

【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】	2018年11月29日提出
【計算期間】	第6期(自 2017年9月7日至 2018年9月6日)
【ファンド名】	野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型
【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】	C E O兼執行役社長 渡邊 国夫
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【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】

外国の株式を実質的な主要投資対象¹とし、MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）²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。

- 1 ファンドは、「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。
- 2 MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）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、ヘッジコストを考慮して円換算した時価総額株価指数です。

信託金の限度額

受益権の信託金限度額は1兆円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該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。

（野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型）

《商品分類表》

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
追加型	海外	債券	
		不動産投信	
		その他資産 ()	特殊型
	内外	資産複合	

《属性区分表》

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

株式 一般 大型株 中小型株	年1回	グローバル (日本を除く)			
	年2回				
	年4回	日本			日経225
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年6回 (隔月)	北米	ファミリーファンド	あり (フルヘッジ)	
	年12回 (毎月)	欧州			TOPIX
	日々	アジア			
不動産投信	日々	オセアニア			
その他資産 (投資信託証券 (株式一般))	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	なし	その他 (MSCI- KOKUSAI指数 (円ベース・為替 ヘッジあり))
	その他 ()	アフリカ			
資産複合 ()		中近東 (中東)			
資産配分固定型 資産配分変更型		エマージング			

当ファンドは、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（株式）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のないファンドをいう。
- (2)追加型投信...一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいう。

[投資対象地域による区分]

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

[投資対象資産による区分]

- (1)株式...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (2)債券...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)不動産投信(リート)...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券及び不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいう。

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

[独立した区分]

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

[補足分類]

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

< 属性区分表定義 >

[投資対象資産による属性区分]

株式

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

債券

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

不動産投信...これ以上の詳細な分類は行わないものとする。

その他資産...組入れている資産を記載するものとする。

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

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

[決算頻度による属性区分]

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

[投資対象地域による属性区分(重複使用可能)]

- (1)グローバル...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。なお、「世界の資産」の中に「日本」を含むか含まないかを明確に記載するものとする。
- (2)日本...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいう。
- (3)北米...目論見書又は投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があ

るものをいう。

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

〔投資形態による属性区分〕

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

〔為替ヘッジによる属性区分〕

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

〔インデックスファンドにおける対象インデックスによる属性区分〕

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

〔特殊型〕

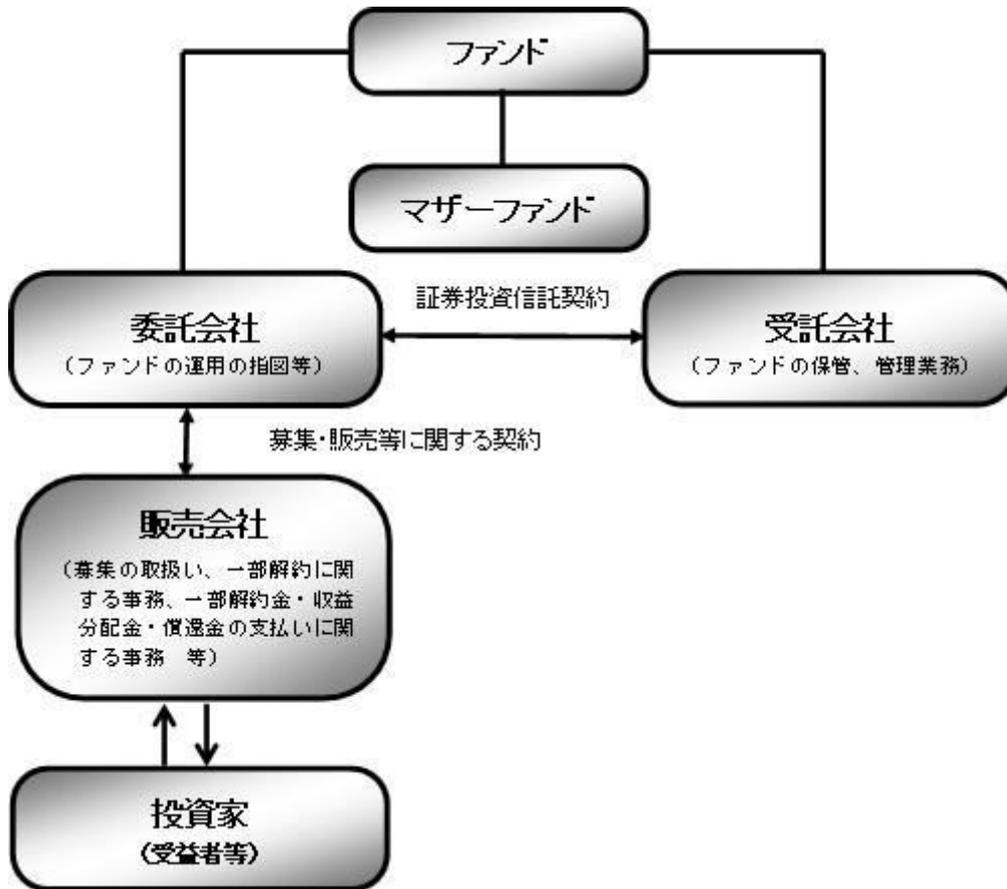
- (1) ブル・ベア型...目論見書又は投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいう。
- (2) 条件付運用型...目論見書又は投資信託約款において、仕組債への投資又はその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいう。
- (3) ロング・ショート型/絶対収益追求型...目論見書又は投資信託約款において、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

(2) 【ファンドの沿革】

2013年5月7日

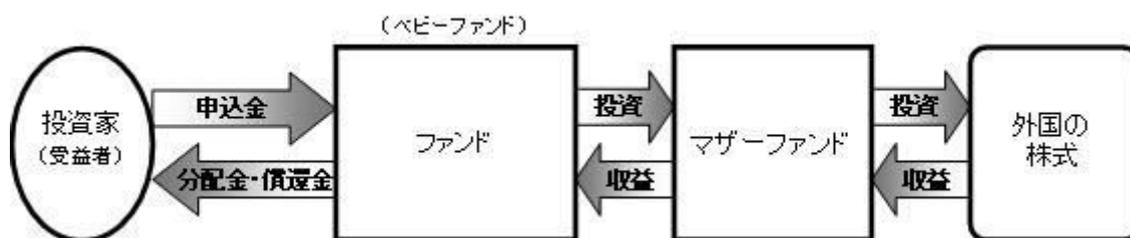
信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】



《ファミリーファンド方式について》

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



ファンド	野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型
マザーファンド (親投資信託)	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社(受託者)	野村信託銀行株式会社

委託会社の概況(2018年10月末現在)

・名称

野村アセットマネジメント株式会社

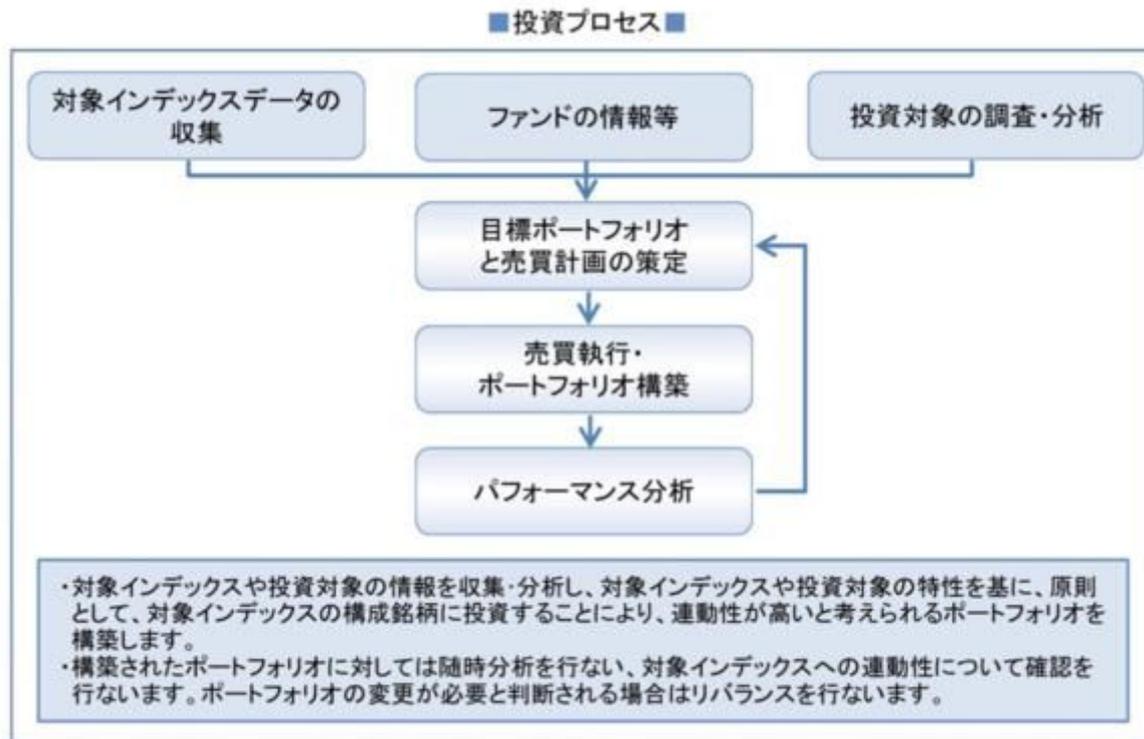
- ・本店の所在の場所
東京都中央区日本橋一丁目12番1号
- ・資本金の額
17,180百万円
- ・会社の沿革
 - 1959年12月1日 野村証券投資信託委託株式会社として設立
 - 1997年10月1日 投資顧問会社である野村投資顧問株式会社と合併して野村アセット・マネジメント投信株式会社に商号を変更
 - 2000年11月1日 野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更
 - 2003年6月27日 委員会等設置会社へ移行
- ・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

外国の株式を実質的な主要投資対象とし、MSCI-KOKUSA1指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。



*上記の投資プロセスは、今後変更となる場合があります。

指数の著作権等について

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

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

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

MSCI-KOKUSAI指数（円ベース・為替ヘッジあり）の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、株価指数先物取引等のデリバティブ取引および為替予約取引を実質的に投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的または為替相場等の変動リスクを減じる目的で、ヘッジ目的外の利用も含め実質的に活用する場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

外国の株式を実質的な主要投資対象とします。

ファンドは、親投資信託である「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資する場合があります。

投資の対象とする資産の種類(信託約款)

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

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 および 」に定めるものに限ります。）に係る権利
 - ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）
- ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

有価証券の指図範囲等(信託約款)

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

1. 株券または新株引受権証券
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）
6. 特定目的会社に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
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. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
13. 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。）
14. 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。）

- 15．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。）
- 16．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。）
- 17．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。）
- 18．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。）
- 19．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 20．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17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
- 21．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17号および第18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17号および第18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13号および第14号の証券ならびに第17号の証券または証書のうち第13号および第14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「(2)投資対象 有価証券の指図範囲等」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

その他の投資対象

- 1．先物取引等
- 2．スワップ取引

(参考)マザーファンドの概要

（外国株式為替ヘッジ型マザーファンド）

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

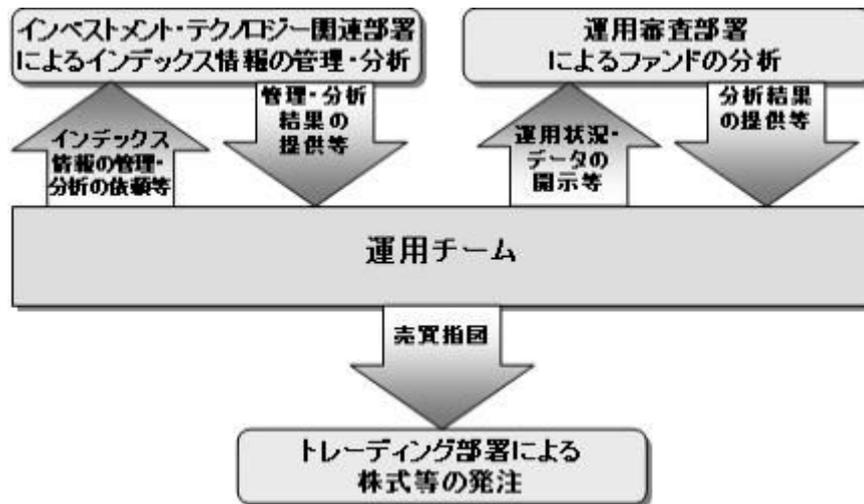
転換社債型新株予約権付社債とは、新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含みます。）をいいます。

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

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

(3) 【運用体制】

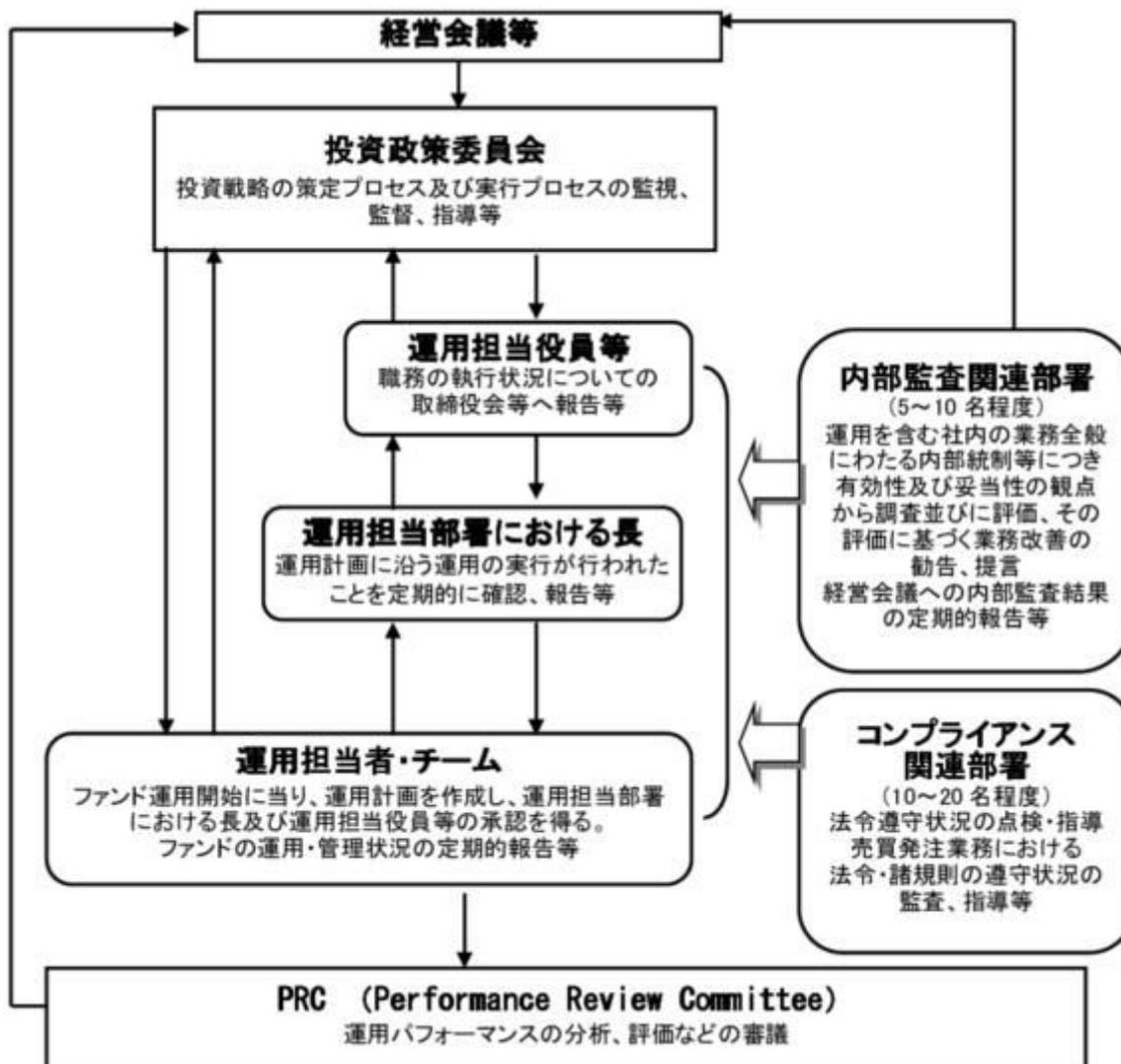
ファンドの運用体制は以下の通りです。



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配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

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

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

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

ファンドの決算日

原則として毎年9月6日（休業日の場合は翌営業日）を決算日とします。

（５）【投資制限】

運用の基本方針 2.運用方法 (3)投資制限(信託約款)

- ・ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ・ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 外国為替予約取引の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 投資信託証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ・ 同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。

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

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

信用取引の指図範囲(信託約款)

- ()委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻しにより行なうことの指図をすることができるものとします。
- ()上記()の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売り出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(信託約款)

- ()委託者は、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができます。なお、選択権取引はオプション取引に含めるものとします(以下同じ。)
- ()委託者は、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行なうことの指図をすることができます。
- ()委託者は、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行なうことの指図をすることができ

ます。

スワップ取引の運用指図（信託約款）

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

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。

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。

[為替変動リスク]

ファンドは、実質組入外貨建資産について、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本としますが、為替変動リスクを完全に排除できるわけではありません。また、円金利がヘッジ対象通貨の金利より低い場合、その金利差相当分のヘッジコストがかかるため、基準価額の変動要因となります。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

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

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

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

ファンドの基準価額と対象インデックスは、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対象インデックスとの連動または上回ることを保証するものではありません。

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

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

投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況によっては、分配金額の一

部または全部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。

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

委託会社におけるリスクマネジメント体制

リスク管理関連の委員会

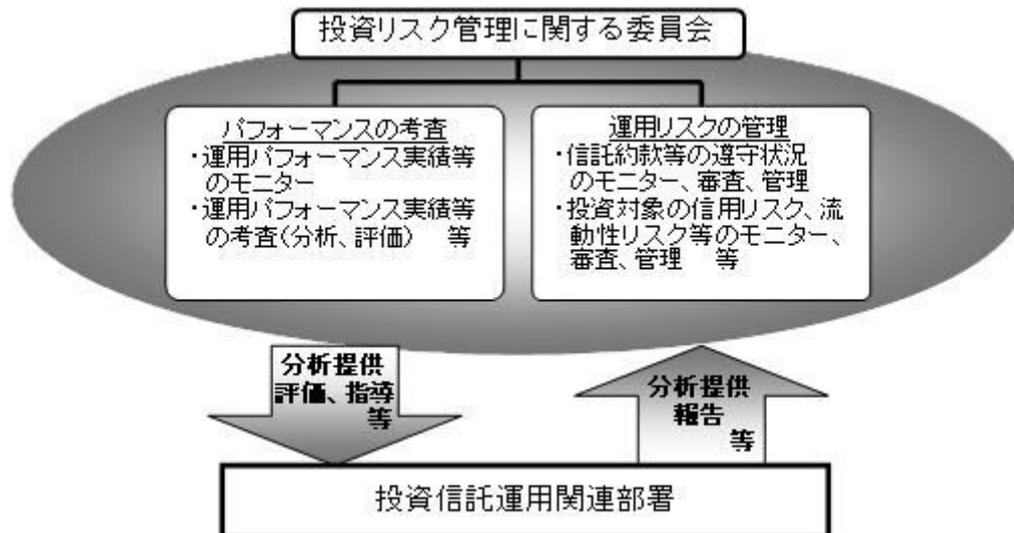
パフォーマンスの考査

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

運用リスクの管理

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

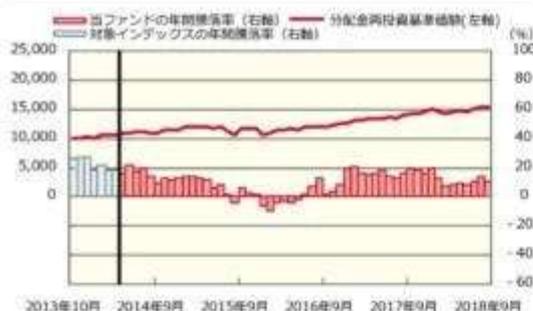
リスク管理体制図



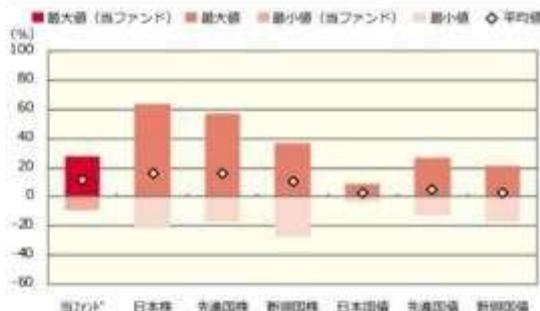
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

■ リスクの定量的比較 (2013年10月末～2018年9月末：月次)

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	27.6	64.2	57.1	37.2	9.3	26.6	20.8
最小値 (%)	△9.3	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値 (%)	11.2	15.7	16.3	10.5	2.1	5.3	2.7

- 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2013年10月末を10,000として指数化しております。
- 年間騰落率は、2013年10月から2018年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。なお、2014年4月までは、対象インデックスの騰落率を表示しております。

- 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。
- 2013年10月から2018年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。なお、当ファンドの設定日以前の年間騰落率につきましては、当ファンドの対象インデックスを用いて算出しております。
- 決算日に対応した数値とは異なります。
- 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

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

<代表的な資産クラスの指数>

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

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)・・・東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) は、株式会社東京証券取引所 (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、責任を有しません。
- MSCI-KOKUSA1 指数 (配当込み、円ベース)、MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)・・・MSCI-KOKUSA1 指数 (配当込み、円ベース)、MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし、円ベース)・・・FTSE 世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし、円ベース) は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)」(ここでは「指数」とよびます) についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンパレーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価格や価格を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社 (以下、JPM) がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを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ており、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または債主になっている可能性もあります。
- 米国の J.P. Morgan Securities LLC (ここでは「JPM SLLC」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) についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に関連させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると思わ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。
- JPM SLLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JPMorgan は JP Morgan Chase Bank, NA、JPMI、J.P. Morgan Securities PLC.、またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

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

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

取得申込日の翌営業日の基準価額に、1.08%(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1.0%)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、信託財産の純資産総額に年0.594%(税抜年0.55%)の率を乗じて得た額とし、その配分については次の通り(税抜)とします。

< 委託会社 >	< 販売会社 >	< 受託会社 >
年0.26%	年0.26%	年0.03%

ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

支払先の役務の内容

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

(4) 【その他の手数料等】

ファンドにおいて一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行なった場合、当該借入金の利息は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る有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、売買委託手数料に係る消費税等に相当する金額、先物取引・オプション取引等に要する費用、外貨建資産の保管等に要する費用はファンドから支払われます。

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

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

（５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

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。

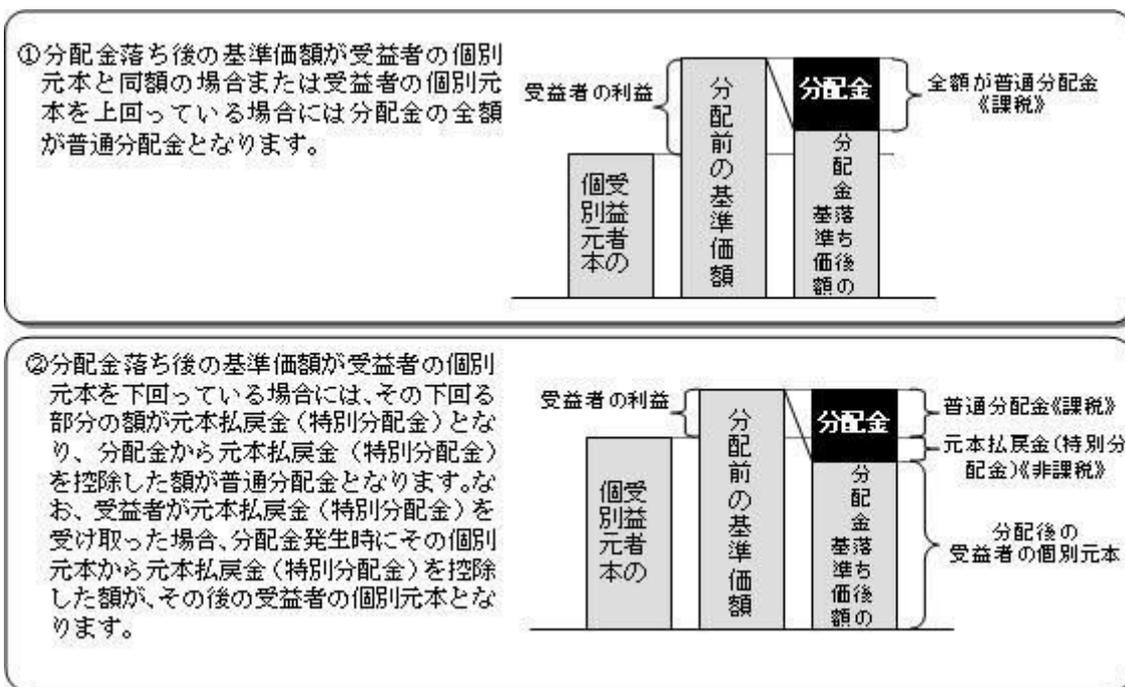
個別元本について

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。

税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2018年9月末現在）が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2018年9月28日現在の運用状況であります。

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

（１）【投資状況】

野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	3,516,808,732	99.99
現金・預金・その他資産（負債控除後）		350,348	0.00
合計（純資産総額）		3,517,159,080	100.00

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

資産の種類	国／地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	31,379,269,741	65.49
	カナダ	1,731,722,615	3.61
	ドイツ	1,711,701,188	3.57
	イタリア	426,927,782	0.89
	フランス	1,935,038,673	4.03
	オランダ	577,940,638	1.20
	スペイン	539,704,788	1.12
	ベルギー	185,199,429	0.38
	オーストリア	42,732,358	0.08
	ルクセンブルグ	10,935,774	0.02
	フィンランド	193,018,484	0.40
	アイルランド	93,328,170	0.19
	ポルトガル	29,378,950	0.06
	イギリス	3,130,621,893	6.53
	スイス	1,482,207,644	3.09
	スウェーデン	496,183,357	1.03
	ノルウェー	138,641,222	0.28
	デンマーク	303,026,370	0.63
	オーストラリア	1,115,881,509	2.32
	ニュージーランド	37,893,323	0.07
香港	558,098,828	1.16	
シンガポール	206,090,525	0.43	
イスラエル	52,722,429	0.11	
小計		46,378,265,690	96.79
投資証券	アメリカ	846,324,486	1.76
	カナダ	8,178,917	0.01
	フランス	60,265,420	0.12

	イギリス	32,817,133	0.06
	オーストラリア	86,062,574	0.17
	香港	27,881,617	0.05
	シンガポール	20,235,025	0.04
	小計	1,081,765,172	2.25
現金・預金・その他資産(負債控除後)		454,469,519	0.94
合計(純資産総額)		47,914,500,381	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	1,392,822,480	2.90
	買建	カナダ	67,056,696	0.13
	買建	ドイツ	249,718,169	0.52
	買建	イギリス	133,926,529	0.27
	買建	スイス	63,435,199	0.13
	買建	オーストラリア	37,866,832	0.07

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	日本	親投資信託 受益証券	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1,829,384,484	1.8980	3,472,171,751	1.9224	3,516,808,732	99.99

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	99.99
合計	99.99

(参考)外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	53,860	21,414.71	1,153,396,364	25,547.57	1,375,992,201	2.87

2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	80,030	11,079.51	886,693,232	12,993.54	1,039,873,302	2.17
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	4,522	184,597.10	834,748,115	228,614.13	1,033,793,135	2.15
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インターネットソフトウェア・サービス	26,360	20,729.96	546,441,941	19,175.15	505,457,186	1.05
5	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	37,040	12,883.38	477,200,425	13,006.03	481,743,588	1.00
6	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インターネットソフトウェア・サービス	3,453	123,844.26	427,634,234	135,675.26	468,486,689	0.97
7	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	29,490	14,089.14	415,489,020	15,697.64	462,923,563	0.96
8	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	46,600	9,081.92	423,217,878	9,740.89	453,925,889	0.94
9	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インターネットソフトウェア・サービス	3,284	124,444.77	408,676,639	137,119.87	450,301,670	0.93
10	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	105,000	3,491.14	366,569,889	3,400.28	357,030,009	0.74
11	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融サービス	14,080	22,775.73	320,682,346	24,610.61	346,517,516	0.72
12	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術サービス	19,680	14,916.09	293,548,785	17,037.77	335,303,341	0.69
13	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	34,240	9,020.56	308,864,208	9,441.71	323,284,246	0.67
14	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	63,900	4,019.24	256,829,583	4,985.72	318,587,700	0.66
15	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	10,590	26,177.57	277,220,542	30,056.30	318,296,222	0.66
16	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気通信サービス	80,100	3,553.85	284,664,140	3,795.50	304,020,303	0.63
17	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	50,500	6,125.96	309,361,273	5,998.76	302,937,754	0.63
18	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売り	12,720	21,241.94	270,197,544	23,490.81	298,803,215	0.62
19	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	21,080	14,556.20	306,844,789	13,908.91	293,199,989	0.61
20	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	51,500	5,227.62	269,222,795	5,488.83	282,675,162	0.58
21	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気通信サービス	45,600	5,310.04	242,137,827	6,086.21	277,531,463	0.57
22	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・半導体製造装置	51,400	6,135.35	315,357,314	5,210.59	267,824,408	0.55
23	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	27,760	8,290.18	230,135,579	9,410.41	261,232,987	0.54
24	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術サービス	10,140	21,691.78	219,954,676	25,247.74	256,012,152	0.53
25	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	6,070	39,163.10	237,720,045	41,724.48	253,267,608	0.52
26	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	29,300	6,624.94	194,111,005	8,031.67	235,327,943	0.49
27	スイス	株式	NOVARTIS-REG	医薬品	23,760	9,042.00	214,838,049	9,806.64	233,005,852	0.48
28	アメリカ	株式	CITIGROUP	銀行	27,900	8,168.55	227,902,623	8,284.93	231,149,589	0.48
29	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	44,000	4,763.37	209,588,438	5,225.35	229,915,651	0.47
30	イギリス	株式	HSBC HOLDINGS PLC	銀行	217,400	1,067.40	232,054,188	1,012.97	220,220,678	0.45

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
----	-------	----	---------

株式	国外	不動産管理・開発	0.51
		エネルギー設備・サービス	0.47
		石油・ガス・消耗燃料	6.49
		化学	2.45
		建設資材	0.28
		容器・包装	0.27
		金属・鉱業	1.37
		紙製品・林産品	0.12
		航空宇宙・防衛	2.37
		建設関連製品	0.35
		建設・土木	0.33
		電気設備	0.74
		コングロマリット	1.45
		機械	1.59
		商社・流通業	0.34
		商業サービス・用品	0.41
		航空貨物・物流サービス	0.58
		旅客航空輸送業	0.11
		海運業	0.06
		陸運・鉄道	1.07
		運送インフラ	0.18
		自動車部品	0.37
		自動車	0.87
		家庭用耐久財	0.37
		レジャー用品	0.05
		繊維・アパレル・贅沢品	1.39
		ホテル・レストラン・レジャー	1.78
		メディア	1.97
		販売	0.06
		インターネット販売・通信販売	2.92
		複合小売り	0.41
		専門小売り	1.70
		食品・生活必需品小売り	1.49
		飲料	1.81
		食品	1.75
		タバコ	1.01
		家庭用品	1.14
		パーソナル用品	0.69
		ヘルスケア機器・用品	2.52
		ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	2.28
		バイオテクノロジー	2.14
医薬品	5.43		

	銀行	8.55
	各種金融サービス	0.98
	保険	3.75
	インターネットソフトウェア・サービス	3.39
	情報技術サービス	3.60
	ソフトウェア	5.01
	通信機器	0.95
	コンピュータ・周辺機器	3.19
	電子装置・機器・部品	0.47
	半導体・半導体製造装置	2.91
	各種電気通信サービス	2.01
	無線通信サービス	0.30
	電力	1.72
	ガス	0.15
	総合公益事業	0.92
	水道	0.07
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.01
	消費者金融	0.47
	資本市場	2.83
	各種消費者サービス	0.01
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.06
	ヘルスケア・テクノロジー	0.08
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.69
	専門サービス	0.66
投資証券		2.25
合 計		99.05

【投資不動産物件】

野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型

該当事項はありません。

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型

該当事項はありません。

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取 引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2018 年12月限)	買建	84	米ドル	12,213,890	1,387,131,490	12,264,000	1,392,822,480	2.90
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2018年12 月限)	買建	4	カナダ ドル	761,690	66,381,284	769,440	67,056,696	0.13
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指 数先物(2018年12 月限)	買建	55	ユーロ	1,850,320	244,501,284	1,889,800	249,718,169	0.52
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SPI200株価指 数先物(2018年12 月限)	買建	3	豪ドル	462,975	37,885,244	462,750	37,866,832	0.07
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指 数先物(2018年12 月限)	買建	12	英ポ ンド	877,550	130,342,501	901,680	133,926,529	0.27
	スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取 引所	SMI株価指 数先物 (2018年12月 限)	買建	6	スイス フラン	536,240	62,321,812	545,820	63,435,199	0.13

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型

2018年9月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2013年 9月 6日)	92	92	1.0254	1.0254
第2計算期間 (2014年 9月 8日)	477	477	1.2264	1.2264
第3計算期間 (2015年 9月 7日)	930	930	1.1874	1.1874
第4計算期間 (2016年 9月 6日)	1,538	1,538	1.3197	1.3197
第5計算期間 (2017年 9月 6日)	2,458	2,458	1.4773	1.4773
第6計算期間 (2018年 9月 6日)	3,482	3,482	1.6552	1.6552
2017年 9月末日	2,461		1.5094	
10月末日	2,553		1.5453	
11月末日	2,704		1.5635	
12月末日	2,850		1.5907	
2018年 1月末日	3,010		1.6442	
2月末日	2,974		1.6001	
3月末日	2,906		1.5458	
4月末日	3,038		1.5748	
5月末日	3,157		1.6020	
6月末日	3,163		1.5923	

7月末日	3,302		1.6399
8月末日	3,465		1.6737
9月末日	3,517		1.6758

【分配の推移】

野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型

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

【収益率の推移】

野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型

	計算期間	収益率
第1計算期間	2013年 5月 7日～2013年 9月 6日	2.5%
第2計算期間	2013年 9月 7日～2014年 9月 8日	19.6%
第3計算期間	2014年 9月 9日～2015年 9月 7日	3.2%
第4計算期間	2015年 9月 8日～2016年 9月 6日	11.1%
第5計算期間	2016年 9月 7日～2017年 9月 6日	11.9%
第6計算期間	2017年 9月 7日～2018年 9月 6日	12.0%

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

（４）【設定及び解約の実績】

野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型

	計算期間	設定口数	解約口数	発行済み口数
第1計算期間	2013年 5月 7日～2013年 9月 6日	135,241,452	44,950,752	90,290,700
第2計算期間	2013年 9月 7日～2014年 9月 8日	467,567,917	168,711,598	389,147,019
第3計算期間	2014年 9月 9日～2015年 9月 7日	618,415,635	224,142,231	783,420,423
第4計算期間	2015年 9月 8日～2016年 9月 6日	887,376,092	505,221,802	1,165,574,713
第5計算期間	2016年 9月 7日～2017年 9月 6日	1,305,642,818	807,104,428	1,664,113,103

第6計算期間	2017年 9月 7日 ~ 2018年 9月 6日	1,337,043,827	897,424,138	2,103,732,792
--------	---------------------------	---------------	-------------	---------------

本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報



運用実績（2018年9月28日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次；設定来）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2018年9月	0 円
2017年9月	0 円
2016年9月	0 円
2015年9月	0 円
2014年9月	0 円
設定来累計	0 円

■ 主要な資産の状況

実質的な銘柄別投資比率（上位）

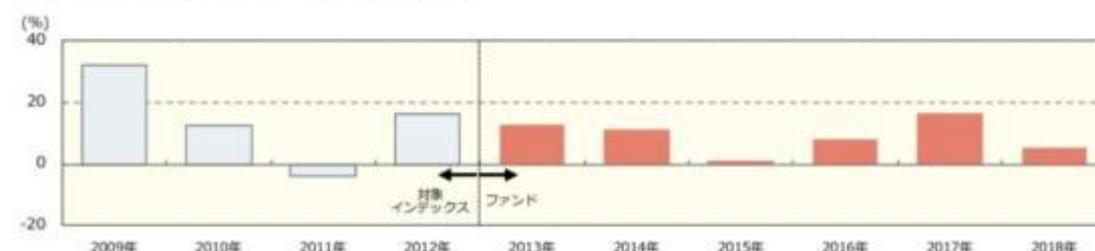
順位	銘柄	業種	投資比率（%）
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	2.9
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	2.2
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	2.1
4	FACEBOOK INC-A	インターネットソフトウェア・サービス	1.0
5	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	1.0
6	ALPHABET INC-CL C	インターネットソフトウェア・サービス	1.0
7	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	1.0
8	EXXON MOBIL CORP	石油・ガス・消耗燃料	0.9
9	ALPHABET INC-CL A	インターネットソフトウェア・サービス	0.9
10	BANK OF AMERICA CORP	銀行	0.7

実質的な国/地域別投資比率（上位）

順位	国/地域（通貨別）	投資比率（%）
1	アメリカ	67.2
2	イギリス	6.6
3	フランス	4.1
4	カナダ	3.6
5	ドイツ	3.6

※ユーロについては発行国で記載しております。

■ 年間収益率の推移（暦年ベース）



・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。 ・2013年は設定日（2013年5月7日）から年末までのファンドの収益率。
 ・2009年から2012年は対象インデックスの年間収益率。（出所：MSCI） ・2018年は年初から運用実績作成基準日までのファンドの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- ・ 申込期間中の各営業日に受益権の募集が行なわれます。
- ・ 取得申込の受付については、午後3時まで、取得申込みが行なわれかつ当該取得申込みにかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日のお申込み分とします。
- ・ 販売会社の営業日であっても、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。

○ 申込日当日が、ニューヨーク証券取引所の休場日と同日の場合
申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104（フリーダイヤル）

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 販売の単位は、1万口以上1万口単位(当初元本1口 = 1円)または1万円以上1円単位とします。
積立方式

販売会社によっては、「定時定額購入サービス」等に関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込の単位によるものとします。

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

- ・ 受益権の販売価額は、取得申込日の翌営業日の基準価額とします。
- ・ 販売会社の定める期日までに申込代金を申込みの販売会社に支払うものとします。
詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- ・ 金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、受益権の取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取り消す場合があります。

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

2【換金（解約）手続等】

- ・ 受益者は、委託者に1万口単位、1口単位または1円単位で一部解約の実行を請求することができます。
- ・ 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行なうものとします。
- ・ 一部解約の実行の請求の受付については、午後3時まで、解約請求のお申込みが行なわれかつ、その

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

- ・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の受付を行いません。(申込不可日については、「サポートダイヤル」でもご確認いただけます。)
- ・換金価額は、解約申込みの受付日の翌営業日の基準価額となります。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口解約には制限を設ける場合があります。
- ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。
- ・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、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付を取り消す場合があります。
- ・一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行なった当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、当該受益権の一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして信託約款の規定に準じて計算された価額とします。

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<基準価額の計算方法>

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

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日の金融商品取引所の最終相場で評価します。
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行ないます。

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。

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

(2)【保管】

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

(3)【信託期間】

無期限とします(2013年5月7日設定)。

(4)【計算期間】

原則として、毎年9月7日から翌年9月6日までとします。

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

(5)【その他】

(a)ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が30億口を下回った場合または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、もしくはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託者は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

(b)信託期間の終了

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

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

- ()上記()の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行ないます。
- ()上記()から()までの規定は、委託者が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記()から()までに規定するこの信託契約の解約の手続を行うことが困難な場合には適用しません。
- ()委託者は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。
- ()委託者が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託者は、この信託契約を解約し、信託を終了させます。ただし、監督官庁がこの信託契約に関する委託者の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、この信託は、下記「(d)信託約款の変更等()」の書面決議が否決となる場合を除き、当該投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(c)運用報告書

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

(d)信託約款の変更等

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

(e) 公告

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

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

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

(f) 受託者の辞任および解任に伴う取扱い

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

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

(g) 反対受益者の受益権買取請求の不適用

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

(h) 他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

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

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

(i) 関係法人との契約の更新に関する手続

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

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

4 【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

< 累積投資契約を結んでいない場合 >

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 >

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ます。)に、原則として償還日(償還日が休業日の場合は
翌営業日)から起算して5営業日までに支払いを開始します。

償還金請求権の失効

受益者は、償還金を支払開始日から10年間支払請求しないと権利を失います。

換金(解約)請求権

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

第3【ファンドの経理状況】

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

(2)当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第6期計算期間(2017年9月7日から2018年9月6日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

【野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第5期 (2017年 9月 6日現在)	第6期 (2018年 9月 6日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	8,215,101	16,016,307
親投資信託受益証券	2,458,201,339	3,481,806,689
未収入金	40,146	57,218
流動資産合計	2,466,456,586	3,497,880,214
資産合計	2,466,456,586	3,497,880,214
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,022,717	6,191,140
未払受託者報酬	378,964	517,135
未払委託者報酬	6,568,644	8,963,682
未払利息	13	24
その他未払費用	37,835	51,648
流動負債合計	8,008,173	15,723,629
負債合計	8,008,173	15,723,629
純資産の部		
元本等		
元本	1,664,113,103	2,103,732,792
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	794,335,310	1,378,423,793
(分配準備積立金)	229,149,263	385,392,251
元本等合計	2,458,448,413	3,482,156,585
純資産合計	2,458,448,413	3,482,156,585
負債純資産合計	2,466,456,586	3,497,880,214

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第5期		第6期	
	自 2016年 9月 7日 至 2017年 9月 6日		自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6日	
営業収益				
有価証券売買等損益		235,895,841		334,038,660
営業収益合計		235,895,841		334,038,660
営業費用				
支払利息		3,976		4,960
受託者報酬		658,685		951,428
委託者報酬		11,417,111		16,491,453
その他費用		65,744		95,019
営業費用合計		12,145,516		17,542,860
営業利益又は営業損失()		223,750,325		316,495,800
経常利益又は経常損失()		223,750,325		316,495,800
当期純利益又は当期純損失()		223,750,325		316,495,800
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()		51,563,746		70,289,960
期首剰余金又は期首欠損金()		372,577,822		794,335,310
剰余金増加額又は欠損金減少額		521,034,297		789,682,317
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		521,034,297		789,682,317
剰余金減少額又は欠損金増加額		271,463,388		451,799,674
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		271,463,388		451,799,674
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金()		794,335,310		1,378,423,793

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2017年9月7日から2018年9月6日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第5期 2017年9月6日現在	第6期 2018年9月6日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 1,664,113,103口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,103,732,792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 1.4773円 (10,000口当たり純資産額) (14,773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 1.6552円 (10,000口当たり純資産額) (16,552円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第5期 自 2016年9月7日 至 2017年9月6日	第6期 自 2017年9月7日 至 2018年9月6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>44,398,201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>127,788,378円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>565,186,047円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>56,962,684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>794,335,310円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>1,664,113,103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>4,773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	44,398,201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	127,788,378円	収益調整金額	C	565,186,047円	分配準備積立金額	D	56,962,684円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	794,335,310円	当ファンドの期末残存口数	F	1,664,113,103口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,773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>58,317,093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>187,888,747円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>993,031,542円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>139,186,411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>1,378,423,793円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,103,732,792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>6,552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	58,317,093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	187,888,747円	収益調整金額	C	993,031,542円	分配準備積立金額	D	139,186,411円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,378,423,793円	当ファンドの期末残存口数	F	2,103,732,792口	10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,552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	44,398,201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	127,788,378円																																																											
収益調整金額	C	565,186,047円																																																											
分配準備積立金額	D	56,962,684円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	794,335,310円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,664,113,103口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	4,773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	58,317,093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	187,888,747円																																																											
収益調整金額	C	993,031,542円																																																											
分配準備積立金額	D	139,186,411円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,378,423,793円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	2,103,732,792口																																																											
10,000口当たり収益分配対象額	G=E/F×10,000	6,552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5期 自 2016年 9月 7日 至 2017年 9月 6日</p>	<p style="text-align: center;">第6期 自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6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、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5期 2017年 9月 6日現在</p>	<p style="text-align: center;">第6期 2018年 9月 6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ぬ。</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5期 自 2016年 9月 7日 至 2017年 9月 6日	第6期 自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6日
市場価格その他当該取引に係る公正な価格を勘案して、一般 の取引条件と異なる関連当事者との取引は行なわれていない ため、該当事項はございません。	同左

（その他の注記）

1 元本の移動

第5期 自 2016年 9月 7日 至 2017年 9月 6日	第6期 自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6日
期首元本額 1,165,574,713円	期首元本額 1,664,113,103円
期中追加設定元本額 1,305,642,818円	期中追加設定元本額 1,337,043,827円
期中一部解約元本額 807,104,428円	期中一部解約元本額 897,424,138円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第5期 自 2016年 9月 7日 至 2017年 9月 6日	第6期 自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6日
	損益に含まれた評価差額（円）	損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	215,603,525	292,638,885
合計	215,603,525	292,638,885

3 デリバティブ取引関係

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年9月6日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2018年9月6日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	外国株式為替ヘッジ型マザーファンド	1,834,364,201	3,481,806,689	
	小計	銘柄数: 1 組入時価比率: 100.0%	1,834,364,201	3,481,806,689 100.0%	
合計				3,481,806,689	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(参考)

当ファンドは「外国株式為替ヘッジ型マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2018年 9月 6日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	53,807,924
コール・ローン	952,363,977
株式	44,182,775,883
投資証券	1,086,276,341
派生商品評価勘定	16,749,077
未収入金	246,320
未収配当金	81,071,945
差入委託証拠金	417,008,893
流動資産合計	46,790,300,360
資産合計	46,790,300,360

(2018年 9月 6日現在)

負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	139,857,747
未払金	20,393,444
未払解約金	103,336,903
未払利息	1,465
その他未払費用	580,700
流動負債合計	264,170,259
負債合計	264,170,259
純資産の部	
元本等	
元本	24,511,893,185
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	22,014,236,916
元本等合計	46,526,130,101
純資産合計	46,526,130,101
負債純資産合計	46,790,300,360

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2018年 9月 6日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1,8981円
(10,000口当たり純資産額)	(18,981円)

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

自 2017年 9月 7日 至 2018年 9月 6日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の為替変動リスクの低減、並びに信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2018年 9月 6日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	

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

ん。

2. 時価の算定方法

株式

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2018年 9月 6日現在	
期首	2017年 9月 7日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	23,280,567,282円
同期中における追加設定元本額	13,099,409,864円
同期中における一部解約元本額	11,868,083,961円
期末元本額	24,511,893,185円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型	1,834,364,201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	652,865,602円
野村外国株インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	521,250,221円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,295,256円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,229,021円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,250,107円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,040,848円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,081,996円
野村外国株インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	4,223,119,280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)	1,932,758,244円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジあり)連動型上場投信	94,750,143円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	61,360,789円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	10,531,121,100円
野村外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA(適格機関投資家専用)	1,873,109,010円
ノムラ外国株式インデックスファンド為替ヘッジ型VA(適格機関投資家専用)	1,419,118,693円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	1,353,178,674円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年9月6日現在)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	米ドル	BAKER HUGHES,A GE CO,LLC	5,200	31.67	164,684.00	
		HALLIBURTON CO	9,000	37.13	334,170.00	
		HELMERICH & PAYNE	1,000	64.53	64,530.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	4,200	46.26	194,292.00	
		SCHLUMBERGER LTD	14,800	61.02	903,096.00	
		TECHNIPFMC PLC	5,200	29.39	152,828.00	
		ANADARKO PETE	6,100	64.39	392,779.00	
		ANDEAVOR	1,710	155.47	265,853.70	
		ANTERO RESOURCES CORP	2,900	17.67	51,243.00	
		APACHE CORPORATION	4,400	43.92	193,248.00	
		CABOT OIL & GAS CORP	4,600	22.48	103,408.00	
		CHENIERE ENERGY INC	2,500	66.71	166,775.00	
		CHEVRON CORP	20,400	118.92	2,425,968.00	
		CIMAREX ENERGY CO	960	86.13	82,684.80	
		CONCHO RESOURCES INC	1,970	135.49	266,915.30	
		CONOCOPHILLIPS	12,700	73.00	927,100.00	
		CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	1,180	63.40	74,812.00	
		DEVON ENERGY CORP	6,000	41.71	250,260.00	
		DIAMONDBACK ENERGY INC	890	117.46	104,539.40	
		EOG RESOURCES INC	6,290	117.89	741,528.10	
		EQT CORP	2,500	48.77	121,925.00	
		EXXON MOBIL CORP	45,900	81.36	3,734,424.00	
		HESS CORP	2,900	65.41	189,689.00	
		HOLLYFRONTIER CORP	1,600	73.84	118,144.00	
		KINDER MORGAN INC	21,900	17.79	389,601.00	
		MARATHON OIL CORP	8,300	21.21	176,043.00	
		MARATHON PETROLEUM CORP	4,900	83.94	411,306.00	
		NEWFIELD EXPLORATION CO	1,900	27.62	52,478.00	
		NOBLE ENERGY INC	5,000	29.83	149,150.00	
		OCCIDENTAL PETE CORP	8,500	79.14	672,690.00	
ONEOK INC	4,600	66.08	303,968.00			
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	1,800	26.70	48,060.00			

PHILLIPS 66	4,860	117.99	573,431.40
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	1,860	169.22	314,749.20
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	2,000	25.49	50,980.00
TARGA RESOURCES CORP	1,900	54.67	103,873.00
VALERO ENERGY CORP	4,550	116.91	531,940.50
WILLIAMS COS	12,800	29.47	377,216.00
AIR PRODUCTS	2,440	165.39	403,551.60
ALBEMARLE CORP	1,080	96.45	104,166.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	2,900	30.00	87,000.00
CELANESE CORP-SERIES A	1,480	114.98	170,170.40
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	2,400	51.24	122,976.00
CHEMOURS CO/THE	1,700	44.61	75,837.00
DOWDUPONT INC	25,400	70.05	1,779,270.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	1,490	97.80	145,722.00
ECOLAB INC	2,630	152.47	400,996.10
FMC CORP	1,200	83.48	100,176.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	950	127.72	121,334.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	3,480	111.67	388,611.60
MOSAIC CO/THE	3,660	30.51	111,666.60
PPG INDUSTRIES	2,870	110.60	317,422.00
PRAXAIR INC	3,130	156.14	488,718.20
SHERWIN-WILLIAMS	960	461.66	443,193.60
WESTLAKE CHEMICAL CORP	280	93.13	26,076.40
MARTIN MARIETTA MATERIALS	620	199.60	123,752.00
VULCAN MATERIALS CO	1,520	110.00	167,200.00
AVERY DENNISON CORP	810	105.28	85,276.80
BALL CORP	3,220	41.95	135,079.00
CROWN HOLDINGS INC	1,800	42.56	76,608.00
IP (INTERNATIONAL PAPER CO)	4,400	51.43	226,292.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	1,050	111.75	117,337.50
SEALED AIR CORP	1,500	40.46	60,690.00
WESTROCK CO	2,900	55.18	160,022.00
FREEMONT-MCMORAN INC	14,500	13.67	198,215.00
NEWMONT MINING CORP HOLDINGS CO	5,300	30.13	159,689.00
NUCOR CORP	3,300	63.63	209,979.00

STEEL DYNAMICS	2,100	46.80	98,280.00
ARCONIC INC	4,400	22.16	97,504.00
BOEING CO	6,070	346.68	2,104,347.60
GENERAL DYNAMICS	2,700	193.98	523,746.00
HARRIS CORP	1,300	162.68	211,484.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	540	244.57	132,067.80
L3 TECHNOLOGIES INC	860	211.00	181,460.00
LOCKHEED MARTIN	2,790	321.33	896,510.70
NORTHROP GRUMMAN CORP	1,800	296.75	534,150.00
RAYTHEON COMPANY	3,130	198.03	619,833.90
ROCKWELL COLLINS INC	1,820	136.96	249,267.20
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	1,120	85.46	95,715.20
TEXTRON INC	2,800	69.83	195,524.00
TRANSDIGM GROUP INC	490	351.71	172,337.90
UNITED TECHNOLOGIES	8,200	132.78	1,088,796.00
ALLEGION PLC	810	89.20	72,252.00
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	1,740	53.87	93,733.80
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	9,500	38.27	363,565.00
LENNOX INTERNATIONAL INC	320	225.97	72,310.40
MASCO CORP	3,300	38.12	125,796.00
OWENS CORNING INC	1,050	56.97	59,818.50
SMITH (A.O.) CORP	1,400	57.86	81,004.00
FLUOR CORP	1,400	56.92	79,688.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	1,270	72.68	92,303.60
ACUITY BRANDS INC	440	151.93	66,849.20
AMETEK INC	2,630	78.00	205,140.00
EATON CORP PLC	4,610	84.56	389,821.60
EMERSON ELEC	6,900	77.27	533,163.00
ROCKWELL AUTOMATION INC	1,300	181.96	236,548.00
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	1,600	52.43	83,888.00
3M CORP	6,510	211.83	1,379,013.30
GENERAL ELEC CO	94,900	12.56	1,191,944.00
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	8,100	161.79	1,310,499.00
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	2,500	61.09	152,725.00

JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	2,100	35.41	74,361.00
ROPER TECHNOLOGIES INC	1,050	301.77	316,858.50
AGCO CORP	770	61.22	47,139.40
CATERPILLAR INC DEL	6,480	140.59	911,023.20
CUMMINS INC	1,760	142.44	250,694.40
DEERE & COMPANY	3,390	144.88	491,143.20
DOVER CORP	1,700	86.90	147,730.00
FLOWSERVE CORP	1,480	52.71	78,010.80
FORTIVE CORP	3,470	84.34	292,659.80
IDEX CORP	950	152.69	145,055.50
ILLINOIS TOOL WORKS INC	3,290	141.36	465,074.40
INGERSOLL-RAND PLC	2,830	103.03	291,574.90
MIDDLEBY CORP	660	125.49	82,823.40
PACCAR	3,890	69.91	271,949.90
PARKER HANNIFIN CORP	1,370	176.56	241,887.20
PENTAIR PLC	2,100	43.47	91,287.00
SNAP-ON INC	550	181.01	99,555.50
STANLEY BLACK & DECKER INC	1,570	142.35	223,489.50
WABCO HOLDINGS INC	620	124.00	76,880.00
WABTEC CORP	860	112.57	96,810.20
XYLEM INC	2,150	77.71	167,076.50
AERCAP HOLDINGS NV	1,400	56.64	79,296.00
FASTENAL CO	2,900	59.09	171,361.00
GRAINGER(W.W.) INC	570	355.62	202,703.40
HD SUPPLY HOLDINGS INC	1,700	44.18	75,106.00
UNITED RENTALS INC	800	156.62	125,296.00
CINTAS CORP	900	214.63	193,167.00
COPART INC	2,600	64.68	168,168.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	2,400	73.98	177,552.00
ROLLINS INC	1,000	60.42	60,420.00
STERICYCLE INC	870	61.87	53,826.90
WASTE CONNECTIONS INC	3,000	80.11	240,330.00
WASTE MANAGEMENT INC	4,820	91.54	441,222.80
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	1,580	96.57	152,580.60
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH	1,600	74.99	119,984.00

INC			
FEDEX CORPORATION	2,700	244.76	660,852.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	7,460	124.66	929,963.60
XPO LOGISTICS INC	1,490	106.49	158,670.10
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	1,100	39.67	43,637.00
DELTA AIR LINES INC	1,700	57.21	97,257.00
SOUTHWEST AIRLINES	1,500	61.40	92,100.00
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS INC	860	88.19	75,843.40
AMERCO	80	365.82	29,265.60
CSX CORP	9,300	74.30	690,990.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	880	123.07	108,301.60
KANSAS CITY SOUTHERN	1,260	117.12	147,571.20
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	1,300	35.25	45,825.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	3,170	174.98	554,686.60
OLD DOMINION FREIGHT LINE	580	158.78	92,092.40
UNION PAC CORP	8,590	154.17	1,324,320.30
APTIV PLC	2,950	85.26	251,517.00
AUTOLIV INC	980	86.55	84,819.00
BORGWARNER INC	2,600	44.28	115,128.00
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	2,800	23.42	65,576.00
LEAR CORP	810	159.90	129,519.00
FORD MOTOR COMPANY	40,700	9.49	386,243.00
GENERAL MOTORS CO	13,400	35.29	472,886.00
HARLEY-DAVIDSON INC	1,800	44.07	79,326.00
TESLA INC	1,370	280.74	384,613.80
DR HORTON INC	4,300	45.11	193,973.00
GARMIN LTD	900	68.72	61,848.00
LEGGETT & PLATT INC	1,400	46.08	64,512.00
LENNAR CORP-A	3,000	52.52	157,560.00
MOHAWK INDUSTRIES	660	191.00	126,060.00
NEWELL BRANDS INC	5,900	21.87	129,033.00
NVR INC	44	2,655.87	116,858.28
PULTEGROUP INC	2,800	28.52	79,856.00
TOLL BROTHERS INC	1,400	37.40	52,360.00
WHIRLPOOL CORP	700	126.80	88,760.00

HASBRO INC	1,110	100.09	111,099.90
MATTEL INC	3,400	15.30	52,020.00
POLARIS INDUSTRIES INC	640	112.48	71,987.20
HANESBRANDS INC	3,400	17.85	60,690.00
LULULEMON ATHLETICA INC	1,000	152.74	152,740.00
MICHAEL KORS HOLDINGS LTD	1,900	73.24	139,156.00
NIKE INC-B	14,000	79.92	1,118,880.00
PVH CORP	930	136.94	127,354.20
RALPH LAUREN CORPORATION	640	131.18	83,955.20
TAPESTRY INC	3,300	50.43	166,419.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	2,100	20.45	42,945.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	2,114	19.19	40,567.66
V F CORP	3,720	91.09	338,854.80
ARAMARK	3,000	40.92	122,760.00
CARNIVAL CORP	4,800	60.95	292,560.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	270	477.88	129,027.60
DARDEN RESTAURANTS INC	1,390	118.87	165,229.30
DOMINOS PIZZA INC	470	289.81	136,210.70
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	2,800	75.72	212,016.00
LAS VEGAS SANDS CORP	4,330	63.11	273,266.30
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	3,250	125.01	406,282.50
MCDONALD'S CORP	8,680	163.24	1,416,923.20
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	3,000	23.05	69,150.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	6,500	27.66	179,790.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	2,600	52.98	137,748.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	1,940	120.84	234,429.60
STARBUCKS CORP	15,300	53.79	822,987.00
VAIL RESORTS INC	500	289.73	144,865.00
WYNN RESORTS LTD	890	140.37	124,929.30
YUM BRANDS INC	3,740	86.73	324,370.20
CBS CORP-CL B	3,700	52.95	195,915.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	1,800	306.81	552,258.00
COMCAST CORP-CL A	50,500	36.28	1,832,140.00
DISCOVERY INC - A	2,030	27.46	55,743.80
DISCOVERY INC - C	2,751	25.44	69,985.44

DISH NETWORK CORP-A	2,400	34.55	82,920.00
DISNEY (WALT) CO	16,360	109.87	1,797,473.20
INTERPUBLIC GROUP	3,600	22.63	81,468.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	1,340	80.76	108,218.40
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	5,300	25.35	134,355.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	2,300	26.25	60,375.00
LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	1,900	37.00	70,300.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	2,030	46.28	93,948.40
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	1,160	46.02	53,383.20
LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	1,400	49.41	69,174.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	4,300	12.88	55,384.00
OMNICOM GROUP	2,620	68.70	179,994.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	17,000	7.00	119,000.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC	11,500	45.24	520,260.00
TWENTY-FIRST CENTURY FOX INC CLASS B	4,700	44.72	210,184.00
VIACOM INC-CLASS B	3,600	29.44	105,984.00
GENUINE PARTS CO	1,560	101.11	157,731.60
LKQ CORP	2,800	34.01	95,228.00
AMAZON.COM INC	4,439	1,994.82	8,855,005.98
BOOKING HOLDINGS INC	515	1,892.18	974,472.70
EXPEDIA GROUP INC	1,170	123.85	144,904.50
NETFLIX INC	4,730	341.18	1,613,781.40
QURATE RETAIL INC - A	5,100	20.73	105,723.00
TRIPADVISOR INC	1,300	51.20	66,560.00
DOLLAR GENERAL CORP	2,830	111.06	314,299.80
DOLLAR TREE INC	2,440	82.64	201,641.60
KOHL'S CORP	1,500	81.08	121,620.00
MACYS INC	3,700	35.80	132,460.00
NORDSTROM INC	1,600	64.83	103,728.00
TARGET CORP	5,400	88.60	478,440.00
ADVANCE AUTO PARTS	760	167.00	126,920.00
AUTOZONE	320	772.43	247,177.60
BEST BUY COMPANY INC	2,700	79.07	213,489.00
CARMAX INC	1,700	78.86	134,062.00
GAP INC	2,400	30.26	72,624.00

HOME DEPOT	12,480	204.15	2,547,792.00
L BRANDS, INC	2,600	26.48	68,848.00
LOWES COS INC	8,760	108.41	949,671.60
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	880	340.86	299,956.80
ROSS STORES INC	3,880	97.46	378,144.80
TIFFANY & CO	1,020	120.72	123,134.40
TJX COS INC	6,900	111.13	766,797.00
TRACTOR SUPPLY COMPANY	1,600	90.19	144,304.00
ULTA BEAUTY INC	620	274.93	170,456.60
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	4,740	235.61	1,116,791.40
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	2,500	9.06	22,650.00
KROGER CO	9,500	31.96	303,620.00
SYSCO CORP	5,500	75.00	412,500.00
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	8,800	68.24	600,512.00
WALMART INC	15,710	96.62	1,517,900.20
BROWN-FORMAN CORP-CL B	3,000	52.94	158,820.00
COCA COLA CO	44,000	45.38	1,996,720.00
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	2,100	42.31	88,851.00
CONSTELLATION BRANDS INC-A	1,910	209.75	400,622.50
MOLSON COORS BREWING CO-B	1,960	65.65	128,674.00
MONSTER BEVERAGE CORP	4,800	61.45	294,960.00
PEPSICO INC	15,460	113.12	1,748,835.20
ARCHER DANIELS MIDLAND	6,300	49.83	313,929.00
BUNGE LIMITED	1,700	63.99	108,783.00
CAMPBELL SOUP CO	2,000	39.86	79,720.00
CONAGRA BRANDS INC	4,600	36.10	166,060.00
GENERAL MILLS	6,000	45.55	273,300.00
HERSHEY CO/THE	1,510	102.87	155,333.70
HORMEL FOODS CORP	3,600	40.34	145,224.00
INGREDION INC	690	102.59	70,787.10
JM SMUCKER CO/THE-NEW	1,230	107.15	131,794.50
KELLOGG CO	2,530	72.70	183,931.00
KRAFT HEINZ CO/THE	6,560	57.00	373,920.00
MCCORMICK & CO INC.	1,450	127.73	185,208.50
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	16,200	43.49	704,538.00

TYSON FOODS INC-CL A	2,990	62.50	186,875.00
ALTRIA GROUP INC	20,800	60.65	1,261,520.00
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	16,950	78.79	1,335,490.50
CHURCH & DWIGHT CO INC	2,600	57.70	150,020.00
CLOROX CO	1,290	148.46	191,513.40
COLGATE PALMOLIVE CO.	9,000	66.59	599,310.00
KIMBERLY-CLARK CORP	3,790	116.69	442,255.10
PROCTER & GAMBLE CO	26,950	83.29	2,244,665.50
COTY INC-CL A	4,300	12.19	52,417.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	2,530	137.75	348,507.50
ABBOTT LABORATORIES	19,100	66.00	1,260,600.00
ABIOMED INC	500	383.83	191,915.00
ALIGN TECHNOLOGY INC	810	372.91	302,057.10
BAXTER INTERNATIONAL INC.	5,300	74.07	392,571.00
BECTON,DICKINSON	2,810	257.58	723,799.80
BOSTON SCIENTIFIC CORP	15,400	35.75	550,550.00
DANAHER CORP	6,850	104.01	712,468.50
DENTSPLY SIRONA INC	2,420	39.46	95,493.20
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,180	139.80	304,764.00
HOLOGIC INC	2,900	39.04	113,216.00
IDEXX LABORATORIES INC	900	245.65	221,085.00
INTUITIVE SURGICAL INC	1,200	536.72	644,064.00
MEDTRONIC PLC	14,810	96.04	1,422,352.40
RESMED INC	1,680	111.98	188,126.40
STRYKER CORP	3,650	168.04	613,346.00
TELEFLEX INC	510	242.52	123,685.20
THE COOPER COMPANIES, INC.	440	255.34	112,349.60
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	1,060	110.40	117,024.00
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	2,050	122.52	251,166.00
AETNA INC	3,540	201.93	714,832.20
AMERISOURCEBERGEN CORP	1,650	89.44	147,576.00
ANTHEM INC	2,760	267.85	739,266.00
CARDINAL HEALTH INC	3,500	52.36	183,260.00
CENTENE CORP	2,230	145.23	323,862.90
CIGNA CORP	2,580	184.93	477,119.40

CVS HEALTH CORP	10,900	74.89	816,301.00
DAVITA INC	1,400	67.09	93,926.00
EXPRESS SCRIPTS HOLDING INC-COMMON	6,170	89.83	554,251.10
HCA HEALTHCARE INC	2,870	133.79	383,977.30
HENRY SCHEIN INC	1,480	80.65	119,362.00
HUMANA INC	1,460	332.88	486,004.80
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	1,050	168.90	177,345.00
MCKESSON CORP	2,090	123.43	257,968.70
QUEST DIAGNOSTICS INC	1,360	109.45	148,852.00
UNITEDHEALTH GROUP INC	10,330	267.64	2,764,721.20
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	870	127.11	110,585.70
ABBVIE INC	16,530	95.19	1,573,490.70
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	2,510	120.33	302,028.30
ALKERMES PLC	1,640	44.51	72,996.40
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	840	118.08	99,187.20
AMGEN INC	7,310	197.75	1,445,552.50
BIOGEN INC	2,240	346.60	776,384.00
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,680	96.60	162,288.00
CELGENE CORP	8,040	92.19	741,207.60
GILEAD SCIENCES INC	14,100	74.53	1,050,873.00
INCYTE CORP	1,820	74.23	135,098.60
REGENERON PHARMACEUTICALS	890	406.94	362,176.60
SEATTLE GENETICS INC	1,100	76.96	84,656.00
UNITED THERAPEUTICS CORP	490	119.24	58,427.60
VERTEX PHARMACEUTICALS	2,720	183.21	498,331.20
ALLERGAN PLC	3,660	191.24	699,938.40
BRISTOL MYERS SQUIBB	17,900	61.20	1,095,480.00
ELI LILLY & CO.	10,640	105.72	1,124,860.80
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	550	171.30	94,215.00
JOHNSON & JOHNSON	29,020	135.86	3,942,657.20
MERCK & CO INC	29,300	68.62	2,010,566.00
MYLAN NV	6,100	39.48	240,828.00
NEKTAR THERAPEUTICS	1,380	67.56	93,232.80
PERRIGO CO PLC	1,130	77.05	87,066.50
PFIZER INC	63,900	41.85	2,674,215.00

TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	9,800	22.64	221,872.00
ZOETIS INC	5,250	89.06	467,565.00
BANK OF AMERICA CORP	105,000	31.18	3,273,900.00
BB&T CORPORATION	8,100	52.32	423,792.00
CIT GROUP INC	1,000	54.46	54,460.00
CITIGROUP	27,900	71.17	1,985,643.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	5,300	41.48	219,844.00
COMERICA INC	1,800	97.98	176,364.00
EAST WEST BANCORP INC	1,200	63.87	76,644.00
FIFTH THIRD BANCORP	6,900	29.68	204,792.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	1,700	102.18	173,706.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	11,900	16.40	195,160.00
JPMORGAN CHASE & CO	37,040	114.59	4,244,413.60
KEYCORP	12,300	21.33	262,359.00
M & T BANK CORP	1,440	179.73	258,811.20
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	2,700	18.64	50,328.00
PNC FINANCIAL	5,020	144.18	723,783.60
REGIONS FINANCIAL CORP	12,300	19.93	245,139.00
SIGNATURE BANK	520	117.41	61,053.20
SUNTRUST BKS INC.	5,200	74.45	387,140.00
SVB FINANCIAL GROUP	630	325.73	205,209.90
US BANCORP	16,600	54.33	901,878.00
WELLS FARGO CO	50,500	58.95	2,976,975.00
ZIONS BANCORPORATION	2,300	53.83	123,809.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	13,720	212.26	2,912,207.20
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	3,000	23.53	70,590.00
VOYA FINANCIAL INC	2,100	49.58	104,118.00
AFLAC INC	8,200	47.08	386,056.00
ALLEGHANY CORP	170	642.52	109,228.40
ALLSTATE CORP	3,710	101.40	376,194.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	630	112.97	71,171.10
AMERICAN INTL GROUP	10,100	53.82	543,582.00
AON PLC	2,640	147.73	390,007.20
ARCH CAPITAL GROUP LTD	3,990	30.59	122,054.10
ARTHUR J GALLAGHER & CO	1,700	73.53	125,001.00

ASSURANT INC	750	102.70	77,025.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	2,000	49.57	99,140.00
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	1,000	57.13	57,130.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	890	41.36	36,810.40
CHUBB LTD	5,060	137.28	694,636.80
CINCINNATI FINANCIAL CORP	1,550	77.45	120,047.50
EVEREST RE GROUP LTD	440	221.10	97,284.00
FNF GROUP	2,400	40.36	96,864.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	4,100	50.05	205,205.00
LINCOLN NATIONAL CORP	2,200	66.62	146,564.00
LOEWS CORP	2,800	50.27	140,756.00
MARKEL CORP	144	1,203.12	173,249.28
MARSH & MCLENNAN COS	5,270	84.89	447,370.30
METLIFE INC	10,000	46.33	463,300.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	3,080	56.00	172,480.00
PROGRESSIVE CO	6,300	68.79	433,377.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	4,670	99.72	465,692.40
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	750	143.18	107,385.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	490	132.51	64,929.90
TORCHMARK CORP	1,230	89.10	109,593.00
TRAVELERS COS INC/THE	2,850	132.59	377,881.50
UNUM GROUP	2,700	37.41	101,007.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	1,310	147.74	193,539.40
WR BERKLEY CORP	990	78.66	77,873.40
XL GROUP LTD	2,400	57.37	137,688.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	1,800	73.69	132,642.00
ALPHABET INC-CL A	3,229	1,199.10	3,871,893.90
ALPHABET INC-CL C	3,405	1,186.48	4,039,964.40
EBAY INC	10,400	34.13	354,952.00
FACEBOOK INC-A	25,900	167.18	4,329,962.00
GODADDY INC - CLASS A	1,800	79.34	142,812.00
IAC/INTERACTIVE CORP	700	195.66	136,962.00
MERCADOLIBRE INC	450	328.00	147,600.00
TWITTER INC	6,700	32.73	219,291.00
VERISIGN INC	1,090	156.38	170,454.20

ZILLOW GROUP INC - C	1,120	47.68	53,401.60
ACCENTURE PLC-CL A	6,840	168.64	1,153,497.60
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	510	238.85	121,813.50
AUTOMATIC DATA PROCESS	4,910	146.14	717,547.40
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	1,410	135.64	191,252.40
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	6,310	75.29	475,079.90
DXC TECHNOLOGY CO	3,310	90.07	298,131.70
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	3,380	106.54	360,105.20
FIRST DATA CORP- CLASS A	5,600	25.87	144,872.00
FISERV INC	4,600	79.71	366,666.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	950	214.83	204,088.50
GARTNER INC	920	153.49	141,210.80
GLOBAL PAYMENTS INC	1,880	123.69	232,537.20
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	9,900	146.66	1,451,934.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	670	157.98	105,846.60
LEIDOS HOLDINGS INC	1,800	70.73	127,314.00
MASTERCARD INC	10,140	211.16	2,141,162.40
PAYCHEX INC	3,400	73.82	250,988.00
PAYPAL HOLDINGS INC	12,100	89.05	1,077,505.00
SABRE CORP	1,900	25.72	48,868.00
SQUARE INC - A	3,200	87.20	279,040.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	1,600	96.52	154,432.00
VISA INC-CLASS A SHARES	19,240	142.67	2,744,970.80
WESTERN UNION CO	5,500	18.71	102,905.00
WORLDPAY INC - CL A	3,160	96.31	304,339.60
ACTIVISION BLIZZARD INC	7,700	71.65	551,705.00
ADOBE SYSTEMS INC.	5,360	256.14	1,372,910.40
ANSYS INC	950	184.31	175,094.50
AUTODESK INC.	2,480	149.33	370,338.40
CA INC	2,800	43.88	122,864.00
CADENCE DESIGN SYS INC	2,800	46.53	130,284.00
CDK GLOBAL INC	1,430	60.59	86,643.70
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	1,570	115.57	181,444.90
CITRIX SYSTEMS INC	1,590	112.38	178,684.20

DELL TECHNOLOGIES INC-CL V	1,900	95.69	181,811.00
ELECTRONIC ARTS	3,190	111.55	355,844.50
FORTINET INC	1,500	83.52	125,280.00
INTUIT INC	2,650	218.69	579,528.50
MICROSOFT CORP	78,910	108.49	8,560,945.90
ORACLE CORPORATION	32,900	48.04	1,580,516.00
RED HAT INC	1,950	144.28	281,346.00
SALESFORCE.COM INC	7,410	148.65	1,101,496.50
SERVICENOW INC	1,900	190.76	362,444.00
SPLUNK INC	1,300	121.93	158,509.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	2,200	55.13	121,286.00
SYMANTEC CORP	6,700	19.88	133,196.00
SYNOPSYS INC	1,780	100.67	179,192.60
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	1,380	128.90	177,882.00
VMWARE INC - CLASS A	900	151.12	136,008.00
WORKDAY INC-CLASS A	1,560	142.21	221,847.60
ARISTA NETWORKS INC	560	272.29	152,482.40
CISCO SYSTEMS	51,500	47.27	2,434,405.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	1,600	31.23	49,968.00
F5 NETWORKS INC	760	189.72	144,187.20
JUNIPER NETWORKS INC	4,100	27.99	114,759.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1,550	127.42	197,501.00
PALO ALTO NETWORKS INC	910	222.23	202,229.30
APPLE INC	53,200	226.87	12,069,484.00
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	16,500	16.59	273,735.00
HP INC	18,400	24.68	454,112.00
NETAPP INC	2,900	83.32	241,628.00
SEAGATE TECHNOLOGY	3,200	49.37	157,984.00
WESTERN DIGITAL CORP	3,040	60.01	182,430.40
XEROX CORP	2,500	27.30	68,250.00
AMPHENOL CORP-CL A	3,130	95.12	297,725.60
ARROW ELECTRS INC	750	76.58	57,435.00
AVNET INC	800	47.99	38,392.00
CDW CORPORATION	1,500	87.14	130,710.00
COGNEX CORP	1,640	52.57	86,214.80

CORNING INC	8,600	33.32	286,552.00
FLEX LTD	4,700	13.60	63,920.00
FLIR SYSTEMS INC	1,200	62.95	75,540.00
IPG PHOTONICS CORP	360	161.08	57,988.80
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	2,300	65.55	150,765.00
TE CONNECTIVITY LTD	3,810	90.61	345,224.10
TRIMBLE INC	2,500	42.14	105,350.00
ADVANCED MICRO DEVICES	10,900	28.51	310,759.00
ANALOG DEVICES INC	4,010	97.87	392,458.70
APPLIED MATERIALS	11,500	42.50	488,750.00
BROADCOM INC	4,310	221.42	954,320.20
INTEL CORP	50,000	47.72	2,386,000.00
KLA TENCOR CORP	1,610	118.83	191,316.30
LAM RESEARCH	1,680	172.04	289,027.20
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	7,400	20.48	151,552.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	2,800	60.39	169,092.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	2,660	85.14	226,472.40
MICRON TECHNOLOGY	12,500	49.54	619,250.00
NVIDIA CORP	6,280	278.42	1,748,477.60
NXP SEMICONDUCTORS NV	3,720	93.88	349,233.60
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	3,500	20.49	71,715.00
QORVO INC	1,200	79.68	95,616.00
QUALCOMM INC	15,700	70.89	1,112,973.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	1,950	89.75	175,012.50
TEXAS INSTRUMENTS INC	10,400	111.13	1,155,752.00
XILINX INC	2,640	78.80	208,032.00
AT & T INC	77,500	32.02	2,481,550.00
CENTURYLINK INC	11,200	21.65	242,480.00
VERIZON COMMUNICATIONS	44,100	53.82	2,373,462.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	1,800	34.21	61,578.00
SPRINT CORP	7,300	6.08	44,384.00
T-MOBILE US INC	3,900	65.71	256,269.00
ALLIANT ENERGY CORP	2,100	43.73	91,833.00
AMERICAN ELECTRIC POWER	5,500	73.24	402,820.00
DUKE ENERGY CORP	7,460	83.19	620,597.40

EDISON INTERNATIONAL	3,700	67.30	249,010.00
ENTERGY CORP	1,800	84.96	152,928.00
EVERGY INC	2,500	58.52	146,300.00
EVERSOURCE ENERGY	3,300	63.38	209,154.00
EXELON CORPORATION	9,900	44.20	437,580.00
FIRSTENERGY CORP	5,700	37.80	215,460.00
NEXTERA ENERGY INC	5,110	171.62	876,978.20
OGE ENERGY CORP	2,700	37.28	100,656.00
PG&E CORP	6,000	47.00	282,000.00
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	1,150	80.04	92,046.00
PPL CORPORATION	7,300	30.62	223,526.00
SOUTHERN CO.	11,000	44.66	491,260.00
XCEL ENERGY INC	5,700	49.28	280,896.00
ATMOS ENERGY CORP	1,100	93.60	102,960.00
UGI CORP	1,600	54.65	87,440.00
AMEREN CORPORATION	2,300	64.95	149,385.00
CENTERPOINT ENERGY INC	3,900	28.92	112,788.00
CMS ENERGY CORP	2,700	50.18	135,486.00
CONSOLIDATED EDISON INC	3,180	80.69	256,594.20
DOMINION ENERGY INC	6,890	72.45	499,180.50
DTE ENERGY COMPANY	1,800	113.27	203,886.00
NISOURCE INC	2,800	27.54	77,112.00
PUBLIC SVC ENTERPRISE	5,700	52.93	301,701.00
SCANA CORP	1,200	37.69	45,228.00
SEMPRA ENERGY	2,630	118.14	310,708.20
WEC ENERGY GROUP INC	3,600	68.93	248,148.00
AMERICAN WATER WORKS CO INC	1,660	89.50	148,570.00
NEW YORK COMMUNITY BANCORP	6,100	10.89	66,429.00
ALLY FINANCIAL INC	3,900	27.18	106,002.00
AMERICAN EXPRESS CO	7,950	105.68	840,156.00
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	5,310	99.85	530,203.50
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	3,670	78.53	288,205.10
SYNCHRONY FINANCIAL	7,400	32.01	236,874.00
AFFILIATED MANAGERS GROUP	600	144.63	86,778.00
AMERIPRISE FINANCIAL INC	1,680	143.92	241,785.60

BANK OF NEWYORK MELLON CORP	10,900	52.25	569,525.00	
BLACKROCK INC	1,270	478.24	607,364.80	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	1,240	103.31	128,104.40	
CME GROUP INC	3,690	171.29	632,060.10	
E*TRADE FINANCIAL CORP	3,100	58.26	180,606.00	
EATON VANCE CORP	1,600	52.59	84,144.00	
FRANKLIN RESOURCES INC	3,400	31.42	106,828.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	3,970	237.56	943,113.20	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	6,400	76.71	490,944.00	
INVESCO LTD	4,400	24.60	108,240.00	
MOODYS CORP	1,800	176.10	316,980.00	
MORGAN STANLEY	14,300	48.72	696,696.00	
MSCI INC	1,070	178.52	191,016.40	
NASDAQ INC	1,430	94.50	135,135.00	
NORTHERN TRUST CORP	2,220	106.99	237,517.80	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	1,300	93.28	121,264.00	
S&P GLOBAL INC	2,760	204.99	565,772.40	
SCHWAB(CHARLES)CORP	13,100	50.52	661,812.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	1,400	63.18	88,452.00	
STATE STREET CORP	3,780	87.26	329,842.80	
T ROWE PRICE GROUP INC	2,730	114.50	312,585.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	2,700	57.73	155,871.00	
H & R BLOCK INC	1,800	26.30	47,340.00	
AES CORP	6,100	13.41	81,801.00	
VISTRA ENERGY CORP	4,600	22.99	105,754.00	
CERNER CORP	3,190	64.71	206,424.90	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	1,500	101.00	151,500.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	3,590	66.96	240,386.40	
ILLUMINA INC	1,590	346.35	550,696.50	
IQVIA HOLDINGS INC	1,910	125.95	240,564.50	
METTLER-TOLEDO INTL	300	586.76	176,028.00	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	4,340	236.37	1,025,845.80	
WATERS CORP	810	189.30	153,333.00	
COSTAR GROUP INC	370	442.51	163,728.70	
EQUIFAX INC	1,220	134.54	164,138.80	

	IHS MARKIT LTD	4,500	55.03	247,635.00	
	MANPOWERGROUP INC	590	92.16	54,374.40	
	NIELSEN HOLDINGS PLC	3,700	26.37	97,569.00	
	ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	1,430	74.08	105,934.40	
	TRUNSION	2,300	75.34	173,282.00	
	VERISK ANALYTICS INC	1,720	120.06	206,503.20	
	CBRE GROUP INC	3,000	47.16	141,480.00	
	HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	15,000	6.80	102,000.00	
	JONES LANG LASALLE INC	470	149.11	70,081.70	
小計	銘柄数：598			270,271,501.04	
				(30,070,407,205)	
	組入時価比率：64.6%			68.2%	
カナダドル	ARC RESOURCES LTD	3,800	13.14	49,932.00	
	CAMECO CORP	5,000	13.15	65,750.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	13,300	43.85	583,205.00	
	CENOVUS ENERGY INC	9,400	11.83	111,202.00	
	CRESCENT POINT ENERGY CORP	6,700	7.61	50,987.00	
	ENBRIDGE INC	18,800	45.65	858,220.00	
	ENCANA CORP	9,700	17.06	165,482.00	
	HUSKY ENERGY INC	3,779	21.90	82,760.10	
	IMPERIAL OIL	2,900	40.35	117,015.00	
	INTER PIPELINE LTD	3,800	23.43	89,034.00	
	KEYERA CORP	2,020	35.24	71,184.80	
	PEMBINA PIPELINE CORP	5,200	44.20	229,840.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1,800	23.47	42,246.00	
	SEVEN GENERATIONS ENERGY - A	3,100	14.68	45,508.00	
	SUNCOR ENERGY INC	18,200	52.73	959,686.00	
	TOURMALINE OIL CORP	2,800	19.74	55,272.00	
	TRANSCANADA CORP	9,900	56.33	557,667.00	
	VERMILION ENERGY INC	1,410	40.50	57,105.00	
	METHANEX CORP	970	94.07	91,247.90	
	NUTRIEN LTD	6,600	72.27	476,982.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	1,450	64.16	93,032.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	2,100	42.93	90,153.00	
	BARRICK GOLD	12,400	12.97	160,828.00	

FIRST QUANTUM MINERALS LTD	7,800	15.05	117,390.00
FRANCO-NEVADA CORP	1,800	80.40	144,720.00
GOLDCORP INC	7,900	13.38	105,702.00
KINROSS GOLD CORP	10,000	3.68	36,800.00
LUNDIN MINING CORP	8,000	6.20	49,600.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	6,100	29.30	178,730.00
TURQUOISE HILL RESOURCES LTD	8,740	3.02	26,394.80
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	4,000	21.20	84,800.00
WEST FRASER TIMBER	780	87.60	68,328.00
BOMBARDIER B SHEARS	19,500	4.19	81,705.00
CAE INC	1,900	26.15	49,685.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	1,900	52.24	99,256.00
WSP GLOBAL INC	1,100	68.35	75,185.00
FINNING INTERNATIONAL INC	2,000	30.45	60,900.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	8,050	113.96	917,378.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	1,600	274.06	438,496.00
LINAMAR CORP	500	54.88	27,440.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	3,900	69.97	272,883.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	2,700	38.27	103,329.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	2,700	73.63	198,801.00
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	3,800	25.58	97,204.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	660	160.77	106,108.20
DOLLARAMA INC	3,120	48.75	152,100.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	4,500	63.15	284,175.00
EMPIRE CO LTD A	1,300	24.64	32,032.00
LOBLAW COMPANIES	2,400	69.27	166,248.00
METRO INC	2,300	40.83	93,909.00
WESTON(GEORGE)LTD	390	99.42	38,773.80
SAPUTO INC	3,100	38.58	119,598.00
AURORA CANNABIS INC	4,000	8.68	34,720.00
BAUSCH HEALTH COS INC	3,900	28.14	109,746.00
BANK OF MONTREAL	6,930	107.77	746,846.10
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	12,700	74.95	951,865.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	4,700	123.23	579,181.00

	NATIONAL BANK OF CANADA	3,600	64.68	232,848.00	
	ROYAL BANK OF CANADA	15,800	103.76	1,639,408.00	
	TORONTO DOMINION BANK	20,100	79.39	1,595,739.00	
	ONEX CORPORATION	900	90.80	81,720.00	
	FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	330	690.19	227,762.70	
	GREAT-WEST LIFE CO INC	3,800	31.25	118,750.00	
	INDUSTRIAL ALLIANCE INSURANC	800	53.57	42,856.00	
	INTACT FINANCIAL CORP	1,460	102.37	149,460.20	
	MANULIFE FINANCIAL CORP	20,500	23.56	482,980.00	
	POWER CORPORATION OF CANADA	3,500	28.62	100,170.00	
	POWER FINANCIAL CORP	3,300	30.01	99,033.00	
	SUN LIFE FINANCIAL INC	6,800	51.43	349,724.00	
	SHOPIFY INC - CLASS A	1,040	184.39	191,765.60	
	CGI GROUP INC - CLASS A	3,000	84.89	254,670.00	
	BLACKBERRY LTD	4,500	13.15	59,175.00	
	CONSTELLATION SOFTWARE INC	236	958.75	226,265.00	
	OPEN TEXT CORP	3,100	51.26	158,906.00	
	BCE INC	1,200	53.18	63,816.00	
	TELUS CORP	2,600	48.73	126,698.00	
	ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	4,200	67.41	283,122.00	
	EMERA INC	600	41.17	24,702.00	
	FORTIS INC	5,000	42.86	214,300.00	
	HYDRO ONE LTD	3,100	19.10	59,210.00	
	ALTAGAS LTD	3,600	24.11	86,796.00	
	ATCO LTD CL1	900	38.37	34,533.00	
	CANADIAN UTILITIES LTD A	1,090	31.66	34,509.40	
	BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	9,200	56.14	516,488.00	
	CI FINANCIAL CORP	3,700	20.46	75,702.00	
	IGM FINANCIAL INC	600	36.00	21,600.00	
	THOMSON REUTERS CORP	2,700	58.58	158,166.00	
	FIRST CAPITAL REALTY INC	1,100	20.19	22,209.00	
小計	銘柄数：88			19,487,451.60	
				(1,645,520,413)	
	組入時価比率：3.5%			3.7%	
ユ-口	TENARIS SA	5,400	13.89	75,033.00	

ENAGAS	1,900	24.31	46,189.00
ENI SPA	26,700	15.96	426,132.00
GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	5,800	16.83	97,643.00
NESTE OYJ	1,500	71.80	107,700.00
OMV AG	1,500	45.16	67,740.00
REPSOL SA	14,976	16.53	247,628.16
SNAM SPA	23,000	3.63	83,628.00
TOTAL SA	26,300	52.53	1,381,539.00
VOPAK	700	42.86	30,002.00
AIR LIQUIDE	4,770	105.60	503,712.00
AKZO NOBEL	2,620	80.58	211,119.60
ARKEMA	850	104.25	88,612.50
BASF SE	9,710	77.25	750,097.50
COVESTRO AG	2,240	70.94	158,905.60
EVONIK INDUSTRIES AG	1,800	31.14	56,052.00
FUCHS PETROLUB SE -PFD	740	48.78	36,097.20
K+S AG	2,400	18.69	44,856.00
KONINKLIJKE DSM NV	1,890	87.86	166,055.40
LANXESS	970	65.36	63,399.20
LINDE AG - TENDER	2,010	190.00	381,900.00
SOLVAY SA	920	112.00	103,040.00
SYMRISE AG	1,530	77.52	118,605.60
UMICORE	2,400	46.17	110,808.00
CRH PLC	9,600	28.26	271,296.00
HEIDELBERGCEMENT AG	1,470	67.38	99,048.60
IMERYS	450	60.45	27,202.50
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	2,300	35.38	81,374.00
ARCELORMITTAL	6,400	24.84	158,976.00
THYSSENKRUPP AG	4,800	19.61	94,128.00
VOESTALPINE AG	1,400	37.55	52,570.00
STORA ENSO OYJ-R	6,100	15.43	94,123.00
UPM-KYMMENE OYJ	6,200	32.84	203,608.00
AIRBUS SE	6,140	103.00	632,420.00
DASSAULT AVIATION SA	26	1,544.00	40,144.00
LEONARDO SPA	4,200	9.86	41,412.00

MTU AERO ENGINES AG	520	183.20	95,264.00
SAFRAN SA	3,670	109.10	400,397.00
THALES SA	1,000	117.30	117,300.00
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	5,500	36.38	200,090.00
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	2,425	35.00	84,875.00
BOUYGUES	2,130	35.45	75,508.50
EIFFAGE SA	930	94.96	88,312.80
FERROVIAL SA	4,785	18.02	86,249.62
HOCHTIEF AG	160	136.00	21,760.00
VINCI	5,480	79.46	435,440.80
LEGRAND SA	2,860	63.28	180,980.80
OSRAM LICHT AG	821	37.18	30,524.78
PRYSMIAN SPA	2,800	21.71	60,788.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	5,980	67.92	406,161.60
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	1,800	12.50	22,500.00
SIEMENS AG	8,380	108.62	910,235.60
ALSTOM	2,100	37.60	78,960.00
ANDRITZ AG	700	49.68	34,776.00
CNH INDUSTRIAL NV	10,100	10.02	101,252.50
GEA GROUP AG	1,700	31.75	53,975.00
KION GROUP AG	970	57.00	55,290.00
KONE OYJ	3,800	45.47	172,786.00
MAN SE	430	93.45	40,183.50
METSO OYJ	800	28.96	23,168.00
WARTSILA OYJ	4,800	17.19	82,536.00
BRENNTAG AG	1,900	52.06	98,914.00
REXEL SA	4,100	13.29	54,509.50
EDENRED	2,900	32.66	94,714.00
SOCIETE BIC SA	300	76.40	22,920.00
BOLLORE	7,500	3.85	28,920.00
DEUTSCHE POST AG-REG	10,900	30.61	333,649.00
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	3,000	22.47	67,410.00
INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GRP	6,000	7.71	46,308.00
ADP	290	189.70	55,013.00

AENA SME SA	650	150.65	97,922.50
ATLANTIA SPA	5,300	17.20	91,186.50
FRAPORT AG	380	77.18	29,328.40
GETLINK	6,300	10.85	68,386.50
CONTINENTAL AG	1,120	152.70	171,024.00
FAURECIA	750	50.46	37,845.00
MICHELIN (CGDE)	1,990	99.54	198,084.60
NOKIAN RENKAAT OYJ	1,100	35.35	38,885.00
PIRELLI & C. SPA	3,500	6.92	24,248.00
SCHAEFFLER AG	1,300	11.03	14,345.50
VALEO SA	2,400	37.39	89,736.00
BAYER MOTOREN WERK	3,720	81.25	302,250.00
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	760	70.10	53,276.00
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	9,700	54.28	526,516.00
FERRARI NV	1,440	108.70	156,528.00
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	11,500	14.57	167,578.00
PEUGEOT CITROEN	6,900	23.19	160,011.00
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	1,600	52.70	84,320.00
RENAULT SA	2,020	72.26	145,965.20
VOLKSWAGEN AG	370	133.70	49,469.00
VOLKSWAGEN AG-PREF	2,090	136.14	284,532.60
SEB SA	260	157.20	40,872.00
ADIDAS AG	2,100	207.00	434,700.00
HERMES INTERNATIONAL	340	530.40	180,336.00
HUGO BOSS AG	720	67.66	48,715.20
KERING SA	830	439.20	364,536.00
LUXOTTICA GROUP SPA	1,600	55.72	89,152.00
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	2,950	281.25	829,687.50
MONCLER SPA	1,700	36.98	62,866.00
PUMA SE	61	438.00	26,718.00
ACCOR SA	2,100	43.53	91,413.00
PADDY POWER PLC	890	77.95	69,375.50
SODEXO	1,110	89.58	99,433.80
AXEL SPRINGER SE	360	60.95	21,942.00
EUTELSAT COMMUNICATIONS	2,200	20.13	44,286.00

JC DECAUX SA	750	29.26	21,945.00
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA SE	2,700	22.33	60,291.00
PUBLICIS GROUPE	1,900	51.62	98,078.00
RTL GROUP	310	62.45	19,359.50
SES FDR	3,900	16.57	64,623.00
TELENET GROUP HOLDING NV	690	46.34	31,974.60
VIVENDI SA	11,400	21.64	246,696.00
ZALANDO SE	900	42.45	38,205.00
INDITEX SA	12,000	25.08	300,960.00
CARREFOUR SUPERMARCHE	5,600	15.11	84,616.00
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	700	26.72	18,704.00
COLRUYT SA	400	50.58	20,232.00
JERONIMO MARTINS	2,000	12.43	24,870.00
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	13,500	20.96	282,960.00
METRO AG	1,700	13.55	23,035.00
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	8,150	78.20	637,330.00
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	5,500	7.48	41,140.00
HEINEKEN HOLDING NV	1,290	80.55	103,909.50
HEINEKEN NV	2,680	83.38	223,458.40
PERNOD RICARD SA	2,150	134.70	289,605.00
REMY COINTREAU	140	117.80	16,492.00
DANONE	6,450	65.45	422,152.50
KERRY GROUP PLC-A	1,820	96.00	174,720.00
HENKEL AG & CO KGAA	1,030	93.50	96,305.00
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	1,840	106.85	196,604.00
BEIERSDORF AG	940	98.52	92,608.80
LOREAL-ORD	2,690	199.45	536,520.50
UNILEVER NV-CVA	16,500	48.19	795,135.00
BIOMERIEUX	420	77.80	32,676.00
ESSILOR INTERNATIONAL	2,320	121.05	280,836.00
KONINKLIJKE PHILIPS NV	10,400	37.25	387,452.00
SARTORIUS AG-VORZUG	320	147.80	47,296.00
SIEMENS HEALTHINEERS AG	1,600	38.12	61,000.00
FRESENIUS MEDICAL CARE	2,300	85.96	197,708.00
FRESENIUS SE & CO KGAA	4,520	63.86	288,647.20

GRIFOLS SA	3,600	24.54	88,344.00
BAYER AG-REG	10,170	78.48	798,141.60
IPSEN	520	149.10	77,532.00
MERCK KGAA	1,260	88.98	112,114.80
ORION OYJ	1,000	30.16	30,160.00
RECORDATI SPA	1,100	30.49	33,539.00
SANOFI	12,380	72.55	898,169.00
UCB SA	1,300	76.70	99,710.00
ABN AMRO GROUP NV-CVA	4,400	23.61	103,884.00
AIB GROUP PLC	8,000	4.78	38,256.00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	71,500	5.36	383,454.50
BANCO DE SABADELL SA	70,000	1.36	95,550.00
BANCO SANTANDER SA	176,000	4.27	752,136.00
BANK OF IRELAND GROUP PLC	11,500	7.14	82,167.50
BANKIA SA	12,250	3.42	41,895.00
BANKINTER S.A.	8,200	7.79	63,894.40
BNP PARIBAS	11,900	51.11	608,209.00
CAIXABANK	41,000	4.06	166,829.00
COMMERZBANK AG	11,400	8.48	96,751.80
CREDIT AGRICOLE SA	11,100	12.27	136,241.40
ERSTE GROUP BANK AG	3,300	35.45	116,985.00
ING GROEP NV	41,500	11.55	479,491.00
INTESA SANPAOLO	166,000	2.33	387,029.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	13,429	0.00	0.00
KBC GROEP NV	2,750	62.58	172,095.00
MEDIOBANCA S.P.A.	5,600	8.75	49,044.80
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	1,500	24.05	36,075.00
SOCIETE GENERALE	8,500	36.13	307,147.50
UNICREDIT SPA	22,500	13.23	297,675.00
EURAZEO SE	334	64.60	21,576.40
EXOR NV	1,300	55.54	72,202.00
GROUPE BRUXELLES LAM	940	88.22	82,926.80
WENDEL	260	124.50	32,370.00
AEGON NV	18,000	5.24	94,320.00
AGEAS	1,800	44.66	80,388.00

ALLIANZ SE-REG	4,650	180.84	840,906.00
ASSICURAZIONI GENERALI	13,000	14.79	192,270.00
AXA	21,200	22.00	466,400.00
CNP ASSURANCES	1,640	19.73	32,357.20
HANNOVER RUECK SE	530	119.30	63,229.00
MAPFRE SA	12,700	2.55	32,385.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	1,730	184.80	319,704.00
NN GROUP NV	3,700	37.41	138,417.00
POSTE ITALIANE SPA	7,300	7.05	51,508.80
SAMPO OYJ-A SHS	4,500	43.78	197,010.00
SCOR SE	1,400	37.75	52,850.00
DELIVERY HERO SE	800	45.32	36,256.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	1,500	43.40	65,100.00
AMADEUS IT GROUP SA	4,840	76.94	372,389.60
ATOS SE	890	100.05	89,044.50
CAPGEMINI SA	1,630	106.25	173,187.50
WIRECARD AG	1,350	182.10	245,835.00
DASSAULT SYSTEMES SA	1,410	130.10	183,441.00
SAP SE	10,730	99.22	1,064,630.60
UBISOFT ENTERTAINMENT	920	87.84	80,812.80
NOKIA OYJ	60,000	4.62	277,620.00
INGENICO GROUP	690	56.26	38,819.40
ASML HOLDING NV	4,500	167.32	752,940.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	12,400	20.86	258,664.00
STMICROELECTRONICS NV	8,000	16.49	131,920.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	35,700	13.44	479,986.50
ELISA OYJ	1,600	36.79	58,864.00
ILIAD SA	310	107.45	33,309.50
KONINKLIJKE KPN NV	39,000	2.18	85,332.00
ORANGE SA	21,700	13.64	295,988.00
PROXIMUS	1,550	19.85	30,767.50
TELECOM ITALIA SPA	112,000	0.51	57,948.80
TELECOM ITALIA-RNC	68,000	0.46	31,409.20
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	5,000	3.49	17,495.00
TELEFONICA SA	50,400	6.80	342,770.40

	1&1 DRILLISCH AG	570	41.44	23,620.80	
	ELECTRICITE DE FRANCE	7,400	13.79	102,083.00	
	ENDESA S.A.	3,500	19.37	67,812.50	
	ENEL SPA	87,000	4.29	373,230.00	
	ENERGIAS DE PORTUGAL	30,000	3.30	99,150.00	
	FORTUM OYJ	4,900	21.12	103,488.00	
	IBERDROLA SA	64,182	6.34	407,042.24	
	RED ELECTRICA CORPORACION SA	4,200	18.26	76,713.00	
	TERNA SPA	18,000	4.69	84,438.00	
	NATURGY ENERGY GROUP SA	4,200	23.18	97,356.00	
	E.ON SE	24,800	8.96	222,307.20	
	ENGIE	20,000	12.34	246,900.00	
	INNOGY SE	1,600	37.52	60,032.00	
	RWE AG	6,300	21.01	132,363.00	
	SUEZ	3,600	12.17	43,830.00	
	VEOLIA ENVIRONNEMENT	5,200	17.84	92,794.00	
	AMUNDI SA	600	61.60	36,960.00	
	DEUTSCHE BANK AG-REG	20,900	9.87	206,303.90	
	DEUTSCHE BOERSE AG	2,040	117.50	239,700.00	
	NATIXIS	11,000	5.83	64,152.00	
	UNIPER SE	2,100	25.78	54,138.00	
	EUROFINS SCIENTIFIC SE	130	462.80	60,164.00	
	QIAGEN NV	2,176	32.80	71,372.80	
	BUREAU VERITAS SA	3,100	21.92	67,952.00	
	RANDSTAD NV	1,500	51.92	77,880.00	
	RELX NV	10,900	18.76	204,484.00	
	TELEPERFORMANCE	570	165.00	94,050.00	
	WOLTERS KLUWER	2,900	53.70	155,730.00	
	DEUTSCHE WOHNEN SE	4,200	43.28	181,776.00	
	VONOVIA SE	4,900	43.48	213,052.00	
	小計 銘柄数：240			41,756,832.90	
				(5,406,257,155)	
	組入時価比率：11.6%			12.2%	
英債券	WOOD GROUP (JOHN) PLC	6,500	7.13	46,384.00	
	BP PLC	217,000	5.46	1,185,471.00	

ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	49,200	25.07	1,233,444.00
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	40,900	25.45	1,041,109.50
CRODA INTERNATIONAL PLC	1,500	50.14	75,210.00
JOHNSON MATTHEY PLC	1,700	34.86	59,262.00
ANGLO AMERICAN PLC	11,400	15.30	174,420.00
ANTOFAGASTA PLC	5,400	7.96	42,994.80
BHP BILLITON PLC	23,000	16.18	372,232.00
FRESNILLO PLC	2,700	8.72	23,565.60
GLENCORE PLC	122,000	3.12	380,762.00
RANDGOLD RESOURCES LTD	1,090	49.47	53,922.30
RIO TINTO PLC-REG	13,100	35.64	466,949.50
MONDI PLC	3,900	21.15	82,485.00
BAE SYSTEMS PLC	35,200	6.07	213,734.40
MEGGITT PLC	11,000	5.39	59,356.00
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	19,000	9.66	183,654.00
MELROSE INDUSTRIES PLC	56,000	2.22	124,712.00
DCC PLC	820	68.30	56,006.00
SMITHS GROUP PLC	4,700	15.97	75,059.00
WEIR GROUP PLC	2,800	17.86	50,008.00
ASHTED GROUP PLC	5,900	23.61	139,299.00
BUNZLE	3,000	23.90	71,700.00
FERGUSON PLC	2,548	62.29	158,714.92
TRAVIS PERKINS PLC	2,400	11.35	27,252.00
BABCOCK INTL GROUP PLC	3,300	7.05	23,278.20
G4S PLC	16,100	2.41	38,817.10
ROYAL MAIL PLC	12,100	4.67	56,507.00
EASYJET PLC	1,900	14.95	28,405.00
BARRATT DEVELOPMENTS PLC	10,500	5.45	57,246.00
PERSIMMON PLC	2,800	23.72	66,416.00
TAYLOR WIMPEY PLC	34,300	1.66	57,075.20
THE BERKELEY GRP HOLDINGS	1,400	35.38	49,532.00
BURBERRY GROUP PLC	4,800	21.16	101,568.00
CARNIVAL PLC	1,700	45.92	78,064.00
COMPASS GROUP PLC	17,600	16.49	290,312.00
GVC HOLDINGS PLC	5,800	10.98	63,684.00

INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,723	46.65	80,377.95
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	6,200	3.78	23,479.40
TUI AG-DI	5,400	13.63	73,629.00
WHITBREAD PLC	1,700	47.11	80,087.00
INFORMA PLC	13,000	7.64	99,346.00
ITV PLC	41,000	1.58	65,087.50
PEARSON	8,800	8.98	79,024.00
SKY PLC	10,100	15.46	156,146.00
WPP PLC	13,200	11.47	151,470.00
MARKS & SPENCER PLC	17,200	3.00	51,600.00
NEXT PLC	1,800	54.80	98,640.00
KINGFISHER PLC	25,000	2.71	67,750.00
MORRISON SUPERMARKETS	20,000	2.62	52,480.00
SAINSBURY	18,000	3.20	57,762.00
TESCO PLC	108,000	2.40	259,524.00
COCA-COLA HBC AG-DI	1,900	25.62	48,678.00
DIAGEO PLC	26,500	26.85	711,657.50
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	3,300	22.84	75,372.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	25,000	37.12	928,125.00
IMPERIAL BRANDS PLC	10,400	26.92	279,968.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	7,270	64.68	470,223.60
UNILEVER PLC	13,600	42.83	582,488.00
CONVATEC GROUP PLC-WI	9,000	2.10	18,909.00
SMITH & NEPHEW PLC	8,900	13.68	121,796.50
MEDICLINIC INTERNATIONAL PLC	4,400	4.86	21,392.80
NMC HEALTH PLC	800	37.34	29,872.00
SHIRE PLC	9,900	43.97	435,352.50
ASTRAZENECA PLC	13,900	57.01	792,439.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	54,200	15.53	841,834.40
BARCLAYS PLC	188,000	1.78	334,640.00
HSBC HOLDINGS PLC	217,400	6.70	1,456,797.40
LLOYDS BANKING GROUP PLC	781,000	0.60	473,364.10
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	57,000	2.50	142,728.00
STANDARD CHARTERED PLC	30,200	6.30	190,531.80
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	26,797	3.20	85,830.79

	ADMIRAL GROUP PLC	1,500	20.95	31,425.00	
	AVIVA PLC	44,100	4.85	214,237.80	
	DIRECT LINE INSURANCE GROUP	12,000	3.29	39,480.00	
	LEGAL & GENERAL	62,000	2.53	157,294.00	
	PRUDENTIAL PLC	28,700	17.10	490,913.50	
	RSA INSURANCE GROUP PLC	12,100	6.26	75,818.60	
	AUTO TRADER GROUP PLC	7,000	4.27	29,939.00	
	MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	3,900	13.01	50,758.50	
	SAGE GROUP PLC (THE)	13,500	5.79	78,273.00	
	BT GROUP PLC	84,000	2.18	183,792.00	
	VODAFONE GROUP PLC	289,000	1.62	470,781.00	
	SSE PLC	10,400	12.64	131,456.00	
	CENTRICA PLC	55,000	1.43	78,870.00	
	NATIONAL GRID PLC	37,300	8.02	299,481.70	
	SEVERN TRENT PLC	2,700	19.22	51,907.50	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	7,300	7.12	52,034.40	
	3I GROUP PLC	9,000	9.18	82,692.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	3,600	21.86	78,696.00	
	INVESTEC PLC	6,200	4.86	30,150.60	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	3,600	46.62	167,832.00	
	SCHRODERS PLC	1,100	29.90	32,890.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	6,200	11.27	69,905.00	
	EXPERIAN PLC	10,400	18.94	196,976.00	
	INTERTEK GROUP PLC	1,500	50.56	75,840.00	
	RELX PLC	12,000	16.89	202,740.00	
小計	銘柄数：97			20,121,198.36	
				(2,892,422,264)	
	組入時価比率：6.2%			6.5%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	2,200	23.48	51,656.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	70	603.50	42,245.00	
	GIVAUDAN-REG	93	2,309.00	214,737.00	
	SIKA AG-REG	1,260	139.20	175,392.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	4,800	45.19	216,912.00	
	GEBERIT AG-REG	390	435.80	169,962.00	
	ABB LTD	19,800	22.68	449,064.00	

	SCHINDLER HOLDING AG-REG	140	222.80	31,192.00	
	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	390	227.80	88,842.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	630	154.50	97,335.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	5,710	82.94	473,587.40	
	THE SWATCH GROUP AG-B	340	385.50	131,070.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	550	74.45	40,947.50	
	DUFREY AG-REG	280	114.85	32,158.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	22	1,763.00	38,786.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	14	6,730.00	94,220.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	1	78,600.00	78,600.00	
	NESTLE SA-REG	33,740	79.90	2,695,826.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	690	191.00	131,790.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	100	748.00	74,800.00	
	NOVARTIS-REG	23,760	79.46	1,887,969.60	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	7,640	237.70	1,816,028.00	
	VIFOR PHARMA AG	390	170.75	66,592.50	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	280	76.85	21,518.00	
	BALOISE HOLDING AG	580	149.20	86,536.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	390	351.00	136,890.00	
	SWISS RE LTD	3,470	88.12	305,776.40	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	1,650	296.10	488,565.00	
	TEMENOS AG-REG	770	152.40	117,348.00	
	SWISSCOM AG-REG	260	431.40	112,164.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	28,900	14.72	425,552.50	
	JULIUS BAER GROUP LTD	2,500	50.64	126,600.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	170	750.00	127,500.00	
	UBS GROUP AG	41,800	15.43	645,183.00	
	LONZA AG-REG	840	307.00	257,880.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	1,910	57.88	110,550.80	
	SGS SA-REG	57	2,524.00	143,868.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	740	87.80	64,972.00	
小計	銘柄数：38			12,270,615.70	
				(1,407,562,326)	
	組入時価比率：3.0%			3.2%	
スウェーデンク ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	2,500	310.20	775,500.00	

BOLIDEN AB	2,600	235.00	611,000.00	
ASSA ABLOY AB-B	10,100	184.65	1,864,965.00	
SKANSKA AB-B SHS	3,100	167.25	518,475.00	
ALFA LAVAL AB	3,000	241.00	723,000.00	
ATLAS COPCO AB-A	6,900	259.35	1,789,515.00	
ATLAS COPCO AB-B	4,800	239.60	1,150,080.00	
EPIROC AB - A	6,900	94.45	651,705.00	
EPIROC AB - B	3,500	86.85	303,975.00	
SANDVIK AB	11,200	154.30	1,728,160.00	
SKF AB-B SHARES	4,600	171.15	787,290.00	
VOLVO AB-B SHS	17,300	154.65	2,675,445.00	
SECURITAS AB-B SHS	4,300	157.50	677,250.00	
ELECTROLUX AB-B	2,600	198.55	516,230.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	4,600	72.80	334,880.00	
HENNES&MAURITZ AB-B	9,200	122.32	1,125,344.00	
ICA GRUPPEN AB	900	272.20	244,980.00	
SWEDISH MATCH AB	1,900	471.90	896,610.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	6,500	235.90	1,533,350.00	
NORDEA BANK AB	30,500	97.08	2,960,940.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	18,400	97.62	1,796,208.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	17,100	109.45	1,871,595.00	
SWEDBANK AB	10,100	213.00	2,151,300.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	2,000	189.95	379,900.00	
INVESTOR AB-B SHS	5,100	408.10	2,081,310.00	
KINNEVIK AB - B	2,300	288.00	662,400.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	800	298.60	238,880.00	
ERICSSON LM-B	32,000	76.34	2,442,880.00	
HEXAGON AB-B SHS	3,000	523.40	1,570,200.00	
TELIA CO AB	32,000	39.86	1,275,520.00	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR- SDR	570	501.00	285,570.00	
TELE 2 AB-B SHS	4,200	113.35	476,070.00	
小計銘柄数：32			37,100,527.00	
			(455,965,476)	
組入時価比率：1.0%				1.0%
ノルウェーク	AKER AB ASA	800	288.00	230,400.00

ローネ					
		EQUINOR ASA	12,500	210.10	2,626,250.00
		YARA INTERNATIONAL ASA	1,700	376.10	639,370.00
		NORSK HYDRO	14,200	45.79	650,218.00
		SCHIBSTED ASA-B SHS	900	269.00	242,100.00
		MARINE HARVEST ASA	4,800	182.95	878,160.00
		ORKLA ASA	10,200	68.30	696,660.00
		DNB ASA	10,400	170.15	1,769,560.00
		GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	2,600	138.00	358,800.00
		TELENOR ASA	8,700	157.25	1,368,075.00
	小計	銘柄数：10			9,459,593.00 (125,339,607)
	組入時価比率：0.3%			0.3%	
デンマーク ローネ		CHR HANSEN HOLDING A/S	1,000	629.80	629,800.00
		NOVOZYMES A/S-B SHARES	2,500	342.60	856,500.00
		VESTAS WIND SYSTEMS A/S	2,300	427.10	982,330.00
		ISS A/S	1,900	217.10	412,490.00
		A P MOLLER - MAERSK A/S-A	51	8,555.00	436,305.00
		A P MOLLER-MAERSK A/S	79	9,154.00	723,166.00
		DSV A/S	1,800	600.40	1,080,720.00
		PANDORA A/S	1,290	388.20	500,778.00
		CARLSBERG B	1,060	774.00	820,440.00
		COLOPLAST-B	1,290	669.40	863,526.00
		WILLIAM DEMANT HOLDING	1,300	255.20	331,760.00
		GENMAB A/S	540	1,061.50	573,210.00
		H LUNDBECK A/S	700	366.40	256,480.00
		NOVO NORDISK A/S-B	19,400	306.50	5,946,100.00
		DANSKE BANK AS	7,700	181.75	1,399,475.00
		TRYG A/S	1,000	155.90	155,900.00
		ORSTED A/S	2,300	394.90	908,270.00
	小計	銘柄数：17			16,877,250.00 (293,157,832)
		組入時価比率：0.6%			0.7%
豪ドル		CALTEX AUSTRALIA LIMITED	3,200	30.15	96,480.00
		OIL SEARCH LTD	14,000	8.73	122,220.00

ORIGIN ENERGY LTD	17,000	7.76	131,920.00
SANTOS LTD.	23,000	6.76	155,480.00
WOODSIDE PETROLEUM	9,444	36.28	342,628.32
INCITEC PIVOT LTD	17,000	3.93	66,810.00
ORICA LTD	2,800	16.65	46,620.00
BORAL LTD	14,000	6.98	97,720.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	5,200	21.13	109,876.00
AMCOR	14,000	14.25	199,500.00
ALUMINA LTD	26,200	2.82	73,884.00
BHP BILLITON LIMITED	34,100	32.20	1,098,020.00
BLUESCOPE STEEL LTD	7,300	17.16	125,268.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	15,000	3.60	54,000.00
NEWCREST MINING	7,700	18.97	146,069.00
RIO TINTO LTD	4,700	69.68	327,496.00
SOUTH32 LTD	61,000	3.39	206,790.00
CIMIC GROUP LTD	1,045	49.16	51,372.20
BRAMBLES LTD	16,000	10.89	174,240.00
AURIZON HOLDINGS LTD	19,000	4.22	80,180.00
SYDNEY AIRPORT	9,000	7.39	66,510.00
TRANSURBAN GROUP	26,000	11.63	302,380.00
TRANSURBAN GROUP-RTS	4,561	0.90	4,127.70
ARISTOCRAT LEISURE LTD	5,700	30.89	176,073.00
CROWN RESORTS LTD	4,800	14.08	67,584.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	500	53.45	26,725.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	800	58.50	46,800.00
TABCORP HOLDINGS	18,320	4.84	88,668.80
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	5,540	3.49	19,334.60
WESFARMERS LIMITED	11,700	50.86	595,062.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	13,600	28.38	385,968.00
COCA-COLA AMATIL LTD	4,300	9.38	40,334.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	9,100	19.11	173,901.00
COCHLEAR LTD	740	217.45	160,913.00
HEALTHSCOPE LTD	12,000	2.15	25,800.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	1,900	54.90	104,310.00
SONIC HEALTHCARE LTD	4,900	25.88	126,812.00

	CSL LIMITED	4,980	227.44	1,132,651.20	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	31,400	28.59	897,726.00	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	4,126	11.26	46,458.76	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	3,700	10.82	40,034.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	18,900	70.11	1,325,079.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	30,100	28.03	843,703.00	
	WESTPAC BANKING CORP	36,100	27.94	1,008,634.00	
	AMP LIMITED	31,000	3.32	102,920.00	
	CHALLENGER LIMITED	6,000	10.45	62,700.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	28,000	7.53	210,840.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	30,000	2.95	88,500.00	
	QBE INSURANCE	16,400	11.08	181,712.00	
	SUNCORP GROUP LTD	13,700	15.19	208,103.00	
	REA GROUP LTD	600	90.16	54,096.00	
	COMPUTERSHARE LTD	3,700	18.98	70,226.00	
	TELSTRA CORP LTD	42,000	3.02	126,840.00	
	TPG TELECOM LTD	4,359	8.20	35,743.80	
	AUSNET SERVICES	25,264	1.61	40,801.36	
	APA GROUP	12,700	9.90	125,730.00	
	AGL ENERGY LTD	6,500	20.04	130,260.00	
	ASX LTD	2,000	66.46	132,920.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	3,420	127.56	436,255.20	
	SEEK LTD	3,800	22.21	84,398.00	
小計	銘柄数：60			13,504,207.94	
				(1,081,011,845)	
	組入時価比率：2.3%			2.4%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	7,345	6.27	46,053.15	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	13,000	6.99	90,870.00	
	A2 MILK CO LTD	8,000	12.40	99,200.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	5,400	15.20	82,080.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	5,000	13.70	68,500.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	18,200	3.96	72,072.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	15,300	3.26	49,878.00	
小計	銘柄数：7			508,653.15	

				(37,375,833)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	29,416	90.20	2,653,323.20	
	NWS HOLDINGS LTD	19,000	14.18	269,420.00	
	MTR CORP	13,000	39.70	516,100.00	
	MINTH GROUP LTD	10,000	29.50	295,000.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES CO	18,000	47.70	858,600.00	
	LI & FUNG LTD	62,000	2.13	132,060.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	5,500	22.50	123,750.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	24,000	56.75	1,362,000.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	13,600	14.42	196,112.00	
	SANDS CHINA LTD	27,200	36.65	996,880.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	7,000	11.70	81,900.00	
	SJM HOLDINGS LIMITED	24,000	8.60	206,400.00	
	WYNN MACAU LTD	18,000	20.75	373,500.00	
	WH GROUP LIMITED	106,000	5.92	627,520.00	
	BANK OF EAST ASIA	11,540	28.15	324,851.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	39,000	37.10	1,446,900.00	
	HANG SENG BANK	7,700	205.00	1,578,500.00	
	AIA GROUP LTD	130,200	65.80	8,567,160.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	3,200	80.60	257,920.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	38,120	10.10	385,012.00	
	PCCW LTD	41,000	4.21	172,610.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	5,000	58.00	290,000.00	
	CLP HLDGS	17,000	90.25	1,534,250.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	14,500	54.90	796,050.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	101,503	15.88	1,611,867.64	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	12,800	219.80	2,813,440.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	29,416	56.25	1,654,650.00	
HANG LUNG GROUP LTD	10,000	21.20	212,000.00		
HANG LUNG PROPERTIES LTD	22,000	15.16	333,520.00		
HENDERSON LAND	16,223	39.75	644,864.25		
HYSAN DEVELOPMENT	7,000	38.95	272,650.00		
KERRY PROPERTIES	6,500	28.40	184,600.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	73,333	10.14	743,596.62		

	SINO LAND CO.LTD	31,000	13.02	403,620.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	18,000	111.30	2,003,400.00	
	SWIRE PACIFIC-A	5,000	86.25	431,250.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	10,800	29.90	322,920.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	16,200	49.75	805,950.00	
	WHARF(HOLDING)	10,200	22.00	224,400.00	
	WHEELLOCK & COMPANY LTD	8,000	48.15	385,200.00	
小計	銘柄数：40			37,093,746.71	
				(525,989,328)	
	組入時価比率：1.1%			1.2%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	18,000	3.26	58,680.00	
	KEPPEL CORP.	16,000	6.44	103,040.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	12,000	2.75	33,000.00	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	27,000	1.09	29,430.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	3,600	9.72	34,992.00	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	16,000	2.25	36,000.00	
	SATS LTD	8,000	5.04	40,320.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	81,000	1.07	86,670.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	17,000	2.76	46,920.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	1,111	30.25	33,607.75	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	86,000	0.29	24,940.00	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	17,000	3.15	53,550.00	
	DBS GROUP HLDGS	18,300	24.49	448,167.00	
	OCBC-ORD	35,450	11.10	393,495.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	14,700	26.34	387,198.00	
	VENTURE CORP LTD	3,200	17.10	54,720.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	92,000	3.16	290,720.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	6,000	7.38	44,280.00	
	CAPITALAND LIMITED	32,000	3.35	107,200.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	4,000	8.96	35,840.00	
	UOL GROUP LIMITED	3,000	6.76	20,280.00	
小計	銘柄数：21			2,363,049.75	
				(191,217,985)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	

新シケル	FRUTAROM	400	366.90	146,760.00	
	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	6,000	20.33	121,980.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	270	459.10	123,957.00	
	BANK HAPOALIM BM	14,000	25.64	358,960.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	13,000	23.10	300,300.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	1,100	64.20	70,620.00	
	NICE LTD	810	416.00	336,960.00	
	BEZEQ THE ISRAELI TELECOM CP	25,000	4.12	103,000.00	
	AZRIELI GROUP	400	186.00	74,400.00	
	小計	銘柄数：9			1,636,937.00
				(50,548,614)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				44,182,775,883	(44,182,775,883)

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2018年9月6日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	6,100	116,632.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	1,030	131,335.30	
		AMERICAN TOWER CORP	4,880	720,288.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	11,400	120,156.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	1,560	286,884.00	
		BOSTON PROPERTIES	1,660	217,543.00	
		BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	2,669	51,404.94	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	960	90,556.80	
		CROWN CASTLE INTL CORP	4,360	496,604.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	2,340	288,896.40	
		DUKE REALTY CORP	3,100	87,885.00	
		EQUINIX INC	880	378,584.80	
		EQUITY RESIDENTIAL	3,720	250,839.60	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	680	166,715.60	

	EXTRA SPACE STORAGE INC	1,110	102,541.80	
	FEDERAL REALTY INVS TRUST	780	101,501.40	
	HCP INC	4,300	114,552.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	7,700	163,548.00	
	INVITATION HOMES INC	3,000	69,720.00	
	IRON MOUNTAIN INC	3,400	124,236.00	
	KIMCO REALTY CORP	5,000	86,100.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	1,400	60,718.00	
	MACERICH CO /THE	800	45,848.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	1,420	146,984.20	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	1,700	78,132.00	
	PROLOGIS INC	7,100	477,404.00	
	PUBLIC STORAGE	1,730	373,161.00	
	REALTY INCOME CORP	3,300	193,479.00	
	REGENCY CENTERS CORP	1,400	92,232.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	1,290	202,181.70	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	3,330	607,425.30	
	SL GREEN REALTY CORP	940	96,820.00	
	UDR INC	3,400	135,932.00	
	VENTAS INC	3,500	209,790.00	
	VEREIT INC	11,100	86,802.00	
	VORNADO REALTY TRUST	1,770	135,334.20	
	WELLTOWER INC	4,230	284,552.10	
	WEYERHAEUSER CO	8,300	285,354.00	
小計	銘柄数：38	127,339	7,678,674.14	
			(854,329,284)	
	組入時価比率：1.8%		78.7%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	1,200	24,132.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	1,986	49,908.18	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	700	21,798.00	
小計	銘柄数：3	3,886	95,838.18	
			(8,092,575)	
	組入時価比率：0.0%		0.7%	
ユーロ	COVIVIO	230	20,619.50	
	GECINA SA	560	82,992.00	
	ICADE	230	19,136.00	

小計	KLEPIERRE	2,200	66,638.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	1,520	266,516.80	
	銘柄数：5	4,740	455,902.30	(59,025,670)
	組入時価比率：0.1%			5.4%
英ポンド	BRITISH LAND	9,100	56,674.80	
	HAMMERSON PLC	8,600	38,829.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	7,312	66,429.52	
	SEGRO PLC	9,360	61,027.20	
	小計	銘柄数：4	34,372	222,960.52
	組入時価比率：0.1%			3.0%
豪ドル	DEXUS	13,200	142,824.00	
	GOODMAN GROUP	17,000	179,690.00	
	GPT GROUP	15,000	77,850.00	
	LENDLEASE GROUP	6,600	129,294.00	
	MIRVAC GROUP	36,000	90,360.00	
	SCENTRE GROUP	54,000	224,640.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	25,800	107,070.00	
	VICINITY CENTRES	44,000	121,000.00	
	小計	銘柄数：8	211,600	1,072,728.00
	組入時価比率：0.2%			7.9%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	30,000	236,700.00	
	LINK REIT	22,000	1,670,900.00	
	小計	銘柄数：2	52,000	1,907,600.00
	組入時価比率：0.1%			2.5%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	34,000	93,160.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	22,154	38,769.50	
	CAPITALAND MALL TRUST	27,800	58,936.00	
	SUNTEC REIT	29,000	54,520.00	
	小計	銘柄数：4	112,954	245,385.50
	組入時価比率：0.0%			1.8%
合計			1,086,276,341	

(1,086,276,341)

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2018年 9月 6日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	1,291,485,268	-	1,290,417,400	1,067,868
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
売建	45,900,290,598	-	46,022,331,400	122,040,802
米ドル	31,146,164,820	-	31,220,525,700	74,360,880
カナダドル	1,697,376,681	-	1,688,086,400	9,290,281
ユーロ	5,638,702,500	-	5,670,786,000	32,083,500
英ポンド	3,012,533,850	-	3,018,682,200	6,148,350
スイスフラン	1,438,056,320	-	1,441,260,000	3,203,680
スウェーデンクローナ	458,836,488	-	465,053,600	6,217,112
ノルウェークローネ	127,466,850	-	127,766,000	299,150
デンマーククローネ	301,563,882	-	303,280,200	1,716,318
豪ドル	1,204,618,920	-	1,210,182,000	5,563,080
ニュージーランドドル	38,720,194	-	38,859,600	139,406
香港ドル	566,213,617	-	567,556,500	1,342,883
シンガポールドル	218,091,960	-	218,106,000	14,040
新シェケル	51,944,516	-	52,187,200	242,684
合計	-	-	-	123,108,670

(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ありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型

2018年9月28日現在

資産総額	3,531,143,007円
負債総額	13,983,927円
純資産総額（ - ）	3,517,159,080円
発行済口数	2,098,778,731口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6758円

（参考）外国株式為替ヘッジ型マザーファンド

2018年9月28日現在

資産総額	94,637,525,491円
負債総額	46,723,025,110円
純資産総額（ - ）	47,914,500,381円
発行済口数	24,924,111,067口
1口当たり純資産額（ / ）	1.9224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わないものとします。

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先

口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行なわれるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託者は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託者が必要と認め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り扱い

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

2018年10月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

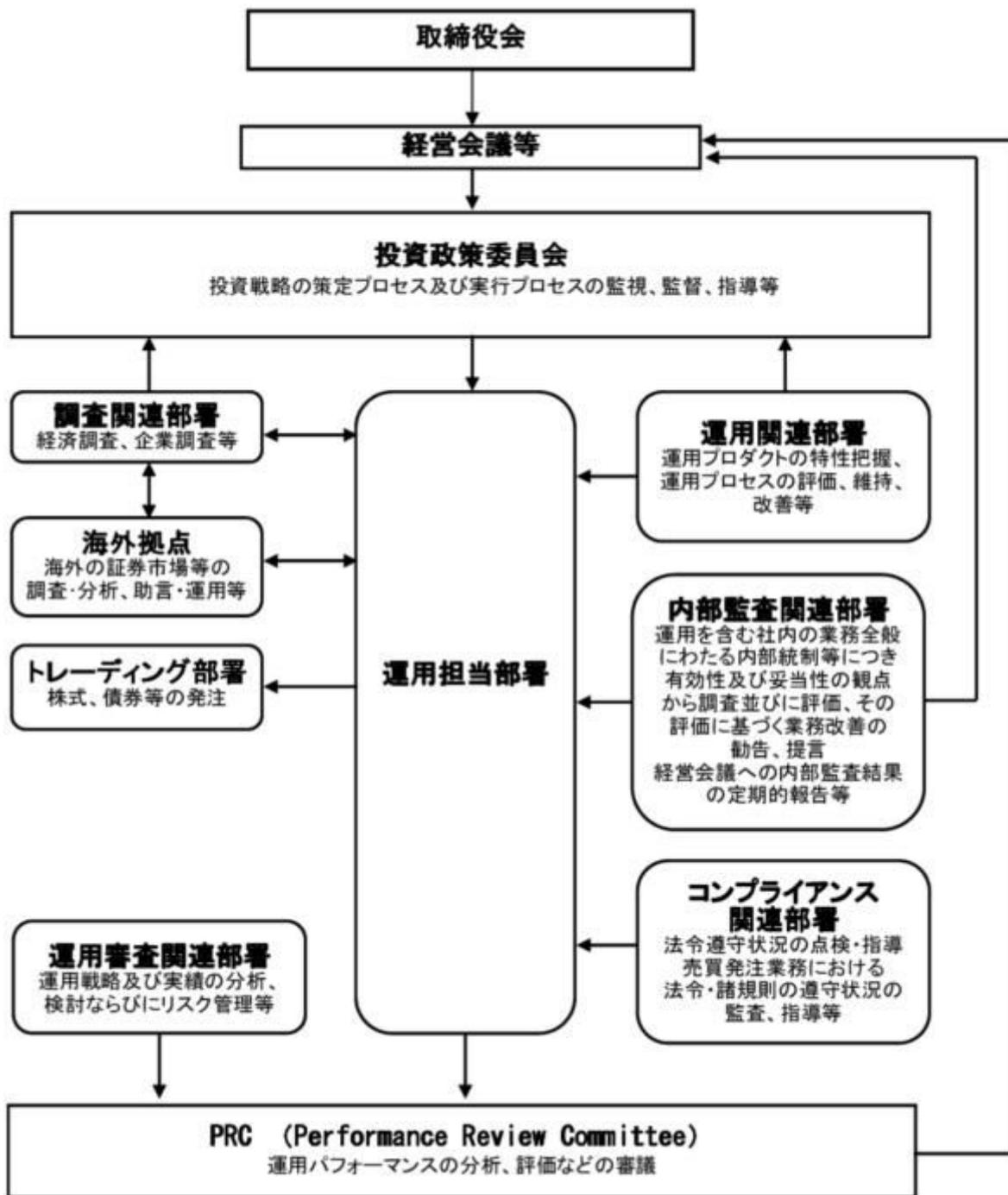
代表執行役・執行役

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

委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2018年9月28日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

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

追加型株式投資信託	1,018	28,181,711
単位型株式投資信託	130	687,711
追加型公社債投資信託	14	5,486,753
単位型公社債投資信託	401	1,760,275
合計	1,563	36,116,450

3【委託会社等の経理状況】

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

(1)【貸借対照表】

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

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

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

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

(2)【損益計算書】

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

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

(単位：百万円)

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

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

(単位：百万円)

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

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

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

(単位：百万円)

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 子会社株式及び関連会社株式 ... 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの ... 決算期末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。) 時価のないもの ... 移動平均法による原価法</p>								
2. 金銭の信託の評価基準及び評価方法	時価法								
3. 固定資産の減価償却の方法	<p>(1) 有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物(附属設備を除く)、並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。 主な耐用年数は以下の通りであります。</p> <table data-bbox="691 1384 986 1507"> <tr> <td>建物</td> <td>38～50年</td> </tr> <tr> <td>附属設備</td> <td>8～15年</td> </tr> <tr> <td>構築物</td> <td>20年</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>4～15年</td> </tr> </table> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>								

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

[未適用の会計基準等]

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

日)

(1) 概要

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

(2) 適用予定日

2019年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

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

(1) 概要

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

ステップ1：顧客との契約を識別する。

ステップ2：契約における履行義務を識別する。

ステップ3：取引価格を算定する。

ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

[表示方法の変更に関する注記]

(貸借対照表)

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

[注記事項]

貸借対照表関係

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

損益計算書関係

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

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

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当金支払額

配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2016年5月13日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

配当金の総額 34,973百万円

配当の原資 利益剰余金

1株当たり配当額 6,790円

基準日 2016年3月31日

効力発生日 2016年6月24日

配当財産が金銭以外である場合における当該財産の総額

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

普通株式の配当に関する事項

配当財産の種類 株式会社野村総合研究所の株式

配当財産の帳簿価額 3,064百万円

1株当たり配当額 594円87銭

効力発生日 2016年10月27日

配当財産の種類 株式会社ジャフコの株式

配当財産の帳簿価額 282百万円

1株当たり配当額 54円93銭

効力発生日 2016年10月27日

配当財産の種類 朝日火災海上保険株式会社の株式

配当財産の帳簿価額 87百万円

1株当たり配当額 16円89銭

効力発生日 2016年10月27日

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

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

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

(単位：百万円)

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

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

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

（1）金融商品に対する取組方針

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

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

（2）金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

（単位：百万円）

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

 その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

ます。

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 2016年 4月 1日 至 2017年 3月 31日）

1．売買目的有価証券(2017年 3月 31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2017年 3月 31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2017年 3月 31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2017年 3月 31日)

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

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

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

1．売買目的有価証券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2018年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2018年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)
1．採用している退職給付制度の概要 当社は、確定給付型の制度として確定給付型企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	18,692 百万円
勤務費用	889
利息費用	125
数理計算上の差異の発生額	464
退職給付の支払額	634
その他	8
退職給付債務の期末残高	19,546

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

年金資産の期首残高	15,764 百万円
期待運用収益	394
数理計算上の差異の発生額	468
事業主からの拠出額	507
退職給付の支払額	562
年金資産の期末残高	16,572

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

積立型制度の退職給付債務	16,578 百万円
年金資産	16,572
	5
非積立型制度の退職給付債務	2,967
未積立退職給付債務	2,973
未認識数理計算上の差異	2,992
未認識過去勤務費用	371
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352
退職給付引当金	2,947
前払年金費用	2,594
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	352

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	889 百万円
利息費用	125
期待運用収益	394
数理計算上の差異の費用処理額	412
過去勤務費用の費用処理額	40
確定給付制度に係る退職給付費用	993

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

債券	49%
株式	39%
生保一般勘定	12%
その他	0%
合計	100%

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企業年金制度の割引率	0.9%
退職一時金制度の割引率	0.6%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

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

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

税効果会計関係

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

セグメント情報等

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 2016年4月1日 至 2017年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等

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

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

ニューヨーク証券取引所に上場)

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

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

【重要な後発事象】

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

* 2018年9月末現在

(2)販売会社

(a)名称	(b)資本金の額 [*]	(c)事業の内容
野村證券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
香川証券株式会社	555百万円	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
九州 F G 証券株式会社	3,000百万円	
四国アライアンス証券株式会社	3,000百万円	
株式会社 証券ジャパン	3,000百万円	
高木証券株式会社	11,069百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
西日本シティIT証券株式会社	3,000百万円	
八十二証券株式会社	3,000百万円	
百五証券株式会社	3,000百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	

マネックス証券株式会社	12,200百万円	
丸近証券株式会社	200百万円	
山和証券株式会社	585百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
ワイエム証券株式会社	1,270百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます
株式会社池田泉州銀行	61,385百万円	
株式会社伊予銀行	20,948百万円	
株式会社大垣共立銀行	46,773百万円	
株式会社新生銀行	512,204百万円	
スルガ銀行株式会社	30,043百万円	
株式会社但馬銀行	5,481百万円	
株式会社中国銀行	15,149百万円	
株式会社筑波銀行	48,868百万円	
株式会社東京スター銀行	26,000百万円	
株式会社東邦銀行	23,519百万円	
株式会社名古屋銀行	25,090百万円	
株式会社肥後銀行	18,128百万円	
株式会社百五銀行	20,000百万円	
株式会社北越銀行	24,538百万円	
株式会社北洋銀行	121,101百万円	
株式会社北陸銀行	140,409百万円	
株式会社山梨中央銀行	15,400百万円	
株式会社琉球銀行	54,127百万円	
労働金庫連合会	120,000百万円 ¹	労働金庫法に基づき労働金庫の事業を営んでいます。
岡崎信用金庫	3,203百万円 ¹	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

* 2018年9月末現在

1 労働金庫連合会および岡崎信用金庫の資本金の額の箇所には、出資の総額を記載しております。

2【関係業務の概要】

(1)受託者

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

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1)受託者

該当事項はありません。

(2)販売会社

委託会社は、丸近証券株式会社の株式の10.9%を保有しています。

第3【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
2017年11月30日	有価証券届出書
2017年11月30日	有価証券報告書
2018年 5月24日	有価証券届出書の訂正届出書
2018年 5月24日	半期報告書

独立監査人の監査報告書

2018年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森 重 俊 寛指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 櫻 井 雄 一 郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津 村 健 二 郎

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

強調事項

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

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2018年10月26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 伊藤 志保指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 森 重俊寛

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型の2017年9月7日から2018年9月6日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、野村インデックスファンド・外国株式・為替ヘッジ型の2018年9月6日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。