

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年11月8日提出
【計算期間】	第13期(自 2019年2月19日至 2019年8月19日)
【ファンド名】	ネクストコア
【発行者名】	野村アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	C E O兼代表取締役社長 中川 順子
【本店の所在の場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	松井 秀仁
【連絡場所】	東京都中央区日本橋一丁目12番1号
【電話番号】	03-3241-9511
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

国内および外国（新興国を含む）の株式、国内および外国（新興国を含む）の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券（REIT）を実質的な主要投資対象とし、また為替予約取引等を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に運用を行なうことを基本とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」、「野村マネー マザーファンド」を親投資信託（「マザーファンド」といいます。）とするファミリーファンド方式で運用します。「実質的な主要投資対象」とは、マザーファンドを通じて投資する、主要な投資対象という意味です。

信託金の限度額

受益権の信託金限度額は、5,000億円です。ただし、受託者と合意のうえ、当該信託金限度額を変更することができます。

<商品分類>

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

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

（ネクストコア）

《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)
単位型	国内	株式
	海外	債券
		不動産投信
		その他資産 ()
追加型	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
--------	------	--------	------	-------

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

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

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

上記、商品分類及び属性区分の定義については、下記をご覧ください。

なお、下記一般社団法人投資信託協会のホームページでもご覧頂けます。

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

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

<商品分類表定義>

[単位型投信・追加型投信の区分]

- (1)単位型投信...当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われ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。

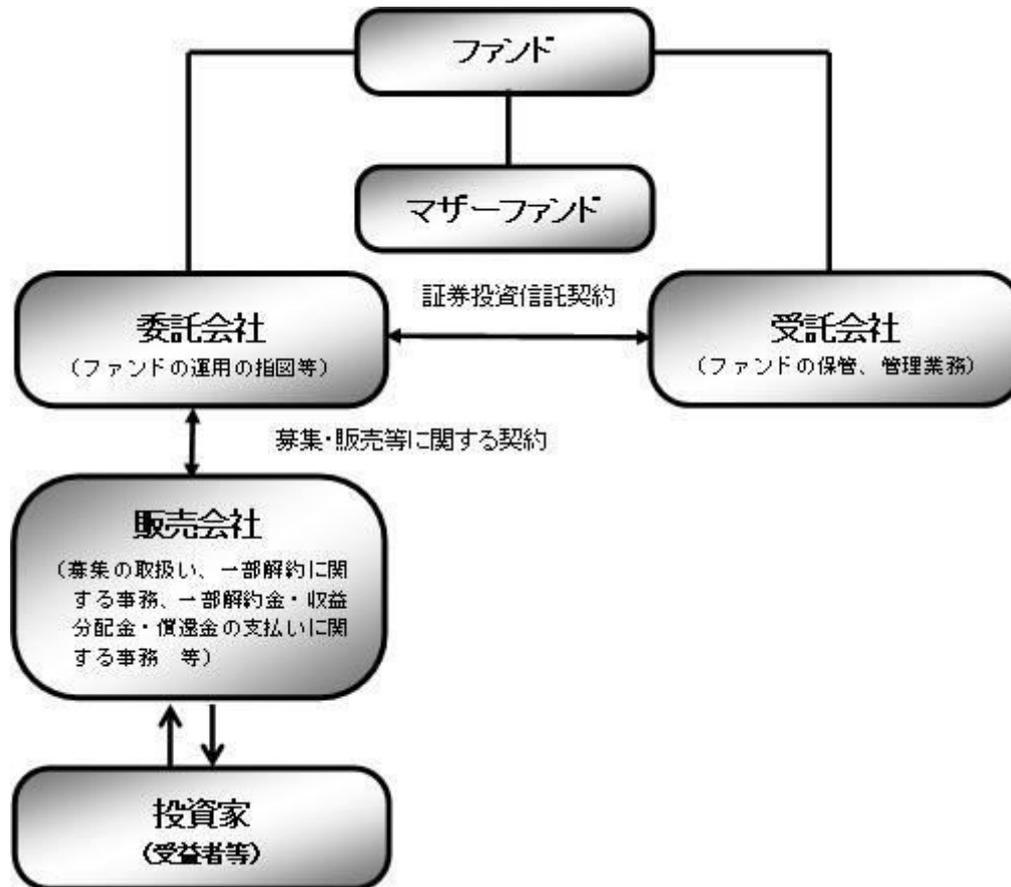
[特殊型]

- (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1月31日 信託契約締結、ファンドの設定日、運用開始

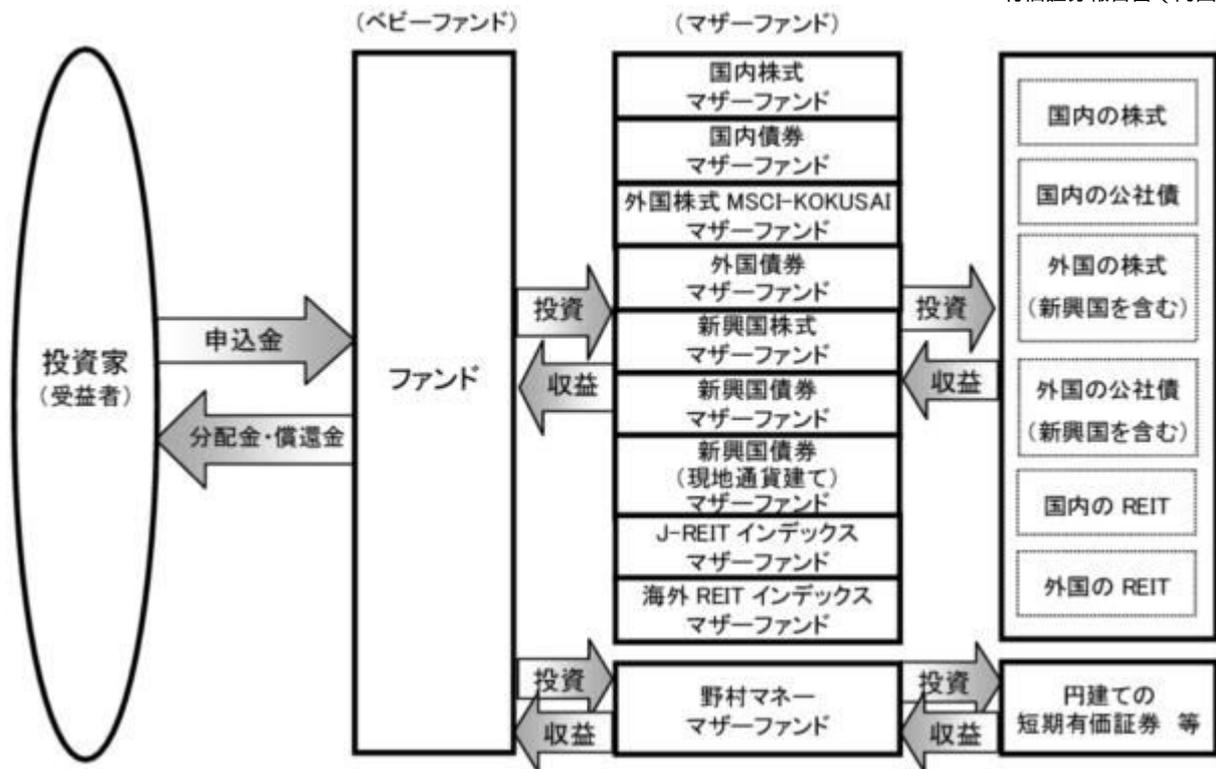
(3) 【ファンドの仕組み】



ファンド	ネクストコア
マザーファンド (親投資信託)	国内株式マザーファンド 国内債券マザーファンド 外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド 外国債券マザーファンド 新興国株式マザーファンド 新興国債券マザーファンド 新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド J-REITインデックス マザーファンド 海外REITインデックス マザーファンド 野村マネー マザーファンド
委託会社(委託者)	野村アセットマネジメント株式会社
受託会社(受託者)	野村信託銀行株式会社

《ファミリーファンド方式について》

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



ファンドは、各マザーファンドへの投資を行なうと共に、為替予約取引等を活用します。

委託会社の概況(2019年9月末現在)

- ・名称

野村アセットマネジメント株式会社

- ・本店の所在の場所

東京都中央区日本橋一丁目12番1号

- ・資本金の額

17,180百万円

- ・会社の沿革

1959年12月1日

野村証券投資信託委託株式会社として設立

1997年10月1日

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

2000年11月1日

野村アセットマネジメント株式会社に商号を変更

- ・大株主の状況

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

2【投資方針】

(1)【投資方針】

[1] 運用にあたっては、世界の様々な指標の動きを計量的なアプローチを用いて分析し、リスク水準¹を一定範囲内程度に抑えつつ効率的に収益を獲得することを目指して、各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジション²を決定します。

¹ リスク水準とは、推定されるポートフォリオの変動の大きさのことです。ファンドでは推定される基準価

額の「振れ幅」（上下変動の程度）を表しています。なお、市場環境等によってはポートフォリオのリスク水準をより引き下げた運用を行なう場合があります。

- 2 マザーファンドを通じて実質的に投資を行なう内外の株式およびREITへの投資比率、ファンドが投資する外貨建資産と為替予約取引等を加味した実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、以下の範囲内となります。

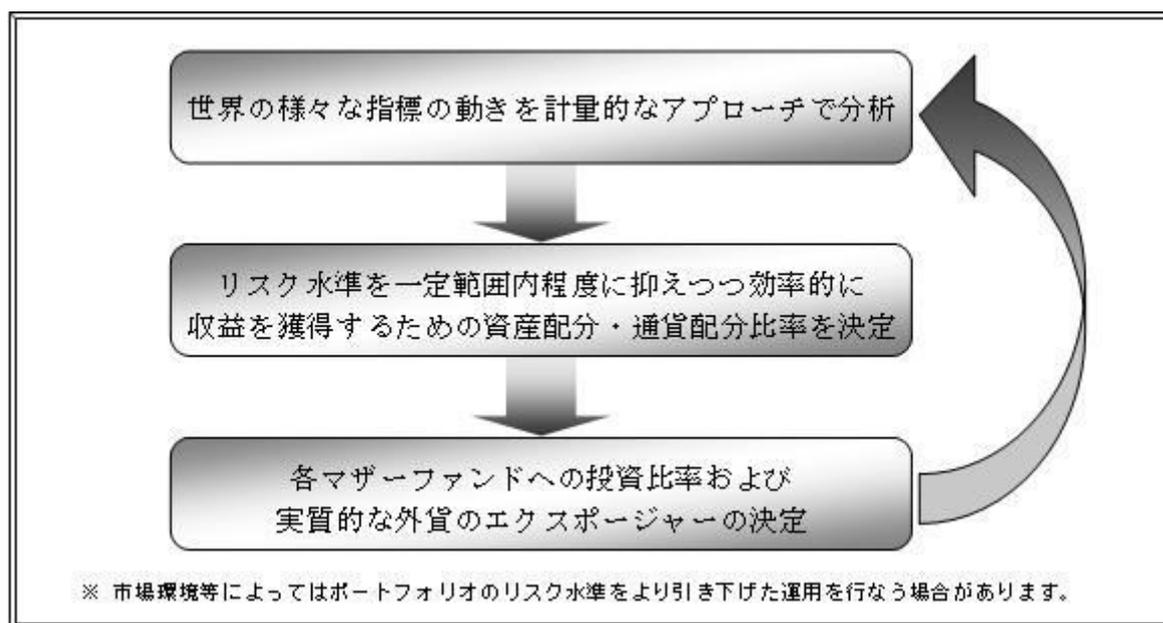
実質的な内外の株式 およびREITへの投資比率	実質的な外貨の エクスポージャー
純資産総額の50%以内	純資産総額の50%以内

各マザーファンドへの投資比率および為替予約取引等のポジションは適宜見直しを行いません。

一部のマザーファンドへの投資比率がゼロとなる場合があります。

内外の株式およびREITをそれぞれ主な投資対象とする「国内株式マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」への投資比率の合計は、原則として、信託財産の純資産総額の50%以内とします。

運用プロセスについて



- [2] 為替予約取引等の利用については、外貨建資産の為替変動リスクを回避する目的（ヘッジ目的。代替ヘッジを含みます。）のほか、効率的に収益を獲得する目的（ヘッジ目的外）で活用します。

為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額は信託財産の純資産総額の100%以内とします。

実質的な外貨のエクスポージャーは、原則として、信託財産の純資産総額の50%以内となるように調整を行いません。

各マザーファンドの投資方針等について

[国内株式マザーファンド]

- ・わが国の株式を主要投資対象とし、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。
- ・主として東京証券取引所第一部上場株式に投資することにより、東証株価指数（TOPIX）の動きに連動する投資成果を目指します。
- ・非株式割合（株式以外の資産への投資割合）は、原則として信託財産総額の50%以下を基本とします。

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

[国内債券 マザーファンド]

- ・わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI 国債指数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。

「NOMURA-BPI 国債指数」は、野村證券株式会社が公表する、国内で発行された公募利付国債の市場全体の動向を表わす投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された国債ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

[外国株式MSCI-KOKUSAI マザーファンド]

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

「MSCI-KOKUSAI 指数（円ベース・為替ヘッジなし）」は、MSCI-KOKUSAI 指数をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。
MSCI-KOKUSAI 指数は、MSCIが開発した、日本を除く先進国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[外国債券マザーファンド]

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

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

[新興国株式マザーファンド]

- ・新興国の株式（DR（預託証券））を含みます。）を主要投資対象とし、MSCIエマージング・マーケット・インデックス（配当込み・円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行いません。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

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

MSCIエマージング・マーケット・インデックスは、MSCIが開発した、新興国で構成された浮動株数ベースの時価総額株価指数です。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[新興国債券マザーファンド]

- ・新興国の公社債を主要投資対象とし、JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）の中長期的な動きを概ね捉える投資成果を目指して運用を行ないます。なお、一部ローンに投資する場合があります。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。
- ・投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）を含む市況動向や、その他資金動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（円換算ベース）は、JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus (USドルベース) をもとに、委託会社が円換算したものです。

JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス（JP Morgan Emerging Market Bond Index (EMBI) Plus）は、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、エマージング諸国が発行する米ドル建のプレディ債、ローン、ユーロボンドを対象としたインデックスであり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

[新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド]

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

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

JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス - エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイドは、J.P.Morgan Securities LLCが公表している、現地通貨建のエマージング・マーケット債で構成される時価総額加重平均指数であり、その著作権および知的財産権は同社に帰属します。

[J - REITインデックス マザーファンド]

- ・J - REIT を主要投資対象とし、東証REIT指数（配当込み）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
- ・J - REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
わが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。）とします。

「東証REIT指数(配当込み)」は、東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄に投資した場合の投資成果(市場における価格の変動と配当金の受け取りをあわせた投資成果)を表す指数です。東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄を対象とした時価総額加重平均を、2003年3月31日を1,000として指数化したものです。

[海外REITインデックス マザーファンド]

- ・日本を除く世界各国のREIT を主要投資対象とし、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
- ・REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。
- ・外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

世界の金融商品取引所に上場(これに準ずるものを含みます。)されている不動産投資信託証券(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。)とします。なお、国によっては、「不動産投資信託証券」について、「REIT」という表記を用いていない場合もありますが、当ファンドにおいては、こうした場合も含め、全て「REIT」といいます。

「S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)」は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルベース)をもとに、委託会社が独自に円換算したものです。S&P先進国REIT指数は、S&Pの持つグローバル・インデックスであるS&Pグローバル株価指数から、REIT及びREITと同様の制度に基づく銘柄を抽出して算出するインデックスで、先進国に上場する不動産投資信託(REIT)及び同様の制度に基づく銘柄の浮動株修正時価総額に基づいて毎日算出されます。同指数の構成国や構成銘柄等については定期的に見直しが行なわれますので、変動することがあります。

[野村マネー マザーファンド]

- ・本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。
- ・残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

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。

(2) 【投資対象】

国内および外国(新興国を含む)の株式、国内および外国(新興国を含む)の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券(REIT)を実質的な主要投資対象とし、為替予約取引等を主要取引対象とします。

ファンドは、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国株式マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」および「野村マネー マザーファンド」の各受益証券への投資を通じて、実質的に国内および外国(新興国を含む)の株式、国内および外国(新興国を含む)の公社債、国内および外国の不動産投資信託証券(REIT)に投資を行ないます。

各マザーファンドの主要投資対象

国内株式マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
国内債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	外国の株式を主要投資対象とします。
外国債券マザーファンド	外国の公社債を主要投資対象とします。
新興国株式マザーファンド	新興国の株式（DR（預託証書）を含みます。）を主要投資対象とします。
新興国債券マザーファンド	新興国の公社債を主要投資対象とします。
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。
J-REITインデックス マザーファンド	J-REITを主要投資対象とします。
海外REITインデックス マザーファンド	日本を除く世界各国のREITを主要投資対象とします。
野村マネー マザーファンド	円建ての短期有価証券等を主要投資対象とします。

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、）に係る権利

ハ．約束手形（イに掲げるものに該当するものを除きます。）

ニ．金銭債権（イ及びハに掲げるものに該当するものを除きます。）

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

ロ．次に掲げるものをすべてみだす資産

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

有価証券の指図範囲等(信託約款)

委託者は、信託金を、野村アセットマネジメント株式会社を委託者とし、野村信託銀行株式会社を受託者として締結された親投資信託である国内株式マザーファンド、国内債券マザーファンド、外国株式MSCI-

KOKUSAI マザーファンド、外国債券マザーファンド、新興国株式マザーファンド、新興国債券マザーファンド、新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド、J-REITインデックス マザーファンド、海外REITインデックス マザーファンドおよび野村マネー マザーファンド(以下「各マザーファンド」といいます。) 受益証券のほか、次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。) に投資することを指図します。

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

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

び第16号の証券の性質を有するものを以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲等(信託約款)

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

1. 預金
2. 指定金銭信託（上記 に掲げるものを除く。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって、金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で前号の権利の性質を有するもの
7. 日本の会社に類似した性質を有しない外国の者が発行する債務証券または証書（上記 に定める証券または証書を除きます。）
8. 流動性のあるプリファード セキュリティーズおよびこれらに類するもの（上記 第13号に定める証券または証書を除きます。なお、上記 第13号に定める証券または証書を含め、「優先証券」といいます。）
9. リミテッド・パートナーシップ、リミテッド・ライアビリティ・カンパニー、またはこれらと類似するものに対する出資持分を表象するもの、もしくは、トラストまたはこれと類似するものから利益を受ける権利を表象するものであって、流動性のある前各号および上記 各号以外のもの

その他の投資対象

1. 先物取引等
2. スワップ取引
3. 金利先渡取引¹
4. 為替先渡取引²
5. 直物為替先渡取引³

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

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

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

(参考)各マザーファンドの概要

(国内株式マザーファンド) 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

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

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資は行ないません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第16条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第17条の範囲で行ないます。

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

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

(国内債券マザーファンド) 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、NOMURA-BPI国債指数の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

わが国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主としてわが国の国債に投資することにより、NOMURA-BPI国債指数の動きに連動する投資成果を目指します。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド）

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

有価証券先物取引等は約款第17条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第18条の範囲で行ないます。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

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。

（外国債券マザーファンド） 運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

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

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

（新興国株式マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

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

2. 運用方法

(1) 投資対象

新興国の株式（DR（預託証券）を含みます。）を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

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

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

同一銘柄の株式への投資割合には制限を設けません。

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

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

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。

一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超

えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

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

（新興国債券マザーファンド）
運 用 の 基 本 方 針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1．基本方針

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

2．運用方法

(1) 投資対象

新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

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

(3) 投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

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

（新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド）

運用の基本方針

約款第14条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

現地通貨建ての新興国の公社債を主要投資対象とします。

(2)投資態度

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

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

外国為替予約取引はヘッジ目的に限定しません。

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

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(J-REITインデックス マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

2.運用方法

(1)投資対象

わが国の不動産投資信託証券(以下「J-REIT」といいます。)を主要投資対象とします。

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

(2)投資態度

J-REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への直接投資は行ないません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

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

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

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

(海外REITインデックス マザーファンド)

運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1.基本方針

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

S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、円換算ベース)は、S&P先進国REIT指数(除く日本、配当込み、ドルベース)を委託会社において円換算した指数です。

2.運用方法

(1)投資対象

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

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

(2)投資態度

REITの組入比率は原則として高位を維持することを基本とします。

外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行ないません。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3)投資制限

投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

外貨建資産への投資割合には制限を設けません。

株式への直接投資は行ないません。

不動産投信指数先物取引は約款第14条の2の範囲で行ないます。

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

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

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

(野村マネー マザーファンド)
運用の基本方針

約款第13条に基づき委託者の定める方針は、次のものとします。

1. 基本方針

この投資信託は、本邦通貨表示の公社債等に投資を行ない、安定した収益と流動性の確保を図ることを目的として運用を行ないます。

2. 運用方法

(1) 投資対象

本邦通貨表示の短期有価証券を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

残存期間の短い公社債やコマーシャル・ペーパー等の短期有価証券への投資により利息等収益の確保を図り、あわせてコール・ローンなどで運用を行なうことで流動性の確保を図ります。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資は行ないません。

外貨建資産への投資は行ないません。

有価証券先物取引等は約款第14条の範囲で行ないます。

スワップ取引は約款第15条の範囲で行ないます。

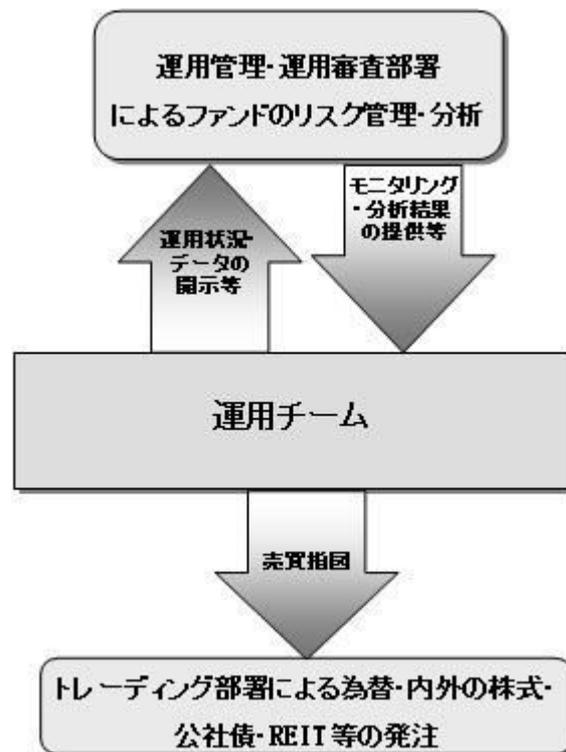
一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等（同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。）の利用は行ないません。

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポー

ジャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

(3) 【運用体制】

ファンドの運用体制は以下の通りです。

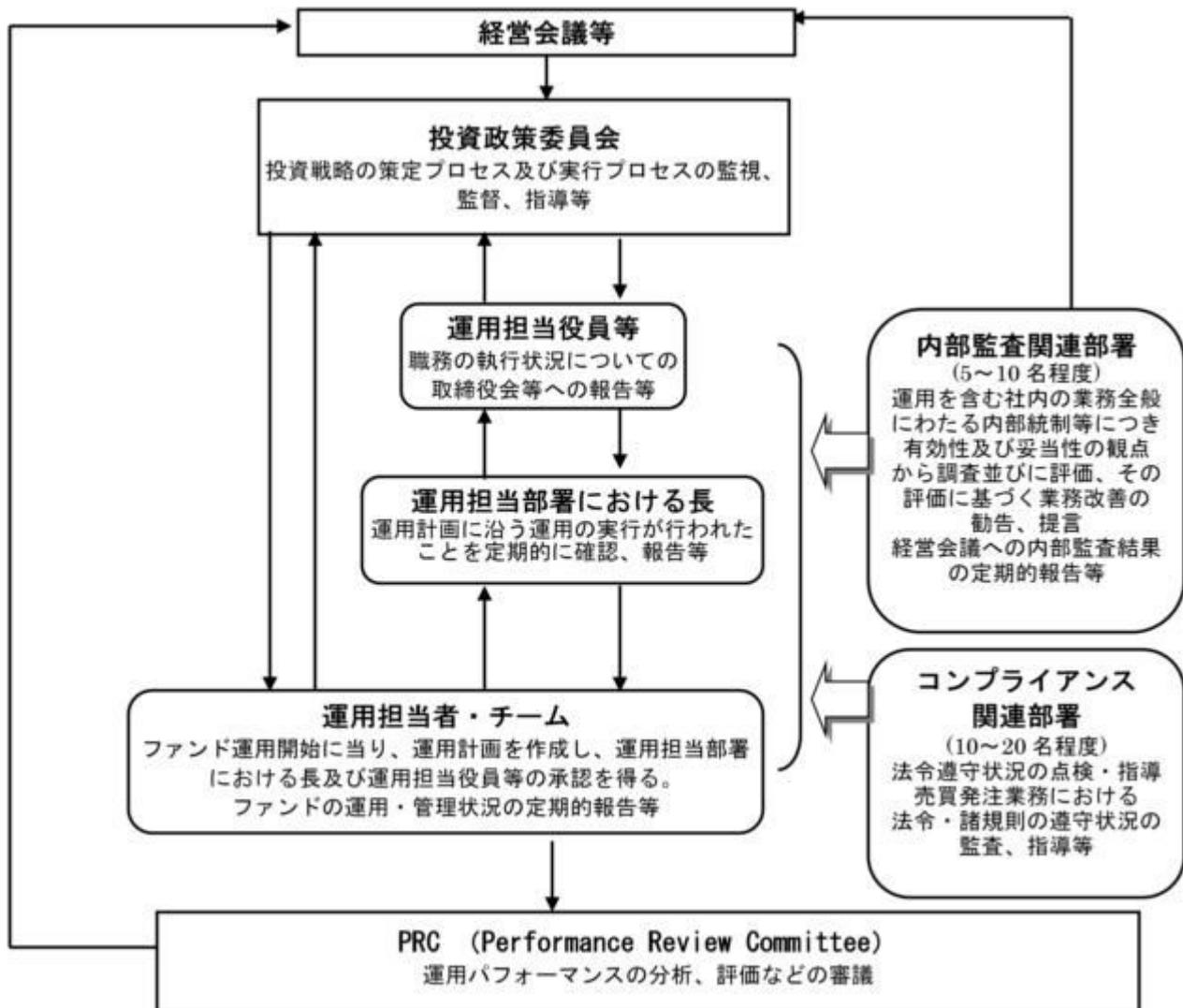


運用体制はマザーファンドを含め記載されております。

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

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

す。



委託会社によるファンドの関係法人（販売会社を除く）に対する管理体制等

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

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

ファンドの運用体制等は今後変更となる場合があります。

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行いません。

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

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

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

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

ファンドの決算日

原則として**毎年2月および8月の各17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

- ・ 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 外国為替予約取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。
- ・ 新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以内とします。
- ・ 同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。
- ・ 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。
- ・ 投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以内とします。
- ・ 一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えることとなるデリバティブ取引等(同規則に定めるデリバティブ取引等をいいます。)の利用は行ないません。
- ・ 前各号の規定にかかわらず、一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、同規則に従い当該比率以内となるよう調整を行なうこととします。

投資する株式等の範囲(信託約款)

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

信用取引の指図範囲(信託約款)

- () 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売り付けの決済については、株券の引き渡しまたは買い戻し

により行なうことの指図をすることができるものとします。

- () 上記()の信用取引の指図は、次の各号に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行なうことができるものとし、かつ次の各号に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
1. 信託財産に属する株券および新株引受権証書の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売り出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権(前号のものを除きます。)の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図(信託約款)

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

スワップ取引の運用指図(信託約款)

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

有価証券の貸付の指図および範囲(信託約款)

- () 委託者は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の各号の範囲内で貸付の指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。

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

- () 上記()に定める限度額を超えることとなった場合には、委託者は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- () 委託者は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行なうものとします。

公社債の借入れ(信託約款)

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

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限(信託約款)

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

直物為替先渡取引の運用指図(信託約款)

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

資金の借入れ(信託約款)

- () 委託者は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性をはかるため、一部解約に伴う支払資

金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行なわないものとします。

- () 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行なう日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
- () 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- () 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

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

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

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

3【投資リスク】

基準価額の変動要因

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

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

[株価変動リスク]

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

す。

[REITの価格変動リスク]

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

[債券価格変動リスク]

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

[為替変動リスク]

ファンドは、為替変動リスクの低減を図る目的（ヘッジ目的）のほか、効率的に収益を追求する目的（ヘッジ目的外）で為替予約取引等を活用しますので、為替変動の影響を受けます。特にファン

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

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

その他の留意点

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

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

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

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

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。

各マザーファンド(「野村マネー マザーファンド」を除く)が対象とするインデックスの著作権等について

国内株式マザーファンドについて

「東証株価指数(TOPIX)」

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

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

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

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

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

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

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

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

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

国内債券マザーファンドについて

「NOMURA-BPI国債指数」

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

外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンドについて

新興国株式マザーファンドについて

「MSCI-KOKUSAI指数」

「MSCIエマージング・マーケット・インデックス」

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入れる義務は一切ありません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの発行時期、発行価格または発行数量の決定について、また、本ファンドを現金に償還する方程式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本ファンドの所有者に対し、本ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCIは、自らが信頼できると考える情報源から本件指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI、MSCIの関連会社及びMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、本件指数またはそれに含まれるいかなるデータの獨創性、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。

外国債券マザーファンドについて

「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。

新興国債券マザーファンドについて

新興国債券(現地通貨建て)マザーファンドについて

「JP モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス」

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

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

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

本インデックスは、インデックス・スポンサーに帰属し、インデックス・スポンサーが一切の財産権を保持します。

JPMSLは、全米証券業者協会、ニューヨーク証券取引所及び米国証券投資家保護公社の会員です。「JPモルガン」は、ジェー・ピー・モルガン・チェース・バンク・エヌ・イー、JPMSL、ジェー・ピー・モルガン・セキュリティーズ・リミテッド(英国金融監督庁認可、ロンドン証券取引所会員)及びその投資銀行業務関連会社の投資銀行業務についてのマーケティング上の名称です。

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

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

J-REITインデックスマザーファンドについて

「東証REIT指数」

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

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

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

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

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

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

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

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

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

海外REITインデックスマザーファンドについて

「S&P先進国REIT指数」

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

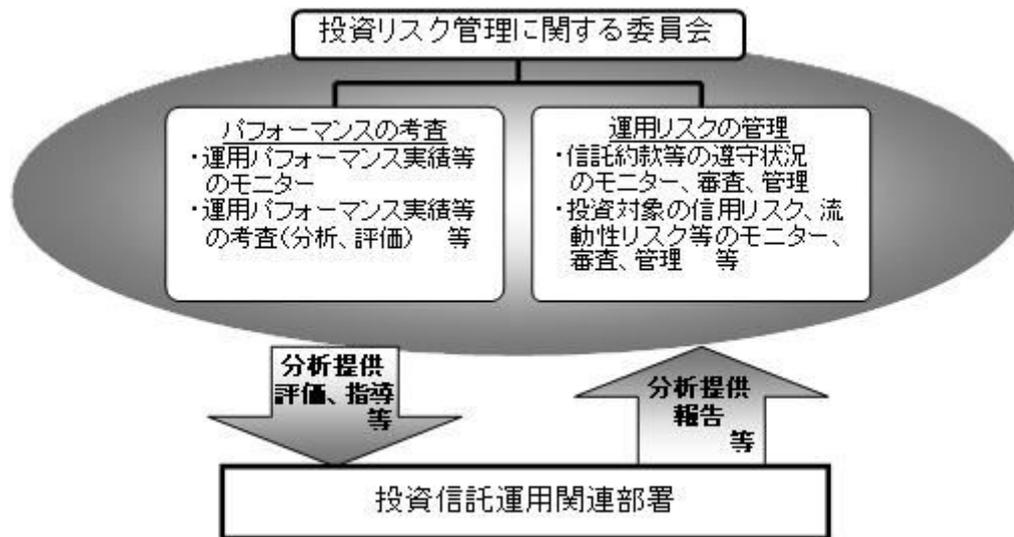
パフォーマンスの考査

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、審議を行いません。

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、適切な管理を行いません。

リスク管理体制図



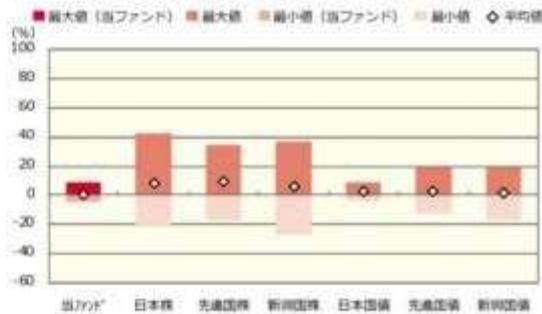
投資リスクに関する管理体制等は今後変更となる場合があります。

■ リスクの定量的比較 (2014年10月末～2019年9月末；月次)

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移



ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値 (%)	9.0	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値 (%)	△5.0	△22.0	△17.5	△27.4	△4.0	△12.3	△17.4
平均値 (%)	0.9	8.4	9.6	5.9	2.1	2.3	1.2

- * 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したものです。2014年10月末を10,000として指数化しております。
- * 年間騰落率は、2014年10月から2019年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率を表示したものです。

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

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

<代表的な資産クラスの指数>

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

■ 代表的な資産クラスの指数の著作権等について ■

- 東証株価指数（TOPIX）（配当込み）・・・東証株価指数（TOPIX）（配当込み）は、株式会社東京証券取引所（東京証券取引所）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に際して記述するいかなる損害に対しても、責任を負いません。
- MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）・・・MSCI-KOKUSAI 指数（配当込み、円ベース）、MSCI エマージング・マーケット・インデックス（配当込み、円ベース）は、MSCI が開発した指数です。同指数に対する著作権、知的財産権その他一切の権利は MSCI に帰属します。また MSCI は、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。
- NOMURA-BPI 国債・・・NOMURA-BPI 国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI 国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI 国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。
- FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）・・・FTSE 世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし、円ベース）は、FTSE Fixed Income LLC により運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数は FTSE Fixed Income LLC の知的財産であり、指数に関するすべての権利は FTSE Fixed Income LLC が有しています。
- JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）・・・「JP モルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド（円ベース）」（ここでは「指数」とよびます）についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や価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も法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JP Morgan Chase & Co. 及びその子会社（以下、JPM）がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPM やその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあります。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、または買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「JPMSLLC」と呼びます）（「指数スポンサー」）は、指数に関する証券、金融商品または取引（ここでは「プロダクト」と呼びます）についての提供、保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。JPMSLLC は NASD、NYSE、SIPC の会員です。JP Morgan 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、2.2%（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等に相当する率）（税抜2.0%）以内で販売会社が独自に定める率を乗じて得た額とします。

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

収益分配金を再投資する場合には無手数料とします。

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

（２）【換金（解約）手数料】

換金手数料はありません。

（３）【信託報酬等】

信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、ファンドの純資産総額に年1.485%（税抜年1.35%）の率を乗じた額とします。ファンドの信託報酬は、日々計上され、ファンドの基準価額に反映されます。なお、毎計算期末または信託終了のときファンドから支払われます。

信託報酬の配分については次の通り（税抜）とします。

ファンドの純資産総額	300億円以下の部分	300億円超 500億円以下の部分	500億円超の部分
委託会社	年0.65%	年0.66%	年0.67%
販売会社	年0.65%	年0.65%	年0.65%
受託会社	年0.05%	年0.04%	年0.03%

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および信託財産に属する資産のデフォルト等の発生に伴う諸費用（債権回収に要する弁護士費用等を含む。）等は、受益者の負担とし、ファンドから支払われます。

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

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

費用はファンドから支払われます。また、ファンドが投資するマザーファンドに関する有価証券の貸付に係る事務の処理に要する費用が、ファンドから実質的に支払われます。

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

(5) 【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取扱われます。

個人、法人別の課税について

個人の投資家に対する課税

< 収益分配金に対する課税 >

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

なお、配当控除は適用されません。

< 換金(解約)時および償還時の差益(譲渡益)に対する課税 >

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

損益通算について

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

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

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

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

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

法人の投資家に対する課税

分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに換金(解約)時および償還時の個別元本超過額に

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。

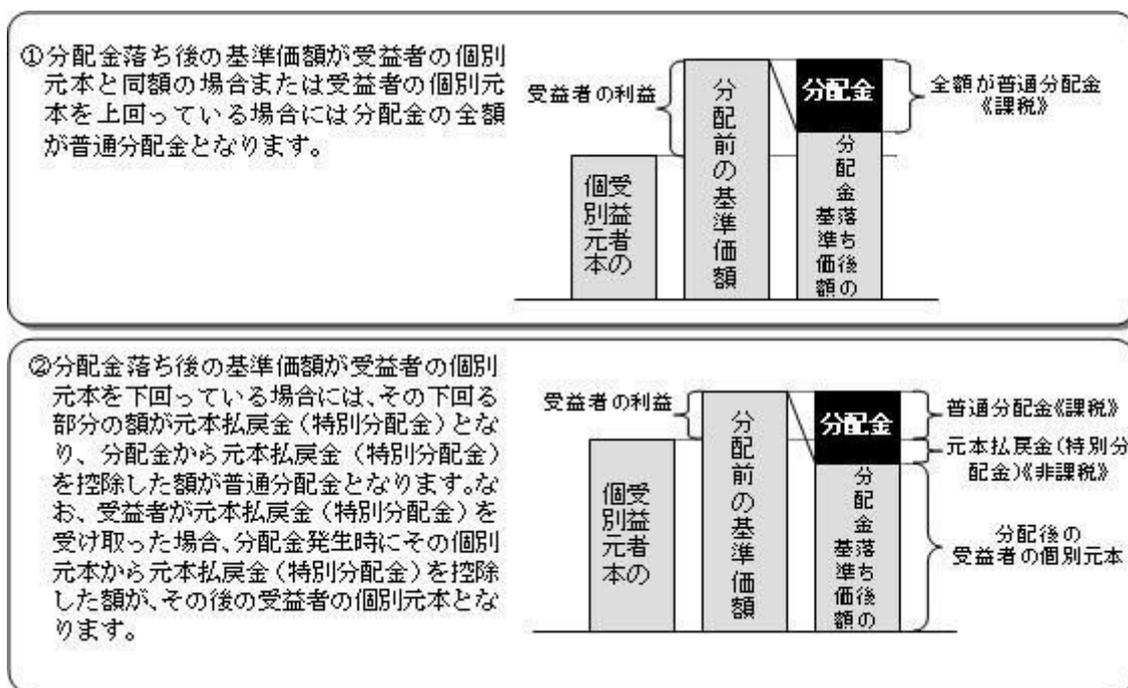
個別元本について

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。

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

* 税法が改正された場合等は、上記「(5)課税上の取扱い」の内容（2019年9月末現在）が変更になる場合があります。

5【運用状況】

以下は2019年9月30日現在の運用状況であります。

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

(1)【投資状況】

ネクストコア

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	2,156,059,777	89.17
現金・預金・その他資産(負債控除後)		261,637,206	10.82
合計(純資産総額)		2,417,696,983	100.00

(参考)国内株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	431,514,797,010	97.56
現金・預金・その他資産(負債控除後)		10,768,822,098	2.43
合計(純資産総額)		442,283,619,108	100.00

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

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

(参考)国内債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	37,495,617,110	99.12
現金・預金・その他資産(負債控除後)		332,440,150	0.87
合計(純資産総額)		37,828,057,260	100.00

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	397,135,525,430	65.81
	カナダ	22,650,264,801	3.75
	ドイツ	18,487,894,608	3.06
	イタリア	5,104,284,157	0.84
	フランス	23,811,555,739	3.94
	オランダ	8,007,949,983	1.32
	スペイン	6,309,044,415	1.04
	ベルギー	2,219,968,947	0.36
	オーストリア	486,481,154	0.08
	ルクセンブルグ	233,169,518	0.03
	フィンランド	2,144,187,892	0.35
	アイルランド	1,159,726,598	0.19
	ポルトガル	344,699,716	0.05
	イギリス	35,305,407,234	5.85
	スイス	20,573,562,270	3.40
	スウェーデン	5,598,241,437	0.92
	ノルウェー	1,423,713,456	0.23
	デンマーク	3,867,087,107	0.64
	オーストラリア	14,267,736,331	2.36
	ニュージーランド	525,013,193	0.08
香港	6,719,598,905	1.11	
シンガポール	2,484,487,313	0.41	
イスラエル	758,197,704	0.12	
	小計	579,617,797,908	96.05
投資証券	アメリカ	13,992,722,030	2.31
	カナダ	114,217,198	0.01
	フランス	646,108,161	0.10
	イギリス	384,543,316	0.06
	オーストラリア	1,168,685,460	0.19
	香港	407,725,312	0.06
	シンガポール	277,843,132	0.04
	小計	16,991,844,609	2.81
現金・預金・その他資産（負債控除後）		6,839,784,807	1.13
合計（純資産総額）		603,449,427,324	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	4,461,878,205	0.73
	買建	カナダ	243,687,695	0.04
	買建	ドイツ	745,732,974	0.12
	買建	イギリス	392,152,024	0.06
	買建	スイス	228,899,512	0.03
	買建	オーストラリア	170,776,060	0.02

（参考）外国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	アメリカ	294,280,195,402	47.36
	カナダ	11,888,956,886	1.91
	メキシコ	4,861,474,637	0.78
	ドイツ	35,442,158,953	5.70
	イタリア	57,783,267,908	9.30
	フランス	61,009,173,060	9.81
	オランダ	9,511,179,267	1.53
	スペイン	38,783,093,818	6.24
	ベルギー	15,213,255,655	2.44
	オーストリア	7,766,642,636	1.25
	フィンランド	3,237,405,165	0.52
	アイルランド	5,123,111,332	0.82
	イギリス	39,425,024,952	6.34
	スウェーデン	2,025,408,023	0.32
	ノルウェー	1,407,566,029	0.22
	デンマーク	3,241,586,472	0.52
	ポーランド	3,545,674,248	0.57
	オーストラリア	12,218,143,912	1.96
	シンガポール	2,576,372,714	0.41
	マレーシア	2,830,387,608	0.45
南アフリカ	3,327,257,802	0.53	
	小計	615,497,336,479	99.06
現金・預金・その他資産（負債控除後）		5,802,220,231	0.93
合計（純資産総額）		621,299,556,710	100.00

（参考）新興国株式マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	アメリカ	4,997,617,246	12.89

	メキシコ	915,199,033	2.36
	ブラジル	2,867,088,564	7.39
	チリ	153,773,293	0.39
	コロンビア	82,033,068	0.21
	ギリシャ	118,283,335	0.30
	イギリス	24,067,842	0.06
	トルコ	218,549,259	0.56
	チェコ	56,131,436	0.14
	ハンガリー	110,242,528	0.28
	ポーランド	374,113,055	0.96
	香港	8,086,128,896	20.85
	マレーシア	773,686,285	1.99
	タイ	1,104,046,871	2.84
	フィリピン	415,303,393	1.07
	インドネシア	787,148,324	2.03
	韓国	4,533,039,092	11.69
	台湾	4,334,179,792	11.18
	インド	3,337,158,769	8.60
	パキスタン	9,815,370	0.02
	カタール	379,366,819	0.97
	エジプト	57,094,560	0.14
	南アフリカ	1,753,366,300	4.52
	アラブ首長国連邦	249,388,197	0.64
	サウジアラビア	981,253,590	2.53
	小計	36,718,074,917	94.71
投資信託受益証券	アメリカ	961,954,093	2.48
投資証券	メキシコ	32,808,962	0.08
	南アフリカ	64,960,601	0.16
	小計	97,769,563	0.25
現金・預金・その他資産（負債控除後）		989,173,751	2.55
合計（純資産総額）		38,766,972,324	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	957,606,536	2.47

（参考）新興国債券マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
-------	------	---------	---------

国債証券	アメリカ	20,704,812,181	98.18
現金・預金・その他資産（負債控除後）		382,887,998	1.81
合計（純資産総額）		21,087,700,179	100.00

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
国債証券	メキシコ	762,707,131	9.89
	ブラジル	773,279,091	10.03
	チリ	259,501,467	3.36
	コロンビア	481,068,674	6.24
	ペルー	284,333,228	3.68
	ウルグアイ	10,167,100	0.13
	ドミニカ共和国	16,952,024	0.21
	トルコ	301,542,637	3.91
	チェコ	290,127,242	3.76
	ハンガリー	308,653,052	4.00
	ポーランド	655,424,469	8.50
	ロシア	608,983,901	7.90
	ルーマニア	196,908,849	2.55
	マレーシア	457,498,066	5.93
	タイ	726,187,542	9.42
	フィリピン	21,069,776	0.27
	インドネシア	748,124,557	9.70
	南アフリカ	651,098,133	8.44
	小計	7,553,626,939	98.01
現金・預金・その他資産（負債控除後）		153,333,780	1.98
合計（純資産総額）		7,706,960,719	100.00

（参考）J-REITインデックス マザーファンド

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

その他の資産の投資状況

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

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

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	アメリカ	22,507,477,522	74.20
	カナダ	575,312,799	1.89
	ドイツ	79,432,888	0.26
	イタリア	6,561,912	0.02
	フランス	985,051,983	3.24
	オランダ	75,272,448	0.24
	スペイン	193,560,353	0.63
	ベルギー	296,087,632	0.97
	アイルランド	72,570,970	0.23
	イギリス	1,419,443,804	4.67
	オーストラリア	1,927,318,450	6.35
	ニュージーランド	128,263,373	0.42
	香港	630,109,203	2.07
	シンガポール	1,069,601,513	3.52
	韓国	4,309,806	0.01
イスラエル	24,424,632	0.08	
	小計	29,994,799,288	98.89
現金・預金・その他資産（負債控除後）		335,986,370	1.10
合計（純資産総額）		30,330,785,658	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	269,251,766	0.88

（参考）野村マネー マザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計（円）	投資比率（％）
地方債証券	日本	1,191,912,085	14.08
特殊債券	日本	2,271,724,479	26.84
社債券	日本	1,752,396,859	20.71

コマーシャルペーパー	日本	499,996,087	5.90
現金・預金・その他資産(負債控除後)		2,744,866,663	32.44
合計(純資産総額)		8,460,896,173	100.00

(2) 【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

ネクストコア

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	親投資信託受益証券	国内債券マザーファンド	484,257,323	1.4054	680,575,242	1.3955	675,781,094	27.95
2	日本	親投資信託受益証券	外国債券マザーファンド	224,696,226	2.3107	519,205,570	2.3270	522,868,117	21.62
3	日本	親投資信託受益証券	J-REITインデックスマザーファンド	123,273,564	2.5347	312,461,503	2.6697	329,103,433	13.61
4	日本	親投資信託受益証券	新興国債券マザーファンド	89,223,308	1.8930	168,899,723	1.9082	170,255,916	7.04
5	日本	親投資信託受益証券	国内株式マザーファンド	89,594,081	1.4924	133,710,207	1.6014	143,475,961	5.93
6	日本	親投資信託受益証券	海外REITインデックスマザーファンド	47,138,857	2.3987	113,071,977	2.5229	118,926,622	4.91
7	日本	親投資信託受益証券	新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド	76,593,202	1.3274	101,669,817	1.3433	102,887,648	4.25
8	日本	親投資信託受益証券	外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	26,188,597	2.6930	70,527,237	2.7658	72,432,421	2.99
9	日本	親投資信託受益証券	野村マネーマザーファンド	19,922,154	1.0205	20,330,558	1.0204	20,328,565	0.84

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	89.17
合計	89.17

(参考) 国内株式マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	2,116,400	6,589.50	13,946,019,435	7,216.00	15,271,942,400	3.45
2	日本	株式	ソニー	電気機器	1,274,900	5,479.04	6,985,233,642	6,347.00	8,091,790,300	1.82
3	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	12,894,500	524.82	6,767,397,639	548.40	7,071,343,800	1.59
4	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,274,700	4,783.38	6,097,384,776	5,156.00	6,572,353,200	1.48
5	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,478,700	5,362.61	7,929,700,302	4,240.00	6,269,688,000	1.41

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

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.26
		建設業	2.82
		食料品	3.96
		繊維製品	0.64
		パルプ・紙	0.24
		化学	7.09
		医薬品	5.39
		石油・石炭製品	0.54
		ゴム製品	0.74
		ガラス・土石製品	0.79
		鉄鋼	0.74

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

(参考) 国内債券マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資 比率 (%)
1	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 40回	585,000,000	104.08	608,884,650	104.63	612,120,600	0.4	2025/9/20	1.61
2	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 8回	580,000,000	100.55	583,242,200	100.71	584,152,800	0.1	2021/6/20	1.54
3	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 45回	520,000,000	102.29	531,932,800	103.40	537,726,800	0.1	2026/12/20	1.42
4	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 42回	520,000,000	102.07	530,771,200	103.07	536,010,800	0.1	2026/3/20	1.41
5	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 50回	500,000,000	102.35	511,771,400	103.65	518,270,000	0.1	2028/3/20	1.37
6	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 43回	500,000,000	101.95	509,796,000	103.20	516,010,000	0.1	2026/6/20	1.36
7	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 44回	490,000,000	102.29	501,230,000	103.28	506,111,200	0.1	2026/9/20	1.33
8	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 6回	500,000,000	100.42	502,130,000	100.49	502,475,000	0.1	2020/12/20	1.32

9	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 38回	470,000,000	103.33	485,688,600	104.23	489,913,900	0.4	2025/3/20	1.29
10	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 4回	470,000,000	101.09	475,141,000	101.49	477,040,600	0.1	2022/12/20	1.26
11	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 52回	450,000,000	102.74	462,352,900	103.54	465,943,500	0.1	2028/9/20	1.23
12	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 39回	440,000,000	103.48	455,325,200	104.43	459,518,400	0.4	2025/6/20	1.21
13	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 9回	420,000,000	101.76	427,422,400	102.08	428,765,400	0.1	2024/3/20	1.13
14	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 2回	420,000,000	100.92	423,870,200	101.22	425,124,000	0.1	2022/6/20	1.12
15	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 1回	420,000,000	100.75	423,187,800	101.09	424,594,800	0.1	2022/3/20	1.12
16	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第12 9回	420,000,000	100.67	422,819,700	100.84	423,536,400	0.1	2021/9/20	1.11
17	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 6回	410,000,000	101.48	416,108,500	101.79	417,339,000	0.1	2023/6/20	1.10
18	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 41回	400,000,000	103.10	412,420,000	104.23	416,924,000	0.3	2025/12/20	1.10
19	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 0回	410,000,000	100.77	413,185,800	100.96	413,940,100	0.1	2021/12/20	1.09
20	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 35回	370,000,000	103.62	383,397,700	104.35	386,098,700	0.5	2024/9/20	1.02
21	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 3回	380,000,000	101.07	384,083,200	101.36	385,187,000	0.1	2022/9/20	1.01
22	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 46回	370,000,000	102.07	377,692,100	103.52	383,057,300	0.1	2027/3/20	1.01
23	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 47回	360,000,000	102.44	368,808,800	103.61	372,996,000	0.1	2027/6/20	0.98
24	日本	国債証券	国庫債券 利付 (2年)第40 2回	370,000,000	100.63	372,352,300	100.72	372,697,300	0.1	2021/7/1	0.98
25	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 29回	350,000,000	104.00	364,028,000	104.39	365,365,000	0.8	2023/6/20	0.96
26	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 32回	350,000,000	103.57	362,509,000	104.06	364,238,000	0.6	2023/12/20	0.96
27	日本	国債証券	国庫債券 利付 (5年)第13 8回	350,000,000	101.57	355,497,300	101.94	356,818,000	0.1	2023/12/20	0.94
28	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 34回	340,000,000	104.07	353,866,400	104.60	355,663,800	0.6	2024/6/20	0.94
29	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 53回	340,000,000	102.07	347,051,600	103.44	351,726,600	0.1	2028/12/20	0.92
30	日本	国債証券	国庫債券 利付 (10年)第3 51回	330,000,000	102.98	339,839,500	103.62	341,969,100	0.1	2028/6/20	0.90

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.12
合計	99.12

(参考)外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	アメリカ	株式	APPLE INC	コン ピュー タ・周辺 機器	674,300	20,585.77	13,880,985,700	23,615.05	15,923,631,182	2.63
2	アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフト ウェア	1,066,900	12,868.69	13,729,610,835	14,863.82	15,858,211,265	2.62
3	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	インター ネット販 売・通信 販売	61,340	192,230.36	11,791,410,750	186,210.56	11,422,155,996	1.89
4	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	352,300	18,124.96	6,385,423,928	19,112.63	6,733,380,254	1.11
5	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	45,960	126,673.73	5,821,924,641	132,211.71	6,076,450,320	1.00
6	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	475,700	10,999.84	5,232,623,959	12,704.34	6,043,455,680	1.00
7	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	インタラ クティ ブ・メ ディアお よびサー ビス	43,910	127,044.57	5,578,527,222	132,304.52	5,809,491,649	0.96
8	アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品	389,400	15,005.84	5,843,277,688	13,878.51	5,404,292,573	0.89
9	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品	449,300	10,425.49	4,684,176,597	11,726.37	5,268,660,737	0.87
10	アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO	家庭用品	367,900	11,344.94	4,173,805,975	13,443.59	4,945,898,380	0.81
11	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	情報技術 サービス	255,100	16,987.36	4,333,475,915	18,778.08	4,790,288,208	0.79
12	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	石油・ガ ス・消耗 燃料	620,700	8,626.13	5,354,243,042	7,714.12	4,788,155,277	0.79
13	アメリカ	株式	AT & T INC	各種電気 通信サー ビス	1,070,700	3,415.04	3,656,487,305	4,039.44	4,325,034,404	0.71
14	アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	各種金融 サービス	190,700	21,689.78	4,136,242,262	22,388.00	4,269,392,363	0.70
15	アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	1,325,300	2,980.40	3,949,935,523	3,167.45	4,197,824,136	0.69
16	アメリカ	株式	HOME DEPOT	専門小売 り	161,400	20,859.36	3,366,701,493	24,806.49	4,003,767,680	0.66
17	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS	各種電気 通信サー ビス	606,800	6,367.52	3,863,815,459	6,507.57	3,948,797,117	0.65
18	アメリカ	株式	MASTERCARD INC	情報技術 サービス	133,400	25,666.14	3,423,863,637	29,044.50	3,874,537,581	0.64
19	アメリカ	株式	DISNEY (WALT) CO	娯楽	264,100	12,191.45	3,219,763,783	14,025.28	3,704,077,293	0.61
20	アメリカ	株式	INTEL CORP	半導体・ 半導体製 造装置	657,000	5,748.53	3,776,787,049	5,480.17	3,600,476,683	0.59

21	アメリカ	株式	CHEVRON CORP	石油・ガス・消耗燃料	279,500	13,244.29	3,701,779,286	12,799.31	3,577,407,704	0.59
22	アメリカ	株式	COCA COLA CO	飲料	594,800	5,108.27	3,038,402,252	5,861.13	3,486,203,217	0.57
23	アメリカ	株式	WELLS FARGO CO	銀行	626,700	5,207.60	3,263,604,353	5,472.62	3,429,692,959	0.56
24	アメリカ	株式	MERCK & CO INC	医薬品	377,900	8,979.00	3,393,164,889	8,947.64	3,381,315,877	0.56
25	アメリカ	株式	CISCO SYSTEMS	通信機器	628,300	5,799.44	3,643,790,989	5,270.81	3,311,651,682	0.54
26	アメリカ	株式	BOEING CO	航空宇宙・防衛	78,450	40,973.59	3,214,378,142	41,318.25	3,241,416,807	0.53
27	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	139,500	26,583.15	3,708,349,738	23,230.85	3,240,704,858	0.53
28	スイス	株式	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	医薬品	103,120	29,851.43	3,078,280,206	31,422.76	3,240,315,836	0.53
29	アメリカ	株式	COMCAST CORP-CL A	メディア	664,800	4,343.32	2,887,440,931	4,835.89	3,214,903,129	0.53
30	アメリカ	株式	PFIZER INC	医薬品	814,900	4,538.81	3,698,679,356	3,908.86	3,185,331,970	0.52

種類別及び業種別投資比率

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	3.27
		メディア	1.27
		娯楽	1.28
		不動産管理・開発	0.50
		エネルギー設備・サービス	0.29
		石油・ガス・消耗燃料	5.25
		化学	2.23
		建設資材	0.29
		容器・包装	0.28
		金属・鉱業	1.34
		紙製品・林産品	0.08
		航空宇宙・防衛	2.42
		建設関連製品	0.39
		建設・土木	0.34
		電気設備	0.70
		コングロマリット	1.26
		機械	1.56
		商社・流通業	0.26
		商業サービス・用品	0.48
		航空貨物・物流サービス	0.48
旅客航空輸送業	0.09		
海運業	0.04		
陸運・鉄道	1.05		
運送インフラ	0.21		
自動車部品	0.28		
自動車	0.78		

家庭用耐久財	0.37
レジャー用品	0.04
繊維・アパレル・贅沢品	1.46
ホテル・レストラン・レジャー	1.86
販売	0.06
インターネット販売・通信販売	2.49
複合小売り	0.53
専門小売り	1.73
食品・生活必需品小売り	1.57
飲料	2.10
食品	2.07
タバコ	0.79
家庭用品	1.47
パーソナル用品	0.74
ヘルスケア機器・用品	2.79
ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	1.75
バイオテクノロジー	1.78
医薬品	5.34
銀行	7.80
各種金融サービス	0.94
保険	3.92
情報技術サービス	4.14
ソフトウェア	5.16
通信機器	0.84
コンピュータ・周辺機器	2.91
電子装置・機器・部品	0.52
半導体・半導体製造装置	3.03
各種電気通信サービス	2.17
無線通信サービス	0.29
電力	2.16
ガス	0.21
総合公益事業	1.11
水道	0.09
消費者金融	0.49
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	0.11
ヘルスケア・テクノロジー	0.10
ライフサイエンス・ツール/サービス	0.76
専門サービス	0.76
投資証券	2.81
合計	98.86

(参考) 外国債券マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	72,200,000	13,320.11	9,617,123,090	13,672.11	9,871,267,030	6	2026/2/15	1.58
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	80,000,000	10,954.68	8,763,747,980	11,001.51	8,801,212,710	2.5	2022/1/15	1.41
3	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,737.19	7,548,248,834	11,196.70	7,871,280,100	2.25	2025/11/15	1.26
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,800,000	10,855.47	7,685,677,204	10,890.22	7,710,278,159	2.625	2020/11/15	1.24
5	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	70,300,000	10,645.29	7,483,642,885	10,836.68	7,618,189,805	1.75	2022/4/30	1.22
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	40,400,000	13,345.82	5,391,713,444	14,062.48	5,681,242,351	5.25	2028/11/15	0.91
7	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	48,800,000	11,041.82	5,388,411,620	11,064.75	5,399,598,260	3.625	2021/2/15	0.86
8	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,400,000	10,088.48	4,681,056,857	11,611.51	5,387,744,120	2.5	2045/2/15	0.86
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	47,900,000	10,605.66	5,080,115,242	10,851.86	5,198,041,450	1.75	2023/1/31	0.83
10	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	46,900,000	10,620.00	4,980,781,172	11,023.85	5,170,189,667	2	2025/2/15	0.83
11	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000	14,744.23	5,027,785,363	14,983.22	5,109,281,123	3.5	2026/4/25	0.82
12	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	45,100,000	10,841.64	4,889,581,083	11,197.54	5,050,091,828	2.375	2024/8/15	0.81
13	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	35,600,000	13,402.31	4,771,224,140	14,144.26	5,035,358,340	5.25	2029/2/15	0.81
14	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	45,400,000	10,976.80	4,983,469,726	11,036.08	5,010,382,019	3.125	2021/5/15	0.80
15	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000	17,862.32	4,822,828,290	18,479.61	4,989,497,078	5.5	2029/4/25	0.80
16	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	38,800,000	12,539.79	4,865,441,567	12,689.87	4,923,670,943	6.25	2023/8/15	0.79
17	イギリス	国債証券	UK TREASURY	23,600,000	18,382.87	4,338,357,933	20,823.04	4,914,237,841	3.5	2045/1/22	0.79
18	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	34,100,000	13,845.79	4,721,417,190	14,342.82	4,890,901,802	6.5	2026/11/15	0.78
19	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	32,700,000	14,348.27	4,691,884,593	14,888.74	4,868,619,146	5.375	2031/2/15	0.78
20	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	42,700,000	10,703.50	4,570,396,892	11,078.66	4,730,588,888	2.125	2024/9/30	0.76
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	36,900,000	11,076.97	4,087,404,037	12,678.07	4,678,207,961	3	2044/11/15	0.75
22	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,100,000	19,716.90	4,357,436,023	20,982.12	4,637,049,998	5.75	2032/10/25	0.74
23	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	41,100,000	11,165.94	4,589,202,687	11,263.30	4,629,218,793	2.75	2023/7/31	0.74
24	イギリス	国債証券	UK TSY 3 1/4% 2044	23,000,000	17,559.84	4,038,764,082	19,831.84	4,561,324,902	3.25	2044/1/22	0.73
25	イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	30,400,000	13,480.24	4,097,994,298	13,814.24	4,199,529,264	5.5	2022/11/1	0.67
26	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,700,000	17,229.04	3,566,411,564	20,156.73	4,172,443,155	3.25	2045/5/25	0.67
27	フランス	国債証券	FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,300,000	14,250.91	4,175,518,095	14,210.78	4,163,760,943	4.25	2023/10/25	0.67
28	アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	28,300,000	13,516.13	3,825,066,507	14,212.55	4,022,153,873	5.5	2028/8/15	0.64
29	ドイツ	国債証券	BUNDESREP. DEUTSCHLAND	21,500,000	18,380.64	3,951,838,683	18,569.62	3,992,468,485	6.5	2027/7/4	0.64
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B	35,000,000	10,980.01	3,843,005,623	11,377.97	3,982,289,873	2.625	2025/3/31	0.64

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	99.06
合計	99.06

(参考) 新興国株式マザーファンド

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
1	香港	株式	TENCENT HOLDINGS LTD	インタラクティブ・メディアおよびサービス	373,100	5,131.04	1,914,393,382	4,532.54	1,691,092,166	4.36
2	アメリカ	株式	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	インターネット販売・通信販売	93,060	19,132.46	1,780,466,785	17,912.56	1,666,942,982	4.29
3	台湾	株式	TAIWAN SEMICONDUCTOR	半導体・半導体製造装置	1,610,000	889.48	1,432,077,263	946.56	1,523,961,600	3.93
4	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS	コンピュータ・周辺機器	312,780	3,832.38	1,198,694,874	4,351.16	1,360,955,825	3.51
5	アメリカ	投資信託受益証券	XTRACKERS HARVEST CSI300 CHINA A-SHS ETF		330,500	2,887.25	954,239,285	2,910.60	961,954,093	2.48
6	香港	株式	CHINA CONSTRUCTION BANK-H	銀行	6,323,000	88.30	558,356,608	81.45	515,066,522	1.32
7	南アフリカ	株式	NASPERS LTD-N SHS	インターネット販売・通信販売	28,983	17,713.84	513,400,456	16,515.05	478,655,798	1.23
8	香港	株式	PING AN INSURANCE GROUP CO-H	保険	365,000	1,197.28	437,010,521	1,236.33	451,262,640	1.16
9	インド	株式	RELIANCE INDUSTRIES LIMITED	石油・ガス・消耗燃料	188,200	1,939.09	364,936,989	2,015.93	379,399,343	0.97
10	香港	株式	CHINA MOBILE LTD	無線通信サービス	401,500	997.38	400,450,709	880.64	353,576,960	0.91
11	インド	株式	HOUSING DEVELOPMENT FINANCE	貯蓄・抵当・不動産金融	108,000	2,982.82	322,144,883	3,135.28	338,610,888	0.87

12	香港	株式	IND & COMM BK OF CHINA-H	銀行	4,302,000	75.67	325,561,518	71.41	307,224,749	0.79
13	ブラジル	株式	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-PREF	銀行	320,591	848.21	271,928,510	922.00	295,586,024	0.76
14	インド	株式	INFOSYS LTD	情報技術 サービス	225,200	1,110.27	250,033,935	1,204.58	271,273,218	0.69
15	アメリカ	株式	PJSC GAZPROM-ADR	石油・ガ ス・消耗燃 料	352,500	553.19	195,001,854	764.07	269,335,944	0.69
16	韓国	株式	SK HYNIX INC	半導体・半 導体製造装 置	36,150	6,778.58	245,045,775	7,317.86	264,540,639	0.68
17	アメリカ	株式	PJSC SBERBANK OF RUSSIA	銀行	686,300	382.46	262,487,026	380.84	261,374,913	0.67
18	ブラジル	株式	VALE SA	金属・鉱業	210,021	1,260.91	264,818,305	1,236.77	259,749,142	0.67
19	アメリカ	株式	LUKOIL PJSC-SPON ADR	石油・ガ ス・消耗燃 料	26,080	8,690.60	226,651,037	9,119.23	237,829,779	0.61
20	ブラジル	株式	BANCO BRADESCO SA - PREF	銀行	259,415	909.81	236,020,850	895.27	232,247,764	0.59
21	香港	株式	BANK OF CHINA LTD-H	銀行	5,271,000	47.87	252,355,383	41.96	221,213,328	0.57
22	台湾	株式	HON HAI PRECISION INDUSTRY	電子装置・ 機器・部品	805,649	290.56	234,090,433	254.73	205,227,804	0.52
23	アメリカ	株式	BAIDU INC - SPON ADR	インタラク ティブ・メ ディアおよ びサービス	17,910	16,719.37	299,443,970	10,922.58	195,623,465	0.50
24	香港	株式	CNOOC LTD	石油・ガ ス・消耗燃 料	1,188,000	182.17	216,428,410	164.56	195,508,685	0.50
25	ブラジル	株式	PETROBRAS-PETROLEO BRAS-PR	石油・ガ ス・消耗燃 料	271,600	695.66	188,943,299	717.77	194,948,233	0.50
26	韓国	株式	SAMSUNG ELECTRONICS PFD	コンピュー タ・周辺機 器	53,300	3,126.03	166,617,682	3,533.07	188,312,631	0.48
27	インド	株式	TATA CONSULTANCY SVS LTD	情報技術 サービス	58,300	3,339.20	194,675,509	3,166.47	184,605,259	0.47
28	メキシコ	株式	AMERICA MOVIL SAB DE C-SER L	無線通信 サービス	2,183,000	74.31	162,223,589	79.13	172,743,410	0.44
29	カタール	株式	QATAR NATIONAL BANK	銀行	301,600	542.45	163,603,612	566.97	170,999,962	0.44
30	ブラジル	株式	AMBEV SA	飲料	315,156	455.86	143,667,552	504.72	159,067,900	0.41

種類別及び業種別投資比率

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国外	インタラクティブ・メディアおよびサービス	5.69
		メディア	0.30
		娯楽	0.70
		不動産管理・開発	2.37
		エネルギー設備・サービス	0.08
		石油・ガス・消耗燃料	7.36
		化学	2.47
		建設資材	1.14
		容器・包装	0.04
		金属・鉱業	3.13
		紙製品・林産品	0.21
		航空宇宙・防衛	0.13
		建設関連製品	0.01
		建設・土木	0.63
		電気設備	0.20
		コングロマリット	1.31
		機械	0.52
		商社・流通業	0.04
		商業サービス・用品	0.16
		航空貨物・物流サービス	0.17
		旅客航空輸送業	0.23
		海運業	0.09
		陸運・鉄道	0.34
		運送インフラ	0.93
		自動車部品	0.50
		自動車	1.77
		家庭用耐久財	0.30
		レジャー用品	0.06
		繊維・アパレル・贅沢品	0.89
		ホテル・レストラン・レジャー	0.71
インターネット販売・通信販売	6.58		
複合小売り	0.58		
専門小売り	0.51		

	食品・生活必需品小売り	1.80
	飲料	1.14
	食品	1.91
	タバコ	0.49
	家庭用品	0.49
	パーソナル用品	0.62
	ヘルスケア機器・用品	0.10
	ヘルスケア・プロバイダー/ヘルスケア・サービス	0.52
	バイオテクノロジー	0.33
	医薬品	1.12
	銀行	16.43
	各種金融サービス	0.69
	保険	3.73
	情報技術サービス	1.69
	ソフトウェア	0.13
	通信機器	0.05
	コンピュータ・周辺機器	4.92
	電子装置・機器・部品	1.89
	半導体・半導体製造装置	5.70
	各種電気通信サービス	1.61
	無線通信サービス	2.80
	電力	1.17
	ガス	0.63
	総合公益事業	0.05
	水道	0.26
	貯蓄・抵当・不動産金融	0.92
	消費者金融	0.29
	資本市場	1.27
	各種消費者サービス	0.60
	独立系発電事業者・エネルギー販売業者	0.54
	ヘルスケア・テクノロジー	0.05
	ライフサイエンス・ツール/サービス	0.28
	専門サービス	0.02
	その他の業種	0.00
投資信託受益証券		2.48
投資証券		0.25

合 計	97.44
-----	-------

(参考)新興国債券マザーファンド

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

27	アメリカ	国債証券	COLOMBIA GLOBAL	1,220,000	14,010.71	170,930,711	15,378.70	187,620,237	7.375	2037/9/18	0.88
28	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	1,320,000	12,779.93	168,695,148	14,083.66	185,904,417	6.125	2041/1/18	0.88
29	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF INDONESIA	1,400,000	11,740.59	164,368,333	13,229.35	185,210,938	5.25	2047/1/8	0.87
30	アメリカ	国債証券	REPUBLIC OF TURKEY	1,600,000	11,299.00	180,784,130	11,512.32	184,197,165	7.625	2029/4/26	0.87

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.18
合計	98.18

(参考)新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	9,140,000,000	3.86	352,866,884	3.97	363,422,377	9.85	2027/6/28	4.71
2	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	9,200,000	2,704.58	248,822,042	2,707.00	249,044,734	1.75	2021/7/25	3.23
3	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000	2,802.85	170,989,981	2,950.28	179,967,279	10	2023/1/1	2.33
4	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5,500,000	2,739.25	150,659,256	2,836.78	156,023,010	2.75	2028/4/25	2.02
5	ポーランド	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5,600,000	2,748.42	153,911,856	2,781.18	155,746,577	2.5	2024/4/25	2.02
6	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	380,000	2,866.51	108,935,887	3,111.42	118,234,327	10	2027/1/1	1.53
7	南アフリカ	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	13,300,000	793.74	105,567,892	795.96	105,863,158	10.5	2026/12/21	1.37
8	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	376,000	2,756.81	103,657,340	2,808.93	105,615,786	10	2021/1/1	1.37
9	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	59,000,000	163.18	96,279,917	175.21	103,375,670	7.75	2026/9/16	1.34
10	ブラジル	国債証券	NOTA DO TESOURO NACIONAL	311,000	2,897.18	90,105,844	3,040.93	94,572,963	10	2025/1/1	1.22
11	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	20,900,000	433.96	90,699,145	449.53	93,952,442	1	2026/6/26	1.21
12	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	20,200,000	408.55	82,527,190	438.90	88,658,366	0.95	2030/5/15	1.15
13	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	4,000,000	2,129.51	85,180,783	2,191.19	87,647,890		2022/1/1	1.13
14	マレーシア	国債証券	MALAYSIA GOVERNMENT	3,300,000	2,571.28	84,852,416	2,652.08	87,518,933	3.899	2027/11/16	1.13
15	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000	376.57	81,716,561	382.74	83,056,013	3.625	2023/6/16	1.07
16	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,000,000	353.29	81,257,013	358.96	82,561,207	1.875	2022/6/17	1.07
17	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000	349.31	75,801,047	370.66	80,434,822	2.125	2026/12/17	1.04
18	ロシア	国債証券	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	48,000,000	155.83	74,799,932	165.03	79,217,059	6.5	2024/2/28	1.02
19	メキシコ	国債証券	MEXICAN FIXED RATE BONDS	13,500,000	543.92	73,429,589	574.71	77,586,525	8	2023/12/7	1.00
20	チェコ	国債証券	CZECH REPUBLIC	17,200,000	432.75	74,433,613	443.03	76,201,924	0.45	2023/10/25	0.98

21	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,230,000,000	0.77	71,510,274	0.80	74,608,010	8.375	2024/3/15	0.96
22	タイ	国債証券	THAILAND GOVERNMENT BOND	18,500,000	375.22	69,416,220	396.20	73,297,973	2.875	2028/12/17	0.95
23	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000	2,581.28	72,275,966	2,603.34	72,893,708	3.62	2021/11/30	0.94
24	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,500,000	2,029.65	71,038,085	2,058.09	72,033,456		2023/7/1	0.93
25	コロンビア	国債証券	REPUBLIC OF COLOMBIA	2,160,000,000	3.25	70,369,852	3.25	70,266,875	7.75	2021/4/14	0.91
26	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	8,680,000,000	0.77	67,482,783	0.80	69,794,144	8.375	2034/3/15	0.90
27	マレーシア	国債証券	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000	2,627.14	68,305,792	2,676.55	69,590,502	4.181	2024/7/15	0.90
28	インドネシア	国債証券	INDONESIA GOVERNMENT	9,150,000,000	0.71	65,218,249	0.75	68,915,531	7	2027/5/15	0.89
29	ブラジル	国債証券	LETRA TESOURO NACIONAL	3,100,000	2,156.15	66,840,687	2,186.31	67,775,650		2022/7/1	0.87
30	メキシコ	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,000,000	477.23	62,040,345	520.38	67,650,216	5.75	2026/3/5	0.87

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	98.01
合計	98.01

(参考) J - R E I Tインデックス マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	日本	投資証券	日本ビルファンド投資法人 投資証券	4,001	751,959	3,008,591,319	830,000	3,320,830,000	7.05
2	日本	投資証券	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	4,132	657,808	2,718,064,639	725,000	2,995,700,000	6.36
3	日本	投資証券	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	12,885	167,758	2,161,563,376	195,200	2,515,152,000	5.34
4	日本	投資証券	オリックス不動産投資法人 投資証券	8,233	198,821	1,636,894,280	236,000	1,942,988,000	4.12
5	日本	投資証券	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,277	178,478	1,655,748,291	207,000	1,920,339,000	4.07
6	日本	投資証券	日本リテールファンド投資法人 投資証券	7,809	218,637	1,707,341,096	228,600	1,785,137,400	3.79
7	日本	投資証券	日本プロロジスリート投資法人 投資証券	5,936	233,631	1,386,837,889	296,100	1,757,649,600	3.73
8	日本	投資証券	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,570	258,248	1,438,446,094	304,000	1,693,280,000	3.59
9	日本	投資証券	G L P投資法人 投資証券	10,291	118,572	1,220,224,863	143,400	1,475,729,400	3.13
10	日本	投資証券	アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,919	318,496	1,248,186,451	355,000	1,391,245,000	2.95
11	日本	投資証券	日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,615	472,273	1,234,994,025	513,000	1,341,495,000	2.84
12	日本	投資証券	インヴィンシブル投資法人 投資証券	18,124	60,024	1,087,875,700	66,700	1,208,870,800	2.56
13	日本	投資証券	積水ハウス・リート投資法人 投資証券	12,081	78,460	947,881,783	96,900	1,170,648,900	2.48

14	日本	投資証券	アクティブ・プロパティーズ投資法人 投資証券	2,070	472,179	977,411,627	552,000	1,142,640,000	2.42
15	日本	投資証券	ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,278	754,448	964,184,774	854,000	1,091,412,000	2.31
16	日本	投資証券	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,310	87,627	1,166,318,963	80,600	1,072,786,000	2.27
17	日本	投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人 投資証券	1,373	591,249	811,785,439	673,000	924,029,000	1.96
18	日本	投資証券	森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,754	152,359	724,315,541	171,600	815,786,400	1.73
19	日本	投資証券	大和証券オフィス投資法人 投資証券	954	763,728	728,597,275	839,000	800,406,000	1.70
20	日本	投資証券	産業ファンド投資法人 投資証券	5,084	130,453	663,224,475	155,200	789,036,800	1.67
21	日本	投資証券	日本ロジスティクスファンド投資法人 投資証券	2,700	247,737	668,891,061	267,400	721,980,000	1.53
22	日本	投資証券	ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,514	184,626	648,775,974	198,600	697,880,400	1.48
23	日本	投資証券	フロンティア不動産投資法人 投資証券	1,468	467,145	685,769,476	460,500	676,014,000	1.43
24	日本	投資証券	イオンリート投資法人 投資証券	4,459	136,437	608,373,563	148,900	663,945,100	1.41
25	日本	投資証券	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,700	160,909	595,365,520	176,400	652,680,000	1.38
26	日本	投資証券	日本リート投資法人 投資証券	1,342	421,984	566,303,588	451,500	605,913,000	1.28
27	日本	投資証券	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 投資証券	1,720	300,814	517,401,232	347,000	596,840,000	1.26
28	日本	投資証券	ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,842	128,702	494,474,082	154,800	594,741,600	1.26
29	日本	投資証券	プレミアム投資法人 投資証券	3,732	136,852	510,734,574	158,600	591,895,200	1.25
30	日本	投資証券	MCUBS MidCity投資法人 投資証券	4,901	105,057	514,886,464	118,700	581,748,700	1.23

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	96.93
合計	96.93

(参考) 海外REITインデックス マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
1	アメリカ	投資証券	PROLOGIS INC	132,150	8,496.90	1,122,866,197	9,257.37	1,223,362,450	4.03
2	アメリカ	投資証券	EQUINIX INC	17,760	61,214.14	1,087,163,182	62,228.83	1,105,184,028	3.64
3	アメリカ	投資証券	SIMON PROPERTY GROUP INC	64,310	17,531.42	1,127,445,807	17,047.04	1,096,295,348	3.61
4	アメリカ	投資証券	PUBLIC STORAGE	31,460	26,558.54	835,531,771	26,441.47	831,848,936	2.74
5	アメリカ	投資証券	WELLTOWER INC	84,640	9,045.91	765,645,948	9,744.09	824,740,353	2.71
6	アメリカ	投資証券	EQUITY RESIDENTIAL	73,060	8,472.23	618,981,441	9,308.10	680,049,786	2.24
7	アメリカ	投資証券	AVALONBAY COMMUNITIES INC	29,270	22,593.23	661,304,115	23,124.01	676,840,019	2.23
8	アメリカ	投資証券	VENTAS INC	78,100	7,085.32	553,363,577	7,948.30	620,762,855	2.04
9	アメリカ	投資証券	DIGITAL REALTY TRUST INC	43,680	12,605.27	550,598,214	13,905.49	607,391,891	2.00
10	アメリカ	投資証券	REALTY INCOME CORP	66,700	7,852.73	523,777,417	8,323.86	555,202,102	1.83
11	香港	投資証券	LINK REIT	439,600	1,326.03	582,923,003	1,177.85	517,785,498	1.70
12	アメリカ	投資証券	ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,790	32,224.35	444,373,788	35,219.69	485,679,553	1.60

13	フランス	投資証券	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	28,880	15,944.09	460,465,327	15,531.43	448,547,756	1.47
14	アメリカ	投資証券	BOSTON PROPERTIES	30,170	14,626.99	441,296,298	14,042.55	423,663,746	1.39
15	アメリカ	投資証券	HCP INC	103,100	3,456.01	356,315,039	3,833.31	395,215,127	1.30
16	アメリカ	投資証券	ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	23,810	16,239.67	386,666,676	16,523.63	393,427,659	1.29
17	アメリカ	投資証券	WP CAREY INC	35,870	9,216.96	330,612,413	9,717.11	348,552,980	1.14
18	オーストラリア	投資証券	GOODMAN GROUP	335,600	1,043.56	350,220,036	1,023.96	343,642,318	1.13
19	アメリカ	投資証券	EXTRA SPACE STORAGE INC	26,990	11,909.81	321,445,958	12,593.18	339,890,058	1.12
20	アメリカ	投資証券	MID-AMERICA APARTMENT COMM	23,710	12,746.43	302,217,883	14,065.21	333,486,214	1.09
21	オーストラリア	投資証券	SCENTRE GROUP	1,119,000	280.67	314,071,607	287.14	321,317,717	1.05
22	アメリカ	投資証券	UDR INC	61,500	4,999.68	307,480,517	5,215.77	320,770,076	1.05
23	アメリカ	投資証券	SUN COMMUNITIES INC	18,850	14,139.67	266,532,938	16,002.37	301,644,818	0.99
24	アメリカ	投資証券	INVITATION HOMES INC	89,400	2,906.28	259,821,932	3,195.51	285,678,701	0.94
25	アメリカ	投資証券	HOST HOTELS & RESORTS INC	151,700	1,963.06	297,796,930	1,846.51	280,115,749	0.92
26	アメリカ	投資証券	DUKE REALTY CORP	75,100	3,411.35	256,192,475	3,673.59	275,887,120	0.90
27	アメリカ	投資証券	EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	18,930	13,376.68	253,220,629	14,398.68	272,567,134	0.89
28	アメリカ	投資証券	REGENCY CENTERS CORP	34,800	7,268.41	252,940,737	7,455.11	259,437,953	0.85
29	イギリス	投資証券	SEGRO PLC	225,900	956.69	216,117,378	1,070.01	241,715,747	0.79
30	アメリカ	投資証券	CAMDEN PROPERTY TRUST	20,130	11,479.45	231,081,337	11,961.85	240,792,097	0.79

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
投資証券	98.89
合計	98.89

(参考)野村マネー マザーファンド

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	利率(%)	償還期限	投資比率(%)
1	日本	特殊債券	地方公共団体金融機構債券 第6回	460,000,000	100.23	461,102,072	100.23	461,102,072	1.518	2019/11/28	5.44
2	日本	特殊債券	阪神高速道路 第15回	460,000,000	100.00	460,025,000	100.00	460,025,000	0.01	2019/12/20	5.43
3	日本	特殊債券	首都高速道路 第14回	420,000,000	100.06	420,257,549	100.06	420,257,549	0.273	2019/12/20	4.96
4	日本	社債券	三菱東京UFJ銀行 第110回特定社債間限定同順位特約付	400,000,000	100.06	400,271,087	100.06	400,271,087	1.485	2019/10/16	4.73
5	日本	社債券	中部電力 第492回	350,000,000	100.09	350,340,350	100.09	350,340,350	1.405	2019/10/25	4.14
6	日本	特殊債券	農林債券 利付 第773回い号	300,000,000	100.02	300,060,456	100.02	300,060,456	0.24	2019/10/25	3.54
7	日本	特殊債券	中日本高速道路社債 第58回	230,000,000	100.04	230,096,410	100.04	230,096,410	0.182	2019/12/20	2.71
8	日本	地方債証券	さいたま市 公券 第7回	200,000,000	100.30	200,614,936	100.30	200,614,936	1.34	2019/12/25	2.37
9	日本	社債券	関西電力 第477回	200,000,000	100.30	200,605,864	100.30	200,605,864	1.405	2019/12/20	2.37

10	日本	地方債証券	共同発行市場地方債 公募第80回	200,000,000	100.21	200,434,629	100.21	200,434,629	1.54	2019/11/25	2.36
11	日本	社債券	東京急行電鉄第69回社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.11	200,224,444	100.11	200,224,444	1.7	2019/10/25	2.36
12	日本	社債券	三菱UFJリース 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	100.06	200,130,690	100.06	200,130,690	0.441	2019/11/21	2.36
13	日本	特殊債券	農林債券 利付第775回い号	200,000,000	100.05	200,117,426	100.05	200,117,426	0.23	2019/12/27	2.36
14	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,998,504		199,998,504			2.36
15	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	200,000,000		199,998,389		199,998,389			2.36
16	日本	社債券	東北電力 第452回	100,000,000	100.33	100,331,500	100.33	100,331,500	1.405	2019/12/25	1.18
17	日本	社債券	三井不動産 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100.32	100,320,180	100.32	100,320,180	1.493	2019/12/20	1.18
18	日本	社債券	日立キャピタル 第45回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100.13	100,137,700	100.13	100,137,700	0.666	2019/12/20	1.18
19	日本	地方債証券	大阪府 公募第331回	100,000,000	100.11	100,111,750	100.11	100,111,750	1.41	2019/10/29	1.18
20	日本	地方債証券	広島市 公募平成21年度第2回	100,000,000	100.11	100,110,664	100.11	100,110,664	1.35	2019/10/29	1.18
21	日本	地方債証券	岐阜県 公募平成21年度第1回	100,000,000	100.10	100,103,856	100.10	100,103,856	1.35	2019/10/28	1.18
22	日本	地方債証券	共同発行市場地方債 公募第79回	100,000,000	100.09	100,096,424	100.09	100,096,424	1.34	2019/10/25	1.18
23	日本	地方債証券	静岡県 公募平成21年度第5回	100,000,000	100.07	100,070,976	100.07	100,070,976	1.35	2019/10/18	1.18
24	日本	地方債証券	兵庫県 公募平成21年度第23回	100,000,000	100.06	100,067,770	100.06	100,067,770	1.37	2019/10/18	1.18
25	日本	特殊債券	しんきん中金債券 利付第301回	100,000,000	100.05	100,053,814	100.05	100,053,814	0.225	2019/12/27	1.18
26	日本	社債券	四国電力 第290回	100,000,000	100.03	100,035,044	100.03	100,035,044	0.14	2019/12/25	1.18
27	日本	地方債証券	鹿児島県 公募(5年)平成26年度第1回	100,000,000	100.01	100,018,012	100.01	100,018,012	0.153	2019/10/31	1.18
28	日本	特殊債券	地方公共団体金融機構債券(5年) 第16回	100,000,000	100.01	100,011,752	100.01	100,011,752	0.175	2019/10/28	1.18
29	日本	コマーシャルペーパー	三井住友F&L	100,000,000		99,999,194		99,999,194			1.18
30	日本	地方債証券	神奈川県 公募第169回	90,000,000	100.31	90,283,068	100.31	90,283,068	1.43	2019/12/20	1.06

種類別及び業種別投資比率

種類	投資比率(%)
地方債証券	14.08
特殊債券	26.84
社債券	20.71

コマーシャルペーパー	5.90
合 計	67.55

【投資不動産物件】

ネクストコア

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

該当事項はありません。

（参考）外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国株式マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）J - REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

該当事項はありません。

（参考）野村マネー 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】

ネクストコア

該当事項はありません。

（参考）国内株式マザーファンド

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

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

(参考) 国内債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

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

種類	国/地 域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指 数先物 取引	アメリカ	シカゴ マーカン タイル取 引所	E-mini S&P500株 価指数先物(2019 年12月限)	買建	279	米ドル	41,880,980	4,519,795,362	41,344,312.5	4,461,878,205	0.73
	カナダ	モントリ オール取 引所	S&P TSX60株価指 数先物(2019年12 月限)	買建	15	カナダ ドル	3,001,320	244,577,567	2,990,400	243,687,695	0.04
	ドイツ	ユーレック ス・ドイツ 金融先物取 引所	ユーロ50株価指数 先物(2019年12月 限)	買建	179	ユーロ	6,284,010	741,638,861	6,318,700	745,732,974	0.12
	オース トラリ ア	シドニー先 物取引所	SP1200株価指数先 物(2019年12月限)	買建	14	豪ドル	2,335,900	170,240,392	2,343,250	170,776,060	0.02
	イギリ ス	ロンドン国 際金融先物 オプション 取引所	FT100株価指数先 物(2019年12月限)	買建	40	英ポ ンド	2,921,085	387,598,768	2,955,400	392,152,024	0.06
	スイス	ユーレック ス・チュー リッヒ取 引所	SMI株価指数先物 (2019年12月限)	買建	21	スイス フラン	2,093,090	227,895,639	2,102,310	228,899,512	0.03

(参考) 外国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新興国株式マザーファンド

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

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

株価指数先物取引	アメリカ	インターコンチネンタル取引所	E-mini MSCIエマーシングマーケット株価指数先物(2019年12月限)	買建	178	米ドル	9,051,845	976,875,115	8,873,300	957,606,536	2.47
----------	------	----------------	---	----	-----	-----	-----------	-------------	-----------	-------------	------

(参考) 新興国債券マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) 新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

該当事項はありません。

(参考) J-REITインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

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

(参考) 海外REITインデックス マザーファンド

その他の資産として、下記の通り先物取引を利用しています。

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

種類	国/地域	取引所	名称	買建/ 売建	枚数	通貨	帳簿価額	帳簿価額 (円)	評価額	評価額 (円)	投資 比率 (%)
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴボード オブトレード	ダウ・ジョーンズ米国不動産指数先物(2019年12月限)	買建	68	米ドル	2,464,480	265,966,682	2,494,920	269,251,766	0.88

(参考) 野村マネー マザーファンド

該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

ネクストコア

2019年9月末日及び同日前1年以内における各月末並びに下記決算期末の純資産の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		1口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間 (2013年 8月19日)	1,335	1,335	0.9583	0.9583
第2計算期間 (2014年 2月17日)	1,850	1,850	0.9721	0.9721
第3計算期間 (2014年 8月18日)	1,925	1,925	1.0181	1.0181
第4計算期間 (2015年 2月17日)	2,341	2,341	1.0461	1.0461
第5計算期間 (2015年 8月17日)	2,712	2,712	1.0175	1.0175
第6計算期間 (2016年 2月17日)	3,004	3,004	0.9984	0.9984
第7計算期間 (2016年 8月17日)	3,714	3,714	1.0329	1.0329
第8計算期間 (2017年 2月17日)	4,295	4,295	1.0153	1.0153
第9計算期間 (2017年 8月17日)	3,911	3,911	1.0230	1.0230
第10計算期間 (2018年 2月19日)	3,134	3,134	1.0190	1.0190
第11計算期間 (2018年 8月17日)	2,822	2,822	1.0165	1.0165
第12計算期間 (2019年 2月18日)	2,882	2,882	1.0211	1.0211
第13計算期間 (2019年 8月19日)	2,545	2,545	1.0574	1.0574
2018年 9月末日	2,980		1.0262	
10月末日	3,019		1.0078	
11月末日	2,952		1.0150	
12月末日	2,887		1.0074	
2019年 1月末日	2,903		1.0195	
2月末日	2,869		1.0223	
3月末日	2,872		1.0343	
4月末日	2,866		1.0293	
5月末日	2,828		1.0281	
6月末日	2,655		1.0419	
7月末日	2,589		1.0523	
8月末日	2,514		1.0598	
9月末日	2,417		1.0682	

【分配の推移】

ネクストコア

	計算期間	1口当たりの分配金
第1計算期間	2013年 1月31日～2013年 8月19日	0.0000円
第2計算期間	2013年 8月20日～2014年 2月17日	0.0000円
第3計算期間	2014年 2月18日～2014年 8月18日	0.0000円

第4計算期間	2014年 8月19日～2015年 2月17日	0.0000円
第5計算期間	2015年 2月18日～2015年 8月17日	0.0000円
第6計算期間	2015年 8月18日～2016年 2月17日	0.0000円
第7計算期間	2016年 2月18日～2016年 8月17日	0.0000円
第8計算期間	2016年 8月18日～2017年 2月17日	0.0000円
第9計算期間	2017年 2月18日～2017年 8月17日	0.0000円
第10計算期間	2017年 8月18日～2018年 2月19日	0.0000円
第11計算期間	2018年 2月20日～2018年 8月17日	0.0000円
第12計算期間	2018年 8月18日～2019年 2月18日	0.0000円
第13計算期間	2019年 2月19日～2019年 8月19日	0.0000円

【収益率の推移】

ネクストコア

	計算期間	収益率
第1計算期間	2013年 1月31日～2013年 8月19日	4.2%
第2計算期間	2013年 8月20日～2014年 2月17日	1.4%
第3計算期間	2014年 2月18日～2014年 8月18日	4.7%
第4計算期間	2014年 8月19日～2015年 2月17日	2.8%
第5計算期間	2015年 2月18日～2015年 8月17日	2.7%
第6計算期間	2015年 8月18日～2016年 2月17日	1.9%
第7計算期間	2016年 2月18日～2016年 8月17日	3.5%
第8計算期間	2016年 8月18日～2017年 2月17日	1.7%
第9計算期間	2017年 2月18日～2017年 8月17日	0.8%
第10計算期間	2017年 8月18日～2018年 2月19日	0.4%
第11計算期間	2018年 2月20日～2018年 8月17日	0.2%
第12計算期間	2018年 8月18日～2019年 2月18日	0.5%
第13計算期間	2019年 2月19日～2019年 8月19日	3.6%

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】

ネクストコア

	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 1月31日～2013年 8月19日	1,445,052,123	51,972,335	1,393,079,788
第2計算期間	2013年 8月20日～2014年 2月17日	670,704,216	160,711,546	1,903,072,458
第3計算期間	2014年 2月18日～2014年 8月18日	582,888,344	594,495,481	1,891,465,321
第4計算期間	2014年 8月19日～2015年 2月17日	858,557,285	512,113,562	2,237,909,044

第5計算期間	2015年 2月18日～2015年 8月17日	774,652,374	346,882,589	2,665,678,829
第6計算期間	2015年 8月18日～2016年 2月17日	547,418,537	203,743,660	3,009,353,706
第7計算期間	2016年 2月18日～2016年 8月17日	954,092,064	366,986,976	3,596,458,794
第8計算期間	2016年 8月18日～2017年 2月17日	939,380,069	304,883,559	4,230,955,304
第9計算期間	2017年 2月18日～2017年 8月17日	332,500,890	739,734,400	3,823,721,794
第10計算期間	2017年 8月18日～2018年 2月19日	110,489,900	857,902,021	3,076,309,673
第11計算期間	2018年 2月20日～2018年 8月17日	172,843,131	472,676,803	2,776,476,001
第12計算期間	2018年 8月18日～2019年 2月18日	414,396,154	367,449,793	2,823,422,362
第13計算期間	2019年 2月19日～2019年 8月19日	145,606,121	562,058,695	2,406,969,788

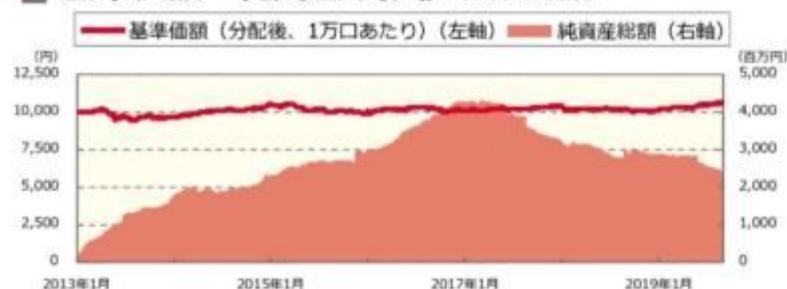
本邦外における設定及び解約の実績はありません。

参考情報



運用実績（2019年9月30日現在）

■ 基準価額・純資産の推移（日次；設定来）



■ 分配の推移

（1万口あたり、課税前）

2019年8月	0 円
2019年2月	0 円
2018年8月	0 円
2018年2月	0 円
2017年8月	0 円
設定来累計	0 円

■ 主要な資産の状況

各マザーファンドへの投資比率

銘柄	投資比率 (%)
国内株式マザーファンド	5.9
国内債券マザーファンド	28.0
外国株式MSCI-KOKUSA Iマザーファンド	3.0
外国債券マザーファンド	21.6
新興国株式マザーファンド	-
新興国債券マザーファンド	7.0
新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	4.3
J-REITインデックス マザーファンド	13.6
海外REITインデックス マザーファンド	4.9
野村マネー マザーファンド	0.8

実質的な銘柄別投資比率（上位）

・「国内株式マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	トヨタ自動車	輸送用機器	0.2
2	ソニー	電気機器	0.1
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	0.1
4	日本電信電話	情報・通信業	0.1
5	ソフトバンクグループ	情報・通信業	0.1

・「国内債券マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	国庫債券 利付（10年）第340回	国債証券	0.4
2	国庫債券 利付（5年）第128回	国債証券	0.4
3	国庫債券 利付（10年）第345回	国債証券	0.4
4	国庫債券 利付（10年）第342回	国債証券	0.4
5	国庫債券 利付（10年）第350回	国債証券	0.4

・「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	業種	投資比率 (%)
1	APPLE INC	コンピュータ・周辺機器	0.1
2	MICROSOFT CORP	ソフトウェア	0.1
3	AMAZON.COM INC	インターネット販売・通信販売	0.1
4	FACEBOOK INC-A	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.0
5	ALPHABET INC-CL C	インタラクティブ・メディアおよびサービス	0.0

・「外国債券マザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	US TREASURY BOND	国債証券	0.3
2	US TREASURY N/B	国債証券	0.3
3	US TREASURY N/B	国債証券	0.3
4	US TREASURY N/B	国債証券	0.3
5	US TREASURY N/B	国債証券	0.3

・「新興国債券マザーファンド」を通じた投資銘柄

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

・「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	REPUBLIC OF COLOMBIA	国債証券	0.2
2	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1
3	NOTA DO TESOURO NACIONAL	国債証券	0.1
4	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1
5	POLAND GOVERNMENT BOND	国債証券	0.1

・「J-REITインデックス マザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	日本ビルファンド投資法人 投資証券	投資証券	1.0
2	ジャパンリアルエステイト投資法人 投資証券	投資証券	0.9
3	野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	投資証券	0.7
4	オリックス不動産投資法人 投資証券	投資証券	0.6
5	ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	投資証券	0.6

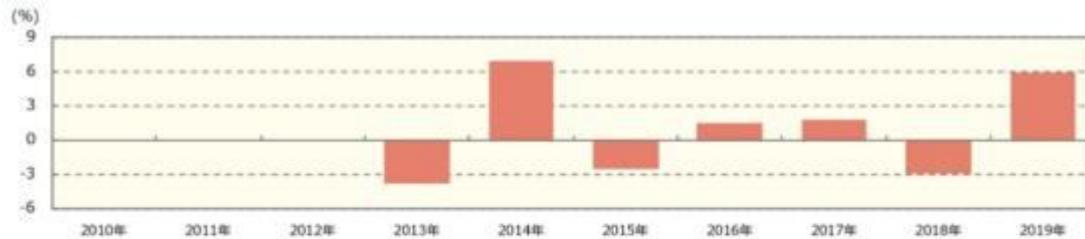
・「海外REITインデックス マザーファンド」を通じた投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	PROLOGIS INC	投資証券	0.2
2	EQUINIX INC	投資証券	0.2
3	SIMON PROPERTY GROUP INC	投資証券	0.2
4	PUBLIC STORAGE	投資証券	0.1
5	WELLTOWER INC	投資証券	0.1

・「野村マネー マザーファンド」を通じての投資銘柄

順位	銘柄	種類	投資比率 (%)
1	地方公共団体金融機構債券 第6回	特殊債券	0.0
2	阪神高速道路 第15回	特殊債券	0.0
3	首都高速道路 第14回	特殊債券	0.0
4	三菱東京UFJ銀行 第110回特定社債間限定同順位特約付	社債券	0.0
5	中部電力 第492回	社債券	0.0

■ 年間収益率の推移 (暦年ベース)



- ・ファンドの年間収益率は税引前分配金を再投資して算出。
- ・ファンドにベンチマークはありません。
- ・2013年は設定日（2013年1月31日）から年末までの収益率。
- ・2019年は年初から運用実績作成基準日までの収益率。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

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

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

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

<受付時間> 営業日の午前9時～午後5時

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

- ・ 販売の単位は、1万口以上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。
- ・ 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。
- ・ 金融商品取引所（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号に規定する外国金融商品市場をいいます。以下同じ。なお、金融商品取引所を単に「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場ないしは当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。）等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で受益権の取得申込の受付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ことができます。

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時までに、解約請求のお申込みが行われかつ、その解約請求のお申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日のお申込み分とします。
- ・ 換金価額は、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/>

- ・なお、信託財産の資金管理を円滑に行なうため、大口換金には制限を設ける場合があります。
- ・解約代金は、原則として一部解約の実行の請求日から起算して6営業日目から申込みの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（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）により、有価証券の売却や売却代金の入金が遅延したとき等は、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約金の支払いを延期する場合があります。
- ・金融商品取引所等における取引の停止（個別銘柄の売買停止等を含みます。）、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（実質的な投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、信託約款の規定に従い、委託者の判断で一部解約の実行の請求の受付けを中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付けを取り消すことができます。

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

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

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<基準価額の計算方法>

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

なお、ファンドにおいては1万口当りの価額で表示されます。

ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

対象	評価方法
株式	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、基準価額計算日 ¹ における以下のいずれかの価額で評価します。 ² 日本証券業協会が発表する売買参考統計値(平均値) 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(売気配相場を除く) 価格情報会社の提供する価額

REIT (不動産投資信託)	原則として、基準価額計算日 ¹ の金融商品取引所の最終相場で評価します。
外貨建資産	原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行いません。

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

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

ファンドの基準価額については下記の照会先までお問い合わせ下さい。

野村アセットマネジメント株式会社

サポートダイヤル 0120-753104 (フリーダイヤル)

< 受付時間 > 営業日の午前9時～午後5時

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

(2) 【保管】

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

(3) 【信託期間】

2028年2月17日までとします(2013年1月31日設定)。

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

(4) 【計算期間】

原則として、毎年2月18日から8月17日までおよび8月18日から翌年2月17日までとします。

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

(5) 【その他】

(a) ファンドの繰上償還条項

委託者は、信託終了前に、信託契約の一部を解約することにより、受益権の口数が30億口を下回った場合、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。)を行いません。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、その投資信託委託会社と受託者との間において存続します。

(c)運用報告書

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

(d)信託約款の変更等

- ()委託者は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託者と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。)を行なうことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
- ()委託者は、上記()の事項(上記()の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行ないます。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知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っては、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。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

収益分配金に対する請求権

収益分配金の支払い開始日

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

上記にかかわらず、累積投資契約を結んでいる場合には、税金を差引いた後、自動的に無手数料で再投

資されます。この場合の受益権の価額は、各計算期間終了日(決算日)の基準価額とします。なお、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

収益分配金請求権の失効

受益者は、収益分配金を支払開始日から5年間支払請求しないと権利を失います。

償還金に対する請求権

償還金の支払い開始日

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行なわれた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)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13期計算期間(2019年2月19日から2019年8月19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】

【ネクストコア】

(1) 【貸借対照表】

(単位 : 円)

	第12期 (2019年 2月18日現在)	第13期 (2019年 8月19日現在)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	594,640,155	169,945,262
親投資信託受益証券	2,312,999,475	2,383,369,021
派生商品評価勘定	8,843,935	16,516,242
流動資産合計	2,916,483,565	2,569,830,525
資産合計	2,916,483,565	2,569,830,525
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定	5,061,386	-
未払解約金	6,816,257	4,554,134
未払受託者報酬	799,076	748,509
未払委託者報酬	20,776,122	19,461,097
未払利息	1,022	261
その他未払費用	47,885	44,847
流動負債合計	33,501,748	24,808,848
負債合計	33,501,748	24,808,848
純資産の部		
元本等		
元本	2,823,422,362	2,406,969,788
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	59,559,455	138,051,889
(分配準備積立金)	109,872,235	112,374,000
元本等合計	2,882,981,817	2,545,021,677
純資産合計	2,882,981,817	2,545,021,677
負債純資産合計	2,916,483,565	2,569,830,525

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第12期		第13期	
	自 2018年 8月18日	至 2019年 2月18日	自 2019年 2月19日	至 2019年 8月19日
営業収益				
有価証券売買等損益	40,698,913		85,669,546	
為替差損益	5,861,131		30,447,676	
営業収益合計	34,837,782		116,117,222	
営業費用				
支払利息	217,415		115,690	
受託者報酬	799,076		748,509	
委託者報酬	20,776,122		19,461,097	
その他費用	58,685		44,847	
営業費用合計	21,851,298		20,370,143	
営業利益又は営業損失（ ）	12,986,484		95,747,079	
経常利益又は経常損失（ ）	12,986,484		95,747,079	
当期純利益又は当期純損失（ ）	12,986,484		95,747,079	
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（ ）	736,379		9,892,511	
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	45,755,427		59,559,455	
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,098,330		4,699,649	
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,098,330		4,699,649	
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,017,165		12,061,783	
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,017,165		12,061,783	
分配金	-		-	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	59,559,455		138,051,889	

(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。 為替予約取引 計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物相場の仲値で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。
4. その他	当ファンドの計算期間は、信託約款の規定により、2019年 2月19日から2019年 8月19日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

第12期 2019年 2月18日現在	第13期 2019年 8月19日現在
1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,823,422,362口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,406,969,788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 1.0211円 (10,000口当たり純資産額) (10,211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 1.0574円 (10,000口当たり純資産額) (10,574円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2018年 8月18日 至 2019年 2月18日	第13期 自 2019年 2月19日 至 2019年 8月19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>12,224,860円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>208,032,536円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>97,647,375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>317,904,771円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,823,422,362口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	12,224,860円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	208,032,536円	分配準備積立金額	D	97,647,375円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	317,904,771円	当ファンドの期末残存口数	F	2,823,422,362口	<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>23,553,352円</td> </tr> <tr> <td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td> <td>B</td> <td>0円</td> </tr> <tr> <td>収益調整金額</td> <td>C</td> <td>182,390,315円</td> </tr> <tr> <td>分配準備積立金額</td> <td>D</td> <td>88,820,648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>294,764,315円</td> </tr> <tr> <td>当ファンドの期末残存口数</td> <td>F</td> <td>2,406,969,788口</td> </tr> </tbody> </table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	23,553,352円	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円	収益調整金額	C	182,390,315円	分配準備積立金額	D	88,820,648円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	294,764,315円	当ファンドの期末残存口数	F	2,406,969,788口
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	12,224,860円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																									
収益調整金額	C	208,032,536円																																									
分配準備積立金額	D	97,647,375円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	317,904,771円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	2,823,422,362口																																									
項目																																											
費用控除後の配当等収益額	A	23,553,352円																																									
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	0円																																									
収益調整金額	C	182,390,315円																																									
分配準備積立金額	D	88,820,648円																																									
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	294,764,315円																																									
当ファンドの期末残存口数	F	2,406,969,788口																																									

10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,125円	10,000口当たり収益分配対象額	$G=E/F \times 10,000$	1,224円
10,000口当たり分配金額	H	0円	10,000口当たり分配金額	H	0円
収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円	収益分配金金額	$I=F \times H/10,000$	0円

(金融商品に関する注記)

(1)金融商品の状況に関する事項

第12期 自 2018年 8月18日 至 2019年 2月18日	第13期 自 2019年 2月19日 至 2019年 8月19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、(その他の注記)の2 有価証券関係に記載しております。</p> <p>当ファンドは、株価変動リスク、REITの価格変動リスク、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされておりますが、主要投資対象である親投資信託受益証券の保有状況によっては、市場リスクの内容は変動する場合があります。</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、為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする為替等に係る価格変動リスクを有しております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p>市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p>信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p>流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>	<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>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</p> <p>同左</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>同左</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

第12期 2019年 2月18日現在	第13期 2019年 8月19日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ ん。</p> <p>2. 時価の算定方法 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。</p> <p>派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、（その他の注記）の 3 デリバティブ取引関係に記載しております。</p> <p>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。</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 同左</p>

（関連当事者との取引に関する注記）

第12期 自 2018年 8月18日 至 2019年 2月18日	第13期 自 2019年 2月19日 至 2019年 8月19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12期 自 2018年 8月18日 至 2019年 2月18日	第13期 自 2019年 2月19日 至 2019年 8月19日
期首元本額 2,776,476,001円	期首元本額 2,823,422,362円
期中追加設定元本額 414,396,154円	期中追加設定元本額 145,606,121円
期中一部解約元本額 367,449,793円	期中一部解約元本額 562,058,695円

2 有価証券関係

売買目的有価証券

種類	第12期 自 2018年 8月18日 至 2019年 2月18日	第13期 自 2019年 2月19日 至 2019年 8月19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	45,993,531	73,119,714

合計	45,993,531	73,119,714
----	------------	------------

3 デリバティブ取引関係

デリバティブ取引の契約額等、時価及び評価損益

種類	第12期(2019年 2月18日現在)				第13期(2019年 8月19日現在)			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超				うち1年超		
市場取引以外の取引								
為替予約取引								
売建	1,158,804,849	-	1,155,022,300	3,782,549	829,992,042	-	813,475,800	16,516,242
米ドル	583,720,141	-	586,671,500	2,951,359	517,289,595	-	510,700,800	6,588,795
カナダドル	27,004,518	-	26,707,200	297,318	18,647,549	-	18,427,600	219,949
ユーロ	433,165,622	-	427,326,200	5,839,422	214,859,349	-	208,899,100	5,960,249
英ポンド	82,538,808	-	82,725,400	186,592	54,634,692	-	51,652,000	2,982,692
豪ドル	32,375,760	-	31,592,000	783,760	24,560,857	-	23,796,300	764,557
合計	1,158,804,849	-	1,155,022,300	3,782,549	829,992,042	-	813,475,800	16,516,242

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

(4) 【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年8月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年8月19日現在)

（単位：円）

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本円	国内株式マザーファンド	122,618,607	182,996,009	
		国内債券マザーファンド	523,067,353	735,118,857	
		外国債券マザーファンド	259,177,112	598,880,552	
		外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド	16,152,133	42,727,237	
		野村マネー マザーファンド	19,922,154	20,330,558	
		J-REITインデックス マザーファンド	143,068,597	362,635,972	
		海外REITインデックス マザーファンド	53,235,453	127,695,881	
		新興国債券マザーファンド	105,783,165	200,247,531	
		新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド	84,930,258	112,736,424	
	小計	銘柄数：9 組入時価比率：93.6%	1,327,954,832	2,383,369,021 100.0%	
合計			2,383,369,021		

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

財務諸表における注記事項として記載しているため省略しております。

（参考）

当ファンドは、当該計算期間末現在、主要投資対象である親投資信託受益証券のうち、「国内株式マザーファンド」、「国内債券マザーファンド」、「外国株式MSCI-KOKUSAIマザーファンド」、「外国債券マザーファンド」、「新興国債券マザーファンド」、「新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド」、「J-REITインデックス マザーファンド」、「海外REITインデックス マザーファンド」および「野村マネー マザーファンド」受益証券に投資しており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

国内株式マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

(2019年 8月19日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	50,145,384,674
株式	377,223,044,950
派生商品評価勘定	4,502,158
未収配当金	599,369,185
未収利息	2,733,989
その他未収収益	27,439,652
差入委託証拠金	495,248,000

(2019年 8月19日現在)

流動資産合計	428,497,722,608
資産合計	428,497,722,608
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	179,962,878
未払金	1,751,944
未払解約金	284,812,897
未払利息	77,251
有価証券貸借取引受入金	43,015,568,330
流動負債合計	43,482,173,300
負債合計	43,482,173,300
純資産の部	
元本等	
元本	257,985,859,611
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	127,029,689,697
元本等合計	385,015,549,308
純資産合計	385,015,549,308
負債純資産合計	428,497,722,608

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月19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	1,4924円
(10,000口当たり純資産額)	(14,924円)
2. 有価証券の消費貸借契約により貸し付けた有価証券	
	41,246,485,930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 2019年 2月19日 至 2019年 8月19日
<p>1.金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>3.金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 8月19日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ</p> <p>ん。</p> <p>2.時価の算定方法</p> <p>株式</p> <p>(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>派生商品評価勘定</p> <p>デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。</p> <p>コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務</p> <p>これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としております。</p>

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 8月19日現在	
期首	2019年 2月19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	251,040,771,991円
同期中における追加設定元本額	21,542,897,481円
同期中における一部解約元本額	14,597,809,861円
期末元本額	257,985,859,611円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	175,138,664円
バランスセレクト50	400,861,691円
バランスセレクト70	505,717,491円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	2,601,317,938円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	3,777,295,913円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	8,112,984,270円
野村資産設計ファンド2015	53,631,019円
野村資産設計ファンド2020	58,770,241円
野村資産設計ファンド2025	94,096,341円
野村資産設計ファンド2030	111,327,967円
野村資産設計ファンド2035	86,221,154円
野村資産設計ファンド2040	190,984,191円
野村日本株インデックス(野村投資一任口座向け)	99,743,388,018円
のむらップ・ファンド(保守型)	3,045,964,789円
のむらップ・ファンド(普通型)	8,307,206,549円
のむらップ・ファンド(積極型)	2,168,534,543円
野村資産設計ファンド2045	29,337,217円
野村インデックスファンド・TOPIX	2,175,799,724円
マイ・ロード	4,056,891,229円
ネクストコア	122,618,607円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,068,250,926円
野村日本株インデックス(野村SMA・EW向け)	1,977,201,701円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	813,676,393円
野村資産設計ファンド2050	47,973,965円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	15,155,597円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	6,226,944円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	4,593,293円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	2,892,056円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	315,627,969円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	280,668,420円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,274,086円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,353,448円
インデックス・ブレンド(タイプ)	16,393,242円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,461,052円
インデックス・ブレンド(タイプ)	21,339,737円
野村6資産均等バランス	680,757,821円
世界6資産分散ファンド	151,086,068円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)日本株式	392,614,102円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	485,150,396円

グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	363,072,147円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	747,046,206円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	826,609,772円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	4,608,087円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	10,682,971円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	2,577,739円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,635,148,169円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	18,019,767円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	148,942,246円
野村・国内株式インデックスファンド・VAS(適格機関投資家専用)	112,859,140円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	50,765,803円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	109,007,979円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	299,360,326円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	4,907,542,978円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	679,567,117円
ノムラ日本株式インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	615,161,696円
ノムラFOFs用インデックスファンド・TOPIX(適格機関投資家専用)	2,726,081,233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)	358,704,987円
TOPIXインデックスファンド(適格機関投資家専用)	617,707円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	7,562,038円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	34,359,756円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	44,838,190円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	123,259,748円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	5,221,787,066円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	15,618,356,135円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	20,504,738,507円
野村国内株式インデックスファンド・TOPIX(確定拠出年金向け)	32,607,587,232円
マイバランスDC30	3,377,797,849円
マイバランスDC50	4,806,524,918円
マイバランスDC70	4,565,728,397円
野村DC国内株式インデックスファンド・TOPIX	10,309,214,612円
野村DC運用戦略ファンド	1,112,038,152円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	54,981,097円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	694,770,350円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	427,253,682円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	329,393,894円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	3,925,779円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	2,578,775円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	27,900,425円
野村資産設計ファンド(DC)2030	3,906,175円
野村資産設計ファンド(DC)2040	2,315,812円
野村資産設計ファンド(DC)2050	3,841,913円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	168,584,128円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	106,796,826円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	40,125,462円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	56,531,851円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年8月19日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
				単価	金額	
株式	日本円	極洋	7,800	2,861.00	22,315,800	
		日本水産	239,500	597.00	142,981,500	貸付有価証券 33,200株
		マルハニチロ	34,600	2,667.00	92,278,200	貸付有価証券 4,200株
		カネコ種苗	7,300	1,137.00	8,300,100	貸付有価証券 800株
		サカタのタネ	29,200	3,420.00	99,864,000	貸付有価証券 3,600株
		ホクト	20,100	1,837.00	36,923,700	貸付有価証券 100株
		ホクリヨウ	3,200	599.00	1,916,800	
		住石ホールディングス	51,600	127.00	6,553,200	貸付有価証券 5,700株(2,200株)
		日鉄鉱業	5,500	4,090.00	22,495,000	貸付有価証券 600株
		三井松島ホールディングス	10,000	1,173.00	11,730,000	貸付有価証券 1,200株
		国際石油開発帝石	960,800	922.10	885,953,680	貸付有価証券 60,700株
		石油資源開発	34,400	2,562.00	88,132,800	貸付有価証券 400株
		K&Oエナジーグループ	11,600	1,371.00	15,903,600	貸付有価証券 1,400株
		ヒノキヤグループ	5,900	1,905.00	11,239,500	貸付有価証券 700株
		ショーボンドホールディングス	34,200	3,755.00	128,421,000	貸付有価証券 18,800株
		ミライト・ホールディングス	67,400	1,542.00	103,930,800	貸付有価証券 38,700株
タマホーム	11,500	1,468.00	16,882,000	貸付有価証券 6,300株(2,300株)		

サンヨーホームズ	3,500	627.00	2,194,500	貸付有価証券 500株
日本アクア	9,500	526.00	4,997,000	貸付有価証券 6,300株
ファーストコーポレーション	7,300	596.00	4,350,800	貸付有価証券 3,800株（100株）
ベステラ	4,600	1,267.00	5,828,200	貸付有価証券 2,100株
TATERU	48,600	164.00	7,970,400	貸付有価証券 32,500株（10,900株）
スペースバリューホールディングス	29,200	464.00	13,548,800	貸付有価証券 1,100株
ダイセキ環境ソリューション	4,600	702.00	3,229,200	
第一カッター興業	3,000	1,614.00	4,842,000	貸付有価証券 400株
安藤・間	153,600	684.00	105,062,400	貸付有価証券 19,200株
東急建設	70,100	719.00	50,401,900	貸付有価証券 100株
コムシスホールディングス	84,900	2,777.00	235,767,300	貸付有価証券 10,600株
ミサワホーム	18,900	1,044.00	19,731,600	貸付有価証券 2,300株
ピーアールホールディングス	26,100	303.00	7,908,300	貸付有価証券 1,400株
高松コンストラクショングループ	14,900	2,282.00	34,001,800	
東建コーポレーション	7,400	6,160.00	45,584,000	貸付有価証券 1,000株
ソネック	2,500	820.00	2,050,000	貸付有価証券 200株
ヤマウラ	9,200	822.00	7,562,400	貸付有価証券 700株
大成建設	196,700	3,655.00	718,938,500	貸付有価証券 400株
大林組	592,600	952.00	564,155,200	
清水建設	604,400	869.00	525,223,600	貸付有価証券 80,400株
飛島建設	16,900	1,147.00	19,384,300	貸付有価証券 100株
長谷工コーポレーション	247,000	1,123.00	277,381,000	貸付有価証券

				200株
松井建設	21,800	680.00	14,824,000	貸付有価証券 2,600株
銭高組	2,400	3,895.00	9,348,000	貸付有価証券 200株
鹿島建設	463,100	1,219.00	564,518,900	貸付有価証券 59,700株
不動テトラ	13,500	1,131.00	15,268,500	
大末建設	7,000	901.00	6,307,000	
鉄建建設	12,000	2,605.00	31,260,000	
西松建設	42,600	1,832.00	78,043,200	
三井住友建設	142,500	521.00	74,242,500	貸付有価証券 400株
大豊建設	13,400	2,601.00	34,853,400	
前田建設工業	140,900	839.00	118,215,100	貸付有価証券 17,800株
佐田建設	12,700	394.00	5,003,800	
ナカノフドー建設	15,100	408.00	6,160,800	貸付有価証券 100株
奥村組	32,500	2,767.00	89,927,500	貸付有価証券 300株
東鉄工業	23,700	3,010.00	71,337,000	貸付有価証券 2,900株
イチケン	3,600	1,597.00	5,749,200	貸付有価証券 400株
富士ピー・エス	8,100	452.00	3,661,200	貸付有価証券 900株
浅沼組	6,600	3,500.00	23,100,000	
戸田建設	229,700	570.00	130,929,000	貸付有価証券 35,900株
熊谷組	28,200	2,785.00	78,537,000	貸付有価証券 4,100株
青木あすなろ建設	9,700	1,208.00	11,717,600	貸付有価証券 1,600株
北野建設	4,100	2,221.00	9,106,100	貸付有価証券 600株
植木組	2,400	2,322.00	5,572,800	貸付有価証券 1,400株
矢作建設工業	26,900	671.00	18,049,900	貸付有価証券 100株(100株)
ピーエス三菱	20,800	665.00	13,832,000	

日本ハウスホールディングス	37,800	422.00	15,951,600	貸付有価証券 7,300株
大東建託	70,400	13,740.00	967,296,000	貸付有価証券 3,100株
新日本建設	23,500	742.00	17,437,000	貸付有価証券 2,800株
N I P P O	52,300	1,848.00	96,650,400	貸付有価証券 6,500株
東亜道路工業	3,700	3,090.00	11,433,000	
前田道路	61,900	2,334.00	144,474,600	貸付有価証券 10,900株
日本道路	5,300	6,000.00	31,800,000	貸付有価証券 600株
東亜建設工業	17,200	1,216.00	20,915,200	
日本国土開発	32,300	511.00	16,505,300	貸付有価証券 20,800株
若築建設	9,900	1,454.00	14,394,600	
東洋建設	72,300	421.00	30,438,300	貸付有価証券 200株
五洋建設	234,900	520.00	122,148,000	貸付有価証券 3,500株
世紀東急工業	28,800	688.00	19,814,400	貸付有価証券 400株
福田組	6,400	3,690.00	23,616,000	貸付有価証券 700株
住友林業	140,000	1,280.00	179,200,000	貸付有価証券 2,300株
日本基礎技術	20,300	322.00	6,536,600	
巴コーポレーション	24,600	343.00	8,437,800	貸付有価証券 100株（100株）
大和ハウス工業	547,200	3,285.00	1,797,552,000	貸付有価証券 900株
ライト工業	38,000	1,320.00	50,160,000	貸付有価証券 6,300株
積水ハウス	605,100	1,836.50	1,111,266,150	貸付有価証券 219,500株
日特建設	16,800	635.00	10,668,000	
北陸電気工事	9,600	915.00	8,784,000	貸付有価証券 1,100株
ユアテック	31,600	650.00	20,540,000	貸付有価証券 3,900株

四電工	3,000	2,709.00	8,127,000	貸付有価証券 100株
中電工	25,500	2,238.00	57,069,000	貸付有価証券 3,100株
関電工	89,900	886.00	79,651,400	貸付有価証券 800株
きんでん	131,400	1,545.00	203,013,000	貸付有価証券 17,000株
東京エネシス	20,400	902.00	18,400,800	貸付有価証券 2,500株
トーエネック	5,600	3,110.00	17,416,000	
住友電設	13,700	1,880.00	25,756,000	
日本電設工業	33,700	2,021.00	68,107,700	貸付有価証券 4,300株
協和エクシオ	77,400	2,338.00	180,961,200	貸付有価証券 200株
新日本空調	16,000	1,729.00	27,664,000	貸付有価証券 2,400株
九電工	39,000	3,115.00	121,485,000	貸付有価証券 100株
三機工業	44,600	1,238.00	55,214,800	貸付有価証券 5,900株
日揮	170,200	1,260.00	214,452,000	貸付有価証券 57,800株
中外炉工業	5,600	1,514.00	8,478,400	
ヤマト	17,700	670.00	11,859,000	貸付有価証券 2,100株
太平電業	13,400	2,280.00	30,552,000	貸付有価証券 1,600株
高砂熱学工業	48,000	1,580.00	75,840,000	貸付有価証券 6,000株
三晃金属工業	2,400	2,375.00	5,700,000	
朝日工業社	4,100	2,760.00	11,316,000	貸付有価証券 500株
明星工業	35,800	716.00	25,632,800	貸付有価証券 4,700株
大気社	26,900	3,000.00	80,700,000	貸付有価証券 3,400株
ダイダン	13,200	2,071.00	27,337,200	貸付有価証券 1,600株
日比谷総合設備	17,800	1,837.00	32,698,600	

東芝プラントシステム	42,800	1,725.00	73,830,000	貸付有価証券 5,400株
OSJBホールディングス	87,200	227.00	19,794,400	貸付有価証券 2,800株
レイズネクスト	35,500	1,137.00	40,363,500	貸付有価証券 4,400株
日本製粉	56,100	1,626.00	91,218,600	貸付有価証券 7,100株
日清製粉グループ本社	200,000	1,943.00	388,600,000	貸付有価証券 24,600株
日東富士製粉	1,300	6,420.00	8,346,000	貸付有価証券 100株
昭和産業	16,200	3,030.00	49,086,000	貸付有価証券 100株
鳥越製粉	15,700	806.00	12,654,200	貸付有価証券 1,900株
中部飼料	21,600	1,139.00	24,602,400	貸付有価証券 2,600株
フィード・ワン	118,900	158.00	18,786,200	貸付有価証券 600株
東洋精糖	2,700	1,028.00	2,775,600	
日本甜菜製糖	10,100	1,835.00	18,533,500	
三井製糖	14,000	2,169.00	30,366,000	貸付有価証券 1,700株
塩水港精糖	19,200	210.00	4,032,000	貸付有価証券 2,200株
日新製糖	8,400	1,857.00	15,598,800	
森永製菓	44,500	5,200.00	231,400,000	貸付有価証券 5,500株
中村屋	4,600	4,165.00	19,159,000	貸付有価証券 500株
江崎グリコ	53,200	4,620.00	245,784,000	貸付有価証券 6,600株
名糖産業	8,500	1,275.00	10,837,500	
井村屋グループ	7,500	2,012.00	15,090,000	貸付有価証券 900株
不二家	9,900	1,977.00	19,572,300	貸付有価証券 1,800株
山崎製パン	132,700	1,930.00	256,111,000	貸付有価証券 2,500株
第一屋製パン	3,000	957.00	2,871,000	

モロゾフ	3,000	4,745.00	14,235,000	貸付有価証券 300株
亀田製菓	11,000	4,630.00	50,930,000	貸付有価証券 1,300株
寿スピリッツ	18,700	6,760.00	126,412,000	貸付有価証券 300株
カルビー	80,700	3,125.00	252,187,500	貸付有価証券 600株
森永乳業	35,500	4,205.00	149,277,500	貸付有価証券 4,300株
六甲バター	11,700	1,612.00	18,860,400	貸付有価証券 1,500株
ヤクルト本社	131,100	5,960.00	781,356,000	貸付有価証券 18,400株
明治ホールディングス	125,400	7,650.00	959,310,000	
雪印メグミルク	42,600	2,468.00	105,136,800	貸付有価証券 100株
プリマハム	24,900	2,037.00	50,721,300	貸付有価証券 3,200株
日本ハム	73,300	3,895.00	285,503,500	貸付有価証券 3,200株
林兼産業	5,900	566.00	3,339,400	
丸大食品	18,900	2,100.00	39,690,000	貸付有価証券 2,400株
S Foods	15,900	3,115.00	49,528,500	貸付有価証券 3,200株
伊藤ハム米久ホールディングス	114,000	634.00	72,276,000	貸付有価証券 14,400株
サッポロホールディングス	60,400	2,488.00	150,275,200	貸付有価証券 36,000株
アサヒグループホールディングス	370,700	4,796.00	1,777,877,200	貸付有価証券 99,900株
キリンホールディングス	750,700	2,096.50	1,573,842,550	貸付有価証券 228,600株（1,900株）
宝ホールディングス	132,500	985.00	130,512,500	貸付有価証券 16,500株
オエノンホールディングス	46,700	359.00	16,765,300	貸付有価証券 100株
養命酒製造	5,400	1,950.00	10,530,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	124,200	2,220.00	275,724,000	貸付有価証券 56,100株（2,100株）
サントリー食品インター	118,400	4,545.00	538,128,000	貸付有価証券

ナショナル				45,600株
ダイトーグループホールディングス	10,000	4,205.00	42,050,000	貸付有価証券 5,600株
伊藤園	53,700	4,750.00	255,075,000	貸付有価証券 12,500株(1,100株)
キーコーヒー	17,400	2,105.00	36,627,000	貸付有価証券 2,100株
ユニカフェ	4,600	965.00	4,439,000	貸付有価証券 200株
ジャパンフーズ	2,500	1,190.00	2,975,000	貸付有価証券 900株
日清オイリオグループ	22,800	3,030.00	69,084,000	
不二製油グループ本社	43,200	2,779.00	120,052,800	貸付有価証券 10,300株(800株)
かどや製油	1,900	3,790.00	7,201,000	貸付有価証券 200株
J - オイルミルズ	9,200	3,970.00	36,524,000	貸付有価証券 1,300株
キッコーマン	116,800	4,950.00	578,160,000	貸付有価証券 14,300株
味の素	390,900	1,899.50	742,514,550	貸付有価証券 53,600株
キューピー	98,600	2,452.00	241,767,200	貸付有価証券 500株
ハウス食品グループ本社	66,200	4,005.00	265,131,000	貸付有価証券 100株
カゴメ	70,900	2,609.00	184,978,100	貸付有価証券 12,500株(2,000株)
焼津水産化学工業	8,600	1,035.00	8,901,000	
アリアケジャパン	16,200	7,660.00	124,092,000	貸付有価証券 100株
ピエトロ	2,300	1,594.00	3,666,200	
エバラ食品工業	4,300	2,018.00	8,677,400	
やまみ	900	1,969.00	1,772,100	
ニチレイ	91,900	2,359.00	216,792,100	
東洋水産	91,100	4,355.00	396,740,500	貸付有価証券 11,300株
イトアンド	6,100	1,681.00	10,254,100	貸付有価証券 1,200株
大冷	2,000	1,987.00	3,974,000	
ヨシムラ・フード・ホー	4,800	781.00	3,748,800	貸付有価証券

ルディングス				3,200株
日清食品ホールディングス	75,200	6,950.00	522,640,000	貸付有価証券 10,700株
永谷園ホールディングス	9,400	1,985.00	18,659,000	
一正蒲鉾	6,900	1,054.00	7,272,600	貸付有価証券 800株
フジッコ	19,200	1,882.00	36,134,400	
ロック・フィールド	19,100	1,367.00	26,109,700	
日本たばこ産業	1,022,100	2,298.50	2,349,296,850	貸付有価証券 559,000株
ケンコーマヨネーズ	9,900	2,165.00	21,433,500	貸付有価証券 2,100株
わらべや日洋ホールディングス	11,600	1,613.00	18,710,800	貸付有価証券 600株
なとり	9,900	1,576.00	15,602,400	貸付有価証券 1,200株
イフジ産業	3,100	696.00	2,157,600	
ピクルスコーポレーション	4,200	2,277.00	9,563,400	貸付有価証券 200株
北の達人コーポレーション	69,500	759.00	52,750,500	貸付有価証券 25,300株
ユーグレナ	75,500	862.00	65,081,000	貸付有価証券 28,100株
ミヨシ油脂	6,800	1,090.00	7,412,000	
理研ビタミン	8,400	3,265.00	27,426,000	貸付有価証券 1,100株
片倉工業	25,100	1,255.00	31,500,500	貸付有価証券 11,500株
ゲンゼ	11,600	4,405.00	51,098,000	
東洋紡	73,100	1,338.00	97,807,800	貸付有価証券 13,100株
ユニチカ	50,600	331.00	16,748,600	貸付有価証券 200株
富士紡ホールディングス	9,000	2,528.00	22,752,000	貸付有価証券 1,100株
倉敷紡績	16,500	1,898.00	31,317,000	
シキボウ	9,100	926.00	8,426,600	
日本毛織	56,800	878.00	49,870,400	貸付有価証券 1,700株
ダイトウボウ	27,900	81.00	2,259,900	貸付有価証券 4,500株（100株）

トーア紡コーポレーション	6,900	456.00	3,146,400	
ダイドーリミテッド	20,600	287.00	5,912,200	貸付有価証券 600株(100株)
帝国繊維	19,400	1,760.00	34,144,000	貸付有価証券 400株
帝人	140,900	1,852.00	260,946,800	貸付有価証券 17,300株
東レ	1,339,900	776.40	1,040,298,360	貸付有価証券 2,300株
サカイオーベックス	4,200	1,594.00	6,694,800	
住江織物	5,000	2,928.00	14,640,000	貸付有価証券 600株
日本フェルト	9,800	451.00	4,419,800	
イチカワ	2,400	1,394.00	3,345,600	貸付有価証券 200株
日東製網	2,000	1,379.00	2,758,000	貸付有価証券 200株
アツギ	14,200	857.00	12,169,400	貸付有価証券 1,700株
ダイニック	7,000	692.00	4,844,000	貸付有価証券 800株
セーレン	42,500	1,212.00	51,510,000	貸付有価証券 100株
ソトー	6,900	966.00	6,665,400	
東海染工	2,400	1,107.00	2,656,800	
小松マテーレ	28,300	731.00	20,687,300	貸付有価証券 3,500株
ワコールホールディングス	48,800	2,483.00	121,170,400	
ホギメディカル	21,500	2,923.00	62,844,500	貸付有価証券 1,600株
レナウン	49,900	113.00	5,638,700	貸付有価証券 27,500株(2,600株)
クラウドシアホールディングス	4,200	536.00	2,251,200	貸付有価証券 2,300株
T S Iホールディングス	63,700	555.00	35,353,500	貸付有価証券 6,200株
マツオカコーポレーション	5,500	2,198.00	12,089,000	貸付有価証券 3,000株(400株)
ワールド	22,600	2,281.00	51,550,600	

三陽商会	9,000	1,364.00	12,276,000	貸付有価証券 1,300株
ナイガイ	6,300	394.00	2,482,200	
オンワードホールディングス	103,800	517.00	53,664,600	貸付有価証券 15,000株
ルックホールディングス	5,900	1,026.00	6,053,400	
ゴールドウイン	15,700	14,410.00	226,237,000	貸付有価証券 8,600株（7,000株）
デサント	42,100	1,468.00	61,802,800	貸付有価証券 500株
キング	9,200	526.00	4,839,200	貸付有価証券 100株
ヤマトインターナショナル	10,500	424.00	4,452,000	貸付有価証券 5,700株
特種東海製紙	11,000	3,550.00	39,050,000	貸付有価証券 1,400株
王子ホールディングス	777,600	481.00	374,025,600	貸付有価証券 71,500株
日本製紙	82,700	1,712.00	141,582,400	貸付有価証券 7,200株
三菱製紙	28,100	512.00	14,387,200	
北越コーポレーション	114,600	500.00	57,300,000	貸付有価証券 200株
中越パルプ工業	7,300	1,501.00	10,957,300	
巴川製紙所	5,700	869.00	4,953,300	
大王製紙	84,200	1,167.00	98,261,400	貸付有価証券 33,600株（8,000株）
阿波製紙	4,500	398.00	1,791,000	
レンゴー	178,100	786.00	139,986,600	貸付有価証券 2,500株
トーモク	10,600	1,534.00	16,260,400	貸付有価証券 1,300株
ザ・パック	13,100	3,305.00	43,295,500	貸付有価証券 1,600株
クラレ	272,000	1,229.00	334,288,000	貸付有価証券 82,200株
旭化成	1,228,800	957.40	1,176,453,120	貸付有価証券 3,000株
共和レザー	10,700	734.00	7,853,800	貸付有価証券 1,300株
昭和電工	123,000	2,720.00	334,560,000	貸付有価証券

				67,100株
住友化学	1,359,600	466.00	633,573,600	貸付有価証券 3,400株
住友精化	8,400	3,015.00	25,326,000	貸付有価証券 1,000株
日産化学	105,300	4,845.00	510,178,500	貸付有価証券 13,300株
ラサ工業	6,100	1,209.00	7,374,900	貸付有価証券 2,900株(2,200株)
クレハ	15,900	5,980.00	95,082,000	貸付有価証券 1,900株
多木化学	5,000	4,330.00	21,650,000	貸付有価証券 3,400株
テイカ	14,100	1,928.00	27,184,800	貸付有価証券 1,700株
石原産業	33,200	904.00	30,012,800	貸付有価証券 400株
片倉コープアグリ	5,000	1,066.00	5,330,000	貸付有価証券 100株
日東エフシー	1,200	1,199.00	1,438,800	貸付有価証券 800株
日本曹達	27,300	2,415.00	65,929,500	
東ソー	267,000	1,353.00	361,251,000	貸付有価証券 200株
トクヤマ	49,800	2,177.00	108,414,600	貸付有価証券 6,100株
セントラル硝子	37,600	2,120.00	79,712,000	貸付有価証券 4,700株
東亜合成	108,400	1,058.00	114,687,200	貸付有価証券 29,400株
大阪ソーダ	18,700	2,451.00	45,833,700	
関東電化工業	41,000	674.00	27,634,000	貸付有価証券 1,000株
デンカ	67,900	2,818.00	191,342,200	
信越化学工業	304,400	10,495.00	3,194,678,000	貸付有価証券 37,400株
日本カーバイド工業	5,800	1,217.00	7,058,600	
堺化学工業	11,500	2,396.00	27,554,000	貸付有価証券 1,400株
第一稀元素化学工業	18,700	799.00	14,941,300	
エア・ウォーター	141,400	1,761.00	249,005,400	貸付有価証券

				19,200株
大陽日酸	142,300	2,288.00	325,582,400	貸付有価証券 19,600株
日本化学工業	5,900	2,148.00	12,673,200	
東邦アセチレン	2,600	1,212.00	3,151,200	
日本パーカライジング	94,400	1,124.00	106,105,600	貸付有価証券 600株
高压ガス工業	27,400	782.00	21,426,800	貸付有価証券 3,300株
チタン工業	2,200	2,770.00	6,094,000	貸付有価証券 900株
四国化成工業	29,000	1,032.00	29,928,000	
戸田工業	3,700	2,137.00	7,906,900	貸付有価証券 1,700株
ステラ ケミファ	10,100	2,610.00	26,361,000	貸付有価証券 1,400株
保土谷化学工業	6,000	2,790.00	16,740,000	
日本触媒	29,000	6,040.00	175,160,000	貸付有価証券 4,400株
大日精化工業	14,300	2,770.00	39,611,000	貸付有価証券 1,700株
カネカ	44,700	3,210.00	143,487,000	
三菱瓦斯化学	175,600	1,240.00	217,744,000	
三井化学	156,800	2,293.00	359,542,400	
J S R	173,300	1,702.00	294,956,600	貸付有価証券 22,700株
東京応化工業	29,600	3,395.00	100,492,000	貸付有価証券 12,900株
大阪有機化学工業	16,000	944.00	15,104,000	
三菱ケミカルホールディングス	1,154,600	730.00	842,858,000	貸付有価証券 145,300株
K Hネオケム	30,400	2,063.00	62,715,200	貸付有価証券 11,300株
ダイセル	254,400	813.00	206,827,200	
住友ベークライト	29,900	3,590.00	107,341,000	
積水化学工業	371,400	1,552.00	576,412,800	貸付有価証券 47,000株
日本ゼオン	155,800	1,160.00	180,728,000	貸付有価証券 1,400株
アイカ工業	51,800	3,015.00	156,177,000	貸付有価証券

				1,900株
宇部興産	87,200	2,016.00	175,795,200	
積水樹脂	28,500	1,906.00	54,321,000	貸付有価証券 3,500株
タキロンシーアイ	37,400	620.00	23,188,000	貸付有価証券 100株
旭有機材	11,900	1,235.00	14,696,500	
日立化成	79,900	3,270.00	261,273,000	貸付有価証券 38,300株
ニチバン	9,100	1,538.00	13,995,800	
リケンテクノス	47,100	492.00	23,173,200	貸付有価証券 5,900株
大倉工業	8,200	1,539.00	12,619,800	貸付有価証券 300株
積水化成品工業	25,700	712.00	18,298,400	貸付有価証券 3,200株
群栄化学工業	4,400	2,335.00	10,274,000	貸付有価証券 500株
タイガースポリマー	9,100	524.00	4,768,400	貸付有価証券 1,100株
ミライアル	5,000	1,209.00	6,045,000	
ダイキアクシス	6,100	748.00	4,562,800	
ダイキョーニシカワ	36,400	746.00	27,154,400	
竹本容器	6,200	921.00	5,710,200	貸付有価証券 800株
森六ホールディングス	9,300	2,217.00	20,618,100	
日本化薬	106,900	1,175.00	125,607,500	貸付有価証券 13,800株
カーリットホールディングス	18,400	565.00	10,396,000	
日本精化	13,900	1,068.00	14,845,200	
扶桑化学工業	17,500	2,248.00	39,340,000	貸付有価証券 2,100株
トリケミカル研究所	3,800	5,000.00	19,000,000	貸付有価証券 1,900株
A D E K A	85,100	1,300.00	110,630,000	貸付有価証券 10,400株
日油	65,000	3,365.00	218,725,000	貸付有価証券 100株
新日本理化	31,200	189.00	5,896,800	貸付有価証券 6,300株

ハリマ化成グループ	14,300	1,124.00	16,073,200	貸付有価証券 1,700株
花王	428,100	7,549.00	3,231,726,900	貸付有価証券 76,500株(4,000株)
第一工業製薬	6,400	2,977.00	19,052,800	
石原ケミカル	4,400	1,569.00	6,903,600	貸付有価証券 700株
日華化学	5,800	800.00	4,640,000	貸付有価証券 2,800株
ニイタカ	2,700	1,445.00	3,901,500	
三洋化成工業	11,600	4,605.00	53,418,000	
有機合成薬品工業	13,200	229.00	3,022,800	貸付有価証券 100株
大日本塗料	19,500	955.00	18,622,500	
日本ペイントホールディングス	142,500	4,700.00	669,750,000	貸付有価証券 33,300株
関西ペイント	194,100	2,100.00	407,610,000	貸付有価証券 36,200株(900株)
神東塗料	13,600	158.00	2,148,800	貸付有価証券 400株
中国塗料	56,700	826.00	46,834,200	貸付有価証券 8,700株
日本特殊塗料	12,900	1,076.00	13,880,400	貸付有価証券 1,500株
藤倉化成	23,300	553.00	12,884,900	
太陽ホールディングス	14,200	3,215.00	45,653,000	
D I C	72,900	2,684.00	195,663,600	貸付有価証券 21,500株
サカタインクス	37,700	898.00	33,854,600	貸付有価証券 5,500株
東洋インキSCホールディングス	36,500	2,154.00	78,621,000	貸付有価証券 15,200株
T & K T O K A	13,400	886.00	11,872,400	貸付有価証券 1,600株
富士フイルムホールディングス	366,300	4,568.00	1,673,258,400	貸付有価証券 500株
資生堂	350,400	7,905.00	2,769,912,000	貸付有価証券 101,600株(3,400株)
ライオン	229,300	2,089.00	479,007,700	貸付有価証券 14,300株(2,100株)
高砂香料工業	12,100	2,650.00	32,065,000	貸付有価証券

				1,500株
マンダム	39,600	2,512.00	99,475,200	貸付有価証券 100株
ミルボン	23,600	5,120.00	120,832,000	貸付有価証券 2,800株
ファンケル	78,500	2,468.00	193,738,000	貸付有価証券 300株
コーセー	29,900	17,230.00	515,177,000	貸付有価証券 8,400株(300株)
コタ	9,200	1,172.00	10,782,400	
シーボン	2,100	2,349.00	4,932,900	貸付有価証券 200株
ポーラ・オルビスホールディングス	75,300	2,552.00	192,165,600	貸付有価証券 42,000株
ノエビアホールディングス	16,800	5,180.00	87,024,000	貸付有価証券 2,000株
アジュバンコスメジャパン	3,900	919.00	3,584,100	貸付有価証券 500株
エステー	12,600	1,495.00	18,837,000	貸付有価証券 1,500株
アグロ カネショウ	5,500	1,425.00	7,837,500	貸付有価証券 900株
コニシ	31,200	1,421.00	44,335,200	貸付有価証券 4,100株
長谷川香料	23,400	1,999.00	46,776,600	貸付有価証券 3,000株
星光PMC	10,100	764.00	7,716,400	貸付有価証券 1,000株
小林製薬	49,400	7,650.00	377,910,000	貸付有価証券 6,900株
荒川化学工業	15,800	1,339.00	21,156,200	貸付有価証券 2,000株
メック	12,100	1,144.00	13,842,400	貸付有価証券 1,600株
日本高純度化学	4,800	2,405.00	11,544,000	貸付有価証券 500株
タカラバイオ	46,200	2,236.00	103,303,200	貸付有価証券 200株
JCU	22,900	1,875.00	42,937,500	貸付有価証券 5,100株
新田ゼラチン	11,100	648.00	7,192,800	貸付有価証券 1,300株

O A T アグリオ	3,000	1,395.00	4,185,000	
デクセリアルズ	45,400	717.00	32,551,800	貸付有価証券 300株
アース製薬	13,300	5,050.00	67,165,000	貸付有価証券 1,700株
北興化学工業	18,100	457.00	8,271,700	
大成ラミック	5,800	2,777.00	16,106,600	
クミアイ化学工業	72,900	899.00	65,537,100	貸付有価証券 13,300株
日本農薬	31,400	449.00	14,098,600	貸付有価証券 1,400株
アキレス	12,800	1,748.00	22,374,400	貸付有価証券 1,500株
有沢製作所	27,800	899.00	24,992,200	貸付有価証券 5,600株
日東電工	121,700	4,915.00	598,155,500	
レック	18,800	969.00	18,217,200	貸付有価証券 3,300株
三光合成	20,200	346.00	6,989,200	
きもと	30,000	171.00	5,130,000	貸付有価証券 4,300株
藤森工業	15,800	2,865.00	45,267,000	
前澤化成工業	12,100	1,095.00	13,249,500	貸付有価証券 1,400株
未来工業	9,500	1,874.00	17,803,000	貸付有価証券 1,200株
ウェーブロックホール ディングス	4,900	755.00	3,699,500	貸付有価証券 800株
J S P	10,300	1,699.00	17,499,700	貸付有価証券 200株
エフピコ	19,400	6,800.00	131,920,000	貸付有価証券 500株
天馬	11,700	1,902.00	22,253,400	
信越ポリマー	31,700	675.00	21,397,500	
東リ	43,900	243.00	10,667,700	貸付有価証券 200株
ニフコ	70,600	2,421.00	170,922,600	貸付有価証券 7,500株
バルカー	14,300	2,045.00	29,243,500	貸付有価証券 1,700株
ユニ・チャーム	339,900	3,130.00	1,063,887,000	貸付有価証券

				64,200株
ショーエイコーポレーション	1,400	784.00	1,097,600	貸付有価証券 100株
協和キリン	177,400	1,817.00	322,335,800	貸付有価証券 87,000株
武田薬品工業	1,539,600	3,543.00	5,454,802,800	貸付有価証券 1,100株
アステラス製薬	1,551,300	1,444.00	2,240,077,200	
大日本住友製薬	130,700	1,877.00	245,323,900	貸付有価証券 16,100株
塩野義製薬	225,500	5,791.00	1,305,870,500	貸付有価証券 27,700株
田辺三菱製薬	184,400	1,167.00	215,194,800	貸付有価証券 2,900株
わかもと製薬	21,000	258.00	5,418,000	貸付有価証券 2,900株(100株)
あすか製薬	21,800	1,059.00	23,086,200	貸付有価証券 200株
日本新薬	46,200	8,680.00	401,016,000	貸付有価証券 500株
ビオフェルミン製薬	3,000	2,124.00	6,372,000	貸付有価証券 300株
中外製薬	183,900	7,430.00	1,366,377,000	貸付有価証券 58,000株(3,500株)
科研製薬	30,200	4,880.00	147,376,000	貸付有価証券 3,900株
エーザイ	211,100	5,386.00	1,136,984,600	貸付有価証券 100株
ロート製薬	90,400	2,570.00	232,328,000	貸付有価証券 1,000株
小野薬品工業	416,500	2,035.00	847,577,500	貸付有価証券 59,900株
久光製薬	52,100	4,315.00	224,811,500	
持田製薬	26,700	4,205.00	112,273,500	
参天製薬	328,400	1,816.00	596,374,400	貸付有価証券 44,300株
扶桑薬品工業	6,200	1,920.00	11,904,000	
日本ケミファ	2,300	2,863.00	6,584,900	貸付有価証券 1,300株
ツムラ	54,600	2,989.00	163,199,400	貸付有価証券 8,400株
日医工	46,400	1,187.00	55,076,800	貸付有価証券

				9,800株
キッセイ薬品工業	31,200	2,492.00	77,750,400	
生化学工業	34,200	1,162.00	39,740,400	貸付有価証券 100株
栄研化学	31,000	1,634.00	50,654,000	
日水製薬	7,400	1,193.00	8,828,200	
鳥居薬品	11,000	2,615.00	28,765,000	貸付有価証券 1,500株
J C Rファーマ	12,400	7,560.00	93,744,000	
東和薬品	25,400	2,430.00	61,722,000	貸付有価証券 8,800株
富士製薬工業	12,000	1,300.00	15,600,000	
沢井製薬	36,200	5,620.00	203,444,000	貸付有価証券 4,500株
ゼリア新薬工業	34,900	1,856.00	64,774,400	貸付有価証券 400株
第一三共	504,700	7,228.00	3,647,971,600	貸付有価証券 62,200株
キョーリン製薬ホールディングス	38,900	1,771.00	68,891,900	
大幸薬品	7,900	2,339.00	18,478,100	
ダイト	10,300	3,070.00	31,621,000	
大塚ホールディングス	336,000	4,291.00	1,441,776,000	貸付有価証券 48,900株（500株）
大正製薬ホールディングス	37,300	7,550.00	281,615,000	
ペプチドリーム	89,200	5,640.00	503,088,000	貸付有価証券 12,600株
日本コークス工業	149,000	86.00	12,814,000	貸付有価証券 18,900株
ニチレキ	22,600	1,026.00	23,187,600	
ユシロ化学工業	9,100	1,313.00	11,948,300	
ビーピー・カストロール	6,300	1,308.00	8,240,400	
富士石油	42,800	232.00	9,929,600	貸付有価証券 7,500株
MORESCO	6,400	1,351.00	8,646,400	貸付有価証券 900株
出光興産	203,600	2,735.00	556,846,000	
J X T Gホールディングス	2,966,300	444.80	1,319,410,240	貸付有価証券 8,600株

コスモエネルギーホールディングス	51,100	1,888.00	96,476,800	貸付有価証券 34,100株
横浜ゴム	102,100	1,948.00	198,890,800	貸付有価証券 31,600株（1,800株）
TOYO TIRE	101,300	1,239.00	125,510,700	貸付有価証券 67,800株
ブリヂストン	542,100	3,937.00	2,134,247,700	貸付有価証券 296,500株
住友ゴム工業	158,400	1,146.00	181,526,400	貸付有価証券 44,800株
藤倉コンポジット	15,400	400.00	6,160,000	
オカモト	11,800	4,080.00	48,144,000	
フコク	7,700	686.00	5,282,200	貸付有価証券 700株
ニッタ	19,900	2,733.00	54,386,700	
住友理工	34,200	754.00	25,786,800	
三ツ星ベルト	23,200	1,740.00	40,368,000	貸付有価証券 2,400株
バンドー化学	33,600	823.00	27,652,800	貸付有価証券 100株
日東紡績	26,200	2,876.00	75,351,200	貸付有価証券 3,300株
A G C	174,300	3,020.00	526,386,000	貸付有価証券 75,400株（1,000株）
日本板硝子	84,300	604.00	50,917,200	貸付有価証券 21,300株（3,700株）
石塚硝子	2,900	1,820.00	5,278,000	
日本山村硝子	7,300	1,292.00	9,431,600	
日本電気硝子	70,800	2,208.00	156,326,400	貸付有価証券 16,100株
オハラ	7,000	1,264.00	8,848,000	貸付有価証券 3,800株（800株）
住友大阪セメント	35,600	4,465.00	158,954,000	貸付有価証券 4,300株
太平洋セメント	111,400	2,624.00	292,313,600	貸付有価証券 13,700株
日本ヒューム	17,700	669.00	11,841,300	
日本コンクリート工業	38,000	247.00	9,386,000	貸付有価証券 300株
三谷セキサン	8,200	2,860.00	23,452,000	貸付有価証券 1,000株

アジアパイルホールディングス	25,000	479.00	11,975,000	
東海カーボン	184,700	983.00	181,560,100	貸付有価証券 123,700株
日本カーボン	9,100	3,530.00	32,123,000	貸付有価証券 5,900株
東洋炭素	10,300	1,941.00	19,992,300	貸付有価証券 200株
ノリタケカンパニーリミテド	10,600	3,880.00	41,128,000	
TOTO	135,700	4,060.00	550,942,000	貸付有価証券 17,100株
日本碍子	215,200	1,464.00	315,052,800	
日本特殊陶業	148,700	1,819.00	270,485,300	貸付有価証券 21,400株
ダントーホールディングス	13,100	110.00	1,441,000	貸付有価証券 1,800株
MARUWA	6,100	6,100.00	37,210,000	
品川リフラクトリーズ	4,600	2,602.00	11,969,200	貸付有価証券 500株
黒崎播磨	3,500	4,975.00	17,412,500	貸付有価証券 400株
ヨータイ	15,400	531.00	8,177,400	
イソライト工業	9,000	414.00	3,726,000	貸付有価証券 2,300株
東京窯業	22,400	282.00	6,316,800	貸付有価証券 3,600株
ニッカトー	8,000	626.00	5,008,000	貸付有価証券 2,100株
フジインコーポレーテッド	15,700	2,368.00	37,177,600	貸付有価証券 1,900株
クニミネ工業	7,900	880.00	6,952,000	貸付有価証券 200株
エーアンドエーマテリアル	3,400	974.00	3,311,600	貸付有価証券 500株
ニチアス	48,300	1,706.00	82,399,800	貸付有価証券 4,600株
ニチハ	24,500	2,580.00	63,210,000	
日本製鉄	810,400	1,455.00	1,179,132,000	貸付有価証券 1,800株
神戸製鋼所	319,200	550.00	175,560,000	貸付有価証券 1,400株

中山製鋼所	24,200	444.00	10,744,800	
合同製鐵	8,400	1,987.00	16,690,800	
ジェイ エフ イー ホールディングス	471,000	1,227.50	578,152,500	貸付有価証券 1,400株
東京製鐵	93,400	794.00	74,159,600	貸付有価証券 13,900株
共英製鋼	19,700	1,802.00	35,499,400	貸付有価証券 3,000株
大和工業	37,100	2,706.00	100,392,600	貸付有価証券 5,000株
東京鐵鋼	7,200	1,201.00	8,647,200	
大阪製鐵	11,600	1,409.00	16,344,400	貸付有価証券 1,400株
淀川製鋼所	23,500	1,813.00	42,605,500	貸付有価証券 2,800株
丸一鋼管	61,800	2,710.00	167,478,000	貸付有価証券 8,600株
モリ工業	5,200	1,832.00	9,526,400	
大同特殊鋼	28,500	3,795.00	108,157,500	貸付有価証券 4,500株
日本高周波鋼業	6,400	435.00	2,784,000	貸付有価証券 300株
日本冶金工業	144,300	200.00	28,860,000	貸付有価証券 96,500株
山陽特殊製鋼	22,000	1,394.00	30,668,000	貸付有価証券 600株（400株）
愛知製鋼	9,800	3,045.00	29,841,000	
日立金属	187,900	1,120.00	210,448,000	貸付有価証券 53,100株
日本金属	4,000	772.00	3,088,000	
大平洋金属	11,800	2,113.00	24,933,400	貸付有価証券 5,100株（200株）
新日本電工	112,400	158.00	17,759,200	貸付有価証券 75,300株（2,100株）
栗本鐵工所	8,800	1,350.00	11,880,000	
虹技	2,600	1,234.00	3,208,400	
日本鑄鉄管	1,800	988.00	1,778,400	貸付有価証券 1,200株（1,000株）
三菱製鋼	12,900	1,093.00	14,099,700	
日亜鋼業	25,500	296.00	7,548,000	貸付有価証券 4,300株（100株）

日本精線	2,500	2,484.00	6,210,000	
エンビプロ・ホールディングス	6,600	639.00	4,217,400	貸付有価証券 3,100株(600株)
シンニッタン	27,100	383.00	10,379,300	貸付有価証券 2,000株
新家工業	4,000	1,343.00	5,372,000	貸付有価証券 400株
大紀アルミニウム工業所	28,700	689.00	19,774,300	貸付有価証券 9,200株
日本軽金属ホールディングス	475,200	183.00	86,961,600	貸付有価証券 600株
三井金属鉱業	47,100	2,165.00	101,971,500	貸付有価証券 12,400株
東邦亜鉛	9,700	1,819.00	17,644,300	貸付有価証券 1,100株
三菱マテリアル	115,200	2,617.00	301,478,400	貸付有価証券 2,200株
住友金属鉱山	238,800	3,084.00	736,459,200	貸付有価証券 32,400株
DOWAホールディングス	40,700	3,520.00	143,264,000	貸付有価証券 5,600株(200株)
古河機械金属	28,800	1,283.00	36,950,400	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,100	1,560.00	31,356,000	貸付有価証券 5,700株
東邦チタニウム	31,200	762.00	23,774,400	貸付有価証券 7,100株
UACJ	26,500	1,503.00	39,829,500	貸付有価証券 10,300株
CKサンエツ	3,300	2,869.00	9,467,700	貸付有価証券 300株
古河電気工業	50,300	2,329.00	117,148,700	貸付有価証券 6,100株
住友電気工業	652,100	1,216.50	793,279,650	
フジクラ	210,600	332.00	69,919,200	貸付有価証券 34,500株(400株)
昭和電線ホールディングス	20,300	748.00	15,184,400	貸付有価証券 100株
東京特殊電線	2,200	1,718.00	3,779,600	
タツタ電線	34,600	440.00	15,224,000	
カナレ電気	2,900	1,769.00	5,130,100	貸付有価証券 200株

平河ヒューテック	7,200	1,054.00	7,588,800	貸付有価証券 800株
リョービ	21,400	1,582.00	33,854,800	貸付有価証券 1,400株
アーレスティ	21,400	539.00	11,534,600	
アサヒホールディングス	32,700	2,189.00	71,580,300	
稲葉製作所	9,800	1,366.00	13,386,800	貸付有価証券 1,400株
宮地エンジニアリンググループ	5,300	1,466.00	7,769,800	貸付有価証券 100株
トーカロ	45,000	766.00	34,470,000	貸付有価証券 100株
アルファC o	6,100	1,164.00	7,100,400	
SUMCO	208,800	1,292.00	269,769,600	貸付有価証券 139,900株
川田テクノロジーズ	3,900	6,410.00	24,999,000	
RS Technologies	4,900	2,897.00	14,195,300	貸付有価証券 600株
信和	9,200	905.00	8,326,000	貸付有価証券 400株
東洋製罐グループホールディングス	111,100	1,611.00	178,982,100	貸付有価証券 13,600株
ホッカンホールディングス	8,800	1,515.00	13,332,000	
コロナ	9,600	987.00	9,475,200	
横河ブリッジホールディングス	32,400	1,478.00	47,887,200	貸付有価証券 400株
駒井ハルテック	3,300	1,420.00	4,686,000	
高田機工	1,600	2,425.00	3,880,000	
三和ホールディングス	180,100	1,158.00	208,555,800	貸付有価証券 700株
文化シャッター	51,400	838.00	43,073,200	貸付有価証券 13,100株（2,100株）
三協立山	24,200	1,133.00	27,418,600	
アルインコ	13,800	940.00	12,972,000	貸付有価証券 1,700株
東洋シャッター	4,200	677.00	2,843,400	貸付有価証券 500株
LIXILグループ	257,300	1,759.00	452,590,700	貸付有価証券 31,500株
日本ファイルコン	13,400	484.00	6,485,600	貸付有価証券

				1,700株
ノーリツ	36,200	1,129.00	40,869,800	貸付有価証券 5,000株
長府製作所	17,700	2,137.00	37,824,900	
リンナイ	31,100	6,600.00	205,260,000	貸付有価証券 4,100株
ダイニチ工業	9,400	616.00	5,790,400	
日東精工	24,100	536.00	12,917,600	
三洋工業	2,300	1,791.00	4,119,300	
岡部	35,300	796.00	28,098,800	
ジーテクト	19,200	1,442.00	27,686,400	貸付有価証券 100株
中国工業	2,600	544.00	1,414,400	
東プレ	32,500	1,609.00	52,292,500	
高周波熱錬	33,600	775.00	26,040,000	貸付有価証券 400株
東京製綱	10,700	897.00	9,597,900	貸付有価証券 1,300株
サンコール	9,800	447.00	4,380,600	貸付有価証券 1,400株
モリテック スチール	13,600	330.00	4,488,000	貸付有価証券 1,600株
パイオラックス	27,900	1,747.00	48,741,300	貸付有価証券 3,400株
エイチワン	17,100	610.00	10,431,000	貸付有価証券 900株
日本発條	173,700	719.00	124,890,300	貸付有価証券 36,400株
中央発條	2,100	2,742.00	5,758,200	貸付有価証券 200株
アドバネクス	2,300	1,610.00	3,703,000	
立川ブラインド工業	7,700	1,383.00	10,649,100	貸付有価証券 200株
三益半導体工業	15,500	1,758.00	27,249,000	貸付有価証券 200株
日本ドライケミカル	4,700	1,146.00	5,386,200	
日本製鋼所	52,900	1,676.00	88,660,400	貸付有価証券 6,500株
三浦工業	75,500	2,798.00	211,249,000	貸付有価証券 3,300株
タクマ	63,600	1,152.00	73,267,200	貸付有価証券

				100株
ツガミ	39,100	834.00	32,609,400	貸付有価証券 26,100株
オークマ	22,200	5,110.00	113,442,000	貸付有価証券 2,900株
東芝機械	19,700	2,011.00	39,616,700	貸付有価証券 500株
アマダホールディングス	262,000	1,035.00	271,170,000	
アイダエンジニアリング	47,100	798.00	37,585,800	貸付有価証券 300株
滝澤鉄工所	5,400	1,252.00	6,760,800	
F U J I	69,600	1,345.00	93,612,000	貸付有価証券 5,500株
牧野フライス製作所	20,400	4,260.00	86,904,000	貸付有価証券 2,500株
オーエスジー	80,500	2,003.00	161,241,500	貸付有価証券 20,300株(3,600株)
ダイジェット工業	2,000	1,426.00	2,852,000	
旭ダイヤモンド工業	45,700	601.00	27,465,700	貸付有価証券 200株
D M G 森精機	110,300	1,412.00	155,743,600	貸付有価証券 60,400株(17,400株)
ソディック	41,000	776.00	31,816,000	貸付有価証券 7,200株
ディスコ	23,600	19,240.00	454,064,000	貸付有価証券 5,100株
日東工器	9,600	2,058.00	19,756,800	
日進工具	5,100	1,923.00	9,807,300	貸付有価証券 600株
パンチ工業	12,100	448.00	5,420,800	
富士ダイス	7,700	568.00	4,373,600	貸付有価証券 100株
豊和工業	9,600	737.00	7,075,200	貸付有価証券 5,000株
O K K	7,100	728.00	5,168,800	
東洋機械金属	12,500	544.00	6,800,000	
津田駒工業	3,400	1,247.00	4,239,800	貸付有価証券 2,200株(1,800株)
エンシュウ	4,500	1,056.00	4,752,000	貸付有価証券 100株
島精機製作所	24,000	2,573.00	61,752,000	貸付有価証券

				3,600株
オプトラン	19,400	2,949.00	57,210,600	貸付有価証券 1,200株
NCホールディングス	5,600	497.00	2,783,200	
イワキポンプ	7,400	882.00	6,526,800	貸付有価証券 1,200株
フリー	13,900	956.00	13,288,400	
ヤマシンフィルタ	30,300	551.00	16,695,300	貸付有価証券 12,400株(5,200株)
日阪製作所	21,500	802.00	17,243,000	貸付有価証券 2,400株
やまびこ	33,800	961.00	32,481,800	
平田機工	8,200	6,910.00	56,662,000	貸付有価証券 1,000株
ペガサスミシン製造	16,300	486.00	7,921,800	
マルマエ	7,100	847.00	6,013,700	貸付有価証券 4,700株(2,100株)
タツモ	8,100	761.00	6,164,100	貸付有価証券 900株
ナプテスコ	102,800	2,975.00	305,830,000	貸付有価証券 68,800株(200株)
三井海洋開発	18,500	2,347.00	43,419,500	貸付有価証券 300株
レオン自動機	17,100	1,459.00	24,948,900	貸付有価証券 2,400株
S M C	51,600	39,320.00	2,028,912,000	貸付有価証券 6,600株
ヤマハモーターロボティクスホールディング	13,200	394.00	5,200,800	貸付有価証券 7,300株(700株)
ホソカワミクロン	6,100	3,780.00	23,058,000	貸付有価証券 700株
ユニオンツール	6,500	3,010.00	19,565,000	
オイレス工業	24,400	1,525.00	37,210,000	
日精エー・エス・ビー機 械	5,900	2,900.00	17,110,000	貸付有価証券 2,400株
サトーホールディングス	21,000	2,561.00	53,781,000	
技研製作所	15,300	3,230.00	49,419,000	貸付有価証券 1,900株
日本エアージェット	5,500	582.00	3,201,000	貸付有価証券 100株
カワタ	4,700	918.00	4,314,600	貸付有価証券

				600株
日精樹脂工業	14,600	917.00	13,388,200	
オカダアイヨン	6,000	1,119.00	6,714,000	貸付有価証券 200株
ワイエイシイホールディングス	6,900	687.00	4,740,300	貸付有価証券 2,400株
小松製作所	798,500	2,255.00	1,800,617,500	貸付有価証券 100,700株
住友重機械工業	100,900	3,075.00	310,267,500	貸付有価証券 100株
日立建機	70,700	2,240.00	158,368,000	貸付有価証券 8,600株
日工	4,800	3,335.00	16,008,000	
巴工業	7,500	2,288.00	17,160,000	貸付有価証券 900株
井関農機	17,600	1,372.00	24,147,200	
TOWA	15,100	701.00	10,585,100	貸付有価証券 8,300株（200株）
丸山製作所	3,900	1,145.00	4,465,500	貸付有価証券 300株
北川鉄工所	7,900	1,845.00	14,575,500	
ローツェ	7,700	2,387.00	18,379,900	貸付有価証券 5,200株（200株）
タカキタ	6,100	528.00	3,220,800	貸付有価証券 2,600株
クボタ	944,800	1,530.50	1,446,016,400	貸付有価証券 447,400株
荏原実業	4,400	1,848.00	8,131,200	貸付有価証券 500株
三菱化工機	6,100	1,578.00	9,625,800	
月島機械	35,000	1,314.00	45,990,000	貸付有価証券 4,700株
帝国電機製作所	12,300	1,140.00	14,022,000	
東京機械製作所	6,700	373.00	2,499,100	貸付有価証券 1,800株
新東工業	41,800	893.00	37,327,400	貸付有価証券 5,300株（100株）
澁谷工業	15,400	2,763.00	42,550,200	貸付有価証券 3,000株
アイチ コーポレーション	30,500	618.00	18,849,000	貸付有価証券 4,400株

小森コーポレーション	44,700	1,043.00	46,622,100	貸付有価証券 5,900株
鶴見製作所	13,700	1,811.00	24,810,700	貸付有価証券 1,700株
住友精密工業	2,900	2,922.00	8,473,800	
日本ギア工業	5,300	470.00	2,491,000	貸付有価証券 3,300株
酒井重工業	3,300	2,949.00	9,731,700	貸付有価証券 1,800株
荏原製作所	78,200	2,379.00	186,037,800	貸付有価証券 22,500株（9,600株）
石井鐵工所	2,700	1,996.00	5,389,200	
酉島製作所	18,000	1,003.00	18,054,000	貸付有価証券 2,200株
北越工業	18,200	1,158.00	21,075,600	
ダイキン工業	240,700	13,270.00	3,194,089,000	貸付有価証券 30,600株
オルガノ	6,300	3,845.00	24,223,500	
トーヨーカネツ	6,600	1,809.00	11,939,400	
栗田工業	95,400	2,751.00	262,445,400	貸付有価証券 11,800株
椿本チエイン	23,100	3,230.00	74,613,000	貸付有価証券 100株
大同工業	8,400	784.00	6,585,600	貸付有価証券 1,000株
木村化工機	14,700	354.00	5,203,800	
アネスト岩田	27,400	893.00	24,468,200	貸付有価証券 300株
ダイフク	97,100	4,795.00	465,594,500	貸付有価証券 44,900株
サムコ	4,800	778.00	3,734,400	貸付有価証券 100株
加藤製作所	9,000	1,613.00	14,517,000	貸付有価証券 500株
油研工業	3,000	1,598.00	4,794,000	
タダノ	85,100	901.00	76,675,100	貸付有価証券 35,700株（2,300株）
フジテック	64,100	1,235.00	79,163,500	貸付有価証券 8,100株
C K D	49,000	1,080.00	52,920,000	貸付有価証券 12,000株

キトー	13,300	1,404.00	18,673,200	
平和	49,200	2,057.00	101,204,400	貸付有価証券 20,000株
理想科学工業	15,600	1,689.00	26,348,400	貸付有価証券 700株
SANKYO	44,200	3,600.00	159,120,000	貸付有価証券 100株
日本金銭機械	19,500	941.00	18,349,500	貸付有価証券 3,200株(900株)
マースグループホールディングス	11,200	1,872.00	20,966,400	
福島工業	10,900	2,919.00	31,817,100	
オーイズミ	7,400	371.00	2,745,400	
ダイコク電機	8,100	1,487.00	12,044,700	貸付有価証券 4,300株
竹内製作所	29,500	1,538.00	45,371,000	貸付有価証券 6,100株
アマノ	50,400	3,140.00	158,256,000	貸付有価証券 1,000株
JUKI	24,500	821.00	20,114,500	貸付有価証券 2,200株
サンデンホールディングス	21,500	469.00	10,083,500	貸付有価証券 10,500株(2,700株)
蛇の目マシン工業	16,000	406.00	6,496,000	
マックス	26,900	1,660.00	44,654,000	貸付有価証券 100株
グローリー	48,900	2,832.00	138,484,800	貸付有価証券 1,100株
新晃工業	16,400	1,616.00	26,502,400	貸付有価証券 2,100株
大和冷機工業	25,500	1,046.00	26,673,000	
セガサミーホールディングス	174,900	1,329.00	232,442,100	貸付有価証券 26,700株
日本ピストンリング	6,400	1,226.00	7,846,400	
リケン	8,200	3,695.00	30,299,000	貸付有価証券 1,000株
TPR	23,700	1,594.00	37,777,800	
ツバキ・ナカシマ	35,900	1,536.00	55,142,400	貸付有価証券 6,300株
ホシザキ	51,500	7,320.00	376,980,000	貸付有価証券 7,400株

大豊工業	14,400	743.00	10,699,200	貸付有価証券 100株
日本精工	362,200	814.00	294,830,800	貸付有価証券 44,600株
N T N	379,000	268.00	101,572,000	貸付有価証券 51,100株（100株）
ジェイテクト	169,200	1,122.00	189,842,400	貸付有価証券 21,400株
不二越	16,400	4,115.00	67,486,000	貸付有価証券 6,100株
日本トムソン	52,300	432.00	22,593,600	貸付有価証券 6,400株
T H K	102,600	2,415.00	247,779,000	貸付有価証券 55,400株
ユーシン精機	13,700	930.00	12,741,000	
前澤給装工業	6,900	1,976.00	13,634,400	貸付有価証券 100株
イーグル工業	21,800	957.00	20,862,600	
前澤工業	11,700	310.00	3,627,000	
日本ピラー工業	17,800	1,025.00	18,245,000	
キッツ	71,500	659.00	47,118,500	貸付有価証券 9,000株
マキタ	214,600	3,080.00	660,968,000	貸付有価証券 30,100株
日立造船	139,800	354.00	49,489,200	貸付有価証券 5,900株
三菱重工業	295,500	4,013.00	1,185,841,500	
I H I	135,500	2,018.00	273,439,000	貸付有価証券 16,600株
スター精密	27,600	1,395.00	38,502,000	貸付有価証券 5,200株
日清紡ホールディングス	117,500	790.00	92,825,000	貸付有価証券 49,100株（300株）
イビデン	108,000	2,053.00	221,724,000	
コニカミノルタ	385,300	732.00	282,039,600	貸付有価証券 500株
ブラザー工業	229,700	1,838.00	422,188,600	貸付有価証券 28,200株
ミネベアミツミ	327,400	1,577.00	516,309,800	貸付有価証券 41,800株
日立製作所	793,900	3,670.00	2,913,613,000	貸付有価証券

				3,800株
三菱電機	1,763,500	1,271.00	2,241,408,500	貸付有価証券 4,500株
富士電機	114,400	3,090.00	353,496,000	貸付有価証券 14,400株
東洋電機製造	6,900	1,592.00	10,984,800	
安川電機	204,400	3,455.00	706,202,000	貸付有価証券 88,300株
シンフォニアテクノロジー	24,500	1,075.00	26,337,500	
明電舎	34,900	1,632.00	56,956,800	貸付有価証券 300株
オリジン	4,800	1,391.00	6,676,800	
山洋電気	8,500	4,160.00	35,360,000	貸付有価証券 1,000株
デンヨー	16,300	1,518.00	24,743,400	
東芝テック	22,100	3,215.00	71,051,500	
芝浦メカトロニクス	3,100	2,812.00	8,717,200	
マブチモーター	48,800	3,640.00	177,632,000	貸付有価証券 13,000株
日本電産	212,200	13,740.00	2,915,628,000	貸付有価証券 30,200株
ユー・エム・シー・エレクトロニクス	9,500	766.00	7,277,000	貸付有価証券 3,300株
トレックス・セミコンダクター	7,900	1,127.00	8,903,300	貸付有価証券 900株
東光高岳	8,900	1,148.00	10,217,200	貸付有価証券 1,100株
ダブル・スコープ	24,000	850.00	20,400,000	貸付有価証券 8,800株(100株)
ダイヘン	19,300	2,932.00	56,587,600	貸付有価証券 2,500株
ヤーマン	25,600	798.00	20,428,800	貸付有価証券 13,800株(300株)
JVCケンウッド	134,700	274.00	36,907,800	
ミマキエンジニアリング	15,800	520.00	8,216,000	貸付有価証券 1,700株
第一精工	6,400	1,565.00	10,016,000	貸付有価証券 4,200株
日新電機	41,300	1,184.00	48,899,200	貸付有価証券 5,000株

大崎電気工業	35,100	653.00	22,920,300	貸付有価証券 200株
オムロン	187,400	5,130.00	961,362,000	貸付有価証券 25,300株
日東工業	28,300	2,080.00	58,864,000	貸付有価証券 100株
I D E C	23,600	1,810.00	42,716,000	貸付有価証券 3,000株
正興電機製作所	4,100	727.00	2,980,700	
不二電機工業	1,900	1,204.00	2,287,600	貸付有価証券 1,000株
ジーエス・ユアサ コー ポレーション	63,400	1,830.00	116,022,000	貸付有価証券 8,000株
サクサホールディングス	4,400	1,834.00	8,069,600	貸付有価証券 500株
メルコホールディングス	7,300	2,839.00	20,724,700	貸付有価証券 4,000株
テクノメディカ	4,000	2,132.00	8,528,000	貸付有価証券 900株
日本電気	228,200	4,645.00	1,059,989,000	貸付有価証券 700株
富士通	170,000	8,542.00	1,452,140,000	貸付有価証券 700株
沖電気工業	76,400	1,449.00	110,703,600	貸付有価証券 200株
岩崎通信機	8,300	774.00	6,424,200	貸付有価証券 100株
電気興業	9,300	2,925.00	27,202,500	貸付有価証券 100株
サンケン電気	20,600	1,807.00	37,224,200	貸付有価証券 6,000株
ナカヨ	3,400	1,689.00	5,742,600	
アイホン	10,000	1,654.00	16,540,000	
ルネサスエレクトロニク ス	838,000	630.00	527,940,000	貸付有価証券 172,700株
セイコーエプソン	218,800	1,396.00	305,444,800	貸付有価証券 27,000株
ワコム	127,700	364.00	46,482,800	貸付有価証券 6,100株
アルバック	35,100	4,290.00	150,579,000	貸付有価証券 19,200株（3,000株）
アクセル	7,400	630.00	4,662,000	貸付有価証券

				900株
E I Z O	16,200	3,645.00	59,049,000	貸付有価証券 1,900株
ジャパンディスプレイ	417,000	62.00	25,854,000	貸付有価証券 270,600株(13,800 株)
日本信号	44,900	1,127.00	50,602,300	貸付有価証券 5,700株
京三製作所	37,900	353.00	13,378,700	貸付有価証券 700株
能美防災	23,300	2,139.00	49,838,700	
ホーチキ	11,200	1,332.00	14,918,400	
星和電機	9,400	525.00	4,935,000	貸付有価証券 1,400株
エレコム	16,700	4,155.00	69,388,500	
パナソニック	2,014,700	806.90	1,625,661,430	貸付有価証券 61,000株
シャープ	174,900	1,123.00	196,412,700	貸付有価証券 117,600株(7,200株)
アンリツ	113,500	1,957.00	222,119,500	貸付有価証券 62,200株
富士通ゼネラル	53,800	1,656.00	89,092,800	貸付有価証券 33,000株(10,500株)
ソニー	1,183,500	5,896.00	6,977,916,000	貸付有価証券 145,700株
T D K	92,200	8,400.00	774,480,000	
帝国通信工業	7,800	1,091.00	8,509,800	
タムラ製作所	68,000	563.00	38,284,000	貸付有価証券 9,900株
アルプスアルパイン	183,600	1,755.00	322,218,000	貸付有価証券 200株
池上通信機	5,600	1,058.00	5,924,800	貸付有価証券 100株
日本電波工業	15,900	447.00	7,107,300	貸付有価証券 3,400株
鈴木	9,500	609.00	5,785,500	貸付有価証券 1,100株
日本トリム	3,300	4,775.00	15,757,500	
ローランド ディー . ジー .	9,700	1,994.00	19,341,800	
フォスター電機	19,900	1,737.00	34,566,300	貸付有価証券

				500株
S M K	4,900	2,735.00	13,401,500	貸付有価証券 2,700株
ヨコオ	12,600	2,566.00	32,331,600	貸付有価証券 200株
ティアック	12,700	193.00	2,451,100	貸付有価証券 7,100株(300株)
ホシデン	51,900	1,002.00	52,003,800	貸付有価証券 7,200株
ヒロセ電機	25,200	11,850.00	298,620,000	貸付有価証券 3,200株
日本航空電子工業	40,400	1,433.00	57,893,200	貸付有価証券 2,700株
T O A	18,900	1,245.00	23,530,500	
マクセルホールディング ス	38,000	1,384.00	52,592,000	貸付有価証券 8,600株(3,300株)
古野電気	22,700	864.00	19,612,800	貸付有価証券 3,100株
ユニデンホールディング ス	5,200	1,747.00	9,084,400	
スミダコーポレーション	13,500	999.00	13,486,500	貸付有価証券 7,400株
アイコム	9,800	2,325.00	22,785,000	貸付有価証券 1,200株
リオン	8,100	2,393.00	19,383,300	
本多通信工業	15,100	456.00	6,885,600	貸付有価証券 100株
船井電機	17,800	606.00	10,786,800	貸付有価証券 5,900株
横河電機	176,500	1,999.00	352,823,500	貸付有価証券 21,900株
新電元工業	6,200	3,195.00	19,809,000	
アズビル	111,300	2,694.00	299,842,200	貸付有価証券 14,000株
東亜ディーケーケー	8,700	772.00	6,716,400	貸付有価証券 200株
日本光電工業	77,700	3,050.00	236,985,000	貸付有価証券 400株
チノー	6,100	1,233.00	7,521,300	
共和電業	18,400	407.00	7,488,800	貸付有価証券 2,200株
日本電子材料	7,000	478.00	3,346,000	貸付有価証券

				1,500株
堀場製作所	34,900	5,450.00	190,205,000	貸付有価証券 6,000株
アドバンテスト	120,200	4,025.00	483,805,000	貸付有価証券 15,000株
小野測器	7,300	499.00	3,642,700	
エスペック	15,600	1,879.00	29,312,400	貸付有価証券 1,900株
キーエンス	86,600	59,160.00	5,123,256,000	貸付有価証券 11,300株
日置電機	9,200	3,320.00	30,544,000	貸付有価証券 1,800株
シスメックス	137,400	6,437.00	884,443,800	貸付有価証券 26,400株
日本マイクロニクス	30,700	771.00	23,669,700	貸付有価証券 4,300株
メガチップス	13,900	1,602.00	22,267,800	貸付有価証券 6,100株
O B A R A G R O U P	9,100	3,195.00	29,074,500	貸付有価証券 1,100株
澤藤電機	2,100	1,748.00	3,670,800	
原田工業	7,100	830.00	5,893,000	貸付有価証券 4,000株
コーセル	22,400	1,014.00	22,713,600	貸付有価証券 10,900株（800株）
イリソ電子工業	16,200	5,130.00	83,106,000	貸付有価証券 8,300株（100株）
オプテックスグループ	28,900	1,369.00	39,564,100	貸付有価証券 4,400株
千代田インテグレ	8,100	1,907.00	15,446,700	
アイ・オー・データ機器	6,500	898.00	5,837,000	貸付有価証券 900株
レーザーテック	36,100	5,780.00	208,658,000	貸付有価証券 1,700株
スタンレー電気	124,400	2,545.00	316,598,000	
岩崎電気	6,900	1,218.00	8,404,200	貸付有価証券 800株
ウシオ電機	102,400	1,324.00	135,577,600	貸付有価証券 15,800株
岡谷電機産業	12,600	376.00	4,737,600	貸付有価証券 2,900株
ヘリオス テクノ ホー	16,200	546.00	8,845,200	貸付有価証券

ルディング				3,000株
エノモト	4,900	872.00	4,272,800	
日本セラミック	17,900	2,632.00	47,112,800	貸付有価証券 2,100株
遠藤照明	8,900	658.00	5,856,200	
古河電池	12,600	604.00	7,610,400	貸付有価証券 4,400株
双信電機	8,500	462.00	3,927,000	貸付有価証券 5,600株(300株)
山一電機	12,800	1,141.00	14,604,800	貸付有価証券 2,700株(900株)
図研	11,500	1,871.00	21,516,500	貸付有価証券 1,400株
日本電子	34,800	2,324.00	80,875,200	貸付有価証券 4,400株
カシオ計算機	156,000	1,425.00	222,300,000	貸付有価証券 42,000株(900株)
ファナック	167,600	18,010.00	3,018,476,000	貸付有価証券 100株
日本シイエムケイ	44,900	512.00	22,988,800	貸付有価証券 22,700株(2,500株)
エンプラス	8,000	3,165.00	25,320,000	
大真空	6,400	994.00	6,361,600	貸付有価証券 800株
ローム	84,300	7,570.00	638,151,000	
浜松ホトニクス	126,500	3,685.00	466,152,500	貸付有価証券 17,400株
三井ハイテック	19,400	1,202.00	23,318,800	貸付有価証券 8,300株(700株)
新光電気工業	59,200	823.00	48,721,600	
京セラ	268,800	6,369.00	1,711,987,200	
太陽誘電	78,400	2,086.00	163,542,400	貸付有価証券 52,800株
村田製作所	555,000	4,522.00	2,509,710,000	貸付有価証券 69,000株
双葉電子工業	27,900	1,352.00	37,720,800	
北陸電気工業	6,600	960.00	6,336,000	貸付有価証券 800株
ニチコン	55,500	873.00	48,451,500	貸付有価証券 7,200株
日本ケミコン	12,500	1,400.00	17,500,000	貸付有価証券

				6,400株
K O A	26,600	1,244.00	33,090,400	貸付有価証券 3,200株
市光工業	26,400	678.00	17,899,200	貸付有価証券 3,400株
小糸製作所	105,600	4,910.00	518,496,000	貸付有価証券 15,900株
ミツバ	32,400	538.00	17,431,200	貸付有価証券 4,300株
S C R E E Nホールディングス	30,600	5,790.00	177,174,000	貸付有価証券 5,100株（100株）
キヤノン電子	18,500	1,751.00	32,393,500	貸付有価証券 1,800株
キヤノン	949,400	2,754.50	2,615,122,300	貸付有価証券 614,900株（11,500株）
リコー	530,200	947.00	502,099,400	貸付有価証券 27,900株
象印マホービン	51,700	1,246.00	64,418,200	貸付有価証券 34,600株（1,100株）
M U T O Hホールディングス	2,400	1,614.00	3,873,600	
東京エレクトロン	117,600	18,675.00	2,196,180,000	貸付有価証券 200株（200株）
トヨタ紡織	61,700	1,391.00	85,824,700	貸付有価証券 7,500株
芦森工業	3,600	1,347.00	4,849,200	貸付有価証券 1,000株
ユニプレス	34,200	1,612.00	55,130,400	貸付有価証券 4,900株
豊田自動織機	142,700	5,500.00	784,850,000	貸付有価証券 23,000株
モリタホールディングス	30,800	1,567.00	48,263,600	貸付有価証券 3,500株
三櫻工業	22,400	440.00	9,856,000	貸付有価証券 9,000株
デンソー	388,300	4,257.00	1,652,993,100	貸付有価証券 47,800株
東海理化電機製作所	46,400	1,618.00	75,075,200	貸付有価証券 100株
三井E & Sホールディングス	63,700	828.00	52,743,600	貸付有価証券 5,900株（1,100株）
川崎重工業	137,200	2,017.00	276,732,400	

				貸付有価証券 700株
名村造船所	53,000	225.00	11,925,000	貸付有価証券 4,300株
サノヤホールディングス	23,200	171.00	3,967,200	貸付有価証券 1,800株
日本車輛製造	6,400	2,266.00	14,502,400	貸付有価証券 3,200株
三菱ロジスネクスト	21,000	1,033.00	21,693,000	貸付有価証券 2,600株
近畿車輛	2,600	1,396.00	3,629,600	貸付有価証券 600株
日産自動車	2,079,900	663.40	1,379,805,660	貸付有価証券 33,000株
いすゞ自動車	557,400	1,090.00	607,566,000	貸付有価証券 79,000株
トヨタ自動車	1,965,300	6,873.00	13,507,506,900	貸付有価証券 900株
日野自動車	220,200	843.00	185,628,600	貸付有価証券 27,100株
三菱自動車工業	652,800	426.00	278,092,800	貸付有価証券 96,900株
エフテック	12,300	719.00	8,843,700	
レシップホールディングス	6,300	800.00	5,040,000	貸付有価証券 100株
G M B	3,400	760.00	2,584,000	貸付有価証券 100株
ファルテック	3,100	718.00	2,225,800	
武蔵精密工業	42,800	1,135.00	48,578,000	貸付有価証券 18,200株
日産車体	34,400	901.00	30,994,400	貸付有価証券 4,500株
新明和工業	73,900	1,231.00	90,970,900	貸付有価証券 9,600株
極東開発工業	35,100	1,178.00	41,347,800	貸付有価証券 4,400株
日信工業	32,300	1,373.00	44,347,900	
トピー工業	14,500	1,761.00	25,534,500	
ティラド	6,400	1,753.00	11,219,200	
タチエス	28,900	1,220.00	35,258,000	貸付有価証券 3,800株
N O K	94,800	1,404.00	133,099,200	貸付有価証券

				31,200株
フタバ産業	49,000	680.00	33,320,000	貸付有価証券 11,100株
K Y B	18,300	2,854.00	52,228,200	貸付有価証券 3,000株
大同メタル工業	28,600	592.00	16,931,200	
プレス工業	87,400	425.00	37,145,000	貸付有価証券 300株
ミクニ	22,400	309.00	6,921,600	
太平洋工業	36,900	1,407.00	51,918,300	貸付有価証券 4,700株
ケーヒン	40,500	1,343.00	54,391,500	貸付有価証券 5,000株
河西工業	21,600	699.00	15,098,400	
アイシン精機	145,200	2,984.00	433,276,800	貸付有価証券 1,200株
マツダ	553,500	897.30	496,655,550	貸付有価証券 68,100株
今仙電機製作所	16,400	842.00	13,808,800	貸付有価証券 100株
本田技研工業	1,487,700	2,472.00	3,677,594,400	貸付有価証券 191,500株
スズキ	322,600	3,880.00	1,251,688,000	貸付有価証券 44,500株
S U B A R U	547,500	2,716.50	1,487,283,750	
安永	8,500	1,249.00	10,616,500	貸付有価証券 3,900株
ヤマハ発動機	230,000	1,747.00	401,810,000	貸付有価証券 89,700株
ショーワ	41,600	1,289.00	53,622,400	貸付有価証券 100株
T B K	20,900	383.00	8,004,700	貸付有価証券 2,700株（100株）
エクセディ	23,900	1,953.00	46,676,700	
豊田合成	56,900	1,936.00	110,158,400	貸付有価証券 400株
愛三工業	27,600	710.00	19,596,000	
盟和産業	2,700	998.00	2,694,600	貸付有価証券 300株
日本プラスト	13,800	670.00	9,246,000	
ヨロズ	16,500	1,209.00	19,948,500	貸付有価証券

				200株
エフ・シー・シー	31,700	1,834.00	58,137,800	
シマノ	66,000	15,120.00	997,920,000	貸付有価証券 6,500株
テイ・エス テック	41,000	2,779.00	113,939,000	
ジャムコ	8,800	1,545.00	13,596,000	貸付有価証券 2,700株
テルモ	499,000	3,270.00	1,631,730,000	貸付有価証券 71,100株
クリエートメディック	5,800	898.00	5,208,400	
日機装	52,900	1,115.00	58,983,500	貸付有価証券 14,600株
島津製作所	227,000	2,548.00	578,396,000	貸付有価証券 6,800株
JMS	16,300	646.00	10,529,800	貸付有価証券 100株
クボテック	3,800	385.00	1,463,000	貸付有価証券 2,500株
長野計器	13,800	665.00	9,177,000	貸付有価証券 200株
ブイ・テクノロジー	8,300	5,710.00	47,393,000	貸付有価証券 2,500株
東京計器	11,200	865.00	9,688,000	
愛知時計電機	2,300	3,990.00	9,177,000	
インターアクション	9,500	1,856.00	17,632,000	貸付有価証券 4,500株
オーバル	17,200	226.00	3,887,200	貸付有価証券 2,100株
東京精密	31,900	2,782.00	88,745,800	
マニー	23,400	7,480.00	175,032,000	貸付有価証券 5,600株
ニコン	307,300	1,333.00	409,630,900	貸付有価証券 47,100株(100株)
トプコン	94,700	1,190.00	112,693,000	貸付有価証券 11,900株
オリンパス	1,050,800	1,272.00	1,336,617,600	貸付有価証券 138,200株(100株)
理研計器	15,500	1,822.00	28,241,000	貸付有価証券 1,900株
タムロン	14,200	2,334.00	33,142,800	
HOYA	355,000	8,480.00	3,010,400,000	貸付有価証券

				1,700株
シード	7,500	943.00	7,072,500	貸付有価証券 1,100株
ノーリツ鋼機	13,900	1,841.00	25,589,900	貸付有価証券 1,900株
エー・アンド・デイ	16,100	689.00	11,092,900	貸付有価証券 1,900株
朝日インテック	149,600	2,612.00	390,755,200	貸付有価証券 37,000株
シチズン時計	192,900	489.00	94,328,100	貸付有価証券 27,600株
リズム時計工業	6,000	1,076.00	6,456,000	貸付有価証券 700株
大研医器	13,900	568.00	7,895,200	貸付有価証券 100株
メニコン	24,200	3,985.00	96,437,000	貸付有価証券 16,000株
シンシア	1,900	636.00	1,208,400	貸付有価証券 1,000株
松風	8,600	1,506.00	12,951,600	
セイコーホールディングス	27,200	2,241.00	60,955,200	貸付有価証券 4,500株(600株)
ニプロ	122,000	1,164.00	142,008,000	貸付有価証券 15,900株
中本パックス	4,900	1,421.00	6,962,900	貸付有価証券 200株
スノーピーク	7,800	1,178.00	9,188,400	貸付有価証券 1,000株
パラマウントベッドホールディングス	20,300	3,900.00	79,170,000	
トランザクション	11,200	1,085.00	12,152,000	貸付有価証券 500株(500株)
S H O - B I	5,100	347.00	1,769,700	貸付有価証券 1,000株
ニホンフラッシュ	7,500	2,667.00	20,002,500	貸付有価証券 500株
前田工織	19,400	1,468.00	28,479,200	貸付有価証券 5,900株(600株)
永大産業	23,100	308.00	7,114,800	貸付有価証券 3,200株
アートネイチャー	18,800	630.00	11,844,000	
バンダイナムコホール	182,300	6,140.00	1,119,322,000	貸付有価証券

ディングス				37,000株
アイフィスジャパン	4,500	652.00	2,934,000	貸付有価証券 600株
共立印刷	29,400	147.00	4,321,800	
S H O E I	8,500	4,370.00	37,145,000	貸付有価証券 1,000株
フランスベッドホールディングス	24,900	997.00	24,825,300	
パイロットコーポレーション	30,800	3,590.00	110,572,000	貸付有価証券 600株
萩原工業	9,800	1,341.00	13,141,800	
トッパン・フォームズ	37,800	884.00	33,415,200	貸付有価証券 400株
フジシールインターナショナル	39,500	2,816.00	111,232,000	貸付有価証券 1,500株
タカラトミー	73,800	1,099.00	81,106,200	
廣済堂	16,400	698.00	11,447,200	貸付有価証券 2,500株
エステールホールディングス	4,700	616.00	2,895,200	貸付有価証券 100株
アーク	67,300	95.00	6,393,500	貸付有価証券 8,800株
タカノ	6,900	724.00	4,995,600	貸付有価証券 4,000株
プロネクサス	15,100	1,019.00	15,386,900	貸付有価証券 1,800株
ホクシン	10,900	136.00	1,482,400	
ウッドワン	5,900	1,036.00	6,112,400	
大建工業	13,300	1,897.00	25,230,100	
凸版印刷	262,100	1,599.00	419,097,900	貸付有価証券 900株
大日本印刷	248,500	2,275.00	565,337,500	
共同印刷	5,400	2,718.00	14,677,200	
N I S S H A	36,200	990.00	35,838,000	貸付有価証券 6,300株
光村印刷	1,500	1,672.00	2,508,000	
宝印刷	8,500	1,608.00	13,668,000	貸付有価証券 1,000株
アシックス	145,500	1,459.00	212,284,500	貸付有価証券 63,300株
ツツミ	5,500	2,108.00	11,594,000	

小松ウオール工業	5,400	1,856.00	10,022,400	
ヤマハ	104,900	4,750.00	498,275,000	貸付有価証券 13,200株
河合楽器製作所	5,400	2,935.00	15,849,000	貸付有価証券 100株
クリナップ	16,400	538.00	8,823,200	貸付有価証券 800株
ピジョン	106,600	3,790.00	404,014,000	貸付有価証券 71,100株(9,200株)
兼松サステック	1,100	1,708.00	1,878,800	
キングジム	14,700	838.00	12,318,600	貸付有価証券 2,800株
リンテック	41,900	1,996.00	83,632,400	貸付有価証券 600株
イトーキ	37,500	430.00	16,125,000	貸付有価証券 300株
任天堂	100,900	39,960.00	4,031,964,000	
三菱鉛筆	29,000	1,549.00	44,921,000	
タカラスタンダード	36,400	1,666.00	60,642,400	貸付有価証券 4,900株
コクヨ	84,600	1,415.00	119,709,000	貸付有価証券 19,400株
ナカバヤシ	17,300	517.00	8,944,100	
グローブライト	8,500	3,080.00	26,180,000	
オカムラ	61,500	1,064.00	65,436,000	貸付有価証券 7,500株
美津濃	17,500	2,754.00	48,195,000	
東京電力ホールディングス	1,407,800	512.00	720,793,600	貸付有価証券 174,700株
中部電力	539,500	1,557.50	840,271,250	貸付有価証券 76,300株
関西電力	719,600	1,275.50	917,849,800	貸付有価証券 92,200株
中国電力	243,800	1,341.00	326,935,800	貸付有価証券 76,200株(9,100株)
北陸電力	172,700	658.00	113,636,600	貸付有価証券 30,100株
東北電力	413,000	1,055.00	435,715,000	
四国電力	158,800	978.00	155,306,400	貸付有価証券 30,400株
九州電力	363,500	1,040.00	378,040,000	貸付有価証券

				60,200株
北海道電力	165,000	547.00	90,255,000	貸付有価証券 28,700株
沖縄電力	32,700	1,582.00	51,731,400	
電源開発	140,300	2,336.00	327,740,800	貸付有価証券 400株
エフオン	8,300	721.00	5,984,300	貸付有価証券 100株
イーレックス	30,600	1,340.00	41,004,000	貸付有価証券 5,500株
レノバ	29,000	824.00	23,896,000	貸付有価証券 16,100株
東京瓦斯	346,000	2,709.50	937,487,000	貸付有価証券 42,600株
大阪瓦斯	342,200	1,954.00	668,658,800	貸付有価証券 42,100株
東邦瓦斯	87,300	4,050.00	353,565,000	貸付有価証券 12,400株
北海道瓦斯	9,500	1,458.00	13,851,000	
広島ガス	36,300	329.00	11,942,700	貸付有価証券 3,500株
西部瓦斯	19,900	2,068.00	41,153,200	貸付有価証券 2,500株
静岡ガス	50,100	849.00	42,534,900	
メタウォーター	8,500	3,870.00	32,895,000	
SBSホールディングス	15,200	1,502.00	22,830,400	貸付有価証券 1,900株
東武鉄道	186,000	3,230.00	600,780,000	貸付有価証券 23,600株
相鉄ホールディングス	60,500	2,795.00	169,097,500	貸付有価証券 8,100株
東京急行電鉄	479,000	1,888.00	904,352,000	貸付有価証券 78,800株
京浜急行電鉄	241,600	1,998.00	482,716,800	貸付有価証券 38,400株
小田急電鉄	282,500	2,441.00	689,582,500	貸付有価証券 3,400株
京王電鉄	98,500	6,860.00	675,710,000	貸付有価証券 3,900株
京成電鉄	132,200	4,075.00	538,715,000	貸付有価証券 17,500株
富士急行	24,000	4,395.00	105,480,000	貸付有価証券

				15,700株
新京成電鉄	4,500	2,028.00	9,126,000	
東日本旅客鉄道	313,600	10,085.00	3,162,656,000	貸付有価証券 39,200株
西日本旅客鉄道	158,100	8,828.00	1,395,706,800	貸付有価証券 24,500株
東海旅客鉄道	157,900	20,955.00	3,308,794,500	貸付有価証券 1,300株
西武ホールディングス	218,400	1,763.00	385,039,200	貸付有価証券 28,300株
鴻池運輸	28,100	1,637.00	45,999,700	貸付有価証券 3,400株
西日本鉄道	48,900	2,227.00	108,900,300	貸付有価証券 1,600株
ハマキョウレックス	13,500	3,605.00	48,667,500	
サカイ引越センター	9,300	6,080.00	56,544,000	貸付有価証券 1,500株
近鉄グループホールディングス	167,000	5,200.00	868,400,000	貸付有価証券 23,600株
阪急阪神ホールディングス	222,800	3,975.00	885,630,000	貸付有価証券 28,000株
南海電気鉄道	74,500	2,686.00	200,107,000	貸付有価証券 200株
京阪ホールディングス	74,400	4,415.00	328,476,000	貸付有価証券 11,600株
神戸電鉄	4,300	3,960.00	17,028,000	貸付有価証券 2,300株
名古屋鉄道	137,200	3,155.00	432,866,000	貸付有価証券 2,200株
山陽電気鉄道	12,800	2,116.00	27,084,800	貸付有価証券 1,500株
日本通運	64,400	5,410.00	348,404,000	貸付有価証券 8,000株
ヤマトホールディングス	292,800	1,811.50	530,407,200	貸付有価証券 1,700株
山九	46,400	5,450.00	252,880,000	貸付有価証券 100株
丸運	9,500	259.00	2,460,500	貸付有価証券 1,100株
丸全昭和運輸	13,500	3,085.00	41,647,500	貸付有価証券 1,700株
センコーグループホール	92,100	822.00	75,706,200	貸付有価証券

ディングス				1,700株
トナミホールディングス	4,000	4,570.00	18,280,000	貸付有価証券 400株
ニッコンホールディングス	63,500	2,401.00	152,463,500	貸付有価証券 7,900株
日本石油輸送	2,000	2,891.00	5,782,000	
福山通運	21,400	3,805.00	81,427,000	貸付有価証券 2,600株
セイノーホールディングス	125,100	1,345.00	168,259,500	貸付有価証券 15,800株
エスライン	5,000	829.00	4,145,000	貸付有価証券 600株
神奈川中央交通	4,100	3,730.00	15,293,000	貸付有価証券 2,200株
日立物流	36,700	3,315.00	121,660,500	貸付有価証券 5,200株
丸和運輸機関	8,800	4,785.00	42,108,000	貸付有価証券 1,700株
C & F ロジホールディングス	16,900	1,204.00	20,347,600	貸付有価証券 2,200株
九州旅客鉄道	140,200	3,195.00	447,939,000	貸付有価証券 100株
S Gホールディングス	157,800	2,679.00	422,746,200	貸付有価証券 56,500株
日本郵船	139,700	1,589.00	221,983,300	貸付有価証券 27,400株(9,100株)
商船三井	99,100	2,445.00	242,299,500	貸付有価証券 1,200株
川崎汽船	51,400	1,073.00	55,152,200	貸付有価証券 33,200株
N S ユナイテッド海運	9,200	2,078.00	19,117,600	貸付有価証券 1,300株
明治海運	17,700	298.00	5,274,600	貸付有価証券 2,300株
飯野海運	79,100	327.00	25,865,700	貸付有価証券 200株
共栄タンカー	1,500	1,307.00	1,960,500	
乾汽船	15,000	931.00	13,965,000	貸付有価証券 2,300株
日本航空	305,800	3,308.00	1,011,586,400	貸付有価証券 1,100株
A N Aホールディングス	305,300	3,612.00	1,102,743,600	貸付有価証券

				5,500株
パスコ	3,200	865.00	2,768,000	貸付有価証券 200株
トランコム	4,700	6,090.00	28,623,000	
日新	14,400	1,502.00	21,628,800	
三菱倉庫	57,800	2,622.00	151,551,600	貸付有価証券 16,500株
三井倉庫ホールディングス	20,400	1,569.00	32,007,600	
住友倉庫	61,500	1,366.00	84,009,000	貸付有価証券 7,800株
澁澤倉庫	9,200	1,802.00	16,578,400	貸付有価証券 1,100株
東陽倉庫	30,100	293.00	8,819,300	貸付有価証券 4,100株(100株)
日本トランスシティ	36,800	460.00	16,928,000	貸付有価証券 4,800株(100株)
ケイヒン	3,200	1,187.00	3,798,400	
中央倉庫	10,200	1,020.00	10,404,000	貸付有価証券 1,300株
川西倉庫	3,400	1,037.00	3,525,800	
安田倉庫	13,700	906.00	12,412,200	貸付有価証券 100株
ファイズ	3,000	675.00	2,025,000	貸付有価証券 600株
東洋埠頭	5,100	1,318.00	6,721,800	貸付有価証券 600株
宇徳	14,300	512.00	7,321,600	貸付有価証券 1,700株
上組	103,000	2,457.00	253,071,000	貸付有価証券 12,700株
サンリツ	3,900	654.00	2,550,600	貸付有価証券 400株
キムラユニティー	4,500	994.00	4,473,000	
キューソー流通システム	4,200	1,811.00	7,606,200	貸付有価証券 500株
近鉄エクスプレス	31,500	1,418.00	44,667,000	
東海運	9,500	304.00	2,888,000	貸付有価証券 1,300株
エーアイテイー	10,800	926.00	10,000,800	貸付有価証券 1,400株

内外トランスライン	5,900	1,200.00	7,080,000	
日本コンセプト	5,300	1,258.00	6,667,400	貸付有価証券 200株
NEC ネットエスアイ	19,100	2,747.00	52,467,700	貸付有価証券 2,600株
クロスキャット	4,500	959.00	4,315,500	貸付有価証券 2,300株
システナ	61,700	1,718.00	106,000,600	
デジタルアーツ	9,300	7,720.00	71,796,000	貸付有価証券 1,500株
日鉄ソリューションズ	25,900	3,490.00	90,391,000	貸付有価証券 100株
キューブシステム	9,200	760.00	6,992,000	貸付有価証券 5,400株
エイジア	3,400	1,330.00	4,522,000	
コア	7,300	1,301.00	9,497,300	貸付有価証券 1,000株
ソリトンシステムズ	7,600	957.00	7,273,200	貸付有価証券 2,500株
ソフトクリエイトホールディングス	7,500	1,667.00	12,502,500	
T I S	57,700	6,070.00	350,239,000	貸付有価証券 500株
ネオス	6,900	718.00	4,954,200	貸付有価証券 4,600株（500株）
電算システム	6,600	2,903.00	19,159,800	貸付有価証券 900株
グリー	119,400	469.00	55,998,600	貸付有価証券 44,900株
コーエーテクモホールディングス	35,400	2,083.00	73,738,200	貸付有価証券 4,400株
三菱総合研究所	7,400	3,770.00	27,898,000	
ボルテージ	3,200	508.00	1,625,600	貸付有価証券 300株
電算	1,900	1,977.00	3,756,300	貸付有価証券 200株
A G S	9,800	642.00	6,291,600	貸付有価証券 300株
ファインデックス	14,600	1,103.00	16,103,800	貸付有価証券 4,700株（2,600株）
ブレインパッド	3,300	6,790.00	22,407,000	貸付有価証券 2,200株

K L a b	33,100	1,017.00	33,662,700	貸付有価証券 18,300株(900株)
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディ	23,000	1,131.00	26,013,000	
イーブックイニシアティブジャパン	2,800	1,801.00	5,042,800	貸付有価証券 1,800株
ネクソン	490,800	1,317.00	646,383,600	貸付有価証券 61,300株
アイスタイル	44,300	607.00	26,890,100	貸付有価証券 29,800株(1,700株)
エムアップ	6,000	2,116.00	12,696,000	貸付有価証券 4,000株
エイチーム	11,900	1,100.00	13,090,000	貸付有価証券 5,900株
エニグモ	12,300	1,156.00	14,218,800	貸付有価証券 8,000株(4,800株)
テクノスジャパン	14,500	514.00	7,453,000	貸付有価証券 200株
e n i s h	7,600	938.00	7,128,800	貸付有価証券 4,100株(700株)
コロプラ	56,600	668.00	37,808,800	貸付有価証券 20,800株
オルトプラス	11,500	246.00	2,829,000	貸付有価証券 7,400株(1,600株)
ブロードリーフ	85,800	556.00	47,704,800	貸付有価証券 1,200株
クロス・マーケティンググループ	7,700	318.00	2,448,600	貸付有価証券 2,900株
デジタルハーツホールディングス	7,800	993.00	7,745,400	貸付有価証券 2,900株(300株)
システム情報	8,700	1,197.00	10,413,900	貸付有価証券 4,800株(4,700株)
メディアドゥホールディングス	6,000	3,255.00	19,530,000	
じげん	24,500	636.00	15,582,000	貸付有価証券 4,100株
ブイキューブ	10,600	466.00	4,939,600	貸付有価証券 7,100株
エンカレッジ・テクノロジー	2,300	743.00	1,708,900	
サイバーリンクス	2,700	1,058.00	2,856,600	
ディー・エル・イー	12,200	164.00	2,000,800	貸付有価証券

				8,100株(3,500株)
フィックスターズ	18,400	1,556.00	28,630,400	貸付有価証券 5,500株
CARTA HOLDINGS	8,300	992.00	8,233,600	
オプティム	7,500	2,735.00	20,512,500	貸付有価証券 5,000株(2,700株)
セレス	5,700	1,301.00	7,415,700	貸付有価証券 2,000株
ティーガイア	12,300	2,087.00	25,670,100	
セック	2,800	3,260.00	9,128,000	貸付有価証券 800株
日本アジアグループ	18,200	331.00	6,024,200	貸付有価証券 1,200株
豆蔵ホールディングス	11,800	1,664.00	19,635,200	
テクマトリックス	12,200	2,412.00	29,426,400	
プロシップ	5,000	1,238.00	6,190,000	貸付有価証券 900株
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	41,700	2,373.00	98,954,100	貸付有価証券 22,800株
GMOペイメントゲートウェイ	28,500	8,100.00	230,850,000	貸付有価証券 12,400株
ザッパラス	9,000	330.00	2,970,000	貸付有価証券 1,100株
システムリサーチ	2,300	3,900.00	8,970,000	
インターネットイニシアティブ	28,100	2,363.00	66,400,300	貸付有価証券 1,800株
さくらインターネット	20,600	614.00	12,648,400	貸付有価証券 2,500株
ヴィンクス	4,900	1,167.00	5,718,300	貸付有価証券 3,200株
GMOクラウド	3,200	2,533.00	8,105,600	貸付有価証券 1,600株
SRAホールディングス	9,200	2,470.00	22,724,000	
Minorityソリューションズ	3,400	1,946.00	6,616,400	
システムインテグレータ	4,900	696.00	3,410,400	貸付有価証券 3,200株
朝日ネット	14,000	703.00	9,842,000	
eBASE	10,300	934.00	9,620,200	貸付有価証券 1,200株

アバント	6,200	2,008.00	12,449,600	貸付有価証券 3,400株
アドソル日進	6,100	2,130.00	12,993,000	
フリービット	10,300	1,011.00	10,413,300	貸付有価証券 6,800株（3,600株）
コムチュア	9,700	4,045.00	39,236,500	貸付有価証券 2,300株
サイバーコム	3,100	1,778.00	5,511,800	貸付有価証券 1,400株（300株）
アステリア	11,500	614.00	7,061,000	貸付有価証券 1,400株
マークラインズ	8,600	1,758.00	15,118,800	貸付有価証券 1,300株
メディカル・データ・ビ ジョン	13,100	1,053.00	13,794,300	貸付有価証券 1,000株
g u m i	22,100	568.00	12,552,800	貸付有価証券 4,300株
ショーケース	4,100	750.00	3,075,000	貸付有価証券 2,700株
モバイルファクトリー	4,300	1,718.00	7,387,400	貸付有価証券 2,600株
テラスカイ	2,700	1,854.00	5,005,800	
デジタル・インフォメー ション・テクノロジー	7,600	1,668.00	12,676,800	貸付有価証券 1,600株（800株）
P C Iホールディングス	3,500	2,013.00	7,045,500	
パイプドHD	2,700	1,197.00	3,231,900	貸付有価証券 1,500株（1,400株）
アイビーシー	3,100	1,057.00	3,276,700	貸付有価証券 1,300株
ネオジャパン	3,200	980.00	3,136,000	貸付有価証券 600株
P R T I M E S	1,500	2,696.00	4,044,000	貸付有価証券 100株
ランドコンピュータ	2,600	1,012.00	2,631,200	
ダブルスタンダード	1,500	4,935.00	7,402,500	貸付有価証券 800株（100株）
オープンドア	8,600	2,170.00	18,662,000	貸付有価証券 800株
マイネット	5,600	461.00	2,581,600	貸付有価証券 600株
アカツキ	6,100	6,900.00	42,090,000	貸付有価証券 1,300株

ベネフィットジャパン	1,300	1,381.00	1,795,300	貸付有価証券 800株（700株）
Ubicomホールディングス	3,100	1,812.00	5,617,200	貸付有価証券 500株（300株）
LINE	39,600	3,490.00	138,204,000	貸付有価証券 18,800株
カナミックネットワーク	3,500	2,206.00	7,721,000	
ノムラシステムコーポレーション	3,800	393.00	1,493,400	貸付有価証券 600株
チェンジ	3,400	1,882.00	6,398,800	貸付有価証券 1,500株（1,000株）
シンクロ・フード	7,400	476.00	3,522,400	貸付有価証券 2,300株
オークネット	10,600	1,182.00	12,529,200	貸付有価証券 1,700株
セグエグループ	1,400	1,334.00	1,867,600	貸付有価証券 100株
エイトレッド	1,800	2,068.00	3,722,400	貸付有価証券 900株（100株）
AOI TYO Holdings	17,500	652.00	11,410,000	
マクロミル	30,700	924.00	28,366,800	貸付有価証券 2,200株
ビーグリー	3,400	858.00	2,917,200	
オロ	4,500	2,274.00	10,233,000	貸付有価証券 3,000株（1,400株）
テモナ	2,300	459.00	1,055,700	貸付有価証券 100株
ニーズウェル	2,100	727.00	1,526,700	貸付有価証券 400株
サインポスト	2,700	2,185.00	5,899,500	貸付有価証券 1,800株（1,100株）
ソルクシーズ	7,300	911.00	6,650,300	貸付有価証券 200株
フェイス	6,800	667.00	4,535,600	貸付有価証券 800株
プロトコーポレーション	15,500	1,216.00	18,848,000	
ハイマックス	2,000	1,764.00	3,528,000	貸付有価証券 100株
野村総合研究所	330,200	1,968.00	649,833,600	貸付有価証券 500株
サイバネットシステム	12,300	593.00	7,293,900	貸付有価証券

				1,500株
C Eホールディングス	5,000	1,108.00	5,540,000	貸付有価証券 1,100株
日本システム技術	2,800	1,301.00	3,642,800	貸付有価証券 300株
インテージホールディングス	21,600	831.00	17,949,600	貸付有価証券 1,400株
東邦システムサイエンス	5,100	918.00	4,681,800	貸付有価証券 800株
ソースネクスト	67,100	449.00	30,127,900	貸付有価証券 44,900株(17,000株)
インフォコム	18,900	2,792.00	52,768,800	
F I G	18,700	299.00	5,591,300	貸付有価証券 2,500株
アルテリア・ネットワークス	19,200	1,396.00	26,803,200	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	3,900	1,656.00	6,458,400	貸付有価証券 400株
フォーカスシステムズ	11,600	816.00	9,465,600	
クレスコ	5,300	3,445.00	18,258,500	貸付有価証券 600株
フジ・メディア・ホールディングス	179,500	1,353.00	242,863,500	貸付有価証券 1,000株
オービック	60,000	11,850.00	711,000,000	貸付有価証券 200株
ジャストシステム	24,600	4,100.00	100,860,000	
T D Cソフト	15,100	751.00	11,340,100	
ヤフー	1,128,300	268.00	302,384,400	
トレンドマイクロ	76,900	5,080.00	390,652,000	貸付有価証券 26,200株(1,100株)
I Dホールディングス	6,600	1,207.00	7,966,200	貸付有価証券 1,200株
日本オラクル	35,100	9,290.00	326,079,000	貸付有価証券 1,500株
アルファシステムズ	5,400	2,788.00	15,055,200	貸付有価証券 600株
フューチャー	20,900	1,804.00	37,703,600	貸付有価証券 4,700株
C A C H o l d i n g s	11,200	1,113.00	12,465,600	貸付有価証券 5,000株(1,200株)
ソフトバンク・テクノロ	7,400	2,056.00	15,214,400	貸付有価証券

ジー				3,300株
トーセ	4,700	825.00	3,877,500	貸付有価証券 500株
オービックビジネスコン サルタント	17,700	4,610.00	81,597,000	貸付有価証券 3,000株(800株)
伊藤忠テクノソリュー ションズ	78,800	2,842.00	223,949,600	貸付有価証券 1,100株
アイティフォー	20,900	940.00	19,646,000	貸付有価証券 2,500株
東計電算	2,600	2,982.00	7,753,200	貸付有価証券 300株
エックスネット	3,200	930.00	2,976,000	
大塚商会	93,600	3,825.00	358,020,000	貸付有価証券 4,300株
サイボウズ	20,200	1,097.00	22,159,400	
ソフトブレーン	10,200	592.00	6,038,400	貸付有価証券 2,000株
電通国際情報サービス	10,700	3,395.00	36,326,500	貸付有価証券 2,800株
デジタルガレージ	33,700	3,305.00	111,378,500	貸付有価証券 13,300株(700株)
E Mシステムズ	14,100	1,650.00	23,265,000	貸付有価証券 5,000株(2,500株)
ウェザーニューズ	5,800	3,050.00	17,690,000	貸付有価証券 700株
C I J	12,800	830.00	10,624,000	
東洋ビジネスエンジニア リング	1,700	2,681.00	4,557,700	
日本エンタープライズ	17,800	175.00	3,115,000	貸付有価証券 3,100株
WOWOW	8,300	2,464.00	20,451,200	貸付有価証券 4,500株
スカラ	12,100	1,097.00	13,273,700	貸付有価証券 100株(100株)
インテリジェント ウェ イブ	6,500	892.00	5,798,000	貸付有価証券 2,600株(600株)
I M A G I C A G R O U P	14,600	446.00	6,511,600	貸付有価証券 6,000株(2,400株)
ネットワンシステムズ	61,200	3,030.00	185,436,000	貸付有価証券 400株
システムソフト	40,900	110.00	4,499,000	貸付有価証券 400株

アルゴグラフィックス	14,700	2,690.00	39,543,000	
マーベラス	26,400	749.00	19,773,600	貸付有価証券 5,000株
エイベックス	29,700	1,255.00	37,273,500	貸付有価証券 3,600株
日本ユニシス	54,000	3,325.00	179,550,000	
兼松エレクトロニクス	9,400	2,998.00	28,181,200	
東京放送ホールディングス	114,800	1,671.00	191,830,800	貸付有価証券 15,100株
日本テレビホールディングス	158,900	1,377.00	218,805,300	貸付有価証券 2,700株
朝日放送グループホールディングス	17,200	705.00	12,126,000	貸付有価証券 100株
テレビ朝日ホールディングス	47,500	1,691.00	80,322,500	貸付有価証券 400株
スカパーJSATホールディングス	113,800	418.00	47,568,400	貸付有価証券 500株
テレビ東京ホールディングス	14,200	2,168.00	30,785,600	貸付有価証券 1,700株
日本BS放送	5,800	1,081.00	6,269,800	貸付有価証券 3,200株
ビジョン	5,400	4,860.00	26,244,000	
スマートバリュー	5,100	668.00	3,406,800	貸付有価証券 3,000株
USEN-NEXT HOLDINGS	6,600	791.00	5,220,600	貸付有価証券 2,100株
ワイヤレスゲート	8,100	732.00	5,929,200	貸付有価証券 4,500株（800株）
コネクシオ	12,200	1,348.00	16,445,600	
日本通信	150,700	220.00	33,154,000	貸付有価証券 100,900株（32,300株）
クロップス	3,200	602.00	1,926,400	貸付有価証券 600株
日本電信電話	1,183,600	4,976.00	5,889,593,600	貸付有価証券 9,800株
KDDI	1,418,600	2,736.00	3,881,289,600	
ソフトバンク	1,834,800	1,500.50	2,753,117,400	貸付有価証券 387,900株
光通信	20,400	24,800.00	505,920,000	
NTTドコモ	1,095,700	2,646.00	2,899,222,200	貸付有価証券

				139,000株
エムティーアイ	16,700	733.00	12,241,100	貸付有価証券 2,100株
GMOインターネット	69,300	1,790.00	124,047,000	貸付有価証券 27,600株
ファイバーゲート	1,600	3,245.00	5,192,000	貸付有価証券 700株
アйдママーケティング コミュニケーション	3,700	556.00	2,057,200	
KADOKAWA	50,500	1,515.00	76,507,500	貸付有価証券 600株
学研ホールディングス	5,800	5,180.00	30,044,000	
ゼンリン	34,500	1,859.00	64,135,500	貸付有価証券 2,700株
昭文社	8,000	343.00	2,744,000	
インプレスホールディング ス	14,300	141.00	2,016,300	貸付有価証券 2,700株
アイネット	9,800	1,376.00	13,484,800	
松竹	11,400	12,000.00	136,800,000	貸付有価証券 7,700株
東宝	113,800	4,475.00	509,255,000	貸付有価証券 14,100株
東映	7,300	14,950.00	109,135,000	貸付有価証券 4,000株
エヌ・ティ・ティ・デー タ	460,700	1,376.00	633,923,200	貸付有価証券 56,700株
ピー・シー・エー	2,200	4,255.00	9,361,000	貸付有価証券 1,200株(900株)
ビジネスブレイン太田昭 和	3,000	2,477.00	7,431,000	貸付有価証券 100株
D T S	38,700	2,291.00	88,661,700	貸付有価証券 300株
スクウェア・エニックス ホールディングス	80,500	4,270.00	343,735,000	貸付有価証券 12,800株
シーイーシー	18,500	2,387.00	44,159,500	
カプコン	74,200	2,888.00	214,289,600	貸付有価証券 200株
アイ・エス・ピー	3,400	1,378.00	4,685,200	貸付有価証券 400株
ジャステック	11,000	1,084.00	11,924,000	
S C S K	45,600	4,995.00	227,772,000	

日本システムウエア	5,700	2,458.00	14,010,600	
アイネス	21,900	1,112.00	24,352,800	
T K C	14,600	4,475.00	65,335,000	貸付有価証券 300株
富士ソフト	22,100	4,850.00	107,185,000	貸付有価証券 100株
N S D	28,400	2,884.00	81,905,600	貸付有価証券 9,400株
コナミホールディングス	70,700	4,510.00	318,857,000	貸付有価証券 8,700株
福井コンピュータホールディングス	5,700	2,138.00	12,186,600	貸付有価証券 300株
J B C Cホールディングス	13,600	1,471.00	20,005,600	
ミロク情報サービス	17,200	2,781.00	47,833,200	貸付有価証券 10,100株（6,700株）
ソフトバンクグループ	1,373,100	4,980.00	6,838,038,000	貸付有価証券 9,200株
ハウスイ	1,400	810.00	1,134,000	貸付有価証券 100株
高千穂交易	6,700	1,077.00	7,215,900	貸付有価証券 1,000株
伊藤忠食品	4,300	4,335.00	18,640,500	貸付有価証券 500株
エレマテック	16,200	1,018.00	16,491,600	貸付有価証券 1,300株
J A L U X	4,900	2,310.00	11,319,000	貸付有価証券 3,200株
あらた	12,800	3,335.00	42,688,000	
トーメンデバイス	2,600	2,281.00	5,930,600	貸付有価証券 1,600株
東京エレクトロン デバイス	6,300	1,903.00	11,988,900	
フィールズ	15,200	487.00	7,402,400	貸付有価証券 1,900株
双日	959,300	322.00	308,894,600	貸付有価証券 3,300株
アルフレッサ ホールディングス	193,000	2,441.00	471,113,000	貸付有価証券 200株
横浜冷凍	48,700	1,008.00	49,089,600	貸付有価証券 600株
神栄	2,400	842.00	2,020,800	

ラサ商事	9,200	809.00	7,442,800	貸付有価証券 1,100株
ラクーンホールディングス	8,300	613.00	5,087,900	
アルコニックス	18,400	1,157.00	21,288,800	貸付有価証券 3,900株
神戸物産	30,000	5,360.00	160,800,000	貸付有価証券 5,900株
あいホールディングス	24,800	1,622.00	40,225,600	貸付有価証券 10,800株
ディーブイエックス	6,800	782.00	5,317,600	貸付有価証券 900株
ダイワボウホールディングス	15,800	4,410.00	69,678,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	48,100	1,386.00	66,666,600	貸付有価証券 200株
ラクト・ジャパン	6,500	4,065.00	26,422,500	貸付有価証券 4,000株
バイタルケーエスケー・ホールディングス	32,700	1,048.00	34,269,600	貸付有価証券 15,900株
八洲電機	13,400	879.00	11,778,600	貸付有価証券 7,300株
メディアスホールディングス	9,800	686.00	6,722,800	貸付有価証券 1,700株
レスターホールディングス	19,000	1,659.00	31,521,000	貸付有価証券 400株
ジュテックホールディングス	4,000	929.00	3,716,000	
大光	7,400	654.00	4,839,600	貸付有価証券 600株
OCHIホールディングス	5,000	1,113.00	5,565,000	
TOKAIホールディングス	91,800	992.00	91,065,600	貸付有価証券 1,700株
黒谷	3,900	459.00	1,790,100	貸付有価証券 1,200株
Cominix	3,000	772.00	2,316,000	
三洋貿易	8,700	2,199.00	19,131,300	
ビューティガレージ	2,800	1,723.00	4,824,400	貸付有価証券 700株
ウイン・パートナーズ	11,300	1,002.00	11,322,600	
ミタチ産業	5,200	651.00	3,385,200	貸付有価証券

				100株
シップヘルスケアホールディングス	36,200	4,930.00	178,466,000	貸付有価証券 4,400株
明治電機工業	5,500	1,313.00	7,221,500	
デリカフーズホールディングス	3,100	1,448.00	4,488,800	
スターティアホールディングス	3,400	505.00	1,717,000	貸付有価証券 100株
コメダホールディングス	40,200	2,002.00	80,480,400	貸付有価証券 26,900株
富士興産	6,700	731.00	4,897,700	貸付有価証券 4,400株
協栄産業	2,100	1,308.00	2,746,800	
小野建	15,600	1,275.00	19,890,000	貸付有価証券 1,900株
南陽	3,500	1,494.00	5,229,000	貸付有価証券 400株
佐島電機	12,800	799.00	10,227,200	貸付有価証券 1,700株
エコトレーディング	4,000	526.00	2,104,000	貸付有価証券 800株
伯東	11,900	1,123.00	13,363,700	貸付有価証券 1,400株
コンドーテック	13,400	884.00	11,845,600	
中山福	10,000	492.00	4,920,000	
ナガイレーベン	25,100	2,252.00	56,525,200	貸付有価証券 3,400株
三菱食品	19,100	2,556.00	48,819,600	貸付有価証券 2,300株
松田産業	12,700	1,435.00	18,224,500	
第一興商	25,900	4,660.00	120,694,000	
メディカルホールディングス	187,400	2,253.00	422,212,200	貸付有価証券 100株
S P K	3,700	2,488.00	9,205,600	
萩原電気ホールディングス	6,400	2,761.00	17,670,400	
アズワン	12,500	9,220.00	115,250,000	貸付有価証券 1,500株
スズデン	6,000	1,315.00	7,890,000	貸付有価証券 100株
尾家産業	5,600	1,155.00	6,468,000	貸付有価証券

				600株
シモジマ	10,600	1,025.00	10,865,000	貸付有価証券 1,300株
ドウシシャ	16,400	1,700.00	27,880,000	
小津産業	3,800	1,692.00	6,429,600	貸付有価証券 400株
高速	10,300	1,192.00	12,277,600	貸付有価証券 1,200株
たけびし	6,100	1,265.00	7,716,500	貸付有価証券 700株
リックス	3,900	1,473.00	5,744,700	貸付有価証券 400株
丸文	15,400	543.00	8,362,200	
ハビネット	14,500	1,246.00	18,067,000	貸付有価証券 200株
橋本総業ホールディングス	3,500	1,558.00	5,453,000	貸付有価証券 400株
日本ライフライン	51,400	1,732.00	89,024,800	貸付有価証券 20,800株
タカショー	8,400	455.00	3,822,000	貸付有価証券 300株
エクセル	6,500	1,234.00	8,021,000	
マルカ	6,100	1,807.00	11,022,700	
I D O M	58,500	376.00	21,996,000	貸付有価証券 7,900株(3,900株)
日本エム・ディ・エム	10,100	1,734.00	17,513,400	貸付有価証券 900株
進和	10,300	2,185.00	22,505,500	貸付有価証券 5,700株
エスケイジャパン	4,200	410.00	1,722,000	貸付有価証券 2,800株(1,200株)
ダイترون	7,300	1,186.00	8,657,800	貸付有価証券 800株
シークス	22,100	1,258.00	27,801,800	貸付有価証券 3,700株
田中商事	5,800	618.00	3,584,400	貸付有価証券 800株
オーハシテクニカ	9,800	1,389.00	13,612,200	
白銅	5,600	1,265.00	7,084,000	
伊藤忠商事	1,214,900	2,069.00	2,513,628,100	
丸紅	1,712,800	675.50	1,156,996,400	

高島	2,700	1,607.00	4,338,900	貸付有価証券 300株
長瀬産業	97,700	1,425.00	139,222,500	貸付有価証券 12,200株
蝶理	11,100	1,564.00	17,360,400	
豊田通商	193,900	3,215.00	623,388,500	
三共生興	29,600	466.00	13,793,600	貸付有価証券 3,800株
兼松	69,400	1,116.00	77,450,400	貸付有価証券 300株
ツカモトコーポレーショ ン	3,100	1,030.00	3,193,000	貸付有価証券 300株
三井物産	1,431,000	1,643.50	2,351,848,500	
日本紙パルプ商事	9,900	3,510.00	34,749,000	
日立ハイテクノロジーズ	52,800	5,550.00	293,040,000	
カメイ	22,600	1,001.00	22,622,600	
東都水産	2,400	2,595.00	6,228,000	貸付有価証券 1,600株
OUGホールディングス	2,700	2,628.00	7,095,600	
スターゼン	6,400	3,865.00	24,736,000	
山善	67,800	918.00	62,240,400	貸付有価証券 8,800株
椿本興業	3,900	3,255.00	12,694,500	
住友商事	1,027,300	1,552.00	1,594,369,600	貸付有価証券 126,500株
内田洋行	7,400	3,295.00	24,383,000	
三菱商事	1,218,900	2,571.00	3,133,791,900	
第一実業	7,900	2,713.00	21,432,700	貸付有価証券 900株
キャノンマーケティング ジャパン	49,600	2,090.00	103,664,000	貸付有価証券 24,200株
西華産業	9,800	1,256.00	12,308,800	貸付有価証券 100株
佐藤商事	15,500	765.00	11,857,500	貸付有価証券 1,900株
菱洋エレクトロ	17,600	1,759.00	30,958,400	貸付有価証券 2,100株
東京産業	17,300	488.00	8,442,400	
ユアサ商事	17,800	2,921.00	51,993,800	貸付有価証券 2,100株

神鋼商事	3,900	2,203.00	8,591,700	
小林産業	10,400	257.00	2,672,800	貸付有価証券 1,700株
阪和興業	30,100	2,728.00	82,112,800	貸付有価証券 300株
正栄食品工業	11,200	2,994.00	33,532,800	貸付有価証券 7,500株
カナデン	15,700	1,246.00	19,562,200	貸付有価証券 2,000株
菱電商事	13,700	1,607.00	22,015,900	貸付有価証券 1,600株
フルサト工業	9,600	1,365.00	13,104,000	
岩谷産業	38,500	3,515.00	135,327,500	貸付有価証券 18,500株（12,700株）
すてきナイスグループ	7,400	607.00	4,491,800	貸付有価証券 4,900株
昭光通商	5,600	610.00	3,416,000	
ニチモウ	2,700	1,696.00	4,579,200	貸付有価証券 300株
極東貿易	5,300	1,750.00	9,275,000	
イワキ	22,800	480.00	10,944,000	貸付有価証券 2,500株
三愛石油	46,600	938.00	43,710,800	貸付有価証券 5,800株
稲畑産業	41,700	1,225.00	51,082,500	貸付有価証券 5,200株
G S Iクレオス	4,600	1,025.00	4,715,000	
明和産業	16,000	532.00	8,512,000	貸付有価証券 1,900株
クワザワ	6,200	400.00	2,480,000	貸付有価証券 2,200株（1,500株）
ワキタ	37,000	1,000.00	37,000,000	貸付有価証券 4,600株
東邦ホールディングス	51,400	2,503.00	128,654,200	貸付有価証券 24,300株（18,000株）
サンゲツ	51,600	1,930.00	99,588,000	
ミツウロコグループホールディングス	23,000	881.00	20,263,000	貸付有価証券 3,100株
シナネンホールディングス	7,100	1,745.00	12,389,500	貸付有価証券 800株
伊藤忠エネクス	38,400	802.00	30,796,800	貸付有価証券

				4,700株
サンリオ	53,600	2,029.00	108,754,400	貸付有価証券 8,300株
サンワテクノス	10,500	768.00	8,064,000	
リョーサン	19,200	2,553.00	49,017,600	
新光商事	16,300	1,891.00	30,823,300	貸付有価証券 3,500株
トーホー	7,800	1,832.00	14,289,600	貸付有価証券 900株
三信電気	12,000	1,623.00	19,476,000	貸付有価証券 1,400株
東陽テクニカ	20,000	1,079.00	21,580,000	貸付有価証券 100株
モスフードサービス	22,800	2,328.00	53,078,400	貸付有価証券 15,300株
加賀電子	17,300	1,602.00	27,714,600	貸付有価証券 100株
ソーダニッカ	17,900	512.00	9,164,800	貸付有価証券 2,300株
立花エレテック	12,800	1,524.00	19,507,200	貸付有価証券 100株
フォーバル	7,600	897.00	6,817,200	貸付有価証券 900株
PALTAC	31,300	5,050.00	158,065,000	貸付有価証券 3,800株
三谷産業	20,300	273.00	5,541,900	貸付有価証券 3,700株
太平洋興発	6,800	749.00	5,093,200	
西本Wismettac ホールディングス	3,100	3,555.00	11,020,500	貸付有価証券 300株
ヤマシタヘルスケアホー ルディングス	1,400	1,273.00	1,782,200	貸付有価証券 100株
国際紙パルプ商事	40,500	316.00	12,798,000	貸付有価証券 9,700株
ヤマタネ	8,700	1,304.00	11,344,800	
丸紅建材リース	1,700	1,574.00	2,675,800	
日鉄物産	12,400	4,055.00	50,282,000	
泉州電業	5,300	2,623.00	13,901,900	貸付有価証券 700株
トラスコ中山	36,100	2,357.00	85,087,700	貸付有価証券 16,400株(2,300株)

オートバックスセブン	69,000	1,723.00	118,887,000	貸付有価証券 8,700株
モリト	12,600	781.00	9,840,600	貸付有価証券 2,500株
加藤産業	27,200	3,070.00	83,504,000	貸付有価証券 3,300株
北恵	3,300	856.00	2,824,800	貸付有価証券 400株
イノテック	10,300	853.00	8,785,900	貸付有価証券 1,200株
イエローハット	32,800	1,496.00	49,068,800	貸付有価証券 100株
J Kホールディングス	15,700	480.00	7,536,000	貸付有価証券 1,900株
日伝	14,400	1,855.00	26,712,000	
北沢産業	13,000	242.00	3,146,000	貸付有価証券 1,800株（200株）
杉本商事	9,400	1,892.00	17,784,800	
因幡電機産業	24,700	4,625.00	114,237,500	
東テク	5,700	2,143.00	12,215,100	
ミスミグループ本社	217,500	2,285.00	496,987,500	貸付有価証券 34,700株
アルテック	13,800	205.00	2,829,000	貸付有価証券 2,700株
タキヒヨー	5,300	1,763.00	9,343,900	貸付有価証券 2,900株
蔵王産業	2,800	1,349.00	3,777,200	
スズケン	79,200	5,750.00	455,400,000	貸付有価証券 200株
ジェコス	12,000	846.00	10,152,000	
グローセル	15,900	400.00	6,360,000	貸付有価証券 100株
ローソン	43,900	5,510.00	241,889,000	貸付有価証券 4,200株
サンエー	13,100	4,360.00	57,116,000	貸付有価証券 1,600株
カワチ薬品	13,500	1,983.00	26,770,500	
エービーシー・マート	27,100	6,540.00	177,234,000	
ハードオフコーポレーション	6,900	711.00	4,905,900	
アスクル	18,200	2,706.00	49,249,200	貸付有価証券

				5,200株
ゲオホールディングス	26,500	1,302.00	34,503,000	貸付有価証券 100株
アダストリア	24,000	2,005.00	48,120,000	貸付有価証券 6,500株
ジーフット	10,500	647.00	6,793,500	貸付有価証券 7,100株
シー・ヴィ・エス・ベイ エリア	2,200	691.00	1,520,200	貸付有価証券 1,200株
くら寿司	9,100	4,125.00	37,537,500	貸付有価証券 5,800株(2,600株)
キャンドウ	8,300	1,626.00	13,495,800	貸付有価証券 1,700株
パルグループホールディ ングス	8,900	3,200.00	28,480,000	
エディオン	73,600	1,028.00	75,660,800	貸付有価証券 40,300株(3,000株)
サーラコーポレーション	35,300	570.00	20,121,000	貸付有価証券 5,000株
ワッツ	7,600	666.00	5,061,600	貸付有価証券 4,200株
ハローズ	6,500	2,175.00	14,137,500	貸付有価証券 2,900株
フジオフードシステム	7,300	2,644.00	19,301,200	貸付有価証券 2,400株
あみやき亭	3,700	3,385.00	12,524,500	
ひらまつ	34,600	342.00	11,833,200	
大黒天物産	4,200	3,165.00	13,293,000	貸付有価証券 500株
ハニーズホールディング ス	15,300	1,351.00	20,670,300	
ファーマライズホール ディングス	4,000	550.00	2,200,000	貸付有価証券 400株
アルペン	13,300	1,517.00	20,176,100	貸付有価証券 4,500株
ハブ	5,600	1,082.00	6,059,200	貸付有価証券 600株
クオールホールディング ス	25,600	1,410.00	36,096,000	貸付有価証券 200株
ジンズホールディングス	9,200	5,630.00	51,796,000	貸付有価証券 4,900株
ビックカメラ	103,000	1,061.00	109,283,000	貸付有価証券

				69,000株
DCMホールディングス	93,700	1,048.00	98,197,600	貸付有価証券 33,000株
ペッパーフードサービス	13,800	1,514.00	20,893,200	貸付有価証券 9,200株(2,900株)
Monotaro	123,500	2,450.00	302,575,000	貸付有価証券 82,700株(12,500株)
東京一番フーズ	4,400	605.00	2,662,000	
DDホールディングス	3,900	2,922.00	11,395,800	貸付有価証券 400株
きちりホールディングス	4,600	716.00	3,293,600	貸付有価証券 700株
アークランドサービス ホールディングス	12,700	1,917.00	24,345,900	貸付有価証券 300株
J.フロント リテイ リング	222,200	1,208.00	268,417,600	貸付有価証券 31,100株
ドトール・日レスホール ディングス	30,500	2,025.00	61,762,500	貸付有価証券 4,200株
マツモトキヨシホール ディングス	71,800	3,610.00	259,198,000	貸付有価証券 19,500株
ブロンコビリー	9,100	2,210.00	20,111,000	貸付有価証券 6,000株(400株)
ZOZO	187,700	2,064.00	387,412,800	貸付有価証券 125,700株
トレジャー・ファクト リー	5,100	1,158.00	5,905,800	貸付有価証券 400株
物語コーポレーション	4,300	9,410.00	40,463,000	
ココカラファイン	19,500	5,480.00	106,860,000	
三越伊勢丹ホールディ ングス	325,100	780.00	253,578,000	貸付有価証券 45,900株
Hamee	5,300	705.00	3,736,500	貸付有価証券 3,500株
ウエルシアホールディ ングス	45,900	5,380.00	246,942,000	貸付有価証券 8,800株
クリエイティブSDホー ルディングス	25,600	2,311.00	59,161,600	貸付有価証券 3,100株
丸善CHIホールディ ングス	20,300	375.00	7,612,500	貸付有価証券 13,000株
ミサワ	3,100	436.00	1,351,600	貸付有価証券 1,000株(1,000株)
ティーライフ	2,300	846.00	1,945,800	貸付有価証券 700株

エー・ピーカンパニー	3,300	551.00	1,818,300	貸付有価証券 2,200株
チムニー	5,300	2,406.00	12,751,800	貸付有価証券 3,400株
シュッピン	11,800	1,023.00	12,071,400	貸付有価証券 1,400株
ネクステージ	24,700	1,201.00	29,664,700	貸付有価証券 200株
ジョイフル本田	50,900	1,277.00	64,999,300	貸付有価証券 1,900株
鳥貴族	5,700	2,147.00	12,237,900	貸付有価証券 3,100株（600株）
キリン堂ホールディングス	6,800	1,774.00	12,063,200	
ホットランド	10,100	1,391.00	14,049,100	貸付有価証券 700株
すかいらーくホールディングス	194,700	1,851.00	360,389,700	貸付有価証券 100,000株（47,300株）
S F Pホールディングス	7,400	2,171.00	16,065,400	貸付有価証券 2,100株（500株）
綿半ホールディングス	6,500	2,185.00	14,202,500	貸付有価証券 2,000株
ヨシックス	2,800	3,030.00	8,484,000	貸付有価証券 400株
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	50,500	951.00	48,025,500	貸付有価証券 33,400株
ゴルフダイジェスト・オンライン	8,000	633.00	5,064,000	
B E E N O S	6,100	1,320.00	8,052,000	貸付有価証券 2,900株
あさひ	14,400	1,231.00	17,726,400	
日本調剤	6,100	3,900.00	23,790,000	
コスモス薬品	7,700	20,620.00	158,774,000	貸付有価証券 5,100株
トーエル	8,400	661.00	5,552,400	貸付有価証券 1,000株
オンリー	2,900	880.00	2,552,000	貸付有価証券 1,900株
セブン & アイ・ホールディングス	728,000	3,790.00	2,759,120,000	
薬王堂	7,600	2,350.00	17,860,000	貸付有価証券

				200株
クリエイト・レストランツ・ホールディング	46,700	1,628.00	76,027,600	貸付有価証券 31,200株
ツルハホールディングス	37,700	11,000.00	414,700,000	貸付有価証券 9,500株(200株)
サンマルクホールディングス	13,700	2,454.00	33,619,800	貸付有価証券 100株
フェリシモ	3,800	1,007.00	3,826,600	貸付有価証券 2,100株
トリドールホールディングス	21,400	2,301.00	49,241,400	貸付有価証券 12,400株
TOKYO BASE	15,600	784.00	12,230,400	貸付有価証券 2,900株(2,400株)
ウイルプラスホールディングス	2,700	811.00	2,189,700	貸付有価証券 100株
ジャパンミート	8,800	1,885.00	16,588,000	貸付有価証券 1,000株
サツドラホールディングス	2,600	1,766.00	4,591,600	貸付有価証券 200株
デファクトスタンダード	1,500	311.00	466,500	貸付有価証券 400株
アレンザホールディングス	9,300	764.00	7,105,200	貸付有価証券 1,800株
串カツ田中ホールディングス	2,600	1,920.00	4,992,000	貸付有価証券 1,700株
パロックジャパンリミテッド	14,000	1,010.00	14,140,000	貸付有価証券 2,300株
クスリのアオキホールディングス	17,300	7,630.00	131,999,000	貸付有価証券 11,400株
力の源ホールディングス	6,500	871.00	5,661,500	貸付有価証券 4,300株
スシローグローバルホールディングス	19,100	6,250.00	119,375,000	貸付有価証券 6,000株
LIXILピバ	14,700	1,377.00	20,241,900	
メディカルシステムネットワーク	18,500	547.00	10,119,500	貸付有価証券 7,300株
はるやまホールディングス	8,100	777.00	6,293,700	貸付有価証券 1,100株
ノジマ	30,900	1,716.00	53,024,400	貸付有価証券 400株
カッパ・クリエイト	24,400	1,400.00	34,160,000	貸付有価証券 3,500株(400株)

ライトオン	13,000	724.00	9,412,000	貸付有価証券 7,200株
ジーンズメイト	5,300	311.00	1,648,300	貸付有価証券 2,300株（1,100株）
良品計画	24,600	17,910.00	440,586,000	貸付有価証券 200株
三城ホールディングス	21,500	300.00	6,450,000	貸付有価証券 300株（200株）
アドヴァン	26,500	1,131.00	29,971,500	貸付有価証券 3,600株
アルピス	6,600	2,399.00	15,833,400	貸付有価証券 3,600株
コナカ	20,500	405.00	8,302,500	貸付有価証券 900株
ハウス オブ ローゼ	2,100	1,599.00	3,357,900	貸付有価証券 200株
G - 7ホールディングス	5,100	2,973.00	15,162,300	
イオン北海道	17,400	732.00	12,736,800	貸付有価証券 2,400株
コジマ	29,900	460.00	13,754,000	貸付有価証券 20,000株
ヒマラヤ	6,100	837.00	5,105,700	貸付有価証券 3,300株
コーナン商事	22,800	2,317.00	52,827,600	貸付有価証券 700株
エコス	6,400	1,445.00	9,248,000	貸付有価証券 3,500株
ワタミ	22,800	1,501.00	34,222,800	貸付有価証券 15,400株
マルシェ	4,600	773.00	3,555,800	貸付有価証券 2,500株
パン・パシフィック・イ ンターナショナルホ	104,000	6,470.00	672,880,000	貸付有価証券 23,700株
西松屋チェーン	38,100	856.00	32,613,600	貸付有価証券 25,500株
ゼンショーホールディン グス	84,400	2,379.00	200,787,600	貸付有価証券 11,800株
幸楽苑ホールディングス	11,000	2,635.00	28,985,000	貸付有価証券 4,000株
ハークスレイ	3,600	1,019.00	3,668,400	貸付有価証券 400株
サイゼリヤ	28,600	2,599.00	74,331,400	貸付有価証券

				15,700株
V Tホールディングス	78,400	454.00	35,593,600	貸付有価証券 500株
魚力	4,800	1,543.00	7,406,400	貸付有価証券 2,700株
ポプラ	4,500	493.00	2,218,500	貸付有価証券 2,500株
フジ・コーポレーション	4,600	2,038.00	9,374,800	貸付有価証券 500株
ユナイテッドアローズ	19,900	3,050.00	60,695,000	貸付有価証券 2,400株
ハイデイ日高	25,100	2,116.00	53,111,600	貸付有価証券 16,800株
京都きもの友禅	11,000	330.00	3,630,000	貸付有価証券 5,800株
コロワイド	57,700	2,069.00	119,381,300	貸付有価証券 31,800株（4,500株）
ピーシーデポコーポレーション	23,100	491.00	11,342,100	貸付有価証券 100株
壱番屋	12,200	5,160.00	62,952,000	貸付有価証券 8,200株
トップカルチャー	6,300	362.00	2,280,600	貸付有価証券 3,500株（2,200株）
P L A N T	4,400	715.00	3,146,000	貸付有価証券 2,400株
スギホールディングス	38,100	5,420.00	206,502,000	貸付有価証券 4,900株
ヴィア・ホールディングス	21,300	631.00	13,440,300	貸付有価証券 4,800株（900株）
スクロール	26,700	331.00	8,837,700	貸付有価証券 3,300株
ヨンドシーホールディングス	19,300	2,497.00	48,192,100	貸付有価証券 2,300株
ユニー・ファミリーマートホールディングス	194,300	2,380.00	462,434,000	貸付有価証券 23,900株
木曽路	21,300	2,620.00	55,806,000	貸付有価証券 11,700株
S R Sホールディングス	20,500	1,019.00	20,889,500	貸付有価証券 100株
千趣会	31,400	302.00	9,482,800	貸付有価証券 2,400株
タカキュー	13,400	177.00	2,371,800	貸付有価証券

				1,900株(100株)
ケーヨー	32,100	467.00	14,990,700	貸付有価証券 6,200株
上新電機	20,500	2,018.00	41,369,000	貸付有価証券 2,500株
日本瓦斯	27,400	3,015.00	82,611,000	貸付有価証券 4,700株
ロイヤルホールディングス	30,300	2,606.00	78,961,800	貸付有価証券 1,200株
東天紅	1,300	1,235.00	1,605,500	貸付有価証券 700株
いなげや	19,400	1,428.00	27,703,200	貸付有価証券 2,800株
島忠	36,700	2,381.00	87,382,700	貸付有価証券 500株
チヨダ	18,200	1,544.00	28,100,800	
ライフコーポレーション	13,200	2,106.00	27,799,200	
リンガーハット	21,400	2,558.00	54,741,200	貸付有価証券 14,400株
MrMaxHD	23,900	435.00	10,396,500	貸付有価証券 2,900株
テンアライド	16,000	421.00	6,736,000	貸付有価証券 8,800株
AOKIホールディングス	34,700	1,035.00	35,914,500	貸付有価証券 200株
オークワ	24,800	1,068.00	26,486,400	貸付有価証券 700株
コメリ	26,800	2,110.00	56,548,000	
青山商事	30,400	1,882.00	57,212,800	
しまむら	20,200	8,100.00	163,620,000	貸付有価証券 2,500株
はせがわ	9,200	398.00	3,661,600	貸付有価証券 400株(400株)
高島屋	136,300	1,243.00	169,420,900	貸付有価証券 5,400株
松屋	35,000	731.00	25,585,000	貸付有価証券 5,300株
エイチ・ツー・オー テイリング	89,100	1,096.00	97,653,600	貸付有価証券 2,100株
近鉄百貨店	6,600	3,100.00	20,460,000	貸付有価証券 4,400株
パルコ	16,700	1,166.00	19,472,200	貸付有価証券

				10,700株
丸井グループ	147,000	2,005.00	294,735,000	貸付有価証券 20,200株
アクシアル リテイリ ング	14,400	3,790.00	54,576,000	貸付有価証券 1,700株
井筒屋	8,800	213.00	1,874,400	貸付有価証券 4,800株
イオン	668,400	1,932.00	1,291,348,800	貸付有価証券 85,900株
イズミ	35,300	3,875.00	136,787,500	
平和堂	35,300	1,948.00	68,764,400	貸付有価証券 23,700株
フジ	21,000	1,798.00	37,758,000	貸付有価証券 14,000株
ヤオコー	19,700	4,760.00	93,772,000	貸付有価証券 8,600株
ゼビオホールディングス	21,000	1,149.00	24,129,000	
ケースホールディングス	180,500	1,056.00	190,608,000	貸付有価証券 1,000株
Olympicグループ	10,200	604.00	6,160,800	貸付有価証券 4,200株(2,500株)
日産東京販売ホールディ ングス	25,500	282.00	7,191,000	貸付有価証券 3,300株(100株)
Genky Drug S tores	8,500	2,079.00	17,671,500	貸付有価証券 4,100株
総合メディカルホール ディングス	15,100	1,495.00	22,574,500	
ブックオフグループホー ルディングス	9,000	1,480.00	13,320,000	貸付有価証券 4,900株
アインホールディングス	23,300	5,520.00	128,616,000	貸付有価証券 3,100株
元気寿司	4,900	2,818.00	13,808,200	貸付有価証券 700株
ヤマダ電機	529,200	482.00	255,074,400	貸付有価証券 100,100株
アークランドサカモト	29,500	1,214.00	35,813,000	
ニトリホールディングス	75,200	15,085.00	1,134,392,000	貸付有価証券 10,100株
グルメ杵屋	12,400	1,159.00	14,371,600	貸付有価証券 8,300株
愛眼	13,800	241.00	3,325,800	貸付有価証券 2,700株

ケーユーホールディングス	9,100	770.00	7,007,000	貸付有価証券 1,100株
吉野家ホールディングス	60,600	2,245.00	136,047,000	貸付有価証券 40,600株(1,000株)
松屋フーズホールディングス	8,400	3,760.00	31,584,000	貸付有価証券 1,200株
サガミホールディングス	23,200	1,336.00	30,995,200	貸付有価証券 15,500株
関西スーパーマーケット	13,100	1,093.00	14,318,300	貸付有価証券 1,600株
王将フードサービス	12,800	7,170.00	91,776,000	貸付有価証券 1,500株
ブレナス	19,400	1,731.00	33,581,400	貸付有価証券 5,600株
ミニストップ	12,900	1,462.00	18,859,800	貸付有価証券 8,300株
アークス	32,600	2,182.00	71,133,200	貸付有価証券 4,000株
パローホールディングス	37,500	1,758.00	65,925,000	貸付有価証券 1,600株
藤久	1,400	722.00	1,010,800	貸付有価証券 800株
ベルク	8,600	5,120.00	44,032,000	貸付有価証券 1,000株
大庄	9,300	1,601.00	14,889,300	貸付有価証券 6,200株
ファーストリテイリング	23,200	62,900.00	1,459,280,000	貸付有価証券 2,800株
サンドラッグ	65,300	3,030.00	197,859,000	
サックスパーホールディングス	14,700	891.00	13,097,700	
ヤマザワ	3,600	1,668.00	6,004,800	貸付有価証券 2,400株
やまや	3,000	2,183.00	6,549,000	
ペルーナ	42,600	617.00	26,284,200	貸付有価証券 400株
島根銀行	3,700	665.00	2,460,500	貸付有価証券 1,200株
じもとホールディングス	117,500	92.00	10,810,000	貸付有価証券 1,600株
めぶきフィナンシャルグループ	903,800	237.00	214,200,600	貸付有価証券 2,900株

東京きらぼしフィナンシャルグループ	23,500	1,312.00	30,832,000	貸付有価証券 2,900株
九州フィナンシャルグループ	285,400	399.00	113,874,600	貸付有価証券 39,700株
ゆうちょ銀行	492,800	992.00	488,857,600	貸付有価証券 145,100株
富山第一銀行	41,500	275.00	11,412,500	貸付有価証券 5,400株(100株)
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,091,200	352.00	384,102,400	貸付有価証券 3,700株
西日本フィナンシャルホールディングス	109,500	675.00	73,912,500	貸付有価証券 13,800株
関西みらいフィナンシャルグループ	81,700	701.00	57,271,700	貸付有価証券 10,900株
三十三フィナンシャルグループ	15,000	1,557.00	23,355,000	
第四北越フィナンシャルグループ	30,200	2,535.00	76,557,000	
新生銀行	127,600	1,441.00	183,871,600	貸付有価証券 85,400株(900株)
あおぞら銀行	97,200	2,549.00	247,762,800	貸付有価証券 500株
三菱UFJフィナンシャル・グループ	11,973,700	505.30	6,050,310,610	
りそなホールディングス	1,908,800	413.20	788,716,160	
三井住友トラスト・ホールディングス	342,000	3,442.00	1,177,164,000	貸付有価証券 1,600株
三井住友フィナンシャルグループ	1,226,000	3,479.00	4,265,254,000	
千葉銀行	598,300	526.00	314,705,800	貸付有価証券 200株
群馬銀行	347,900	350.00	121,765,000	貸付有価証券 1,000株
武蔵野銀行	25,900	1,832.00	47,448,800	貸付有価証券 3,100株
千葉興業銀行	47,700	285.00	13,594,500	貸付有価証券 200株
筑波銀行	72,300	152.00	10,989,600	貸付有価証券 8,000株
七十七銀行	54,600	1,362.00	74,365,200	
青森銀行	13,500	2,530.00	34,155,000	貸付有価証券 1,700株

秋田銀行	11,100	1,971.00	21,878,100	貸付有価証券 800株
山形銀行	19,500	1,438.00	28,041,000	貸付有価証券 2,400株
岩手銀行	12,200	2,403.00	29,316,600	貸付有価証券 1,500株
東邦銀行	155,500	241.00	37,475,500	貸付有価証券 20,300株
東北銀行	8,900	962.00	8,561,800	
みちのく銀行	11,200	1,545.00	17,304,000	貸付有価証券 1,300株
ふくおかフィナンシャル グループ	153,200	1,754.00	268,712,800	貸付有価証券 100株
静岡銀行	430,700	701.00	301,920,700	貸付有価証券 500株
十六銀行	23,400	2,130.00	49,842,000	貸付有価証券 2,700株
スルガ銀行	177,900	376.00	66,890,400	貸付有価証券 113,500株
八十二銀行	419,800	382.00	160,363,600	貸付有価証券 56,700株
山梨中央銀行	20,900	986.00	20,607,400	
大垣共立銀行	36,600	2,149.00	78,653,400	貸付有価証券 500株
福井銀行	14,900	1,355.00	20,189,500	貸付有価証券 1,800株
北國銀行	17,900	2,614.00	46,790,600	貸付有価証券 2,200株
清水銀行	7,200	1,715.00	12,348,000	貸付有価証券 800株
富山銀行	3,400	2,506.00	8,520,400	貸付有価証券 400株
滋賀銀行	34,900	2,254.00	78,664,600	貸付有価証券 12,400株
南都銀行	27,100	2,224.00	60,270,400	
百五銀行	156,500	324.00	50,706,000	貸付有価証券 11,700株
京都銀行	62,300	3,740.00	233,002,000	貸付有価証券 8,400株
紀陽銀行	61,600	1,361.00	83,837,600	貸付有価証券 8,300株
ほくほくフィナンシャル	115,800	974.00	112,789,200	貸付有価証券

グループ				14,500株
広島銀行	256,800	479.00	123,007,200	貸付有価証券 3,600株
山陰合同銀行	103,100	592.00	61,035,200	貸付有価証券 400株
中国銀行	149,700	867.00	129,789,900	貸付有価証券 2,500株
鳥取銀行	5,900	1,395.00	8,230,500	貸付有価証券 300株
伊予銀行	230,500	505.00	116,402,500	貸付有価証券 1,400株
百十四銀行	18,500	2,012.00	37,222,000	貸付有価証券 2,200株
四国銀行	24,700	895.00	22,106,500	貸付有価証券 3,100株
阿波銀行	26,600	2,291.00	60,940,600	貸付有価証券 4,800株
大分銀行	10,700	2,966.00	31,736,200	貸付有価証券 1,500株
宮崎銀行	11,600	2,237.00	25,949,200	貸付有価証券 1,400株
佐賀銀行	10,600	1,463.00	15,507,800	貸付有価証券 100株
沖縄銀行	15,900	3,040.00	48,336,000	貸付有価証券 1,900株
琉球銀行	40,100	1,029.00	41,262,900	貸付有価証券 5,000株
セブン銀行	587,700	278.00	163,380,600	貸付有価証券 76,200株
みずほフィナンシャルグループ	23,635,500	155.20	3,668,229,600	貸付有価証券 254,100株
高知銀行	6,300	732.00	4,611,600	
山口フィナンシャルグループ	217,100	688.00	149,364,800	
長野銀行	5,700	1,606.00	9,154,200	貸付有価証券 3,800株
名古屋銀行	14,100	3,170.00	44,697,000	貸付有価証券 2,000株
北洋銀行	262,200	213.00	55,848,600	貸付有価証券 41,400株
愛知銀行	6,300	3,375.00	21,262,500	貸付有価証券 100株

中京銀行	7,100	2,143.00	15,215,300	貸付有価証券 200株
大光銀行	6,000	1,680.00	10,080,000	貸付有価証券 800株
愛媛銀行	24,300	1,068.00	25,952,400	貸付有価証券 5,700株
トマト銀行	6,700	996.00	6,673,200	貸付有価証券 100株
京葉銀行	74,200	605.00	44,891,000	貸付有価証券 10,100株
栃木銀行	90,000	165.00	14,850,000	貸付有価証券 900株
北日本銀行	5,400	1,713.00	9,250,200	貸付有価証券 800株
東和銀行	30,500	700.00	21,350,000	貸付有価証券 3,700株
福島銀行	15,100	206.00	3,110,600	
大東銀行	8,300	550.00	4,565,000	
トモニホールディングス	134,500	316.00	42,502,000	貸付有価証券 18,500株
フィデアホールディングス	168,900	112.00	18,916,800	貸付有価証券 2,200株
池田泉州ホールディングス	184,600	184.00	33,966,400	貸付有価証券 24,200株
F P G	54,600	992.00	54,163,200	貸付有価証券 21,500株
マーキュリアインベストメント	7,700	692.00	5,328,400	貸付有価証券 900株
S B Iホールディングス	207,200	2,250.00	466,200,000	貸付有価証券 59,800株
日本アジア投資	14,700	242.00	3,557,400	貸付有価証券 6,000株（1,100株）
ジャフコ	28,500	3,695.00	105,307,500	貸付有価証券 3,500株
大和証券グループ本社	1,395,700	444.90	620,946,930	貸付有価証券 30,800株
野村ホールディングス	3,060,600	392.10	1,200,061,260	貸付有価証券 239,900株
岡三証券グループ	148,200	348.00	51,573,600	貸付有価証券 20,900株
丸三証券	51,700	511.00	26,418,700	貸付有価証券 34,700株

東洋証券	62,200	120.00	7,464,000	貸付有価証券 8,400株
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	207,400	283.00	58,694,200	貸付有価証券 24,800株
光世証券	4,200	580.00	2,436,000	貸付有価証券 1,000株
水戸証券	50,300	193.00	9,707,900	貸付有価証券 1,200株
いちよし証券	34,800	674.00	23,455,200	貸付有価証券 4,400株
松井証券	85,200	870.00	74,124,000	貸付有価証券 20,500株
だいこう証券ビジネス	7,000	532.00	3,724,000	貸付有価証券 900株
マネックスグループ	160,400	307.00	49,242,800	貸付有価証券 83,500株（31,800株）
極東証券	23,300	846.00	19,711,800	
岩井コスモホールディングス	17,800	1,060.00	18,868,000	貸付有価証券 100株
藍澤證券	31,200	678.00	21,153,600	貸付有価証券 3,900株
マネーパートナーズグループ	20,400	264.00	5,385,600	貸付有価証券 8,500株
スパークス・グループ	68,900	221.00	15,226,900	貸付有価証券 10,700株
小林洋行	5,000	242.00	1,210,000	貸付有価証券 400株
かんぼ生命保険	61,600	1,558.00	95,972,800	貸付有価証券 8,000株
SOMPOホールディングス	306,600	4,123.00	1,264,111,800	貸付有価証券 37,700株
アニコムホールディングス	14,300	4,365.00	62,419,500	貸付有価証券 8,500株（1,000株）
MS&ADインシュアランスグループホール	454,800	3,462.00	1,574,517,600	
ソニーフィナンシャルホールディングス	142,900	2,423.00	346,246,700	貸付有価証券 26,100株
第一生命ホールディングス	984,200	1,373.00	1,351,306,600	
東京海上ホールディングス	622,000	5,503.00	3,422,866,000	貸付有価証券 1,300株
T&Dホールディングス	538,000	1,007.00	541,766,000	貸付有価証券

				1,000株
アドバンスクリエイト	4,100	1,756.00	7,199,600	貸付有価証券 2,700株
全国保証	49,000	3,965.00	194,285,000	貸付有価証券 5,000株
ジェイリース	4,800	336.00	1,612,800	貸付有価証券 800株
イントラスト	4,900	734.00	3,596,600	貸付有価証券 1,500株
日本モーゲージサービス	3,100	1,075.00	3,332,500	貸付有価証券 200株
C a s a	7,800	1,119.00	8,728,200	
アルヒ	15,800	2,118.00	33,464,400	貸付有価証券 10,500株(6,800株)
プレミアグループ	10,000	1,842.00	18,420,000	貸付有価証券 1,500株
クレディセゾン	121,800	1,195.00	145,551,000	貸付有価証券 800株
芙蓉総合リース	19,900	6,390.00	127,161,000	
興銀リース	32,700	2,633.00	86,099,100	貸付有価証券 4,100株
東京センチュリー	35,000	4,165.00	145,775,000	貸付有価証券 600株
日本証券金融	76,700	486.00	37,276,200	貸付有価証券 300株
アイフル	265,300	219.00	58,100,700	貸付有価証券 156,900株
リコーリース	13,700	3,270.00	44,799,000	貸付有価証券 1,600株
イオンフィナンシャル サービス	111,100	1,613.00	179,204,300	貸付有価証券 100株
アコム	349,600	371.00	129,701,600	貸付有価証券 44,800株
ジャックス	19,200	2,209.00	42,412,800	
オリエントコーポレー ション	470,500	122.00	57,401,000	貸付有価証券 43,300株
日立キャピタル	41,000	2,123.00	87,043,000	
アプラスフィナンシャル	83,500	67.00	5,594,500	貸付有価証券 17,700株(200株)
オリックス	1,160,400	1,511.00	1,753,364,400	貸付有価証券 23,900株
三菱UFJリース	392,400	584.00	229,161,600	貸付有価証券

				49,600株
九州リースサービス	8,500	594.00	5,049,000	貸付有価証券 1,000株
日本取引所グループ	469,900	1,566.00	735,863,400	貸付有価証券 4,100株
イー・ギャランティ	16,300	1,252.00	20,407,600	
アサックス	7,200	585.00	4,212,000	貸付有価証券 800株
NEC キャピタルソ リューション	7,100	2,008.00	14,256,800	貸付有価証券 800株
いちご	221,200	401.00	88,701,200	貸付有価証券 2,800株
日本駐車場開発	190,800	161.00	30,718,800	貸付有価証券 55,500株
スター・マイカ・ホール ディングス	9,000	1,754.00	15,786,000	貸付有価証券 1,100株
ヒューリック	363,000	983.00	356,829,000	貸付有価証券 155,400株(11,700 株)
三栄建築設計	7,000	1,459.00	10,213,000	
野村不動産ホールディ ングス	115,900	2,136.00	247,562,400	貸付有価証券 600株
三重交通グループホール ディングス	35,300	546.00	19,273,800	貸付有価証券 23,600株
サムティ	24,700	1,763.00	43,546,100	貸付有価証券 5,700株
ディア・ライフ	22,300	513.00	11,439,900	貸付有価証券 10,100株
コーセーアールイー	5,100	671.00	3,422,100	貸付有価証券 200株
エー・ディー・ワークス	535,700	33.00	17,678,100	貸付有価証券 358,900株
日本商業開発	10,900	1,485.00	16,186,500	
プレサンスコーポーレ ーション	27,600	1,590.00	43,884,000	貸付有価証券 300株(300株)
ユニゾホールディングス	26,200	4,080.00	106,896,000	貸付有価証券 17,600株(1,800株)
THEグローバル社	8,900	446.00	3,969,400	貸付有価証券 3,200株(100株)
日本管理センター	11,500	1,198.00	13,777,000	貸付有価証券 4,700株
サンセイランディック	5,100	763.00	3,891,300	貸付有価証券

				100株
エストラスト	2,400	696.00	1,670,400	貸付有価証券 300株
フージャースホールディングス	37,800	618.00	23,360,400	貸付有価証券 24,500株(15,900株)
オープンハウス	25,200	4,940.00	124,488,000	貸付有価証券 8,700株
東急不動産ホールディングス	467,800	627.00	293,310,600	貸付有価証券 60,500株
飯田グループホールディングス	145,100	1,587.00	230,273,700	貸付有価証券 23,500株
イーグランド	2,400	682.00	1,636,800	
ムゲンエステート	12,000	590.00	7,080,000	貸付有価証券 1,900株
ビーロット	4,000	1,632.00	6,528,000	
ファーストブラザーズ	4,000	965.00	3,860,000	貸付有価証券 2,600株
ハウスドゥ	9,600	1,523.00	14,620,800	貸付有価証券 6,400株(3,500株)
シーアールイー	4,300	1,137.00	4,889,100	
プロパティエージェント	2,300	1,184.00	2,723,200	貸付有価証券 400株(400株)
ケイアイスター不動産	4,700	1,754.00	8,243,800	貸付有価証券 2,600株(1,900株)
アグレ都市デザイン	2,800	406.00	1,136,800	貸付有価証券 600株
グッドコムアセット	4,000	1,668.00	6,672,000	貸付有価証券 1,500株(200株)
ジェイ・エス・ビー	1,800	4,350.00	7,830,000	貸付有価証券 200株
テンポイノベーション	1,900	1,795.00	3,410,500	貸付有価証券 300株(300株)
グローバル・リンク・マネジメント	2,900	570.00	1,653,000	貸付有価証券 300株
パーク24	93,300	2,445.00	228,118,500	貸付有価証券 31,000株(1,800株)
パラカ	4,500	2,024.00	9,108,000	貸付有価証券 3,000株
三井不動産	922,800	2,408.00	2,222,102,400	貸付有価証券 2,700株
三菱地所	1,218,600	1,999.50	2,436,590,700	貸付有価証券 159,300株

平和不動産	31,900	2,461.00	78,505,900	貸付有価証券 100株
東京建物	190,100	1,323.00	251,502,300	貸付有価証券 26,900株（600株）
ダイビル	51,200	1,023.00	52,377,600	貸付有価証券 100株
京阪神ビルディング	30,400	1,221.00	37,118,400	貸付有価証券 3,800株
住友不動産	391,000	3,949.00	1,544,059,000	貸付有価証券 500株
テーオーシー	39,800	777.00	30,924,600	貸付有価証券 100株
東京楽天地	2,500	5,210.00	13,025,000	貸付有価証券 300株
レオパレス21	214,500	254.00	54,483,000	貸付有価証券 140,300株（52,800 株）
スターツコーポレーション	23,700	2,299.00	54,486,300	
フジ住宅	22,200	691.00	15,340,200	
空港施設	20,300	506.00	10,271,800	
明和地所	9,500	534.00	5,073,000	貸付有価証券 1,200株
ゴールドクレスト	13,700	1,980.00	27,126,000	貸付有価証券 3,800株（500株）
日本エスリード	6,800	1,635.00	11,118,000	
日神不動産	25,700	452.00	11,616,400	貸付有価証券 100株
日本エスコン	31,500	724.00	22,806,000	貸付有価証券 16,900株（13,800株）
タカラレーベン	79,500	368.00	29,256,000	貸付有価証券 2,600株
サンヨーハウジング名古屋	9,800	952.00	9,329,600	貸付有価証券 6,500株
イオンモール	87,200	1,681.00	146,583,200	
毎日コムネット	3,700	741.00	2,741,700	貸付有価証券 600株
ファースト住建	7,400	1,211.00	8,961,400	貸付有価証券 900株
カチタス	19,400	4,145.00	80,413,000	貸付有価証券 3,600株（300株）
トーセイ	23,900	1,171.00	27,986,900	貸付有価証券

				100株
穴吹興産	1,900	2,812.00	5,342,800	貸付有価証券 200株
サンフロンティア不動産	24,000	1,215.00	29,160,000	貸付有価証券 1,300株
エフ・ジェー・ネクスト	15,200	1,026.00	15,595,200	貸付有価証券 8,400株
インテリックス	4,900	742.00	3,635,800	貸付有価証券 300株
ランドビジネス	7,300	766.00	5,591,800	貸付有価証券 800株
日本社宅サービス	4,400	1,000.00	4,400,000	貸付有価証券 200株
グランディハウス	15,200	434.00	6,596,800	貸付有価証券 1,800株
日本空港ビルデング	55,500	4,085.00	226,717,500	貸付有価証券 37,300株
日本工営	11,300	2,536.00	28,656,800	貸付有価証券 3,300株
L I F U L L	58,800	632.00	37,161,600	貸付有価証券 3,700株
ジェイエイシーリクルー トメント	11,300	2,065.00	23,334,500	貸付有価証券 2,500株
日本M&Aセンター	125,600	2,921.00	366,877,600	貸付有価証券 5,900株
メンバーズ	5,700	1,752.00	9,986,400	貸付有価証券 3,800株
中広	1,700	583.00	991,100	貸付有価証券 200株
アイティメディア	3,400	808.00	2,747,200	貸付有価証券 600株
タケエイ	17,500	962.00	16,835,000	貸付有価証券 500株
E・Jホールディングス	2,100	1,201.00	2,522,100	
トラスト・テック	18,600	1,296.00	24,105,600	貸付有価証券 7,600株
コシダカホールディング ス	40,600	1,653.00	67,111,800	貸付有価証券 27,200株
アルトナー	4,100	698.00	2,861,800	
パソナグループ	20,500	1,460.00	29,930,000	貸付有価証券 1,200株
C D S	4,200	1,274.00	5,350,800	貸付有価証券

				200株
リンクアンドモチベーション	37,100	477.00	17,696,700	貸付有価証券 23,800株(200株)
G C A	19,900	699.00	13,910,100	貸付有価証券 6,100株
エス・エム・エス	61,900	2,401.00	148,621,900	貸付有価証券 7,600株
サニーサイドアップ	3,700	1,010.00	3,737,000	貸付有価証券 2,000株(2,000株)
パーソルホールディングス	168,500	2,125.00	358,062,500	貸付有価証券 200株
リニカル	9,500	1,073.00	10,193,500	貸付有価証券 2,100株(700株)
クックパッド	58,800	278.00	16,346,400	貸付有価証券 32,200株(1,000株)
エスクリ	4,600	819.00	3,767,400	
アイ・ケイ・ケイ	8,200	716.00	5,871,200	貸付有価証券 1,200株(200株)
学情	6,000	1,145.00	6,870,000	貸付有価証券 2,100株
スタジオアリス	8,500	2,102.00	17,867,000	貸付有価証券 5,600株
シミックホールディングス	9,300	1,750.00	16,275,000	貸付有価証券 1,100株
N J S	3,700	1,571.00	5,812,700	
総合警備保障	67,000	5,160.00	345,720,000	貸付有価証券 8,200株
カカクコム	126,200	2,525.00	318,655,000	貸付有価証券 24,400株
セントケア・ホールディング	12,200	480.00	5,856,000	貸付有価証券 6,800株
サイネックス	2,800	632.00	1,769,600	貸付有価証券 100株
ルネサンス	9,400	1,590.00	14,946,000	貸付有価証券 5,100株
ディップ	27,200	2,300.00	62,560,000	貸付有価証券 14,900株
オプトホールディング	9,100	1,593.00	14,496,300	
新日本科学	22,800	638.00	14,546,400	貸付有価証券 8,700株
ツクイ	39,700	437.00	17,348,900	貸付有価証券 200株

キャリアデザインセンター	4,200	1,399.00	5,875,800	
ベネフィット・ワン	46,700	1,762.00	82,285,400	貸付有価証券 3,200株
エムスリー	354,800	2,255.00	800,074,000	貸付有価証券 84,400株
ツカダ・グローバルホールディング	10,700	584.00	6,248,800	貸付有価証券 1,600株
プラス	1,900	601.00	1,141,900	
アウトソーシング	96,300	1,044.00	100,537,200	貸付有価証券 35,500株
ウェルネット	15,900	744.00	11,829,600	貸付有価証券 1,000株
ワールドホールディングス	5,600	1,546.00	8,657,600	貸付有価証券 600株
ディー・エヌ・エー	90,800	2,078.00	188,682,400	
博報堂D Yホールディングス	234,300	1,564.00	366,445,200	貸付有価証券 29,400株
ぐるなび	24,000	711.00	17,064,000	貸付有価証券 1,700株
タカミヤ	17,400	755.00	13,137,000	貸付有価証券 8,400株
ジャパンベストレスキューシステム	11,400	1,124.00	12,813,600	貸付有価証券 6,200株
ファンコミュニケーションズ	46,300	545.00	25,233,500	貸付有価証券 100株
ライク	6,600	1,830.00	12,078,000	貸付有価証券 1,000株
ビジネス・ブレークスルー	7,000	356.00	2,492,000	貸付有価証券 1,000株
W D Bホールディングス	7,700	2,403.00	18,503,100	貸付有価証券 900株
ティア	9,800	629.00	6,164,200	
C D G	1,500	1,398.00	2,097,000	貸付有価証券 500株
バリューコマース	9,400	1,697.00	15,951,800	貸付有価証券 1,100株(1,100株)
インフォマート	92,300	1,573.00	145,187,900	貸付有価証券 61,800株
J Pホールディングス	48,100	270.00	12,987,000	貸付有価証券 300株
E P Sホールディングス	25,400	1,333.00	33,858,200	貸付有価証券

				100株
レグス	4,200	1,730.00	7,266,000	貸付有価証券 2,300株
プレステージ・インター ナショナル	31,500	1,765.00	55,597,500	貸付有価証券 5,100株
アミューズ	10,200	2,456.00	25,051,200	貸付有価証券 1,200株
ドリームインキュベータ	5,100	1,260.00	6,426,000	
クイック	10,500	1,356.00	14,238,000	
T A C	9,100	192.00	1,747,200	貸付有価証券 1,100株
ケネディクス	160,300	501.00	80,310,300	貸付有価証券 24,900株
電通	173,700	3,715.00	645,295,500	貸付有価証券 102,800株
テイクアンドギヴ・ニ ーズ	6,400	1,240.00	7,936,000	
ぴあ	4,800	4,225.00	20,280,000	貸付有価証券 1,900株
イオンファンタジー	5,400	2,961.00	15,989,400	貸付有価証券 3,000株
シーティーエス	19,000	710.00	13,490,000	貸付有価証券 8,700株
ネクシィーズグループ	5,900	1,667.00	9,835,300	貸付有価証券 1,000株（200株）
みらかホールディングス	47,100	2,287.00	107,717,700	貸付有価証券 100株
アルプス技研	14,900	1,398.00	20,830,200	貸付有価証券 2,300株
ダイオーズ	3,900	1,444.00	5,631,600	貸付有価証券 2,500株（100株）
日本空調サービス	19,100	702.00	13,408,200	
オリエンタルランド	199,100	15,035.00	2,993,468,500	貸付有価証券 31,500株
ダスキン	43,300	2,724.00	117,949,200	貸付有価証券 5,700株
明光ネットワークジャ パン	19,800	952.00	18,849,600	貸付有価証券 13,200株
ファルコホールディング ス	9,300	1,584.00	14,731,200	貸付有価証券 1,200株
秀英予備校	3,700	435.00	1,609,500	
田谷	3,100	588.00	1,822,800	貸付有価証券

				1,700株
ラウンドワン	52,300	1,604.00	83,889,200	
リゾートトラスト	71,300	1,624.00	115,791,200	貸付有価証券 400株
ビー・エム・エル	21,700	2,966.00	64,362,200	
ワタベウェディング	2,700	625.00	1,687,500	貸付有価証券 500株
りらいあコミュニケーションズ	30,400	1,308.00	39,763,200	
リソー教育	85,500	498.00	42,579,000	貸付有価証券 11,700株
早稲田アカデミー	4,800	853.00	4,094,400	貸付有価証券 2,700株
ユー・エス・エス	205,800	1,906.00	392,254,800	貸付有価証券 26,100株（300株）
東京個別指導学院	5,900	840.00	4,956,000	貸付有価証券 3,800株
サイバーエージェント	96,900	4,420.00	428,298,000	貸付有価証券 19,300株（6,600株）
楽天	785,500	1,017.00	798,853,500	貸付有価証券 160,400株
クリーク・アンド・リバー社	9,900	1,239.00	12,266,100	貸付有価証券 4,100株（1,500株）
テー・オー・ダブリュー	14,700	775.00	11,392,500	貸付有価証券 1,900株
山田コンサルティンググループ	8,200	1,700.00	13,940,000	貸付有価証券 1,600株
セントラルスポーツ	6,300	3,010.00	18,963,000	貸付有価証券 4,200株
フルキャストホールディングス	16,900	1,958.00	33,090,200	貸付有価証券 3,000株
エン・ジャパン	24,500	3,815.00	93,467,500	貸付有価証券 5,400株（2,100株）
リソルホールディングス	1,800	3,895.00	7,011,000	
テクノプロ・ホールディングス	33,800	6,050.00	204,490,000	貸付有価証券 4,200株
アトラ	3,900	235.00	916,500	貸付有価証券 2,200株
インターワークス	3,200	547.00	1,750,400	
アイ・アールジャパンホールディングス	6,800	3,975.00	27,030,000	
K e e P e r 技研	6,200	1,333.00	8,264,600	貸付有価証券

				1,500株
ファーストロジック	3,900	609.00	2,375,100	貸付有価証券 200株
三機サービス	3,500	879.00	3,076,500	貸付有価証券 1,800株
Gunosy	11,700	1,355.00	15,853,500	貸付有価証券 6,900株(400株)
デザインワン・ジャパン	3,300	286.00	943,800	貸付有価証券 1,100株
イー・ガーディアン	8,500	1,831.00	15,563,500	貸付有価証券 3,000株
リブセンス	10,800	258.00	2,786,400	貸付有価証券 6,300株
ジャパンマテリアル	46,100	1,126.00	51,908,600	
ベクトル	21,000	894.00	18,774,000	貸付有価証券 5,500株
ウチヤマホールディングス	8,300	501.00	4,158,300	
チャーム・ケア・コーポレーション	5,400	2,066.00	11,156,400	
ライクキッズネクスト	4,000	965.00	3,860,000	
キャリアリンク	6,200	583.00	3,614,600	貸付有価証券 3,400株
I B J	11,300	1,087.00	12,283,100	貸付有価証券 2,100株
アサンテ	6,800	1,992.00	13,545,600	
N・フィールド	11,600	646.00	7,493,600	貸付有価証券 1,700株
バリューHR	3,300	3,130.00	10,329,000	
M&Aキャピタルパートナーズ	6,000	6,330.00	37,980,000	貸付有価証券 600株
ライドオンエクスプレスホールディングス	7,000	1,630.00	11,410,000	貸付有価証券 2,800株
E R Iホールディングス	4,700	763.00	3,586,100	貸付有価証券 500株
アピスト	2,600	2,614.00	6,796,400	
シグマクシス	8,000	1,331.00	10,648,000	貸付有価証券 1,700株(1,700株)
ウィルグループ	11,000	818.00	8,998,000	
エスクロー・エージェント・ジャパン	23,200	218.00	5,057,600	貸付有価証券 7,000株(800株)

日本ビューホテル	5,300	1,536.00	8,140,800	
リクルートホールディングス	1,207,200	3,311.00	3,997,039,200	
エラン	10,000	1,726.00	17,260,000	
土木管理総合試験所	7,300	425.00	3,102,500	貸付有価証券 400株
ネットマーケティング	6,000	752.00	4,512,000	貸付有価証券 3,300株（3,300株）
日本郵政	1,381,200	995.00	1,374,294,000	
ベルシステム24ホールディングス	28,200	1,583.00	44,640,600	
鎌倉新書	12,400	1,674.00	20,757,600	貸付有価証券 7,300株（100株）
ソネット・メディア・ネットワークス	2,100	678.00	1,423,800	貸付有価証券 1,400株（1,000株）
一蔵	1,800	623.00	1,121,400	
LITALICO	3,800	1,841.00	6,995,800	貸付有価証券 1,200株
グローバルキッズCOMPANY	2,500	861.00	2,152,500	貸付有価証券 600株
エポラブルアジア	7,500	2,295.00	17,212,500	貸付有価証券 1,700株
アトラエ	4,400	2,698.00	11,871,200	貸付有価証券 2,400株
ストライク	6,400	2,536.00	16,230,400	貸付有価証券 2,000株（400株）
ソラスト	41,200	1,221.00	50,305,200	貸付有価証券 600株
セラク	5,300	761.00	4,033,300	貸付有価証券 400株（400株）
インソース	6,500	2,947.00	19,155,500	貸付有価証券 2,000株
ベイカレント・コンサルティング	11,900	4,840.00	57,596,000	貸付有価証券 300株
Orchestra Holdings	3,300	958.00	3,161,400	貸付有価証券 900株
アイモバイル	5,300	737.00	3,906,100	貸付有価証券 3,500株（2,400株）
キャリアインデックス	5,700	525.00	2,992,500	貸付有価証券 3,800株
MS - Japan	6,800	1,452.00	9,873,600	貸付有価証券 1,200株

船場	2,700	916.00	2,473,200	
グレイステクノロジー	6,100	3,170.00	19,337,000	貸付有価証券 3,300株（300株）
ジャパンエレベーター サービスホールディング	13,300	2,732.00	36,335,600	貸付有価証券 1,400株
フルテック	2,400	1,171.00	2,810,400	貸付有価証券 200株
グリーンズ	6,400	1,332.00	8,524,800	
ツナググループ・ホール ディングス	2,000	575.00	1,150,000	貸付有価証券 200株
ソウルドアウト	2,600	1,671.00	4,344,600	貸付有価証券 900株（100株）
M S & C o n s u l t i n g	2,700	1,013.00	2,735,100	
日総工産	11,200	1,131.00	12,667,200	貸付有価証券 2,600株
キュービーネットホール ディングス	10,300	2,248.00	23,154,400	貸付有価証券 200株
R P Aホールディングス	7,100	1,603.00	11,381,300	貸付有価証券 3,900株
スプリックス	5,600	1,695.00	9,492,000	貸付有価証券 3,700株（2,200株）
アドバンテッジリスクマ ネジメント	6,600	861.00	5,682,600	貸付有価証券 2,100株
リログループ	92,100	2,662.00	245,170,200	貸付有価証券 17,000株
東祥	10,500	2,714.00	28,497,000	貸付有価証券 900株
エイチ・アイ・エス	26,300	2,571.00	67,617,300	貸付有価証券 17,600株（2,000株）
ラックランド	3,400	2,225.00	7,565,000	貸付有価証券 100株
共立メンテナンス	25,800	4,455.00	114,939,000	貸付有価証券 4,800株
イチネンホールディング ス	17,500	1,040.00	18,200,000	
建設技術研究所	11,600	1,583.00	18,362,800	
スペース	10,900	1,146.00	12,491,400	
長大	6,200	766.00	4,749,200	
燦ホールディングス	3,700	2,077.00	7,684,900	
スバル興業	1,200	5,970.00	7,164,000	貸付有価証券

				100株
東京テアトル	6,600	1,347.00	8,890,200	貸付有価証券 4,100株(100株)
タナベ経営	3,200	1,259.00	4,028,800	
ナガワ	4,700	4,865.00	22,865,500	貸付有価証券 700株
よみうりランド	3,700	4,490.00	16,613,000	
東京都競馬	11,000	3,115.00	34,265,000	
常磐興産	6,800	1,667.00	11,335,600	貸付有価証券 2,800株
カナモト	27,600	2,663.00	73,498,800	貸付有価証券 300株
東京ドーム	63,000	1,020.00	64,260,000	貸付有価証券 3,100株
西尾レントオール	17,100	2,765.00	47,281,500	
トランス・コスモス	18,700	2,628.00	49,143,600	貸付有価証券 2,300株
乃村工藝社	78,800	1,341.00	105,670,800	貸付有価証券 1,300株
藤田観光	7,400	2,781.00	20,579,400	貸付有価証券 1,100株
KNT-CTホールディングス	9,000	1,443.00	12,987,000	貸付有価証券 100株
日本管財	18,000	1,852.00	33,336,000	貸付有価証券 2,200株
トーカイ	16,300	2,219.00	36,169,700	
白洋舎	1,900	2,784.00	5,289,600	貸付有価証券 200株
セコム	178,800	8,934.00	1,597,399,200	貸付有価証券 100株
セントラル警備保障	8,100	4,980.00	40,338,000	貸付有価証券 5,400株
丹青社	31,800	1,273.00	40,481,400	
メイテック	20,900	5,510.00	115,159,000	
応用地質	18,100	1,101.00	19,928,100	
船井総研ホールディングス	34,800	2,167.00	75,411,600	貸付有価証券 700株
進学会ホールディングス	7,700	529.00	4,073,300	
オオバ	13,200	599.00	7,906,800	
いであ	3,100	1,091.00	3,382,100	貸付有価証券

					100株
	学究社	5,500	1,276.00	7,018,000	
	ベネッセホールディングス	61,700	2,614.00	161,283,800	貸付有価証券 8,600株
	イオンディライト	20,800	3,250.00	67,600,000	
	ナック	10,600	943.00	9,995,800	貸付有価証券 1,300株
	ニチイ学館	24,000	1,670.00	40,080,000	貸付有価証券 3,700株
	ダイセキ	28,300	2,676.00	75,730,800	貸付有価証券 3,500株
	ステップ	6,200	1,416.00	8,779,200	
	小計 銘柄数：2,131 組入時価比率：98.0%			377,223,044,950	100.0%
	合計			377,223,044,950	

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

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

(2)株式以外の有価証券(2019年8月19日現在)

該当事項はありません。

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 8月19日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
株価指数先物取引				
買建	7,951,808,000	-	7,776,600,000	175,460,720
合計	7,951,808,000	-	7,776,600,000	175,460,720

(注)時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

国内債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 8月19日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	85,803,121
国債証券	34,065,624,080
未収利息	74,735,938
前払費用	2,833,484
流動資産合計	34,228,996,623
資産合計	34,228,996,623
負債の部	
流動負債	
未払解約金	15,923,507
未払利息	132
流動負債合計	15,923,639
負債合計	15,923,639
純資産の部	
元本等	
元本	24,344,240,553
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,868,832,431
元本等合計	34,213,072,984
純資産合計	34,213,072,984
負債純資産合計	34,228,996,623

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
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る場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月19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	1.4054円
(10,000口当たり純資産額)	(14,054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 2019年 2月19日 至 2019年 8月19日
<p>1.金融商品に対する取組方針 当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2.金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。 当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。 これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 8月19日現在
<p>1.貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2.時価の算定方法 国債証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 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。</p>

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 8月19日現在	
期首	2019年 2月19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	19,423,740,506円
同期中における追加設定元本額	5,979,574,274円
同期中における一部解約元本額	1,059,074,227円
期末元本額	24,344,240,553円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	533,826,001円

バランスセレクト50	597,167,520円
バランスセレクト70	243,208,559円
ネクストコア	523,067,353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)	11,899,518,898円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	23,109,494円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	49,517,603円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	22,206,412円
野村日本国債インデックスファンド(確定拠出年金向け)	4,885,168,959円
国内債券・株式バランスファンド(確定拠出年金向け)	136,557,827円
野村DC運用戦略ファンド	4,920,222,815円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	510,669,112円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年8月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年8月19日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	日本円	国庫債券 利付(2年)第393回	120,000,000	120,475,200	
		国庫債券 利付(2年)第394回	170,000,000	170,725,900	
		国庫債券 利付(2年)第395回	230,000,000	231,048,800	
		国庫債券 利付(2年)第396回	340,000,000	341,655,800	
		国庫債券 利付(2年)第398回	70,000,000	70,392,000	
		国庫債券 利付(2年)第399回	170,000,000	171,018,300	
		国庫債券 利付(2年)第400回	200,000,000	201,276,000	
		国庫債券 利付(2年)第401回	100,000,000	100,671,000	
		国庫債券 利付(5年)第125回	380,000,000	381,444,000	
		国庫債券 利付(5年)第126回	500,000,000	502,375,000	
		国庫債券 利付(5年)第127回	280,000,000	281,643,600	
		国庫債券 利付(5年)第128回	580,000,000	584,002,000	
		国庫債券 利付(5年)第129回	270,000,000	272,178,900	
		国庫債券 利付(5年)第130回	360,000,000	363,254,400	

国庫債券 利付(5年)第131回	420,000,000	424,258,800	
国庫債券 利付(5年)第132回	320,000,000	323,654,400	
国庫債券 利付(5年)第133回	380,000,000	384,731,000	
国庫債券 利付(5年)第134回	440,000,000	446,001,600	
国庫債券 利付(5年)第135回	290,000,000	294,355,800	
国庫債券 利付(5年)第136回	180,000,000	182,968,200	
国庫債券 利付(5年)第137回	330,000,000	335,735,400	
国庫債券 利付(5年)第138回	250,000,000	254,612,500	
国庫債券 利付(5年)第139回	220,000,000	224,294,400	
国庫債券 利付(40年)第1回	30,000,000	48,432,600	
国庫債券 利付(40年)第2回	30,000,000	47,218,500	
国庫債券 利付(40年)第3回	60,000,000	95,406,600	
国庫債券 利付(40年)第4回	75,000,000	120,450,750	
国庫債券 利付(40年)第5回	100,000,000	156,012,000	
国庫債券 利付(40年)第6回	90,000,000	138,799,800	
国庫債券 利付(40年)第7回	100,000,000	148,997,000	
国庫債券 利付(40年)第8回	100,000,000	140,093,000	
国庫債券 利付(40年)第9回	130,000,000	137,688,200	
国庫債券 利付(40年)第10回	120,000,000	148,581,600	
国庫債券 利付(40年)第11回	50,000,000	60,313,000	
国庫債券 利付(10年)第310回	30,000,000	30,407,700	
国庫債券 利付(10年)第311回	190,000,000	192,169,800	
国庫債券 利付(10年)第312回	70,000,000	71,362,900	
国庫債券 利付(10年)第314回	30,000,000	30,652,500	
国庫債券 利付(10年)第315回	70,000,000	71,894,900	
国庫債券 利付(10年)第316回	130,000,000	133,279,900	
国庫債券 利付(10年)第317回	30,000,000	30,868,200	
国庫債券 利付(10年)第318回	80,000,000	82,147,200	
国庫債券 利付(10年)第319回	70,000,000	72,269,400	
国庫債券 利付(10年)第320回	90,000,000	92,706,300	

回			
国庫債券 利付(10年)第321回	150,000,000	155,010,000	
国庫債券 利付(10年)第322回	130,000,000	134,004,000	
国庫債券 利付(10年)第323回	70,000,000	72,379,300	
国庫債券 利付(10年)第324回	150,000,000	154,669,500	
国庫債券 利付(10年)第325回	330,000,000	341,249,700	
国庫債券 利付(10年)第326回	240,000,000	248,080,800	
国庫債券 利付(10年)第327回	230,000,000	238,519,200	
国庫債券 利付(10年)第328回	230,000,000	237,578,500	
国庫債券 利付(10年)第329回	350,000,000	365,137,500	
国庫債券 利付(10年)第330回	220,000,000	230,197,000	
国庫債券 利付(10年)第331回	190,000,000	197,233,300	
国庫債券 利付(10年)第332回	350,000,000	364,150,500	
国庫債券 利付(10年)第333回	250,000,000	260,692,500	
国庫債券 利付(10年)第334回	340,000,000	355,439,400	
国庫債券 利付(10年)第335回	370,000,000	385,880,400	
国庫債券 利付(10年)第336回	230,000,000	240,430,500	
国庫債券 利付(10年)第337回	220,000,000	227,585,600	
国庫債券 利付(10年)第338回	470,000,000	489,782,300	
国庫債券 利付(10年)第339回	440,000,000	459,373,200	
国庫債券 利付(10年)第340回	335,000,000	350,399,950	
国庫債券 利付(10年)第341回	400,000,000	416,572,000	

国庫債券 利付(10年)第342回	430,000,000	442,586,100	
国庫債券 利付(10年)第343回	500,000,000	515,205,000	
国庫債券 利付(10年)第344回	530,000,000	547,325,700	
国庫債券 利付(10年)第345回	520,000,000	537,612,400	
国庫債券 利付(10年)第346回	330,000,000	341,431,200	
国庫債券 利付(10年)第347回	260,000,000	269,204,000	
国庫債券 利付(10年)第348回	150,000,000	155,356,500	
国庫債券 利付(10年)第349回	240,000,000	248,630,400	
国庫債券 利付(10年)第350回	340,000,000	352,131,200	
国庫債券 利付(10年)第351回	130,000,000	134,595,500	
国庫債券 利付(10年)第352回	220,000,000	227,686,800	
国庫債券 利付(10年)第353回	340,000,000	351,706,200	
国庫債券 利付(10年)第354回	330,000,000	341,167,200	
国庫債券 利付(30年)第3回	40,000,000	50,872,000	
国庫債券 利付(30年)第5回	10,000,000	12,802,600	
国庫債券 利付(30年)第6回	10,000,000	13,141,700	
国庫債券 利付(30年)第7回	15,000,000	19,673,850	
国庫債券 利付(30年)第8回	20,000,000	25,088,600	
国庫債券 利付(30年)第9回	20,000,000	24,021,800	
国庫債券 利付(30年)第10回	30,000,000	34,884,300	
国庫債券 利付(30年)第11回	10,000,000	12,481,000	
国庫債券 利付(30年)第12回	10,000,000	13,086,800	
国庫債券 利付(30年)第13回	10,000,000	12,987,800	
国庫債券 利付(30年)第14回	30,000,000	40,825,500	
国庫債券 利付(30年)第15回	70,000,000	96,674,200	
国庫債券 利付(30年)第16回	10,000,000	13,854,800	
国庫債券 利付(30年)第17回	20,000,000	27,508,000	

国庫債券	利付(30年)第18回	120,000,000	163,767,600
国庫債券	利付(30年)第19回	10,000,000	13,684,800
国庫債券	利付(30年)第20回	10,000,000	14,055,100
国庫債券	利付(30年)第21回	60,000,000	82,608,600
国庫債券	利付(30年)第22回	50,000,000	70,726,000
国庫債券	利付(30年)第23回	40,000,000	56,737,200
国庫債券	利付(30年)第24回	80,000,000	113,877,600
国庫債券	利付(30年)第25回	50,000,000	69,632,500
国庫債券	利付(30年)第26回	80,000,000	113,157,600
国庫債券	利付(30年)第27回	100,000,000	144,169,000
国庫債券	利付(30年)第28回	30,000,000	43,491,000
国庫債券	利付(30年)第29回	120,000,000	172,657,200
国庫債券	利付(30年)第30回	80,000,000	114,238,400
国庫債券	利付(30年)第31回	60,000,000	84,975,600
国庫債券	利付(30年)第32回	110,000,000	158,961,000
国庫債券	利付(30年)第33回	130,000,000	181,004,200
国庫債券	利付(30年)第34回	110,000,000	158,631,000
国庫債券	利付(30年)第35回	122,000,000	171,715,000
国庫債券	利付(30年)第36回	130,000,000	183,933,100
国庫債券	利付(30年)第37回	130,000,000	181,977,900
国庫債券	利付(30年)第38回	90,000,000	124,529,400
国庫債券	利付(30年)第39回	80,000,000	112,863,200
国庫債券	利付(30年)第40回	120,000,000	166,800,000
国庫債券	利付(30年)第41回	100,000,000	137,033,000
国庫債券	利付(30年)第42回	60,000,000	82,339,800
国庫債券	利付(30年)第43回	90,000,000	123,841,800
国庫債券	利付(30年)第44回	110,000,000	151,769,200
国庫債券	利付(30年)第45回	90,000,000	119,946,600
国庫債券	利付(30年)第46回	100,000,000	133,587,000
国庫債券	利付(30年)第47回	110,000,000	149,851,900
国庫債券	利付(30年)第48回	110,000,000	144,515,800
国庫債券	利付(30年)第49回	120,000,000	157,999,200
国庫債券	利付(30年)第50回	110,000,000	127,948,700
国庫債券	利付(30年)第51回	80,000,000	82,668,800
国庫債券	利付(30年)第54回	160,000,000	186,555,200
国庫債券	利付(30年)第55回	80,000,000	93,269,600

国庫債券	利付(30年)第56回	80,000,000	93,384,000
国庫債券	利付(30年)第57回	110,000,000	128,385,400
国庫債券	利付(30年)第58回	180,000,000	210,335,400
国庫債券	利付(30年)第59回	90,000,000	102,686,400
国庫債券	利付(30年)第60回	140,000,000	167,626,200
国庫債券	利付(30年)第61回	100,000,000	114,170,000
国庫債券	利付(30年)第62回	90,000,000	97,677,000
国庫債券	利付(30年)第63回	20,000,000	21,126,000
国庫債券	利付(20年)第47回	15,000,000	15,400,800
国庫債券	利付(20年)第48回	30,000,000	31,108,500
国庫債券	利付(20年)第49回	40,000,000	41,510,000
国庫債券	利付(20年)第52回	25,000,000	26,249,250
国庫債券	利付(20年)第53回	10,000,000	10,559,200
国庫債券	利付(20年)第54回	10,000,000	10,582,700
国庫債券	利付(20年)第55回	10,000,000	10,594,700
国庫債券	利付(20年)第56回	10,000,000	10,654,100
国庫債券	利付(20年)第57回	10,000,000	10,625,500
国庫債券	利付(20年)第58回	10,000,000	10,683,300
国庫債券	利付(20年)第59回	30,000,000	32,020,500
国庫債券	利付(20年)第60回	10,000,000	10,572,500
国庫債券	利付(20年)第61回	10,000,000	10,474,300
国庫債券	利付(20年)第62回	80,000,000	83,460,000
国庫債券	利付(20年)第63回	10,000,000	10,818,400
国庫債券	利付(20年)第64回	10,000,000	10,916,600
国庫債券	利付(20年)第65回	10,000,000	10,973,300
国庫債券	利付(20年)第66回	20,000,000	21,858,600
国庫債券	利付(20年)第67回	10,000,000	11,029,500
国庫債券	利付(20年)第68回	10,000,000	11,168,900
国庫債券	利付(20年)第69回	30,000,000	33,367,200
国庫債券	利付(20年)第70回	40,000,000	45,340,400
国庫債券	利付(20年)第71回	10,000,000	11,237,000
国庫債券	利付(20年)第72回	20,000,000	22,501,800
国庫債券	利付(20年)第73回	10,000,000	11,262,000
国庫債券	利付(20年)第74回	10,000,000	11,316,300
国庫債券	利付(20年)第75回	40,000,000	45,526,000
国庫債券	利付(20年)第76回	17,000,000	19,155,260

国庫債券 利付(20年)第77回	15,000,000	16,987,050	
国庫債券 利付(20年)第78回	10,000,000	11,326,200	
国庫債券 利付(20年)第79回	10,000,000	11,385,700	
国庫債券 利付(20年)第80回	10,000,000	11,445,200	
国庫債券 利付(20年)第81回	10,000,000	11,443,200	
国庫債券 利付(20年)第82回	15,000,000	17,257,950	
国庫債券 利付(20年)第83回	15,000,000	17,352,450	
国庫債券 利付(20年)第84回	50,000,000	57,518,000	
国庫債券 利付(20年)第85回	13,000,000	15,109,770	
国庫債券 利付(20年)第86回	10,000,000	11,757,300	
国庫債券 利付(20年)第88回	20,000,000	23,652,200	
国庫債券 利付(20年)第90回	20,000,000	23,670,600	
国庫債券 利付(20年)第91回	10,000,000	11,907,900	
国庫債券 利付(20年)第92回	30,000,000	35,479,200	
国庫債券 利付(20年)第93回	20,000,000	23,614,000	
国庫債券 利付(20年)第94回	20,000,000	23,769,400	
国庫債券 利付(20年)第95回	10,000,000	12,104,900	
国庫債券 利付(20年)第96回	15,000,000	17,916,300	
国庫債券 利付(20年)第97回	50,000,000	60,407,000	
国庫債券 利付(20年)第99回	30,000,000	36,154,500	
国庫債券 利付(20年)第100回	20,000,000	24,371,400	
国庫債券 利付(20年)第101回	20,000,000	24,723,400	
国庫債券 利付(20年)第102回	20,000,000	24,831,800	
国庫債券 利付(20年)第103回	25,000,000	30,813,750	
国庫債券 利付(20年)第104回	10,000,000	12,144,500	
国庫債券 利付(20年)第105回	70,000,000	85,331,400	
国庫債券 利付(20年)第106回	100,000,000	122,832,000	
国庫債券 利付(20年)第107回	100,000,000	122,401,000	
国庫債券 利付(20年)第108回	80,000,000	96,392,000	
国庫債券 利付(20年)第109回	30,000,000	36,259,800	

回			
国庫債券 利付(20年)第110回	90,000,000	110,543,400	
国庫債券 利付(20年)第111回	10,000,000	12,432,100	
国庫債券 利付(20年)第112回	85,000,000	104,818,600	
国庫債券 利付(20年)第113回	160,000,000	198,080,000	
国庫債券 利付(20年)第114回	130,000,000	161,551,000	
国庫債券 利付(20年)第115回	50,000,000	62,662,500	
国庫債券 利付(20年)第116回	110,000,000	138,386,600	
国庫債券 利付(20年)第117回	60,000,000	74,836,200	
国庫債券 利付(20年)第118回	40,000,000	49,634,000	
国庫債券 利付(20年)第119回	50,000,000	60,937,500	
国庫債券 利付(20年)第120回	110,000,000	131,631,500	
国庫債券 利付(20年)第121回	100,000,000	123,386,000	
国庫債券 利付(20年)第122回	130,000,000	158,932,800	
国庫債券 利付(20年)第123回	100,000,000	126,088,000	
国庫債券 利付(20年)第124回	100,000,000	124,934,000	
国庫債券 利付(20年)第125回	100,000,000	127,696,000	
国庫債券 利付(20年)第126回	30,000,000	37,601,400	
国庫債券 利付(20年)第127回	120,000,000	148,992,000	
国庫債券 利付(20年)第128回	100,000,000	124,620,000	
国庫債券 利付(20年)第129回	50,000,000	61,708,000	
国庫債券 利付(20年)第130回	90,000,000	111,394,800	

国庫債券 利付(20年)第131回	35,000,000	42,890,050	
国庫債券 利付(20年)第132回	60,000,000	73,717,200	
国庫債券 利付(20年)第133回	120,000,000	148,938,000	
国庫債券 利付(20年)第134回	70,000,000	87,167,500	
国庫債券 利付(20年)第135回	60,000,000	73,948,800	
国庫債券 利付(20年)第136回	30,000,000	36,591,000	
国庫債券 利付(20年)第137回	40,000,000	49,424,000	
国庫債券 利付(20年)第138回	50,000,000	60,478,000	
国庫債券 利付(20年)第139回	60,000,000	73,354,800	
国庫債券 利付(20年)第140回	140,000,000	173,411,000	
国庫債券 利付(20年)第141回	140,000,000	173,821,200	
国庫債券 利付(20年)第142回	100,000,000	125,507,000	
国庫債券 利付(20年)第143回	130,000,000	160,095,000	
国庫債券 利付(20年)第144回	80,000,000	97,420,800	
国庫債券 利付(20年)第145回	290,000,000	361,949,000	
国庫債券 利付(20年)第146回	140,000,000	175,249,200	
国庫債券 利付(20年)第147回	150,000,000	186,135,000	
国庫債券 利付(20年)第148回	120,000,000	147,427,200	
国庫債券 利付(20年)第149回	90,000,000	110,845,800	
国庫債券 利付(20年)第150回	130,000,000	158,410,200	
国庫債券 利付(20年)第151回	170,000,000	202,366,300	
国庫債券 利付(20年)第152回	180,000,000	214,657,200	

	回			
	国庫債券 利付(20年)第153回	120,000,000	145,158,000	
	国庫債券 利付(20年)第155回	160,000,000	186,286,400	
	国庫債券 利付(20年)第156回	130,000,000	138,621,600	
	国庫債券 利付(20年)第157回	180,000,000	185,745,600	
	国庫債券 利付(20年)第158回	60,000,000	64,959,000	
	国庫債券 利付(20年)第159回	340,000,000	373,741,600	
	国庫債券 利付(20年)第160回	130,000,000	145,232,100	
	国庫債券 利付(20年)第161回	110,000,000	120,906,500	
	国庫債券 利付(20年)第162回	110,000,000	120,951,600	
	国庫債券 利付(20年)第163回	190,000,000	208,794,800	
	国庫債券 利付(20年)第164回	130,000,000	140,510,500	
	国庫債券 利付(20年)第165回	190,000,000	205,184,800	
	国庫債券 利付(20年)第166回	90,000,000	100,583,100	
	国庫債券 利付(20年)第167回	140,000,000	151,050,200	
	国庫債券 利付(20年)第168回	100,000,000	105,964,000	
	国庫債券 利付(20年)第169回	40,000,000	41,596,000	
小計	銘柄数: 253 組入時価比率: 99.6%	30,462,000,000	34,065,624,080 100.0%	
合計			34,065,624,080	

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 8月19日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	5,886,069,958
コール・ローン	828,073,017
株式	535,276,180,774
投資証券	15,743,722,614
派生商品評価勘定	29,554,274
未収入金	53,432
未収配当金	1,011,465,639
差入委託証拠金	2,175,488,029
流動資産合計	560,950,607,737
資産合計	560,950,607,737
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	144,790,387
未払解約金	129,255,203
未払利息	1,275
その他未払費用	2,428,100
流動負債合計	276,474,965
負債合計	276,474,965
純資産の部	
元本等	
元本	211,947,959,517
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	348,726,173,255
元本等合計	560,674,132,772
純資産合計	560,674,132,772
負債純資産合計	560,950,607,737

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	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金</p> <p>原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</p> <p>投資信託受益証券については、原則として収益分配金落ち日において、当該収益分配金額を計上しております。</p> <p>有価証券売買等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>派生商品取引等損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p> <p>為替差損益</p> <p>約定日基準で計上しております。</p>
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p> <p>また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引の市場リスクの大きさを示すものではありません。</p>

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月19日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.6453円
(10,000口当たり純資産額)	(26,453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 2019年 2月19日 至 2019年 8月19日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、株価変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、株価指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p>

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 8月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
株式	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
投資証券	(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 8月19日現在	
期首	2019年 2月19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	208,348,489,022円
同期中における追加設定元本額	18,666,898,369円
同期中における一部解約元本額	15,067,427,874円
期末元本額	211,947,959,517円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	48,552,038円
バランスセレクト50	149,031,929円
バランスセレクト70	156,489,622円
野村外国株式インデックスファンド	542,658,982円
野村世界6資産分散投信(安定コース)	4,325,550,037円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	6,280,978,783円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	4,496,837,914円
野村資産設計ファンド2015	17,241,180円
野村資産設計ファンド2020	18,952,710円
野村資産設計ファンド2025	30,315,326円

野村資産設計ファンド2030	35,819,769円
野村資産設計ファンド2035	27,841,843円
野村資産設計ファンド2040	61,479,104円
野村外国株インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	35,438,302,503円
のむらップ・ファンド(保守型)	1,048,656,721円
のむらップ・ファンド(普通型)	7,546,593,682円
のむらップ・ファンド(積極型)	4,991,196,597円
野村資産設計ファンド2045	9,436,676円
野村インデックスファンド・外国株式	4,292,543,085円
マイ・ロード	1,384,825,688円
ネクストコア	16,152,133円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	113,192,826円
野村外国株インデックスBコース(野村SMA・EW向け)	1,149,535,276円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,074,994,996円
野村資産設計ファンド2050	15,470,637円
野村ターゲットデートファンド2016 2026-2028年目標型	4,881,455円
野村ターゲットデートファンド2016 2029-2031年目標型	2,019,835円
野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,484,462円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	936,103円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	199,439,751円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	328,177,160円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,377,572円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,464,418円
インデックス・ブレンド(タイプ)	13,698,697円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,319,815円
インデックス・ブレンド(タイプ)	22,668,995円
野村6資産均等バランス	377,328,214円
野村つみたて外国株投信	2,881,315,323円
野村外国株(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	3,759,816,974円
世界6資産分散ファンド	83,739,264円
NEXT FUNDS 外国株式・MSCI-KOKUSAI指数(為替ヘッジなし)連動型上場投信	390,014,178円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国株式	711,355,797円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	268,880,844円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	201,222,441円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	1,237,962,331円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,283,018,284円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	2,553,843円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	7,236,286円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	3,142,933円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	3,994,999円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	55,031,344円
野村外国株式インデックスファンド(適格機関投資家専用)	15,421,137円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	21,103,710円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	40,278,739円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	165,928,451円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	3,108,878,197円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	376,689,989円

野村MSCI - KOKUSA Iインデックスファンド(適格機関投資家専用)	36,618,167円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国株式(適格機関投資家専用)	670,168,267円
野村FOFs用・外国株式MSCI - KOKUSA Iインデックスファンド(適格機関投資家専用)	17,271,160,890円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	2,080,717円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	12,979,566円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	13,920,152円
野村外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSA I(確定拠出年金向け)	65,421,691,622円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	1,442,192,317円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	5,842,521,922円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	6,377,815,574円
マイバランスDC30	933,026,309円
マイバランスDC50	1,801,436,398円
マイバランスDC70	1,418,096,872円
野村DC外国株式インデックスファンド・MSCI - KOKUSA I	20,068,234,906円
野村DC運用戦略ファンド	142,945,567円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	6,621,445円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	220,314,431円
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	146,139,739円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	113,851,448円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	6,527,913円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	4,288,070円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	15,465,450円
野村資産設計ファンド(DC)2030	1,256,818円
野村資産設計ファンド(DC)2040	745,519円
野村資産設計ファンド(DC)2050	1,239,044円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	61,521,001円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	35,303,963円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	12,355,896円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	17,407,936円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年8月19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	75,000	21.06	1,579,500.00	
		HALLIBURTON CO	119,600	18.87	2,256,852.00	
		HELMERICH & PAYNE	14,600	39.41	575,386.00	
		NATIONAL OILWELL VARCO INC	50,600	18.64	943,184.00	

SCHLUMBERGER LTD	193,100	32.72	6,318,232.00
TECHNIPFMC PLC	61,000	23.76	1,449,360.00
APACHE CORPORATION	54,100	20.84	1,127,444.00
CABOT OIL & GAS CORP	58,500	16.47	963,495.00
CHENIERE ENERGY INC	32,500	59.98	1,949,350.00
CHEVRON CORP	268,500	115.81	31,094,985.00
CIMAREX ENERGY CO	13,800	41.05	566,490.00
CONCHO RESOURCES INC	27,600	71.63	1,976,988.00
CONOCOPHILLIPS	161,000	51.47	8,286,670.00
CONTINENTAL RESOURCES INC/OK	13,900	29.77	413,803.00
DEVON ENERGY CORP	62,400	22.54	1,406,496.00
DIAMONDBACK ENERGY INC	21,600	97.26	2,100,816.00
EOG RESOURCES INC	80,800	75.92	6,134,336.00
EXXON MOBIL CORP	598,600	68.30	40,884,380.00
HESS CORP	39,400	59.82	2,356,908.00
HOLLYFRONTIER CORP	23,600	44.35	1,046,660.00
KINDER MORGAN INC	284,000	20.13	5,716,920.00
MARATHON OIL CORP	111,000	12.45	1,381,950.00
MARATHON PETROLEUM CORP	94,600	46.22	4,372,412.00
NOBLE ENERGY INC	64,400	21.51	1,385,244.00
OCCIDENTAL PETE CORP	127,279	44.57	5,672,825.03
ONEOK INC	58,800	69.30	4,074,840.00
PARSLEY ENERGY INC-CLASS A	37,000	15.95	590,150.00
PHILLIPS 66	64,900	98.83	6,414,067.00
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	23,200	124.61	2,890,952.00
PLAINS GP HOLDINGS LP-CL A	19,000	22.30	423,700.00
TARGA RESOURCES CORP	29,900	34.08	1,018,992.00
VALERO ENERGY CORP	58,000	78.12	4,530,960.00
WILLIAMS COS	169,400	23.28	3,943,632.00
AIR PRODUCTS	30,600	228.76	7,000,056.00
ALBEMARLE CORP	14,800	63.09	933,732.00
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	29,200	27.73	809,716.00
CELANESE CORP-SERIES A	18,000	110.30	1,985,400.00
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	31,400	48.18	1,512,852.00
CHEMOURS CO/THE	23,400	12.66	296,244.00

CORTEVA INC	103,366	30.24	3,125,787.84
DOW INC	109,100	44.51	4,856,041.00
DUPONT DE NEMOURS INC	106,800	66.12	7,061,616.00
EASTMAN CHEMICAL CO.	18,600	65.49	1,218,114.00
ECOLAB INC	36,900	206.81	7,631,289.00
FMC CORP	18,000	85.59	1,540,620.00
INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCE	14,200	112.78	1,601,476.00
LINDE PLC	78,000	188.79	14,725,620.00
LYONDELLBASELL INDU-CL A	37,200	74.25	2,762,100.00
MOSAIC CO/THE	48,800	19.74	963,312.00
PPG INDUSTRIES	32,600	110.72	3,609,472.00
SHERWIN-WILLIAMS	11,880	530.09	6,297,469.20
WESTLAKE CHEMICAL CORP	5,000	61.25	306,250.00
MARTIN MARIETTA MATERIALS	9,000	254.84	2,293,560.00
VULCAN MATERIALS CO	18,600	141.73	2,636,178.00
AMCOR PLC	234,000	9.92	2,321,280.00
AVERY DENNISON CORP	12,200	113.98	1,390,556.00
BALL CORP	45,500	79.63	3,623,165.00
CROWN HOLDINGS INC	19,100	66.35	1,267,285.00
IP(INTERNATIONAL PAPER CO)	52,300	38.99	2,039,177.00
PACKAGING CORP OP AMERICA	13,200	101.28	1,336,896.00
SEALED AIR CORP	21,900	42.38	928,122.00
WESTROCK CO	34,200	33.35	1,140,570.00
FREEMONT-MCMORAN INC	206,000	9.10	1,874,600.00
NEWMONT GOLDCORP CORP	116,800	38.58	4,506,144.00
NUCOR CORP	42,700	48.76	2,082,052.00
STEEL DYNAMICS	33,400	27.30	911,820.00
ARCONIC INC	64,000	24.84	1,589,760.00
BOEING CO	75,890	330.45	25,077,850.50
GENERAL DYNAMICS	34,900	184.35	6,433,815.00
HEICO CORP	6,300	141.80	893,340.00
HEICO CORP-CLASS A	10,900	108.82	1,186,138.00
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	5,660	206.82	1,170,601.20
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	31,400	210.87	6,621,318.00
LOCKHEED MARTIN	36,030	377.00	13,583,310.00

NORTHROP GRUMMAN CORP	22,900	367.91	8,425,139.00	
RAYTHEON COMPANY	40,100	178.19	7,145,419.00	
SPIRIT AEROSYSTEMS HOLD-CL A	14,600	73.15	1,067,990.00	
TEXTRON INC	33,500	44.36	1,486,060.00	
TRANSDIGM GROUP INC	6,700	530.10	3,551,670.00	
UNITED TECHNOLOGIES	115,900	125.05	14,493,295.00	
ALLEGION PLC	13,600	95.43	1,297,848.00	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC	19,400	50.52	980,088.00	
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	110,100	42.33	4,660,533.00	
LENNOX INTERNATIONAL INC	5,100	256.12	1,306,212.00	
MASCO CORP	42,800	38.46	1,646,088.00	
OWENS CORNING INC	14,200	55.38	786,396.00	
SMITH (A.O.) CORP	18,600	46.27	860,622.00	
FLUOR CORP	18,400	17.38	319,792.00	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	20,000	83.48	1,669,600.00	
ACUITY BRANDS INC	5,000	123.99	619,950.00	
AMETEK INC	31,800	85.65	2,723,670.00	
EATON CORP PLC	60,400	77.32	4,670,128.00	
EMERSON ELEC	87,600	57.92	5,073,792.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	16,800	150.31	2,525,208.00	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	21,400	44.34	948,876.00	
3M CORP	81,600	161.50	13,178,400.00	
GENERAL ELEC CO	1,234,000	8.79	10,846,860.00	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	103,200	165.03	17,031,096.00	
JARDINE MATHESON HLDGS LTD	30,700	53.54	1,643,678.00	
JARDINE STRATEGIC HLDGS LTD	30,000	32.40	972,000.00	
ROPER TECHNOLOGIES INC	14,480	357.41	5,175,296.80	
CATERPILLAR INC DEL	81,600	116.43	9,500,688.00	
CUMMINS INC	20,500	149.25	3,059,625.00	
DEERE & COMPANY	42,400	149.23	6,327,352.00	
DOVER CORP	19,700	90.72	1,787,184.00	
FLOWSERVE CORP	17,200	42.37	728,764.00	
FORTIVE CORP	43,200	68.93	2,977,776.00	
IDEX CORP	10,300	164.00	1,689,200.00	

ILLINOIS TOOL WORKS INC	46,600	150.22	7,000,252.00
INGERSOLL-RAND PLC	33,400	117.88	3,937,192.00
MIDDLEBY CORP	7,500	110.95	832,125.00
PACCAR	47,800	64.48	3,082,144.00
PARKER HANNIFIN CORP	18,100	161.82	2,928,942.00
PENTAIR PLC	23,200	36.18	839,376.00
SNAP-ON INC	7,400	147.42	1,090,908.00
STANLEY BLACK & DECKER INC	21,300	133.82	2,850,366.00
WABCO HOLDINGS INC	7,000	132.24	925,680.00
WABTEC CORP	26,100	66.62	1,738,782.00
XYLEM INC	26,000	76.57	1,990,820.00
AERCAP HOLDINGS NV	19,700	52.11	1,026,567.00
FASTENAL CO	82,600	29.98	2,476,348.00
GRAINGER(W.W.) INC	6,430	269.26	1,731,341.80
HD SUPPLY HOLDINGS INC	22,900	38.00	870,200.00
UNITED RENTALS INC	11,200	107.99	1,209,488.00
CINTAS CORP	12,700	264.40	3,357,880.00
COPART INC	27,900	75.50	2,106,450.00
REPUBLIC SERVICES INC-CL A	30,800	89.92	2,769,536.00
ROLLINS INC	21,000	33.05	694,050.00
WASTE CONNECTIONS INC	37,000	92.51	3,422,870.00
WASTE MANAGEMENT INC	60,200	119.12	7,171,024.00
C.H.ROBINSON WORLDWIDE INC	18,300	83.82	1,533,906.00
EXPEDITORS INTERNATIONAL WASH INC	23,000	71.43	1,642,890.00
FEDEX CORPORATION	35,300	156.00	5,506,800.00
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	98,700	115.30	11,380,110.00
XPO LOGISTICS INC	14,900	66.83	995,767.00
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	14,600	25.79	376,534.00
DELTA AIR LINES INC	22,400	58.04	1,300,096.00
SOUTHWEST AIRLINES	19,800	49.79	985,842.00
UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	9,200	82.94	763,048.00
AMERCO	1,170	349.35	408,739.50
CSX CORP	110,100	65.09	7,166,409.00
HUNT J B TRANSPORT SVCS INC	11,800	98.02	1,156,636.00
KANSAS CITY SOUTHERN	14,200	120.07	1,704,994.00

KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION HOLDINGS INC	16,700	33.14	553,438.00
NORFOLK SOUTHERN CORP	38,000	173.00	6,574,000.00
OLD DOMINION FREIGHT LINE	8,600	165.69	1,424,934.00
UBER TECHNOLOGIES INC	26,500	35.23	933,595.00
UNION PAC CORP	102,300	166.25	17,007,375.00
APTIV PLC	36,700	81.85	3,003,895.00
AUTOLIV INC	11,900	65.83	783,377.00
BORGWARNER INC	29,600	32.00	947,200.00
LEAR CORP	8,400	108.97	915,348.00
FORD MOTOR COMPANY	557,000	8.96	4,990,720.00
GENERAL MOTORS CO	176,900	37.00	6,545,300.00
HARLEY-DAVIDSON INC	22,400	32.26	722,624.00
TESLA INC	18,500	219.94	4,068,890.00
DR HORTON INC	51,200	47.75	2,444,800.00
GARMIN LTD	18,600	77.17	1,435,362.00
LEGGETT & PLATT INC	18,900	38.51	727,839.00
LENNAR CORP-A	40,700	49.25	2,004,475.00
MOHAWK INDUSTRIES	8,700	111.34	968,658.00
NEWELL BRANDS INC	67,000	15.84	1,061,280.00
NVR INC	480	3,499.90	1,679,952.00
PULTEGROUP INC	37,900	32.07	1,215,453.00
WHIRLPOOL CORP	8,300	131.77	1,093,691.00
HASBRO INC	17,300	114.37	1,978,601.00
POLARIS INC	8,300	79.91	663,253.00
CAPRI HOLDINGS LTD	19,900	28.24	561,976.00
HANESBRANDS INC	51,000	13.62	694,620.00
LULULEMON ATHLETICA INC	15,700	177.83	2,791,931.00
NIKE INC-B	178,300	80.28	14,313,924.00
PVH CORP	9,900	70.72	700,128.00
RALPH LAUREN CORPORATION	7,800	86.94	678,132.00
TAPESTRY INC	38,300	19.96	764,468.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS A	24,000	18.65	447,600.00
UNDER ARMOUR INC-CLASS C	25,000	16.79	419,750.00
V F CORP	48,100	78.78	3,789,318.00

ARAMARK	35,400	37.10	1,313,340.00
CARNIVAL CORP	58,600	44.93	2,632,898.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	3,710	817.20	3,031,812.00
DARDEN RESTAURANTS INC	17,900	117.10	2,096,090.00
DOMINOS PIZZA INC	5,270	234.95	1,238,186.50
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	39,800	93.01	3,701,798.00
LAS VEGAS SANDS CORP	47,700	52.40	2,499,480.00
MARRIOTT INTERNATIONAL-CLA	41,300	128.82	5,320,266.00
MCDONALD'S CORP	108,200	218.47	23,638,454.00
MELCO RESORTS & ENTERT-ADR	34,000	20.04	681,360.00
MGM RESORTS INTERNATIONAL	70,000	28.31	1,981,700.00
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	30,200	50.48	1,524,496.00
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	24,700	105.18	2,597,946.00
STARBUCKS CORP	176,000	96.52	16,987,520.00
VAIL RESORTS INC	5,410	236.27	1,278,220.70
WYNN RESORTS LTD	13,800	105.55	1,456,590.00
YUM BRANDS INC	43,700	115.62	5,052,594.00
GENUINE PARTS CO	19,600	89.79	1,759,884.00
LKQ CORP	45,000	25.57	1,150,650.00
AMAZON.COM INC	58,940	1,792.57	105,654,075.80
BOOKING HOLDINGS INC	6,380	1,922.19	12,263,572.20
EBAY INC	124,000	40.02	4,962,480.00
EXPEDIA GROUP INC	19,600	128.60	2,520,560.00
GRUBHUB INC	11,900	59.94	713,286.00
MERCADOLIBRE INC	6,030	624.53	3,765,915.90
QURATE RETAIL INC - A	58,000	11.57	671,060.00
WAYFAIR INC - CLASS A	8,600	110.42	949,612.00
DOLLAR GENERAL CORP	37,500	135.91	5,096,625.00
DOLLAR TREE INC	34,100	93.71	3,195,511.00
KOHL'S CORP	22,500	45.51	1,023,975.00
MACYS INC	43,700	15.98	698,326.00
NORDSTROM INC	15,000	25.32	379,800.00
TARGET CORP	74,300	84.21	6,256,803.00
ADVANCE AUTO PARTS	9,900	136.59	1,352,241.00
AUTOZONE	3,570	1,091.74	3,897,511.80
BEST BUY COMPANY INC	33,800	65.48	2,213,224.00

BURLINGTON STORES INC	9,800	172.13	1,686,874.00	
CARMAX INC	23,900	85.03	2,032,217.00	
GAP INC	31,500	15.97	503,055.00	
HOME DEPOT	159,600	203.65	32,502,540.00	
L BRANDS, INC	30,300	20.36	616,908.00	
LOWES COS INC	113,600	93.92	10,669,312.00	
OREILLY AUTOMOTIVE INC,	11,200	381.64	4,274,368.00	
ROSS STORES INC	52,800	103.18	5,447,904.00	
TIFFANY & CO	16,100	80.80	1,300,880.00	
TJX COS INC	175,000	51.39	8,993,250.00	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	16,300	100.55	1,638,965.00	
ULTA BEAUTY INC	7,890	322.03	2,540,816.70	
COSTCO WHOLESALE CORPORATION	62,350	274.10	17,090,135.00	
DAIRY FARM INTL HLDGS LTD	45,000	7.12	320,400.00	
KROGER CO	115,000	22.66	2,605,900.00	
SYSCO CORP	67,800	72.96	4,946,688.00	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	114,100	50.48	5,759,768.00	
WALMART INC	205,500	112.99	23,219,445.00	
BROWN-FORMAN CORP-CL B	43,100	57.54	2,479,974.00	
COCA COLA CO	574,100	54.41	31,236,781.00	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	33,300	55.10	1,834,830.00	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	23,800	198.79	4,731,202.00	
MOLSON COORS BREWING CO-B	25,600	51.88	1,328,128.00	
MONSTER BEVERAGE CORP	58,400	57.18	3,339,312.00	
PEPSICO INC	198,600	131.76	26,167,536.00	
ARCHER DANIELS MIDLAND	80,400	37.84	3,042,336.00	
BUNGE LIMITED	19,100	54.87	1,048,017.00	
CAMPBELL SOUP CO	24,800	42.64	1,057,472.00	
CONAGRA BRANDS INC	66,700	29.47	1,965,649.00	
GENERAL MILLS	83,600	55.02	4,599,672.00	
HERSHEY CO/THE	20,600	155.44	3,202,064.00	
HORMEL FOODS CORP	42,800	41.45	1,774,060.00	
INGREDION INC	9,600	75.90	728,640.00	
JM SMUCKER CO/THE-NEW	15,900	114.35	1,818,165.00	
KELLOGG CO	35,600	63.78	2,270,568.00	

KRAFT HEINZ CO/THE	93,400	25.41	2,373,294.00	
LAMB WESTON HOLDINGS INC	19,300	68.81	1,328,033.00	
MCCORMICK & CO INC.	16,800	169.94	2,854,992.00	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	204,800	54.54	11,169,792.00	
TYSON FOODS INC-CL A	41,000	87.70	3,595,700.00	
ALTRIA GROUP INC	265,600	46.48	12,345,088.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	220,000	84.91	18,680,200.00	
CHURCH & DWIGHT CO INC	35,400	79.70	2,821,380.00	
CLOROX CO	17,700	160.90	2,847,930.00	
COLGATE PALMOLIVE CO.	116,300	72.28	8,406,164.00	
KIMBERLY-CLARK CORP	48,000	140.72	6,754,560.00	
PROCTER & GAMBLE CO	353,400	119.18	42,118,212.00	
COTY INC-CL A	37,000	9.11	337,070.00	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	31,100	179.22	5,573,742.00	
ABBOTT LABORATORIES	248,500	84.78	21,067,830.00	
ABIOMED INC	6,420	193.01	1,239,124.20	
ALIGN TECHNOLOGY INC	10,680	177.29	1,893,457.20	
BAXTER INTERNATIONAL INC.	69,300	86.97	6,027,021.00	
BECTON,DICKINSON	38,200	248.33	9,486,206.00	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	196,800	42.15	8,295,120.00	
DANAHER CORP	89,500	140.35	12,561,325.00	
DENTSPLY SIRONA INC	30,300	52.33	1,585,599.00	
DEXCOM INC	12,900	163.68	2,111,472.00	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	29,600	219.34	6,492,464.00	
HOLOGIC INC	36,600	50.45	1,846,470.00	
IDEXX LABORATORIES INC	12,100	275.41	3,332,461.00	
INTUITIVE SURGICAL INC	16,260	495.45	8,056,017.00	
MEDTRONIC PLC	189,700	102.76	19,493,572.00	
RESMED INC	20,600	134.44	2,769,464.00	
STERIS PLC	11,900	152.74	1,817,606.00	
STRYKER CORP	47,600	217.00	10,329,200.00	
TELEFLEX INC	6,320	369.81	2,337,199.20	
THE COOPER COMPANIES, INC.	7,120	335.38	2,387,905.60	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	12,900	108.95	1,405,455.00	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	28,700	137.01	3,932,187.00	

AMERISOURCEBERGEN CORP	22,000	87.34	1,921,480.00	
ANTHEM INC	36,450	275.54	10,043,433.00	
CARDINAL HEALTH INC	41,000	43.19	1,770,790.00	
CENTENE CORP	59,400	48.01	2,851,794.00	
CIGNA CORP	54,000	161.24	8,706,960.00	
CVS HEALTH CORP	184,000	60.28	11,091,520.00	
DAVITA INC	17,500	57.82	1,011,850.00	
HCA HEALTHCARE INC	39,100	123.93	4,845,663.00	
HENRY SCHEIN INC	20,500	61.75	1,265,875.00	
HUMANA INC	19,310	297.00	5,735,070.00	
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	14,200	166.15	2,359,330.00	
MCKESSON CORP	27,000	145.29	3,922,830.00	
QUEST DIAGNOSTICS INC	19,100	100.60	1,921,460.00	
UNITEDHEALTH GROUP INC	135,600	245.69	33,315,564.00	
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	11,800	147.35	1,738,730.00	
WELLCARE HEALTH PLANS INC	7,050	274.36	1,934,238.00	
ABBVIE INC	208,900	64.43	13,459,427.00	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	30,700	110.85	3,403,095.00	
ALKERMES PLC	20,100	21.65	435,165.00	
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	12,700	80.69	1,024,763.00	
AMGEN INC	88,100	204.02	17,974,162.00	
BEIGENE, LTD ADR	4,600	143.76	661,296.00	
BIOGEN INC	28,000	231.68	6,487,040.00	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	24,100	76.50	1,843,650.00	
CELGENE CORP	99,600	94.74	9,436,104.00	
EXACT SCIENCES CORP	17,700	119.82	2,120,814.00	
GILEAD SCIENCES INC	180,800	63.14	11,415,712.00	
INCYTE CORP	24,900	83.12	2,069,688.00	
IONIS PHARMACEUTICALS INC	18,800	69.08	1,298,704.00	
REGENERON PHARMACEUTICALS	11,530	296.85	3,422,680.50	
SEATTLE GENETICS INC	15,400	79.20	1,219,680.00	
VERTEX PHARMACEUTICALS	36,400	184.94	6,731,816.00	
ALLERGAN PLC	47,300	158.25	7,485,225.00	
BRISTOL MYERS SQUIBB	231,500	46.98	10,875,870.00	
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	41,100	29.36	1,206,696.00	

ELI LILLY & CO.	126,600	110.52	13,991,832.00
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	7,800	134.83	1,051,674.00
JOHNSON & JOHNSON	376,200	131.36	49,417,632.00
MERCK & CO INC	364,800	85.06	31,029,888.00
MYLAN NV	69,300	18.53	1,284,129.00
NEKTAR THERAPEUTICS	25,000	18.10	452,500.00
PERRIGO CO PLC	16,500	46.18	761,970.00
PFIZER INC	784,800	34.65	27,193,320.00
TEVA PHARMACEUTICAL-SP ADR	154,000	6.41	987,140.00
ZOETIS INC	68,000	125.37	8,525,160.00
BANK OF AMERICA CORP	1,296,600	27.03	35,047,098.00
BB&T CORPORATION	108,800	46.55	5,064,640.00
CIT GROUP INC	13,400	42.41	568,294.00
CITIGROUP	332,600	63.48	21,113,448.00
CITIZENS FINANCIAL GROUP	63,900	32.40	2,070,360.00
COMERICA INC	23,000	61.33	1,410,590.00
EAST WEST BANCORP INC	20,700	39.91	826,137.00
FIFTH THIRD BANCORP	113,800	25.67	2,921,246.00
FIRST REPUBLIC BANK/CA	24,100	92.06	2,218,646.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	141,000	12.93	1,823,130.00
JPMORGAN CHASE & CO	462,500	107.72	49,820,500.00
KEYCORP	138,000	16.43	2,267,340.00
M & T BANK CORP	18,900	147.52	2,788,128.00
PEOPLES UNITED FINANCIAL INC	50,000	14.50	725,000.00
PNC FINANCIAL	64,900	127.00	8,242,300.00
REGIONS FINANCIAL CORP	139,000	14.09	1,958,510.00
SIGNATURE BANK	7,600	119.41	907,516.00
SUNTRUST BKS INC.	63,400	60.68	3,847,112.00
SVB FINANCIAL GROUP	7,400	191.71	1,418,654.00
US BANCORP	215,500	52.28	11,266,340.00
WELLS FARGO CO	611,000	44.39	27,122,290.00
ZIONS BANCORP NA	27,500	40.20	1,105,500.00
AXA EQUITABLE HOLDINGS INC	40,000	20.24	809,600.00
BERKSHIRE HATHAWAY INC CL B	184,300	199.72	36,808,396.00
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC	35,000	18.56	649,600.00

VOYA FINANCIAL INC	21,700	49.22	1,068,074.00
AFLAC INC	106,900	52.65	5,628,285.00
ALLEGHANY CORP	2,100	750.67	1,576,407.00
ALLSTATE CORP	46,600	103.22	4,810,052.00
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	10,800	99.70	1,076,760.00
AMERICAN INTL GROUP	123,700	54.31	6,718,147.00
AON PLC	34,100	191.51	6,530,491.00
ARCH CAPITAL GROUP LTD	56,000	39.75	2,226,000.00
ARTHUR J GALLAGHER & CO	26,600	89.72	2,386,552.00
ASSURANT INC	9,000	124.53	1,120,770.00
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	21,400	38.93	833,102.00
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	13,900	35.24	489,836.00
CHUBB LTD	65,000	155.40	10,101,000.00
CINCINNATI FINANCIAL CORP	21,600	109.70	2,369,520.00
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	3,700	221.55	819,735.00
EVEREST RE GROUP LTD	5,600	249.29	1,396,024.00
FNF GROUP	37,200	44.23	1,645,356.00
GLOBE LIFE INC	14,000	87.17	1,220,380.00
HARTFORD FINANCIAL SERVICES	51,600	58.47	3,017,052.00
LINCOLN NATIONAL CORP	29,900	53.49	1,599,351.00
LOEWS CORP	39,700	48.85	1,939,345.00
MARKEL CORP	2,000	1,152.02	2,304,040.00
MARSH & MCLENNAN COS	71,800	97.78	7,020,604.00
METLIFE INC	116,000	45.35	5,260,600.00
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	38,000	53.29	2,025,020.00
PROGRESSIVE CO	81,400	77.49	6,307,686.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	57,100	82.03	4,683,913.00
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	9,000	148.69	1,338,210.00
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	5,900	189.73	1,119,407.00
TRAVELERS COS INC/THE	36,800	146.81	5,402,608.00
UNUM GROUP	31,200	26.69	832,728.00
WILLIS TOWERS WATSON PLC	17,800	194.55	3,462,990.00
WR BERKLEY CORP	19,500	72.23	1,408,485.00
ACCENTURE PLC-CL A	90,200	193.22	17,428,444.00
AKAMAI TECHNOLOGIES	22,500	86.65	1,949,625.00

ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	6,600	138.69	915,354.00
AUTOMATIC DATA PROCESS	61,800	167.02	10,321,836.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC	16,300	128.22	2,089,986.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS CORP	80,400	61.22	4,922,088.00
DXC TECHNOLOGY CO	37,800	31.79	1,201,662.00
EPAM SYSTEMS INC	7,700	188.02	1,447,754.00
FIDELITY NATIONAL INFORMATION	86,900	138.31	12,019,139.00
FISERV INC	81,500	107.26	8,741,690.00
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	12,100	291.27	3,524,367.00
GARTNER INC	12,700	129.29	1,641,983.00
GLOBAL PAYMENTS INC	22,600	157.75	3,565,150.00
GODADDY INC - CLASS A	24,700	63.55	1,569,685.00
INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES	125,900	133.76	16,840,384.00
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	10,600	141.92	1,504,352.00
LEIDOS HOLDINGS INC	20,000	83.82	1,676,400.00
MASTERCARD INC	129,000	274.36	35,392,440.00
MONGODB INC	4,700	143.79	675,813.00
OKTA INC	14,300	128.18	1,832,974.00
PAYCHEX INC	45,300	81.47	3,690,591.00
PAYPAL HOLDINGS INC	157,800	106.16	16,752,048.00
SABRE CORP	36,000	23.72	853,920.00
SQUARE INC - A	45,600	62.87	2,866,872.00
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	23,700	127.35	3,018,195.00
TWILIO INC - A	15,600	124.76	1,946,256.00
VERISIGN INC	15,500	205.00	3,177,500.00
VISA INC-CLASS A SHARES	247,300	178.23	44,076,279.00
WESTERN UNION CO	59,000	21.09	1,244,310.00
WIX.COM LTD	6,700	143.80	963,460.00
ADOBE INC	69,000	287.45	19,834,050.00
ANSYS INC	11,500	209.57	2,410,055.00
AUTODESK INC.	31,300	144.13	4,511,269.00
CADENCE DESIGN SYS INC	40,300	69.32	2,793,596.00
CDK GLOBAL INC	16,700	44.96	750,832.00
CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD.	17,200	108.12	1,859,664.00

CITRIX SYSTEMS INC	18,500	92.44	1,710,140.00
CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL	5,500	115.16	633,380.00
DOCUSIGN INC	14,900	44.81	667,669.00
DROPBOX INC-CLASS A	28,000	17.48	489,440.00
FORTINET INC	19,900	80.66	1,605,134.00
INTUIT INC	36,750	270.96	9,957,780.00
MICROSOFT CORP	1,028,800	136.13	140,050,544.00
ORACLE CORPORATION	355,400	53.59	19,045,886.00
PALO ALTO NETWORKS INC	13,500	199.27	2,690,145.00
PAYCOM SOFTWARE INC	7,000	241.42	1,689,940.00
PTC INC	14,700	65.38	961,086.00
SALESFORCE.COM INC	117,350	143.89	16,885,491.50
SERVICENOW INC	25,700	256.91	6,602,587.00
SPLUNK INC	21,300	124.79	2,658,027.00
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	30,600	45.45	1,390,770.00
SYMANTEC CORP	91,000	23.51	2,139,410.00
SYNOPSYS INC	20,700	128.98	2,669,886.00
VMWARE INC - CLASS A	11,700	143.72	1,681,524.00
WORKDAY INC-CLASS A	21,100	192.39	4,059,429.00
ARISTA NETWORKS INC	7,400	221.18	1,636,732.00
CISCO SYSTEMS	622,200	46.96	29,218,512.00
COMMSCOPE HOLDING CO INC	22,800	10.83	246,924.00
F5 NETWORKS INC	8,100	128.74	1,042,794.00
JUNIPER NETWORKS INC	46,700	23.92	1,117,064.00
MOTOROLA SOLUTIONS INC	23,400	173.32	4,055,688.00
APPLE INC	665,600	206.50	137,446,400.00
DELL TECHNOLOGIES-C	20,790	48.43	1,006,859.70
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	188,000	12.80	2,406,400.00
HP INC	219,000	19.08	4,178,520.00
NETAPP INC	35,200	46.76	1,645,952.00
SEAGATE TECHNOLOGY	34,700	46.03	1,597,241.00
WESTERN DIGITAL CORP	42,000	55.19	2,317,980.00
XEROX HOLDINGS CORP	28,900	28.57	825,673.00
AMPHENOL CORP-CL A	41,300	86.61	3,576,993.00
ARROW ELECTRS INC	12,100	68.02	823,042.00

CDW CORPORATION	21,100	111.69	2,356,659.00
COGNEX CORP	24,800	44.19	1,095,912.00
CORNING INC	108,000	27.63	2,984,040.00
FLEX LTD	76,000	9.99	759,240.00
FLIR SYSTEMS INC	17,800	46.98	836,244.00
IPG PHOTONICS CORP	4,730	119.42	564,856.60
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	27,100	85.69	2,322,199.00
TE CONNECTIVITY LTD	48,400	89.99	4,355,516.00
TRIMBLE INC	34,900	37.33	1,302,817.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	7,700	203.50	1,566,950.00
ADVANCED MICRO DEVICES	133,900	31.18	4,175,002.00
ANALOG DEVICES INC	51,500	110.52	5,691,780.00
APPLIED MATERIALS	132,300	46.63	6,169,149.00
BROADCOM INC	56,080	273.78	15,353,582.40
INTEL CORP	635,600	46.50	29,555,400.00
KLA CORP	23,500	136.12	3,198,820.00
LAM RESEARCH	21,200	205.11	4,348,332.00
MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD	86,000	24.94	2,144,840.00
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	37,400	54.11	2,023,714.00
MICROCHIP TECHNOLOGY	33,400	88.38	2,951,892.00
MICRON TECHNOLOGY	159,400	43.55	6,941,870.00
NVIDIA CORP	81,600	159.56	13,020,096.00
NXP SEMICONDUCTORS NV	41,000	103.56	4,245,960.00
ON SEMICONDUCTOR CORPORATION	59,000	17.54	1,034,860.00
QORVO INC	17,600	71.61	1,260,336.00
QUALCOMM INC	171,500	73.28	12,567,520.00
SKYWORKS SOLUTIONS INC	23,800	76.66	1,824,508.00
TEXAS INSTRUMENTS INC	132,900	122.82	16,322,778.00
XILINX INC	34,900	105.46	3,680,554.00
AT & T INC	1,029,400	34.97	35,998,118.00
CENTURYLINK INC	136,000	11.21	1,524,560.00
VERIZON COMMUNICATIONS	584,000	56.65	33,083,600.00
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	33,700	33.79	1,138,723.00
SPRINT CORP	109,000	6.91	753,190.00
T-MOBILE US INC	47,200	77.75	3,669,800.00

ALLIANT ENERGY CORP	34,300	51.63	1,770,909.00	
AMERICAN ELECTRIC POWER	68,800	90.23	6,207,824.00	
DUKE ENERGY CORP	103,200	89.77	9,264,264.00	
EDISON INTERNATIONAL	49,000	72.50	3,552,500.00	
ENTERGY CORP	27,200	109.19	2,969,968.00	
EVERGY INC	34,800	64.45	2,242,860.00	
EVERSOURCE ENERGY	44,500	78.64	3,499,480.00	
EXELON CORPORATION	135,200	45.13	6,101,576.00	
FIRSTENERGY CORP	76,000	44.68	3,395,680.00	
NEXTERA ENERGY INC	67,700	217.53	14,726,781.00	
OGE ENERGY CORP	28,600	43.10	1,232,660.00	
PINNACLE WEST CAPITAL CORP	15,400	94.12	1,449,448.00	
PPL CORPORATION	103,500	29.41	3,043,935.00	
SOUTHERN CO.	146,900	57.48	8,443,812.00	
XCEL ENERGY INC	73,400	61.80	4,536,120.00	
ATMOS ENERGY CORP	17,000	110.44	1,877,480.00	
UGI CORP	22,700	48.21	1,094,367.00	
AMEREN CORPORATION	35,200	76.64	2,697,728.00	
CENTERPOINT ENERGY INC	70,400	27.87	1,962,048.00	
CMS ENERGY CORP	40,900	61.20	2,503,080.00	
CONSOLIDATED EDISON INC	44,500	87.20	3,880,400.00	
DOMINION ENERGY INC	113,500	76.86	8,723,610.00	
DTE ENERGY COMPANY	25,100	129.29	3,245,179.00	
NISOURCE INC	53,300	29.42	1,568,086.00	
PUBLIC SVC ENTERPRISE	72,200	58.10	4,194,820.00	
SEMPRA ENERGY	38,300	138.88	5,319,104.00	
WEC ENERGY GROUP INC	43,500	90.44	3,934,140.00	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	26,000	124.22	3,229,720.00	
ALLY FINANCIAL INC	57,400	30.76	1,765,624.00	
AMERICAN EXPRESS CO	101,600	124.63	12,662,408.00	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	66,600	85.50	5,694,300.00	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	46,300	80.35	3,720,205.00	
SYNCHRONY FINANCIAL	91,700	33.43	3,065,531.00	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	7,500	75.94	569,550.00	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	19,200	126.34	2,425,728.00	

BANK OF NEWYORK MELLON CORP	122,400	42.33	5,181,192.00	
BLACKROCK INC	16,900	419.46	7,088,874.00	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	15,000	121.37	1,820,550.00	
CME GROUP INC	50,700	213.58	10,828,506.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	35,000	41.09	1,438,150.00	
EATON VANCE CORP	16,400	39.71	651,244.00	
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	5,410	277.03	1,498,732.30	
FRANKLIN RESOURCES INC	43,400	27.37	1,187,858.00	
GOLDMAN SACHS GROUP	47,000	199.42	9,372,740.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	79,200	91.67	7,260,264.00	
INVESCO LTD	58,000	15.65	907,700.00	
KKR & CO INC-A	68,000	24.47	1,663,960.00	
MARKETAXESS HOLDINGS INC	5,330	366.21	1,951,899.30	
MOODYS CORP	24,500	214.29	5,250,105.00	
MORGAN STANLEY	182,100	39.94	7,273,074.00	
MSCI INC	12,000	226.23	2,714,760.00	
NASDAQ INC	15,400	97.53	1,501,962.00	
NORTHERN TRUST CORP	28,400	87.00	2,470,800.00	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	17,700	75.75	1,340,775.00	
S&P GLOBAL INC	35,300	256.68	9,060,804.00	
SCHWAB(CHARLES)CORP	170,600	37.14	6,336,084.00	
SEI INVESTMENTS COMPANY	19,100	56.56	1,080,296.00	
STATE STREET CORP	52,200	50.20	2,620,440.00	
T ROWE PRICE GROUP INC	33,800	107.37	3,629,106.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	37,900	43.92	1,664,568.00	
H & R BLOCK INC	27,900	27.52	767,808.00	
AES CORP	91,000	15.20	1,383,200.00	
NRG ENERGY INC	40,000	35.47	1,418,800.00	
VISTRA ENERGY CORP	51,600	23.69	1,222,404.00	
CERNER CORP	45,100	70.65	3,186,315.00	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	17,600	160.34	2,821,984.00	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	45,600	71.08	3,241,248.00	
ILLUMINA INC	20,920	286.17	5,986,676.40	
IQVIA HOLDINGS INC	23,400	155.21	3,631,914.00	
METTLER-TOLEDO INTL	3,420	665.19	2,274,949.80	

PERKINELMER INC	15,700	82.34	1,292,738.00
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	56,490	276.15	15,599,713.50
WATERS CORP	9,800	205.54	2,014,292.00
COSTAR GROUP INC	5,130	618.85	3,174,700.50
EQUIFAX INC	17,400	143.74	2,501,076.00
IHS MARKIT LTD	54,400	64.83	3,526,752.00
MANPOWERGROUP INC	8,000	84.95	679,600.00
NIELSEN HOLDINGS PLC	47,200	20.35	960,520.00
ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	17,100	55.04	941,184.00
TRUNSION	25,300	82.27	2,081,431.00
VERISK ANALYTICS INC	22,300	156.88	3,498,424.00
CBRE GROUP INC	45,500	51.65	2,350,075.00
HONGKONG LAND HOLDINGS LTD	161,000	5.67	912,870.00
JONES LANG LASALLE INC	7,600	132.83	1,009,508.00
ALTICE USA INC-A	20,000	26.55	531,000.00
CBS CORP-CL B	47,000	43.80	2,058,600.00
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	22,390	384.51	8,609,178.90
COMCAST CORP-CL A	638,500	43.18	27,570,430.00
DISCOVERY INC - A	19,300	27.95	539,435.00
DISCOVERY INC - C	50,300	26.10	1,312,830.00
DISH NETWORK CORP-A	31,900	31.96	1,019,524.00
FOX CORP-CLASS A	48,033	32.99	1,584,608.67
FOX CORP-CLASS B	25,400	33.01	838,454.00
INTERPUBRIC GROUP	50,000	20.10	1,005,000.00
LIBERTY BROADBAND CORP-C	15,600	99.94	1,559,064.00
LIBERTY GLOBAL PLC -SERIES C	69,500	25.66	1,783,370.00
LIBERTY GLOBAL PLC-A	24,000	26.04	624,960.00
LIBERTY SIRIUS GROUP-C	22,400	40.66	910,784.00
LIBERTY SIRIUSXM GROUP	12,900	40.11	517,419.00
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	55,000	13.76	756,800.00
OMNICOM GROUP	32,200	77.10	2,482,620.00
SIRIUS XM HOLDINGS INC	229,000	6.08	1,392,320.00
ACTIVISION BLIZZARD INC	108,900	46.66	5,081,274.00
DISNEY (WALT) CO	254,300	135.20	34,381,360.00
ELECTRONIC ARTS	42,900	89.56	3,842,124.00

	LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY-C	29,300	40.83	1,196,319.00	
	LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	20,800	70.35	1,463,280.00	
	NETFLIX INC	61,770	302.80	18,703,956.00	
	TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	15,700	127.20	1,997,040.00	
	VIACOM INC-CLASS B	50,200	26.02	1,306,204.00	
	ALPHABET INC-CL A	42,290	1,179.21	49,868,790.90	
	ALPHABET INC-CL C	44,400	1,177.60	52,285,440.00	
	FACEBOOK INC-A	336,900	183.70	61,888,530.00	
	IAC/INTERACTIVE CORP	11,200	249.17	2,790,704.00	
	SNAP INC-A	97,000	15.98	1,550,060.00	
	TRIPADVISOR INC	14,600	37.99	554,654.00	
	TWITTER INC	101,000	40.58	4,098,580.00	
	ZILLOW GROUP INC - C	16,000	35.94	575,040.00	
小計	銘柄数：610			3,473,384,121.64	
				(369,602,804,383)	
	組入時価比率：65.9%			69.1%	
カナダドル	CAMECO CORP	56,000	10.95	613,200.00	
	CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD	168,200	31.06	5,224,292.00	
	CENOVUS ENERGY INC	140,000	10.85	1,519,000.00	
	ENBRIDGE INC	286,900	44.61	12,798,609.00	
	ENCANA CORP	206,000	5.57	1,147,420.00	
	HUSKY ENERGY INC	52,000	8.77	456,040.00	
	IMPERIAL OIL	37,500	32.66	1,224,750.00	
	INTER PIPELINE LTD	60,000	24.53	1,471,800.00	
	KEYERA CORP	28,500	32.28	919,980.00	
	PEMBINA PIPELINE CORP	70,900	48.95	3,470,555.00	
	PRAIRIESKY ROYALTY LTD	31,000	16.37	507,470.00	
	SUNCOR ENERGY INC	224,700	37.30	8,381,310.00	
	TC ENERGY CORP	131,200	64.23	8,426,976.00	
	TOURMALINE OIL CORP	33,000	12.86	424,380.00	
	VERMILION ENERGY INC	18,500	19.90	368,150.00	
	METHANEX CORP	8,600	43.34	372,724.00	
	NUTRIEN LTD	86,000	66.11	5,685,460.00	
	CCL INDUSTRIES INC - CL B	21,200	59.08	1,252,496.00	
	AGNICO EAGLE MINES LTD	33,100	78.40	2,595,040.00	

BARRICK GOLD	247,000	24.38	6,021,860.00
FIRST QUANTUM MINERALS LTD	99,000	8.44	835,560.00
FRANCO-NEVADA CORP	26,900	123.10	3,311,390.00
KINROSS GOLD CORP	174,000	6.34	1,103,160.00
KIRKLAND LAKE GOLD LTD	28,900	58.59	1,693,251.00
LUNDIN MINING CORP	95,000	5.81	551,950.00
TECK RESOURCES LTD-CLS B	68,000	21.95	1,492,600.00
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	63,000	35.15	2,214,450.00
WEST FRASER TIMBER	8,400	48.97	411,348.00
BOMBARDIER B SHEARS	262,000	1.66	434,920.00
CAE INC	36,000	33.88	1,219,680.00
SNC-LAVALIN GROUP INC	25,200	16.72	421,344.00
WSP GLOBAL INC	15,700	70.62	1,108,734.00
CANADIAN NATL RAILWAY CO	102,700	122.73	12,604,371.00
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	20,000	315.84	6,316,800.00
MAGNA INTERNATIONAL INC	45,000	63.24	2,845,800.00
GILDAN ACTIVEWEAR INC	27,800	48.03	1,335,234.00
RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC	33,800	98.89	3,342,482.00
STARS GROUP INC/THE	33,000	18.48	609,840.00
CANADIAN TIRE CORP LTD A	8,600	133.43	1,147,498.00
DOLLARAMA INC	41,800	50.62	2,115,916.00
ALIMENTATION COUCHE-TARD-B	62,600	83.33	5,216,458.00
EMPIRE CO LTD A	26,000	36.71	954,460.00
LOBLAW COMPANIES	26,100	71.98	1,878,678.00
METRO INC	36,800	54.30	1,998,240.00
WESTON(GEORGE)LTD	10,700	107.42	1,149,394.00
SAPUTO INC	32,100	41.73	1,339,533.00
AURORA CANNABIS INC	97,000	7.91	767,270.00
BAUSCH HEALTH COS INC	42,500	28.26	1,201,050.00
CANOPY GROWTH CORP	27,500	37.25	1,024,375.00
CRONOS GROUP INC	25,000	16.12	403,000.00
BANK OF MONTREAL	90,800	93.19	8,461,652.00
BANK OF NOVA SCOTIA HALIFAX	173,900	67.72	11,776,508.00
CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE	62,000	99.04	6,140,480.00

NATIONAL BANK OF CANADA	46,000	61.05	2,808,300.00	
ROYAL BANK OF CANADA	203,200	99.74	20,267,168.00	
TORONTO DOMINION BANK	259,200	72.52	18,797,184.00	
ONEX CORPORATION	10,900	76.42	832,978.00	
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	3,880	585.00	2,269,800.00	
GREAT-WEST LIFE CO INC	36,000	27.90	1,004,400.00	
IA FINANCIAL CORP INC	14,700	55.26	812,322.00	
INTACT FINANCIAL CORP	18,900	124.52	2,353,428.00	
MANULIFE FINANCIAL CORP	275,000	22.21	6,107,750.00	
POWER CORPORATION OF CANADA	39,000	27.10	1,056,900.00	
POWER FINANCIAL CORP	39,000	27.57	1,075,230.00	
SUN LIFE FINANCIAL INC	83,900	52.81	4,430,759.00	
CGI INC	33,800	103.29	3,491,202.00	
SHOPIFY INC - CLASS A	14,030	476.54	6,685,856.20	
BLACKBERRY LTD	71,000	9.11	646,810.00	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	2,890	1,254.99	3,626,921.10	
OPEN TEXT CORP	38,400	51.05	1,960,320.00	
BCE INC	22,700	62.01	1,407,627.00	
TELUS CORP	29,300	48.02	1,406,986.00	
ROGERS COMMUNICATIONS-CL B	50,200	67.79	3,403,058.00	
EMERA INC	7,600	56.59	430,084.00	
FORTIS INC	61,800	54.43	3,363,774.00	
HYDRO ONE LTD	49,000	23.94	1,173,060.00	
ALTAGAS LTD	42,000	18.96	796,320.00	
ATCO LTD CL1	9,600	45.81	439,776.00	
CANADIAN UTILITIES LTD A	15,700	36.32	570,224.00	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	120,200	67.79	8,148,358.00	
CI FINANCIAL CORP	33,600	18.85	633,360.00	
IGM FINANCIAL INC	10,300	34.92	359,676.00	
THOMSON REUTERS CORP	28,247	89.46	2,526,976.62	
FIRST CAPITAL REALTY INC	25,000	21.97	549,250.00	
QUEBECOR INC-CL B	27,000	30.15	814,050.00	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	63,000	25.55	1,609,650.00	
小計銘柄数：86			256,168,495.92	
			(20,537,028,317)	

	組入時価比率：3.7%			3.8%
ユーロ	TENARIS SA	71,000	9.48	673,364.00
	ENI SPA	355,000	13.04	4,629,200.00
	GALP ENERGIA SGPS SA-B SHRS	67,000	12.52	838,840.00
	NESTE OYJ	59,300	29.86	1,770,698.00
	OMV AG	21,000	43.73	918,330.00
	REPSOL SA	204,035	12.47	2,545,336.62
	TOTAL SA	336,500	43.23	14,548,577.50
	VOPAK	9,000	43.33	389,970.00
	AIR LIQUIDE	61,000	123.20	7,515,200.00
	AKZO NOBEL	32,700	80.78	2,641,506.00
	ARKEMA	9,900	74.36	736,164.00
	BASF SE	130,400	56.85	7,413,240.00
	COVESTRO AG	27,000	38.30	1,034,100.00
	EVONIK INDUSTRIES AG	27,300	21.50	586,950.00
	FUCHS PETROLUB SE -PFD	10,500	31.04	325,920.00
	KONINKLIJKE DSM NV	26,000	107.50	2,795,000.00
	LANXESS	12,000	50.48	605,760.00
	SOLVAY SA	10,300	87.02	896,306.00
	SYMRISE AG	18,100	81.12	1,468,272.00
	UMICORE	28,000	26.56	743,680.00
	CRH PLC	116,100	28.91	3,356,451.00
	HEIDELBERGCEMENT AG	20,300	59.96	1,217,188.00
	IMERYS	3,800	35.82	136,116.00
	SMURFIT KAPPA GROUP PLC	32,000	26.74	855,680.00
	ARCELORMITTAL	88,500	11.77	1,042,353.00
	THYSSENKRUPP AG	62,000	9.52	590,488.00
	VOESTALPINE AG	16,500	19.24	317,460.00
	STORA ENSO OYJ-R	85,000	9.63	819,060.00
	UPM-KYMMENE OYJ	73,300	23.17	1,698,361.00
	AIRBUS SE	82,500	123.02	10,149,150.00
	DASSAULT AVIATION SA	330	1,199.00	395,670.00
	LEONARDO SPA	55,000	10.09	555,225.00
	MTU AERO ENGINES AG	7,600	241.40	1,834,640.00
	SAFRAN SA	45,700	126.30	5,771,910.00
		15,200	101.70	1,545,840.00

THALES SA				
COMP DE SAINT-GOBAIN (ORD)	70,800	31.90	2,258,874.00	
KINGSPAN GROUP PLC	22,200	42.24	937,728.00	
ACS,ACTIVIDADES CONS Y SERV	36,457	33.00	1,203,081.00	
BOUYGUES	31,400	31.98	1,004,172.00	
EIFFAGE SA	10,800	88.88	959,904.00	
FERROVIAL SA	67,474	25.33	1,709,116.42	
HOCHTIEF AG	3,800	96.50	366,700.00	
VINCI	72,300	95.48	6,903,204.00	
LEGRAND SA	37,000	61.36	2,270,320.00	
PRYSMIAN SPA	30,900	17.72	547,702.50	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	78,200	72.64	5,680,448.00	
SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA	30,000	12.00	360,000.00	
SIEMENS AG	108,500	85.84	9,313,640.00	
ALSTOM	20,500	38.29	784,945.00	
ANDRITZ AG	11,700	30.94	361,998.00	
CNH INDUSTRIAL NV	141,000	7.95	1,121,796.00	
GEA GROUP AG	24,200	22.89	553,938.00	
KION GROUP AG	9,900	41.47	410,553.00	
KNORR-BREMSE AG	7,100	85.47	606,837.00	
KONE OYJ	48,700	50.96	2,481,752.00	
METSO OYJ	16,200	31.94	517,428.00	
WARTSILA OYJ	63,000	10.80	680,400.00	
BRENNTAG AG	20,600	40.54	835,124.00	
EDENRED	32,800	43.67	1,432,376.00	
SOCIETE BIC SA	3,800	57.45	218,310.00	
BOLLORE	106,000	3.82	405,344.00	
DEUTSCHE POST AG-REG	138,500	28.58	3,958,330.00	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	31,000	13.09	405,945.00	
ADP	3,900	153.10	597,090.00	
AENA SME SA	9,300	162.85	1,514,505.00	
ATLANTIA SPA	72,000	22.92	1,650,240.00	
FRAPORT AG	6,300	74.02	466,326.00	
GETLINK	62,000	12.45	771,900.00	
CONTINENTAL AG	15,900	106.26	1,689,534.00	

FAURECIA	10,500	35.86	376,530.00	
MICHELIN (CGDE)	24,100	92.84	2,237,444.00	
NOKIAN RENKAAT OYJ	15,800	26.11	412,538.00	
PIRELLI & C. SPA	53,000	4.51	239,348.00	
VALEO SA	33,100	24.62	814,922.00	
BAYER MOTOREN WERK	47,400	59.56	2,823,144.00	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE-PFD	7,800	48.32	376,896.00	
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	129,400	41.24	5,337,103.00	
FERRARI NV	17,100	140.05	2,394,855.00	
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV	150,000	11.05	1,658,100.00	
PEUGEOT CITROEN	82,000	19.00	1,558,410.00	
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	20,300	55.10	1,118,530.00	
RENAULT SA	28,100	48.34	1,358,494.50	
VOLKSWAGEN AG	4,500	143.50	645,750.00	
VOLKSWAGEN AG-PREF	26,500	139.86	3,706,290.00	
SEB SA	3,000	133.70	401,100.00	
ADIDAS AG	25,620	257.70	6,602,274.00	
ESSILORLUXOTTICA	40,100	127.25	5,102,725.00	
HERMES INTERNATIONAL	4,460	605.80	2,701,868.00	
HUGO BOSS AG	9,300	49.29	458,397.00	
KERING SA	10,800	432.30	4,668,840.00	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	39,330	348.45	13,704,538.50	
MONCLER SPA	25,200	33.86	853,272.00	
PUMA SE	10,610	65.70	697,077.00	
ACCOR SA	26,200	37.88	992,456.00	
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	10,900	70.96	773,464.00	
SODEXO	12,100	99.98	1,209,758.00	
DELIVERY HERO SE	16,500	44.20	729,300.00	
ZALANDO SE	18,300	40.00	732,000.00	
INDITEX SA	152,700	25.99	3,968,673.00	
CARREFOUR SUPERMARCHE	80,000	15.43	1,234,800.00	
CASINO GUICHARD-PERRACHON SA	8,300	34.88	289,504.00	
COLRUYT SA	8,700	46.07	400,809.00	
JERONIMO MARTINS	38,000	14.46	549,670.00	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	169,000	20.98	3,546,465.00	

METRO AG	25,000	14.21	355,250.00	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	108,000	85.63	9,248,040.00	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	76,000	7.84	595,840.00	
HEINEKEN HOLDING NV	16,000	87.60	1,401,600.00	
HEINEKEN NV	37,100	94.20	3,494,820.00	
PERNOD RICARD SA	30,300	159.10	4,820,730.00	
REMY COINTREAU	3,000	130.60	391,800.00	
DANONE	87,600	80.10	7,016,760.00	
KERRY GROUP PLC-A	22,100	106.20	2,347,020.00	
HENKEL AG & CO KGAA	14,400	78.40	1,128,960.00	
HENKEL AG & CO KGAA VORZUG	24,600	85.96	2,114,616.00	
BEIERSDORF AG	13,700	110.00	1,507,000.00	
LOREAL-ORD	35,800	233.30	8,352,140.00	
UNILEVER NV	206,600	53.34	11,020,044.00	
BIOMERIEUX	5,900	73.95	436,305.00	
CARL ZEISS MEDITEC AG-BR	6,000	99.30	595,800.00	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	129,400	41.65	5,389,510.00	
SARTORIUS AG-VORZUG	5,300	172.20	912,660.00	
SIEMENS HEALTHINEERS AG	19,900	35.35	703,465.00	
FRESENIUS MEDICAL CARE	29,400	59.36	1,745,184.00	
FRESENIUS SE & CO KGAA	57,600	42.25	2,433,888.00	
GRIFOLS SA	43,700	28.72	1,255,064.00	
BAYER AG-REG	132,400	64.61	8,554,364.00	
IPSEN	5,500	93.45	513,975.00	
MERCK KGAA	18,700	94.32	1,763,784.00	
ORION OYJ	13,000	32.54	423,020.00	
RECORDATI SPA	14,100	38.80	547,080.00	
SANOFI	159,100	75.99	12,090,009.00	
UCB SA	16,500	68.42	1,128,930.00	
ABN AMRO BANK NV-CVA	58,100	16.53	960,683.50	
AIB GROUP PLC	125,000	2.50	313,000.00	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA S.A.	951,000	4.36	4,151,590.50	
BANCO DE SABADELL SA	790,000	0.77	611,460.00	
BANCO SANTANDER SA	2,304,000	3.58	8,260,992.00	
BANK OF IRELAND GROUP PLC	133,000	3.32	441,560.00	

BANKIA SA	151,000	1.63	246,507.50
BANKINTER S.A.	88,000	5.44	478,896.00
BNP PARIBAS	159,900	40.61	6,493,539.00
CAIXABANK	530,000	2.09	1,112,470.00
COMMERZBANK AG	135,000	5.00	675,135.00
CREDIT AGRICOLE SA	154,000	10.23	1,575,420.00
ERSTE GROUP BANK AG	43,000	30.40	1,307,200.00
FINECOBANK BANCA FINECO SPA	91,000	8.65	787,696.00
ING GROEP NV	543,000	8.58	4,660,569.00
INTESA SANPAOLO	2,080,000	1.88	3,914,560.00
IRISH BANK RESOLUTION CORP LTD	139,810	0.00	0.00
KBC GROEP NV	36,100	52.20	1,884,420.00
MEDIOBANCA S.P.A.	88,000	8.50	748,704.00
NORDEA BANK ABP	6,120	5.52	33,825.24
RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG	20,100	19.65	395,065.50
SOCIETE GENERALE	110,000	22.07	2,427,700.00
UNICREDIT SPA	288,000	9.53	2,744,928.00
EURAZEO SE	5,953	59.05	351,524.65
EXOR NV	15,100	57.16	863,116.00
GROUPE BRUXELLES LAM	11,000	80.92	890,120.00
WENDEL	3,400	121.50	413,100.00
AEGON NV	246,000	3.55	873,300.00
AGEAS	25,800	47.75	1,231,950.00
ALLIANZ SE-REG	60,100	198.64	11,938,264.00
ASSICURAZIONI GENERALI	153,000	15.98	2,444,940.00
AXA	276,000	21.52	5,940,900.00
CNP ASSURANCES	21,200	16.75	355,100.00
HANNOVER RUECK SE	7,900	144.70	1,143,130.00
MAPFRE SA	163,000	2.36	384,680.00
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	20,700	217.00	4,491,900.00
NN GROUP NV	42,900	31.43	1,348,347.00
POSTE ITALIANE SPA	77,000	9.23	711,018.00
SAMPO OYJ-A SHS	61,200	36.78	2,250,936.00
SCOR SE	23,200	36.46	845,872.00
ADYEN NV	1,490	659.40	982,506.00

AMADEUS IT GROUP SA	61,400	67.24	4,128,536.00
ATOS SE	13,600	65.98	897,328.00
CAPGEMINI SA	21,900	105.30	2,306,070.00
WIRECARD AG	16,900	138.65	2,343,185.00
WORLDLINE SA	10,440	61.75	644,670.00
DASSAULT SYSTEMES SA	18,800	127.50	2,397,000.00
SAP SE	139,100	107.30	14,925,430.00
NOKIA OYJ	805,000	4.63	3,729,565.00
INGENICO GROUP	8,100	87.24	706,644.00
ASML HOLDING NV	60,300	191.42	11,542,626.00
INFINEON TECHNOLOGIES AG	173,000	15.18	2,626,140.00
STMICROELECTRONICS NV	99,000	15.81	1,565,190.00
CELLNEX TELECOM SA	28,000	35.08	982,240.00
DEUTSCHE TELEKOM-REG	473,000	14.88	7,039,186.00
ELISA OYJ	19,500	44.98	877,110.00
ILIAD SA	3,900	91.86	358,254.00
KONINKLIJKE KPN NV	505,000	2.77	1,400,365.00
ORANGE SA	279,000	13.46	3,755,340.00
PROXIMUS	21,600	27.16	586,656.00
TELECOM ITALIA SPA	1,290,000	0.44	574,179.00
TELECOM ITALIA-RNC	880,000	0.41	364,144.00
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG	97,000	2.20	213,594.00
TELEFONICA SA	666,000	6.00	3,999,996.00
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	16,800	28.58	480,144.00
1&1 DRILLISCH AG	8,000	24.02	192,160.00
ELECTRICITE DE FRANCE	82,000	10.54	864,280.00
ENDESA S.A.	44,400	23.45	1,041,180.00
ENEL SPA	1,155,000	6.28	7,259,175.00
ENERGIAS DE PORTUGAL	361,000	3.34	1,207,545.00
FORTUM OYJ	65,000	20.65	1,342,250.00
IBERDROLA SA	853,000	9.24	7,886,838.00
RED ELECTRICA CORPORACION SA	59,000	17.78	1,049,020.00
TERNA SPA	207,000	5.43	1,124,424.00
VERBUND AG	9,000	53.80	484,200.00
ENAGAS SA	30,400	20.29	616,816.00

NATURGY ENERGY GROUP SA	42,700	23.70	1,011,990.00	
SNAM SPA	298,000	4.48	1,337,126.00	
E.ON SE	309,000	8.28	2,560,683.00	
ENGIE	261,000	13.46	3,514,365.00	
INNOGY SE	19,500	43.56	849,420.00	
RWE AG	78,000	25.57	1,994,460.00	
SUEZ	52,000	13.45	699,660.00	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	77,000	21.93	1,688,610.00	
AMUNDI SA	8,200	54.55	447,310.00	
DEUTSCHE BANK AG-REG	275,000	6.16	1,694,000.00	
DEUTSCHE BOERSE AG	26,600	129.00	3,431,400.00	
NATIXIS	128,000	3.49	446,720.00	
UNIPER SE	26,200	27.25	713,950.00	
EUROFINS SCIENTIFIC SE	1,700	377.00	640,900.00	
QIAGEN NV	31,400	31.18	979,052.00	
SARTORIUS STEDIM BIOTECH	4,100	134.40	551,040.00	
BUREAU VERITAS SA	41,000	20.83	854,030.00	
RANDSTAD NV	15,300	41.83	639,999.00	
TELEPERFORMANCE	8,400	188.50	1,583,400.00	
WOLTERS KLUWER	39,400	64.32	2,534,208.00	
AROUNDTOWN SA	135,000	7.16	966,870.00	
DEUTSCHE WOHNEN SE	48,400	30.95	1,497,980.00	
VONOVIA SE	70,500	44.80	3,158,400.00	
AXEL SPRINGER SE-TEND	5,900	62.80	370,520.00	
EUTELSAT COMMUNICATIONS	24,100	15.72	378,852.00	
JC DECAUX SA	9,300	25.18	234,174.00	
PUBLICIS GROUPE	29,200	42.31	1,235,452.00	
RTL GROUP	5,400	41.76	225,504.00	
SES FDR	48,000	14.26	684,480.00	
TELENET GROUP HOLDING NV	6,700	45.40	304,180.00	
UBISOFT ENTERTAINMENT	11,100	71.78	796,758.00	
VIVENDI SA	130,900	25.47	3,334,023.00	
小計銘柄数：241			519,862,190.93	
			(61,348,937,151)	
組入時価比率：10.9%				11.6%

英bond	WOOD GROUP (JOHN) PLC	86,000	4.33	372,380.00
	BP PLC	2,867,000	4.90	14,054,034.00
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	626,500	22.73	14,240,345.00
	ROYAL DUTCH SHELL PLC-B	530,300	22.65	12,013,946.50
	CRODA INTERNATIONAL PLC	16,790	46.80	785,772.00
	JOHNSON MATTHEY PLC	26,700	27.93	745,731.00
	ANGLO AMERICAN PLC	151,000	16.98	2,564,584.00
	ANTOFAGASTA PLC	59,000	7.91	466,808.00
	BHP GROUP PLC	300,000	17.55	5,265,600.00
	EVRAZ PLC	76,000	4.96	376,960.00
	FRESNILLO PLC	26,000	6.63	172,536.00
	GLENCORE PLC	1,588,000	2.24	3,563,472.00
	RIO TINTO PLC-REG	161,800	40.05	6,480,090.00
	MONDI PLC	67,400	15.37	1,035,938.00
	BAE SYSTEMS PLC	441,000	5.49	2,421,090.00
	MEGGITT PLC	111,000	6.09	675,990.00
	ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	238,000	7.54	1,794,520.00
	MELROSE INDUSTRIES PLC	680,000	1.63	1,114,860.00
	DCC PLC	14,500	65.66	952,070.00
	SMITHS GROUP PLC	54,000	15.54	839,160.00
	SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC	10,500	77.85	817,425.00
	WEIR GROUP PLC	38,000	12.77	485,260.00
	ASHTED GROUP PLC	68,700	20.91	1,436,517.00
	BUNZLE	50,000	20.32	1,016,000.00
	FERGUSON PLC	32,900	59.66	1,962,814.00
	G4S PLC	219,000	1.70	373,285.50
	RENTOKIL INTIAL PLC	263,000	4.54	1,195,072.00
	EASYJET PLC	21,000	8.87	186,270.00
	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	145,000	6.19	898,420.00
	PERSIMMON PLC	42,600	18.41	784,266.00
	TAYLOR WIMPEY PLC	450,000	1.43	646,200.00
	THE BERKELEY GRP HOLDINGS	17,100	38.29	654,759.00
BURBERRY GROUP PLC	60,000	21.02	1,261,200.00	
CARNIVAL PLC	22,900	35.24	806,996.00	
COMPASS GROUP PLC	222,000	20.38	4,524,360.00	

GVC HOLDINGS PLC	87,000	5.66	492,942.00
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	23,750	51.21	1,216,237.50
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-WI	89,000	4.52	402,280.00
TUI AG-DI	60,000	7.46	448,080.00
WHITBREAD PLC	18,500	40.97	757,945.00
OCADO GROUP PLC	65,000	11.51	748,150.00
MARKS & SPENCER PLC	249,600	1.81	452,400.00
NEXT PLC	19,800	56.22	1,113,156.00
KINGFISHER PLC	308,000	1.93	595,672.00
MORRISON SUPERMARKETS	315,000	1.81	570,307.50
SAINSBURY	255,000	1.82	465,375.00
TESCO PLC	1,372,000	2.16	2,964,892.00
COCA-COLA HBC AG-DI	29,000	27.16	787,640.00
DIAGEO PLC	342,400	34.52	11,819,648.00
ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	49,400	23.03	1,137,682.00
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	325,100	30.29	9,847,279.00
IMPERIAL BRANDS PLC	134,000	20.89	2,799,260.00
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	100,500	61.70	6,200,850.00
UNILEVER PLC	157,500	50.11	7,892,325.00
SMITH & NEPHEW PLC	122,000	18.97	2,314,950.00
NMC HEALTH PLC	13,300	18.51	246,183.00
ASTRAZENECA PLC	179,400	72.56	13,017,264.00
GLAXOSMITHKLINE PLC	703,000	16.58	11,655,740.00
BARCLAYS PLC	2,450,000	1.39	3,425,590.00
HSBC HOLDINGS PLC	2,836,000	5.97	16,936,592.00
LLOYDS BANKING GROUP PLC	10,150,000	0.49	5,039,475.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP	650,000	1.82	1,183,975.00
STANDARD CHARTERED PLC	404,000	6.12	2,474,096.00
ADMIRAL GROUP PLC	27,000	21.50	580,500.00
AVIVA PLC	542,000	3.60	1,954,994.00
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	183,000	2.97	545,157.00
LEGAL & GENERAL	858,000	2.26	1,944,228.00
PRUDENTIAL PLC	369,000	14.15	5,223,195.00
RSA INSURANCE GROUP PLC	140,000	5.21	729,400.00
MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC	48,116	15.97	768,797.44

	SAGE GROUP PLC (THE)	159,000	6.99	1,111,410.00	
	HALMA PLC	54,000	19.36	1,045,710.00	
	BT GROUP PLC	1,210,000	1.64	1,984,642.00	
	VODAFONE GROUP PLC	3,730,000	1.50	5,626,332.00	
	SSE PLC	149,000	11.07	1,649,430.00	
	CENTRICA PLC	780,000	0.65	510,432.00	
	NATIONAL GRID PLC	477,000	8.57	4,091,229.00	
	SEVERN TRENT PLC	32,400	20.07	650,268.00	
	UNITED UTILITIES GROUP PLC	96,000	7.81	750,336.00	
	3I GROUP PLC	132,000	10.70	1,412,400.00	
	HARGREAVES LANSDOWN PLC	40,100	18.98	761,098.00	
	INVESTEC PLC	92,000	4.07	375,268.00	
	LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC	44,900	68.52	3,076,548.00	
	SCHRODERS PLC	15,800	27.11	428,338.00	
	ST JAMES S PLACE PLC	70,000	9.40	658,000.00	
	STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	366,000	2.41	884,988.00	
	EXPERIAN PLC	126,200	25.18	3,177,716.00	
	INTERTEK GROUP PLC	21,600	54.70	1,181,520.00	
	RELX PLC	279,000	19.25	5,372,145.00	
	INFORMA PLC	173,000	8.45	1,462,196.00	
	ITV PLC	500,000	1.06	534,500.00	
	PEARSON	109,000	8.14	887,696.00	
	WPP PLC	183,000	9.52	1,743,258.00	
	AUTO TRADER GROUP PLC	121,000	5.25	635,492.00	
小計	銘柄数：94			245,747,940.44	
				(31,743,261,466)	
	組入時価比率：5.7%			5.9%	
スイスフラン	CLARIANT AG-REG	25,900	17.28	447,552.00	
	EMS-CHEMIE HOLDING AG-REG	1,220	577.00	703,940.00	
	GIVAUDAN-REG	1,296	2,598.00	3,367,008.00	
	SIKA AG-REG	18,000	137.75	2,479,500.00	
	LAFARGEHOLCIM LTD	67,000	45.97	3,079,990.00	
	GEBERIT AG-REG	5,340	434.20	2,318,628.00	
	ABB LTD	258,000	18.06	4,660,770.00	
	SCHINDLER HOLDING AG-REG	3,000	205.40	616,200.00	

	SCHINDLER HOLDING-PART CERT	5,500	206.10	1,133,550.00	
	KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	7,300	139.00	1,014,700.00	
	CIE FINANCIERE RICHEMONT-BR A	74,300	73.90	5,490,770.00	
	THE SWATCH GROUP AG-B	4,120	261.80	1,078,616.00	
	THE SWATCH GROUP AG-REG	7,400	48.60	359,640.00	
	DUFREY AG-REG	6,500	77.28	502,320.00	
	BARRY CALLEBAUT AG	300	1,918.00	575,400.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-PC	140	7,420.00	1,038,800.00	
	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT-REG	15	79,600.00	1,194,000.00	
	NESTLE SA-REG	432,700	107.76	46,627,752.00	
	ALCON INC	62,100	59.21	3,676,941.00	
	SONOVA HOLDING AG-REG	7,600	224.10	1,703,160.00	
	STRAUMANN HOLDING AG-REG	1,450	784.80	1,137,960.00	
	NOVARTIS AG-REG	306,500	87.52	26,824,880.00	
	ROCHE HOLDING (GENUSSCHEINE)	99,330	273.20	27,136,956.00	
	VIFOR PHARMA AG	6,700	154.00	1,031,800.00	
	PARGESA HOLDING SA-BEARER SHARES	5,800	68.75	398,750.00	
	BALOISE HOLDING AG	6,600	178.80	1,180,080.00	
	SWISS LIFE HOLDING AG	4,850	463.70	2,248,945.00	
	SWISS RE LTD	43,500	98.82	4,298,670.00	
	ZURICH INSURANCE GROUP AG	21,510	347.10	7,466,121.00	
	TEMENOS AG-REG	9,300	159.10	1,479,630.00	
	SWISSCOM AG-REG	3,510	487.20	1,710,072.00	
	CREDIT SUISSE GROUP AG-REG	365,000	11.05	4,033,250.00	
	JULIUS BAER GROUP LTD	31,000	37.67	1,167,770.00	
	PARTNERS GROUP HOLDING AG	2,630	787.40	2,070,862.00	
	UBS GROUP AG	549,000	10.14	5,566,860.00	
	LONZA AG-REG	10,390	342.40	3,557,536.00	
	ADECCO GROUP AG-REG	21,500	51.10	1,098,650.00	
	SGS SA-REG	746	2,363.00	1,762,798.00	
	SWISS PRIME SITE-REG	10,100	96.65	976,165.00	
小計	銘柄数：39			177,216,992.00	
				(19,258,170,520)	
	組入時価比率：3.4%			3.6%	
スウェーデン ローナ	LUNDIN PETROLEUM AB	24,800	272.10	6,748,080.00	

BOLIDEN AB	36,300	195.26	7,087,938.00	
ASSA ABLOY AB-B	144,000	215.20	30,988,800.00	
SKANSKA AB-B SHS	45,000	173.95	7,827,750.00	
ALFA LAVAL AB	45,000	172.40	7,758,000.00	
ATLAS COPCO AB-A	94,700	269.20	25,493,240.00	
ATLAS COPCO AB-B	52,900	242.50	12,828,250.00	
EPIROC AB - A	92,000	97.60	8,979,200.00	
EPIROC AB - B	58,000	93.00	5,394,000.00	
SANDVIK AB	159,000	133.20	21,178,800.00	
SKF AB-B SHARES	49,000	145.90	7,149,100.00	
VOLVO AB-B SHS	214,000	128.55	27,509,700.00	
SECURITAS AB-B SHS	45,000	142.50	6,412,500.00	
ELECTROLUX AB-B	34,000	220.70	7,503,800.00	
HUSQVARNA AB-B SHS	55,000	74.20	4,081,000.00	
HENNES&MAURITZ AB-B	118,000	168.42	19,873,560.00	
ICA GRUPPEN AB	13,800	483.40	6,670,920.00	
SWEDISH MATCH AB	23,400	370.70	8,674,380.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	87,300	290.50	25,360,650.00	
NORDEA BANK ABP	437,000	59.37	25,944,690.00	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB	221,000	83.54	18,462,340.00	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A	212,000	85.30	18,083,600.00	
SWEDBANK AB	126,000	125.45	15,806,700.00	
INDUSTRIVARDEN AB-C SHS	25,000	196.30	4,907,500.00	
INVESTOR AB-B SHS	65,400	436.20	28,527,480.00	
KINNEVIK AB - B	33,700	244.20	8,229,540.00	
LUNDBERGS AB-B SHS	9,200	353.60	3,253,120.00	
ERICSSON LM-B	440,000	80.40	35,376,000.00	
HEXAGON AB-B SHS	36,100	436.30	15,750,430.00	
TELIA CO AB	401,000	41.12	16,489,120.00	
MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR-SDR	9,700	473.00	4,588,100.00	
TELE 2 AB-B SHS	69,000	141.40	9,756,600.00	
小計 銘柄数：32			452,694,888.00	
			(4,979,643,768)	
			0.9%	
組入時価比率：0.9%				
ノルウェーク	AKER AB ASA	14,100	224.20	3,161,220.00

ローネ					
		EQUINOR ASA	140,000	147.40	20,636,000.00
		YARA INTERNATIONAL ASA	26,200	365.00	9,563,000.00
		NORSK HYDRO	184,000	26.49	4,874,160.00
		MOWI ASA	62,000	231.30	14,340,600.00
		ORKLA ASA	115,000	80.08	9,209,200.00
		DNB ASA	136,000	145.75	19,822,000.00
		GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	31,000	167.70	5,198,700.00
		TELENOR ASA	102,000	183.35	18,701,700.00
		SCHIBSTED ASA-B SHS	12,900	239.00	3,083,100.00
小計	銘柄数：10			108,589,680.00	(1,282,444,120)
	組入時価比率：0.2%				0.2%
デンマーク ローネ		CHR HANSEN HOLDING A/S	15,100	550.00	8,305,000.00
		NOVOZYMES A/S-B SHARES	31,300	278.10	8,704,530.00
		VESTAS WIND SYSTEMS A/S	26,800	505.40	13,544,720.00
		ISS A/S	21,800	166.00	3,618,800.00
		A P MOLLER - MAERSK A/S-A	520	6,870.00	3,572,400.00
		AP MOLLER-MAERSK A/S-B	880	7,308.00	6,431,040.00
		DSV A/S	31,100	634.20	19,723,620.00
		PANDORA A/S	13,700	226.40	3,101,680.00
		CARLSBERG B	15,500	1,002.00	15,531,000.00
		COLOPLAST-B	16,400	823.00	13,497,200.00
		DEMANT A/S	16,000	205.40	3,286,400.00
		GENMAB A/S	9,400	1,351.00	12,699,400.00
		H LUNDBECK A/S	10,500	269.40	2,828,700.00
		NOVO NORDISK A/S-B	244,000	347.50	84,790,000.00
		DANSKE BANK AS	97,000	91.12	8,838,640.00
		TRYG A/S	16,000	201.40	3,222,400.00
		ORSTED A/S	27,200	677.00	18,414,400.00
小計	銘柄数：17			230,109,930.00	(3,642,640,191)
	組入時価比率：0.6%				0.7%
豪ドル		WORLEYPARSONS LTD	47,000	13.26	623,220.00
		CALTEX AUSTRALIA LIMITED	33,300	25.60	852,480.00

OIL SEARCH LTD	204,000	6.31	1,287,240.00
ORIGIN ENERGY LTD	239,000	7.02	1,677,780.00
SANTOS LTD.	261,000	6.59	1,719,990.00
WASHINGTON H. SOUL PATTINSON	17,000	19.74	335,580.00
WOODSIDE PETROLEUM	134,000	31.21	4,182,140.00
INCITEC PIVOT LTD	233,000	3.16	736,280.00
ORICA LTD	50,000	20.81	1,040,500.00
BORAL LTD	153,000	4.98	761,940.00
JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC	58,000	22.59	1,310,220.00
ALUMINA LTD	350,000	2.19	766,500.00
BHP GROUP LIMITED	418,000	36.17	15,119,060.00
BLUESCOPE STEEL LTD	68,000	12.20	829,600.00
FORTESCUE METALS GROUP LTD	201,000	7.66	1,539,660.00
NEWCREST MINING	110,000	36.26	3,988,600.00
RIO TINTO LTD	53,200	84.72	4,507,104.00
SOUTH32 LTD	700,000	2.76	1,932,000.00
CIMIC GROUP LTD	11,700	30.85	360,945.00
BRAMBLES LTD	218,000	12.66	2,759,880.00
AURIZON HOLDINGS LTD	273,000	5.83	1,591,590.00
SYDNEY AIRPORT	144,000	8.10	1,166,400.00
TRANSURBAN GROUP	371,000	14.77	5,479,670.00
ARISTOCRAT LEISURE LTD	82,000	28.00	2,296,000.00
CROWN RESORTS LTD	55,000	11.28	620,400.00
DOMINO S PIZZA ENTERPRISES L	8,500	40.14	341,190.00
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	7,300	43.05	314,265.00
TABCORP HOLDINGS	287,000	4.43	1,271,410.00
HARVEY NORMAN HOLDINGS LTD	97,117	4.57	443,824.69
WESFARMERS LIMITED	158,800	37.84	6,008,992.00
COLES GROUP LTD	163,000	13.14	2,141,820.00
WOOLWORTHS GROUP LTD	180,000	34.99	6,298,200.00
COCA-COLA AMATIL LTD	77,000	10.21	786,170.00
TREASURY WINE ESTATES LTD	100,000	17.08	1,708,000.00
COCHLEAR LTD	8,100	209.43	1,696,383.00
RAMSAY HEALTH CARE LTD	20,500	68.94	1,413,270.00
SONIC HEALTHCARE LTD	62,000	27.28	1,691,360.00

	CSL LIMITED	64,300	227.40	14,621,820.00	
	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANK	406,000	26.39	10,714,340.00	
	BANK OF QUEENSLAND LTD	56,000	8.88	497,280.00	
	BENDIGO AND ADELAIDE BANK LTD	67,000	10.58	708,860.00	
	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	250,700	75.12	18,832,584.00	
	NATIONAL AUSTRALIA BANK	395,000	27.03	10,676,850.00	
	WESTPAC BANKING CORP	489,000	27.82	13,603,980.00	
	AMP LIMITED	390,000	1.73	676,650.00	
	CHALLENGER LIMITED	80,000	6.69	535,200.00	
	INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD	335,000	7.84	2,626,400.00	
	MEDIBANK PRIVATE LTD	400,000	3.39	1,356,000.00	
	QBE INSURANCE	179,000	12.04	2,155,160.00	
	SUNCORP GROUP LTD	181,000	13.10	2,371,100.00	
	COMPUTERSHARE LTD	63,000	14.48	912,240.00	
	TELSTRA CORP LTD	590,000	3.77	2,224,300.00	
	TPG TELECOM LTD	52,000	6.46	335,920.00	
	AUSNET SERVICES	230,000	1.76	405,950.00	
	APA GROUP	159,000	10.49	1,667,910.00	
	AGL ENERGY LTD	94,000	19.01	1,786,940.00	
	ASX LTD	26,300	84.79	2,229,977.00	
	MACQUARIE GROUP LIMITED	45,300	118.54	5,369,862.00	
	SEEK LTD	48,000	18.89	906,720.00	
	REA GROUP LTD	6,900	100.20	691,380.00	
小計	銘柄数：60			177,507,086.69	
				(12,807,136,304)	
	組入時価比率：2.3%			2.4%	
ニュージーランドドル	FLETCHER BUILDING LTD	112,627	4.52	509,074.04	
	AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	130,000	9.66	1,255,800.00	
	A2 MILK CO LTD	106,000	15.70	1,664,200.00	
	FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORPORATION L	86,000	15.80	1,358,800.00	
	RYMAN HEALTHCARE LTD	58,000	13.08	758,640.00	
	SPARK NEW ZEALAND LTD	260,000	3.98	1,034,800.00	
	MERIDIAN ENERGY LTD	159,000	4.75	755,250.00	
小計	銘柄数：7			7,336,564.04	

				(500,940,592)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
香港ドル	CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	387,040	67.90	26,280,016.00	
	NWS HOLDINGS LTD	220,500	13.70	3,020,850.00	
	TECHTRONIC INDUSTRIES COMPANY LIMITED	197,000	53.90	10,618,300.00	
	MTR CORP	221,000	48.30	10,674,300.00	
	YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	97,000	21.70	2,104,900.00	
	GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L	316,000	46.85	14,804,600.00	
	MGM CHINA HOLDINGS LTD	124,000	11.72	1,453,280.00	
	SANDS CHINA LTD	336,000	34.95	11,743,200.00	
	SHANGRI-LA ASIA LTD	160,333	8.22	1,317,937.26	
	SJM HOLDINGS LIMITED	270,000	7.42	2,003,400.00	
	WYNN MACAU LTD	228,000	16.30	3,716,400.00	
	VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	102,000	37.15	3,789,300.00	
	WH GROUP LIMITED	1,310,000	6.37	8,344,700.00	
	BANK OF EAST ASIA	167,060	20.80	3,474,848.00	
	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	536,000	26.55	14,230,800.00	
	HANG SENG BANK	105,800	167.30	17,700,340.00	
	AIA GROUP LTD	1,709,000	76.00	129,884,000.00	
	ASM PACIFIC TECHNOLOGY	38,000	93.70	3,560,600.00	
	HKT TRUST AND HKT LTD	519,600	12.46	6,474,216.00	
	PCCW LTD	550,000	4.29	2,359,500.00	
	CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD	89,000	55.20	4,912,800.00	
	CLP HLDGS	227,000	82.10	18,636,700.00	
	POWER ASSETS HOLDINGS LTD	191,000	54.10	10,333,100.00	
	HONG KONG & CHINA GAS	1,430,348	16.62	23,772,383.76	
	HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD	169,300	245.00	41,478,500.00	
	CK ASSET HOLDINGS LTD	364,040	53.60	19,512,544.00	
HANG LUNG PROPERTIES LTD	310,000	17.66	5,474,600.00		
HENDERSON LAND	204,443	38.25	7,819,944.75		
HYSAN DEVELOPMENT	83,000	34.45	2,859,350.00		
KERRY PROPERTIES	79,000	28.75	2,271,250.00		
NEW WORLD DEVELOPMENT	839,666	10.42	8,749,319.72		

	SINO LAND CO.LTD	480,000	11.56	5,548,800.00	
	SUN HUNG KAI PROPERTIES	228,000	116.80	26,630,400.00	
	SWIRE PACIFIC-A	75,000	81.50	6,112,500.00	
	SWIRE PROPERTIES LTD	173,000	27.70	4,792,100.00	
	WHARF REAL ESTATE INVESTMENT	164,000	48.20	7,904,800.00	
	WHARF(HOLDING)	174,000	17.66	3,072,840.00	
	WHEELOCK & COMPANY LTD	117,000	46.75	5,469,750.00	
小計	銘柄数：38			482,907,169.49	
				(6,553,050,289)	
	組入時価比率：1.2%			1.2%	
シンガポールド ル	SINGAPORE TECH ENGINEERING	198,000	4.04	799,920.00	
	KEPPEL CORP.	202,000	5.89	1,189,780.00	
	SEMBCORP INDUSTRIES	140,040	2.23	312,289.20	
	YANGZIJIANG SHIPBUILDING	280,000	0.99	277,200.00	
	SINGAPORE AIRLINES LTD	77,040	8.94	688,737.60	
	COMFORTDELGRO CORP LTD	310,000	2.49	771,900.00	
	SATS LTD	77,000	4.73	364,210.00	
	GENTING SINGAPORE LTD	870,000	0.87	761,250.00	
	JARDINE CYCLE&CARRIAGE LTD	14,000	30.28	423,920.00	
	GOLDEN AGRI-RESOURCES LTD	940,020	0.29	272,605.80	
	WILMAR INTERNATIONAL LTD	289,000	3.72	1,075,080.00	
	DBS GROUP HLDGS	251,000	24.70	6,199,700.00	
	OCBC-ORD	448,000	10.63	4,762,240.00	
	UNITED OVERSEAS BANK	175,000	25.04	4,382,000.00	
	VENTURE CORP LTD	35,000	15.20	532,000.00	
	SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LIMITED	1,170,000	3.21	3,755,700.00	
	SINGAPORE EXCHANGE LTD	111,000	8.18	907,980.00	
	CAPITALAND LIMITED	380,000	3.40	1,292,000.00	
	CITY DEVELOPMENTS LTD	70,000	9.16	641,200.00	
	UOL GROUP LIMITED	65,000	7.25	471,250.00	
	SINGAPORE PRESS HOLDINGS	240,000	2.06	494,400.00	
小計	銘柄数：21			30,375,362.60	
				(2,331,916,586)	
	組入時価比率：0.4%			0.4%	

新シェケル	ISRAEL CHEMICALS LIMITED	91,000	16.85	1,533,350.00	
	ELBIT SYSTEMS LTD	3,600	543.80	1,957,680.00	
	BANK HAPOALIM BM	167,000	26.23	4,380,410.00	
	BANK LEUMI LE-ISRAEL	195,000	24.45	4,767,750.00	
	ISRAEL DISCOUNT BANK-A	172,000	14.60	2,511,200.00	
	MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	17,000	84.20	1,431,400.00	
	NICE LTD	8,600	534.00	4,592,400.00	
	AZRIELI GROUP	6,500	267.00	1,735,500.00	
小計	銘柄数：8			22,909,690.00	
				(688,207,087)	
	組入時価比率：0.1%			0.1%	
合計				535,276,180,774	
				(535,276,180,774)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

(2)株式以外の有価証券(2019年8月19日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	AGNC INVESTMENT CORP	71,000	1,152,330.00	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	15,800	2,339,980.00	
		AMERICAN TOWER CORP	62,500	13,933,125.00	
		ANNALY CAPITAL MANAGEMENT	196,000	1,754,200.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	19,400	3,993,296.00	
		BOSTON PROPERTIES	22,200	2,846,262.00	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	13,100	1,390,958.00	
		CROWN CASTLE INTL CORP	59,000	8,432,280.00	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	29,200	3,611,164.00	
		DUKE REALTY CORP	52,300	1,739,498.00	
		EQUINIX INC	11,270	6,218,898.70	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	12,100	1,633,258.00	
		EQUITY RESIDENTIAL	51,800	4,228,952.00	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	9,030	2,841,921.60	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	17,900	2,159,098.00	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	9,800	1,280,370.00	

	HCP INC	66,100	2,279,128.00	
	HOST HOTELS & RESORTS INC	100,000	1,585,000.00	
	INVITATION HOMES INC	64,800	1,835,136.00	
	IRON MOUNTAIN INC	38,300	1,206,067.00	
	KIMCO REALTY CORP	58,000	1,082,860.00	
	LIBERTY PROPERTY TRUST	19,800	1,031,580.00	
	MACERICH CO /THE	14,200	416,060.00	
	MID-AMERICA APARTMENT COMM	16,500	2,049,465.00	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	22,000	1,207,360.00	
	PROLOGIS INC	89,600	7,382,144.00	
	PUBLIC STORAGE	22,400	5,796,672.00	
	REALTY INCOME CORP	42,300	3,079,863.00	
	REGENCY CENTERS CORP	23,900	1,558,041.00	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	16,100	4,190,669.00	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	43,900	6,523,979.00	
	SL GREEN REALTY CORP	12,500	989,500.00	
	SUN COMMUNITIES INC	12,200	1,781,566.00	
	UDR INC	40,000	1,879,200.00	
	VENTAS INC	49,200	3,601,440.00	
	VEREIT INC	142,000	1,366,040.00	
	VORNADO REALTY TRUST	24,200	1,482,250.00	
	WELLTOWER INC	54,100	4,803,539.00	
	WEYERHAEUSER CO	107,000	2,692,120.00	
	WP CAREY INC	23,600	2,091,432.00	
小計	銘柄数：40	1,755,100	121,466,702.30	
			(12,925,271,791)	
	組入時価比率：2.3%		82.1%	
カナダドル	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	20,000	451,000.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	22,000	581,020.00	
	SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	11,000	350,680.00	
小計	銘柄数：3	53,000	1,382,700.00	
			(110,851,059)	
	組入時価比率：0.0%		0.7%	
ユーロ	COVIVIO	6,600	616,770.00	
	GECINA SA	6,400	897,280.00	
	ICADE	5,100	398,820.00	

小計	KLEPIERRE	28,000	758,520.00	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	19,100	2,298,685.00	
	銘柄数：5	65,200	4,970,075.00	(586,518,550)
	組入時価比率：0.1%			3.7%
英債券	BRITISH LAND	128,000	611,584.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	99,000	736,164.00	
	SEGRO PLC	145,000	1,079,380.00	
小計	銘柄数：3	372,000	2,427,128.00	(313,512,123)
	組入時価比率：0.1%			2.0%
豪ドル	DEXUS	155,000	2,013,450.00	
	GOODMAN GROUP	227,000	3,311,930.00	
	GPT GROUP	285,000	1,747,050.00	
	LENDLEASE GROUP	77,000	1,042,580.00	
	MIRVAC GROUP	570,000	1,789,800.00	
	SCENTRE GROUP	769,000	2,914,510.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	348,000	1,545,120.00	
	VICINITY CENTRES	470,000	1,146,800.00	
小計	銘柄数：8	2,901,000	15,511,240.00	(1,119,135,966)
	組入時価比率：0.2%			7.1%
香港ドル	HK ELECTRIC INVESTMENTS -SS	370,000	2,860,100.00	
	LINK REIT	302,000	27,965,200.00	
小計	銘柄数：2	672,000	30,825,300.00	(418,299,321)
	組入時価比率：0.1%			2.7%
シンガポールドル	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	380,000	1,151,400.00	
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	369,972	769,541.76	
	CAPITALAND MALL TRUST	390,000	1,021,800.00	
	SUNTEC REIT	300,000	576,000.00	
小計	銘柄数：4	1,439,972	3,518,741.76	(270,133,804)
	組入時価比率：0.0%			1.7%
合計			15,743,722,614	(15,743,722,614)

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 8月19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	9,365,662,345	-	9,249,524,225	116,138,120
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	636,805,093	-	637,707,100	902,007
米ドル	430,036,760	-	430,890,500	853,740
カナダドル	41,604,628	-	41,683,200	78,572
ユーロ	43,866,363	-	43,663,700	202,663
スイスフラン	48,790,093	-	48,901,500	111,407
豪ドル	45,436,601	-	45,448,200	11,599
香港ドル	27,070,648	-	27,120,000	49,352
合計	-	-	-	115,236,113

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

外国先物取引について

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

2 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

外国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 8月19日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	1,346,131,602
コール・ローン	178,800,522
国債証券	601,367,478,238
派生商品評価勘定	146,850
未収入金	1,899,490,847
未収利息	4,385,139,887
前払費用	147,059,181
流動資産合計	609,324,247,127
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,885,344
未払金	1,912,207,997
未払解約金	1,404,721,051
未払利息	275
その他未払費用	3,517,500
流動負債合計	3,323,332,167
負債合計	3,323,332,167
純資産の部	
元本等	
元本	262,258,048,737
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	343,742,866,223
元本等合計	606,000,914,960
純資産合計	606,000,914,960
負債純資産合計	609,324,247,127

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月19日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.3107円
(10,000口当たり純資産額)	(23,107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 2019年 2月19日 至 2019年 8月19日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行なっております。</p> <p style="padding-left: 20px;">市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行なっております。</p> <p style="padding-left: 20px;">信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行なっております。</p> <p style="padding-left: 20px;">流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行なっております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 8月19日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p>

2. 時価の算定方法

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 8月19日現在	
期首	2019年 2月19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	271,259,590,671円
同期中における追加設定元本額	11,427,595,413円
同期中における一部解約元本額	20,429,137,347円
期末元本額	262,258,048,737円
期末元本額の内訳*	
バランスセレクト30	87,964,834円
バランスセレクト50	90,249,834円
バランスセレクト70	75,760,387円
野村外国債券インデックスファンド	294,758,017円
野村世界6資産分散投信（安定コース）	3,534,530,144円
野村世界6資産分散投信（分配コース）	25,663,982,874円
野村世界6資産分散投信（成長コース）	1,574,783,396円
野村資産設計ファンド2015	29,877,242円
野村資産設計ファンド2020	32,667,472円
野村資産設計ファンド2025	48,743,959円
野村資産設計ファンド2030	45,014,920円
野村資産設計ファンド2035	31,079,455円
野村資産設計ファンド2040	60,882,542円
野村外国債券インデックス Bコース（野村投資一任口座向け）	130,030,801,272円
のむらっぴ・ファンド（保守型）	5,774,201,127円
のむらっぴ・ファンド（普通型）	10,836,519,436円
のむらっぴ・ファンド（積極型）	2,149,308,927円
野村外国債券インデックス（野村SMA向け）	925,432,794円
野村資産設計ファンド2045	7,710,976円
野村インデックスファンド・外国債券	842,701,708円
マイ・ロード	8,856,904,615円
ネクストコア	259,177,112円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	138,739,621円
野村外国債券インデックスBコース（野村SMA・EW向け）	4,677,046,515円
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,684,557,561円
野村資産設計ファンド2050	9,681,108円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型	5,658,725円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型	1,911,459円

野村ターゲットデートファンド2016 2032-2034年目標型	1,433,425円
野村ターゲットデートファンド2016 2035-2037年目標型	1,104,259円
のむらップ・ファンド(やや保守型)	498,201,139円
のむらップ・ファンド(やや積極型)	259,058,795円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,082,001円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,423,216円
インデックス・ブレンド(タイプ)	6,093,552円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,455,180円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,853,002円
野村6資産均等バランス	462,488,453円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	8,720,189,721円
世界6資産分散ファンド	102,658,571円
NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	1,326,921,056円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	1,111,678,875円
野村外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	9,029,104円
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	1,582,506,278円
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	394,738,986円
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	1,776,330,159円
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	1,403,940,754円
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	3,130,845円
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	9,677,686円
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	700,551円
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	4,116,035,392円
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	22,037,402円
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	101,194,460円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	25,866,676円
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	172,799,828円
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	203,377,305円
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	1,905,110,019円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	923,222,940円
ノムラ外国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,686,657,963円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国債券(適格機関投資家専用)	938,868,459円
バランスセレクト30(確定拠出年金向け)	3,824,561円
バランスセレクト50(確定拠出年金向け)	7,501,285円
バランスセレクト70(確定拠出年金向け)	6,769,809円
野村外国債券パッシブファンド(確定拠出年金向け)	563,167,144円
マイバランス30(確定拠出年金向け)	2,630,415,168円
マイバランス50(確定拠出年金向け)	3,528,389,543円
マイバランス70(確定拠出年金向け)	3,092,708,425円
野村外国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	15,049,728,822円
マイバランスDC30	1,709,526,450円
マイバランスDC50	1,084,407,015円
マイバランスDC70	691,601,266円
野村DC外国債券インデックスファンド	5,236,266,919円
野村DC運用戦略ファンド	2,439,212,882円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	271,916,823円
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	110,470,005円

マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	126,248,922円
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	60,355,984円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	5,334,140円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	17,519,505円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	5,415,795円
野村資産設計ファンド(DC)2030	1,579,306円
野村資産設計ファンド(DC)2040	738,260円
野村資産設計ファンド(DC)2050	775,138円
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	33,790,353円
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	18,278,608円
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	6,057,813円
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	8,534,712円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年8月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年8月19日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	US TREASURY BOND	2,000,000.00	2,138,828.00	
		US TREASURY BOND	25,300,000.00	28,910,191.09	
		US TREASURY BOND	38,800,000.00	46,065,905.28	
		US TREASURY BOND	45,100,000.00	47,150,638.37	
		US TREASURY BOND	72,200,000.00	92,393,437.50	
		US TREASURY BOND	34,100,000.00	45,819,208.38	
		US TREASURY BOND	23,000,000.00	31,245,858.80	
		US TREASURY BOND	28,300,000.00	37,769,443.19	
		US TREASURY BOND	40,400,000.00	53,365,875.00	
		US TREASURY BOND	35,600,000.00	47,320,185.72	
		US TREASURY BOND	100,000.00	141,382.81	
		US TREASURY BOND	27,500,000.00	32,310,349.50	
		US TREASURY BOND	16,000,000.00	21,555,000.00	
		US TREASURY N/B	300,000.00	300,773.43	

US TREASURY N/B	5,700,000.00	5,693,765.34	
US TREASURY N/B	6,200,000.00	6,251,585.86	
US TREASURY N/B	3,380,000.00	3,410,235.11	
US TREASURY N/B	1,100,000.00	1,097,679.66	
US TREASURY N/B	36,200,000.00	36,358,375.00	
US TREASURY N/B	36,800,000.00	36,679,248.16	
US TREASURY N/B	6,000,000.00	6,022,030.80	
US TREASURY N/B	700,000.00	697,839.80	
US TREASURY N/B	7,100,000.00	7,184,867.01	
US TREASURY N/B	300,000.00	299,917.95	
US TREASURY N/B	4,000,000.00	4,006,093.60	
US TREASURY N/B	700,000.00	697,648.42	
US TREASURY N/B	70,800,000.00	71,676,702.24	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,301,675.70	
US TREASURY N/B	13,700,000.00	13,765,288.72	
US TREASURY N/B	2,200,000.00	2,200,171.82	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,084,062.40	
US TREASURY N/B	1,400,000.00	1,402,734.34	
US TREASURY N/B	800,000.00	809,718.72	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,465,390.16	
US TREASURY N/B	35,300,000.00	35,561,989.54	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,187,859.06	
US TREASURY N/B	48,800,000.00	50,250,653.20	
US TREASURY N/B	10,900,000.00	10,973,233.83	
US TREASURY N/B	3,900,000.00	3,873,796.68	
US TREASURY N/B	11,800,000.00	11,930,444.28	
US TREASURY N/B	600,000.00	597,046.86	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,556,304.26	
US TREASURY N/B	10,800,000.00	10,930,359.24	
US TREASURY N/B	4,200,000.00	4,190,484.06	
US TREASURY N/B	45,400,000.00	46,643,179.12	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,018,789.00	
US TREASURY N/B	17,900,000.00	18,050,331.36	
US TREASURY N/B	300,000.00	299,250.00	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,137,616.70	

US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,773,566.36	
US TREASURY N/B	34,000,000.00	34,395,780.40	
US TREASURY N/B	800,000.00	794,374.96	
US TREASURY N/B	2,100,000.00	2,144,050.65	
US TREASURY N/B	10,600,000.00	10,751,546.08	
US TREASURY N/B	3,800,000.00	3,773,577.84	
US TREASURY N/B	25,000,000.00	25,311,522.50	
US TREASURY N/B	6,800,000.00	6,870,921.28	
US TREASURY N/B	16,000,000.00	16,213,748.80	
US TREASURY N/B	9,650,000.00	9,579,885.99	
US TREASURY N/B	16,800,000.00	16,991,624.16	
US TREASURY N/B	1,900,000.00	1,891,093.75	
US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,425,932.95	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,009,179.60	
US TREASURY N/B	3,700,000.00	3,723,991.91	
US TREASURY N/B	12,400,000.00	12,591,811.88	
US TREASURY N/B	6,700,000.00	6,783,750.00	
US TREASURY N/B	80,000,000.00	81,965,624.00	
US TREASURY N/B	8,000,000.00	8,010,624.80	
US TREASURY N/B	14,000,000.00	14,140,000.00	
US TREASURY N/B	32,800,000.00	33,253,561.68	
US TREASURY N/B	7,300,000.00	7,355,890.26	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,536,367.10	
US TREASURY N/B	9,900,000.00	9,978,116.94	
US TREASURY N/B	500,000.00	505,625.00	
US TREASURY N/B	1,300,000.00	1,327,066.39	
US TREASURY N/B	70,300,000.00	70,882,168.36	
US TREASURY N/B	25,300,000.00	25,584,625.00	
US TREASURY N/B	11,100,000.00	11,193,222.24	
US TREASURY N/B	700,000.00	708,421.84	
US TREASURY N/B	2,900,000.00	2,924,241.97	
US TREASURY N/B	26,200,000.00	26,721,951.16	
US TREASURY N/B	100,000.00	100,937.50	
US TREASURY N/B	100,000.00	101,648.43	
US TREASURY N/B	1,000,000.00	1,012,656.20	

US TREASURY N/B	10,300,000.00	10,358,339.20	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,260,936.00	
US TREASURY N/B	900,000.00	908,578.08	
US TREASURY N/B	1,500,000.00	1,526,367.15	
US TREASURY N/B	11,400,000.00	11,471,250.00	
US TREASURY N/B	28,200,000.00	28,836,702.42	
US TREASURY N/B	47,900,000.00	48,405,191.72	
US TREASURY N/B	17,000,000.00	17,333,358.10	
US TREASURY N/B	24,200,000.00	24,264,280.04	
US TREASURY N/B	14,300,000.00	14,883,171.16	
US TREASURY N/B	11,000,000.00	11,027,500.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,036,718.50	
US TREASURY N/B	34,800,000.00	35,202,375.00	
US TREASURY N/B	9,000,000.00	9,062,577.90	
US TREASURY N/B	13,700,000.00	13,604,741.16	
US TREASURY N/B	40,000,000.00	42,006,248.00	
US TREASURY N/B	18,000,000.00	18,745,311.60	
US TREASURY N/B	13,900,000.00	13,871,764.93	
US TREASURY N/B	5,200,000.00	5,189,843.36	
US TREASURY N/B	14,600,000.00	14,717,483.28	
US TREASURY N/B	15,600,000.00	16,443,375.00	
US TREASURY N/B	9,200,000.00	9,465,218.52	
US TREASURY N/B	3,000,000.00	3,103,359.30	
US TREASURY N/B	800,000.00	846,062.48	
US TREASURY N/B	1,700,000.00	1,752,726.52	
US TREASURY N/B	22,000,000.00	23,084,529.60	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	20,539,062.00	
US TREASURY N/B	2,300,000.00	2,376,367.13	
US TREASURY N/B	46,000,000.00	47,548,902.80	
US TREASURY N/B	5,600,000.00	5,828,374.72	
US TREASURY N/B	34,200,000.00	35,602,733.52	
US TREASURY N/B	3,500,000.00	3,621,952.95	
US TREASURY N/B	46,900,000.00	48,277,687.50	
US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,635,343.58	
US TREASURY N/B	35,000,000.00	37,206,638.00	

US TREASURY N/B	30,000,000.00	32,327,343.00	
US TREASURY N/B	6,500,000.00	6,743,750.00	
US TREASURY N/B	5,000,000.00	5,361,328.00	
US TREASURY N/B	27,000,000.00	27,835,312.50	
US TREASURY N/B	19,200,000.00	20,914,498.56	
US TREASURY N/B	70,300,000.00	73,556,865.43	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,018,906.20	
US TREASURY N/B	10,200,000.00	10,780,125.00	
US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,816,593.66	
US TREASURY N/B	2,000,000.00	2,002,343.60	
US TREASURY N/B	13,000,000.00	13,459,062.50	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	21,078,124.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	532,460.90	
US TREASURY N/B	20,000,000.00	21,128,124.00	
US TREASURY N/B	500,000.00	549,257.80	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	2,843,164.00	
US TREASURY N/B	4,900,000.00	7,178,882.69	
US TREASURY N/B	24,700,000.00	34,585,787.21	
US TREASURY N/B	2,500,000.00	3,503,320.25	
US TREASURY N/B	200,000.00	300,078.12	
US TREASURY N/B	100,000.00	143,664.06	
US TREASURY N/B	100,000.00	127,710.93	
US TREASURY N/B	100,000.00	140,398.43	
US TREASURY N/B	100,000.00	145,015.62	
US TREASURY N/B	100,000.00	143,015.62	
US TREASURY N/B	300,000.00	443,179.68	
US TREASURY N/B	100,000.00	143,578.12	
US TREASURY N/B	200,000.00	270,046.86	
US TREASURY N/B	300,000.00	425,226.54	
US TREASURY N/B	200,000.00	302,093.74	
US TREASURY N/B	100,000.00	144,453.12	
US TREASURY N/B	700,000.00	932,914.01	
US TREASURY N/B	300,000.00	365,929.68	
US TREASURY N/B	500,000.00	610,117.15	
US TREASURY N/B	500,000.00	598,554.65	

	US TREASURY N/B	200,000.00	230,015.62
	US TREASURY N/B	16,600,000.00	19,073,139.38
	US TREASURY N/B	24,200,000.00	29,558,030.04
	US TREASURY N/B	10,000,000.00	13,210,156.00
	US TREASURY N/B	12,700,000.00	16,818,569.36
	US TREASURY N/B	18,900,000.00	24,115,218.75
	US TREASURY N/B	23,000,000.00	28,236,092.60
	US TREASURY N/B	36,900,000.00	44,412,607.53
	US TREASURY N/B	46,400,000.00	51,206,747.68
	US TREASURY N/B	21,700,000.00	26,177,319.77
	US TREASURY N/B	16,000,000.00	18,912,499.20
	US TREASURY N/B	14,400,000.00	17,410,500.00
	US TREASURY N/B	30,500,000.00	33,692,968.75
	US TREASURY N/B	24,200,000.00	26,731,545.06
	US TREASURY N/B	1,800,000.00	1,894,921.74
	US TREASURY N/B	14,200,000.00	16,851,405.54
	US TREASURY N/B	1,700,000.00	2,066,164.02
	US TREASURY N/B	3,400,000.00	3,950,109.12
	US TREASURY N/B	11,300,000.00	13,136,250.00
	US TREASURY N/B	9,500,000.00	11,572,929.45
	US TREASURY N/B	6,100,000.00	7,607,366.73
	US TREASURY N/B	11,700,000.00	14,284,053.81
	US TREASURY N/B	4,400,000.00	5,386,218.64
	US TREASURY N/B	3,500,000.00	4,190,976.30
小計	銘柄数：178	2,507,130,000.00	2,726,344,654.99 (290,110,334,737)
	組入時価比率：47.9%		48.2%
カナダドル	CANADA GOVERNMENT	5,500,000.00	5,720,495.00
	CANADIAN GOVERNMENT	700,000.00	701,981.00
	CANADIAN GOVERNMENT	3,800,000.00	3,769,714.00
	CANADIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,207,224.00
	CANADIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	12,244,111.00
	CANADIAN GOVERNMENT	11,900,000.00	11,780,762.00
	CANADIAN GOVERNMENT	12,750,000.00	13,171,897.50
	CANADIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,806,210.00

	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	296,613.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,548,832.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,700,000.00	6,646,065.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,200,000.00	1,220,856.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,645,494.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,133,264.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	1,600,000.00	1,674,768.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	6,800,000.00	7,213,236.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,664,000.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,043,680.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,750,000.00	7,157,870.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	200,000.00	197,950.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	107,274.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,080,000.00	14,344,848.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	4,200,000.00	6,601,476.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	2,900,000.00	4,594,180.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	8,600,000.00	12,814,258.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	10,400,000.00	15,219,568.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	300,000.00	402,780.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	600,000.00	705,582.00	
	CANADIAN GOVERNMENT	100,000.00	149,038.00	
小計	銘柄数：29	123,280,000.00	144,784,026.50	
			(11,607,335,404)	
	組入時価比率：1.9%		1.9%	
メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	95,300,000.00	94,431,817.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	73,100,000.00	73,447,458.92	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	58,000,000.00	57,366,060.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	35,300,000.00	36,956,777.26	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,000,000.00	45,479,912.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	47,700,000.00	44,713,980.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	86,300,000.00	89,033,984.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	49,600,000.00	54,861,568.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	46,500,000.00	48,925,440.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,503,100.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	56,300,000.00	71,198,106.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	40,300,000.00	44,989,308.00	

小計	MEX BONOS DESARR FIX RT	64,200,000.00	66,721,134.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	15,000,000.00	16,024,872.00	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	83,000,000.00	86,378,100.00	
	銘柄数：15	800,600,000.00	841,031,617.18	
	組入時価比率：0.8%		(4,558,391,365)	0.8%
ユーロ	BELGIUM KINGDOM	1,700,000.00	1,785,164.90	
	BELGIUM KINGDOM	700,000.00	775,075.00	
	BELGIUM KINGDOM	400,000.00	450,937.60	
	BELGIUM KINGDOM	5,700,000.00	6,544,170.00	
	BELGIUM KINGDOM	7,900,000.00	8,842,248.80	
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	3,020,930.00	
	BELGIUM KINGDOM	4,000,000.00	4,650,800.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,061,700.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,083,100.00	
	BELGIUM KINGDOM	8,400,000.00	11,298,806.40	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,109,292.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,000,000.00	2,207,034.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,109,300.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,125,074.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,500,000.00	1,719,829.95	
	BELGIUM KINGDOM	3,500,000.00	5,387,434.50	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	593,150.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,238,974.00	
	BELGIUM KINGDOM	500,000.00	664,806.00	
	BELGIUM KINGDOM	5,400,000.00	10,004,531.40	
	BELGIUM KINGDOM	5,500,000.00	10,198,210.00	
	BELGIUM KINGDOM	2,900,000.00	3,817,893.50	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,345,997.00	
	BELGIUM KINGDOM	1,200,000.00	1,851,301.20	
	BELGIUM KINGDOM	1,000,000.00	1,569,750.00	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	11,500,000.00	17,535,073.50	
	BELGIUM KINGDOM GOVT	10,600,000.00	18,970,586.80	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,200,000.00	5,537,407.20	
	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,500,000.00	2,521,467.50	

BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	19,400,000.00	21,405,766.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,900,000.00	6,051,726.76
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,000,000.00	3,040,260.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,550,000.00	16,845,909.97
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,350,000.00	4,462,143.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	5,460,590.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	13,500,000.00	16,255,215.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	5,462,132.30
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,300,000.00	6,377,696.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	14,600,000.00	18,011,348.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,800,000.00	9,338,550.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	450,000.00	521,772.75
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	900,000.00	996,147.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	15,100,000.00	19,514,288.70
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,734,919.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	6,000,000.00	6,858,768.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	22,400,000.00	31,890,864.32
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3,100,000.00	3,506,720.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,252,647.40
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5,000,000.00	5,655,500.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	9,300,000.00	13,780,740.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,000,000.00	2,393,892.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,400,000.00	10,684,800.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,500,000.00	4,583,655.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	7,400,000.00	13,430,171.20
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	8,100,000.00	16,104,906.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,000,000.00	5,930,952.00
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4,300,000.00	6,225,957.10
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2,400,000.00	4,259,304.00
BUNDESobligation	100,000.00	101,287.00
BUNDESobligation	1,600,000.00	1,623,760.00
BUNDESobligation	3,300,000.00	3,384,117.00
BUNDESobligation	1,900,000.00	1,957,703.00
BUNDESobligation	1,000,000.00	1,035,800.00
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	100,000.00	103,251.00

BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000.00	4,088,370.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4,800,000.00	5,178,384.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,400,000.00	6,820,224.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	14,300,000.00	15,316,873.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,500,000.00	7,012,460.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,000,000.00	5,381,050.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,000,000.00	3,262,980.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	11,000,000.00	12,029,160.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,600,000.00	6,272,504.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	13,900,000.00	18,379,136.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,700,000.00	1,909,542.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,500,000.00	1,676,625.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,100,000.00	8,893,881.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,700,000.00	2,911,977.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	9,100,000.00	10,154,053.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,800,000.00	9,605,552.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,060,980.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	700,000.00	757,897.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	21,500,000.00	34,273,365.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1,000,000.00	1,106,680.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,200,000.00	12,764,202.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2,000,000.00	2,221,220.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,300,000.00	9,486,855.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,500,000.00	13,125,075.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6,200,000.00	10,723,272.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	8,800,000.00	16,012,013.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,400,000.00	6,151,681.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,700,000.00	11,203,885.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,800,000.00	12,312,930.20	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3,900,000.00	7,232,245.80	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,300,000.00	12,540,465.60	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	7,200,000.00	12,661,128.00	
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5,600,000.00	8,006,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,700,000.00	9,061,398.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,003,350.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	1,200,000.00	1,210,572.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,650,000.00	13,374,484.47	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	99,410.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,200,000.00	12,952,130.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,100,000.00	5,128,050.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	8,000,000.00	8,551,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,400,000.00	15,723,360.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	417,640.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	550,000.00	551,127.50	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	104,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,400,000.00	20,563,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	300,000.00	306,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	410,040.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	400,000.00	405,480.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	7,400,000.00	8,524,060.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,100,000.00	3,192,866.70	
BUONI POLIENNALI DEL TES	30,400,000.00	35,151,520.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	100,000.00	101,260.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,100,000.00	1,255,623.60	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	579,500.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	18,700,000.00	25,097,270.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	15,900,000.00	18,515,550.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,000,000.00	1,048,300.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	6,614,900.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	4,700,000.00	4,839,590.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	16,800,000.00	20,453,664.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	5,417,660.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,090,198.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,000,000.00	3,179,700.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	11,500,000.00	13,989,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,000,000.00	2,135,200.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	17,100,000.00	24,288,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	21,500,000.00	30,401,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,800,000.00	7,552,180.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	19,700,000.00	26,788,060.00	

BUONI POLIENNALI DEL TES	18,300,000.00	26,835,120.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	503,750.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	10,900,000.00	16,115,650.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,400,000.00	5,887,620.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	12,100,000.00	17,098,510.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	1,500,000.00	1,943,850.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	500,000.00	570,600.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	6,500,000.00	9,532,250.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	13,300,000.00	19,565,630.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	14,800,000.00	21,689,400.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	5,300,000.00	6,401,340.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,800,000.00	3,493,840.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	3,500,000.00	4,627,000.00	
BUONI POLIENNALI DEL TES	2,200,000.00	2,321,000.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,012,650.00	
FINNISH GOVERNMENT	600,000.00	643,449.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,533,211.50	
FINNISH GOVERNMENT	2,200,000.00	2,368,015.32	
FINNISH GOVERNMENT	1,200,000.00	1,303,085.16	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	413,335.60	
FINNISH GOVERNMENT	2,900,000.00	3,280,625.00	
FINNISH GOVERNMENT	3,600,000.00	4,620,960.00	
FINNISH GOVERNMENT	100,000.00	109,610.62	
FINNISH GOVERNMENT	2,000,000.00	2,154,649.40	
FINNISH GOVERNMENT	3,300,000.00	4,276,275.30	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	437,221.20	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	903,200.00	
FINNISH GOVERNMENT	1,500,000.00	1,803,540.00	
FINNISH GOVERNMENT	400,000.00	650,663.20	
FINNISH GOVERNMENT	800,000.00	1,095,992.00	
FRANCE (GOVT OF)	5,700,000.00	5,769,682.50	
FRANCE (GOVT OF)	8,000,000.00	8,112,800.00	
FRANCE (GOVT OF)	400,000.00	408,414.44	
FRANCE (GOVT OF)	3,000,000.00	3,090,450.00	
FRANCE (GOVT OF)	5,370,000.00	5,901,479.64	

FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	103,565.00	
FRANCE (GOVT OF)	10,500,000.00	12,048,330.00	
FRANCE (GOVT OF)	11,000,000.00	11,768,900.00	
FRANCE (GOVT OF)	1,800,000.00	1,940,598.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,500,000.00	2,807,625.00	
FRANCE (GOVT OF)	2,000,000.00	2,224,826.00	
FRANCE (GOVT OF)	12,000,000.00	15,744,660.00	
FRANCE (GOVT OF)	4,000,000.00	4,807,100.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	121,030.00	
FRANCE (GOVT OF)	100,000.00	132,463.50	
FRANCE (GOVT OF)	7,600,000.00	11,000,779.60	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2,800,000.00	2,908,332.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1,100,000.00	1,113,959.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	11,800,000.00	12,708,954.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,185,900.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	9,500,000.00	10,494,935.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	7,371,799.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,600,000.00	19,362,675.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	9,726,552.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	29,300,000.00	35,637,590.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,000,000.00	3,402,597.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	19,800,000.00	28,170,846.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6,000,000.00	6,635,400.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	34,100,000.00	43,859,420.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,200,000.00	9,185,760.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	27,000,000.00	42,893,118.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	13,500,000.00	16,357,450.50	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	22,100,000.00	39,861,328.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	7,300,000.00	12,916,576.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,300,000.00	5,808,788.70	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	17,500,000.00	33,964,070.00	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	20,700,000.00	36,124,729.20	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5,200,000.00	11,208,100.80	
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3,200,000.00	7,252,768.00	
IRISH GOVERNMENT	500,000.00	533,380.00	

IRISH GOVERNMENT	2,430,000.00	3,233,528.10	
IRISH GOVERNMENT	6,000,000.00	6,598,680.00	
IRISH TSY 0.8% 2022	400,000.00	415,248.00	
IRISH TSY 1.10% 2029	600,000.00	672,114.00	
IRISH TSY 1.3% 2033	2,400,000.00	2,762,400.00	
IRISH TSY 1.35% 2031	2,000,000.00	2,295,000.00	
IRISH TSY 1.5% 2050	500,000.00	611,030.00	
IRISH TSY 1.7% 2037	1,300,000.00	1,594,918.00	
IRISH TSY 1% 2026	4,600,000.00	5,035,896.00	
IRISH TSY 2.4% 2030	4,600,000.00	5,814,492.00	
IRISH TSY 2% 2045	2,800,000.00	3,791,790.80	
IRISH TSY 2022	300,000.00	306,375.00	
IRISH TSY 3.4% 2024	5,200,000.00	6,162,728.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	50,000.00	53,979.75	
NETHERLANDS GOVERNMENT	300,000.00	306,450.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	500,000.00	546,950.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	600,000.00	696,960.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,300,000.00	2,971,830.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,400,000.00	1,547,560.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	100,000.00	103,777.60	
NETHERLANDS GOVERNMENT	12,000,000.00	13,705,164.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,500,000.00	1,592,287.50	
NETHERLANDS GOVERNMENT	4,000,000.00	4,348,800.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,500,000.00	2,786,775.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	7,300,000.00	11,204,770.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	1,000,000.00	1,128,780.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	2,400,000.00	2,597,760.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,000,000.00	8,472,600.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,100,000.00	5,517,814.00	
NETHERLANDS GOVERNMENT	3,900,000.00	7,536,266.40	
NETHERLANDS GOVERNMENT	6,500,000.00	11,920,811.50	
REPUBLIC OF AUSTRIA	800,000.00	1,625,197.60	
REPUBLIC OF AUSTRIA	700,000.00	763,350.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,000,000.00	1,120,000.00	
REPUBLIC OF AUSTRIA	1,600,000.00	1,640,902.88	

	REPUBLIC OF AUSTRIA	200,000.00	227,972.20	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	4,124,000.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,550,000.00	1,718,011.63	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,347,775.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	3,700,000.00	4,165,996.50	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	1,300,000.00	1,454,414.39	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,400,000.00	7,404,480.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	2,000,000.00	2,197,170.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	7,600,000.00	11,819,178.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	4,000,000.00	5,534,892.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	400,000.00	698,504.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,700,000.00	10,026,824.40	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	5,300,000.00	7,167,720.00	
	REPUBLIC OF AUSTRIA	950,000.00	2,272,314.50	
	REPUBLIC OF IRELAND	3,350,000.00	3,902,046.50	
	SPANISH GOVERNMENT	16,000,000.00	25,098,460.80	
	SPANISH GOVERNMENT	14,900,000.00	25,414,930.00	
	SPANISH GOVERNMENT	1,000,000.00	1,620,923.00	
小計	銘柄数：257	1,454,850,000.00	1,929,414,422.95	
			(227,690,196,052)	
	組入時価比率：37.6%		37.9%	
英債券	UK TREASURY	350,000.00	361,732.00	
	UK TREASURY	5,200,000.00	5,273,424.00	
	UK TREASURY	140,000.00	158,967.20	
	UK TREASURY	770,000.00	821,928.80	
	UK TREASURY	3,150,000.00	3,436,272.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	2,908,729.00	
	UK TREASURY	1,500,000.00	1,561,050.00	
	UK TREASURY	22,700,000.00	23,007,812.00	
	UK TREASURY	5,000,000.00	5,372,550.00	
	UK TREASURY	1,200,000.00	1,233,468.00	
	UK TREASURY	8,750,000.00	9,782,675.00	
	UK TREASURY	10,750,000.00	13,474,157.50	
	UK TREASURY	1,000,000.00	1,099,100.00	
	UK TREASURY	700,000.00	753,669.00	

	UK TREASURY	9,630,000.00	12,670,865.10	
	UK TREASURY	200,000.00	220,764.00	
	UK TREASURY	6,900,000.00	10,402,716.00	
	UK TREASURY	5,700,000.00	8,331,120.00	
	UK TREASURY	5,250,000.00	7,578,900.00	
	UK TREASURY	6,600,000.00	10,134,960.00	
	UK TREASURY	2,900,000.00	4,449,470.00	
	UK TREASURY	2,300,000.00	3,885,850.00	
	UK TREASURY	3,700,000.00	5,962,180.00	
	UK TREASURY	3,500,000.00	5,728,800.00	
	UK TREASURY	5,500,000.00	9,541,400.00	
	UK TREASURY	23,600,000.00	36,799,480.00	
	UK TREASURY	6,700,000.00	11,883,120.00	
	UK TREASURY	2,800,000.00	3,133,200.00	
	UK TREASURY	2,600,000.00	3,086,720.00	
	UK TREASURY	5,350,000.00	9,879,310.00	
	UK TREASURY	8,750,000.00	15,521,625.00	
	UK TREASURY	800,000.00	950,864.00	
	UK TREASURY	3,600,000.00	4,490,640.00	
	UK TREASURY	200,000.00	314,300.00	
	UK TREASURY	2,950,000.00	5,857,520.00	
	UK TSY 3 1/4% 2044	22,900,000.00	34,006,500.00	
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	6,800,000.00	13,585,040.00	
小計	銘柄数 : 37	203,340,000.00	287,660,878.60	
			(37,157,155,688)	
	組入時価比率 : 6.1%		6.2%	
スウェーデンク ローナ	SWEDISH GOVERNMENT	1,700,000.00	1,824,494.40	
	SWEDISH GOVERNMENT	44,050,000.00	49,329,392.50	
	SWEDISH GOVERNMENT	29,900,000.00	32,787,431.04	
	SWEDISH GOVERNMENT	34,350,000.00	40,739,100.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	12,000,000.00	13,425,840.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	16,800,000.00	18,716,567.52	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,000,000.00	11,227,300.00	
	SWEDISH GOVERNMENT	10,500,000.00	17,700,967.20	
小計	銘柄数 : 8	159,300,000.00	185,751,092.66	

			(2,043,262,019)	
	組入時価比率：0.3%		0.3%	
ノルウェークローネ	NORWEGIAN GOVERNMENT	20,600,000.00	21,555,840.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	13,300,000.00	13,788,775.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	44,900,000.00	48,958,960.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,903,510.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	4,700,000.00	4,864,735.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	9,600,000.00	10,132,800.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,809,840.00	
	NORWEGIAN GOVERNMENT	7,500,000.00	8,038,500.00	
小計	銘柄数：8	112,500,000.00	120,052,960.00	
			(1,417,825,457)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
デンマーククローネ	KINGDOM OF DENMARK	2,700,000.00	2,739,150.00	
	KINGDOM OF DENMARK	29,500,000.00	32,128,709.60	
	KINGDOM OF DENMARK	16,070,000.00	17,742,887.00	
	KINGDOM OF DENMARK	36,600,000.00	42,721,350.00	
	KINGDOM OF DENMARK	12,200,000.00	13,556,640.00	
	KINGDOM OF DENMARK	5,900,000.00	6,620,390.00	
	KINGDOM OF DENMARK	40,500,000.00	83,243,700.00	
小計	銘柄数：7	143,470,000.00	198,752,826.60	
			(3,146,257,245)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,200,000.00	3,347,584.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	1,912,350.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	13,500,000.00	14,742,675.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	19,200,000.00	19,578,956.16	
	POLAND GOVERNMENT BOND	37,300,000.00	40,953,535.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	11,400,000.00	11,913,000.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	10,200,000.00	11,050,782.00	
	POLAND GOVERNMENT BOND	14,600,000.00	19,966,390.60	
	POLAND GOVERNMENT BOND	3,700,000.00	4,093,393.62	
小計	銘柄数：9	115,000,000.00	127,558,666.38	
			(3,464,493,378)	
	組入時価比率：0.6%		0.6%	
豪ドル	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,541,189.05	

	AUSTRALIAN GOVERNMENT	11,100,000.00	12,059,572.80	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,737,674.32	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	8,017,800.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	800,000.00	840,400.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,100,000.00	9,517,844.25	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	7,200,000.00	7,882,920.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	13,200,000.00	15,062,846.04	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,780,000.00	15,640,164.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	12,100,000.00	15,638,922.09	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3,200,000.00	3,686,504.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	17,800,000.00	19,827,420.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2,100,000.00	2,447,920.02	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	10,100,000.00	12,310,423.38	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,400,000.00	1,649,480.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	500,000.00	581,622.55	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	8,400,000.00	12,149,381.16	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	2,230,015.86	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5,000,000.00	7,055,369.50	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	700,000.00	937,230.00	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1,500,000.00	1,900,255.65	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4,500,000.00	6,034,050.00	
小計	銘柄数：22	137,380,000.00	163,749,004.67	
			(11,814,490,686)	
	組入時価比率：1.9%		2.0%	
シンガポールドル	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,438,160.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,380,000.00	1,394,490.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	991,650.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,800,000.00	1,804,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,504,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	300,930.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,124,800.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	711,225.97	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,900,000.00	2,023,880.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,100,000.00	1,141,690.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	700,000.00	721,140.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,900,000.00	4,407,000.00	

小計	SINGAPORE GOVERNMENT	300,000.00	332,010.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2,400,000.00	2,679,600.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,442,970.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	800,000.00	850,400.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3,000,000.00	3,496,500.00	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1,000,000.00	1,182,260.00	
	銘柄数：18	29,280,000.00	31,547,605.97	(2,421,909,710)
組入時価比率：0.4%			0.4%	
リンギ	MALAYSIA GOVERNMENT	1,100,000.00	1,119,224.04	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	416,152.60	
	MALAYSIA GOVERNMENT	600,000.00	692,133.42	
	MALAYSIA GOVERNMENT	400,000.00	472,934.20	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	400,000.00	402,984.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	603,420.78	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,000,000.00	3,055,020.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,300,000.00	9,471,361.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	505,166.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,630,717.42	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	500,000.00	508,918.05	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	13,500,000.00	13,636,748.25	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,500,000.00	3,571,052.45	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,200,000.00	2,249,722.86	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,800,000.00	6,062,518.44	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	621,855.36	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	8,800,000.00	9,403,161.68	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,600,000.00	4,815,027.00	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	7,000,000.00	7,150,568.60	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,800,000.00	1,878,234.30	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,700,000.00	3,138,335.28	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,700,000.00	6,336,772.08	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	4,400,000.00	4,810,322.44	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	5,100,000.00	5,539,366.02	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	800,000.00	847,272.24	
MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	995,195.70		

小計	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	3,346,804.72
	MALAYSIAN GOVERNMENT	9,700,000.00	11,881,268.10
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,300,000.00	2,771,126.48
	銘柄数：29 組入時価比率：0.5%	103,600,000.00	110,933,385.41 (2,826,582,660) 0.5%
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	5,900,000.00	5,903,442.06
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	50,100,000.00	50,623,209.33
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	62,300,000.00	69,428,633.89
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,200,000.00	35,473,261.08
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,000,000.00	25,137,000.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	53,900,000.00	49,178,457.02
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6,800,000.00	6,334,569.24
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	38,100,000.00	27,266,047.83
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	32,000,000.00	28,406,400.00
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	11,800,000.00	10,802,488.18
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	30,600,000.00	21,263,067.90
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	89,000,000.00	78,776,623.40
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	43,200,000.00	38,137,236.48
	小計	銘柄数：13 組入時価比率：0.5%	491,900,000.00
合計			601,367,478,238 (601,367,478,238)

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 8月19日現在		
	契約額等(円)		時価(円)
		うち1年超	
市場取引以外の取引 為替予約取引 売建	1,252,638,506	-	1,255,377,000
			2,738,494

米ドル	615,298,256	-	617,120,000	1,821,744
ユーロ	506,927,450	-	507,443,000	515,550
英ポンド	51,456,800	-	51,664,000	207,200
デンマーククローネ	78,956,000	-	79,150,000	194,000
合計	1,252,638,506	-	1,255,377,000	2,738,494

(注) 時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2019年 8月19日現在)

資産の部	
流動資産	
預金	58,581,420
コール・ローン	52,566,533
国債証券	20,493,149,412
派生商品評価勘定	62,880
未収入金	66,972,965
未収利息	256,832,807
前払費用	10,589,959
流動資産合計	20,938,755,976
資産合計	
20,938,755,976	
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	234,437
未払解約金	76,279,941
未払利息	80
その他未払費用	202,500
流動負債合計	76,716,958
負債合計	
76,716,958	
純資産の部	
元本等	
元本	11,020,776,030
剰余金	

(2019年 8月19日現在)

期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,841,262,988
元本等合計	20,862,039,018
純資産合計	20,862,039,018
負債純資産合計	20,938,755,976

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月19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	1.8930円
(10,000口当たり純資産額)	(18,930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 2019年 2月19日 至 2019年 8月19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>

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

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

3.金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 8月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	
貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありませ	
ん。	
2. 時価の算定方法	
国債証券	
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。	
派生商品評価勘定	
デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。	
コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務	
これらの科目は短期間で決済されるため、帳簿価額は時価と近似していることから、当該帳簿価額を時価としており	
ます。	

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 8月19日現在	
期首	2019年 2月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	9,969,921,649円
同期中における追加設定元本額	2,197,183,127円
同期中における一部解約元本額	1,146,328,746円
期末元本額	11,020,776,030円
期末元本額の内訳*	
野村インデックスファンド・新興国債券・為替ヘッジ型	1,317,133,912円
ネクストコア	105,783,165円
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	580,674,851円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,481,083円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,533,637円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,952,458円

インデックス・ブレンド(タイプ)	1,323,503円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,685,367円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	1,125,924,842円
野村外国債券(含む新興国)インデックス Bコース(野村投資一任口座向け)	1,976,833,458円
NEXT FUNDS 新興国債券・J.P.モルガン・エマージング・マーケット・ボンド・インデックス・プラス(為替ヘッジなし)運動型上場投信	114,649,603円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)外国債券	300,208,672円
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	10,111,024円
ノムラ新興国債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	3,466,893円
新興国債券・インデックスF(適格機関投資家専用)	335,114,715円
野村新興国債券インデックスファンド(確定拠出年金向け)	4,100,337,586円
野村DC運用戦略ファンド	987,529,024円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	50,032,237円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年8月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年8月19日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル	ARGENT-GLOBAL	640,000.00	504,284.99	
		ARGENT-GLOBAL	420,000.00	318,871.35	
		ARGENT-GLOBAL	2,300,000.00	1,015,473.00	
		BRAZIL GLOBAL	650,000.00	842,562.50	
		BRAZIL GLOBAL	1,070,000.00	1,492,660.70	
		BRAZIL GLOBAL	900,000.00	1,165,509.00	
		COLOMBIA GLOBAL	250,000.00	310,940.00	
		COLOMBIA GLOBAL	1,220,000.00	1,753,762.20	
		CROATIA	500,000.00	528,500.00	
		CROATIA	1,100,000.00	1,218,294.00	
		CROATIA	1,000,000.00	1,151,230.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,630,000.00	1,695,216.30	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,300,000.00	1,300,013.00	
		FED REPUBLIC OF BRAZIL	2,300,000.00	2,443,198.00	

FED REPUBLIC OF BRAZIL	900,000.00	1,050,759.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	2,046,794.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,800,000.00	2,045,268.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,600,000.00	1,691,016.00	
FED REPUBLIC OF BRAZIL	1,900,000.00	2,160,081.50	
HUNGARY	1,100,000.00	1,212,646.60	
HUNGARY	1,350,000.00	1,534,531.50	
HUNGARY	1,400,000.00	1,583,162.00	
INDONESIA GLOBAL	1,200,000.00	1,357,444.80	
MEXICO GLOBAL	1,080,000.00	1,448,550.00	
PANAMA GLOBAL	300,000.00	381,378.00	
PANAMA GLOBAL	250,000.00	385,002.50	
PANAMA GLOBAL	1,150,000.00	1,657,449.00	
PERU GLOBAL	900,000.00	1,161,000.00	
PERU GLOBAL	670,000.00	999,144.20	
PHILIPPINES GLOBAL	2,100,000.00	2,242,751.07	
PHILIPPINES GLOBAL	750,000.00	1,239,431.70	
PHILIPPINES GLOBAL	800,000.00	1,205,244.48	
PHILIPPINES GLOBAL	500,000.00	695,354.85	
REPUBLIC OF ARGENTINA	900,000.00	476,550.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,400,000.00	1,512,000.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,650,000.00	1,480,687.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	600,000.00	319,500.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	4,100,000.00	2,224,250.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000.00	1,207,500.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,300,000.00	1,196,000.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,500,000.00	787,500.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,100,000.00	1,100,400.00	
REPUBLIC OF ARGENTINA	2,150,000.00	1,141,671.50	
REPUBLIC OF ARGENTINA	1,300,000.00	676,000.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,100,000.00	1,140,436.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	600,000.00	603,756.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,900,000.00	2,014,494.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,000,000.00	1,096,375.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000.00	1,390,350.00	

REPUBLIC OF COLOMBIA	1,200,000.00	1,345,212.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,320,000.00	1,725,913.20	
REPUBLIC OF COLOMBIA	1,300,000.00	1,639,625.00	
REPUBLIC OF COLOMBIA	2,500,000.00	2,955,650.00	
REPUBLIC OF HUNGARY	1,500,000.00	1,595,839.50	
REPUBLIC OF HUNGARY	600,000.00	1,003,763.40	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,039,783.50	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,332,957.08	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,300,000.00	1,389,329.89	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,500,000.00	1,669,969.65	
REPUBLIC OF INDONESIA	700,000.00	766,010.63	
REPUBLIC OF INDONESIA	400,000.00	425,416.88	
REPUBLIC OF INDONESIA	200,000.00	208,919.10	
REPUBLIC OF INDONESIA	900,000.00	977,834.16	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,261,925.50	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,000,000.00	1,516,502.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,200,000.00	1,460,797.56	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	906,685.20	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	1,145,299.28	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	959,662.32	
REPUBLIC OF INDONESIA	800,000.00	1,055,816.56	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,400,000.00	1,701,755.44	
REPUBLIC OF INDONESIA	1,100,000.00	1,225,375.58	
REPUBLIC OF INDONESIA	600,000.00	775,346.40	
REPUBLIC OF PANAMA	1,700,000.00	1,814,767.00	
REPUBLIC OF PANAMA	1,500,000.00	1,652,827.50	
REPUBLIC OF PANAMA	500,000.00	610,000.00	
REPUBLIC OF PANAMA	800,000.00	971,008.00	
REPUBLIC OF PERU	900,000.00	1,030,725.00	
REPUBLIC OF PERU	1,400,000.00	2,103,514.00	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,000,000.00	1,091,982.50	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	965,596.80	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,000,000.00	1,133,061.60	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,170,425.60	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	800,000.00	1,047,152.40	

REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000.00	2,034,585.50	
REPUBLIC OF PHILIPPINES	1,700,000.00	2,000,581.42	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	950,000.00	1,014,989.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	732,567.50	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,350,000.00	1,481,625.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	800,000.00	828,008.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	1,600,000.00	1,568,604.80	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	433,488.80	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	400,000.00	399,591.60	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	482,425.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	700,000.00	719,635.00	
REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	500,000.00	555,625.00	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	1,118,612.00	
REPUBLIC OF TURKEY	600,000.00	597,521.40	
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,727,871.50	
REPUBLIC OF TURKEY	700,000.00	642,166.00	
REPUBLIC OF TURKEY	900,000.00	936,954.00	
REPUBLIC OF TURKEY	400,000.00	353,077.20	
REPUBLIC OF TURKEY	1,300,000.00	1,176,678.10	
REPUBLIC OF TURKEY	2,100,000.00	2,014,662.30	
REPUBLIC OF TURKEY	1,100,000.00	989,268.50	
REPUBLIC OF TURKEY	1,500,000.00	1,429,117.50	
REPUBLIC OF TURKEY	950,000.00	894,209.35	
REPUBLIC OF TURKEY	1,200,000.00	1,034,356.80	
REPUBLIC OF TURKEY	2,400,000.00	1,867,372.80	
REPUBLIC OF TURKEY	1,700,000.00	1,561,572.40	
REPUBLIC OF TURKEY	1,900,000.00	1,586,471.50	
ROMANIA	1,200,000.00	1,323,742.80	
ROMANIA	900,000.00	963,567.00	
ROMANIA	500,000.00	547,650.00	
ROMANIA	600,000.00	798,687.60	
ROMANIA	600,000.00	700,020.00	
RUSSIA	1,312,500.00	1,482,619.68	
RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,052,466.00	
RUSSIAN FEDERATION	1,800,000.00	1,945,170.00	

	RUSSIAN FEDERATION	1,800,000.00	1,951,695.00	
	RUSSIAN FEDERATION	1,400,000.00	1,483,419.00	
	RUSSIAN FEDERATION	1,000,000.00	1,068,432.00	
	RUSSIAN FEDERATION	1,600,000.00	1,963,756.80	
	RUSSIAN FEDERATION	800,000.00	1,015,960.00	
	RUSSIAN FEDERATION	4,400,000.00	5,199,502.00	
	TURKEY GLOBAL	1,500,000.00	1,470,894.00	
	TURKEY GLOBAL	2,400,000.00	2,504,594.40	
	TURKEY GLOBAL	650,000.00	874,876.60	
	UKRAINE GOVERNMENT	600,000.00	611,581.20	
	UKRAINE GOVERNMENT	1,200,000.00	1,356,498.00	
	UKRAINE GOVERNMENT	1,600,000.00	1,580,380.80	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	665,000.00	681,957.50	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	409,000.00	424,505.19	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	709,000.00	735,091.20	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	700,000.00	729,750.00	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,249,441.20	
	UKRAINE GOVERNMENT REGS	1,200,000.00	1,219,560.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,501,188.00	
	UNITED MEXICAN STATES	400,000.00	407,254.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,100,000.00	1,136,850.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,950,000.00	2,056,811.25	
	UNITED MEXICAN STATES	1,200,000.00	1,244,400.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,300,000.00	1,379,313.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,300,000.00	2,441,473.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,600,000.00	1,658,800.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,110,000.00	2,642,796.10	
	UNITED MEXICAN STATES	1,500,000.00	1,631,250.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	2,069,750.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,700,000.00	1,815,617.00	
	UNITED MEXICAN STATES	1,400,000.00	1,447,264.00	
	UNITED MEXICAN STATES	2,000,000.00	2,155,020.00	
小計	銘柄数：151	185,805,500.00	192,586,687.46	
			(20,493,149,412)	
	組入時価比率：98.2%		100.0%	

合計		20,493,149,412	
		(20,493,149,412)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 8月19日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	25,470,720	-	25,533,600	62,880
米ドル	25,470,720	-	25,533,600	62,880
売建	55,093,563	-	55,328,000	234,437
米ドル	55,093,563	-	55,328,000	234,437
合計	-	-	-	171,557

(注)時価の算定方法

1 為替予約取引

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

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

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

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

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

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

新興国債券(現地通貨建て)マザーファンド

貸借対照表

(単位:円)

(2019年 8月19日現在)

資産の部
流動資産

(2019年 8月19日現在)

預金	37,740,034
コール・ローン	12,610,285
国債証券	9,077,942,837
未収利息	110,166,332
前払費用	11,782,270
流動資産合計	9,250,241,758
資産合計	9,250,241,758
負債の部	
流動負債	
未払解約金	8,442,006
未払利息	19
その他未払費用	424,700
流動負債合計	8,866,725
負債合計	8,866,725
純資産の部	
元本等	
元本	6,962,115,720
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2,279,259,313
元本等合計	9,241,375,033
純資産合計	9,241,375,033
負債純資産合計	9,250,241,758

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。
3. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益 約定日基準で計上しております。 為替差損益 約定日基準で計上しております。
4. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月19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	1.3274円
(10,000口当たり純資産額)	(13,274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 2019年 2月19日
至 2019年 8月19日

1. 金融商品に対する取組方針

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

2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク

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

当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。

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

3. 金融商品に係るリスク管理体制

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

市場リスクの管理

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

信用リスクの管理

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

流動性リスクの管理

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

(2) 金融商品の時価等に関する事項

2019年 8月19日現在

1. 貸借対照表計上額、時価及び差額

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

ん。

2. 時価の算定方法

国債証券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 8月19日現在

期首	2019年 2月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	5,992,467,619円
同期中における追加設定元本額	1,275,006,090円
同期中における一部解約元本額	305,357,989円
期末元本額	6,962,115,720円
期末元本額の内訳*	
野村資産設計ファンド2015	10,976,714円
野村資産設計ファンド2020	12,150,505円

野村資産設計ファンド2025		18,724,509円
野村資産設計ファンド2030		17,289,736円
野村資産設計ファンド2035		11,934,518円
野村資産設計ファンド2040		23,387,405円
野村資産設計ファンド2045		2,953,129円
野村インデックスファンド・新興国債券 ネクストコア		862,404,358円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス		84,930,258円
野村資産設計ファンド2050		232,215,702円
野村ターゲットデートファンド2016 2026 - 2028年目標型		3,636,562円
野村ターゲットデートファンド2016 2029 - 2031年目標型		2,173,538円
野村ターゲットデートファンド2016 2032 - 2034年目標型		734,280円
野村ターゲットデートファンド2016 2035 - 2037年目標型		535,210円
世界6資産分散ファンド		420,066円
ノムラFOFs用インデックスファンド・新興国債券(適格機関投資家専用)		171,772,159円
野村DC新興国債券(現地通貨建て)インデックスファンド		4,333,749,560円
野村DC運用戦略ファンド		381,222,062円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)		751,633,889円
野村資産設計ファンド(DC)2030		38,090,138円
野村資産設計ファンド(DC)2040		606,673円
野村資産設計ファンド(DC)2050		283,548円
		291,201円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年8月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年8月19日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	アルゼンチンペソ	REPUBLIC OF ARGENTINA	5,300,000.00	2,676,500.00	
		REPUBLIC OF ARGENTINA	13,300,000.00	7,115,500.00	
	小計	銘柄数: 2	18,600,000.00	9,792,000.00	
		組入時価比率: 0.2%		(18,996,480)	0.2%
	メキシコペソ	MEX BONOS DESARR FIX RT	12,100,000.00	11,989,769.00	
		MEX BONOS DESARR FIX RT	12,000,000.00	12,057,038.40	
MEX BONOS DESARR FIX RT		21,100,000.00	20,869,377.00		

	MEX BONOS DESARR FIX RT	10,000,000.00	10,469,342.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,500,000.00	8,527,483.50	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,000,000.00	12,186,200.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	21,150,000.00	21,820,032.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	8,600,000.00	9,512,288.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	7,900,000.00	8,312,064.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	6,200,000.00	6,511,922.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	2,700,000.00	3,414,474.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	13,600,000.00	15,182,496.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	9,700,000.00	10,080,919.00	
	MEX BONOS DESARR FIX RT	5,500,000.00	5,875,786.40	
	MEXICAN FIXED RATE BONDS	13,500,000.00	14,049,450.00	
小計	銘柄数：15	164,550,000.00	170,858,641.30	
			(926,053,835)	
	組入時価比率：10.0%		10.3%	
リアル	LETRA TESOURO NACIONAL	7,000,000.00	6,105,589.70	
	LETRA TESOURO NACIONAL	3,100,000.00	2,611,345.76	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	376,000.00	4,024,073.82	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	610,000.00	6,828,350.98	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	651,000.00	7,504,198.73	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	380,000.00	4,470,772.96	
	NOTA DO TESOURO NACIONAL	150,000.00	1,797,126.15	
小計	銘柄数：7	12,267,000.00	33,341,458.10	
			(885,549,127)	
	組入時価比率：9.6%		9.8%	
チリペソ	BONOS TESORERIA PESOS	170,000,000.00	180,041,118.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	280,000,000.00	319,877,348.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	275,000,000.00	334,215,392.50	
	BONOS TESORERIA PESOS	490,000,000.00	640,412,948.00	
	BONOS TESORERIA PESOS	265,000,000.00	406,879,410.00	
	REPUBLIC OF CHILE	220,000,000.00	226,168,800.00	
小計	銘柄数：6	1,700,000,000.00	2,107,595,016.50	
			(316,350,011)	
	組入時価比率：3.4%		3.5%	
コロンビアペソ	REPUBLIC OF COLOMBIA	4,040,000,000.00	4,224,022,000.00	
	REPUBLIC OF COLOMBIA	11,840,000,000.00	15,163,073,600.00	

小計	銘柄数：2	15,880,000,000.00	19,387,095,600.00	
			(600,999,963)	
	組入時価比率：6.5%		6.6%	
ソル	BONOS DE TESORERIA	1,400,000.00	1,561,825.86	
	BONOS DE TESORERIA	1,400,000.00	1,596,474.60	
	BONOS DE TESORERIA	1,600,000.00	1,843,708.64	
	BONOS DE TESORERIA	700,000.00	752,528.35	
	PERU BONO SOBERANO	800,000.00	1,019,243.60	
	PERU BONO SOBERANO	1,100,000.00	1,350,255.06	
	PERU BONO SOBERANO	1,120,000.00	1,389,473.68	
	REPUBLIC OF PERU	1,300,000.00	1,519,371.10	
小計	銘柄数：8	9,420,000.00	11,032,880.89	
			(347,315,090)	
	組入時価比率：3.8%		3.8%	
ウルグアイペソ	REPUBLICA ORIENT URUGUAY	4,000,000.00	3,400,000.00	
小計	銘柄数：1	4,000,000.00	3,400,000.00	
			(9,996,000)	
	組入時価比率：0.1%		0.1%	
ドミニカペソ	DOMINICAN REPUBLIC	8,000,000.00	8,433,360.00	
小計	銘柄数：1	8,000,000.00	8,433,360.00	
			(17,541,388)	
	組入時価比率：0.2%		0.2%	
トルコリラ	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,000,000.00	944,500.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	700,000.00	630,350.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,550,000.00	2,270,775.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	1,746,100.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,390,000.00	1,180,110.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,300,000.00	2,139,000.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,270,000.00	1,780,815.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	520,000.00	440,960.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,610,000.00	1,286,390.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,020,000.00	758,880.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,300,000.00	1,071,850.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,200,000.00	986,640.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	2,100,000.00	1,684,200.00	
	TURKEY GOVERNMENT BOND	1,400,000.00	1,240,400.00	

小計	銘柄数：14 組入時価比率：3.7%	21,260,000.00	18,160,970.00 (346,329,697) 3.8%
チェココルナ	CZECH REPUBLIC	3,500,000.00	3,485,793.85
	CZECH REPUBLIC	6,700,000.00	6,896,366.28
	CZECH REPUBLIC	26,900,000.00	26,445,295.85
	CZECH REPUBLIC	28,900,000.00	29,204,776.51
	CZECH REPUBLIC	20,200,000.00	20,311,908.00
小計	銘柄数：5 組入時価比率：4.3%	86,200,000.00	86,344,140.49 (396,319,604) 4.4%
フォリント	HUNGARY GOVERNMENT BOND	28,000,000.00	30,605,582.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	25,000,000.00	25,220,190.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	120,000,000.00	126,382,800.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	50,000,000.00	59,417,860.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	152,000,000.00	158,373,892.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	77,000,000.00	94,509,800.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	142,000,000.00	157,610,642.20
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	63,000,000.00	79,469,460.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	86,000,000.00	95,477,200.00
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	182,000,000.00	206,788,072.40
	HUNGARY GOVERNMENT BOND	57,000,000.00	83,094,753.90
小計	銘柄数：11 組入時価比率：4.4%	982,000,000.00	1,116,950,252.50 (406,011,416) 4.5%
ズロチ	POLAND GOVERNMENT BOND	3,730,000.00	3,902,027.60
	POLAND GOVERNMENT BOND	800,000.00	804,432.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	2,580,000.00	2,817,489.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,900,000.00	1,957,760.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	4,740,000.00	5,204,283.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	5,600,000.00	5,852,000.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	1,500,000.00	1,578,387.00
	POLAND GOVERNMENT BOND	7,000,000.00	7,583,870.00
小計	銘柄数：8 組入時価比率：8.7%	27,850,000.00	29,700,248.60 (806,658,751) 8.9%

ルーブル	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	8,000,000.00	8,103,320.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	31,000,000.00	31,066,185.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	60,500,000.00	61,534,550.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,000,000.00	37,051,800.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	48,000,000.00	47,159,040.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	26,300,000.00	26,738,158.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	59,000,000.00	61,096,270.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	20,000,000.00	21,000,000.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	61,700,000.00	61,317,460.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	35,000,000.00	38,437,350.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	37,500,000.00	38,580,000.00	
	RUSSIA GOVT BOND - OFZ	10,000,000.00	9,907,050.00	
	小計	銘柄数：12 組入時価比率：7.7%	434,000,000.00	441,991,183.00 (711,605,804) 7.8%
レイ	ROMANIA	2,290,000.00	2,288,660.35	
	ROMANIA	300,000.00	313,858.50	
	ROMANIA	500,000.00	507,430.00	
	ROMANIA	400,000.00	400,620.00	
	ROMANIA	1,500,000.00	1,503,067.50	
	ROMANIA	550,000.00	593,832.25	
	ROMANIA	1,100,000.00	1,084,451.50	
	ROMANIA	920,000.00	965,825.20	
	ROMANIA	1,010,000.00	1,143,143.25	
	小計	銘柄数：9 組入時価比率：2.4%	8,570,000.00	8,800,888.55 (219,670,178) 2.4%
リング	MALAYSIA GOVERNMENT	300,000.00	312,114.45	
	MALAYSIA GOVERNMENT	3,300,000.00	3,439,174.20	
	MALAYSIA GOVERNMENT	1,000,000.00	1,182,335.50	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	1,100,000.00	1,106,271.43	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	620,000.00	631,370.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,800,000.00	2,828,931.28	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,500,000.00	2,550,751.75	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,600,000.00	2,717,680.68	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	600,000.00	624,911.22	

小計	MALAYSIAN GOVERNMENT	2,000,000.00	2,088,688.80	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	3,300,000.00	3,443,429.55	
	MALAYSIAN GOVERNMENT	900,000.00	952,350.39	
	銘柄数：12	21,020,000.00	21,878,010.05	(557,451,696)
	組入時価比率：6.0%			6.1%
パーツ	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,200,000.00	8,622,481.22	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	23,000,000.00	23,300,883.70	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	14,000,000.00	14,281,082.20	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000.00	23,506,913.43	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	22,000,000.00	22,933,057.40	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	4,000,000.00	4,588,655.60	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	21,700,000.00	22,788,671.64	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	24,500,000.00	27,601,646.10	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	12,500,000.00	16,353,380.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	15,000,000.00	18,559,413.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	8,200,000.00	10,370,444.06	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	22,500,000.00	28,879,326.00	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	9,900,000.00	12,864,470.85	
	THAILAND GOVERNMENT BOND	11,000,000.00	13,531,059.30	
	小計	銘柄数：14	218,200,000.00	248,181,484.50
	組入時価比率：9.3%			9.4%
フィリピンペソ	REPUBLIC OF PHILIPPINES	10,000,000.00	10,125,100.00	
	小計	銘柄数：1	10,000,000.00	10,125,100.00
	組入時価比率：0.2%			0.2%
ルピア	INDONESIA GOVERNMENT	2,700,000,000.00	2,855,628,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,700,000,000.00	1,886,728,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	7,780,000,000.00	7,874,916,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	8,700,000,000.00	8,399,850,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	9,230,000,000.00	9,795,891,300.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	9,600,000,000.00	10,139,328,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	5,580,000,000.00	6,618,828,600.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	9,150,000,000.00	9,008,724,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	12,500,000,000.00	11,507,875,000.00	

	INDONESIA GOVERNMENT	5,530,000,000.00	6,085,156,700.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	6,400,000,000.00	6,788,800,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	1,110,000,000.00	1,343,422,344.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,400,000,000.00	2,750,400,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,100,000,000.00	4,271,913,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	3,200,000,000.00	3,140,640,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	4,900,000,000.00	4,446,750,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	8,680,000,000.00	9,174,760,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	11,000,000,000.00	11,482,130,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	900,000,000.00	877,365,000.00	
	INDONESIA GOVERNMENT	2,500,000,000.00	2,639,550,000.00	
小計	銘柄数：20	117,660,000,000.00	121,088,655,944.00	
			(908,164,919)	
	組入時価比率：9.8%		10.0%	
ランド	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	440,000.00	440,256.69	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,700,000.00	8,790,856.71	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	17,600,000.00	19,613,867.68	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,400,000.00	7,800,402.96	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,460,000.00	8,764,434.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,000,000.00	6,386,812.60	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,000,000.00	3,726,217.20	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	10,800,000.00	7,728,958.44	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8,800,000.00	7,811,760.00	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,100,000.00	6,499,802.21	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	4,450,000.00	3,092,178.17	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7,300,000.00	6,461,453.38	
	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	19,500,000.00	17,214,724.80	
小計	銘柄数：13	114,550,000.00	104,331,724.84	
			(726,148,804)	
	組入時価比率：7.9%		8.0%	
合計			9,077,942,837	
			(9,077,942,837)	

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

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

J - R E I Tインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)	
(2019年 8月19日現在)	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	797,638,200
投資証券	43,921,932,220
派生商品評価勘定	81,133,884
未収配当金	267,855,528
流動資産合計	45,068,559,832
資産合計	45,068,559,832
負債の部	
流動負債	
前受金	63,774,900
未払金	69,380,363
未払解約金	23,820,359
未払利息	1,228
流動負債合計	156,976,850
負債合計	156,976,850
純資産の部	
元本等	
元本	17,718,806,355
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	27,192,776,627
元本等合計	44,911,582,982
純資産合計	44,911,582,982
負債純資産合計	45,068,559,832

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>投資証券 原則として時価で評価しております。</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 取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。</p>
2. 費用・収益の計上基準	<p>受取配当金 原則として配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。</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>

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月19日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2,5347円
(10,000口当たり純資産額)	(25,347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 2019年 2月19日 至 2019年 8月19日	
1. 金融商品に対する取組方針	
当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。	
2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク	
当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。	
当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。	
これらは、REITの価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。	
当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。	
3. 金融商品に係るリスク管理体制	
委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。	
市場リスクの管理	
市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。	
信用リスクの管理	
信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。	
流動性リスクの管理	
流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。	

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 8月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	

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

ん。

2. 時価の算定方法

投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 8月19日現在	
期首	2019年 2月19日
本報告書における開示対象ファンドの期首における当ファンドの元本額	17,119,807,358円
同期中における追加設定元本額	2,283,648,996円
同期中における一部解約元本額	1,684,649,999円
期末元本額	17,718,806,355円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,655,113,163円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,403,311,527円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	737,422,653円
野村資産設計ファンド2015	17,061,343円
野村資産設計ファンド2020	16,996,848円
野村資産設計ファンド2025	18,709,241円
野村資産設計ファンド2030	19,003,051円
野村資産設計ファンド2035	17,888,246円
野村資産設計ファンド2040	32,715,639円
野村資産設計ファンド2045	3,060,014円
野村インデックスファンド・J-REIT	2,690,037,357円
ネクストコア	143,068,597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	679,684,518円
野村J-REITインデックス(野村SMA・EW向け)	1,915,365,953円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	887,379,348円
野村資産設計ファンド2050	4,624,745円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,591,585円
インデックス・ブレンド(タイプ)	881,733円
インデックス・ブレンド(タイプ)	3,310,904円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,014,445円
インデックス・ブレンド(タイプ)	4,583,001円
野村6資産均等バランス	433,138,529円
野村世界REITインデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	86,410,894円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	79,566,187円
ノムラFOFs用インデックスファンド・J-REIT(適格機関投資家専用)	785,994,200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)	1,930,550,002円
J-REITインデックスファンド(適格機関投資家専用)	1,719,745,712円

野村DC運用戦略ファンド	1,345,737,057円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	76,731,254円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	2,497,846円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,640,786円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	2,536,073円
野村資産設計ファンド(DC)2030	666,805円
野村資産設計ファンド(DC)2040	396,714円
野村資産設計ファンド(DC)2050	370,385円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年8月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年8月19日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	日本円	エスコンジャパンリート投資法人 投資証券	429	49,678,200	
		サンケイリアルエステート投資法人 投資証券	413	49,560,000	
		日本アコモデーションファンド投資 法人 投資証券	1,390	942,420,000	
		M C U B S M i d C i t y 投資法 人 投資証券	4,962	554,751,600	
		森ヒルズリート投資法人 投資証券	4,813	787,888,100	
		産業ファンド投資法人 投資証券	5,147	757,638,400	
		アドバンス・レジデンス投資法人 投資証券	3,873	1,320,693,000	
		ケネディクス・レジデンシャル・ネ クスト投資法人 投資証券	2,603	511,489,500	
		アクティブ・プロパティーズ投資 法人 投資証券	2,096	1,108,784,000	
		G L P 投資法人 投資証券	10,418	1,418,931,600	
		コンフォリア・レジデンシャル投資 法人 投資証券	1,742	573,118,000	

日本プロロジスリート投資法人 投資証券	6,010	1,701,431,000	
星野リゾート・リート投資法人 投資証券	636	354,252,000	
Oneリート投資法人 投資証券	652	204,076,000	
イオンリート投資法人 投資証券	4,294	581,407,600	
ヒューリックリート投資法人 投資証券	3,400	647,700,000	
日本リート投資法人 投資証券	1,359	570,100,500	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人 投資証券	26,873	517,036,520	
日本ヘルスケア投資法人 投資証券	203	36,661,800	
積水ハウス・リート投資法人 投資証券	12,230	1,105,592,000	
トーセイ・リート投資法人 投資証券	769	99,354,800	
ケネディクス商業リート投資法人 投資証券	1,533	397,813,500	
ヘルスケア&メディカル投資法人 投資証券	892	118,903,600	
サムティ・レジデンシャル投資法人 投資証券	837	97,092,000	
野村不動産マスターファンド投資法人 投資証券	13,045	2,445,937,500	
いちごホテルリート投資法人 投資証券	693	82,189,800	
ラサールロジポート投資法人 投資証券	3,471	494,964,600	
スターアジア不動産投資法人 投資証券	1,388	159,897,600	
マリモ地方創生リート投資法人 投資証券	360	42,876,000	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人 投資証券	1,030	438,265,000	
大江戸温泉リート投資法人 投資証券	711	62,212,500	
さくら総合リート投資法人 投資証券	905	86,337,000	
投資法人みらい 投資証券	4,537	259,516,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人 投資証券	981	139,988,700	
三菱地所物流リート投資法人 投資	668	211,422,000	

証券			
C R E ロジスティクスファンド投資 法人 投資証券	587	77,366,600	
ザイマックス・リート投資法人 投 資証券	607	80,609,600	
タカラレーベン不動産投資法人 投 資証券	887	106,351,300	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス 投資法人 投資証券	647	68,905,500	
日本ビルファンド投資法人 投資証 券	4,051	3,192,188,000	
ジャパンリアルエステイト投資法 人 投資証券	4,183	2,932,283,000	
日本リテールファンド投資法人 投 資証券	7,906	1,741,691,800	
オリックス不動産投資法人 投資証 券	8,334	1,876,816,800	
日本プライムリアルティ投資法人 投資証券	2,648	1,308,112,000	
プレミア投資法人 投資証券	3,778	558,388,400	
東急リアル・エステート投資法人 投資証券	2,804	563,604,000	
グローバル・ワン不動産投資法人 投資証券	2,905	419,772,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人 投資証券	9,392	1,897,184,000	
森トラスト総合リート投資法人 投 資証券	2,989	565,518,800	
インヴィンシブル投資法人 投資証 券	18,349	1,110,114,500	
フロンティア不動産投資法人 投資 証券	1,423	648,888,000	
平和不動産リート投資法人 投資証 券	2,605	341,255,000	
日本ロジスティクスファンド投資法 人 投資証券	2,733	718,232,400	
福岡リート投資法人 投資証券	2,163	393,666,000	
ケネディクス・オフィス投資法人 投資証券	1,294	1,044,258,000	
いちごオフィスリート投資法人 投 資証券	3,239	337,179,900	
大和証券オフィス投資法人 投資証	965	811,565,000	

	券			
	阪急阪神リート投資法人 投資証券	1,889	298,273,100	
	スタートプロシード投資法人 投資証券	651	119,979,300	
	大和ハウスリート投資法人 投資証券	5,639	1,559,747,400	
	ジャパン・ホテル・リート投資法人 投資証券	13,475	1,152,112,500	
	日本賃貸住宅投資法人 投資証券	4,705	449,798,000	
	ジャパンエクセレント投資法人 投資証券	3,746	618,090,000	
小計	銘柄数：63 組入時価比率：97.8%	239,957	43,921,932,220	100.0%
合計			43,921,932,220	

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

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 8月19日現在			
	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	906,920,100	-	988,105,500	81,133,884
合計	906,920,100	-	988,105,500	81,133,884

(注) 時価の算定方法

1 先物取引

国内先物取引について

先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段を用いております。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

海外REITインデックス マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 8月19日現在)

資産の部

流動資産

(2019年 8月19日現在)

預金	86,144,204
コール・ローン	32,316,788
投資証券	26,742,618,566
派生商品評価勘定	4,243,233
未収入金	2,053,473
未収配当金	68,851,922
差入委託証拠金	46,706,774
流動資産合計	26,982,934,960
資産合計	26,982,934,960
負債の部	
流動負債	
未払金	43,629,330
未払解約金	2,692,798
未払利息	49
その他未払費用	351,300
流動負債合計	46,673,477
負債合計	46,673,477
純資産の部	
元本等	
元本	11,229,294,105
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	15,706,967,378
元本等合計	26,936,261,483
純資産合計	26,936,261,483
負債純資産合計	26,982,934,960

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

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

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

(貸借対照表に関する注記)

2019年 8月19日現在	
1. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2,3987円
(10,000口当たり純資産額)	(23,987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;">自 2019年 2月19日 至 2019年 8月19日</p>
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、REITの価格変動リスク、為替変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する資産の価格変動リスクの低減を目的として、REIT指数先物取引を行っております。</p> <p>当ファンドは、信託財産に属する外貨建資金の受渡を行うことを目的として、為替予約取引を利用しております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</p> <p> 市場リスクの管理</p> <p>市場リスクに関しては、資産配分等の状況を常時、分析・把握し、投資方針に沿っているか等の管理を行っております。</p> <p> 信用リスクの管理</p> <p>信用リスクに関しては、発行体や取引先の財務状況等に関する情報収集・分析を常時、継続し、格付等の信用度に応じた組入制限等の管理を行っております。</p> <p> 流動性リスクの管理</p> <p>流動性リスクに関しては、必要に応じて市場流動性の状況を把握し、取引量や組入比率等の管理を行っております。</p>

(2)金融商品の時価等に関する事項

2019年 8月19日現在	
1. 貸借対照表計上額、時価及び差額	

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

ん。

2. 時価の算定方法

投資証券

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

派生商品評価勘定

デリバティブ取引については、附属明細表に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

(その他の注記)

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 8月19日現在	
期首	2019年 2月19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	10,568,270,267円
同期中における追加設定元本額	1,706,501,966円
同期中における一部解約元本額	1,045,478,128円
期末元本額	11,229,294,105円
期末元本額の内訳*	
野村世界6資産分散投信(安定コース)	1,666,066,412円
野村世界6資産分散投信(分配コース)	2,419,109,778円
野村世界6資産分散投信(成長コース)	742,303,313円
野村資産設計ファンド2015	17,170,376円
野村資産設計ファンド2020	17,109,351円
野村資産設計ファンド2025	18,833,086円
野村資産設計ファンド2030	19,122,954円
野村資産設計ファンド2035	18,005,057円
野村資産設計ファンド2040	32,932,001円
野村資産設計ファンド2045	3,080,265円
野村インデックスファンド・外国REIT	1,390,372,311円
ネクストコア	53,235,453円
野村インデックスファンド・海外5資産バランス	261,589,994円
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	887,079,030円
野村資産設計ファンド2050	4,655,080円
インデックス・ブレンド(タイプ)	2,006,274円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,542,809円
インデックス・ブレンド(タイプ)	5,924,981円
インデックス・ブレンド(タイプ)	1,894,561円
インデックス・ブレンド(タイプ)	7,413,329円
野村6資産均等バランス	436,005,029円
NEXT FUNDS 外国REIT・S&P先進国REIT指数(除く日本・為替ヘッジなし)連動型上場投信	651,595,224円
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)REIT	701,973,427円
ノムラ海外REITインデックス・ファンドVA(適格機関投資家専用)	368,935,645円
ノムラFOFs用インデックスファンド・外国REIT(適格機関投資家専用)	997,307,762円
野村DC運用戦略ファンド	470,723,797円

野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	25,144,382円
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	2,514,350円
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	1,651,631円
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	2,553,008円
野村資産設計ファンド(DC)2030	671,214円
野村資産設計ファンド(DC)2040	399,363円
野村資産設計ファンド(DC)2050	372,858円

*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年8月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年8月19日現在)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル	ACADIA REALTY TRUST	17,100	473,670.00	
		AGREE REALTY CORP	8,500	614,295.00	
		ALEXANDERS INC	750	270,397.50	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	22,790	3,375,199.00	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	9,300	437,658.00	
		AMERICAN CAMPUS COMMUNITIES	27,600	1,302,444.00	
		AMERICAN FINANCE TRUST INC	12,000	147,360.00	
		AMERICAN HOMES 4 RENT-A	52,900	1,317,739.00	
		AMERICOLD REALTY TRUST	38,900	1,397,677.00	
		APARTMENT INVT&MGMT CO-A	30,000	1,519,800.00	
		APPLE HOSPITALITY REIT INC	42,400	666,952.00	
		ASHFORD HOSPITALITY TRUST	15,600	45,708.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	28,270	5,819,096.80	
		BLUEROCK RESIDENTIAL GROWTH	4,200	51,954.00	
		BOSTON PROPERTIES	31,330	4,016,819.30	
		BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	6,000	55,560.00	
		BRANDYWINE REALTY TRUST	35,000	503,650.00	
		BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	60,900	1,127,259.00	

BROOKFIELD PROPERTY REIT INC CLASS A	18,900	360,990.00	
BRT APARTMENTS CORP	1,600	22,992.00	
CAMDEN PROPERTY TRUST	19,700	2,091,746.00	
CARETRUST REIT INC ACQUIRES	18,900	439,992.00	
CBL&ASSOCIATES PROPERTIES	31,000	25,503.70	
CEDAR REALTY TRUST INC	16,000	37,600.00	
CHATHAM LODGING TRUST	9,500	161,785.00	
CHESAPEAKE LODGING TRUST	12,300	320,292.00	
CITY OFFICE REIT INC	8,000	104,800.00	
CLIPPER REALTY INC	2,400	26,448.00	
COLONY CAPITAL INC	96,000	427,200.00	
COLUMBIA PROPERTY TRUST INC	23,200	497,408.00	
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	3,500	151,200.00	
CORECIVIC INC	23,600	417,012.00	
CORESITE REALTY CORP	7,410	841,627.80	
CORPORATE OFFICE PROPERTIES	22,500	648,900.00	
COUSINS PROPERTIES INC	29,800	1,031,080.00	
CUBESMART	38,500	1,356,740.00	
CYRUSONE INC	23,000	1,609,770.00	
DIAMONDROCK HOSPITALITY CO	41,500	390,100.00	
DIGITAL REALTY TRUST INC	42,210	5,220,110.70	
DOUGLAS EMMETT INC	32,700	1,371,111.00	
DUKE REALTY CORP	73,000	2,427,980.00	
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTIES INC	15,900	329,289.00	
EASTGROUP PROPERTIES	7,380	920,655.00	
EMPIRE STATE REALTY TRUST IN	28,000	373,520.00	
EPR PROPERTIES	15,260	1,157,013.20	
EQUITY COMMONWEALTH	24,500	833,980.00	
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	18,290	2,468,784.20	
EQUITY RESIDENTIAL	75,120	6,132,796.80	
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	14,700	325,017.00	
ESSEX PROPERTY TRUST INC	13,330	4,195,217.60	
EXTRA SPACE STORAGE INC	25,780	3,109,583.60	
FARMLAND PARTNERS INC	5,500	35,200.00	

FEDERAL REALTY INVS TRUST	15,260	1,993,719.00	
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	25,500	984,045.00	
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	13,700	383,463.00	
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	22,800	178,980.00	
FRONT YARD RESIDENTIAL CORP	10,000	112,600.00	
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	40,900	1,532,114.00	
GEO GROUP INC/THE	25,100	443,015.00	
GETTY REALTY CORP	7,200	215,784.00	
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	6,600	147,972.00	
GLADSTONE LAND CORP	4,200	48,888.00	
GLOBAL MEDICAL REIT INC	5,000	55,050.00	
GLOBAL NET LEASE INC	16,600	327,518.00	
HCP INC	96,500	3,327,320.00	
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	26,000	859,820.00	
HEALTHCARE TRUST OF AMERICA	41,900	1,178,228.00	
HERSHA HOSPITALITY TRUST	7,800	115,050.00	
HIGHWOODS PROPERTIES INC	20,800	908,336.00	
HOSPITALITY PROPERTIES TRUST	33,200	819,708.00	
HOST HOTELS & RESORTS INC	149,700	2,372,745.00	
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	31,600	1,064,288.00	
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	18,700	250,206.00	
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERTIES	13,700	291,262.00	
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPERTIES INC	2,330	247,213.00	
INVESTORS REAL ESTATE TRUST	2,200	150,788.00	
INVITATION HOMES INC	85,300	2,415,696.00	
IRON MOUNTAIN INC	57,900	1,823,271.00	
JBG SMITH PROPERTIES	24,800	965,712.00	
KILROY REALTY CORP	20,490	1,609,899.30	
KIMCO REALTY CORP	85,500	1,596,285.00	
KITE REALTY GROUP TRUST	17,200	251,808.00	
LEXINGTON REALTY TRUST	41,300	435,302.00	
LIBERTY PROPERTY TRUST	29,800	1,552,580.00	
LIFE STORAGE INC	9,360	965,203.20	
LTC PROPERTIES INC	8,000	392,400.00	

MACERICH CO /THE	21,600	632,880.00	
MACK-CALI REALTY CORP	18,000	401,400.00	
MANULIFE US REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	279,007	248,316.23	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	88,900	1,613,535.00	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	23,060	2,864,282.60	
MONMOUTH REIT-CLASS A	19,800	260,172.00	
NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	32,800	1,800,064.00	
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	11,500	372,945.00	
NATL HEALTH INVESTORS INC	8,760	725,590.80	
NEW SENIOR INVESTMENT GROUP	18,000	113,940.00	
NEXPOINT RESIDENTIAL TRUST INC	4,100	183,844.00	
NORTHSTAR REALTY EUROPE CORP	9,700	164,221.00	
OFFICE PROPERTIES INCOME	10,200	285,294.00	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	43,700	1,713,914.00	
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	2,800	77,448.00	
PARAMOUNT GROUP INC	41,400	549,792.00	
PARK HOTELS & RESORTS INC	41,300	987,896.00	
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	26,400	701,976.00	
PENN REAL ESTATE INVEST TST	11,500	52,325.00	
PHYSICIANS REALTY TRUST	37,400	658,988.00	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	24,900	497,502.00	
PREFERRED APARTMENT COMMUNITIES INC	8,000	114,560.00	
PROLOGIS INC	127,670	10,518,731.30	
PS BUSINESS PARKS INC/CA	4,080	720,609.60	
PUBLIC STORAGE	30,390	7,864,324.20	
QTS REALTY TRUST INC CL A	11,500	559,820.00	
REALTY INCOME CORP	63,800	4,645,278.00	
REGENCY CENTERS CORP	34,000	2,216,460.00	
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	23,800	423,640.00	
RETAIL PROPERTIES OF AME-A	44,200	503,438.00	
RETAIL VALUE INC	3,500	129,920.00	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY INC	22,200	965,700.00	
RLJ LODGING TRUST	34,600	560,520.00	
RPT REALTY	15,700	188,400.00	

RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	10,390	846,577.20	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	38,400	827,520.00	
SAFEHOLD INC	1,500	43,275.00	
SAUL CENTERS INC	2,400	123,120.00	
SENIOR HOUSING PROP TRUST	49,100	441,409.00	
SERITAGE GROWTH PROP-A REIT	5,900	231,221.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	62,540	9,294,069.40	
SITE CENTERS CORP	29,000	397,300.00	
SL GREEN REALTY CORP	17,200	1,361,552.00	
SPIRIT MTA REIT	9,600	81,888.00	
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	17,500	809,725.00	
STAG INDUSTRIAL INC	25,300	745,085.00	
STORE CAPITAL CORP	41,100	1,503,849.00	
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	20,300	227,360.00	
SUN COMMUNITIES INC	18,320	2,675,269.60	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	46,900	617,204.00	
TANGER FACTORY OUTLET CENTER	18,400	269,376.00	
TAUBMAN CENTERS INC	12,500	508,625.00	
TERRENO REALTY CORP	12,700	644,779.00	
UDR INC	56,900	2,673,162.00	
UMH PROPERTIES INC	7,200	91,152.00	
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	2,630	253,400.50	
URBAN EDGE PROPERTIES	23,900	410,124.00	
URSTADT BIDDLE-CL A	6,000	124,620.00	
VENTAS INC	74,900	5,482,680.00	
VEREIT INC	196,300	1,888,406.00	
VICI PROPERTIES INC	83,000	1,720,590.00	
VORNADO REALTY TRUST	35,300	2,162,125.00	
WASHINGTON PRIME GROUP INC	37,000	121,360.00	
WASHINGTON REAL ESTATE INV	16,000	425,120.00	
WEINGARTEN REALTY INVESTORS	24,400	662,460.00	
WELLTOWER INC	82,000	7,280,780.00	
WHITESTONE REIT	7,400	93,092.00	
WP CAREY INC	34,410	3,049,414.20	
XENIA HOTELS & RESORTS INC	23,200	479,080.00	

小計	銘柄数：155 組入時価比率：73.4%	4,647,317	185,907,448.33 (19,782,411,576) 74.0%	
カナダドル	ALLIED PROPERTIES REAL ESTAT	11,200	578,032.00	
	ARTIS REAL ESTATE INVESTMENT	14,700	179,193.00	
	BOARDWALK REAL ESTATE INVEST	5,000	217,250.00	
	CAN APARTMENT PROP REAL ESTA	15,600	822,900.00	
	CHOICE PROPERTIES REIT	30,100	409,360.00	
	COMINAR REAL ESTATE INV-TR U	19,000	236,930.00	
	CROMBIE REAL ESTATE INVESTMENT	8,200	127,018.00	
	CT REAL ESTATE INVESTMENT TR	9,500	136,515.00	
	DREAM GLOBAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	20,000	285,000.00	
	DREAM INDUSTRIAL REAL ESTATE INVESTMENT	12,000	148,320.00	
	DREAM OFFICE REAL ESTATE INVESTMENT TRUS	6,500	172,965.00	
	GRANITE REAL ESTATE INVESTME	5,100	319,566.00	
	H&R REAL ESTATE INVSTMNT-UTS	27,800	626,890.00	
	INTERRENT REAL ESTATE INVEST	11,000	167,970.00	
	KILLAM APARTMENT REAL ESTATE	9,600	195,456.00	
	MINTO APARTMENT REAL ESTATE	2,500	56,250.00	
	MORGUARD NORTH AMERICAN RESI	3,300	64,746.00	
	NORTHVIEW APARTMENT REAL ESTATE INVEST	5,800	164,720.00	
	NORTHWEST HEALTHCARE PROPERT	12,000	138,120.00	
	RIOCAN REAL ESTATE INVST TR	30,700	810,787.00	
	SLATE OFFICE REIT	5,900	34,574.00	
	SLATE RETAIL REIT	4,300	55,685.00	
SMARTCENTRES REAL ESTATE INV	14,200	452,696.00		
SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT	12,800	163,584.00		
TRUE NORTH COMMERCIAL REAL E	5,000	33,450.00		
小計	銘柄数：25 組入時価比率：2.0%	301,800	6,597,977.00 (528,959,816) 2.0%	
ユーロ	AEDIFICA	5,090	507,473.00	
	ALSTRIA OFFICE REIT-AG	32,400	470,124.00	

	ALTAREA	680	123,352.00
	BEFIMMO S.C.A.	4,700	243,460.00
	COFINIMMO	4,900	589,960.00
	COVIVIO	13,350	1,247,557.50
	EUROCOMMERCIAL PROPRTI-CVA	8,400	188,328.00
	GECINA SA	11,110	1,557,622.00
	GREEN REIT PLC	136,000	258,400.00
	HAMBORNER REIT AG	15,400	142,357.60
	HIBERNIA REIT PLC	146,000	213,452.00
	ICADE	9,120	713,184.00
	IMMOBILIARE GRANDE DISTRIBUZ	10,000	52,500.00
	INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA	55,200	563,040.00
	INTERVEST OFFICES & WAREHOUSES	4,114	106,758.30
	IRISH RESIDENTIAL PROPERTIES	70,000	119,000.00
	KLEPIERRE	40,900	1,107,981.00
	LAR ESPANA REAL ESTATE SOCIM	14,000	90,720.00
	MERCIALYS	10,400	107,640.00
	MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA	73,800	896,670.00
	MONTEA	2,120	161,756.00
	NSI NV	3,800	149,910.00
	RETAIL ESTATES	1,500	121,350.00
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	27,910	3,358,968.50
	VASTNED RETAIL NV	3,100	80,290.00
	WAREHOUSES DE PAUW SCA	3,540	569,940.00
	WERELDHAVE NV	8,600	152,220.00
小計	銘柄数：27	716,134	13,894,013.90
			(1,639,632,580)
	組入時価比率：6.1%		6.1%
英債券	ASSURA PLC	480,000	321,600.00
	BIG YELLOW GROUP PLC	31,800	310,050.00
	BRITISH LAND	196,000	936,488.00
	CAPITAL & REGIONAL PLC	93,000	13,485.00
	CIVITAS SOCIAL HOUSING PLC	122,000	100,650.00
	DERWENT LONDON PLC	22,400	681,856.00
	EMPIRIC STUDENT PROPERTY PLC	108,000	98,064.00
	GREAT PORTLAND ESTATES PLC	54,700	365,396.00

	HAMMERSON PLC	152,000	314,032.00	
	HANSTEEN HOLDINGS PLC	82,000	72,980.00	
	INTU PROPERTIES PLC	184,000	67,252.00	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	152,200	1,131,759.20	
	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	173,000	348,768.00	
	LXI REIT PLC	112,000	139,776.00	
	NEWRIVER REIT PLC	63,000	92,988.00	
	PICTON PROPERTY INCOME LTD	104,000	88,920.00	
	PRIMARY HEALTH PROPERTIES	237,000	310,470.00	
	RDI REIT PLC	56,000	58,576.00	
	REGIONAL REIT LTD	82,000	85,116.00	
	SAFESTORE HOLDINGS PLC	41,900	260,618.00	
	SCHRODER REAL ESTATE INVESTM TRUST	110,000	58,850.00	
	SEGRO PLC	218,500	1,626,514.00	
	SHAFTESBURY PLC	48,100	364,117.00	
	TRIPLE POINT SOCIAL HOUSING	63,000	52,542.00	
	TRITAX BIG BOX REIT PLC	348,000	500,424.00	
	UK COMMERCIAL PROPERTY REIT	140,000	116,900.00	
	UNITE GROUP PLC	59,000	615,960.00	
	WORKSPACE GROUP PLC	27,000	219,645.00	
小計	銘柄数 : 28	3,560,600	9,353,796.20	
			(1,208,229,855)	
	組入時価比率 : 4.5%		4.5%	
豪ドル	ABACUS PROPERTY GROUP	69,000	278,070.00	
	APN INDUSTRIA REIT	20,000	58,200.00	
	ARENA REIT	52,000	145,600.00	
	BWP TRUST	102,000	387,600.00	
	CHARTER HALL EDUCATION TRUST	54,000	199,800.00	
	CHARTER HALL GROUP	93,200	1,116,536.00	
	CHARTER HALL LONG WALE REIT	56,000	303,520.00	
	CHARTER HALL RETAIL REIT	73,000	335,070.00	
	CROMWELL PROPERTY GROUP	388,000	471,420.00	
	DEXUS	220,600	2,865,594.00	
	GDI PROPERTY GROUP	112,000	168,560.00	
	GOODMAN GROUP	326,100	4,757,799.00	

	GPT GROUP	389,000	2,384,570.00	
	GROWTHPOINT PROPERTIES AUSTR	60,000	260,400.00	
	HOTEL PROPERTY INVESTMENTS L	27,000	92,340.00	
	INGENIA COMMUNITIES GROUP	39,000	134,550.00	
	MIRVAC GROUP	798,000	2,505,720.00	
	NATIONAL STORAGE REIT	150,000	256,500.00	
	RURAL FUNDS GROUP	60,000	117,000.00	
	SCENTRE GROUP	1,075,000	4,074,250.00	
	SHOPPING CENTRES AUSTRALASIA	176,000	447,040.00	
	STOCKLAND TRUST GROUP	496,000	2,202,240.00	
	VICINITY CENTRES	656,000	1,600,640.00	
	VIVA ENERGY REIT	92,000	243,800.00	
小計	銘柄数：24	5,583,900	25,406,819.00	
			(1,833,101,990)	
	組入時価比率：6.8%		6.9%	
ニュージーランドドル	ARGOSY PROPERTY LTD	160,000	226,400.00	
	GOODMAN PROPERTY TRUST	214,000	454,750.00	
	KIWI PROPERTY GROUP LTD	288,000	463,680.00	
	PRECINCT PROPERTIES NEW ZEALAND	220,000	403,700.00	
	STRIDE STAPLED GROUP	80,000	186,400.00	
	VITAL HEALTHCARE PROPERTY TRUST	64,000	167,680.00	
小計	銘柄数：6	1,026,000	1,902,610.00	
			(129,910,210)	
	組入時価比率：0.5%		0.5%	
香港ドル	CHAMPION REIT	412,000	2,278,360.00	
	FORTUNE REIT	281,000	2,776,280.00	
	LINK REIT	427,600	39,595,760.00	
	PROSPERITY REIT	260,000	816,400.00	
	SUNLIGHT REAL ESTATE INVESTMENT	195,000	1,088,100.00	
	YUEXIU REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	268,000	1,404,320.00	
小計	銘柄数：6	1,843,600	47,959,220.00	
			(650,806,615)	
	組入時価比率：2.4%		2.4%	
シンガポールドル	AIMS APAC REIT MANAGEMENT LTD	112,000	161,280.00	
	ASCENDAS HOSPITALITY TRUST	150,000	157,500.00	

	ASCENDAS REAL ESTATE INV TRT	518,000	1,569,540.00
	ASCOTT RESIDENCE TRUST	253,000	321,310.00
	CACHE LOGISTICS TRUST	209,860	154,247.10
	CAPITALAND COMMERCIAL TRUST	558,964	1,162,645.12
	CAPITALAND MALL TRUST	573,000	1,501,260.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST	128,000	188,160.00
	CAPITALAND RETAIL CHINA TRUST - RTS	11,136	334.08
	CDL HOSPITALITY TRUSTS	145,000	230,550.00
	ESR REIT	390,000	196,950.00
	FAR EAST HOSPITALITY TRUST	210,000	135,450.00
	FIRST REAL ESTATE INVT TRUST	120,000	121,200.00
	FRASERS CENTREPOINT TRUST	136,596	364,711.32
	FRASERS COMMERCIAL TRUST	139,000	221,010.00
	FRASERS HOSPITALITY TRUST	140,000	97,300.00
	FRASERS LOGISTICS & INDUSTRI	320,000	377,600.00
	KEPPEL DC REIT	190,956	326,534.76
	KEPPEL REIT	365,000	448,950.00
	LIPPO MALLS INDONESIA RETAIL TRUST	460,000	101,200.00
	MAPLETREE COMMERCIAL TRUST	386,025	795,211.50
	MAPLETREE INDUSTRIAL TRUST	264,000	596,640.00
	MAPLETREE LOGISTICS TRUST	484,000	755,040.00
	MAPLETREE NORTH ASIA COMMERCIAL	426,000	566,580.00
	QUE HOSPITALITY TRUST	220,043	158,430.96
	PARKWAY LIFE REAL ESTATE	82,000	246,820.00
	SABANA SHARIAH COMP IND REIT	133,764	58,856.16
	SOILBUILD BUSINESS SPACE REI	136,700	78,602.50
	SPH REIT	124,000	132,680.00
	STARHILL GLOBAL REIT	260,000	195,000.00
	SUNTEC REIT	460,000	883,200.00
小計	銘柄数：31	8,107,044	12,304,793.50 (944,638,996)
	組入時価比率：3.5%		3.5%
ウォン	SHINHAN ALPHA REIT CO LTD	6,000	42,960,000.00
小計	銘柄数：1	6,000	42,960,000.00

				(3,784,776)	
		組入時価比率：0.0%		0.0%	
	新シケル	REIT 1 LTD	34,000	703,800.00	
	小計	銘柄数：1	34,000	703,800.00	
				(21,142,152)	
		組入時価比率：0.1%		0.1%	
	合計			26,742,618,566	
				(26,742,618,566)	

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

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

(注3)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

種類	2019年 8月19日現在			
	契約額等(円)		時価(円)	評価損益(円)
		うち1年超		
市場取引				
REIT指数先物取引				
買建	168,106,518	-	172,288,431	4,181,913
市場取引以外の取引				
為替予約取引				
買建	21,367,480	-	21,428,800	61,320
米ドル	15,916,200	-	15,960,000	43,800
英ポンド	2,570,480	-	2,583,200	12,720
豪ドル	2,880,800	-	2,885,600	4,800
合計	-	-	-	4,243,233

(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いません。

上記取引でヘッジ会計が適用されているものはございません。

野村マネー マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

(2019年 8月19日現在)

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	2,925,096,627
地方債証券	1,157,903,863
特殊債券	1,050,692,130
社債券	2,804,925,300
コマーシャル・ペーパー	499,997,255
未収利息	7,779,040
前払費用	11,771,369
流動資産合計	8,458,165,584
資産合計	8,458,165,584
負債の部	
流動負債	
未払利息	4,506
流動負債合計	4,506
負債合計	4,506
純資産の部	
元本等	
元本	8,288,568,727
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金()	169,592,351
元本等合計	8,458,161,078
純資産合計	8,458,161,078
負債純資産合計	8,458,165,584

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	地方債証券、特殊債券、社債券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 コマーシャル・ペーパー 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益

3. 金融商品の時価等に関する事項の補足説明	<p>約定日基準で計上しております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>
------------------------	---

（貸借対照表に関する注記）

2019年 8月19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	1.0205円
(10,000口当たり純資産額)	(10,205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 2019年 2月19日 至 2019年 8月19日
<p>1. 金融商品に対する取組方針</p> <p>当ファンドは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第4項に定める証券投資信託であり、信託約款に規定する運用の基本方針に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。</p> <p>2. 金融商品の内容及びその金融商品に係るリスク</p> <p>当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。</p> <p>当ファンドが保有する有価証券の詳細は、附属明細表に記載しております。</p> <p>これらは、金利変動リスクなどの市場リスク、信用リスク及び流動性リスクにさらされております。</p> <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> <p>委託会社においては、独立した投資リスク管理に関する委員会を設け、パフォーマンスの考査及び運用リスクの管理を行っております。</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

2019年 8月19日現在
<p>1. 貸借対照表計上額、時価及び差額</p> <p>貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。</p> <p>2. 時価の算定方法</p>

地方債証券、特殊債券、社債券

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コマーシャル・ペーパー

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務

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

（その他の注記）

元本の移動及び期末元本額の内訳

2019年 8月19日現在	
期首	2019年 2月19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	11,039,670,818円
同期中における追加設定元本額	139,479,989円
同期中における一部解約元本額	2,890,582,080円
期末元本額	8,288,568,727円
期末元本額の内訳*	
野村日本ブランド株投資（マネープールファンド）年2回決算型	104,556,769円
野村世界業種別投資シリーズ（マネープール・ファンド）	10,607,461円
ノムラ・アジア・シリーズ（マネープール・ファンド）	96,909,215円
野村新エマージング債券投信（マネープールファンド）年2回決算型	2,513,115円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信（マネープールファンド）年2回決算型	1,230,043円
野村グローバルC B投信（マネープールファンド）年2回決算型	996,807円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信（マネープールファンド）年2回決算型	2,551,759円
ネクストコア	19,922,154円
野村世界高金利通貨投信	151,953,753円
野村新世界高金利通貨投信	982,608円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（欧州通貨コース）	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（円コース）	982,609円
欧州ハイ・イールド・ボンド・ファンド（豪ドルコース）	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）毎月分配型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）毎月分配型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（円コース）年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（米ドルコース）年2回決算型	98,261円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ユーロコース）年2回決算型	9,826円
野村米国ハイ・イールド債券投信（豪ドルコース）年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（ブラジルリアルコース）年2回決算型	982,608円
野村米国ハイ・イールド債券投信（南アフリカランドコース）年2回決算型	98,260円
野村米国ハイ・イールド債券投信（トルコリラコース）年2回決算型	98,261円
野村日本ブランド株投資（円コース）毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資（豪ドルコース）毎月分配型	982,608円

野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261円
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)毎月分配型	982,607円
野村日本ブランド株投資(円コース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(豪ドルコース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村日本ブランド株投資(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,260円
野村日本ブランド株投資(トルコリラコース)年2回決算型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)毎月分配型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	98,261円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(トルコリラコース)年2回決算型	98,260円
野村新エマージング債券投信(円コース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)毎月分配型	98,261円
野村新エマージング債券投信(中国元コース)毎月分配型	982,607円
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	982,608円
野村新エマージング債券投信(円コース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村新エマージング債券投信(豪ドルコース)年2回決算型	98,260円
野村新エマージング債券投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(南アフリカランドコース)年2回決算型	9,826円
野村新エマージング債券投信(中国元コース)年2回決算型	982,608円
野村新エマージング債券投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	98,261円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,834円
野村グローバル・ハイ・イールド債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,834円
野村高金利国際機関債投信(毎月分配型)	49,354,623円
野村アジアC B投信(毎月分配型)	982,608円
野村グローバルC B投信(円コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)毎月分配型	984,543円
野村グローバルC B投信(円コース)年2回決算型	984,543円
野村グローバルC B投信(資源国通貨コース)年2回決算型	984,543円
野村グローバルC B投信(アジア通貨コース)年2回決算型	984,543円
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA向け)	10,000円
野村ドイチェ・高配当インフラ関連株投信(円コース)毎月分配型	984,252円

野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)毎月分配型	98,261円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(円コース)年2回決算型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(米ドルコース)年2回決算型	98,261円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(豪ドルコース)年2回決算型	984,252円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	984,252円
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	982,609円
野村日本ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	982,609円
野村日本ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	982,609円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)毎月分配型	982,607円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)毎月分配型	982,607円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)毎月分配型	982,608円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(円コース)年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(資源国通貨コース)年2回決算型	98,261円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(アジア通貨コース)年2回決算型	98,261円
野村米国ブランド株投資(円コース)毎月分配型	98,261円
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)毎月分配型	983,768円
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)毎月分配型	983,768円
野村米国ブランド株投資(円コース)年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資(資源国通貨コース)年2回決算型	983,768円
野村米国ブランド株投資(アジア通貨コース)年2回決算型	983,768円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)毎月分配型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(円コース)年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(資源国通貨コース)年2回決算型	983,672円
ノムラ・グローバルトレンド(アジア通貨コース)年2回決算型	983,672円
野村テンプレトン・トータル・リターン Aコース	983,381円
野村テンプレトン・トータル・リターン Bコース	98,261円
野村テンプレトン・トータル・リターン Cコース	983,381円
野村テンプレトン・トータル・リターン Dコース	983,381円
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609円
野村米国ハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,262円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,609円
野村ドイツ・高配当インフラ関連株投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	98,261円
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	983,091円
野村グローバル高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	983,091円
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)毎月分配型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(円コース)年2回決算型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898円
野村アジアハイ・イールド債券投信(アジア通貨セレクトコース)年2回決算型	982,898円
野村豪ドル債オープン・プレミアム毎月分配型	982,801円

野村豪ドル債オープン・プレミアム年2回決算型	491,401円
野村グローバルREITプレミアム(円コース)毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(円コース)年2回決算型	982,608円
野村グローバルREITプレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,608円
野村日本高配当株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,415円
野村日本高配当株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,415円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)毎月分配型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)毎月分配型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(円コース)年2回決算型	982,029円
野村高配当インフラ関連株プレミアム(通貨セレクトコース)年2回決算型	982,029円
野村カルミニャック・ファンド Aコース	981,547円
野村カルミニャック・ファンド Bコース	981,547円
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)毎月分配型	1,813円
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)毎月分配型	315,476円
野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)毎月分配型	946,340円
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)毎月分配型	123,377円
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)毎月分配型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)毎月分配型	41,316円
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)毎月分配型	54,497円
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)毎月分配型	277,875円
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)毎月分配型	48,092円
野村通貨選択日本株投信(米ドルコース)年2回決算型	981,451円
野村通貨選択日本株投信(ユーロコース)年2回決算型	4,908円
野村通貨選択日本株投信(豪ドルコース)年2回決算型	253,829円
野村通貨選択日本株投信(ブラジルリアルコース)年2回決算型	213,673円
野村通貨選択日本株投信(トルコリラコース)年2回決算型	43,905円
野村通貨選択日本株投信(メキシコペソコース)年2回決算型	774,485円
野村通貨選択日本株投信(中国元コース)年2回決算型	51,703円
野村通貨選択日本株投信(インドネシアルピアコース)年2回決算型	36,381円
野村通貨選択日本株投信(インドルピーコース)年2回決算型	118,445円
野村通貨選択日本株投信(ロシアルーブルコース)年2回決算型	13,741円
野村エマージング債券プレミアム毎月分配型	981,451円
野村エマージング債券プレミアム年2回決算型	981,451円
ノムラ THE USA Aコース	981,258円
ノムラ THE USA Bコース	981,258円
ノムラ THE EUROPE Aコース	98,117円
ノムラ THE EUROPE Bコース	98,117円
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)毎月分配型	9,809円
野村日本ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,809円
野村日本ブランド株投資(メキシコペソコース)年2回決算型	9,809円
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,808円
野村アジアハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,808円
野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,808円

野村米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,808円
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)毎月分配型	9,807円
野村米国ブランド株投資(米ドルコース)年2回決算型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,807円
野村PIMCO新興国インフラ関連債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,807円
野村グローバルボンド投信 Aコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Bコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Cコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Dコース	980,489円
野村グローバルボンド投信 Eコース	98,049円
野村グローバルボンド投信 Fコース	980,489円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)毎月分配型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(米ドルコース)年2回決算型	9,805円
野村新米国ハイ・イールド債券投信(メキシコペソコース)年2回決算型	9,805円
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)毎月分配型	9,803円
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)毎月分配型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(円コース)年2回決算型	9,803円
野村高配当インフラ関連株ファンド(米ドルコース)年2回決算型	980,297円
野村高配当インフラ関連株ファンド(通貨セレクトコース)年2回決算型	9,803円
野村新興国高配当株トリプルウイング ブラジルリアル毎月分配型	9,803円
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(円コース)	9,803円
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(米ドルコース)	9,803円
ピムコ・世界インカム戦略ファンド(世界通貨分散コース)	9,803円
ノムラ新興国債券ファンズ(野村SMA・EW向け)	9,801円
野村ブルーベイ・トータルリターンファンド(野村SMA・EW向け)	9,801円
ノムラ THE ASIA Aコース	97,992円
ノムラ THE ASIA Bコース	979,912円
グローバル・ストック Aコース	97,953円
グローバル・ストック Bコース	979,528円
グローバル・ストック Cコース	97,953円
グローバル・ストック Dコース	979,528円
野村グローバル・クオリティ・グロース Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村グローバル・クオリティ・グロース Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Aコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村MFSグローバル・リサーチ・フォーカス株式 Bコース(野村SMA・EW向け)	9,794円
野村ファンドラップ債券プレミア	9,795円
野村ファンドラップオルタナティブプレミア	9,795円
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)毎月分配型	9,797円
野村PIMCO米国投資適格債券戦略ファンド(為替ヘッジあり)年2回決算型	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Aコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Bコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Cコース	9,797円
野村ウエスタン・世界債券戦略ファンド Dコース	9,797円
第1回 野村短期公社債ファンド	3,037,421円

第2回 野村短期公社債ファンド	3,919,169円
第3回 野村短期公社債ファンド	1,371,897円
第4回 野村短期公社債ファンド	1,077,981円
第5回 野村短期公社債ファンド	1,959,729円
第6回 野村短期公社債ファンド	1,077,981円
第7回 野村短期公社債ファンド	686,093円
第8回 野村短期公社債ファンド	98,261円
第9回 野村短期公社債ファンド	5,094,831円
第10回 野村短期公社債ファンド	1,959,728円
第11回 野村短期公社債ファンド	1,861,757円
第12回 野村短期公社債ファンド	6,664,982円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド30(非課税適格機関投資家専用)	5,129,840,665円
ノムラスマートプレミアムファンドハイブリッド50(適格機関投資家転売制限付)	2,050,866,611円
野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Dプライス(適格機関投資家専用)	424,221,200円
野村DC運用戦略ファンド	85,180,134円
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Aコース	9,818円
野村DCテンプレートン・トータル・リターン Bコース	9,818円
野村DC運用戦略ファンド(マイルド)	7,492,405円

* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式(2019年8月19日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2019年8月19日現在)

(単位:円)

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
地方債証券	日本円	大阪府 公募第330回	116,000,000	116,173,408	
		大阪府 公募第331回	100,000,000	100,269,250	
		兵庫県 公募平成21年度第23回	100,000,000	100,218,676	
		静岡県 公募平成21年度第4回	100,000,000	100,007,202	
		静岡県 公募平成21年度第5回	100,000,000	100,222,428	
		広島県 公募平成21年度第3回	140,000,000	140,196,247	
		福岡県 公募平成26年度第4回	100,000,000	100,016,960	
		岐阜県 公募平成21年度第1回	100,000,000	100,256,568	
		共同発行市場地方債 公募第79回	100,000,000	100,246,616	

小計		広島市 公募平成21年度第2回	100,000,000	100,262,242
		鹿児島県 公募(5年)平成26年度第1回	100,000,000	100,034,266
		銘柄数: 11 組入時価比率: 13.7%	1,156,000,000	1,157,903,863 21.0%
	合計			1,157,903,863
特殊債券	日本円	日本政策投資銀行社債 財投機関債第46回	100,000,000	100,020,650
		日本政策投資銀行社債 財投機関債第67回	100,000,000	100,000,000
		日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第53回	400,000,000	400,478,136
		国際協力銀行債券 第16回財投機関債	100,000,000	100,172,344
		商工債券 利付第771回い号	350,000,000	350,021,000
	小計	銘柄数: 5 組入時価比率: 12.4%	1,050,000,000	1,050,692,130 19.1%
	合計			1,050,692,130
社債券	日本円	三菱東京UFJ銀行 第110回特定社債間限定同順位特約付	400,000,000	400,898,525
		三菱UFJリース 第26回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,224,854
		三井不動産 第37回社債間限定同順位特約付	100,000,000	100,484,610
		東京急行電鉄 第69回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,594,758
		東海旅客鉄道 第16回社債間限定同順位特約付	600,000,000	600,959,048
		中部電力 第492回	350,000,000	350,881,562
		東北電力 第452回	100,000,000	100,489,000
		九州電力 第423回	100,000,000	100,093,560
		北海道電力 第319回	550,000,000	550,281,663
		電源開発 第28回社債間限定同順位特約付	200,000,000	200,017,720
	小計	銘柄数: 10 組入時価比率: 33.2%	2,800,000,000	2,804,925,300 50.8%
合計			2,804,925,300	
コマーシャル・ペーパー	日本円	三井住友F&L	200,000,000	199,999,464
		三井住友F&L	100,000,000	99,999,338

		三井住友 F & L	200,000,000	199,998,453	
	小計	銘柄数 : 3 組入時価比率 : 5.9%	500,000,000	499,997,255	9.1%
	合計			499,997,255	
	合計			5,513,518,548	

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

第2 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ネクストコア

2019年9月30日現在

資産総額	3,203,516,938円
負債総額	785,819,955円
純資産総額（ - ）	2,417,696,983円
発行済口数	2,263,250,960口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0682円

（参考）国内株式マザーファンド

2019年9月30日現在

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

（参考）国内債券マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	38,798,821,177円
負債総額	970,763,917円
純資産総額（ - ）	37,828,057,260円
発行済口数	27,107,791,012口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3955円

（参考）外国株式MSCI - KOKUSAIマザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	616,498,786,084円
負債総額	13,049,358,760円
純資産総額（ - ）	603,449,427,324円
発行済口数	218,180,349,215口
1口当たり純資産額（ / ）	2.7658円

（参考）外国債券マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	636,278,406,678円
負債総額	14,978,849,968円
純資産総額（ - ）	621,299,556,710円
発行済口数	266,992,854,681口
1口当たり純資産額（ / ）	2.3270円

（参考）新興国株式マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	39,000,433,535円
負債総額	233,461,211円
純資産総額（ - ）	38,766,972,324円
発行済口数	32,793,811,074口
1口当たり純資産額（ / ）	1.1821円

（参考）新興国債券マザーファンド

2019年9月30日現在

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

（参考）新興国債券（現地通貨建て）マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	7,971,136,503円
負債総額	264,175,784円
純資産総額（ - ）	7,706,960,719円
発行済口数	5,737,293,903口
1口当たり純資産額（ / ）	1.3433円

（参考）J - R E I Tインデックス マザーファンド

2019年9月30日現在

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

（参考）海外REITインデックス マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	30,463,646,355円
負債総額	132,860,697円
純資産総額（ - ）	30,330,785,658円
発行済口数	12,022,238,871口
1口当たり純資産額（ / ）	2.5229円

（参考）野村マネー マザーファンド

2019年9月30日現在

資産総額	8,560,942,862円
負債総額	100,046,689円
純資産総額（ - ）	8,460,896,173円
発行済口数	8,291,448,194口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0204円

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1) 受益証券の名義書換えの事務等

該当事項はありません。

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

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

(2) 受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3) 受益権の譲渡

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

記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

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

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

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

2019年9月末現在、17,180百万円

会社が発行する株式総数 20,000,000株

発行済株式総数 5,150,693株

過去5年間における主な資本金の額の増減：該当事項はありません。

(2)会社の機構

(a)会社の意思決定機構

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

株主総会

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

取締役会

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

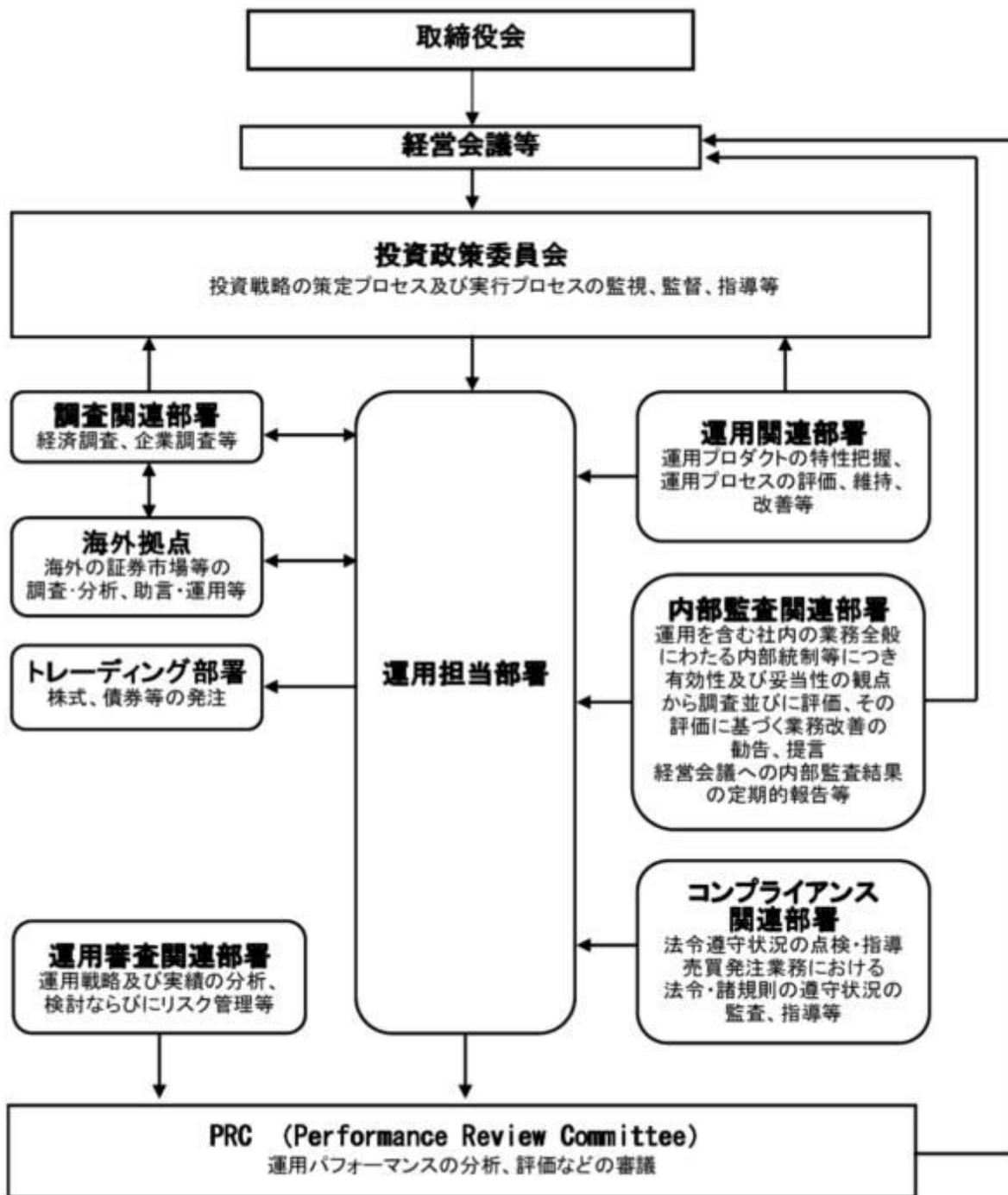
代表取締役・業務執行取締役

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

監査等委員会

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

(b)投資信託の運用体制



2【事業の内容及び営業の概況】

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

委託者の運用する証券投資信託は2019年8月30日現在次の通りです(ただし、親投資信託を除きます。)

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

追加型株式投資信託	1,015	27,315,094
単位型株式投資信託	175	929,775
追加型公社債投資信託	14	5,087,312
単位型公社債投資信託	429	1,730,185
合計	1,633	35,062,367

3【委託会社等の経理状況】

1. 委託会社である野村アセットマネジメント株式会社(以下「委託会社」という)の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号、以下「財務諸表等規則」という)、ならびに同規則第2条の規定に基づき、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年8月6日内閣府令第52号)により作成しております。
2. 財務諸表の記載金額は、百万円未満の端数を切り捨てて表示しております。
3. 委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度(2018年4月1日から2019年3月31日まで)の財務諸表について、EY新日本有限責任監査法人の監査を受けております。
なお、従来、当社が監査証明を受けている新日本有限責任監査法人は、2018年7月1日に名称を変更し、EY新日本有限責任監査法人となりました。

(1)【貸借対照表】

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

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

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

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

(2)【損益計算書】

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

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

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

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

(単位：百万円)

	株主資本								株主 資本 合計
	資本金	資本剰余金			利益 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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

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

(単位:百万円)

	評価・換算差額等
--	----------

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

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<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。 <table style="margin-left: 20px;"> <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> <p>(2) 無形固定資産及び投資その他の資産 定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。</p>	建物	38～50年	附属設備	8～15年	構築物	20年	器具備品	4～15年
建物	38～50年								
附属設備	8～15年								
構築物	20年								
器具備品	4～15年								
4. 引当金の計上基準	<p>(1) 貸倒引当金 一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を検討し、回収不能見込額を計上しております。</p> <p>(2) 賞与引当金 賞与の支払いに備えるため、支払見込額を計上しております。</p>								

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

【未適用の会計基準等】

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

(1) 概要

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

ステップ1: 顧客との契約を識別する。

ステップ2: 契約における履行義務を識別する。

ステップ3: 取引価格を算定する。

ステップ4: 契約における履行義務に取引価格を配分する。

ステップ5: 履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

(2) 適用予定日

2022年3月期の期首より適用予定であります。

(3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

【表示方法の変更に関する注記】

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

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

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

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

[注記事項]

貸借対照表関係

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

損益計算書関係

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

株主資本等変動計算書関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2017年5月12日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 剰余金の配当に関する事項

(1) 配当財産が金銭である場合における当該金銭の総額

2018年5月14日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

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

2019年5月15日開催の取締役会において、次のとおり決議しております。

普通株式の配当に関する事項

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

金融商品関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1. 金融商品の状況に関する事項

(1) 金融商品に対する取組方針

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

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

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びにリスク管理体制

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

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

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

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

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

(単位：百万円)

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

注1：金融商品の時価の算定方法並びに有価証券に関する事項

(1) 現金・預金

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

(2) 金銭の信託

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

(3)未収委託者報酬、(4)未収運用受託報酬

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

ます。

(5) 有価証券及び投資有価証券

その他有価証券

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

(6) 未払金、(7) 未払費用、(8) 未払法人税等

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

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

注3：金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

(単位：百万円)

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

有価証券関係

前事業年度（自 2017年4月 1 日 至 2018年3月31日）

1．売買目的有価証券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2018年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2018年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2018年3月31日)

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

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

該当事項はありません。

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

1．売買目的有価証券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

2．満期保有目的の債券(2019年3月31日)

該当事項はありません。

3．子会社株式及び関連会社株式(2019年3月31日)

該当事項はありません。

4．その他有価証券(2019年3月31日)

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

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

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

該当事項はありません。

退職給付関係

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	
1. 採用している退職給付制度の概要	
当社は、確定給付型の制度として確定給付型企业年金制度及び退職一時金制度を、また確定拠出型の制度として確定拠出年金制度を設けております。	
2. 確定給付制度	
(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表	
退職給付債務の期首残高	19,546 百万円
勤務費用	929
利息費用	167
数理計算上の差異の発生額	1,415
退職給付の支払額	660
その他	0
退職給付債務の期末残高	21,398
(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表	
年金資産の期首残高	16,572 百万円
期待運用収益	414
数理計算上の差異の発生額	395
事業主からの拠出額	510
退職給付の支払額	518
年金資産の期末残高	17,373
(3) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表	
積立型制度の退職給付債務	18,163 百万円
年金資産	17,373
	790
非積立型制度の退職給付債務	3,235
未積立退職給付債務	4,025
未認識数理計算上の差異	3,768
未認識過去勤務費用	331
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588
退職給付引当金	2,938
前払年金費用	2,350
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	588

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

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

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、195百万円でした。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 採用している退職給付制度の概要

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

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

(2) 年金資産の期首残高と期末残高の調整表

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

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

及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	20,181 百万円
年金資産	17,469
	2,712
非積立型制度の退職給付債務	3,369
未積立退職給付債務	6,082
未認識数理計算上の差異	5,084
未認識過去勤務費用	220
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218
退職給付引当金	3,219
前払年金費用	2,001
貸借対照表上に計上された負債と資産の純額	1,218

(4) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	951 百万円
利息費用	179
期待運用収益	434
数理計算上の差異の費用処理額	598
過去勤務費用の費用処理額	38
確定給付制度に係る退職給付費用	1,255

(5) 年金資産に関する事項

年金資産の主な内容

年金資産合計に対する主な分類毎の比率は、次の通りです。

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

長期期待運用収益率の設定方法

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

(6) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎

確定給付型企业年金制度の割引率	0.7%
退職一時金制度の割引率	0.4%
長期期待運用収益率	2.5%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、197百万円でした。

税効果会計関係

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

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

セグメント情報等

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. セグメント情報

当社は投資運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

2. 関連情報

(1) 製品・サービスごとの情報

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

(2) 地域ごとの情報

売上高

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

有形固定資産

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

(3) 主要な顧客ごとの情報

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

関連当事者情報

前事業年度(自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等
該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

当事業年度(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 関連当事者との取引

(ア) 親会社及び法人主要株主等

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

(イ) 子会社等

該当はありません。

(ウ) 兄弟会社等

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

(エ) 役員及び個人主要株主等

該当はありません。

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

2. 取引条件及び取引条件の決定方針等

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

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

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

(1) 親会社情報

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

(2) 重要な関連会社の要約財務諸表

該当はありません。

1株当たり情報

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

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

(1)定款の変更

委託者の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2)訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1)受託者

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

* 2019年8月末現在

(2)販売会社

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

野村証券株式会社	10,000百万円	「金融商品取引法」に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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	
カブドットコム証券株式会社	7,196百万円	
ぐんぎん証券株式会社	3,000百万円	
七十七証券株式会社	3,000百万円	
東海東京証券株式会社	6,000百万円	
百五証券株式会社	3,000百万円	
ひろぎん証券株式会社	5,000百万円	
F F G証券株式会社	3,000百万円	
マネックス証券株式会社	12,200百万円	
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	
株式会社愛知銀行	18,000百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社青森銀行	19,562百万円	
株式会社足利銀行	135,000百万円	
株式会社イオン銀行	51,250百万円	
株式会社大分銀行	19,598百万円	
株式会社紀陽銀行	80,096百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	
株式会社熊本銀行	33,847百万円	
株式会社佐賀銀行	16,062百万円	
株式会社七十七銀行	24,658百万円	
株式会社十八銀行	24,404百万円	
株式会社十六銀行	36,839百万円	
株式会社常陽銀行	85,113百万円	
株式会社親和銀行	36,878百万円	
株式会社第四銀行	32,776百万円	
株式会社但馬銀行	5,481百万円	
株式会社千葉銀行	145,069百万円	
株式会社きらぼし銀行	43,734百万円	
株式会社南都銀行	37,900百万円	
株式会社百五銀行	20,000百万円	
株式会社広島銀行	54,573百万円	
株式会社福井銀行	17,965百万円	
株式会社福岡銀行	82,329百万円	
株式会社武蔵野銀行	45,743百万円	
株式会社山梨中央銀行	15,400百万円	
株式会社琉球銀行	56,967百万円	

* 2019年8月末現在

2 【関係業務の概要】

(1)受託者

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

(2)販売会社

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

3【資本関係】

(持株比率5.0%以上を記載します。)

(1)受託者

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年 5月10日	有価証券届出書
2019年 5月10日	有価証券報告書

独立監査人の監査報告書

2019年6月5日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 亀井 純子指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 櫻井 雄一郎指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 津村 健二郎

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

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

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

以 上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2019年10月3日

野村アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 亀井純子
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤志保
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているネクストコアの2019年2月19日から2019年8月19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、ネクストコアの2019年8月19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。