29回	1,500,000,000	2,082,645,000
国庫債券	利付(30年)第30回	1,700,000,000	2,339,336,000
国庫債券	利付(30年)第31回	1,600,000,000	2,184,624,000
国庫債券	利付(30年)第32回	1,900,000,000	2,644,838,000
国庫債券	利付(30年)第33回	2,100,000,000	2,813,244,000
国庫債券	利付(30年)第34回	2,100,000,000	2,910,768,000
国庫債券	利付(30年)第35回	2,300,000,000	3,107,185,000
国庫債券	利付(30年)第36回	2,300,000,000	3,121,261,000
国庫債券	利付(30年)第37回	2,300,000,000	3,086,393,000
国庫債券	利付(30年)第38回	1,600,000,000	2,118,832,000
国庫債券	利付(30年)第39回	1,600,000,000	2,159,152,000
国庫債券	利付(30年)第40回	1,100,000,000	1,462,296,000
国庫債券	利付(30年)第41回	1,500,000,000	1,963,200,000
国庫債券	利付(30年)第42回	1,600,000,000	2,098,800,000
国庫債券	利付(30年)第43回	1,300,000,000	1,707,251,000
国庫債券	利付(30年)第44回	1,400,000,000	1,842,764,000
国庫債券	利付(30年)第45回	1,700,000,000	2,159,017,000
国庫債券	利付(30年)第46回	1,800,000,000	2,290,446,000
国庫債券	利付(30年)第47回	1,700,000,000	2,207,433,000
国庫債券	利付(30年)第48回	1,900,000,000	2,376,539,000
国庫債券	利付(30年)第49回	1,900,000,000	2,380,776,000
国庫債券	利付(30年)第50回	1,600,000,000	1,766,592,000
国庫債券	利付(30年)第51回	2,900,000,000	2,837,331,000
国庫債券	利付(30年)第52回	1,900,000,000	1,952,953,000
国庫債券	利付(30年)第53回	1,700,000,000	1,789,335,000

国庫債券	利付(30年)第54回	1,700,000,000	1,876,171,000
国庫債券	利付(30年)第55回	1,500,000,000	1,656,750,000
国庫債券	利付(30年)第56回	1,900,000,000	2,097,562,000
国庫債券	利付(30年)第57回	1,400,000,000	1,544,802,000
国庫債券	利付(30年)第58回	2,100,000,000	2,315,985,000
国庫債券	利付(30年)第59回	1,600,000,000	1,722,720,000
国庫債券	利付(30年)第60回	1,050,000,000	1,186,815,000
国庫債券	利付(30年)第61回	1,200,000,000	1,290,132,000
国庫債券	利付(30年)第62回	1,300,000,000	1,327,066,000
国庫債券	利付(30年)第63回	2,200,000,000	2,182,730,000
国庫債券	利付(30年)第64回	1,200,000,000	1,188,936,000
国庫債券	利付(20年)第49回	200,000,000	205,506,000
国庫債券	利付(20年)第50回	183,000,000	187,585,980
国庫債券	利付(20年)第51回	310,000,000	319,780,500
国庫債券	利付(20年)第52回	100,000,000	103,876,000
国庫債券	利付(20年)第53回	250,000,000	261,045,000
国庫債券	利付(20年)第54回	100,000,000	104,616,000
国庫債券	利付(20年)第55回	231,000,000	241,949,400
国庫債券	利付(20年)第56回	120,000,000	126,326,400
国庫債券	利付(20年)第57回	210,000,000	220,548,300
国庫債券	利付(20年)第58回	180,000,000	189,963,000
国庫債券	利付(20年)第59回	230,000,000	242,521,200
国庫債券	利付(20年)第60回	780,000,000	815,466,600
国庫債券	利付(20年)第61回	300,000,000	310,935,000
国庫債券	利付(20年)第62回	440,000,000	454,220,800
国庫債券	利付(20年)第63回	300,000,000	320,181,000
国庫債券	利付(20年)第64回	400,000,000	430,364,000
国庫債券	利付(20年)第65回	455,000,000	491,859,550
国庫債券	利付(20年)第66回	300,000,000	323,103,000
国庫債券	利付(20年)第67回	310,000,000	336,604,200
国庫債券	利付(20年)第68回	290,000,000	318,585,300
国庫債券	利付(20年)第69回	560,000,000	612,819,200
国庫債券	利付(20年)第70回	540,000,000	601,149,600
国庫債券	利付(20年)第71回	200,000,000	220,846,000
国庫債券	利付(20年)第72回	670,000,000	740,597,900
国庫債券	利付(20年)第73回	1,600,000,000	1,769,520,000
国庫債券	利付(20年)第74回	900,000,000	999,864,000
国庫債券	利付(20年)第75回	600,000,000	670,068,000
国庫債券	利付(20年)第76回	910,000,000	1,006,687,500
国庫債券	利付(20年)第77回	700,000,000	778,064,000
国庫債券	利付(20年)第78回	800,000,000	889,128,000
国庫債券	利付(20年)第79回	860,000,000	960,559,800
国庫債券	利付(20年)第80回	900,000,000	1,010,196,000

国庫債券 利付(20年)第81回	360,000,000	404,042,400	
国庫債券 利付(20年)第82回	820,000,000	925,058,400	
国庫債券 利付(20年)第83回	1,370,000,000	1,553,210,100	
国庫債券 利付(20年)第84回	1,200,000,000	1,353,240,000	
国庫債券 利付(20年)第85回	400,000,000	455,572,000	
国庫債券 利付(20年)第86回	1,400,000,000	1,612,058,000	
国庫債券 利付(20年)第87回	500,000,000	572,600,000	
国庫債券 利付(20年)第88回	1,100,000,000	1,273,415,000	
国庫債券 利付(20年)第89回	470,000,000	541,026,400	
国庫債券 利付(20年)第90回	1,500,000,000	1,734,975,000	
国庫債券 利付(20年)第91回	250,000,000	290,857,500	
国庫債券 利付(20年)第92回	1,550,000,000	1,790,343,000	
国庫債券 利付(20年)第93回	300,000,000	345,990,000	
国庫債券 利付(20年)第94回	200,000,000	232,116,000	
国庫債券 利付(20年)第95回	700,000,000	826,595,000	
国庫債券 利付(20年)第96回	400,000,000	466,312,000	
国庫債券 利付(20年)第97回	1,300,000,000	1,532,375,000	
国庫債券 利付(20年)第98回	300,000,000	351,288,000	
国庫債券 利付(20年)第99回	2,100,000,000	2,469,684,000	
国庫債券 利付(20年)第100回	1,520,000,000	1,807,006,400	
国庫債券 利付(20年)第101回	250,000,000	301,347,500	
国庫債券 利付(20年)第102回	500,000,000	605,345,000	
国庫債券 利付(20年)第103回	600,000,000	721,296,000	
国庫債券 利付(20年)第104回	400,000,000	474,040,000	
国庫債券 利付(20年)第105回	1,900,000,000	2,260,221,000	
国庫債券 利付(20年)第106回	400,000,000	479,348,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	300,000,000	358,185,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	1,600,000,000	1,881,456,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	900,000,000	1,061,703,000	
国庫債券 利付(20年)第110回	1,100,000,000	1,318,009,000	
国庫債券 利付(20年)第111回	800,000,000	969,592,000	
国庫債券 利付(20年)第112回	1,800,000,000	2,164,464,000	
国庫債券 利付(20年)第113回	2,000,000,000	2,413,420,000	
	1,700,000,000	2,058,360,000	

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	1,220,790,000	
国庫債券 利付(20年)第116回	1,100,000,000	1,348,182,000	
国庫債券 利付(20年)第117回	1,400,000,000	1,701,546,000	
国庫債券 利付(20年)第118回	500,000,000	604,475,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	800,000,000	950,400,000	
国庫債券 利付(20年)第120回	800,000,000	933,640,000	
国庫債券 利付(20年)第121回	1,700,000,000	2,043,332,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	1,100,000,000	1,310,364,000	
国庫債券 利付(20年)第123回	1,500,000,000	1,841,850,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	1,000,000,000	1,216,940,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	900,000,000	1,118,529,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	1,000,000,000	1,220,430,000	
国庫債券 利付(20年)第127回	1,200,000,000	1,451,088,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	1,800,000,000	2,182,572,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	800,000,000	960,888,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	1,400,000,000	1,686,720,000	
国庫債券 利付(20年)第131回	800,000,000	954,504,000	
国庫債券 利付(20年)第132回	1,300,000,000	1,554,527,000	
国庫債券 利付(20年)第133回	1,400,000,000	1,690,766,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	1,400,000,000	1,694,658,000	
国庫債券 利付(20年)第135回	700,000,000	838,838,000	
国庫債券 利付(20年)第136回	700,000,000	830,347,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	1,000,000,000	1,201,650,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	800,000,000	941,528,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	1,000,000,000	1,189,280,000	
	2,300,000,000	2,769,591,000	

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	3,139,110,000	
国庫債券 利付(20年)第142回	950,000,000	1,159,180,500	
国庫債券 利付(20年)第143回	1,300,000,000	1,555,580,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	1,300,000,000	1,538,589,000	
国庫債券 利付(20年)第145回	2,300,000,000	2,789,440,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	2,400,000,000	2,916,192,000	
国庫債券 利付(20年)第147回	4,200,000,000	5,054,700,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	2,100,000,000	2,503,620,000	
国庫債券 利付(20年)第149回	2,350,000,000	2,805,547,500	
国庫債券 利付(20年)第150回	3,830,000,000	4,526,523,800	
国庫債券 利付(20年)第151回	2,500,000,000	2,884,600,000	
国庫債券 利付(20年)第152回	1,700,000,000	1,964,265,000	
国庫債券 利付(20年)第153回	2,450,000,000	2,871,890,000	
国庫債券 利付(20年)第154回	3,400,000,000	3,936,554,000	
国庫債券 利付(20年)第155回	2,800,000,000	3,156,636,000	
国庫債券 利付(20年)第156回	2,000,000,000	2,064,480,000	
国庫債券 利付(20年)第157回	2,490,000,000	2,488,008,000	
国庫債券 利付(20年)第158回	2,800,000,000	2,931,236,000	
国庫債券 利付(20年)第159回	2,700,000,000	2,870,289,000	
国庫債券 利付(20年)第160回	2,900,000,000	3,131,043,000	
国庫債券 利付(20年)第161回	2,100,000,000	2,230,557,000	
国庫債券 利付(20年)第162回	1,700,000,000	1,804,074,000	
国庫債券 利付(20年)第163回	3,400,000,000	3,607,842,000	
国庫債券 利付(20年)第164回	2,600,000,000	2,710,942,000	
国庫債券 利付(20年)第165回	2,200,000,000	2,293,082,000	
	2,300,000,000	2,478,526,000	

小計	国庫債券 利付(20年)第166回				
	国庫債券 利付(20年)第167回	2,600,000,000	2,705,508,000		
	国庫債券 利付(20年)第168回	3,300,000,000	3,369,168,000		
	国庫債券 利付(20年)第169回	2,700,000,000	2,704,968,000		
	国庫債券 利付(20年)第170回	2,700,000,000	2,702,511,000		
	メキシコ合衆国 第22回円貨社債(2016)	300,000,000	301,458,000		
	メキシコ合衆国 第25回円貨社債(2018)	100,000,000	99,523,000		
	銘柄数:262 組入時価比率:79.7%	511,999,000,000	563,264,699,980	80.5%	
	合計		563,264,699,980		
地方債証券	日本円	東京都 公募第703回	100,000,000	101,981,000	
		東京都 公募第707回	100,000,000	101,944,000	
		東京都 公募第708回	100,000,000	102,217,000	
		東京都 公募第710回	100,000,000	102,020,000	
		東京都 公募第712回	100,000,000	102,117,000	
		東京都 公募第715回	100,000,000	102,280,000	
		東京都 公募第716回	200,000,000	204,618,000	
		東京都 公募第731回	100,000,000	102,700,000	
		東京都 公募第745回	300,000,000	308,679,000	
		東京都 公募第760回	100,000,000	100,167,000	
		東京都 公募第761回	100,000,000	100,369,000	
		東京都 公募第769回	500,000,000	506,715,000	
		東京都 公募(30年)第7回	100,000,000	139,679,000	
		東京都 公募第10回	200,000,000	274,926,000	
		東京都 公募第1回	300,000,000	316,125,000	
		東京都 公募(20年)第3回	200,000,000	219,140,000	
		東京都 公募第7回	100,000,000	112,347,000	
		東京都 公募(20年)第16回	200,000,000	234,638,000	
		東京都 公募(20年)第17回	200,000,000	236,066,000	
		東京都 公募第23回	100,000,000	121,555,000	
		東京都 公募(20年)第26回	100,000,000	119,181,000	
		北海道 公募平成24年度第6回	100,000,000	102,247,000	
		北海道 公募平成24年度第9回	100,000,000	102,246,000	
		北海道 公募平成25年度第1回	300,000,000	305,799,000	
		北海道 公募平成26年度第13回	100,000,000	102,202,000	
		北海道 公募平成27年度第7回	100,000,000	102,883,000	
		北海道 公募平成28年度第13回	200,000,000	200,096,000	
北海道 公募平成29年度第5回	200,000,000	202,170,000			

北海道	公募平成29年度第6回	700,000,000	700,182,000	
北海道	公募平成29年度第7回	100,000,000	101,301,000	
北海道	公募平成29年度第9回	100,000,000	101,249,000	
宮城県	公募第32回2号	100,000,000	100,570,000	
神奈川県	公募第184回	100,000,000	101,518,000	
神奈川県	公募第188回	200,000,000	204,688,000	
神奈川県	公募第196回	100,000,000	102,204,000	
神奈川県	公募第200回	100,000,000	103,094,000	
神奈川県	公募第205回	100,000,000	102,823,000	
神奈川県	公募第206回	100,000,000	102,949,000	
神奈川県	公募第210回	200,000,000	204,532,000	
神奈川県	公募第231回	200,000,000	203,026,000	
神奈川県	公募(30年)第3回	100,000,000	138,914,000	
神奈川県	公募第7回	300,000,000	347,496,000	
神奈川県	公募(20年)第14回	100,000,000	119,408,000	
神奈川県	公募(20年)第17回	200,000,000	241,540,000	
神奈川県	公募(20年)第26回	100,000,000	117,559,000	
大阪府	公募第346回	100,000,000	101,365,000	
大阪府	公募第356回	100,000,000	102,139,000	
大阪府	公募第378回	104,000,000	106,870,400	
大阪府	公募第381回	100,000,000	102,865,000	
大阪府	公募第382回	100,000,000	102,882,000	
大阪府	公募第383回	100,000,000	103,027,000	
大阪府	公募第384回	100,000,000	102,980,000	
大阪府	公募第387回	300,000,000	307,353,000	
大阪府	公募第389回	100,000,000	102,586,000	
大阪府	公募第417回	102,000,000	103,581,000	
大阪府	公募第423回	100,000,000	101,148,000	
大阪府	公募第429回	179,000,000	181,287,620	
大阪府	公募第5回	100,000,000	121,055,000	
大阪府	公募第8回	100,000,000	119,504,000	
大阪府	公募(5年)第130回	600,000,000	600,072,000	
大阪府	公募(5年)第137回	1,024,000,000	1,024,122,880	
大阪府	公募(5年)第141回	230,000,000	230,034,500	
京都府	公募平成24年度第2回	100,000,000	102,268,000	
京都府	公募平成24年度第6回	100,000,000	102,267,000	
京都府	公募平成26年度第5回	100,000,000	117,329,000	
京都府	公募平成26年度第7回	200,000,000	205,374,000	
京都府	公募(15年)平成27年度第8回	100,000,000	106,975,000	
京都府	公募(20年)平成28年度第5回	100,000,000	100,667,000	
兵庫県	公募平成26年度第17回	100,000,000	102,325,000	

兵庫県	公募平成29年度第22回	100,000,000	101,206,000
兵庫県	公募(30年)第2回	200,000,000	276,488,000
兵庫県	公募(15年)第1回	300,000,000	332,262,000
兵庫県	公募(15年)第3回	200,000,000	219,812,000
兵庫県	公募(12年)第3回	300,000,000	308,745,000
兵庫県	公募第2回	100,000,000	117,991,000
兵庫県	公募第9回	100,000,000	121,014,000
兵庫県	公募(20年)第11回	200,000,000	236,010,000
兵庫県	公募(20年)第14回	100,000,000	118,763,000
兵庫県	公募(20年)第22回	100,000,000	116,472,000
静岡県	公募平成24年度第5回	100,060,000	102,248,312
静岡県	公募平成24年度第10回	100,000,000	102,209,000
静岡県	公募平成25年度第5回	101,000,000	104,359,260
静岡県	公募平成26年度第3回	165,000,000	169,974,750
静岡県	公募平成26年度第8回	100,000,000	102,696,000
静岡県	公募平成26年度第9回	200,000,000	205,386,000
静岡県	公募平成27年度第11回	115,400,000	116,045,086
静岡県	公募平成28年度第2回	300,000,000	301,119,000
静岡県	公募平成29年度第3回	100,000,000	101,045,000
静岡県	公募(31年)第1回	174,000,000	174,238,380
静岡県	公募(15年)第9回	100,000,000	106,503,000
静岡県	公募(20年)第11回	100,000,000	118,306,000
静岡県	公募(20年)第14回	200,000,000	238,264,000
静岡県	公募(20年)第18回	100,000,000	117,485,000
愛知県	公募平成20年度第8回	100,000,000	117,639,000
愛知県	公募平成23年度第19回	100,000,000	102,198,000
愛知県	公募平成24年度第2回	100,000,000	102,302,000
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	100,000,000	118,506,000
愛知県	公募平成24年度第8回	150,000,000	153,366,000
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	400,000,000	440,804,000
愛知県	公募平成24年度第17回	100,000,000	120,981,000
愛知県	公募(30年)平成25年度第8回	120,000,000	161,497,200
愛知県	公募平成26年度第8回	100,000,000	130,812,000
愛知県	公募平成26年度第13回	100,000,000	116,306,000
愛知県	公募(15年)平成27年度第2回	100,000,000	106,435,000
愛知県	公募平成27年度第15回	100,000,000	102,758,000
愛知県	公募平成29年度第8回	100,000,000	101,302,000
愛知県	公募平成29年度第9回	100,000,000	100,924,000
広島県	公募平成22年度第6回	300,000,000	304,098,000
広島県	公募平成24年度第4回	100,000,000	102,380,000

広島県	公募平成25年度第3回	200,000,000	206,024,000
広島県	公募平成26年度第5回	109,650,000	111,462,514
広島県	公募平成29年度第4回	211,300,000	214,467,387
埼玉県	公募平成24年度第4回	300,000,000	306,528,000
埼玉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	103,305,000
埼玉県	公募平成25年度第6回	148,000,000	152,497,720
埼玉県	公募平成25年度第10回	100,000,000	102,810,000
埼玉県	公募平成25年度第11回	100,000,000	102,798,000
埼玉県	公募平成26年度第3回	100,000,000	102,962,000
埼玉県	公募平成26年度第6回	200,000,000	205,300,000
埼玉県	公募平成26年度第7回	400,000,000	409,592,000
埼玉県	公募平成26年度第9回	100,000,000	102,190,000
埼玉県	公募平成27年度第9回	100,000,000	101,324,000
埼玉県	公募平成28年度第5回	100,000,000	100,197,000
埼玉県	公募平成30年度第4回	200,000,000	202,708,000
埼玉県	公募平成30年度第7回	200,000,000	200,182,000
埼玉県	公募(15年)第3回	100,000,000	103,081,000
埼玉県	公募(20年)第16回	100,000,000	114,533,000
埼玉県	公募(20年)第20回	100,000,000	105,386,000
福岡県	公募平成23年度第5回	100,000,000	101,883,000
福岡県	公募平成26年度第1回	100,000,000	102,960,000
福岡県	公募平成27年度第1回	300,000,000	309,447,000
福岡県	公募平成29年度第1回	100,000,000	101,270,000
福岡県	公募平成23年度第1回	100,000,000	110,137,000
福岡県	公募(15年)令和元年度第1回	100,000,000	100,125,000
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	100,000,000	139,641,000
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	100,000,000	131,100,000
福岡県	公募(30年・定時償還)平成29年度第2回	100,000,000	111,411,000
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	100,000,000	117,729,000
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	100,000,000	118,052,000
千葉県	公募平成24年度第1回	100,000,000	102,453,000
千葉県	公募平成24年度第2回	100,000,000	102,202,000
千葉県	公募平成24年度第7回	100,000,000	102,225,000
千葉県	公募平成24年度第8回	100,000,000	102,603,000
千葉県	公募平成25年度第3回	100,000,000	103,120,000
千葉県	公募平成25年度第4回	100,000,000	103,304,000
千葉県	公募平成26年度第3回	200,000,000	205,630,000
千葉県	公募平成28年度第4回	200,000,000	200,872,000
千葉県	公募平成29年度第8回	100,000,000	101,357,000

千葉県 公募(20年)第8回	100,000,000	121,230,000
千葉県 公募(20年)第16回	200,000,000	237,012,000
千葉県 公募(20年)第17回	100,000,000	116,702,000
群馬県 公募第8回	100,000,000	101,989,000
群馬県 公募第12回	100,000,000	102,895,000
群馬県 公募(20年)第3回	100,000,000	118,562,000
岐阜県 公募平成26年度第1回	186,670,000	191,626,088
大分県 公募平成23年度第1回	902,000,000	918,750,140
共同発行市場地方債 公募第94回	300,000,000	304,026,000
共同発行市場地方債 公募第96回	100,000,000	101,608,000
共同発行市場地方債 公募第101回	300,000,000	305,280,000
共同発行市場地方債 公募第102回	150,000,000	152,718,000
共同発行市場地方債 公募第103回	100,000,000	101,846,000
共同発行市場地方債 公募第104回	200,000,000	203,978,000
共同発行市場地方債 公募第108回	200,000,000	204,550,000
共同発行市場地方債 公募第110回	200,000,000	204,308,000
共同発行市場地方債 公募第111回	200,000,000	204,454,000
共同発行市場地方債 公募第112回	100,000,000	102,176,000
共同発行市場地方債 公募第113回	800,000,000	816,496,000
共同発行市場地方債 公募第114回	243,700,000	249,205,183
共同発行市場地方債 公募第115回	100,000,000	102,277,000
共同発行市場地方債 公募第116回	200,000,000	204,688,000
共同発行市場地方債 公募第118回	100,000,000	102,603,000
共同発行市場地方債 公募第119回	200,000,000	205,092,000
共同発行市場地方債 公募第120回	300,000,000	306,657,000
共同発行市場地方債 公募第121回	100,000,000	101,912,000
共同発行市場地方債 公募第122回	400,000,000	408,516,000
共同発行市場地方債 公募第124回	200,000,000	206,536,000
共同発行市場地方債 公募第126回	100,000,000	103,049,000
共同発行市場地方債 公募第128回	300,000,000	307,791,000
	100,000,000	102,852,000

共同発行市場地方債 公募第129回			
共同発行市場地方債 公募第130回	100,000,000	103,117,000	
共同発行市場地方債 公募第132回	100,000,000	102,816,000	
共同発行市場地方債 公募第136回	200,000,000	205,630,000	
共同発行市場地方債 公募第137回	200,000,000	205,306,000	
共同発行市場地方債 公募第139回	155,000,000	159,101,300	
共同発行市場地方債 公募第143回	540,000,000	552,355,200	
共同発行市場地方債 公募第145回	1,000,000,000	1,021,360,000	
共同発行市場地方債 公募第156回	200,000,000	200,996,000	
共同発行市場地方債 公募第157回	300,000,000	301,134,000	
共同発行市場地方債 公募第161回	300,000,000	300,798,000	
共同発行市場地方債 公募第172回	600,000,000	608,838,000	
共同発行市場地方債 公募第184回	100,000,000	101,067,000	
共同発行市場地方債 公募第190回	410,000,000	413,140,600	
共同発行市場地方債 公募第191回	100,000,000	100,545,000	
堺市 公募平成22年度第1回	100,000,000	119,584,000	
堺市 公募平成26年度第1回	100,000,000	127,597,000	
島根県 公募平成28年度第3回	100,000,000	100,019,000	
佐賀県 公募平成28年度第1回	100,000,000	100,388,000	
福島県 公募平成26年度第1回	200,000,000	204,912,000	
滋賀県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,567,000	
滋賀県 公募平成26年度第1回	142,000,000	145,487,520	
栃木県 公募平成24年度第1回	100,000,000	102,326,000	
栃木県 公募平成25年度第1回	100,000,000	102,567,000	
新潟市 公募平成25年度第1回	233,200,000	239,951,140	
新潟市 公募平成29年度第1回	100,000,000	101,435,000	
奈良県 公募平成28年度第1回	100,000,000	100,019,000	
浜松市 公募平成26年度第1回	100,000,000	101,674,000	
大阪市 公募平成25年度第6回	100,000,000	102,725,000	
大阪市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,837,000	
大阪市 公募（5年）平成28年度第5回	100,000,000	100,019,000	
大阪市 公募（15年）第1回	100,000,000	111,345,000	
大阪市 公募（20年）第1回	300,000,000	353,586,000	

大阪市 公募(20年)第5回	100,000,000	121,047,000
大阪市 公募(20年)第6回	100,000,000	119,157,000
大阪市 公募(20年)第17回	100,000,000	119,479,000
名古屋市 公募第478回	100,000,000	102,372,000
名古屋市 公募第481回	100,000,000	102,232,000
名古屋市 公募第488回	300,000,000	308,547,000
名古屋市 公募第503回	100,000,000	101,398,000
名古屋市 公募第504回	200,000,000	202,702,000
名古屋市 公募(12年)第1回	200,000,000	211,266,000
名古屋市 公募(15年)第2回	100,000,000	107,831,000
京都市 公募平成23年度第4回	100,000,000	102,139,000
京都市 公募平成29年度第1回	100,000,000	101,376,000
京都市 公募平成29年度第4回	101,280,000	102,915,672
京都市 公募(20年)第2回	100,000,000	112,119,000
京都市 公募(20年)第13回	100,000,000	116,277,000
神戸市 公募平成26年度第17回	300,000,000	304,194,000
神戸市 公募平成28年度第1回	200,000,000	200,754,000
横浜市 公募公債平成24年度2回	200,000,000	204,602,000
横浜市 公募公債平成25年度1回	200,000,000	204,536,000
横浜市 公募公債平成25年度5回	200,000,000	205,128,000
横浜市 公募公債平成26年度5回	200,000,000	204,714,000
横浜市 公募平成28年度第5回	300,000,000	304,353,000
横浜市 公募平成29年度第3回	100,000,000	101,446,000
横浜市 公募(30年)第2回	200,000,000	266,706,000
横浜市 公募(20年)第18回	100,000,000	119,839,000
横浜市 公募(20年)第26回	100,000,000	120,257,000
横浜市 公募(20年)第30回	100,000,000	116,336,000
札幌市 公募(15年)平成23年度第9回	100,000,000	110,433,000
札幌市 公募(20年)平成24年度第1回	100,000,000	119,626,000
札幌市 公募(20年)平成24年度第11回	100,000,000	120,617,000
札幌市 公募平成26年度第4回	100,000,000	102,437,000
札幌市 公募平成26年度第9回	200,000,000	204,324,000
川崎市 公募第85回	100,000,000	102,161,000
川崎市 公募(20年)第17回	100,000,000	117,276,000
川崎市 公募(20年)第19回	100,000,000	116,132,000
北九州市 公募(20年)第14回	100,000,000	119,235,000
福岡市 公募(20年)平成23年度第4回	100,000,000	119,985,000
福岡市 公募平成26年度第2回	100,000,000	117,742,000
福岡市 公募平成26年度第5回	100,000,000	102,626,000
福岡市 公募平成26年度第8回	160,000,000	163,857,600

		広島市 公募平成26年度第2回	100,000,000	102,297,000	
		広島市 公募平成27年度第2回	500,000,000	513,760,000	
		広島市 公募(10年)平成30年度第6回	241,000,000	242,446,000	
		千葉県 公募平成24年度第1回	100,000,000	102,453,000	
		三重県 公募平成24年度第1回	140,660,000	143,867,048	
		三重県 公募平成28年度第1回	155,000,000	156,517,450	
		鹿児島県 公募(5年)平成28年度第1回	100,000,000	100,018,000	
		福井県 公募平成22年度第2回	100,000,000	101,859,000	
		福井県 公募平成24年度第4回	100,000,000	101,547,000	
		福井県 公募平成27年度第4回	200,000,000	200,822,000	
		山梨県 公募平成24年度第1回	200,000,000	204,566,000	
		岡山県 公募平成28年度第2回	168,900,000	171,094,011	
		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	118,259,000	
		愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	300,000,000	358,797,000	
		福岡北九州高速道路債券 第117回	100,000,000	117,505,000	
		福岡北九州高速道路債券 第136回	100,000,000	105,288,000	
	小計	銘柄数: 267 組入時価比率: 6.7%	44,562,820,000	47,023,952,961 6.7%	
	合計			47,023,952,961	
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	102,672,000	
		新関西国際空港債券 政府保証第1回	151,000,000	154,359,750	
		新関西国際空港債券 政府保証第2回	191,000,000	197,104,360	
		新関西国際空港債券 政府保証第5回	117,000,000	118,440,270	
		新関西国際空港社債 財投機関債第12回	100,000,000	108,433,000	
		新関西国際空港社債 財投機関債第22回	200,000,000	200,278,000	
		日本政策投資銀行債券 政府保証第22回	100,000,000	107,765,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第31回	300,000,000	306,495,000	
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	100,000,000	108,570,000	
		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	100,890,000	
		日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	102,000,000	104,371,500	

日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	159,000,000	162,577,500	
日本政策投資銀行社債 政府保証第38回	1,500,000,000	1,501,500,000	
日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	300,000,000	303,945,000	
道路債券 財投機関債第17回	300,000,000	313,746,000	
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	135,237,000	
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	229,794,000	
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	115,422,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回	300,000,000	352,371,000	
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	322,890,000	
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	239,508,000	
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	121,151,000	
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	102,151,000	
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	408,992,000	
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	204,156,000	
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	118,105,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第100回	200,000,000	204,656,000	
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	102,138,000	
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	413,724,500	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回	100,000,000	120,213,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第107回	100,000,000	103,238,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第122回	100,000,000	102,954,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第123回	100,000,000	102,895,000	
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	205,020,000	
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	204,696,000	
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	205,520,000	
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	369,408,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第149回	100,000,000	124,988,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第157回	100,000,000	107,075,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第164回	100,000,000	112,756,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第173回	100,000,000	98,170,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第188回	100,000,000	104,232,000	
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	102,317,000	
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	102,470,000	
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	239,820,000	
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	240,220,000	
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	242,474,000	
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	241,316,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回	200,000,000	237,864,000	
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	133,487,000	
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	856,312,800	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第149回	140,000,000	142,933,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第155回	100,000,000	101,948,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第157回	140,000,000	142,837,800	
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	1,022,610,000	
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	129,546,000	
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	102,252,000	
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	118,193,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第170回	218,000,000	222,861,400	
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	117,325,000	
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	395,103,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第173回	200,000,000	204,696,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第175回	200,000,000	204,682,000	
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	204,598,000	
	900,000,000	924,129,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第182回			
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	119,860,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第189回	196,000,000	199,739,680	
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	408,716,000	
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	1,032,030,000	
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	280,663,200	
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	308,697,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第211回	137,000,000	140,951,080	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第213回	145,000,000	149,168,750	
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	117,799,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第217回	100,000,000	128,954,000	
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	117,756,000	
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	103,039,000	
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	129,080,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	190,000,000	195,213,600	
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	102,536,000	
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	568,600,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第261回	200,000,000	204,998,000	
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	151,519,440	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第297回	100,000,000	100,739,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第306回	403,000,000	407,960,930	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第315回	100,000,000	101,090,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第321回	500,000,000	506,530,000	
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	109,154,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第339回	500,000,000	508,175,000	
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	132,520,910	
	100,000,000	101,104,000	

日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第351回			
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第354回	200,000,000	201,972,000	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第357回	100,000,000	101,637,000	
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	138,123,700	
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	539,436,000	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第33回	100,000,000	137,081,000	
公営企業債券 30年第4回財投機関債	100,000,000	137,223,000	
地方公営企業等金融機構債券（20年）第1回	100,000,000	117,487,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	100,000,000	119,537,000	
地方公共団体金融機構債券 F16回	100,000,000	113,928,000	
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	300,000,000	363,183,000	
地方公共団体金融機構債券 F24回	100,000,000	105,433,000	
地方公共団体金融機構債券（20年）第10回	300,000,000	349,560,000	
地方公共団体金融機構債券 第27回	300,000,000	305,196,000	
地方公共団体金融機構債券 第28回	500,000,000	509,240,000	
地方公共団体金融機構債券 F104回	100,000,000	106,658,000	
地方公共団体金融機構債券 F106回	100,000,000	105,376,000	
地方公共団体金融機構債券 F122回	100,000,000	109,982,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第37回	604,000,000	617,825,560	
地方公共団体金融機構債券 第37回	400,000,000	408,632,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第38回	194,000,000	198,302,920	
地方公共団体金融機構債券 F132回	500,000,000	529,730,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回	100,000,000	102,193,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第40回	101,000,000	103,325,020	
政保 地方公共団体金融機構債券 第41回	102,000,000	104,357,220	
地方公共団体金融機構債券 第41回	600,000,000	613,824,000	
	100,000,000	104,977,000	

地方公共団体金融機構債券 F 1 4 2 回			
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 5 回	200,000,000	210,630,000	
地方公共団体金融機構債券 F 1 4 7 回	100,000,000	108,895,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	108,000,000	110,604,960	
地方公共団体金融機構債券 第 4 2 回	100,000,000	102,372,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 3 回	202,000,000	206,593,480	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	145,000,000	148,849,750	
地方公共団体金融機構債券 第 4 4 回	100,000,000	102,428,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 5 回	223,000,000	228,936,260	
地方公共団体金融機構債券 F 1 6 0 回	100,000,000	108,110,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 8 回	500,000,000	510,765,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 4 9 回	13,000,000	13,411,840	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 0 回	100,000,000	103,341,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 1 回	600,000,000	618,744,000	
地方公共団体金融機構債券 第 5 2 回	300,000,000	309,282,000	
地方公共団体金融機構債券（ 1 5 年） 第 2 回	200,000,000	218,744,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 6 回	591,000,000	609,687,420	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 5 9 回	116,000,000	119,484,640	
地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年） 第 3 8 回	100,000,000	117,079,000	
地方公共団体金融機構債券 F 2 4 0 回	300,000,000	327,630,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	102,709,000	
地方公共団体金融機構債券 第 6 4 回	100,000,000	102,728,000	
地方公共団体金融機構債券（ 2 0 年） 第 3 9 回	100,000,000	116,307,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 5 回	400,000,000	410,948,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 6 9 回	320,000,000	327,488,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第 7 2 回	189,000,000	194,618,970	
	300,000,000	308,265,000	

地方公共団体金融機構債券 第74回			
地方公共団体金融機構債券 第77回	100,000,000	102,656,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	509,000,000	521,658,830	
地方公共団体金融機構債券 第79回	400,000,000	410,748,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第5回	500,000,000	504,155,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	116,000,000	116,402,520	
地方公共団体金融機構債券 第101回	400,000,000	405,300,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第108回	157,000,000	158,821,200	
政保 地方公共団体金融機構債券 第110回	100,000,000	100,982,000	
政保 地方公共団体金融機構債券 第113回	110,000,000	111,860,100	
公営企業債券(20年) 第2回財投機関債	100,000,000	104,312,000	
公営企業債券(20年) 第5回財投機関債	200,000,000	215,718,000	
公営企業債券(20年) 第19回財投機関債	100,000,000	116,134,000	
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債	100,000,000	120,384,000	
首都高速道路 第17回	200,000,000	200,088,000	
都市再生債券 財投機関債第55回	100,000,000	101,845,000	
都市再生債券 財投機関債第96回	200,000,000	205,670,000	
都市再生債券 財投機関債第97回	100,000,000	108,474,000	
都市再生債券 財投機関債第109回	100,000,000	107,703,000	
都市再生債券 財投機関債第113回	300,000,000	321,027,000	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	100,000,000	112,019,000	
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	360,000,000	370,022,400	
東京交通債券 第342回	200,000,000	211,454,000	
東京交通債券 第347回	157,000,000	169,688,740	
関西国際空港社債 財投機関債第32回	100,000,000	102,015,000	
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	100,000,000	102,333,000	
中部国際空港債券 政府保証第18回	368,000,000	376,327,840	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	200,000,000	231,740,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	100,000,000	108,032,000	

住宅金融支援機構債券 財投機関債 第42回	100,000,000	109,939,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第49回	100,000,000	120,031,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第59回	100,000,000	118,791,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第73回	100,000,000	101,884,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第75回	100,000,000	120,910,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第77回	300,000,000	332,952,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第78回	100,000,000	120,934,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第79回	100,000,000	101,851,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第86回	200,000,000	203,626,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第90回	200,000,000	221,488,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第120回	100,000,000	119,715,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第123回	100,000,000	119,424,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第128回	100,000,000	137,724,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第132回	200,000,000	216,444,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第137回	100,000,000	110,221,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第143回	100,000,000	109,574,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第177回	250,000,000	256,545,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第198回	200,000,000	201,530,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第223回	100,000,000	101,468,000	
住宅金融支援機構債券 財投機関債 第244回	130,000,000	131,994,200	
成田国際空港 第10回	100,000,000	101,895,000	
成田国際空港 第13回一般担保付	200,000,000	205,040,000	
成田国際空港 第17回	200,000,000	204,512,000	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機 関債第17回	100,000,000	101,810,000	
商工債券 利付第806回い号	300,000,000	300,582,000	
商工債券 利付第811回い号	300,000,000	301,308,000	
商工債券 利付第815回い号	100,000,000	100,451,000	
商工債券 利付第818回い号	100,000,000	100,483,000	
商工債券 利付第819回い号	300,000,000	301,590,000	
しんきん中金債券 利付第316回	100,000,000	100,080,000	

しんきん中金債券 利付第317回	800,000,000	800,600,000	
しんきん中金債券 利付第327回	200,000,000	200,244,000	
しんきん中金債券 利付第335回	200,000,000	200,542,000	
商工債券 利付(3年)第223回	500,000,000	500,830,000	
商工債券 利付(3年)第231回	200,000,000	200,256,000	
商工債券 利付(3年)第236回	500,000,000	499,940,000	
商工債券 利付(10年)第15回	200,000,000	203,288,000	
国際協力機構債券 第6回財投機関債	200,000,000	241,386,000	
東日本高速道路 第34回	100,000,000	100,279,000	
東日本高速道路 第36回	200,000,000	200,162,000	
中日本高速道路 第63回	100,000,000	103,054,000	
中日本高速道路 第66回	1,200,000,000	1,200,732,000	
西日本高速道路 第20回	200,000,000	205,552,000	
西日本高速道路 第22回	400,000,000	412,228,000	
西日本高速道路 第23回	100,000,000	102,606,000	
西日本高速道路 第30回	300,000,000	302,007,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第62回	100,000,000	102,864,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第68回	200,000,000	205,352,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回	100,000,000	116,454,000	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第71回	100,000,000	102,558,000	
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	32,532,000	32,871,634	
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	59,915,000	61,304,428	
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	60,582,000	60,745,571	
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	37,335,000	38,155,249	
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	41,196,000	43,201,833	
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	12,911,000	13,357,591	
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	27,922,000	28,969,075	
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	31,768,000	33,350,999	
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	35,766,000	36,591,479	
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	59,120,000	61,104,067	
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	60,885,000	62,590,997	
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	54,748,000	57,228,084	

貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	91,794,000	95,755,829
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	15,270,000	15,988,758
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	23,893,000	25,870,145
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	78,318,000	83,912,254
貸付債権担保5種第16回住宅金融支援機構債券	16,201,000	16,548,187
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	84,134,000	88,837,090
貸付債権担保5種第17回住宅金融支援機構債券	32,608,000	33,324,397
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	101,166,000	107,796,419
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	74,218,000	78,450,652
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	42,582,000	45,798,644
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	94,266,000	100,404,601
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	105,168,000	110,210,805
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	141,429,000	148,368,921
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	137,793,000	145,271,026
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	88,850,000	93,332,482
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	34,457,000	36,515,805
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	81,178,000	86,238,636
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	46,220,000	48,171,870
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	98,856,000	103,154,258
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	44,775,000	46,673,012
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	25,410,000	26,210,415
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	134,412,000	141,120,502
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	29,338,000	31,433,319
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	31,408,000	33,702,668
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	31,165,000	33,220,331
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	33,395,000	35,607,752
	90,498,000	95,721,544

貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券			
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	128,871,000	136,259,174	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	43,084,000	45,597,951	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	86,814,000	90,926,379	
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	11,948,000	12,206,076	
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	68,590,000	69,643,542	
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	27,986,000	28,410,267	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	83,912,000	90,030,023	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	84,357,000	90,055,315	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	168,470,000	177,398,910	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	91,078,000	96,328,646	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	148,539,000	155,599,058	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	130,077,000	135,476,496	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	101,004,000	106,557,199	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	86,480,000	90,801,405	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	209,284,000	218,184,848	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	363,405,000	378,344,579	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	54,331,000	56,376,018	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	57,199,000	59,429,761	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	58,548,000	60,594,252	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	122,202,000	125,682,312	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	128,562,000	131,269,515	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	68,891,000	71,106,534	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	72,762,000	74,893,198	
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	215,457,000	222,857,947	
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	220,842,000	229,373,126	
	147,700,000	153,348,048	

		貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券			
		貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	72,564,000	75,166,870	
		貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	72,540,000	75,347,298	
		貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	260,814,000	263,701,210	
		貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	174,770,000	177,506,898	
		貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	175,940,000	178,436,588	
		貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	88,124,000	89,436,166	
		貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	176,354,000	178,863,517	
		貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券	89,053,000	89,949,763	
		貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券	89,348,000	90,422,856	
		貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	90,519,000	91,788,076	
		貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券	363,356,000	367,425,587	
		貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	274,113,000	277,363,980	
		貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	183,326,000	185,364,585	
		貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券	184,932,000	187,624,609	
		貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券	188,968,000	190,719,733	
		貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	94,722,000	95,595,336	
		貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	95,169,000	96,394,776	
		貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	96,167,000	96,894,984	
		貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	291,255,000	292,102,552	
		貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	292,578,000	293,599,097	
		貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	499,225,000	495,810,301	
		貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	200,000,000	200,398,000	
	小計	銘柄数：309	57,485,712,000	60,592,864,730	
		組入時価比率：8.6%		8.7%	
	合計			60,592,864,730	
社債券	日本円	フランス相互信用連合銀行（BFCM）第14回円貸社債	200,000,000	201,104,000	

フランス相互信用連合銀行(B F C M) 第 2 9 回円貨社債	200,000,000	199,542,000	
フランス相互信用連合銀行(B F C M) 第 3 1 回円貨社債	100,000,000	98,637,000	
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第 1 4 回円貨社債	100,000,000	99,850,000	
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	201,128,000	
クレディ・アグリコル・エス・エー 第 6 回円貨社債(2 0 1 4)	100,000,000	102,385,000	
クレディ・アグリコル・エス・エー 第 1 5 回円貨社債(2 0 1 8)	100,000,000	99,606,000	
クレディ・アグリコル・エス・エー 第 1 6 回円貨社債(2 0 1 8)	100,000,000	99,896,000	
スタンダード・チャータード 第 3 回円貨社債(2 0 1 5)	100,000,000	100,533,000	
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	101,657,000	
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	103,415,000	
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	100,386,000	
ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第 6 回円貨社債	100,000,000	99,923,000	
ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第 7 回円貨社債	100,000,000	98,216,000	
サンタンデール銀行 第 1 回円貨社債	100,000,000	99,991,000	
フランス電力 第 4 回円貨社債(2 0 1 7)	100,000,000	102,912,000	
現代キャピタル・サービス・インク 第 1 5 回円貨社債	200,000,000	200,632,000	
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第 1 回円貨社債(2 0 1 7)	100,000,000	101,803,000	
ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第 1 2 回円貨社	200,000,000	200,012,000	
オーストラリア・ニュージーランド銀行 第 1 0 回円貨社債	200,000,000	199,770,000	
ソシエテ・ジェネラル 第 1 回非上位円貨社債(2 0 1 7)	100,000,000	100,072,000	
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	100,483,000	
大和ハウス工業 第 9 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,960,000	
森永乳業 第 1 3 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,081,000	
明治ホールディングス 第 8 回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,910,000	
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	100,610,000	
麒麟ホールディングス 第 1 0 回社債間限定同順位特約付	200,000,000	204,368,000	
	200,000,000	200,500,000	

味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付			
日本たばこ産業 第13回	100,000,000	100,594,000	
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,081,000	
野村不動産ホールディングス 第5回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,485,000	
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付	200,000,000	197,400,000	
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,882,000	
東急不動産ホールディングス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,878,000	
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,836,000	
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,690,000	
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	101,328,000	
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,565,000	
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,776,000	
三井化学 第47回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,233,000	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,682,000	
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	201,108,000	
電通 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,987,000	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,218,000	
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,988,000	
第一三共 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,638,000	
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,772,000	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,252,000	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,894,000	
JXホールディングス 第9回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,761,000	
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,413,000	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,597,000	
住友ゴム工業 第24回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,598,000	
日本特殊陶業 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,936,000	

新日鐵住金 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,832,000	
新日鐵住金 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,179,000	
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,282,000	
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,456,000	
神戸製鋼所 第62回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,034,000	
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	102,346,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,924,000	
DOWAホールディングス 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,877,000	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,394,000	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	219,088,000	
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,449,000	
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,308,000	
日本電産 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,807,000	
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,291,000	
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,470,000	
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	200,000,000	202,684,000	
ソニー 第32回	200,000,000	200,816,000	
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,422,000	
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,630,000	
三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,375,000	
J A 三井リース 第7回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,028,000	
J A 三井リース 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,269,000	
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	100,228,000	
トヨタ自動車 第14回社債間限定同等特約付	100,000,000	102,814,000	
アイシン精機 第15回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,972,000	
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	100,322,000	
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,063,000	

伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付	200,000,000	203,598,000	
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,425,000	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,706,000	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	209,028,000	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,482,000	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,231,000	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,701,000	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,908,000	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,640,000	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,699,000	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,659,000	
イオン 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,163,000	
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	102,262,000	
りそなホールディングス 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,873,000	
りそなホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,126,000	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	200,000,000	205,134,000	
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	118,522,000	
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	106,131,000	
三菱東京UFJ銀行 第159回特定社債間限定同順位特約付	200,000,000	201,024,000	
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	305,844,000	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	100,000,000	102,449,000	
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	107,317,000	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	100,000,000	102,102,000	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	300,000,000	310,296,000	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,267,000	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,848,000	
	200,000,000	204,484,000	

みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付			
三井住友銀行 第24回劣後特約付	100,000,000	102,142,000	
N T Tファイナンス 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,399,000	
トヨタファイナンス 第81回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,230,000	
リコーリース 第28回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,132,000	
アコム 第76回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,891,000	
アコム 第77回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,820,000	
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,685,000	
ジャックス 第19回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,005,000	
日立キャピタル 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,564,000	
日立キャピタル 第57回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,017,000	
三井住友ファイナンス&リース 第27回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,586,000	
三菱U F Jリース 第52回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,463,000	
三菱U F Jリース 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,952,000	
三菱U F Jリース 第30回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,484,000	
大和証券グループ本社 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,790,000	
三菱地所 第56回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	105,706,000	
三菱地所 第111回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	102,165,000	
三菱地所 第120回担保提供制限等財務上特約無	100,000,000	100,058,000	
東京建物 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,687,000	
ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	98,538,000	
住友不動産 第95回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,239,000	
住友不動産 第97回社債間限定同順位特約付	200,000,000	205,846,000	
住友不動産 第100回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,683,000	
日本ビルファンド投資法人 第13回特定投資法人債間限定同順位	100,000,000	102,921,000	
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	117,860,000	
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人 第5回特定投資法人債	100,000,000	102,245,000	

東武鉄道 第102回社債間限定同順位特約付	200,000,000	213,454,000	
相鉄ホールディングス 第32回相模鉄道株式会社保証付	200,000,000	203,654,000	
東京急行電鉄 第75回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,116,000	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,858,000	
小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付	200,000,000	215,024,000	
小田急電鉄 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,899,000	
東日本旅客鉄道 第19回社債間限定同順位特約付	200,000,000	209,916,000	
東日本旅客鉄道 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,360,000	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	200,000,000	238,008,000	
東日本旅客鉄道 第71回社債間限定同順位特約付	100,000,000	117,147,000	
東日本旅客鉄道 第106回社債間限定同順位特約付	100,000,000	108,734,000	
東日本旅客鉄道 第107回社債間限定同順位特約付	100,000,000	120,256,000	
東日本旅客鉄道 第133回社債間限定同順位特約付	100,000,000	116,107,000	
西日本旅客鉄道 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	115,275,000	
西日本旅客鉄道 第15回社債間限定同順位特約付	300,000,000	348,837,000	
西日本旅客鉄道 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,575,000	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	200,000,000	239,368,000	
東海旅客鉄道 第70回社債間限定同順位特約付	100,000,000	112,057,000	
東海旅客鉄道 第74回社債間限定同順位特約付	100,000,000	126,074,000	
東京地下鉄 第22回	100,000,000	100,147,000	
東京地下鉄 第23回	100,000,000	103,419,000	
東京地下鉄 第24回	100,000,000	111,445,000	
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	204,430,000	
名古屋鉄道 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,473,000	
日本通運 第11回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,826,000	
日本通運 第12回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,700,000	
日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	110,121,000	
横浜高速鉄道 第2回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,001,000	

九州旅客鉄道 第4回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,483,000	
A N Aホールディングス 第32回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,557,000	
三菱倉庫 第14回	100,000,000	100,400,000	
滋澤倉庫 第8回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,970,000	
K D D I 第20回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,756,000	
K D D I 第25回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,108,000	
東京電力 第548回	100,000,000	112,152,000	
東京電力 第560回	100,000,000	110,739,000	
中部電力 第500回	200,000,000	206,258,000	
中部電力 第524回	100,000,000	100,955,000	
中部電力 第530回	200,000,000	199,242,000	
関西電力 第496回	100,000,000	103,277,000	
関西電力 第497回	200,000,000	207,738,000	
関西電力 第511回	100,000,000	99,925,000	
関西電力 第514回	200,000,000	200,188,000	
関西電力 第527回	200,000,000	200,428,000	
中国電力 第330回	100,000,000	102,516,000	
中国電力 第377回	400,000,000	414,296,000	
中国電力 第378回	100,000,000	103,271,000	
中国電力 第400回	100,000,000	100,340,000	
中国電力 第402回	300,000,000	300,933,000	
北陸電力 第301回	100,000,000	103,287,000	
北陸電力 第304回	100,000,000	103,253,000	
北陸電力 第307回	100,000,000	105,145,000	
北陸電力 第308回	100,000,000	102,748,000	
東北電力 第473回	100,000,000	100,698,000	
東北電力 第475回	100,000,000	102,839,000	
東北電力 第481回	200,000,000	206,310,000	
東北電力 第484回	100,000,000	103,358,000	
四国電力 第281回	200,000,000	207,008,000	
九州電力 第424回	300,000,000	312,330,000	
九州電力 第428回	105,000,000	108,431,400	
九州電力 第449回	200,000,000	201,764,000	
九州電力 第451回	100,000,000	101,024,000	
九州電力 第476回	100,000,000	100,317,000	
北海道電力 第321回	100,000,000	103,113,000	
北海道電力 第323回	100,000,000	108,845,000	
北海道電力 第338回	100,000,000	103,131,000	
電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,468,000	

	電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,139,000	
	電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	100,000,000	103,072,000	
	電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	100,000,000	102,788,000	
	電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,611,000	
	電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,181,000	
	東京電力パワーグリッド 第2回	100,000,000	100,843,000	
	東京電力パワーグリッド 第6回	100,000,000	101,004,000	
	東京電力パワーグリッド 第11回	300,000,000	301,206,000	
	東京電力パワーグリッド 第14回	100,000,000	100,465,000	
	東京電力パワーグリッド 第28回	100,000,000	101,476,000	
	東京瓦斯 第34回社債間限定同順位特約付	100,000,000	101,735,000	
	東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	100,000,000	132,063,000	
	東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	100,000,000	96,132,000	
	大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,663,000	
	東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	100,000,000	104,386,000	
	北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,239,000	
	北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,860,000	
	広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,486,000	
	東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,005,000	
	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	101,041,000	
	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	103,200,000	
	ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,969,000	
	ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付	100,000,000	99,302,000	
小計	銘柄数：224 組入時価比率：4.0%	27,805,000,000	28,600,109,400	4.1%
合計			28,600,109,400	
合計			699,481,627,071	

(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12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	80,155,021
コール・ローン	253,935,490
国債証券	61,995,372,500
派生商品評価勘定	5,701,627
未収入金	58,583
未収利息	402,662,005
前払費用	29,795,214
差入委託証拠金	286,194
流動資産合計	62,767,966,634
資産合計	62,767,966,634
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	367,881,869
未払金	517,339
未払解約金	425,822
未払利息	374
その他未払費用	631,000
流動負債合計	369,456,404
負債合計	369,456,404
純資産の部	
元本等	
元本	52,581,841,715
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,816,668,515
元本等合計	62,398,510,230
純資産合計	62,398,510,230
負債純資産合計	62,767,966,634

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年12月26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	1,1867円
(10,000口当たり純資産額)	(11,867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12月27日 至 2019年12月26日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年12月26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12月26日現在	
期首	2018年12月27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	51,467,038,453円
同期中における追加設定元本額	14,127,551,620円
同期中における一部解約元本額	13,012,748,358円
期末元本額	52,581,841,715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	1,233,662,868円
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	773,813,384円
野村ターゲットデートファンド2016-2026-2028年目標型	19,944,207円
野村ターゲットデートファンド2016-2029-2031年目標型	5,189,230円
野村ターゲットデートファンド2016-2032-2034年目標型	3,139,890円
野村ターゲットデートファンド2016-2035-2037年目標型	1,975,316円
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	5,478,177,439円
インデックス・ブレンド(タイプ)	14,892,759円
インデックス・ブレンド(タイプ)	7,095,808円
インデックス・ブレンド(タイプ)	19,741,654円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,333,187円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,829,847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)	31,487,715,287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)	9,170,507,762円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	4,220,942,340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)	136,880,737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12月26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12月26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	81,276.56	
		US TREASURY BOND	4,500,000.00	4,630,957.20	
		US TREASURY BOND	610,000.00	759,211.73	
		US TREASURY BOND	2,680,000.00	3,494,050.00	
		US TREASURY BOND	1,800,000.00	2,367,000.00	
		US TREASURY BOND	2,280,000.00	2,938,884.43	
		US TREASURY BOND	20,000.00	25,507.81	
		US TREASURY BOND	80,000.00	102,581.24	
		US TREASURY BOND	510,000.00	561,000.00	
		US TREASURY BOND	3,450,000.00	4,355,894.44	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,146,757.76	
		US TREASURY N/B	3,580,000.00	3,594,683.72	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,038,125.20	
		US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,686,847.61	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,015,117.30	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	996,210.90	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,028,281.20	
		US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,525,293.10	
		US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,030,000.00	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,009,414.10	
		US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,875,984.52	
		US TREASURY N/B	6,150,000.00	6,197,086.24	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,526,542.95	
		US TREASURY N/B	4,000,000.00	3,965,156.40	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,512,187.50	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,486,347.60	
		US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,145,445.26	
		US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,616,757.78	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,489,335.90	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,006,992.20	
		US TREASURY N/B	800,000.00	818,218.72	
		US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,506,738.30	
		US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,002,070.30	
		US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,021,210.90	
US TREASURY N/B	600,000.00	604,429.68			
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,503,867.15			
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,208,375.04			
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,008,320.20			
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,409,960.98			
US TREASURY N/B	2,700,000.00	2,732,800.68			
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,203,703.08			

US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,027,539.10	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,006,015.60	
US TREASURY N/B	300,000.00	299,953.14	
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,119,253.79	
US TREASURY N/B	700,000.00	704,675.79	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,509,433.65	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,009,921.90	
US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,148,908.23	
US TREASURY N/B	2,260,000.00	2,291,957.75	
US TREASURY N/B	110,000.00	111,173.05	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,030,000.00	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,094,585.91	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,504,160.10	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,997,656.20	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,475,195.25	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,449,003.95	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,234,921.92	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	2,968,007.70	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,595,507.75	
US TREASURY N/B	700,000.00	698,523.42	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,039,726.60	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,049,335.90	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,089,843.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,043,203.20	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,064,921.80	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,541,976.52	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,034,296.80	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,542,793.10	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,045,312.60	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,549,746.15	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,049,218.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,003,203.20	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,053,671.80	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,013,828.20	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,036,562.60	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,049,062.60	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,098,437.60	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,528,125.00	
US TREASURY N/B	800,000.00	820,062.48	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,025,781.20	
US TREASURY N/B	800,000.00	815,250.00	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,115,546.80	

US TREASURY N/B	2,780,000.00	2,814,098.36
US TREASURY N/B	600,000.00	631,593.78
US TREASURY N/B	1,640,000.00	1,682,281.33
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,979,453.20
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,153,406.46
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,724,000.00
US TREASURY N/B	2,600,000.00	2,629,046.94
US TREASURY N/B	700,000.00	719,523.42
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,866,937.50
US TREASURY N/B	3,200,000.00	3,291,750.08
US TREASURY N/B	600,000.00	617,296.86
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,480,218.96
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,694,140.75
US TREASURY N/B	3,100,000.00	3,345,820.39
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,404,687.60
US TREASURY N/B	2,900,000.00	3,077,851.49
US TREASURY N/B	500,000.00	704,570.30
US TREASURY N/B	340,000.00	484,048.44
US TREASURY N/B	2,060,000.00	2,801,278.22
US TREASURY N/B	400,000.00	482,718.76
US TREASURY N/B	2,300,000.00	3,047,859.49
US TREASURY N/B	2,150,000.00	2,994,882.92
US TREASURY N/B	2,340,000.00	2,972,348.49
US TREASURY N/B	300,000.00	426,515.64
US TREASURY N/B	500,000.00	572,265.65
US TREASURY N/B	500,000.00	538,906.25
US TREASURY N/B	800,000.00	916,312.48
US TREASURY N/B	700,000.00	868,656.25
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,857,375.00
US TREASURY N/B	2,540,000.00	2,867,025.00
US TREASURY N/B	2,760,000.00	3,050,231.38
US TREASURY N/B	3,020,000.00	3,416,375.00
US TREASURY N/B	1,530,000.00	1,579,725.00
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,511,296.96
US TREASURY N/B	2,230,000.00	2,192,717.29
US TREASURY N/B	2,400,000.00	2,662,125.12
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,135,937.50
US TREASURY N/B	2,020,000.00	2,191,700.00
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,627,382.85
US TREASURY N/B	2,800,000.00	3,185,000.00
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,747,265.70
US TREASURY N/B	500,000.00	569,687.50

小計	銘柄数：125 組入時価比率：47.0%	254,660,000.00	267,631,240.94 (29,327,031,382) 47.3%
カナダドル	CANADIAN GOVERNMENT	2,570,000.00	2,541,010.40
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	1,950,460.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,002,900.00
	CANADIAN GOVERNMENT	800,000.00	796,168.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,060,000.00	1,098,923.20
	CANADIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	991,550.00
	CANADIAN GOVERNMENT	330,000.00	475,790.70
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	411,588.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,020,000.00	1,383,548.40
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	298,020.00
	CANADIAN GOVERNMENT	400,000.00	599,808.00
	CANADIAN GOVERNMENT	780,000.00	1,102,826.40
	CANADIAN GOVERNMENT	1,040,000.00	1,298,034.40
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	217,258.00
小計	銘柄数：14 組入時価比率：1.9%	12,800,000.00	14,167,885.50 (1,180,043,183) 1.9%
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,200,000.00	9,171,940.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,800,000.00	2,826,152.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	14,917,200.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	14,000,000.00	13,251,560.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	20,100,000.00	20,838,876.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	3,100,000.00	3,303,143.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,000,000.00	7,705,140.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,000,000.00	7,939,820.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	4,300,000.00	4,681,186.40
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	9,300,000.00	9,688,182.00
	小計	銘柄数：10 組入時価比率：0.9%	90,800,000.00
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	340,000.00	369,372.73
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	552,658.25
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	794,553.97
	BELGIUM KINGDOM	200,000.00	219,697.80
	BELGIUM KINGDOM	1,400,000.00	1,436,716.68
	BELGIUM KINGDOM	230,000.00	261,500.96
	BELGIUM KINGDOM	1,300,000.00	1,355,362.06
	BELGIUM KINGDOM	100,000.00	108,059.30
	BELGIUM KINGDOM	950,000.00	1,016,827.27
	BELGIUM KINGDOM	300,000.00	321,666.15

BELGIUM KINGDOM	800,000.00	865,851.44
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,314,594.24
BELGIUM KINGDOM	550,000.00	804,373.35
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	231,287.20
BELGIUM KINGDOM	420,000.00	519,958.15
BELGIUM KINGDOM	300,000.00	515,525.01
BELGIUM KINGDOM	550,000.00	937,739.00
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	240,856.00
BELGIUM KINGDOM	200,000.00	244,780.20
BELGIUM KINGDOM	170,000.00	238,894.88
BELGIUM KINGDOM GOVT	370,000.00	622,969.33
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	502,738.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	730,000.00	743,901.39
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	504,147.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,490,000.00	1,686,055.69
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,431,564.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,059,007.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	300,000.00	306,204.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,940,000.00	2,283,265.54
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,920,000.00	2,247,651.84
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,400,000.00	1,593,036.48
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	500,000.00	629,384.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	720,000.00	803,927.52
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,078,643.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,094,767.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,100,000.00	1,202,923.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,800,000.00	1,964,242.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,600,000.00	1,746,086.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	330,000.00	468,110.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,150,160.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,093,435.29
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,000,000.00	1,704,130.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	1,674,025.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,150,000.00	1,582,681.63
BUNDES OblIGATION	700,000.00	705,994.87
BUNDES OblIGATION	1,700,000.00	1,719,748.05
BUNDES OblIGATION	1,100,000.00	1,125,259.30
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,024,199.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	896,362.06
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,379,220.70
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,310,000.00	1,405,027.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	767,202.52

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	511,539.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	610,000.00	669,240.57
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	764,099.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	440,000.00	472,019.24
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	900,000.00	954,027.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	300,000.00	308,879.31
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,270,000.00	1,331,235.59
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	1,984,385.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	850,000.00	908,595.60
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,070,741.30
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	500,000.00	524,810.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	409,541.04
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,100,000.00	1,802,821.90
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	1,196,041.56
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	400,000.00	672,297.40
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	510,000.00	925,211.65
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	60,000.00	117,137.33
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	750,000.00	1,268,779.95
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,300,000.00	2,021,446.18
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,110,000.00	1,763,746.26
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	200,000.00	255,021.92
BUONI POLIENNALI DEL TES	170,000.00	178,007.68
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	736,677.90
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,300,000.00	2,319,115.30
BUONI POLIENNALI DEL TES	710,000.00	767,308.36
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,041,727.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,450,000.00	1,460,361.70
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,042,130.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	717,330.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,030,000.00	1,058,714.34
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	509,330.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	900,000.00	930,702.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	200,000.00	229,990.40
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,400,000.00	2,451,537.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	170,731.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,613,437.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,011,482.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	180,000.00	239,038.74
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,561,937.40
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,715,787.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	727,503.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,088,474.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	350,000.00	426,332.90

BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	517,701.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	330,000.00	352,219.56
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	574,368.30
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,100,000.00	2,142,264.60
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,346,522.54
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	560,847.20
BUONI POLIENNALI DEL TES	800,000.00	853,867.04
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,040,000.00	2,630,730.96
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	575,275.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,356,430.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	598,750.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	700,000.00	1,026,393.20
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	504,821.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,070,000.00	1,163,167.04
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,110,000.00	1,557,801.75
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	523,450.50
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,080,000.00	1,387,296.72
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	452,276.40
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	217,960.92
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	435,849.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,180,000.00	3,153,482.05
BUONI POLIENNALI DEL TES	960,000.00	1,131,895.68
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	322,827.00
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,000.00	10,411.15
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	304,216.80
FINNISH GOVERNMENT	300,000.00	318,153.30
FINNISH GOVERNMENT	150,000.00	160,251.15
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	221,372.20
FINNISH GOVERNMENT	310,000.00	325,131.72
FINNISH GOVERNMENT	740,000.00	920,322.46
FINNISH GOVERNMENT	200,000.00	225,110.80
FINNISH GOVERNMENT	160,000.00	237,898.88
FRANCE (GOVT OF)	1,600,000.00	1,614,120.00
FRANCE (GOVT OF)	1,500,000.00	1,519,230.75
FRANCE (GOVT OF)	2,800,000.00	3,022,586.00
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	816,280.16
FRANCE (GOVT OF)	3,010,000.00	3,374,397.52
FRANCE (GOVT OF)	1,000,000.00	1,018,570.00
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	418,649.40
FRANCE (GOVT OF)	700,000.00	734,000.47
FRANCE (GOVT OF)	1,250,000.00	1,289,871.12
FRANCE (GOVT OF)	800,000.00	869,115.20

FRANCE (GOVT OF)	2,300,000.00	2,460,259.40
FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	2,673,198.00
FRANCE (GOVT OF)	1,020,000.00	1,276,861.50
FRANCE (GOVT OF)	1,850,000.00	2,088,068.91
FRANCE (GOVT OF)	460,000.00	562,949.56
FRANCE (GOVT OF)	2,110,000.00	2,753,254.60
FRANCE (GOVT OF)	300,000.00	351,710.94
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,140,000.00	1,206,860.31
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,000,000.00	1,071,759.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,320,000.00	1,432,362.75
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	900,000.00	913,320.00
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	610,000.00	659,618.31
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,800,000.00	2,133,103.50
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	664,054.20
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	822,649.80
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	910,000.00	1,129,167.13
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,900,000.00	2,334,224.29
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,820,866.20
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,640,000.00	1,891,640.28
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	511,673.40
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,490,000.00	2,470,494.50
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	400,000.00	652,657.60
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	720,000.00	1,284,994.08
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,200,000.00	1,904,947.20
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	600,000.00	1,212,649.20
IRISH GOVERNMENT	800,000.00	861,510.40
IRISH TSY 0.8% 2022	1,300,000.00	1,337,242.40
IRISH TSY 1.7% 2037	550,000.00	656,007.55
IRISH TSY 1% 2026	650,000.00	698,125.74
IRISH TSY 2% 2045	250,000.00	322,173.25
IRISH TSY 2022	1,000,000.00	1,012,837.00
IRISH TSY 3.4% 2024	500,000.00	580,157.10
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	530,441.50
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	506,343.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	230,000.00	261,023.59
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	375,325.80
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	325,101.03
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,114,144.80
NETHERLANDS GOVERNMENT	400,000.00	422,110.80
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,076,000.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	878,754.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	850,000.00	1,124,805.00
NETHERLANDS GOVERNMENT	610,000.00	1,075,396.63

小計	NETHERLANDS GOVERNMENT	650,000.00	1,067,767.48
	REPUBLIC OF AUSTRIA	10,000.00	12,861.78
	REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	879,800.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	711,357.50
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,120,000.00	1,217,692.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	320,482.35
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	420,247.00
	REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	749,701.40
	REPUBLIC OF AUSTRIA	530,000.00	692,355.43
	REPUBLIC OF AUSTRIA	230,000.00	378,029.15
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	647,213.20
	REPUBLIC OF AUSTRIA	300,000.00	370,726.50
	REPUBLIC OF AUSTRIA	330,000.00	700,466.58
	REPUBLIC OF IRELAND	80,000.00	91,318.72
	SPANISH GOVERNMENT	90,000.00	135,489.23
	SPANISH GOVERNMENT	800,000.00	1,301,889.12
	SPANISH GOVERNMENT	410,000.00	628,780.26
	銘柄数：197	165,520,000.00	196,028,532.96 (23,811,585,898)
	組入時価比率：38.2%		38.4%
	英債券	UK TREASURY	1,400,000.00
UK TREASURY		520,000.00	559,753.58
UK TREASURY		1,000,000.00	1,033,353.00
UK TREASURY		900,000.00	906,570.00
UK TREASURY		550,000.00	584,545.50
UK TREASURY		500,000.00	509,310.00
UK TREASURY		1,200,000.00	1,321,776.00
UK TREASURY		1,370,000.00	1,452,468.52
UK TREASURY		300,000.00	384,627.42
UK TREASURY		900,000.00	973,179.00
UK TREASURY		90,000.00	131,640.50
UK TREASURY		800,000.00	808,614.40
UK TREASURY		600,000.00	849,313.20
UK TREASURY		200,000.00	278,420.52
UK TREASURY		200,000.00	294,822.00
UK TREASURY		1,160,000.00	1,704,434.40
UK TREASURY		370,000.00	404,345.39
UK TREASURY		1,350,000.00	2,227,331.65
UK TREASURY		400,000.00	591,524.00
UK TREASURY		2,180,000.00	3,665,321.20
UK TREASURY		1,700,000.00	1,792,446.00
UK TREASURY		1,200,000.00	1,340,352.00

小計	UK TREASURY	840,000.00	1,467,446.40
	UK TREASURY	860,000.00	1,445,209.01
	UK TREASURY	280,000.00	523,712.44
	UK TSY 3 1/4% 2044	100,000.00	141,087.60
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	780,000.00	1,478,630.40
	銘柄数：27	21,750,000.00	28,283,816.65 (4,018,847,507)
	組入時価比率：6.4%		6.5%
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	600,000.00	629,550.00
	SWEDISH GOVERNMENT	3,500,000.00	3,827,166.00
	SWEDISH GOVERNMENT	3,000,000.00	3,208,417.20
	SWEDISH GOVERNMENT	250,000.00	286,599.90
	SWEDISH GOVERNMENT	2,700,000.00	2,905,821.00
	SWEDISH GOVERNMENT	4,000,000.00	4,257,989.60
	SWEDISH GOVERNMENT	1,100,000.00	1,710,703.06
小計	銘柄数：7	15,150,000.00	16,826,246.76 (196,025,774)
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	1,085,941.92
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,900,000.00	1,941,363.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2,750,000.00	2,937,415.25
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,700,000.00	1,714,168.48
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,750,000.00	1,790,145.00
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,564,500.00
	小計	銘柄数：6	10,650,000.00
組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	1,500,000.00	1,605,063.00
	KINGDOM OF DENMARK	1,650,000.00	1,784,514.60
	KINGDOM OF DENMARK	3,400,000.00	3,849,143.40
	KINGDOM OF DENMARK	2,300,000.00	2,456,296.50
	KINGDOM OF DENMARK	1,400,000.00	1,499,652.00
	KINGDOM OF DENMARK	3,900,000.00	7,353,879.00
	小計	銘柄数：6	14,150,000.00
組入時価比率：0.5%		0.5%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	1,600,000.00	1,571,012.80
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,700,000.00	4,725,406.79
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,060,585.80
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,800,000.00	2,997,522.92
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,000,000.00	2,102,323.20
	小計	銘柄数：5	13,100,000.00

	組入時価比率：0.6%		0.6%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,225,558.56	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	120,000.00	134,713.72	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,246,962.48	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	919,781.36	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,075,639.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	340,000.00	379,063.96	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	520,000.00	619,577.86	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	820,000.00	1,024,874.45	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	900,000.00	1,003,048.56	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,820,000.00	3,041,633.95	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,000,000.00	1,122,656.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	906,244.40	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,170,000.00	1,605,471.42	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	150,000.00	197,699.22	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	420,000.00	524,730.86	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	300,000.00	349,324.74	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	270,000.00	331,156.86	
	小計	銘柄数：17	13,830,000.00	15,708,138.60 (1,192,247,719)
		組入時価比率：1.9%		1.9%
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,030,000.00	1,023,789.10	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,400,000.00	1,453,871.02	
	SINGAPORE GOVERNMENT	400,000.00	415,526.76	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	719,966.80	
	SINGAPORE GOVERNMENT	730,000.00	820,149.08	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	321,452.82	
	SINGAPORE GOVERNMENT	610,000.00	677,528.15	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	737,810.08	
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	568,452.50	
	小計	銘柄数：9	6,370,000.00	6,738,546.31 (545,148,396)
	組入時価比率：0.9%		0.9%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	800,560.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,500,000.00	4,570,145.55	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,900,000.00	7,706,395.41	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,650,000.00	6,207,084.06	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,800,000.00	2,374,236.76	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	3,500,000.00	3,261,043.10	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,800,000.00	7,727,528.16	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,000,000.00	5,466,795.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	2,100,000.00	1,848,255.15	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,250,000.00	6,353,443.97	

	小計	銘柄数：10 組入時価比率：0.6%	49,300,000.00	46,315,487.16 (358,018,715) 0.6%	
	合計			61,995,372,500 (61,995,372,500)	

(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12月26日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	62,495,869,378	-	62,858,049,620	362,180,242
米ドル	29,581,108,833	-	29,652,549,120	71,440,287
カナダドル	1,180,184,036	-	1,194,313,130	14,129,094
メキシコペソ	528,548,327	-	545,893,500	17,345,173
ユーロ	24,001,366,440	-	24,171,025,840	169,659,400
英ポンド	4,085,279,574	-	4,106,616,778	21,337,204
スウェーデンクローナ	191,166,496	-	194,225,040	3,058,544
ノルウェークローネ	141,900,498	-	146,242,520	4,342,022
デンマーククローネ	316,978,887	-	319,268,352	2,289,465
ズロチ	375,144,739	-	384,102,180	8,957,441
豪ドル	1,201,919,550	-	1,231,782,520	29,862,970
シンガポールドル	549,939,302	-	555,120,240	5,180,938
ランド	342,332,696	-	356,910,400	14,577,704
合計	62,495,869,378	-	62,858,049,620	362,180,242

(注)時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年12月26日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	88,181,745
コール・ローン	230,960,236
国債証券	604,568,483,635
未収入金	698,057,728
未収利息	5,492,971,028
前払費用	265,567,879
その他未収収益	3,834,591
流動資産合計	611,348,056,842
資産合計	611,348,056,842
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	1,251,394
未払解約金	745,136,530
未払利息	340
その他未払費用	5,902,593
流動負債合計	752,290,857
負債合計	752,290,857
純資産の部	
元本等	
元本	260,083,815,731
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	350,511,950,254
元本等合計	610,595,765,985
純資産合計	610,595,765,985
負債純資産合計	611,348,056,842

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年12月26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	2,347円
(10,000口当たり純資産額)	(23,477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	129,928,135,746円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	
3. 自由処分権を有する担保受入金融資産の時価	
貸付有価証券の担保として受け入れている資産は次の通りであります。	
有価証券	138,214,179,618円
なお、上記の金額は利含み価格で表示しております。	

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2018年12月27日 至 2019年12月26日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年12月26日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませぬ。</p> <p>2. 時価の算定方法</p>

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年12月26日現在		2018年12月27日
期首		2018年12月27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		272,731,598,658円
同期中における追加設定元本額		32,088,834,892円
同期中における一部解約元本額		44,736,617,819円
期末元本額		260,083,815,731円
期末元本額の内訳*		
バランスセレクト30		89,188,194円
バランスセレクト50		91,704,202円
バランスセレクト70		78,309,112円
野村外国債券インデックスファンド		304,652,636円
野村世界6資産分散投信（安定コース）		3,715,870,808円
野村世界6資産分散投信（分配コース）		25,291,011,002円
野村世界6資産分散投信（成長コース）		1,604,756,579円
野村資産設計ファンド2015		28,753,373円
野村資産設計ファンド2020		32,278,056円
野村資産設計ファンド2025		48,768,606円
野村資産設計ファンド2030		45,158,772円
野村資産設計ファンド2035		31,711,266円
野村資産設計ファンド2040		61,827,110円
野村外国債券インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）		118,971,300,318円
のむらっぴ・ファンド（保守型）		5,746,373,256円
のむらっぴ・ファンド（普通型）		11,488,533,808円
のむらっぴ・ファンド（積極型）		2,301,804,234円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）		803,675,188円
野村資産設計ファンド2045		7,478,008円
野村インデックスファンド・外国債券		836,357,317円
マイ・ロード		8,611,431,187円
ネクストコア		185,865,067円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		148,376,804円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）		5,538,957,422円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）		1,187,135,747円
野村資産設計ファンド2050		9,803,715円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		5,891,604円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		2,063,577円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		1,488,569円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		1,154,422円

のむラップ・ファンド(やや保守型)	548,918,660円
のむラップ・ファンド(やや積極型)	273,758,146円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,596,925円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,556,177円
インデックス・ブレンド(タイプ)	7,054,878円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,685,118円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,332,426円
野村6資産均等バランス	653,186,792円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	8,337,446,512円
世界6資産分散ファンド	90,767,834円
野村資産設計ファンド2060	803,967円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	1,772,387,146円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	1,608,534,904円
野村外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	9,016,145円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,479,114,150円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	383,878,472円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	1,704,336,209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)	1,368,864,686円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	3,134,429円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	9,636,834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)	724,248円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,884,447,046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)	20,908,409円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	98,589,192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)	18,273,579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)	173,296,083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)	194,266,230円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	1,922,363,282円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	109,422,395円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,636,294,508円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	2,125,704,436円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,671,278円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,514,713円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	6,304,606円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	568,260,631円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,297,904,587円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,891,576,029円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	4,318,267,520円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	15,543,927,968円
マイバランスDC30	1,790,125,824円
マイバランスDC50	1,164,093,824円
マイバランスDC70	746,309,725円
野村DC外国債券インデックスファンド	5,593,402,644円
野村DC運用戦略ファンド	2,684,874,330円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	231,251,933円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	130,261,359円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	172,524,614円

マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	80,958,261円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	7,551,128円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	20,122,757円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	7,272,052円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	2,845,943円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	1,521,636円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	1,146,863円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	44,949,883円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	27,366,842円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	9,888,517円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	10,819,691円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	120,796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12月26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12月26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	29,400,000.00	32,848,758.18	
		US TREASURY BOND	38,800,000.00	45,050,439.44	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	46,412,482.16	
		US TREASURY BOND	72,200,000.00	89,860,798.68	
		US TREASURY BOND	34,100,000.00	44,457,875.00	
		US TREASURY BOND	27,900,000.00	36,688,500.00	
		US TREASURY BOND	43,300,000.00	55,813,024.52	
		US TREASURY BOND	49,300,000.00	62,876,756.58	
		US TREASURY BOND	35,600,000.00	45,648,655.36	
		US TREASURY BOND	100,000.00	133,835.94	
		US TREASURY BOND	24,500,000.00	26,950,000.00	
		US TREASURY BOND	14,800,000.00	18,686,155.88	
		US TREASURY N/B	4,800,000.00	4,816,500.00	
		US TREASURY N/B	700,000.00	699,945.33	

US TREASURY N/B	9,600,000.00	9,670,500.48	
US TREASURY N/B	700,000.00	700,792.96	
US TREASURY N/B	800,000.00	806,875.04	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,941,726.29	
US TREASURY N/B	35,300,000.00	35,482,017.39	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,187,859.48	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,321,203.24	
US TREASURY N/B	48,800,000.00	49,886,561.28	
US TREASURY N/B	32,000,000.00	32,215,001.60	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,944,707.44	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,876,386.67	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,009,804.70	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	11,889,882.96	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,791,492.12	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,508,656.82	
US TREASURY N/B	10,800,000.00	10,887,327.72	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,185,070.26	
US TREASURY N/B	45,400,000.00	46,318,641.76	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,013,437.50	
US TREASURY N/B	17,900,000.00	17,990,199.89	
US TREASURY N/B	300,000.00	298,863.27	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,087,851.40	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	11,054,132.54	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,245,704.40	
US TREASURY N/B	1,600,000.00	1,587,624.96	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,131,500.00	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,507,320.74	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,768,531.44	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	25,191,407.50	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,838,781.08	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,130,000.00	
US TREASURY N/B	9,650,000.00	9,562,169.56	
US TREASURY N/B	24,700,000.00	24,859,198.91	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,886,492.14	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,062,929.80	

US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,004,492.20	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,707,660.11	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,518,188.12	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,747,371.01	
US TREASURY N/B	80,000,000.00	81,371,872.00	
US TREASURY N/B	6,400,000.00	6,382,750.08	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,066,718.40	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,042,155.84	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,817,531.08	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,517,500.00	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,910,207.08	
US TREASURY N/B	500,000.00	502,656.25	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,317,875.00	
US TREASURY N/B	68,300,000.00	68,489,423.22	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	25,438,360.64	
US TREASURY N/B	9,100,000.00	9,124,883.04	
US TREASURY N/B	200,000.00	201,164.06	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,908,496.13	
US TREASURY N/B	25,400,000.00	25,708,569.36	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,308.59	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,917.97	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,006,015.60	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,299,796.94	
US TREASURY N/B	19,100,000.00	19,218,628.19	
US TREASURY N/B	900,000.00	902,601.54	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,514,882.85	
US TREASURY N/B	7,600,000.00	7,596,140.72	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	28,598,764.92	
US TREASURY N/B	47,900,000.00	48,042,205.52	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,181,289.70	
US TREASURY N/B	24,200,000.00	24,086,562.50	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,729,000.00	
US TREASURY N/B	10,400,000.00	10,348,812.24	
US TREASURY N/B	15,000,000.00	14,982,421.50	
US TREASURY N/B	34,800,000.00	34,896,514.32	

US TREASURY N/B	15,000,000.00	14,982,421.50	
US TREASURY N/B	13,700,000.00	13,500,386.89	
US TREASURY N/B	41,100,000.00	42,641,250.00	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,494,727.20	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	13,751,769.01	
US TREASURY N/B	35,200,000.00	34,810,874.56	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	11,775,109.08	
US TREASURY N/B	42,600,000.00	44,292,353.16	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,351,296.76	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,064,804.80	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,341,031.25	
US TREASURY N/B	800,000.00	833,406.24	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,729,152.28	
US TREASURY N/B	20,100,000.00	20,766,598.41	
US TREASURY N/B	17,700,000.00	17,917,793.19	
US TREASURY N/B	600,000.00	610,734.36	
US TREASURY N/B	42,700,000.00	43,480,611.51	
US TREASURY N/B	3,600,000.00	3,688,312.68	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	35,041,641.48	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,343,125.00	
US TREASURY N/B	46,900,000.00	47,504,569.14	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,570,132.94	
US TREASURY N/B	35,000,000.00	36,543,556.00	
US TREASURY N/B	30,000,000.00	31,719,141.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,623,906.25	
US TREASURY N/B	4,100,000.00	4,312,527.19	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	27,331,171.20	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	20,483,249.28	
US TREASURY N/B	70,300,000.00	72,112,425.39	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	1,979,453.20	
US TREASURY N/B	8,600,000.00	8,893,273.76	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,780,031.34	
US TREASURY N/B	26,500,000.00	25,970,000.00	
US TREASURY N/B	12,000,000.00	11,663,437.20	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,526,937.36	

US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,145,234.70	
US TREASURY N/B	11,300,000.00	11,615,163.78	
US TREASURY N/B	500,000.00	518,593.75	
US TREASURY N/B	8,400,000.00	8,640,843.96	
US TREASURY N/B	500,000.00	533,359.40	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,939,781.34	
US TREASURY N/B	1,200,000.00	1,321,406.28	
US TREASURY N/B	4,900,000.00	6,904,788.94	
US TREASURY N/B	44,500,000.00	59,866,406.25	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,466,351.59	
US TREASURY N/B	200,000.00	284,734.38	
US TREASURY N/B	100,000.00	135,984.38	
US TREASURY N/B	100,000.00	120,679.69	
US TREASURY N/B	100,000.00	132,515.63	
US TREASURY N/B	100,000.00	136,640.63	
US TREASURY N/B	100,000.00	134,820.31	
US TREASURY N/B	300,000.00	417,890.64	
US TREASURY N/B	100,000.00	135,296.88	
US TREASURY N/B	200,000.00	254,046.88	
US TREASURY N/B	300,000.00	400,101.57	
US TREASURY N/B	100,000.00	142,171.88	
US TREASURY N/B	100,000.00	135,882.81	
US TREASURY N/B	100,000.00	125,218.75	
US TREASURY N/B	300,000.00	343,359.39	
US TREASURY N/B	500,000.00	572,343.75	
US TREASURY N/B	500,000.00	561,406.25	
US TREASURY N/B	200,000.00	215,687.50	
US TREASURY N/B	13,600,000.00	14,658,250.00	
US TREASURY N/B	22,200,000.00	25,427,671.32	
US TREASURY N/B	4,700,000.00	5,818,453.36	
US TREASURY N/B	15,700,000.00	19,482,718.75	
US TREASURY N/B	18,900,000.00	22,600,266.57	
US TREASURY N/B	23,000,000.00	26,446,407.40	
US TREASURY N/B	36,900,000.00	41,581,687.50	
US TREASURY N/B	46,400,000.00	47,879,000.00	

	US TREASURY N/B	23,900,000.00	26,977,125.00	
	US TREASURY N/B	16,000,000.00	17,682,500.80	
	US TREASURY N/B	13,200,000.00	14,932,500.00	
	US TREASURY N/B	31,500,000.00	32,523,750.00	
	US TREASURY N/B	28,200,000.00	29,123,110.08	
	US TREASURY N/B	15,800,000.00	15,535,844.54	
	US TREASURY N/B	14,200,000.00	15,750,906.96	
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,931,093.75	
	US TREASURY N/B	10,400,000.00	11,284,000.00	
	US TREASURY N/B	11,300,000.00	12,259,617.47	
	US TREASURY N/B	9,500,000.00	10,806,250.00	
	US TREASURY N/B	6,100,000.00	7,105,547.18	
	US TREASURY N/B	12,500,000.00	14,242,187.50	
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,880,515.54	
	US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,904,960.85	
	US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,081,093.75	
小計	銘柄数：170	2,483,750,000.00	2,653,714,497.37	
			(290,794,034,621)	
	組入時価比率：47.6%		48.2%	
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,641,295.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	11,300,000.00	11,364,636.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	14,300,000.00	14,138,696.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	13,050,000.00	13,331,749.50	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,794,708.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	295,419.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,243,029.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,584,760.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,203,480.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,460,000.00	4,438,636.60	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,113,948.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	500,000.00	512,205.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	7,049,696.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,540,404.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,586,480.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	7,250,000.00	10,452,977.50	

小計	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	191,196.00
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	102,897.00
	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	13,672,713.60
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	6,258,420.00
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	5,698,176.00
	CANADIAN GOVERNMENT	9,200,000.00	13,007,696.00
	CANADIAN GOVERNMENT	9,450,000.00	13,057,159.50
	CANADIAN GOVERNMENT	1,300,000.00	1,622,543.00
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	651,774.00
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	134,963.00
	銘柄数：26	121,590,000.00	140,689,657.70 (11,718,041,589)
組入時価比率：1.9%		1.9%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	95,300,000.00	95,009,335.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	66,600,000.00	67,222,044.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,400,000.00	56,088,672.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	53,300,000.00	55,888,365.26
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	45,432,000.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	51,300,000.00	48,557,502.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	112,300,000.00	116,428,148.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	45,300,000.00	50,336,907.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	68,500,000.00	72,798,375.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,655,300.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	72,299,897.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,300,000.00	45,710,678.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	78,000,000.00	82,332,900.00
	MEX BONOS DESARR FIX RT	33,000,000.00	35,925,384.00
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	87,100,000.00	90,735,554.00
小計	銘柄数：15	893,700,000.00	945,421,061.26 (5,464,533,734)
組入時価比率：0.9%		0.9%	
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	760,473.28
	BELGIUM KINGDOM	800,000.00	884,253.20
	BELGIUM KINGDOM	4,900,000.00	5,561,877.79
	BELGIUM KINGDOM	9,700,000.00	10,655,343.30
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	2,976,055.98

BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,547,842.80
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,042,586.20
BELGIUM KINGDOM	3,000,000.00	3,185,525.40
BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	10,920,781.20
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,080,593.00
BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,140,689.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,072,220.50
BELGIUM KINGDOM	1,800,000.00	1,948,165.74
BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,643,242.80
BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,118,739.50
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	564,655.00
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	578,218.00
BELGIUM KINGDOM	500,000.00	618,997.80
BELGIUM KINGDOM	3,400,000.00	5,842,616.78
BELGIUM KINGDOM	4,700,000.00	8,013,406.00
BELGIUM KINGDOM	6,200,000.00	7,466,536.00
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,223,901.00
BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,681,240.80
BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,405,264.00
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	16,859,425.50
BELGIUM KINGDOM GOVT	11,000,000.00	18,520,709.90
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,500,000.00	2,513,690.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,400,000.00	20,951,612.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,100,000.00	5,197,119.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	10,700,000.00	10,788,752.22
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,550,000.00	16,464,503.55
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,350,000.00	4,430,297.52
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,067,638.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,500,000.00	15,885,112.50
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,200,000.00	4,286,856.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,237,787.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	17,566,282.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,900,000.00	8,077,498.80
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	512,047.44
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	977,926.50

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	19,007,411.90	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,617,356.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,699,396.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	30,868,841.92	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,390,057.70	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,182,492.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,456,520.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	13,192,213.68	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,300,320.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,400,000.00	10,205,396.04	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,500,000.00	4,311,535.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,700,000.00	14,825,931.00	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,100,000.00	15,066,226.80	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,700,000.00	6,468,351.03	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,800,000.00	7,766,720.84	
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1,700,000.00	2,724,852.65	
BUNDES OblIGATION	700,000.00	705,994.87	
BUNDES OblIGATION	15,000,000.00	15,174,247.50	
BUNDES OblIGATION	3,300,000.00	3,349,298.70	
BUNDES OblIGATION	750,000.00	763,540.50	
BUNDES OblIGATION	1,000,000.00	1,020,742.00	
BUNDES OblIGATION	5,000,000.00	5,128,040.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	103,376.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,350,000.00	4,609,394.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,400,000.00	6,715,552.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	6,047,352.30	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	740,873.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,190,000.00	2,338,023.41	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	10,100,000.00	10,832,654.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,080,000.00	5,567,698.28	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,900,000.00	17,775,994.15	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,865,096.69	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	800,000.00	873,256.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000.00	8,689,445.10	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,843,424.00	

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	9,875,587.54	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,800,000.00	9,328,272.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,029,597.70	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	733,751.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	21,500,000.00	32,818,675.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,068,936.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	12,197,249.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,400,000.00	1,499,037.82	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	10,504,006.50	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,500,000.00	15,795,156.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	10,161,359.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,300,000.00	14,181,635.64	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	5,714,527.90	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	10,340,600.85	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,900,000.00	11,518,504.51	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,400,000.00	4,060,095.84	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	11,351,197.78	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	11,440,516.32	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,900,000.00	11,348,475.44	
BUONI POLIENNALI DEL TES	150,000.00	157,065.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	100,264.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,200,000.00	12,839,243.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	5,142,386.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,488,928.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,400,000.00	15,562,310.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	416,690.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	553,930.30	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	104,213.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,400,000.00	20,383,023.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	307,427.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	411,151.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	407,464.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000.00	8,454,470.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,205,753.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,400,000.00	34,958,540.80	

BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	102,147.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,252,031.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	578,504.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	24,833,469.10	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,700,000.00	17,118,399.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	317,086.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,634,376.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,884,663.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,088,474.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,463,979.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	5,487,635.90	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,114,981.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,187,670.40	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,201,996.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	14,008,253.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,143,686.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,100,000.00	25,584,311.99	
BUONI POLIENNALI DEL TES	21,500,000.00	30,145,537.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,479,529.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,700,000.00	26,721,671.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,000,000.00	26,392,968.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	504,821.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	16,050,849.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,400,000.00	5,870,188.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,400,000.00	21,612,745.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,192,713.20	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,926,801.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	565,345.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,000,000.00	7,265,364.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,143,746.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,300,000.00	17,869,809.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,800,000.00	21,408,960.72	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000.00	4,126,703.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,402,576.80	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,000,000.00	9,043,740.30	

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,700,000.00	1,769,896.35	
FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	632,522.40	
FINNISH GOVERNMENT	900,000.00	912,650.40	
FINNISH GOVERNMENT	1,700,000.00	1,802,868.70	
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,282,009.20	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	407,710.00	
FINNISH GOVERNMENT	2,900,000.00	3,209,896.90	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,479,804.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	106,889.20	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,097,624.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,104,140.70	
FINNISH GOVERNMENT	1,400,000.00	1,470,190.40	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	860,000.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,688,331.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	594,747.20	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	981,164.80	
FRANCE (GOVT OF)	3,700,000.00	3,727,043.30	
FRANCE (GOVT OF)	8,400,000.00	8,474,130.00	
FRANCE (GOVT OF)	6,000,000.00	6,076,923.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,600,000.00	2,648,239.88	
FRANCE (GOVT OF)	1,570,000.00	1,694,807.15	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	102,035.02	
FRANCE (GOVT OF)	9,600,000.00	10,762,198.08	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,833,426.00	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,512,858.50	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,887,429.78	
FRANCE (GOVT OF)	13,300,000.00	13,724,228.77	
FRANCE (GOVT OF)	1,700,000.00	1,846,869.80	
FRANCE (GOVT OF)	5,000,000.00	5,348,390.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,600,000.00	1,710,846.72	
FRANCE (GOVT OF)	12,000,000.00	15,021,900.00	
FRANCE (GOVT OF)	9,800,000.00	11,074,891.80	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	112,868.59	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	122,380.34	
FRANCE (GOVT OF)	11,100,000.00	14,483,946.00	

FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	12,492,062.92	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,600,000.00	6,001,850.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	10,308,671.35	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	7,306,560.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,031,610.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,900,000.00	14,233,874.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	31,996,552.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,320,271.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	27,147,443.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,465,100.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	42,312,746.30	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4,500,000.00	5,528,425.95	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	40,969,489.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	15,571,429.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,100,000.00	34,282,117.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	10,300,000.00	17,077,915.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	300,000.00	489,493.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	18,100,000.00	32,303,323.40	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,700,000.00	32,860,339.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,200,000.00	10,067,214.56	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,200,000.00	6,467,462.40	
IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,147,941.07	
IRISH GOVERNMENT	6,000,000.00	6,461,328.00	
IRISH TSY 0.8% 2022	1,200,000.00	1,234,377.60	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	657,669.24	
IRISH TSY 1.3% 2033	2,400,000.00	2,693,866.08	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,252,716.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	500,000.00	579,498.50	
IRISH TSY 1.7% 2037	700,000.00	834,918.70	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	4,940,582.16	
IRISH TSY 2.4% 2030	3,700,000.00	4,560,394.30	
IRISH TSY 2% 2045	3,100,000.00	3,994,948.30	
IRISH TSY 2022	4,800,000.00	4,861,617.60	
IRISH TSY 3.4% 2024	5,200,000.00	6,033,633.84	
NETHERLANDS GOVERNMENT	50,000.00	53,044.15	

NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	303,805.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	537,169.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	680,931.12	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,300,000.00	7,881,841.80	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,517,138.14	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	102,109.30	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,000,000.00	13,369,737.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,553,925.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,221,108.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,690,000.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	10,691,507.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,081,580.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,400,000.00	2,483,263.20	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,000,000.00	7,939,800.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,700,000.00	6,114,890.10	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	525,459.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,400,000.00	5,994,014.02	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,500,000.00	10,677,674.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,311,282.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	749,914.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,099,750.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,600,000.00	1,625,960.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	223,355.20	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	4,075,560.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,550,000.00	1,685,198.75	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,325,597.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,700,000.00	4,070,231.25	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,415,970.40	
REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,144,804.80	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,136,549.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,317,547.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	2,600,000.00	2,727,452.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	5,225,324.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	657,442.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	3,700,000.00	5,986,722.10	

小計	REPUBLIC OF AUSTRIA	6,700,000.00	8,279,558.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	2,016,494.70	
	REPUBLIC OF IRELAND	3,350,000.00	3,823,971.40	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	24,086,974.40	
	SPANISH GOVERNMENT	16,400,000.00	26,688,726.96	
	SPANISH GOVERNMENT	500,000.00	766,805.20	
	銘柄数：256	1,453,920,000.00	1,864,597,385.80	(226,492,644,453)
	組入時価比率：37.1%			37.5%
英債券	UK TREASURY	6,220,000.00	6,280,345.19	
	UK TREASURY	840,000.00	930,266.40	
	UK TREASURY	3,370,000.00	3,552,604.12	
	UK TREASURY	2,050,000.00	2,206,720.86	
	UK TREASURY	900,000.00	900,091.80	
	UK TREASURY	4,500,000.00	4,650,088.50	
	UK TREASURY	14,400,000.00	14,505,120.00	
	UK TREASURY	4,800,000.00	5,101,488.00	
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,222,344.00	
	UK TREASURY	8,750,000.00	9,637,950.00	
	UK TREASURY	10,550,000.00	12,938,836.50	
	UK TREASURY	200,000.00	200,250.96	
	UK TREASURY	200,000.00	216,450.80	
	UK TREASURY	160,000.00	169,631.36	
	UK TREASURY	400,000.00	418,796.96	
	UK TREASURY	9,630,000.00	12,346,540.18	
	UK TREASURY	200,000.00	216,262.00	
	UK TREASURY	6,900,000.00	10,092,438.87	
	UK TREASURY	6,000,000.00	8,493,132.00	
	UK TREASURY	6,550,000.00	9,118,272.03	
	UK TREASURY	9,900,000.00	14,593,689.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	4,261,086.00	
	UK TREASURY	1,100,000.00	1,775,917.00	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,539,260.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	4,525,044.00	
UK TREASURY	5,700,000.00	9,404,289.21		

	UK TREASURY	21,340,000.00	31,557,805.40	
	UK TREASURY	6,700,000.00	11,264,978.00	
	UK TREASURY	8,200,000.00	8,645,916.00	
	UK TREASURY	4,300,000.00	4,802,928.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	9,346,236.00	
	UK TREASURY	8,750,000.00	14,704,161.50	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,117,550.00	
	UK TREASURY	3,600,000.00	4,234,059.36	
	UK TREASURY	100,000.00	147,650.66	
	UK TREASURY	2,450,000.00	4,582,483.92	
	UK TSY 3 1/4% 2044	22,200,000.00	31,321,447.20	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,800,000.00	12,890,624.00	
小計	銘柄数：38	202,110,000.00	273,912,755.78	
			(38,920,263,468)	
	組入時価比率：6.4%		6.4%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,700,000.00	1,783,725.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	44,050,000.00	48,167,617.80	
	SWEDISH GOVERNMENT	29,900,000.00	31,977,224.76	
	SWEDISH GOVERNMENT	32,250,000.00	36,971,387.10	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	12,914,760.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	17,883,556.32	
	SWEDISH GOVERNMENT	14,300,000.00	15,225,782.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,500,000.00	16,329,438.30	
小計	銘柄数：8	161,500,000.00	181,253,491.28	
			(2,111,603,173)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ノルウェークロー ネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	20,600,000.00	21,305,146.24	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	13,589,541.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	47,959,979.90	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,797,854.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,739,171.68	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	9,820,224.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,509,600.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	7,672,350.00	
小計	銘柄数：8	112,500,000.00	117,393,866.82	
			(1,443,944,561)	

		組入時価比率：0.2%		0.2%
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK		20,200,000.00	21,614,848.40
	KINGDOM OF DENMARK		400,000.00	410,302.16
	KINGDOM OF DENMARK		18,570,000.00	20,083,900.68
	KINGDOM OF DENMARK		34,600,000.00	39,170,694.60
	KINGDOM OF DENMARK		15,700,000.00	16,766,893.50
	KINGDOM OF DENMARK		10,400,000.00	11,140,272.00
	KINGDOM OF DENMARK		40,500,000.00	76,367,205.00
小計	銘柄数：7		140,370,000.00	185,554,116.34 (3,017,109,931)
		組入時価比率：0.5%		0.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND		1,500,000.00	1,513,008.00
	POLAND GOVERNMENT BOND		28,900,000.00	29,056,224.73
	POLAND GOVERNMENT BOND		19,200,000.00	19,513,703.04
	POLAND GOVERNMENT BOND		12,600,000.00	12,981,690.54
	POLAND GOVERNMENT BOND		28,500,000.00	30,510,501.15
	POLAND GOVERNMENT BOND		2,000,000.00	2,063,616.80
	POLAND GOVERNMENT BOND		10,200,000.00	10,721,848.32
	POLAND GOVERNMENT BOND		14,600,000.00	19,370,418.60
小計	銘柄数：8		117,500,000.00	125,731,011.18 (3,587,105,748)
		組入時価比率：0.6%		0.6%
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT		6,800,000.00	7,251,936.16
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		6,900,000.00	7,046,961.72
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		5,040,000.00	5,657,976.57
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		680,000.00	706,612.07
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		7,100,000.00	8,163,059.57
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		7,200,000.00	7,744,603.68
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		15,200,000.00	16,946,388.80
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		12,780,000.00	15,227,317.60
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		12,100,000.00	15,123,147.49
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		3,200,000.00	3,566,394.88
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		17,800,000.00	19,198,966.08
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		2,100,000.00	2,357,579.28
	AUSTRALIAN GOVERNMENT		10,100,000.00	11,817,983.74
AUSTRALIAN GOVERNMENT		5,300,000.00	6,003,869.15	

小計	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,226,987.40
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,400,000.00	11,526,461.52
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,093,340.06
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	6,589,974.00
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	874,551.44
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,746,623.70
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,500,000.00	5,519,281.05
	銘柄数：21	136,200,000.00	157,390,015.96 (11,945,902,211)
組入時価比率：2.0%		2.0%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	1,380,000.00	1,391,978.12
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,300,000.00	1,292,161.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,300,000.00	2,308,024.47
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,495,655.60
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	301,289.37
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,600,000.00	3,738,525.48
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	710,782.03
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,017,724.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,142,698.59
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	719,966.80
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,381,618.41
	SINGAPORE GOVERNMENT	500,000.00	535,754.70
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	329,812.50
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,665,684.56
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,422,276.00
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,100,000.00	2,213,430.24
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,750,000.00	3,128,115.37
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,136,905.00
	銘柄数：18	29,830,000.00	31,932,402.24 (2,583,331,341)
	組入時価比率：0.4%		0.4%
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,120,408.74
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	414,477.92
	MALAYSIA GOVERNMENT	600,000.00	661,496.16
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	449,544.28

	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,542,862.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	6,200,000.00	6,305,849.50
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	505,706.35
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,641,158.96
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	509,477.20
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,652,606.70
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,570,092.75
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,249,497.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,036,261.26
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	620,400.96
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,170,627.84
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,746,490.68
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,047,586.70
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,246,391.62
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	3,061,005.39
	MALAYSIAN GOVERNMENT	280,000.00	292,008.27
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,169,314.63
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,661,528.96
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,346,149.97
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	812,817.68
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	955,169.82
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,198,979.28
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	11,039,927.93
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,524,570.85
	MALAYSIAN GOVERNMENT	300,000.00	339,280.65
小計	銘柄数：29	100,780,000.00	105,891,690.85
			(2,805,070,890)
	組入時価比率：0.5%		0.5%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,100,000.00	38,693,898.99
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	62,300,000.00	69,580,932.47
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,200,000.00	35,655,731.02
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	25,438,251.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	64,900,000.00	59,262,403.09
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,800,000.00	6,335,740.88
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,100,000.00	27,151,793.55
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00	28,100,102.40

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000.00	10,751,363.50	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,600,000.00	21,256,816.32	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	132,500,000.00	116,616,098.75	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	43,200,000.00	37,857,762.72	
	小計	銘柄数：12	528,500,000.00	476,700,894.69	
				(3,684,897,915)	
		組入時価比率：0.6%		0.6%	
合計				604,568,483,635	
				(604,568,483,635)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(3)貸付有価証券の明細(2019年12月26日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY N/B	396,000	
		US TREASURY N/B	46,000,000	
		US TREASURY N/B	85,000	
		US TREASURY BOND	35,000,000	
		US TREASURY BOND	49,000,000	
		US TREASURY N/B	27,795,000	
		US TREASURY BOND	43,000,000	
		US TREASURY BOND	50,000,000	
		US TREASURY BOND	21,000,000	
		US TREASURY BOND	37,000,000	
		US TREASURY BOND	34,000,000	
		US TREASURY N/B	17,000,000	
		US TREASURY N/B	47,000,000	
		US TREASURY N/B	425,000	
		US TREASURY N/B	46,000,000	
		US TREASURY N/B	21,590,000	
		US TREASURY N/B	42,000,000	
		US TREASURY N/B	32,550,000	
		US TREASURY N/B	50,000,000	
		US TREASURY N/B	20,000,000	
		US TREASURY BOND	45,000,000	
		US TREASURY N/B	50,000,000	
		US TREASURY N/B	27,000,000	
		US TREASURY N/B	33,000,000	
		US TREASURY N/B	42,000,000	
		US TREASURY N/B	45,000,000	
US TREASURY N/B	48,000,000			
	ユーロ	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,100,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,400,000	
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,800,000	

	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,700,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,500,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,500,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,100,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,200,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000	
	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,900,000	
	FRANCE (GOVT OF)	11,300,000	
	FRANCE (GOVT OF)	4,200,000	
	FRANCE (GOVT OF)	4,500,000	
	FRANCE (GOVT OF)	2,000,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,100,000	
	FRANCE (GOVT OF)	1,300,000	
	FRANCE (GOVT OF)	1,300,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,500,000	
	FRANCE (GOVT OF)	8,100,000	
	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	8,000,000	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000	
スウェーデンクローナ	SWEDISH GOVERNMENT	35,000,000	

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年12月26日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	554,477,606	-	555,729,000	1,251,394
米ドル	328,062,279	-	328,647,000	584,721
ユーロ	84,894,327	-	85,022,000	127,673
英ポンド	141,521,000	-	142,060,000	539,000
合計	554,477,606	-	555,729,000	1,251,394

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

（2019年12月26日現在）

資産の部	
流動資産	
預金	76,585,022
コール・ローン	108,703,599
国債証券	7,860,684,768
派生商品評価勘定	266,082
未収利息	96,074,622
前払費用	4,441,148
流動資産合計	8,146,755,241
資産合計	
8,146,755,241	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	97,526
未払金	56,634,447
未払解約金	9,452,529
未払利息	160
その他未払費用	540,000
流動負債合計	66,724,662
負債合計	
66,724,662	
純資産の部	
元本等	
元本	5,692,464,158
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,387,566,421
元本等合計	8,080,030,579
純資産合計	
8,080,030,579	
負債純資産合計	8,146,755,241

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。</p>
--------------------	---

2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	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12月26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	1.4194円
(10,000口当たり純資産額)	(14,194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12月27日 至 2019年12月26日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年12月26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12月26日現在

2019年12月26日現在		2018年12月27日
期首		2018年12月27日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額		5,917,456,856円
同期中における追加設定元本額		1,910,666,063円
同期中における一部解約元本額		2,135,658,761円
期末元本額		5,692,464,158円
期末元本額の内訳*		
野村資産設計ファンド2015		10,783,249円
野村資産設計ファンド2020		12,253,347円
野村資産設計ファンド2025		19,120,399円
野村資産設計ファンド2030		17,705,449円
野村資産設計ファンド2035		12,434,053円
野村資産設計ファンド2040		24,238,034円
野村資産設計ファンド2045		2,922,989円
野村インデックスファンド・新興国債券		881,886,037円
ネクストコア		61,361,732円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		253,494,246円
野村資産設計ファンド2050		3,760,014円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		2,308,433円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		808,532円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		573,828円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		445,717円
世界6資産分散ファンド		155,056,612円
野村資産設計ファンド2060		301,483円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券（適格機関投資家専用）		2,936,288,869円
野村DC新興国債券（現地通貨建て）インデックスファンド		382,482,446円
野村DC運用戦略ファンド		845,786,420円
野村DC運用戦略ファンド（マイルド）		66,253,549円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2030		1,115,792円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2040		596,583円
野村資産設計ファンド（DC・つみたてNISA）2050		439,813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12月26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12月26日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,100,000.00	10,069,195.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	15,600,000.00	15,745,704.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,200,000.00	7,160,256.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,485,622.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7,500,000.00	8,518,500.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,900,000.00	10,317,286.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	11,150,000.00	11,559,874.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10,200,000.00	11,334,138.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,600,000.00	7,014,150.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6,200,000.00	6,606,286.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,467,313.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,600,000.00	6,351,856.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	9,700,000.00	10,238,835.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5,500,000.00	5,987,564.00	
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	13,500,000.00	14,063,490.00	
		小計	銘柄数：15 組入時価比率：9.9%	132,450,000.00	138,920,069.00 (802,957,998) 10.2%
	レアル	LETRA TESOURO NACIONAL	2,900,000.00	2,611,402.73	
LETRA TESOURO NACIONAL		4,400,000.00	3,834,144.16		
LETRA TESOURO NACIONAL		3,500,000.00	2,840,138.00		
NOTA DO TESOURO NACIONAL		376,000.00	4,131,428.96		

小計	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000.00	7,056,641.65	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	311,000.00	3,701,507.07	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	320,000.00	3,891,958.40	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	150,000.00	1,861,285.05	
	銘柄数：8	12,567,000.00	29,928,506.02	(804,777,526)
	組入時価比率：10.0%			10.2%
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	170,000,000.00	177,675,500.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	100,000,000.00	106,485,000.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	280,000,000.00	311,022,096.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	275,000,000.00	316,813,750.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	240,000,000.00	287,064,024.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	265,000,000.00	368,628,250.00	
	銘柄数：6	1,330,000,000.00	1,567,688,620.00	(228,412,231)
組入時価比率：2.8%			2.9%	
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,160,000,000.00	2,229,833,448.00	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	8,590,000,000.00	10,813,993,950.00	
	TITULOS DE TESORERIA	900,000,000.00	940,230,720.00	
	TITULOS DE TESORERIA	500,000,000.00	532,774,750.00	
	銘柄数：4	12,150,000,000.00	14,516,832,868.00	(481,958,851)
組入時価比率：6.0%			6.1%	
ソル	BONOS DE TESORERIA	900,000.00	1,006,651.08	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	679,885.26	
	BONOS DE TESORERIA	600,000.00	682,405.08	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	738,790.78	
	PERU BONO SOBERANO	800,000.00	1,018,120.00	
	PERU BONO SOBERANO	1,100,000.00	1,331,225.72	
	PERU BONO SOBERANO	1,120,000.00	1,354,689.05	
	REPUBLIC OF PERU	1,300,000.00	1,514,220.89	
	銘柄数：8	7,120,000.00	8,325,987.86	(274,840,859)
組入時価比率：3.4%			3.5%	
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	3,492,795.20	
小計	銘柄数：1	4,000,000.00	3,492,795.20	

			(10,338,673)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
ドミニカペソ	DOMINICAN REPUBLIC	8,000,000.00	8,192,320.00	
小計	銘柄数：1	8,000,000.00	8,192,320.00	
			(16,958,102)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	995,500.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	300,000.00	290,700.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	250,000.00	240,625.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,300,000.00	2,277,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	790,000.00	737,070.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,300,000.00	2,320,700.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,270,000.00	1,997,600.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	497,120.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,610,000.00	1,437,730.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	858,840.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,218,750.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	1,131,600.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	644,700.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,416,800.00	
小計	銘柄数：14	16,960,000.00	16,064,735.00	
			(296,394,360)	
	組入時価比率：3.7%		3.8%	
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	4,700,000.00	4,775,670.00	
	CZECH REPUBLIC	17,200,000.00	16,575,129.16	
	CZECH REPUBLIC	20,900,000.00	20,202,215.88	
	CZECH REPUBLIC	20,200,000.00	18,927,400.00	
小計	銘柄数：4	63,000,000.00	60,480,415.04	
			(288,491,579)	
	組入時価比率：3.6%		3.7%	
フォロント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	25,000,000.00	25,155,750.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	10,000,000.00	10,457,500.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	50,000,000.00	58,521,500.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	125,000,000.00	129,973,312.50	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	93,424,100.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	142,000,000.00	156,356,200.00	

小計	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	78,013,845.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	86,000,000.00	93,899,392.40	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	82,000,000.00	90,964,797.60	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	80,583,750.00	
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	36,000,000.00	39,724,812.00	
	銘柄数：11	753,000,000.00	857,074,959.50	(313,689,435)
組入時価比率：3.9%			4.0%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	6,800,000.00	6,836,758.76	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,900,000.00	3,147,106.10	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,600,000.00	5,769,640.24	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,500,000.00	3,612,442.40	
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,250,000.00	5,518,598.40	
	銘柄数：5	24,050,000.00	24,884,545.90	(709,956,094)
組入時価比率：8.8%			9.0%	
ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	8,000,000.00	8,237,320.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	39,000,000.00	39,987,285.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	22,500,000.00	23,513,962.50	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,000,000.00	38,372,700.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	44,000,000.00	44,978,340.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	26,300,000.00	27,785,555.50	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	59,000,000.00	64,311,770.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,000,000.00	22,009,000.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	18,700,000.00	19,679,693.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	10,484,050.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	35,000,000.00	41,256,250.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,500,000.00	41,745,750.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	10,735,100.00	
	銘柄数：13	367,000,000.00	393,096,776.00	(695,781,293)
組入時価比率：8.6%			8.9%	
レイ	ROMANIA	790,000.00	787,479.90	
	ROMANIA	300,000.00	310,012.50	
	ROMANIA	500,000.00	502,827.50	
	ROMANIA	400,000.00	397,640.00	

小計	ROMANIA	1,500,000.00	1,489,605.00
	ROMANIA	550,000.00	584,353.00
	ROMANIA	500,000.00	486,995.00
	ROMANIA	920,000.00	949,357.20
	ROMANIA	500,000.00	519,572.50
	ROMANIA	1,010,000.00	1,109,384.00
	ROMANIA	800,000.00	829,112.00
	銘柄数：11	7,770,000.00	7,966,338.60
組入時価比率：2.5%		(202,504,327)	
			2.6%
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	300,000.00	310,858.44
	MALAYSIA GOVERNMENT	3,300,000.00	3,409,713.12
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,000,000.00	1,123,860.70
	MALAYSIAN GOVERNMENT	620,000.00	630,629.77
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,831,955.56
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,224,031.80
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,705,910.22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	619,298.22
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,063,741.00
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,837,956.78
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,251,464.04
	小計	銘柄数：11	17,420,000.00
			(477,069,526)
			6.1%
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	7,200,000.00	7,549,410.96
	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,000,000.00	23,395,774.80
	THAILAND GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	14,326,081.00
	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000.00	23,454,605.58
	THAILAND GOVERNMENT BOND	3,000,000.00	3,133,941.00
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,576,946.40
	THAILAND GOVERNMENT BOND	17,700,000.00	18,609,178.20
	THAILAND GOVERNMENT BOND	18,500,000.00	20,663,162.45
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,500,000.00	20,160,099.80
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	18,192,280.50
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,200,000.00	10,137,871.56
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	15,401,005.00

小計	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,900,000.00	12,177,875.16
	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,000,000.00	13,003,360.70
	銘柄数：14	181,200,000.00	204,781,593.11 (743,357,182)
	組入時価比率：9.2%		9.5%
フィリピンペソ 小計	REPUBLIC OF PHILIPPINES	10,000,000.00	10,142,000.00
	銘柄数：1	10,000,000.00	10,142,000.00 (21,906,720)
ルピア 小計	INDONESIA GOVERNMENT	1,100,000,000.00	1,207,053,320.00
	INDONESIA GOVERNMENT	7,780,000,000.00	7,929,765,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,700,000,000.00	2,650,419,090.00
	INDONESIA GOVERNMENT	9,230,000,000.00	9,876,638,109.00
	INDONESIA GOVERNMENT	5,600,000,000.00	5,959,800,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,406,988,320.00
	INDONESIA GOVERNMENT	4,580,000,000.00	5,487,435,400.00
	INDONESIA GOVERNMENT	9,150,000,000.00	9,106,009,545.00
	INDONESIA GOVERNMENT	8,500,000,000.00	8,004,630,200.00
	INDONESIA GOVERNMENT	5,530,000,000.00	6,164,163,257.00
	INDONESIA GOVERNMENT	6,400,000,000.00	6,894,400,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,361,083,554.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,776,247,040.00
	INDONESIA GOVERNMENT	4,100,000,000.00	4,327,670,130.00
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,183,150,720.00
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,514,817,860.00
	INDONESIA GOVERNMENT	8,680,000,000.00	9,265,900,000.00
	INDONESIA GOVERNMENT	3,000,000,000.00	3,158,515,800.00
	INDONESIA GOVERNMENT	900,000,000.00	889,566,570.00
	INDONESIA GOVERNMENT	2,500,000,000.00	2,663,750,000.00
銘柄数：20	93,760,000,000.00	97,828,003,915.00 (772,841,230)	
組入時価比率：9.6%		9.8%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	440,000.00	440,308.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,300,000.00	7,413,791.67
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	14,700,000.00	16,417,972.83
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,400,000.00	7,840,527.24

		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,460,000.00	8,869,470.18	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,000,000.00	6,391,938.70	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	3,726,906.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,800,000.00	7,696,571.40	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,200,000.00	9,835,035.84	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	6,469,040.75	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	3,091,269.04	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,300,000.00	6,424,886.95	
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	9,500,000.00	8,325,202.45	
	小計	銘柄数：13	102,650,000.00	92,942,921.45	
				(718,448,782)	
		組入時価比率：8.9%		9.1%	
	合計			7,860,684,768	
				(7,860,684,768)	

(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12月26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	169,880,086	-	170,121,200	241,114
米ドル	97,362,690	-	97,507,700	145,010
メキシコペソ	11,549,924	-	11,540,000	9,924
トルコリラ	7,368,998	-	7,376,000	7,002
チェココルナ	8,583,044	-	8,568,000	15,044
ズロチ	12,784,070	-	12,829,500	45,430
ルーブル	10,556,413	-	10,560,000	3,587
レイ	10,156,730	-	10,160,000	3,270
ランド	11,518,217	-	11,580,000	61,783
売建	72,517,396	-	72,589,954	72,558
米ドル	72,517,396	-	72,589,954	72,558
合計	-	-	-	168,556

（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ありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型

2020年1月31日現在

資産総額	115,178,506円
負債総額	119,272円
純資産総額（ - ）	115,059,234円
発行済口数	97,186,100口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1839円

野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型

2020年1月31日現在

資産総額	40,248,101円
負債総額	42,167円
純資産総額（ - ）	40,205,934円
発行済口数	34,034,263口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1813円

野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型

2020年1月31日現在

資産総額	29,389,275円
負債総額	30,051円
純資産総額（ - ）	29,359,224円
発行済口数	24,957,090口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1764円

野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型

2020年1月31日現在

資産総額	19,127,384円
負債総額	19,712円
純資産総額（ - ）	19,107,672円
発行済口数	16,392,514口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1656円

（参考）国内株式マザーファンド

2020年1月31日現在

資産総額	480,502,082,563円
負債総額	31,845,763,913円
純資産総額（ - ）	448,656,318,650円
発行済口数	263,621,935,067口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7019円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2020年1月31日現在

資産総額	669,442,747,738円
負債総額	1,516,087,843円
純資産総額（ - ）	667,926,659,895円
発行済口数	217,083,640,128口
1口当たり純資産額（ / ）	3.0768円

（参考）新興国株式マザーファンド

2020年1月31日現在

資産総額	42,255,211,077円
負債総額	126,185,833円
純資産総額（ - ）	42,129,025,244円
発行済口数	32,856,763,525口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2822円

（参考）国内債券NOMURA - BPI総合マザーファンド

2020年1月31日現在

資産総額	717,331,355,385円
負債総額	3,013,493,577円
純資産総額（ - ）	714,317,861,808円
発行済口数	530,931,754,922口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3454円

（参考）外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

2020年1月31日現在

資産総額	128,302,938,945円
負債総額	63,581,753,742円
純資産総額（ - ）	64,721,185,203円
発行済口数	53,487,484,674口
1口当たり純資産額（ / ）	1.2100円

（参考）外国債券マザーファンド

2020年1月31日現在

資産総額	619,157,296,834円
負債総額	703,972,151円
純資産総額（ - ）	618,453,324,683円
発行済口数	259,729,163,801口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3811円

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2020年1月31日現在

資産総額	8,264,002,154円
負債総額	79,543,190円
純資産総額（ - ）	8,184,458,964円
発行済口数	5,796,430,056口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4120円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託者がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行なわないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または

記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

委託者は、上記の振替について、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

(4) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託者および受託者に対抗することができません。

(5) 受益権の再分割

委託者は、受託者と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6) 質権口記載又は記録の受益権の取扱い

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

第二部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

2020年1月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

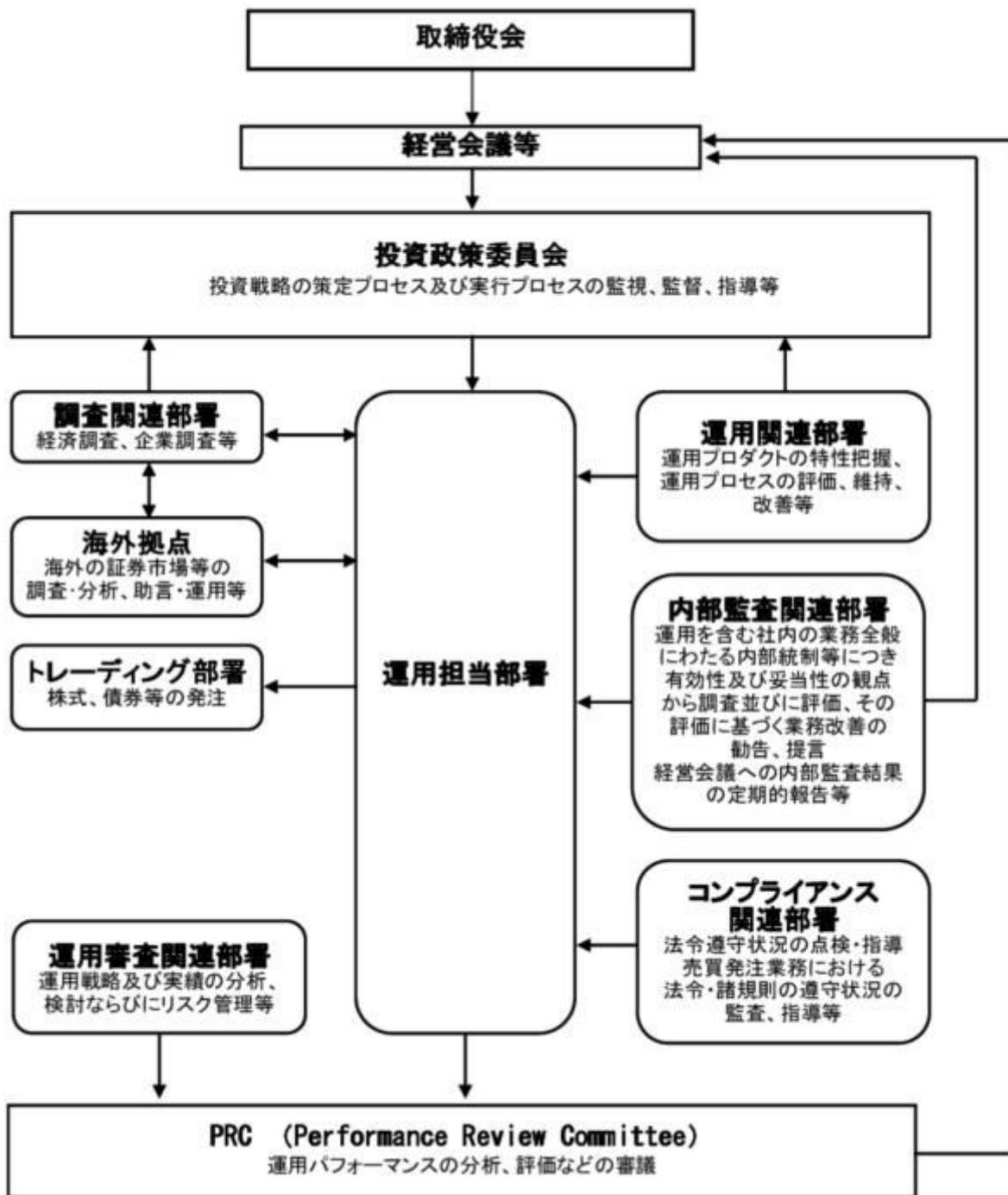
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2019年12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	1,001	30,220,515
単位型株式投資信託	181	921,877
追加型公社債投資信託	14	5,779,652
単位型公社債投資信託	445	1,714,679
合計	1,641	38,636,722

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。

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

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

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

(1)【貸借対照表】

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

有形固定資産			874		714
建物	2	348		320	
器具備品	2	525		393	
無形固定資産			7,157		6,438
ソフトウェア		7,156		6,437	
その他		0		0	
投資その他の資産			13,825		18,608
投資有価証券		1,184		1,562	
関係会社株式		9,033		12,631	
従業員長期貸付金		36		-	
長期差入保証金		54		235	
長期前払費用		36		22	
前払年金費用		2,350		2,001	
繰延税金資産		3,074		2,694	
その他		168		168	
貸倒引当金		0		-	
投資損失引当金		-		707	
固定資産計			23,969		25,761
資産合計			126,906		124,679

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

その他利益剰余金		54,483		55,329
別途積立金		24,606		24,606
繰越利益剰余金		29,876		30,723
評価・換算差額等			11	33
その他有価証券評価差額金			11	33
純資産合計			86,090	86,958
負債・純資産合計			126,906	124,679

(2) 【損益計算書】

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

区分	注記 番号	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
		金額(百万円)		金額(百万円)	
営業外収益					
受取配当金	1	4,031		6,538	
受取利息		4		0	
その他		362		424	
営業外収益計			4,398		6,964
営業外費用					
支払利息		2		1	
金銭の信託運用損		312		489	
時効後支払損引当金繰入額		13		43	
為替差損		46		34	
その他		31		17	
営業外費用計			405		585
經常利益			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 準備金	利益剰余金		利益 剰余金 合計	
		資本 準備金	その他 資本 剰余金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
						別 途 積立金	繰 越 利益 剰余金		
当期首残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	30,635	55,927	86,837

当期変動額									
剰余金の配当							25,598	25,598	25,598
当期純利益							24,840	24,840	24,840
株主資本以外の 項目の当期変動 額(純額)									
当期変動額合計	-	-	-	-	-	-	758	758	758
当期末残高	17,180	11,729	2,000	13,729	685	24,606	29,876	55,168	86,078

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

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

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

【未適用の会計基準等】

- ・「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				
其他有価証券	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	
退職給付債務の期首残高	19,546 百万円
勤務費用	929
利息費用	167
数理計算上の差異の発生額	1,415
退職給付の支払額	660
その他	0
退職給付債務の期末残高	21,398
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	16,572 百万円
期待運用収益	414
数理計算上の差異の発生額	395
事業主からの拠出額	510
退職給付の支払額	518
年金資産の期末残高	17,373
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	18,163 百万円
年金資産	17,373
	790
非積立型制度の退職給付債務	3,235
未積立退職給付債務	4,025
未認識数理計算上の差異	3,768
未認識過去勤務費用	331
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588
退職給付引当金	2,938
前払年金費用	2,350
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

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

セグメント情報等

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

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

中間財務諸表

中間貸借対照表

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

		2019年9月30日現在
区分	注記 番号	金額(百万円)
(負債の部)		
流動負債		
未払金		11,888
未払収益分配金		0
未払償還金		25
未払手数料		7,472
関係会社未払金		3,649
その他未払金	2	739
未払費用		9,291
未払法人税等		1,661
賞与引当金		2,294
その他		181
流動負債計		25,317
固定負債		
退職給付引当金		3,267
時効後支払損引当金		565
固定負債計		3,832
負債合計		29,150
(純資産の部)		
株主資本		
資本金		17,180
資本剰余金		13,729
資本準備金		11,729
その他資本剰余金		2,000
利益剰余金		45,212
利益準備金		685
その他利益剰余金		44,527
別途積立金		24,606
繰越利益剰余金		19,920
評価・換算差額等		6
その他有価証券評価差額金		6
純資産合計		76,128

負債・純資産合計		105,278
----------	--	---------

中間損益計算書

区分	注記 番号	自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日 金額(百万円)
営業収益		
委託者報酬		58,947
運用受託報酬		8,401
その他営業収益		158
営業収益計		67,507
営業費用		
支払手数料		20,298
調査費		13,552
その他営業費用		3,856
営業費用計		37,706
一般管理費	1	14,394
営業利益		15,406
営業外収益	2	5,561
営業外費用	3	27
経常利益		20,940
特別利益	4	44
特別損失	5	410
税引前中間純利益		20,574
法人税、住民税及び事業税		5,116
法人税等調整額		610
中間純利益		14,847

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

(単位:百万円)

	株主資本				株 主
	資本剰余金		利益剰余金		
			その他利益剰余金		

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

(単位：百万円)

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	33	33	86,958
当中間期変動額			
剰余金の配当			25,650
中間純利益			14,847
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	27	27	27
当中間期変動額合計	27	27	10,830
当中間期末残高	6	6	76,128

[重要な会計方針]

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

<p>4 引当金の計上基準</p>	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率等により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払に備えるため、支払見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、退職一時金及び確定給付型企業年金について、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。</p> <p>退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。</p> <p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法 確定給付型企業年金に係る数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。また、退職一時金に係る数理計算上の差異は、発生した事業年度の翌期に一括して費用処理することとしております。</p> <p>退職一時金及び確定給付型企業年金に係る過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数による定額法により、発生した事業年度から費用処理することとしております。</p> <p>(4) 時効後支払損引当金 時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。</p> <p>(5) 投資損失引当金 子会社等に対する投資に係る損失に備えるため、当該会社の財政状態等を勘案して必要額を計上しております。</p>
<p>5 消費税等の会計処理</p>	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜き方式によっております。</p>
<p>6 連結納税制度の適用</p>	<p>連結納税制度を適用しております。</p>

[注記事項]

中間貸借対照表関係

2019年9月30日現在	
1 有形固定資産の減価償却累計額	3,881百万円
2 消費税等の取扱い 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他未払金」に含めて表示しております。	

中間損益計算書関係

自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日	
1 減価償却実施額 有形固定資産 無形固定資産	38百万円 1,145百万円

2	営業外収益のうち主要なもの		
	受取配当金	4,936百万円	
	金銭信託運用益	433百万円	
3	営業外費用のうち主要なもの		
	時効後支払損引当金繰入	10百万円	
	為替差損	6百万円	
4	特別利益の内訳		
	投資有価証券等売却益	1百万円	
	株式報酬受入益	43百万円	
5	特別損失の内訳		
	投資有価証券等評価損	119百万円	
	投資損失引当金繰入額	291百万円	

中間株主資本等変動計算書関係

自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日				
1	発行済株式に関する事項			
	株式の種類	当事業年度期首	増加	減少
	普通株式	5,150,693株	-	-
				当中間会計期間末 5,150,693株
2	配当に関する事項			
	配当金支払額			
	2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。			
	・普通株式の配当に関する事項			
	(1) 配当金の総額		25,650百万円	
	(2) 1株当たり配当額		4,980円	
	(3) 基準日		2019年3月31日	
	(4) 効力発生日		2019年6月28日	

金融商品関係

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
(1)現金・預金	2,212	2,212	-
(2)金銭の信託	42,268	42,268	-
(3)未収委託者報酬	25,161	25,161	-
(4)未収運用受託報酬	4,788	4,788	-
(5)有価証券及び投資有価証券			
その他有価証券	5,800	5,800	-
資産計	80,231	80,231	-
(6)未払金	11,888	11,888	-

未払収益分配金	0	0	-
未払償還金	25	25	-
未払手数料	7,472	7,472	-
関係会社未払金	3,649	3,649	-
その他未払金	739	739	-
(7)未払費用	9,291	9,291	-
(8)未払法人税等	1,661	1,661	-
負債計	22,841	22,841	-

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3) 未収委託者報酬、(4) 未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

有価証券関係

当中間会計期間末（2019年9月30日）

1．満期保有目的の債券(2019年9月30日)

該当事項はありません。

2．子会社株式及び関連会社株式(2019年9月30日)

該当事項はありません。

3．その他有価証券(2019年9月30日)

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

セグメント情報等

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1．セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2．関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

1 株当たり情報

自 2019年4月 1日 至 2019年9月30日

1株当たり純資産額	14,780円24銭
-----------	------------

1株当たり中間純利益	2,882円67銭
------------	-----------

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益につきましては、新株予約権付社債等潜在株式がないため、記載しておりません。

2. 1株当たり中間純利益の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

中間純利益	14,847百万円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益	14,847百万円
期中平均株式数	5,150千株

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12月末現在

(2) 販売会社

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

* 2019年12月末現在

2【関係業務の概要】

(1) 受託者

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

(2) 販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1) 受託者

該当事項はありません。

(2) 販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 3月15日	有価証券届出書
2019年 3月15日	有価証券報告書
2019年 9月20日	有価証券届出書の訂正届出書
2019年 9月20日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 亀井 純子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 櫻井 雄一郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津村 健二郎

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年2月21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ターゲットデートファンド2016-2026-2028年目標型の2018年12月27日から2019年12月26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、野村ターゲットデートファンド2016-2026-2028年目標型の2019年12月26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。

独立監査人の監査報告書

2020年2月21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ターゲットデートファンド2016-2029-2031年目標型の2018年12月27日から2019年12月26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、野村ターゲットデートファンド2016-2029-2031年目標型の2019年12月26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。

独立監査人の監査報告書

2020年2月21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ターゲットデートファンド2016-2032-2034年目標型の2018年12月27日から2019年12月26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、野村ターゲットデートファンド2016-2032-2034年目標型の2019年12月26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。

独立監査人の監査報告書

2020年2月21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ターゲットデートファンド2016-2035-2037年目標型の2018年12月27日から2019年12月26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、野村ターゲットデートファンド2016-2035-2037年目標型の2019年12月26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。

独立監査人の中間監査報告書

2019年11月28日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 亀井純子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 櫻井雄一郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津村健二郎

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている野村アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第61期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以 上

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